

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)

## 截至2024年6月30日止六個月之中期業績公告

海通證券股份有限公司（「本公司」）董事會（「董事會」）謹此宣佈本公司及其附屬公司截至2024年6月30日止六個月之未經審計中期業績。本公告列載本公司2024年中期報告全文，並符合香港聯合交易所有限公司證券上市規則中有關中期業績初步公告附載的資料之要求。

### 刊登中期業績公告及中期報告

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

本公司將適時在本公司及香港聯合交易所有限公司網站刊載本公司2024年中期報告，並將寄發予已提供指示表示欲收取印刷文本的本公司股東。

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8月29日

於本公告日期，本公司執行董事為周杰先生、李軍先生、韓建新先生；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

# 目錄

重要提示	02
第一節 釋義及重大風險提示	03
第二節 本公司簡介和主要財務指標	07
第三節 董事會報告	16
第四節 公司治理	60
第五節 環境與社會責任	73
第六節 重要事項	80
第七節 股份變動及股東情況	104
第八節 優先股相關情況	113
第九節 債券相關情況	114
第十節 財務報告	148
第十一節 證券公司信息披露	149



## 重要提示

本公司董事會、監事會及董事、監事、高級管理人員保證中期報告(「本報告」)內容的真實性、準確性、完整性，不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並承擔個別和連帶的法律責任。

本報告經本公司第八屆董事會第十二次會議、第八屆監事會第七次會議審議通過。全體董事出席董事會會議，全體監事出席監事會會議。未有董事、監事對本報告提出異議。

本公司董事長周杰、主管會計工作負責人張信軍及會計機構負責人(會計主管人員)馬中聲明：保證本報告中未經審計中期財務資料的真實、準確及完整。除特別說明外，本報告所列數據以人民幣為單位。

本公司2024年中期利潤分配採用現金分紅的方式，以2024年中期分紅派息股權登記日登記的總股本扣除公司回購專用證券賬戶的股份為基數，每10股分配現金紅利人民幣0.3元(含稅)。若以審議2024年中期利潤分配預案的董事會召開日本公司總股本13,064,200,000股扣除公司回購專用證券賬戶的股份77,074,467股，即12,987,125,533股為基數計算，分配現金紅利總額為人民幣389,613,765.99元，佔2024年1-6月合併口徑歸屬於母公司股東淨利潤的40.88%；本公司2024年1-6月以現金為對價，採用集中競價方式已實施的A股股份回購金額人民幣303,053,231.80元(不含交易費用)，現金分紅和回購金額合計人民幣692,666,997.79元，佔2024年1-6月合併口徑歸屬於母公司股東淨利潤的72.68%。

本報告可能載有未來計劃及發展戰略等前瞻性陳述。本報告所載除過往事實陳述以外的一切陳述均為或視為前瞻性陳述。本公司及其任何附屬公司並無責任因出現新數據而公開更新或修訂任何前瞻性陳述。本報告中所涉及的未來計劃、發展戰略等前瞻性描述不構成本公司對投資者的承諾，敬請投資者注意投資風險，不應過分依賴前瞻性陳述。

報告期內，本公司不存在被控股股東及其他關聯方非經營性佔用資金情況。

報告期內，本公司不存在違反規定決策程序對外提供擔保的情況。

## 第一節 釋義及重大風險提示

### 一、釋義

在本報告中，除非文義另有所指，下列詞語具有如下含義：

A股	指	本公司每股面值人民幣1.00元的內資股，於上海證券交易所上市並進行交易
公司章程	指	海通證券的公司章程
審計委員會	指	本公司審計委員會
董事會	指	海通證券董事會
北交所	指	北京證券交易所
守則	指	香港上市規則附錄C1《企業管治守則》及《企業管治報告》
本公司、公司、海通證券	指	海通證券股份有限公司
公司法	指	中華人民共和國公司法
合規與風險管理委員會	指	本公司合規與風險管理委員會
中國證監會	指	中國證券監督管理委員會
上海證監局	指	中國證券監督管理委員會上海監管局
發展戰略與ESG管理委員會	指	本公司發展戰略與ESG管理委員會
董事	指	海通證券董事
ETF	指	交易型開放式指數基金
歐元	指	歐元區法定貨幣
FICC	指	固定收益、外匯及大宗商品
富國基金	指	富國基金管理有限公司

## 第一節 釋義及重大風險提示

集團或本集團	指	本公司及其子公司
H股	指	本公司每股面值人民幣1.00元的普通股，於香港聯交所上市及以港元買賣
海通銀行	指	海通銀行(Haitong Bank, S.A.)
海通開元	指	海通開元投資有限公司
海通期貨	指	海通期貨股份有限公司
海通創新證券	指	海通創新證券投資有限公司
海通國際控股	指	海通國際控股有限公司
海通國際	指	海通國際證券集團有限公司
海通恒信	指	海通恒信國際融資租賃股份有限公司，於香港聯交所上市，股份代號：1905
恒信金融集團	指	海通恒信金融集團有限公司
海富通基金	指	海富通基金管理有限公司
港元或港幣	指	香港法定貨幣
香港上市規則	指	香港聯交所證券上市規則
香港聯交所	指	香港聯合交易所有限公司
海通資管公司	指	上海海通證券資產管理有限公司
IPO	指	首次公開發售
標準守則	指	香港上市規則附錄C3所載之《上市發行人董事進行證券交易的標準守則》



## 第一節 釋義及重大風險提示

新三板	指	全國中小企業股份轉讓系統
提名與薪酬考核委員會	指	本公司提名與薪酬考核委員會
全國社保基金	指	中國社會保障基金理事會
報告期	指	2024年1月1日至2024年6月30日
人民幣	指	中國法定貨幣
證券及期貨條例	指	香港法例第571章證券及期貨條例（經不時修訂、補充或以其他方式修改）
上海國盛集團	指	上海國盛（集團）有限公司
《上交所上市規則》	指	《上海證券交易所股票上市規則》
上海惟泰置業	指	上海惟泰置業管理有限公司
上交所	指	上海證券交易所
科創板	指	上交所科創板
監事	指	海通證券監事
監事會	指	海通證券監事會
深交所	指	深圳證券交易所
美元	指	美利堅合眾國法定貨幣
WIND	指	萬得信息技術股份有限公司

## 第一節 釋義及重大風險提示

### 二、重大風險提示

本集團的業務高度依賴於中國及其他業務所處國家或地區的整體經濟及市場狀況，宏觀經濟環境、行業周期特徵、市場發展程度、投資者行為以及國際經濟形勢等諸多因素都將對本集團經營業績產生重大影響。

本集團面臨的主要風險包括：因違反法律法規和準則而使證券公司被依法追究法律責任、採取監管措施、給予紀律處分等情形的法律及合規風險；因借款人、交易對手方或債務發行人無法履行其約定的財務義務而可能對經營造成損失的信用風險；因市場價格的不利變動而使自有資金投資業務發生損失的市場風險；由於內部流程不完善、員工操作失誤及不當行為、信息系統故障缺陷以及外部事件導致的操作風險；無法以合理成本及時獲得充足資金，以償付到期債務、履行其他支付義務和滿足正常業務開展所需資金的流動性風險；因經營、管理及其他行為或外部事件導致利益相關方進行負面評價的聲譽風險。以上各類風險將給本集團的經營和收益帶來直接影響，同時由於風險之間存在一定關聯性，這種影響還可能產生疊加效應。

針對上述風險的具體分析及採取的具體措施，請投資者認真閱讀本報告「董事會報告」中關於「可能面對的風險及應對措施」相關內容，並特別注意上述風險因素。

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 一、公司信息

本公司的中文名稱	海通證券股份有限公司
本公司的中文簡稱	海通證券
本公司的外文名稱	Haitong Securities Co., Ltd.
本公司的外文名稱縮寫	Haitong Securities
本公司的法定代表人	周杰
本公司總經理	李軍
本公司授權代表	周杰、裴長江
聯席公司秘書	裴長江、黃慧玲
合規總監	趙慧文



## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 註冊資本和淨資本

單位：元 幣種：人民幣

	本報告期末	上年度末
註冊資本	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
淨資本	85,471,167,982.01	80,835,517,814.17

### 本公司經營範圍

證券經紀；證券自營；證券承銷與保薦；證券投資諮詢；與證券交易、證券投資活動有關的財務顧問；直接投資業務；證券投資基金代銷；為期貨公司提供中間介紹業務；融資融券業務；代銷金融產品；股票期權做市業務；中國證監會批准的其他業務，本公司可以對外投資設立子公司從事金融產品等投資業務。【依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動】

### 本公司的各單項業務資格情況

1. 網上證券委託業務資格（證監信息字[2001]3號）
2. 全國銀行間同業拆借市場和債券市場從事拆借、購買債券、債券現券交易和債券回購業務資格（銀辦函[2001]819號）
3. 開放式證券投資基金代銷業務資格（證監基金[2002]076號）
4. 從事相關創新活動試點證券公司（中證協函[2005]079號）
5. 從事短期融資券承銷業務資格（銀發[2005]173號）
6. 上證基金通業務（2005年7月）
7. 報價轉讓業務資格（中證協函[2006]3號）
8. 上海證券交易所固定收益證券綜合電子平台交易商資格（上證會函[2007]86號）
9. 作為合格境內機構投資者從事境外證券投資管理業務資格（證監許可[2008]146號）
10. 中國證券登記結算有限責任公司甲類結算參與人資格（中國結算函字[2008]22號）
11. 為期貨公司提供中間介紹業務資格（證監許可[2008]第479號）
12. 開展直接投資業務試點資格（機構部部函[2008]421號）
13. 向保險機構投資者提供交易單元資格（保監資金審證[2009]1號）

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

14. 融資融券業務資格（證監許可[2010]315號）
15. 基金評價業務資格（中證協發[2010]070號）
16. 公司自營業務參與股指期貨套期保值交易業務資格（滬證監機構字[2010]372號）
17. 全國社保基金理事會簽約券商資格（2011年8月）
18. 資產管理業務參與股指期貨交易資格（滬證監機構字[2011]237號）
19. 約定購回式證券交易業務試點（機構部部函[2011]512號）
20. 債券質押式報價回購業務試點（機構部部函[2011]585號）
21. 中小企業私募債券承銷業務試點資格（中證協函[2012]561號）
22. 轉融通業務試點資格（中證金函[2012]113號）
23. 合夥企業獨立託管業務試點（機構部部函[2012]686號）
24. 櫃台交易業務（中證協函[2012]825號）
25. 證券業務外匯經營許可（上海匯覆[2013]014號）
26. 作為主辦券商在全國股份轉讓系統從事推薦業務和經紀業務（股轉系統函[2013]61號）
27. 代銷金融產品業務資格（滬證監機構字[2013]180號）
28. 權益類收益互換業務和場外期權交易業務（中證協函[2013]996號）
29. 開展客戶證券資金消費支付服務試點資格（機構部部函[2013]741號）
30. 軍工涉密業務諮詢服務（2013年10月）
31. 開展黃金等貴金屬現貨合約代理和黃金現貨合約自營業務資格（機構部部函[2013]959號）
32. 證券投資基金託管資格（證監許可[2013]1643號）
33. 保險兼業代理人（滬保監許可[2013]204號）
34. 代理證券質押登記業務資格（2014年2月）
35. 互聯網證券業務試點（中證協函[2014]358號）
36. 上市公司股權激勵行權融資業務試點（深證函[2014]321號）
37. 期權結算業務資格（中國結算函字[2015]20號）
38. 股票期權做市業務資格（證監許可[2015]153號）
39. 上證50ETF期權合約品種的主做市商（上證函[2015]214號）
40. 境外自營業務資格（機構部函[2015]1204號）
41. 單向視頻開戶創新方案的無異議函（中國結算辦字[2015]461號）
42. 銀行間黃金詢價業務資格（上金交發[2015]120號）
43. 非金融企業債務融資工具主承銷業務資質（2016年8月）

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

44. 場外期權業務二級交易商資格(中證協發[2018]386號)
45. 信用衍生品業務資格(機構部函[2019]469號)
46. 股指期權做市業務(機構部函[2019]3073號)
47. 滬深300ETF期權主做市商(2019年12月)
48. 利率互換實時承接業務資格(2020年3月)
49. 受信用保護債券質押式回購業務合格創設機構資格(中國結算函字[2021]201號)
50. 商品互換業務一級交易商(2022年7月)
51. 上交所中證500ETF期權一般做市商(2022年9月)
52. 深交所創業板ETF期權一般做市商(2022年9月)
53. 深交所中證500ETF期權一般做市商(2022年9月)
54. 上交所基金通做市業務資格(2022年12月)
55. 個人養老金基金銷售資格(2022年12月)
56. 北交所融資融券業務資格(2023年2月)
57. 深交所基金通做市業務資格(2023年3月)
58. 上交所科創50ETF期權主做市商資格(2023年6月)
59. 中央債券借貸業務(2023年12月)

本公司具備上交所、深交所和北交所會員資格，是中國證券業協會、上海清算所、上海黃金交易所等機構會員。本公司附屬子公司均依法，或經相關監管部門批准獲得相應的業務資格後開展經營業務活動。

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 二、聯繫人和聯繫方式

	董事會秘書	證券事務代表
姓名	裴長江	孫濤
聯繫地址	中國上海市黃浦區中山南路888號 海通外灘金融廣場 (郵政編碼：200011)	中國上海市黃浦區中山南路888號 海通外灘金融廣場 (郵政編碼：200011)
電話	8621-23180000	8621-23180000
傳真	8621-63410627	8621-63410627
電子信箱	dshbgs@haitong.com	dshbgs@haitong.com

### 三、基本情況變更簡介

本公司註冊地址	中國上海市廣東路689號
本公司註冊地址的歷史變更情況	中國上海市江西中路200號(1988年) 中國上海市四川中路480號(1990年) 中國上海市北海寧路30號(1994年) 中國上海市唐山路218號(1998年) 中國上海市淮海中路98號(2001年) 中國上海市廣東路689號海通證券大廈(2012年)
本公司辦公地址	中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場
本公司辦公地址的郵政編碼	200011
本公司網址	<a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>
電子信箱	haitong@haitong.com
香港主要營業地址	香港黃竹坑香葉道2號One Island South 15樓
營業執照統一社會信用代碼	9131000013220921X6

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 四、信息披露及備置地地點變更情況簡介

本公司選定的信息披露報紙名稱	中國證券報、上海證券報、證券時報、證券日報
登載中期報告的上交所網站地址	<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的網址	<a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>
本公司中期報告備置地地點	中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場
報告期內變更情況查詢索引	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> <a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>

### 五、本公司股票簡況

股票種類	股票上市交易所	股票簡稱	股票代碼	變更前股票簡稱	股份登記處
A股	上交所	海通證券	600837	/	中國證券登記結算 有限責任公司 上海分公司
H股	香港聯交所	海通證券	6837	/	香港中央證券登記 有限公司

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 六、其他有關資料

✓不適用

### 七、本集團主要會計數據和財務指標

如無特別說明，本報告所載會計數據和財務數據指標按照國際財務報告準則編製。

#### （一）主要會計數據和財務指標

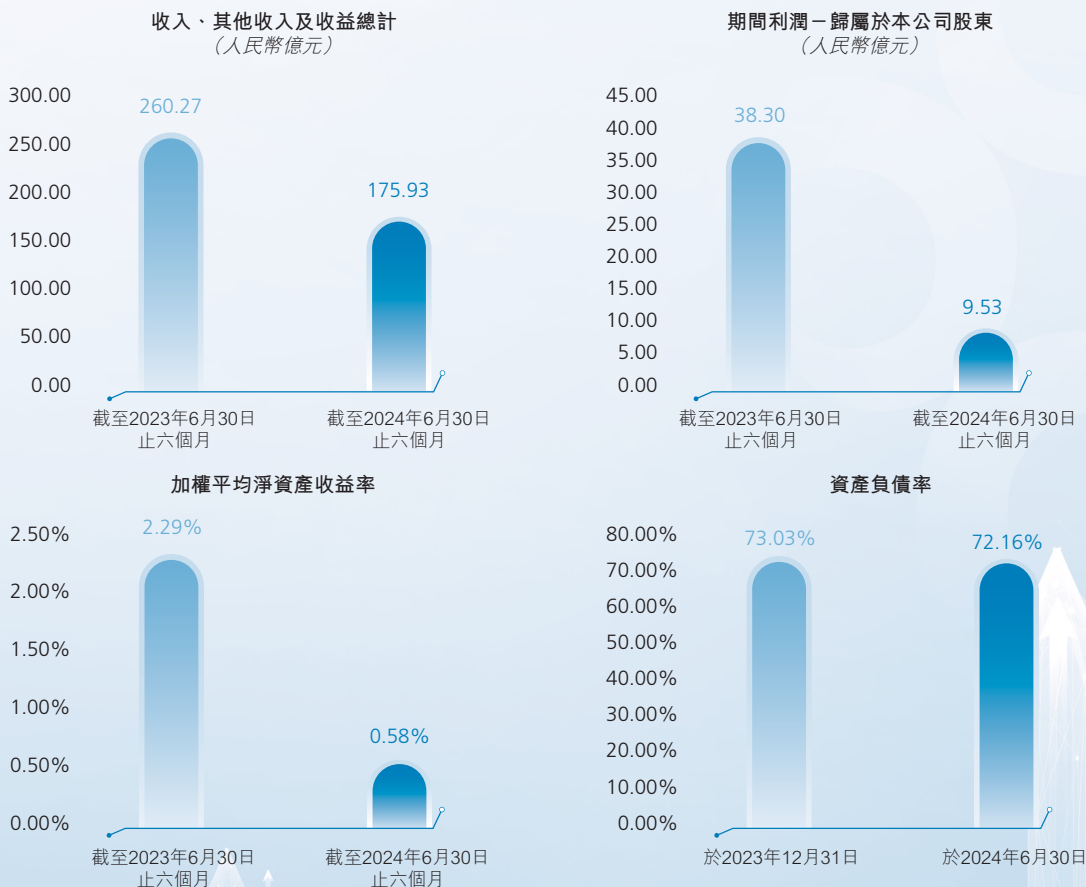
項目	截至2024年 6月30日止 六個月	截至2023年 6月30日止 六個月	本期比上期
<b>經營業績（人民幣千元）</b>			增減
收入、其他收益及收益總計	<b>17,592,860</b>	26,027,428	-32.41%
所得稅前利潤	<b>1,905,876</b>	5,251,724	-63.71%
期間利潤－歸屬於本公司股東	<b>953,097</b>	3,829,635	-75.11%
來自／（用於）經營活動的現金淨額	<b>25,691,802</b>	-13,306,411	不適用
其他綜合收益	<b>291,108</b>	795,560	-63.41%
<b>每股計（人民幣元／股）</b>			
基本每股收益	<b>0.07</b>	0.29	-75.86%
稀釋每股收益	<b>0.07</b>	0.29	-75.86%
<b>盈利能力指標</b>			
加權平均淨資產收益率（%）	<b>0.58</b>	2.29	下降 1.71個百分點



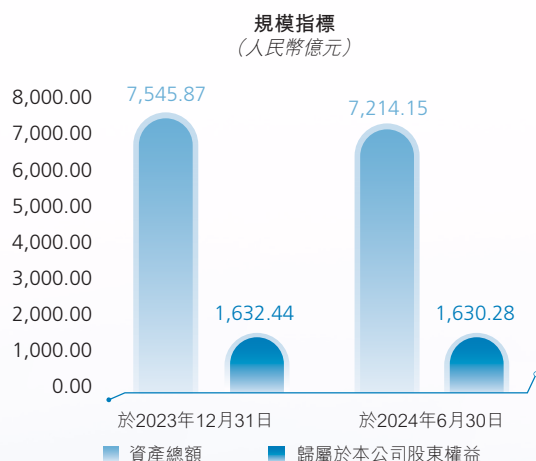
## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

項目	2024年 6月30日	2023年 12月31日	本期末比 上年期末
<b>規模指標 (人民幣千元)</b>			
資產總額	<b>721,414,535</b>	754,586,792	-4.40%
負債總額	<b>550,222,980</b>	579,787,233	-5.10%
應付經紀業務客戶賬款	<b>106,526,337</b>	106,538,717	-0.01%
歸屬於本公司股東權益	<b>163,027,730</b>	163,243,990	-0.13%
<b>總股本 (千股)</b>			
	<b>13,064,200</b>	13,064,200	0.00%
<b>歸屬於本公司股東</b>			
每股淨資產 (人民幣元/股)	<b>12.48</b>	12.50	-0.16%
資產負債率 (%) <sup>(1)</sup>	<b>72.16</b>	73.03	下降 0.87個百分點

註1：資產負債率 = (負債總額 - 應付經紀業務客戶賬款) / (資產總額 - 應付經紀業務客戶賬款)



## 第二節 本公司簡介和主要財務指標



### (二) 境內外會計準則下會計資料差異

本集團按照中國企業會計準則編製的合併財務報表及按照國際財務報告準則編製的合併財務報表中列示的2024年1月至6月及2023年1月至6月的淨利潤、截至2024年6月30日及2023年12月31日的淨資產無差異。

### (三) 母公司的淨資本及風險控制指標

於2024年6月30日，本公司按照中國企業會計準則計算的淨資本為人民幣854.71億元，較上年末(人民幣808.36億元)增加人民幣46.35億元。報告期內，本公司淨資本等各項風險控制指標均符合監管要求。

項目	於2024年6月30日	於2023年12月31日
淨資本(人民幣元)	<b>85,471,167,982.01</b>	80,835,517,814.17
淨資產(人民幣元)	<b>155,446,130,921.35</b>	153,271,166,148.86
風險覆蓋率(%)	<b>204.13</b>	197.71
資本槓桿率(%)	<b>21.18</b>	17.68
流動性覆蓋率(%)	<b>408.22</b>	223.69
淨穩定資金率(%)	<b>157.66</b>	141.88
淨資本／淨資產(%)	<b>54.98</b>	52.74
淨資本／負債(%)	<b>33.19</b>	28.96
淨資產／負債(%)	<b>60.36</b>	54.91
自營權益類證券及其衍生品／淨資本(%)	<b>14.99</b>	16.92
自營非權益類證券及其衍生品／淨資本(%)	<b>234.39</b>	229.18

## 第三節 董事會報告

### 一、報告期內本公司所屬行業及主營業務情況說明

報告期內，本集團所屬行業情況請參見本節「三、管理層討論與分析」。

本集團主要業務有財富管理、投資銀行、資產管理、交易及機構、融資租賃等，所從事的業務情況請參見本節「三、管理層討論與分析」。

報告期內，本集團實現營業收入人民幣175.93億元、歸屬於母公司股東的淨利潤人民幣9.53億元、總資產人民幣7,214.15億元、歸屬於母公司股東的淨資產人民幣1,630.28億元。

### 二、報告期內核心競爭力分析

在長期經營過程中，本公司逐步形成了具有自身特色的七大核心競爭力。

#### 1. 聚焦新質生產力的服務價值鏈與客戶生態圈

本集團堅持踐行國家發展戰略，順應深化金融體制改革和監管「兩強兩嚴」政策要求，深刻把握金融工作政治性、人民性，聚焦金融「五篇大文章」，堅守金融服務實體經濟本源，推動培育新質生產力，成為國家戰略的重要踐行者和金融改革的重要探索者。有力融入「科技—產業—金融」循環，立足科創板聚焦支持科技創新，在半導體、高端裝備、生物醫藥等眾多「硬科技」創新領域打響海通品牌，形成市場影響力。順應「綠色金融」新趨勢，在投行、融資租賃及資產管理等各業務領域不斷探索助力實現「碳達峰、碳中和」的金融服務手段，支持綠色產業和綠色項目發展。構建母基金生態圈與投資鏈，參與國家級基金、長三角產業基金的設立，聚焦推進臨港新片區、上海先導產業等重點區域與行業服務。本集團發揮專業力量，積極踐行金融國企使命擔當，以閉環的服務價值鏈，構建開放的客戶生態圈，湧現了一批創新成果，成為持續提升本公司競爭優勢和品牌影響力的重要支撐。

## 第三節 董事會報告

### 2. 全功能佈局的綜合金融服務平台

以母公司業務出發，通過設立、收購專業子公司，本集團不斷擴充金融產品服務範圍，延伸金融服務邊界，已基本建成涵蓋證券期貨經紀、投行、自營、資產管理、私募股權投資、另類投資、融資租賃、境外銀行等多個業務領域的金融服務集團。本集團財富管理業務持續深化服務能級，提升資源整合效率；投資銀行業務圍繞科創企業全生命周期，發揮產融結合優勢和資本市場功能，圍繞關鍵產業鏈，在集成電路、生物醫藥等行業積極佈局、重點開拓，業務排名行業前列；資產管理業務產品種類與管理規模持續提升；私募股權投資業務規模及品牌影響力行業領先；海外業務積極服務「一帶一路」「粵港澳大灣區」等國家戰略；融資租賃業務已確立並持續保持行業領先地位；研究服務市場影響力強。本集團深入踐行「一個海通」理念，深化「投、融、保、研」及財富管理業務線的協同聯動，加強整體協同，有效推進業務落地。本集團綜合化的金融平台具有強大的規模效應和交叉銷售潛力，為業務發展提供了有力支撐，為客戶綜合金融服務創造條件。

### 3. 廣泛的營業網點以及扎實的客戶基礎

本集團營業網點覆蓋「紐、倫、新、港、滬、東」六大國際金融中心。截至報告期末，本集團在中國境內擁有345家證券及期貨營業部（其中證券營業部311家，期貨營業部34家），遍佈30個省、直轄市和自治區；境外方面，在亞洲、歐洲、北美洲、南美洲、大洋洲全球5大洲15個國家和地區設有分行、子公司或代表處。憑藉遍佈全國的營業網點和極具戰略性的國際化佈局，本集團得以建立龐大且穩定的客戶群，截至報告期末，本集團在境內外擁有超2,500萬名客戶。

## 第三節 董事會報告

### 4. 加速改革深化的國際跨境服務平台

通過收購整合海通國際、海通銀行，設立上海自貿區分公司，本集團建立了跨境綜合金融服務平台，獲得了亞太地區先發優勢以及歐美地區的戰略儲備，伴隨中國客戶走出去、服務境外客戶引進來，本集團持續深化跨境業務深度協同。海通國際在2024年1月完成私有化的契機下，邁入新的發展階段，在本集團發展平台下不斷夯實自身核心競爭力。港股IPO領域不斷強化項目執行能力及品牌影響力，致力於提供全球範圍的跨境投資銀行服務；踐行ESG理念，積極參與綠色及可持續發展債券發行；打造面向全球機構客戶的全方位交易、研究與銷售平台，持續優化面向企業家客戶的私人財富管理模式，並着力佈局環球家族辦公室業務；資產管理領域業績持續提升，率先探索產品創新。海通銀行是深化本集團國際化戰略的重要儲備，也是本集團踐行國家「一帶一路」戰略的重要承載平台，海通銀行擁有在歐盟及南美市場上逾三十年的展業經驗，具有全銀行牌照，圍繞企業銀行、投資銀行以及資產管理三大重點業務領域，在深耕本土業務的基礎上，致力於開拓中國與歐洲、中國與拉丁美洲間的跨境業務合作。自貿區跨境業務方面，本公司是首批加入上海自貿試驗區FTU(自貿區分賬核算單元)體系的證券機構，持續助力上海自貿試驗區金融高水平開放。2024上半年，自貿區分公司圍繞優化自由貿易賬戶功能，持續推動FTU業務拓展和本集團內跨境業務聯動。全方位多地區的國際業務平台有利於本集團把握日益增長的跨境業務機會，滿足客戶的跨境業務需求，提升本集團的國際影響力。

## 第三節 董事會報告

### 5. 領先的資本實力

本公司通過A+H股上市、增發等多次戰略性股權融資和債券融資，迅速增強並持續保持了雄厚的資本實力，淨資產連續多年穩居行業前列。與機構投資者長期保持良好的合作關係，不斷強化融資能力建設，有序推進各項融資計劃，增強了本公司流動性管理能力與風險防控能力，確保了境內外業務的健康有序發展。充足的資本為本公司業務發展、滿足客戶的多元化金融服務需求、持續提升實體經濟服務能力夯實了基礎。

### 6. 穩健的經營理念

本公司始終堅持「務實、開拓、穩健、卓越」的經營理念與「穩健乃至保守」的風險控制理念，在三十多年的經營中，成功渡過了多個市場和業務周期、監管改革和行業轉型發展。本公司基本建立了覆蓋全集團的風險管理體系，落實全面風險管理要求，較為有效地管理市場風險、信用風險、流動性風險和操作風險等各類風險。本公司依照監管規定，建立健全合規管理制度和組織體系，不斷夯實合規審查、合規監測及合規檢查等職能履行，保障與促進本公司持續合規穩健發展。同時，本公司始終堅持以風險為本的工作原則，嚴格按照反洗錢法律法規，採取相關措施，控制洗錢及恐怖融資風險。



## 第三節 董事會報告

### 7. 行業領先的金融科技創新能力

本公司始終秉承「科技引領」發展戰略，以建設「敏捷化、平台化、智能化、生態化」為核心特徵的「數字海通2.0」為目標，堅持關鍵技術自主可控，深入推進金融科技創新，已成為行業數字化轉型的探索者、先行者。賦能業務成效持續深化，「e海通財」打造集團生態、行業生態、用戶生態於一體的綜合財富服務入口，APP月度活躍數繼續保持行業前列；「e海方舟」通過自研算法和市場主流算法相結合，打造海通特色的機構服務平台；「e海通行」助力南北向跨境交易業務，為境內外機構投資者提供多樣化、專業化的跨境投資交易及對沖工具；「e海言道」大模型業務場景不斷深入，推動金融服務提質升級；數字化底座持續夯實，證券公司中規模最大、設施最先進的自建科技園積極踐行ESG理念，着力打造綠色低碳園區，成為行業首家上榜國家綠色數據中心名單的證券公司；數據治理水平持續提升，致力於構建價值驅動的高可信數據資產管理體系，通過數據管理能力國家標準認證，成為率先獲評DCMM四級的證券公司之一；科技創新能力持續增強，截至報告期末，累計獲得38項國家專利授權和113項軟件著作權，數量位居行業前列。

## 三、管理層討論與分析

### (一) 總體經營情況

2024年以來，本公司以習近平新時代中國特色社會主義思想為指導，深入貫徹落實黨的二十大、中央經濟工作會議、中央金融工作會議等重要會議精神以及資本市場新「國九條」、證監會「兩強兩嚴」等政策文件精神，以建設金融強國為使命，以服務實體經濟為己任，聚焦金融「五篇大文章」，做優做強主責主業，充分發揮綜合金融服務優勢和資本市場服務功能，有效行使直接融資「服務商」、資本市場「看門人」、社會財富「管理者」的職責，在深化業務改革創新、加強集團化業務協同、服務打造新質生產力等方面取得積極成效。

## 第三節 董事會報告

### （二）主營業務分析

#### 1. 財富管理業務

##### 市場環境：

報告期內，資本市場「1+N」政策體系逐步建立，高質量發展加速推進，引導財富管理業務秉承「以投資者為本」的經營理念，以提高專業水平和服務能力為立足點，在貫徹「強本強基」、適應「嚴監嚴管」中，加快推動向以客戶為中心的買方服務模式轉型，更好服務社會財富管理需求。

報告期內，股票市場延續震盪調整態勢，股票、基金交投活躍度有所下滑，債券交易規模穩步增長。根據WIND數據，報告期內滬深兩市股票、基金交易量達人民幣230萬億元，同比下降7.62%；銀行間和交易所市場債券結算量人民幣1,280萬億元，同比增長4.05%。受股票市場波動影響，權益類基金規模有所下降，金融產品銷售市場承壓，根據WIND數據，報告期末股票型及混合型基金資產淨值合計人民幣6.16萬億元，較上年末下降2.05%。逆周期調節和監管政策不斷落地，市場兩融規模顯著下降，根據WIND數據，報告期末市場融資融券餘額達人民幣1.48萬億元，較上年末下降10.30%。股票質押式回購業務持續回歸服務實體經濟本源，市場整體風險可控。

##### 經營舉措及業績：

本公司深耕客戶需求，構建以客戶為中心，以財富管理轉型為方向，以資訊、產品、投研、投顧及工具為抓手的多層次客戶服務體系，為零售客戶、企業客戶及同業客戶提供綜合金融解決方案。報告期內，本公司股票、基金交易量合計人民幣7.40萬億元；期貨代理交易量人民幣13.09萬億元（單邊計算）；新開客戶數量69.60萬戶，新開客戶資產人民幣767.26億元。報告期末，本公司財富管理客戶數量1,875萬戶，託管客戶資產規模人民幣2.61萬億元。

## 第三節 董事會報告

### 2024年上半年本公司代理交易額變化

	本報告期	上年同期
股票交易量(人民幣億元)	58,360	66,514
基金交易量(人民幣億元)	15,623	15,971
合計(人民幣億元)	73,983	82,485

#### (1) 零售業務

本公司持續推進財富管理機構化轉型，致力於全面提升面向客戶全生命周期的綜合金融服務能力。報告期內，本公司加強國家重大發展戰略區域網點覆蓋，在北京、廈門等6個城市完成創新網點佈設，已有17家綜合創新網點正式開業，2家網點正在籌建中。本公司升級特色金融服務體系，發佈園區金融服務方案，優化戰略客戶及區域合作生態和平台，與29家地方政府、園區、高校簽署戰略合作協議。本公司構建企業家服務生態，組建長三角、京津冀、大灣區等五大區域企業家辦公室，通過「投資銀行+企業金融+私人金融」模式，優化存量客戶服務體驗，促進增量業務挖掘轉換。本公司基於買方投顧理念積極推動投顧業務佈局和轉型，不斷提升「盈投顧」品牌影響力和服務能級，搭建「交易+理財+綜合金融」立體式服務架構，強化以深度資訊、簡訊、直播、策略會為代表的多層次、多維度、多元化客戶服務工具，面向高淨值客戶持續推進「匠心100」專戶定制服務。

本公司以「統一管理、自主可控、融合業務、引領發展」為指引，以高水平數字金融能力滿足社會金融服務需求。報告期內，「e海通財」APP9.0以數字科技賦能客戶交易、以智能策略驅動數字化運營，推動全鏈路「數智化」場景搭建，圍

## 第三節 董事會報告

繞ETF場景探索工具矩陣、內容社區、分級課程等線上特色服務，構建「指數投資到海通」品牌，為客戶提供一站式線上財富管理服務；「e海方舟」以全面支持機構交易場景為目標，通過提供軟硬件極速櫃台、算法商城等五大產品線構建貫穿交易全流程的一體化綜合機構交易服務平台，通過金融科技賦能滿足機構投資者通用性、專業性的需求，為機構投資者提供極致交易服務體驗；通過打造機構業務「e海方舟」和「乘舟聽海」雙品牌，助力公司機構業務生態發展。報告期內，「e海通財」APP月度活躍數583萬人，行業排名第四；「e海方舟」累計股票、基金交易量逾人民幣萬億元。

### (2) 金融產品銷售業務

本公司以優化客戶體驗為抓手提升產品保有量，通過強化銷售組織、理順溝通機制、優化系統平台、完善銷售制度，不斷加強與外部優質基金公司深度合作，並建立以產品細分為基礎的專業化評估跟蹤機制，覆蓋公募、私募、資管等各類產品以及產品售前、售中和售後全生命周期。報告期內，本公司構建以客戶為中心的全光譜產品體系，在權益市場波動下通過固收類產品提前佈局，金融產品保有規模實現穩中有增，同時發力「e海通合」機構代銷綜合服務，機構客戶產品保有量佔比顯著提升。報告期內，本公司金融產品日均保有規模人民幣1,304億元，同比增長3.6%；債券型公募銷售量人民幣149億元，同比增長108.9%；固定收益類私募產品銷售量人民幣113億元，同比增長81.2%。

## 第三節 董事會報告

### (3) 融資類業務

本公司融資類業務嚴格落實監管各項要求，強化業務逆周期調節，確保業務平穩有序發展。報告期內，融資融券業務堅持以合規為本，持續夯實業務基本盤，加強高淨值客戶和企業客戶的拓展和服務，着力為客戶需求提供綜合解決方案，業務整體市佔率穩中有升。股票質押業務聚焦金融服務實體經濟定位，防範化解金融風險，積極引進優質項目，提升管理資產質量。報告期末，本公司融資類業務規模人民幣835.84億元，其中融資融券業務規模人民幣608.53億元，股票質押式回購業務規模人民幣227.00億元。

#### 2024年上半年末本公司融資類業務規模變化

	本報告期末	上年度末
融資融券餘額(人民幣億元)	608.53	655.62
股票質押餘額(人民幣億元) <sup>1</sup>	227.00	262.06
約定購回餘額(人民幣億元)	0.31	0.31
合計(人民幣億元)	835.84	917.99

### (4) 期貨業務

海通期貨各項業務穩步推進，市場地位持續鞏固。報告期內，實現代理交易額人民幣13.09萬億元(單邊計算)，市場佔比4.65%，行業排名第四。報告期末，客戶權益人民幣422.08億元；期貨資管業務規模人民幣275.72億元，較年

<sup>1</sup> 上表不含表外資管股票質押式回購業務，本報告期末表外資管股票質押式回購業務規模人民幣48.03億元



## 第三節 董事會報告

初增長27%，行業排名第三。海通期貨建立以衍生品類金融產品為核心的代銷產品線，報告期內基金銷售新增人民幣15.35億元，同比增長47.7%，集運（歐線）指數期貨成交量77萬手，金額人民幣1,342億元，市場排名第二。本公司榮獲2023年度鄭州商品交易所優秀會員、中國金融期貨交易所優秀會員綜合獎白金獎、上海期貨交易所優秀會員等逾40項獎項。

### (5) 境外財富管理

海通國際財富管理團隊不斷優化產品與解決方案，以股票、債券、基金、衍生產品及另類投資產品的多元貨架為基礎，以專業投資顧問服務為抓手，提升全面的產品服務能力。報告期內，海通國際財富管理客戶數量穩步提升，孖展規模有所下降，信用風險控制良好。

## 2. 投資銀行業務

### 市場環境：

報告期內，A股市場發行節奏持續放緩，從嚴監管政策相繼落地。根據WIND數據，全市場股權融資項目數量159家，同比下降60.93%，融資金額人民幣1,730億元，同比下降73.90%；其中IPO項目數量44家，同比下降74.57%，融資金額人民幣325億元，同比下降84.50%。北交所繼續進行深化改革，新增上市公司10家，新三板新增掛牌企業112家，超過半數企業躋身創新層。

報告期內，我國債券發行增勢不減，配置需求推動債市走強。根據WIND數據，各類債券發行合計人民幣38.33萬億元，同比增長10.82%；其中利率債發行合計人民幣12.24萬億元，同比減少1.46%；信用債發行合計人民幣9.73萬億元，同比增長3.93%；同業存單發行合計人民幣16.32萬億元，同比增長27.85%。



## 第三節 董事會報告

### 經營舉措及業績：

#### (1) 股權融資

境內股權融資方面，本公司積極落實國家戰略和監管政策，持續建設功能性投資銀行，着力服務科技創新和新質生產力發展，深入貫徹「行業化」「區域化」戰略部署，繼續強化品牌優勢，穩固市場領先地位。同時，本公司貫徹落實「一線要實、二線要專、三線要嚴」內部控制理念，進一步夯實合規風控建設，切實提高執業質量。報告期內，本公司共完成股權融資項目5單，融資金額人民幣29億元。本公司堅定專業化路線，積極佈局戰略性新興產業及未來產業，完成4單代表新質生產力的IPO項目，市場排名第一，融資金額人民幣26億元，市場排名第五；其中，完成科創板IPO項目1單，市場排名第二，融資金額人民幣6億元，市場排名第四。本公司緊抓北交所深化改革、新三板掛牌增量機遇，報告期內完成新三板掛牌項目2單，申報新三板掛牌項目12單。本公司大力推進申報工作，股權項目儲備豐富，報告期末本公司保薦的IPO在審及待發項目數量24家，再融資在審及待發項目數量12家。

## 第三節 董事會報告

### 境內股權融資項目發行及項目儲備情況

		本報告期	上年同期
首次公開發行	承銷金額(人民幣億元)	26.39	263.37
	承銷家數	4	11
再融資發行	承銷金額(人民幣億元)	3.00	66.31
	承銷家數	1	7
在審及待發項目數量	首次公開發行	24	67
	再融資發行	12	23

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

境外股權融資方面，海通國際致力於提供全方位的投資銀行服務，發揮「一個海通」協同優勢，在香港IPO保薦市場中保持領先地位。報告期內，海通國際完成香港聯交所IPO保薦項目4單，項目數量和承銷金額在香港所有中外資投行中分別排名第三和第四；完成香港IPO承銷項目3單，港股二級股權融資承銷項目1單。

