

公司代码：600837

公司简称：海通证券

# 海通证券股份有限公司 2017 年年度报告

## 重要提示

一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证年度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

### 二、未出席董事情况

| 未出席董事职务 | 未出席董事姓名 | 未出席董事的原因说明 | 被委托人姓名 |
|---------|---------|------------|--------|
| 董事      | 余莉萍     | 因公出差       | 张新玫    |
| 独立董事    | 冯仑      | 因公出差       | 肖遂宁    |

三、本公司按照中国企业会计准则和国际财务报告准则编制的年度财务报告，分别经立信会计师事务所（特殊普通合伙）和德勤·关黄陈会计师行为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人周杰、主管会计工作负责人李础前及会计机构负责人（会计主管人员）马中声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。除特别说明外，本报告所列数据以人民币为单位。

### 五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

2017年12月31日的A股和H股总股本11,501,700,000股为基数，公司向股权登记日登记在册的A股和H股股东每10股派发现金股利人民币2.30元（含税），共计分配现金股利人民币2,645,391,000.00元。本次现金股利分配后母公司的未分配利润17,817,845,957.76元结转下一年度。

### 六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告可能载有未来计划及发展战略等前瞻性陈述。本报告所载除过往事实陈述以外的一切陈述均为或视为前瞻性陈述。本公司及其任何附属公司并无责任因出现新数据而公开更新或修订任何前瞻性陈述。敬请投资者注意投资风险，不应过分倚赖前瞻性陈述。

报告期内本公司不存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况。

## 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

## 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

## 九、 重大风险提示

公司的业务高度依赖于业务所处国家或地区的证券市场状况，宏观经济环境、行业周期特征、市场发展程度、投资者行为以及国际经济形势等诸多因素都可能对公司经营业绩产生重大影响。

公司在经营活动中面临的主要风险包括：因国家宏观调控措施，与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等变动，从而对证券公司经营产生不利影响的政策性风险；因未能遵循法律法规、监管要求、规则、自律性组织制定的有关准则、以及适用于证券公司自身业务活动的行为准则，而可能遭受法律制裁或监管处罚、重大财务损失的合规风险；因发行人、借款人或者交易对手未能履行合同义务，或公司持有借款人或交易对手提交的抵押品价值不足而导致的信用风险；因市场价格（股票价格、利率、汇率或商品价格等）的不利变动而使公司自有资金投资的相关业务发生损失的市场风险；由于内部程序不力或过失、员工不恰当地业务操作、信息技术故障及外部事件导致的操作风险；公司发行的公司债、收益凭证、次级债、短期公司债等增加了杠杆率，使公司面临更大的流动性风险；因公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价的声誉风险。以上各类风险可能给公司的经营业绩和财务状况带来直接影响，同时由于风险之间存在一定关联性，这种影响还可能产生叠加效应。

针对上述风险的具体分析及公司已经和将要采取的具体措施，请投资者认真阅读本年度报告第四节“经营情况讨论与分析”中关于“可能面对的风险”部分内容，并特别注意上述风险因素。

## 十、 其他

适用 不适用

## 目录

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| 第一节  | 释义 .....               | 5   |
| 第二节  | 公司简介和主要财务指标.....       | 7   |
| 第三节  | 公司业务概要 .....           | 20  |
| 第四节  | 经营情况讨论与分析.....         | 24  |
| 第五节  | 重要事项 .....             | 50  |
| 第六节  | 普通股股份变动及股东情况.....      | 71  |
| 第七节  | 优先股相关情况.....           | 78  |
| 第八节  | 董事、监事、高级管理人员和员工情况..... | 79  |
| 第九节  | 公司治理 .....             | 114 |
| 第十节  | 公司债券相关情况.....          | 138 |
| 第十一节 | 财务报告 .....             | 145 |
| 第十二节 | 备查文件目录 .....           | 318 |
| 第十三节 | 证券公司信息披露.....          | 319 |

## 第一节 释义

### 一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

| 常用词语释义      |   |                                       |
|-------------|---|---------------------------------------|
| 本公司、公司或海通证券 | 指 | 海通证券股份有限公司                            |
| 集团或本集团      | 指 | 本公司及其子公司                              |
| 董事会         | 指 | 海通证券董事会                               |
| 监事会         | 指 | 海通证券监事会                               |
| 董事          | 指 | 海通证券董事                                |
| 监事          | 指 | 海通证券监事                                |
| 中国证监会       | 指 | 中国证券监督管理委员会                           |
| 上交所         | 指 | 上海证券交易所                               |
| 深交所         | 指 | 深圳证券交易所                               |
| 香港联交所       | 指 | 香港联合交易所有限公司                           |
| 全国社保基金      | 指 | 中国社会保障基金理事会                           |
| 香港上市规则      | 指 | 香港联交所证券上市规则                           |
| 标准守则        | 指 | 香港上市规则附录十所载之《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》      |
| 守则          | 指 | 香港上市规则附录十四《企业管治守则》及《企业管治报告》           |
| 证券及期货条例     | 指 | 香港法例第 571 章证券及期货条例（经不时修订、补充或以其他方式修改）  |
| 公司章程或章程     | 指 | 海通证券的公司章程                             |
| 中国          | 指 | 中华人民共和国，就本报告而言并不包括香港、澳门特别行政区及台湾       |
| 香港          | 指 | 中国香港特别行政区                             |
| 人民币         | 指 | 中国法定货币                                |
| 港元或港币       | 指 | 香港法定货币                                |
| 欧元          | 指 | 欧元区法定货币                               |
| 美元          | 指 | 美利坚合众国法定货币                            |
| A 股         | 指 | 本公司每股面值人民币 1.00 元的内资股，于上海证券交易所上市并进行交易 |
| H 股         | 指 | 本公司每股面值人民币 1.00 元的普通股，于香港联交所上市及以港元买卖  |
| QDII        | 指 | 合格境内机构投资者                             |
| QFII        | 指 | 合格境外机构投资者                             |
| RQFII       | 指 | 人民币合格境外机构投资者                          |
| IPO         | 指 | 首次公开发售                                |
| 新三板         | 指 | 全国中小企业股份转让系统                          |
| 报告期         | 指 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日      |
| 富国基金        | 指 | 富国基金管理有限公司                            |
| 海通银行        | 指 | 海通银行 (Haitong Bank, S.A)              |
| 海通开元        | 指 | 海通开元投资有限公司                            |
| 海通期货        | 指 | 海通期货股份有限公司                            |
| 海通创新证券      | 指 | 海通创新证券投资有限公司                          |
| 海通国际控股      | 指 | 海通国际控股有限公司                            |
| 海通国际证券      | 指 | 海通国际证券集团有限公司，于香港联交所上市，股份代             |

|              |   |                  |
|--------------|---|------------------|
|              |   | 号：665            |
| 恒信金融集团       | 指 | 海通恒信金融集团有限公司     |
| 海通恒信         | 指 | 海通恒信国际租赁股份有限公司   |
| 海通恒信融资租赁（上海） | 指 | 海通恒信融资租赁（上海）有限公司 |
| 海通恒信租赁（香港）   | 指 | 海通恒信租赁（香港）有限公司   |
| 海通恒运         | 指 | 海通恒运国际租赁有限公司     |
| 贵安恒信         | 指 | 贵安恒信融资租赁（上海）有限公司 |
| 海通恒信融资租赁控股   | 指 | 海通恒信融资租赁控股有限公司   |
| 海通新创         | 指 | 海通新创投资管理有限公司     |
| 海富产业         | 指 | 海富产业投资基金管理有限公司   |
| 海富通基金        | 指 | 海富通基金管理有限公司      |
| 海通资管公司       | 指 | 上海海通证券资产管理有限公司   |
| 富诚海富通        | 指 | 上海富诚海富通资产管理有限公司  |
| 海通资源         | 指 | 上海海通资源管理有限公司     |
| 上海惟泰置业       | 指 | 上海惟泰置业管理有限公司     |

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、 公司信息

|           |                              |
|-----------|------------------------------|
| 公司的中文名称   | 海通证券股份有限公司                   |
| 公司的中文简称   | 海通证券                         |
| 公司的外文名称   | Haitong Securities Co., Ltd. |
| 公司的外文名称缩写 | Haitong Securities           |
| 公司的法定代表人  | 周杰                           |
| 公司总经理     | 瞿秋平                          |
| 公司授权代表    | 周杰、姜诚君                       |
| 联席公司秘书    | 姜诚君、黄慧玲                      |

### 公司注册资本和净资本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

|      | 本报告期末             | 上年度末              |
|------|-------------------|-------------------|
| 注册资本 | 11,501,700,000.00 | 11,501,700,000.00 |
| 净资本  | 75,292,211,294.80 | 78,663,534,022.30 |

### 公司经营范围

证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；直接投资业务；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品；股票期权做市业务；中国证监会批准的其他业务，公司可以对外投资设立子公司从事金融产品等投资业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

### 公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

1. 网上证券委托业务资格（证监信息字 [2001] 3号）
2. 全国银行间同业拆借市场和债券市场从事拆借、购买债券、债券现券交易和债券回购业务资格（银办函 [2001] 819号）
3. 全国银行间同业拆借中心组织的拆借交易和债券交易资格（中汇交发 [2001] 306号）
4. 收购证券营业部资格（沪证机便 [2002] 090号）
5. 开放式证券投资基金代销业务资格（证监基金 [2002] 076号）
6. 从事相关创新活动试点证券公司（中证协函 [2005] 079号）
7. 从事短期融资券承销业务资格（银发 [2005] 173号）
8. 报价转让业务资格（中证协函 [2006] 3号）
9. 上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格（上证会函 [2007] 86号）
10. 中国银行间市场交易商协会资格（2007.08）
11. 作为合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务资格（证监许可 [2008] 146号）

12. 中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与者资格（中国结算函字[2008]22号）
13. 为期货公司提供中间介绍业务资格（沪证监机构字[2010]122号）
14. 开展直接投资业务试点资格（机构部部函[2008]421号）
15. 实施经纪人制度资格（沪证监机构字[2009]302号）
16. 向保险机构投资者提供交易单元的资格（保监资金审证[2009]1号）
17. 融资融券业务资格（证监许可[2010]315号）
18. 公司自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格（沪证监机构字[2010]372号）
19. 全国社保基金理事会签约券商资格（2011.08）
20. 基金评价业务资格（中证协发[2010]070号）
21. 资产管理业务参与股指期货交易资格（沪证监机构字[2011]237号）
22. 约定购回式证券交易业务试点（机构部部函[2011]512号）（上证交字[2011]37号）
23. 发行境外上市外资股资格（证监许可[2011]1821号）（H股）
24. 债券质押式报价回购业务试点（机构部部函[2011]585号）
25. 合伙企业独立托管业务试点（机构部部函[2012]686号）
26. 柜台市场交易业务（中证协函[2012]825号）
27. 转融通业务试点资格（中证金函[2012]113号）
28. 中小企业私募债券承销业务试点资格（中证协函[2012]561号）
29. 证券业务外汇经营（SC201307）
30. 发行短期融资券资格（证券投资基金机构监管部部函[2014]1551号）
31. 代销金融产品业务资格（沪证监机构字[2013]180号）
32. 开展客户证券资金消费支付服务试点资格（机构部部函[2013]741号）
33. 2013年第十一批保险兼业代理人资格（沪保监许可[2013]204号）
34. 开展黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务资格（机构部部函[2013]959号）
35. 证券投资基金托管资格（证监许可[2013]1643号）
36. 代理证券质押登记业务资格（2014.02）
37. 互联网证券业务试点（中证协函[2014]358号）
38. 黄金交易所会员资格（证书编号:T004）
39. 试点发行证券公司短期公司债券（上证短债[2014]4号）
40. 上市公司股权激励行权融资业务试点（深圳函[2014]321号）
41. 股票期权做市业务资格（证监许可[2015]153号）
42. 上证50ETF期权合约品种的主做市商（上证函[2015]214号）
43. 期权结算业务资格（中国结算函字[2015]20号）
44. 期货会员证书（证书编号：NO. G02008）
45. 境外自营业务资格（机构部部函[2015]1204号）

- 46. 单向视频开户创新方案的无异议函（中国结算办字[2015]461号）
- 47. 银行间黄金询价业务资格（上金交发[2015]120号）
- 48. 非金融企业债务融资工具主承销业务资质(2016.08)
- 49. 票据交易资质（银办发[2016]224号）
- 50. 信用风险缓释工具相关业务资格（2017.01）

公司具备上交所和深交所的会员资格，中国证券登记结算有限责任公司权证结算业务资格。

公司附属子公司均依法，或经相关监管部门批准获得相应的业务资格后开展经营业务活动。

## 二、 联系人和联系方式

|      | 董事会秘书                              | 证券事务代表                             |
|------|------------------------------------|------------------------------------|
| 姓名   | 姜诚君                                | 孙涛                                 |
| 联系地址 | 中国上海市广东路689号海通证券大厦12层（邮政编码：200001） | 中国上海市广东路689号海通证券大厦12层（邮政编码：200001） |
| 电话   | 8621-23219000                      | 8621-23219000                      |
| 传真   | 8621-63410627                      | 8621-63410627                      |
| 电子信箱 | jiangcj@htsec.com                  | sunt@htsec.com                     |

## 三、 基本情况简介

|              |   |
|--------------|---|
| 公司注册地址       | 中国上海市广东路689号  |
| 公司注册地址的邮政编码  | 200001  |
| 公司办公地址       | 中国上海市广东路689号  |
| 公司办公地址的邮政编码  | 200001  |
| 公司网址         | <a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>   |
| 电子信箱         | haitong@htsec.com   |
| 香港主要营业地址     | 香港中环德辅道中189号李宝椿大厦21楼                                      |
| 报告期内变更情况查询索引 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> |
| 营业执照统一社会信用代码 | 9131000013220921X6  |
| 合规总监         | 王建业   |

## 四、 信息披露及备置地点

|                     |   |
|---------------------|---|
| 公司选定的信息披露媒体名称       | 中国证券报、上海证券报、证券时报  |
| 登载年度报告的中国证监会指定网站的网址 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>   |
| 登载年度报告的香港联交所指定的网址   | <a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a> |
| 公司年度报告备置地点          | 中国上海市广东路689号海通证券大厦12层董事会办公室                                 |

## 五、 公司股票简况

| 公司股票简况 |         |      |        |         |                     |
|--------|---------|------|--------|---------|---------------------|
| 股票种类   | 股票上市交易所 | 股票简称 | 股票代码   | 变更前股票简称 | 股份登记处               |
| A股     | 上交所     | 海通证券 | 600837 | /       | 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 |
| H股     | 香港联交所   | 海通证券 | 6837   | /       | 香港中央证券登记有限公司        |

## 六、公司其他情况

### (一) 公司历史沿革的情况，主要包括以前年度经历的改制重组、增资扩股等情况

√适用 □不适用

海通证券为上交所上市公司上海市都市农商社股份有限公司（以下简称“都市股份”）重大资产出售暨吸收合并海通证券后的存续公司。2007年7月6日，存续公司在上海市工商行政管理局办理了工商登记手续，合并后原海通证券依法注销，存续公司更名为海通证券。

海通证券的历史沿革：

海通证券成立于1988年，注册资本人民币1000万元，注册地为上海，当时名称为上海海通证券公司，主要股东为交通银行上海分行。经营范围为主营经销和代理发行各类有价证券，兼营证券业务咨询，承办各类有价证券的代保管、过户、还本付息等业务，办理证券的代理投资业务及经中国人民银行批准的其他有关业务。

经中国人民银行《关于上海海通证券公司改制问题的批复》（银复[1994]5号）的批准，1994年9月27日，上海海通证券公司改制成为海通证券有限公司，注册资本人民币100,000万元，经营范围变更为：代理证券发行、还本付息业务；自营、代理证券买卖业务；办理证券的代保管和鉴证业务；接受委托代收证券本息和红利、办理证券的登记、过户和清算；证券投资咨询和投资基金业务；经人民银行批准经营的其它业务。

经中国证监会《关于核准海通证券有限公司增资扩股方案和综合类证券公司的批复》（证监机构字[2000]296号）的批准，2000年12月29日，海通证券有限公司完成增资扩股，公司资本金增至人民币374,692.80万元，经营范围为：代理证券发行业务；自营、代理证券买卖业务；代理证券还本付息业务；办理证券的代保管和证券鉴证业务；接受委托代收证券本息和红利，接受委托办理证券的登记、过户和清算；证券投资咨询业务；证券投资基金业务。

经中国证监会《关于海通证券有限公司整体变更为股份有限公司的批复》（证监机构字[2001]278号）的批准，2002年1月28日，海通证券有限公司整体变更为股份有限公司，海通证券有限公司更名为“海通证券股份有限公司”，注册资本为人民币4,006,093,000元。

经中国证监会《关于同意海通证券股份有限公司增资扩股的批复》（证监机构字[2002]329号）的批准，2002年11月1日，海通证券注册资本金增至8,734,438,870元人民币。公司经营范围变更为：证券（含境内上市外资股）的代理买卖，代理证券的还本付息、分红派息，证券代保管、鉴证，代理登记开户，证券的自营业买卖，证券（含境内上市外资股）的承销（含主承销），证券投资咨询（含财务顾问），受托投资管理，中国证监会批准的其他业务。

2005年5月，公司获创新试点类证券公司。

经中国证监会证监公司字[2007]90号文件核准，2007年6月7日，都市股份将全部资产与负债出售予子公司控股股东光明食品（集团）有限公司，同时吸收合并原海通证券。吸收合并完成后，存续公司更名为海通证券股份有限公司，并承继了原海通证券的全部业务，原海通证券的职工、资产与负债由存续公司承接。2007年6月29日，新增股份完成中国证券登记结算有限责任公司上海

分公司网下登记工作,2007年7月6日,存续公司在上海市工商行政管理局办理工商登记变更手续,注册资本变更为人民币3,389,272,910元。

2007年7月31日,海通证券在上交所挂牌上市。

经中国证监会《关于核准海通证券股份有限公司非公开发行股票的通知》(证监发行字[2007]368号)文件核准,公司于2007年11月21日完成非公开发行股票,公司的注册资本、实收资本由人民币3,389,272,910元变更登记为人民币4,113,910,590元。

公司于2008年5月5日召开了2007年度股东大会,审议通过了《关于公司2007年度进行利润分配的预案》,以2007年12月31日总股本4,113,910,590股为基数,向全体股东每10股派发现金股利1.00元(含税),派送股票股利3股(含税),以资本公积向全体股东每10股转增7股,公司派送股票股利和资本公积转增股本后,总股本由4,113,910,590股变更为8,227,821,180股。该分配方案于2008年5月28日实施完毕。

2012年4月27日,本公司发行的1,229,400,000股境外上市外资股(H股),以及本公司相关25家国有股东为进行国有股减持而划转给全国社保基金并转为境外上市外资股的122,940,000股H股,合计1,352,340,000股H股,于香港联交所主板挂牌并开始上市交易。2012年5月19日,联席全球协调人就本公司H股首次公开发售部分行使超额配售权,本公司额外发行127,500,000股H股,并于2012年5月22日在香港联交所主板上市交易。本公司相关国有股东再次进行国有股减持,即按部分行使超额配售权而额外发行的H股数量的10%,将其合计持有的12,750,000股本公司内资股(A股)划转由全国社保基金以H股的形式持有。

2015年2月9日,本公司召开2015年第一次临时股东大会、2015年第一次A股类别股东会议与2015年第一次H股类别股东会议,审议通过了《关于公司新增发行H股方案的议案》。2015年5月,公司收到中国证监会《关于核准海通证券股份有限公司增发境外上市外资股的批复》(证监许可[2015]811号),核准公司增发不超过1,916,978,820股境外上市外资股,每股面值人民币1元,全部为普通股。2015年5月8日,公司获得香港联交所批准新H股于香港联交所上市及买卖。公司于2015年5月29日完成本次H股发行,发行股数为1,916,978,820股,其中1,048,141,220股新H股的交割于2015年5月15日完成,868,837,600股新H股的交割于2015年5月29日完成。

本公司增发H股发行完成后,股份总数为11,501,700,000股,其中:A股8,092,131,180股,H股3,409,568,820股,H股股票简称为“海通证券”(中文)、“HAITONG SEC”(英文),H股股票代码为“6837”。

## (二) 公司组织机构情况

√适用 □不适用

公司依据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《证券公司内部控制指引》等有关法律法规及《公司章程》的规定,规范运作,构建了科学规范的法人治理,公司“三会一

层”（股东大会、董事会、监事会和经营层）权限职责清晰明确。同时，公司还建立了符合公司发展需要的组织架构和运行机制。

#### 1. 公司的组织结构图（见本报告附录一）

#### 2. 公司主要控股子公司和参股公司情况

##### （1）海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

成立日期：2003 年 4 月 18 日

注册资本：人民币 3 亿元

持股比例：51%

法定代表人：张文伟

联系电话：021-38650999

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营）

##### （2）富国基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 16-17 楼

成立日期：1999 年 4 月 13 日

注册资本：人民币 3 亿元

持股比例：27.775%

法定代表人：薛爱东

联系电话：021-20361818

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营）

##### （3）海富产业投资基金管理有限公司

注册地址：上海市静安区万航渡路 888 弄 8 号 A 室

成立日期：2004 年 10 月 18 日

注册资本：人民币 1 亿元

持股比例：67%

法定代表人：李保国

联系电话：021-62883005

经营范围：产业投资基金管理；投资咨询；发起设立投资基金。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营）

##### （4）海通期货股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1589 号 17 楼，6 楼 01、03、04 单元，25 楼、2 楼 05 单元

成立日期：1993 年 3 月 18 日

注册资本：人民币 13 亿元

持股比例：66.667%

法定代表人：吴红松

联系电话：021-61871688

经营范围：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理，基金销售。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后开展经营）

#### **(5) 海通国际控股有限公司**

注册地址：香港中环德辅道中 189 号李宝椿大厦 22 楼

成立日期：2007 年 7 月 24 日

法定股本：港币 88.5 亿元

已发行股本：港币 88.5 亿元

已缴股本：港币 88.5 亿元

持股比例：100%

联系电话：852-39268888

业务性质：投资控股

经营范围：投资控股，通过设立不同子公司分别经营香港证券监管规则允许的经纪业务、企业融资和资产管理等业务，以及其他业务。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后开展经营）

#### **(6) 海通开元投资有限公司**

注册地址：上海市广东路 689 号 26 楼 07-12 室

成立日期：2008 年 10 月 23 日

注册资本：人民币 106.5 亿元

持股比例：100%

法定代表人：张向阳

联系电话：021-63410311

经营范围：使用自有资金或设立直投资基金，对企业进行股权投资与股权相关的债权投资，或投资于与股权投资相关的其他投资基金；为客户提供与股权投资相关的投资顾问、投资管理、财务顾问服务；经中国证监会认可开展的其他业务。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后开展经营）

#### **(7) 海通创新证券投资有限公司**

注册地址：上海市静安区常德路 774 号 2 幢 107N 室

成立日期：2012 年 4 月 24 日

注册资本：人民币 35 亿元

持股比例：100%

法定代表人：时建龙

联系电话：021-23219000

经营范围：金融产品投资，证券投资，投资咨询，投资管理。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

**(8) 上海海通证券资产管理有限公司**

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层第 01-12 室单元

成立日期：2012 年 6 月 26 日

注册资本：人民币 22 亿元

持股比例：100%

法定代表人：裴长江

联系电话：021-23219000

经营范围：证券资产管理业务。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

**(9) 上海惟泰置业管理有限公司**

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号三层

成立日期：2014 年 1 月 8 日

注册资本：人民币 1,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：龚志宏

联系电话：021-23219000

经营范围：房地产开发经营、物业管理。（依法需经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

**(三) 公司证券营业部的数量和分布情况**

√适用 □不适用

截至报告期末，公司共有分公司 27 家，证券营业部 290 家。（见本报告附录二）

**七、其他相关资料**

|                 |             |   |
|-----------------|-------------|---|
| 公司聘请的会计师事务所（境内） | 名称          | 立信会计师事务所（特殊普通合伙）                        |
|                 | 办公地址        | 上海市南京东路 61 号 4 楼                        |
|                 | 签字会计师姓名     | 黄晔、迟媛                                   |
| 公司聘请的会计师事务所（境外） | 名称          | 德勤会计师事务所（德勤·关黄陈方会计师行和德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
|                 | 办公地址        | 香港金钟道 88 号太古广场一座 35 楼                   |
|                 | 签字会计师姓名     | 文启斯                                     |
| 中国内地法律顾问        | 国浩律师（上海）事务所 |   |
| 香港法律顾问          | 高伟绅律师行      |   |

## 八、近三年主要会计数据和财务指标

### (一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

| 主要会计数据                | 2017 年             | 2016 年             | 本期比上年同期增减 (%)   | 2015 年             |
|-----------------------|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| 营业收入                  | 28,221,667,163.35  | 28,011,014,594.51  | 0.75            | 38,086,267,720.37  |
| 归属于母公司股东的净利润          | 8,618,423,293.06   | 8,043,334,519.30   | 7.15            | 15,838,850,897.61  |
| 归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 8,095,806,771.88   | 7,673,813,008.18   | 5.50            | 15,737,911,809.89  |
| 经营活动产生的现金流量净额         | -58,816,601,545.90 | -50,177,681,468.50 |                 | 15,582,998,300.08  |
| 其他综合收益的税后净额           | 793,728,726.62     | 281,583,321.87     | 181.88          | 695,633,444.61     |
|                       | 2017 年末            | 2016 年末            | 本期末比上年同期末增减 (%) | 2015 年末            |
| 资产总额                  | 534,706,332,789.81 | 560,865,846,150.32 | -4.66           | 576,448,892,328.27 |
| 负债总额                  | 405,012,028,902.49 | 438,907,444,778.41 | -7.72           | 459,521,221,374.63 |
| 归属于母公司股东的权益           | 117,755,478,685.09 | 110,130,127,286.66 | 6.92            | 107,694,544,738.79 |
| 所有者权益总额               | 129,694,303,887.32 | 121,958,401,371.91 | 6.34            | 116,927,670,953.64 |

### (二) 主要财务指标

| 主要财务指标                   | 2017 年 | 2016 年 | 本期比上年同期增减 (%) | 2015 年 |
|--------------------------|--------|--------|---------------|--------|
| 基本每股收益 (元 / 股)           | 0.75   | 0.70   | 7.14          | 1.48   |
| 稀释每股收益 (元 / 股)           | 0.74   | 0.70   | 5.71          | 1.48   |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益 (元 / 股) | 0.70   | 0.67   | 4.48          | 1.47   |
| 加权平均净资产收益率 (%)           | 7.56   | 7.39   | 增加 0.17 个百分点  | 17.56  |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率 (%) | 7.11   | 7.05   | 增加 0.06 个百分点  | 17.45  |

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用  不适用

### (三) 母公司的净资本及风险控制指标

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 本报告期末              | 上年度末               |
|-------------|--------------------|--------------------|
| 净资本         | 75,292,211,294.80  | 78,663,534,022.30  |
| 净资产         | 106,859,158,264.85 | 101,244,982,020.44 |
| 风险覆盖率 (%)   | 249.31             | 258.90             |
| 资本杠杆率 (%)   | 27.06              | 27.64              |
| 流动性覆盖率 (%)  | 188.90             | 155.23             |
| 净稳定资金率 (%)  | 135.49             | 131.65             |
| 净资本/净资产 (%) | 70.46              | 77.70              |
| 净资本/负债 (%)  | 50.16              | 52.56              |

|                       |       |       |
|-----------------------|-------|-------|
| 净资产/负债 (%)            | 71.20 | 67.65 |
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本 (%)  | 30.78 | 29.66 |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%) | 57.72 | 80.98 |

九、境内外会计准则下会计数据差异

(一) 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

适用 不适用

(二) 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

适用 不适用

(三) 境内外会计准则差异的说明:

适用 不适用

十、2017 年分季度主要财务数据

单位: 元 币种: 人民币

|                         | 第一季度<br>(1-3 月份)   | 第二季度<br>(4-6 月份)  | 第三季度<br>(7-9 月份)   | 第四季度<br>(10-12 月份) |
|-------------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| 营业收入                    | 6,442,835,734.86   | 6,371,120,330.70  | 6,441,489,110.85   | 8,966,221,986.94   |
| 归属于上市公司股东的净利润           | 2,240,164,455.28   | 1,783,313,257.44  | 2,121,786,384.61   | 2,473,159,195.73   |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润 | 1,936,143,339.42   | 1,689,141,104.06  | 2,101,308,763.79   | 2,369,213,564.61   |
| 经营活动产生的现金流量净额           | -22,577,833,626.12 | 13,306,813,131.57 | -25,397,119,218.09 | -24,148,461,833.26 |

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

| 非经常性损益项目   | 2017 年金额       | 2016 年金额        | 2015 年金额       |
|--|----------------|-----------------|----------------|
| 非流动资产处置损益  | -9,111,469.61  | -1,193,151.89   | -2,460,153.32  |
| 计入当期损益的政府补助, 但与公司正常经营业务密切相关, 符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外 | 648,512,045.00 | 568,028,571.86  | 249,572,706.80 |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益  | -560,541.57    | -43,992,892.60  | 1,500,000.00   |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出   | -43,309,881.60 | -10,131,955.91  | -82,221,497.58 |
| 少数股东权益影响额  | -877,137.78    | -4,663,024.80   | -2,285,397.61  |
| 所得税影响额   | -72,036,493.26 | -138,526,035.54 | -63,166,570.57 |
| 合计   | 522,616,521.18 | 369,521,511.12  | 100,939,087.72 |

十二、采用公允价值计量的项目

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目名称                   | 期初余额               | 期末余额               | 当期变动               | 对当期利润的影响金额        |
|------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 92,347,493,554.98  | 99,856,694,835.91  | 7,509,201,280.93   | 7,033,219,617.43  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 38,639,631,004.32  | 20,743,499,166.70  | -17,896,131,837.62 | -518,956,708.40   |
| 可供出售金融资产               | 53,318,414,541.31  | 41,228,756,005.51  | -12,089,658,535.80 | 2,861,418,699.43  |
| 衍生金融工具                 | 1,341,062,066.85   | -884,841,975.92    | -2,225,904,042.77  | -1,023,330,927.97 |
| 合计                     | 185,646,601,167.46 | 160,944,108,032.20 | -24,702,493,135.26 | 8,352,350,680.49  |

十三、按《证券公司年度报告内容与格式准则（2013年修订）》（中国证监会公告【2013】41号），公司合并财务报表和母公司财务报表主要项目会计数据

√适用 □不适用

1. 合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 2017年12月31日        | 2016年12月31日        | 增减幅度     |
|------------------------|--------------------|--------------------|----------|
| 货币资金                   | 103,795,726,857.30 | 121,024,751,374.94 | -14.24%  |
| 结算备付金                  | 7,982,728,644.47   | 12,191,899,273.79  | -34.52%  |
| 融出资金                   | 61,560,952,642.71  | 63,212,919,802.15  | -2.61%   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 99,856,694,835.91  | 92,347,493,554.98  | 8.13%    |
| 衍生金融资产                 | 2,610,612,302.28   | 3,935,071,348.81   | -33.66%  |
| 买入返售金融资产               | 96,549,868,542.17  | 84,523,225,559.75  | 14.23%   |
| 应收利息                   | 3,703,898,935.74   | 7,422,060,199.20   | -50.10%  |
| 可供出售金融资产               | 41,228,756,005.51  | 58,028,837,828.19  | -28.95%  |
| 固定资产                   | 2,657,276,109.00   | 1,420,756,931.36   | 87.03%   |
| 无形资产                   | 1,316,011,591.12   | 468,009,610.75     | 181.19%  |
| 其他资产                   | 79,852,780,202.94  | 83,885,832,076.72  | -4.81%   |
| 短期借款                   | 30,712,830,026.17  | 38,564,767,181.01  | -20.36%  |
| 应付短期融资款                | 29,426,762,416.95  | 19,864,117,000.00  | 48.14%   |
| 拆入资金                   | 11,811,638,917.40  | 8,809,461,725.51   | 34.08%   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 20,743,499,166.70  | 38,639,631,004.32  | -46.32%  |
| 衍生金融负债                 | 3,495,454,278.20   | 2,594,009,281.96   | 34.75%   |
| 卖出回购金融资产款              | 33,045,726,729.85  | 43,731,726,557.56  | -24.44%  |
| 代理买卖证券款                | 83,774,388,361.26  | 104,059,286,700.58 | -19.49%  |
| 代理承销证券款                | -                  | 1,054,351,430.62   | -100.00% |
| 预计负债                   | 167,342,904.85     | 124,621,521.35     | 34.28%   |
| 长期借款                   | 30,609,159,576.41  | 22,583,788,217.83  | 35.54%   |
| 应付债券                   | 130,158,268,817.49 | 128,295,192,262.28 | 1.45%    |
| 递延所得税负债                | 867,319,662.68     | 557,471,978.61     | 55.58%   |
| 资本公积                   | 56,357,979,615.67  | 56,338,469,573.57  | 0.03%    |
| 其他综合收益                 | 1,626,529,293.67   | 108,737,230.40     | 1395.83% |
| 未分配利润                  | 30,297,545,652.24  | 26,331,639,342.89  | 15.06%   |

| 项目        | 2017年度            | 上年同期              | 增减幅度    |
|-----------|-------------------|-------------------|---------|
| 手续费及佣金净收入 | 9,556,198,727.08  | 10,965,008,854.57 | -12.85% |
| 利息净收入     | 3,665,925,531.96  | 3,839,610,355.40  | -4.52%  |
| 投资收益      | 11,365,519,110.20 | 6,539,692,047.35  | 73.79%  |

|             |                   |                   |          |
|-------------|-------------------|-------------------|----------|
| 公允价值变动收益    | -1,329,410,866.60 | -231,333,741.19   | -        |
| 汇兑收益        | -225,471,617.33   | 58,149,350.76     | -487.75% |
| 其他业务收入      | 5,195,688,687.62  | 6,840,538,439.43  | -24.05%  |
| 税金及附加       | 165,972,927.57    | 490,685,726.69    | -66.18%  |
| 业务及管理费      | 9,755,117,004.73  | 9,563,542,327.78  | 2.00%    |
| 资产减值损失      | 1,686,658,289.93  | 1,419,492,720.73  | 18.82%   |
| 其他业务成本      | 4,326,834,499.27  | 5,888,928,108.28  | -26.53%  |
| 利润总额        | 12,889,397,003.65 | 11,161,726,994.30 | 15.48%   |
| 所得税费用       | 3,013,794,133.39  | 2,231,208,739.89  | 35.07%   |
| 净利润         | 9,875,602,870.26  | 8,930,518,254.41  | 10.58%   |
| 其他综合收益的税后净额 | 793,728,726.62    | 281,583,321.87    | 181.88%  |
| 综合收益总额      | 10,669,331,596.88 | 9,212,101,576.28  | 15.82%   |

## 2. 母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 2017年12月31日       | 2016年12月31日       | 增减幅度     |
|------------------------|-------------------|-------------------|----------|
| 货币资金                   | 59,147,193,318.25 | 76,058,406,010.83 | -22.23%  |
| 结算备付金                  | 9,649,410,234.03  | 13,863,883,065.10 | -30.40%  |
| 融出资金                   | 47,877,760,395.98 | 44,591,605,611.47 | 7.37%    |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 48,977,872,139.63 | 45,896,579,362.00 | 6.71%    |
| 买入返售金融资产               | 88,857,913,847.45 | 66,452,306,595.87 | 33.72%   |
| 应收款项                   | 685,159,660.56    | 169,280,724.98    | 304.75%  |
| 存出保证金                  | 1,062,287,471.94  | 729,817,647.69    | 45.56%   |
| 可供出售金融资产               | 20,737,083,721.40 | 24,600,315,041.79 | -15.70%  |
| 长期股权投资                 | 26,812,249,257.34 | 25,947,897,592.75 | 3.33%    |
| 在建工程                   | 19,945,291.71     | 32,932,351.33     | -39.44%  |
| 其他资产                   | 783,408,365.14    | 15,045,310,734.90 | -94.79%  |
| 应付短期融资款                | 21,897,221,000.00 | 18,434,617,000.00 | 18.78%   |
| 拆入资金                   | 5,450,000,000.00  | 1,900,000,000.00  | 186.84%  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 2,276,176,292.18  | 4,722,901,220.00  | -51.81%  |
| 衍生金融负债                 | 625,529,666.41    | 225,340,234.48    | 177.59%  |
| 卖出回购金融资产款              | 21,454,363,748.71 | 28,230,549,493.15 | -24.00%  |
| 代理买卖证券款                | 51,325,229,036.42 | 65,268,025,603.79 | -21.36%  |
| 代理承销证券款                | -                 | 1,054,351,430.62  | -100.00% |
| 长期借款                   | 1,652,191,890.00  | 1,246,099,790.00  | 32.59%   |
| 应付债券                   | 88,446,966,516.88 | 86,818,313,569.28 | 1.88%    |
| 递延所得税负债                | 598,832,864.85    | 66,258,353.82     | 803.78%  |
| 资本公积                   | 56,486,198,528.36 | 56,486,198,528.36 | 0.00%    |
| 其他综合收益                 | 1,296,283,785.15  | -660,702,446.08   | -296.20% |
| 未分配利润                  | 20,463,236,957.76 | 18,662,316,148.54 | 9.65%    |

| 项目        | 2017年度           | 上年同期             | 增减幅度     |
|-----------|------------------|------------------|----------|
| 手续费及佣金净收入 | 5,520,637,574.04 | 7,445,029,364.93 | -25.85%  |
| 利息净收入     | 2,512,339,736.69 | 2,670,773,581.22 | -5.93%   |
| 投资收益      | 4,056,996,004.20 | 2,455,750,159.16 | 65.20%   |
| 税金及附加     | 98,389,456.80    | 379,440,582.29   | -74.07%  |
| 业务及管理费    | 4,925,505,819.56 | 5,306,477,838.41 | -7.18%   |
| 资产减值损失    | 289,052,846.02   | 12,929,067.97    | 2135.68% |
| 营业外支出     | 22,775,004.09    | 12,237,664.88    | 86.11%   |

|             |                  |                  |        |
|-------------|------------------|------------------|--------|
| 利润总额        | 7,523,084,573.50 | 6,823,864,362.33 | 10.25% |
| 所得税费用       | 1,335,520,560.32 | 1,099,188,968.48 | 21.50% |
| 净利润         | 6,187,564,013.18 | 5,724,675,393.85 | 8.09%  |
| 其他综合收益的税后净额 | 1,956,986,231.23 | -423,608,955.97  | -      |
| 综合收益总额      | 8,144,550,244.41 | 5,301,066,437.88 | 53.64% |

### 第三节 公司业务概要

#### 一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

##### 1. 报告期内公司从事的主要业务及经营模式

公司主要业务有证券及期货经纪业务、投资银行业务、自营业务、直投业务、资产管理业务、融资租赁业务和海外业务。

证券及期货经纪业务是指公司接受客户委托，按照客户要求，代理客户买卖证券、期货，并向客户收取佣金的业务。公司将客户分为零售客户、高净值个人客户、企业客户和金融机构客户，根据不同类型客户差异化的需求提供针对性的综合服务解决方案。

投资银行业务是指公司为企业客户在资本市场上发行股票、债券等筹集长期资金提供中介服务，为企业客户优化资本结构、进行产业整合、促进业务转型提供财务顾问服务，并按合同约定收取费用的业务。公司按业务性质不同，将投资银行业务分为股权融资业务、债券融资业务、并购融资业务、新三板与结构融资业务，公司致立于为客户提供一站式的境内外投资银行服务。

自营业务是指公司以自有资金作为本金在资本市场进行运作，以期获得投资收益的业务。按照投资标的的不同，公司将自营业务分为权益类投资、固定收益类投资和另类投资。

直投业务是指公司以自有资金作为本金对非公开发行公司的股权进行投资，投资收益通过以后企业的上市或购并时出售股权兑现的业务。

资产管理业务是指公司作为资产管理人，根据资产管理合同约定的方式、条件、要求及限制，对客户资产进行经营运作，为客户提供证券及其它金融产品的投资管理服务的行为。海通资管公司的经营范围包括定向业务、集合业务、专项业务、QDII业务和创新业务等；海富通基金、富国基金的主要业务包括共同基金（含QDII）管理业务、企业年金、全国社保基金和特定客户资产管理等，为投资者提供专业化的基金投资理财服务；公司还具备一批私募股权投资业务（PE）的专业投资管理平台，经营范围为产业投资基金管理、投资咨询、发起设立投资基金等。

融资租赁业务是指公司作为出租人向承租人交付特定商品的使用权，而向承租人收取一定费用的业务。公司租赁业务主要由海通恒信经营，海通恒信目前在基础设施、交通物流、工业、教育、医疗、建筑与房地产及化工等诸多行业领域开展业务，充分运用丰富的行业经验及市场渠道，与国内外知名设备厂商展开合作，为客户的业务发展提供全面的融资解决方案及服务。近两年来，积极开拓有券商特色的融资租赁业务模式，推出了与股权、债权相结合的多样化产品组合，为客户提供更多的结构化创新融资方案。

公司目前海外业务的经营主体主要包括海通国际证券和海通银行。海通国际证券以企业融资、经纪及孖展融资、投资管理、固定收益、外汇及商品、结构性投融资、现金股票及股票衍生产品等业务板块为核心，服务全球及本地企业客户、机构客户和零售客户三大客户群；海通银行拥有超过26年历史，为全球企业及机构客户提供广泛的投资银行服务，海通银行的主要业务地点覆盖

葡萄牙、巴西、墨西哥、波兰、西班牙，在证券、研究、资本市场、兼并收购、财务咨询和项目融资等方面具有专长。

## 2. 报告期内公司所属行业的发展阶段、周期性特点以及公司所处的行业地位

2017年，国内股市表现分化，以蓝筹为代表的沪深300指数全年上涨22%，创业板指数全年下跌11%，A股全年交易量229万亿元(双边)，同比下降11%。在去杠杆、控总量、调结构的宏观调控政策影响下，国内债券市场继续走弱，中债综合净价指数全年下跌4.2%；直接融资规模有所萎缩，股权融资规模1.6万亿元，同比下降16%；债券融资规模20.6万亿元，同比下降12%，其中金融类和企业类债券融资规模12.2万亿元，同比下降15%；ABS发行规模1.49万亿元，同比增长65%。从行业竞争和发展态势来看，行业内各家券商均加紧推进资本补充，行业资产分布保持稳定，但营收利润逐渐向大型券商集中；传统业务（经纪、自营和承销保荐）收入占比下降，战略性业务（财富管理、资产管理、主经纪商和国际业务等）布局加快。随着宏观降杠杆的不断推进，金融服务实体经济发展要求的不断强化，资本市场仍将面对较大的发展机遇，行业发展前景向好。

2017年，公司继续坚持以客户为中心，以经纪、投资银行、资产管理等卖方业务为本体，以资本型中介业务和投资业务为两翼，以创新和国际化为驱动力，坚持集团化、国际化、信息化的发展方向，不断巩固战略先发优势，逐步释放战略储备，扎实推进各项工作，取得了良好的经营成绩。

报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

适用 不适用

期末余额占总资产 5%以上且当期变动超过 30%的主要资产变化，详见第四节二、（三）资产、负债情况分析

其中：海外资产 148,608,587,501.66(单位：元 币种：人民币)，占总资产的比例为 27.79%。

## 二、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

在长期经营过程中，公司逐步形成了具有自身特色的六大核心竞争力。

### 1. 雄厚的资本实力

2007 至 2017 年，公司抓住市场机遇，通过 A+H 股上市、增发等多次战略性股权融资和债券融资，迅速增强了资本实力。2017 年，公司通过发行公司债、次级债、ABS、并购贷款、收益凭证、收益权转让、转融资等方式，在有效控制融资成本的同时，构建了多元化的融资渠道，为公司业务发展和重大战略事项推进提供了充足的资金保障。充足的资本为公司转型发展创造了先发优势。

### 2. 卓越的综合金融服务平台

以证券母公司业务出发，通过设立、收购专业子公司，公司不断扩充金融产品服务范围，延伸金融服务边界，已基本建成涵盖经纪、投行、资产管理、私募股权投资、另类投资、融资租赁等多个业务领域的金融服务集团。公司经纪业务客户基础雄厚；投资银行业务排名行业前列；资产管理业务主动管理规模持续提升；私募股权投资业务规模及利润贡献行业领先；在港业务各项

数据排名行业首位；融资租赁业务确立行业领先地位；研究服务市场影响力强。综合化的金融平台具有强大的规模效应和交叉销售潜力，为业务发展提供了有力支撑，为客户综合金融服务创造条件。

### 3. 广泛的营业网点以及扎实的客户基础

截至 2017 年 12 月 31 日，公司在中国境内拥有 331 家证券及期货营业部（其中证券营业部 290 家，期货营业部 41 家），遍布 30 个省、直辖市和自治区；在亚洲、欧洲、北美洲、南美洲等 14 个国家和地区设有分行、子公司或代表处。凭借遍布全国的营业网点和极具战略性的国际化布局，公司得以建立庞大且稳定的客户群，截至 2017 年 12 月 31 日，公司在境内外拥有超过 1,130 万名客户。

### 4. 业内领先的国际业务平台

通过收购整合海通国际证券、海通银行，设立自贸区分公司，公司建立了业内领先的国际业务平台，获得了亚太地区先发优势以及欧美地区前瞻性的战略储备。2017 年，海通国际证券投行业务继续保持领先，股权融资金额排名在港中资投行第一；中国离岸债券发行数量排名全体投行第一。交易业务成功转型，正式推出全新程序交易服务系统，能够为全球机构客户提供 24 小时综合电子交易，并具备自主知识产权。资管业务规模和收入不断提升，管理规模 660 亿港元。与此同时，海通国际证券进一步推进国际金融资源的整合产生了效果：印度业务整合后完成了印度市场近十年来最大的私营企业 IPO 项目；美国和英国业务的后续整合已经启动。海通国际证券在海外的战略布局进一步优化。

海通银行是公司国际化战略的重要组成部分，拥有伊比利亚本地市场的专业知识以及在海外市场长达 20 多年的经验，立足于支持中国、欧洲、南美洲和非洲间的跨境业务交流，把公司的业务发展到更广阔的地理区域，为国际化进程的加速提前部署。自贸区分公司是首批加入自贸区 FTU 体系的证券机构，成功实施了国内券商首单 FT 项下跨境融资项目。业内领先、全方位多地区的国际业务平台有利于公司把握日益增长的跨境业务机会，满足客户的跨境业务需求，提升公司的国际影响力。

### 5. 稳健的经营理念、有效的合规风险管理和内部控制体系

公司秉承“稳健乃至保守”的合规与风险管理理念，在近 30 年的经营历史中，成功度过了多个市场和业务周期、监管改革和行业转型发展，是中国境内二十世纪八十年代成立的证券公司中唯一一家至今仍在营运并且未更名、未被政府注资且未被收购重组过的大型证券公司。公司通过搭建覆盖全公司的风险管理体系，切实落实全面风险管理要求，有效地管理市场风险、信用风险、流动性风险和营运风险。公司已为各业务之间建立了有效的风险隔离机制和适当的预防机制，处理潜在利益冲突。此外，公司还建立了独立和集中化的内部审计及合规体系，用以有效检查、监督各项营运和交易的合规性、真实性、完整性、有效性。

### 6. 持续增强的科技实力

公司坚持“统一管理、自主可控、融合业务、引领发展”的科技指导思想，通过持续提升生产运行、软件研发、科技管理三大科技能力，为实现公司战略、打造中国标杆式投行提供全面支撑。一方面，紧跟金融科技发展趋势，金融云、大数据、人工智能等战略性工作稳步推进，全面支持各项业务创新发展。另一方面，应用系统自主可控能力日益提升，互联网金融、合规与风险管理、数据服务等领域的自主研发优势不断扩大。以互联网金融领域为例，2017年公司在业内领先推出自主研发的PC版证券交易系统后，公司的“e海通财”互联网金融平台已覆盖手机、PC、IPAD等主流终端。随着自主研发能力的提升，公司已获得手机证券系统、柜台业务系统等8项软件著作权证书，并提交了1项发明专利申请。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2017 年，公司按照年初确定的经营目标，把握金融服务实体经济发展这根主线，抓住市场机遇，积极应对挑战，取得了良好的经营业绩。公司大投行主要业务市场排名靠前，债券融资业务创新能力突出，服务实体经济能力进一步加强；融资类业务规模稳步提升，排名保持行业前列，通过强化信用风险管理，信贷资产质量保持优良，通过加强融资主体资金投向管理，积极支持符合国家产业政策的融资需求。公司集团化发展稳步推进，潜力不断释放，直投和融资租赁等业务进入收获期，在行业内形成了独特的竞争优势，服务实体经济手段不断丰富；国际化发展深入推进，海外战略布局不断优化，海通国际证券在香港的市场地位进一步巩固，品牌影响力进一步提升，海通银行逐步进入良性发展轨道；信息化建设快速推进，IT 发展战略逐步落地，业务和管理信息化水平显著提升。公司不断完善和健全合规与风险管理体系，牢牢守住不发生系统性风险的底线；积极推进精准扶贫，履行社会责任。

### 二、报告期内主要经营情况

截至 2017 年 12 月 31 日，公司总资产 5,347.06 亿元，归属于母公司净资产 1,177.55 亿元。2017 年，公司实现营业收入 282.22 亿元，归属于母公司净利润 86.18 亿元；加权平均净资产收益率 7.56%。其中，子公司实现收入 178.22 亿元，占比 60%；海外业务实现收入 48.73 亿元，占比 17%。