#### (2) 債券融資

境內債券融資方面，本公司聚焦服務金融「五篇大文章」，持續助力金融強國建設。報告期內，本公司主承銷各類債券560隻，承銷金額人民幣1,945億元。本公司着力支持科技創新，主承銷科技創新公司債券和科創票據42隻，承銷金額人民幣106億元；持續支持綠色經濟發展，主承銷各品種綠色債券19隻，承銷金額人民幣57億元；積極助力小微企業對接資本市場，主承銷小微企業貸款專

## 第三節 董事會報告

項金融債券7隻，承銷金額人民幣49億元；拓寬金融創新渠道，助力發行全國首單總損失吸收能力(TLAC)非資本債券；支持人民幣國際化進程，助力發行全球首筆非金融企業離岸人民幣社會責任債券。

境外債券融資方面，海通國際作為核心主承銷商，完成多筆具有代表性的明星交易，報告期內共完成債券發行項目157筆；積極推動可持續金融發展，深入踐行ESG理念，完成ESG債券發行項目22筆，在ESG投融資領域保持中資金融機構領先地位；貫徹落實「一個海通」戰略，通過境內外協同聯動，完成20單境外發債項目及1單境內ABS項目；助力京東集團發行美元可換股優先票據20億美元，助力本公司發行全國最大規模兼首筆券商人民幣玉蘭債券，規模人民幣35億元。

### 3. 資產管理業務

#### 市場環境：

報告期內，隨着權益市場持續震盪，居民整體風險偏好降低，黃金、寬基指數、紅利策略等安全資產需求旺盛，同時在利率下行、供給端增量節奏放緩的背景下，疊加手工補息暫停帶來的「存款搬家」效果，債市需求強於供給，債牛行情推動固收類銀行理財、公募基金產品規模持續增長。根據中國基金業協會數據，報告期末公募基金存續規模人民幣31.08萬億元，較上年末增長12.62%。券商資管嚴格落實去通道、淨值化的監管要求，資產管理規模持續壓降。伴隨券商資管主動管理能力的提升和業務結構的轉型，在固收類產品的驅動下，券商資管私募產品規模企穩回升。根據中國基金業協會數據，報告期末證券期貨經營機構私募資管存續規模人民幣12.72萬億元，較上年末增長2.54%，其中證券公司及其資管子子公司存量產品規模人民幣5.80萬億元，較上年末增長9.30%。

## 第三節 董事會報告

### 經營舉措及業績：

本公司貫徹落實監管要求，持續提升主動管理能力，着力打造客戶類型、投資市場以及投資策略全覆蓋的產品體系，積極謀劃資管業務轉型並佈局公募市場，推進資產管理業務高質量發展。報告期末，全集團資產管理業務總規模超人民幣2.0萬億元。

#### (1) 基金管理公司

報告期內，富國基金全面貫徹新「國九條」精神，重點圍繞普惠金融、養老金融等推進業務高質量發展。報告期末，富國基金資產管理總規模約人民幣1.5萬億元。其中，公募基金規模逾人民幣9,900億元，固收類產品增長顯著；各類養老金業務有序推進，保持穩健增長態勢，管理組合數量及管理規模持續創新高。

報告期末，海富通基金資產管理總規模人民幣4,221億元，較年初實現正增長，其中非貨基金規模人民幣1,145億元，較年初增長11.7%。海富通基金債券ETF規模超人民幣400億元，是目前國內市場中債券ETF數量最多、品類最全、管理規模最大以及投資運作經驗最豐富的基金公司。

#### (2) 海通資管公司

海通資管公司順應資管行業發展的大趨勢，着力構建公募、私募產品條線，致力於打造投資策略全覆蓋的資管產品體系。公募業務方面，17隻參公大集合產品已初步形成了產品風險等級由低到高、持有期限差異化的公募產品矩陣線，在充分控制投資風險的前提下，力求實現產品資產的增值。報告期內，在收益率下行的背景下，海通資管公司立足投資者需求，在精細化運作的基礎上重點發力現金寶、安裕中短債、紅利優選等產品，幫助客戶在收益與風險間更好地實現平衡。私募業務方面，依託良好的投資歷史業績及市場口碑，以客戶需求

## 第三節 董事會報告

為導向，重點佈局固定收益、量化、另類投資、組合投資和跨境資管的綜合產品矩陣，為機構客戶及高淨值客戶提供個性化、專業化、多元化的全方位服務。報告期內，海通資管公司面向高淨值客戶積極佈局FOF產品，重點推進海外債券資產配置，成功發行公司首單集合QDII產品，為上海國際金融中心建設貢獻力量。報告期末，海通資管公司資產管理規模人民幣782億元，其中主動管理規模人民幣771億元，佔比達98.60%，集合理財產品投資業績市場排名前列。

### 海通資管公司業務規模及淨收入變化

	本報告期		上年同期	
	資產管理規模 (人民幣億元)	淨收入 (人民幣萬元)	資產管理規模 (人民幣億元)	淨收入 (人民幣萬元)
集合資產管理	358	8,875	233	7,840
單一資產管理	142	2,302	187	2,084
專項資產管理	282	423	405	473
合計	782	11,600	825	10,397

### (3) 私募股權基金

本公司私募股權投資基金始終牢記金融服務實體經濟的本源，聚焦佈局戰略性新興產業和未來產業，新增投資項目覆蓋集成電路、新一代信息技術、新能源、新材料、航空航天等科技領域，有效踐行「投早、投小、投硬科技」的投資理念。報告期內，新增投資項目16個，投資金額人民幣10億元；完成3隻基金的備案工作，合計認繳規模人民幣38億元。報告期末，基金管理數量合計63

## 第三節 董事會報告

隻，基金管理規模合計人民幣359億元。此外，積極探索賦能產業發展、助力產業升級的新模式，母基金業務加速開展，完成浦東新區引領區母基金和安徽海螺工業互聯網母基金對17隻子基金的投決工作，有效發揮海通母基金在培育耐心資本、助力科創企業發展方面的引領作用和放大效應。

報告期內，海通開元榮獲「2023年度中國最佳私募股權投資機構」「2023年度中國最佳券商私募子公司」「2022-2023年度中國最佳券商母基金」等獎項，獲得市場廣泛認可。

### 私募投資基金業務規模變化

	本報告期末	上年度末
管理基金數量	63	63
管理規模餘額(人民幣億元)	359	333
累計投資項目數量	16	52
累計投資項目金額(人民幣億元)	10	31
項目退出(含部分退出)數量	35	64

#### (4) 境外資產管理

海通國際資產管理團隊強調客戶導向，加速產品轉型，優化資產結構，深度挖掘和服務客戶在境內外市場的投資及配置需求，幫助海外機構客戶投資中國市場。報告期內，圍繞本公司「海外產品中心與配置中心」戰略定位，海通國際資產管理團隊一方面持續深化戰略轉型，積極打造符合客戶需求的市場化、標準化基金產品，提升外部客戶資產管理規模；另一方面深入踐行「一個海通」理念，加強跨境業務協同聯動，助力打造投行生態圈和跨境生態圈。報告期內，外部客戶資產管理規模新增約20億港元，旗下基金產品榮獲強積金評級、投資洞見與委託、亞洲資產管理等評選的多個獎項。海通銀行進一步完善業務佈局，資產管理子公司獲得葡萄牙證監會批准從事可轉讓證券組合投資，澳門分行正式獲批吸納公共存款業務。



## 第三節 董事會報告

### 4. 交易與機構服務業務

#### 市場環境：

報告期內，A股市場整體呈現先抑後揚再調整的走勢，大小盤股分化顯著，紅利資產持續上行，上證指數、深證成指、創業板指分別下跌0.25%、7.10%、10.99%，滬深300小幅上漲0.89%。H股市場震盪上行，恒生指數上漲3.94%。央行貨幣政策相對寬鬆，債券市場總體走強，利率中樞持續下行，中債企業債總淨價指數、中債國債總淨價指數、中債總財富指數分別收漲1.49%、2.96%、3.83%。

#### 經營舉措及業績：

##### (1) 交易業務

本公司固定收益業務根據債券市場的變化，及時調整債券久期和結構，在實現較好投資收益的同時，積極服務國家戰略，社會責任投資達人民幣163億元。報告期內，本公司榮獲銀行間市場外匯交易中心「X-Lending活躍機構」、深交所「2023年度優秀利率債承銷機構」、上交所「2023年度優秀債券投資機構(自營類)」等多個獎項。

本公司權益投資業務以「防範風險、追求絕對收益」為目標，以「立足長期、追求穩健」為基調，通過專業化、精細化研究，做好即期利潤和淨資產增長的平衡。報告期內，本公司堅持穩健的投資風格，以估值低、確定性強的高分紅價值組合為基石，輔以部分成長型股票，更靈活地把握市場結構性機會。

本公司衍生產品與交易業務通過場外衍生品工具提供豐富的表內非標準化衍生產品，解決客戶策略管理、財富管理、全球資產配置和風險管理等全方位的需求。做市業務聚焦服務能級提升，積極踐行社會責任，報告期末基金做市業務主做市品種超450隻，頭部基金公司全覆蓋，做市標的類型涵蓋股票型ETF、跨

## 第三節 董事會報告

境ETF、債券ETF、貨幣基金、REITs等全部品種；股票做市業務積極發揮功能性作用，助力多層次資本市場發展，為76家新三板掛牌企業做市，市場排名第二；期權做市業務獲得中金所「2023年度股指期權優秀做市商金獎」。

海通創新證券按照堅持「專業、專注」、堅持「兩個聚焦」（聚焦重點行業、聚焦重點行業的頭部企業）、踐行「三個服務」（服務實體經濟、服務國家科創戰略、服務「一個海通」）的戰略要求，積極推進優質項目儲備，為可持續發展奠定基礎。海通創新證券聚焦前沿科技領域，完善投資生態圈佈局，參與設立上海三大先導產業母基金，認繳金額人民幣10億元。

### (2) 機構業務

本公司機構業務完善頂層設計，圍繞「信息共享、資源互補、專業協同」推出機構客戶服務體系，成立機構業務委員會及業務部和區域中心，構建開放式機構客戶經理、敏捷式機構銷售團隊、一站式機構客戶服務，打造一支專業強、協同好、業績優的高質量機構業務團隊，提升本公司機構客戶綜合服務能力和市場競爭力。本公司推動研究體系改革，以鏈條化、國際化、立體化提升研究質量，構建「產研－投研－政研」研究新體系，積極發揮研究牽引和聯動作用，加強研究與本公司其他條線的合作力度，成為服務地方政府的智庫、國企改革的智囊、區域發展的助手、企業成長的推手。此外，本公司發揮海通國際海外研究和服務覆蓋的優勢，把握中資機構國際化發展迫切訴求和居民國際化配置資產需求，通過境內外多維度的屬地化研究和調研，不斷創新服務和產品，有力促進創收提升和價值挖潛，為機構客戶充分展示海通機構業務的全球視角。

報告期內，本公司機構業務發揮總分聯動優勢，形成北京、上海、廣深三大區域中心，打通屬地化和專業化的正向循環，在公募基金服務上保持高覆蓋率，

## 第三節 董事會報告

市場佔有率穩中有升，保持市場前列，與銀行理財子交易量、資管受託規模等取得突破。本公司研究所對外發佈報告2,869篇，舉辦電話會議721場，組織路演14,542餘場，覆蓋客戶超13萬人次。本公司充分整合境內外研究和銷售資源，舉辦「第二屆香港科技醫藥策略會」「印度日」「日本日」「越南日」等主題論壇，為境內企業跨境投資和併購提供智庫服務。

### 5. 融資租賃業務

#### 市場環境：

報告期內，國家金融監督管理總局發佈《金融租賃公司管理辦法(徵求意見稿)》，體現堅持回歸租賃業務本源、嚴格准入標準和監管要求、堅持防控金融風險三大監管導向，對融資租賃行業的合規展業具備參考意義。國務院印發《推動大規模設備更新和消費品以舊換新行動方案》，圍繞設備更新、消費品以舊換新、回收循環利用、標準提升四大行動部署具體措施，有利於提振內需，推動我國宏觀經濟延續回升向好態勢。嚴監管為融資租賃行業健康發展提供有序的外部保障，擴需求為融資租賃業務發展提供了穩健的市場基礎。融資租賃企業作為金融服務實體經濟的紐帶，立足租賃本源，在助力製造業升級，促進產業高端化、智能化、綠色化發展方面，具有廣闊的市場前景。

#### 經營舉措及業績：

報告期內，海通恒信緊抓服務國家戰略主線，立足租賃本源，堅持金融服務實體經濟的根本宗旨，圍繞金融「五篇大文章」深耕產業細分賽道，不斷深化產業化轉型，助力國家現代產業體系建設。報告期內，海通恒信實現收入總額及其他收入／收益人民幣

## 第三節 董事會報告

40.29億元，實現期間溢利人民幣8.12億元，海通恒信多措並舉優化負債結構，持續降低負債成本，期間溢利較上年同期略有增長；生息資產平均收益率為6.69%，加權平均淨資產回報率為8.55%。報告期末，海通恒信資產總額為人民幣1,130.82億元，權益總額為人民幣201.93億元。

報告期內本公司經營情況的重大變化，以及報告期內發生的對本公司經營情況有重大影響和預計未來會有重大影響的事項

✓不適用

## 四、報告期內主要經營情況

於2024年6月30日，本集團總資產人民幣7,214.15億元，歸屬於母公司淨資產人民幣1,630.28億元。截至2024年6月30日止六個月，本集團實現收入人民幣175.93億元，歸屬於母公司淨利潤人民幣9.53億元；加權平均淨資產收益率0.58%。

### (一) 綜合損益情況分析

#### 1 收入構成

單位：千元 幣種：人民幣

項目	截至2024年	截至2023年		增減情況	
	6月30日 止六個月 金額	6月30日 止六個月 金額	金額	金額	比例
佣金及手續費收入	<b>4,941,756</b>	6,462,063	-1,520,307		-23.53%
利息收入	<b>8,188,000</b>	9,320,529	-1,132,529		-12.15%
融資租賃收入	<b>765,501</b>	781,925	-16,424		-2.10%
投資收入及收益 (淨額)	<b>1,791,039</b>	3,286,842	-1,495,803		-45.51%
其他收入及收益	<b>1,906,564</b>	6,176,069	-4,269,505		-69.13%
收入、其他收入及 收益合計	<b>17,592,860</b>	26,027,428	-8,434,568		-32.41%

2024年上半年，本集團實現收入、其他收入及收益人民幣175.93億元，同比減少人民幣84.35億元，減幅32.41%，主要是子公司銷售收入減少。

## 第三節 董事會報告

### a. 佣金及手續費收入

單位：千元 幣種：人民幣

項目	截至2024年	截至2023年	增減金額	增減比例
	6月30日 止六個月	6月30日 止六個月		
證券及期貨經紀 業務收入	<b>3,083,600</b>	3,438,879	-355,279	-10.33%
承銷費及保薦費收入	<b>751,004</b>	1,827,800	-1,076,796	-58.91%
資產管理費收入 (含基金管理費收入)	<b>871,475</b>	959,640	-88,165	-9.19%
財務諮詢顧問費收入	<b>197,368</b>	188,618	8,750	4.64%
其他	<b>38,309</b>	47,126	-8,817	-18.71%
佣金及手續費收入 合計	<b>4,941,756</b>	6,462,063	-1,520,307	-23.53%

佣金及手續費收入為人民幣49.42億元，較去年同期減少人民幣15.20億元，減幅23.53%，主要是承銷費及保薦費收入和證券及期貨經紀業務收入減少。

### b. 利息收入

利息收入人民幣81.88億元，較去年同期減少人民幣11.33億元，減幅12.15%，主要是售後回租安排的應收款利息收入減少。

### c. 投資收入及收益(淨額)

投資收入及收益(淨額)人民幣17.91億元，較去年同期減少人民幣14.96億元，減幅45.51%，主要是金融工具投資收益減少。

## 第三節 董事會報告

### 本集團主營業務情況表

#### 主營業務分行業情況

單位：千元 幣種：人民幣

分部	分部收入	分部支出	分部 利潤率	分部收入比 上年同期增減	分部支出比 上年同期增減	分部利潤率比 上年同期增減
財富管理業務	6,248,569	4,931,456	21.08%	-11.76%	-7.74%	-3.44%
投資銀行業務	1,249,248	1,187,263	4.96%	-50.32%	-26.08%	-31.16%
資產管理業務	1,102,515	682,822	38.07%	-6.72%	-20.07%	10.34%
交易及機構服務	4,193,445	4,867,865	-16.08%	-30.58%	-5.07%	-31.19%
融資租賃業務	4,040,301	3,085,522	23.63%	-12.55%	-16.45%	3.56%
其他	758,782	860,821	-13.45%	-83.46%	-81.40%	-12.57%

#### 主營業務分地區情況

單位：千元 幣種：人民幣

分地區	分部收入	分部支出	分部 利潤率	分部收入比 上年同期增減	分部支出比 上年同期增減	分部利潤率比 上年同期增減
境內業務	12,857,605	9,431,048	26.65%	-31.12%	-32.95%	2.00%
境外業務	4,735,255	6,184,701	-30.61%	-35.68%	-13.98%	-32.94%
小計	17,592,860	15,615,749	11.24%	-32.41%	-26.53%	-7.10%



### 第三節 董事會報告

財富管理業務營業收入人民幣62.49億元，同比(人民幣70.82億元)減少人民幣8.33億元，減幅11.76%，主要是融資類業務收入同比減少；本集團緊緊圍繞服務實體經濟和新質生產力發展，不斷完善產品和服務體系，發揮本集團「投、融、保、研」與財富管理協同發力的綜合金融服務優勢，切實提升金融服務實體經濟質效。投資銀行業務營業收入人民幣12.49億元，同比(人民幣25.14億元)減少人民幣12.65億元，減幅50.32%，主要是IPO融資金額同比下降，本集團股權承銷收入減少。資產管理業務營業收入人民幣11.03億元，同比(人民幣11.82億元)減少人民幣0.79億元，減幅6.72%，主要是管理費率下降，本集團深入推進業務和功能轉型，不斷提升產品創新力度和投研能力，資管規模穩步提升。交易及機構業務營業收入人民幣41.93億元，同比(人民幣60.40億元)減少人民幣18.47億元，減幅30.58%，主要是市場行情波動，投資收入及收益減少。融資租賃業務營業收入人民幣40.40億元，同比(人民幣46.20億元)減少人民幣5.80億元，減幅12.55%，本集團緊抓傳統產業轉型升級、現代化產業體系加速建設的機遇，加強戰略謀劃和系統佈局，服務新質生產力發展。

## 第三節 董事會報告

### 2 支出構成

單位：千元 幣種：人民幣

支出總額	截至2024年	截至2023年	增減情況	
	6月30日 止六個月	6月30日 止六個月	金額	比例
折舊和攤銷費用	886,463	839,209	47,254	5.63%
僱員成本	3,038,109	3,651,013	-612,904	-16.79%
佣金及手續費支出	1,437,546	1,521,494	-83,948	-5.52%
利息支出	7,182,697	7,918,051	-735,354	-9.29%
預期信用損失模式下的減值損失	870,126	1,203,824	-333,698	-27.72%
其他資產減值損失	15,648	9,878	5,770	58.41%
其他支出	2,185,160	6,112,006	-3,926,846	-64.25%
合計	15,615,749	21,255,475	-5,639,726	-26.53%

2024年上半年，本集團支出總額人民幣156.16億元，較去年同期減少人民幣56.39億元，減幅26.53%，主要是子公司銷售成本減少。

2024年上半年，本集團實現歸屬於本公司股東的淨利潤人民幣9.53億元，同比下降75.11%；實現基本每股收益人民幣0.07元／股，同比下降75.86%；加權平均淨資產收益率0.58%，同比減少1.71個百分點。

## 第三節 董事會報告

### 3 公益投入

2024年上半年，本集團在環保公益、救災捐款、教育資助、慈善捐款等公益性方面的投入金額共計人民幣2,488千元。

#### 2024年上半年公益性投入構成明細

單位：千元 幣種：人民幣

項目	本期發生額
慈善捐贈，教育資助，救災捐款等	2,488
合計	2,488

### 4 現金流

2024年上半年末，本集團現金及現金等價物總計人民幣692.27億元，較上年末增加人民幣116.86億元，其中：

來自經營活動的現金淨額人民幣256.92億元，主要是以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產和衍生金融資產的減少，導致現金流入人民幣95.15億元；應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的減少，導致現金流入人民幣79.29億元。

來自投資活動的現金淨額人民幣57.83億元，主要是處置收回以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具，導致現金流入人民幣315.74億元；購買以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具，導致現金流出人民幣267.13億元。

用於籌資活動的現金淨額人民幣197.73億元，主要是償還借款、短期融資券及非可轉換債券支付的款項，導致現金流出人民幣956.02億元；發行短期融資券及非可轉換債券等所得款項，導致現金流入人民幣453.09億元；籌集借款所得款項，導致現金流入人民幣396.45億元。

### 5 其他

報告期內，本集團利潤構成和來源未發生重大變動。

## 第三節 董事會報告

### （二）綜合財務狀況表主要分析

#### 1 綜合財務狀況主要項目分析

單位：千元 幣種：人民幣

	2024年		2023年		增減情況	
	6月30日	構成	12月31日	構成	金額	比例
<b>非流動資產</b>	<b>186,436,875</b>		192,117,950		-5,681,075	-2.96%
其中：應收融資租賃款	10,157,761	1.41%	11,248,040	1.49%	-1,090,279	-9.69%
售後回租安排的應收款	36,083,833	5.00%	40,593,188	5.38%	-4,509,355	-11.11%
以公允價值計量且其變動計入 其他全面收益的債務工具	53,933,453	7.48%	52,676,210	6.98%	1,257,243	2.39%
以公允價值計量且其變動計入 其他全面收益的權益工具	10,416,426	1.44%	8,010,844	1.06%	2,405,582	30.03%
以公允價值計量且其變動計入 損益的金融資產	26,207,802	3.63%	24,766,774	3.28%	1,441,028	5.82%
其他貸款及應收款項	122,104	0.02%	548,019	0.07%	-425,915	-77.72%
權益法項下投資	7,560,572	1.05%	8,115,626	1.08%	-555,054	-6.84%
買入返售金融資產	806,799	0.11%	2,013,400	0.27%	-1,206,601	-59.93%
物業及設備	16,349,799	2.27%	16,643,326	2.21%	-293,527	-1.76%
客戶貸款	5,106,119	0.71%	5,155,382	0.68%	-49,263	-0.96%
商譽	3,476,950	0.48%	3,468,589	0.46%	8,361	0.24%
<b>流動資產</b>	<b>534,977,660</b>		562,468,842		-27,491,182	-4.89%
其中：銀行結餘及現金	139,804,562	19.38%	136,387,128	18.07%	3,417,434	2.51%
結算備付金	15,900,998	2.20%	15,584,378	2.07%	316,620	2.03%
以公允價值計量且其變動計入 損益的金融資產	185,190,483	25.67%	196,506,316	26.04%	-11,315,833	-5.76%
孖展融資客戶墊款	63,944,096	8.86%	68,418,208	9.07%	-4,474,112	-6.54%
應收賬款	8,320,102	1.15%	12,167,275	1.61%	-3,847,173	-31.62%
買入返售金融資產	32,029,721	4.44%	34,769,832	4.61%	-2,740,111	-7.88%
應收融資租賃款	7,716,322	1.07%	8,644,405	1.15%	-928,083	-10.74%
售後回租安排的應收款	37,017,928	5.13%	38,923,317	5.16%	-1,905,389	-4.90%
以公允價值計量且其變動計入 其他全面收益的債務工具	3,279,794	0.45%	8,634,537	1.14%	-5,354,743	-62.02%
交易所儲備及保證金	20,731,501	2.87%	23,480,478	3.11%	-2,748,977	-11.71%
衍生金融資產	2,079,842	0.29%	2,278,555	0.30%	-198,713	-8.72%
其他貸款及應收款項	5,176,240	0.72%	4,742,213	0.63%	434,027	9.15%
<b>資產總額</b>	<b>721,414,535</b>		754,586,792		-33,172,257	-4.40%

### 第三節 董事會報告

	2024年		2023年		增減情況	
	6月30日	構成	12月31日	構成	金額	比例
<b>流動負債</b>	<b>407,786,889</b>		420,156,185		-12,369,296	-2.94%
其中：應付經紀業務客戶賬款	106,526,337	19.36%	106,538,717	18.38%	-12,380	-0.01%
賣出回購金融資產款	98,965,552	17.99%	111,617,827	19.25%	-12,652,275	-11.34%
借款	51,588,937	9.38%	48,942,398	8.44%	2,646,539	5.41%
拆入資金	17,610,021	3.20%	12,740,366	2.20%	4,869,655	38.22%
以公允價值計量且其變動計入 損益的金融負債	10,230,741	1.86%	13,130,414	2.26%	-2,899,673	-22.08%
衍生金融負債	1,230,667	0.22%	1,190,945	0.21%	39,722	3.34%
其他應付及預計費用	19,352,470	3.52%	22,538,352	3.89%	-3,185,882	-14.14%
應付短期融資款	15,571,430	2.83%	18,853,059	3.25%	-3,281,629	-17.41%
客戶存款	5,664,040	1.03%	4,828,712	0.83%	835,328	17.30%
所得稅負債	590,433	0.11%	851,562	0.15%	-261,129	-30.66%
應付債券	79,895,931	14.52%	78,301,231	13.51%	1,594,700	2.04%
<b>流動資產淨值</b>	<b>127,190,771</b>		142,312,657		-15,121,886	-10.63%
<b>非流動負債</b>	<b>142,436,091</b>		159,631,048		-17,194,957	-10.77%
其中：應付債券	109,554,840	19.91%	115,619,049	19.94%	-6,064,209	-5.24%
長期借款	18,784,786	3.41%	24,410,822	4.21%	-5,626,036	-23.05%
賣出回購金融資產款	760,127	0.14%	946,966	0.16%	-186,839	-19.73%
以公允價值計量且其變動計入 損益的金融負債	2,016,560	0.37%	7,322,991	1.26%	-5,306,431	-72.46%
拆入資金	1,894,976	0.34%	1,971,998	0.34%	-77,022	-3.91%
<b>負債總額</b>	<b>550,222,980</b>		579,787,233		-29,564,253	-5.10%
<b>權益總額</b>	<b>171,191,555</b>		174,799,559		-3,608,004	-2.06%

\* 構成比例資產類為佔總資產的比例，負債類為佔總負債的比例

截至2024年6月30日，本集團資產總額為人民幣7,214.15億元，較2023年末減少人民幣331.72億元，減幅4.40%；負債總額為人民幣5,502.23億元，較2023年末減少人民幣295.64億元，減幅5.10%。

## 第三節 董事會報告

截至2024年6月30日，非流動資產為人民幣1,864.37億元，較2023年末減少2.96%，主要是售後回租安排的應收款減少；流動資產為人民幣5,349.78億元，較2023年末減少4.89%，主要是以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產減少。流動負債為人民幣4,077.87億元，較2023年末減少2.94%，主要是賣出回購金融資產款減少；流動資產淨值為人民幣1,271.91億元，較2023年末減少10.63%；非流動負債為人民幣1,424.36億元，較2023年末減少10.77%，主要是應付債券減少。

截至2024年6月30日，本集團歸屬於本公司擁有人的權益為人民幣1,630.28億元，較2023年末減少人民幣2.16億元，減幅0.13%；扣除應付經紀業務客戶賬款的影響因素，本集團資產負債率為72.16%，較2023年末資產負債率73.03%，下降了0.87個百分點，本集團資產負債結構保持相對穩定。

### 借款及債券融資

截至2024年6月30日，本集團的借款及債券融資額為人民幣275,396百萬元，下表載列於2024年6月末本集團的借款及債券融資明細：

單位：千元 幣種：人民幣

	2024年 6月30日	2023年 12月31日
應付債券	189,450,771	193,920,280
借款	70,373,723	73,353,220
應付短期融資款	15,571,430	18,853,059
合計	<b>275,395,924</b>	286,126,559

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

截至2024年6月30日，於一年內到期的借款、應付短期融資款及債券金額為人民幣1,470.56億元，本集團扣除於一年內到期的應付債券、借款、應付短期融資款等負債後的流動資產淨值為人民幣1,271.91億元，因此，本集團面臨的流動性風險並不重大。

除在本報告中已披露外，於2024年6月30日，本集團並無未償還按揭、抵押、債券、其他債務資本、承兌負債或其他類似債項、租購及融資租賃承擔、保證或其他重大或然負債。



## 第三節 董事會報告

### (三) 投資狀況分析

#### 1. 對外股權投資總體分析

報告期末，本集團權益法項下投資人民幣75.61億元，較上年末(人民幣81.16億元)減少人民幣5.55億元，減幅6.84%。權益法項下投資參見本報告綜合財務資料附註20。

##### (1). 重大的股權投資

報告期內，本集團無重大股權投資。

##### (2). 重大的非股權投資

報告期內，本集團無重大非股權投資。

##### (3). 以公允價值計量的金融資產

本集團以公允價值計量的金融資產主要為以公允價值計量且變動計入損益的金融該資產人民幣2,113.98億元，以公允價值計量且變動計入損益的金融負債人民幣122.47億元，以公允價值計量且變動計入其他綜合收益的權益工具人民幣104.16億元，以公允價值計量且變動計入其他綜合收益的債務工具人民幣572.13億元及衍生金融工具人民幣8.49億元。

### (四) 重大資產和股權出售

報告期內，本集團無重大資產或股權出售。

### (五) 主要控股參股公司分析

1. 海通創新證券，註冊資本人民幣115億元，海通證券持有100%的股權。於2024年6月30日，海通創新證券總資產為人民幣195.06億元，淨資產人民幣192.78億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣-6.67億元，淨虧損人民幣4.48億元。
2. 海通國際控股，註冊資本111.80億港幣，海通證券持有100%的股權。於2024年6月30日，海通國際控股總資產為1,126.96億港幣，淨資產13.82億港幣；截至2024年上半年，實現營業收入-16.97億港幣，淨虧損28.73億港幣。
3. 海通開元，註冊資本人民幣55億元，海通證券持有100%的股權。於2024年6月30日，海通開元總資產為人民幣81.41億元，淨資產人民幣74.53億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣-3.97億元，淨虧損人民幣3.37億元。

### 第三節 董事會報告

4. 恆信金融集團，註冊資本41.46億港幣，海通證券持有100%的股權。於2024年6月30日，恆信金融集團的總資產為人民幣1,139.16億元，淨資產人民幣212.05億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣24.05億元，淨利潤人民幣8.24億元。
5. 海通資管公司，註冊資本人民幣22億元，海通證券持有100%的股權。於2024年6月30日，海通資管公司的總資產為人民幣59.88億元，淨資產人民幣57.78億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣1.94億元，淨利潤人民幣0.49億元。
6. 上海惟泰置業，註冊資本人民幣1,000萬元，海通證券持有100%的股權。於2024年6月30日，上海惟泰置業的總資產為人民幣2.73億元，淨資產人民幣0.16億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣0.12億元，淨利潤人民幣97.84萬元。
7. 海通期貨，註冊資本人民幣13.015億元，海通證券持有83.22%的股權。於2024年6月30日，海通期貨總資產為人民幣487.66億元，淨資產人民幣37.86億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣13.37億元，淨利潤人民幣1.19億元。
8. 海富通基金，註冊資本人民幣3億元，海通證券持有51%的股權。於2024年6月30日，海富通基金總資產為人民幣38.11億元，淨資產人民幣26.58億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣4.54億元，淨利潤人民幣1.34億元。
9. 富國基金，註冊資本人民幣5.2億元，海通證券持有27.775%的股權。於2024年6月30日，富國基金總資產為人民幣133.69億元，淨資產人民幣82.08億元；截至2024年上半年，實現營業收入人民幣29.18億元，淨利潤人民幣7.74億元。

## 第三節 董事會報告

### (六) 本公司控制的結構化主體情況

本公司對期末持有的結構化主體，綜合考慮合併報表範圍內的本公司合計享有這些結構化主體的可變回報，或承擔的風險敞口等因素，認定將58個結構化主體納入合併報表範圍。

## 五、其他披露事項

### (一) 可能面對的風險及應對措施

#### 1. 風險管理概述

本集團一直以來注重對風險的防範與控制，確立了「務實、開拓、穩健、卓越」的經營理念，樹立了「穩健乃至保守」的風險控制理念，經營管理實行合規優先、風險管理優先的原則。

本集團根據《證券公司全面風險管理規範》等監管要求及內部制度，從全覆蓋、可監測、能計量、有分析、能應對等方面持續完善全面風險管理體系建設，強化風控指標併表管理，健全集團T+1風險數據集市；搭建層級分明的風險管理組織架構，覆蓋各風險類別、各業務條線、各單位，不斷完善風險識別、評估、計量、監控、報告和應對；建立多層級風控指標體系，通過系統實現監控和預警，並通過開展壓力測試評估極端風險影響；加強同一客戶、同一業務風險管理，完善集團風險限額體系並向部門、子公司拆解；建立集團智能預警平台，提升風險預判預警能力；開展市場風險、信用風險、流動性風險計量，建立模型管理機制並持續對模型開展評估和驗證；定期編製集團風險報告，針對重大風險事件編製專項報告；選擇合適的應對策略，建立有效的應對機制以及具有可操作性的應急預案。此外，本集團從文化建設、制度建設、數據和系統建設、人才隊伍建設、加強風控投入等方面為全面風險管理提供保障和支持。

## 第三節 董事會報告

### 2. 風險管理架構

本公司依據《公司法》《證券法》《證券公司內部控制指引》《證券公司全面風險管理規範》等法規及公司規章制度要求，搭建了多層次的風險管理組織架構，明確了董事會、監事會、經營層、首席風險官、風險管理部門、業務及管理部門、分支機構、子公司等各層級在風險管理工作中的具體職責。

董事會是本公司風險管理戰略目標的制定者和授權人，負責審議批准本公司風險管理的總體目標、基本政策和重要制度、本公司整體風險偏好和風險容忍度、重大風險的解決方案、定期風險評估報告監督本公司風險管理政策的實施，任免考核首席風險官，建立與首席風險官的直接溝通機制，及本公司章程規定的其他職責。本公司董事會設合規與風險管理委員會，具體履行董事會風險管理職責。

本公司監事會是本公司風險管理和內部控制體系的監督者，負責對董事會、經營層建立和實施風險管理及內部控制的情況進行監督，並履行本公司章程規定的其他職責。

本公司經營層根據董事會的授權，負責建立責任明確、程序清晰的組織結構，制定本公司風險管理的政策、規章和制度，貫徹執行本公司整體風險偏好和風險容忍度政策，組織實施各類風險的識別、評估及應對工作，建立健全和有效執行風險管理制度和機制，及時處理或者改正存在的問題缺陷，審議處理本公司重大風險事件，建立涵蓋風險管理有效性的全員績效考核體系，建立完備的信息技術系統和數據質量控制機制，及董事會授予的其他風險管理職責。

## 第三節 董事會報告

本公司設首席風險官，由董事會聘任。首席風險官是負責本公司全面風險管理工作的高級管理人員，負責組織實施董事會、經營層確定的風險管理政策、規章和制度，組織對本公司建立健全各項業務風險管理制度進行督導、審查和評估，組織對本公司風險管理政策和流程的執行情況進行監督和檢查，對風險管理中存在的問題提出處理意見並督促整改，組織評估和完善風險管理的工具和方法，定期組織對本公司面臨主要風險水平及其管理狀況進行評估，並向經營層、董事會及監管部門提交評估報告，組織對子公司風險管理工作負責人的提名和考核等。

本公司設立風險管理部，在首席風險官的領導下履行風險管理職責，負責擬定本公司風險管理的政策、規章和制度，督導本公司各單位制定業務風險管理制度和流程，對相關業務的主要風險進行識別和評估，組織對各項業務風險管理制度執行情況的監督、檢查，定期對本公司整體風險水平及其風險管理狀況進行評估和報告，對重大風險隱患或風險事件，及時報告並提出風險處置建議等。此外，本公司合規管理部負責管理本公司合規風險、洗錢及恐怖融資風險，本公司資金管理總部負責管理本公司流動性風險，本公司總經理辦公室負責管理本公司聲譽風險，本公司信息技術管理部門負責管理本公司信息技術風險。

本公司各部門、分支機構和子公司負責其經營管理範圍內的風險管理工作，建立健全相應的風險管理制度和流程，落實本公司風險管理政策，組織實施相應的風險管理工作。本公司各部門、各分支機構和子公司負責人承擔本單位風險管理有效性的直接責任。本公司各部門、各分支機構和子公司指定專人具體負責本單位的風險管理工作，對風險管理政策和制度的執行情況進行監督、檢查和報告，履行一線風險管理職責。



## 第三節 董事會報告

本公司稽核審計部負責定期對本公司風險管理工作進行稽核檢查，定期評估風險管理體系的有效性，並根據評估結果提出改進建議。

各子公司規範運作，依法經營。本公司將子公司風險管理納入全面風險管理體系，對其風險管理工作實行垂直管理，每日開展風控指標併表管理，建立了集團T+1風險數據集市，並從子公司風險管理負責人提名、風險限額與報告、重大事項審批、風險數據對接、風控指標併表、風險督導檢查、風險考核評價等方面落實對子公司的垂直風險管理。

### 3. 各類風險的應對措施及其報告期內表現

本集團業務經營活動面臨的風險主要有：合規風險、洗錢及恐怖融資風險、信用風險、市場風險、操作風險、流動性風險、聲譽風險，具體情況如下：

#### (1) 合規風險

合規風險是指因證券基金經營機構或其工作人員的經營管理或執業行為違反法律法規和準則而使證券基金經營機構被依法追究法律責任、採取監管措施、給予紀律處分、出現財產損失或商業信譽損失的風險。

本公司按照合規管理監管要求，並結合本公司的實際情況，建立科學合理、職責分明的合規管理架構體系，明確董事會、監事會、經營管理主要負責人、合規總監、其他高級管理人員的合規管理職責定位，合規部門、其他內控部門、本公司下屬單位分工明確，協調互動。本公司制定《海通證券股份有限公司合規管理辦法》及配套制度，配置合規管理人員隊伍體系，通過合規事前審查、事中監測、事後檢查、考核及問責，嚴格開展合規管理，同時加大合規宣導工作力度，積極培育「人人合規、主動合規」的經營環境。



## 第三節 董事會報告

報告期內，本公司在穩步有序開展合規審查、合規檢查、合規監測等合規管理基礎工作的基礎上，堅持目標導向、問題導向，夯實對重點領域的執行保障支持力度，提升合規與業務的雙向融合，加強本集團合規管理建設，積極培育人人合規、主動合規、持續合規、全面合規的合規文化。

### (2) 洗錢及恐怖融資風險

本公司根據《法人金融機構洗錢和恐怖融資風險管理指引(試行)》，制定了《海通證券股份有限公司洗錢和恐怖融資風險管理辦法》，建立健全董事會負責下的反洗錢組織架構，形成本公司反洗錢領導小組統籌協調、合規部門牽頭組織實施、相關業務部門和分支機構落實執行的反洗錢管理體系。本公司建立了包括集團洗錢風險管理制度、本公司反洗錢基本制度及其他配套制度和操作規程等在內的反洗錢管理制度體系，制定以「風險為本」的洗錢和恐怖融資風險管理策略，針對本公司各業務條線面臨的不同風險狀況採取相應的風險管控措施，並通過培訓和宣傳促進洗錢風險管理文化傳導，營造良好的洗錢風險管理文化氛圍，積極防範洗錢和恐怖融資風險。

報告期內，本公司持續完善洗錢和恐怖融資風險管理機制，全面推進洗錢和恐怖融資風險管理文化宣導，提升本公司洗錢和恐怖融資風險管理水平。一是進一步加強信息技術對洗錢和恐怖融資風險管理的支持，研究優化監測模型，提升監測和報告針對性和有效性。二是加強洗錢風險管理文化建設，開展反洗錢專項培訓，提升一線單位反洗錢履職能力。三是積極履行反洗錢宣導義務，通過本公司微信公眾號發佈宣傳材料，結合5•15全國打擊經濟犯罪宣傳日組織開展宣傳活動，提高投資者洗錢和恐怖融資風險防範意識。

## 第三節 董事會報告

### (3) 信用風險

信用風險是指因融資人、交易對手方或債務發行人無法履行其約定的財務義務或信用資質發生不利變化而可能造成損失的風險。本集團目前面臨的信用風險主要集中在交易性融資業務（如融資融券、股票質押式回購、孖展交易）、信用債券交易與投資業務、融資租賃業務、場外衍生品業務等。

針對交易性融資業務，本集團通過制定和實施各項嚴格的制度和措施，主要從盡職調查、內部評級、項目評審、授信管理、逐日盯市、限額監控、貸後跟蹤、補充增信、平倉處置、司法追索和撥備計提等環節實施管控。