#### (一) 主营业务分析

利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位:元 币种:人民币

| 科目            | 本期数                | 上年同期数              | 变动比例 (%) |
|---------------|--------------------|--------------------|----------|
| 营业收入          | 28,221,667,163.35  | 28,011,014,594.51  | 0.75     |
| 营业成本          | 15,934,582,721.50  | 17,362,648,883.48  | -8.22    |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -58,816,601,545.90 | -50,177,681,468.50 | -        |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 34,893,952,588.85  | -31,577,797,907.40 | -        |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 3,973,222,499.17   | 33,354,876,131.57  | -88.09   |
| 研发支出          | 86,978,217.01      | 108,742,883.18     | -20.01   |

#### 1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

##### (1). 营业收入

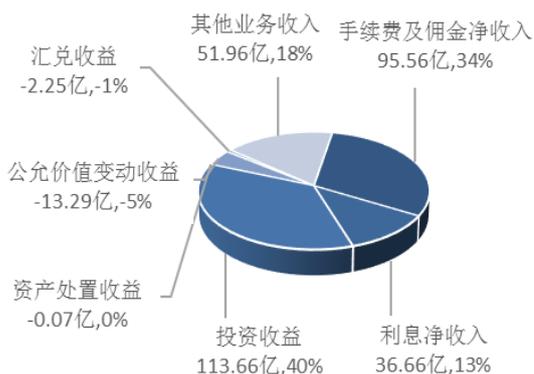
2017 年度，集团实现营业收入 282.22 亿元，同比(280.11 亿元)增加 2.11 亿元，增幅 0.75%，主要变动情况是：1) 经纪业务手续费净收入 39.41 亿元，同比(53.14 亿元)减少 13.73 亿元，减幅 25.84%，主要是二级市场交易较不活跃，成交量同比减少；2) 资产管理业务手续费净收入

20.98 亿元，同比（16.41 亿元）增加 4.57 亿元，增幅 27.85%，主要是基金管理、资产管理业务收入增加；3）利息净收入 36.66 亿元，同比（38.40 亿元）减少 1.74 亿元，减幅 4.53%，主要是客户资金及融资融券利息收入减少；4）投资收益及公允价值变动收益合计 100.36 亿元，同比（63.08 亿元）增加 37.28 亿元，增幅 59.09%，主要是处置金融工具产生的投资收益增加；5）其他业务收入 51.96 亿元，同比（68.41 亿元）减少 16.45 亿元，减幅 24.05%，主要是子公司销售收入减少。

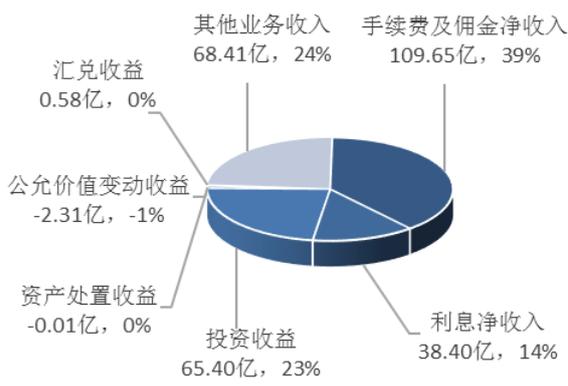
比较式会计报表中变动幅度超过 30%以上主要项目的情况 单位：元 币种：人民币

| 项目       | 2017 年度           | 上年同期             | 增减 (%)  | 主要原因                |
|----------|-------------------|------------------|---------|---------------------|
| 投资收益     | 11,365,519,110.20 | 6,539,692,047.35 | 73.79   | 主要是处置金融工具产生的投资收益增加  |
| 公允价值变动收益 | -1,329,410,866.60 | -231,333,741.19  | -       | 主要是衍生金融工具公允价值变动收益减少 |
| 汇兑收益     | -225,471,617.33   | 58,149,350.76    | -487.75 | 主要是汇率变动影响           |

2017年营业收入占比



2016年营业收入占比



(2). 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位：元 币种：人民币

| 主营业务分行业情况 |                  |                  |         |               |               |                |
|-----------|------------------|------------------|---------|---------------|---------------|----------------|
| 分行业       | 营业收入             | 营业成本             | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%)   |
| 证券及期货经纪业务 | 6,697,871,230.78 | 2,924,060,677.28 | 56.34   | -21.34        | -13.15        | 减少 4.12 个百分点   |
| 投资银行业务    | 2,049,736,453.52 | 887,147,438.72   | 56.72   | -5.60         | -8.07         | 增加 1.16 个百分点   |
| 资产管理业务    | 2,310,203,087.41 | 965,688,412.36   | 58.20   | 28.32         | 9.51          | 增加 7.18 个百分点   |
| 自营业务      | 6,570,874,632.14 | 4,593,938,303.10 | 30.09   | -21.07        | -25.69        | 增加 4.34 个百分点   |
| 直投业务      | 2,416,250,606.27 | 268,482,341.07   | 88.89   | 138.38        | 45.14         | 增加 7.14 个百分点   |
| 管理部门及其他   | 2,418,685,902.31 | 1,639,401,351.45 | 32.22   | 356.21        | 2.93          | 增加 232.64 个百分点 |
| 海外业务      | 4,872,838,427.88 | 3,663,211,845.01 | 24.82   | 23.26         | 12.53         | 增加 7.16 个百分点   |

|            |                   |                   |         |               |               | 个百分点          |
|------------|-------------------|-------------------|---------|---------------|---------------|---------------|
| 融资租赁业务     | 2,589,245,082.13  | 1,117,805,845.33  | 56.83   | 30.41         | 16.28         | 增加 5.25 个百分点  |
| 主营业务分地区情况  |                   |                   |         |               |               |               |
| 分地区        | 营业收入              | 营业成本              | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%)  |
| 上海         | 628,400,037.07    | 360,004,228.43    | 42.71   | -28.36        | -11.08        | 减少 11.13 个百分点 |
| 浙江         | 409,779,249.50    | 190,054,411.73    | 53.62   | -30.95        | -21.12        | 减少 5.78 个百分点  |
| 黑龙江        | 393,321,892.15    | 222,417,606.42    | 43.45   | -29.77        | -16.63        | 减少 8.92 个百分点  |
| 江苏         | 292,203,598.96    | 179,367,605.73    | 38.62   | -29.96        | -14.05        | 减少 11.36 个百分点 |
| 山东         | 221,780,998.10    | 124,246,889.51    | 43.98   | -27.78        | -13.71        | 减少 9.13 个百分点  |
| 其他地区分支机构   | 1,595,957,772.07  | 977,505,596.98    | 38.75   | -29.84        | -17.29        | 减少 9.30 个百分点  |
| 公司总部及境内子公司 | 21,511,423,446.71 | 10,342,928,030.51 | 51.92   | 11.39         | -11.50        | 增加 12.44 个百分点 |
| 境内小计       | 25,052,866,994.56 | 12,396,524,369.31 | 50.52   | 2.92          | -12.29        | 增加 8.59 个百分点  |
| 海外业务       | 4,872,838,427.88  | 3,663,211,845.01  | 24.82   | 23.26         | 12.53         | 增加 7.16 个百分点  |
| 抵销         | -1,704,038,259.09 | -125,153,492.82   | -       | -             | -             | -             |
| 合计         | 28,221,667,163.35 | 15,934,582,721.50 | 43.54   | 0.75          | -8.22         | 增加 5.52 个百分点  |

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

√适用 □不适用

➤ 经纪业务

(1) 零售经纪业务

2017 年，公司股票、基金交易金额市场占比 4.68%，较 2016 年提升 0.21 个百分点，排名从市场第六攀升至第四；公司新开客户 133 万，客户总数达 1,067 万，年末客户总资产达到 1.66 万亿元，较 2016 年末上升 13.4%。

港股通业务保持行业领先，截至 2017 年末，公司开通港股通客户总数达到 11.6 万户，2017 年交易金额市场占比 9.36%，排名行业第一。

2017 年公司交易额及交易份额变化

|               | 本报告期  | 上年同期  |
|---------------|-------|-------|
| 股票基金交易量 (万亿元) | 10.74 | 11.66 |
| 股票基金交易份额 (%)  | 4.68  | 4.47  |
| 市场排名          | 4     | 6     |

数据来源：上交所、深交所、公司内部统计

(2) 互联网金融

公司加大集团资源整合，持续完善以“e 海通财”为核心品牌的互联网综合金融服务建设。一方面，积极拥抱金融科技，打造以账户为核心以智能化为方向的互联网平台。另一方面，搭建数

字化运营体系，在精准营销、客户分析、个性化服务方面不断突破，客户服务效率显著提升。此外，完善客户和服务分级体系，实现更深入的差异化服务。报告期末移动端应用“e海通财”用户数突破 1,900 万，根据猎豹大数据、AppAnnie 等多家三方数据服务商公布数据显示“e海通财”活跃用户数稳居行业前三，在行业内外赢得了良好的声誉和口碑，获得多家行业及互联网媒体颁发的主要奖项。

### (3) 融资类业务

2017 年公司各项融资类业务仍旧保持稳步增长的态势，期末融资类业务规模 1,617 亿元，排名行业第二。报告期内，公司在加强信用风险管理与资金投向管理的基础上，通过提高项目审核效率、加强重点项目和客户的跟踪督导，加大分支机构的培训力度，实现融资类业务规模稳健增长和结构逐步优化。

#### 2017 年公司融资类业务规模变化

|            | 本报告期     | 上年同期     |
|------------|----------|----------|
| 融资融券余额（亿元） | 480.33   | 447.25   |
| 股票质押余额（亿元） | 1,120.69 | 948.77   |
| 约定购回余额（亿元） | 15.75    | 10.28    |
| 合计（亿元）     | 1,616.77 | 1,406.30 |

数据来源：上交所、深交所、公司内部统计

### (4) 研究业务

研究继续排名行业第一梯队。在 2017 年新财富最佳分析师评比中，公司研究所获得最具影响力研究团队第三名，策略研究、石油化工和非银金融排名行业第一，21 个行业领域排名行业前五。

### (5) 期货业务

海通期货主要业务市场排名行业前列。2017 年期货代理成交金额市场份额 9.17%，同比增长 0.74 个百分点，其中上海期货交易所市场份额 11.2%，排名行业第一；首批获得大连商品交易所、郑州商品交易所商品期权做市商资格。

证券及期货经纪业务 2017 年实现利润总额 37.91 亿元，占公司利润总额的比例为 29.41%。

### ► 投行业务

公司股权融资业务积极响应国家号召，不断提高对实体经济的服务力度，在夯实传统业务品种和行业客户的基础上，把握新一轮国企改革机会，并提高对具有核心竞争力的高新技术和新经济新产业的开拓力度。同时，基于市场需求和自身优势，选择聚焦部分重点行业提升专业化服务能力，发挥投行业务平台的协同性，共享客户资源以及全产品服务资源。

2017 年，公司完成 IPO 项目 31 家，市场排名第二；实现 IPO 承销及保荐收入 9.75 亿，市场排名第二。为 20 家企业提供并购财务顾问服务，排名行业第二。

#### 2017 年公司股权融资类业务及财务顾问业务规模变化

|     |        | 本报告期   | 上年同期     |
|-----|--------|--------|----------|
| IPO | 金额（亿元） | 138.14 | 3.1      |
|     | 家数     | 31     | 2        |
| 再融资 | 金额（亿元） | 416.57 | 1,092.15 |

|      |        |       |       |
|------|--------|-------|-------|
|      | 家数     | 28    | 40    |
| 财务顾问 | 金额（亿元） | 571.5 | 918.9 |
|      | 家数     | 20    | 16    |

数据来源：WIND 资讯

注：再融资包含并购中的配套融资

债券业务创新能力突出。公司债券融资业务年内完成金价挂钩债、绿色债券系列产品等九大方面创新，获得了国家发改委评选的企业债券主承销商全面评价结果第一名，中央国债登记结算有限责任公司结算公司评选的“优秀承销机构奖”和“创新业务奖”。

2017 年，公司企业债承销金额 269.85 亿元，市场排名第一，承销只数排名第二；公司债承销金额 578.02 亿元，市场排名第四，承销只数排名第三。

### 2017 年公司债务融资规模变化

|     |        | 本报告期     | 上年同期     |
|-----|--------|----------|----------|
| 公司债 | 金额（亿元） | 578.02   | 838.33   |
|     | 只数     | 94       | 102      |
| 企业债 | 金额（亿元） | 269.85   | 443.90   |
|     | 只数     | 25       | 35       |
| 其他  | 金额（亿元） | 1,123.23 | 1,147.70 |
|     | 只数     | 157      | 110      |

数据来源：WIND 资讯

注：其他包括证券公司债、非政策性金融债、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、可交换债。

投资银行业务 2017 年实现利润总额 11.64 亿元，占公司利润总额的比例为 9.03%。

#### ➤ 自营业务

权益类趋势投资业务抓住市场趋势性机会实现投资收益 6.22 亿元，固定收益类趋势投资保持合理杠杆规模，实现收入 4.53 亿元。非趋势投资积极开展 ETF 套利、国债期货套利、货币市场套利、黄金租赁、利率互换等业务，实现良好收益。

自营业务 2017 年实现利润总额 19.85 亿元，占公司利润总额的比例为 15.40%。

#### ➤ 资产管理业务

公司资产管理业务的主要平台包括：海通资管公司、海富通基金、富国基金以及从事私募投资基金业务的子公司。截至 2017 年 12 月 31 日，公司资产管理总规模合计 9,783 亿元。

##### (1) 海通资管公司

2017 年海通资管公司主动压缩通道业务规模，明确战略发展目标，业务全面向主动管理转型，通过加强投研团队建设，不断提升投资管理水平，在行业去通道、降杠杆的背景下，收入、利润均实现较快幅度的增长，经营稳健度不断提升。截至 2017 年末，海通资管公司管理规模 3,273 亿元，主动管理规模稳步提升，集合类产品投资业绩排名位于同类产品前 24%。报告期内，海通资管公司业务规模和收入情况如下表所示：

### 2017 年海通资管公司业务规模变化

|  | 本报告期 | 上年同期 |
|--|------|------|
|--|------|------|

|        | 资产管理规模<br>(亿元) | 净收入<br>(万元) | 资产管理规模<br>(亿元) | 净收入<br>(万元) |
|--------|----------------|-------------|----------------|-------------|
| 集合资产管理 | 513.47         | 37,789.11   | 622.17         | 25,285.33   |
| 定向资产管理 | 2,707.36       | 25,483.36   | 7,776.52       | 30,617.53   |
| 专项资产管理 | 52.34          | 228.57      | 7.62           | 74.23       |
| 合计     | 3,273.17       | 63,501.04   | 8,406.31       | 55,977.09   |

数据来源：公司内部统计

### (2) 基金管理公司

海富通基金持续加强产品布局，在公募 FOF、债券 ETF、货币、定开债等产品方面抓住机会，并做大现有产品；丰富公司养老金产品线，加强专户拓展，提升管理规模。截止 2017 年末，海富通基金资产管理规模 2,049 亿元，其中公募基金规模 508 亿元，较年初增加 14.4%。

2017 年，富国基金旗下产品整体保持优异业绩，尤其是权益产品表现突出。在产品布局方面，富国基金通过产品线的丰富与完善，进一步巩固主动权益投资、固定收益投资、量化投资三大领域的传统业务优势，进一步扩大各类客户群体的覆盖面。截止 2017 年末，富国基金总体资产管理规模 4,285 亿元。

### (3) 私募投资基金业务

公司私募投资基金业务逐渐进入回报期，截至 2017 年末，公司 PE 基金数量达到 34 只，管理总规模 176 亿元。报告期内，基金所投企业共有 12 家实现 IPO 上市。

资产管理业务 2017 年实现利润总额 13.81 亿元，占公司利润总额的比例为 10.71%。

#### ➤ 直投业务

2017 年公司直投业务对公司贡献度进一步提升，在直投收益实现上共退出投资项目 16 个，其中完全退出投资项目 8 个、部分退出投资项目 8 个。公司抓住机遇，积极推进所投企业进行上市申报及新三板挂牌，加强投后项目管理，报告期内所投企业新增 5 家实现 IPO 上市。2017 年海通开元获得清科集团“2017 中国私募股权投资机构 10 强”、“中国券商直投 10 强”并均位列前茅。

直投业务 2017 年实现利润总额 21.78 亿元，占公司利润总额的比例为 16.90%。

#### ➤ 融资租赁业务

2017 年海通恒信“一大一小”战略继续稳步推进，在以大客户大项目夯实业务整体规模的同时，全面推动极具发展潜力的中小微企业及个人客户业务。同时，海通恒信积极介入新型领域，向新业态转型，以国家供给侧结构性改革、互联网+、绿色经济等产业经济政策为指引制定公司战略方向和业务规划，重点聚焦于交通物流、IDC 大数据、高端智能制造、智慧城市、TMT、政府 PPP、普惠医疗等行业领域。

海通恒信 2017 年国内主体信用等级上调至 AAA，在合理控制流动性风险的前提下，通过主动拓展融资渠道、调整融资结构、融资期限等方式降低资金成本。通过优化调整信审机制，加强资产质量监测，提高尽调水平与租后回访覆盖，不良率控制在较低水平。

融资租赁业务 2017 年实现利润总额 15.62 亿元，占公司利润总额的比例为 12.12%。

➤ 海外业务

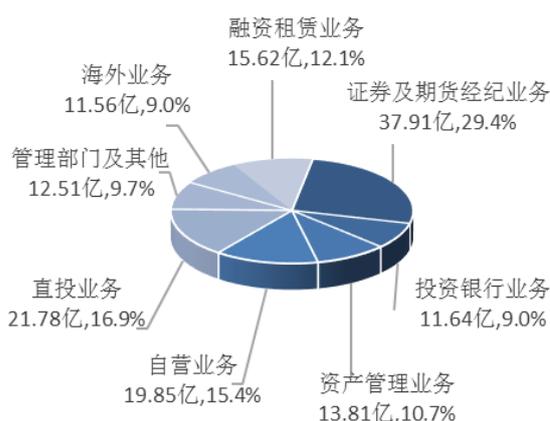
经过近十年的培育和发展，公司初步完成了在全球 14 个国家和地区的业务布局，并且依托海通国际证券在香港的快速发展，逐步将公司国际化的战略储备转化为战略优势。

海通国际证券投行业务继续保持领先，股权融资金额在港中资投行排名第一；中国离岸债券发行数量排名全体投行第一。交易业务成功转型，正式推出全新程序交易服务系统，能够为全球机构客户提供 24 小时综合电子交易，并具备自主知识产权。资管业务规模和收入不断提升，管理规模达 660 亿港元。

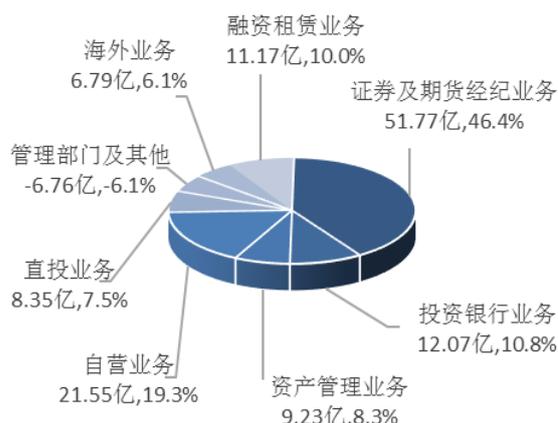
公司进一步推进国际金融资源整合产生效果。印度业务整合后完成了印度市场近十年来最大的私营企业 IPO 项目。美国和英国业务的后续整合已经启动，公司在海外的战略布局进一步优化。海通银行经历了近两年的磨合、整合和融合，理顺了公司治理架构，发展逐步进入正轨；通过业务重组，自身造血功能正逐步恢复。

海外业务 2017 年实现利润总额 11.56 亿元，占公司利润总额的比例为 8.97%。

2017年各分部利润总额情况



2016年各分部利润总额情况



(3). 产销量情况分析表

适用 不适用

(4). 成本分析表

单位：元

| 成本构成项目 | 本期金额             | 本期占总成本比例 (%) | 上年同期金额           | 上年同期占总成本比例 (%) | 本期金额较上年同期变动比例 (%) | 情况说明                    |
|--------|------------------|--------------|------------------|----------------|-------------------|-------------------------|
| 税金及附加  | 165,972,927.57   | 1.04         | 490,685,726.69   | 2.83           | -66.18            | 主要是金融行业“营改增”影响          |
| 业务及管理费 | 9,755,117,004.73 | 61.22        | 9,563,542,327.78 | 55.08          | 2.00              | 主要是职工薪酬增加               |
| 资产减值损失 | 1,686,658,289.93 | 10.58        | 1,419,492,720.73 | 8.18           | 18.82             | 主要是应收保理款和买入返售金融资产减值损失增加 |

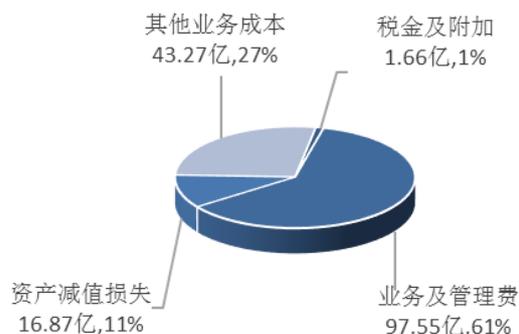
|        |                  |       |                  |       |        |              |
|--------|------------------|-------|------------------|-------|--------|--------------|
| 其他业务成本 | 4,326,834,499.27 | 27.15 | 5,888,928,108.28 | 33.92 | -26.53 | 主要是子公司销售成本减少 |
|--------|------------------|-------|------------------|-------|--------|--------------|

成本分析其他情况说明

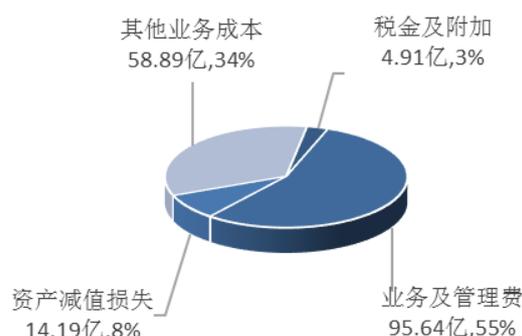
√适用 □不适用

2017 年度，集团营业支出 159.35 亿元，同比（173.63 亿元）减少 14.28 亿元，减幅 8.22%。主要变动情况是：1) 税金及附加 1.66 亿元，同比（4.91 亿元）减少 3.25 亿元，减幅 66.18%，主要是 2016 年 5 月起金融行业“营改增”的影响；2) 业务及管理费 97.55 亿元，同比（95.64 亿元）增加 1.91 亿元，增幅 2.00%，主要是职工薪酬增加；3) 资产减值损失 16.87 亿元，同比（14.19 亿元）增加 2.68 亿元，增幅 18.82%，主要是应收保理款和买入返售金融资产减值损失增加；4) 其他业务成本 43.27 亿元，同比（58.89 亿元）减少 15.62 亿元，减幅 26.53%，主要是子公司销售成本减少。

2017年营业支出占比



2016年营业支出占比



(5). 主要销售客户及主要供应商情况

□适用 √不适用

2. 费用

□适用 √不适用

3. 研发投入

研发投入情况表

√适用 □不适用

单位：元

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 本期费用化研发投入           | 20,638,682.20 |
| 本期资本化研发投入           | 66,339,534.81 |
| 研发投入合计              | 86,978,217.01 |
| 研发投入总额占营业收入比例 (%)   | 0.31          |
| 公司研发人员的数量           | 108           |
| 研发人员数量占公司总人数的比例 (%) | 1             |
| 研发投入资本化的比重 (%)      | 76            |

情况说明

适用 不适用

4. 现金流

适用 不适用

(1) 经营活动产生的现金流量净额为-588.17 亿元，其中：现金流入 389.55 亿元，占现金流入总量的 14.35%，主要是收取利息、手续费及佣金的现金 251.37 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 92.69 亿元；现金流出 977.71 亿元，占现金流出总量的 33.54%，主要是回购业务资金净减少额 260.67 亿元，支付其他与经营活动有关的现金 218.15 亿元，代理买卖证券支付的现金净额 202.85 亿元，处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净减少额 143.30 亿元。

(2) 投资活动产生的现金流量净额为 348.94 亿元，其中：现金流入 878.32 亿元，占现金流入总量的 32.34%，主要是收回可供出售金融资产等收到现金 863.51 亿元；现金流出 529.38 亿元，占现金流出总量的 18.16%，主要是投资可供出售金融资产等支付现金 503.64 亿元。

(3) 筹资活动产生的现金流量净额为 39.73 亿元，其中：现金流入 1,447.75 亿元，占现金流入总量的 53.31%，主要是发行债券收到的现金 1,022.12 亿元，取得借款收到的现金 425.35 亿元；现金流出 1,408.02 亿元，占现金流出总量的 48.30%，主要是偿还债务支付的现金 1,294.50 亿元。

(二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

(三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

1. 资产及负债状况

单位：元

| 项目名称                   | 本期期末数             | 本期期末数占总资产的比例 (%) | 上期期末数             | 上期期末数占总资产的比例 (%) | 本期期末金额较上期期末变动比例 (%) | 情况说明            |
|------------------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|---------------------|-----------------|
| 结算备付金                  | 7,982,728,644.47  | 1.49             | 12,191,899,273.79 | 2.17             | -34.52              | 主要是公司自有备付金减少    |
| 衍生金融资产                 | 2,610,612,302.28  | 0.49             | 3,935,071,348.81  | 0.70             | -33.66              | 主要是利率衍生工具减少     |
| 应收利息                   | 3,703,898,935.74  | 0.69             | 7,422,060,199.20  | 1.32             | -50.10              | 主要是应收债券利息减少     |
| 固定资产                   | 2,657,276,109.00  | 0.50             | 1,420,756,931.36  | 0.25             | 87.03               | 主要是本期经营租赁固定资产增加 |
| 无形资产                   | 1,316,011,591.12  | 0.25             | 468,009,610.75    | 0.08             | 181.19              | 主要是本期房屋使用权增加    |
| 应付短期融资款                | 29,426,762,416.95 | 5.50             | 19,864,117,000.00 | 3.54             | 48.14               | 主要是短期融资券发行规模增加  |
| 拆入资金                   | 11,811,638,917.40 | 2.21             | 8,809,461,725.51  | 1.57             | 34.08               | 主要是转融通业务融入资金增加  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 20,743,499,166.70 | 3.88             | 38,639,631,004.32 | 6.89             | -46.32              | 主要是结构化主体规模减少    |
| 衍生金融负债                 | 3,495,454,278.20  | 0.65             | 2,594,009,281.96  | 0.46             | 34.75               | 主要是权益衍生工具规模增加   |

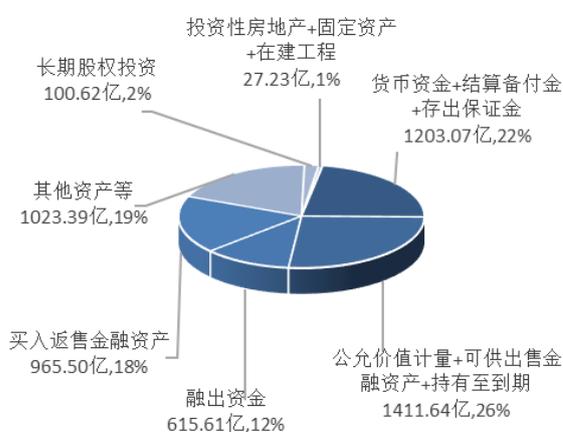
|         |                   |      |                   |      |         |                     |
|---------|-------------------|------|-------------------|------|---------|---------------------|
| 代理承销证券款 | -                 | -    | 1,054,351,430.62  | 0.19 | -100.00 | 主要是本期无代理承销证券        |
| 预计负债    | 167,342,904.85    | 0.03 | 124,621,521.35    | 0.02 | 34.28   | 主要是境外子公司可能税项损失      |
| 长期借款    | 30,609,159,576.41 | 5.72 | 22,583,788,217.83 | 4.03 | 35.54   | 主要是信用借款增加           |
| 递延所得税负债 | 867,319,662.68    | 0.16 | 557,471,978.61    | 0.10 | 55.58   | 主要是可供出售金融资产公允价值变动增加 |

➤ 资产状况

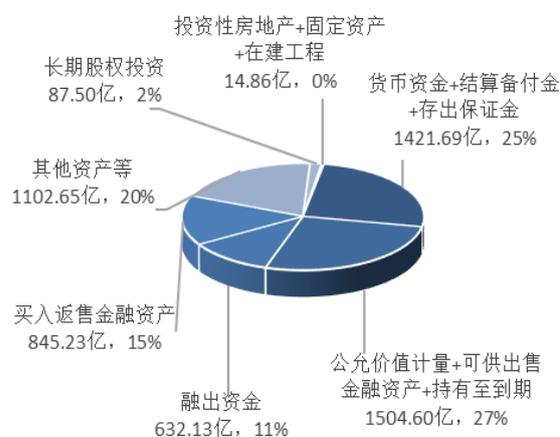
2017 年末，集团总资产 5,347.06 亿元，较年初（5,608.66 亿元）减少 261.60 亿元，减幅 4.66%。主要变动情况是：货币资金、结算备付金及存出保证金减少 218.62 亿元，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售及持有至到期等金融资产减少 92.96 亿元，应收款项类投资等其他资产减少 40.33 亿元，应收利息减少 37.18 亿元，买入返售金融资产增加 120.27 亿元。

集团以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售及持有至到期等金融资产占集团总资产的 26%，货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的比率为 22%，买入返售金融资产占总资产的 18%，融出资金占总资产的 12%，固定资产、在建工程及投资性房地产占集团总资产不到 1%，大部分资产变现能力较强，集团资产流动性较强，资产结构优良。

2017年末总资产占比



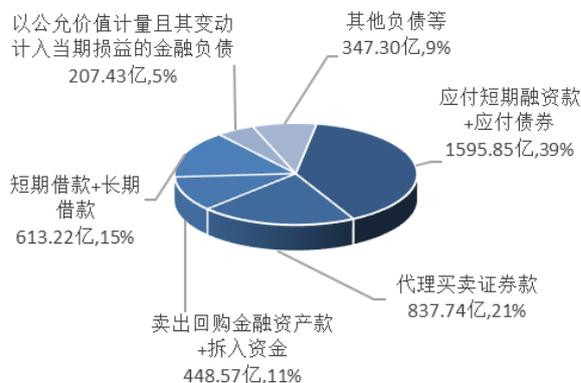
2016年末总资产占比



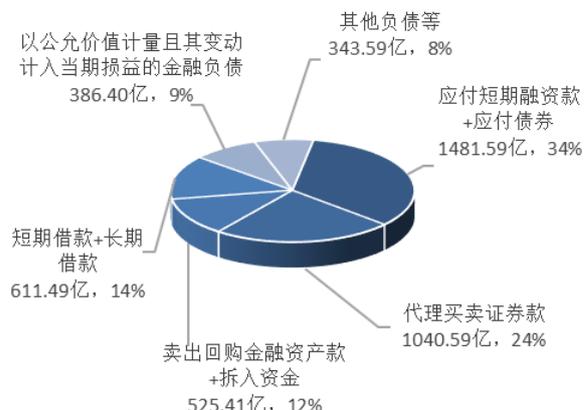
➤ 负债状况

2017 年末，集团负债总额 4,050.12 亿元，较年初（4,389.07 亿元）减少 338.95 亿元，减幅 7.72%。主要变动情况是：代理买卖证券款减少 202.85 亿元，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债减少 178.97 亿元，卖出回购金融资产款及拆入资金减少 76.84 亿元，应付短期融资款及应付债券增加 114.26 亿元，长期应付款等其他负债增加 24.41 亿元。

2017年末总负债占比



2016年末总负债占比



2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用  不适用

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见“第十一节 财务报告”中“五、合并财务报表项目注释 1. 货币资金，5. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，7. 买入返售金融资产，以及 11. 可供出售金融资产”的相关内容。

3. 其他说明

适用  不适用

(四) 行业经营性信息分析

适用  不适用

详见本报告“第三节 公司业务概要”和“第四节 经营情况讨论与分析”中的相关内容。

(五) 投资状况分析

◆ 对外股权投资总体分析

适用  不适用

报告期末，集团长期股权投资 100.62 亿元，较上年末（87.50 亿元）增加 13.12 亿元，增加 14.99%，主要是海通国际控股下属子公司增加投资。子公司投资参见本报告“第十一节 财务报告”中“五、合并财务报表项目注释 14. 长期股权投资”。

(1) 重大的股权投资

适用  不适用

单位：万元 币种：人民币

| 所持对象名称     | 占该公司股权比例 | 期末账面价值    | 报告期损益     | 报告期所有者权益变动 |
|------------|----------|-----------|-----------|------------|
| 富国基金管理有限公司 | 27.775%  | 79,002.69 | 20,166.41 | -172.10    |

注：1. 报告期损益指该项投资对公司本报告期合并净利润的影响。

2. 报告期所有者权益变动金额不含报告期损益影响。

(2) 重大的非股权投资

适用  不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产

√适用 □不适用

单位：元

| 项目                     | 期末投资成本            | 期末账面余额            | 报告期内购入或出售净额        | 报告期内公允价值变动        | 报告期内投资收益         |
|------------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 99,077,826,849.81 | 99,856,694,835.91 | 7,726,239,561.46   | -238,839,784.46   | 7,272,059,401.89 |
| 可供出售金融资产               | 39,169,350,402.17 | 41,228,756,005.51 | -18,725,581,434.29 | 1,878,996,247.71  | 3,109,381,404.87 |
| 衍生金融工具                 |                   | -884,841,975.92   |                    | -1,007,083,460.72 | -16,247,467.25   |

(六) 重大资产和股权出售

□适用 √不适用

(七) 主要控股参股公司分析

√适用 □不适用

1. 海富通基金，注册资本 3 亿元人民币，海通证券持有 51%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海富通基金总资产为 16.93 亿元，净资产 11.58 亿元；2017 年，实现营业收入 8.03 亿元，净利润 2.55 亿元。

2. 富国基金，注册资本 3 亿元人民币，海通证券持有 27.775%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，富国基金总资产为 42.28 亿元，净资产 28.44 亿元；2017 年，实现营业收入 23.68 亿元，净利润 7.26 亿元。

3. 海富产业，注册资本 1 亿元人民币，海通证券持有 67%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海富产业总资产为 2.56 亿元，净资产 1.99 亿元；2017 年，实现营业收入 1.67 亿元，净利润 0.72 亿元。

4. 海通期货，注册资本 13 亿元人民币，海通证券持有 66.667%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海通期货总资产为 207.48 亿元，净资产 27.23 亿元；2017 年，实现营业收入 51.71 亿元，净利润 3.35 亿元。

5. 海通国际控股，注册资本 88.50 亿港元，海通证券持有 100%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海通国际控股总资产为 2,520.05 亿港元，归属于母公司的净资产 125.66 亿港元；2017 年，实现收入 145.99 亿港元，净利润 21.10 亿港元。

6. 海通开元，注册资本 106.50 亿元人民币，海通证券持有 100%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海通开元总资产为 184.54 亿元，归属于母公司净资产 143.87 亿元；2017 年，实现营业收入 26.64 亿元，净利润 18.39 亿元。

7. 海通创新证券，注册资本 35 亿元人民币，海通证券持有 100%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海通创新证券总资产为 51.23 亿元，净资产 49.18 亿元；2017 年，实现营业收入 5.05 亿元，净利润 3.52 亿元。

8. 海通资管公司，注册资本 22 亿元人民币，海通证券持有 100%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，海通资管公司的总资产为 50.93 亿元，净资产 36.32 亿元；2017 年，实现营业收入 7.49 亿元，净利润 3.78 亿元。

9. 上海惟泰置业，注册资本 1000 万元人民币，海通证券持有 100%的股权。截至 2017 年 12 月 31 日，上海惟泰置业的总资产为 1.28 亿元，净资产 0.10 亿元；2017 年，实现营业收入 0.17 亿元，净利润 20.65 万元。

#### (八) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

##### 1. 报告期内设立公司控制的特殊目的主体的情况

2017 年 7 月，海通恒信通过 Haitong UT Leasing Irish Holding Corporation Limited，于爱尔兰注册成立 5 家特殊目的公司，分别为 Haitong Unitrust No. 2 Limited、Haitong Unitrust No. 3 Limited、Haitong Unitrust No. 4 Limited、Haitong Unitrust No. 5 Limited 及 Haitong Unitrust No. 6 Limited，用于经营飞机租赁相关业务，主要包括飞机采购、销售、租赁及分租等租赁服务。上述 5 家特殊目的主体皆是通过 Haitong UT Leasing Irish Holding Corporation Limited 于 2017 年 7 月 3 日全资设立，注册资本皆为 1.00 美元，且注册地皆为爱尔兰。

##### 2. 结构化主体或通过受托经营等方式形成控制权的经营实体

公司对由子公司作为管理人的结构化主体，综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报，或承担的风险敞口等因素，认定将 22 个结构化主体纳入合并报表范围。

#### (九) 实施新金融工具会计准则变更对公司财务状况和经营成果的影响

2017 年，中国财政部陆续修订了金融工具相关会计准则，包括《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以上简称“新金融工具准则”）。根据财政部规定，公司于 2018 年 1 月 1 日起执行上述新准则。

实施上述新金融工具准则对会计核算和相关列报的主要影响有：根据新准则，对公司金融资产进行分类和计量，包括对估值方法进行必要的调整；对相关金融资产运用预期损失法进行减值测试，并重新计量其账面价值；相应调整其他综合收益和期初留存收益。基于公司年末金融资产持仓情况和上述变更的测算，金融资产分类、计量及减值方法等变更预计将对公司财务报表产生广泛影响，但对公司的总资产和净资产未产生重大影响。

#### (十) 其他

##### 1. 报告期内公司营业部、分公司、子公司新设和处置情况

报告期内，公司经批准新设并已开业证券营业部 0 家；截至报告期末，公司共有证券分公司 27 家，证券营业部 290 家（详见报告附录二）。

##### 2. 账户规范情况专项说明

公司已于 2008 年 4 月完成账户清理工作，并被中国证监会授予“账户清理工作先进集体”称号。报告期内，公司进一步加强了对新开账户的管理，通过规范流程，强化监督和审核等手段，

有效杜绝了新开不规范账户的发生，并对已实施另库存放的不合格、小额休眠、风险处置休眠账户实施进一步的账户规范清理。报告期内，公司共清理不合格资金账户 94 户（含纯资金不合格账户 54 户）；清理小额休眠资金账户 1,885 户（含纯资金小额休眠账户 215 户）；清理风险处置账户 210 户。截至 2017 年 12 月 31 日，公司剩余不合格资金账户 26,018 户（含纯资金不合格资金账户 22,977 户）；剩余小额休眠资金账户 1,542,293 户（含纯资金小额休眠资金账户 445,438 户）；剩余风险处置资金账户 97,777 户。

### 3. 业务创新情况

公司始终坚持以创新促转型，取得多项业务创新成果：

(1) 积极推进监管部门主导的各项创新。公司首批入围“债券通”主承销商名单；海富通基金子公司首批获得 FOF 基金批文，并且是首批获得批文的 FOF 基金中唯一一只偏股型产品，获得中国基金报颁发的“中国基金业 20 年最佳产品创新奖——最佳另类组合创新产品奖”等多个奖项；期货子公司和资源管理公司首批获得大连商品交易所豆粕期权和郑州商品交易所白糖期权业务资格。

(2) 继续加快自主创新步伐，为客户提供创新的业务解决方案。债券融资业务创新能力突出，设计并成功发行了国内首单金价挂钩债券和煤炭价格连结债券，成功发行首单财政部 PPP 项目资产证券化项目、首单绿色应收账款出表资产证券化项目、首只创新创业金融债券等，公司获得发改委评选的企业债券主承销商全面评价结果第一名，中央国债登记结算有限责任公司评选的“优秀承销机构奖”和“创新业务奖”。

(3) 创新业务保持行业领先地位。公司客户融资类业务总规模位居行业前列；柜台市场产品发行数量和规模行业领先；公司创新业务收入占比同比持续提升。

## 三、公司关于公司未来发展的讨论与分析

### (一) 行业格局和趋势

适用 不适用

在间接融资体系向直接融资体系转型、跨境投融资需求增加的长期趋势背景下，在我国经济从高速增长向高质量发展转变的过程中，经济高速增长所积累的企业资产和个人财富将为资本市场和券商发展提供巨大的潜力，公司大投行、大资管、私募股权投资、另类投资、跨境业务面临较好的发展机遇。另一方面，受从严监管成为常态、互联网金融迅猛发展、行业准入放宽等因素的影响，证券行业的盈利基础将发生深刻变革，行业发展空间短期受到压制，业内竞争将进一步加剧。预计未来行业发展将呈现以下趋势：市场双向开放，跨境资本自由流动将推进行业的国际化和全球化；行业整合将提速，市场集中度进一步上升，行业领先者之间的竞争更加激烈，并在业务和服务、资本驱动、综合化、产品化、金融科技等方面形成差异化经营的局面；基于牌照和监管的盈利模式将逐步消失，资本、客户流量和专业服务能力将成为提升核心竞争力的重要基础；行业资产分布保持稳定，营收利润向大券商集中；传统业务收入占比下降，战略性业务布局加快。

## (二) 公司发展战略

√适用 □不适用

在转型背景下，公司的总体发展战略为：坚持以客户为中心，以经纪、投资银行、资产管理等中介业务为核心，以资本型中介业务和投资/租赁业务为两翼，以创新和国际化为驱动力，加强研究、人才、IT 和风控合规四根支柱建设，加强资本与投资管理、资产和财富管理、投行承揽与销售定价、机构经纪与销售交易和互联网证券等五大能力建设，致力于把海通建设成为以网上证券、财富管理证券、中小企业证券、机构业务证券为核心的国内一流、国际有影响力的中国标杆式投行。

## (三) 经营计划

√适用 □不适用

2018 年，公司将在总体战略指引下，坚持稳健经营，聚焦发展主线，加强业务协同，深入挖掘经纪、投行、融资、直投等业务线客户的综合业务需求，提升单一客户价值量；补足短板，寻找资产管理、财富管理等业务的突破口；稳步推进子公司发展，进一步提升子公司的利润贡献度；深入推进国际资源整合；持续提升公司 IT 管理、人力资源管理、合规与风险管理、财务和资产负债管理水平，以推进公司从高速增长向高质量发展转变为基础，全方位提升公司综合竞争实力。

公司将重点做好以下几方面工作：深入挖掘经纪业务潜力；持续做大投行业务规模；持续提升租赁业务盈利水平，夯实 PE 业务发展基础，加大对子公司的支持与管理；打好国际化发展攻坚战；全面加强基础管理工作；提升资产负债管理能力；加强研究驱动业务发展力度；强化“软文化”与“硬制度”建设。

## (四) 可能面对的风险

√适用 □不适用

### 1. 公司经营活动面对的风险及采取的措施

公司业务经营活动面对的风险主要有：信用风险、市场风险、操作风险、流动性风险、声誉风险等，具体来讲，主要表现在以下几个方面：

#### (1) 信用风险

信用风险指公司融资类客户、交易对手或公司持有证券的发行人无法履行合同义务的情况下给本公司造成损失的风险，或者本公司持有第三方当事人发行的证券，在该方信用质量发生恶化情况下给本公司造成损失的风险。信用风险和市场风险具有一定的相关性，在市场波动的情况下，公司部分金融产品因持有或交易产生的信用风险暴露程度将随之发生变化，对此，公司对市场波动采取必要的监控和防范措施，以实现信用风险的有效管理。

公司面临的信用风险主要涉及存放在其他金融机构的自有货币资金，经纪业务代理客户买卖证券的交易结算，为客户提供融资融券、约定购回式证券交易和股票质押式回购交易等融资类业

务，债券投资、衍生品交易等自营业务，上述业务因为客户、交易对手无法履约使公司面临产生损失的风险。

公司的货币资金主要存放在国有商业银行或信誉良好的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。经纪业务采取全额保证金结算方式可以切实规避相关信用风险。融资融券、约定购回式证券交易和股票质押式回购业务方面，公司通过制定和实施各项严格的制度和措施从尽职调查、征信、授信、逐日盯市、强制平仓、司法追索等环节对涉及的信用风险进行控制。公司对信用类固定收益证券投资注重分散投资，投资的信用产品主要为高信用评级产品，并密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，投资标的信用风险控制良好。场外衍生品业务方面，公司从客户准入、标的证券管理、交易对手授信管理、风险处置流程等方面建立了比较完善的制度规范，对存续期内的每笔场外衍生品业务逐日盯市，并通过严格履行预警、止损等措施管理信用风险。

除上述风险因素外，集团个别子公司在开展融资类业务、投资业务、租赁业务、场外衍生品等业务过程中，也面临信用风险。相关子公司在公司统一的风险偏好下，根据其业务特点制定了信用风险管控的制度、措施和流程，并针对信用风险暴露情况制定了风险限额，经公司审核后执行。公司已按照集团全面风险管理的总体规划，从制度建设、限额体系、监控机制、信息系统、风险报告等各方面逐步强化和完善集团层面的信用风险管理。

## （2）市场风险

市场风险主要指在公司的经营活动中，因市场价格（股票价格、利率、汇率等）的不利变动而使公司自有资金投资的相关业务发生损失的风险。

A、股票价格风险。股票价格风险主要指公司所投资的权益类证券市场价格发生变化致使本公司承受损失的风险。承担此类风险的业务主要包括权益类证券自营业务、做市业务和场外衍生品业务等。股票价格风险具有较大的不确定性，是公司主要面对的市场风险类型之一。公司密切关注相关资产价格波动，并采取相应措施予以防范。

2017年，中国股票市场走势总体震荡上行，各板块走势有所分化，具有业绩支撑的价值股表现相对较好。以上证综指为例，2017年年初指数从3105.31点开盘，年末收盘于3307.17点，全年累计涨幅6.56%；同期上证50指数涨幅25.08%，沪深300指数涨幅21.78%，中小板指涨幅16.73%，创业板指跌幅10.67%。市场波动率方面，2017年股票市场波动率整体区间震荡。以上交所中国波指（iVIX）为例，该指数由1月初的17.80开始逐步下行，5月触及区间低点7.95后开始反弹，截至12月29日该指数为14.27，较年初下降17.13%。

为了监控相关风险因素的影响，公司定期跟踪证券持仓的投资规模和风险价值（VaR）变化情况。公司通过实施多元化投资策略，对各类证券品种的投资规模进行适当控制和适时调整，并结合各类套期保值工具，较为有效地控制了市场风险。

B、利率风险。利率风险是指因市场利率变动而导致的风险，公司资产中有关利率风险的部分主要包括货币性存款、债券投资以及债券发行等。中债综合全价指数在2017年震荡下行，先震荡

下行至 5 月下旬，探底后反弹至短期高点，后继续震荡下探。中债综合全价指数 2017 年末报收 113.37，比上年末下降 3.39%，中债五年期国债到期收益率较上年末上行约 99 个基点至 3.84%，中债十年期国债到期收益率较上年末上行约 87 个基点至 3.88%。公司对利率风险的控制，主要采用规模控制和投资组合等方法，合理配置资产，匹配负债与资产的期限结构，并通过定期测算投资组合久期、凸性、DV01 等指标衡量利率风险。

C、汇率风险。汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。随着公司国际化的拓展，汇率风险逐步显现。除公司的境外股权投资外，子公司或附属公司还通过发行外币债券等方式增加外币的负债规模，导致集团整体外币规模增加，管理难度有所增加。公司一直对外汇市场进行专门跟踪研究，不断加强制度建设和内部管理，并通过一系列措施对冲、缓释汇率风险，以支持公司境外业务的开拓。公司还注重从集团的层面进行外币资产和负债的匹配，以缩小外汇风险的敞口。同时公司还采用境外经营净投资套期等平滑外汇敞口对集团经营成果的影响。截至本报告期末，集团的汇率风险对财务报表无重大影响。

除上述风险因素之外，集团所从事的境外投资业务也承担着相关市场风险，全球范围内各种市场风险因子的波动都可能对集团的整体损益带来影响。公司将境外投资业务纳入整体市场风险管理体系内。对于集团下属境外子公司进行的投资业务，由相关子公司制定并落实相应的风险限额和风险管理政策，经母公司审核通过后实行，同时子公司定期将风险限额的执行情况向母公司进行报告。

### （3）操作风险

操作风险是指由内部流程不完善、员工操作失误及不当行为、信息系统故障缺陷以及外部事件所造成损失的风险。其中，信息技术风险是指因系统中断或者运行缓慢导致信息系统的可用性、完整性丧失的风险，以及信息系统被外部攻击等原因导致信息系统机密性丧失的风险。信息技术风险是目前操作风险的一个重要组成部分，信息技术对于证券交易、清算和服务等多个方面的业务发展和管理至关重要，系统不可靠、网络技术不完善、数据误差都会造成公司的损失。此外，公司还面临因公司或公司工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规和准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的合规风险。

公司坚持不断健全内部控制管理机制，完善操作流程，加强检查稽核，强化问责制度，以降低操作风险发生的可能性、积极应对并妥善处置其不利影响。公司根据中国证监会《证券公司内部控制指引》等监管规定以及公司内部管理需要，制定了较为完善的内部控制制度，确保操作风险管理有制度可依。公司根据《企业内部控制基本规范》要求制定了涵盖各部门各业务条线的内部控制矩阵，每年组织对内部控制矩阵执行情况的自查，公司稽核部门对内部控制矩阵的执行情况进行评估。公司通过建立集团范围内的重大操作风险事件信息沟通机制并加强内部控制管理，不断提升操作风险管理水平。尽管如此，仍不能保证完全避免因操作差错和主观不作为可能引发的操作风险事件及损失。此外，员工发生违法犯罪行为，将会给公司造成财务损失，给公司声誉造成不利影响。公司一直坚持实施精细化管理，不断规范完善业务流程，加强对员工的职业操守

和职业道德教育，努力控制和减少操作风险事件的发生。公司持续加强信息技术管理的制度建设和系统建设，不断完善信息技术风险应急预案，并采用定期或不定期的监测、专项检查等多种手段对系统运行情况、应用研发情况、信息安全情况、科技管理情况等方面的信息技术管理情况进行监控和管理，防范信息技术风险。公司不断加强对下属单位、各业务条线及员工的合规管理，提升各项制度、机制及流程的执行力度，以有效防范公司合规风险，推动公司合规管理有效运行，促进公司持续、健康、合规发展。

#### （4）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。由于公司自营业务规模及融资类业务规模较大，公司经营过程中易受宏观政策、市场变化、经营状况、客户信用等因素影响，并可能因资产负债结构不匹配而引发流动性风险。

在日间流动性风险管理方面，公司始终秉承“稳健乃至保守”的风控理念，持续按照前期所确定的流动性风险偏好及风险指标限额的要求，通过合理的监测机制和调控手段，始终将流动性风险敞口控制在合理范围内。为进一步提升对流动性风险的精细化管理的水平，公司严格按照内部相关规定和办法，储备了充足的优质流动性资产，保障了公司业务的顺利展开和到期负债的顺利偿付。此外，公司继续完善日间流动性和风险指标的管控机制，建立了包括年度风险展望分析、月度指标研判预测和日间指标头寸跟进在内的流动性及风险分析框架，丰富了不同期限内流动性风险管理的工具，从更深层次强化了公司对流动性风险的科学管控和预判的效率。

在中长期流动性风险管控方面，公司继续优化资本配置结构，强化对资产负债发展趋势的分析，从源头上强化对公司流动性风险的管控。一方面，公司在融资负债统一归口管理的基础上积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构；另一方面，公司及时完善负债规划，负债结构和到期日分布更趋合理。报告期内，公司重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持融资渠道畅通。集团层面的负债统一归口管理工作也在逐步推进，大额融资已基本完成集团管控。

报告期内，伴随着监管部门金融去杠杆总体政策的推进，权益、债券均呈现出持续震荡的态势，此外，公司 2017 年有公司债、次级债、收益权转让等在内的多个品种负债需偿付或续作。外部市场的变化与公司资产负债的调整叠加，共同构成了报告期内公司流动性风险压力的主要来源。面对市场环境的变化和公司内部资金需求的转化，公司积极筹划，从多个方面着手，通过事前风险识别、事中风险缓释、事后改进等措施，不断强化对流动性风险的管控。公司核心流动性风险指标均满足监管所设定的预警要求，各期限结构内流动性风险敞口始终保持在合理的范围内，可保证在压力情景下持续稳健运营，整体流动性风险可控。

#### （5）声誉风险

声誉风险指由公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价的风险。声誉风险与其他金融风险不同，难以直接测算，难以与其他风险分离和进行独立处理。良好的声

誉是公司多年发展积累的重要资源,是维护良好的投资者关系、客户关系等诸多重要关系的保证。良好的声誉风险管理对于公司增强竞争优势,提升盈利能力和实现长期战略目标起着不可忽视的作用。

公司面临的声誉风险主要包括公司经营出现问题,影响公司形象和客户信心;公司由于出现合规风险被监管部门采取监管举措或处罚;公司由于媒体的不实报道或负面报道导致声誉受损,直接或间接影响公司品牌形象及业务发展;公司员工未经规定的流程审批,擅自接受媒体采访且内容违反法定信息披露规定;以及可能对公司造成重大负面影响的其他负面声誉突发事件。

对此,公司采取必要的监控和防范措施,以实现声誉风险的有效管理。公司建立声誉风险预警机制,加强舆情监控,负面声誉突发事件发生时第一时间向公司管理层报告,对于严重的负面声誉突发事件,公司总经理办公室根据《海通证券股份有限公司突发事件应对实施办法》以及《海通证券有限公司重大事项报告暂行办法》相关规定,向上级主管部门、监管部门报告,并会同公司相关部门制订沟通策略,统一宣传口径,由公司新闻发言人对外发布信息或对事件作出回应。负面声誉突发事件平息后,相关单位积极采取声誉公关修复措施,对负面声誉突发事件处理过程进行分析报告,并密切关注新问题、新情况,避免舆情出现反复。同时加强与媒体的沟通与联系,通过推广正面形象等多种途径开展公司形象修复工作。公司员工接受媒体采访前,须按照《海通证券股份有限公司宣传信息工作规定》相关要求,通过办公系统发起媒体采访流程,经公司审核同意后方可发表,发表稿件提交总经理办公室备案。

## 2. 主要风险因素在本报告期内的表现

报告期内,公司根据《证券公司全面风险管理规范》等监管要求及内部制度,深入推进全面风险管理体系建设:全覆盖方面,公司搭建了层级分明的风险管理组织架构,覆盖各风险类别、各业务条线、各部门/分支机构/子公司,完善风险识别、评估、计量、监控、报告和应对等风险管理流程,不断强化对各类风险的事前防范、事中监控和事后检查处置;可监测方面,建立了监管指标、容忍度和限额、业务风控指标三层指标体系并进行持续监测,通过各类压力测试评估极端风险;能计量方面,针对市场、信用、流动性等风险分别开展计量并不断优化量化模型和方法;有分析方面,定期编制各类报告,针对重大风险事件编制不定期报告,并将子公司纳入报告范围;能应对方面,根据风险评估和预警的结果,选择合适的应对策略,建立了有效的应对机制,并制定了具体的应急制度。此外,公司通过以下措施为全面风险管理提供支持和保障:重视风险管理文化宣导,通过举办各类培训、专题会议、期刊宣传等方式进行风险文化宣导;完善风险管理制度建设,搭建了以《海通证券股份有限公司全面风险管理办法》为纲领的多层级制度体系,覆盖了各类风险、各项业务及各管控要素;全面建设风险管理系统,建立了各类风险管理系统,并积极推进数据治理工作;广招风险管理人才,在2017年2月组织架构调整后,重新核定了风险管理部人员编制,并积极引进人才,持续满足监管要求的风险管理比例和风险管理工作需要;加大风险管理投入,制定了信息系统专项预算,加大风险管理信息系统投入,为深化落实集团风险管理提供保障。

报告期内，上述各项风险管理因素的具体表现如下：

### （1）信用风险

截至 2017 年 12 月底，公司融资融券客户的平均维持担保比例为 267.27%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为 213.83%，股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为 231.56%，融资人提交担保品充足，融资类业务信用风险整体可控；公司信用类固定收益证券投资中，债项或发行人主体评级在 AA 及以上的高信用评级证券比例为 96.98%；公司场外衍生品业务的交易对手主要是商业银行、证券公司、资产管理公司等金融机构，公司在开展此类业务的过程中，严格控制业务规模并采取合理可行的风险缓释措施，当前面临的交易对手信用风险较小。

此外，海通国际证券 2017 年继续执行谨慎的风险管理政策，融资类业务信用风险总体可控。报告期内，客户集中度、单一最大客户、单一股票集中度及潜在新增穿仓比率四项预警性考量限额指标均保持在额度内；继续完善五级分类的管理制度，并针对各业务的发展，完善相应审批政策及贷后管理，就所有融资项目进行监控和审查；场外衍生品业务方面，应用了国际认可的交易对手评级体系(CAMEL)去评估交易对手的信用质量和审批信用额度，当前面临的交易对手信用风险可控。2017 年，恒信金融集团针对信用风险实施了贷前、贷中、贷后全链条风控体系，并从组织架构、信审指引、尽职调查、风险定价、信贷审查审批等各个角度完善了相关政策、制度、规范及要求，整体信用风险管理水平有所提升，报告期内各项信用风险指标均未超限。海通银行在 2017 年对风险偏好和信贷政策做了相应修订，并制定了一系列计划调整资产结构。报告期内，海通银行设立了专业团队加强了对存量信贷资产的贷后管理，未新增信用风险事件，整体信用风险可控。

### （2）市场风险

2017 年，公司各月月末风险价值占公司净资产的比例一直保持在 0.2%以内，年末母公司及集团主要子公司风险价值占集团净资产比例在 0.2%以内，市场风险可控可承受。但是，各类金融工具的使用仍然受到监管环境、市场环境、投资策略有效性的影响，管理方法的有效性在市场流动性发生负面变化也会受到制约。

2017 年，公司权益类证券投资规模整体保持稳定，除传统的趋势投资以外，公司还积极开展了期权做市、场外期权等创新业务。上述创新业务运作过程中公司坚持风险中性的投资策略，有效控制了业务开展过程中的风险敞口。

公司根据债券市场的走势及判断，以及流动性管理需要，灵活调整非权益类证券的配置，2017 年公司整体非权益类证券投资规模呈现稳中有增的趋势。整体组合久期得到控制，各个月末的久期变化幅度不大，相对稳定。2017 年年末的久期为 2.62。2017 年公司固定收益投资的市场风险控制状况总体良好。

### （3）操作风险

公司总体规范经营，报告期内未发生重大操作风险事件。公司持续加强信息技术系统的建设和运维，严格按照操作管理程序进行定期和不定期的检查和维护，以保证系统的可靠、稳定和安全运转，报告期内未发生重大信息技术风险事件。公司持续健全内部控制体系建设，强化各项规

章制度的执行力并着力完善各项制度和流程，报告期内没有产生对公司有实质性影响的操作风险事件。公司进一步加强对下属单位、各业务条线及员工的合规管理，提升各项制度、机制及流程的执行力度。

#### （4）流动性风险

本报告期内，公司持续充足的资金储备降低了流动性风险发生的可能，并保证了公司在复杂市场环境下的平稳运营能力。公司核心流动性监管指标均远高于监管要求及预警标准。面对未来不确定的市场环境，集团将继续积极开展资产负债管理，在保障安全性、流动性的基础上，提升资金使用效率，保障公司稳健运营。另一方面，公司通过进行流动性应急演练，测试公司压力情况下的融资渠道和优质流动资产变现能力，不断提升公司流动性风险应对能力。

#### （5）声誉风险

报告期内，公司总体舆论环境健康。针对少数负面新闻报道，公司根据《海通证券股份有限公司宣传信息工作规定》相关要求，有步骤地开展应对措施，有效遏制了负面报道的影响，未发生重大声誉风险事件。

报告期内，本公司各项业务稳健、资产配置合理、财务状况良好，净资本等各项风险控制指标持续符合监管要求。集团全面风险管理架构清晰，各子公司经营稳健，整体风险可控。集团将进一步健全制度建设、完善内控机制，提升风险管理精细化水平。

### （五）公司风险控制指标和净资本补足机制建立情况

#### 1. 动态风险控制指标监控

为了建立健全风险控制指标动态监控机制，加强风险监控，在风险可测、可控、可承受前提下开展各项业务，根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》、上海证监局《关于印发〈上海辖区证券公司财务与资金状况敏感性分析和压力测试机制指导意见（试行）的通知〉》、中国证券业协会《证券公司压力测试指引》的要求，公司在风控指标动态监控平台基础上建立了符合相关规定要求的内部制度、组织架构以及相应的技术系统，并据此开展风险控制指标的动态监控工作。公司严格按照监管规定，定期向监管部门书面报告风险控制指标数据和达标情况；针对风控指标变动达到一定幅度的情况，及时向当地证监局报告。公司不断完善对动态监控平台的制度建设、流程优化、数据系统升级改造，实现了 T+1 日内向当地证监局上报公司净资本计算表、表内外资产总额计算表、流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表、风险资本准备计算表和风险控制指标监管报表。通过上述措施，确保净资本等各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。

## 2. 净资本补足机制的建立情况

公司建立了净资本补足机制，当净资本等各项风险控制指标接近或者触及预警标准时，公司将采用压缩风险较高的自营投资品种的规模、加大应收款项追讨力度、募集资金本金、发行次级债等方式补充净资本。

## 3. 报告期内风险控制指标的监控情况

公司始终坚持稳健的经营理念，注重风险管理，保持良好的资本结构。报告期末，公司净资产为 752.92 亿元，净资产 1,068.59 亿元，风险覆盖率为 249.31%，资本杠杆率为 27.06%，流动性覆盖率为 188.90%，净稳定资金率为 135.49%。报告期内，公司经营风险控制可在承受范围内，资产质量较高，业务经营规范，各项风险控制指标均符合监管要求。

## 4. 风险控制指标的敏感性分析和压力测试情况

2017 年，公司对股利分配、重大投资、调整业务规模上限、发行债务工具、投行承销项目等事项，均进行了敏感性分析或压力测试，在分析和测试结论满足监管要求的前提下开展上述事项。同时根据监管要求，每月末考虑各种可能出现的极端情况，实施压力测试。2017 年，公司总共进行了 60 项风险控制指标敏感性分析和压力测试，测试结果均符合监管部门要求，并作为公司有关重大决策的依据。此外，公司还开展了 48 次流动性风险压力测试，确保未来流动性风险控制指标在任一时间点满足监管要求。

## （六）公司合规管理体系建设情况

2007 年 5 月，中国证监会下发《关于发布指导证券公司设立合规总监建立合规管理制度试点工作方案的通知》，公司作为七家首批合规试点券商之一，于 2008 年 3 月在行业内率先完成合规试点工作。通过建立健全合规管理制度和组织体系，开展合规咨询、培训、审核、合规监测、检查和问责等，将合规工作深入到各个业务环节，得到了监管部门的肯定。

2017 年，《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号，以下简称《合规管理办法》）及《证券公司合规管理实施指引》（中证协发〔2017〕208 号，以下简称《合规管理实施指引》），《合规管理办法》与《合规管理实施指引》合称合规管理新规）正式生效，证券公司合规管理进入新时代。报告期内，公司严格按照合规管理新规要求，并结合公司的实际情况，建立了科学合理、职责分明的合规管理架构体系。

在纵向上，搭建合规管理组织架构，明确董事会、监事会、经营管理主要负责人、合规总监、其他高级管理人员的合规管理职责定位。其中，公司董事会对合规管理有效性承担责任；监事会对董事会、高管履行合规管理职责的情况进行监督；经营管理主要负责人对公司合规运营承担责任；其他高管对分管业务的合规运营承担责任；合规总监对公司及其工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行审核、监督和检查。

在横向上，形成了合规部门、其他内控部门、公司下属单位（包括各部门、各分支机构、各子公司）的横轴，其中，合规部门对合规总监负责，按照公司规定和合规总监的安排履行合规管理职责；风险管理部门、运营部门、稽核部门、财务部门、信息管理部门、纪检监察及其他承担合规管理职责的前中后台部门明确职责分工，协调互动；下属单位负责人落实本单位的合规管理目标，对本单位合规运营承担责任，全体员工对自身执业行为的合规性承担责任。

由此，合规管理贯穿于决策、执行、监督及反馈各环节，形成纵横结合、紧密联动的全方位合规体系，经营管理及业务发展各方建立全员合规、合规从管理层做起的全新理念。

报告期内，公司合规总监严格依法履行合规管理职责，未发生股东、董事和高级管理人员违反规定的职责和程序直接向合规总监下达指令或者干涉其工作的情形。本公司为合规总监全面履职和合规管理提供了人力、物力、财力和技术支持，确保合规管理有效开展。

报告期内，公司推动新规落实，贯彻“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，加强对下属单位、各业务条线、对员工的合规管理，通过合规事前审查、事中监控、事后检查、考核及问责，努力提高各项制度、机制及流程的执行力度，同时，公司加大政策传导及合规宣导工作力度，积极培育一线“人人合规、主动合规”的新环境。

报告期内，公司合规部门及稽核部门定期或不定期对公司各部门、分支机构和子公司进行包括合规检查、常规稽核、专项稽核在内的检查稽核工作，加以相应的合规考核和合规问责机制，有力推动公司内部控制水平的提升。同时，面对全面依法从严的监管态势，公司积极研究各项监管新规，不断深化合规管理的建设，保障与促进公司持续、合规、健康发展。

#### （七）其他

适用 不适用

#### 四、公司因不适用准则规定或国家秘密、商业秘密等特殊原因，未按准则披露的情况和原因说明

适用 不适用

#### 五、其他

##### 1. 优先认股权安排

根据中国法律及公司章程的规定，本公司股东并无优先认股权。

##### 2. 公众持股量的充足性

于本报告日期，根据已公开资料以及就董事所知悉，董事相信公司的公众持股量符合《香港上市规则》第 8.08 条对最低公众持股比例的要求。

##### 3. 董事在与本公司构成竞争的业务所占之权益

本公司非执行董事陈斌先生自 2014 年 10 月起至今担任东方证券股份有限公司的非执行董事，本公司非执行董事许建国先生自 2016 年 11 月至今担任东方证券股份有限公司的非执行董事，由

于东方证券股份有限公司的经营范围包括证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券自营、融资融券、证券承销、证券投资基金代销、股票期权做市等，东方证券股份有限公司已经或可能与本公司某些业务直接或间接构成竞争。除此以外，本公司无其他任何董事在与本公司直接或间接构成或可能构成竞争的业务中有任何权益。

#### 4. 董事、监事服务合约

公司所有董事和监事，均未与公司或公司附属公司订立任何在一年内不能终止，或除法定补偿外还须支付任何补偿方可终止的服务合约。

#### 5. 董事、监事在重要交易、安排或合约中的权益

公司或附属公司均未订立任何令公司董事或监事或与董事或监事有关联的实体于报告期内直接或间接享有重大权益的重要交易、安排或合约。

#### 6. 购股权计划

有关本集团的购股权计划，请参见本报告“第五节 重要事项”中“十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响”。

#### 7. 主要客户及供应商

公司为多个行业中的各类机构和个人客户提供服务。公司的客户包括大型国有企业、跨国企业、中小企业、高净值客户和零售客户，主要客户位于中国。日渐完善的海外网络布局，将有利于公司开展境外服务，拓展客户来源。2017 年，公司前五大客户产生的收入占集团营业收入的 6.27%。

#### 8. 重要合约

报告期内，公司无直接持有本公司 5%以上股份的股东，且无实际控制人，公司或其任何附属公司不存在《香港上市规则》附录十六项下的与控股股东或其附属公司之间所订立的重要合约，亦没有控股股东或其附属公司向本公司或其附属公司提供服务的重要合约。

#### 9. 管理合约

报告期内，公司没有任何仍然生效的合约（与本公司的任何董事、监事或任何全职雇员所订立的服务合约除外），而任何个人或实体据此承担公司的全部或任何中大部分业务的管理及行政。

#### 10. 获准许弥偿条文

董事之获准许的弥偿条文现时并于报告期内生效。公司已就董事、监事和高级管理人员可能的法律行动及责任作出适当的投保安排。

#### 11. 股票挂钩协议

报告期内，本集团概无新订或已有股票挂钩协议。

#### 12. 利润分配预案

##### 12.1 A 股股东税项

根据《财政部国家税务总局证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85 号）及《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》（财税[2015]101号）的规定，对于公司个人股东，持股期限（个人从公开发行和转让市场取得上市公司股票日至转让交割该股票之日前一日的持有时间）在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额（实际税率为20%）；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额（实际税率为10%）；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。对个人持股1年以内（含1年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税；待个人转让股票时，证券登记结算公司根据其持股期限计算应纳税额，公司通过证券登记结算公司另行代扣代缴。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照财税[2012]85号文的规定计征个人所得税。对于居民企业股东，现金红利所得税由其自行缴纳。

对于 QFII，根据《国家税务总局关于中国居民企业向 QFII 支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函 2009[47]号）的规定，上市公司按 10% 的税率代扣代缴企业所得税。如 QFII 股东取得的股息红利收入需要享受税收协定（安排）待遇的，可按照规定在取得股息红利后自行向主管税务机关提出退税申请。

## 12.2 H 股股东税项

根据《国家税务总局关于国税发[1993]045号文件废止后有关个人所得税征管问题的通知》（国税函[2011]348号）的规定，境外居民个人股东从境内非外商投资企业在香港发行股票取得的股息红利所得，应按照“利息、股息、红利所得”项目，由扣缴义务人依法代扣代缴个人所得税。境内非外商投资企业在香港发行股票，其境外居民个人股东根据其居民身份所属国家与中国签署的税收协定及内地和香港（澳门）间税收安排的规定，享受相关税收优惠。根据相关税收协定及税收安排规定的相关股息税率一般为 10%，为简化税收征管，在香港发行股票的境内非外商投资企业派发股息红利时，一般可按 10% 税率扣缴个人所得税，无需办理申请事宜。对股息税率不属 10% 的情况，按以下规定办理：（1）低于 10% 税率的协定国家居民，扣缴义务人可代为办理享受有关协定待遇申请，经主管税务机关审核批准后，对多扣缴税款予以退还；（2）高于 10% 低于 20% 税率的协定国家居民，扣缴义务人派发股息红利时应按协定实际税率扣缴个人所得税，无需办理申请审批事宜；（3）没有税收协定国家居民及其他情况，扣缴义务人派发股息红利时应按 20% 税率扣缴个人所得税。

根据《国家税务总局关于中国居民企业向境外 H 股非居民企业股东派发股息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函[2008]897号）的规定，中国居民企业向境外 H 股非居民企业股东派发 2008 年及以后年度股息时，统一按 10% 的税率代扣代缴企业所得税。

根据现行香港税务局惯例，在香港无须就本公司派付的股息缴税。

## 12.3 通过沪港通投资本公司 H 股的中国内地投资者利润分配事宜

对于上交所投资者（包括企业和个人）投资香港联交所本公司 H 股股票，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司作为沪港通 H 股投资者名义持有人将接收本公司派发的现金红利，并通过其登记结算系统将现金红利派发至相关沪港通 H 股股票投资者。沪港通 H 股股票投资者的现金红利以人民币派发。根据《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知（财税

[2014]81号)》的相关规定：对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，比照个人投资者征税。H 股公司对内地企业投资者不代扣股息红利所得税款，应纳税款由企业自行申报缴纳。

#### 12.4 通过深港通投资本公司 H 股的中国内地投资者利润分配事宜

对于深交所投资者（包括企业和个人）投资香港联交所本公司 H 股股票，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司预期将作为深港通 H 股投资者名义持有人接收本公司派发的现金红利，并通过其登记结算系统将现金红利派发至相关深港通 H 股股票投资者。深港通 H 股股票投资者的现金红利以人民币派发。根据《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税[2016]127 号）的相关规定：对内地个人投资者通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，比照个人投资者征税。H 股公司对内地企业投资者不代扣股息红利所得税款，应纳税款由企业自行申报缴纳。

#### 12.5 沪股通投资者利润分配事宜

对于投资本公司于上交所上市的 A 股股票的香港联交所投资者（包括企业和个人）（以下简称“沪股通投资者”），其末期股息将由本公司通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司向股票名义持有人账户以人民币派发。本公司按照 10% 的税率代扣所得税，并向主管税务机关办理扣缴申报。对于沪股通投资者中属于其他国家税收居民且其所在国与中国签订的税收协定规定现金红利所得税率低于 10% 的，企业或个人可以自行或委托代扣代缴义务人，向本公司主管税务机关提出享受税收协定待遇的申请，主管税务机关审核后，按已征税款和根据税收协定税率计算的应纳税款的差额予以退税。

建议本公司股东向彼等的税务顾问咨询有关拥有及处置本公司股份所涉及的中国、香港及其他国家（地区）税务影响的意见。

## 第五节 重要事项

### 一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

#### (一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

适用 不适用

公司一贯对股东的投资进行合理回报，实施连续、稳定、积极的利润分配政策。公司利润分配政策尤其是现金分红政策的制定及执行，严格按照《公司章程》的相关规定，经公司董事会和股东大会审议通过，分红标准和比例明确、清晰，相关的决策程序和机制完备，独立董事尽职履责并发挥了应有的作用，中小股东有充分表达意见和诉求的机会，充分保护了中小股东的合法权益。

公司 2007 至 2016 年累计向股东派发现金股利 182.29 亿元（含税），派送股票股利 12.34 亿股（含税），以资本公积转增股本 28.80 亿股。2007 至 2016 年，公司每年的股利分配金额占当年可供投资者分配利润的比例均超 30%，其中 2014 至 2016 年分别为 148.25%、54.71%、63.14%。

公司在《公司章程》中明确制定了公司的利润分配政策：“公司根据盈利情况，从实际出发，兼顾公司即期利益与长远利益，采取现金或股票方式分配股利，并优先采取现金分红的方式。原则上，公司在盈利年度进行现金分红。公司可以进行中期分配。公司利润分配应满足监管等规定或要求，不超过累计可分配利润，不影响公司持续经营能力。若公司在上一个会计年度实现盈利，但董事会在上一个会计年度结束后未提出现金分配预案的，公司应当在年度报告中说明未分红的原因、未用于分红的资金留存公司的用途，独立董事还应当对此发表独立意见。公司最近三年以现金方式累计分配的利润不少于最近三年实现的年均可分配利润的百分之三十，具体每个年度的分红比例将在满足公司经营和发展需要、根据年度盈利状况和未来资金使用计划等作出决议。如出现下列任一情况，并经出席公司股东大会的股东所持表决权的三分之二以上通过时，公司可对前述利润分配政策进行调整或变更：（一）相关法律法规发生变化或调整时；（二）净资产等风险控制指标出现预警时；（三）公司经营状况恶化时；（四）董事会建议调整时。公司根据经营情况和长期发展的需要确需调整利润分配政策的，调整后的利润分配政策不得违反公司监管部门的有关规定。对现金分红政策进行调整的，股东大会表决该议案时应提供网络投票方式，应经出席股东大会的股东所持表决权的三分之二以上通过，并应听取公众投资者的意见，及时答复公众投资者关心的问题。公司应当按照相关规定在年度报告中披露分红政策的制定、执行情况及其他相关情况。如涉及对现金分红政策进行调整或变更的，应详细说明调整或变更的条件及程序是否合规、透明。”

公司 2016 年度利润分配方案已于 2017 年 7 月 27 日实施完毕。公司以总股本 11,501,700,000 股为基数，向全体股东每股派发现金红利人民币 0.22 元（含税）（即每 10 股派发现金红利人民币 2.20 元（含税）），共计派发现金红利人民币 2,530,374,000.00 元（含税）；其中 A 股股本为 8,092,131,180 股，本次共计派发 A 股现金红利人民币 1,780,268,859.60 元；H 股股本为 3,409,568,820 股，本次共计派发 H 股现金红利港币 855,874,056.68 元。

**(二) 公司近三年（含报告期）的普通股股利分配方案或预案、资本公积金转增股本方案或预案**

经审计，公司 2017 年度合并报表中归属于母公司所有者的净利润为 8,618,423,293.06 元，母公司 2017 年度净利润为 6,187,564,013.18 元。

根据《公司法》、《证券法》、《金融企业财务规则》及《公司章程》等相关规定，公司在提取法定公积金、准备金后可以向投资者分配。公司按 2017 年母公司实现净利润的 10% 分别提取法定盈余公积、一般风险准备、交易风险准备 618,756,401.32 元，三项合计金额为 1,856,269,203.96 元，加母公司年初未分配利润 18,662,316,148.54 元，减公司本年实施 2016 年度利润分配方案分配的股利 2,530,374,000.00 元，母公司年末未分配的利润 20,463,236,957.76 元。根据有关规定，可供分配利润中公允价值变动收益部分不得用于现金分配，扣除 2017 年度公允价值变动收益对可供投资者现金分配利润的影响，公司 2017 年当年可供投资者现金分配的利润为 4,189,625,766.29 元。公司综合考虑长远发展和投资者利益，对 2017 年的利润分配预案确定为：

1. 以 2017 年 12 月 31 日的 A 股和 H 股总股本 11,501,700,000 股为基数，公司向股权登记日登记在册的 A 股和 H 股股东每 10 股派发现金股利人民币 2.30 元（含税），共计分配现金股利人民币 2,645,391,000.00 元。本次现金股利分配后母公司的未分配利润 17,817,845,957.76 元结转下一年度。

2. 现金股利以人民币计值和宣布，以人民币向 A 股股东支付，以港币向 H 股股东支付。港币实际发放金额按照公司 2017 年度股东大会召开日前五个工作日中国人民银行公布的人民币兑换港币平均基准汇率计算。

公司 2017 年度利润分配议案经年度股东大会审议通过后，将于该次股东大会召开之日起第二个月内进行现金股利分配。

单位：元 币种：人民币

| 分红年度   | 每 10 股送红股数 (股) | 每 10 股派息数 (元) (含税) | 每 10 股转增数 (股) | 现金分红的数额 (含税)     | 分红年度合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润 | 占合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润的比率 (%) |
|--------|----------------|--------------------|---------------|------------------|---------------------------|-------------------------------|
| 2017 年 | 0              | 2.3                | 0             | 2,645,391,000.00 | 8,618,423,293.06          | 30.69                         |
| 2016 年 | 0              | 2.2                | 0             | 2,530,374,000.00 | 8,043,334,519.30          | 31.46                         |
| 2015 年 | 0              | 4.5                | 0             | 5,175,765,000.00 | 15,838,850,897.61         | 32.68                         |

**(三) 以现金方式要约回购股份计入现金分红的情况**

适用  不适用

(四) 报告期内盈利且母公司可供普通股股东分配利润为正，但未提出普通股现金利润分配方案预案的，公司应当详细披露原因以及未分配利润的用途和使用计划

适用 不适用

## 二、承诺事项履行情况

(一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

适用 不适用

(二) 公司资产或项目存在盈利预测，且报告期仍处在盈利预测期间，公司就资产或项目是否达到原盈利预测及其原因作出说明

已达到 未达到 不适用

## 三、报告期内资金被占用情况及清欠进展情况

适用 不适用

## 四、公司对会计师事务所“非标准意见审计报告”的说明

适用 不适用

## 五、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明

(一) 公司对会计政策、会计估计变更原因及影响的分析说明

适用 不适用

2017 年财政部陆续修订了的企业会计准则，包括：《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》、《企业会计准则第 14 号——收入》、《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》、《企业会计准则第 16 号——政府补助》。根据财政部要求，公司对上述会计政策进行变更。本次会计政策变更具体情况及对公司影响如下：

### 1. 金融工具相关会计政策变更

根据财政部修订的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》规定，依据持有金融资产的“业务模式”和“金融资产合同现金流量特征”，金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产三类；金融资产减值由“已发生损失法”改为“预期损失法”，并且扩大了计提范围；套期会计方面扩大了符合条件的被套期项目和套期工具范围，以定性的套期有效性要求取代了定量要求，引入套期关系的“再平衡”机制；金融工具披露要求相应调整。

根据财政部规定，公司应于 2018 年 1 月 1 日起执行上述新准则。根据准则衔接规定，企业应当按照新准则重新编制 2018 年 1 月 1 日的资产负债表，无需重述前期可比数。2018 年 1 月 1 日及以后会计期间，公司按新会计准则的要求进行会计核算和相关列报，不重述 2017 年比较期间数据。

实施上述新准则对会计核算和相关列报的主要影响有：根据新准则，对公司金融资产进行分类和计量，包括对估值方法进行必要的调整；对相关金融资产运用预期损失法进行减值测试，并重新计量其账面价值；相应调整其他综合收益和期初留存收益。基于公司年末金融资产持仓情况和上述变更的测算，金融资产分类、计量及减值方法等变更预计将对公司财务报表产生广泛影响，但对公司的总资产和净资产未产生重大影响。

## 2. 收入相关会计政策变更

根据财政部修订的《企业会计准则第 14 号—收入》，将原收入准则和建造合同准则统一纳入收入确认的模型；以控制权转移替代风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准；对于包含多重交易安排的合同的会计处理提供更明确的指引；对于某些特定交易（或事项）的收入确认和计量给出了明确规定。

根据财政部规定，公司应于 2018 年 1 月 1 日起执行上述新准则。根据衔接规定，首次执行本准则的企业，应当根据首次执行本准则的累积影响数，调整首次执行本准则当年年初留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整。此次变更对公司净利润、总资产和净资产未产生重大影响。

其余会计政策已于 2017 年生效，对 2017 年财务报告未产生重大影响。

公司第六届董事会第二十九次会议审议通过了上述会计政策变更的议案。

### （二） 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明

适用 不适用

### （三） 与前任会计师事务所进行的沟通情况

适用 不适用

### （四） 其他说明

适用 不适用

## 六、聘任、解聘会计师事务所情况

单位：万元 币种：人民币

|              | 现聘任                                     |
|--------------|---|
| 境内会计师事务所名称   | 立信会计师事务所（特殊普通合伙）                        |
| 境内会计师事务所报酬   | 290                                     |
| 境内会计师事务所审计年限 | 7 年                                     |
| 境外会计师事务所名称   | 德勤会计师事务所（德勤·关黄陈方会计师行和德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 境外会计师事务所报酬   | 330                                     |
| 境外会计师事务所审计年限 | 6 年                                     |

|              | 名称               | 报酬 |
|--------------|------------------|----|
| 内部控制审计会计师事务所 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） | 40 |

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

报告期内，本公司续聘立信会计师事务所（特殊普通合伙）（简称“立信事务所”）为本公司 2017 年度外部审计师，负责根据中国企业会计准则等提供相关的境内审计服务，聘期一年，审计费用人民币 290 万元；聘请立信事务所为内部控制审计事务所，审计费用人民币 40 万元。续聘德勤会计师事务所（德勤·关黄陈方会计师行和德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），简称“德勤事务所”）为本公司 2017 年度外部审计师，负责根据国际财务报告准则提供相关的审计及审阅服务，聘期一年，审计费用人民币 330 万元。立信事务所、德勤事务所等为本集团内子公司提供审计服务费用合计人民币 1511 万元。报告期内，未出现董事会不同意审计委员会对甄选、委任外聘审计师事宜的意见。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

七、面临暂停上市风险的情况

(一) 导致暂停上市的原因

适用 不适用

(二) 公司拟采取的应对措施

适用 不适用

八、面临终止上市的情况和原因

适用 不适用

九、破产重整相关事项

适用 不适用

十、重大诉讼、仲裁事项

本年度公司有重大诉讼、仲裁事项 本年度公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》中要求披露的涉案金额超过 1,000 万元并且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10%以上的重大诉讼、仲裁事项。

十一、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况

适用 不适用

截至报告期末，本公司无直接持有本公司 5%以上股份的股东，且无实际控制人。报告期内，公司董事会、董事、监事、高级管理人员不存在被有权机关调查、被司法机关或纪检部门采取强

制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会立案调查或行政处罚、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚，以及被证券交易所公开谴责等情形。公司董事、监事、高级管理人员不存在违反相关规定买卖公司股票的情形。

2017 年 5 月 23 日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2017〕59 号），因公司涉嫌在融资融券业务中未按照规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款，中国证监会拟对公司作出行政处罚，详见公司于 2017 年 5 月 24 日发布的公告（公告编号：临 2017-024）。该事件涉及的公司员工已按照规定程序提出陈述、申辩，目前还在等待进一步处理意见。

## 十二、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

公司无直接持有本公司 5%以上股份的股东，且无实际控制人，在披露报告期内不存在未履行法院生效判决、不存在所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

## 十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

报告期内，本公司未实行股权激励计划。

### （一）相关激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

### （二）临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

#### 1. 海通国际证券集团购股权计划

2002 年 8 月 23 日，海通国际证券经股东批准采纳一项购股权计划（以下简称“2002 年购股权计划”），已于 2012 年 8 月 22 日届满。根据 2002 年购股权计划，购股权可授予海通国际证券或其任何附属（子）公司或联营公司的任何全职员工、执行董事及非执行董事。购股权行使价由海通国际证券董事确定，不得低于下列各项的最高值：（1）公司股票于要约日期在联交所的收盘价；（2）公司股票于要约日期前 5 个交易日在联交所的平均收盘价；（3）公司股票面值。2017 年度，海通国际证券购股权持有人在 2002 年购股权计划下共行使 3,327,798 份购股权。

海通国际证券于 2015 年 6 月 8 日召开的股东特别大会审议批准采纳新购股权计划（“以下简称“2015 年购股权计划”），该购股权计划于采纳日期起 10 年内有效及生效。根据 2015 年购股权计划，购股权可授予海通国际证券或其任何附属（子）公司的任何董事（包括执行董事、非执行董事、独立董事）或职员（不论全职或兼职）。购股权行使价由海通国际证券董事确定，不得低于下列各项的最高值：（1）公司股票于要约日期在香港联交所的收盘价的 110% 的价格；（2）公司股票于要约日期前 5 个交易日在香港联交所的平均收盘价；（3）公司股票面值。

2017 年度，海通国际证券在 2015 年购股权计划下授出并获接纳合共 13,350,000 份购股权。另有 1,951,274 份购股权于期内因员工辞职失效。

截至 2017 年 12 月 31 日，海通国际证券已发行但未获行使的购股权情况如下：

| 购股权计划       | 已发行但未获行使购<br>股权数量（注） | 每股行使价<br>（注） | 行权期限                                |
|-------------|----------------------|--------------|-------------------------------------|
| 2002 年购股权计划 | 5,812,110 份          | 2.764 港元     | 2011 年 3 月 3 日至<br>2019 年 3 月 2 日   |
| 2015 年购股权计划 | 15,878,100 份         | 4.667 港元     | 2016 年 12 月 8 日至<br>2021 年 5 月 11 日 |
|             | 13,350,000 份         | 5.038 港元     | 2018 年 6 月 7 日至<br>2022 年 11 月 9 日  |
| 合计          | 35,040,210 份         |              |                                     |

注：购股权数量及购股权行使价格可因供股、以股代息、红股发行或公司股本的其他类似变动而进行调整。根据 2002 年购股权计划尚未行使的购股权约占海通国际证券 2017 年 12 月 31 日已发行股份约 0.11%，若余下购股权获悉数行使，在海通国际证券目前的资本结构下，将须额外发行 5,812,110 股海通国际证券普通股，而海通国际证券的股本将额外增加 581,000 港元，股本溢价为 15,483,000 港元（未扣除发行开支）。

根据 2015 年购股权计划尚未行使的购股权约占海通国际证券 2017 年 12 月 31 日已发行股份约 0.53%，若余下购股权获悉数行使，在海通国际证券目前的资本结构下，将须额外发行 29,228,100 股海通国际证券普通股，而海通国际证券的股本将额外增加 2,923,000 港元，股本溢价为 138,438,000 港元（未扣除发行开支）。（详情请参阅海通国际证券于香港联交所网站刊发的 2017 年年度报告。）

## 2. 恒信金融集团购股权计划

海通国际控股子公司恒信金融集团于 2014 年 5 月 27 日采纳了一项股票期权激励计划，有效期 5 年。根据该计划，激励对象为恒信金融集团董事会认定的恒信金融集团及其附属公司的董事、高级管理人员、经营管理骨干、核心技术及业务人员等，总计不超过 50 人。该计划拟授予激励对象不超过 97,321,500 份股票期权，2015 年 1 月 19 日按决议要约向该计划下 28 名合格参与者分配购股权，以根据购股权计划认购恒信金融集团股本中合共不超过 85,980,375 股普通股。

考虑到中国现行法律法规的要求及海通恒信战略发展和经营管理的需要，经恒信金融集团董事会决策，基于海通证券股东大会于 2014 年 5 月 27 日对恒信金融集团董事会的授权，对股票期权计划下已授予但未获行权的股票期权进行退出性安排。在拟定此安排时，已充分考虑股权激励计划有关条文和相关员工对海通恒信所作出的贡献。

十四、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易

报告期内，公司严格按照2016年度股东大会审议通过的《关于预计公司2017年度日常关联交易的议案》，开展日常关联交易，相关执行情况如下表：

➤ 与法国巴黎投资管理 BE 控股公司及其相关企业的关联交易

| 交易类别      | 交易内容     | 交易说明  | 2017 年实际发生交易金额<br>(单位：万元) | 占同类业务比例 |
|-----------|----------|---|---------------------------|---------|
| 证券和金融产品服务 | 手续费及佣金收入 | 主要包括投资银行业务收入、基金产品代销收入、投资咨询服务费、资产管理费、证券承销收入等 | 952.37                    | 0.19%   |
|           | 业务及管理费支出 | 主要包括向关联方支付的咨询费、销售费用等                        | 12.17                     | 0.00%   |
| 证券和金融产品交易 | 手续费及佣金收入 | 主要包括证券交易手续费及佣金收入                            | 89.12                     | 0.01%   |
|           | 债券交易金额   | 主要包括股票质押回购、银行间市场买入返售或卖出回购、收益互换等业务产生的交易金额    | 31,000.00                 | -       |
|           | 回购交易金额   | 主要为固定收益等业务所涉及的回购交易                          | 19,012.00                 | -       |
|           | 利率互换     | 主要为固定收益等业务产生的交易                             | 34,000.00                 | -       |
|           | 应收款项     | 主要为应收管理费，                                   | 213.34                    | 0.03%   |
|           | 应付款项     | 主要包括基金客户维护等业务产生的应付款项                        | 1,014.57                  | 0.16%   |

➤ 与上海盛源房地产（集团）有限公司的关联交易

| 交易类别      | 交易内容    | 交易说明         | 2017 年实际发生交易金额<br>(单位：万元) | 占同类业务比例 |
|-----------|---------|--------------|---------------------------|---------|
| 证券和金融产品交易 | 代理买卖证券款 | 主要包括客户保证金等资产 | 0.31                      | 0.00%   |

➤ 与本公司董事、监事、高级管理人员担任董事、高级管理人员的除本公司及其控股子公司以外的企业等其它关联法人的关联交易

| 交易类别 | 交易内容 | 交易说明 | 2017 年实际发生交易金额<br>(单位：万元) | 占同类业务比例 |
|------|------|------|---------------------------|---------|
|------|------|------|---------------------------|---------|

|           |          |   |              |       |
|-----------|----------|---|--------------|-------|
| 证券和金融产品服务 | 手续费及佣金收入 | 主要包括投资银行业务收入、基金产品代销收入、投资咨询服务费、资产管理费、证券承销收入等 | 13,695.97    | 2.76% |
|           | 业务及管理费支出 | 主要包括向关联方支付的咨询费、销售费用等                        | 3,817.04     | 0.39% |
| 证券和金融产品交易 | 手续费及佣金收入 | 主要包括证券交易手续费及佣金收入                            | 41.62        | 0.01% |
|           | 利息收入     | 主要包括股票质押回购、银行间市场买入返售或卖出回购、收益互换等业务利息收入       | 12,691.44    | 0.84% |
|           | 利息支出     | 主要包括客户资金存款利息支出等                             | 8,550.06     | 0.75% |
|           | 代理买卖证券款  | 主要包括客户保证金等资产                                | 23,282.30    | 0.28% |
|           | 应付短期融资款  | 主要为收益凭证认购等                                  | 10,031.34    | 0.34% |
|           | 回购交易金额   | 主要为固定收益等业务所涉及的回购交易                          | 1,632,697.50 | -     |
|           | 债券交易金额   | 主要为固定收益等业务产生的交易                             | 545,000.00   | -     |
|           | 利率互换     | 主要为固定收益等业务产生的交易                             | 90,000.00    | -     |
|           | 银行借款     | 主要为融资租赁等业务产生的银行借款                           | 279,149.10   | 4.55% |
|           | 应付利息     | 主要为融资租赁等业务产生的应付利息                           | 253.44       | 0.08% |

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(五) 其他

适用 不适用

十五、重大合同及其履行情况

(一) 托管、承包、租赁事项

1、托管情况

适用 不适用

2、承包情况

适用 不适用

3、租赁情况

适用 不适用

(二) 担保情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）               |             |      |      |               |       |   |      |            |        |        |         |          |      |
|------------------------------------|-------------|------|------|---------------|-------|---|------|------------|--------|--------|---------|----------|------|
| 担保方                                | 担保方与上市公司的关系 | 被担保方 | 担保金额 | 担保发生日期（协议签署日） | 担保起始日 | 担保到期日   | 担保类型 | 担保是否已经履行完毕 | 担保是否逾期 | 担保逾期金额 | 是否存在反担保 | 是否为关联方担保 | 关联关系 |
|                                    |             |      |      |               |       |   |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）            |             |      |      |               |       | 0   |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）          |             |      |      |               |       | 0   |      |            |        |        |         |          |      |
| 公司及其子公司对子公司的担保情况                   |             |      |      |               |       |   |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期内对子公司担保发生额合计                    |             |      |      |               |       | 2,997,984,000   |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期末对子公司担保余额合计（B）                  |             |      |      |               |       | 29,684,423,852  |      |            |        |        |         |          |      |
| 公司担保总额情况（包括对子公司的担保）                |             |      |      |               |       |   |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保总额（A+B）                          |             |      |      |               |       | 29,684,423,852  |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保总额占公司净资产的比例（%）                   |             |      |      |               |       | 25.2%   |      |            |        |        |         |          |      |
| 其中：                                |             |      |      |               |       |   |      |            |        |        |         |          |      |
| 为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）           |             |      |      |               |       | 0   |      |            |        |        |         |          |      |
| 直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D） |             |      |      |               |       | 22,243,097,800  |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保总额超过净资产50%部分的金额（E）               |             |      |      |               |       | 0   |      |            |        |        |         |          |      |
| 上述三项担保金额合计（C+D+E）                  |             |      |      |               |       | 22,243,097,800  |      |            |        |        |         |          |      |
| 未到期担保可能承担连带清偿责任说明                  |             |      |      |               |       |   |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保情况说明                             |             |      |      |               |       | <p>1. 2017年4月27日，公司召开的第六届董事会第二十四次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。公司2017年6月8日作为担保人签署《贷款协议》，为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供2亿欧元连带责任保证担保。</p> <p>2. 2016年8月29日，公司第六届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管追加净资本担保承诺及对其增加注册资本的议案》，同意公司对海通资管追加不超过人民币40亿元的净资本担保承诺。公司为海通资管提供最高额度为人民币40亿元的净资本</p> |      |            |        |        |         |          |      |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>担保承诺，并承诺当海通资管开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效</p> <p>3. 2015 年 2 月 9 日，公司 2015 年第一次临时股东大会、2015 年度第一次 A 股/H 股类别股东大会审议通过了《关于新增对外担保额度的议案》，公司拟为公司在境外的全资附属公司一次或多次或多期公开或非公开发行的境外债务融资工具，且境外公司债务融资工具的规模合共不超过公司最近一期末公司净资产额的 50%，提供连带责任保证担保。</p> <p>2015 年 6 月 5 日，公司第六届董事会第六次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司发行欧元债提供连带责任保证担保的议案》。鉴于本次发行的实际情况，本次发行分两次交割，因此分两次签署《担保协议》，公司于 2016 年 5 月 18 日签署第一份《担保协议》，为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 1 亿欧元、于 2021 年到期、票面利率为 1.6% 的欧元债，提供连带责任保证担保。</p> <p>公司于 2016 年 5 月 26 日签署第二份《担保协议》，为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 1.2 亿欧元、于 2021 年到期、票面利率为 1.6% 的欧元债券，提供连带责任保证担保。</p> <p>4. 2016 年 3 月 30 日，公司第六届董事会第十五次会议审议通过了《关于为子公司提供融资担保的议案》。2016 年 5 月 26 日，公司 2015 年度股东大会审议通过了《关于提请股东大会授权董事会决定子公司担保事宜的议案》，公司拟为全资附属子公司（包括资产负债率超过 70% 的全资附属子公司）和控股子公司一次或多次或多期公开或非公开发行境内或境外的债务融资工具（包括但不限于债券、次级债券、超短期融资券、短期融资券、中期票据、票据、成立票据计划等）</p> |
|--|--|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>以及境内或境外银行贷款（包括但不限于银行授信、银行贷款、银团贷款等），且公司对外担保规模合计不超过公司最近一期末公司经审计净资产额的 50%，以及单笔担保额不超过最近一期末公司经审计净资产 10%，提供连带责任保证担保。</p> <p>公司于 2016 年 5 月 31 日签署《担保协议》，为境外间接全资附属公司 Haitong Investment Ireland Public Limited Company 向银团贷款提供 7.5 亿欧元的连带责任保证（以下简称“本次担保”）。本次新融资是为了替换此前 Novo Banco, S.A.（以下简称“NB”）向本公司境外附属公司 Banco Espírito Santo de Investimento, S.A.（现更名为 Haitong Bank, S.A, 以下简称“海通银行”）提供的 7.5 亿欧元贷款（以下简称“NB 贷款”）议案决定担保的新融资的本金金额不超过 8 亿欧元，担保期限不超过 5 年，并将撤销公司原来对 NB 贷款的担保。</p> <p>同时，海通银行与被担保人签署双边贷款协议，并根据与 NB 达成的协议将所得资金提前偿还原 NB 贷款，公司原来对 NB 贷款的担保义务撤消。本次撤销的担保是公司收购海通银行于 2015 年 9 月 7 日签署的担保协议，该笔担保的担保人为本公司，被担保人为 Banco Espírito Santo de Investimento, S.A.（现更名为 Haitong Bank, S.A），债权人为 NB, 担保金额为 7.5 亿欧元本金及利息，担保期限为 3 年。</p> <p>本次担保相关的《融资协议》签署于 2016 年 5 月 31 日，其中的担保条款规定，担保人为本公司，被担保人为 Haitong Investment Ireland Public Limited Company，牵头行为中国建设银行股份有限公司伦敦分行，代理行为中国建设银行股份有限公司法兰克福分行，担保金额为 7.5 亿欧元贷款本金、利息、前端费、借款人应当承担的其他费用等，担保期限为 5 年。</p> <p>5. 2015 年 4 月 13 日，公司第六届董事会第三次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司发行美元债</p> |
|--|--|

|  |  |
|--|--|
|  | <p>提供连带责任保证担保的议案》。公司就境外的全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 6.7 亿美元、于 2020 年到期、票面利率为 3.5% 的美元债券, 提供连带责任保证担保。</p> <p>6. 公司于 2013 年 10 月发行首期境外债券(9 亿美元), 发行主体为间接全资附属公司 Haitong International Finance Holdings Limited。为增强本次首期境外债券的偿债保障, 降低发行利率, 根据公司 2013 年度第一次临时股东大会的授权, 公司获授权人士确定由中国银行新加坡分行以开立备用信用证方式为本次首期境外债券提供担保。同时, 根据第五届董事会第二十一次会议决议, 公司就发行的首期境外债券开立的备用信用证向中国银行出具反担保函, 反担保金额为发行的首期境外债券本金、利息及其他相关费用。保证方式为连带责任保证, 保证期结束日期为备用信用证有效期届满之日起六个月。</p> <p>7. 公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》, 董事会同意本公司随时对海通资管公司提供不超过十五亿元的净资本担保承诺, 以保证其净资本保持充足。2013 年 6 月 9 日, 上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2013]145 号), 同意本公司向海通资管公司提供 8 亿元的担保承诺。本公司扣减了 8 亿元净资本, 并相应增加海通资管公司 8 亿元净资本。</p> |
|--|--|