針對信用債券交易與投資業務，本集團注重通過分散投資控制集中度風險，投資標的主要傾向於高信用評級資產，在信用風險管理中密切跟蹤投資標的的經營情況和信用評級變化，落實內部評級和統一授信管理機制，建立健全債務發行人、行業和地域集中度等信用風險監控指標，在投後跟蹤中及時根據財務指標變動、重大風險事件和負面輿情等信息更新債務發行人內部評級和授信限額指標，動態調整交易策略。

針對融資租賃業務，本集團堅守服務實體經濟本源，堅持以行業與客戶並重的策略確定信用風險管理政策。行業層面上，本集團就融資租賃客戶所處行業的景氣程度施行動態跟蹤和評估，以此為基礎制定相應的行業投放政策、管控行業集中度風險。客戶層面上，本集團主要通過開展盡職調查、內部評級、授信審核、貸後資產巡檢、風險預警與監測、集中度限額控制等措施對客戶信用風險實施管控。

### 第三節 董事會報告

針對場外衍生品業務，本集團從交易對手准入和授信管理、標的證券管理、風險應對與處置等方面建立了完善的管理制度與流程，對存續期內的場外衍生品交易進行逐日盯市，並通過嚴格履行淨額結算和履約保障等措施管理交易對手信用風險。同時，本集團關注信用風險和市場風險之間的相關性，對市場波動背景下的信用風險採取必要的監控和應對措施，包括但不限於交易保證金安排、交易對手內部評級與授信管理、未來潛在風險暴露計量、錯向風險識別等。

本集團根據行業監管政策、資本市場環境和集團業務發展戰略，持續完善信用風險管理體系。報告期內，本集團以信用風險管理辦法等制度為依據，全面落實以同一客戶、同一業務為核心的信用風險識別、評估、計量、監控、報告及應對工作。一是依託集團智能預警中心的建設成果，制定信用風險預警管理制度，全面推廣預警工作機制在全集團的應用，落實並完善業務事前、事中及事後的風險監測，賦能業務發展、增強風險預警預判能力；二是基於集團T+1風險數據集市，持續優化信用風險管理系統，完善內部評級體系，提升風險識別、計量與壓力測試能力，從資產質量、風險抵補和集中度風險等多個維度完善信用風險限額體系；三是堅持風險管理關口前移的工作思路，全面修訂法人客戶信用評級管理辦法，持續強化信用風險評估的前瞻性、及時性和規範化程度。報告期內，本集團核心信用風險監控指標運行平穩，整體信用風險可控。

針對融資類三項業務，本公司主動優化業務結構，審慎評估新做項目，強化存續項目的跟蹤、監控和管理，加大存量風險項目追償力度並審慎、前瞻地計提信用減值準備，確保風險撥備計提充分。截至報告期末，本公司融資融券存量負債客戶的平均維持擔保比例為251.01%，約定購回式證券交易客戶的平均履約保障比例為288.24%，股票質押式回購業務客戶的平均履約保障比例為207.01%，融資人提供的擔保品較為充足，信用風險整體可控。

## 第三節 董事會報告

### （4）市場風險

市場風險是指因市場價格的不利變動而使自有資金投資的相關業務發生損失的風險。市場風險的類別主要包括股票價格風險、利率風險、匯率風險和商品價格風險。

針對股票價格風險，本集團承擔此類風險的業務主要包括權益類證券自營業務、做市業務和場外衍生品業務等。股票價格風險具有較大的不確定性，是本集團主要面對的市場風險類型之一。本集團密切關注相關資產價格波動，並採取相應措施予以防範，通過每日跟蹤證券持倉的投資規模和風險價值（VaR）變化情況進行監測和管控。本集團通過實施多元化投資策略，對各類證券品種的投資規模進行適當控制和適時調整，並結合各類套期保值工具，較為有效地控制了市場風險。

針對利率風險，本集團承擔此類風險的業務主要包括債券投資業務和利率衍生品業務等。本集團對利率風險的控制，主要採用規模控制和投資組合等方法，合理配置資產，匹配負債與資產的期限結構，並通過定期測算投資組合久期、凸性、DV01等指標衡量利率風險。

針對匯率風險，本集團面對複雜多變的境外市場，持續跟蹤研究外匯市場，不斷完善制度建設和內部管理，通過套保等一系列措施對沖、緩釋匯率風險。本集團注重外幣資產和負債的匹配，以控制外匯風險的敞口。

針對商品價格風險，本集團相關風險敞口較低，主要通過商品期貨、期權等商品衍生工具進行對沖，以管理商品風險。

### 第三節 董事會報告

除上述風險因素之外，本集團所從事的境外投資交易業務也承擔着相關市場風險，全球範圍內各種市場風險因子的波動都可能對本集團的整體損益帶來影響。報告期內，根據集團市場風險管理辦法的有關要求，本公司不斷推進落實集團層面市場風險的識別、評估、計量、監測、應對和報告等程序，將子公司投資交易業務納入整體市場風險管理體系內。對於集團下屬子公司進行的投資交易業務，通過制定並分配風險價值限額、止損限額等市場風險限額指標進行管控，並基於T+1風險數據集市、集團市場風險管理系統、風險報告等工具或手段，對子公司市場風險狀況和風險限額執行情況進行跟蹤和監督。

本集團通過以風險價值為主的市場風險量化指標體系對各項投資交易類業務承擔的市場風險情況進行計量和管控。風險價值指在一定的置信水平下，投資組合在未來特定前瞻期內因市場波動而產生的最大可能損失，是衡量市場風險的主要指標。本集團風險價值模型的具體計量參數為95%置信水平、1日前瞻期，模型計量的覆蓋範圍包括本集團層面持有的權益、利率、外匯等各類金融資產和衍生品。本集團通過返回檢驗等手段，持續監控和評估風險價值模型的有效性，並隨着業務發展和風險管理的需要持續完善風險價值模型。此外，本集團建立壓力測試管理機製作為風險價值模型的重要補充，通過構建各類歷史情景和模擬情景以及相應的壓力測試傳導機制，衡量投資交易業務可能面臨的極端損失情況，並評估損失是否在可承受範圍內。報告期內，本公司各月月末風險價值佔本公司淨資產的比例、以及本集團風險價值佔本集團淨資產的比例均保持在0.2%以內，市場風險可控可承受。



## 第三節 董事會報告

### （5）操作風險

操作風險是指由內部流程缺陷、人員失誤或不當行為、信息系統缺陷或故障，以及外部因素等原因而造成損失的風險。操作風險貫穿於業務開展與日常運營過程中的各個環節，並可能導致法律風險、合規風險、聲譽風險等其他風險。本集團以操作風險管理辦法等制度為依據，利用風險與控制自我評估、關鍵風險指標、損失數據收集等風險管理工具開展操作風險識別、評估、監測、報告等工作。本集團每年開展年度風險與控制自我評估，並根據監管要求及新業務、新產品開展情況等進行專項風險與控制自我評估。建立了覆蓋集團主要部門及子公司的關鍵風險指標體系，對關鍵風險指標開展監測工作。在本集團範圍內開展操作風險事件收集工作，監控風險事件發生情況及進展，並針對風險事件揭示的問題及時排查分析並制定相應的整改措施。報告期內，本集團根據中國證券業協會發佈《證券公司操作風險管理指引》，持續完善操作風險管理體系建設，進一步推進優化集團操作風險管理的機制流程，提升操作風險管理工具的應用實效。

信息技術風險是指在借助信息技術手段從事證券基金業務活動中，由於自然因素、人為因素、技術漏洞和管理缺陷產生的風險。本集團持續加強信息技術管理的制度建設，不斷完善網絡與信息安全事件應急預案，定期進行應急演練，並採用定期或不定期的監測、專項檢查等多種手段對系統運行、系統建設、信息安全、科技管理等方面的信息技術相關情況進行監控和管理，防範信息技術風險。報告期內，本集團持續加強信息技術系統的建設和運維，嚴格按照操作程序進行定期和不定期的檢查和維護，以保證系統的可靠、穩定和安全運轉。



## 第三節 董事會報告

### (6) 流動性風險

流動性風險是指無法以合理成本及時獲得充足資金，以償付到期債務、履行其他支付義務和滿足正常業務開展的資金需求的風險。本公司經營過程中易受宏觀政策、市場變化、經營狀況、客戶信用等因素影響，並可能因資產負債結構不匹配而引發流動性風險。

在日間流動性風險管理方面，本公司按照風險偏好及限額的要求，通過合理的監測和調控手段，始終確保流動性風險可測、可控和可承受，同時儲備了充足的優質流動性資產，以保障本公司業務的開展和到期負債的償付。本公司開展日間流動性和風險指標管理，結合資產端和負債端，構建資金、指標聯動體系，完善了包括日間指標頭寸跟進、月度指標前瞻分析和部門指標拆解在內的流動性風險分析框架，豐富了不同期限內流動性風險管理的工具，提升了本公司流動性風險管理和預判的效率。

在中長期流動性風險管理方面，本公司不斷優化資產配置結構，強化對資產負債發展趨勢的分析，從源頭上把控流動性風險。一方面，本公司成立資產負債配置委員會，積極開展資產負債管理工作，通過及時分析業務發展趨勢、潛在中長期資金需求，調整負債期限結構，保持資產負債的期限、規模的合理匹配；另一方面，本公司持續提升流動性精細化管理水平，負債端結構和到期日分佈更趨合理，也保證資產端在安全性、流動性、收益性之間的平衡。報告期內，本公司重視與各大商業銀行保持良好的合作關係，注重規範經營，維繫良好信譽，保持融資渠道暢通。

此外，本公司穩步推進對集團和子公司流動性風險管理的要求，以集團流動性風險管理辦法為指引，根據各子公司業務特點制定了較為科學有效的流動性風險管理策略，基本實現集團層面流動性風險的統一管理。首先，本公司以流動性風險管理為基礎，從風險和資產負債管理等方面持續對子公司實行分類管

## 第三節 董事會報告

理，並從組織制度保障、風險管控框架、風險應對手段三個維度提出不同要求，指導子公司完善其流動性風險管理體系；其次，以流動性風險併表指標為基礎，根據各子公司所處行業、地域和風險特徵的差異，下發各子公司的限額管理要求，以更有效地監測各子公司的流動性風險實質情況；最後，為強化本集團流動性風險處置能力，本公司持續完善本集團流動性支持體系，牢牢守住本集團不發生流動性風險的底線。

報告期內，面對市場環境的變化和本公司內部資金需求的轉化，本公司積極籌劃，從多個方面着手，通過事前風險識別、事中風險緩釋、事後改進等措施，不斷強化對流動性風險的管控。本公司通過市場研判，抓住利率低位時點及時通過發債增加資金儲備並續作各項到期負債，降低了流動性風險發生的可能，並保證了本公司在複雜市場環境下的平穩運營能力。報告期內，本公司核心流動性監管指標流動性覆蓋率日均344.57%，淨穩定資金率日均148.86%，均高於監管要求及預警標準。

### (7) 聲譽風險

聲譽風險是指由於本公司行為或外部事件，以及工作人員違反廉潔規定、職業道德、業務規範、行規行約等相關行為，導致投資者、發行人、監管機構、自律組織、社會公眾、媒體等對本公司形成負面評價，從而損害本公司品牌價值，不利於本公司正常經營，甚至影響到市場穩定和社會穩定的風險。本集團不斷加強輿情工作的前瞻性和主動性管理，持續滿足監管部門關於聲譽風險系統化管理的要求，通過修訂制度、強化意識、打磨流程、鞏固隊伍等舉措不斷強化母子公司、境內境外協同處置效能。在中國內地和中國香港建立傳播渠道，圍繞經營亮點強化主動宣傳，為集團發展營造良好的輿論環境。針對少數負面輿情，嚴格遵循全程全員、預防第一、審慎管理、快速響應的基本原則，科學研判、做足預案、主動應對，及時把握輿情走勢。與主流媒體保持良好溝通，做好輿論引導，維護本集團品牌形象。報告期內，本集團總體輿論環境良好。

## 第三節 董事會報告

### (二) 其他披露事項

#### 經營計劃進展說明

2024年上半年，我國經濟總量穩定，實現良好開局。在總體戰略的指引下，本公司深入踐行「一個海通」理念，聚焦金融「五篇大文章」，發揮綜合金融服務優勢，深化改革、強基固本，做優做強主責主業，充分發揮資本市場服務功能。

在「科技金融」方面，本公司圍繞打造新質生產力，服務高水平科技自立自強。私募股權投資及直投業務線聚焦前沿科技領域，完善投資生態圈佈局；投資銀行業務線助力企業登陸科創板，主承銷多只科技創新公司債和科創票據。在「綠色金融」方面，本公司在ESG體系建設、綠色融資、綠色投資、綠色研究、綠色運營方面助力產業轉型升級，服務國家「雙碳」目標。在「普惠金融」方面，本公司助力小微企業發展，滿足居民財富管理需求。財富管理業務線產品持有客戶數持續增長；大投行業務線積極助力小微企業對接資本市場；海通恒信持續深耕小微高端裝備製造、小微工程機械、小微醫療等融資租賃業務；海通期貨不斷豐富三農風險管控手段。在「養老金融」方面，本公司支持多層次養老保障體系建設，通過遞延養老基金產品、養老FOF、「居家養老設備租賃產品」等產品積極引導科學養老與資本市場的良好互動，助推銀發經濟快速發展。在「數字金融」方面，本公司以「統一管理、自主可控、融合業務、引領發展」為指引，以高水平數字金融能力滿足社會金融服務需求，強化頂層設計，扎實推進本公司數字化轉型。與此同時，本公司持續深化改革，機構業務改革不斷向縱深推進，區域合作生態圈提速擴容，助力證券交易市場平穩發展，分支機構高質量發展邁上新台阶，境內外協同發展成效顯現。本公司回歸本源，謀求發展新成效，做好直接融資「服務商」，做實社會財富「管理者」，當好資本市場「看門人」。本公司推陳出新，打造「銀證保」合作新模式，不斷提升央國企服務能級。本公司強基固本，持續提升運營質效、管理能級。

## 第三節 董事會報告

2024年下半年，本公司將平衡功能性與盈利性，緊緊圍繞服務實體經濟和新質生產力發展，在做好金融「五篇大文章」方面持續加力，不斷完善產品和服務體系，具體的業務重點包括：財富管理業務線以做大產品規模、提升產品服務能力為目標，組建創新型服務團隊，建立長效服務機制。投資銀行業務線加速推進併購重組業務開展，加大產業類債券、金融債等產品的投入力度，優化境內外協同機制，並進一步壓實「三道防線」責任。資產管理業務線瞄準養老金融、普惠金融領域精準發力，打造具有市場競爭力的投研團隊與滿足不同投資者需求的全產品線。交易及機構業務線進一步提升投資管理能力，加強業務風險監測預警，通過鏈條化、國際化、立體化提升研究質量，打造差異化、精準化、專業化的服務策略。私募股權投資及直投業務線加強行業聚焦，深耕重點投資方向，並以投資上海三大先導產業母基金為契機，探索向科創策源前端延伸和佈局。海外業務線鞏固境外投行品牌優勢，推進全業務鏈條「垂直」一體化管控，實現境內外業務的深度協同發展。融資租賃業務線加快產業化轉型發展，擴大產業生態圈，促進政策利好領域的業務投放。與此同時，本公司下半年還將圍繞高質量的合規內控、科技運營、財資管理、集團化管理等體系建設，提升管理工作效能，護航本公司高質量發展。

## 第四節 公司治理

### 一、股東大會情況簡介

會議屆次	召開日期	決議刊登的指定網站的查詢索引	決議刊登的披露日期	會議決議
2023年度股東週年大會	2024年6月12日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> <a href="https://www.hkexnews.hk">https://www.hkexnews.hk</a>	2024年6月13日 2024年6月12日	詳見下文「股東大會情況說明」
2024年度第一次股東特別大會	2024年7月18日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> <a href="https://www.hkexnews.hk">https://www.hkexnews.hk</a>	2024年7月19日 2024年7月18日	詳見下文「股東大會情況說明」

#### 表決權恢復的優先股股東請求召開臨時股東大會

✓不適用

#### 股東大會情況說明

本報告期內，本公司於2024年6月12日在海通外灘金融廣場召開了2023年度股東週年大會，審議並通過12項議案，分別是普通決議案1. 審議及批准本公司2023年度董事會工作報告；2. 審議及批准本公司2023年度監事會工作報告；3. 審議及批准本公司2023年度獨立非執行董事述職報告；4. 審議及批准本公司2023年年度報告；5. 審議及批准本公司2023年度財務決算報告；6. 審議及批准本公司2023年度利潤分配預案；7. 審議及批准關於提請股東大會授權董事會決定本公司二零二四年中期利潤分配的議案；8. 審議及批准關於預計本公司2024年度自營投資業務配置規模的議案；9. 審議及批准關於預計本公司2024年度對外擔保的議案；10. 審議及批准關於預計本公司2024年度日常關聯／連交易的議案；11. 審議及批准建議委任韓建新先生為本公司執行董事的議案；及特別決議案1. 審議及批准建議修訂《公司章程》的議案。

本報告披露日前，本公司於2024年7月18日在海通外灘金融廣場召開了2024年度第一次股東特別大會，審議並通過2項普通決議案，分別是1. 審議及批准聘請2024年度會計師事務所的議案；及2. 審議及批准建議委任謝維青先生為本公司監事的議案。

上述股東大會決議公告於會議當日刊登在香港聯交所披露易網站 (<http://www.hkexnews.hk>) 及本公司網站，於會議次日刊登於上交所網站 (<http://www.sse.com.cn>)、《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》和《證券日報》。



## 第四節 公司治理

### 二、本公司董事、監事、高級管理人員變動情況

姓名	擔任的職務	變動情形
韓建新	執行董事	選舉
謝維青	非職工代表監事	選舉
李爭浩	非職工代表監事	離任
姜誠君	副總經理	離任

#### 本公司董事、監事、高級管理人員變動的情況說明

##### 1. 董事變更情況

2024年4月26日，本公司召開的第八屆董事會第五次會議審議通過了《關於提名韓建新先生為公司董事候選人的議案》，同意提名韓建新先生為本公司第八屆董事會董事候選人。2024年6月12日，本公司召開的2023年度股東週年大會審議通過了《關於選舉韓建新先生為公司董事的議案》，同意選舉韓建新為本公司第八屆董事會董事，任期自股東大會審議通過之日起至第八屆董事會任期屆滿之日止。詳見本公司2024年4月26日於香港聯交所披露易網站披露的《海外監管公告》和2024年6月12日於香港聯交所披露易網站披露的《於2024年6月12日舉行之股東週年大會之投票結果》公告。

##### 2. 監事變更情況

2024年6月27日，本公司召開的第八屆監事會第六次會議（臨時會議）審議通過了《關於更換公司監事的議案》，李爭浩先生因工作調動原因，不再擔任本公司第八屆監事會監事，同時推薦謝維青先生為本公司第八屆監事會監事候選人。該議案經2024年7月18日召開的本公司2024年第一次股東特別大會審議通過，謝維青先生自2024年7月18日起擔任本公司第八屆監事會監事，任期自股東大會審議通過之日起至第八屆監事會任期屆滿之日止。詳見本公司2024年6月27日於香港聯交所披露易網站披露的《建議委任外部核數師及建議更換監事》公告和2024年7月18日於香港聯交所披露易網站披露的《於2024年7月18日舉行之2024年第一次股東特別大會之投票結果》公告。

## 第四節 公司治理

### 3. 高級管理人員變更情況

姜誠君先生因個人原因向董事會申請辭去本公司副總經理職務，其辭任自辭職報告送達本公司董事會之日起生效。詳見本公司2024年7月31日於香港聯交所披露易網站披露的《海外監管公告》。

## 三、本公司董事、監事、高級管理人員及員工其他情況說明

### (一) 董事、監事及有關僱員之證券交易

本公司已採納《標準守則》所訂標準作為本公司董事、監事及相關僱員進行證券交易的行為準則。本公司經查詢全體董事及監事後，已確認他們於本公司2024年1月1日起至2024年6月30日期間一直遵守上述《標準守則》的要求。本公司沒有發現有關僱員違反指引。

### (二) 董事、監事相關信息的重大變更

獨立非執行董事毛付根先生自2024年7月起不再擔任中紅普林醫療用品股份有限公司(於深交所上市，股票代碼：300981)獨立董事。

獨立非執行董事范仁達先生自2024年2月起不再擔任金至尊集團(國際)有限公司(前稱香港資源控股有限公司，於香港聯交所上市，股份代號：2882)董事。

監事李爭浩先生(已離任)自2024年1月起擔任申能財產保險股份有限公司黨委副書記，自2024年4月起不再擔任申能(集團)有限公司財務部總經理，自2024年6月起不再擔任申能股份有限公司董事，自2024年6月起不再擔任上海燃氣有限公司董事。

除上述披露者外，概無其他本公司之董事及監事的資料須根據香港上市規則第13.51B(1)條予以披露。

### (三) 董事、監事服務合約的說明

本公司與本公司任何董事或監事以其各自作為董事／監事的身份而言，並無訂立亦不擬訂立任何服務合約(於一年內屆滿或可由僱主於一年內終止而毋須支付賠償(不包括法定賠償)的合約除外)。

## 第四節 公司治理

### （四）員工及薪酬政策

截至報告期末，本集團員工人數13,346人。其中母公司員工人數8,182人，子公司員工人數5,164人。

本公司重視人才的吸引、激勵、培養和保留，不斷檢視和優化薪酬體系，堅持市場化分配、績效導向、兼顧公平的激勵原則，持續完善薪酬遞延支付、追索扣回等機制。本公司員工薪酬由固定薪酬、績效薪酬和福利三部分構成。本公司依據適用的相關法律法規，為員工建立各項社會保險（養老保險、醫療保險、失業保險、工傷保險及生育保險）、住房公積金，並依據法規足額繳納上述各項社會保險費和住房公積金。本公司建立企業年金計劃，為員工提供補充養老保障，並為員工投保補充醫療保險和人身意外保險。

本公司根據適用的相關法律法規，與員工簽訂勞動合同，建立勞動關係。勞動合同包含關於合同期限、工作時間和休息休假、勞動報酬和保險福利、勞動保護和勞動條件、合同的變更及解除等條款。

### （五）員工培訓

2024年上半年，培訓工作堅持統籌規劃、系統培養、訓戰結合、賦能發展，圍繞公司戰略佈局、一個海通協同，依託海通黨校和海通財富研修院兩個平台，統籌開展實踐歷練、專題培訓和在線傳授。不斷完善培養體系，推進首批公司總部中後台部門幹部員工與業務部門、子公司幹部員工進行輪崗交流。啟動2024年「青年人才訓練營」，選拔各層次人才進行跨單位崗位鍛煉。分批次推動總部校招新員工到分支機構經受鍛煉。不斷優化培訓形式，開展三期「學習貫徹習近平總書記考察上海重要講話和在深入推進長三角一體化發展座談會上的重要講話精神」專題培訓班，近200名領導幹部參訓。升級「蒲公英計劃」，聯合分、子公司開展專題培訓。開展「海星計劃」新員工培訓，啟動「海貝計劃」分公司儲備人才培養項目，開展集中培訓和系統輔導。不斷豐富培訓內容，2024年上半年，海通財富研修院共上線578門課程，設置專題學習課程，組織開展專題直播和主題活動，促進內部資源共享和協同共建。

## 第四節 公司治理

### 四、利潤分配或資本公積金轉增預案

#### (一) 報告期實施的利潤分配方案的執行或調整情況

本公司於2024年6月12日召開2023年度股東週年大會，審議通過了本公司2023年度利潤分配預案：以截至股權登記日本公司總股本13,064,200,000股扣除本公司回購專用證券賬戶的股份77,074,467股，即12,987,125,533股為基數計算，共計派發現金紅利人民幣1,298,712,553.30元(含稅)。其中A股股本為9,577,556,713股(扣除回購專用賬戶的股份)，本次共計派發A股現金紅利人民幣957,755,671.30元(含稅)；H股股本為3,409,568,820股，本次共計派發H股現金紅利港幣374,602,166.16元(含稅)。

本公司在《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》《證券日報》、上交所網站、香港聯交所披露易網站及本公司網站刊登了2023年度利潤分配實施的有關公告，並於2024年8月8日實施完畢。

#### (二) 半年度擬定的利潤分配預案、公積金轉增股本預案

是否分配或轉增	是
每10股送紅股數(股)	0
每10股派息數(人民幣元)(含稅)	0.30
每10股轉增數(股)	0

#### 利潤分配或資本公積金轉增預案的相關情況說明

本公司2024年1-6月合併報表(未經審計)中歸屬於母公司所有者的淨利潤為人民幣953,097,368.84元。母公司2024年1-6月淨利潤為人民幣3,235,664,772.32元。

根據有關規定，公允價值變動收益部分不得用於現金分配，扣除相關因素影響，2024年1-6月可供現金分配的利潤為人民幣1,091,086,327.87元；母公司2024年6月末可供分配利潤為人民幣36,622,356,278.95元。

## 第四節 公司治理

從股東利益和公司發展等綜合因素考慮，建議本公司2024年中期利潤分配預案如下：

- 1、本公司2024年中期利潤分配採用現金分紅的方式，以2024年中期分紅派息股權登記日登記的總股本扣除公司回購專用證券賬戶的股份為基數，每10股分配現金紅利人民幣0.3元（含稅）。若以審議2024年中期利潤分配預案的董事會召開日本公司總股本13,064,200,000股扣除公司回購專用證券賬戶的股份77,074,467股，即12,987,125,533股為基數計算，分配現金紅利總額為人民幣389,613,765.99元，佔2024年1-6月合併口徑歸屬於母公司股東淨利潤的40.88%；本公司2024年1-6月以現金為對價，採用集中競價方式已實施的A股股份回購金額人民幣303,053,231.80元（不含交易費用），現金分紅和回購金額合計人民幣692,666,997.79元，佔2024年1-6月合併口徑歸屬於母公司股東淨利潤的72.68%。

在本次董事會召開日後至實施權益分派的股權登記日前本公司總股本扣除公司回購專用證券賬戶的股份發生變動的，擬維持每股分配比例不變，相應調整分配總額。本次現金紅利分配後的剩餘可供投資者分配的利潤將轉入下一期。

- 2、現金紅利以人民幣計值和宣佈，以人民幣向本公司A股股東支付，以港幣向本公司H股股東支付。港幣實際派發金額按照本次董事會召開日前五個工作日中國人民銀行公佈的人民幣兌換港幣平均基準匯率計算。

根據本公司2023年度股東週年大會對2024年度中期利潤分配事宜的相關授權，本次利潤分配方案無需提交股東大會審議。本公司將於本次董事會召開之日起兩個月內派發2024年中期現金紅利。



## 第四節 公司治理

董事會亦知會股東二零二四年度中期股息派發詳情如下：

本公司將於二零二四年十月十八日(星期五)向本公司H股持有人派發截至二零二四年六月三十日止六個月之現金中期股息(「中期股息」)，即每10股派發現金股利人民幣0.30元(含稅)。本公司將於二零二四年九月十三日(星期五)至二零二四年九月十九日(星期四)(首尾兩天包括在內)期間暫停辦理H股股份過戶登記手續，期間將不會辦理任何H股股份過戶手續。為符合資格收取中期股息，H股持有人須不遲於二零二四年九月十二日(星期四)下午四時三十分之前，將相關H股股票連同全部股份過戶文件一併送交本公司H股股份過戶登記處香港中央證券登記有限公司，地址為香港灣仔皇后大道東183號合和中心17樓1712-1716號舖。凡於二零二四年九月十九日(星期四)(「登記日」)名列H股股東名冊的H股持有人均有權收取中期股息。

根據《公司章程》規定，本公司股息以人民幣計值及宣派。應付A股持有人的股息以人民幣支付，應付H股持有人的股息以港幣支付。以港幣實際派發的H股股息金額按二零二四年八月二十九日(董事會召開日)前五個營業日中國人民銀行公佈的人民幣兌換港幣平均基準匯率(即人民幣0.913678元兌港幣1.00元)計算，即每10股H股派發現金股利港幣0.328343元(含稅)。

根據《國家稅務總局關於國稅發[1993]045號文件廢止後有關個人所得稅徵管問題的通知》(國稅函[2011]348號)的規定，境外居民個人股東從境內非外商投資企業在香港發行股票取得的股息紅利所得，應按照「利息、股息、紅利所得」項目，由扣繳義務人依法代扣代繳個人所得稅。持有境內非外商投資企業在香港發行股票的境外居民個人股東根據其居民身份所屬國家與中國簽署的稅收協議或內地和香港(澳門)間稅收安排的規定，享受相關稅收優惠。根據相關稅收協議及稅收安排規定的相關股息稅率一般為10%，為簡化稅收徵管，在香港發行股票的境內非外商投資企業派發股息紅利時，一般可按10%稅率扣繳個人所得稅，無需辦理申請事宜。對股息稅率不屬10%的情況，按以下規定辦理：(1)低於10%稅率的稅收協議國家居民，扣繳義務人可代為辦理享受有關協議優惠待遇申請，經主管稅務機關審核批准後，對多扣繳稅款予以退還；(2)高於10%低於20%稅率的協議國家居民，扣繳義務人派發股息紅利時將按協議實際稅率扣繳個人所得稅，無需辦理申請事宜；(3)沒有稅收協議國家居民及其他情況，扣繳義務人派發股息紅利時將按20%稅率扣繳個人所得稅。

## 第四節 公司治理

根據國家稅務總局《關於中國居民企業向境外H股非居民企業股東派發股息代扣代繳企業所得稅有關問題的通知》(國稅函[2008]897號)的規定，中國居民企業向境外H股非居民企業股東派發二零零八年及以後年度股息時，統一按10%的稅率代扣代繳企業所得稅。

本公司將嚴格依法或根據相關政府部門的要求，嚴格依照登記日的本公司H股股東名冊代扣代繳相關所得稅。對於任何因股東身份未及時確定或確定不准而提出的任何要求或對代扣代繳安排機制的爭議，本公司概不承擔責任，亦不會受理。本公司已委任中國銀行(香港)信託有限公司作為H股持有人收款代理人，代表H股持有人接受有關本公司就H股所派發的所有股息。

本公司將於上海證券交易所網站另行公佈有關向A股持有人派發中期股息安排之其他詳情。

### **通過滬港通投資本公司H股的中國內地投資者利潤分配事宜**

對於上海證券交易所投資者(包括企業和個人)投資香港聯交所上市的本公司H股股票，中國證券登記結算有限責任公司上海分公司作為滬港通H股投資者名義持有人將接收本公司派發的現金紅利，並通過其登記結算系統將現金紅利派發予相關滬港通H股股票投資者。

滬港通H股股票投資者的現金紅利以人民幣派發。根據《關於滬港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》(財稅[2014]81號)的相關規定：對內地個人投資者通過滬港通投資香港聯交所上市H股取得的股息紅利，H股公司按照20%的稅率代扣代繳個人所得稅。對內地證券投資基金通過滬港通投資香港聯交所上市H股股票取得的股息紅利，比照個人投資者徵稅。H股公司對內地企業投資者不代扣代繳股息紅利所得稅款，應納稅款由企業投資者自行申報繳納。

## 第四節 公司治理

### 通過深港通投資本公司H股的中國內地投資者利潤分配事宜

對於深圳證券交易所投資者(包括企業和個人)投資香港聯交所上市的本公司H股股票，中國證券登記結算有限責任公司深圳分公司作為深港通H股投資者名義持有人將接收本公司派發的現金紅利，並通過其登記結算系統將現金紅利派發予相關深港通H股股票投資者。

深港通H股股票投資者的現金紅利以人民幣派發。根據《關於深港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》(財稅[2016]127號)的相關規定：對內地個人投資者通過深港通投資香港聯交所上市H股取得的股息紅利，H股公司按照20%的稅率代扣代繳個人所得稅。對內地證券投資基金通過深港通投資香港聯交所上市H股股票取得的股息紅利，比照個人投資者徵稅。H股公司對內地企業投資者不代扣代繳股息紅利所得稅款，應納稅款由企業投資者自行申報繳納。

滬港通投資者及深港通投資者股權登記日、現金股利派發日等時間安排與本公司H股股東一致。

### 滬股通投資者利潤分配事宜

對於投資本公司於上海證券交易所上市的A股股票的香港聯交所投資者(包括企業和個人)(「滬股通投資者」)，其中期股息將由本公司通過中國證券登記結算有限責任公司上海分公司向A股股票名義持有人賬戶以人民幣派發。本公司按照10%的稅率代扣代繳所得稅，並向主管稅務機關辦理扣繳申報。對於滬股通投資者中屬於其他國家稅收居民且其所在國與中國簽訂的稅收協定規定現金紅利所得稅率低於10%的，企業或個人可以自行或委託代扣代繳義務人，向本公司主管稅務機關提出享受稅收協議優惠待遇的申請，主管稅務機關審核後，按已徵稅款和根據稅收協議稅率計算的應納稅款的差額予以退稅。

滬股通投資者的股權登記日、除息日、中期股息派發日等時間安排與本公司A股股東一致。

## 第四節 公司治理

### 五、本公司股權激勵計劃、員工持股計劃或其他員工激勵措施的情況及其影響

#### （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

✓不適用

#### （二）臨時公告未披露或有後續進展的激勵情況

##### 股權激勵情況

✓不適用

##### 其他說明

✓不適用

##### 員工持股計劃情況

✓不適用

##### 其他激勵措施

✓不適用

### 六、本公司治理的其他情況

報告期內，本公司經營和管理規範有序，符合《上市公司治理準則》《證券公司治理準則》《證券公司監督管理條例》以及中國證監會相關法律法規的要求，同時，於報告期內及截至本報告日期，本公司遵守《守則》，全面遵循《守則》中的所有守則條文（如適用），並符合其中所列明的絕大多數建議最佳常規條文的要求。

報告期內，本公司召開股東大會1次，董事會7次，監事會4次，審計委員會7次，獨立董事年報工作會議2次，提名與薪酬考核委員會1次，發展戰略與ESG管理委員會3次，合規與風險管理委員會1次，獨立董事專門會議1次，共計27次會議。

## 第四節 公司治理

### (一) 關於股東和股東大會

本公司嚴格按照《公司章程》和《公司股東大會議事規則》的要求召集、召開股東大會，確保所有股東享有平等地位，能夠充分行使自己的權利。

### (二) 關於董事和董事會

本公司嚴格按照《公司章程》的規定聘任和變更董事，董事人數構成和任職資格符合法律、法規的要求。截至2024年6月30日，本公司董事會由11名董事組成，其中執行董事3名，分別為周杰先生、李軍先生和韓建新先生；非執行董事4名，分別為屠旋旋先生、石磊先生、肖荷花女士及許建國先生；獨立非執行董事4名，分別為周宇先生、范仁達先生、毛付根先生及毛惠剛先生。各位董事能夠勤勉盡責地履行職責，維護本公司和全體股東的利益。董事會下設發展戰略與ESG管理委員會、審計委員會、合規與風險管理委員會、提名與薪酬考核委員會，各委員會分工明確，權責分明，有效運作，四個委員會中，發展戰略與ESG管理委員會主任委員由董事長周杰擔任，合規與風險管理委員會主任委員由執行董事李軍擔任，另兩個委員會的主任委員均由獨立非執行董事擔任。

本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上市規則第三章的規定，成員有5名，包括毛付根先生(主任委員)、肖荷花女士、許建國先生、周宇先生和范仁達先生。審計委員會主要負責本公司內、外部審計的溝通、監督及核查等工作，並向董事會提供專業意見。審計委員會已審閱並確認本集團截至2024年6月30日止六個月的未經審計中期財務資料，未對本集團所採用的會計政策及常規提出異議。



## 第四節 公司治理

### （三）關於監事和監事會

截至2024年6月30日，本公司監事會由8名監事組成，其中監事會主席1名，職工代表監事3名，非職工代表監事4名；截至本報告披露日，本公司監事會由9名監事組成，其中監事會主席1名，職工代表監事3名，非職工代表監事5名。本公司監事會人員任職資格和構成符合法律、法規的要求。本公司監事能夠勤勉盡責地履行職責，本着對股東負責的精神，對本公司財務、董事會成員以及高級管理人員履行職責的合法合規性進行監督，並就有關事項向董事會和高級管理層提出建議和改進意見。

### （四）關於高級管理層

本公司高級管理層產生的程序符合《公司法》和《公司章程》的規定，本公司高級管理層能夠依照法律、法規和董事會的授權，依法合規經營，努力實現股東利益和社會效益的最大化。

### （五）關於相關利益者

本公司充分尊重和維護相關利益者的合法權益，共同推進本公司持續健康發展。

### （六）關於信息披露和投資者關係管理

報告期內，本公司能夠嚴格按照中國大陸和香港兩個上市地的法律、法規及相關規範性文件的要求，真實、準確、完整、及時、公平地披露本公司的信息，能夠嚴格按照《公司內幕信息知情人登記制度》的有關規定，加強對本公司內幕信息的管理，做好內幕信息知情人登記工作。

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

## 第四節 公司治理

報告期內，本公司順利以視頻結合網絡互動的方式，召開面向境內外市場各類投資者的2023年度業績說明會，管理層對本公司發展戰略和經營亮點進行全面介紹，並就市場熱點問題與投資者及分析師充分交流，積極回應投資者關切，正確引導市場預期。本公司建立投資者常態化溝通機制，實時更新本公司官網投資者關係欄目和上證e互動平台內容，保持投資者熱線暢通，及時處理投資者問詢和建議。報告期內，本公司接聽投資者熱線279起，回答上證e互動問題60個。本公司不斷豐富投資者溝通的渠道和形式，注重在信息披露範圍內加強主動性和戰略性溝通，多次以現場或電話方式接待境內外機構投資者及分析師調研，並多次受邀參加境內外賣方機構投資策略會，就本公司經營情況和行業發展趨勢與投資者及分析師溝通，並及時向董事會、管理層反饋資本市場的觀點和期待，形成市場前瞻思維與本公司發展戰略的良性互動。

### (七) 合規體系建設

報告期內，本公司嚴格按照中國證監會的要求，結合自身實際情況，不斷完善本公司合規管理。本公司合規總監嚴格依法履行合規管理職責。本公司股東、董事和高級管理人員未發生違反規定的職責和程序直接向合規總監下達指令或者干涉其工作的情形。本公司為合規總監全面履職提供了人力、物力、財力和技術支持，為合規管理提供了保障。報告期內，本公司廣泛傳導資本市場新「國九條」，圍繞資本市場「1+N」政策體系，在穩步有序開展合規審查、合規檢查、合規監測等合規管理工作的基礎上，堅持目標導向、問題導向，夯實對重點領域的執行保障支持力度，提升合規與業務的雙向融合，加強集團合規管理建設，積極培育人人合規、主動合規、持續合規、全面合規的合規文化。

## 第五節 環境與社會責任

### 一、環境信息情況

#### （一）屬於環境保護部門公佈的重點排污單位的公司及其主要子公司的環保情況說明

✓不適用

#### （二）重點排污單位之外的公司的環保情況說明

##### 1. 因環境問題受到行政處罰的情況

本公司及子公司不屬於環境保護部門公佈的重點排污單位。

本集團嚴格遵守《中華人民共和國環境保護法》《中華人民共和國水污染防治法》《中華人民共和國大氣污染防治法》等環保方面的法律法規，報告期內未出現因違反環保相關法規而受到處罰的情況。

##### 2. 參照重點排污單位披露其他環境信息

✓不適用

##### 3. 未披露其他環境信息的原因

✓不適用

#### （三）報告期內披露環境信息內容的後續進展或變化情況的說明

✓不適用

## 第五節 環境與社會責任

### (四) 有利於保護生態、防治污染、履行環境責任的相關信息

本公司順應「綠色金融」新趨勢，從自身運營及綠色金融兩方面履行企業環境責任，助力產業轉型升級，服務國家「雙碳」目標。自身運營層面，設定綠色環保目標，推進綠色數據中心建設，通過倡導無紙化辦公、空調限溫、綠色出行、按需用餐等方式涵育綠色文化，減少辦公運營過程中的資源浪費和能源消耗。綠色金融層面，本公司聚焦主責主業，不斷加大對綠色經濟、低碳經濟、循環經濟的服務支持力度，引導和激勵更多社會資本投入綠色低碳轉型產業，並積極開展綠色研究諮詢、綠色金融行業交流，以實際行動踐行ESG理念。憑藉突出的ESG管理核心競爭力，本公司成功入選中央廣播電視總台「中國ESG上市公司先鋒100」榜單(2024)。