(三) 其他重大合同

适用  不适用

十六、其他重大事项的说明

适用  不适用

1. 子公司增资事项

(1) 海富通基金及其全资子公司完成增资

根据 2016 年 10 月 28 日公司第六届董事会第十九次会议通过的《关于对海富通基金管理有限公司增资的议案》，控股子公司海富通基金以留存收益转增注册资本的方式增资 1.5 亿元。增资后，海富通基金注册资本金 3 亿元，其中海通证券持股比例为 51%，保持不变。上述增资已于 2017 年 6 月完成。

根据 2016 年 10 月 28 日公司第六届董事会第十九次会议通过的《关于海富通基金对上海富诚海富通资产管理有限公司增资的议案》，海富通基金于 2017 年累计出资 0.80 亿元，以现金出资方式完成对全资子公司富诚海富通增资。截至 2017 年 12 月 31 日，富诚海富通注册资本金 1.80 亿元，海富通基金持有其 100% 股权。

#### (2) 海通期货完成对其子公司增资

根据 2017 年 2 月 24 日公司第六届董事会第二十二次会议通过的《关于海通期货股份有限公司向海通期货香港有限公司增资的议案》，控股子公司海通期货于 2017 年 5 月完成向其全资子公司海通期货香港有限公司增资 4,000 万港元。增资后海通期货香港有限公司注册资本为 7,000 万港元。

根据 2018 年 1 月 12 日公司第六届董事会第二十八次会议通过的《关于海通期货对海通资源增加注册资本的议案》，海通期货拟于 2018 年向其全资子公司海通资源增资 3 亿元人民币，增资后海通资源注册资本为 5 亿元人民币，并保持股权结构不变。

#### (3) 海通银行完成增资

根据 2017 年 3 月 29 日公司第六届董事会第二十三次会议审议通过的《关于向海通银行增资的议案》，截至 2017 年 8 月 31 日，公司通过全资子公司海通国际控股完成向其全资子公司海通银行 4.185 亿欧元的增资。增资完成后，海通银行的注册资本增加至 8.45 亿欧元。

#### (4) 海通恒信完成对其子公司的增资

2017 年 5 月，海通恒信融资租赁（上海）第一届董事会第七次会议审议通过了《海通恒信融资租赁（上海）有限公司关于 2016 年度利润分配的议案》，同意以海通恒信融资租赁（上海）2016 年年末未分配利润人民币 1.6 亿元按照各股东出资比例转增公司注册资本。增资完成后，海通恒信融资租赁（上海）注册资本由 12 亿元人民币增加至 13.6 亿元人民币。上述增资已于 2017 年 8 月完成。

## 2. 子公司收购、新设、变更等事项

#### (1) 海通银行出售子公司

2017 年 12 月 15 日，海通银行同海通国际证券的全资附属公司 Haitong International (BVI) Limited 签订出售协议。据此，Haitong International (BVI) Limited 收购海通银行持有的英国子公司 Haitong (UK) Limited 及美国子公司 Haitong Securities USA LLC 100% 的股权。2018 年 2 月 23 日，海通国际证券与海通银行顺利完成被收购公司的股权交割工作，Haitong (UK) Limited 和 Haitong Securities USA LLC 正式成为海通国际证券的间接全资子公司。

#### (2) 海通国际证券对外收购

2017 年 2 月 28 日，海通国际证券已收购 Haitong International Financial Services (Singapore) Pte Limited (前称 G. K. Goh Financial Services (Singapore) Pte Limited)，并付出现金收购价新加坡币 1,249 万元（港币等值 6,798 万元）。

### （3）海通恒信设立子公司

2017 年 4 月，海通恒信于香港注册成立全资附属公司海通恒信租赁（香港）。

2017 年 6 月，恒信金融集团于香港注册成立全资附属公司海通恒信融资租赁控股。

2017 年 6 月，海通恒信通过海通恒信租赁（香港），于爱尔兰注册成立全资附属公司 Haitong UT Leasing Irish Holding Corporation Limited。

## 3. 子公司其他事项

### （1）海通期货挂牌新三板

控股子公司海通期货于 2017 年 12 月 29 日获批在全国中小企业股份转让系统挂牌，并于 2018 年 3 月 6 日完成正式挂牌。

### （2）海通恒信启动上市

经 2017 年 3 月 29 日召开的海通证券第六届董事会第二十三次会议及 2017 年 6 月 6 日召开的海通证券 2016 年度股东大会审议通过，海通恒信拟分拆独立上市，公开发行境外上市外资股（H 股）并在香港联交所主板上市。2017 年 6 月 21 日，海通恒信取得了证监会出具的行政许可申请受理通知书。2017 年 6 月 27 日，海通恒信通过联席保荐人向香港联交所呈交上市申请（A1 表格），申请海通恒信 H 股股份于香港联交所主板上市及批准买卖（以下简称“上市申请”）。自上市申请之日起六个月期间已届满，上市申请于 2018 年 2 月 28 日获重续。目前，海通恒信的 H 股上市工作正在稳步推进中。

根据中国证监会和香港联交所的相关规定与指引，为避免同业竞争、减少关联/连交易、保障未来股东权益，海通恒信拟通过香港子公司直接或间接收购或持有恒信金融集团所持有的海通恒信融资租赁（上海）、海通恒运、贵安恒信各 25%的股权。按重组计划，2017 年 11 月，恒信金融集团将其持有的海通恒运 25%的股权受让至恒信金融集团全资子公司海通恒信融资租赁控股。2018 年 1 月，恒信金融集团将其持有的海通恒信融资租赁（上海）25%的股权受让至海通恒信融资租赁控股。目前，恒信金融集团持有的贵安恒信 25%的股权受让至海通恒信融资租赁控股事项正在办理工商变更登记中。

### （3）恒信金融集团的融资与担保事项

根据境外发债计划结构安排，恒信金融集团对境外发债主体 Unican Limited 提供担保，2017 年发生额 2.2 亿美元，2017 年年末未到期的余额为 2.84 亿美元及 10 亿元人民币。

海通恒信租赁（香港）有限公司 2017 年 8 月组建境外美元银团贷款，以支持境外飞机租赁项目，总规模 1.33 亿美元。

### （4）恒信金融集团及其子公司发行债券

2017 年 4 月，海通恒信境内主体信用等级调升至 AAA。

恒信金融集团通过旗下的特殊目的主体 Unican Limited 分别于 2017 年 5 月及 9 月成功发行境外美元私募债，规模共计 2.2 亿美元。

海通恒信 2017 年共发行五期超短期融资券，合计规模 46 亿元人民币；发行两期公司债，合计规模 25 亿元人民币；发行一期短期融资券，规模 10 亿元人民币；发行资产支持证券及资产支持票据，合计规模（含次级）30.8 亿元人民币；发行一期非公开定向债务融资工具 PPN，规模 8 亿元人民币。

#### （5）高级管理人员的任免

2017 年 10 月 31 日，葡萄牙央行批复了海通银行 2017-2019 任期董事长及首席执行官的任命，由林涌先生担任海通银行董事长、非执行董事，伍敏先生担任海通银行首席执行官、执行董事。

2018 年 2 月 8 日，海通国际控股及其控股子公司海通国际证券完成了董事会主席的任免。吉宇光先生卸任海通国际控股董事会主席、海通国际证券董事会主席及非执行董事；瞿秋平先生就任海通国际控股董事会主席、海通国际证券董事会主席兼非执行董事。

## 十七、积极履行社会责任的工作情况

### （一）上市公司扶贫工作情况

√适用 □不适用

2017 年是推进脱贫攻坚战的冲锋年，也是国家精准扶贫的深化年。公司继续贯彻落实《中国证监会关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》要求，通过“一司一县”、“一县一企”结对帮扶、城乡结对综合帮扶、资本市场产业帮扶、社会慈善公益帮扶等各种形式，积极履行社会责任，全心致力脱贫攻坚。

#### 1. 精准扶贫规划

2017 年，公司的扶贫规划主基调不变，依然聚焦在以下四个方面：一是通过签订“一司一县”和“一县一企”结对帮扶工作框架协议，促进贫困县区域经济持续发展和稳定增长，帮助困难群众脱贫，力争通过三年时间帮助地方政府完成区域经济转型，实现脱贫致富目标；二是发挥公司金融服务专业优势和资源优势，利用资本市场多层次融资功能，通过金融扶贫促进地方经济稳步发展；三是在加快上海城乡一体化发展进程中，继续开展为期五年的新一轮农村综合帮扶工作，推进实施“美丽乡村，生态崇明”行动计划，并与上海郊区贫困村镇开展城乡党组织结对帮扶工作，通过各类帮扶手段，帮助地方发展经济；四是多方位开展公益慈善活动，在创造经济效益的同时不忘反哺社会，积极履行社会责任。

#### 2. 年度精准扶贫概要

（1）坚定贯彻精准扶贫攻坚战略，落实“一司一县”、“一县一企”结对帮扶行动

2016 年，公司分别与安徽省亳州市利辛县、江西省赣州市宁都县、安徽省六安市舒城县签订了“一司一县”结对帮扶框架协议。在此基础上，2017 年 12 月黑龙江分公司与黑龙江省哈尔滨

市延寿县签订了“一司一县”扶贫服务备忘录。公司积极落实精准扶贫攻坚战略，与地方政府在资金扶贫、金融扶贫、智力扶贫、消费扶贫等方面加强了合作，建立了长效帮扶机制。

公司每年向利辛县、舒城县和宁都县政府各拨付 100 万元专项扶贫资金，定向支持贫困县的教育、医疗等民生保障工程。

利用公司综合金融平台的优势，公司在融资策划、债券发行、企业上市、并购重组等方面为辖区内企业提供全方位金融服务，帮助结对地区拓宽融资渠道，为地方经济寻找持续增长模式。2017 年 9 月和 11 月，公司分别与安徽省利辛县春蕾农业发展有限公司和江西家俊婴童用品有限公司签订了“一县一企”结对帮扶工作框架协议，帮助两家企业规范公司治理，优化财务内控制度，提升融资能力和企业形象，保障业务持续发展。2017 年 3 月，公司在两省三地举办了金融和资本市场专题的相关讲座；公司业务部门也赴当地调研，并推进了利辛春蕾农业发展公司债项目、利辛农商行 IPO 上市计划、舒城农商行二级资本债融资方案、宁都新三板企业永通股份（831705.0C）定增发行等业务；公司成功推荐两省三地的特色产品通过消费扶贫平台在线销售，实现产业扶贫；公司对贫困地区的干部交流工作也在持续推进，挂职干部的工作成绩得到当地政府和党委的肯定。

### （2）发挥自身优势，把资本市场专业金融服务引入扶贫工作

公司发挥证券期货行业优势，积极探索资本市场的普惠金融功能与机制，在投资银行、债券融资、期货经营、资本投资和融资租赁等各业务领域开展精准扶贫，业务政策积极倾向对贫困地区的经济扶持，支持贫困地区拓宽融资渠道，降低融资成本，抵御市场风险，形成多渠道、多层次的扶持格局。

公司于 2017 年完成的贫困地区投行项目包括：宁夏嘉泽新能源股份有限公司首次公开发行项目，募集资金总额 24408 万元；贫困地区新三板企业贵州三阁园林债转股及现金融资项目，融资金额 3000 万元；湖南马上游科技股份有限公司新三板定增项目，募集资金 2,700 万元；江西永通科技股份有限公司新三板定增项目 3,870 万元。

公司旗下子公司海通期货先后与河南省睢县、陕西省延长县签订了“一司一县”精准帮扶备忘录，为海南琼中县、云南勐海县、河南睢县、黑龙江明水县提供了定制化场外期权风险管理服务，对农产品价格下跌风险进行保护，项目名义本金及套期保值金额已达 1,736 万元。同时海通期货出资 90 万元无偿援助陕西省延长县发展畜禽养殖业，产业扶贫到村到户，促进贫困户稳定增收，已帮助 44 户共 112 人实现脱贫目标。

子公司海通恒信积极在贫困县开展融资租赁业务，融资范围覆盖医疗、教育、工业、农业、建筑、印刷、林业、能源与环保等诸多行业，直接通过租赁、回租、保理、委托贷款等方式先后为 100 多个贫困县（区）的企事业单位提供了继续的设备和资金支持，累计投放金额近 30 亿，为贫困地区的经济尽快摆脱困境，走上绿色可持续发展道路贡献了力量。

### （3）助力崇明生态岛建设，做好“家门口”的帮扶工作

2017 年是公司与崇明区签订综合帮扶框架协议收官之年。综合帮扶五年来，公司累计完成拨付帮扶资金 2,500 万元，持续聚焦重点“造血”项目，协助崇明建设现代化农业示范区、推进“美丽乡村”行动计划，助力崇明实现建设国际生态岛的规划目标。2017 年，公司继续与崇明区建设镇富安村、上海金山区廊下镇景展居委会、浦东新区宣桥镇光明村开展城乡党组织结对帮扶工作，定期慰问当地困难群众，举办各类文艺活动为地区提供智力支持，为当地投资者开展普惠金融教育，不断将城乡党组织结对工作推向深入。

(4) 多方位开展慈善公益活动，积极履行企业社会责任

公司在创造经济效益的同时，通过捐资助学、扶贫慈善、爱心公益等各类社会公益活动，积极履行企业社会责任。公司团委持续开展青年公益志愿服务系列活动——“爱在海通”的公益品牌深入人心。2017 年 5 月，团委组织公司上海地区的团员青年开展 5.20 青年公益徒步和爱心义卖活动，定向帮扶宁都县车头完小，改善学生的学习生活条件。四川分公司组织团员青年积极参加中国扶贫基金会“善行者”健跑活动，身体力行投身公益。新疆分公司多年与新疆证监局定点帮扶县麦盖提县建立帮扶关系，连续数年资助当地维吾尔族大学生，2017 年又捐助 20 万元用于当地基础建设。广东分公司积极参与广东广播电视台举办的大型公益宣传活动，通过运动赛事传播新农村建设成就。山西分公司开展了为环卫工人献爱心活动，在营业部设立爱心驿站，为环卫工人提供饮用水、微波炉和休息场所，并捐赠药品和劳保用品。甘肃武威建国街营业部连续 7 年开展捐资助学活动，哈尔滨一曼街营业部连续 3 年开展爱心助考服务。公益慈善活动已经成为公司员工的共识，融入了海通的公司文化。

3. 精准扶贫成效

单位：万元 币种：人民币

| 指 标                 | 数量及开展情况   |
|---------------------|---|
| 一、总体情况              |   |
| 其中：1. 资金            | 935.98  |
| 2. 物资折款             | /   |
| 3. 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人） | 15  |
| 二、分项投入              |   |
| 1. 产业发展脱贫           |   |
| 其中：1.1 产业扶贫项目类型     | <input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫<br><input type="checkbox"/> 旅游扶贫<br><input type="checkbox"/> 电商扶贫<br><input type="checkbox"/> 资产收益扶贫<br><input type="checkbox"/> 科技扶贫<br><input type="checkbox"/> 其他 |
| 1.2 产业扶贫项目个数（个）     | 2   |
| 1.3 产业扶贫项目投入金额      | 90  |
| 2. 生态保护扶贫           |   |
| 其中：2.1 项目名称         | <input checked="" type="checkbox"/> 开展生态保护与建设<br><input type="checkbox"/> 建立生态保护补偿方式<br><input type="checkbox"/> 设立生态公益岗位<br><input type="checkbox"/> 其他  |

|                    |       |
|--------------------|-------|
| 2.2 投入金额           | 500   |
| 3. 社会扶贫            |       |
| 其中：3.1 东西部扶贫协作投入金额 | /     |
| 3.2 定点扶贫工作投入金额     | 300   |
| 3.3 扶贫公益基金         | 15.98 |
| 4. 其他项目            |       |
| 其中：4.1. 项目个数（个）    | 2     |
| 4.2. 投入金额          | 30    |

#### 4. 后续精准扶贫计划

2018 年是国家扶贫工作的攻坚之年，也是全面建成小康社会的决胜冲刺阶段。公司将继续担负起精准扶贫的社会责任，充分发挥自身优势，以服务贫困区域转型发展和帮助贫困群众摆脱贫困为目标，继续在努力做好以下四方面工作：

一是继续深化“一司一县”结对帮扶行动。公司将继续扎实推进与对口国家级贫困县的金融扶贫项目，与当地县政府就金融扶贫、产业扶贫、消费扶贫、人才培养和帮扶资金使用等方面开展进一步合作。2018 年公司将与结对县地方政府携手开展人才和干部双向挂职交流，在扶贫攻坚战中培养、锻炼和考察干部。通过“一县一企”结对帮扶行动，聚焦当地有发展前景的龙头企业，帮助企业融资融智，为结对县实现区域转型发展提供全方位有力支持；二是继续深化金融扶贫和产业扶贫工作，发挥公司综合金融平台的优势，重点做好资本市场产业扶贫工作，为贫困地区培育壮大实体经济，积蓄脱贫后持续发展致富的后劲；三是扩大上海地区城乡党组织结对帮扶成果，围绕帮助发展经济、帮助困难群众、帮助培养人才、帮助改善村貌和帮助文化建设等五方面扩大结对帮扶成果；四是结合公司成立三十周年庆，提升公司对公益慈善事业的支持力度。公司将努力扩大“爱在海通”公益品牌的影响力和收益面，邀请上海保险交易所设计满足贫困地区需求的个性化爱心保险产品，开展“爱在海通·爱传递”乡村教师培训项目和“爱在海通·爱传递”再生电脑教室公益项目，带领广大员工一起持续社会慈善公益扶贫上下功夫，充分展现公司的企业社会责任和公司员工作为金融从业人员的社会责任。

#### (二) 社会责任工作情况

适用  不适用

有关公司具体的环境政策及表现、公司遵守对该公司有重大影响的有关法律及规例的情况及公司与其雇员、顾客及供应商的重要关系的说明，请参见本公司于 2018 年 3 月 27 日于上交所披露的《2017 海通证券社会责任报告》。

#### (三) 环境信息情况

##### 1. 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其重要子公司的环保情况说明

适用  不适用

不属于重点排污企业，不涉及相关信息。

2. 重点排污单位之外的公司

适用 不适用

不属于重点排污企业，不涉及相关信息。

3. 其他说明

适用 不适用

(四) 其他说明

适用 不适用

十八、可转换公司债券情况

(一) 转债发行情况

适用 不适用

(二) 报告期转债持有人及担保人情况

适用 不适用

(三) 报告期转债变动情况

适用 不适用

报告期转债累计转股情况

适用 不适用

(四) 转股价格历次调整情况

适用 不适用

(五) 公司的负债情况、资信变化情况及在未来年度还债的现金安排

适用 不适用

(六) 转债其他情况说明

适用 不适用

## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、普通股股本变动情况

#### (一) 普通股股份变动情况表

##### 1、普通股股份变动情况表

报告期内，公司普通股股份总数及股本结构未发生变化。

##### 2、普通股股份变动情况说明

适用 不适用

##### 3、普通股股份变动对最近一年和最近一期每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）

适用 不适用

##### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

#### (二) 限售股份变动情况

适用 不适用

### 二、证券发行与上市情况

#### (一) 截至报告期内证券发行情况

适用 不适用

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

适用 不适用

| 股票及衍生证券的种类 | 发行日期        | 发行价格或利率 | 发行数量   | 上市日期        | 获准上市交易数量 | 交易终止日期                      |
|------------|-------------|---------|--------|-------------|----------|-----------------------------|
| 公司债        | 2013年11月25日 | 6.15%   | 23.5亿元 | 2013年12月16日 | 23.5亿元   | 2018年11月22日                 |
| 公司债        | 2013年11月25日 | 6.18%   | 23.9亿元 | 2013年12月16日 | 23.9亿元   | 2023年11月23日                 |
| 公司债        | 2014年07月14日 | 5.45%   | 45.5亿元 | 2014年08月13日 | 45.5亿元   | 2019年07月11日                 |
| 公司债        | 2014年07月14日 | 5.85%   | 8亿元    | 2014年08月13日 | 8亿元      | 2024年07月11日                 |
| 公司债        | 2017年08月11日 | 4.63%   | 50亿元   | 2017年08月24日 | 50亿元     | 2020年08月07日                 |
| 公司债        | 2017年08月11日 | 4.80%   | 10亿元   | 2017年08月24日 | 10亿元     | 2022年08月09日                 |
| 公司债        | 2017年09月22日 | 4.99%   | 55亿元   | 2017年10月10日 | 55亿元     | 2027年09月20日                 |
| 公司债        | 2017年10月25日 | 4.77%   | 5亿元    | 2017年11月07日 | 5亿元      | 2020年10月22日                 |
| 次级债        | 2015年04月08日 | 5.50%   | 150亿元  | 2015年05月11日 | 150亿元    | 2018年04月04日<br>2020年04月06日* |

|          |                  |       |        |                  |        |                                       |
|----------|------------------|-------|--------|------------------|--------|---------------------------------------|
| 次级债      | 2015 年 06 月 12 日 | 5.38% | 50 亿元  | 2015 年 08 月 26 日 | 50 亿元  | 2018 年 06 月 08 日<br>2020 年 06 月 10 日* |
| 次级债      | 2016 年 11 月 17 日 | 3.30% | 40 亿元  | 2016 年 11 月 30 日 | 40 亿元  | 2019 年 11 月 14 日                      |
| 次级债      | 2016 年 11 月 17 日 | 3.40% | 20 亿元  | 2016 年 11 月 30 日 | 20 亿元  | 2021 年 11 月 15 日                      |
| 次级债      | 2017 年 03 月 16 日 | 4.80% | 45 亿元  | 2017 年 3 月 30 日  | 45 亿元  | 2020 年 03 月 12 日                      |
| 非公开发行公司债 | 2016 年 05 月 18 日 | 3.60% | 150 亿元 | 2016 年 06 月 15 日 | 150 亿元 | 2019 年 05 月 15 日<br>2020 年 05 月 14 日* |
| 非公开发行公司债 | 2016 年 05 月 18 日 | 3.80% | 50 亿元  | 2016 年 06 月 15 日 | 50 亿元  | 2021 年 05 月 13 日                      |

\*若发行人行使赎回选择权，则根据募集说明书约定确定交易终止日。

### 1. 公司债券

2013 年 3 月 26 日，公司第五届董事会第十六次会议审议通过了《关于公司发行公司债券的议案》、《关于公司发行公司债券一般性授权的议案》，并经 2013 年 5 月 27 日召开的公司 2012 年度股东大会审议通过，授权董事长、总经理共同或分别全权办理发行公司债券相关事宜。经中国证监会于 2013 年 9 月 25 日签发的“证监许可[2013]1220 号”文核准，公司获准向社会公开发行面值总额不超过 230 亿元的公司债券。本次债券采取分期发行的方式，公司根据市场情况等因素协商确定各期债券的发行时间、发行规模及其他发行条款。本次债券的首期 120 亿元已于 2013 年 11 月 27 日完成发行，三年期、五年期、十年期品种规模分别为 72.6 亿元、23.5 亿元和 23.9 亿元。第二期 110 亿元于 2014 年 7 月 16 日完成发行，三年期、五年期、十年期品种规模分别为 56.5 亿元、45.5 亿元和 8.0 亿元。其中，首期发行的三年期品种 13 海通 01 已 2016 年 11 月 25 日到期兑付本息并摘牌，详见上交所公告（编号：临 2016-049）；第二期发行的三年期品种 13 海通 04 已 2017 年 7 月 14 日到期兑付本息并摘牌，详见上交所公告（编号：临 2017-033）。

根据 2016 年 3 月 30 日公司第六届董事会第十五次会议和 2016 年 5 月 26 日公司 2015 年度股东大会审议通过的《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》，公司向上交所和中国证监会申请并取得了《关于核准海通证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2017] 408 号）。该批复核准我公司向合格投资者公开发行面值总额不超过 120 亿元的公司债券。依据上述议案与监管核准，报告期内，公司公开发行了三期公司债券，首期 60 亿元于 2017 年 8 月 11 日完成发行，三年期、五年期规模分别为 50 亿元和 10 亿元；第二期于 2017 年 9 月 22 日发行，规模为 55 亿元，期限为 10 年；第三期于 2017 年 10 月 25 日发行，规模为 5 亿元，期限为 3 年。

### 2. 次级债券

2014 年 12 月 19 日，公司第五届董事会第三十二次会议（临时会议）审议通过了《关于公司发行其它境内债务融资工具一般性授权的议案》，并经 2015 年 2 月 9 日召开的公司 2015 年度第一次临时股东大会、2015 年度第一次 A 股/H 股类别股东大会审议通过，同意公司一次或多次或多期在境内公开或非公开发行除证券公司短期融资券、公司债券以外的其它债务融资工具，合计不超过公司最近一期末公司净资产额的 200%，授权董事长、总经理共同或分别全权办理发行其它境

内债务融资工具的相关事宜。截至报告期末，公司已发行二期共 350 亿元的次级债券。首期 150 亿元已于 2015 年 4 月 8 日发行，期限为 5 年期，其中第 3 年末附发行人赎回权。第二期 200 亿元于 2015 年 6 月 12 日完成发行，其中品种一为 3 年期品种，发行规模为 150 亿元，在第 2 年末附发行人赎回权；品种二为 5 年期品种，发行规模为 50 亿元，在第 3 年末附发行人赎回权。其中，首期发行的三年期品种 15 海通 C2 已于 2017 年 6 月 12 日行使赎回权兑付全额本息并摘牌，详见上交所公告（编号：临 2017-030）。

2016 年 3 月 30 日召开的公司第六届董事会第十五次会议和 2016 年 5 月 26 日召开的公司 2015 年年度股东大会分别审议通过《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》。同意公司一次或多次或多期在境内公开或非公开发行债务融资工具，包括但不限于证券公司短期融资券、公司债、短期公司债券、资产支持证券（票据）、收益凭证、次级债券、次级债务，及其它按相关规定经中国证监会、中国证券业协会及其它相关部门审批或备案本公司可以发行的境内债务融资工具（用于日常流动性运作的拆借、回购除外），合计不超过公司最近一期末公司净资产额的 200%。公司股东大会同意授权董事会，并同意董事会授权董事长、总经理发行公司境内债务融资工具的获授权人士，共同或分别代表公司根据股东大会的决议及董事会授权具体处理与公司境内债务融资工具发行有关的一切事务。经上交所于 2016 年 11 月 4 日签发的“上证函[2016]2080 号”文核准，公司获准在中国境内非公开发行面值总额不超过人民币 300 亿元次级债券。公司于 2016 年 11 月发行了 60 亿元次级债券，其中品种一期限为 3 年期，发行规模为 40 亿元；品种二期限为 5 年期，发行规模为 20 亿元；公司于 2017 年 3 月发行了 45 亿元非公开发行次级债券，期限为 3 年期。

### 3. 非公开发行公司债券

依据《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号）以及上交所《关于对海通证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》（上证函[2016]886 号），公司于 2016 年 5 月发行 200 亿元非公开发行公司债券。其中品种一期限为 4 年期，发行规模为 150 亿元，在第 3 年末附发行人赎回权；品种二期限为 5 年期，发行规模为 50 亿元。

### 4. 子公司在报告期内证券发行情况的说明

由于不同子公司在报告期内存续债券的情况各异，故不再一一披露，子公司目前存续债券详细情况详见“第十一节 财务报告”中“七、合并财务报表附注（三十六）应付债券”。

## (二) 公司普通股股份总数及股东结构变动及公司资产和负债结构的变动情况

不适用

## (三) 现存的内部职工股情况

适用 不适用

### 三、股东和实际控制人情况

#### (一) 股东总数

|                         |                                      |
|-------------------------|--------------------------------------|
| 截止报告期末普通股股东总数(户)        | 245,638<br>(其中 A 股 245,485; H 股 153) |
| 年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户) | 249,401<br>(其中 A 股 249,249; H 股 152) |

#### (二) 截止报告期末前十名股东、前十名流通股东(或无限售条件股东)持股情况表

单位:股

| 前十名股东持股情况                         |                   |               |               |                                 |                  |        |          |
|-----------------------------------|-------------------|---------------|---------------|---------------------------------|------------------|--------|----------|
| 股东名称<br>(全称)                      | 报告期内增<br>减        | 期末持股数量        | 比例            | 持有<br>有限<br>售条<br>件股<br>份数<br>量 | 质押或冻结情况          |        | 股东<br>性质 |
|                                   |                   |               |               |                                 | 股<br>份<br>状<br>态 | 数<br>量 |          |
| 香港中央结算(代理人)有限公司                   | 480,799           | 3,408,867,562 | 29.64%        | 0                               | 无                | 0      | 境外法人     |
| 中国证券金融股份有限公司                      | 205,516,388       | 563,548,259   | 4.90%         | 0                               | 无                | 0      | 其他       |
| 光明食品(集团)有限公司                      | 0                 | 402,150,000   | 3.50%         | 0                               | 无                | 0      | 国有法人     |
| 上海海烟投资管理有限公司                      | 0                 | 400,709,623   | 3.48%         | 0                               | 无                | 0      | 国有法人     |
| 申能(集团)有限公司                        | 0                 | 322,162,086   | 2.80%         | 0                               | 无                | 0      | 国有法人     |
| 上海电气(集团)总公司                       | -53,787,900       | 265,298,893   | 2.31%         | 0                               | 无                | 0      | 国家       |
| 上海久事(集团)有限公司                      | 0                 | 235,247,280   | 2.05%         | 0                               | 无                | 0      | 国有法人     |
| 上海百联集团股份有限公司                      | 0                 | 214,471,652   | 1.86%         | 0                               | 无                | 0      | 境内非国有法人  |
| 齐鲁证券资管-工商银行-齐鲁<br>碧辰 10 号集合资产管理计划 | 0                 | 193,402,041   | 1.68%         | 0                               | 无                | 0      | 其他       |
| 云南国际信托有限公司-聚利 15<br>号单一资金信托       | 126,959,368       | 187,702,412   | 1.63%         | 0                               | 无                | 0      | 其他       |
| 前十名无限售条件股东持股情况                    |                   |               |               |                                 |                  |        |          |
| 股东名称                              | 持有无限售条件<br>流通股的数量 | 股份种类及数量       |               |                                 |                  |        |          |
|                                   |                   | 种类            | 数量            |                                 |                  |        |          |
| 香港中央结算(代理人)有限公司                   | 3,408,867,562     | 境外上市外资股       | 3,408,867,562 |                                 |                  |        |          |
| 中国证券金融股份有限公司                      | 563,548,259       | 人民币普通股        | 563,548,259   |                                 |                  |        |          |
| 光明食品(集团)有限公司                      | 402,150,000       | 人民币普通股        | 402,150,000   |                                 |                  |        |          |
| 上海海烟投资管理有限公司                      | 400,709,623       | 人民币普通股        | 400,709,623   |                                 |                  |        |          |
| 申能(集团)有限公司                        | 322,162,086       | 人民币普通股        | 322,162,086   |                                 |                  |        |          |
| 上海电气(集团)总公司                       | 265,298,893       | 人民币普通股        | 265,298,893   |                                 |                  |        |          |
| 上海久事(集团)有限公司                      | 235,247,280       | 人民币普通股        | 235,247,280   |                                 |                  |        |          |
| 上海百联集团股份有限公司                      | 214,471,652       | 人民币普通股        | 214,471,652   |                                 |                  |        |          |
| 齐鲁证券资管-工商银行-齐鲁<br>碧辰 10 号集合资产管理计划 | 193,402,041       | 人民币普通股        | 193,402,041   |                                 |                  |        |          |
| 云南国际信托有限公司-聚利 15<br>号单一资金信托       | 187,702,412       | 人民币普通股        | 187,702,412   |                                 |                  |        |          |

注: 1. 本公司 H 股股东中, 非登记股东的股份由香港中央结算(代理人)有限公司代为持有。

2. 上表中, 香港中央结算(代理人)有限公司所持股份种类为境外上市外资股(H 股), 其他股东所持股份种类均为人民币普通股 A 股。

3. A 股股东性质为股东在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记的账户性质。

4. 因公司股票为融资融券标的证券, 股东持股数量按照其通过普通证券账户、信用证券账户持有的股票及权益数量合并计算。

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

适用 不适用

(三) 主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

截至 2017 年 12 月 31 日，据本公司董事合理查询所知，以下人士（并非本公司董事、监事或最高行政人员）于股份或相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 2 及第 3 分部须向本公司披露并根据《证券及期货条例》第 336 条已记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓：

| 序号 | 主要股东名称   | 股份类别 | 权益性质              | 持有的股份数目(股)  | 占本公司已发行股份总数的比例 (%) | 占本公司已发行A股/H股总数的比例 (%) | 好仓(注2)/淡仓(注3)/可供借出的股份 |
|----|--|------|-------------------|-------------|--------------------|-----------------------|-----------------------|
| 1. | Maunakai Capital Partners (Hong Kong) Limited  | H股   | 投资经理              | 272,590,000 | 2.36               | 7.99                  | 好仓                    |
| 2. | BSA Strategic Fund I                           | H股   | 实益拥有人             | 272,590,000 | 2.36               | 7.99                  | 好仓                    |
| 3. | Insight Capital Management (Hong Kong) Limited | H股   | 投资经理              | 223,415,200 | 1.94               | 6.55                  | 好仓                    |
| 4. | Insight Phoenix Fund                           | H股   | 投资经理              | 223,415,200 | 1.94               | 6.55                  | 好仓                    |
| 5. | 史静   | H股   | 酌情信托的成立人          | 268,000,000 | 2.33               | 7.86                  | 好仓                    |
| 6. | Wickhams Cay Trust Company Limited             | H股   | 受托人<br>(注1)       | 268,000,000 | 2.33               | 7.86                  | 好仓                    |
| 7. | Abhaya Limited                                 | H股   | 受控制的法团的权益<br>(注1) | 268,000,000 | 2.33               | 7.86                  | 好仓                    |
| 8. | Vogel Holding Group Limited                    | H股   | 实益拥有人<br>(注1)     | 248,000,000 | 2.15               | 7.27                  | 好仓                    |
| 9. | BlackRock, Inc.                                | H股   | 受控制的法团的权益         | 175,859,928 | 1.52               | 5.15                  | 好仓                    |
|    |  | H股   | 受控制的法团的权益         | 3,785,600   | 0.03               | 0.11                  | 淡仓                    |

注1: Vogel Holding Group Limited持有本公司248,000,000股H股。Abhaya Limited分别透过其全资拥有的Vogel Holding Group Limited及Union Sky Holding Group Limited持有本公司248,000,000股H股及本公司20,000,000股H股，合共持有本公司268,000,000股H股。Abhaya Limited由Wickhams Cay Trust Company Limited全资拥有，史玉柱为Abhaya Limited的董事，而Abhaya Limited的董事惯于按照史玉柱的指令行事，故Wickhams Cay Trust Company Limited及史玉柱均被视为于Abhaya Limited持有的268,000,000股H股中拥有权益。

注2: 如股东对股份本身持有权益，包括透过持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而持有权益，并因而具有如下的权利与责任，该股东便属于持有「好仓」：(i) 其有权购入相关股份；(ii) 其有责任购入相关股份；(iii) 如相关股份价格上升，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格上升，其有权避免或减低损失。

注3: 如股东根据证券借贷协议借入股份，或如股东因持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而具有以下的权利与责任，该股东便属于持有「淡仓」：(i) 其有权要求另一人购入相关股份；(ii) 其有责任交付相关股份；(iii) 如相关股份价格下降，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格下降，其有权避免或减低损失。

除上述披露外，于 2017 年 12 月 31 日，本公司并不知悉任何其他人士（本公司董事、监事及最高行政人员除外）于本公司股份或相关股份中拥有根据《证券及期货条例》第 336 条规定须记录于登记册内之权益或淡仓。

**董事、监事及最高行政人员于本公司及相联法团的股份、相关股份或债券之权益及淡仓**

截至 2017 年 12 月 31 日，就本公司所获得的资料及据董事所知，本公司董事、监事及最高行政人员在本公司或其相关法团（定义见《证券及期货条例》第 XV 部）的股份、相关股份或债权证中拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 7 及 8 分部须通知本公司及香港联交所的权益及淡仓（包括根据《证券及期货条例》的该等条文被当作或视为拥有的权益或淡仓），或根据《证券及期货条例》第 352 条规定须在存置之权益登记册中记录，或根据《标准守则》的规定需要通知本公司和香港联交所之权益或淡仓的情况如下：

| 序号 | 董事名称 | 股份类别 | 权益性质  | 持有的股份数目(股) | 占本公司已发行股份总数的比例 (%) | 占本公司已发行A股/H股总数的比例 (%) | 好仓(注1)/淡仓(注2)/可供借出的 |
|----|------|------|-------|------------|--------------------|-----------------------|---------------------|
| 1. | 刘志敏  | H股   | 实益拥有人 | 1,000,000  | 0.01               | 0.03                  | 好仓                  |

注1：如股东对股份本身持有权益，包括透过持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而持有权益，并因而具有如下的权利与责任，该股东便属于持有「好仓」：(i) 其有权购入相关股份；(ii) 其有责任购入相关股份；(iii) 如相关股份价格上升，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格上升，其有权避免或减低损失。

注2：如股东根据证券借贷协议借入股份，或如股东因持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而具有以下的权利与责任，该股东便属于持有「淡仓」：(i) 其有权要求另一人购入相关股份；(ii) 其有责任交付相关股份；(iii) 如相关股份价格下降，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格下降，其有权避免或减低损失。

**(四) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东**

适用 不适用

**四、控股股东及实际控制人情况**

**(一) 控股股东情况**

**1 法人**

适用 不适用

**2 自然人**

适用 不适用

**3 公司不存在控股股东情况的特别说明**

适用 不适用

本公司股东持股较为分散，无直接持有本公司 5% 以上股份的股东（不包括香港中央结算（代理人）有限公司）。香港中央结算（代理人）有限公司所持股份为 H 股非登记股东所有。

**4 报告期内控股股东变更情况索引及日期**

适用 不适用

**5 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图**

适用 不适用

(二) 实际控制人情况

1 法人

适用 不适用

2 自然人

适用 不适用

3 公司不存在实际控制人情况的特别说明

适用 不适用

4 报告期内实际控制人变更情况索引及日期

适用 不适用

5 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用

6 实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司

适用 不适用

(三) 控股股东及实际控制人其他情况介绍

适用 不适用

五、其他持股在百分之十以上的法人股东

适用 不适用

六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

### 一、持股变动情况及报酬情况

#### (一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动及报酬情况

√适用 □不适用

单位：万股

| 姓名      | 职务(注)        | 性别 | 年龄 | 任期起始日期     | 任期终止日期     | 年初持股数 | 年末持股数 | 年度内股份增减变动量 | 增减变动原因 | 报告期内从公司获得的税前报酬总额(万元) | 是否在公司关联方获取报酬 |
|---------|--------------|----|----|------------|------------|-------|-------|------------|--------|----------------------|--------------|
| 周杰      | 董事长、党委书记     | 男  | 50 | 2016-10-28 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 93.25                | 否            |
| 瞿秋平     | 董事、总经理、党委副书记 | 男  | 56 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 164.55               | 否            |
| 余莉萍     | 董事           | 女  | 55 | 2015-06-08 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 陈斌      | 董事           | 男  | 36 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 否            |
| 邬跃舟     | 董事           | 男  | 58 | 2017-08-18 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 否            |
| 许建国     | 董事           | 男  | 53 | 2016-10-18 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 否            |
| 张新玫     | 董事           | 女  | 58 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 沈铁冬     | 董事           | 男  | 48 | 2015-06-08 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 刘志敏     | 独立董事         | 男  | 66 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 100   | 100   | 0          | -      | 30                   | 是            |
| 肖遂宁     | 独立董事         | 男  | 69 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 31                   | 是            |
| 冯仑      | 独立董事         | 男  | 58 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 21                   | 是            |
| 张鸣      | 独立董事         | 男  | 59 | 2016-06-12 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 28                   | 是            |
| 林家礼     | 独立董事         | 男  | 58 | 2017-04-06 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 6                    | 是            |
| 王鸿祥(离任) | 董事           | 男  | 61 | 2014-12-30 | 2017-05-12 | 0     | 0     | 0          | -      | 13.6                 | 否            |
| 李光荣(离任) | 独立董事         | 男  | 54 | 2014-12-30 | 2017-04-06 | 0     | 0     | 0          | -      | 15                   | 是            |
| 吴红伟     | 监事会副主席、      | 男  | 51 | 2017-12-15 | 2017-12-30 | 0     | 0     | 0          | -      | 12.97                | 否            |

|             |                           |   |    |            |            |   |   |   |   |        |   |
|-------------|---------------------------|---|----|------------|------------|---|---|---|---|--------|---|
|             | 纪委书记、党委副书记                |   |    |            |            |   |   |   |   |        |   |
| 李林          | 监事                        | 男 | 55 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 是 |
| 郑小芸         | 监事                        | 女 | 55 | 2015-09-21 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 是 |
| 程峰          | 监事                        | 男 | 46 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 是 |
| 陈辉峰         | 监事                        | 男 | 51 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 否 |
| 冯煌          | 监事                        | 男 | 46 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 是 |
| 宋春风         | 监事                        | 男 | 48 | 2016-07-11 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 是 |
| 王美娟         | 职工监事                      | 女 | 53 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 314.39 | 否 |
| 胡海蓉         | 职工监事                      | 女 | 46 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 313.25 | 否 |
| 宋世浩         | 职工监事                      | 男 | 48 | 2015-07-08 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 242.25 | 否 |
| 芮政先         | 职工监事                      | 男 | 55 | 2017-12-11 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 13.14  | 否 |
| 寿伟光<br>(离任) | 监事会主席                     | 男 | 54 | 2015-07-21 | 2017-04-12 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 否 |
| 杨庆忠<br>(离任) | 监事会副主席、<br>纪委书记、党委<br>副书记 | 男 | 61 | 2014-12-30 | 2017-12-13 | 0 | 0 | 0 | - | 122.92 | 否 |
| 仇夏萍<br>(离任) | 职工监事                      | 女 | 57 | 2014-12-30 | 2017-12-11 | 0 | 0 | 0 | - | 0      | 否 |
| 任澎          | 副总经理                      | 男 | 55 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 147.76 | 否 |
| 宫里啓暉        | 副总经理                      | 男 | 52 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 8.29   | 否 |
| 裴长江         | 副总经理                      | 男 | 52 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 145.92 | 否 |
| 王建业         | 合规总监                      | 男 | 57 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 483.88 | 否 |
| 李础前         | 财务总监                      | 男 | 60 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 483.88 | 否 |
| 毛宇星         | 首席信息执行官                   | 男 | 46 | 2016-09-19 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 452.88 | 否 |
| 李建国         | 总经理助理                     | 男 | 54 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | -      | 否 |
| 陈春钱         | 总经理助理                     | 男 | 54 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 500.01 | 否 |
| 张向阳         | 总经理助理                     | 男 | 52 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | -      | 否 |
| 林涌          | 总经理助理                     | 男 | 48 | 2014-12-30 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | -      | 否 |
| 姜诚君         | 总经理助理、董                   | 男 | 49 | 2017-03-29 | 2017-12-30 | 0 | 0 | 0 | - | 547.42 | 否 |

|             |       |   |    |            |            |     |     |   |   |          |   |
|-------------|-------|---|----|------------|------------|-----|-----|---|---|----------|---|
|             | 事会秘书  |   |    |            |            |     |     |   |   |          |   |
| 杜洪波         | 首席风险官 | 男 | 54 | 2017-05-12 | 2017-12-30 | 0   | 0   | 0 | - | 246.88   | 否 |
| 潘光韬         | 总经理助理 | 男 | 46 | 2017-05-12 | 2017-12-30 | 0   | 0   | 0 | - | 358.48   | 否 |
| 吉宇光<br>(离任) | 副总经理  | 男 | 60 | 2014-12-30 | 2018-01-25 | 0   | 0   | 0 | - | 147.76   | 否 |
| 黄正红<br>(离任) | 董事会秘书 | 男 | 42 | 2015-03-12 | 2017-03-29 | 0   | 0   | 0 | - | 196.38   | 否 |
| 合计          | /     | / | /  | /          | /          | 100 | 100 |   | / | 5,140.86 | / |

- 注：1. 公司第六届董事会及监事会于 2017 年 12 月 30 日任期届满。鉴于第七届董事会董事候选人及监事会监事候选人的提名工作尚未结束，董事会及监事会换届工作尚在筹备中，为保证董事会及监事会工作的连续性，第六届董事会及监事会将延期换届选举，董事会各专门委员会和高级管理人员的任期亦相应顺延。第六届董事会、监事会全体成员及本公司高级管理人员在换届选举工作完成前，将继续依照法律、法规和《公司章程》的相关规定履行相应的职责。（详情参见公司公告，公告编号：临 2017-058）
2. 税前报酬总额，含董监高人员任期内的薪酬收入，以及单位缴纳的社会保险、住房公积金、企业年金。其中，外币收入部分按 2017 年 12 月 31 日中国外汇交易中心公布的银行间外汇市场人民币汇率中间价折算。
3. 上述合计数据未包含公司高管在子公司领取的薪酬。其中，公司副总经理宫里启暉除了在母公司领取的薪酬外，在海通银行领取的薪酬为 508.89 万元；公司总经理助理林涌在海通国际证券领取薪酬，为 1,294.90 万元；公司总经理助理李建国在海通国际控股领取薪酬，为 411.84 万元；公司总经理助理张向阳在海通开元领取薪酬，为 1,132.28 万元。
4. 上述董事、监事和高级管理人员在报告期内从公司获得的税前报酬总额包含归属于 2016 年的绩效工资。
5. 董事、监事和高级管理人员报告期内薪酬统计口径为其担任董监高职务期间领取的薪酬，在公司内担任非董监高职务期间领取的薪酬未统计在内。

| 姓名              | 主要工作经历  |
|-----------------|---|
| <b>执行董事（2名）</b> |   |
| 周杰              | 1967 年出生，工学硕士，2016 年 10 月 28 日至今担任公司董事长，2016 年 7 月至今担任公司党委书记。周先生 1992 年 2 月至 1996 年 6 月在上海万国证券有限公司投资银行部工作；1996 年 6 月至 2001 年 12 月先后担任上海上实资产经营有限公司投资部经理、副总经理、董事长兼总经理；2001 年 12 月至 2003 年 4 月担任上海实业医药科技（集团）有限公司董事兼总经理；2002 年 1 月至 2016 年 7 月，先后担任上海实业控股有限公司（于香港联交所上市，股份代号：0363）执行董事兼行政总裁、执行董事兼常务副总裁、副董事长兼行政总裁；2004 年 8 月至 2016 年 7 月，先后担任上海上实（集团）有限公司策划总监、执行董事兼副总裁、执行董事兼常务副总裁、总裁兼党委副书记；2010 年 3 月至 2012 年 5 月担任上海医药集团股份有限公司（于上交所上市，股份代号：601607；于香港联交所上市，股份代号：02607）监事长，2012 年 6 月至 2013 年 6 月、2016 年 5 月至 2016 年 7 月担任上海医药集团股份有限公司董事长兼党委书记；2009 年 1 月 |

|                          |  |
|--------------------------|--|
|                          | <p>至今担任中芯国际集成电路制造有限公司（于纽约证券交易所上市，股份代号：SMI；于香港联交所上市，股份代号：00981）非执行董事。周先生 2016 年至今任上海证券交易所监事、薪酬委员会主任，2016 年至今任上海证券同业公会会长，2017 年至今任上海金融业联合会副理事长，2016 年至今任上海上市公司协会理事会副会长，2016 年至今任中国互联网金融协会会员代表，2017 年至今任上海金融理财师协会会长，2017 年至今任上海市仲裁委仲裁员。</p>   |
|                          |  |
| <p>瞿秋平</p>               | <p>1961 年出生，经济学硕士，高级会计师，2014 年 6 月 25 日至今担任本公司执行董事、总经理、党委副书记。瞿先生 1980 年 9 月至 1983 年 12 月担任中国人民银行上海市南市区办事处会计员、副科长、团委书记；1984 年 1 月至 1992 年 9 月担任中国工商银行上海市南市区办事处副科长、科长；1992 年 9 月至 1995 年 11 月担任中国工商银行上海市分行南市支行副行长；1995 年 11 月至 1996 年 12 月担任中国工商银行上海市分行会计出纳处副处长（其中，1995 年 12 月至 1996 年 12 月主持中国工商银行上海市嘉定支行党政工作）；1996 年 12 月至 1999 年 3 月担任中国工商银行上海市宝山支行行长、党委副书记；1999 年 3 月至 1999 年 12 月担任中国工商银行上海市分行会计结算处处长；1999 年 12 月至 2000 年 6 月担任中国工商银行上海市分行行长助理；2000 年 6 月至 2005 年 2 月担任中国工商银行上海市分行副行长（其中，2002 年 9 月至 2003 年 9 月在美国宾夕法尼亚大学任访问学者）；2005 年 2 月至 2008 年 9 月担任中国工商银行江苏省分行副行长；2008 年 9 月至 2008 年 11 月担任上海银行党委副书记、副董事长；2008 年 11 月至 2010 年 12 月担任上海银行行长、党委副书记、副董事长；2010 年 12 月至 2012 年 8 月担任中国证监会派出机构工作协调部主任；2012 年 8 月至 2014 年 4 月担任中国证监会非上市公司公众公司监管部主任。瞿先生 2015 年 11 月至今担任中国上市公司协会金融服务专业委员会主任委员；2016 年 10 月至今被聘为国务院参事室金融研究中心专家委员会委员；2017 年 4 月至今担任深圳证券交易所理事；2018 年 1 月至今担任中国证券业协会副会长。瞿先生 2018 年 2 月至今担任海通国际控股有限公司董事会主席、海通国际证券集团有限公司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 0665）董事会主席、非执行董事、提名委员会及战略发展委员会主席和薪酬委员会成员。</p> |
| <p><b>非执行董事（6 名）</b></p> |  |
| <p>余莉萍</p>               | <p>1962 年出生，工商管理硕士，高级会计师，2015 年 6 月 8 日至今担任本公司非执行董事，2010 年 8 月至今担任光明食品（集团）有限公司副总裁。余女士 1996 年 8 月至 2006 年 4 月在上海轻工业局、上海轻工控股（集团）公司担任多个职位，包括财务处副处长、财务部经</p>   |

|     |  |
|-----|--|
|     | <p>理、副总会计师；2006年8月至2008年8月担任上海益民食品一厂（集团）有限公司党委委员、副总裁、财务总监；2008年8月至2010年8月担任上海广电（集团）有限公司财务总监；2015年3月至2017年5月担任上海益民食品集团监事会主席。余女士2013年9月至今担任农工商超市（集团）有限公司监事会主席；2014年3月至今担任上海轻工控股（集团）公司法定代表人；2014年9月至今担任光明食品集团财务有限公司监事会主席。</p>   |
| 陈斌  | <p>1981年出生，硕士研究生，2014年12月30日至今担任本公司非执行董事，2017年2月至今担任上海海烟投资管理有限公司副总经理。陈先生2003年7月至2010年1月担任上海烟草（集团）公司投资管理处科员；2010年1月至2016年10月担任上海烟草（集团）公司（现更名为：上海烟草集团有限责任公司）投资管理处科长助理、科长、处长助理；2014年4月至2017年2月担任上海海烟投资管理有限公司总经理助理。陈先生自2014年10月至今担任东方证券股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为600958；于香港联交所上市，股份代号：03958）非执行董事。</p>   |
| 邬跃舟 | <p>1959年出生，上海财经大学大专学历，会计师，2017年8月18日至今担任本公司非执行董事，2016年10月至今担任申能（集团）有限公司副总经济师、资产管理部经理。邬先生1980年8月至1994年12月在上海机床厂工作，先后担任财务处副处长、处长；1995年1月至1999年7月在上海外滩房屋置换有限公司工作，担任财务计划部经理；1999年8月至2000年2月在上海久事公司置换总部工作，担任计财部经理；2000年3月至今在申能（集团）有限公司工作，先后担任投资管理部经理、监事会秘书、审计室主任（2003年1月至2005年6月兼任上海申能科技发展公司董事长、代总经理）。</p>  |
| 许建国 | <p>1964年出生，专业会计学硕士，高级会计师，2016年10月18日至今担任本公司非执行董事，2013年4月至今担任上海电气（集团）总公司财务预算部部长。许先生1984年7月至2001年12月在上海电缆厂财务处、审计室工作；2002年1月至2004年3月在上海电气（集团）总公司稽察室工作；2004年4月至2005年9月在上海电气资产管理有限公司资产财务部工作；2005年9月至2008年8月担任上海电气资产管理有限公司管理一部财务经理助理，期间2006年3月至2008年8月同时担任上海力达重工制造有限公司财务总监；2008年8月至2009年12月担任上海电气资产管理有限公司资产财务部副部长；2009年12月至2013年4月担任上海电气（集团）总公司财务预算部副部长；2016年6月至2017年12月担任上海海立（集团）股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为600619）董事。许先生2013年4月至今担任上海电气集团财务有限责任公司董事；2015年3月至今担任上海人寿保险股份有限公司董事；2016年5月至今担任</p> |

|                     |   |
|---------------------|---|
|                     | 上海集优机械股份有限公司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 02345）监事长；2016 年 6 月至今担任上海微电子装备股份有限公司董事；2016 年 11 月至今担任东方证券股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600958；于香港联交所上市，股份代号：03958）非执行董事；2017 年 12 月至今担任上海海立（集团）股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600619）监事长。   |
| 张新政                 | 1959 年出生，工商管理硕士，正高级会计师，2014 年 12 月 30 日至今担任本公司非执行董事，2014 年 12 月至今担任上海久事（集团）有限公司副总裁。张女士自 1981 年 3 月至 1995 年 10 月担任上海冶金工业局财务处科员、副主任科员、主任科员、副处长；1995 年 10 月至 1998 年 11 月担任上海冶金控股集团公司财务部副部长、部长、副总会计师；1998 年 11 月至 2004 年 11 月担任上海久事公司（现为“上海久事（集团）有限公司”）财务管理总部经理、资金管理总部经理；2004 年 11 月至 2014 年 12 月担任上海久事公司总会计师；2012 年至 2016 年 9 月担任申银万国证券股份有限公司（现为“申万宏源集团股份有限公司（该公司于深交所上市，股票代码为 000166）”）董事；2015 年 6 月至 2016 年 5 月担任申能股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600642）董事。张女士自 2015 年 10 月至今担任中国太平洋保险（集团）股份有限公司监事；2015 年 11 月至今担任中国太平洋人寿保险股份有限公司监事。 |
| 沈铁冬                 | 1969 年出生，经济学博士，2015 年 6 月 8 日至今担任本公司非执行董事，2014 年 12 月至今担任辽宁能源投资（集团）有限责任公司副董事长、党委副书记、总经理。沈先生 1992 年 6 月至 1993 年 6 月在共青团辽宁省委员会学校部工作，担任驻会主席；1993 年 7 月至 1999 年 9 月在辽宁省国际信托投资公司工作，担任信托部副部长；1999 年 9 月至 2002 年 1 月在辽宁省国际合作（集团）公司工作，担任资本运营部部长；2002 年 2 月至 2009 年 12 月在辽宁能源投资（集团）有限责任公司工作，担任副总经理；2009 年 12 月至 2014 年 12 月在辽宁省盘锦市人民政府工作，先后担任副市长，市委常委、秘书长。   |
| <b>独立非执行董事（5 名）</b> |   |
| 刘志敏                 | 1951 年出生，工商管理学士，自 2011 年 11 月 28 日至今担任本公司独立非执行董事，自 1996 年至今担任百德能控股有限公司董事总经理。刘先生自 2004 年 8 月至今担任星和有限公司（该公司于新加坡交易所上市，股票代码为 CC3）的独立非执行董事；2013 年 6 月至今担任华联酒店房地产信托管理有限公司和华联酒店信托管理有限公司（此两家公司分别为华联酒店信托（该公司于新加坡交易所上市，股票代码为 SK7）之房地产信托管理人和信托管理人）的独立非执行董事；2015 年 5 月至今担任大连万达商业地产股份有限公司的监事会独立监事；2015 年 10 月至今担任 STT GDC Pte. Ltd. 的独立非执行董事。刘先生在亚洲金融服务领域拥有多于 40 年的经验。刘先生的金融和策   |

|     |   |
|-----|---|
|     | 略专长以及他与世界许多地方的主要大企业和业务往来的经验对本公司董事会是一种资产。他亦是香港证券及期货事务监察委员会的收购上诉委员会委员和收购及合并委员会副主席。  |
| 肖遂宁 | 1948 年出生，2013 年 5 月 27 日至今担任本公司独立非执行董事。肖先生 1968 年 7 月至 1971 年 9 月担任云南水利发电建设公司三分公司电工、班长；1971 年 9 月至 1975 年 1 月担任水利发电建设公司喷水洞工区机电排长、电力技术员、工程师；1975 年 1 月至 1984 年 2 月担任云南电力设计院电气设计员、技术员、工程师；1984 年 2 月至 1985 年 8 月担任电力设计院发电厂发电室副主任；1985 年 1 月至 1987 年 8 月担任昆明银鼎实业公司总经理；1987 年 8 月至 1990 年 9 月担任云南省电力设计院代总经济师、代总会计师；1990 年 9 月至 1995 年 11 月担任交通银行重庆分行人事教育处处长、总经理助理、分行总助兼房地产开发公司总经理、分行副总经理和党组成员；1995 年 11 月至 1999 年 8 月担任交通银行珠海分行行长、党组书记；1999 年 8 月至 2007 年 2 月担任交通银行深圳分行行长、党组书记；2007 年 2 月至 2012 年 11 月担任深圳发展银行总行行长、董事长；2017 年 7 月至 2018 年 1 月担任太合汇投资管理（宁波）有限公司董事长兼总经理。肖先生自 2013 年 7 月至今担任北京清新环境技术股份有限公司（该公司于深交所上市，股票代码为 002573）独立董事；2013 年 8 月至今担任中润资源投资股份有限公司（该公司于深交所上市，股票代码为 000506）独立董事；2016 年 4 月至今担任南海控股有限公司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 0680.HK）的独立非执行董事；2016 年 4 月至今担任中国数码信息有限公司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 0250.HK）的独立非执行董事。 |
| 冯仑  | 1959 年出生，法学博士，公共政策硕士学位（MPP），2014 年 12 月 30 日至今担任本公司独立非执行董事，1993 年 1 月至今担任万通投资控股股份有限公司董事长。冯先生 1984 年 9 月至 1990 年 12 月在中央党校、中宣部和国家体改委任讲师和研究员。冯先生自 1991 年 1 月至 1991 年 12 月创办海南农业高技术投资联合开发总公司，自 1992 年 1 月至 1992 年 12 月创办海南万通企业（集团）有限公司，并任董事长。  |
| 张鸣  | 1958 年出生，经济学博士、教授、高级研究员，2016 年 6 月 12 日至今担任本公司独立非执行董事，现任上海财经大学会计学院教师。张先生于 1983 年自上海财经大学毕业后至今一直在该校任教，先后担任会计学院教研主任、系主任和副院长职务，现任教授和博士生导师。张先生于 2008 年 5 月 8 日至 2014 年 12 月 30 日担任本公司独立非执行董事，2010 年 5 月至 2016 年 5 月担任上海申达股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600626）独立非执行董事；2009 年 5 月至今担任上工申贝（集团）股份有限公司（该公司于上交所  |

|     |  |
|-----|--|
|     | <p>上市，股票代码为 600843) 独立非执行董事；2011 年 6 月至今担任上海金桥出口加工区开发股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600639）独立非执行董事；2015 年 5 月至今担任无锡商业大厦大东方股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600327）独立非执行董事；2016 年 5 月至今，担任上海浦东发展银行股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600000）独立非执行董事。</p>  |
| 林家礼 | <p>1959 年出生，哲学博士，香港高等法院律师(及前大律师)、香港仲裁司学会及香港董事学会资深会员、澳洲会计师公会荣誉资深会员、澳洲管理会计师公会资深会员及香港大学专业教育学院荣誉院士。2017 年 4 月 6 日至今担任公司独立非执行董事，2015 年 5 月至今担任麦格理基础设施及有形资产(香港)有限公司东盟区非执行主席兼亚洲区首席顾问。林先生拥有电讯/传媒/技术(TMT)、消费品/保健、基建/房地产、能源/资源及金融服务行业之跨国企业管理、管理顾问、公司管治、投资银行、直接投资及基金管理经验，现担任亚太区数家上市公司及投资基金独立或非执行董事职务。林先生曾于 1981 年至 2001 年期间在电讯媒体高科技、零售/消费、基建/地产及金融服务行业中的领先企业担任行政总裁、营运总监及总经理等高管职务，其中包括加拿大贝尔有限公司(1981 年 6 月至 1988 年 12 月)、安永会计师事务所(1989 年 4 月至 1989 年 11 月)、香港电讯有限公司(1989 年 11 月至 1993 年 8 月)、新世界电话集团有限公司(1995 年 1 月至 1996 年 12 月)、新加坡主权基金淡马锡控股公司旗下新加坡科技电信媒体有限公司(2000 年 4 月至 2001 年 9 月)。林先生 1993 年 7 月至 1995 年 1 月担任美国科尔尼国际管理顾问公司副总裁、合伙人兼大中华区主管及亚洲区电讯/媒体/高科技业务主管，1998 年 12 月至 1999 年 10 月担任美国海德思哲国际咨询公司合伙人及全球华人业务主管，2001 年 9 月至 2003 年 4 月担任中银国际投资银行部副主席及首席营运官，2003 年 1 月至 2006 年 9 月担任正大集团及集团属下数家在亚洲区的公司董事长、董事及行政总裁，2007 年 5 月至 2015 年 3 月任职于麦格理资本(香港)有限公司，担任中南半岛、缅甸及泰国区主席(及前香港区主席)。林先生曾任正恒国际控股有限公司(前称恒辉企业控股有限公司)(公司代号：185)、大唐西市丝路投资控股有限公司(前称太元集团有限公司)(公司代号：620)及罗马集团有限公司(公司代号：8072)(任期自 2017 年 9 月 13 日至 12 月 11 日)之非执行董事；并曾担任瑞丰石化控股有限公司(公司代号：8096)、铭源医疗发展有限公司(公司代号：233)及意马国际控股有限公司(公司代号：585)之独立非执行董事，上述各公司均于香港联交所上市。林先生目前担任资本策略地产有限公司(公司代号：497)、美亚娱乐咨询集团有限公司(公司代号：391)、黄河实业有限公司(公司代号：318)、旭日企业有限公司(公司代号：393)、</p> |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>易生活控股有限公司（前称神州资源集团有限公司）（公司代号：223）、西安海天天实业股份有限公司（前称西安海天天线控股股份有限公司）（公司代号：8227）、华隆金控有限公司（前称高锐中国物联网国际有限公司）（公司代号：1682）、华融投资股份有限公司（公司代号：2277）及凯知乐国际控股有限公司（公司代号：2122）之独立非执行董事，并为新华汇富金融控股有限公司（公司代号：188）、中国天然气集团有限公司（公司代号：931）、中国山东高速金融集团有限公司（公司代号：412）、国艺娱乐文化集团有限公司（公司代号：8228）及天大药业有限公司（公司代号：455）之非执行董事，上述各公司均于香港联交所上市。林先生现为 Asia-Pacific Strategic Investments Limited（公司代号：5RA）、Rowsley Limited（公司代号：A50）及 Top Global Limited（公司代号：519）独立非执行董事，以及 Singapore eDevelopment Limited（公司代号：40V）之非执行董事，上述各公司均于新加坡证券交易所上市。林先生亦为 Sunwah International Limited（公司代号：SWH）独立董事，该公司于多伦多证券交易所上市；Vietnam Equity Holding（公司代号：3MS）独立非执行董事，该公司于斯图加特证券交易所上市；AustChina Holdings Limited（公司代号：AUH）（前称 Coalbank Limited）之独立非执行董事，该公司于澳洲证券交易所上市；Adamas Finance Asia Limited（公司代号：ADAM）之非执行董事，而该公司之股份于伦敦证券交易所上市。</p> |
| <b>离任董事（2名）</b> |   |
| 王鸿祥             | <p>1956 年出生，工商管理硕士，正高级会计师，2011 年 5 月 16 日至 2017 年 5 月 12 日担任本公司非执行董事。1998 年 12 月至 2016 年 9 月担任申能（集团）有限公司副总会计师。王先生自大学毕业后拥有超过 20 年的会计财务工作经验，曾于上海财经大学担任副教授多年。</p>  |
| 李光荣             | <p>1963 年出生，经济学博士，2014 年 12 月 30 日至 2017 年 4 月 6 日担任本公司独立非执行董事，2004 年 12 月至今担任华安财产保险股份有限公司董事长。李先生 1987 年 7 月至 1993 年 4 月担任湖南省人民政府财贸办科长，1993 年 4 月至 1995 年 10 月担任中国银行湖南省分行证券部经理；1995 年 10 月至 1997 年 12 月担任光大银行广州分行业务发展部总经理。李先生 1998 年 1 月至今担任特华投资控股有限公司董事长，2014 年 6 月至今担任中国民生投资股份有限公司执行董事、董事会咨询委员会主席。</p>  |
| <b>职工监事（5名）</b> |   |
| 吴红伟             | <p>1966 年出生，1990 年毕业于上海交通大学机械工程系，获工学学士学位，2000 年获复旦大学管理学院工商管理硕士学位，研究员职称，2017 年 12 月 13 日至今担任本公司监事，2017 年 12 月 15 日至今担任本公司监事会副主席，2017 年 9 月至今担任本公司党委副书记、纪</p>   |

|     |   |
|-----|---|
|     | <p>委书记。吴先生 1990 年 7 月至 2001 年 6 月在上海航天局 801 所工作，曾担任以下职务：1990 年 7 月至 1997 年 1 月在科研计划处（后更名为“科技处”）工作，曾任设计员、工程组长、处长助理、副处长；（其中 1995 年 8 月至 1997 年 1 月兼任科技委秘书）；1997 年 1 月至 1997 年 3 月担任人事保卫处处长、科技委秘书；1997 年 3 月至 2000 年 10 月担任所务部主任、人事保卫处处长；2000 年 10 月至 2001 年 6 月担任党委副书记、纪委书记、所务部主任（其中 2001 年 3 月至 2001 年 6 月兼任工会主席）。吴先生 2001 年 6 月至 2004 年 4 月担任上海新光电讯厂党委书记；2004 年 4 月至 2015 年 1 月在中共上海市社会工作委员会工作，曾担任以下职务：2004 年 4 月至 2006 年 1 月担任人力资源处副处长（主持工作）；2006 年 1 月至 2011 年 6 月担任人力资源处处长；2011 年 6 月至 2015 年 1 月担任秘书长。吴先生 2015 年 1 月至 2015 年 4 月担任上海市国有资产监督管理委员会（以下简称“上海市国资委”）纪委书记；2015 年 4 月至 2017 年 9 月担任中共上海市纪律检查委员会驻上海市国资委党委纪检组组长、上海市国资委党委委员。</p>   |
| 王美娟 | <p>1964 年出生，经济学硕士，高级会计师，2014 年 12 月 30 日至今担任本公司监事，2011 年 3 月至今担任公司稽核部总经理。王女士 1988 年 1 月至 1994 年 10 月担任上海建材学院管理工程系讲师；1992 年 5 月至 2001 年 5 月担任大华会计师事务所高级经理。王女士曾于本公司担任不同职位，包括：2001 年 5 月至 2001 年 8 月担任稽核部部门经理；2001 年 8 月至 2002 年 3 月担任稽核部总经理助理；2002 年 3 月至 2006 年 5 月担任稽核部副总经理；2006 年 5 月至 2006 年 9 月担任风险控制总部副总经理（部门正职待遇）；2006 年 9 月至 2011 年 3 月担任首席稽核官兼风险控制总部副总经理（部门正职待遇）。王女士 2005 年 7 月至 2016 年 3 月担任海通期货有限公司监事长，2016 年 3 月至今担任海通期货股份有限公司监事会主席。2008 年 10 月至今担任海通开元投资有限公司董事，2010 年 12 月至今担任吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司监事，2011 年 1 月至今担任西安航天新能源产业基金投资有限公司董事，2012 年 4 月至今担任海通创新证券投资有限公司监事，2012 年 9 月至今担任海通国际证券集团有限公司非执行董事（该公司于香港联交所上市，股票代码为 00665），2014 年 1 月至 2017 年 5 月担任海通恒信国际租赁有限公司监事，2017 年 5 月至今担任海通恒信国际租赁股份有限公司监事会主席，2014 年 4 月至今担任海通恒信融资租赁（上海）有限公司监事，2014 年 5 月至今担任海通恒运国际租赁有限公司监事以及上海泛圆投资发展有限公司监事。</p> |
| 胡海蓉 | <p>1971 年出生，法学学士，经济师，2014 年 12 月 30 日至今担任本公司监事，2013 年 3 月至今担任本公司党群工作部主任兼人力资源部副总经理。胡女士曾于本公司担任不同职位，包括：1993 年 7 月至 1995 年 6 月在上海宝山营业部任职；1995 年 6 月至 1996 年 5 月在上海</p>  |

|                  |   |
|------------------|---|
|                  | 业务总部办公室任职；1996 年 5 月至 1998 年 3 月在总经理办公室任职；1998 年 3 月至 2001 年 3 月担任总经理办公室外事科副科长；2001 年 3 月至 2005 年 5 月担任人力资源开发部调配科副科长、科长；2005 年 5 月至 2010 年 12 月担任人力资源开发部总经理助理；2010 年 12 月至 2013 年 2 月担任人力资源开发部副总经理。胡女士自 2012 年 6 月至今担任海通创意资本管理有限公司董事，自 2014 年 12 月至今担任本公司工会副主席。   |
| 宋世浩              | 1969 年出生，工商管理硕士，2015 年 7 月 8 日至今担任本公司监事，2017 年 3 月至今担任公司证券金融部总经理。宋先生 1992 年 7 月至 1996 年 6 月在包头钢铁公司第五中学担任教师；1996 年 6 月至 2000 年 3 月在包头信托投资公司工作，先后担任证券营业部经理、信托营业部经理；2000 年 3 月至 2006 年 3 月在本公司天津营业部工作，先后担任总经理助理、副总经理；2006 年 3 月至 2009 年 8 月在本公司兰州业务总部担任副总经理（主持工作）；2009 年 8 月至 2012 年 2 月在本公司甘肃分公司担任总经理；2011 年 9 月至 2013 年 1 月在本公司运营中心担任副总经理，2013 年 1 月至 2016 年 4 月在本公司合规与风险管理总部担任副总经理（主持工作），2016 年 4 月至 2017 年 3 月担任公司合规与风险管理总部总经理。宋先生自 2013 年 4 月至 2016 年 10 月担任上海海通证券资产管理有限公司董事，2016 年 10 月至今担任上海海通证券资产管理有限公司监事。                             |
| 芮政先              | 1962 年出生，1984 年毕业于华东师范大学数学系，获理学学士学位，助理研究员职称。芮先生 2017 年 12 月 11 日至今担任本公司监事，2014 年 11 月至今担任公司人力资源部副总经理；2015 年 11 月至今担任公司纪委委员。芮先生 1984 年 7 月至 1988 年 2 月在上海警备区教导大队训练处担任教员；1988 年 2 月至 1996 年 3 月在上海社会科学院人口与发展研究所从事研究工作。芮先生 1996 年 3 月至今在本公司工作，曾担任以下不同职位：1996 年 3 月至 2001 年 3 月担任监察室专务；2001 年 3 月至 2002 年 6 月担任监察室二科副科长；2002 年 6 月至 2007 年 3 月担任人力资源开发部劳资科科长；2007 年 3 月至 2008 年 3 月担任人力资源开发部干部科科长；2008 年 3 月至 2014 年 4 月担任人力资源开发部总经理助理兼干部科科长；2014 年 4 月至 2014 年 11 月担任人力资源部总经理助理。芮先生 2008 年 10 月至今担任海通开元投资有限公司监事；2016 年 11 月至今担任海通创新资本管理有限公司董事。 |
| <b>股东监事（6 名）</b> |   |
| 李林               | 1962 年出生，工商管理硕士，2013 年 5 月 27 日至今担任本公司监事，2014 年 4 月至今担任光明食品（集团）有限公司财务总监。李先生 1984 年 7 月至 1996 年 12 月担任上海财经大学会计学院教师；1997 年 1 月至 2001 年 3 月担任上海淮海商业（集团）有限公司副总会计  |

|            |   |
|------------|---|
|            | <p>师；2001年4月至2001年6月担任上海农工商（集团）总公司财务副总监；2001年7月至2007年8月担任上海市都市农商社股份有限公司董事、副总裁、财务总监；2007年9月至2010年7月担任农工商房地产（集团）股份有限公司董事、副总裁、财务总监；2010年8月至2014年4月担任光明食品（集团）有限公司财务部总经理。李先生2014年12月至今担任光明食品集团财务有限公司董事长，2014年10月至今担任赛领资本管理有限公司董事，2014年10月至今担任赛领国际投资基金（上海）有限公司董事。</p>   |
| <p>郑小芸</p> | <p>1962年出生，会计学硕士，高级会计师，2015年9月21日至今担任本公司监事，2015年6月至今任上海百联集团股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为600827，以下简称“上海百联”）财务总监，2015年8月至今任上海百联董事会秘书，2017年6月至今担任上海百联董事。郑女士1982年9月至1999年7月曾任上海永久股份有限公司财务部会计、经理助理、副经理；1999年7月至2002年3月担任上海市广告装潢公司财务总监；2002年3月至2002年12月担任上海一百（集团）有限公司财务部副经理；2002年12月至2003年10月担任上海全方投资管理有限公司财务总监；2003年10月至2005年7月担任上海百联集团有限公司综合事业部财务总监；2005年7月至2010年8月担任上海百联投资管理有限公司财务总监；2010年8月至2014年7月担任上海百联集团资产经营管理有限公司财务总监；2014年7月至2015年6月担任百联电子商务有限公司财务总监；2014年3月至2014年7月担任上海百红商业贸易有限公司董事、华联集团资产托管有限公司董事长。</p>   |
| <p>程峰</p>  | <p>1971年出生，工商管理硕士，2014年12月30日至今担任本公司监事，2013年10月至今担任上海报业集团党委委员、副总经理。程先生1994年7月至1995年3月在上海交通大学管理学院学生组工作；1995年3月至1996年5月在上海市对外经济贸易委员会外经处工作；1996年5月至2001年2月在上海市对外经济贸易委员会团委工作，任职包括副书记、书记；2001年2月至2002年6月担任上海机械进出口（集团）有限公司副总裁（挂职锻炼）；2002年6月至2005年4月在上海市对外经济贸易委员会技术进口处和科技发展与技术贸易处工作，任职包括副处长、处长；2005年4月至2013年10月在上海国际集团工作，任职包括办公室主任、信息中心主任、行政管理总部总经理（兼任上海国盛典当有限公司董事长、总经理）、上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理、党委书记、董事长、上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。程先生2014年3月至今担任上海上报资产管理有限公司董事长，2014年5月至今担任上海新华发行集团有限公司、上海新华传媒股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为600825）董事，2014年8月至今担任上海上报传悦置业发展有限公司董事长，2014年9月至今担任上海文汇新民实业有限公司执行董事、界面（上海）网络科技有限公司监事会主席，</p> |

|            |  |
|------------|--|
|            | <p>2014 年 10 月至今担任上海东方明珠房地产有限公司董事，2015 年 5 月至今担任上海瑞力投资基金管理有限公司董事长、上海申闻实业有限公司执行董事，2016 年 2 月至今担任上海东方票务有限公司董事长、上海人才市场报社有限公司执行董事、上海房地产时报社有限公司执行董事，2016 年 4 月至今担任上海文化产权交易所股份有限公司董事长、上海解放传媒信息发展有限公司执行董事，2016 年 7 月至 2017 年 3 月担任上海东方报业有限公司副董事长，2017 年 3 月至今担任上海东方报业有限公司董事长，2016 年 11 月至今担任汇添富基金管理股份有限公司董事，2017 年 9 月至今担任上海新华传媒股份有限公司常务副董事长。程先生 2014 年 3 月至 2015 年 12 月曾担任上海上报资产管理有限公司总经理，2014 年 4 月至 2015 年 8 月曾担任上海申地资产管理有限公司执行董事。</p>   |
| <p>陈辉峰</p> | <p>1966 年出生，工商管理硕士，高级国际商务师，2014 年 12 月 30 日至今担任本公司监事，2013 年 12 月至今担任东浩兰生（集团）有限公司（前身为“上海东浩兰生国际服务贸易（集团）有限公司”）投资发展部总经理。陈先生 1989 年 8 月至 1996 年 1 月在上海市轻工业品进出口有限公司工作，任日用品分公司副总经理；1996 年 1 月至 2002 年 1 月在上海轻工国际（集团）有限公司工作，任职包括五金分公司总经理；2002 年 1 月至 3 月担任上海市轻工业品进出口有限公司副总经理；2002 年 3 月至 2003 年 12 月担任上海轻工国际发展有限公司副总经理；2003 年 12 月至 2007 年 12 月担任上海兰生股份有限公司常务副总经理、总经理；2007 年 12 月至 2013 年 12 月担任上海兰生（集团）有限公司营运部、投资管理部总经理；2014 年 5 月至 2016 年 1 月担任上海中信国健药业股份有限公司董事。陈先生 2012 年 6 月至今担任上海兰生股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600826）董事，2016 年 7 月至今担任上海东浩兰生会展（集团）有限公司总裁。</p> |
| <p>冯煌</p>  | <p>1971 年出生，工商管理硕士，经济师，企业法律顾问，2014 年 12 月 30 日至今担任本公司监事，冯先生 1999 年 1 月加入上实投资（上海）有限公司，先后担任多个职位，包括 2012 年 12 月至今担任上实投资（上海）有限公司董事、总裁，2014 年 9 月至今兼任上实投资（上海）有限公司副董事长。冯先生 2004 年 7 月至今担任上海陆家嘴金融贸易区联合发展有限公司董事，2012 年 4 月至今担任上海实业投资有限公司董事长、南洋酒店（香港）有限公司董事长，2014 年 1 月至今担任上海国金租赁有限公司副董事长，2014 年 5 月至今担任上海上实集团财务有限公司董事，2014 年 12 月至今担任上海上实资产经营有限公司董事长，2014 年 12 月至今担任上海上实投资管理咨询有限公司董事长及总裁，2015 年 2 月至今担任上海上实金融服务控股有限公司董事，2015 年 12 月至今担任 Shanghai International Shanghai Growth Investment Limited（沪光国际上海发展投资有限公司，该公司于香港联交所上市，股票代码为 0770）非执行董事，</p>             |

|                  |  |
|------------------|--|
|                  | 2015 年 12 月至今担任上海上投资产经营有限公司董事。冯先生 2011 年 5 月 16 日至 2014 年 12 月 30 日担任本公司董事。  |
| 宋春风              | 1969 年出生，法学博士，2016 年 7 月 11 日至今担任本公司监事，2016 年 3 月至今担任中国船东互保协会总经理。宋先生 1992 年 8 月至 1996 年 9 月在中国远洋运输（集团）总公司（以下简称“中远”）工作，先后担任理赔处干部、商务处干部、运输部商务处副主任科员；1996 年 9 月至 1997 年 6 月在北京大学中远管理培训班学习；1997 年 6 月至 1998 年 9 月在中远美洲公司工作；1998 年 9 月至 2009 年 2 月在中远运输部工作，先后担任商务处主任科员、副处长、处长、商务室经理；2009 年 2 月至 2012 年 3 月担任中远和中国远洋控股股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 601919；该公司于香港联交所上市，股票代码为 01919）运输部商务室经理；2012 年 3 月至 2016 年 3 月担任中远（香港）保险顾问有限公司董事总经理。宋先生曾任深圳中远保险经纪公司董事长兼总经理，波罗的海国际航运公会（丹麦）文件委员会委员，亚洲船东论坛保险委员会委员，现任中国海事仲裁委员会仲裁员、委员，华南国际贸易仲裁委员会仲裁员，中国航海学会海运法规研究专业委员会副主任委员，中国海商法协会理事，北京大学海商法研究中心客座研究员。2017 年 2 月至今宋先生担任中国民生银行股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600016）董事。          |
| <b>离任监事（3 名）</b> |  |
| 寿伟光              | 1963 年出生，经济学博士，应用经济学（金融方向）博士后，高级经济师，2015 年 7 月 8 日至 2017 年 4 月 12 日担任本公司监事，2015 年 7 月 21 日至 2017 年 4 月 12 日担任本公司监事会主席。寿先生 1987 年 7 月至 1995 年 10 月在财政部驻上海专员办事处工作，先后担任科员、业务科副科长、工业一科副科长、外贸金融科副科长、科长；1995 年 10 月至 1997 年 12 月担任上海市财政局综合计划处主任科员；1997 年 12 月至 1999 年 8 月担任上海市财政局第六分局副局长；1999 年 8 月至 2000 年 5 月担任上海国际信托投资公司人事处副处长；2000 年 5 月至 2002 年 12 月担任上海国际集团有限公司党委委员、党委办公室主任、干部人事处处长、博士后工作办公室主任；2002 年 12 月至 2009 年 9 月担任上海国际集团有限公司副总经理、党委委员，兼任上海国际集团金融发展研究院常务副院长、博士后工作站副站长；2009 年 9 月至 2013 年 3 月担任上海国有资产经营有限公司党委书记、总裁；2013 年 3 月至 2014 年 6 月担任山西省太原市人民政府副市长；2014 年 6 月至 2015 年 4 月担任山西省太原市委常委、副市长。寿先生 2017 年 4 月至今担任上海国盛（集团）有限公司党委书记、董事长。 |
| 杨庆忠              | 1956 年出生，硕士研究生，高级政工师，2004 年 5 月 21 日至 2017 年 12 月 13 日担任本公司监事，2011 年 5 月 16 日至 2017 年 12 月 13  |

|                         |  |
|-------------------------|--|
|                         | <p>日担任本公司监事会副主席，2008 年 10 月至 2017 年 9 月担任公司纪委书记，2014 年 2 月至 2017 年 9 月担任公司党委副书记。杨先生 1974 年 12 月至 1998 年 8 月在中国人民解放军海军任职。杨先生曾于本公司担任不同职位，包括：1998 年 8 月至 2002 年 11 月担任党委办公室副主任兼纪委委员；1998 年 8 月至 2003 年 8 月担任党委组织部副部长；2003 年 5 月至 2005 年 4 月担任培训中心总经理；2002 年 11 月至 2013 年 2 月担任党群工作部主任；2003 年 8 月至 2013 年 4 月担任人力资源开发部总经理；2003 年 8 月至 2013 年 4 月担任党委组织部部长；2003 年 4 月至 2013 年 7 月担任工会副主席；2013 年 7 月至 2016 年 12 月担任公司工会主席。</p>   |
| 仇夏萍                     | <p>1960 年出生，工商管理硕士，高级会计师，2007 年 7 月 16 日至 2017 年 12 月 11 日担任公司监事。仇女士 1980 年 8 月至 1992 年 8 月在中国工商银行杨浦分行任职；1993 年 3 月至 1993 年 8 月在中国工商银行浦东分行任职；1993 年 8 月至 1994 年 11 月在华夏证券有限公司东方路营业部任职。仇女士曾于本公司担任不同职位，包括：1994 年 11 月至 1996 年 8 月担任本公司计划财务部干部；1996 年 8 月至 1998 年 4 月担任财务会计部财务部科长；1998 年 4 月至 2000 年 7 月担任财务会计部总经理助理；2000 年 7 月至 2009 年 3 月担任财务会计部副总经理；2009 年 3 月至 2010 年 12 月担任计划财务部副总经理（主持工作）；2010 年 12 月至 2014 年 11 月担任计划财务部副总经理（部门正职待遇），2014 年 11 月至 2016 年 5 月担任计划财务部总经理。仇女士 2005 年 10 月至 2016 年 12 月担任海通期货有限公司董事，2008 年 10 月至 2016 年 11 月担任海通开元投资有限公司董事，2008 年 10 月至 2016 年 11 月担任富国基金管理有限公司监事，2010 年 11 月至 2016 年 11 月担任海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司监事，2012 年 6 月至 2017 年 1 月担任海通创意资本管理有限公司监事。</p> |
| <b>其他在任高级管理人员（13 名）</b> |  |
| 任澎                      | <p>1962 年出生，工商管理硕士，经济师，于 1996 年 3 月加入本公司，并自 1997 年 11 月至今担任本公司副总经理，主要负责投资银行业务。任先生 1982 年 6 月至 1988 年 2 月在中国工商银行西湖办事处担任不同管理职位；1988 年 3 月至 1996 年 3 月在中国交通银行杭州分行先后担任多个职务，包括储蓄业务主管及证券部经理等；1996 年 3 月至 1997 年 11 月担任海通证券有限公司杭州营业部经理；2008 年 10 月至 2011 年 8 月担任海通开元投资有限公司董事。任先生 2011 年 3 月至今担任中国—比利时直接股权投资基金董事，2014 年 6 月至 2017 年 5 月担任海通恒信国际租赁有限公司董事长，2017 年 5 月至今担任海通恒信国际租赁股份有限公司董事长，2014 年 6 月至今担任海通恒信金融集团有限公司董事长，2014 年 7 月至今担任海通恒运国际租赁有限公司董事长、上海泛圆投资发展有限公司董事，2014 年 11 月</p>  |

|      |   |
|------|---|
|      | 至今担任海通恒信融资租赁（上海）有限公司董事长。  |
| 宫里啓暉 | 1965 年出生，生物物理与生物化学硕士，于 2009 年 5 月加入本公司，并自 2012 年 3 月至今担任本公司副总经理，主要负责证券投资、交易、上海自贸试验区分公司及柜台市场业务。宫里先生 1993 年 4 月至 1994 年 3 月担任 Credit Suisse First Boston（现为 Credit Suisse Group AG）固定收益部门经理；1994 年 4 月至 1998 年 3 月担任 Deutsche Genossenschaftsbank AG（现为 Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank AG）东京分行的亚洲部主任；1998 年 4 月至 1999 年 9 月担任 J.P. Morgan 东京分行自营投资部全球市场投资经理；1999 年 10 月至 2009 年 3 月担任 Nikko (Citi) Asset Management Co., Ltd. 全球战略资产管理的基金经理、另类投资高级基金经理、中国投资部总经理、大中华区总裁；2007 年 4 月至 2009 年 4 月担任融通基金管理有限公司董事兼股东代表。宫里先生 2009 年 5 月至 2012 年 3 月担任本公司国际业务部总经理；2015 年 9 月至 2017 年 10 月担任海通银行董事长；2016 年 12 月至 2017 年 10 月担任海通银行首席执行官。目前兼任公司自营决策委员会主任、资本配置委员会委员、国际业务协调委员会委员；及中国证券业协会场外市场专业委员会副主任委员、国家千人计划特聘金融专家。 |
| 裴长江  | 1965 年出生，政治经济学硕士，于 2013 年 8 月加入本公司至今一直担任副总经理。裴先生 1993 年 7 月至 1996 年 7 月在上海万国证券公司先后担任多个职务，包括研究部研究员、闸北营业部总经理助理、总经理；1996 年 8 月至 2002 年 10 月先后担任申银万国证券公司闸北营业部总经理、浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理；2002 年 10 月至 2013 年 8 月先后担任华宝信托投资有限责任公司投资总监、华宝兴业基金管理有限公司董事、总经理。裴先生 2014 年 8 月至今担任富国基金管理有限公司董事，2014 年 11 月至今担任上海海通证券资产管理有限公司董事长，2015 年 9 月至 2016 年 3 月担任海通期货有限公司董事长，2016 年 3 月至今担任海通期货股份有限公司董事长。  |
| 王建业  | 1960 年出生，硕士研究生，高级经济师，于 1994 年 8 月加入本公司，并自 2010 年 7 月至今担任本公司合规总监，自 2017 年 3 月至今兼任本公司合规法务部总经理，主要负责合规管理部门。王先生还是中国证券业协会合规专业委员会副主任委员、上海市证券同业公会合规与自律监察专业委员会主任。王先生 1984 年 8 月至 1990 年 8 月先后在中国人民银行内蒙古分行金融管理处教育处担任副主任科员、见习副处长、副处长；1990 年 8 月至 1992 年 5 月担任中国人民银行内蒙古分行金融管理处副处长；1992 年 5 月至 1993 年 3 月担任内蒙古自治区证券公司证券部副总经理，并于 1993 年 3 月至 1994 年 7 月担任该公司的副总经理。王先生亦曾于本公司担任不同职位，包括：1994   |

|     |   |
|-----|---|
|     | <p>年 8 月至 1996 年 3 月担任交易部主管；1996 年 3 月至 1998 年 9 月担任业务管理总部副总经理；1998 年 9 月至 2004 年 8 月担任综合业务管理总部总经理。王先生 2001 年 6 月至 2011 年 2 月担任本公司总经理助理；2005 年 3 月至 2006 年 6 月担任经纪业务总部总经理，2008 年 10 月至 2011 年 3 月兼任风险控制总部总经理，先后负责综合业务管理总部、经纪业务总部、信息技术部、经纪业务营运中心、销售交易总部、客户资产管理部及风险控制部，2011 年 5 月至 2017 年 3 月兼任本公司首席风险官（享受公司副总经理级待遇）。</p>   |
| 李础前 | <p>1957 年出生，经济学硕士，高级经济师，于 1994 年 8 月加入本公司，并自 2007 年 7 月至今担任本公司财务总监（享受公司副总经理待遇），主要负责公司财务工作。李先生还是中国证券业协会财务会计与风险控制专业委员会副主任委员、上海上市公司协会财务总监委员会副主任委员。李先生 1988 年 7 月至 1991 年 8 月担任安徽省财政厅中企处副主任科员；1991 年 8 月至 1994 年 7 月担任安徽省国有资产管理局科长。李先生亦曾于本公司担任不同职位，包括：1994 年 8 月至 1996 年 3 月担任计划财务部主管；1996 年 3 月至 1998 年 4 月担任财务会计部副总经理；1998 年 4 月至 2001 年 7 月担任财务会计部总经理；2001 年 7 月至 2007 年 7 月担任财务副总监及财务会计部总经理。李先生自 2006 年 5 月至 2009 年 5 月担任上海界龙实业集团股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600836）董事，2012 年 6 月至 2016 年 10 月担任上海海通证券资产管理有限公司监事。李先生自 2003 年 4 月至今担任海富通基金管理有限公司监事长，自 2010 年 6 月至今担任海富产业投资基金管理有限公司董事。</p> |
| 毛宇星 | <p>1971 年出生，理学博士，管理学博士后，教授级高级工程师，自 2016 年 9 月 19 日至今担任公司首席信息执行官（副总经理级）、IT 治理委员会主任。毛宇星先生 1993 年 8 月至 2001 年 9 月在中国工商银行上海市分行信息科技部工作，历任程序员、副科长、科长、副处长；2001 年 9 月至 2011 年 11 月在中国工商银行数据中心（上海）工作，历任总经理助理（副处级、正处级）、副总经理，党委委员；2011 年 11 月至 2016 年 4 月担任中国工商银行总行信息科技部副总经理。同时，毛宇星先生还曾兼任中国人民银行、银监会、公安部、工信部等多个专家委员会委员。</p>   |
| 陈春钱 | <p>1963 年出生，经济学博士，于 1997 年 10 月加入本公司，自 2012 年 3 月至今担任总经理助理，负责公司经纪业务，兼任公司经纪业务委员会主任、IT 治理委员会副主任、国际业务协调委员会委员，2017 年 2 月至今享受公司副总经理级待遇。陈先生还是中国证券业协会融资融券业务委员会副主任委员、上海市证券同业公会证券纠纷调解专业委员会副主任。陈先生曾于本公司担任不同职位，包括：1997 年 10 月至 1998 年 1 月担任深圳分公司业务部负责人；1998 年 1 月至 2000 年 3 月担任国际业务部副总经理；2000 年 3 月至 2000 年 12 月担任</p>   |

|     |   |
|-----|---|
|     | 深圳分公司副总经理；2000 年 12 月至 2006 年 5 月担任投资管理部（深圳）总经理；2006 年 5 月至 2013 年 2 月担任销售交易总部总经理，其中 2007 年 11 月至 2009 年 3 月兼任机构业务部总经理。陈先生 2015 年 1 月至今担任证通股份有限公司董事。  |
| 李建国 | 1963 年出生，经济学博士，于 1998 年加入本公司，自 2008 年至今担任本公司总经理助理。李先生 1992 年至 1998 年担任河南省证券有限公司总经理；1998 年至 1999 年担任海通证券股份有限公司副总经理；1999 年 5 月至 2008 年 8 月担任富国基金管理有限公司副董事长、总经理；2008 年 10 月至 2010 年 8 月担任海通国际控股有限公司董事长，2010 年 8 月至今担任海通国际控股有限公司副董事长，2010 年 1 月至今担任海通国际证券集团有限公司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 0665.HK）执行董事，2010 年 3 月至今担任海通国际证券集团有限公司董事会副主席。  |
| 张向阳 | 1965 年出生，工学学士，高级经济师，于 1996 年 5 月加入本公司，自 2014 年 12 月至今担任总经理助理，自 2013 年 3 月至今担任本公司 PE 与产业资本投资委员会主任，主要负责直投业务。张先生 1983 年 12 月至 1988 年 4 月在太原市新华书店任职；1988 年 4 月至 1991 年 12 月在山西广播电视大学任职；1991 年 12 月至 1996 年 5 月在交通银行太原分行任职。张先生曾于本公司担任不同职位，包括：1996 年 5 月至 2002 年 4 月担任太原营业部副总经理（主持工作）及总经理；2002 年 4 月至 2006 年 5 月先后担任综合业务管理总部副总经理及总经理；2006 年 5 月至 2008 年 10 月担任风险控制总部总经理；2008 年 10 月至 2012 年 11 月担任海通开元投资有限公司董事、总经理、投资决策委员会主任，2012 年 6 月至 2015 年 8 月担任海通创意资本管理有限公司董事，2011 年 11 月至 2015 年 7 月担任海通创新资本管理有限公司董事长，2015 年 8 月至 2016 年 3 月担任海通创意资本管理有限公司董事长，2013 年 7 月至 2016 年 5 月担任海通新能源股权投资管理有限公司董事，2015 年 7 月至 2016 年 5 月担任海通新能源股权投资管理有限公司董事长。张先生 2012 年 11 月至今担任海通开元投资有限公司董事长兼投资决策委员会主任，2016 年 3 月至今担任海通创意资本管理有限公司董事，2016 年 6 月至今担任海通并购资本管理（上海）有限公司董事长。张先生目前为中国证券业协会直接投资业务专业委员会主任、上海股权投资协会副会长。 |
| 林涌  | 1969 年出生，经济学博士，于 1996 年 12 月加入本公司，自 2014 年 12 月至今担任总经理助理，自 2007 年 7 月至今担任海通国际控股有限公司总经理。林先生曾于本公司担任不同职位，包括：1996 年 12 月至 2003 年 7 月在本公司投资银行部工作，担任职务包括副总经理，并自 2001 年 1 月至 2003 年 7 月担任副总经理（主持工作）；2003 年 7 月至 2004 年 5 月担任本公司固定收益部副总经理；2004 年 5 月至 2007 年 7 月先后担任本公司投资银行部（上海）副总经理（主持工作）及总经理。林先生 2009 年 12 月至今担任海通国际证券集团有限公   |

|     |  |
|-----|--|
|     | <p>司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 0665）执行董事，2010 年 3 月至 2011 年 3 月担任海通国际证券集团有限公司执行董事、联席行政总裁；2011 年 4 月至今担任海通国际证券集团有限公司执行董事、董事会副主席、董事总经理、行政总裁，2016 年 6 月至今担任海通银行非执行董事，2017 年 10 月至今担任海通银行董事长。</p>  |
| 姜诚君 | <p>1968 年出生，经济学硕士，经济师，2017 年 3 月 29 日至今担任公司总经理助理、董事会秘书，2017 年 4 月 5 日至今担任公司联席公司秘书、联席授权代表，2017 年 4 月至今担任公司投资银行总部总经理。姜先生曾于 1993 年 7 月至 1994 年 7 月担任厦门国贸集团股份有限公司干部；1994 年 7 月至 2000 年 8 月先后担任厦门国泰企业股份有限公司金融证券部副经理、投资管理与发展部经理、总经理助理、董事会秘书、副总经理；2000 年 8 月至 2007 年 7 月担任公司投资银行部副总经理；2007 年 7 月至 2009 年 4 月担任公司投资银行部副总经理（主持工作）；2010 年 3 月至 2011 年 2 月担任公司投资银行委员会委员；2011 年 2 月至 2014 年 3 月担任公司国际业务协调委员会委员；2009 年 4 月至 2017 年 4 月担任公司投资银行部总经理；2011 年 2 月至今担任公司投资银行委员会副主任。</p>  |
| 杜洪波 | <p>1963 年出生，工学学士，工程师，2017 年 5 月至今担任公司首席风险官，2017 年 3 月至今担任公司风险管理部总经理。杜先生 1984 年 8 月至 1990 年 12 月在武汉市电子计算机应用开发研究所工作；1990 年 12 月至 1992 年 8 月在四通集团武汉分公司工作；1992 年 8 月至 1996 年 8 月在武汉软件研究中心工作；1996 年 8 月至 2002 年 3 月在国泰君安证券股份有限公司电脑技术中心工作。杜先生 2002 年 3 月至 2003 年 5 月担任公司网站管理部总经理助理；2003 年 5 月至 2005 年 5 月担任公司经纪业务总部总经理助理；2005 年 5 月至 2006 年 5 月担任公司综合业务管理总部副总经理；2006 年 5 月至 2011 年 3 月在公司风险控制总部工作，担任副总经理及副总经理（部门正职待遇）；2011 年 3 月至 2013 年 1 月担任公司合规与风险管理总部总经理；2013 年 1 月至 2014 年 2 月担任公司柜台市场部总经理；2014 年 2 月至 2017 年 3 月担任公司证券金融部总经理。杜先生自 2011 年 5 月 16 日至 2014 年 12 月 30 日曾担任本公司职工监事。</p> |
| 潘光韬 | <p>1971 出生，工商管理硕士，工程师、助理经济师，2017 年 5 月至今担任公司总经理助理，2013 年 3 月至今担任公司权益投资交易部总经理。潘先生 1994 年 7 月至 1998 年 7 月在申银万国证券公司经纪总部电脑部担任电脑主管；1998 年 7 月至 2002 年 7 月在申银万国证券公司证券投资总部证券投资一部工作，先后担任经理助理、副经理。潘先生 2002 年 8 月至 2003 年 6 月担任公司交易二部总经理助理；2003 年 7 月至 2004 年 8 月在公司交易总部工作，先后担任总经理助理、副总经理；2004 年 8 月至 2006 年 8 月担任公司投资管理部副总经理；2006 年 8 月至 2013 年 3 月在公司证券投资部工作，先后担任副总经理、副总经理（主持工作），2015 年 11 月至今担任海通银行非执行</p>  |

|                     |   |
|---------------------|---|
|                     | 董事。   |
| <b>离任高级管理人员（2名）</b> |   |
| 吉宇光                 | 1957 年出生，硕士研究生，高级经济师，于 1995 年 11 月加入本公司，并自 1997 年 11 月至 2018 年 1 月担任本公司副总经理，主要负责国际业务。吉先生 1983 年 8 月至 1988 年 11 月担任北京市计委财金处干部；1988 年 11 月至 1995 年 11 月在中国交通银行北京分行先后担任多个职位，包括证券交易部副经理及经理；1995 年 11 月至 1997 年 11 月担任海通证券有限公司北京郎家园营业部负责人及总经理；2010 年 12 月至 2011 年 5 月担任吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司董事长；2004 年 11 月至 2011 年 3 月担任中国—比利时直接股权投资基金董事；2003 年 4 月至 2016 年 3 月担任海富通基金管理有限公司董事。吉先生 2010 年 1 月至 2018 年 2 月担任海通国际证券集团有限公司（该公司于香港联交所上市，股票代码为 0665）非执行董事，2011 年 4 月至 2018 年 2 月担任海通国际证券集团有限公司董事会主席，2010 年 8 月至 2018 年 2 月担任海通国际控股有限公司董事，2011 年 3 月至 2018 年 2 月担任海通国际控股有限公司董事会主席。 |
| 黄正红                 | 1975 年出生，经济学硕士，2015 年 3 月至 2017 年 3 月担任本公司董事会秘书，2015 年 4 月至 2017 年 4 月担任本公司联席公司秘书、联席授权代表。黄先生曾于本公司担任不同职位，包括：2001 年 7 月至 2003 年 12 月担任本公司研究所行业分析师；2003 年 12 月至 2011 年 3 月先后担任本公司总经理办公室副科级秘书、正科级秘书、主任助理；2011 年 3 月至 2012 年 11 月担任本公司战略发展与 IT 治理办公室副主任兼总经理办公室主任助理，2012 年 11 月至 2017 年 2 月担任战略发展部总经理。  |