#### 1. 自身運營

綠色運營方面，本公司持續開展節能降耗、提高資源利用率，調整工作場所照明時間及空調閉閑時間；推動綠色數據中心建設，張江數據中心成功入選2023年度國家綠色數據中心名單，成為首家上榜的證券公司；持續優化辦公協同信息系統，借助RPA智能流程自動化機器人、智能審核系統等搭建信息化、無紙化辦公模式，大量減少紙張使用和其他廢棄物的產生；鼓勵員工自覺做到人走燈滅、按需用餐，提倡綠色出行；優先採購節水器具、節能燈具，對用水、用能設備定期檢修，有效減少資源與能源損耗。

綠色宣傳方面，本公司緊扣「雙碳」、綠色金融等主題，依託本公司官網、官微等宣傳渠道，圍繞「植樹節」「3.15投資者保護」「世界水日」「世界地球日」「世界環境日」等時點開展綠色主題宣傳，展示本公司ESG理念以及在能源管理、水資源管理、排放物及廢棄物管理方面的目標舉措。本公司圍繞減塑行動、廢紙回收、物料循環、綠色出行、節能降耗等方面發出低碳倡議，並在總部園區設置塑料回收站與廢紙回收處，倡導綠色生活理念，推動可再生產品的循環利用和紙張「零廢棄」。

## 第五節 環境與社會責任

### 2. 綠色金融

綠色融資方面，報告期內，本公司承銷發行綠色債券、綠色資產支持證券19支，融資規模合計人民幣244億元；助力綠色科技材料龍頭企業中侖新材成功登陸創業板；海通恒信作為首批融資租賃機構入駐上海綠色金融服務平台，實現首單工商業儲能直租業務投放。

綠色投資方面，報告期內，本公司以自有資金參與綠色債券投資64筆，投資規模達人民幣38億元；完成對功率器件龍頭企業中車時代半導體以及光伏設備供應商紅太陽光電的股權投資，投資金額超人民幣2.2億元；海富通基金正式成立「海富通ESG領先股票型證券投資基金」，為踐行綠色金融和ESG投資理念提供良好投資工具；截至報告期末，海富通碳中和主題基金總規模達人民幣4.54億元。

綠色研究諮詢方面，報告期內，本公司圍繞負責任投資、ESG策略、綠色金融等主題，通過提供ESG研究諮詢累計服務605家機構客戶。研究所發佈《國內外ESG體系對比研究與政策建議》，藉鑑國際經驗為促進中國ESG發展提供政策建議；富國基金《印度ESG發展趨勢及對中國的啟示》入選中國證券投資基金業協會「聲音」專欄。

綠色金融交流方面，本公司參加中國品牌全球行與ESG可持續發展會議，「以科技賦能數據中心綠色高質量發展」案例入選《中國企業ESG發展調研報告》「綠色低碳實踐案例」；與上海市國資委聯合牽頭「ESG實踐披露結果的應用研究」課題，積極探索ESG的理念和實踐與企業發展、城市建設、社會運行緊密結合；本公司製作的《ESG理念下證券公司高質量發展》課程入選中國證券業協會2024年遠程培訓共建課程，聚焦券商如何在ESG理念下高質量開展相關業務提出建議與參考。



## 第五節 環境與社會責任

### (五) 在報告期內為減少其碳排放所採取的措施及效果

本公司碳排放的主要來源為日常運營過程中使用電力和天然氣以及公務用車耗油產生的碳排放。本公司通過綠色數據中心運營、綠色辦公、低碳出行等方式減少自身運營的碳排放量，推進能源管理。

本公司秉承綠色發展理念，推進綠色數據中心建設，推進並開展了一系列節能降耗措施，包括進一步部署光伏設備、搭建AI節能製冷調優平台、實現機房樓整體智能照明環境、持續優化機房氣流組織、試點應用綠色裝備、首次部署應用節水裝置、試點運行配電巡檢機器人等。相較上一年度同期能耗，在IT用能增加約55%的情況下，動力用能下降約20%。2024年6月，工業和信息化部網站正式發佈2023年度國家綠色數據中心名單，本公司張江數據中心成功入選，成為首家上榜的證券公司。報告期內，本公司南外灘總部園區、張江科技園及廣東路大樓總能耗同比下降約243.4萬千瓦時。

### 二、鞏固拓展脫貧攻堅成果、鄉村振興等工作具體情況

2024年上半年，本公司持續開展「一司一縣」「百企幫百村」結對幫扶工作，助力雲南西疇、新疆葉城、江西寧都、安徽利辛、安徽舒城等五個脫貧縣鞏固脫貧攻堅成果，積極開展援滇援疆援藏援青工作，扎實做好上海市農村綜合幫扶和城鄉黨組織結對幫扶工作，努力解決幫扶地區群眾實際問題，持續助力鄉村振興國家戰略。

## 第五節 環境與社會責任

### （一）落實結對幫扶，多措並舉推動鄉村振興

本公司以項目建設為導向，依託分支機構，持續加強與雲南西疇、新疆葉城、江西寧都、安徽利辛、安徽舒城等結對縣的溝通交流，持續助力結對幫扶縣經濟社會發展。聚焦對口幫扶地區，開展公益幫扶項目，比如，重點面向雲南西疇、新疆葉城、江西寧都、安徽利辛、安徽舒城共12所中小學等，開展「海通•愛健康」公益項目，捐贈運動健康器材等，助力當地青少年體育教育。立足金融幫扶、智力幫扶、產業幫扶，開展「金融大講堂」走進江西寧都公益活動，面向縣直相關單位、縣屬國有企業、民營企業等開展金融培訓，緊扣當前經濟社會重點，結合寧都特色產業，圍繞新能源電池產業與寧都發展機會分析、國內債券市場現狀、區域合作賦能區域經濟發展以及加大資本招商優化產業資金佈局等主題進行授課，為推動當地經濟發展貢獻智慧和力量。

### （二）堅持金融賦能，為鄉村振興注入發展動力

本公司積極發揮專業能力和資源整合優勢，幫助幫扶地區企業規範公司治理，改善融資狀況。助力中廣核風電成功發行長期限碳中和綠色科技創新鄉村振興公司債券，共計發行規模人民幣30億元。本公司還助力克拉瑪依市城市建設投資發展有限責任公司發行2024年度第一期超短期融資債券，發行規模人民幣5億元。此外，子公司海通期貨持續探索開展「保險+期貨」金融幫扶模式，比如，投入人民幣40.5萬元公益資金在甘肅禮縣開展蘋果「保險+期貨」鄉村振興項目，幫助農戶規避蘋果價格波動風險，保障收益。此外，本公司積極推進消費幫扶，依託各級工會、物業後勤，採購內蒙古、黑龍江、福建等幫扶地區特色農產品，以購代捐，促進消費，助力當地農戶增收。

## 第五節 環境與社會責任

### (三) 完善公益體系，傳遞「愛在海通」公益理念

本公司堅持以「愛在海通」黨建公益品牌為引領，廣泛凝聚愛心力量，以慈善公益助力鄉村振興。一是做好上海愛在海通公益基金會（「基金會」）的管理運營。按照上海市民政局工作要求，做好年檢年報工作，持續完善基金會各項內部制度，持續完善基金會慈善信息公開，全面夯實基金會管理基礎。二是加強志願者隊伍建設，年初成立海通證券「愛在海通」志願服務總隊，並組建20餘支分隊，進一步統籌各方志願力量，集結起更加專業、協同的志願者隊伍。三是認真落實「愛在海通」公益清單。持續推進「海通•愛健康」品牌公益項目，面向新疆、西藏、雲南、青海、江西、安徽、河南、浦東等地35所中小學校等，捐贈體育用品等，助力健康中國建設。其中，在由克拉瑪依市政府、上海援克前方指揮部主辦的2024年「引客入克」暨滬克航旅推介會上，「海通•愛健康」助力克拉瑪依健身公益項目入選2024年滬克文旅交通十大合作聯動項目。本公司還應邀參加上海報業集團、上海宣傳通訊主辦的「2023美麗西藏助學證書錦旗發放儀式」及座談會，與上海市援藏幹部人才聯絡組、上海慈善基金會等分享「愛在海通•美麗西藏」公益項目成果，進一步講好「愛在海通」公益故事。此外，各子公司、分支機構積極開展「愛在海通 志願先鋒」主題活動，圍繞公益投教、低碳環保、社區服務等方面開展志願公益和捐贈幫扶行動，展現了「愛在海通」公益合力。

## 第五節 環境與社會責任

### （四）參與綜合幫扶，積極開展農村綜合幫扶、城鄉黨組織結對幫扶

本公司積極參加上海市農村綜合幫扶對口幫扶工作會議，按照工作部署，做好本公司與崇明區對口幫扶工作；本公司進一步強化幫扶慰問工作機制，節日期間做好困難群眾關心慰問工作，赴本公司城鄉黨組織結對幫扶村，開展結對共建和走訪慰問活動，為助力當地鄉村振興貢獻力量。此外，本公司積極開展智力幫扶，輸送幹部擔任浦東衛民村駐村第一書記，駐村幹部助力當地農產品品牌建設，幫助提升農業產值，提升產業層次，有效帶動當地集體經濟發展。

下一步，本公司將繼續堅決貫徹落實黨中央關於鄉村振興的重大決策部署，認真履行金融國企職責使命，為助力鄉村振興戰略貢獻更大力量。一是進一步深化結對幫扶工作機制，立足新發展階段，持續優化完善金融、產業、智力、消費、公益等幫扶模式，以更精準的幫扶措施，持續助力結對幫扶地區實現更高質量發展。二是持續發揮專業優勢，創新運用多層次資本市場融資方式，精準對接幫扶地區企業融資需求，為幫扶地區提供多渠道、多品種、全方位的金融服務。三是不斷完善「四個一」公益體系，在「愛在海通」公益理念指引下，依託上海愛在海通公益基金會載體，集結「愛在海通」志願者隊伍，廣泛凝聚愛心力量，豐富拓展「愛在海通」年度公益清單項目，積極助力鄉村振興，持續擦亮「愛在海通」公益品牌。

## 第六節 重要事項

### 一、承諾事項履行情況

#### (一) 本公司實際控制人、股東、關聯方、收購人以及本公司等承諾相關方在報告期內或持續到報告期內的承諾事項

承諾背景	承諾類型	承諾方	承諾內容	承諾時間	是否有履行期限	承諾期限	是否及時嚴格履行	如未能及時履行應說明	如未能及時履行應說明
								未完成履行的具體原因	下一步計劃
與再融資相關的承諾	股份限售	上海國盛(集團)有限公司	再融資認購的股份自發行結束之日起48個月內不得轉讓	自2020年8月5日起48個月	是	48個月	是	-	-
	其他	董事、高級管理人員	1. 承諾不無償或以不公平條件向其它單位或者個人輸送利益,也不採用其它方式損害本公司利益; 2. 承諾對職務消費行為進行約束; 3. 承諾不動用本公司資產從事與其履行職責無關的投資、消費活動; 4. 承諾由董事會或提名與薪酬考核委員會制定的薪酬制度與本公司填補回報措施的執行情況相掛鉤; 5. 若本公司後續推出公司重要交易和事項政策, 承諾擬公佈的本公司股權激勵的行權條件與本公司填補回報措施的執行情況相掛鉤	作為本公司董事、高級管理人員期間	是	作為本公司董事、高級管理人員期間	是	-	-



## 第六節 重要事項

### 二、報告期內控股股東及其他關聯方非經營性佔用資金情況

✓不適用

### 三、違規擔保情況

✓不適用

### 四、聘任、解聘會計師事務所情況

#### （一）聘任、解聘會計師事務所的情況說明

本公司於2024年7月18日召開的2024年度第一次股東特別大會審議通過了《公司關於聘請2024年度會計師事務所的議案》，同意本公司聘請立信會計師事務所（特殊普通合夥）（簡稱立信）為本公司2024年度境內審計師，聘任德勤•關黃陳方會計師行（簡稱德勤香港）為本公司2024年度境外審計師。由立信負責對按照中國企業會計準則編製的財務報表及內部控制提供相關的境內審計及審閱服務，由德勤香港負責對按照國際財務報告準則編製的財務報表提供相關的境外審計及審閱服務。本次變更會計師事務所主要是考慮本公司現有業務狀況、發展需求及整體審計需要，本公司不存在與前任會計師事務所在工作安排、收費、意見等方面存在分歧的情形。

#### 審計期間改聘會計師事務所的情況說明

✓不適用

#### （二）本公司對會計師事務所「非標準意見審計報告」的說明

✓不適用

### 五、上年年度報告非標準審計意見涉及事項的變化及處理情況

✓不適用

### 六、破產重整相關事項

✓不適用

## 第六節 重要事項

### 七、重大訴訟、仲裁事項

✓本報告期公司無重大訴訟、仲裁事項

報告期內，本公司不存在《上交所上市規則》中要求披露的涉案金額超過人民幣1,000萬元並且佔本公司最近一期經審計淨資產絕對值10%以上的重大訴訟、仲裁事項。

自報告期初至本報告披露日，本集團尚未披露的新增(金額超過人民幣1億元)或已披露且有新進展的訴訟、仲裁事項如下：

#### 寧波浙金鋼材有限公司與華泰證券股份有限公司、公司等侵權責任糾紛案

因侵權責任糾紛，寧波浙金鋼材有限公司向杭州市中級人民法院起訴，要求公司等四名被告承擔連帶賠償責任，賠償原告損失本金人民幣0.95億元及相應利息等。2024年6月，浙江省杭州市中級人民法院受理本案。

#### 張方傑與雷根大數據科技有限公司、公司等財產損害賠償糾紛案

因財產損害賠償糾紛，張方傑向上海金融法院起訴，要求李金龍等十五名被告連帶賠償原告張方傑人民幣1.22億元及相應利息，要求公司等三名被告以前述金額為限承擔補充賠償責任。2023年10月，上海金融法院受理本案。

#### 四川信託與海通資管公司、公司等金融委託理財合同糾紛案

因金融委託理財合同糾紛，四川信託有限公司(以下簡稱四川信託)向四川省成都市中級人民法院起訴，要求上海海通證券資產管理有限公司(以下簡稱海通資管公司)、公司等八名被告返還或賠償原告委託財產人民幣5.15億元及相應利息。2021年9月13日，四川省成都市中級人民法院受理本案，並於2023年9月27日作出一審判決。四川信託提起上訴，四川省高級人民法院於2024年3月1日對案件進行開庭審理，目前案件尚未判決。

## 第六節 重要事項

### 郵儲銀行與富誠海富通等證券虛假陳述責任糾紛案

因「華泰美吉特燈都資產支持專項計劃」發生實質性違約，專項計劃持有人之一中國郵政儲蓄銀行股份有限公司（以下簡稱郵儲銀行）向上海金融法院起訴，要求原始權益人昆山美吉特燈都管理有限公司、上海富誠海富通資產管理有限公司（以下簡稱富誠海富通）等五名被告對其全部損失承擔連帶賠償責任，其訴請金額為本金人民幣5.27億元以及相應的利息等。2020年11月，上海金融法院受理本案，並於2023年4月14日作出一審判決。原告郵儲銀行及富誠海富通等被告向上海市高級人民法院提起上訴。目前，該案正在二審審理中。

除上述案件外，集團內尚處於執行階段的案件共4起，涉及案件金額人民幣11.57億元。

本公司境外上市子公司和主要經營地在境外的子公司（海通恒信、海通國際、海通銀行及上述公司的附屬公司）的重大訴訟、仲裁事宜由其按照所在地的監管規則和相關上市規則（如涉及）自行向法定對象披露相關信息。

## 八、上市公司及其董事、監事、高級管理人員、控股股東、實際控制人涉嫌違法違規、受到處罰及整改情況

1. 截至報告期末，本公司無控股股東且無實際控制人。
2. 報告期內，本公司董事、監事、高級管理人員、第一大股東不存在被有權機關調查、被司法機關或紀檢監察機關採取強制措施、被移送司法機關或追究刑事責任、被中國證監會立案調查或行政處罰、被採取市場禁入、被認為不適當人選、被其他行政管理部門給予重大行政處罰以及被證券交易所公開譴責等情形。本公司董事、監事、高級管理人員不存在違反相關規定買賣公司股票的情形。

## 第六節 重要事項

3. 報告期內，本公司不存在被司法機關或紀檢部門採取強制措施、被移送司法機關或紀檢部門追究刑事責任情形，不存在被其他行政管理部門給予重大行政處罰的情形。

報告期內，本公司及公司董事、高級管理人員存在以下被中國證監會立案調查、行政處罰、被中國證監會或其派出機構採取行政監管措施、被證券交易所採取紀律處分的情況：

2024年1至2月，上海證監局出具《關於對海通證券股份有限公司採取責令改正措施的決定》(滬證監決[2024]17號)等監管函件，認定本公司存在境外子公司合規管理和風險管理不到位、場外期權業務相關內部控制不健全，以及場外衍生品業務相關風險指標體系不健全等情況，對公司採取責令改正、責令處分有關人員措施，對公司相關時任分管高級管理人員採取監管談話等措施。本公司在收到上述監管函件後，高度重視，第一時間對相關人員啟動內部問責程序，深刻檢討業務管控不足，全面落實相關整改工作，確保各業務環節嚴格遵循法律法規與自律準則。

2024年4月，中國證監會出具《行政處罰決定書》([2024]45號)，責令海通證券改正，沒收違法所得人民幣789,445.21元，並處以人民幣6,975,000元罰款。處罰決定書認定本公司以自己名義按照中信中證的報價指令認購中核鈦白非公開發行股票，客觀上幫助中信中證及其客戶取得股票收益，使得定增套利行為得以實現。相關情況詳見日期為2024年4月12日，2024年4月19日及2024年4月30日的公告。本公司高度重視，及時進行整改，強化客戶盡職調查與交易目的核查，完善適當性管理要求和 workflows，切實履行勤勉盡責義務。

## 第六節 重要事項

2024年4月，廣東證監局出具《關於對海通證券股份有限公司採取責令改正監管措施的決定》（[2024]36號），對本公司採取責令改正措施。該函件認定本公司在格力地產股份有限公司債券承銷業務中存在對部分事項盡職調查不充分等情況。本公司收到該監管函件後，高度重視，及時採取措施進行整改，加強法規文件學習，修訂債券融資業務制度和指引，提高項目盡調標準，切實提高執業水平。

2024年4月，新疆證監局出具《關於對海通證券股份有限公司烏魯木齊友好北路證券營業部、苗苗採取出具警示函措施的決定》（[2024]9號），對烏魯木齊友好北路證券營業部及苗苗採取出具警示函措施。該監管函件認定營業部存在為他人使用客戶相關證券賬戶提供便利；未及時重新評估客戶風險承受能力，提供與投資者當時風險承受能力不匹配的融資展期服務等情形。本公司收到該監管函件後，高度重視，督促營業部立即整改，加強合規培訓，督導員工勤勉盡責，提升執業水平，細化落實客戶身份識別工作。

2024年4月，上海證監局出具《關於對海通證券股份有限公司採取責令改正措施的決定》（滬證監決[2024]180號）等監管函件，認定本公司存在未審慎評估個別股票質押標的風險及資金用途、未審慎開展收益互換業務、個別風險債券投資內部控制程序不健全、另類投資子公司投資的個別私募基金實際投資標的超出另類投資子公司業務範圍等情況，對本公司採取責令改正措施，對本公司相關時任分管高級管理人員採取監管談話等措施。本公司在收到上述監管函件後，高度重視，及時進行整改，完善本公司內控管理，深化集團一體化管控舉措，確保切實落實整改要求。



## 第六節 重要事項

2024年5月，上海證券交易所出具《關於對海通證券股份有限公司予以通報批評的決定》([2024]82號)，給予本公司通報批評的紀律處分。該監管函件認定本公司在保薦工作中，存在核查工作履職盡責不到位、內部控制質量存在薄弱環節的情形。本公司收到該監管函件後，高度重視，及時進行整改，加強項目內控審核及跟蹤管理，定期組織開展專項培訓，督導員工勤勉盡責，夯實工作底稿，切實提高執業水平。

2024年5月，中國證監會出具《關於對海通證券股份有限公司及保薦代表人朱楨、周磊採取出具警示函監管措施的決定》([2024]16號)，對本公司及兩名保薦代表人採取出具警示函措施。該監管函件認定本公司在保薦工作中，存在未勤勉盡責履行相關職責等情形。本公司在收到該監管函件後，高度重視，及時進行整改，加強法規文件學習，提高項目盡調標準，強化盡職調查核查力度。

### 九、報告期內本公司及其控股股東、實際控制人誠信狀況的說明

截至報告期末，本公司無控股股東且無實際控制人。報告期內，本公司及第一大股東不存在未履行法院生效判決、不存在所負數額較大的債務到期未清償等情況。

## 第六節 重要事項

### 十、重大關聯交易

#### （一）與日常經營相關的關聯交易

##### 1、已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

##### 2、已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

##### 3、臨時公告未披露的事項

✓不適用

##### 4、日常關聯／連交易

本公司建立了基本完整的關聯／連交易制度體系，構建了較為科學完善的關聯／連交易組織管理框架，相關內部控制總體有效。本公司按照《公司法》《證券法》《上海證券交易所上市公司自律監管指引第5號—交易與關聯交易》《香港上市規則》《上交所上市規則》等相關法律和監管規則，依據《公司章程》《關聯交易管理辦法》《關聯（連）交易管理實施細則（試行）》等內部規章，嚴格履行關聯／連交易審議流程及信息披露要求，對各項業務的關聯／連交易形成了恰當的約束機制。

報告期內，本公司嚴格按照2023年度股東週年大會審議通過的《關於預計公司2024年度日常關聯／連交易的議案》，開展日常關聯／連交易。

本章節所載關聯／連交易的披露系依據《上交所上市規則》與香港上市規則確定，與財務報表附註中的關聯交易數額（依據企業會計準則編製）可能存在差異。本報告之合併財務報表附註63所載關聯方交易不構成香港上市規則第14A章項下本公司的關連交易，唯本公司與上海國盛集團及其聯繫人之關聯方交易構成香港上市規則第14A章項下之持續關連交易，本公司已遵守香港上市規則第14A章之要求。有關該等關連交易詳情，請參見本公司日期為2022年12月30日的持續關連交易公告。除上述關連交易及本報告披露外，報告期內，本公司概無根據香港上市規則第14A章的規定而須披露的任何關連交易。

## 第六節 重要事項

相關執行情況如下：

- 香港上市規則項下的持續性關連交易

茲提述本公司日期為2022年12月30日的關於持續關連交易的公告。截至報告期末，上海國盛集團直接及間接持有本公司10.38%權益。依據香港上市規則第14A.07條，上海國盛集團及其聯繫人構成本公司於香港上市規則下之關連人士。本公司與上海國盛集團於2022年12月30日訂立持續關連交易框架協議，期限為自2023年1月1日起至2026年12月31日止。根據持續關連交易框架協議，本集團與上海國盛集團及其聯繫人在日常業務過程中進行證券和金融產品交易以及證券和金融服務。

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

單位：萬元 幣種：人民幣

交易內容	截至2024年 6月30日止	
	2024年度 預計交易上限	六個月 實際發生金額
<b>證券及金融產品交易</b>		
流入 <sup>(1)</sup>	270,000.00	1,028.29
流出 <sup>(2)</sup>	220,000.00	—
<b>證券及金融服務</b>		
本集團向上海國盛集團及其聯繫人提供 證券和金融服務收取的收入總額	12,000.00	230.23
本集團接受上海國盛集團及其聯繫人提供 證券和金融服務產生的支出總額	3,000.00	—

## 第六節 重要事項

- (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。

• 上交所上市規則項下的日常關聯交易

(1) 與上海國盛(集團)有限公司及上海國盛集團資產有限公司的關聯交易

單位：萬元 幣種：人民幣

交易內容	截至2024年		備註
	6月30日 止六個月 發生金額	佔同類 交易金額 的比例	
手續費及佣金淨收入	37.55	0.01%	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	33.64	0.01%	向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入
利息淨收入	95.41	0.05%	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)	48.21	-0.13%	報告期內，名義本金發生額人民幣0.61億元，期末名義本金餘額人民幣0.50億元。

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。

## 第六節 重要事項

單位：萬元 幣種：人民幣

往來項目	於2024年 6月30日 餘額	佔同類 交易金額 的比例	備註
應收賬款	7.51	0.00%	應向關聯人收取的各項 服務手續費餘額
應付賬款	5,103.31	0.45%	本公司應付關聯人衍生 金融工具保證金餘額
代理買賣證券款	181.46	0.00%	關聯人存放本公司的 客戶保證金餘額
衍生金融資產	152.48	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：萬元 幣種：人民幣

交易內容	截至2024年 6月30日 止六個月 發生金額	佔同類交易 金額的比例	備註
手續費及佣金收入	6,507.18	1.86%	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	551.13	0.16%	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	8.39	0.00%	關聯人保證金產生的利 息收入
銀行存款利息收入	4,360.20	2.33%	關聯人銀行存款產生的 利息收入
信用拆借交易利息支出	62.44	0.28%	報告期內，信用拆借交 易規模人民幣42億 元，期限：1-7天



## 第六節 重要事項

交易內容	截至2024年 6月30日		備註
	止六個月 發生金額	佔同類交易 金額的比例	
債券借貸交易利息支出	245.73	0.63%	報告期內，債券借貸交易規模人民幣67.8億元，期限：1天-11個月
回購交易利息支出	5.18	0.00%	報告期內，回購交易規模10億元，期限：1天
黃金租賃利息支出	6,414.45	16.49%	報告期內，黃金租賃規模人民幣88.24億元，期限：341-365天
銀行貸款利息支出	5,924.71	3.63%	向關聯人支付的銀行貸款利息支出
業務及管理費	18.67	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)	7,449.72	-19.61%	報告期內，名義本金發生額人民幣44.76億元，期末名義本金餘額人民幣54.24億元。

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

單位：萬元 幣種：人民幣

往來項目	於2024年 6月30日		備註
	餘額	佔同類 交易金額 的比例	
銀行存款	369,070.48	2.61%	本公司存放關聯人的銀行存款餘額
應收賬款	2.31	0.00%	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	9,504.60	4.57%	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	273.12	0.00%	關聯人存放本公司的客戶保證金餘額
短期借款	182,536.00	5.47%	關聯人向本公司發放的短期借款餘額
長期借款	70,576.96	1.91%	關聯人向本公司發放的長期借款餘額

## 第六節 重要事項

往來項目	於2024年 6月30日 餘額	佔同類 交易金額 的比例	備註
應付賬款	6.40	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	456,643.55	4.58%	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	1,781.02	1.45%	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	913.06	0.07%	與關聯人進行衍生品交易產生的交易性金融負債餘額

另外，部分證券公司等關聯法人作為合格交易對手方與本公司開展現券買賣交易，報告期內累計成交金額人民幣329.64億元。

### (二) 資產收購或股權收購、出售發生的關聯交易

#### 1、已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

#### 2、已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

#### 3、臨時公告未披露的事項

✓不適用

#### 4、涉及業績約定的，應當披露報告期內的業績實現情況

✓不適用

## 第六節 重要事項

### （三）共同對外投資的重大關聯交易

1、已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

2、已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

3、臨時公告未披露的事項

✓不適用

### （四）關聯債權債務往來

1、已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

2、已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

3、臨時公告未披露的事項

✓不適用

### （五）本公司與存在關聯關係的財務公司、本公司控股財務公司與關聯方之間的金融業務

✓不適用

### （六）其他重大關聯交易

✓不適用

## 第六節 重要事項

### (七) 其他

#### 1. 《香港上市規則》項下的關連交易

茲提述本公司日期為2024年7月5日關於成立合夥企業的關連交易公告。本公司全資子公司海通創新證券合共出資人民幣10億元，與本公司第一大股東上海國盛集團及其全資子公司上海國經投資發展有限公司參與投資設立上海國投先導集成電路私募投資基金合夥企業(有限合夥)(「**集成電路母基金**」)，與上海國經投資發展有限公司參與投資設立上海國投先導生物醫藥私募投資基金合夥企業(有限合夥)(「**生物醫藥母基金**」)、上海國投先導人工智能私募投資基金合夥企業(有限合夥)(「**人工智能母基金**」)(合稱「**上海三大先導產業母基金**」)。

上海三大先導產業母基金的形式為有限合夥企業，分別對應集成電路、生物醫藥和人工智能三大重點方向，上海國投先導私募基金管理有限公司作為基金管理人。集成電路母基金規模為人民幣450.01億元，其中海通創新證券擬作為有限合夥人出資人民幣5億元，持股比例1.1111%，出資來源為自有資金；上海國盛集團擬作為有限合夥人出資人民幣20億元，持股比例4.4443%；上海國經投資發展有限公司擬作為有限合夥人出資人民幣200億元，持股比例44.4435%。生物醫藥母基金規模為人民幣215.01億元，其中海通創新證券擬作為有限合夥人出資人民幣2.5億元，持股比例1.1627%，出資來源為自有資金；上海國經投資發展有限公司擬作為有限合夥人出資人民幣100億元，持股比例46.5095%。人工智能母基金規模為人民幣225.01億元，其中海通創新證券擬作為有限合夥人出資人民幣2.5億元，持股比例1.1111%，出資來源為自有資金；上海國經投資發展有限公司擬作為有限合夥人出資人民幣100億元，持股比例44.4425%。

## 第六節 重要事項

於最後實際可行日期，上海國盛集團為本公司之主要股東，直接或間接持有本公司全部已發行股本約10.38%。上海國經投資發展為上海國盛集團之全資附屬公司。因此，上海國盛集團及上海國經投資發展為上市規則第14A章項下本公司之關連人士。根據上市規則第14A.81條，倘一系列關連交易均於12個月內完成或以其他方式相關連，則該等交易將合併計算，並視作一項事務處理。因此，成立上海三大先導產業母基金項下之交易應合併計算。由於按照合併基準計算之最高適用百分比率高於0.1%但低於5%，故上海三大先導產業母基金項下之交易須遵守上市規則第14A章項下申報及公告之規定，惟獲豁免遵守通函(包括獨立財務意見)及獨立股東批准之規定。

### 十一、重大合同及其履行情況

#### 1 託管、承包、租賃事項

報告期內，本公司無重大託管、承包、租賃事項。



## 第六節 重要事項

### 2 報告期內履行的及尚未履行完畢的重大擔保情況

單位：元 幣種：人民幣

本公司對外擔保情況 (不包括對子公司的擔保)	
報告期內擔保發生額合計 (不包括對子公司的擔保)	—
報告期末擔保餘額合計(A) (不包括對子公司的擔保)	—
本公司對子公司的擔保情況	
報告期內對子公司擔保發生額合計	4,645,422,359
報告期末對子公司擔保餘額合計(B)	31,587,307,218
本公司擔保總額情況 (包括對子公司的擔保)	
擔保總額(A+B)	31,587,307,218
擔保總額佔本公司淨資產的比例(%)	18.45
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)	22,055,409,500
擔保總額超過淨資產50%部分的金額(E)	—
上述三項擔保金額合計(C+D+E)	22,055,409,500
未到期擔保可能承擔連帶清償責任說明	
擔保情況說明	

- 2023年，經本公司第七屆董事會第四十一次會議審議通過，同意本公司為在境外的全資子公司海通國際控股及其全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過5億美元債務融資金額（含5億美元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過7年（含7年）。

本公司於2024年3月1日簽署《擔保契約》，為本公司境外全資附屬公司Haitong International Finance Holdings Limited發行金額為人民幣35億元、於2027年到期的債券提供連帶責任保證擔保。

## 第六節 重要事項

2. 2022年，經本公司第七屆董事會第三十三次會議審議通過，同意本公司為在境外的全資子公司海通國際控股及其全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過10億美元債務融資金（含10億美元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過7年（含7年）。

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

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

3. 2021年，經本公司第七屆董事會第十五次會議審議通過，同意本公司為在境外的全資子公司海通銀行Haitong Bank,S.A.或其附屬公司境外債券融資提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過7.5億歐元債券本金（含7.5億歐元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過9年（含9年）。

本公司於2022年2月8日簽署《擔保函》，為本公司境外全資附屬公司海通銀行發行金額為2.3億歐元、於2025年到期的歐元債券提供連帶責任保證擔保。

本公司於2022年5月31日簽署《擔保協議》，為境外全資附屬公司海通銀行發行金額為1.5億美元、於2027年到期的債券提供連帶責任保證擔保，擔保期限66個月。

## 第六節 重要事項

4. 2020年，經本公司第七屆董事會第十一次會議審議通過，同意本公司為在境外的全資附屬公司海通銀行或其附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過3.75億歐元債務融資本金(含3.75億歐元或等值其他幣種)、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過6年(含6年)。

本公司於2021年5月17日作為擔保人簽署《貸款協議》，為境外全資附屬公司海通銀行3.75億歐元(含3.75億歐元或等值其他貨幣)銀團貸款提供連帶責任保證擔保。截至2024年6月30日，本公司的該項擔保責任餘額為2.25億歐元。

5. 2019年，經本公司第六屆董事會第三十七次會議審議通過，同意本公司為在境外的全資子公司海通國際控股及其全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過6.7億美元債務融資本金(含6.7億美元或等值其他幣種)、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過10年(含10年)。

本公司於2020年3月12日簽署《擔保協議》，為本公司境外全資附屬公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited發行金額為6.7億美元、於2025年到期、票面利率為2.107%的美元債券，提供連帶責任保證擔保。

## 第六節 重要事項

6. 2012年，經本公司第五屆董事會第十二次會議審議通過，同意本公司對海通資管公司提供不超過人民幣十五億元的淨資本擔保承諾。2013年6月，根據上海證監局下發的《關於海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司出具淨資本擔保承諾書的無異議函》(滬證監機構字[2013]145號)，本公司向海通資管公司提供人民幣8億元的擔保承諾。

2016年，經本公司第六屆董事會第十八次會議審議通過，同意本公司對海通資管公司追加不超過人民幣40億元的淨資本擔保承諾。就本次淨資本擔保事宜，海通資管公司已獲得中國證監會上海監管局出具的《關於對海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司出具淨資本擔保承諾書的無異議函》(滬證監機構字[2016]325號)。

2021年12月，本公司對海通資管公司減少提供淨資本擔保承諾金額人民幣18億元。就本次淨資本擔保減少事宜，海通資管公司已收到中國證監會上海監管局《關於對海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司減少提供部分淨資本擔保承諾事項的無異議函》(滬證監機構字[2021]532號)。

2024年4月，本公司對海通資管公司減少提供淨資本擔保承諾金額人民幣20億元。就本次淨資本擔保減少事宜，海通資管公司已收到中國證監會上海監管局《關於對海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司減少提供部分淨資本擔保承諾事項的無異議函》(滬證監機構字[2024]106號)。

截至2024年6月30日，本公司對海通資管公司提供淨資本擔保承諾金額為人民幣10億元。

## 第六節 重要事項

7. 本公司全資子公司海通開元將註冊資本從人民幣75億元減至人民幣55億元，減資人民幣20億元。本公司為海通開元減資過程中未清償債人民幣14,542.24萬元提供一般保證擔保。上述擔保事項已經本公司於2024年4月26日召開的第八屆董事會第五次會議審議通過。截至2024年6月30日，本公司的該項擔保責任餘額為人民幣13,980.51萬元。
8. 本公司子公司海通恒信於2024年3月19日簽署《擔保協議》，為其境外全資子公司Haitong UT Brilliant Limited發行金額為人民幣10億元、於2027年3月到期的債券提供連帶責任保證擔保。
9. 本公司子公司海通恒信於2022年4月27日簽署《擔保協議》，為其境外全資子公司Haitong UT Brilliant Limited發行金額為2億美元、於2025年4月到期的債券提供連帶責任保證擔保。

註： 報告期內子公司海通國際為子公司業務開展向銀行提供擔保，擔保限額按2024年6月28日中國外匯交易中心公佈的人民幣匯率中間價公告1港元對人民幣0.91268元換算，合計為人民幣8,392,092,600元，截至報告期末，實際提貸的擔保餘額合計為人民幣60,000,000元。

報告期內子公司海通國際及其子公司為其附屬公司在多項於國際衍生品框架協議(ISDA)、全球總回購協議(GMRA)、全球證券借貸主協議(GMSLA)等協議項下開展的交易提供擔保。其中，部分擔保為無限額擔保，此類擔保是遵循國際銀行業及資本市場慣例做出的，以保障相關業務的正常開展。同時，鑑於擔保主體為有限責任公司，該等擔保的實質擔保上限為擔保主體的資產淨值，且其出具目的與風險屬性亦有別於債務融資擔保。

### 3 其他重大合同

報告期內，本公司無其他應披露而未披露的重大合同。



## 第六節 重要事項

### 十二、募集資金使用進展說明

✓不適用

### 十三、其他重大事項的說明

#### 子公司其他事項

#### 1. 海通國際完成私有化

2023年9月26日，本公司第七屆董事會第四十二次會議（臨時會議）審議通過《關於海通國際控股有限公司對海通國際證券集團有限公司進行私有化的議案》，同意批准海通國際控股對海通國際的私有化方案。2024年1月11日上午9點整海通國際撤銷在香港聯交所的上市地位生效，已正式退市。

#### 2. 註銷上海澤春投資發展有限公司

2021年8月26日，本公司第七屆董事會第十八次董事會審議通過《關於吸收合併上海澤春投資發展有限公司的議案》，同意以海通證券為主體吸收合併上海澤春投資發展有限公司，被合併方上海澤春投資發展有限公司依法解散並註銷。2024年2月26日，上海澤春投資發展有限公司吸收合併及註銷程序全部完成。

## 第六節 重要事項

### 3. 為境外全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保

2024年3月28日，本公司第八屆董事會第四次會議審議通過了《關於為境外全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保的議案》，同意本公司為在境外的全資子公司海通國際控股有限公司及其全資附屬公司境外債務融資（包括但不限於發行境外債券、中長期商業借款及其他符合監管要求的融資方式）提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過6.7億美元債務融資本金（含6.7億美元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過7年（含7年）；同意本公司為在境外的全資子公司Haitong Bank, S.A.及其分行或全資附屬公司境外債務融資（包括但不限於發行境外債券、中長期商業借款及其他符合監管要求的融資方式）提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過2.3億歐元債務融資本金（含2.3億歐元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過5年（含5年）。

### 4. 變更為境外子公司境外債務融資提供維好支持額度

2024年4月26日，本公司第八屆董事會第五次會議審議通過了《關於變更為境外子公司境外債務融資提供維好支持額度的議案》，將本公司第七屆董事會第三十六次會議《關於為境外子公司境外債務融資提供維好支持額度的議案》變更為：同意本公司將為境外子公司海通國際控股有限公司、海通國際證券集團有限公司及其全資附屬公司境外債務融資提供擔保或維好支持，額度合計不超過人民幣160億（含）港幣（或等值幣種），擔保期限不超過7年（含），維好期限不超過5年（含），其中擔保額度不超過總額度的50%。

### 5. 海通開元投資有限公司減資

2024年4月26日，本公司第八屆董事會第五次會議經審議通過了《關於公司全資子公司海通開元投資有限公司減資及公司為其減資過程中未清償債務提供擔保的議案》，同意子公司海通開元的註冊資本從人民幣75億元減至人民幣55億元。2024年6月13日，該減資事項完成工商變更。

## 第六節 重要事項

### 十四、報告期後事項

除本報告之合併財務報表附註67所載者外，於2024年6月30日後截至本報告日期，本公司並無發生任何重大事項。

### 十五、持有的重大投資、有關附屬公司、聯營公司及合營企業的重大收購及出售、以及未來作重大投資或購入資本資產的計劃

除本報告所披露者外，於報告期內，本公司沒有持有任何重大投資（持有的各項個別投資概不構成本集團截至2024年6月30日總資產5%或以上），亦沒有進行有關附屬公司、聯營公司或合營企業的任何重大收購或出售；於本報告日期，本公司並無任何董事批准的重大投資或購入資本資產。

## 第七節 股份變動及股東情況

### 一、股本變動情況

#### (一) 股份變動情況表

##### 1、 股份變動情況表

報告期內，本公司股份總數及股本結構未發生變化。本公司的股份總數為13,064,200,000股，其中，A股為9,654,631,180股，H股為3,409,568,820股。

##### 2、 股份變動情況說明

報告期內，本公司無股份變動情況。

##### 3、 報告期後到半年報披露日期間發生股份變動對每股收益、每股淨資產等財務指標的影響(如有)

✓不適用

##### 4、 本公司認為必要或證券監管機構要求披露的其他內容

✓不適用

#### (二) 限售股份變動情況

單位：股

股東名稱	期初限售股數	報告期解除 限售股數	報告期增加 限售股數	報告期末 限售股數	限售原因	解除限售日期
上海國盛(集團)有限公司	781,250,000	0	0	781,250,000	非公開發行股份限售	2024年8月15日*
合計	781,250,000	0	0	781,250,000	/	/

\* 上海國盛(集團)有限公司持有的鎖定期限48個月的限售股原本於2024年8月5日解禁，考慮本公司2023年度權益分派實施期間限售股解禁上市對權益分派實施的影響，前述限售股解除限售日期變更為2024年8月15日，自2024年8月15日起本公司無限售股。詳見本公司2024年8月8日於香港聯交所披露易網站披露的《海外監管公告》。