其它情况说明

√适用 □不适用

**1. 董事变更情况**

2016 年 8 月 31 日，公司发布《关于独立董事辞职的公告》（公告编号：临 2016-040），李光荣先生因个人原因辞去公司第六届董事会独立董事职务，同时一并辞去公司董事会提名与薪酬考核委员会主任委员、发展战略与投资管理委员会委员和审计委员会委员职务，其辞职后将不再担任公司其他任何职务，其辞职申请自公司股东大会选举出新任独立董事且独立董事任职资格获得证券监督管理机构核准、新任独立董事履职之日（即 2017 年 4 月 6 日独立董事林家礼先生履职之日）起生效。

2016年9月23日，公司2016年第一次临时股东大会审议通过了《关于提名林家礼先生为独立非执行董事的议案》，同意林家礼先生担任公司独立董事，任期与第六届董事会相同，其担任公司独立董事的任职资格需监管部门核准后生效。2016年10月28日，公司第六届董事会第十九次会议审议通过了《关于选举周杰先生为第六届董事会发展战略与投资管理委员会主任委员及调整委员的议案》、《关于调整审计委员会委员的议案》，对董事会发展战略与投资管理委员会委员以及审计委员会委员进行调整，由林家礼先生接替李光荣先生担任委员，并且审议通过了《关于选举刘志敏先生为第六届董事会提名与薪酬考核委员会主任委员及调整委员的议案》，独立董事刘志敏先生接替李光荣先生任提名与薪酬考核委员会主任委员，同时增补林家礼先生为该委员会委员，上述任职自林家礼先生独立董事任职资格获得监管部门核准后生效。2017年4月6日，公司发布《关于独立董事履职的公告》（公告编号：临2017-011），林家礼先生的独立董事任职资格已经获得核准，林家礼先生自2017年4月6日起履行独立董事职责，并同时履行发展战略与投资管理委员会、审计委员会以及提名与薪酬考核委员会委员的职责。

2017年5月12日，公司发布《关于董事辞职的公告》（公告编号：临2017-021），王鸿祥先生因个人原因辞去公司第六届董事会董事职务，同时一并辞去公司提名与薪酬考核委员会委员、审计委员会委员职务，其辞职后将不再担任公司任何职务。王鸿祥先生的辞职申请自2017年5月12日起生效。

2017年6月6日，公司2016年度股东大会审议通过了《关于提名邬跃舟先生为公司董事的议案》，同意邬跃舟先生担任公司董事，其任期与第六届董事会相同，其担任公司董事的任职资格需监管部门核准后生效。2017年8月18日，公司发布《关于董事履职的公告》（公告编号：2017-041），邬跃舟先生的董事任职资格已获得核准，邬跃舟先生自2017年8月18日起履行董事职责。2017年8月29日，公司第六届董事会第二十五次会议审议通过了《关于选举邬跃舟先生为第六届董事会提名与薪酬考核委员会委员及审计委员会委员的议案》，由邬跃舟先生接任王鸿祥先生任提名与薪酬考核委员会委员及审计委员会委员。邬跃舟先生自2017年8月29日起履行提名与薪酬考核委员会委员及审计委员会委员的职责。

## 2. 监事变更情况

2017年4月12日，公司发布《关于监事会主席辞任的公告》（公告编号：临2017-013），寿伟光先生因工作调动原因辞去公司第六届监事会主席及监事职务，其辞职后不再担任公司任何职务。寿伟光先生的辞职申请自2017年4月12日起生效。

2017年11月20日，公司发布《关于变更职工代表监事的公告》（公告编号：临2017-054），杨庆忠先生和仇夏萍女士因年龄原因不再担任公司职工代表监事职务，公司于2017年11月20日以通讯方式召开了第三届职工代表大会第八次会议，选举吴红伟先生和芮政先先生为公司第六届监事会职工代表监事，在其证券公司监事任职资格生效之前，杨庆忠先生和仇夏萍女士仍继续履行公司职工代表监事的职责，杨庆忠先生仍继续履行公司监事会

副主席的职责。2017年12月15日，公司发布《关于职工代表监事履职的公告》（临2017-055），吴红伟先生和芮政先先生的证券公司监事任职资格已获证券监管部门核准，吴红伟先生自2017年12月13日起履行职工代表监事职责，芮政先先生自2017年12月11日起履行职工代表监事职责，其任期与第六届监事会相同，且杨庆忠先生和仇夏萍女士不再履行公司职工代表监事的职责。2017年12月15日公司召开第六届监事会第十六次会议（临时会议），会议选举吴红伟先生为公司第六届监事会副主席。

### 3. 高级管理人员变更情况

2017年3月29日，公司第六届董事会第二十三次会议审议通过了《关于聘任董事会秘书及联席公司秘书的议案》和《关于聘任公司高级管理人员的议案》，黄正红先生因个人原因辞去公司董事会秘书、联席公司秘书、联席授权代表及接收香港联合交易所电子呈交系统密码及处理其后的登记事宜之授权人士，公司董事会聘任姜诚君先生担任公司总经理助理、董事会秘书、联席公司秘书、联席授权代表及接收香港联合交易所电子呈交系统密码及处理其后的登记事宜之授权人士。姜诚君先生自2017年3月29日起履行总经理助理、董事会秘书、联席授权代表及接收香港联合交易所电子呈交系统密码及处理其后的登记事宜之授权人士的职责，自2017年4月5日起履行联席公司秘书的职责。

2017年3月29日，公司第六届董事会第二十三次会议审议通过了《关于聘任公司高级管理人员的议案》，聘任杜洪波先生担任公司首席风险官，王建业先生不再担任公司首席风险官，聘任潘光韬先生担任公司总经理助理，上述任职自杜洪波先生和潘光韬先生的证券公司经理层高级管理人员任职资格获得批复后生效。2017年5月12日，公司发布《关于杜洪波先生和潘光韬先生履职的公告》（公告编号：临2017-020），杜洪波先生和潘光韬先生的证券公司经理层高级管理人员任职资格已获证券监管部门核准，自2017年5月12日起履行公司高级管理人员职责。

2018年1月25日，公司发布《关于吉宇光先生不再担任公司副总经理的公告》（公告编号：临2018-007），吉宇光先生因年龄原因不再担任公司副总经理职务。

2018年3月27日，公司第六届董事会第二十九次会议审议通过了《关于聘任财务总监的议案》，鉴于李础前先生因年龄原因不再担任公司财务总监，依据《公司法》和《公司章程》的规定，公司董事会聘任张信军先生担任财务总监。张信军先生的任职资格已获证券监督管理机构的核准，于当日起履行财务总监的职责。

(二) 董事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

二、现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员的任职情况

(一) 在股东单位任职情况

适用 不适用

| 任职人员姓名           | 股东单位名称           | 在股东单位担任的职务     | 任期起始日期 | 任期终止日期 |
|------------------|------------------|----------------|--------|--------|
| <b>现任董事任职情况:</b> |                  |                |        |        |
| 余莉萍              | 光明食品（集团）有限公司     | 副总裁            | 2010 年 | 至今     |
| 陈斌               | 上海海烟投资管理有限公司     | 副总经理           | 2017 年 | 至今     |
| 邬跃舟              | 申能（集团）有限公司       | 副总经济师、资产管理部经理  | 2016 年 | 至今     |
| 许建国              | 上海电气（集团）总公司      | 财务预算部部长        | 2013 年 | 至今     |
| 张新玫              | 上海久事（集团）有限公司     | 副总裁            | 2014 年 | 至今     |
| 沈铁冬              | 辽宁能源投资（集团）有限责任公司 | 副董事长、党委副书记、总经理 | 2014 年 | 至今     |
| <b>离任董事任职情况:</b> |                  |                |        |        |
| 王鸿祥              | 申能（集团）有限公司       | 副总会计师          | 1998 年 | 2016 年 |
| <b>现任监事任职情况:</b> |                  |                |        |        |
| 李林               | 光明食品（集团）有限公司     | 财务总监           | 2014 年 | 至今     |
| 郑小芸              | 上海百联集团股份有限公司     | 财务总监、董事会秘书     | 2015 年 | 至今     |
|                  | 上海百联集团股份有限公司     | 董事             | 2017 年 | 至今     |
| 程峰               | 上海报业集团           | 党委委员、副总经理      | 2013 年 | 至今     |
| 宋春风              | 中国船东互保协会         | 总经理            | 2016 年 | 至今     |
| 陈辉峰              | 上海兰生股份有限公司       | 董事             | 2012 年 | 至今     |

(二) 在其他单位任职情况

适用 不适用

| 任职人员姓名           | 其他单位名称        | 在其他单位担任的职务 | 任期起始日期 | 任期终止日期 |
|------------------|---------------|------------|--------|--------|
| <b>现任董事任职情况:</b> |               |            |        |        |
| 余莉萍              | 农工商超市（集团）有限公司 | 监事会主席      | 2013 年 | 至今     |

|     |                   |       |        |        |
|-----|-------------------|-------|--------|--------|
|     | 上海轻工控股（集团）公司      | 法定代表人 | 2014 年 | 至今     |
|     | 光明食品集团财务有限公司      | 监事会主席 | 2014 年 | 至今     |
|     | 上海益民食品集团          | 监事会主席 | 2015 年 | 2017 年 |
| 陈斌  | 东方证券股份有限公司        | 非执行董事 | 2014 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团静安烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团闸北烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团卢湾烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团铁路烟草有限公司    | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团嘉定烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团普陀烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团黄浦烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团奉贤烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团金山烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草集团长宁烟草糖酒有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海白玉兰烟草材料有限公司     | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海金鼎印务有限公司        | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海海烟烟行连锁企业管理有限公司  | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海烟草拍卖行有限责任公司     | 董事    | 2017 年 | 至今     |
|     | 上海烟草包装印刷有限公司      | 董事    | 2017 年 | 至今     |
|     | 上海牡丹香精香料有限公司      | 董事    | 2017 年 | 至今     |
|     | 华环国际烟草有限公司        | 董事    | 2017 年 | 至今     |
| 许建国 | 上海集优机械股份有限公司      | 监事长   | 2016 年 | 至今     |
|     | 东方证券股份有限公司        | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海人寿保险股份有限公司      | 董事    | 2015 年 | 至今     |
|     | 上海电气集团财务有限责任公司    | 董事    | 2013 年 | 至今     |
|     | 上海微电子装备股份有限公司     | 董事    | 2016 年 | 至今     |
|     | 上海海立（集团）股份有限公司    | 董事    | 2016 年 | 2017 年 |
|     | 上海海立（集团）股份有限公司    | 监事长   | 2017 年 | 至今     |
| 张新玫 | 中国太平洋保险（集团）股份有限公司 | 监事    | 2015 年 | 至今     |
|     | 中国太平洋人寿保险股份有限公司   | 监事    | 2015 年 | 至今     |

| 现任独立董事任职情况： |   |                  |        |        |
|-------------|---|------------------|--------|--------|
| 刘志敏         | 百德能控股有限公司                                     | 董事总经理            | 1996 年 | 至今     |
|             | 星和有限公司  | 独立非执行董事          | 2004 年 | 至今     |
|             | OUEHospitality Trust Management Pte. Ltd      | 独立非执行董事          | 2013 年 | 至今     |
|             | OUEHospitality REITManagement Pte. Ltd        | 独立非执行董事          | 2013 年 | 至今     |
|             | 大连万达商业地产股份有限公司                                | 独立监事             | 2015 年 | 至今     |
|             | STGDC Pte.Ltd.                                | 独立非执行董事          | 2015 年 | 至今     |
| 肖遂宁         | 先锋太盟融资租赁有限公司                                  | 董事长              | 2013 年 | 至今     |
|             | 北京清新环境技术股份有限公司                                | 独立董事             | 2013 年 | 至今     |
|             | 中润资源投资股份有限公司                                  | 独立董事             | 2013 年 | 至今     |
|             | 南海控股有限公司                                      | 独立董事             | 2016 年 | 至今     |
|             | 中国数码信息有限公司                                    | 独立董事             | 2016 年 | 至今     |
|             | 太合汇投资管理（宁波）有限公司                               | 董事长兼总经理          | 2017 年 | 2018 年 |
| 冯仑          | 万通投资控股股份有限公司                                  | 董事长              | 1993 年 | 至今     |
|             | 北京四方御风投资有限公司                                  | 董事长              | 2016 年 | 至今     |
| 张鸣          | 上海财经大学会计学院                                    | 教授               | 1997 年 | 至今     |
|             | 上工申贝(集团)股份有限公司                                | 独立董事             | 2009 年 | 至今     |
|             | 上海金桥出口加工区开发股份有限公司                             | 独立董事             | 2011 年 | 至今     |
|             | 无锡商业大厦大东方股份有限公司                               | 独立董事             | 2015 年 | 至今     |
|             | 上海浦东发展银行股份有限公司                                | 独立董事             | 2016 年 | 至今     |
| 林家礼         | 麦格理基础建设及有型资产(香港)有限公司                          | 东盟区非执行主席兼亚洲区首席顾问 | 2015 年 | 至今     |
|             | 胡百全律师事务所                                      | 资深律师             | 2014 年 | 至今     |
|             | Hong Kong Casin Holdings Limited (香港财信控股有限公司) | 董事               | 2017 年 | 至今     |
|             | PT Purimas Sasmita (Sinar Mas Group 金光集团)     | 资深顾问             | 2017 年 | 至今     |
|             | Adamas Finance Asia Limited                   | 董事               | 2017 年 | 至今     |
|             | Asia-Pacific Strategic Investments            | 独立董事             | 2017 年 | 至今     |

|                    |  |      |        |    |
|--------------------|--|------|--------|----|
|                    | Limited  |      |        |    |
|                    | AustChina Holdings Limited (前称: Coalbank Limited)  | 独立董事 | 2013 年 | 至今 |
|                    | 中国天然气集团有限公司  | 董事   | 2014 年 | 至今 |
|                    | 中国山东高速金融集团有限公司   | 董事   | 2017 年 | 至今 |
|                    | 资本策略地产有限公司   | 独立董事 | 2001 年 | 至今 |
|                    | 易生活控股有限公司(前称 神州资源集团有限公司)   | 独立董事 | 2015 年 | 至今 |
|                    | 旭日企业有限公司   | 独立董事 | 2004 年 | 至今 |
|                    | 华隆金控有限公司(前称 高锐中国物联网国际有限公司)   | 独立董事 | 2017 年 | 至今 |
|                    | 华融投资股份有限公司   | 独立董事 | 2017 年 | 至今 |
|                    | 凯知乐国际控股有限公司  | 独立董事 | 2017 年 | 至今 |
|                    | 美亚娱乐咨询信息集团有限公司   | 独立董事 | 2017 年 | 至今 |
|                    | 国艺娱乐文化集团有限公司   | 董事   | 2017 年 | 至今 |
|                    | Rowsley Limited  | 独立董事 | 2002 年 | 至今 |
|                    | Singapore eDevelopment Ltd   | 董事   | 2017 年 | 至今 |
|                    | Sunwah International Limited   | 独立董事 | 2011 年 | 至今 |
|                    | 新华汇富金融控股有限公司   | 董事   | 2007 年 | 至今 |
|                    | 天大药业有限公司   | 董事   | 2018 年 | 至今 |
|                    | Top Global Limited   | 独立董事 | 2010 年 | 至今 |
|                    | Vietnam Equity Holding (VEH) (Vietnam Property Holding (VPH) 于 2017 年 6 月 30 日已并入 (VEH)) | 独立董事 | 2007 年 | 至今 |
|                    | 黄河实业有限公司   | 独立董事 | 2005 年 | 至今 |
|                    | 西安海天天实业股份有限公司 (前名: 西安海天天线控股股份有限公司)   | 独立董事 | 2017 年 | 至今 |
| <b>离任独立董事任职情况:</b> |  |      |        |    |
| 李光荣                | 特华投资控股有限公司   | 董事长  | 1998 年 | 至今 |

|                  |                           |                        |        |        |
|------------------|---------------------------|------------------------|--------|--------|
|                  | 华安财产保险股份有限公司              | 董事长                    | 2004 年 | 至今     |
|                  | 华安财保资产管理有限责任公司            | 董事长                    | 2014 年 | 至今     |
|                  | 渤海国际信托有限公司                | 董事长                    | 2014 年 | 至今     |
|                  | 中国民生投资股份有限公司              | 董事会咨询委员会主席             | 2014 年 | 至今     |
| <b>现任监事任职情况:</b> |                           |                        |        |        |
| 李林               | 光明食品集团财务有限公司              | 董事长                    | 2014 年 | 至今     |
|                  | 赛领资本管理有限公司                | 董事                     | 2014 年 | 至今     |
|                  | 赛领国际投资基金（上海）有限公司          | 董事                     | 2014 年 | 至今     |
| 程峰               | 上海上报资产管理有限公司              | 董事长                    | 2014 年 | 至今     |
|                  | 上海新华发行集团有限公司、上海新华传媒股份有限公司 | 董事                     | 2014 年 | 至今     |
|                  | 上海新华传媒股份有限公司              | 常务副董事长                 | 2017 年 | 至今     |
|                  | 上海上报传悦置业发展有限公司            | 董事长                    | 2014 年 | 至今     |
|                  | 上海文汇新民实业有限公司              | 执行董事                   | 2014 年 | 至今     |
|                  | 界面（上海）网络科技有限公司            | 监事会主席                  | 2014 年 | 至今     |
|                  | 上海东方明珠房地产有限公司             | 董事                     | 2014 年 | 至今     |
|                  | 上海瑞力投资基金管理有限公司            | 董事长                    | 2015 年 | 至今     |
|                  | 上海申闻实业有限公司                | 执行董事                   | 2015 年 | 至今     |
|                  | 上海东方票务有限公司                | 董事长                    | 2016 年 | 至今     |
|                  | 上海人才市场报社有限公司              | 执行董事                   | 2016 年 | 至今     |
|                  | 上海房地产时报社有限公司              | 执行董事                   | 2016 年 | 至今     |
|                  | 上海文化产权交易所股份有限公司           | 董事长                    | 2016 年 | 至今     |
|                  | 上海解放传媒信息发展有限公司            | 执行董事                   | 2016 年 | 至今     |
|                  | 上海东方报业有限公司                | 副董事长                   | 2016 年 | 2017 年 |
|                  | 上海东方报业有限公司                | 董事长                    | 2017 年 | 至今     |
|                  | 汇添富基金管理股份有限公司             | 董事                     | 2016 年 | 至今     |
| 冯煌               | 上实投资（上海）有限公司              | 董事、总裁、副董事长（自 2014 年至今） | 2012 年 | 至今     |
|                  | 上海陆家嘴金融贸易区联合发展有限公司        | 董事                     | 2004 年 | 至今     |
|                  | 上海实业投资有限公司、南洋酒店（香港）有      | 董事长                    | 2012 年 | 至今     |

|                     |  |          |        |        |
|---------------------|--|----------|--------|--------|
|                     | 限公司  |          |        |        |
|                     | 上海国金租赁有限公司   | 副董事长     | 2014 年 | 至今     |
|                     | 上海上实集团财务有限公司   | 董事       | 2014 年 | 至今     |
|                     | 上海上实资产经营有限公司   | 董事长      | 2014 年 | 至今     |
|                     | 上海上实金融服务控股有限公司   | 董事       | 2015 年 | 至今     |
|                     | Shanghai International Shanghai Growth Investment Limited (于香港联交所上市, 股票代码为 0770) | 非执行董事    | 2015 年 | 至今     |
|                     | 上海上投资产经营有限公司   | 董事       | 2015 年 | 至今     |
|                     | 上海上实投资管理咨询有限公司   | 董事长、总裁   | 2014 年 | 至今     |
| 宋春风                 | 中国民生银行股份有限公司   | 董事       | 2017 年 | 至今     |
| 陈辉峰                 | 上海东浩兰生(集团)有限公司(前身为上海东浩兰生国际服务贸易(集团)有限公司)  | 投资发展部总经理 | 2013 年 | 至今     |
|                     | 上海东浩兰生会展(集团)有限公司   | 总裁       | 2016 年 | 至今     |
| <b>离任监事任职情况:</b>    |  |          |        |        |
| 寿伟光                 | 上海国盛(集团)有限公司   | 党委书记、董事长 | 2017 年 | 至今     |
| <b>其他高级管理人员任职情况</b> |  |          |        |        |
| 任澎                  | 中国一比利时直接股权投资基金   | 董事       | 2011 年 | 至今     |
|                     | 海通恒信金融集团有限公司   | 董事长      | 2014 年 | 至今     |
|                     | 海通恒信国际租赁股份有限公司(前身为海通恒信国际租赁有限公司)  | 董事长      | 2014 年 | 至今     |
|                     | 海通恒运国际租赁有限公司   | 董事长      | 2014 年 | 至今     |
|                     | 海通恒信融资租赁(上海)有限公司   | 董事长      | 2014 年 | 至今     |
|                     | 上海泛圆投资发展有限公司   | 董事       | 2014 年 | 至今     |
| 宫里啟暉                | 海通银行   | 董事长      | 2015 年 | 2017 年 |
|                     | 海通银行   | 首席执行官    | 2016 年 | 2017 年 |
| 裴长江                 | 富国基金管理有限公司   | 董事       | 2014 年 | 至今     |
|                     | 上海海通证券资产管理有限公司   | 董事长      | 2014 年 | 至今     |
|                     | 海通期货股份有限公司(前身为海通期货有限   | 董事长      | 2015 年 | 至今     |

|                      |                  |                   |        |        |
|----------------------|------------------|-------------------|--------|--------|
|                      | 公司)              |                   |        |        |
| 李础前                  | 海富通基金管理有限公司      | 监事长               | 2003 年 | 至今     |
|                      | 海富产业投资基金管理有限公司   | 董事                | 2010 年 | 至今     |
| 李建国                  | 海通国际控股有限公司       | 副董事长              | 2010 年 | 至今     |
|                      | 海通国际证券集团有限公司     | 执行董事              | 2010 年 | 至今     |
|                      | 海通国际证券集团有限公司     | 董事会副主席            | 2010 年 | 至今     |
| 陈春钱                  | 证通股份有限公司         | 董事                | 2015 年 | 至今     |
| 张向阳                  | 海通开元投资有限公司       | 董事长兼投资决策委员会主任     | 2012 年 | 至今     |
|                      | 海通创意资本管理有限公司     | 董事                | 2016 年 | 至今     |
|                      | 海通并购资本管理（上海）有限公司 | 董事长               | 2016 年 | 至今     |
| 林涌                   | 海通国际证券集团股份有限公司   | 执行董事              | 2009 年 | 至今     |
|                      | 海通国际证券集团股份有限公司   | 董事会副主席、董事总经理、行政总裁 | 2011 年 | 至今     |
|                      | 海通银行             | 非执行董事             | 2016 年 | 至今     |
|                      | 海通银行             | 董事长               | 2017 年 | 至今     |
| 潘光韬                  | 海通银行             | 非执行董事             | 2015 年 | 至今     |
| <b>离任高级管理人员任职情况:</b> |                  |                   |        |        |
| 吉宇光                  | 海通国际证券集团有限公司     | 非执行董事             | 2010 年 | 2018 年 |
|                      | 海通国际证券集团有限公司     | 董事会主席             | 2011 年 | 2018 年 |
|                      | 海通国际控股有限公司       | 董事                | 2010 年 | 2018 年 |
|                      | 海通国际控股有限公司       | 董事会主席             | 2011 年 | 2018 年 |
| 黄正红                  | 海通恒信金融集团有限公司     | 董事                | 2014 年 | 2017 年 |
|                      | 海通恒信国际租赁有限公司     | 董事                | 2014 年 | 2017 年 |
|                      | 海通恒运国际租赁有限公司     | 董事                | 2014 年 | 2017 年 |
|                      | 上海泛圆投资发展有限公司     | 董事                | 2014 年 | 2017 年 |
|                      | 海通恒信融资租赁（上海）有限公司 | 董事                | 2014 年 | 2017 年 |
|                      | 上海海通资源管理有限公司     | 董事                | 2013 年 | 2017 年 |
|                      | 海富通基金管理有限公司      | 董事                | 2016 年 | 2017 年 |

三、董事、监事、高级管理人员报酬情况

√适用 □不适用

|                                    |   |
|------------------------------------|---|
| <p>董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序</p>         | <p>公司独立非执行董事报酬由董事会制定，报股东大会审议决定，独立非执行董事津贴按月计提。公司高级管理人员报酬，由董事会审议决定。董事和高级管理人员报酬决策程序：董事会提名与薪酬考核委员会负责就公司董事及高级管理人员的全体薪酬及架构，及就设立规范透明的程序制定薪酬政策，向董事会提出建议。董事会决定高级管理人员的报酬和奖惩事项，股东大会决定董事的报酬事项。</p>  |
| <p>董事、监事、高级管理人员报酬确定依据</p>          | <p>本公司董事、监事（非职工监事）的报酬根据公司的经营业绩、岗位职责、工作表现、市场环境等因素确定，公司独立非执行董事报酬标准参照同行业上市公司的平均水平确定。公司非执行董事、外部监事不在公司领取报酬。本公司内部董事、职工监事、高级管理人员的报酬由公司薪酬考核体系决定，根据岗位职责、按年度计划完成情况考核确定报酬。在现有法律框架内，公司实行的是绩效薪酬激励。董事会根据公司取得的经营业绩，给予相应绩效薪酬总额，根据既定的原则进行分配。</p> |
| <p>董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况</p>       | <p>详见本节“现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动及薪酬情况”。</p>  |
| <p>报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计</p> | <p>报告期末全体董事、监事和高级管理人员从公司实际获得的报酬合计为：5,140.86 万元。（上述合计数据未包含公司高管在子公司领取的薪酬。董事、监事和高级管理人员报告期内从公司获得的税前报酬总额包含归属于 2016 年的绩效工资。）</p>  |

四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

√适用 □不适用

| 姓名  | 担任的职务 | 变动情形 | 变动原因 |
|-----|-------|------|------|
| 王鸿祥 | 董事    | 离任   | 个人原因 |

|     |                           |    |        |
|-----|---------------------------|----|--------|
| 李光荣 | 独立董事                      | 离任 | 个人原因   |
| 邬跃舟 | 董事                        | 选举 |        |
| 林家礼 | 独立董事                      | 选举 |        |
| 寿伟光 | 监事会主席                     | 离任 | 工作调动原因 |
| 杨庆忠 | 监事会副主席                    | 离任 | 年龄原因   |
| 仇夏萍 | 职工监事                      | 离任 | 年龄原因   |
| 吴红伟 | 监事会副主席                    | 选举 |        |
| 芮政先 | 职工监事                      | 选举 |        |
| 吉宇光 | 副总经理                      | 离任 | 年龄原因   |
| 王建业 | 首席风险官                     | 离任 | 工作变动原因 |
| 黄正红 | 董事会秘书、联席公司秘书、联席授权代表       | 离任 | 个人原因   |
| 姜诚君 | 总经理助理、董事会秘书、联席公司秘书、联席授权代表 | 聘任 |        |
| 杜洪波 | 首席风险官                     | 聘任 |        |
| 潘光韬 | 总经理助理                     | 聘任 |        |

### 五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

√适用 □不适用

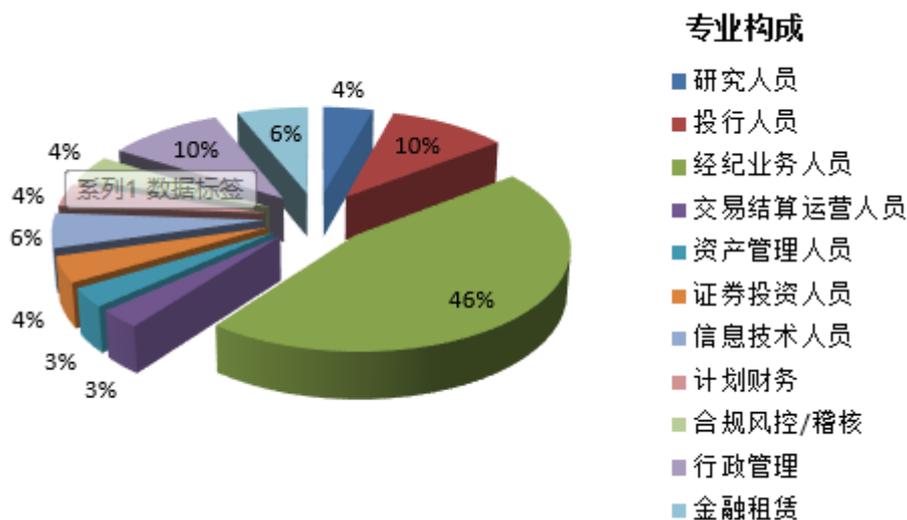
2015年8月24日，公司收到中国证监会《调查通知书》（津证调查字2015011号）。因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，中国证监会决定对公司立案调查（详见公司公告临2015-054号公告）。2015年9月10日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]73号）（详见公司公告临2015-063号）。2016年11月25日，中国证监会向公司出具《行政处罚决定书》（〔2016〕127号），认定公司杭州解放路营业部和上海建国西路营业部对杭州恒生网络技术服务有限公司 HOMS 系统开放专线接入，公司对上述外部接入的第三方交易终端软件未进行软件认证许可，未实施有效管理，及对相关客户身份情况缺乏了解的事实，要求公司责令改正，进行警告，没收违法所得，并处以罚款（详见公司公告临2016-053号）。针对此问题，公司已按照监管要求完成了整改；同时，公司对涉及此案所得和处罚金额已于2015年度全额计入损益。此后，公司一直贯彻落实好中国证监会、上海证监局关于清理整顿违法从事证券业务活动的要求，对遗留问题进行了持续跟踪监控，无新增外部系统接入。

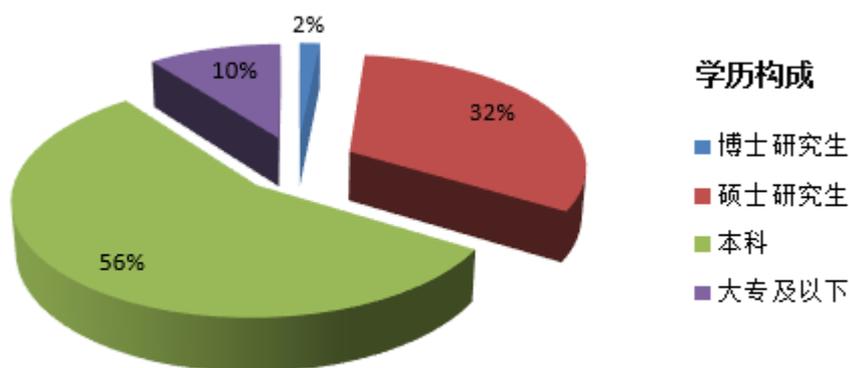
2017 年 5 月 23 日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2017〕59 号），因公司涉嫌在融资融券业务中未按照规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款，中国证监会拟对公司作出行政处罚（详见公司公告临 2017-024）。该事件涉及的公司员工已按照规定程序提出陈述、申辩，目前还在等待进一步处理意见。

六、母公司和主要子公司的员工情况

(一) 员工情况

|                        |        |
|------------------------|--------|
| 母公司在职员工的数量             | 5,718  |
| 主要子公司在职员工的数量           | 4,366  |
| 在职员工的数量合计              | 10,084 |
| 母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数 | 33     |
| 专业构成                   |        |
| 专业构成类别                 | 专业构成人数 |
| 研究人员                   | 438    |
| 投行人员                   | 1,036  |
| 经纪业务人员                 | 4,618  |
| 交易结算运营人员               | 299    |
| 资产管理人员                 | 307    |
| 证券投资人员                 | 420    |
| 信息技术人员                 | 556    |
| 计划财务                   | 369    |
| 合规风控/稽核                | 410    |
| 行政管理                   | 1,011  |
| 金融租赁                   | 620    |
| 合计                     | 10,084 |
| 教育程度                   |        |
| 教育程度类别                 | 数量     |
| 博士研究生                  | 159    |
| 硕士研究生                  | 3,239  |
| 本科                     | 5,641  |
| 大专及以下                  | 1,045  |
| 合计                     | 10,084 |





## (二) 薪酬政策

√适用 □不适用

截至报告期末，本集团雇员人数10,084人。其中本公司雇员人数5,718人，子公司雇员人数4,366人。

本公司重视人才的吸引、激励、培养和使用，制定了一系列符合公司实际情况的薪酬制度，实行以市场水平为定薪依据、以绩效考核结果为分配导向的薪酬体系。本公司薪酬由固定薪酬、绩效薪酬和福利构成。依据相关法律法规，本公司与每位雇员签订劳动合同，建立劳动关系，劳动合同包含关于合同期限、工作时间和休息休假、劳动报酬和保险福利、劳动保护和劳动条件、合同的变更及解除等条款。本公司为雇员建立各项社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险及生育保险）、住房公积金，并依据法规足额缴纳上述社会保险费和住房公积金。同时依据适用的法规，本公司建立企业年金制度，为雇员提供补充养老保障。

## (三) 培训计划

√适用 □不适用

2017 年公司培训工作立足员工培训需求，依托海通财富管理学院平台，根据干部员工成长路径，实施分类、分层培训，全面建设符合公司发展需求的培训体系。2017 年公司组织实施面授培训、在线培训及外派培训等各类培训项目 587 期；新增各类线上及线下课程 539 门，内训师资队伍达到 125 人；进一步完善三位一体的海通财富管理学院平台功能，全年迭代更新 9 次，并荣获中国企业在线学习大会 2017 年度博奥奖“最佳学习生态运营奖”。

2018 年培训将以“上接战略、下接绩效”为工作导向，以“知识管理、人才培养、文化传承、创新协作”为目标，以海通财富管理学院为载体，充分整合内外部培训资源，构建集团范围内培训体系，做好“培训管理流程化、规范化；培训项目多层次、广覆盖；资源库建设多元化、体系化；平台建设智能化、场景化”四方面的重点工作，有效推动员工持续成长和干部梯队建设，实现培训对公司人才发展战略和组织绩效提升的支持作用。

**(四) 劳务外包情况**

√适用 □不适用

|             |            |
|-------------|------------|
| 劳务外包的工时总数   | 959,462 小时 |
| 劳务外包支付的报酬总额 | 3522.19 万元 |

**七、其他**

√适用 □不适用

**委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况**

自 2009 年取得证券经纪人业务资格以来，公司严格按照《证券经纪人管理暂行规定》（[2009]2 号）、《证券经纪人制度现场核查意见书》（沪证监机构字 [2009] 302 号）的核查意见及内部制度等有关规定，对证券经纪人实施集中统一管理，通过完善规章制度、健全内控机制、改进支持系统和强化内部培训，进一步规范证券经纪人的执业行为，维护客户的合法权益。截至报告期末，公司已有 269 家证券营业部实际开展证券经纪人业务，证券经纪人共计 6,217 名，其中，已在中国证券业协会完成执业注册的共 6,103 名。

经纪人直接隶属于公司证券营业部，接受公司委托，代理公司从事客户招揽、客户服务，遵守经纪人行为规范和公司各项规章制度，客户可通过登陆公司网站、查询营业部现场信息公示、拨打 95553 客户服务统一电话等方式查询经纪人的执业注册信息。公司建立风险监控平台，对经纪人所属客户的交易行为进行监控、预警和跟踪处理，有效控制经纪人风险。营业部负责人作为第一管理责任人，全面具体负责本营业部的经纪人管理工作，并接受公司总部的管理、协调和监督、检查。证券营业部定期通过面谈、电话、信函或者其他方式对经纪人招揽和服务的客户进行回访，了解经纪人的执业合规情况。2017 年公司进一步加强对经纪人合规展业培训、规范执业管理。

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

#### （一）公司治理基本情况

作为在中国大陆和香港两地上市的公众公司，公司严格按照境内外上市地的法律、法规及规范性文件的要求，规范运作，不断致力于维护和提升公司良好的市场形象。公司根据《公司法》、《证券法》、中国证监会相关法规的要求及《香港上市规则》等相关规定，不断完善法人治理结构，进一步建立健全了合规风控制度和内控管理体系，形成了股东大会、董事会、监事会和经营管理层相互分离、相互制衡的公司治理结构，使各层次在各自的职责、权限范围内，各司其职，各负其责，确保了公司的规范运作，公司治理科学、规范、透明。公司“三会”（股东大会、董事会、监事会）的召集、召开及表决程序规范合法有效，信息披露真实、准确、完整、及时、公平，能够严格按照《公司内幕信息知情人登记制度》的有关规定，加强对公司内幕信息的管理，做好内幕信息知情人登记工作，投资者关系管理工作专业规范。

报告期内，公司根据《公司法》、《上市公司章程指引》、《证券公司全面风险管理规范》以及公司的实际情况，对《公司章程》、《公司董事会议事规则》和《公司监事会议事规则》进行了修订，修订明确了中国共产党在公司内发挥政治核心作用，同时主要修订了公司全面风险管理的相关内容，明确首席信息官和首席风险官为公司高级管理人员，并对监事会人数进行了修改，进一步优化和完善了公司治理结构。另外，公司根据中国证监会最新颁布的《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第133号）的有关规定及公司实际情况，对《公司章程》、《公司董事会议事规则》和《公司监事会议事规则》中的合规管理相关内容进行修订，此次修订已经过公司股东大会审议通过，仍需经监管机构批准后生效。

报告期内，公司严格遵循《守则》中的所有守则条文，同时达到了《守则》中所列明的绝大多数建议最佳常规条文的要求。

报告期内，本公司召开股东大会3次，董事会7次，监事会5次，独立非执行董事年报工作会议2次，审计委员会5次，提名与薪酬考核委员会2次，发展战略与投资管理委员会2次，合规与风险管理委员会3次，共计29次会议。

#### （二）内幕信息知情人管理制度的制定、实施情况

报告期内，公司在编制定期报告等重大事项的过程中，能够根据《内幕信息知情人登记制度》的要求，做好内幕信息管理以及内幕信息知情人登记工作，能够如实、完整记录内幕信息在公开前的报告、传递、编制、审核、披露各环节中涉及的所有内幕信息知情人名单，以及知情人知悉内幕信息的内容和时间等相关档案，供公司自查和相关监管机构查询。报告期内，公司未发生违反《内幕信息知情人登记制度》的情形，该制度执行情况良好。

### （三）企业管治政策以及就企业管治而言董事会的职责

公司严格遵照《香港上市规则》，以《守则》中所列的所有原则作为企业管治政策。就企业管治而言，董事会具有如下职责：

- (a) 制定及检讨公司的企业管治政策及常规；
- (b) 检讨及监察董事及高级管理人员的培训及持续专业发展；
- (c) 检讨及监察公司在遵守法律及监管规定方面的政策及常规；
- (d) 制定、检讨及监察雇员及董事的操守准则及合规手册（如有）；
- (e) 检讨公司遵守《守则》的情况及在《企业管治报告》内的披露。

公司治理与中国证监会相关规定的要求是否存在重大差异；如有重大差异，应当说明原因  
适用 不适用

## 二、股东大会情况简介

| 会议届次                | 召开日期           | 决议刊登的指定网站的查询索引  | 决议刊登的披露日期      |
|---------------------|----------------|---|----------------|
| 2016 年度股东大会         | 2017 年 6 月 6 日 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> | 2017 年 6 月 7 日 |
| 2017 年第一次 A 股类别股东大会 | 2017 年 6 月 6 日 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> | 2017 年 6 月 7 日 |
| 2017 年第一次 H 股类别股东大会 | 2017 年 6 月 6 日 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> | 2017 年 6 月 7 日 |

### 股东大会情况说明

适用 不适用

本报告期内，公司于 2017 年 6 月 6 日在上海青城大酒店召开了 2016 年度股东大会，审议了 17 项议案：1. 公司 2016 年度董事会工作报告；2. 公司 2016 年度监事会工作报告；3. 公司 2016 年年度报告；4. 公司 2016 年度财务决算报告；5. 公司 2016 年度利润分配方案；6. 关于续聘会计师事务所的议案；7. 关于公司权益类、非权益类投资资产配置的议案；8. 关于预计公司 2017 年度日常关联交易的议案；9. 关于海通恒信国际租赁有限公司境外上市符合《关于规范境内上市公司所属企业到境外上市有关问题的通知》的议案；10. 关于海通恒信国际租赁有限公司境外上市方案的议案；11. 关于在海通恒信国际租赁有限公司上市后维持本公司独立上市地位承诺的议案；12. 关于在海通恒信国际租赁有限公司上市后本公司持续盈利能力的说明与前景的议案；13. 关于提请股东大会授权董事会及其授权人士全权办理与海通恒信国际租赁有限公司境外上市有关事宜的议案；14. 关于分拆海通恒信国际租赁有限公司境外上市仅向本公司 H 股股东提供保证配额的议案；15. 关于修订《公司章程》、《董事会议事规则》及《监事会议事规则》的议案；16. 关于提请股东大会给予董事会认可、分配或发行 A 股及/或 H 股股份的一般性授权的议案；17. 关于提名邬跃舟先生为公司董事的议案。其中议案 1 至议案 13 以及议案 17 为普通决议案，议案 14 至议案 16 为特别决议案，以上议案均经审议通过。相关决议于会议当日刊登在上交所网站

(<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 以及本公司网站 (<http://www.htsec.com>)，于 2017 年 6 月 7 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。

公司于 2017 年 6 月 6 日在上海青松城大酒店召开了 2017 年第一次 A 股类别股东大会、2017 年第一次 H 股类别股东大会，分别审议了 1 项议案：关于分拆海通恒信国际租赁有限公司境外上市仅向本公司 H 股股东提供保证配额的议案（即 2016 年度股东大会审议的议案 14），以上议案经审议通过。相关决议于会议当日刊登在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 以及本公司网站 (<http://www.htsec.com>)，于 2017 年 6 月 7 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。

### 三、董事履行职责情况

董事会按照《公司章程》的规定行使其职权，以公司及股东的最大利益为原则，向股东大会报告工作，执行股东大会的决议，对股东大会负责。

董事于本报告日期的简历详见本报告“第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况”中董事、监事、高级管理人员的“主要工作经历”版块。董事、监事及高级管理人员与其他董事、监事或高级管理人员不存在任何关系（包括财政、业务、家族或其它重大或相关关系）。董事会结构科学，每名董事均具备与本集团业务运营及发展有关的丰富知识、经验及才能。所有董事深知其共同及个别对股东所负之责任。

自本公司上市以来，董事会一直符合《香港上市规则》有关委任至少三名独立非执行董事、且所委任的独立非执行董事必须占董事会成员人数至少三分之一的要求，本公司五名独立非执行董事的资格完全符合《香港上市规则》第 3.10（1）及（2），第 3.10（A）条的规定。此外，本公司已收到每名独立非执行董事根据《香港上市规则》第 3.13 条就其各自的独立性出具的年度确认书。因此，本公司认为每名独立非执行董事均具备《香港上市规则》要求的独立性。

#### （一） 董事参加董事会和股东大会的情况

根据《公司章程》的规定，董事会每年至少召开四次会议，董事会会议由董事长召集。定期董事会会议应于召开前至少十四天发出通知，通知须列明会议日期和地点、会议期限、事由及议题和发出通知的日期。

董事会会议应有过半数的董事参加方可举行。除公司章程另有规定外，董事会作出决议，必须经全体董事的过半数通过。董事与董事会会议决议事项所涉及的企业有关联关系的，不得对该项决议行使表决权，也不得代理其它董事行使表决权。该董事会会议由过半数的无关联关系董事出席即可举行，董事会会议所作决议须经无关联关系董事过半数通过。出席董事会的无关联董事人数不足 3 人的，应将该事项提交股东大会审议。董事会会议以现场召开为原则。必要时，董事会临时会议可以通过视频、电话、传真方式召开，也可以采取现场与其它方式同时进行的方式召开。董事可以亲自参加董事会，亦可以书面委托其它董事代为出席董事会。

| 董事姓名        | 是否独立董事 | 参加董事会情况    |        |           |        |      |               | 参加股东大会情况  |
|-------------|--------|------------|--------|-----------|--------|------|---------------|-----------|
|             |        | 本年应参加董事会次数 | 亲自出席次数 | 以通讯方式参加次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | 是否连续两次未亲自参加会议 | 出席股东大会的次数 |
| 周杰          | 否      | 7          | 5      | 2         | 0      | 0    | 否             | 3         |
| 瞿秋平         | 否      | 7          | 4      | 2         | 1      | 0    | 否             | 3         |
| 余莉萍         | 否      | 7          | 4      | 2         | 1      | 0    | 否             | 0         |
| 陈斌          | 否      | 7          | 3      | 2         | 2      | 0    | 否             | 3         |
| 许建国         | 否      | 7          | 5      | 2         | 0      | 0    | 否             | 3         |
| 邬跃舟         | 否      | 3          | 3      | 0         | 0      | 0    | 否             | 0         |
| 张新玫         | 否      | 7          | 5      | 2         | 0      | 0    | 否             | 3         |
| 沈铁冬         | 否      | 7          | 3      | 2         | 2      | 0    | 否             | 3         |
| 刘志敏         | 是      | 7          | 5      | 2         | 0      | 0    | 否             | 3         |
| 肖遂宁         | 是      | 7          | 5      | 2         | 0      | 0    | 否             | 3         |
| 冯仑          | 是      | 7          | 3      | 2         | 2      | 0    | 否             | 0         |
| 张鸣          | 是      | 7          | 5      | 2         | 0      | 0    | 否             | 0         |
| 林家礼         | 是      | 4          | 4      | 0         | 0      | 0    | 否             | 0         |
| 王鸿祥<br>(离任) | 否      | 4          | 2      | 2         | 0      | 0    | 否             | 0         |
| 李光荣<br>(离任) | 是      | 3          | 0      | 2         | 1      | 0    | 否             | 0         |

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

|                |   |
|----------------|---|
| 年内召开董事会会议次数    | 7 |
| 其中：现场会议次数      | 1 |
| 通讯方式召开会议次数     | 2 |
| 现场结合通讯方式召开会议次数 | 4 |

全体董事对董事会审议议案的表决结果均为同意，无弃权和反对。

报告期内，董事会共召开 7 次会议，具体如下：

1. 2017 年 1 月 20 日公司以通讯方式召开第六届董事会第二十一次会议，会议审议通过了《关于举牌受让上海惟泰置业管理有限公司 100%股权及转让方对标的企业 10191.607425 万元债权的议案》。

2. 2017 年 2 月 24 日公司以通讯方式召开第六届董事会第二十二次会议，会议审议通过了《关于调整公司组织架构的议案》、《关于海通期货股份有限公司向海通期货香港有限公司增资的议案》。

3. 2017 年 3 月 29 日公司现场召开第六届董事会第二十三次会议，会议审议通过了《公司 2016 年年度报告》、《公司 2016 年度财务决算报告》、《公司 2016 年度利润分配预案》、《公司 2016

年度内部控制评价报告》、《公司 2016 年度合规报告》、《关于续聘会计师事务所的议案》、《公司董事会审计委员会 2016 年度履职报告》、《公司 2016 年度董事会工作报告》、《公司 2016 年度独立董事述职报告》、《公司 2016 年度企业社会责任报告》、《关于公司权益类、非权益类投资资产配置的议案》、《关于提请股东大会给予董事会认可、分配或发行 A 股及/或 H 股股份的一般性授权的议案》、《关于预计公司 2017 年度日常关联交易的议案》、《关于修订〈公司章程〉及〈董事会议事规则〉的议案》、《关于修订〈海通证券股份有限公司全面风险管理办法〉和〈海通证券股份有限公司流动性风险管理办法〉的议案》、《关于调整公司风险容忍度指标的议案》、《关于公司全面风险管理工作方案的议案》、《关于海通恒信国际租赁有限公司境外上市符合〈关于规范境内上市公司所属企业到境外上市有关问题的通知〉的议案》、《关于海通恒信国际租赁有限公司境外上市方案的议案》、《关于在海通恒信国际租赁有限公司上市后维持本公司独立上市地位承诺的议案》、《关于在海通恒信国际租赁有限公司上市后本公司持续盈利能力的说明与前景的议案》、《关于提请股东大会授权董事会及董事会授权人士全权办理与海通恒信国际租赁有限公司境外上市有关事宜的议案》、《关于分拆海通恒信国际租赁有限公司境外上市仅向本公司 H 股股东提供保证配额的议案》、《关于海通恒信国际租赁有限公司资产重组及改制的议案》、《关于对海通银行增资的议案》、《关于对海通国际控股增资的议案》、《关于对海通创新证券投资有限公司增资的议案》、《关于公司购买办公用房（地）的一般性授权的议案》、《关于公司经营班子 2016 年考核结果的议案》、《关于给予公司高级管理人员 2016 年度经营业绩专项奖励的议案》、《关于 2017 年公司高级管理人员考核激励方案的议案》、《关于召开公司 2016 年度股东大会、2017 年第一次 A 股类别股东大会及 2017 年第一次 H 股类别股东大会的议案》、《关于聘任公司高级管理人员的议案》、《关于聘任董事会秘书的议案》。

4. 2017 年 4 月 27 日公司以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届董事会第二十四次会议，会议审议通过了《公司 2017 年第一季度报告》、《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》、《关于实施海通证券股份有限公司职业经理人方案的议案》。

5. 2017 年 8 月 29 日公司以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届董事会第二十五次会议，会议审议通过了《关于公司 2017 年半年度报告的议案》、《公司 2017 年半年度合规报告》、《关于调整公司流动性风险容忍度的议案》、《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》、《关于修订〈公司章程〉及〈公司董事会议事规则〉的议案》、《关于修订〈公司董事会合规与风险管理委员会工作细则〉的议案》、《关于续聘立信会计师事务所的议案》、《关于选举邬跃舟先生为第六届董事会提名与薪酬考核委员会委员及审计委员会委员的议案》。

6. 2017 年 10 月 27 日公司以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届董事会第二十六次会议，会议审议通过了《公司 2017 年第三季度报告》、《关于制定〈公司合规管理办法〉的议案》、《关于修订〈公司稽核审计管理办法〉的议案》。

7. 2017 年 12 月 15 日公司以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届董事会第二十七次会议，会议审议通过了《关于限期海通开元转让海通恒信股权的议案》、《关于海通国际证券收购海通银行英国及美国子公司的议案》、《关于海通国际证券购置办公写字楼的议案》。

## (二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

适用 不适用

报告期内，公司独立董事未对董事会议案及其他议案提出异议。独立董事出席股东大会、董事会及专门委员会的情况见本节“董事参加董事会和股东大会的情况”的有关内容，独立董事履职情况具体见公司将于 2018 年 3 月 27 日在上交所网站上披露的《海通证券股份有限公司 2017 年度独立董事述职报告》。

## (三) 其他

适用 不适用

### ● 由董事会和管理层行使的职权

董事会和管理层的权力和职责已在《公司章程》中进行了明确规定，以确保为良好的公司治理和内部控制提供充分的平衡和制约机制。

董事会负责决定公司的经营计划和投资方案，决定公司内部管理机构的设置，制定公司的基本管理制度，对公司的其它重大业务和行政事项作出决议并对管理层进行监督。

公司管理层，在总经理（同时亦为执行董事）的领导下，负责执行董事会作出的各项决议，组织公司的日常经营管理。

#### 1. 董事长及总经理

本公司董事长和总经理（即《香港上市规则》条文下之行政总裁）职务分别由不同人士担任，以确保各自职责的独立性、可问责性以及权力和授权的分布平衡。董事长由周杰先生担任，总经理由瞿秋平先生担任，董事会审议通过《董事会议事规则》和《总经理工作细则》分别对董事长和总经理的职责分工进行了明确的界定。

董事长周杰先生领导董事会确定公司的整体发展战略，确保董事会有效运转，履行法定职责，并及时就所有重要的适当事项进行讨论；确保公司制定良好的企业管治常规及程序；确保董事会行事符合公司及全体股东的最佳利益。总经理瞿秋平先生主要负责公司的日常运营管理，包括组织实施董事会决议、进行日常决策等。

#### 2. 委任及重选董事

根据《公司章程》的规定，非职工代表出任的董事由股东大会选举或更换，职工代表出任的董事由公司职工代表大会选举或更换，每届任期不得超过三年，可连选连任。本公司已就新董事的委任执行了一套有效的程序。在《公司章程》规定的人数范围内，按照拟选任的人数，董事候选人可由董事会提名，单独或合并持有公司百分之三以上股份的股东也可以提名董事候选人，并

由股东大会选举或公司职工代表大会通过。关于股东提名董事候选人的具体程序，本公司已编制《股东提名候选董事的程序》并已公布于本公司网站。

### 3. 非执行董事的任期

本公司的非执行董事均于股东大会上推选，任期为三年，可于重选及重新委任时续期。

### 4. 董事薪酬

具体见本报告“第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况”中“三、董事、监事、高级管理人员报酬情况”。

### 5. 董事培训

本公司高度重视董事的持续培训，以确保他们对本公司的运作及业务有适当的理解，确保他们了解中国证监会、上交所、香港联交所以及《公司章程》等相关法律及监管规定所赋予的职责。报告期内，董事除了参加当地监管部门组织的定期培训，完成持续培训的要求之外，公司董事会办公室定期编辑发送《董监事通讯》（2017 年度共有 12 期）、《证券市场法规及案例分析》（2017 年度共有 4 期），对所有董事（包括董事周杰、瞿秋平、余莉萍、陈斌、邬跃舟、许建国、张新玫、沈铁冬，独立董事刘志敏、肖遂宁、冯仑、张鸣、林家礼）进行了 2017 年度的日常培训，离任董事王鸿祥、离任独立董事李光荣在任期内也收到过 3 期《董监事通讯》和 1 期《证券市场法规及案例分析》，完成了书面培训，该类培训协助董事及时了解掌握最新的政策法规和经典案例，并建立多层次的信息沟通机制，搭建信息交流平台，加强董事、监事和管理层之间的信息共享及沟通，提高了董事的履职能力。除此以外，董事参与的其他具体培训情况如下：

| 董事姓名 | 日期                               | 持续时间 | 组织者                                    | 内容   | 培训地  |
|------|----------------------------------|------|--|--|------|
| 张新玫  | 2017 年 7 月 25 日至 2017 年 7 月 27 日 | 3 天  | 上海国家会计学院                               | 高级会计师继续教育  | 上海   |
| 林家礼  | 2017 年 5 月 16 日                  | 1 小时 | 新华汇富金融控股有限公司                           | 证监会 SFC issued Guidance Note on directors' duties regarding corporate transactions and independent valuations SFC Guidance Note Summary- Valuations SFC Guidance Note- Directors Duties on Valuation | /    |
|      | 2017 年 6 月 9 日                   | 1 小时 | Lovable International Holdings Limited | 董事培训   | 电话会议 |
|      | 2017 年 6 月 13 日                  | 1 小时 | 易生活控股有限公司                              | 香港上市规则概览及条例更新  | 阅读文件 |

|            |         |  |  |                   |
|------------|---------|--|--|-------------------|
| 2017年6月15日 | 1小时     | 新华汇富金融控股有限公司                               | SFC Elaborates on the Liabilities of Directors and Senior Executives | 阅读文件              |
| 2017年6月17日 | 3小时15分钟 | LexOmnibus<br>(http://www.lexomnibus.com/) | 持续专业发展培训证书课程(CPD 3分)   | LexOmnibus培训中心    |
| 2017年8月18日 | 3小时15分钟 | LexOmnibus                                 | 持续专业发展培训证书课程(CPD 3分)   | LexOmnibus培训中心    |
| 2017年8月19日 | 3小时15分钟 | LexOmnibus                                 | 持续专业发展培训证书课程(CPD 3分)   | LexOmnibus培训中心    |
| 2017年8月31日 | 1小时     | Adamas Finance Asia Limited                | The key implications of being on AIM / 董事培训                          | 电话会议              |
| 2017年9月1日  | 3小时15分钟 | LexOmnibus                                 | 持续专业发展培训证书课程(CPD 3分)   | LexOmnibus培训中心    |
| 2017年9月16日 | 3小时15分钟 | LexOmnibus                                 | 持续专业发展培训证书课程(CPD 3分)   | LexOmnibus培训中心    |
| 2017年9月25日 | 0.5小时   | 西安海天实业股份有限公司                               | 董事培训   | LOEB & LOEB 律师事务所 |
| 2017年9月26日 | 0.5小时   | 罗马集团有限公司                                   | 董事培训   | 李智聪律师事务所          |
| 2017年10月3日 | 0.5小时   | 华隆金控有限公司                                   | 董事培训   | 普衡律师事务所           |

**四、董事会下设专门委员会在报告期内履行职责时所提出的重要意见和建议，存在异议事项的，应当披露具体情况**

√适用 □不适用

**(一) 董事会专门委员会及其成员情况**

公司第六届董事会下设四个专门委员会，各委员会及其成员如下：

1. 发展战略与投资管理委员会：周杰（主任委员）、刘志敏、肖遂宁、余莉萍、陈斌、许建国、（李光荣）林家礼
2. 合规与风险管理委员会：肖遂宁（主任委员）、刘志敏、冯仑、瞿秋平、陈斌、张新玫
3. 提名与薪酬考核委员会：（李光荣）刘志敏（主任委员）、肖遂宁、张鸣、余莉萍、（王鸿祥）邬跃舟、沈铁冬、林家礼
4. 审计委员会：张鸣（主任委员）、刘志敏、冯仑、张新玫、许建国、（王鸿祥）邬跃舟、（李光荣）林家礼

注：董事会专门委员会成员变动情况请参见本报告“第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况”中的“董事变更情况”。

## （二）各专门委员会职责及召开会议情况

### 1. 合规与风险管理委员会

合规与风险管理委员会的主要职责为：依据法律、法规及监管政策制定合规管理政策供董事会审核；审查、监督公司合规管理制度的科学性、合理性、有效性以及执行情况；制定公司风险管理的原则和重要风险的界限；审查、监督经营管理层制订的内部控制制度的执行情况，并就此进行督导；合规与风险管理委员会的具体职责，请参见《董事会合规与风险管理委员会工作细则》，该细则已公布在公司和香港联交所网站。

报告期内，合规与风险管理委员会共召开 3 次会议，具体如下：

- 2017 年 3 月 27 日公司现场召开合规与风险管理委员会 2017 年第一次会议，会议审议通过了《公司 2016 年度内部控制评价报告》、《公司 2016 年度合规报告》、《公司 2016 年度风险评估报告》、《关于修改〈公司全面风险管理办法〉和〈公司流动性风险管理办法〉的议案》、《关于调整公司风险容忍度指标的议案》、《关于公司全面风险管理工作方案的议案》、《关于修改〈公司章程〉和〈董事会议事规则〉的议案》。

- 2017 年 8 月 28 日公司现场召开合规与风险管理委员会 2017 年第二次会议，会议审议通过了《公司 2017 年半年度合规报告》、《公司 2017 年上半年风险评估报告》、《关于调整公司流动性风险容忍度的议案》、《关于修订〈公司章程〉及〈公司董事会议事规则〉的议案》、《关于修订〈公司董事会合规与风险管理委员会工作细则〉的议案》。

- 2017 年 10 月 26 日公司以通讯方式召开合规与风险管理委员会 2017 年第三次会议，会议审议通过了《关于制定〈公司合规管理办法〉的议案》，并听取了《公司关于〈证券公司合规管理办法及实施指引〉落实工作的报告》。

报告期内，合规与风险管理委员会委员出席会议情况：

| 姓名  | 实际出席会议次数/应出席会议次数 |
|-----|------------------|
| 肖遂宁 | 3/3              |
| 刘志敏 | 3/3              |
| 冯仑  | 2/3              |
| 瞿秋平 | 3/3              |
| 陈斌  | 3/3              |
| 张新玫 | 3/3              |

### 2. 审计委员会

审计委员会的主要职责为：提议聘请或更换外部审计机构，批准外部审计机构的薪酬及聘用条款；保证外部审计机构的客观独立性及审核程序有效；审核公司的财务信息及其披露，根据需要对重大关联交易进行审核；审查公司及各子公司、分公司的财务监控、内控制度及风险管理制度的科学性、合理性、有效性以及执行情况；与管理层讨论风险管理及内部监控系统，确保管理层已履行职责建立有效的系统。检讨集团的财务及会计政策及实务；董事会赋予的其它职责。就审计委员会的具体职责，请参见《董事会审计委员会工作细则》，该细则已公布在公司和香港联交所网站。

审计委员会根据公司《董事会审计委员会工作细则》的有关规定，召集会议、审议相关事项，努力提高工作效率和科学决策的水平；审计委员会认真履行职责，按照公司《董事会审计委员会年报工作规程》积极参与年度财务报告的编制、审计及披露工作，与注册会计师进行充分的沟通，共同制定 2017 年度公司审计项目计划，公司 2017 年度审计工作安排在审计委员会的指导下开展，确保了审计的独立性，提高审计质量，维护公司及股东的整体利益。审计委员会及其委员按照有关法律法规的要求，充分发挥了审查、监督作用，勤勉尽责地开展工作，为完善公司治理结构、提高审计工作质量发挥了重要作用。报告期内，审计委员会共召开 5 次会议，具体如下：

- 2017 年 1 月 16 日公司现场召开审计委员会 2016 年报第一次工作会议。会议主要内容为：学习监管部门关于做好上市公司 2016 年度报告的相关文件；听取财务总监对公司 2016 年度简要财务情况（母公司）的汇报；与年审注册会计师（立信、德勤）沟通制定年度审计工作计划；审阅公司财务部门编制的 2016 年财务报表（母公司未经审计），并请审计委员会形成书面意见。

- 2017 年 3 月 28 日公司现场召开审计委员会 2016 年报第二次工作会议。会议审议通过了《公司 2016 年度财务报告及专项报告（审计或审核初稿）》、《公司董事会审计委员会关于会计师事务所从事本年度审计工作的相关意见》、《关于续聘会计师事务所的提议》、《关于预计公司 2017 年度日常关联交易的议案》、《公司 2016 年度内部控制评价报告》、《公司董事会审计委员会 2016 年度履职报告》；会议还听取了《公司 2016 年度财务决算与 2017 年度财务预算报告》、《会计师事务所关于 2016 年度审计初步结果的沟通报告》和《公司 2016 年社会责任报告》，对最新关联人名册进行了确认。

- 2017 年 4 月 26 日公司以通讯方式召开审计委员会 2017 年第一季度报告会议，会议审议通过了《公司 2017 年第一季度报告》。

- 2017 年 8 月 28 日公司现场召开审计委员会 2017 年半年度报告会议，会议审议通过了《公司 2017 年上半年财务情况说明》（A+H）、《关于续聘立信会计师事务所的议案》；同时，会议听取了《公司 2017 年上半年财务情况说明》（A+H），并确认了公司关联人名单。

- 2017 年 10 月 26 日公司以通讯方式召开审计委员会 2017 年第三季度报告会议，会议审议通过了《公司 2017 年第三季度报告》和《关于修订〈公司稽核审计管理办法〉的议案》。

报告期内，审计委员会委员出席会议情况：

| 姓名      | 实际出席会议次数/应出席会议次数 |
|---------|------------------|
| 张鸣      | 5/5              |
| 刘志敏     | 5/5              |
| 冯仑      | 5/5              |
| 张新玫     | 5/5              |
| 许建国     | 5/5              |
| 邬跃舟     | 2/2              |
| 林家礼     | 3/3              |
| 王鸿祥（离任） | 3/3              |
| 李光荣（离任） | 0/2              |

### 3. 发展战略与投资管理委员会

发展战略与投资管理委员会的主要职责为：对公司中长期发展战略规划进行研究并提出建议；对《公司章程》规定须经董事会批准的重大投资融资方案进行研究并提出建议；对《公司章程》规定须经董事会批准的重大资本运作、资产经营、并购重组等进行可行性论证并提出建议；对其他影响公司发展的重大事项进行研究并提出建议；对以上事项的实施进行检查督导；董事会授权的其它事宜。

报告期内，发展战略与投资管理委员会共召开2次会议，具体如下：

- 2017年3月28日公司现场召开发展战略与投资管理委员会2017年第一次会议，会议审议通过了《关于公司权益类、非权益类投资资产配置的议案》、《关于海通恒信国际租赁有限公司境外上市符合〈关于规范境内上市公司所属企业到境外上市有关问题的通知〉的议案》、《关于海通恒信国际租赁有限公司境外上市方案的议案》、《关于在海通恒信国际租赁有限公司上市后维持本公司独立上市地位承诺的议案》、《关于在海通恒信国际租赁有限公司上市后本公司持续盈利能力的说明与前景的议案》、《关于提请股东大会授权董事会及董事会授权人士全权办理与海通恒信国际租赁有限公司境外上市有关事宜的议案》、《关于分拆海通恒信国际租赁有限公司境外上市仅向本公司H股股东提供保证配额的议案》、《关于海通恒信国际租赁有限公司资产重组及改制的议案》、《关于对海通银行增资的议案》、《关于对海通国际控股增资的议案》、《关于对海通创新投资有限公司增资的议案》，同时会议听取了《公司2016年度经营情况汇报及2017年经营计划》、《2016年度董事会议案执行情况报告》、《公司股东大会、董事会授权执行情况报告》。

- 2017年12月13日公司以通讯方式召开发展战略与投资管理委员会2017年第二次会议，会议审议通过了《关于限期海通开元转让海通恒信股权的议案》、《关于海通国际证券收购海通银行英国及美国子公司的议案》、《关于海通国际证券购置办公写字楼的议案》。

报告期内，发展战略与投资管理委员会委员出席会议情况：

| 姓名      | 实际出席会议次数/应出席会议次数 |
|---------|------------------|
| 周杰      | 2/2              |
| 刘志敏     | 2/2              |
| 肖遂宁     | 2/2              |
| 余莉萍     | 2/2              |
| 陈斌      | 2/2              |
| 许建国     | 2/2              |
| 林家礼     | 0/0              |
| 李光荣（离任） | 1/2              |

#### 4. 提名与薪酬考核委员会

提名与薪酬考核委员会的主要职责为：研究董事、经理人员的选择标准和程序并提出建议；广泛搜寻合格的董事和经理人员人选；对董事和经理候选人进行审查并提出建议；检讨董事会的架构、人数及组成（包括技能、知识及经验方面），并就任何为配合公司的策略而拟对董事会作出的变动提出建议；评核独立非执行董事的独立性，并就董事委任、重新委任以及董事（尤其是董事长及总经理）继任计划向董事会提出建议；制定薪酬政策，包括但不限于绩效评价标准、程序及主要评价体系，奖励和惩罚的主要方案和制度等；根据审计委员会的年度审计结果，审查公司董事及经理人员履行职责情况，对其进行年度绩效考评，并提出建议；对公司的薪酬改革方案进行评议，批准执行董事服务合约条款，同时对公司薪酬制度执行情况进行监督。就提名与薪酬考核委员会的具体职责，对董事、经理人员的提名以及对董事、高级管理人员的考评以及薪酬审查程序，请参见《董事会提名与薪酬考核委员会工作细则》，该细则已公布在公司和香港联交所网站。

为符合及落实《香港上市规则》关于董事会多元化的有关规定，使董事会的构成更加科学合理，公司制定了《海通证券股份有限公司董事会成员多元化政策》，内容包括制定该政策的目的、意义、政策声明、可计量的目标、监督与举报等内容，改政策刊登在公司网站。本公司确认，董事会的构成符合香港上市规则中有关董事多元化的规定且符合公司制定的多元化政策。

报告期内，提名与薪酬考核委员会共召开 2 次会议，具体如下：

- 2017 年 3 月 28 日公司现场召开提名与薪酬考核委员会 2017 年第一次会议，会议审议通过了《关于公司经营班子 2016 年考核结果的议案》、《关于给予公司经营班子 2016 年度单项奖励的议案》、《关于 2017 年公司高级管理人员考核激励方案的议案》、《关于修改<公司章程>和<董事会议事规则>的议案》、《关于聘任公司高管的议案》、《关于聘任董事会秘书的议案》，

同时会议听取了《公司 2016 年度经营情况汇报及 2017 年经营计划》、《关于公司 2017 年度人工成本预算情况的报告》。

● 2017 年 4 月 26 日公司以通讯方式召开提名与薪酬考核委员会 2017 年第二次会议，会议审议通过了《关于实施海通证券股份有限公司职业经理人方案的议案》。

报告期内，提名与薪酬考核委员会委员出席会议情况：

| 姓名      | 实际出席会议次数/应出席会议次数 |
|---------|------------------|
| 刘志敏     | 2/2              |
| 肖遂宁     | 2/2              |
| 张鸣      | 2/2              |
| 余莉萍     | 2/2              |
| 邬跃舟     | 0/0              |
| 沈铁冬     | 2/2              |
| 林家礼     | 1/1              |
| 李光荣（离任） | 0/1              |
| 王鸿祥（离任） | 2/2              |

## 五、监事会发现公司存在风险的说明

适用 不适用

监事会对报告期内的监督事项无异议。

### （一）监事参加监事会情况

| 监事姓名 | 本年应参加监事会次数 | 亲自出席次数 | 以通讯方式参加次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | 是否连续两次未亲自参加会议 |
|------|------------|--------|-----------|--------|------|---------------|
| 吴红伟  | 1          | 1      | 0         | 0      | 0    | 否             |
| 王美娟  | 5          | 4      | 0         | 1      | 0    | 否             |
| 胡海蓉  | 5          | 5      | 0         | 0      | 0    | 否             |
| 宋世浩  | 5          | 5      | 0         | 0      | 0    | 否             |
| 芮政先  | 1          | 1      | 0         | 0      | 0    | 否             |
| 李林   | 5          | 4      | 0         | 1      | 0    | 否             |
| 郑小芸  | 5          | 2      | 2         | 1      | 0    | 否             |
| 程峰   | 5          | 1      | 2         | 2      | 0    | 否             |
| 冯煌   | 5          | 5      | 0         | 0      | 0    | 否             |
| 宋春风  | 5          | 3      | 1         | 1      | 0    | 否             |

|             |   |   |   |   |   |   |
|-------------|---|---|---|---|---|---|
| 陈辉峰         | 5 | 3 | 0 | 2 | 0 | 否 |
| 寿伟光<br>(离任) | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | 否 |
| 杨庆忠<br>(离任) | 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 否 |
| 仇夏萍<br>(离任) | 4 | 3 | 0 | 1 | 0 | 否 |

全体监事对监事会审议议案的表决结果均为同意，无弃权 and 反对。

## (二) 监事会召开情况

报告期内，监事会共召开 5 次会议，具体如下：

1. 2017 年 3 月 29 日现场召开第六届监事会第十二次会议，会议审议通过了《公司 2016 年年度报告》、《公司 2016 年度内部控制评价报告》、《公司 2016 年度合规报告》、《公司 2016 年度监事会工作报告》、《关于修订〈公司监事会议事规则〉的议案》。

2. 2017 年 4 月 27 日以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届监事会第十三次会议，会议审议通过了《公司 2017 年第一季度报告》。

3. 2017 年 8 月 29 日以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届监事会第十四次会议，会议审议通过了《公司 2017 年半年度报告》、《公司 2017 年半年度合规报告》、《关于修订〈公司监事会议事规则〉的议案》。

4. 2017 年 10 月 27 日以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届监事会第十五次会议，会议审议通过了《公司 2017 年第三季度报告》。

5. 2017 年 12 月 25 日以现场会议和电话会议相结合的方式召开第六届监事会第十六次会议，会议审议通过了《关于选举监事会副主席的议案》。

## 六、公司就其与控股股东在业务、人员、资产、机构、财务等方面存在的不能保证独立性、不能保持自主经营能力的情况说明

适用 不适用

本公司股权结构较分散，无控股股东。公司与股东单位在业务、人员、资产、机构、财务等方面完全分开，董事会、监事会及各职能部门均能独立运作，具有独立完整的业务和自主经营能力。

### 1. 业务独立情况

公司按照《中华人民共和国公司法》和《公司章程》的规定，根据中国证监会核准的经营范围依法自主独立地开展业务，公司已取得了经营证券业务所需的相关业务许可，具有独立完整的业务体系和自主经营能力，业务运营不受股东单位及关联方控制和影响，能独立面向市场参与竞争，不存在股东单位及关联方违反公司运作程序，干预公司内部管理和经营决策的行为。

### 2. 人员独立情况

公司设有专门的人力资源部，拥有独立完整的劳动、人事及工资管理体系。公司通过法定程序选举/聘任了董事、监事和高级管理人员，公司高级管理人员未在股东单位及下属企业担任除董事、监事以外的任何职务，也未在与公司业务相同或相近的其他企业任职。公司股东没有超越股东大会、董事会的职权任免公司董事、监事和高级管理人员。董事、监事和高级管理人员的聘任均严格按照《公司法》、《证券法》和《公司章程》的规定，通过合法程序进行。公司建立了完善的劳动用工、人事管理、工资管理和社会保障制度，且全体员工均依法与公司签订《劳动合同》，公司拥有独立的劳动用工权力，不存在受股东干涉的情况。

### 3. 资产独立情况

公司具有开展证券业务所必备的独立完整的资产，不存在股东单位及关联方占用公司资产以及损害公司、公司其他股东、公司客户合法权益的情况。公司依法独立经营管理公司资产，拥有业务经营所需的特许经营权、房产、经营设备以及商标。

### 4. 机构独立情况

公司建立了完善的法人治理结构，设有股东大会、董事会、监事会、经营层以及相关经营管理部门，“三会一层”运作良好，依法行使各自职权。公司拥有独立完整的证券业务经营、管理体系，独立自主地开展业务经营，组织机构的设置和运行符合中国证监会的有关要求。现有的办公机构和经营场所与股东单位完全分开，不存在机构混同的情况，也不存在股东单位直接干预公司经营活动的情形。

### 5. 财务独立情况

公司设立了专门的财务部门，建立了专门的财务核算体系和财务管理制度。公司按照决策程序进行财务决策，不存在股东单位及关联方干预公司资金使用的情况。公司由董事会任命财务总监，并配备了专职财务人员，在银行单独开立账户，不存在与股东单位及关联方共用账户的情况。公司作为独立纳税人，依法按财税制度规定缴纳各类税款。

存在同业竞争的，公司相应的解决措施、工作进度及后续工作计划

适用 不适用

## 七、报告期内对高级管理人员的考评机制，以及激励机制的建立、实施情况

适用 不适用

公司第六届董事会第十三次会议审议通过了《关于制定〈海通证券股份有限公司高级管理人员薪酬管理办法〉的议案》、《关于制定〈海通证券股份有限公司高级管理人员业绩考核管理办法〉的议案》（以下简称“两个《办法》”）。按照两个《办法》，每个会计年度结束后，公司董事会对高级管理人员进行年度绩效考核及相应的薪酬激励。报告期内，公司第六届董事会第二十三次会议审议通过了《关于 2017 年公司高级管理人员考核激励方案的议案》，以贯彻实施两个《办法》建立的“高管与股东利益的紧密联结，以及以股东长期价值创造为出发点的高管整体薪酬考核制

度”、“以绩效为导向，长、短期结合的高管薪酬考核方案”，从而保障高管薪酬激励制度市场化，以及激励机制在本行业具有市场竞争力。

同时，公司第六届董事会第二十四次会议审议通过了《关于实施海通证券股份有限公司职业经理人方案的议案》，按照“市场化选聘、契约化管理、差异化薪酬”原则，以“水平适当、结构合理、管理规范、监督有效”为目标，坚持激励与约束相结合，实施契约化管理，将职业经理人绩效年薪和中长期激励收入与公司业绩、个人业绩考核结果紧密挂钩，从而为高管薪酬激励制度市场化提供保障，切实提高公司整体竞争力。

## 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

公司内部控制自我评价报告的具体内容详见公司 2018 年 3 月 27 日于上交所网站披露的《海通证券股份有限公司 2017 年度内部控制评价报告》。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

## 九、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

公司内部控制审计机构立信会计师事务所（特殊普通合伙）为公司出具了标准无保留意见的内部控制审计报告。

公司内部控制审计报告的具体内容详见公司 2018 年 3 月 27 日于上交所网站披露的《海通证券股份有限公司 2017 年度内部控制审计报告》。

是否披露内部控制审计报告：是

## 十、风险管理与内部控制制度建立及执行情况

### （一）董事会声明

建立健全并有效实施风险管理及内部控制是公司董事会的责任；监事会对董事会建立与实施风险管理及内部控制进行监督；经理层负责组织领导公司风险管理及内部控制的日常运行。

公司风险管理及内部控制的目标是：合理保证经营合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率，促进公司实现发展战略。由于风险管理及内部控制存在固有局限性，故仅能对达到上述目标提供合理保证。

董事会已按照《企业内部控制基本规范》要求对风险管理及内部控制进行了评价，并认为其在截至 2017 年 12 月 31 日有效。

### （二）风险管理及内部控制机构设置情况

公司建立了科学、有效的风险管理及内部控制架构体系，以识别、评估及管理本集团重大风险。董事会、监事会、经理层、职能管理部门和业务经营部门在整个内部控制架构体系中，分工明确，各司其职。

公司董事会下设审计委员会、合规和风险管理委员会，负责审查公司风险管理及内部控制制度，总体监督风险管理及内部控制的有效实施和内部控制自我评价。董事会通过审计委员会至少每年检讨风险管理及内部控制系统的成效。该等委员会协助董事会履行其监察及企业管治职责，涵盖本集团的财务、营运、合规、风险管理及内部监控，以及财务资源及内部审计职能。合规总监负责执行合规管理的战略和政策，并向董事会呈报合规报告；监事会负责对董事会建立与实施风险管理及内部控制进行监督；首席风险官负责公司风险管理及内部控制体系建设和运行的总体推动和协调工作，执行公司风险管理的战略和政策；职能管理部门包括合规法务部、风险管理部、战略发展部、稽核部、计划财务部、信息技术部、运营中心和人力资源部等部门，负责内控工作的具体实施并评估各项内控制度的健全有效性；业务经营部门内部指定专人负责本单位内部控制制度的制定和落实，以及对规章制度执行情况的检查，对业务风险进行一线监控。

### （三）风险管理及内部监控体系

董事会是公司风险管理战略目标的制定者和授权人。公司董事会对风险管理和内部控制体系的有效性承担最终责任，负责推进风险文化建设，审议批准公司风险管理的总体目标及基本政策和制度、公司整体风险偏好和风险容忍度以及重大风险限额、重大风险的解决方案、公司定期风险评估报告、任免和考核首席风险官，并建立与首席风险官的直接沟通机制。公司董事会设合规与风险管理委员会，具体履行董事会风险管理职责。

公司根据法律、法规和行业规范，建立健全包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制及良好的风险管理文化在内的全面风险管理及内部控制体系。由董事会、经理层以及全体员工共同参与，对公司经营活动中面临的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、信息技术风险、声誉风险等进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。

全面风险管理体系的建设旨在提高公司管理和运营的科学性、规范性和有效性，增强对金融风险的防范能力，保障公司各项业务的持续、稳定、健康发展，只合理而非绝对保证可防范重大失实陈述或损失，因为其目的均旨在管理，而非消除未能达成业务目标的风险。

公司全面风险管理遵循以下基本原则：（一）全面性原则：公司风险管理体系由公司董事会、经理层及全体员工共同参与，包括风险识别、测量、监控、报告、管理和检查等程序。风险管理的理念、方法贯穿公司所有部门、分支机构和子公司以及业务条线；（二）独立性原则：在前台业务部门和中后台部门间建立有效的隔离制衡机制，风险管理部门独立地评估和监控风险；（三）审慎性原则：公司须对风险管理各个环节进行严谨的判断，审慎评估公司面临的风险。

公司对内幕消息的处理和发布进行规范，以确保内幕消息在获适当批准披露前一直保密，并确保有效及一致地发布有关消息。

#### （四）风险管理及内部控制制度的建立健全情况

报告期内，公司不断加强风险管理及内部控制制度建设，健全风险管理及内部控制机制，规范业务流程，完善管理制度，确保内部控制贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖公司的各个业务和管理环节。公司已采纳多项政策及程序，以评估及审慎地提高本集团风险管理及内部控制系统的成效。

##### 1. 传统业务管理

业务控制方面，公司制定或修订完善了《适当性管理试行办法（2017年第二次修订）》、《代销金融产品适当性管理指引（2017修订）》、《海通基金风险评级办法》、《主动管理类非公开募集产品风险评价办法》、《债券市场投资者适当性管理办法（2017年修订）》、《风险警示股票和退市整理股票交易投资者适当性管理办法》、《证券发行内核小组工作规则》、《首次公开发行股票网下投资者业务细则》、《投资银行业务适当性管理试行办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法（试行）》、《实物资产管理办法》、《印章管理规定（2017年修订）》、《分支机构业务印章管理办法（2017年修订）》、《分支机构分类分级管理办法（试行）》、《分支机构组织架构及岗位设置管理办法（试行）》、《证券经纪人管理办法》、《投资者教育基地管理与考核办法》等制度；

风险管理方面，公司制定或修订完善了《市场风险管理办法（试行）》、《市场风险限额管理办法（试行）》、《风险控制指标动态监控实施办法》、《压力测试管理办法（试行）》、《海通证券股份有限公司信用风险管理办法（试行）》、《海通证券股份有限公司操作风险管理办法（试行）》、《流动性风险管理办法（试行）》、《全面风险管理办法（试行）》、《流动性风险指标及限额管理办法》、《内部稽核管理办法（修订）》、《稽核整改实施细则（修订）》等制度；

合规管理方面，公司制定或修订完善了《合规管理办法》、《反洗钱工作管理办法（2017年修订）》、《大额交易和可疑交易报告管理实施细则》等制度；

资金管理、财务管理方面，公司制定了《增值税会计核算办法》、《研发费用加计扣除管理暂行办法》、《工会经费管理办法》等制度；

信息系统控制等方面，公司制定或修订完善了《信息技术类制度建设管理办法》、《信息技术类制度编写规范》、《负债及流动性风险管理系统权限管理办法》、《经纪业务信息系统权限管理办法（2017年修订）》、《信息系统变更管理办法（试行）》、《信息技术稽核实施细则》、《特别保障时期信息系统运维管理办法》、《信息系统项目管理办法》、《信息系统软件需求管理办法》、《数据中心设备托管管理办法》、《总部无线网络接入管理办法》、《信息系统生产事件管理办法》等制度。

## 2. 创新业务管理

公司建立了创新业务评估审查机制，在创新业务前期准备阶段对业务的合规性、可行性和风险进行充分的评估论证，并制定相关管理制度、操作流程、风险控制措施和保护客户合法权益的措施。公司开展的创新业务均在开展前期制定了相应的管理制度和风险控制方案。

公司已开展的创新业务制度根据监管要求和业务发展需要修订完善。针对融资融券、股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、转融通证券出借代理等业务，公司于 2017 年 6 月进一步修订完善了《融资融券业务管理办法》等 17 项制度，对各业务的管理职责、客户适当性管理、合规监控等业务规则和流程进行了修订；针对适当性管理，公司根据监管部门的最新要求制定或修订了各项创新业务的适当性管理办法，包括《贵金属代理业务客户适当性管理实施细则（修订）》、《全国中小企业股份转让系统投资者适当性管理实施方案（试行）》、《权益类场外衍生品交易业务投资者适当性管理办法（试行）（2017 年修订）》、《港股通业务投资者适当性管理实施办法》、《分级基金适当性管理指引》、《行权融资业务适当性管理实施方案》等制度。其他创新业务制度的修订及完善主要包括《贵金属代理业务权限管理办法》、《国际黄金租借业务管理办法（试行）》、《股票期权经纪业务权限管理办法》、《权益类场外衍生品交易业务标的证券管理办法（修订版）》、《利率衍生品自营业务管理办法》、《利率衍生品自营业务内控及风险管理指引》、《自营业务交易所债券质押式回购交易内控及风险管理指引》、《债券质押式回购业务管理办法（经纪）》、《投资顾问业务管理办法（2017 年修订）》、《互联网渠道业务合作管理办法》、《股权激励行权融资业务管理办法（试行）》《股权激励行权融资业务风险管理办法》等相关制度。

### （五）建立财务报告内部控制的依据

公司建立财务报告内部控制的依据为财政部、证监会、审计署、银监会、保监会联合发布的《企业内部控制基本规范》及其配套指引、中国证监会发布的《证券公司内部控制指引》和上交所发布的《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等文件。

公司严格按照《公司法》、《会计法》、《企业会计准则》、《会计工作基础规范》、《金融企业财务规则》、《企业内部控制基本规范》等相关法律法规的规定，结合行业特点及公司实际情况，报告期内制定或修订完善了《增值税会计核算办法》、《研发费用加计扣除管理暂行办法》等财务会计管理制度及其他内部控制制度。公司通过设置科学的财务会计组织架构、配备合格财务会计专业人员、使用规范严密的财务会计管理系统、选用恰当的会计政策和合理的会计估计等确保公司编制的财务报告符合会计准则的要求，并能够真实、准确、完整地反映公司财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。公司监事会以及外部审计机构等依据《公司章程》和相关规定对公司财务进行有效地检查监督，并对公司财务报告发表专业的审计意见。

报告期内，公司财务报告相关内部控制制度健全，运行情况良好，能够保障财务报告质量，确保财务信息的高度可靠性。报告期内，公司财务报告相关的内部控制不存在重大缺陷，公司年度财务报告真实、准确、完整。

#### （六）风险管理及内部控制体系的运行情况

公司风险管理及内部控制体系的运行能够针对经营活动中面临的各项风险，执行“事前、事中、事后三位一体”的风险管理及内部控制。

在事前，公司针对各项业务制定相应的管理制度和审核流程；在事中，公司已建立实时监控系统，实现了风险控制指标的动态监控和自动预警，已建立净资本补足机制，保证净资本等风险控制指标持续符合监管部门的要求；事后控制方面，针对监控中发现的问题及时进行督促整改，稽核部门每年制定稽核计划对公司相关部门、分支机构以及子公司进行现场稽核，并对发现的问题进行督导整改。

报告期内，根据《企业内部控制基本规范》和监管要求，公司对照梳理各项业务流程，查找经营管理主要风险点，持续完善覆盖公司主要业务、重点领域和关键环节的风险管控清单；构建风险管控清单的动态调整机制，定期评估制度执行情况，针对存在问题及时调整风险管控清单内容及对应的相关制度，确保内控制度的合理性和适应性；推进信息系统建设，加大信息化管控的程度和范围；围绕风险管控清单，组织内部审计和内控自评工作，并对内、外部检查中发现的问题和缺陷实行清单式管理和销号管理，形成检查整改持续完善的闭环管理。

报告期内，公司继续推进全面风险管理及流动性风险管理体系建设及运行，并不断完善。系统建设方面，公司推进并表系统二期和信用风险管理系统的开发建设工作，计划实现子公司财务、金融资产等基础数据的标准化采集汇总，和客户管理与内部评级管理功能；风险监控方面，公司全面实施风控指标的监控，包括每日监控公司净资本及各项风控指标并向监管部门报送，每日对权益投资、固定收益、新三板做市等业务进行日常盯市执行市场风险限额管理，每日监控融资融券、股票质押、约定购回等业务的风控指标并编制日报，确保重大信用风险事件汇报的及时性；子公司管理方面，完善子公司风险报告汇报机制，持续推进子公司内部评级系统建设，目前已完成对各子公司信用风险管理的访谈和调研。

报告期内，公司根据行业合规管理新规及公司发展实际情况，不断完善合规管理制度与机制，分拆“合规与风险管理总部”，设“合规法务部”为独立的一级合规管理部门，推进集团化合规人员队伍的建设，增强合规管理独立性、权威性。配合公司发展战略，公司积极探索集团化合规管理模式，增强对下属单位的合规管控，特别是增强合规检查力度以及合规监测的自动化、系统化，有效提升对总部部门、分支机构及子公司的合规管理能力。

#### （七）风险管理及内部控制建立、执行的内部监督情况

公司制定了《海通证券内部控制自我评价手册》用于规范内部控制自我评价活动。公司设立内部控制规范落实工作领导小组、工作小组以及内部控制评价小组。总经理办公会议指定风险管理部为风险管理及内部控制规范落实工作小组的牵头部门，负责指导风险管理及内部控制建设与实施工作；指定稽核部为内部控制评价小组的牵头部门，负责内部控制自我评价工作并出具内部控制评价报告。风险管理部、稽核部分别独立履行内部控制建设实施和有效性评估的职能。风险管理部发起部门协作督促公司部门对内部控制矩阵进行梳理，重点关注新业务新流程的内部控制设计；稽核部组织各部门和子公司开展内部控制运行有效性自我评价工作，复核评价底稿，汇总内部控制缺陷并对缺陷进行跟踪整改。

风险管理及内部监控方面，公司合规和风险管理委员会与审计委员会履行其监督职责，检验公司风险管理及内部监控系统的成效；公司每年的内部控制自我评价范围涵盖所有公司部门及子公司，内容涵盖财务、营运和合规等方面的风险管理和内部监控；此外，稽核部不定期对风险管理及内部监控情况进行稽核，对其有效性进行评估。除公司内部的检查评价外，外部审计师的工作也包括对重要风险及内部监控是否足够和有效进行评估。

#### （八）风险管理及内部控制缺陷及其认定

公司董事会根据《企业内部控制基本规范》、《企业内部控制评价指引》、《证券公司内部控制指引》以及《上海证券交易所上市公司内部控制指引》对重大缺陷、重要缺陷和一般缺陷的认定要求，结合公司规模、行业特征、风险水平等因素，研究确定了适用本公司的内部控制缺陷及具体认定标准，即：按缺陷影响程度分类，分为重大缺陷、重要缺陷和一般缺陷。

重大缺陷指一个或多个控制缺陷的组合，可能导致企业严重偏离控制目标；重要缺陷指一个或多个控制缺陷的组合，其严重程度和经济后果低于重大缺陷，但仍有可能导致企业偏离控制目标；一般缺陷指除重大缺陷、重要缺陷之外的其他缺陷。

#### （九）公司风险管理及内部控制有效性评价

公司已根据《香港上市规则》、《企业内部控制基本规范》、《企业内部控制评价指引》、《证券公司内部控制指引》以及《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等相关法律法规的要求，对公司截至 2017 年 12 月 31 日的内部控制设计与运行的有效性进行了自我评价，并出具 2017 年度《内部控制评价报告》。董事会合规与风险管理委员会对本集团的风险管理及内部监控系统足够和有效地作出分析及独立评估。报告期内，公司对纳入评价范围的业务与事项均已建立了风险管理及内部控制并有效执行，达到了公司风险管理及内部控制的目标，在风险管理及内部控制设计或执行方面不存在重大缺陷。自内部控制评价报告报告基准日至内部控制评价报告发出日之间未发生对评价结论产生实质性影响的内部控制的重大变化。报告期内，外部注册会计师对公司内部控制设计及执行情况进行了独立审计，认为公司按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制，也未发现非财务报告内部控制的重大缺陷。

#### （十）2018 年度风险管理及内部控制的工作计划

风险管理及内部控制应当与公司经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，并随着情况的变化及时加以调整。2018 年度风险管理及内部控制工作计划主要包括：持续推进内部控制体系建设，关注重点领域和关键环节，不断完善各项制度、政策与流程，确保不存在制度设计缺陷和执行中的管控盲点；按照有关法律法规和监管部门的要求，持续完善全面风险管理体系，推进风险管理系统建设，加大信息化管控的程度和范围；按照监管及公司内部制度要求执行日常监控及信息报告；继续评估制度执行情况，针对存在问题及时完善和改进风险控制和策略；继续对内部控制评价实施过程中发现的问题和缺陷实行清单式销号管理，严格落实整改；吸收内控管理理论的新知识和新理念，修订内控评价手册，提高内部控制的效率与效果；继续加强内部控制规范的宣传与培训，继续提升公司内部控制及风险管理水平。

#### 十一、 其他

√适用 □不适用

##### （一）公司秘书

姜诚君先生与黄慧玲女士为本公司联席公司秘书，黄慧玲女士为信永方圆企业服务集团有限公司的副总监，本公司内部之主要联络人为董事会秘书兼联席公司秘书姜诚君先生。根据《香港上市规则》第 3.29 条的要求，截至 2017 年 12 月 31 日，姜诚君先生及黄慧玲女士均接受了超过 15 个小时之相关专业培训。

##### （二）遵守证券交易守则

本公司已采纳《标准守则》作为所有董事及监事进行本公司证券交易的行为守则。根据对本公司董事及监事的专门查询后，所有董事及监事均确认：于本报告期内，各董事及监事均已严格遵守《标准守则》所订之标准。本公司亦就有关雇员（定义见《香港上市规则》）买卖公司证券交易事宜设定指引，指引内容不比《标准守则》宽松。本公司并没有发现有关雇员违反指引。

董事会将不时检查本公司的公司治理及运作，以符合《香港上市规则》有关规定并保障股东的利益。

##### （三）内部监控

公司内部控制审计报告的具体内容详见公司 2018 年 3 月 27 日于上交所网站披露的《海通证券股份有限公司 2017 年度内部控制审计报告》。

##### （四）董事及核数师就账目之责任

董事会已确认其承担编制本集团截至 2017 年 12 月 31 日止年度报告的责任。

董事会负责就年度及中期报告、股价敏感资料及其它根据《香港上市规则》及其它监管规定所需披露事项，呈报清晰及明确的评估。管理层已向董事会提供有关必要的解释及资料，以便董事会就本集团的财务数据及状况作出知情评估，以供董事会审批。

本公司并无面临可能对本公司持续经营业务之能力产生重大疑虑的重大不确定事件或情况。

另外，本公司已就董事、监事和高级管理人员可能的法律行动及责任作出适当的投保安排。

### （五）与股东的沟通

股东大会是公司的最高权力机构，股东通过股东大会行使权力。公司严格按照相关规定召集、召开股东大会，确保所有股东，特别是中小股东享有平等的地位，能够充分行使自己的权利。在《公司章程》的制度约束下，公司有序运行并保持健康稳定的发展，切实保护了公司及股东的利益。

本公司高度重视股东的意见和建议，积极、主动、规范地开展各类投资者关系活动，与股东保持沟通，及时满足股东的合理需求。同时，本公司通过网站 [www.htsec.com](http://www.htsec.com) 发布本公司的公告、财务数据及其它有关数据，作为促进与股东有效沟通的渠道，股东如有任何查询，可通过邮件、热线电话以及直接致函至本公司办公地址，公司会及时以适当方式处理相关查询。

董事会欢迎股东提出意见，并鼓励股东出席股东大会以直接向董事会或管理层提出其可能持有的任何疑虑。董事长及各委员会主任和管理层通常会出席年度股东大会及其它股东大会，以回答股东所提出的问题。

股东可以根据公司章程第 71 条和第 76 条列明的程序召开股东特别大会并在股东大会上提出提案，公司章程已公布在上交所网站、香港联交所网站和公司网站。

本公司 2017 年年度股东大会将安排董事会回答股东提问。

有关投票表决的详细程序及以投票方式、表决的决议议案将刊登于上交所网站（A 股），或载于股东通函内（H 股）。

### （六）投资者关系活动

2017 年，证券行业估值承压，投资者关系的维护压力不断加大。公司管理层根据董事会要求，积极采取措施维护投资者关系，通过业绩推介会、全球路演、接待投资者来访、参加投资者会议、投资者热线、上证 E 互动等多种方式积极向投资者介绍公司的经营战略、策略和经营成效，引导资本市场对公司的合理预期。2017 年公司组织了两次业绩发布会，董事长、总经理带队进行全球路演，公司共接待境内外分析师及投资者现场调研 47 次，接待投资者约 116 名，参加券商交流会 7 次，有效提升了公司的透明度。