## 第七節 股份變動及股東情況

### 二、股東情況

#### (一) 股東總數：

截至報告期末普通股股東總數(戶) 244,569 (其中A股244,422；H股147)

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

單位：股

前十名股東持股情況(不含通過轉融通出借股份)

股東名稱(全稱)	報告期內增減	期末持股數量	比例(%)	持有有限售 質押、標記或凍結情況			股東性質
				條件股份數量	股份狀態	數量	
香港中央結算(代理人)有限公司	316,400	3,409,025,756	26.09	0	未知	-	境外法人
上海國盛(集團)有限公司	0	862,489,059	6.60	781,250,000	無	0	國有法人
上海海煙投資管理有限公司	0	635,084,623	4.86	0	無	0	國有法人
光明食品(集團)有限公司	0	480,275,000	3.68	0	無	0	國有法人
上海電氣控股集團有限公司	-478,600	343,767,818	2.63	0	無	0	國家
申能(集團)有限公司	0	322,162,086	2.47	0	無	0	國有法人
中國證券金融股份有限公司	0	258,104,024	1.98	0	無	0	其他
上海國盛集團資產有限公司	0	238,382,008	1.82	0	無	0	國有法人
上海久事(集團)有限公司	5,162,900	235,247,280	1.80	0	無	0	國有法人
香港中央結算有限公司	69,399,390	234,083,689	1.79	0	無	0	境外法人



## 第七節 股份變動及股東情況

### 前十名無限售條件股東持股情況 (不含通過轉融通出借股份)

股東名稱	持有無限售條件流通股的數量	股份種類及數量	
		種類	數量
香港中央結算(代理人)有限公司	3,409,025,756	境外上市外資股	3,409,025,756
上海海煙投資管理有限公司	635,084,623	人民幣普通股	635,084,623
光明食品(集團)有限公司	480,275,000	人民幣普通股	480,275,000
上海電氣控股集團有限公司	343,767,818	人民幣普通股	343,767,818
申能(集團)有限公司	322,162,086	人民幣普通股	322,162,086
中國證券金融股份有限公司	258,104,024	人民幣普通股	258,104,024
上海國盛集團資產有限公司	238,382,008	人民幣普通股	238,382,008
上海久事(集團)有限公司	235,247,280	人民幣普通股	235,247,280
香港中央結算有限公司	234,083,689	人民幣普通股	234,083,689
中國建設銀行股份有限公司－國泰中證 全指證券公司交易型開放式指數證券 投資基金	217,735,748	人民幣普通股	217,735,748
前十名股東中回購專戶情況說明			—
上述股東委託表決權、受託表決權、 放棄表決權的說明			—
上述股東關聯關係或一致行動的說明	上海國盛集團資產有限公司為上海國盛(集團)有限公司的全資子公司，此外，未知其他股東之間是否存在關聯關係，也未知是否屬於《上市公司收購管理辦法》規定的一致行動人。		
表決權恢復的優先股股東及持股數量的說明			

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

## 第七節 股份變動及股東情況

2. 上表中，境外上市外資股為H股。本公司H股股東中，非登記股東的股份由香港中央結算（代理人）有限公司代為持有。
3. 上海國盛集團及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司持有本公司A股和H股共計135,632.75萬股，佔本公司總股本的10.38%；上海電氣控股集團有限公司持有本公司A股和H股共計64,643.02萬股，佔本公司總股本的4.95%。
4. 因本公司股票為融資融券標的證券，股東持股數量按照其通過普通證券賬戶、信用證券賬戶持有的股票及權益數量合併計算。

### 持股5%以上股東、前十名股東及前十名無限售流通股股東參與轉融通業務出借股份情況

單位：股

股東名稱（全稱）	持股5%以上股東、前十名股東及前十名無限售流通股股東參與轉融通業務出借股份情況							
	期初普通賬戶、信用賬戶持股		期初轉融通出借股份且尚未歸還		期末普通賬戶、信用賬戶持股		期末轉融通出借股份且尚未歸還	
	數量合計	比例(%)	數量合計	比例(%)	數量合計	比例(%)	數量合計	比例(%)
上海電氣控股集團有限公司	344,246,418	2.6350	300,000	0.0023	343,767,818	2.6314	778,600	0.0060
上海久事（集團）有限公司	230,084,380	1.7612	5,162,900	0.0395	235,247,280	1.8007	0	0
中國建設銀行股份有限公司－ 國泰中證全指證券公司交易型 開放式指數證券投資基金	208,194,248	1.5936	1,468,400	0.0112	217,735,748	1.6667	440,600	0.0034

## 第七節 股份變動及股東情況

前十名股東及前十名無限售流通股股東因轉融通出借／歸還原因導致較上期發生變化

✓不適用

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	有限售條件股份可上市交易情況		限售條件
		持有的有限售 條件股份數量	新增可上市 交易股份數量	
1	上海國盛(集團)有限公司 上述股東關聯關係或一致行動的說明	781,250,000	2024年8月15日	- 限售期48個月 無
				2020年8月5日，本公司向上海國盛集團等13家特定對象非公開發行人民幣普通股(A股)1,562,500,000股完成後，本公司的股份總數由11,501,700,000股增加至13,064,200,000股，其中，H股仍為3,409,568,820股，A股從8,092,131,180股增加到9,654,631,180股。增發完成後，本公司無限售條件流通股為11,501,700,000股，有限售條件流通股為1,562,500,000股(均為本次非公開發行的A股股票)。本公司非公開發行的部分限售股已分別於2021年2月5日、2022年2月7日、2024年8月15日解禁，具體內容詳見2021年1月29日、2022年1月21日、2024年8月8日本公司於香港聯交所網站披露的《海外監管公告》。截至報告期末，本公司股份總數中無限售條件的流通股為13,064,200,000股，有限售條件的流通股為0股。

## 第七節 股份變動及股東情況

### (三) 主要股東及其他人士於股份及相關股份擁有的權益及淡倉

於2024年6月30日，據本公司董事合理查詢所知，以下人士（並非本公司董事、監事或最高行政人員）於股份或相關股份中，擁有根據《證券及期貨條例》第XV部第2及第3分部須向本公司披露並根據《證券及期貨條例》第336條已記錄於本公司須存置的登記冊內的權益或淡倉：

序號	主要股東名稱	股份類別	權益性質	持有的股份數目(股)	佔本公司已發行股份總數的比例(%)	佔本公司已發行A股/H股總數的比例(%)	好倉(註3)/淡倉(註4)/可供借出的股份
1.	Maunakai Capital Partners (Hong Kong) Limited	H股	投資經理	272,590,000	2.09	7.99	好倉
2.	BSA Strategic Fund I	H股	實益擁有人	272,590,000	2.09	7.99	好倉
3.	史靜	H股	酌情信託的成立人	228,000,000	1.75	6.69	好倉
4.	Wickhams Cay Trust Company Limited	H股	受託人(註1)	228,000,000	1.75	6.69	好倉
5.	Abhaya Limited	H股	受控制的法團的權益(註1)	228,000,000	1.75	6.69	好倉
6.	Heyday Trend Limited	H股	實益擁有人(註1)	228,000,000	1.75	6.69	好倉
7.	上海國盛(集團)有限公司(註5)	H股	實益擁有人	241,206,000	1.85	7.07	好倉
		A股	實益擁有人	1,100,871,067	8.43	11.40	好倉
8.	上海電氣控股集團有限公司	H股	實益擁有人及受控制的法團的權益(註2)	307,409,200	2.35	9.02	好倉
9.	中國煙草總公司	A股	實益擁有人	635,084,623	4.86	6.58	好倉

註1：Heyday Trend Limited持有本公司228,000,000股H股。Abhaya Limited透過其全資擁有的Heyday Trend Limited持有本公司228,000,000股H股。Abhaya Limited由Wickhams Cay Trust Company Limited全資擁有，史玉柱為Abhaya Limited的董事，而Abhaya Limited的董事慣於按照史玉柱的指令行事，故Wickhams Cay Trust Company Limited及史玉柱均被視為於Abhaya Limited持有的228,000,000股H股中擁有權益。

註2：上海電氣集團香港有限公司持有本公司4,746,800股H股。上海電氣集團香港有限公司由上海電氣控股集團有限公司全資擁有，故上海電氣控股集團有限公司被視為於上海電氣集團香港有限公司持有的4,746,800股H股中擁有權益。

## 第七節 股份變動及股東情況

註3：如股東對股份本身持有權益，包括透過持有、沽出或發行金融文書（包括衍生工具）而持有權益，並因而具有如下的權利與責任，該股東便屬於持有「好倉」：(i)其有權購入相關股份；(ii)其有責任購入相關股份；(iii)如相關股份價格上升，其有權收取款項；或(iv)如相關股份價格上升，其有權避免或減低損失。

註4：如股東根據證券借貸協議借入股份，或如股東因持有、沽出或發行金融文書（包括衍生工具）而具有以下的權利與責任，該股東便屬於持有「淡倉」：(i)其有權要求另一人購入相關股份；(ii)其有責任交付相關股份；(iii)如相關股份價格下降，其有權收取款項；或(iv)如相關股份價格下降，其有權避免或減低損失。

註5：為免疑議，因上述權益披露的範圍不限於有關股東實際持有的股份，本表格中顯示的有關股東持有權益的股份數目及比例與中期報告其他部分所披露的有關股東實質持有的股份數目和比例可能存在差異。

除上述披露外，於2024年6月30日，本公司並不知悉任何其他人士（本公司董事、監事及最高行政人員除外）於本公司股份或相關股份中擁有根據《證券及期貨條例》第336條規定須記錄於登記冊內之權益或淡倉。

### **董事、監事及最高行政人員於本公司及相聯法團的股份、相關股份或債券之權益及淡倉**

於2024年6月30日，就本公司所獲得的資料及據董事所知，概無本公司董事、監事或最高行政人員在本公司或其相關法團（定義見《證券及期貨條例》第XV部）的股份、相關股份或債權證中擁有根據《證券及期貨條例》第XV部第7及8分部須通知本公司及香港聯交所的權益及淡倉（包括根據《證券及期貨條例》的該等條文被當作或視為擁有的權益或淡倉），或根據《證券及期貨條例》第352條規定須在存置之權益登記冊中記錄，或根據《標準守則》的規定需要通知本公司和香港聯交所之權益或淡倉。

### **(四) 戰略投資者或一般法人因配售新股成為前10名股東**

✓不適用



## 第七節 股份變動及股東情況

### 三、董事、監事和高級管理人員情況

#### （一）現任及報告期內離任董事、監事和高級管理人員持股變動情況

✓不適用

#### （二）董事、監事、高級管理人員報告期內被授予的股權激勵情況

報告期內，本公司董事、監事、高級管理人員不存在被授予股權激勵的情況。

#### （三）其他說明

✓不適用

### 四、控股股東或實際控制人變更情況

本公司無控股股東且無實際控制人，本公司第一大股東上海國盛集團及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司持有本公司股份比例為10.38%，本公司第一大股東情況如下：

名稱	上海國盛（集團）有限公司
單位負責人或法定代表人	葉勁松
成立日期	2007年9月26日
主要經營業務	開展以非金融為主，金融為輔的投資，資本運作與資產管理，產業研究，社會經濟諮詢。【依法經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動】

## 第七節 股份變動及股東情況

### 五、購回、出售或贖回上市證券

2024年1月30日，本公司召開的第八屆董事會第三次會議（臨時會議）審議通過了《關於以集中競價交易方式回購公司A股股份方案的議案》，該次回購是本公司自2023年8月以來實施的第二次股份回購計劃，已於2024年4月30日完成。

於2024年6月30日止六個月，本公司通過上交所實際回購本公司A股股份35,567,000股，佔本公司總股本的0.2722%，回購最高價格人民幣9.12元／股，回購最低價格人民幣7.69元／股，回購均價人民幣8.52元／股，使用資金總額人民幣303,053,231.80元（不含交易費用）。回購期間的每月報告如下：

月份	回購數量 (股)	最高成交價 (人民幣元／股)	最低成交價 (人民幣元／股)	資金總額 (人民幣元， 不含交易費用)
2024年1月	10,000,000	8.81	8.69	87,474,539.80
2024年2月	5,940,900	8.60	8.18	50,273,483.00
2024年3月	3,379,600	9.12	8.62	30,092,486.00
2024年4月	16,246,500	8.78	7.69	135,212,723.00

於2024年6月30日，本公司持有77,074,467股A股庫存股。本公司回購的A股股份擬在發佈回購結果暨A股股份變動公告之後12個月後採用集中競價交易方式予以出售。若本公司未能將回購的A股股份在發佈回購結果暨股份變動公告後3年內出售完畢，未實施出售的A股股份將被註銷。

報告期內，除上表所述內容，本公司及其附屬公司未有購回、出售或贖回本公司的任何上市證券（惟代表本公司或附屬公司的客戶以代理人身份進行買賣者除外）。

## 第八節 優先股相關情況

報告期內，本公司無優先股事項。



## 第九節 債券相關情況

### 一、公司債券(含企業債券)和非金融企業債務融資工具

#### (一) 公司債券(含企業債券)

##### 1. 公司債券基本情況

以下為本公司在半年度報告批准報出日存續的公司債券情況。

單位：億元 幣種：人民幣

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	2024年8月31日			債券總額	利率(%)	還本付息方式	交易場所	主承銷商	受託管理人	投資者適當性 安排(如有)	交易機制	是否存在禁止 上市交易的風險
				起息日	後的最近回售日	到期日									
2013年公司債券(第二期) (10年期)	13海通06	122313	2014/7/14	2014/7/14	-	2024/7/14	-	5.85	單利按年計息	上交所	中信	中信	社會公眾投資者、機構投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向合格投資者公開發行2017 年公司債券(第二期)	17海通03	143301	2017/9/20	2017/9/22	-	2027/9/22	55	4.99	單利按年計息	上交所	中信	中信	合格投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2020 年公司債券(第一期) (品種二)	20海通05	163508	2020/4/29	2020/4/30	-	2025/4/30	7	2.88	單利按年計息	上交所	中信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021 年公司債券(第六期) (品種二)	21海通06	188458	2021/7/28	2021/7/29	-	2024/7/29	-	3.14	單利按年計息	上交所	中信、國信、 中信建 投、申萬 宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021 年公司債券(第七期)	21海通07	188571	2021/8/19	2021/8/20	-	2024/8/20	-	3.04	單利按年計息	上交所	中信、國信、 中信建 投、申萬 宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021 年公司債券(第八期) (品種一)	21海通08	188663	2021/8/27	2021/8/30	-	2024/8/30	-	3.10	單利按年計息	上交所	中信、國信、 中信建 投、申萬 宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021 年公司債券(第八期) (品種二)	21海通09	188664	2021/8/27	2021/8/30	-	2026/8/30	20	3.43	單利按年計息	上交所	中信、國信、 中信建 投、申萬 宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021 年公司債券(第九期)	21海通10	188962	2021/11/9	2021/11/10	-	2024/11/10	50	3.10	單利按年計息	上交所	中信、國信、 中信建 投、申萬 宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否

## 第九節 債券相關情況

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	2024年8月31日			債券餘額	利率(%)	還本付息方式	交易場所	主承銷商	受託管理人	投資者適當性		是否存在終止上市交易的風險
				起息日	後的最近回售日	到期日							安排(如有)	交易機制	
面向專業投資者公開發行2021年公司債券(第十期)	21海通11	185010	2021/11/19	2021/11/22	-	2024/11/22	50	3.09	單利按年計息	上交所	中信、國信、中信證券、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行次級債券(第一期)	22海通C1	185219	2022/1/11	2022/1/12	-	2025/1/12	50	3.18	單利按年計息	上交所	中信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)	22海通01	185285	2022/1/19	2022/1/20	-	2024/12/25	50	2.84	單利按年計息，到期一次還本付息	上交所	中信、國信、中信證券、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)	22海通02	185359	2022/2/17	2022/2/21	-	2025/2/21	29	2.90	單利按年計息	上交所	中信、國信、中信證券、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行次級債券(第二期)	22海通C2	185400	2022/2/24	2022/2/25	-	2025/2/25	20	3.15	單利按年計息	上交所	中信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)	22海通03	185448	2022/3/4	2022/3/7	-	2025/3/7	5	3.03	單利按年計息	上交所	中信、國信、中信證券、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行次級債券(第三期)	22海通C3	185472	2022/3/8	2022/3/9	-	2025/3/9	24.8	3.29	單利按年計息	上交所	中信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第四期)	22海通04	137555	2022/7/25	2022/7/26	-	2025/7/26	50	2.75	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第五期)	22海通05	137799	2022/9/8	2022/9/9	-	2025/9/9	50	2.53	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否



## 第九節 債券相關情況

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	2024年8月31日			債券總額	利率(%)	還本付息方式	交易場所	主承銷商	受託管理人	投資者適宜性	是否存在禁止	
				起息日	後的最近回售日	到期日							安排(如有)	交易機制	上市交易的風險
2022年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第六期)	22海通06	137904	2022/10/13	2022/10/14	-	2025/10/14	47	2.60	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2022年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第七期)	22海通07	138571	2022/11/9	2022/11/10	-	2025/11/10	30	2.61	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一期)(品種一)	23海通01	138869	2023/2/27	2023/2/8	-	2025/2/8	25	2.95	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一期)(品種二)	23海通02	138870	2023/2/27	2023/2/8	-	2026/2/8	30	3.23	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種一)	23海通03	115003	2023/3/3	2023/3/6	-	2025/3/6	25	3.11	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種二)	23海通04	115004	2023/3/3	2023/3/6	-	2026/3/6	17	3.26	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種一)	23海通05	115104	2023/3/21	2023/3/22	-	2025/3/22	33	2.97	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種二)	23海通06	115105	2023/3/21	2023/3/22	-	2026/3/22	27	3.10	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第四期)(品種一)	23海通07	115272	2023/4/21	2023/4/24	-	2025/4/24	20	2.89	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否

## 第九節 債券相關情況

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	2024年8月31日		到期日	債券餘額	利率(%)	還本付息方式	交易場所	主承銷商	受託管理人	投資者適當性		是否存在終止上市交易的風險
				起息日	後的最近回售日								安裝(如有)	交易機制	
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第四期)(品種二)	23海通08	115273	2023/4/21	2023/4/24	-	2026/4/24	40	3.05	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第五期)(品種一)	23海通09	115362	2023/5/17	2023/5/18	-	2026/5/18	36	2.94	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第五期)(品種二)	23海通10	115363	2023/5/17	2023/5/18	-	2028/5/18	14	3.10	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第六期)(品種一)	23海通11	115487	2023/6/14	2023/6/15	-	2026/6/15	30	2.73	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第六期)(品種二)	23海通12	115488	2023/6/14	2023/6/15	-	2028/6/15	20	3.07	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第七期)(品種一)	23海通13	115618	2023/7/24	2023/7/25	-	2026/7/25	20	2.72	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第七期)(品種二)	23海通14	115619	2023/7/24	2023/7/25	-	2028/7/25	27	3.05	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第八期)	23海通15	155828	2023/8/17	2023/8/18	-	2026/8/18	32	2.67	單利按年計息	上交所	中信、申萬宏源	中信	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否
2023年面向專業機構投資者公開發行短期公司債券(第一期)	23海通51	240048	2023/11/14	2023/11/15	-	2024/10/25	50	2.68	到期一次還本付息	上交所	興發、財通、興發、中銀國際	興發	專業投資者	競價、報價、詢價、協議、議價交易	否

## 第九節 債券相關情況

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	2024年8月31日			債券總額	利率(%)	還本付息方式	交易所	主承銷商	受託管理人	投資者適當性	交易機制	是否存在禁止上市交易的風險
				起息日	後的最近回售日	到期日									
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第九期)	23海通16	240306	2023/11/23	2023/11/24	-	2026/11/24	18	2.95	單利按年計息	上交所	中信、廣發、國信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一類)(品種一)	24海通01	240454	2024/2/21	2024/2/22	-	2027/2/22	10	2.58	單利按年計息	上交所	中信、廣發、華泰聯合	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一類)(品種二)	24海通02	240587	2024/2/21	2024/2/22	-	2029/2/22	50	2.75	單利按年計息	上交所	中信、廣發、華泰聯合	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一類)(品種一)	24海通03	240643	2024/3/4	2024/3/5	-	2027/3/5	17	2.50	單利按年計息	上交所	中信、廣發	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一類)(品種二)	24海通04	240644	2024/3/4	2024/3/5	-	2029/3/5	33	2.70	單利按年計息	上交所	中信、廣發	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第三類)(品種一)	24海通05	240748	2024/3/19	2024/3/20	-	2027/3/20	41	2.55	單利按年計息	上交所	中信、光大、國信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否
2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第三類)(品種二)	24海通06	240749	2024/3/19	2024/3/20	-	2029/3/20	30	2.69	單利按年計息	上交所	中信、光大、國信	中信	專業投資者	競價、報價、詢價和協議交易	否

註： 中信全名中信證券股份有限公司、中信建投全名中信建投證券股份有限公司、國信全名國信證券股份有限公司、申萬宏源全名申萬宏源證券有限公司、廣發全名廣發證券股份有限公司、財通全名財通證券股份有限公司、中銀國際全名中銀國際證券股份有限公司、華泰聯合全名華泰聯合證券有限責任公司、光大全名光大證券股份有限公司。

截至本報告日期，13海通06、21海通06、21海通07、21海通08已完成兌付摘牌。

## 第九節 債券相關情況

本公司對債券終止上市交易風險的應對措施

✓不適用

### 2. 本公司或投資者選擇權條款、投資者保護條款的觸發和執行情況

✓不適用

### 3. 信用評級結果調整情況

✓不適用

其他說明

無

### 4. 擔保情況、償債計劃及其他償債保障措施在報告期內的變更、變化和執行情況及其影響

現狀	執行情況	是否發生變更	變更後情況	變更原因	變更是否 已取得有權 機構批准	變更對債券 投資者權益 的影響
存續的公司債券均為無擔保債券。	正常	否	-	-	-	-
嚴格按照債券募集說明書中有關償債計劃的約定履行兌付兌息職責。	正常	否	-	-	-	-
償債保障措施包括制定《債券持有人會議規則》、設立專門的償付工作小組、充分發揮受託管理人的作用、嚴格履行信息披露義務等。	正常	否	-	-	-	-

## 第九節 債券相關情況

### 其他說明

未發生變更。

### 5. 為債券發行及存續期業務提供服務的中介機構

中介機構名稱	辦公地址	服務內容	聯繫人/簽字會計師	聯繫電話
中信證券股份有限公司	北京市朝陽區亮馬橋路48號中信證券大廈 22、23層	受託管理人	聶磊、祁繼華、康雅然	010-60838888 010-60833046
廣發證券股份有限公司	上海市浦東新區南泉北路429號泰康保險 大廈41樓	受託管理人	馬茜、張毅鉞	021-38003800
普華永道中天會計師事務所(特殊 普通合夥)	上海市黃浦區湖濱路202號領展企業廣場 二座普華永道中心11樓	2020-2023年度 A股審計機構	許康璋、劉偉、王以彬	021-23238888
上海市錦天城律師事務所	上海市浦東新區銀城中路501號上海中心 大廈11、12層	法律顧問	裴振宇、肖文艷	021-20511000
中誠信國際信用評級有限責任公司	北京市東城區南竹桿胡同2號1幢60101	資信評級機構	喬爽	010-66428877
中介機構名稱	變更原因	履行政序	對債券投資者權益的影響	
立信會計師事務所(特殊普通合夥)	考慮公司現有業務狀況、發展需求及整 體審計需要，選聘2024年度A股審計 機構。	2024年6月27日第八屆董事會第九次會 議、2024年7月18日2024年第一次股 東特別大會審議通過。	-	

### (二) 銀行間債券市場非金融企業債務融資工具

✓不適用

### (三) 公司債券募集資金情況

✓公司債券在報告期內涉及募集資金使用或者整改

債券代碼：240454

債券簡稱：24海通01

## 第九節 債券相關情況

### 1. 基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

債券全稱 海通證券股份有限公司2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第一期）（品種一）

是否為專項品種債券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
專項品種債券的具體類型	—
募集資金總額	10
報告期末募集資金餘額	0
報告期末募集資金專項賬戶餘額	0

### 2. 募集資金用途變更調整

約定的募集資金用途（請全文列示） 用於償還到期公司債券本金和置換償還到期公司債券本金的自有資金。

是否變更調整募集資金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
變更調整募集資金用途履行的程序，該程序是否符合募集說明書的約定	—
變更調整募集資金用途的信息披露情況	—
變更調整後的募集資金用途及其合法合規性	—



## 第九節 債券相關情況

### 3. 募集資金實際使用情況 (此處不含臨時補流)

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金實際使用金額	10
3.1.1 償還有息債務(不含公司債券)金額	-
3.1.2 償還有息債務(不含公司債券)情況	-
3.2.1 償還公司債券金額	10
3.2.2 償還公司債券情況	置換償還GC海通01的自有資金
3.3.1 補充流動資金金額	-
3.3.2 補充流動資金情況	-
3.4.1 固定資產項目投資金額	-
3.4.2 固定資產項目投資情況	-
3.5.1 股權投資、債權投資或資產收購金額	-
3.5.2 股權投資、債權投資或資產收購情況	-
3.6.1 其他用途金額	-
3.6.2 其他用途具體情況	-

## 第九節 債券相關情況

### 4. 募集資金用於特定項目

- 4.1 募集資金是否用於固定資產投資項目或者股權投資、債權投資或者資產收購等其他特定項目 是 否
- 4.1.1 項目進展情況 -
- 4.1.2 項目運營效益 -
- 4.1.3 項目抵押或質押事項辦理情況（如有） -
- 4.2 報告期內項目是否發生重大變化，或可能影響募集資金投入使用的計劃 是 否
- 4.2.1 項目變化情況 -
- 4.2.2 項目變化的程序履行情況 -
- 4.2.3 項目變化後，募集資金用途的變更情況（如有） -
- 4.3 報告期末項目淨收益是否較募集說明書等文件披露內容下降50%以上，或者報告期內發生其他可能影響項目實際運營情況的重大不利事項 是 否
- 4.3.1 項目淨收益變化情況 -
- 4.3.2 項目淨收益變化對公司償債能力和投資者權益的影響、應對措施等 -
- 4.4 其他項目建設需要披露的事項 -

### 5. 臨時補流情況

單位：億元 幣種：人民幣

- 報告期內募集資金是否用於臨時補充流動資金 是 否
- 臨時補流金額 -
- 臨時補流情況，包括但不限於臨時補流用途、開始和歸還時間、履行的程序 -

## 第九節 債券相關情況

### 6. 募集資金合規情況

截至報告期末募集資金實際用途 (包括實際使用和臨時補流)	置換償還GC海通01的自有資金
實際用途與約定用途(含募集說明書約定用途和合規變更後的用途)是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
報告期內募集資金賬戶管理和使用是否合規	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
違規的具體情況(如有)	-
募集資金違規被處罰處分情況(如有)	-
募集資金違規的,是否已完成整改及整改情況(如有)	-
募集資金使用是否符合地方政府債務管理規定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不適用
募集資金使用違反地方政府債務管理規定的情形及整改情況(如有)	-

債券代碼：240587

債券簡稱：24海通02

### 1. 基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

債券全稱 海通證券股份有限公司2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一期)(品種二)

是否為專項品種債券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
專項品種債券的具體類型	-
募集資金總額	50
報告期末募集資金餘額	0
報告期末募集資金專項賬戶餘額	0

## 第九節 債券相關情況

### 2. 募集資金用途變更調整

約定的募集資金用途（請全文列示） 用於償還到期公司債券本金和置換償還到期公司債券本金的自有資金。

是否變更調整募集資金用途 是 否  
 變更調整募集資金用途履行的程序，  
 該程序是否符合募集說明書的約定  
 變更調整募集資金用途的信息披露情況  
 變更調整後的募集資金用途及其合法合規性

### 3. 募集資金實際使用情況（此處不含臨時補流）

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金實際使用金額	50
3.1.1 償還有息債務（不含公司債券）金額	-
3.1.2 償還有息債務（不含公司債券）情況	-
3.2.1 償還公司債券金額	50
3.2.2 償還公司債券情況	17億置換償還GC海通01的自有資金， 33億置換償還21海通01的自有資金
3.3.1 補充流動資金金額	-
3.3.2 補充流動資金情況	-
3.4.1 固定資產項目投資金額	-
3.4.2 固定資產項目投資情況	-
3.5.1 股權投資、債權投資或資產收購金額	-
3.5.2 股權投資、債權投資或資產收購情況	-
3.6.1 其他用途金額	-
3.6.2 其他用途具體情況	-

## 第九節 債券相關情況

### 4. 募集資金用於特定項目

- |       |   |  |
|-------|---|--|
| 4.1   | 募集資金是否用於固定資產投資項目或者股權投資、債權投資或者資產收購等其他特定項目                      | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.1.1 | 項目進展情況  | -  |
| 4.1.2 | 項目運營效益  | -  |
| 4.1.3 | 項目抵押或質押事項辦理情況(如有)   | -  |
| 4.2   | 報告期內項目是否發生重大變化，或可能影響募集資金投入使用計劃                                | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.2.1 | 項目變化情況  | -  |
| 4.2.2 | 項目變化的程序履行情況   | -  |
| 4.2.3 | 項目變化後，募集資金用途的變更情況(如有)   | -  |
| 4.3   | 報告期末項目淨收益是否較募集說明書等文件披露內容下降50%以上，或者報告期內發生其他可能影響項目實際運營情況的重大不利事項 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.3.1 | 項目淨收益變化情況   | -  |
| 4.3.2 | 項目淨收益變化對公司償債能力和投資者權益的影響、應對措施等                                 | -  |
| 4.4   | 其他項目建設需要披露的事項   | -  |

## 第九節 債券相關情況

### 5. 臨時補流情況

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金是否用於臨時補充流動資金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
臨時補流金額	—
臨時補流情況，包括但不限於臨時補流用途、開始和歸還時間、履行的程序	—

### 6. 募集資金合規情況

截至報告期末募集資金實際用途（包括實際使用和臨時補流）	17億置換償還GC海通01的自有資金， 33億置換償還21海通01的自有資金
實際用途與約定用途（含募集說明書約定用途和合規變更後的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
報告期內募集資金賬戶管理和使用是否合規	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
違規的具體情況（如有）	—
募集資金違規被處罰處分情況（如有）	—
募集資金違規的，是否已完成整改及整改情況（如有）	—
募集資金使用是否符合地方政府債務管理規定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不適用
募集資金使用違反地方政府債務管理規定的情形及整改情況（如有）	—

債券代碼：240643

債券簡稱：24海通03



## 第九節 債券相關情況

### 1. 基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

**債券全稱** 海通證券股份有限公司2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種一)

是否為專項品種債券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
專項品種債券的具體類型	-
募集資金總額	17
報告期末募集資金餘額	0
報告期末募集資金專項賬戶餘額	0

### 2. 募集資金用途變更調整

**約定的募集資金用途(請全文列示)** 用於置換償還到期公司債券本金的自有資金

是否變更調整募集資金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
變更調整募集資金用途履行的程序， 該程序是否符合募集說明書的約定	-
變更調整募集資金用途的信息披露情況	-
變更調整後的募集資金用途及 其合法合規性	-

## 第九節 債券相關情況

### 3. 募集資金實際使用情況（此處不含臨時補流）

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金實際使用金額	17
3.1.1 償還有息債務（不含公司債券） 金額	-
3.1.2 償還有息債務（不含公司債券） 情況	-
3.2.1 償還公司債券金額	17
3.2.2 償還公司債券情況	置換償還21海通01的自有資金
3.3.1 補充流動資金金額	-
3.3.2 補充流動資金情況	-
3.4.1 固定資產項目投資金額	-
3.4.2 固定資產項目投資情況	-
3.5.1 股權投資、債權投資或資產 收購金額	-
3.5.2 股權投資、債權投資或資產 收購情況	-
3.6.1 其他用途金額	-
3.6.2 其他用途具體情況	-

## 第九節 債券相關情況

### 4. 募集資金用於特定項目

- |       |   |  |
|-------|---|--|
| 4.1   | 募集資金是否用於固定資產投資項目或者股權投資、債權投資或者資產收購等其他特定項目                      | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.1.1 | 項目進展情況  | -  |
| 4.1.2 | 項目運營效益  | -  |
| 4.1.3 | 項目抵押或質押事項辦理情況(如有)   | -  |
| 4.2   | 報告期內項目是否發生重大變化，或可能影響募集資金投入使用計劃                                | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.2.1 | 項目變化情況  | -  |
| 4.2.2 | 項目變化的程序履行情況   | -  |
| 4.2.3 | 項目變化後，募集資金用途的變更情況(如有)   | -  |
| 4.3   | 報告期末項目淨收益是否較募集說明書等文件披露內容下降50%以上，或者報告期內發生其他可能影響項目實際運營情況的重大不利事項 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.3.1 | 項目淨收益變化情況   | -  |
| 4.3.2 | 項目淨收益變化對公司償債能力和投資者權益的影響、應對措施等                                 | -  |
| 4.4   | 其他項目建設需要披露的事項   | -  |

## 第九節 債券相關情況

### 5. 臨時補流情況

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金是否用於臨時補充 流動資金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
臨時補流金額	—
臨時補流情況，包括但不限於臨時補流 用途、開始和歸還時間、履行的程序	—

### 6. 募集資金合規情況

截至報告期末募集資金實際用途（包括 實際使用和臨時補流）	置換償還21海通01的自有資金
實際用途與約定用途（含募集說明書約定 用途和合規變更後的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
報告期內募集資金賬戶管理和使用是否 合規	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
違規的具體情況（如有）	—
募集資金違規被處罰處分情況（如有）	—
募集資金違規的，是否已完成整改及 整改情況（如有）	—
募集資金使用是否符合地方政府債務管理 規定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不適用
募集資金使用違反地方政府債務管理規定 的情形及整改情況（如有）	—

債券代碼：240644

債券簡稱：24海通04

## 第九節 債券相關情況

### 1. 基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

債券全稱 海通證券股份有限公司2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種二)

是否為專項品種債券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
專項品種債券的具體類型	-
募集資金總額	33
報告期末募集資金餘額	0
報告期末募集資金專項賬戶餘額	0

### 2. 募集資金用途變更調整

約定的募集資金用途(請全文列示) 用於置換償還到期公司債券本金的自有資金

是否變更調整募集資金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
變更調整募集資金用途履行的程序，該程序是否符合募集說明書的約定	-
變更調整募集資金用途的信息披露情況	-
變更調整後的募集資金用途及其合法合規性	-

## 第九節 債券相關情況

### 3. 募集資金實際使用情況（此處不含臨時補流）

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金實際使用金額	33
3.1.1 償還有息債務（不含公司債券） 金額	-
3.1.2 償還有息債務（不含公司債券） 情況	-
3.2.1 償還公司債券金額	33
3.2.2 償還公司債券情況	10億置換償還21海通01的自有資金， 23億置換償還21海通02的自有資金
3.3.1 補充流動資金金額	-
3.3.2 補充流動資金情況	-
3.4.1 固定資產項目投資金額	-
3.4.2 固定資產項目投資情況	-
3.5.1 股權投資、債權投資或資產 收購金額	-
3.5.2 股權投資、債權投資或資產 收購情況	-
3.6.1 其他用途金額	-
3.6.2 其他用途具體情況	-



## 第九節 債券相關情況

### 4. 募集資金用於特定項目

- |       |   |  |
|-------|---|--|
| 4.1   | 募集資金是否用於固定資產投資項目或者股權投資、債權投資或者資產收購等其他特定項目                      | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.1.1 | 項目進展情況  | -  |
| 4.1.2 | 項目運營效益  | -  |
| 4.1.3 | 項目抵押或質押事項辦理情況(如有)   | -  |
| 4.2   | 報告期內項目是否發生重大變化，或可能影響募集資金投入使用計劃                                | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.2.1 | 項目變化情況  | -  |
| 4.2.2 | 項目變化的程序履行情況   | -  |
| 4.2.3 | 項目變化後，募集資金用途的變更情況(如有)   | -  |
| 4.3   | 報告期末項目淨收益是否較募集說明書等文件披露內容下降50%以上，或者報告期內發生其他可能影響項目實際運營情況的重大不利事項 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.3.1 | 項目淨收益變化情況   | -  |
| 4.3.2 | 項目淨收益變化對公司償債能力和投資者權益的影響、應對措施等                                 | -  |
| 4.4   | 其他項目建設需要披露的事項   | -  |

## 第九節 債券相關情況

### 5. 臨時補流情況

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金是否用於臨時補充 流動資金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
臨時補流金額	—
臨時補流情況，包括但不限於臨時補流 用途、開始和歸還時間、履行的程序	—

### 6. 募集資金合規情況

截至報告期末募集資金實際用途（包括 實際使用和臨時補流）	10億置換償還21海通01的自有資金， 23億置換償還21海通02的自有資金
實際用途與約定用途（含募集說明書約定 用途和合規變更後的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
報告期內募集資金賬戶管理和使用是否 合規	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
違規的具體情況（如有）	—
募集資金違規被處罰處分情況（如有）	—
募集資金違規的，是否已完成整改及 整改情況（如有）	—
募集資金使用是否符合地方政府債務 管理規定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不適用
募集資金使用違反地方政府債務管理規定 的情形及整改情況（如有）	—

債券代碼：240748

債券簡稱：24海通05

## 第九節 債券相關情況

### 1. 基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

債券全稱 海通證券股份有限公司2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第三期)(品種一)

是否為專項品種債券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
專項品種債券的具體類型	-
募集資金總額	41
報告期末募集資金餘額	0
報告期末募集資金專項賬戶餘額	0

### 2. 募集資金用途變更調整

約定的募集資金用途(請全文列示) 用於償還到期公司債券本金和置換償還到期公司債券本金的自有資金

是否變更調整募集資金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
變更調整募集資金用途履行的程序，該程序是否符合募集說明書的約定	-
變更調整募集資金用途的信息披露情況	-
變更調整後的募集資金用途及其合法合規性	-

## 第九節 債券相關情況

### 3. 募集資金實際使用情況（此處不含臨時補流）

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金實際使用金額	41
3.1.1 償還有息債務（不含公司債券） 金額	-
3.1.2 償還有息債務（不含公司債券） 情況	-
3.2.1 償還公司債券金額	41
3.2.2 償還公司債券情況	31億置換償還21海通02的自有資金， 10億償還21海通03的自有資金
3.3.1 補充流動資金金額	-
3.3.2 補充流動資金情況	-
3.4.1 固定資產項目投資金額	-
3.4.2 固定資產項目投資情況	-
3.5.1 股權投資、債權投資或資產 收購金額	-
3.5.2 股權投資、債權投資或資產 收購情況	-
3.6.1 其他用途金額	-
3.6.2 其他用途具體情況	-

## 第九節 債券相關情況

### 4. 募集資金用於特定項目

- |       |  |  |
|-------|--|--|
| 4.1   | 募集資金是否用於固定資產投資項目或者股權投資、債權投資或者資產收購等其他特定項目                       | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.1.1 | 項目進展情況   | -  |
| 4.1.2 | 項目運營效益   | -  |
| 4.1.3 | 項目抵押或質押事項辦理情況(如有)  | -  |
| 4.2   | 報告期內項目是否發生重大變化, 或可能影響募集資金投入使用計劃                                | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.2.1 | 項目變化情況   | -  |
| 4.2.2 | 項目變化的程序履行情況  | -  |
| 4.2.3 | 項目變化後, 募集資金用途的變更情況(如有)   | -  |
| 4.3   | 報告期末項目淨收益是否較募集說明書等文件披露內容下降50%以上, 或者報告期內發生其他可能影響項目實際運營情況的重大不利事項 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.3.1 | 項目淨收益變化情況  | -  |
| 4.3.2 | 項目淨收益變化對公司償債能力和投資者權益的影響、應對措施等                                  | -  |
| 4.4   | 其他項目建設需要披露的事項  | -  |

## 第九節 債券相關情況

### 5. 臨時補流情況

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金是否用於臨時補充流動資金 是 否

臨時補流金額 -

臨時補流情況，包括但不限於臨時補流用途、開始和歸還時間、履行的程序 -

### 6. 募集資金合規情況

截至報告期末募集資金實際用途（包括實際使用和臨時補流） 31億置換償還21海通02的自有資金，10億償還21海通03的自有資金

實際用途與約定用途（含募集說明書約定用途和合規變更後的用途）是否一致 是 否

報告期內募集資金賬戶管理和使用是否合規 是 否

違規的具體情況（如有） -

募集資金違規被處罰處分情況（如有） -

募集資金違規的，是否已完成整改及整改情況（如有） -

募集資金使用是否符合地方政府債務管理規定 是 否 不適用

募集資金使用違反地方政府債務管理規定的情形及整改情況（如有） -

債券代碼：240749

債券簡稱：24海通06



## 第九節 債券相關情況

### 1. 基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

債券全稱 海通證券股份有限公司2024年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第三期)(品種二)

是否為專項品種債券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
專項品種債券的具體類型	—
募集資金總額	30
報告期末募集資金餘額	0
報告期末募集資金專項賬戶餘額	0

### 2. 募集資金用途變更調整

約定的募集資金用途(請全文列示) 用於償還到期公司債券本金和置換償還到期公司債券本金的自有資金

是否變更調整募集資金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
變更調整募集資金用途履行的程序，該程序是否符合募集說明書的約定	—
變更調整募集資金用途的信息披露情況	—
變更調整後的募集資金用途及其合法合規性	—

## 第九節 債券相關情況

### 3. 募集資金實際使用情況（此處不含臨時補流）

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金實際使用金額	30
3.1.1 償還有息債務（不含公司債券） 金額	-
3.1.2 償還有息債務（不含公司債券） 情況	-
3.2.1 償還公司債券金額	30
3.2.2 償還公司債券情況	償還21海通03的自有資金
3.3.1 補充流動資金金額	-
3.3.2 補充流動資金情況	-
3.4.1 固定資產項目投資金額	-
3.4.2 固定資產項目投資情況	-
3.5.1 股權投資、債權投資或資產 收購金額	-
3.5.2 股權投資、債權投資或資產 收購情況	-
3.6.1 其他用途金額	-
3.6.2 其他用途具體情況	-

## 第九節 債券相關情況

### 4. 募集資金用於特定項目

- |       |   |  |
|-------|---|--|
| 4.1   | 募集資金是否用於固定資產投資項目或者股權投資、債權投資或者資產收購等其他特定項目                      | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.1.1 | 項目進展情況  | -  |
| 4.1.2 | 項目運營效益  | -  |
| 4.1.3 | 項目抵押或質押事項辦理情況(如有)   | -  |
| 4.2   | 報告期內項目是否發生重大變化，或可能影響募集資金投入使用計劃                                | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.2.1 | 項目變化情況  | -  |
| 4.2.2 | 項目變化的程序履行情況   | -  |
| 4.2.3 | 項目變化後，募集資金用途的變更情況(如有)   | -  |
| 4.3   | 報告期末項目淨收益是否較募集說明書等文件披露內容下降50%以上，或者報告期內發生其他可能影響項目實際運營情況的重大不利事項 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 4.3.1 | 項目淨收益變化情況   | -  |
| 4.3.2 | 項目淨收益變化對公司償債能力和投資者權益的影響、應對措施等                                 | -  |
| 4.4   | 其他項目建設需要披露的事項   | -  |

## 第九節 債券相關情況

### 5. 臨時補流情況

單位：億元 幣種：人民幣

報告期內募集資金是否用於臨時補充流動資金 是 否

臨時補流金額 -

臨時補流情況，包括但不限於臨時補流用途、開始和歸還時間、履行的程序 -

### 6. 募集資金合規情況

截至報告期末募集資金實際用途（包括實際使用和臨時補流） 償還21海通03的自有資金

實際用途與約定用途（含募集說明書約定用途和合規變更後的用途）是否一致 是 否

報告期內募集資金賬戶管理和使用是否合規 是 否

違規的具體情況（如有） -

募集資金違規被處罰處分情況（如有） -

募集資金違規的，是否已完成整改及整改情況（如有） -

募集資金使用是否符合地方政府債務管理規定 是 否 不適用

募集資金使用違反地方政府債務管理規定的情形及整改情況（如有） -

## 第九節 債券相關情況

### (四) 專項品種債券應當披露的其他事項

✓不適用

### (五) 報告期內本公司債券相關重要事項

#### 1、非經營性往來佔款和資金拆借

✓不適用

#### 2、負債情況

##### (1) 有息債務及其變動情況

##### 1.1 公司債務結構情況

報告期初和報告期末，本公司（非本公司合併範圍口徑）有息債務餘額分別為人民幣2,521.52億元和人民幣2,394.64億元，報告期內有息債務餘額同比變動-5.03%。

單位：億元 幣種：人民幣

有息債務類別	到期時間			金額合計	金額佔有息債務的佔比(%)
	已逾期	6個月以內(含)	6個月以上		
公司信用類債券	-	296.64	982.80	1,279.44	53.43
銀行貸款	-	-	-	-	-
非銀行金融機構貸款	-	-	-	-	-
其他有息債務	-	1,012.91	102.29	1,115.20	46.57
合計	-	1,309.55	1,085.09	2,394.64	-

註：有息負債科目包括短期借款、應付短期融資款、拆入資金、賣出回購金融資產款、長期借款和應付債券

報告期末本公司存續的公司信用類債券中，公司債券餘額人民幣1,279.44億元，企業債券餘額人民幣0億元，非金融企業債務融資工具餘額人民幣0億元，且共有人民幣200億元本公司信用類債券在2024年9至12月內到期或回售償付。

## 第九節 債券相關情況

### 1.2 公司合併口徑有息債務結構情況

報告期初和報告期末，本公司合併報表範圍內公司有息債務餘額分別為人民幣4,134.04億元和人民幣3,946.27億元，報告期內有息債務餘額同比變動-4.54%。

單位：億元 幣種：人民幣

有息債務類別	到期時間			金額合計	金額佔有息債務的佔比(%)
	已逾期	6個月以內(含)	6個月以上		
公司信用類債券	-	360.75	1,191.80	1,552.55	39.34
銀行貸款	-	385.77	313.78	699.55	17.73
非銀行金融機構貸款	-	1.78	2.41	4.19	0.11
其他有息債務	-	1,226.34	463.64	1,689.98	42.82
合計	-	1,974.64	1,971.63	3,946.27	-

註：有息負債科目包括短期借款、應付短期融資款、拆入資金、賣出回購金融資產款、長期借款和應付債券

報告期末，本公司合併口徑存續的公司信用類債券中，公司債券餘額人民幣1,400.48億元，企業債券餘額人民幣0億元，非金融企業債務融資工具餘額人民幣152.07億元，且共有人民幣240億元本公司信用類債券在2024年9至12月內到期或回售償付。

### 1.3 境外債券情況

截至報告期末，本公司合併報表範圍內發行的境外債券餘額人民幣319.82億元，且在2024年9至12月內到期的境外債券餘額為人民幣4.74億元。



## 第九節 債券相關情況

(2). 報告期末本公司及其子公司存在逾期金額超過人民幣1,000萬元的有息債務或者公司信用類債券逾期情況

✓不適用

(3). 主要負債情況及其變動原因

單位：億元 幣種：人民幣

負債項目	本期末餘額	2023年餘額	變動比例(%)	變動比例超過30%的，
				說明原因
短期借款	333.96	310.54	7.54	-
應付短期融資款	155.71	188.53	-17.41	-
拆入資金	195.05	147.12	32.58	銀行拆入增加
賣出回購金融資產款	997.26	1,125.65	-11.41	-
長期借款	369.77	422.99	-12.58	-
應付債券	1,894.51	1,939.20	-2.30	-
代理買賣證券款	1,065.26	1,065.39	-0.01	-

(4). 可對抗第三人的優先償付負債情況

截至報告期末，本公司合併報表範圍內存在可對抗第三人的優先償付負債：

✓不適用

(六) 公司報告期內合併報表範圍虧損超過上年末淨資產10%

✓不適用

## 第九節 債券相關情況

### (七) 主要會計數據和財務指標

單位：億元 幣種：人民幣

主要指標	本報告期末	上年度末	本報告期末 比上年度末增減		變動原因
				(%)	
流動比率	1.93	1.81	6.63		-
速動比率	1.93	1.81	6.63		-
資產負債率(%)	72.16	73.03	-1.19		-
	本報告期 (1-6月)	上年同期	本報告期 比上年同期增減		變動原因
				(%)	
扣除非經常性損益後 淨利潤	5.46	32.12	-83.01		利潤減少
EBITDA全部債務比	0.02	0.03	-33.33		利潤減少
利息保障倍數	1.27	1.69	-24.85		-
現金利息保障倍數	3.91	-0.10	不適用		-
EBITDA利息保障倍數	1.40	1.80	-22.22		-
貸款償還率(%)	100	100	-		-
利息償付率(%)	100	100	-		-

### 二、可轉換公司債券情況

✓不適用

## 第十節 財務報告

未經審計中期財務資料附後。



## 第十一節 證券公司信息披露

### 本公司重大行政許可事項的相關情況

日期	批覆標題	批覆單位	批文號
2024年1月29日	關於同意海通證券股份有限公司向專業投資者公開發行次級公司債券註冊的批覆	中國證監會	證監許可 [2024]157號

#### 備查文件目錄

載有本公司法定代表人簽名的半年度報告文本  
載有本公司法定代表人、主管會計工作負責人及會計機構負責人簽名蓋章的未經審計中期財務資料文本  
報告期內在符合國務院證券監督管理機構規定條件的媒體上公開披露過的  
所有本公司文件的正本及公告原稿  
其他有關資料

承董事會命  
海通證券股份有限公司  
董事長  
周杰

中國上海  
2024年8月29日

## 簡明綜合損益表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	附註	截至6月30日止六個月期間	
		2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
<b>收入</b>			
— 佣金及手續費收入	4	4,941,756	6,462,063
— 利息收入	5	8,188,000	9,320,529
— 融資租賃收入	5	765,501	781,925
— 投資收入及收益(淨額)	6	1,791,039	3,286,842
		<b>15,686,296</b>	19,851,359
其他收入及收益	7	1,906,564	6,176,069
<b>收入、其他收入及收益總計</b>		<b>17,592,860</b>	26,027,428
佣金及手續費支出	8	(1,437,546)	(1,521,494)
利息支出	9	(7,182,697)	(7,918,051)
折舊和攤銷費用	10	(886,463)	(839,209)
僱員成本		(3,038,109)	(3,651,013)
預期信用損失模式下的減值損失	11	(870,126)	(1,203,824)
其他資產減值損失		(15,648)	(9,878)
其他支出	12	(2,185,160)	(6,112,006)
<b>支出總額</b>		<b>(15,615,749)</b>	(21,255,475)
攤分聯營企業業績		(71,235)	479,771
<b>所得稅前利潤</b>		<b>1,905,876</b>	5,251,724
所得稅費用	13	(676,352)	(1,326,992)
<b>期間利潤</b>		<b>1,229,524</b>	3,924,732
<b>歸屬於：</b>			
本公司股東		953,097	3,829,635
非控制性權益		276,427	95,097
		<b>1,229,524</b>	3,924,732
<b>每股收益(以每股人民幣元列示)</b>			
— 基本	14	0.07	0.29
— 稀釋	14	0.07	0.29

相應附註系該未經審計的簡明綜合財務資料的組成部分。

## 簡明綜合全面收益表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
本期間利潤	1,229,524	3,924,732
<b>其他全面收益／(損失)：</b>		
後續不能重分類至損益的項目：		
設定受益計劃的精算收益／(損失)	10,627	(2,266)
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的 權益工具的公允價值變動收益	93,483	84,353
所得稅影響	(44,825)	(13,950)
小計	59,285	68,137
後續或重分類至損益的項目：		
外幣折算產生的匯兌差額	(193,922)	452,773
指定為現金流量套期的套期工具公允價值變動收益	12,775	54,803
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的 債務工具的公允價值變動收益／(損失)		
－ 期間公允價值變動淨額	693,199	416,681
－ 出售損益的重分類調整	(162,018)	(86,912)
－ 減值損失的重分類調整	16,506	(40,469)
－ 有關其他全面收益部分的所得稅	(135,387)	(72,439)
攤分聯營企業的其他全面收益(稅後)	670	2,986
小計	231,823	727,423
本期其他全面收益(稅後)	291,108	795,560
<b>本期全面收益總額</b>	<b>1,520,632</b>	<b>4,720,292</b>
<b>歸屬於：</b>		
本公司股東	1,276,743	4,381,613
非控制性權益	243,889	338,679
	1,520,632	4,720,292
<b>歸屬於股東的本期全面收益總額來自於：</b>		
持續經營	1,520,632	4,720,292
	1,520,632	4,720,292

相應附註系該未經審計的簡明綜合財務資料的組成部分。



## 簡明綜合財務狀況表

於二零二四年六月三十日

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	附註	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
<b>非流動資產</b>			
物業及設備	15	16,349,799	16,643,326
使用權資產	16	1,657,047	1,763,167
投資物業	17	2,502,581	2,635,841
商譽	18	3,476,950	3,468,589
其他無形資產	19	649,170	691,445
權益法項下投資	20	7,560,572	8,115,626
應收融資租賃款	21	10,157,761	11,248,040
售後回租安排的應收款	22	36,083,833	40,593,188
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具	23	10,416,426	8,010,844
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	24	53,933,453	52,676,210
以攤餘成本計量的債務工具	25	3,529,951	5,035,193
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	26	26,207,802	24,766,774
買入返售金融資產	27	806,799	2,013,400
其他貸款及應收款項	28	122,104	548,019
客戶貸款	29	5,106,119	5,155,382
遞延稅項資產	30	3,302,174	4,187,114
交易所儲備及保證金	31	131,005	163,344
受限制銀行存款	32	2,052,034	1,980,005
其他非流動資產	34	2,391,295	2,422,443
<b>非流動資產總額</b>		<b>186,436,875</b>	192,117,950

## 簡明綜合財務狀況表

於二零二四年六月三十日

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

	附註	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
<b>流動資產</b>			
孖展融資客戶墊款	35	63,944,096	68,418,208
應收賬款	36	8,320,102	12,167,275
應收融資租賃款	21	7,716,322	8,644,405
售後回租安排的應收款	22	37,017,928	38,923,317
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	24	3,279,794	8,634,537
以攤餘成本計量的債務工具	25	1,183,043	1,762,587
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	26	185,190,483	196,506,316
衍生金融資產	37	2,079,842	2,278,555
買入返售金融資產	27	32,029,721	34,769,832
其他貸款及應收款項	28	5,176,240	4,742,213
客戶貸款	29	511,385	460,278
其他流動資產	38	5,765,459	5,015,395
拆出資金		831,819	330,295
交易所儲備及保證金	31	20,731,501	23,480,478
結算備付金	39	15,900,998	15,584,378
存放中央銀行款項	40	5,399,093	4,252,200
存放同業	40	95,272	111,445
銀行結餘及現金	32	139,804,562	136,387,128
<b>流動資產總額</b>		<b>534,977,660</b>	562,468,842
<b>資產總額</b>		<b>721,414,535</b>	754,586,792

## 簡明綜合財務狀況表

於二零二四年六月三十日

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	附註	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
<b>流動負債</b>			
借款	41	51,588,937	48,942,398
應付短期融資款	42	15,571,430	18,853,059
應付債券	43	79,895,931	78,301,231
應付經紀業務客戶賬款	44	106,526,337	106,538,717
客戶存款	45	5,664,040	4,828,712
合同負債		19,174	19,174
其他應付款項及預計費用	46	19,352,470	22,538,352
租賃負債	16	293,551	319,896
預計負債	47	158,579	193,964
所得稅負債		590,433	851,562
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	48	10,230,741	13,130,414
衍生金融負債	37	1,230,667	1,190,945
賣出回購金融資產款	49	98,965,552	111,617,827
拆入資金	50	17,610,021	12,740,366
向中央銀行借款		89,002	89,568
同業及其他金融機構存放款項		24	—
<b>流動負債總額</b>		<b>407,786,889</b>	420,156,185
<b>流動資產淨額</b>		<b>127,190,771</b>	142,312,657
<b>資產總額減流動負債</b>		<b>313,627,646</b>	334,430,607

## 簡明綜合財務狀況表

於二零二四年六月三十日

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

	附註	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
<b>非流動負債</b>			
長期應付款	51	4,495,965	4,923,274
遞延稅項負債	30	546,508	835,048
客戶存款	45	2,179,109	1,581,203
長期借款	41	18,784,786	24,410,822
應付債券	43	109,554,840	115,619,049
其他應付款項及預計費用	46	1,493,485	1,242,428
賣出回購金融資產款	49	760,127	946,966
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	48	2,016,560	7,322,991
租賃負債	16	709,735	777,269
拆入資金	50	1,894,976	1,971,998
<b>非流動負債總額</b>		<b>142,436,091</b>	159,631,048
<b>負債總額</b>		<b>550,222,980</b>	579,787,233
<b>權益</b>			
股本	52	13,064,200	13,064,200
資本公積		75,877,537	75,764,593
庫存股	53	(717,408)	(414,335)
投資重估儲備	54	240,632	(401,324)
外幣報表折算儲備		(1,063,666)	(903,252)
一般儲備	55	33,830,680	33,798,461
未分配利潤	55	41,795,755	42,335,647
<b>歸屬於本公司股東權益</b>		<b>163,027,730</b>	163,243,990
非控制性權益		8,163,825	11,555,569
<b>權益總額</b>		<b>171,191,555</b>	174,799,559
<b>權益及負債總額</b>		<b>721,414,535</b>	754,586,792

相應附註系該未經審計的簡明綜合財務資料的組成部分。

未經審計的中期簡明綜合財務資料已於2024年8月29日由海通證券股份有限公司董事會批准並許可，並由以下代表簽署：

周杰

董事長

李軍

執行董事及總經理

張信軍

首席財務官

## 簡明綜合權益變動表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	歸屬於本公司股東權益								非控制性 權益	權益 總額
	股本	資本公積 (附註)	庫存股	投資重估 儲備	外幣報表 折算儲備	一般儲備	未分配利潤	合計		
於2024年1月1日(經審計)	13,064,200	75,764,593	(414,335)	(401,324)	(903,252)	33,798,461	42,335,647	163,243,990	11,555,569	174,799,559
本期間利潤	-	-	-	-	-	-	953,097	953,097	276,427	1,229,524
本期間其他全面收益/(損失)	-	-	-	484,060	(160,414)	-	-	323,646	(32,538)	291,108
<b>本期間全面收益/(損失)總額</b>	-	-	-	484,060	(160,414)	-	953,097	1,276,743	243,889	1,520,632
購買子公司少數股東權益(附註60)	-	115,658	-	-	-	-	-	115,658	(3,048,320)	(2,932,662)
子公司發行的其他權益工具	-	(2,714)	-	-	-	-	-	(2,714)	1,499,521	1,496,807
劃撥至一般儲備	-	-	-	-	-	32,219	(32,219)	-	-	-
確認為分派的現金股利(附註59)	-	-	-	-	-	-	(1,298,713)	(1,298,713)	-	(1,298,713)
向非控制性權益方和其他權益工具 持有者分派股利	-	-	-	-	-	-	-	-	(119,808)	(119,808)
回購庫存股	-	-	(303,073)	-	-	-	-	(303,073)	-	(303,073)
子公司贖回其他權益工具	-	-	-	-	-	-	-	-	(1,970,000)	(1,970,000)
以公允價值計量且其變動計入 其他全面收益的權益工具處置	-	-	-	157,896	-	-	(157,896)	-	-	-
非控制性權益變動	-	-	-	-	-	-	-	-	3,010	3,010
其他	-	-	-	-	-	-	(4,161)	(4,161)	(36)	(4,197)
<b>於2024年6月30日(未經審計)</b>	<b>13,064,200</b>	<b>75,877,537</b>	<b>(717,408)</b>	<b>240,632</b>	<b>(1,063,666)</b>	<b>33,830,680</b>	<b>41,795,755</b>	<b>163,027,730</b>	<b>8,163,825</b>	<b>171,191,555</b>

## 簡明綜合權益變動表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	歸屬於本公司股東權益						合計	非控制性 權益	權益 總額
	股本	資本公積 (附註)	投資 重估儲備	外幣報表 折算儲備	一般儲備	未分配利潤			
於2023年1月1日(經審計)	13,064,200	75,007,559	(624,143)	(993,170)	31,438,374	46,699,137	164,591,957	13,030,101	177,622,058
本期間利潤	-	-	-	-	-	3,829,635	3,829,635	95,097	3,924,732
本期間其他全面收益	-	-	324,714	227,264	-	-	551,978	243,582	795,560
<b>本期間全面收益總額</b>	-	-	324,714	227,264	-	3,829,635	4,381,613	338,679	4,720,292
子公司供股配發的股份	-	801,557	-	-	-	-	801,557	(738,821)	62,736
子公司發行的其他權益工具	-	-	-	-	-	-	-	480,000	480,000
劃撥至一般儲備	-	-	-	-	52,958	(52,958)	-	-	-
確認為分派的現金股利(附註59)	-	-	-	-	-	(2,743,482)	(2,743,482)	-	(2,743,482)
向非控制性權益方和其他權益工具持有者分派股利	-	-	-	-	-	-	-	(278,200)	(278,200)
子公司股份支付	-	543	-	-	-	-	543	4,755	5,298
以公允價值計量且其變動計入其他全面 收益的權益工具處置	-	-	34,235	-	-	(34,235)	-	-	-
非控制性權益變動	-	-	-	-	-	-	-	1,566	1,566
其他	-	-	-	-	-	(12,553)	(12,553)	10,817	(1,736)
<b>於2023年6月30日(未審計)</b>	13,064,200	75,809,659	(265,194)	(765,906)	31,491,332	47,685,544	167,019,635	12,848,897	179,868,532

附註：本集團的資本公積主要為(i)發行本公司股份所產生的股份溢價；(ii)所支付或收到對價與所佔資產淨值(因集團對子公司未喪失控制權的權益變動)份額之間的差額。

相應附註系該未經審計的簡明綜合財務資料的組成部分。



## 簡明綜合現金流量表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
<b>經營活動</b>		
所得稅前利潤	1,905,876	5,251,724
就下列各項作出調整：		
利息支出	7,182,697	7,918,051
攤分聯營合營企業業績	71,235	(479,771)
折舊及攤銷費用	886,463	839,209
預期信用損失模式下的減值損失	870,126	1,203,824
其他資產減值損失計提	15,648	9,878
子公司權益結算的股份支付確認的費用	—	5,298
處置物業、設備及其它無形資產的損失	878	7,677
匯兌損失淨額	65,963	205,420
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的利息收入	(752,024)	(871,432)
以攤餘成本計量的債務工具的利息收入	(130,569)	(115,835)
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的 權益工具產生的股利收入	(333,353)	(67,285)
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的 債務工具產生的已實現收益淨額	(194,261)	(135,550)
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產 產生的已實現收益淨額	(92)	(69,281)
以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具的公允價值變動	470,978	(48,517)
其他	(19,818)	—
<b>營運資金變動前的營運現金流量</b>	<b>10,039,747</b>	<b>13,653,410</b>

## 簡明綜合現金流量表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的減少／(增加)	7,929,212	(1,764,185)
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產和衍生金融資產的減少	9,514,823	1,898,180
買入返售金融資產減少／(增加)	3,890,238	(8,513,832)
其他貸款及應收款(增加)／減少	(99,886)	295,092
客戶貸款減少／(增加)	4,048	(1,041,152)
客戶墊款減少	4,352,119	1,094,424
應收賬款及其他流動資產減少	3,275,355	732,451
拆出資金(增加)／減少	(501,474)	209,258
交易所保證金減少	2,757,312	1,197,090
存放中央銀行款項增加	(12,338)	(957)
受限制的銀行存款減少	341,133	142,643
代客戶持有的現金減少／(增加)	6,441,273	(2,564,217)
應付經紀業務客戶款項及其他應付款項及預計費用(減少)／增加	(4,661,826)	4,357,816
客戶存款增加	1,433,234	143,888
合同負債增加	-	81,727
預計負債(減少)／增加	(35,385)	7,792
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債以及衍生金融負債的減少	(8,166,382)	(1,333,813)
賣出回購金融資產款減少	(12,320,976)	(18,627,712)
拆入資金增加	4,809,257	2,746,791
向中央銀行借款減少	(566)	(1,543,939)
同業存款增加	24	34,911
來自經營業務的現金	28,988,942	(8,794,334)
已付所得稅淨額	(578,119)	(2,219,039)
已付利息	(2,719,021)	(2,293,038)
來自／(用於)經營活動的現金淨額	25,691,802	(13,306,411)

## 簡明綜合現金流量表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
<b>投資活動</b>		
從聯營企業和其他投資收到的股利	341,353	1,462
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的 權益工具收到的股利	333,353	67,285
收到以攤餘成本計量的債務工具及以公允價值計量且 其變動計入其他全面收益的債務工具的利息收入	882,593	991,078
購買物業、設備及其他無形資產	(301,618)	(344,626)
處置物業及設備所得款項	116,543	2,850
注資聯營企業和合營企業	–	(135,000)
部分處置聯營企業的所得款項	143,135	42,251
購買以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具的現金流出	(2,809,969)	(1,722,347)
購買以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的現金流出	(26,712,620)	(9,992,525)
購買以攤餘成本計量的債務工具的現金流出	(357,284)	(1,770,546)
購買以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產的現金流出	(30,630)	(1,059,768)
處置收回以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具款項	5,596	516,237
處置收回以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具款項	31,573,525	17,514,961
處置或到期收回以攤餘成本計量的債務工具款項	2,471,560	355,999
處置收回以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產款項	127,017	931,613
<b>來自投資活動的現金淨額</b>	<b>5,782,554</b>	<b>5,398,924</b>

## 簡明綜合現金流量表

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
<b>籌資活動</b>		
借款、債券支付的利息及已付股利	(5,506,269)	(5,400,176)
吸收少數股東投資	3,010	64,302
少數股東收回投資款項	(2,932,662)	–
籌集借款所得款項	39,645,189	42,526,736
永續債支付的利息	(86,642)	(60,279)
短期融資券及非可轉換債券等發行費用	(79,916)	(90,033)
償還租賃負債的款項	(220,108)	(183,106)
償還借款、短期融資券及非可轉換債券等支付的款項	(95,602,337)	(94,810,967)
發行短期融資券及非可轉換債券等所得款項	45,309,376	68,877,961
回購庫存股	(303,073)	–
<b>(用於)／來自籌資活動的現金淨額</b>	<b>(19,773,432)</b>	10,924,438
現金及現金等價物增加淨額	11,700,924	3,016,951
外匯變動影響	(15,278)	772,762
期初的現金及現金等價物	57,541,626	67,530,100
<b>期末的現金及現金等價物 (附註33)</b>	<b>69,227,272</b>	71,319,813

相應附註系該未經審計的簡明綜合財務資料的組成部分。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 1 一般資料

海通證券股份有限公司「本公司」前身為成立於1988年的上海海通證券公司，於1994年9月經中國人民銀行批准，改制為全國性的有限責任公司，更名為「海通證券有限公司」。2001年12月，本公司經中國證券監督管理委員會（「中國證監會」）批准，進一步改制為股份有限公司。2002年1月，本公司由海通證券有限公司更名為「海通證券股份有限公司」。2007年6月，本公司與原上海市都市農商社股份有限公司的合併事宜獲中國證監會批准，同年7月在上交所上市，上市後，名稱變更為「海通證券」。2012年4月27日公司H股在香港聯合交易所有限公司（以下簡稱「香港聯交所」）主板掛牌上市。

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

本公司經營範圍為：證券經紀；證券自營；證券承銷與保薦；證券投資諮詢；與證券交易、證券投資活動有關的財務顧問；直接投資業務；證券投資基金代銷；為期貨公司提供中間介紹業務；融資融券業務；代銷金融產品；股票期權做市業務；中國證監會批准的其他業務，本公司可以對外投資設立子公司從事金融產品等投資業務（依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動）。

簡明綜合財務資料乃以人民幣列示，而人民幣為本公司的功能貨幣。

### 2 編製基礎及會計政策

本簡明綜合財務資料已根據國際會計準則第34號「中期財務報告」以及香港證券交易所證券上市規則以及《香港聯合交易所有限公司證券上市規則》附錄16要求的披露編製。

除某些金融工具以公允價值計量外，本中期簡明綜合財務資料是以歷史成本作為計量基礎。

本集團採用持續經營基礎，編製其簡明財務資料。

簡明綜合財務資料並不包括年度財務報表中通常包含的所有附註。本中期簡明綜合財務資料應與按照國際會計準則理事會頒佈的國際財務報告準則編製的2023年度財務報表及本公司於本報告期的公開披露一併閱覽。

除了因應用新《國際財務報告準則》和《國際財務報告準則》修訂而新增的會計政策外，2024年6月30日六個月簡明合併財務報表中使用的會計政策和計算方法與集團截至2023年12月31日的年度財務報表中所述的會計政策和計算方法相同。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 2 編製基礎及會計政策（續）

#### 《國際財務報告準則》修訂的應用

在本期中，集團首次應用了國際會計準則理事會發佈的以下《國際財務報告準則》修訂，這些修訂對於集團自2024年1月1日或之後開始的會計年度編製簡明合併財務報表具有強制性效力：

《國際財務報告準則》第16號修訂	售後回租中的租賃負債
《國際會計準則》第1號修訂	負債作為流動或非流動的分類
《國際會計準則》第1號修訂	具有契約的非流動負債
《國際會計準則》第7號和 《國際財務報告準則》第7號修訂	供應商融資安排

在本期中應用《國際財務報告準則》修訂對集團當前和前期財務狀況、經營成果以及本簡明合併財務報表中的披露沒有產生重大影響。

#### 關鍵會計估計及判斷

本集團持續評估基於歷史經驗和其他因素（包括對未來事件的合理預期）所採用的重大會計估計和判斷。具有導致資產和負債賬面金額重大調整的重大風險會計估計和關鍵假設，與編製截至2023年12月31日止年度財務報表時採用的政策一致。

### 3 分部報告

為作出資源配置及評估分部表現，向本公司董事會（作為首席營運決策者）報告的信息主要集中於由本集團銷售要求、內部報告制度為依據確定經營分部，以經營分部為基礎確定報告分部。經營分部是指公司內同時滿足下列條件的組成部分：(1)該組成部分能夠在日常活動中產生收入、發生費用；(2)本公司董事會能定期評價該組成部分的經營成果，以決定向其配置資源、評價其業績；(3)公司能夠取得該組成部分的財務狀況、經營成果和現金流量等有關會計信息。如果兩個或多個經營分部存在相似經濟特徵且同時具有相同或相似性的經營方式，可以合併為一個經營分部。根據公司戰略規劃及內部管理要求，公司確定六大經營分部：財富管理、投資銀行、資產管理、交易及機構、融資租賃及其他。公司報告分部劃分與經營分部一致。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 3 分部報告 (續)

分部信息按照各分部向本公司董事會報告時所採用的會計政策和計量標準進行計量，這些標準與編製簡明綜合財務資料時的會計和計量標準一致。

具體來說，本集團經營分部如下：

- (1) 財富管理分部：主要向零售及高淨值客戶提供綜合的金融服務和投資解決方案，提供的服務包括證券及期貨經紀服務、投資顧問服務、財富管理服務、以及向客戶提供融資融券、股票質押等融資類業務服務。
- (2) 投資銀行分部：主要向企業和政府客戶提供股票資本市場和債券資本市場融資活動的保薦和承銷服務，為企業客戶的收購兼併、資產重組等提供財務顧問服務，同時提供新三板服務。
- (3) 資產管理分部：主要向個人、企業和機構客戶提供綜合的多元產品投資管理服務，提供的服務包括資產管理、基金管理和股權投資服務。
- (4) 交易及機構分部：主要向全球機構投資者提供全球主要金融市場的股票銷售交易、大宗經紀、股票借貸、全球主要市場的股票研究。亦為世界各地主要交易所的固定收益產品、貨幣及商品產品、期貨及期權、及衍生品提供市場製作服務。
- (5) 融資租賃分部：主要向個人、企業和政府提供創新型金融服務解決方案，提供的服務包括融資租賃、經營租賃、保理、委託貸款和相關諮詢服務。
- (6) 其他分部：為機構客戶提供其他綜合性金融及信息服務，提供的服務包括倉單服務等。

分部利潤／虧損指各分部在未經分配所得稅支出前所賺得的利潤／所錄得的虧損。該等計算乃為資源配置及評估業績而報告予首席營運決策者。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 3 分部報告 (續)

#### 經營和可報告分部

截至2024年6月30日止六個月期間 (未經審計)

	財富管理 分部	投資銀行 分部	資產管理 分部	交易及機構 分部	融資租賃 分部	其他分部	合計
<b>分部收益及業績</b>							
收入	6,175,677	1,208,169	1,061,259	3,948,363	3,352,480	(59,652)	15,686,296
其他收入及收益	72,892	41,079	41,256	245,082	687,821	818,434	1,906,564
分部收入	6,248,569	1,249,248	1,102,515	4,193,445	4,040,301	758,782	17,592,860
分部支出	(4,931,456)	(1,187,263)	(682,822)	(4,867,865)	(3,085,522)	(860,821)	(15,615,749)
分部業績	1,317,113	61,985	419,693	(674,420)	954,779	(102,039)	1,977,111
應佔聯營企業業績	-	-	214,844	(286,079)	-	-	(71,235)
所得稅前利潤	1,317,113	61,985	634,537	(960,499)	954,779	(102,039)	1,905,876

截至2023年6月30日止六個月期間 (未經審計)

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

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 3 分部報告 (續)

#### 經營和可報告分部 (續)

於2024年6月30日 (未經審計)

	財富管理 分部	投資銀行 分部	資產管理 分部	交易及機構 分部	融資租賃 分部	其他分部	合計
<b>分部資產及負債</b>							
分部資產	207,769,034	8,224,782	12,590,488	364,481,643	114,327,199	3,158,643	710,551,789
權益法項下投資	-	-	2,279,776	5,280,796	-	-	7,560,572
遞延稅項資產							3,302,174
<b>集團資產總額</b>							<b>721,414,535</b>
分部負債	172,157,707	2,878,445	5,253,681	270,923,288	97,677,421	785,930	549,676,472
遞延稅項負債							546,508
<b>集團負債總額</b>							<b>550,222,980</b>

於2023年12月31日 (經審計)

	財富管理 分部	投資銀行 分部	資產管理 分部	交易及機構 分部	融資租賃 分部	其他分部	合計
<b>分部資產及負債</b>							
分部資產	212,754,874	10,826,870	13,432,440	377,284,003	125,071,640	2,914,225	742,284,052
權益法項下投資	-	-	2,367,565	5,748,061	-	-	8,115,626
遞延稅項資產							4,187,114
<b>集團資產總額</b>							<b>754,586,792</b>
分部負債	171,369,688	4,600,060	5,993,742	290,485,537	105,565,765	937,393	578,952,185
遞延稅項負債							835,048
<b>集團負債總額</b>							<b>579,787,233</b>

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 4 佣金及手續費收入

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
證券及期貨經紀業務收入	3,083,600	3,438,879
承銷費及保薦費收入	751,004	1,827,800
資產管理費收入(含基金管理費收入)	871,475	959,640
財務諮詢顧問費收入	197,368	188,618
其他	38,309	47,126
	<b>4,941,756</b>	<b>6,462,063</b>

與本集團取得佣金及手續費收入相關的主要業務類型如下：

#### (1) 經紀業務收入

本集團從事代理買賣證券及期貨經紀業務在交易完成時點按照成交金額及約定費率確認收入；本集團從事金融產品代銷業務在代銷完成時點按照代銷規模及約定費率確認收入。

#### (2) 投資銀行業務收入

本集團從事證券和債券承銷業務在承銷合同中約定的履約義務完成時點按照合同或協議約定的金額確認收入；本集團從事證券發行上市保薦業務和企業客戶財務顧問服務，本集團認為作為保薦人或企業顧問的特定合約所承諾的所有服務均相互依存及相互關聯，因此以單一履約義務確認收入。

#### (3) 資產管理業務收入

本集團接受客戶委託負責經營管理受託資產，由於在本集團履約的同時委託客戶即取得並消耗本集團履約所帶來的經濟利益，因此本集團在履約義務履行期間內根據受託管理資產規模及約定費率確認收入；本集團提供資產管理業務根據受託資產業績狀況可能收取額外的業績報酬，本集團在業績評價週期期末，在與業績報酬相關的不確定性消除、已確認的累計收入金額很可能不會發生重大轉回時，按照合同或協議約定的計算方法確認為當期收入。

截至2024年6月30日，本集團與客戶簽訂的大部分合同的原始預期存續期小於一年。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 5 利息收入

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
售後回租安排的應收款利息收入	2,528,571	2,831,408
客戶墊款的利息收入	1,821,577	2,116,168
銀行利息收入	1,872,960	1,977,917
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具和 以攤餘成本計量的債務工具利息收入	882,593	987,267
買入返售金融資產利息收入	719,700	931,069
貸款及應收款項利息收入	326,271	469,824
其他利息收入	36,328	6,876
	<b>8,188,000</b>	9,320,529
融資租賃收入	<b>765,501</b>	781,925

### 6 投資收入及收益 (淨額)

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產／ 負債產生的已實現收益淨額	1,714,585	3,031,855
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具產生的已實現 收益淨額	194,261	135,550
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具產生的股利收入	333,353	67,285
以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具的公允價值變動	(470,978)	48,517
其他	19,818	3,635
	<b>1,791,039</b>	3,286,842

### 7 其他收入及收益

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
大宗商品貿易收入	816,224	4,577,360
政府補助	490,529	729,330
服務收入	127,555	383,249
經營租賃的租金收入	302,345	281,513
投資物業的租金收入	7,096	33,190
匯兌損失	(65,963)	(205,420)
其他	228,778	376,847
	<b>1,906,564</b>	6,176,069



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 8 佣金及手續費支出

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
證券及期貨經紀業務支出	1,316,870	1,378,266
經紀人佣金支出	76,052	88,687
證券承銷、財務顧問等服務支出	44,624	54,541
	<b>1,437,546</b>	1,521,494

### 9 利息支出

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
利息支出源自：		
— 借款	1,631,464	2,088,013
— 銀行及其他金融機構拆入資金	82,587	92,575
— 賣出回購金融資產款	1,307,753	1,406,250
— 應付經紀業務客戶款項	237,161	305,090
— 轉融通支付於中國證券金融股份有限公司（「證金公司」）	178,342	172,695
— 應付債券和應付短期融資款	3,375,099	3,513,367
— 租賃負債	20,752	23,633
— 其他	349,539	316,428
	<b>7,182,697</b>	7,918,051

### 10 折舊和攤銷費用

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
物業及設備折舊	514,105	489,477
使用權資產折舊	210,009	208,855
投資物業折舊	39,246	29,791
其他無形資產攤銷	123,103	111,086
	<b>886,463</b>	839,209



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 11 預期信用損失模式下的減值損失

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
預期信用損失源自：		
— 應收融資租賃款	226,706	145,668
— 售後回租安排的應收款	277,186	459,552
— 孖展融資客戶墊款	109,944	287,492
— 買入返售金融資產	56,474	54,392
— 其他貸款及應收款項	93,103	235,336
— 以攤餘成本計量的債務工具	(7,335)	7,283
— 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	16,506	(40,469)
— 客戶貸款	(3,606)	(362)
— 其他金融資產及其他項目	101,148	54,932
	<b>870,126</b>	<b>1,203,824</b>

### 12 其他支出

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
大宗商品貿易成本	810,890	4,565,500
管理費用	1,209,272	1,368,570
稅金及附加	115,478	129,064
其他	49,520	48,872
	<b>2,185,160</b>	<b>6,112,006</b>

### 13 所得稅費用

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
當期稅項	369,622	1,101,737
遞延稅項	306,730	225,255
	<b>676,352</b>	<b>1,326,992</b>

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

本集團在香港經營的子公司適用香港利得稅。香港利得稅是就在香港產生的估計應課稅溢利按稅率16.5%計算。

其他司法權區的稅項是根據有關司法權區的現行稅率計算。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 13 所得稅費用(續)

2021年12月，經濟合作與發展組織(「經合組織」)發佈了全球最低企業所得稅框架立法模板(「支柱二」)。根據支柱二立法規則，有效稅率低於15%的低稅轄區可能會有補足稅影響。本集團境外經營機構所在轄區中部分轄區已於報告期內實施支柱二立法，上述轄區立法對本集團截至2024年6月30日止六個月的財務狀況及經營成果無重大影響。

本集團已適用豁免確認及披露與支柱二所得稅相關的遞延所得稅資產與負債相關信息的事實。

### 14 每股收益

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
用以計算每股基本收益的收益：		
本公司股東應佔期間利潤	953,097	3,829,635
用以計算每股稀釋收益的收益	953,097	3,829,635
用以計算基本／稀釋每股收益的股份數目：		
已發行股數(千股)	13,064,200	13,064,200
庫存股的影響	(60,906)	—
普通股加權平均	13,003,294	13,064,200
基本每股收益(以每股人民幣元列示)	0.07	0.29
稀釋每股收益(以每股人民幣元列示)	0.07	0.29

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 15 物業及設備

	土地 及建築物	租賃物 改良	電子設備	交通運輸 設備	傢俱、 裝置及設備	在建工程	總計
(未經審計)							
<b>成本</b>							
於2024年1月1日	11,565,483	1,096,653	2,091,402	6,874,074	327,662	211,784	22,167,058
增加	48,863	22,377	45,812	3,643	3,638	75,002	199,335
處置	-	(41,282)	(46,152)	(7,069)	(24,538)	-	(119,041)
轉移	-	23,416	1,732	-	957	(26,105)	-
匯兌差額	3,262	(2,091)	(752)	41,878	(975)	-	41,322
於2024年6月30日	11,617,608	1,099,073	2,092,042	6,912,526	306,744	260,681	22,288,674
<b>累計折舊</b>							
於2024年1月1日	1,547,476	800,349	1,407,694	1,474,652	206,590	-	5,436,761
增加	159,010	57,562	143,455	138,149	15,929	-	514,105
處置	-	(31,409)	(43,531)	(6,739)	(23,493)	-	(105,172)
匯兌差額	592	(2,015)	(527)	8,768	(965)	-	5,853
於2024年6月30日	1,707,078	824,487	1,507,091	1,614,830	198,061	-	5,851,547
<b>減值損失備抵</b>							
於2024年1月1日	30,382	-	4,490	51,391	708	-	86,971
匯兌差額	-	-	32	320	5	-	357
於2024年6月30日	30,382	-	4,522	51,711	713	-	87,328
<b>賬面價值</b>							
於2024年6月30日(未經審計)	9,880,148	274,586	580,429	5,245,985	107,970	260,681	16,349,799
於2023年12月31日(經審計)	9,987,625	296,304	679,218	5,348,031	120,364	211,784	16,643,326

本集團交通運輸工具中包括用於開展經營租賃業務的飛機。於2024年6月30日，其淨值為人民幣5,074,624千元(2023年12月31日：人民幣5,156,559千元)。

截至2024年6月30日，本集團建築物中金額為人民幣26,459千元的房產產權證有待取得(2023年12月31日：人民幣27,059千元)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 16 使用權資產及租賃負債

#### 使用權資產

	租賃土地 及房屋	電子設備	交通運輸 設備	其他	總計
(未經審計)					
<b>成本</b>					
於2024年1月1日	2,894,689	804	2,180	2,187	2,899,860
期內添置	115,531	289	64	1,072	116,956
期內處置	(182,009)	-	(133)	(1,239)	(183,381)
匯兌差額	(4,532)	(21)	(54)	44	(4,563)
於2024年6月30日	2,823,679	1,072	2,057	2,064	2,828,872
<b>累計折舊</b>					
於2024年1月1日	1,133,301	573	1,180	1,639	1,136,693
期內折舊	209,442	87	240	240	210,009
期內處置	(170,533)	-	(130)	(1,239)	(171,902)
匯兌差額	(2,950)	(15)	(31)	21	(2,975)
於2024年6月30日	1,169,260	645	1,259	661	1,171,825
<b>賬面價值</b>					
於2024年6月30日(未經審計)	1,654,419	427	798	1,403	1,657,047
於2023年12月31日(經審計)	1,761,388	231	1,000	548	1,763,167

#### 租賃負債

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
1年以內	293,551	319,896
1年至2年	165,047	220,130
2年至5年	351,351	355,289
5年以上	193,337	201,850
	1,003,286	1,097,165
於流動負債項下顯示的12個月內到期結算的金額	293,551	319,896
於非流動負債項下顯示的12個月以後到期結算的金額	709,735	777,269

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 16 使用權資產及租賃負債 (續)

#### 租賃負債 (續)

本集團租賃各種土地和建築物，電子設備，交通運輸設備及其他用於其運營。大多數租賃合同簽訂的租賃期限為1年到40年。租賃條款是根據個別情況協商確定的，其中包含各種不同的條款和條件。本集團在確定租賃期限和評估不可撤銷的期限時，採用合同的定義並確定合同可強制執行的期限。

截至2024年6月30日止六個月期間，租賃金額的總現金流出為人民幣239,747千元(截至2023年6月30日止六個月期間：人民幣227,310千元)。

截至2024年6月30日止六個月期間，租賃負債的利息支出為人民幣20,752千元(截至2023年6月30日止六個月期間：人民幣23,633千元)。

於2024年6月30日，租賃協議除出租人持有的租賃資產中的抵押權益外，不得簽訂任何其他契約。租賃資產不得用作借貸擔保。

於2024年6月30日，本集團未訂立任何尚未開始的重大租賃。

### 17 投資物業

	房屋、建築物
<b>成本</b>	
於2024年1月1日	2,773,328
本期處置	(106,048)
匯兌差額	13,099
於2024年6月30日	2,680,379
<b>累計折舊</b>	
於2024年1月1日	132,334
期內折舊	39,246
期內處置	(4,768)
匯兌差額	2,091
於2024年6月30日	168,903
<b>減值損失備抵</b>	
於2024年1月1日	5,153
本期計提	3,742
於2024年6月30日	8,895
<b>賬面價值</b>	
於2024年6月30日(未經審計)	2,502,581
於2023年12月31日(經審計)	2,635,841

於2024年6月30日，本集團投資物業的公允價值為人民幣2,714,092千元(2023年12月31日，人民幣3,315,687千元)，系參考相同或相似地點及狀況的類似物業的近期市價釐定公允價值。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 18 商譽

被投資單位名稱	2023年 12月31日 (經審計)	匯兌調整	2024年 6月30日 (未經審計)
海通期貨股份有限公司	5,896	-	5,896
海通國際證券集團有限公司	711,365	5,071	716,436
海通恆信金融集團有限公司	2,289,746	-	2,289,746
Haitong International Holdings (UK) Limited	133,979	955	134,934
Haitong Bank, S.A.	1,056,968	7,534	1,064,502
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	5,006	36	5,042
	4,202,960	13,596	4,216,556
減：減值準備			
Haitong Bank, S.A.	(453,110)	(3,230)	(456,340)
海通國際證券集團有限公司	(142,276)	(1,014)	(143,290)
Haitong International Holdings (UK) Limited	(133,979)	(955)	(134,934)
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	(5,006)	(36)	(5,042)
	3,468,589	8,361	3,476,950

### 19 其他無形資產

	交易席位費	電腦軟件	其他	在建工程	總計
(未經審計)					
<b>成本</b>					
於2024年1月1日	222,717	2,211,996	105,238	28,191	2,568,142
期內添置	-	74,784	4,254	5,017	84,055
期內處置	-	(9,755)	-	-	(9,755)
期內轉移	-	5,349	-	(5,349)	-
匯兌差額	50	(2,472)	192	(893)	(3,123)
於2024年6月30日	222,767	2,279,902	109,684	26,966	2,639,319
<b>累計攤銷</b>					
於2024年1月1日	115,401	1,672,733	88,563	-	1,876,697
期內攤銷	-	122,256	847	-	123,103
期內處置	-	(7,559)	-	-	(7,559)
匯兌差額	-	(2,327)	235	-	(2,092)
於2024年6月30日	115,401	1,785,103	89,645	-	1,990,149
<b>賬面價值</b>					
於2024年6月30日(未經審計)	107,366	494,799	20,039	26,966	649,170
於2023年12月31日(經審計)	107,316	539,263	16,675	28,191	691,445

交易席位費主要包括上交所、深交所、香港聯交所及香港期貨交易所有限公司的交易席位，本集團通過交易席位可以於該等交易所或通過該等交易所進行證券及期貨合約買賣。本集團將交易席位費視作一項使用壽命不確定的無形資產。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 20 權益法項下投資

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
於聯營公司的非上市投資成本	5,060,730	5,203,865
攤分收購後利潤及其他全面收益，並扣除已收的股利	2,499,842	2,911,761
總計	<b>7,560,572</b>	8,115,626

採用權益法核算的投資明細：

富國基金管理有限公司為對於本集團單體重要的聯營企業，主要從事基金管理和基金銷售服務，本集團持有富國基金管理有限公司27.775%的股份。其財務信息概述載列如下：

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
資產總額	13,368,999	13,770,413
負債總額	5,161,075	5,246,417
資產淨值	<b>8,207,924</b>	8,523,996

	截至2024年 6月30日 止六個月期間 (未經審計)	截至2023年 6月30日 止六個月期間 (未經審計)
營業收入	2,918,321	3,648,084
淨利潤	773,517	1,065,400
綜合全面收益	<b>775,928</b>	1,076,152

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 21 應收融資租賃款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
最低租賃收款額		
– 1年以內	9,362,733	10,513,721
– 1年至2年	5,586,615	5,835,744
– 2年至3年	2,782,824	3,275,980
– 3年至4年	1,287,029	1,513,911
– 4年至5年	712,530	779,672
– 5年以上	1,720,380	1,967,554
應收融資租賃款總額	21,452,111	23,886,582
減：未實現融資收益	(2,746,505)	(3,077,166)
應收融資租賃款現值	18,705,606	20,809,416
減：預期信用損失	(831,523)	(916,971)
應收融資租賃款賬面價值	17,874,083	19,892,445
最低租賃收款額的現值		
– 1年以內	8,139,993	9,131,659
– 1年至2年	4,842,670	5,037,427
– 2年至3年	2,408,637	2,844,894
– 3年至4年	1,136,548	1,325,698
– 4年至5年	633,930	694,776
– 5年以上	1,543,828	1,774,962
合計	18,705,606	20,809,416
就報告目的分析如下：		
流動資產	7,716,322	8,644,405
非流動資產	10,157,761	11,248,040
總計	17,874,083	19,892,445

本集團訂立融資租賃安排，租賃資產為交通物流、先進製造等行業之機器設備。本集團絕大部分融資租賃以人民幣計價。簽訂的融資租賃期限為一至十二年。

2024年6月30日，本集團應收融資租賃款淨額計人民幣308,465千元（2023年12月31日：人民幣618,676千元）質押用於借款。

應收融資租賃款之浮動利率參照貸款市場報價利率厘定並定期進行調整。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 21 應收融資租賃款 (續)

預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	358,787	380,220	177,964	916,971
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失(轉回)/確認	(78,431)	145,965	159,172	226,706
— 本期核銷	—	—	(268,063)	(268,063)
— 階段間的轉換	53,796	(140,374)	86,578	—
— 收回以前年度核銷款項	—	—	59,791	59,791
— 其他終止確認情況	—	—	(103,882)	(103,882)
於2024年6月30日	334,152	385,811	111,560	831,523

最低租賃收款額現值分析

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	17,245,529	1,305,859	154,218	18,705,606
於2023年12月31日(經審計)	19,138,399	1,394,427	276,590	20,809,416

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 22 售後回租安排的應收款

下表列舉了售後回租安排的應收款的總額和淨額：

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
— 1年以內	41,663,144	43,518,245
— 1年至2年	23,607,944	26,126,129
— 2年至3年	11,379,515	12,174,279
— 3年至4年	2,963,947	4,641,182
— 4年至5年	1,077,929	1,329,793
— 5年以上	1,265,726	1,076,326
售後回租安排的應收款總額	81,958,205	88,865,954
減：利息調整	(6,761,329)	(7,475,895)
售後回租安排的應收款現值	75,196,876	81,390,059
減：預期信用損失	(2,095,115)	(1,873,554)
售後回租安排的應收款賬面價值	73,101,761	79,516,505
售後回租安排的應收款現值		
— 1年以內	38,226,048	39,882,354
— 1年至2年	21,660,353	23,924,378
— 2年至3年	10,440,736	11,143,670
— 3年至4年	2,719,429	4,245,686
— 4年至5年	989,003	1,214,360
— 5年以上	1,161,307	979,611
總計	75,196,876	81,390,059
就報告目的分析如下：		
流動資產	37,017,928	38,923,317
非流動資產	36,083,833	40,593,188
總計	73,101,761	79,516,505

於2024年6月30日，本集團售後回租安排的應收款淨額計人民幣813,180千元(2023年12月31日：人民幣1,420,613千元)質押用於借款。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 22 售後回租安排的應收款 (續)

預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	1,003,945	658,069	211,540	1,873,554
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失(轉回)/確認	(77,346)	188,504	166,028	277,186
— 本期核銷	—	—	(47,302)	(47,302)
— 階段間的轉換	129,622	(133,550)	3,928	—
— 收回以前年度核銷款項	—	—	2,191	2,191
— 其他終止確認情況	—	—	(10,516)	(10,516)
— 外匯變動及其他	2	—	—	2
於2024年6月30日	1,056,223	713,023	325,869	2,095,115

售後回租安排的應收款現值分析

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	71,701,979	2,944,140	550,757	75,196,876
於2023年12月31日(經審計)	77,943,627	2,953,792	492,640	81,390,059

### 23 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
其他權益投資(附註i)	10,416,426	8,010,844
分析如下：		
— 上市股權證券	9,572,231	7,107,446
— 非上市股權證券	844,195	903,398
	10,416,426	8,010,844

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 23 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具 (續)

附註：

- (i) 於2024年6月30日，以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具包括本集團持有的股票及非交易性股權。以上權益工具並非持作交易目的，本集團將該等權益工具投資指定為以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具投資。

由於戰略調整，本集團處置了若干以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具，人民幣157,896千元(截至2023年6月30日期間的相應損失為人民幣34,235千元)的相應損失自投資重估儲備重新分類至未分配利潤。

- (ii) 2024年6月30日，以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具有承諾條件的金融資產，系用於融出證券業務，其公允價值為人民幣1,244,426千元(2023年12月31日：人民幣1,204,014千元，系用於融出證券業務和轉融通業務)。

以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具投資的股利收入披露於附註6。

### 24 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
未上市債券投資	21,857,669	28,389,099
上市債券投資	35,355,578	32,921,648
	<b>57,213,247</b>	61,310,747
就報告目的分析如下：		
流動資產	3,279,794	8,634,537
非流動資產	53,933,453	52,676,210
	<b>57,213,247</b>	61,310,747
預期信用損失	<b>(145,795)</b>	(134,660)

於2024年6月30日，以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具有承諾條件的金融資產，系用於賣出回購業務、債券借貸業務、轉融通業務、衍生業務質押和向葡萄牙央行融資等，其公允價值為人民幣43,387百萬元(2023年12月31日：人民幣48,325百萬元)。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 24 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具 (續)

預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	69,370	47,710	17,580	134,660
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失確認／(轉回)	23,534	(3,989)	(3,039)	16,506
— 階段間的轉換	(157)	157	—	—
— 外匯變動及其他	(2,543)	8	(2,836)	(5,371)
於2024年6月30日	90,204	43,886	11,705	145,795

下表詳細說明了以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

賬面總額：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	54,786,685	1,489,987	39,410	56,316,082
於2023年12月31日(經審計)	58,922,530	1,983,749	42,567	60,948,846

### 25 以攤餘成本計量的債務工具

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
債務證券	4,738,072	6,832,530
減：預期信用損失	(25,078)	(34,750)
	4,712,994	6,797,780
就報告目的分析如下：		
流動資產	1,183,043	1,762,587
非流動資產	3,529,951	5,035,193
	4,712,994	6,797,780

於2024年6月30日，以攤餘成本計量的債務工具有承諾條件的金融資產，主要系用於賣出回購、向葡萄牙央行融資等，其賬面價值為人民幣3,066百萬元(2023年12月31日：人民幣4,954百萬元)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 25 以攤餘成本計量的債務工具 (續)

預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	23,376	255	11,119	34,750
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失轉回	(5,462)	(255)	(1,618)	(7,335)
— 外匯變動及其他	(1,280)	—	(1,057)	(2,337)
於2024年6月30日	16,634	—	8,444	25,078

下表詳細說明了以攤餘成本計量的債務工具的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

賬面總額：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日 (未經審計)	4,720,145	—	17,927	4,738,072
於2023年12月31日 (經審計)	6,745,086	66,139	21,305	6,832,530

### 26 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
債務證券	113,792,720	124,194,489
股權證券	23,848,589	35,718,418
基金	60,908,007	49,115,360
其他	12,848,969	12,244,823
	211,398,285	221,273,090
就報告目的分析如下：		
流動資產	185,190,483	196,506,316
非流動資產	26,207,802	24,766,774
	211,398,285	221,273,090

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 26 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產(續)

附註：

- (i) 於2024年6月30日，以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產中包括作為賣出回購業務、債券借貸業務、轉融通業務、融出證券業務和衍生業務等擔保物的金融資產，其公允價值為人民幣46,243百萬元(2023年12月31日：人民幣64,197百萬元)。
- (ii) 於2024年6月30日，本集團的以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產中約人民幣1,486百萬元(2023年12月31日：人民幣3,494百萬元)為受限制證券，該等證券附有依法必須履行的限制，本集團在指定期限內不得出售該證券。該等金融資產的公允價值已考慮到該證券相關特性，包括出售限制。
- (iii) 與剩餘到期期限超過一年的結構化產品相關的金融資產，由於預計不會先於一年內清償，因此被列為非流動資產。

### 27 買入返售金融資產

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
按抵押品種類劃分：		
股票(註)	22,903,248	26,409,870
債券	10,653,048	11,036,664
減：預期信用損失	(719,776)	(663,302)
	<b>32,836,520</b>	36,783,232
按市場劃分：		
交易所	28,486,241	33,210,608
銀行間市場	5,070,055	4,235,926
減：預期信用損失	(719,776)	(663,302)
	<b>32,836,520</b>	36,783,232
就報告目的分析如下：		
流動資產	32,029,721	34,769,832
非流動資產	806,799	2,013,400
	<b>32,836,520</b>	36,783,232

註：

該以股票為質押物的買入返售金融資產為符合條件的投資者以約定價格向本集團賣出特定證券，並約定在未來某一日期，按照另一約定價格購回。截至2024年6月30日，本集團以上買入返售期限為1年以內為人民幣22,096,035千元(2023年12月31日：人民幣24,384,883千元)，期限為1年以上為人民幣807,213千元(2023年12月31日：人民幣2,024,987千元)。

截至2024年6月30日，買入返售金融資產的擔保物公允價值為人民幣69,363,164千元(截至2023年12月31日：人民幣83,560,426千元)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 27 買入返售金融資產（續）

預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	11,418	21,982	629,902	663,302
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失(轉回)/確認	(4,815)	(6,689)	67,978	56,474
— 階段間的轉換	2,912	(4,170)	1,258	—
於2024年6月30日	9,515	11,123	699,138	719,776

下表詳細說明了買入返售金融資產的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

賬面總額：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	28,902,177	2,820,581	1,833,538	33,556,296
於2023年12月31日(經審計)	31,431,856	4,109,439	1,905,239	37,446,534

### 28 其他貸款及應收款項

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
委託貸款及其他	384,141	425,919
其他貸款及應收款項	6,242,537	6,100,873
賬面總額	6,626,678	6,526,792
減：預期信用損失	(1,328,334)	(1,236,560)
	5,298,344	5,290,232
就報告目的分析如下：		
流動資產	5,176,240	4,742,213
非流動資產	122,104	548,019
	5,298,344	5,290,232

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 28 其他貸款及應收款項 (續)

預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	1,670	–	1,234,890	1,236,560
預期信用損失的變動：				
– 預期信用損失(轉回)/確認	(1,074)	–	94,177	93,103
– 外匯變動及其他	8	–	(1,337)	(1,329)
於2024年6月30日	604	–	1,327,730	1,328,334

下表詳細說明了其他貸款及應收款項的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

賬面總額：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	1,055,517	–	5,571,161	6,626,678
於2023年12月31日(經審計)	1,015,897	–	5,510,895	6,526,792



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 29 客戶貸款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
客戶貸款	5,671,468	5,675,516
減：預期信用損失	(53,964)	(59,856)
	5,617,504	5,615,660
就報告目的分析如下：		
流動資產	511,385	460,278
非流動資產	5,106,119	5,155,382
	5,617,504	5,615,660

#### 預期信用損失的本期變動：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生 信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生 信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	22,689	5,926	31,241	59,856
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失轉回	(2,864)	(9)	(733)	(3,606)
— 外匯變動及其他	(574)	(230)	(1,482)	(2,286)
於2024年6月30日	19,251	5,687	29,026	53,964

下表詳細說明了客戶貸款的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額：

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期內 預期信用損失 (未發生 信用減值) 階段2	整個存續期內 預期信用損失 (發生 信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	5,227,680	383,033	60,755	5,671,468
於2023年12月31日(經審計)	5,205,801	405,303	64,412	5,675,516

### 30 遞延稅項

就本集團綜合財務狀況表的呈列而言，若干遞延稅項資產及負債已經抵銷。下表乃就財務報告目的而作出的遞延稅項結餘分析：

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
遞延稅項資產	3,302,174	4,187,114
遞延稅項負債	(546,508)	(835,048)
	2,755,666	3,352,066



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 30 遞延稅項 (續)

以下為有關年度獲確認的主要遞延稅項資產(負債)以及其變動：

	以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產/(負債)	加速折舊	衍生金融工具	應計但未繳付支出	以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具	減值損失	稅務損失及其他	合計
(經審計)									
於2023年1月1日	(1,040,446)	(86,647)	211,089	1,066,445	30,323	187,693	3,052,493	381,271	3,802,221
於損益中(扣減)/計入	(18,485)	(506)	(233,865)	(493,362)	-	-	123,660	241,719	(380,839)
於其他全面收益中(扣減)/計入	-	-	(19,299)	-	(124,646)	82,004	-	-	(61,941)
匯率影響及其他	(18)	(1,397)	352	592	1,884	(78,127)	3,056	66,283	(7,375)
於2023年12月31日	(1,058,949)	(88,550)	(41,723)	573,675	(92,439)	191,570	3,179,209	689,273	3,352,066
(未經審計)									
於損益中計入/(扣減)	91,730	(6,110)	(145,920)	(115,599)	3,892	-	(201,442)	66,719	(306,730)
於其他全面收益中扣減	-	-	(6,168)	-	(135,387)	(44,825)	-	-	(186,380)
匯率影響及其他	(28)	(574)	(305)	301	(456)	(52,631)	945	(50,542)	(103,290)
於2024年6月30日	(967,247)	(95,234)	(194,116)	458,377	(224,390)	94,114	2,978,712	705,450	2,755,666

於報告期末，本集團就子公司未分配利潤產生的暫時性差異未確認遞延所得稅負債，因為本集團能夠控制暫時性差異的轉回時點，且在可預測的未來該暫時性差異不會轉回。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 31 交易所儲備及保證金

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
交易所儲備及保證金		
— 上交所	413,961	440,626
— 深交所	285,037	236,397
— 全國中小企業股份轉讓系統	3,866	2,345
— 香港聯合交易所有限公司	1,725	1,713
小計	704,589	681,081
期貨衍生及商品交易所保證金		
— 中國金融期貨交易所	12,112,581	15,713,179
— 上海期貨交易所	3,786,636	2,596,292
— 大連商品交易所	1,812,133	2,107,484
— 鄭州商品交易所	1,042,767	1,200,790
— 上海黃金交易所	6,510	7,074
— 香港期貨結算有限公司	10,382	12,989
— 付予其他地區的保證金	768,172	551,383
小計	19,539,181	22,189,191
交易席位費及其他保證金		
— 存於證金公司的保證金	282,943	358,195
— 存於上海清算所的保證金	154,006	145,014
— 付予香港中央結算有限公司的保證金	104,364	94,630
— 付予上交所的保證金	22,159	99,181
— 付予深交所的保證金	23,999	21,795
— 付予香港聯合交易所期權結算所有有限公司的保證金	3,843	4,492
— 付予北交所的保證金	390	200
— 其他	27,032	50,043
小計	618,736	773,550
合計	20,862,506	23,643,822
就報告目的分析如下：		
流動資產	20,731,501	23,480,478
非流動資產	131,005	163,344
	20,862,506	23,643,822

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 32 銀行結餘及現金

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
自有賬戶	61,106,349	50,960,039
代客戶持有的現金(附註i)	80,750,247	87,407,094
減：非流動受限制銀行存款(附註ii)	141,856,596 (2,052,034)	138,367,133 (1,980,005)
	<b>139,804,562</b>	136,387,128

銀行結餘及現金包括庫存現金及按現行市場利率計息的活期存款。

附註：

- (i) 本集團於銀行設有指定的銀行賬戶，以持有來自一般業務交易所產生的客戶存款。本集團已於應付經紀業務客戶款項中確認應付客戶的賬款(附註44)。本集團從法律上無可執行的抵銷權將該客戶存款與相應的應付款項相互抵銷。
- (ii) 非流動受限制銀行存款為風險準備金以及一年以上的保證金存款。

### 33 現金及現金等價物

現金及現金等價物包括下列各項：

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
銀行結餘及現金－自有(除應計利息)	60,995,674	50,870,676
減：受限制銀行存款(i)	(2,790,900)	(3,132,033)
存放同業款項(除應計利息)	109,983	126,069
存放央行超額準備金	5,371,185	4,236,630
結算備付金－自有	5,541,330	5,440,284
	<b>69,227,272</b>	57,541,626

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

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 34 其他非流動資產

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
長期應收政府與社會資本合作項目款	1,470,717	1,460,794
收回融資租賃資產	56,709	57,374
抵債資產	38,851	42,563
其他	825,018	861,712
	<b>2,391,295</b>	2,422,443

### 35 孖展融資客戶墊款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
孖展客戶的貸款(附註)	67,531,945	71,880,338
減：預期信用損失	(3,587,849)	(3,462,130)
	<b>63,944,096</b>	68,418,208
就報告目的分析如下		
流動資產	<b>63,944,096</b>	68,418,208

附註：

孖展客戶的信貸融資限額乃根據本集團接納的抵押證券的折讓市值而釐定。

大部分給予孖展客戶的貸款由相關已質押證券作抵押且計息。本集團設有一份認可股份清單，以按特定貸款抵押比率給予孖展借款。倘超逾借款比率，則將觸發保證金追繳通知，而客戶須追補該差額。

於2024年6月30日的給予孖展客戶的貸款，藉客戶向本集團抵押未貼現市值約為人民幣171,809,026千元（2023年12月31日：人民幣211,658,319千元）的證券作為抵押品而擔保。

於2024年6月30日，應付經紀業務客戶賬款包括根據證券借貸協議和客戶墊款向客戶收取的現金抵押款項人民幣4,694,502千元（2023年12月31日：人民幣6,816,255千元）。

鑑於業務的性質，賬齡分析不能產生附加值，故本公司董事認為無須披露賬齡分析。本集團根據對可收回性的評估與管理層的判斷，包括評估信貸質量變動、抵押品以及每位客戶過往的收款歷史，以釐定減值債項的備抵。由於客戶群龐大及無關聯，故此信用風險的集中程度有限。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 35 孖展融資客戶墊款(續)

下表列示了孖展融資客戶墊款的預期信用損失變動。

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
(未經審計)				
於2024年1月1日	34,620	16,480	3,411,030	3,462,130
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失(轉回)/確認	(2,866)	4,122	108,688	109,944
— 階段間的轉換	(730)	(2,489)	3,219	—
— 外匯變動及其他	36	49	15,690	15,775
於2024年6月30日	31,060	18,162	3,538,627	3,587,849

下表詳細說明了孖展融資客戶墊款的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額

	12個月的 預期信用損失 階段1	整個存續期 預期信用損失 (未發生信用減值) 階段2	整個存續期 預期信用損失 (發生信用減值) 階段3	總計
於2024年6月30日(未經審計)	52,290,165	8,237,075	7,004,705	67,531,945
於2023年12月31日(經審計)	58,562,128	6,935,009	6,383,201	71,880,338

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 36 應收賬款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
應收賬款來自：		
— 經紀、交易商及結算所	4,460,247	3,395,834
— 現金客戶	934,043	4,379,790
— 資產及基金管理	465,643	502,724
— 顧問及財務規劃	177,902	205,869
— 其他	2,772,768	4,082,780
	<b>8,810,603</b>	12,566,997
減：預期信用損失	<b>(490,501)</b>	(399,722)
	<b>8,320,102</b>	12,167,275

賬齡分析如下：

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
3個月以內	5,923,246	9,811,009
3-6個月	1,277,085	1,009,842
6-12個月	371,617	549,875
超過1年	748,154	796,549
	<b>8,320,102</b>	12,167,275



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具

	2024年6月30日 (未經審計)		
	合約價值	資產	負債
套期會計下衍生投資：			
利率互換合約	1,402,375	48,418	—
外匯互換	541,383	56,110	—
遠期合同	472,078	313	43,516
持作交易的衍生投資：			
股指期貨合約 (附註i)	9,832,426	—	—
國債期貨合約 (附註ii)	41,733,412	—	—
商品期貨合約 (附註iii)	5,528,323	—	—
利率互換合約 (附註iv)	245,367,824	228,696	171,828
權益互換	13,939,669	712,832	704,965
遠期合同	4,890,851	224,812	51,096
期權 (附註v)	52,309,633	799,048	249,126
嵌入式權益工具	6,061,567	6,541	7,258
外匯互換	191,328	69	2,170
信用違約互換	325,000	3,003	708
合計	382,595,869	2,079,842	1,230,667

	2023年12月31日 (經審計)		
	合約價值	資產	負債
套期會計下衍生投資：			
利率互換	1,525,629	53,779	—
外匯互換	539,784	32,794	—
遠期合同	364,818	1,702	5,719
持作交易的衍生投資：			
股指期貨合約 (附註i)	36,376,666	—	—
國債期貨合約 (附註ii)	34,321,921	—	—
商品期貨合約 (附註iii)	10,224,376	—	—
利率互換合約 (附註iv)	190,994,225	245,196	205,162
權益互換	33,398,617	1,264,797	694,187
遠期合同	4,235,114	7,160	33,983
期權 (附註v)	136,458,009	669,653	235,908
嵌入式衍生工具	5,707,332	1,038	13,624
外匯互換	405,949	304	2,159
信用違約互換	2,740,000	2,132	203
合計	457,292,440	2,278,555	1,190,945



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具 (續)

附註：(續)

#### (iii) 商品期貨合約

在每日無負債結算制度下，結算備付金已包括本集團所有的商品期貨合約產生的持倉損益金額。於2024年6月30日，本集團在每日無負債結算制度下持有的商品期貨合約的淨額為人民幣零元(2023年12月31日：人民幣零元)。

	2024年6月30日 (未經審計)		2023年12月31日 (經審計)	
	合約價值	公允價值	合約價值	公允價值
合計	5,528,323	38,816	10,224,376	8,302
加：結算		(38,816)		(8,302)
淨額		-		-

#### (iv) 利率互換合約

在每日無負債結算制度下，本集團於利率互換業務中的頭寸在上海清算所每日結算，於2024年6月30日及2023年12月31日，相應收支計入「結算備付金」。因此，於報告期期末，衍生金融工具項下的利率互換業務的淨頭寸為人民幣零元。

對於中國大陸及香港市場未在每日無負債結算制度下的利率互換合同於報告期期末以全額列示。

	2024年6月30日 (未經審計)		
	合約價值	資產	負債
利率互換 - 於上海清算所清算	236,540,000	1,007,801	1,054,668
利率互換 - 非集中清算	8,827,824	228,696	171,828
合計	245,367,824	1,236,497	1,226,496
加：結算		(1,007,801)	(1,054,668)
利率互換合約淨值		228,696	171,828

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具(續)

附註：(續)

#### (iv) 利率互換合約(續)

	2023年12月31日(經審計)		
	合約價值	資產	負債
利率互換－於上海清算所清算	189,388,538	601,198	589,279
利率互換－非集中清算	1,605,687	245,196	205,162
合計	190,994,225	846,394	794,441
加：結算		(601,198)	(589,279)
利率互換合約淨值		245,196	205,162

#### (v) 期權

於2024年6月30日，本集團在中國大陸境內投資的期權的名義本金分別約為人民幣50,433,933千元(2023年12月31日：人民幣134,651,609千元)。本集團在境外投資的期權名義本金約為人民幣1,875,700千元(2023年12月31日：人民幣1,806,400千元)。

### 38 其他流動資產

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
預付款項	1,258,139	1,155,114
應收股利	236,921	33,504
存貨	664,637	143,609
其他應收(附註i)	4,177,126	4,278,058
減：預期信用損失(附註ii)	6,336,823 (571,364)	5,610,285 (594,890)
	5,765,459	5,015,395

附註：

- (i) 其他應收及預付款項包括經營性租賃的短期租賃押金、日常經營活動的其他預付費用及預付稅項等其他應收及預付款項。截至2024年6月30日，其他應收款餘額中含應收政府補助人民幣618,610千元。
- (ii) 本集團的減值損失主要為應收獨立第三方的款項人民幣429,994千元。於先前年度，本公司董事認為收回應收賬款的機會渺茫，故以前年度全數計提。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 39 結算備付金

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
為下列人士於結算所持有的結算備付金：		
自有	5,541,330	5,440,284
客戶	10,359,668	10,144,094
	<b>15,900,998</b>	15,584,378

該等結算備付金由結算所為本集團持有，本集團可自由提取。該等結餘按現行市場利率計息。

### 40 存放中央銀行款項及存放同業款項

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
存放中央銀行除法定存款準備金以外款項	5,372,862	4,238,039
法定存款準備金	26,231	14,161
	<b>5,399,093</b>	4,252,200
存放同業款項	95,272	111,445
合計	<b>5,494,365</b>	4,363,645

存放中央銀行除法定存款準備金以外款項為即期償還，法定存款準備金不計息。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 41 借款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
短期借款：		
有抵押（附註）	2,726,030	-
無抵押	30,670,412	31,053,895
	<b>33,396,442</b>	31,053,895
長期借款：		
有抵押（附註）	4,899,598	7,815,910
無抵押	32,077,683	34,483,415
	<b>36,977,281</b>	42,299,325
合計	<b>70,373,723</b>	73,353,220
流動負債：		
短期借款	33,396,442	31,053,895
一年內到期的長期借款	18,192,495	17,888,503
	<b>51,588,937</b>	48,942,398
非流動負債：		
長期借款	18,784,786	24,410,822
	<b>70,373,723</b>	73,353,220
到期日分析如下：		
1年以內	51,588,937	48,942,398
1-2年	12,615,050	17,594,814
2-5年	5,358,474	5,837,069
5年以上	811,262	978,939
	<b>70,373,723</b>	73,353,220

附註：

截至2024年6月30日，約有人民幣26.67億元的銀行貸款以本集團下屬子公司海通國際證券集團有限公司百分之七十的股權作為質押。截至2023年12月31日，本集團約有人民幣17.78億元的銀行貸款以本公司下屬子公司海通銀行的股權作為質押。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 41 借款 (續)

附註：(續)

截至2024年6月30日，本集團下屬子公司海通國際證券集團有限公司的銀行質押借款餘額合計港幣0.64億元(折合人民幣0.59億元)(2023年12月31日：無)，該款項系海通國際證券集團有限公司在客戶同意下，以其給予客戶的融資款而取得的質押品(持有的上市公司股份)作為質押借入，截至2024年6月30日，該質押品期末市值為港幣13.44億元(折合人民幣12.27億元)。

截至2024年6月30日，本集團持有短期及長期借款餘額(含應付利息)合計人民幣49.00億元(2023年12月31日：人民幣60.38億元)，以應收融資租賃款、售後回租安排的應收款、下屬子公司股權作為質押及飛機租賃及物業及設備作為抵押。截至2024年6月30日，質押的應收融資租賃款帳面價值為人民幣3.08億元(2023年12月31日：人民幣6.19億元)，質押的售後回租安排的應收款帳面價值為人民幣8.13億元(2023年12月31日：人民幣14.21億元)，抵押的飛機租賃及物業及設備的帳面價值為人民幣62.07億元(2023年12月31日：人民幣63.03億元)。

### 42 應付短期融資款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
超短期融資券	3,029,606	5,043,605
中期票據	-	285,947
短期收益憑證	6,444,837	7,473,086
短期融資券	1,012,916	1,033,166
短期公司債券	5,084,071	5,017,255
	<b>15,571,430</b>	18,853,059

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

發債主體	債券名稱	幣種	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通證券股份有限公司	短期公司債券	人民幣	15/11/2023	25/10/2024	2.68%	5,017,255	66,816	-	5,084,071
海通證券股份有限公司	短期收益憑證	人民幣	04/07/2023- 28/06/2024	01/07/2024- 26/06/2025	0.00%-3.00%	7,473,086	11,536,537	12,564,786	6,444,837
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	短期融資券	人民幣	10/01/2023	10/01/2024	3.41%	1,033,166	841	1,034,007	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	26/04/2023	19/01/2024	2.56%	1,017,490	1,211	1,018,701	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	22/08/2023	08/03/2024	2.40%	1,008,471	4,370	1,012,841	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	04/09/2023	24/05/2024	2.50%	1,007,782	9,814	1,017,596	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	20/09/2023	07/06/2024	2.68%	1,007,173	11,549	1,018,722	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	22/11/2023	16/08/2024	2.81%	1,002,689	14,304	-	1,016,993
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	短期融資券	人民幣	08/01/2024	08/01/2025	2.78%	-	1,012,916	-	1,012,916
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	17/01/2024	25/09/2024	2.65%	-	1,011,764	-	1,011,764
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	05/06/2024	25/02/2025	2.15%	-	1,000,849	-	1,000,849
海通國際證券集團有限公司	中期票據	港幣	09/02/2023	08/02/2024	4.70%	285,947	2,038	287,985	-
合計						18,853,059	14,673,009	17,954,638	15,571,430

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

發債主體	債券類型	幣種	面值 (原幣千元)		起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
			金額	占總額比例							
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	800,000		14/7/2014	14/7/2024	5.85%	821,783	23,349	-	845,132
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,500,000		22/9/2017	22/9/2027	4.99%	5,566,826	137,570	-	5,704,396
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	700,000		30/4/2020	30/4/2025	2.88%	713,194	10,166	20,160	703,200
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	6,000,000		13/1/2021	13/1/2024	3.58%	6,207,612	7,188	6,214,800	-
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,400,000		8/2/2021	8/2/2024	3.79%	5,582,992	21,668	5,604,660	-
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000		23/4/2021	23/4/2024	3.45%	5,118,251	54,249	5,172,500	-
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,800,000		27/5/2021	27/5/2024	3.35%	2,855,405	38,395	2,893,800	-
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,100,000		10/6/2021	10/6/2024	3.4%	2,139,400	32,000	2,171,400	-
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000		29/7/2021	29/7/2024	3.14%	2,026,033	31,864	-	2,057,897
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000		20/8/2021	20/8/2024	3.04%	3,032,174	46,303	-	3,078,477
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000		30/8/2021	30/8/2024	3.1%	2,020,159	31,465	-	2,051,624
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000		30/8/2021	30/8/2026	3.43%	2,021,198	34,480	-	2,055,678
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000		10/11/2021	10/11/2024	3.1%	5,019,278	78,658	-	5,097,936
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000		22/11/2021	22/11/2024	3.09%	5,014,037	78,408	-	5,092,445
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000		20/1/2022	25/12/2024	2.84%	5,131,287	72,470	142,000	5,061,757
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,900,000		21/2/2022	21/2/2025	2.9%	2,970,238	42,765	84,100	2,928,903
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	500,000		7/3/2022	7/3/2025	3.03%	512,041	7,704	15,150	504,595
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000		26/7/2022	26/7/2025	2.75%	5,054,740	69,937	-	5,124,677
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000		9/9/2022	9/9/2025	2.53%	5,034,022	64,464	-	5,098,486
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	4,700,000		14/10/2022	14/10/2025	2.6%	4,721,031	62,231	-	4,783,262
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000		10/11/2022	10/11/2025	2.61%	3,007,572	39,870	-	3,047,442
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,500,000		8/2/2023	8/2/2025	2.95%	2,563,429	37,874	73,750	2,527,553
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000		8/2/2023	8/2/2026	3.23%	3,082,780	49,141	96,900	3,035,021
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,500,000		6/3/2023	6/3/2025	3.11%	2,561,124	39,910	77,750	2,523,284
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,700,000		6/3/2023	6/3/2026	3.26%	1,743,216	28,132	55,420	1,715,928
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,300,000		22/3/2023	22/3/2025	2.97%	3,372,467	50,365	98,010	3,324,822
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,700,000		22/3/2023	22/3/2026	3.1%	2,761,355	42,518	83,700	2,720,173
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000		24/4/2023	24/4/2025	2.89%	2,037,294	29,710	57,800	2,009,204
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	4,000,000		24/4/2023	24/4/2026	3.05%	4,078,118	61,960	122,000	4,018,078
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,600,000		18/5/2023	18/5/2026	2.94%	3,660,496	53,772	105,840	3,608,428
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,400,000		18/5/2023	18/5/2028	3.1%	1,424,700	21,845	43,399	1,403,146
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000		15/6/2023	15/6/2026	2.73%	3,040,086	41,656	81,900	2,999,842

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

發債主體	債券類型	幣種	面值 (原幣千元)	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	15/6/2023	15/6/2028	3.07%	2,030,161	30,895	61,400	1,999,656
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	25/7/2023	25/7/2026	2.72%	2,020,535	27,664	-	2,048,199
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,700,000	25/7/2023	25/7/2028	3.05%	2,731,318	41,429	-	2,772,747
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,200,000	18/8/2023	18/8/2026	2.67%	3,226,427	43,464	-	3,269,891
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,800,000	24/11/2023	24/11/2026	2.95%	1,802,211	26,878	-	1,829,089
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	22/2/2024	22/2/2027	2.58%	-	1,007,491	-	1,007,491
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	22/2/2024	22/2/2029	2.75%	-	5,040,028	-	5,040,028
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,700,000	5/3/2024	5/3/2027	2.5%	-	1,710,864	-	1,710,864
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,300,000	5/3/2024	5/3/2029	2.7%	-	3,322,953	-	3,322,953
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	4,100,000	20/3/2024	20/3/2027	2.55%	-	4,122,383	-	4,122,383
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000	20/3/2024	20/3/2029	2.69%	-	3,017,347	-	3,017,347
海通證券股份有限公司	次級債券	人民幣	5,000,000	12/1/2022	12/1/2025	3.18%	5,150,913	80,656	159,000	5,072,569
海通證券股份有限公司	次級債券	人民幣	2,000,000	25/2/2022	25/2/2025	3.15%	2,052,035	31,984	63,000	2,021,019
海通證券股份有限公司	次級債券	人民幣	2,480,000	9/3/2022	9/3/2025	3.29%	2,544,551	41,424	81,592	2,504,383
海通證券股份有限公司	收益憑證	人民幣	422,584	05/07/2022- 30/05/2024	01/07/2024- 05/01/2026	0.00%-3.10%	736,272	30,206	336,450	430,028
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	26/4/2021	26/4/2025	3.65%	698,539	11,767	24,820	685,486
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	800,000	18/6/2021	18/6/2025	3.36%	581,161	9,249	19,153	571,257
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	600,000	12/8/2021	12/8/2024	3.90%	608,394	12,198	-	620,592
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	24/12/2021	24/12/2024	3.70%	999,424	19,136	-	1,018,560
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,500,000	21/4/2022	21/4/2024	3.48%	1,535,324	15,732	1,551,056	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	500,000	5/5/2022	5/5/2025	3.57%	510,700	8,852	17,473	502,079
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	21/6/2022	21/6/2024	3.16%	1,015,506	14,804	1,030,310	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	600,000	7/7/2022	7/7/2025	3.44%	608,481	10,783	-	619,264
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	21/10/2022	21/10/2025	3.13%	1,003,138	16,418	-	1,019,556



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

## 43 應付債券 (續)

發債主體	債券類型	幣種	面值 (原幣千元)	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	17/4/2023	17/4/2026	3.90%	1,024,966	19,340	38,437	1,005,869
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	26/6/2023	26/6/2028	3.80%	1,017,090	18,948	37,503	998,535
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	25/7/2023	25/7/2028	3.63%	1,013,261	18,594	-	1,031,855
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	24/10/2023	24/10/2027	3.47%	1,004,467	17,913	-	1,022,380
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	15/1/2024	15/1/2028	3.03%	-	1,012,297	-	1,012,297
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	20/5/2024	20/5/2029	2.48%	-	999,605	-	999,605
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	25/6/2024	25/6/2029	2.29%	-	996,462	-	996,462
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	9/12/2021	9/12/2024	3.70%	1,000,755	19,270	-	1,020,025
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	800,000	13/1/2022	13/1/2025	3.64%	826,742	14,520	28,469	812,793
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	27/5/2022	27/5/2025	3.42%	1,018,291	16,959	33,408	1,001,842
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,200,000	10/8/2022	10/8/2025	3.25%	1,212,279	20,395	-	1,232,674
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	14/12/2022	14/12/2025	4.13%	999,571	21,284	-	1,020,855
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	23/2/2023	23/2/2026	4.20%	1,033,586	20,942	41,460	1,013,068
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	6/6/2023	6/6/2026	3.81%	1,019,110	18,998	37,555	1,000,553
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	24/8/2023	24/8/2026	3.46%	1,008,993	17,910	-	1,026,903
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	6/3/2024	6/3/2027	2.80%	-	1,005,999	-	1,005,999
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	15/4/2024	15/4/2029	2.60%	-	1,003,327	-	1,003,327

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

發債主體	債券類型	幣種	面值 (原幣千元)	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持票據	人民幣	950,000	10/3/2022	27/5/2024	3.50%	57,073	374	57,447	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持票據	人民幣	955,000	19/7/2023	18/1/2024	2.80%	966,793	1,245	968,038	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持票據	人民幣	950,000	15/9/2023	8/3/2024	2.97%	957,336	5,179	962,515	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	935,000	28/4/2022	27/12/2024	0.00%	113,892	-	86,211	27,681
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	29/6/2022	26/2/2025	3.19% - 3.60%	235,482	2,883	146,606	91,759
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	943,000	7/7/2022	15/9/2025	3.50% - 4.30%	240,284	1,163	136,542	104,905
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,425,000	16/9/2022	27/9/2027	4.10%	1,405,854	29,132	24,477	1,410,509
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	21/9/2022	26/8/2025	2.98% - 3.40%	375,541	4,630	178,698	201,473
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	984,000	28/10/2022	15/8/2025	3.43% - 4.00%	278,405	1,365	143,754	136,016
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,425,000	23/12/2022	27/12/2027	4.48%	1,409,133	31,833	27,934	1,413,032
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	13/1/2023	26/8/2025	4.50% - 4.70%	512,727	9,734	198,522	323,939
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	737,000	10/3/2023	23/10/2025	3.92% - 4.80%	292,896	2,186	136,439	158,643
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	16/3/2023	28/7/2025	3.70% - 4.00%	507,708	7,075	208,127	306,656
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	24/5/2023	26/12/2025	3.48% - 3.62%	586,339	8,602	274,818	320,123
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	7/6/2023	26/3/2026	3.38% - 3.58%	573,652	9,076	152,280	430,448
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	8/8/2023	26/3/2026	3.16% - 3.30%	637,208	9,008	192,290	453,926
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000	3/11/2023	27/4/2026	2.90% - 3.50%	949,168	11,052	370,166	590,054



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

## 43 應付債券 (續)

發債主體	債券類型	幣種	面值		起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
			(原幣千元)	人民幣							
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000		15/12/2023	26/12/2025	3.09%-3.45%	947,094	12,155	475,775	483,474
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000		20/12/2023	26/12/2025	2.94%-3.32%	1,134,823	14,646	523,947	625,522
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	873,000		7/2/2024	24/2/2026	3.20% - 3.85%	-	880,043	330,562	549,481
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000		28/5/2024	26/11/2026	2.18%-2.39%	-	946,996	-	946,996
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	非公開定向債務融資工具	人民幣	1,000,000		11/11/2021	11/11/2024	4.19%	1,004,496	21,638	-	1,026,134
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	950,000		10/4/2023	26/5/2024	3.29%	154,282	1,272	155,554	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000		12/7/2022	27/5/2024	3.00% - 3.03%	113,104	521	113,625	-
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000		8/9/2022	26/8/2024	2.80%	285,492	2,433	255,795	32,130
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000		25/11/2022	26/11/2024	3.50% - 3.60%	407,117	4,937	291,776	120,278
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000		8/3/2023	26/11/2025	3.63% - 3.70%	503,643	5,812	298,052	211,403
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000		16/5/2023	26/3/2025	3.28% - 3.43%	535,305	7,180	310,779	231,706

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

發債主體	債券類型	幣種	面值 (原幣千元)	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司/海通恒信小微融資租賃(上海)有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	27/6/2023	26/6/2025	3.18%-3.41%	699,305	9,300	344,784	363,821
海通恒信國際融資租賃股份有限公司/海通恒信小微融資租賃(上海)有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	1/9/2023	26/4/2025	2.55%-3.09%	1,146,322	9,396	687,103	468,615
海通恒信國際融資租賃股份有限公司/海通恒信融資租賃(上海)有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,350,000	22/12/2023	26/11/2026	3.10%-3.60%	1,185,257	174,488	451,972	907,773
Haitong UT Brilliant Limited	中期票據	美元	100,000	3/6/2021	3/6/2024	3.00%	701,081	11,583	712,664	-
Haitong UT Brilliant Limited	中期票據	美元	200,000	27/4/2022	27/4/2025	4.20%	1,423,922	38,656	28,689	1,433,889
Haitong UT Brilliant Limited	中期票據	人民幣	1,000,000	19/3/2024	19/3/2027	3.65%	-	1,006,798	-	1,006,798
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	700,000	19/7/2019	19/7/2024	3.38%	5,028,927	35,849	692	5,064,084
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	400,000	18/11/2019	18/5/2025	3.13%	2,836,152	20,543	-	2,856,695
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	300,000	20/5/2021	20/5/2026	2.13%	2,124,942	15,148	660	2,139,430
Haitong International Finance Holdings 2015 Limited	公司債券	美元	670,000	12/3/2020	11/3/2025	2.11%	4,772,463	93,404	62,058	4,803,809
Haitong International Finance Holdings Limited	公司債券	人民幣	4,000,000	20/4/2023	20/4/2026	3.40%	4,089,037	108,993	176,044	4,021,986
Haitong International Finance Holdings Limited	公司債券	人民幣	2,800,000	18/5/2023	18/5/2026	3.20%	2,803,352	73,365	71,879	2,804,838
Haitong International Finance Holdings Limited	公司債券	人民幣	3,500,000	1/3/2024	1/3/2027	3.30%	-	3,562,762	33,757	3,529,005
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	金融債券	巴西雷亞爾	1,240,368	25/06/2021-25/03/2024	10/01/2024-28/07/2026	5.28%-13.25%	2,109,546	120,395	757,507	1,472,434
Haitong Bank, S.A.	金融債券	歐元	230,000	8/2/2022	8/2/2025	5.28%	1,818,073	1,502	45,688	1,773,887
Haitong Bank, S.A.	金融債券	美元	150,000	23/5/2022	29/5/2027	4.00%	1,068,515	7,035	-	1,075,550
合計							193,920,280	32,700,842	37,170,351	189,450,771

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 43 應付債券(續)

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
就報告目的分析如下：		
流動負債	79,895,931	78,301,231
非流動負債	109,554,840	115,619,049
	<b>189,450,771</b>	193,920,280

### 44 應付經紀業務客戶賬款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
應付經紀業務客戶賬款	<b>106,526,337</b>	106,538,717

大部分應付經紀業務客戶賬款須按要求償還，惟若干應付予經紀業務客戶的賬款除外，該等賬款乃就客戶於正常業務過程中進行交易活動而收取客戶的孖展按金。只有超出規定孖展按金的金額可應要求發還客戶。

本集團的應付經紀業務客戶賬款主要有代客戶於銀行及結算所持有的現金，應付經紀業務客戶款項按照現行基準利率計提相應的應付利息。

### 45 客戶存款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
公司活期存款	215,414	241,613
公司定期存款	3,223,640	3,164,475
個人活期存款	12,606	10,662
個人定期存款	4,391,489	2,993,165
	<b>7,843,149</b>	6,409,915
分析如下：		
流動負債	5,664,040	4,828,712
非流動負債	2,179,109	1,581,203
	<b>7,843,149</b>	6,409,915

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 46 其他應付款項及預計費用

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
應付僱員成本(附註i)	2,322,489	2,583,857
應付股利	1,466,314	206,184
短期融資租賃保證金	1,752,290	1,754,578
應付清算款	2,467,190	1,247,727
應付票據	1,538,066	2,027,861
應付經紀商款項	1,294,112	790,103
風險準備金	766,998	751,353
其他稅費	286,145	400,380
應付手續費及佣金	41,911	99,492
應付結算所款項	23,410	241,834
其他(附註ii)	8,887,030	13,677,411
	<b>20,845,955</b>	23,780,780
分析如下：		
流動負債	19,352,470	22,538,352
非流動負債(附註i)	1,493,485	1,242,428
	<b>20,845,955</b>	23,780,780

附註：

- (i) 本集團設立的職工獎金詳細支付計劃。根據該計劃，總計人民幣499,064千元將於一年後償付(2023年12月31日：人民幣499,064千元)，因此被分類為非流動負債。
- (ii) 本集團其他主要是預收的應付款項並不計算利息，須予一年內結轉。

### 47 預計負債

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
未決訴訟及其它	141,507	178,334
對外提供擔保	17,072	15,630
	<b>158,579</b>	193,964

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 48 以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
交易性金融負債	2,167,233	2,169,332
合併結構化主體形成的金融負債	1,757,571	1,930,670
指定以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債(附註)		
— 結構化收益產品	5,940,858	11,925,444
— 黃金期權	955,314	1,333,762
— 收益憑證	1,426,325	3,094,197
	<b>12,247,301</b>	20,453,405
就報告目的分析如下：		
流動負債	10,230,741	13,130,414
非流動負債	2,016,560	7,322,991
	<b>12,247,301</b>	20,453,405

附註：

於2024年6月30日及2023年12月31日，本集團指定以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債的公允價值與到期合同付款之間的差異不顯著。截至2024年6月30日止六個月期間和2023年12月31日止年度，由於集團自身信用風險的變化而導致的公允價值變動並不顯著。

於2024年6月30日及2023年12月31日，本集團指定以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債中包括本集團發行的結構化收益產品、收益憑證及合併結構化主體歸屬於第三方權益等。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 49 賣出回購金融資產款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
按抵押品分類劃分：		
股票	1,676,740	2,172,630
債券	90,102,317	100,738,908
黃金	7,946,622	9,653,255
	<b>99,725,679</b>	112,564,793
按市場所分類劃分：		
交易所	50,078,843	33,916,235
銀行間市場	41,587,204	68,860,072
場外交易市場	8,059,632	9,788,486
	<b>99,725,679</b>	112,564,793
就報告目的分析如下：		
流動負債	98,965,552	111,617,827
非流動負債	760,127	946,966
	<b>99,725,679</b>	112,564,793

賣出回購協議是集團與對手方之間的交易，將證券或者資產出售並同時達成回購協議，在未來某個時間以固定價格購回。即使回購價格是固定的，集團仍然面臨著顯著的信用風險，市場風險和出售這些債券的收益。這些證券不會從財務報表中終止確認，但被視為該負債的抵押品，因為本集團保留了證券的所有風險與收益。

以下表格列示了關於被轉移的金融資產及相關負債的賬面價值或公允價值：

#### 於2024年6月30日

	以公允價值 計量且變動 計入損益的 金融資產	以公允價值 計量且變動 計入其他綜合 收益的債務工具	以攤餘成本計量 的債務工具	買入返售 金融資產	其他	合計
已轉移資產的賬面價值	39,308,847	35,963,863	2,259,084	410,739	31,940,718	109,883,251
相關負債的賬面價值	36,117,187	32,063,551	2,065,491	379,662	29,099,788	99,725,679
淨頭寸	3,191,660	3,900,312	193,593	31,077	2,840,930	10,157,572



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 49 賣出回購金融資產款 (續)

於2023年12月31日

	以公允價值 計量且變動 計入損益的 金融資產	以公允價值 計量且變動 計入其他綜合 收益的債務工具	以攤餘成本計量 的債務工具	買入返售 金融資產	其他	合計
已轉移資產的賬面價值	54,471,311	40,566,570	3,089,912	588,448	25,739,910	124,456,151
相關負債的賬面價值	49,109,515	36,736,533	2,882,554	483,010	23,353,181	112,564,793
淨頭寸	5,361,796	3,830,037	207,358	105,438	2,386,729	11,891,358

### 50 拆入資金

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
銀行拆入資金	8,156,136	3,339,205
從證金公司融入資金	11,348,861	11,373,159
	<b>19,504,997</b>	14,712,364
就報告目的分析如下：		
流動負債	17,610,021	12,740,366
非流動負債	1,894,976	1,971,998
	<b>19,504,997</b>	14,712,364

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 51 長期應付款

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
融資租賃保證金	3,533,797	3,927,541
遞延收益	317,477	360,893
其它	644,691	634,840
	<b>4,495,965</b>	4,923,274

長期應付款主要系本集團從事融資租賃業務收取的保證金。根據合同約定，保證金的到期日均在一年以上，分類為非流動負債。

### 52 股本

	上市A股		上市H股		合計	
	股份數目 (千股)	金額	股份數目 (千股)	金額	股份數目 (千股)	金額
按每股人民幣1.00元註冊、 發行及繳足：						
於2023年12月31日(經審計)	9,654,631	9,654,631	3,409,569	3,409,569	13,064,200	13,064,200
於2024年6月30日(未經審計)	<b>9,654,631</b>	<b>9,654,631</b>	<b>3,409,569</b>	<b>3,409,569</b>	<b>13,064,200</b>	<b>13,064,200</b>

於2024年6月30日，本公司股本總數為13,064,200千股，其中有限售條件的股份為781,250千股(於2023年12月31日：有限售條件的股份為781,250千股)。

### 53 庫存股

截至2024年6月30日的六個月內，公司通過上海證券交易所回購了自身普通股35,567,000股(截至2023年12月31日的十二個月內回購了41,507,467股)，回購總對價為人民幣303,072,674元(截至2023年12月31日的十二個月內支付的總對價為人民幣414,335,029元)。截至2024年6月30日，公司持有的庫存股數量為77,074,467股(截至2023年12月31日為41,507,467股)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 54 投資重估儲備

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
於期／年初	(401,324)	(624,143)
其他債權投資		
－ 於期內公允價值變動淨額	694,923	605,479
－ 處置重分類調整對損益的影響	(162,018)	(127,474)
－ 預期信用損失重分類調整對損益的影響	16,506	(72,156)
－ 所得稅影響	(136,165)	(103,168)
其他權益工具投資		
－ 於期內公允價值變動淨額	93,482	(418,303)
－ 轉至未分配利潤	210,529	342,727
－ 所得稅影響	(97,457)	3,877
所佔聯營企業及合營企業的投資重估損失份額	670	1,362
設定受益計劃的精算收益／(損失)	10,627	(34,915)
指定為現金流量套期的套期工具公允價值變動收益	10,859	25,390
於期／年末	240,632	(401,324)

### 55 儲備及未分配利潤

本集團儲備之金額及年內變動於綜合權益變動表呈列。

#### (a) 資本公積

資本公積主要包括應按高於面值發行新股份而產生的歸屬於公司股東的股份溢價及權益交易產生的資本公積。

#### (b) 投資重估儲備

投資重估儲備主要包括以公允價值計量且變動計入其他全面收益的債務工具及以公允價值計量且變動計入其他全面收益的權益工具的公允價值變動。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 55 儲備及未分配利潤 (續)

#### (c) 一般儲備

一般儲備包括法定儲備、一般風險儲備及交易風險儲備。

根據中華人民共和國公司法，本公司淨利潤的10% (按中國會計規定釐定) 在對股東作出分派前須轉入法定儲備，該儲備達到本公司股本50%時可不再計提。根據公司章程或者經股東大會批准可撥出儲備彌補虧損，擴大生產規模及轉增資本。

根據金融企業適用的金融規則，本公司須在對股東作出分派前，從未分配利潤中撥出按中國相關會計準則核算的利潤淨額的10%的作為一般風險儲備。

根據2013年9月24日發佈的《公開募集證券投資基金風險準備金監督管理暫行辦法》(中國證券監督管理委員會令第94號)的規定，本集團按照公募基金管理費收入的10%提取一般風險準備金。

根據中華人民共和國證券法，本公司須在對股東作出分派前，從未分配利潤中撥出按中國相關會計準則核算的利潤淨額的10%作為交易風險儲備，用於彌補交易損失，不能用於利潤分配和轉增資本。

#### (d) 未分配利潤

根據相關法律，本公司的未分配利潤視作(i)根據中國公認會計準則釐定的未分配利潤或(ii)根據國際財務報告準則釐定的未分配利潤，以較低者為準。

### 56 信用承諾

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
或有負債：		
— 保函和備用信用證	1,063,696	1,082,706
承諾：		
— 不可撤銷信貸承諾	577,464	592,350

保函和備用信用證屬於發生代付情況下才可能導致集團資本流出的銀行業務。

不可撤銷信貸承諾為向海通銀行客戶提供的信貸協定(如未使用的信貸額度)。這些協議通常約定了固定期限或其他要素，且需要客戶支付一定的手續費。所有的信貸承諾在授信時都需要客戶維持一定的已核實的條件。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 57 經營租賃安排

#### 本集團作為出租人

於期末，本集團與租戶已就下列未來最低租金簽訂合約：

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
1年內	567,482	563,118
第1至第2年	520,105	543,308
第2至第3年	511,397	502,161
第3至第4年	322,606	374,266
第4至第5年	184,867	227,145
超過5年	592,962	626,378
	<b>2,699,419</b>	<b>2,836,376</b>

### 58 資本承擔

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
有關收購物業及設備的資本開支： — 已訂約但未計提	<b>392,702</b>	555,423

### 59 股利

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
確認為分派的股利	<b>1,298,713</b>	2,743,482

根據海通證券2024年6月12日召開的2023年度股東週年大會審議批准向全體股東宣派2023年度現金股利每10股人民幣1.00元(含稅)，宣派總額為人民幣1,299百萬元(含稅)。於2024年8月8日，該現金股利已發放。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 60 於子公司的投資

通過設立或投資等方式取得的重要子公司

本集團重要子公司組成如下：

子公司名稱	按照中國法律註冊的 法人實體類型	註冊成立/ 成立地點	本集團持有的股本權益		註冊資本(元)	主要業務
			於2024年 6月30日 (未經審計)	於2023年 12月31日 (經審計)		
海通通基金管理有限公司 HFT Investment Management Co., Ltd.*	有限責任公司(中外合資) Limited liability company (equity joint venture)	上海	51%	51%	人民幣300,000,000	基金管理
海通開元投資有限公司 Haitong Capital Investment Co., Ltd.*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣5,500,000,000	私募股權投資管理
海通國際控股有限公司 Haitong International Holdings Limited	不適用 N/A	香港	100%	100%	港幣11,179,726,140	投資控股
海通期貨股份有限公司 Haitong Futures Co., Ltd.*	股份有限公司(新三板上市) Joint stock limited company (listed on NEEQ)	上海	83%	83%	人民幣1,301,500,000	期貨代理
海通國際證券集團有限公司 Haitong International Securities Group Limited**	不適用 N/A	百慕達	100%	73%	港幣843,819,160	投資控股
海通創新證券投資有限公司 Haitong Innovation Securities Investment Company Limited*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣11,500,000,000	金融產品投資、股權 投資及證券投資
上海海通證券資產管理有限公司 Shanghai Haitong Securities Asset Management Company Limited*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣2,200,000,000	證券資產管理
海通恆信金融集團有限公司 Haitong UT Capital Group Co., Limited	不適用 N/A	香港	100%	100%	港幣4,146,162,881	投資控股
海通恆信國際融資租賃股份有限公司 Haitong UniTrust International Financial Leasing Co., Ltd.*	股份有限公司(上市) Joint stock limited company (listed)	上海	85%	85%	人民幣8,235,300,000	租賃
海通銀行 Haitong Bank, S.A.	不適用 N/A	葡萄牙	100%	100%	歐元871,277,660	銀行
上海惟泰置業管理有限公司 Shanghai Weitai Properties Management Co., Ltd.*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣10,000,000	物業管理、房地產開發 經營、餐飲企業管理

附註：

\* 英語翻譯名稱僅供參考。

\*\* 於2023年9月26日，公司董事會通過了《關於海通國際控股有限公司對海通國際證券集團有限公司進行私有化的議案》。2024年1月11日，海通國際證券集團有限公司正式退市。集團的支付額為人民幣2,932,662千元。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 61 合併結構性主體之權益

本集團合併了部分結構性主體，這些主體主要為資產管理計劃。對於本集團作為資產管理計劃的管理人或作為投資者的情形，本集團綜合評估其因持有投資份額如有而享有的回報、其他利益以及作為資產管理計劃管理人的管理人報酬是否將使本集團面臨可變回報的影響重大，從而表明本集團應作為主要責任人。

本集團持有的上述納入合併財務報表範圍的結構化主體對本集團於2024年6月30日及2023年12月31日的財務狀況及截至2024年6月30日止六個月期間及2023年度的經營成果和現金流量影響並不重大，因此，本集團未對這些被合併結構化主體的財務信息進行單獨披露。

於2024年6月30日，集團直接持有的所有合併結構化實體的總資產為人民幣50,847,631千元(2023年12月31日：人民幣57,960,317千元)。於2024年6月30日，集團直接持有的所有合併結構化實體的權益公允價值為人民幣44,931,493千元(2023年12月31日：人民幣50,450,512千元)。截至2024年6月30日和2023年12月31日，集團未持有結構化產品次級份額的權益。

### 62 未合併結構性主體之權益

除已於附註61中所述已經合併的結構性主體以外，本公司董事認為，本集團所面臨與本集團作為結構性主體管理人相關的可變回報並不顯著或不擁有對被投資者的權利。因此，本集團沒有合併這些結構性主體。

於2024年6月30日，由本集團擔任投資管理人且持有權益之未合併結構性主體(不包括分類為聯營公司的投資)的賬面價值為人民幣8,571,094千元(2023年12月31日：人民幣5,443,534千元)，本集團所面臨風險敞口與賬面價值相若。截至2024年6月30日止六個月期間本集團作為投資管理人，於未納入合併範圍的結構性主體獲取的管理費收入為人民幣845,491千元(截至2023年6月30日止六個月期間：人民幣799,614千元)。

除上述披露的本集團管理的未納入合併範圍的結構性主體中的權益之外，本集團還在其不作為投資管理人的未納入合併範圍的結構化主體中享有權益。與本集團在結構化產品和信託產品有關的最大風險敞口接近於各自的賬面價值。

### 63 關聯方交易

持有公司5%以上股份或對公司有重大影響的關聯方的名稱及關係如下：

關聯方名稱	關聯方關係
— 上海國盛集團有限公司	持股5%以上的股東
— 光明食品(集團)有限公司	重大影響
— 上海電氣控股集團有限公司	重大影響

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 63 關聯方交易 (續)

截至2024年6月30日或2024年6月30日於本資產負債表日及本報告期間與本公司有重大交易的其他關聯方名稱及關聯方關係列示如下：

關聯方名稱	關聯方關係
— 富國基金管理有限公司	聯營企業
— 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司	聯營企業
— 上海併購股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)	聯營企業
— 西安軍融電子衛星基金投資有限公司	聯營企業
— 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 許昌海通創新股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 央視融媒體產業投資基金(有限合夥)	聯營企業
— 安徽省皖能海通雙碳產業併購投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 上海海通煥新私募投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 合肥海通中小基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 吉林海創長新投資中心(有限合夥)	聯營企業
— 金華市海通重點產業發展招商併購投資合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 吉林海通創新衛星投資中心(有限合夥)	聯營企業
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	聯營企業
— 上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 上海浦東引領區海通私募投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司	聯營企業
— 湖北省海通高品質轉型升級併購投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 海通興泰(安徽)新興產業投資基金(有限合夥)	聯營企業
— 海通(吉林)現代服務業創業投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 海通齊東(威海)股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業
— 南昌政通股權投資基金合夥企業(有限合夥)	聯營企業

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 63 關聯方交易 (續)

本集團於有關期間與關聯方的重大交易如下：

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
佣金及手續費收入		
— 央視融媒體產業投資基金(有限合夥)	34,397	40,305
— 富國基金管理有限公司	27,809	71,699
— 遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業(有限合夥)	12,736	12,736
— 合肥海通中小基金合夥企業(有限合夥)	9,561	5,868
— 上海海通煥新私募投資基金合夥企業(有限合夥)	8,585	8,416
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	8,491	8,526
— 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)	7,916	7,500
— 西安軍融電子衛星基金投資有限公司	5,492	3,774
— 遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司	5,000	22
— 上海電氣控股集團有限公司	4,522	23
— 安徽省皖能海通雙碳產業併購投資基金合夥企業(有限合夥)	3,518	2,423
— 上海浦東引領區海通私募投資基金合夥企業(有限合夥)	3,119	—
— 吉林海創長新投資中心(有限合夥)	2,475	1,403
— 湖北省海通高品質轉型升級併購投資基金合夥企業(有限合夥)	1,970	—
— 海通興泰(安徽)新興產業投資基金(有限合夥)	1,666	—
— 許昌海通創新股權投資基金合夥企業(有限合夥)	1,509	1,509
— 廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)	1,231	1,960
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	943	2
— 金華市海通重點產業發展招商併購投資合夥企業(有限合夥)	753	824
— 上海國盛集團有限公司	712	1,138
— 南昌政通股權投資基金合夥企業(有限合夥)	703	—
— 吉林海通創新衛星投資中心(有限合夥)	637	702
— 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司	59	1,925
— 光明食品(集團)有限公司	—	1,415
— 其他	7	323
利息淨收入		
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	2,021	183
— 上海國盛集團有限公司	954	345
— 遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司	638	57
— 上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	145	—
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	97	89
— 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)	71	166
— 光明食品(集團)有限公司	69	141
— 上海電氣控股集團有限公司	7	98
— 其他	112	91
投資收入及收益(淨額)		
— 上海國盛集團有限公司	482	(2,659)

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 63 關聯方交易 (續)

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
應收賬款		
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	38,574	38,574
— 遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司	26,089	31,389
— 遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業(有限合夥)	13,560	60
— 合肥海通中小基金合夥企業(有限合夥)	10,456	20,270
— 上海海通煥新私募投資基金合夥企業(有限合夥)	9,100	—
— 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)	4,625	—
— 安徽省皖能海通雙碳產業併購投資基金合夥企業(有限合夥)	3,730	—
— 上海浦東引領區海通私募投資基金合夥企業(有限合夥)	3,306	—
— 湖北省海通高品質轉型升級併購投資基金合夥企業(有限合夥)	2,088	—
— 金華市海通重點產業發展招商併購投資合夥企業(有限合夥)	798	—
— 上海國盛集團有限公司	75	495
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	60	60
— 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)	—	934
— 許昌海通創新股權投資基金合夥企業(有限合夥)	—	100



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 63 關聯方交易 (續)

	2024年 6月30日 (未經審計)	2023年 12月31日 (經審計)
代理買賣證券款		
— 廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)	(10,136)	(11)
— 海通齊東(威海)股權投資基金合夥企業(有限合夥)	(8,194)	(35,993)
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	(3,169)	(36,115)
— 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)	(2,510)	(196)
— 上海國盛集團有限公司	(1,815)	—
— 西安軍融電子衛星基金投資有限公司	(728)	—
— 上海電氣控股集團有限公司	(652)	(294)
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	(304)	(339,075)
— 海通(吉林)現代服務業創業投資基金合夥企業(有限合夥)	(268)	(267)
— 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司	(203)	(797)
— 光明食品(集團)有限公司	(14)	(39,949)
— 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)	(3)	(43,756)
— 上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)	—	(149,995)
— 遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司	—	(106,941)
— 其他	(6)	(6)
應付款項		
— 上海國盛集團有限公司	(51,033)	(51,614)
衍生金融資產		
— 上海國盛集團有限公司	1,525	1,591

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 63 關聯方交易（續）

本集團主要管理人員的薪酬如下：

	截至6月30日止六個月期間	
	2024 (未經審計)	2023 (未經審計)
短期福利：		
— 袍金、薪金、佣金及花紅	8,347	12,475
退休後福利：		
— 僱主向退休金計劃／年金計劃供款	392	432

### 64 金融風險管理

本集團的主要金融工具包括以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具及債務工具、以攤餘成本計量的債務工具、以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具、衍生金融工具、買入返售金融資產、其他貸款及應收款項、客戶貸款、孖展融資客戶墊款、應收賬款、其他應收、拆出資金、交易所儲備及保證金、結算備付金、受限制銀行存款、銀行結餘及現金、售後回租安排的應收款、借款、應付短期融資款、應付債券、賣出回購金融資產款、應付經紀業務客戶賬款及其他應付款項及預計費用等。有關金融工具的詳情已於各附註中披露。與此類金融工具和應收融資租賃款相關的風險包括市場風險（價格風險、貨幣風險及利率風險）、信用風險及流動性風險。管理層管理及監察風險，以確保及時有效地採取適當的措施。

截至2024年6月30日的六個月期間內，風險管理政策並無重大修改。簡明綜合財務資料並未包含所有金融風險管理資訊與披露，需要與截至2023年12月31日之綜合財務報告聯繫起來閱讀。



## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 65 金融資產及負債的公允價值

本集團部分金融資產和金融負債是以公允價值計量的。本集團董事建立了相關過程來確定公允價值計量中合適的估值技術和輸入值。本集團董事定期覆核相關過程以及公允價值確定的合適性。

#### 65.1 不按照公允價值計量的金融工具

下表概述了在本集團中期簡明綜合財務資料中未以公允價值列示、且賬面價值與預期公允價值有所偏差金融資產和負債。

	2024年6月30日 (未經審計)		2023年12月31日 (經審計)	
	賬面價值	公允價值	賬面價值	公允價值
<b>金融資產</b>				
以攤餘成本計量的債務工具	4,712,994	4,644,757	6,797,780	6,712,823
<b>金融負債</b>				
非可轉換債券	189,450,771	191,357,425	193,920,280	194,829,867

上述金融資產和金融負債的公允價值，採用廣泛使用的現金流貼現定價模型，分為第二層，主要輸入變量為貼現率，該變量反應了交易對手的信用風險。

除了以上列出的金融工具以外，本集團董事認為本集團財務狀況表內按照攤餘成本列賬的金融資產及負債賬面值與其公允價值相若。

#### 65.2 持續按照公允價值計量的金融工具

下表提供了在初步按公允價值確認後計量的金融工具分析，按照公允價值的可觀察程度分為第一至三層。

第一層金融工具：公允價值是相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價。

第二層金融工具：估值通常基於底層投資（投資組合中的債務證券或公開交易的權益工具）的公允價值計算得出，或由第三方（如中央結算公司）基於現金流貼現模型、近期交易價格或其他估值技術提供估值。所有重大輸入值均為市場中直接或間接可觀察的輸入值。

第三層金融工具：管理層自對手方處獲取估值報價，或使用估值技術確定其公允價值，包括現金流貼現分析、淨資產價值、市場可比法和期權定價模型等。這些金融工具的公允價值可能基於對估值有重大影響的不可觀測輸入值，因此本集團將其分為第三層。不可觀測輸入值包括加權平均資本成本、流動性貼現、市淨率等。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 65 金融資產及負債的公允價值 (續)

#### 65.2 持續按照公允價值計量的金融工具 (續)

下表呈列於2024年6月30日及2023年12月31日，按公允價值計量的金融資產和負債。

	第一層	第二層	第三層	合計
(未經審計)				
<b>於2024年6月30日</b>				
以公允價值計量且其變動計入損益的 金融資產				
— 債券投資	461,238	99,831,886	13,499,596	113,792,720
— 權益投資	9,012,901	177,572	14,658,116	23,848,589
— 基金	2,847,688	51,557,609	6,502,710	60,908,007
— 其他	—	8,075,509	4,773,460	12,848,969
以公允價值計量且其變動計入其他 全面收益的債務工具	1,377,949	55,278,515	556,783	57,213,247
以公允價值計量且其變動計入其他 全面收益的權益工具	9,572,231	—	844,195	10,416,426
衍生金融資產	180,727	615,796	1,283,319	2,079,842
	<b>23,452,734</b>	<b>215,536,887</b>	<b>42,118,179</b>	<b>281,107,800</b>
以公允價值計量且其變動計入損益的 金融負債				
— 交易性金融負債	945,626	1,221,607	—	2,167,233
— 指定為以公允價值計量且其變動 計入損益的金融負債	47,556	4,755,082	5,277,430	10,080,068
衍生金融負債	16,706	735,731	478,230	1,230,667
	<b>1,009,888</b>	<b>6,712,420</b>	<b>5,755,660</b>	<b>13,477,968</b>

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 65 金融資產及負債的公允價值 (續)

#### 65.2 持續按照公允價值計量的金融工具 (續)

	第一層	第二層	第三層	合計
(經審計)				
於2023年12月31日				
以公允價值計量且其變動計入損益的				
金融資產				
— 債券投資	614,516	110,063,862	13,516,111	124,194,489
— 權益投資	17,976,267	506,311	17,235,840	35,718,418
— 基金	12,252,818	30,414,864	6,447,678	49,115,360
— 其他	5	6,668,791	5,576,027	12,244,823
以公允價值計量且其變動計入其他				
全面收益的債務工具				
	936,773	59,865,736	508,238	61,310,747
以公允價值計量且其變動計入其他				
全面收益的權益工具				
	7,107,446	—	903,398	8,010,844
衍生金融資產				
	141,099	381,115	1,756,341	2,278,555
	39,028,924	207,900,679	45,943,633	292,873,236
以公允價值計量且其變動計入損益的				
金融負債				
— 交易性金融負債	1,630,647	538,685	—	2,169,332
— 指定為以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	27,718	7,754,226	10,502,129	18,284,073
衍生金融負債				
	2,899	514,796	673,250	1,190,945
	1,661,264	8,807,707	11,175,379	21,644,350

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 65 金融資產及負債的公允價值 (續)

#### 65.2 持續按照公允價值計量的金融工具 (續)

以第三層級公允價值計量的金融資產和金融負債調節。

於2024年6月30日 (未經審計)

	以公允價值 計量且其變動 計入損益的 金融資產	以公允價值 計量且其變動 計入其他綜合 收益的權益工具	以公允價值 計量且其變動 計入其他綜合 收益的債務工具	以公允價值 計量且其變動 計入損益的 金融負債	衍生金融 工具
於2023年12月31日及 2024年1月1日	42,775,656	903,398	508,238	(10,502,129)	1,083,091
轉入	674,121	-	9,104	-	135,730
(處置)/購買	(386,599)	-	37,055	2,789,467	(1,135,780)
轉出	(1,462,536)	-	-	-	(1,269)
其他損益	(2,166,760)	(59,203)	2,386	2,435,232	723,317
於2024年6月30日	39,433,882	844,195	556,783	(5,277,430)	805,089

於2023年12月31日 (經審計)

	以公允價值 計量且其變動 計入損益的 金融資產	以公允價值 計量且其變動 計入其他綜合 收益的權益工具	以公允價值 計量且其變動 計入其他綜合 收益的債務工具	以公允價值 計量且其變動 計入損益的 金融負債	衍生金融 工具
於2022年12月31日及 2023年1月1日	46,172,573	994,827	842,892	(18,864,214)	422,853
轉入	2,948,735	562	4,345	-	14,944
購買/(處置)	1,806,459	1,400	(294,127)	8,661,820	585,118
轉出	(2,892,258)	-	(137,106)	-	-
其他損益	(5,259,853)	(93,391)	92,234	(299,735)	60,176
於2023年12月31日	42,775,656	903,398	508,238	(10,502,129)	1,083,091

於2024年1月1日至6月30日期間，本集團將部分股權投資從第三層次轉移至第一層次，因該等證券的公允價值因禁售期屆滿而採用報價而非估值技術確定。此外，本集團亦將部分金融工具轉入第三層次，原因為該部分金融工具的估值技術方法轉變為基於重大不可觀察輸入值的估值技術方法(2023年度：同)。

於2024年1月1日至6月30日期間及2023年度，以公允價值計量的金融工具在第一層級與第二層級間的轉移並不顯著。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二四年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 66 金融資產轉移

#### 資產支持證券

本集團發行了以應收融資租賃款和售後回租安排的應收款為基礎資產的資產支持證券。由於本集團持有全部的次級資產並對該資產支持證券提供差額支付承諾，該等資產支持證券的基礎資產不符合金融資產終止確認條件，本集團未終止確認已轉移的應收融資租賃款和售後回租安排的應收款，並將收到的對價確認為應付債券。

截至2024年6月30日，本集團未予終止確認的已轉移應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的賬面價值為人民幣11,223百萬元(2023年12月31日：人民幣13,642百萬元)。

#### 資產支持票據

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

截至2024年6月30日，本集團已轉移但未予終止確認的應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的賬面價值為人民幣0元(2023年12月31日：人民幣1,862百萬元)。

#### 融出證券

本集團與客戶訂立協定，融出股票及基金予客戶，以客戶的證券或押金為抵押，由於本集團仍保留有關證券的全部風險，因此並未於資產負債表終止確認該等證券。於2024年6月30日，上述轉讓資產的賬面價值為人民幣2,077百萬元(2023年12月31日：人民幣2,197百萬元)。

### 67 報告期後事項

2024年8月29日，公司第八屆董事會第十二次會議審議通過《公司2024年中期利潤分配預案》，同意採用現金分紅的方式，向股東派發2024年中期股利，每10股分配人民幣0.3元(含稅)，分配總額為人民幣3.89億元(含稅)。根據公司2023年度股東大會對2024年度中期利潤分配事宜的相關授權，本次利潤分配方案無需提交股東大會審議。

除上述披露的事項外，本公司自2024年6月30日至本報告日無其他重大事項。