### （七）其他报告事项

报告期内，本公司对《公司章程》修订了两次。第一次修订已于 2017 年 3 月 29 日召开的第六届董事会第二十三次会议审议通过，并经过 2017 年 6 月 6 日举行的 2016 年度股东大会审议通过，于 2017 年 7 月收到了中国证监会上海监管局《关于核准海通证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复》（沪证监许可【2017】66 号）。有关修订内容请详见本公司日期为 2017 年 3 月 29 日的公告及日期为 2017 年 6 月 6 日的公告。第二次修订已于 2017 年 8 月 29 日召开的第六届董事会第二十五次会议审议通过，并经过 2018 年 3 月 1 日召开的 2018 年第一次临时股东大会审议通过，该次修订仍需经监管机构批准后生效。

## 第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、公司债券基本情况

2013年3月26日，公司第五届董事会第十六次会议审议通过了《关于公司发行公司债券的议案》、《关于公司发行公司债券一般性授权的议案》，经2013年5月27日召开的公司2012年度股东大会审议通过，并授权董事长、总经理共同或分别全权办理本次发行公司债券相关事宜。相关决议公告分别于2013年3月27日、2013年5月28日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）。经中国证监会于2013年9月25日签发的“证监许可[2013]1220号”文核准，公司获准向社会公开发行面值总额不超过230亿元的公司债券，依据上述议案与监管核准，公司公开发行了两期公司债券。

根据2016年3月30日公司第六届董事会第十五次会议和2016年5月26日公司2015年度股东大会审议通过的《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》，公司向上交所和中国证监会申请并取得了《关于核准海通证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2017]408号）。相关决议公告分别于2016年3月31日、2016年5月27日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）。该批复核准我公司向合格投资者公开发行面值总额不超过120亿元的公司债券。依据上述议案与监管标准，报告期内，公司公开发行了三期公司债券。

报告期内，公开发行公司债券新增120亿，到期兑付56.5亿，余额220.9亿元。

单位:亿元 币种:人民币

| 债券名称           | 简称     | 代码     | 发行日        | 到期日        | 债券余额 | 利率    | 还本付息方式 | 交易场所 |
|----------------|--------|--------|------------|------------|------|-------|--------|------|
| 2013年公司债券（第一期） | 13海通02 | 122281 | 2013/11/25 | 2018/11/25 | 23.5 | 6.15% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2013年公司债券（第一期） | 13海通03 | 122282 | 2013/11/25 | 2023/11/25 | 23.9 | 6.18% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2013年公司债券（第二期） | 13海通04 | 122311 | 2014/07/14 | 2017/07/14 | -    | -     | 兑付     | -    |
| 2013年公司债券（第二期） | 13海通05 | 122312 | 2014/07/14 | 2019/07/14 | 45.5 | 5.45% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2013年公司债券（第二期） | 13海通06 | 122313 | 2014/07/14 | 2024/07/14 | 8    | 5.85% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2017年公司债券（第一期） | 17海通01 | 143231 | 2017/08/11 | 2020/08/11 | 50   | 4.63% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2017年公司债券（第一期） | 17海通02 | 143232 | 2017/08/11 | 2022/08/11 | 10   | 4.80% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2017年公司债券（第二期） | 17海通03 | 143301 | 2017/09/22 | 2027/09/22 | 55   | 4.99% | 单利按年计息 | 上交所  |
| 2017年公司债券（第三期） | 17海通04 | 143336 | 2017/10/25 | 2020/10/25 | 5    | 4.77% | 单利按年计息 | 上交所  |

公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

1. 2013 年公司债券（第一期），13 海通 02 和 13 海通 03 的 2017 年度利息于 2017 年 11 月 27 日支付（2017 年 11 月 25 日为休息日，顺延一个交易日至 27 日付息，公告编号：临 2017-052）。

2. 2013 年公司债券（第二期），13 海通 04 于 2017 年 7 月 14 日到期摘牌并兑付本息（公告编号：临 2017-033），13 海通 05 和 13 海通 06 的 2017 年度利息也于同日支付（公告编号：临 2017-034）。

公司债券其他情况的说明

√适用 □不适用

以下为报告期内公司存续的非公开发行公司债券、次级债的情况，报告期内，次级债新增 45 亿，赎回 150 亿，两类债券合计余额 505 亿元。

单位:亿元 币种:人民币

| 债券名称                 | 简称       | 代码     | 期限        | 发行日        | 到期日        | 债券余额 | 利率    | 还本付息方式 | 交易所 |
|----------------------|----------|--------|-----------|------------|------------|------|-------|--------|-----|
| 2015 年次级债券（第一期）      | 15 海通 C1 | 123212 | 5 年 (3+2) | 2015/04/08 | 附赎回选择权     | 150  | 5.50% | 单利按年计息 | 上交所 |
| 2015 年次级债券（第二期）      | 15 海通 C2 | 125994 | 3 年 (2+1) | 2015/06/12 | 2017/06/12 | -    | -     | 赎回     | -   |
| 2015 年次级债券（第二期）      | 15 海通 C3 | 125993 | 5 年 (3+2) | 2015/06/12 | 附赎回选择权     | 50   | 5.38% | 单利按年计息 | 上交所 |
| 2016 年次级债券（第一期）      | 16 海通 C1 | 145179 | 3 年       | 2016/11/17 | 2019/11/17 | 40   | 3.30% | 单利按年计息 | 上交所 |
| 2016 年次级债券（第一期）      | 16 海通 C2 | 145180 | 5 年       | 2016/11/17 | 2021/11/17 | 20   | 3.40% | 单利按年计息 | 上交所 |
| 2017 年次级债券（第一期）      | 17 海通 C1 | 145411 | 3 年       | 2017/03/16 | 2020/03/16 | 45   | 4.80% | 单利按年计息 | 上交所 |
| 2016 年非公开发行公司债券（第一期） | 16 海通 01 | 135484 | 4 年 (3+1) | 2016/05/18 | 附赎回选择权     | 150  | 3.60% | 单利按年计息 | 上交所 |
| 2016 年非公开发行公司债券（第一期） | 16 海通 02 | 135485 | 5 年       | 2016/05/18 | 2021/05/18 | 50   | 3.80% | 单利按年计息 | 上交所 |

1. 发行。

依据上交所《关于对海通证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》（上证函 [2016]2080 号）（参见公司公告，编号：临 2016-048），2017 年 3 月 16 日公司发行 2017 年次级债（第一期），发行结果详见上交所公告（公告编号：临 2017-005）。

2. 赎回。

2015 年次级债（第二期）中的 15 海通 C2 于 2015 年 6 月 12 日发行，额度 150 亿元，利率 5.3%，发行第二年末附赎回选择权。发行人选择行使“赎回选择权”，已于 2017 年 6 月 12 日全额赎回，行权提示和兑付结果见上交所公告（公告编号：临 2017-015、临 2017-025、临 2017-026、临 2017-030）。

二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

|          |         |    |            |
|----------|---------|----|------------|
| 13 海通 02 | 债券受托管理人 | 名称 | 中信证券股份有限公司 |
|----------|---------|----|------------|

|          |         |      |                              |
|----------|---------|------|------------------------------|
| 13 海通 03 |         | 办公地址 | 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 22 层   |
| 13 海通 05 |         | 联系人  | 宋颐岚、常唯                       |
| 13 海通 06 |         | 联系电话 | 010-60836030                 |
| 15 海通 C3 | 资信评级机构  | 名称   | 中诚信证券评估有限公司                  |
| 17 海通 01 |         | 办公地址 | 上海市西藏南路 760 号 8 楼            |
| 17 海通 02 |         | 联系电话 | 021-51019090                 |
| 17 海通 03 |         |      |                              |
| 17 海通 04 |         |      |                              |
| 16 海通 01 | 债券受托管理人 | 名称   | 锦天城律师事务所                     |
| 16 海通 02 |         | 办公地址 | 上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 12 层 |
| 16 海通 C1 |         | 联系人  | 裴振宇、吕希菁、肖文艳                  |
| 16 海通 C2 |         | 联系电话 | 021-20511217                 |
| 17 海通 C1 | 资信评级机构  | 名称   | 中诚信证券评估有限公司                  |

其他说明：

适用 不适用

### 三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

截至 2017 年 12 月 31 日，公司上述债券募集资金全部用于偿还到期债务或补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。其中：2017 年第一期次级债募集资金 45 亿，用于偿还到期的收益权转让及补充流动资金；2017 年第一期公司债券募集资金 60 亿，59 亿用于偿还发行人用短期借款兑付的 13 海通 04 本金和利息，剩余部分补充营运资金；2017 年第二期公司债券募集资金 55 亿，用于偿还发行人用短期借款兑付 2017 年 8 月 15 日到 2017 年 9 月 20 日到期的海通证券“一海通财·理财宝”系列收益凭证及融资业务债券收益权转让的本金及利息；2017 年第三期公司债券募集资金 5 亿，用于补充公司流动资金。

同一个债项批文有效期内分期发行的债券共用同一个募集资金专户，上述募集资金专户内的资金均已使用完毕，余额为零。

### 四、公司债券评级情况

适用 不适用

公司债券资信评级机构为中诚信证券评估有限公司（以下简称“中诚信评估”），中诚信评估是中国诚信信用管理有限公司旗下的全资子公司，成立于 1997 年 8 月，公司注册地址为上海。中诚信评估获得中国证券监督管理委员会和中国人民银行的业务许可，主要从事证券市场资信评级业务和信贷市场资信评级业务。

中诚信评估的业务资质：2007 年 9 月，中国证券监督管理委员会核准从事证券市场资信评级业务批复（证监机构字[2007]223 号）。2012 年 1 月，中国证券监督管理委员会颁发的《证券市场资信评级业务许可证》（ZPJ001）。2013 年 10 月，中国保险监督管理委员会《关于认可 7 家

信用评级机构能力备案的公告》(保监公告[2013]9号)。中诚信评估是中国证券业协会首批资信评级机构会员、中国证券业协会理事单位,在国内公司债券评级业务市场占有率第一。

2017年9月,中诚信评估评级委员会审定公司主体信用等级AAA,评级展望稳定(信评委函字[2017]Z049号)。

2017年3月16日,中诚信评估评定公司非公开发行2017(第一期)次级债的信用等级为AA+(信评委函字[2017]G105-F1号)。

2017年8月到10月,中诚信评估评定公司面向合格投资者公开发行的三期公司债券的信用等级均为AAA(信评委函字[2017]G047-F1号、G047-F2号、G047-F3号)。

2017年,中诚信评估对于公司发行的各项债券出具了跟踪评级报告。2013年公开发行公司债券第一期、第二期的信用等级维持AAA(信评委函字[2017]跟踪059号、060号);2015年次级债券(第二期)的信用等级维持AA+(信评委函字[2017]跟踪061号);2016年次级债券(第一期)的信用等级维持AA+(信评委函字[2017]跟踪062号);2016年非公开发行公司债券(第一期)的信用等级维持AAA(信评委函字[2017]跟踪063号)。

## 五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

适用 不适用

增信机制无,偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。

### 1. 偿债计划

公司将按时履行各期公司债券年度付息及到期还本付息义务。公司偿债能力良好,偿债资金将主要来源于公司日常盈利积累、经营活动所产生的现金流、继续负债以及股本融资活动。公司的收入规模和盈利积累在很大程度上保证了公司按期兑付兑息的能力。

### 2. 其他相关情况

公司2016年5月26日的股东大会审议通过《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》,其中约定偿债保障措施。即“公司发行境内债务融资工具授权董事会并同意董事会授权其获授权人士共同或分别在出现预计不能按期偿付境内债务融资工具本息或者到期未能按期偿付境内债务融资工具本息时,至少采取如下措施:①不向股东分配利润;②暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施;③调减或停发公司董事和高级管理人员的工资和奖金;④主要责任人员不得调离。”

至于其他偿债保障措施的执行情况,公司严格按照债券持有人会议规则组织债券持有人通过债券持有人会议行使其权力、聘请中信证券、锦天城律师事务所分别作为相应债券的受托管理人并按照所签订之《债券受托管理协议》维护债券持有人的利益、严格执行资金的管理计划与信息披露要求,以上措施与募集说明书保持一致。

## 六、公司债券持有人会议召开情况

适用 不适用

### 七、公司债券受托管理人履职情况

√适用 □不适用

作为公司债券及部分次级债的受托管理人，中信证券股份有限公司在履行职责时并未存在利益冲突情形，并对公司履行募集说明书及协议约定义务的情况进行持续跟踪和监督，持续关注公司的资信状况及偿债保障措施的落实情况。2017年4月27日，发布对于公司2013年两期公司债券的2016年度受托管理事务报告；2017年6月30日，发布对公司2015年次级债（第二期）的2016年度受托管理事务报告；2017年6月14日，针对公司收到证监会行政处罚告知书一事，出具了相关受托债券的受托管理事务临时报告。以上报告公司均已在上交所网站公告。

作为非公开发行公司债及部分次级债的受托管理人，锦天城律师事务所在履行职责时并未存在利益冲突情形，并对公司履行募集说明书及协议约定义务的情况进行持续跟踪和监督，持续关注公司的资信状况及偿债保障措施的落实情况。2017年6月29日，锦天城律师事务所出具了对公司2016年非公开发行公司债（第一期）和2016年次级债（第一期）的2016年度受托管理事务报告；2017年6月14日，针对公司收到证监会行政处罚告知书一事出具了相关受托债券的受托管理事务临时报告。以上报告公司均已在上交所网站公告。

### 八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

| 主要指标          | 2017 年            | 2016 年            | 本期比上年同期增减 (%) | 变动原因         |
|---------------|-------------------|-------------------|---------------|--------------|
| 息税折旧摊销前利润     | 24,550,691,809.25 | 23,536,376,402.89 | 4.31          | -            |
| 流动比率          | 2.05              | 1.67              | 22.75         | -            |
| 速动比率          | 2.05              | 1.67              | 22.75         | -            |
| 资产负债率 (%)     | 71.24%            | 73.30%            | -2.81         | -            |
| EBITDA 全部债务比  | 0.08              | 0.07              | 14.29         | -            |
| 利息保障倍数        | 2.15              | 1.93              | 11.40         | -            |
| 现金利息保障倍数      | -3.95             | -2.83             | 39.58         | 经营活动现金流出增加所致 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.20              | 1.96              | 12.24         | -            |
| 贷款偿还率 (%)     | 100%              | 100%              | -             | -            |
| 利息偿付率 (%)     | 100%              | 100%              | -             | -            |

流动比率= (货币资金+结算备付金+拆出资金+融出资金+以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产+衍生金融资产+买入返售金融资产+应收款项+应收利息-代理买卖证券款-代理承销证券款+其他应收款+应收股利+待转承销费用) / (短期借款+拆入资金+以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债+衍生金融负债+卖出回购金融资产款+应付职工薪酬+应交税金+应付利息+应付短期融资款+应付款项)

速动比率= (货币资金+结算备付金+拆出资金+融出资金+以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产+衍生金融资产+买入返售金融资产+应收款项+应收利息-代理买卖证券款-代理承销证券款+其他应收款+应收股利+待转承销费用) / (短期借款+拆入资金+以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债+衍生金融负债+卖出回购金融资产款+应付职工薪酬+应交税金+应付利息+应付短期融资款+应付款项)

### 九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用 □不适用

| 债券名称                 | 简称       | 代码     | 发行日        | 兑付兑息日      | 兑付兑息情况  |
|----------------------|----------|--------|------------|------------|---------|
| 2015 年次级债券（第一期）      | 15 海通 C1 | 123212 | 2015/04/08 | 2017/04/08 | 已足额按时付息 |
| 2015 年次级债券（第二期）      | 15 海通 C2 | 125994 | 2015/06/12 | 2017/06/12 | 已赎回     |
| 2015 年次级债券（第二期）      | 15 海通 C3 | 125993 | 2015/06/12 | 2017/06/12 | 已足额按时付息 |
| 2016 年次级债券（第一期）      | 16 海通 C1 | 145179 | 2016/11/17 | 2017/11/17 | 已足额按时付息 |
| 2016 年次级债券（第一期）      | 16 海通 C2 | 145180 | 2016/11/17 | 2017/11/17 | 已足额按时付息 |
| 2016 年非公开发行公司债券（第一期） | 16 海通 01 | 135484 | 2016/05/18 | 2017/05/18 | 已足额按时付息 |
| 2016 年非公开发行公司债券（第一期） | 16 海通 02 | 135485 | 2016/05/18 | 2017/05/18 | 已足额按时付息 |

#### 1. 2015 年次级债（第一期）、（第二期）

报告期内，公司 2015 年次级债（第一期）、（第二期）均按时兑息，详见上交所公告（公告编号：临 2017-010、临 2017-027）。2015 年次级债（第二期）中的 15 海通 C2 行使赎回权，赎回并摘牌（公告编号：临 2017-026、临 2017-030）。

#### 2. 2016 年次级债（第一期）

报告期内，公司 2016 年次级债（第一期）按时兑息，详见上交所公告（公告编号：临 2017-052）。

#### 3. 2016 年非公开发行公司债券（第一期）

报告期内，非公开发行公司债券 2016 年（第一期）按时兑息，详见上交所公告（公告编号：临 2017-018、临 2017-019）。

### 十、公司报告期内的银行授信情况

√适用 □不适用

报告期内，公司共获得上百家银行的授信，外部授信规模合计近 5,000 亿元。报告期末，公司尚未使用授信规模超过 3,000 亿元。

### 十一、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

□适用 √不适用

### 十二、公司发生的重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

√适用 □不适用

2017 年 5 月 23 日公司收到中国证监会行政处罚事先告知书（处罚字【2017】059 号），2017 年 5 月 25 日公司在上交所将告知书全文公告（公告编号：临 2017-024）。针对该事项，公司各债

券受托管理人均出具了临时受托事务管理报告，后续如有新的进展，公司会给予及时公告。本事件对公司 2017 年及未来财务无重大影响，公司经营情况和偿债能力正常。

## 第十一节 财务报告

### 一、审计报告

适用 不适用

### 审计报告

信会师报字[2018]第 ZA10893 号

海通证券股份有限公司全体股东：

#### 一、审计意见

我们审计了海通证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的合并及公司资产负债表、2017 年度的合并及公司利润表、合并及公司现金流量表、合并及公司股东权益变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了贵公司 2017 年 12 月 31 日的合并及公司财务状况以及 2017 年度的合并及公司经营成果和现金流量。

#### 二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于贵公司，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

#### 三、关键审计事项

关键审计事项是我们根据职业判断，认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景，我们不对这些事项单独发表意见。我们确定下列事项是需要在审计报告中沟通的关键审计事项。

| 关键审计事项  | 审计应对   |
|---|--|
| <p><b>(一) 融出资金的减值</b></p> <p>如合并财务报表附注五、(四) 所列示, 截至 2017 年 12 月 31 日, 贵公司融出资金合计 619 亿元, 计提减值准备 3 亿元。</p> <p>贵公司对融资类业务计提专项坏账准备和一般坏账准备。</p> <p>对于有充分客观证据、可识别具体损失的融资类项目, 贵公司根据客户状况和可能损失的金额, 分析交易对手的资产运作、抵押证券、担保比例以及偿债能力等, 采用专门的方法对相关资产单独进行减值测试, 计提专项坏账准备。</p> <p>对未计提专项坏账准备的融资类业务按组合计提, 即根据风险分类、按业务规模的一定比例计提一般坏账准备, 用于弥补可能的损失。</p> <p>由于相关资产金额重大, 其减值评估需要贵公司管理层 (以下简称“管理层”) 作出重大判断, 我们将该类资产的减值评估确认为重要审计领域。</p>     | <p>我们对贵公司融出资金的减值准备估值执行的审计程序包括:</p> <p>检查管理层识别减值迹象, 评估和计量融出资金减值的控制制度和执行情况;</p> <p>关注涉及风险敞口的事项及其计量;</p> <p>关注对抵押物的估值并与相关市场参数相互印证;</p> <p>评价管理层减值计量判断的合理性。</p>  |
| <p><b>(二) 权益性可供出售金融资产的减值准备</b></p> <p>如合并财务报表附注五、(十一) 1 所列示, 截至 2017 年 12 月 31 日, 权益性可供出售金融资产的计提的减值准备为 5 亿元。</p> <p>管理层在资产负债表日对可供出售金融资产进行判断。</p> <p>对于上市的可供出售金融资产的公允价值若发生较大幅度下降, 或在综合考虑各种相关因素后、或这种下降趋势属于非暂时性的, 或被投资单位经营所处的技术、市场、经济或法律环境等综合因素发生重大不利变化等, 则认定该类资产存在客观的减值证据, 确认减值损失。</p> <p>贵公司对存在减值迹象的非上市股权投资, 根据其账面价值与预计未来现金流量折现确定的现值之间的差额确认减值损失。</p> <p>由于相关资产金额重大, 其减值评估需要管理层作出重大判断, 我们将该类资产的减值评估确认为重要审计领域。</p> | <p>我们对权益性可供出售金融资产的估值及减值准备计提执行的审计程序包括:</p> <p>检查相关资产公允价值的获取方式, 并与可观察市场核对;</p> <p>了解当公允价值低于成本时, 管理层认定公允价值并评估减值准备的程序与方法;</p> <p>关注管理层认定减值迹象的情形及复核管理层如何判断未来现金流的现值低于账面价值;</p> <p>如果预计现金流涉及同行业比较等, 关注与估计未来现金流相关的市场信息;</p> <p>评价预计未来现金流的重要假设。</p> |

| 关键审计事项  | 审计应对   |
|---|--|
| <p><b>(三) 商誉的减值测试</b></p> <p>如合并财务报表附注五、(十九) 所列示, 截至 2017 年 12 月 31 日, 贵公司商誉的账面价值合计 39 亿元, 相应的减值准备余额为零亿元。</p> <p>在对包含商誉的相关资产组或者资产组组合进行减值测试时, 要求贵公司估计相关资产组或者资产组组合未来的现金流入以及确定合适的折现率去计算现值。若相关资产组的现金流量现值低于其账面价值的, 确认商誉的减值损失。</p> <p>由于相关减值评估与测试需要管理层作出重大判断, 因此我们将该类资产的减值评估确认为重要审计领域。</p>  | <p>我们对商誉的减值测试与计量执行的审计程序包括:</p> <p>了解贵公司商誉减值测试的控制程序, 包括了解贵公司划分的资产组及贵公司对资产组价值的判定;</p> <p>了解相关资产组的财务状况, 检查这些资产组的预期未来可收回金额;</p> <p>评估商誉减值测试的估值方法;</p> <p>评价商誉减值测试关键假设的适当性;</p> <p>评价测试所引用参数的合理性。</p>       |
| <p><b>(四) 纳入合并范围的结构化主体的确定</b></p> <p>如合并财务报表附注七、(四) 所列示, 截至 2017 年 12 月 31 日, 贵公司认定 22 个结构化主体纳入合并财务报表范围, 这些产品的资产总额为 136 亿元。</p> <p>贵公司以控制为基础确定合并财务报表的合并范围。判断控制包括贵公司作为投资方:(1) 拥有对被投资方的权力;(2) 通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报;(3) 有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。</p> <p>公司如果作为结构化主体的管理人, 则判断公司拥有对结构化主体的权力。如果贵公司不是结构化主体的管理人, 但是以投资者身份参与、且其投资行为或在结构化主体中担任的角色, 将明显影响可变回报, 则判断贵公司为结构化主体的主要负责人, 也是判断公司拥有对结构化主体权力的条件。</p> <p>由于确认是否控制涉及贵公司重大判断, 其结果直接影响合并财务报表的合并范围, 我们将纳入合并范围的结构化主体的确定作为重要审计领域。</p> | <p>我们对纳入合并范围的结构化主体的确定执行的审计程序包括:</p> <p>检查贵公司确定相关合并范围的程序与方法;</p> <p>获取结构化主体的相关合同, 了解合同规定的管理人和持有人在结构化主体中权力;</p> <p>复核贵公司在结构化主体中享有的收益情况, 包括持有基金份额应当享有的收益和作为管理人应当收取的管理费等;</p> <p>评估结构化主体是否符合纳入合并范围的条件。</p> |

#### 四、其他信息

管理层对其他信息负责。其他信息包括贵公司 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

#### 五、管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估贵公司的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督贵公司的财务报告过程。

#### 六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对贵公司持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致贵公司不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

(6) 就贵公司中实体或业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据，以对财务报表发表审计意见。我们负责指导、监督和执行集团审计，并对审计意见承担全部责任。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施。

在与治理层沟通过的事项中，我们确定哪些事项对本期财务报表审计最为重要，因而构成关键审计事项。我们在审计报告中描述这些事项，除非法律法规禁止公开披露这些事项，或在极少数情形下，如果合理预期在审计报告中沟通某事项造成的负面后果超过在公众利益方面产生的益处，我们确定不应在审计报告中沟通该事项。

立信会计师事务所  
(特殊普通合伙)

中国注册会计师：黄晔  
(项目合伙人)

中国注册会计师：迟媛

中国·上海

二〇一八年三月二十七日

**海通证券股份有限公司**  
**合并资产负债表**  
**2017年12月31日**  
(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

| 资产                     | 附注五   | 期末余额                      | 年初余额                      |
|------------------------|-------|---------------------------|---------------------------|
| <b>资产:</b>             |       |                           |                           |
| 货币资金                   | (一)   | 103,795,726,857.30        | 121,024,751,374.94        |
| 其中: 客户存款               |       | 70,213,568,864.14         | 87,496,620,324.19         |
| 结算备付金                  | (二)   | 7,982,728,644.47          | 12,191,899,273.79         |
| 其中: 客户备付金              |       | 7,607,858,552.05          | 9,325,892,434.58          |
| 拆出资金                   | (三)   | 679,091,978.14            | 705,848,143.60            |
| 融出资金                   | (四)   | 61,560,952,642.71         | 63,212,919,802.15         |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | (五)   | 99,856,694,835.91         | 92,347,493,554.98         |
| 衍生金融资产                 | (六)   | 2,610,612,302.28          | 3,935,071,348.81          |
| 买入返售金融资产               | (七)   | 96,549,868,542.17         | 84,523,225,559.75         |
| 应收款项                   | (八)   | 7,441,999,625.34          | 6,929,537,183.19          |
| 应收利息                   | (九)   | 3,703,898,935.74          | 7,422,060,199.20          |
| 存出保证金                  | (十)   | 8,528,675,180.93          | 8,952,031,305.02          |
| 持有待售资产                 |       | 19,761,633.24             | 26,304,465.56             |
| 可供出售金融资产               | (十一)  | 41,228,756,005.51         | 58,028,837,828.19         |
| 持有至到期投资                | (十三)  | 78,718,210.79             | 83,508,859.69             |
| 长期股权投资                 | (十四)  | 10,062,370,298.56         | 8,749,591,871.35          |
| 投资性房地产                 | (十五)  | 16,864,072.33             | 18,059,212.45             |
| 固定资产                   | (十六)  | 2,657,276,109.00          | 1,420,756,931.36          |
| 在建工程                   | (十七)  | 48,574,453.80             | 47,561,274.04             |
| 无形资产                   | (十八)  | 1,316,011,591.12          | 468,009,610.75            |
| 商誉                     | (十九)  | 3,863,520,199.48          | 4,118,734,158.06          |
| 递延所得税资产                | (二十一) | 2,851,450,468.05          | 2,773,812,116.72          |
| 其他资产                   | (二十)  | 79,852,780,202.94         | 83,885,832,076.72         |
| <b>资产总计</b>            |       | <b>534,706,332,789.81</b> | <b>560,865,846,150.32</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

海通证券股份有限公司  
合并资产负债表（续）

2017年12月31日  
（除特别注明外，金额单位均为人民币元）

| 负债和股东权益                | 附注五   | 期末余额               | 年初余额               |
|------------------------|-------|--------------------|--------------------|
| <b>负债：</b>             |       |                    |                    |
| 短期借款                   | (二十三) | 30,712,830,026.17  | 38,564,767,181.01  |
| 应付短期融资款                | (二十四) | 29,426,762,416.95  | 19,864,117,000.00  |
| 拆入资金                   | (二十五) | 11,811,638,917.40  | 8,809,461,725.51   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | (二十六) | 20,743,499,166.70  | 38,639,631,004.32  |
| 衍生金融负债                 | (六)   | 3,495,454,278.20   | 2,594,009,281.96   |
| 卖出回购金融资产款              | (二十七) | 33,045,726,729.85  | 43,731,726,557.56  |
| 代理买卖证券款                | (二十八) | 83,774,388,361.26  | 104,059,286,700.58 |
| 代理承销证券款                | (二十九) |                    | 1,054,351,430.62   |
| 应付职工薪酬                 | (三十)  | 4,890,341,286.01   | 4,722,530,711.03   |
| 应交税费                   | (三十一) | 2,611,046,351.79   | 2,391,638,347.18   |
| 应付款项                   | (三十二) | 6,441,954,661.18   | 8,907,935,117.35   |
| 应付利息                   | (三十三) | 3,376,692,174.12   | 3,568,230,275.32   |
| 持有待售负债                 |       |                    |                    |
| 预计负债                   | (三十四) | 167,342,904.85     | 124,621,521.35     |
| 长期借款                   | (三十五) | 30,609,159,576.41  | 22,583,788,217.83  |
| 应付债券                   | (三十六) | 130,158,268,817.49 | 128,295,192,262.28 |
| 其中：优先股                 |       |                    |                    |
| 永续债                    |       |                    |                    |
| 递延所得税负债                | (二十一) | 867,319,662.68     | 557,471,978.61     |
| 递延收益                   |       |                    |                    |
| 其他负债                   | (三十七) | 12,879,603,571.43  | 10,438,685,465.90  |
| <b>负债合计</b>            |       | 405,012,028,902.49 | 438,907,444,778.41 |
| <b>股东权益：</b>           |       |                    |                    |
| 股本                     | (三十八) | 11,501,700,000.00  | 11,501,700,000.00  |
| 其他权益工具                 |       |                    |                    |
| 其中：优先股                 |       |                    |                    |
| 永续债                    |       |                    |                    |
| 资本公积                   | (三十九) | 56,357,979,615.67  | 56,338,469,573.57  |
| 减：库存股                  |       |                    |                    |
| 其他综合收益                 | (四十)  | 1,626,529,293.67   | 108,737,230.40     |
| 盈余公积                   | (四十一) | 5,703,912,997.86   | 5,085,156,596.54   |
| 一般风险准备                 | (四十二) | 12,267,811,125.65  | 10,764,424,543.26  |
| 未分配利润                  | (四十三) | 30,297,545,652.24  | 26,331,639,342.89  |
| 归属于母公司股东权益合计           |       | 117,755,478,685.09 | 110,130,127,286.66 |
| 少数股东权益                 |       | 11,938,825,202.23  | 11,828,274,085.25  |
| <b>股东权益合计</b>          |       | 129,694,303,887.32 | 121,958,401,371.91 |
| <b>负债和股东权益总计</b>       |       | 534,706,332,789.81 | 560,865,846,150.32 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：李础前

会计机构负责人：马中

海通证券股份有限公司

资产负债表

2017年12月31日

(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

| 资产                     | 附注十五 | 期末余额                      | 年初余额                      |
|------------------------|------|---------------------------|---------------------------|
| <b>资产:</b>             |      |                           |                           |
| 货币资金                   |      | 59,147,193,318.25         | 76,058,406,010.83         |
| 其中: 客户存款               |      | 43,369,926,725.20         | 56,273,341,353.64         |
| 结算备付金                  |      | 9,649,410,234.03          | 13,863,883,065.10         |
| 其中: 客户备付金              |      | 7,844,781,938.44          | 9,309,212,392.67          |
| 拆出资金                   |      |                           |                           |
| 融出资金                   |      | 47,877,760,395.98         | 44,591,605,611.47         |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |      | 48,977,872,139.63         | 45,896,579,362.00         |
| 衍生金融资产                 |      |                           |                           |
| 买入返售金融资产               |      | 88,857,913,847.45         | 66,452,306,595.87         |
| 应收款项                   |      | 685,159,660.56            | 169,280,724.98            |
| 应收利息                   |      | 1,295,363,872.36          | 1,450,358,913.15          |
| 存出保证金                  |      | 1,062,287,471.94          | 729,817,647.69            |
| 持有待售资产                 |      |                           |                           |
| 可供出售金融资产               |      | 20,737,083,721.40         | 24,600,315,041.79         |
| 持有至到期投资                |      |                           |                           |
| 长期股权投资                 | (一)  | 26,812,249,257.34         | 25,947,897,592.75         |
| 投资性房地产                 |      | 16,864,072.33             | 18,059,212.45             |
| 固定资产                   |      | 1,079,219,694.45          | 988,333,333.75            |
| 在建工程                   |      | 19,945,291.71             | 32,932,351.33             |
| 无形资产                   |      | 238,942,153.26            | 215,520,077.25            |
| 递延所得税资产                |      | 1,036,786,619.78          | 1,173,163,549.60          |
| 其他资产                   |      | 783,408,365.14            | 15,045,310,734.90         |
| <b>资产总计</b>            |      | <b>308,277,460,115.61</b> | <b>317,233,769,824.91</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

**海通证券股份有限公司**  
**资产负债表（续）**  
**2017年12月31日**  
**（除特别注明外，金额单位均为人民币元）**

| 负债和股东权益                | 附注十五 | 期末余额                      | 年初余额                      |
|------------------------|------|---------------------------|---------------------------|
| <b>负债：</b>             |      |                           |                           |
| 短期借款                   |      |                           |                           |
| 应付短期融资款                |      | 21,897,221,000.00         | 18,434,617,000.00         |
| 拆入资金                   |      | 5,450,000,000.00          | 1,900,000,000.00          |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 |      | 2,276,176,292.18          | 4,722,901,220.00          |
| 衍生金融负债                 |      | 625,529,666.41            | 225,340,234.48            |
| 卖出回购金融资产款              |      | 21,454,363,748.71         | 28,230,549,493.15         |
| 代理买卖证券款                |      | 51,325,229,036.42         | 65,268,025,603.79         |
| 代理承销证券款                |      |                           | 1,054,351,430.62          |
| 应付职工薪酬                 |      | 3,670,578,549.09          | 3,799,874,623.35          |
| 应交税费                   |      | 1,120,176,414.91          | 1,414,338,534.83          |
| 应付款项                   |      | 208,932,625.61            | 258,112,572.04            |
| 应付利息                   |      | 2,398,737,276.95          | 2,254,381,657.57          |
| 持有待售负债                 |      |                           |                           |
| 预计负债                   |      |                           |                           |
| 长期借款                   |      | 1,652,191,890.00          | 1,246,099,790.00          |
| 应付债券                   |      | 88,446,966,516.88         | 86,818,313,569.28         |
| 其中：优先股                 |      |                           |                           |
| 永续债                    |      |                           |                           |
| 递延所得税负债                |      | 598,832,864.85            | 66,258,353.82             |
| 递延收益                   |      |                           |                           |
| 其他负债                   |      | 293,365,968.75            | 295,623,721.54            |
| <b>负债合计</b>            |      | <b>201,418,301,850.76</b> | <b>215,988,787,804.47</b> |
| <b>股东权益：</b>           |      |                           |                           |
| 股本                     |      | 11,501,700,000.00         | 11,501,700,000.00         |
| 其他权益工具                 |      |                           |                           |
| 其中：优先股                 |      |                           |                           |
| 永续债                    |      |                           |                           |
| 资本公积                   |      | 56,486,198,528.36         | 56,486,198,528.36         |
| 减：库存股                  |      |                           |                           |
| 其他综合收益                 |      | 1,296,283,785.15          | -660,702,446.08           |
| 盈余公积                   |      | 5,703,912,997.86          | 5,085,156,596.54          |
| 一般风险准备                 |      | 11,407,825,995.72         | 10,170,313,193.08         |
| 未分配利润                  |      | 20,463,236,957.76         | 18,662,316,148.54         |
| <b>股东权益合计</b>          |      | <b>106,859,158,264.85</b> | <b>101,244,982,020.44</b> |
| <b>负债和股东权益总计</b>       |      | <b>308,277,460,115.61</b> | <b>317,233,769,824.91</b> |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：李础前

会计机构负责人：马中

**海通证券股份有限公司**  
**合并利润表**  
**2017 年度**  
(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

| 项目                                  | 附注五   | 本期数               | 上期数               |
|-------------------------------------|-------|-------------------|-------------------|
| 一、营业收入                              |       | 28,221,667,163.35 | 28,011,014,594.51 |
| 手续费及佣金净收入                           | (四十四) | 9,556,198,727.08  | 10,965,008,854.57 |
| 其中: 经纪业务手续费净收入                      |       | 3,941,275,252.46  | 5,314,409,804.29  |
| 投资银行业务手续费净收入                        |       | 3,329,892,535.99  | 3,356,019,560.06  |
| 资产管理业务手续费净收入                        |       | 2,097,888,819.40  | 1,640,822,429.56  |
| 利息净收入                               | (四十五) | 3,665,925,531.96  | 3,839,610,355.40  |
| 投资收益(损失以“-”号填列)                     | (四十六) | 11,365,519,110.20 | 6,539,692,047.35  |
| 其中: 对联营企业和合营企业的投资收益                 |       | 708,486,590.83    | 200,434,890.72    |
| 资产处置收益(损失以“-”号填列)                   | (四十七) | -6,782,409.58     | -650,711.81       |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)                 | (四十八) | -1,329,410,866.60 | -231,333,741.19   |
| 汇兑收益(损失以“-”号填列)                     |       | -225,471,617.33   | 58,149,350.76     |
| 其他收益                                |       |                   |                   |
| 其他业务收入                              | (四十九) | 5,195,688,687.62  | 6,840,538,439.43  |
| 二、营业支出                              |       | 15,934,582,721.50 | 17,362,648,883.48 |
| 税金及附加                               | (五十)  | 165,972,927.57    | 490,685,726.69    |
| 业务及管理费                              | (五十一) | 9,755,117,004.73  | 9,563,542,327.78  |
| 资产减值损失                              | (五十二) | 1,686,658,289.93  | 1,419,492,720.73  |
| 其他业务成本                              | (五十三) | 4,326,834,499.27  | 5,888,928,108.28  |
| 三、营业利润(亏损以“-”号填列)                   |       | 12,287,084,441.85 | 10,648,365,711.03 |
| 加: 营业外收入                            | (五十四) | 684,045,736.26    | 591,593,678.64    |
| 减: 营业外支出                            | (五十五) | 81,733,174.46     | 78,232,395.37     |
| 四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)                 |       | 12,889,397,003.65 | 11,161,726,994.30 |
| 减: 所得税费用                            | (五十六) | 3,013,794,133.39  | 2,231,208,739.89  |
| 五、净利润(净亏损以“-”号填列)                   |       | 9,875,602,870.26  | 8,930,518,254.41  |
| (一) 按经营持续性分类                        |       |                   |                   |
| 1. 持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)              |       | 9,875,602,870.26  | 8,930,518,254.41  |
| 2. 终止经营净利润(净亏损以“-”号填列)              |       |                   |                   |
| (二) 按所有权归属分类                        |       |                   |                   |
| 1. 少数股东损益                           |       | 1,257,179,577.20  | 887,183,735.11    |
| 2. 归属于母公司股东的净利润                     |       | 8,618,423,293.06  | 8,043,334,519.30  |
| 六、其他综合收益的税后净额                       | (四十)  | 793,728,726.62    | 281,583,321.87    |
| 归属母公司股东的其他综合收益的税后净额                 |       | 1,517,792,063.27  | -394,707,737.87   |
| (一) 以后不能重分类进损益的其他综合收益               |       | 3,837,679.67      | -23,025,113.89    |
| 1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动             |       | 3,837,679.67      | -23,025,113.89    |
| 2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额  |       |                   |                   |
| (二) 以后将重分类进损益的其他综合收益                |       | 1,513,954,383.60  | -371,682,623.98   |
| 1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 |       | -23,824,503.30    | 74,262,107.21     |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 |       | 1,321,575,623.38  | -300,412,450.23   |
| 3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益            |       |                   |                   |
| 4. 现金流量套期损益的有效部分                    |       |                   |                   |
| 5. 外币财务报表折算差额                       |       | 230,423,879.62    | -124,397,181.88   |
| 6. 其他                               |       | -14,220,616.10    | -21,135,099.08    |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额                 |       | -724,063,336.65   | 676,291,059.74    |
| 七、综合收益总额                            |       | 10,669,331,596.88 | 9,212,101,576.28  |
| 归属于母公司股东的综合收益总额                     |       | 10,136,215,356.33 | 7,648,626,781.43  |
| 归属于少数股东的综合收益总额                      |       | 533,116,240.55    | 1,563,474,794.85  |
| 八、每股收益                              |       |                   |                   |
| (一) 基本每股收益(元/股)                     |       | 0.75              | 0.70              |
| (二) 稀释每股收益(元/股)                     |       | 0.74              | 0.70              |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 李础前

会计机构负责人: 马中

**海通证券股份有限公司**  
**利润表**  
**2017 年度**  
(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

| 项目                                  | 附注十五 | 本期金额              | 上期金额              |
|-------------------------------------|------|-------------------|-------------------|
| 一、营业收入                              |      | 12,347,447,610.30 | 12,120,220,630.19 |
| 手续费及佣金净收入                           | (二)  | 5,520,637,574.04  | 7,445,029,364.93  |
| 其中: 经纪业务手续费净收入                      |      | 3,225,368,968.49  | 4,489,758,809.46  |
| 投资银行业务手续费净收入                        |      | 2,093,728,635.02  | 2,332,431,031.17  |
| 资产管理业务手续费净收入                        |      |                   |                   |
| 利息净收入                               |      | 2,512,339,736.69  | 2,670,773,581.22  |
| 投资收益(损失以“-”号填列)                     | (三)  | 4,056,996,004.20  | 2,455,750,159.16  |
| 其中: 对联营企业和合营企业的投资收益                 |      | 201,664,118.94    | 208,841,073.22    |
| 资产处置收益(损失以“-”号填列)                   |      |                   |                   |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)                 |      | 141,669,042.93    | -310,812,964.46   |
| 汇兑收益(损失以“-”号填列)                     |      | 100,569,184.83    | -157,326,736.44   |
| 其他收益                                |      |                   |                   |
| 其他业务收入                              |      | 15,236,067.61     | 16,807,225.78     |
| 二、营业支出                              |      | 5,314,143,262.50  | 5,700,042,628.79  |
| 税金及附加                               |      | 98,389,456.80     | 379,440,582.29    |
| 业务及管理费                              |      | 4,925,505,819.56  | 5,306,477,838.41  |
| 资产减值损失                              |      | 289,052,846.02    | 12,929,067.97     |
| 其他业务成本                              |      | 1,195,140.12      | 1,195,140.12      |
| 三、营业利润(亏损以“-”号填列)                   |      | 7,033,304,347.80  | 6,420,178,001.40  |
| 加: 营业外收入                            |      | 512,555,229.79    | 415,924,025.81    |
| 减: 营业外支出                            |      | 22,775,004.09     | 12,237,664.88     |
| 四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)                 |      | 7,523,084,573.50  | 6,823,864,362.33  |
| 减: 所得税费用                            |      | 1,335,520,560.32  | 1,099,188,968.48  |
| 五、净利润(净亏损以“-”号填列)                   |      | 6,187,564,013.18  | 5,724,675,393.85  |
| (一) 持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)             |      | 6,187,564,013.18  | 5,724,675,393.85  |
| (二) 终止经营净利润(净亏损以“-”号填列)             |      |                   |                   |
| 六、其他综合收益的税后净额                       |      | 1,956,986,231.23  | -423,608,955.97   |
| (一) 以后不能重分类进损益的其他综合收益               |      |                   |                   |
| 1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动             |      |                   |                   |
| 2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额  |      |                   |                   |
| (二) 以后将重分类进损益的其他综合收益                |      | 1,956,986,231.23  | -423,608,955.97   |
| 1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 |      | -1,721,018.10     | -12,215,430.50    |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 |      | 1,958,707,249.33  | -411,393,525.47   |
| 3. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益            |      |                   |                   |
| 4. 现金流量套期损益的有效部分                    |      |                   |                   |
| 5. 外币财务报表折算差额                       |      |                   |                   |
| 6. 其他                               |      |                   |                   |
| 七、综合收益总额                            |      | 8,144,550,244.41  | 5,301,066,437.88  |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 李础前

会计机构负责人: 马中

**海通证券股份有限公司**  
**合并现金流量表**  
**2017 年度**  
(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

| 项目                           | 附注五   | 本期金额               | 上期金额               |
|------------------------------|-------|--------------------|--------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量:</b>        |       |                    |                    |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额 |       |                    | 28,197,672,745.36  |
| 收取利息、手续费及佣金的现金               |       | 25,136,593,410.35  | 21,967,126,130.20  |
| 拆入资金净增加额                     |       | 3,021,537,853.08   | 1,024,176,694.59   |
| 融出资金净减少额                     |       | 1,527,042,334.58   | 13,048,809,309.29  |
| 收到其他与经营活动有关的现金               | (五十七) | 9,269,334,626.97   | 15,445,664,611.37  |
| 经营活动现金流入小计                   |       | 38,954,508,224.98  | 79,683,449,490.81  |
| 处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净减少额  |       | 14,329,856,026.30  |                    |
| 回购业务资金净减少额                   |       | 26,067,077,126.61  | 63,485,544,819.23  |
| 代理买卖证券支付的现金净额                |       | 20,284,898,339.32  | 24,967,049,674.21  |
| 支付利息、手续费及佣金的现金               |       | 4,893,774,963.91   | 5,952,166,489.32   |
| 支付给职工以及为职工支付的现金              |       | 6,212,890,009.58   | 6,606,320,362.04   |
| 支付的各项税费                      |       | 4,167,174,833.38   | 6,125,099,254.41   |
| 支付其他与经营活动有关的现金               | (五十七) | 21,815,438,471.78  | 22,724,950,360.10  |
| 经营活动现金流出小计                   |       | 97,771,109,770.88  | 129,861,130,959.31 |
| <b>经营活动产生的现金流量净额</b>         | (五十八) | -58,816,601,545.90 | -50,177,681,468.50 |
| <b>二、投资活动产生的现金流量:</b>        |       |                    |                    |
| 收回投资所收到的现金                   |       | 86,350,562,286.29  | 59,258,316,495.96  |
| 取得投资收益收到的现金                  |       | 1,474,961,179.72   | 2,212,874,665.29   |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额          |       |                    |                    |
| 收到其他与投资活动有关的现金               | (五十七) | 6,383,049.12       | 31,535,973.88      |
| 投资活动现金流入小计                   |       | 87,831,906,515.13  | 61,502,727,135.13  |
| 投资支付的现金                      |       | 50,364,101,919.13  | 92,628,094,351.03  |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金     |       | 1,825,444,151.22   | 452,430,691.50     |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额          |       | 746,965,847.51     |                    |
| 支付其他与投资活动有关的现金               | (五十七) | 1,442,008.42       |                    |
| 投资活动现金流出小计                   |       | 52,937,953,926.28  | 93,080,525,042.53  |
| <b>投资活动产生的现金流量净额</b>         |       | 34,893,952,588.85  | -31,577,797,907.40 |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量:</b>        |       |                    |                    |
| 吸收投资收到的现金                    |       | 28,311,221.76      | 1,278,725,615.87   |
| 其中: 子公司吸收少数股东投资收到的现金         |       | 28,311,221.76      | 78,725,615.87      |
| 取得借款收到的现金                    |       | 42,535,411,703.10  | 33,801,217,009.11  |
| 发行债券收到的现金                    |       | 102,211,552,801.79 | 103,973,048,006.07 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金               |       |                    |                    |
| 筹资活动现金流入小计                   |       | 144,775,275,726.65 | 139,052,990,631.05 |
| 偿还债务支付的现金                    |       | 129,450,084,497.92 | 91,760,790,933.36  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金            |       | 11,241,205,417.25  | 13,619,167,374.46  |
| 其中: 子公司付给少数股东的股利、利润          |       | 363,981,171.23     | 280,891,919.36     |
| 支付其他与筹资活动有关的现金               | (五十七) | 110,763,312.31     | 318,156,191.66     |
| 筹资活动现金流出小计                   |       | 140,802,053,227.48 | 105,698,114,499.48 |
| <b>筹资活动产生的现金流量净额</b>         |       | 3,973,222,499.17   | 33,354,876,131.57  |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>    |       | -1,561,443,060.12  | 1,530,590,010.25   |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>        |       | -21,510,869,518.00 | -46,870,013,234.08 |
| 加: 期初现金及现金等价物余额              |       | 131,153,159,354.26 | 178,023,172,588.34 |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>        |       | 109,642,289,836.26 | 131,153,159,354.26 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

企业法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 李础前

会计机构负责人: 马中

**海通证券股份有限公司**  
**现金流量表**  
**2017 年度**  
(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

| 项目                           | 附注十五 | 本期金额               | 上期金额               |
|------------------------------|------|--------------------|--------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量:</b>        |      |                    |                    |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额 |      |                    | 17,757,807,107.21  |
| 收取利息、手续费及佣金的现金               |      | 16,262,944,262.01  | 19,545,579,700.45  |
| 拆入资金净增加额                     |      | 3,550,000,000.00   | 400,000,000.00     |
| 融出资金净减少额                     |      |                    | 15,938,555,659.72  |
| 收到其他与经营活动有关的现金               |      | 659,087,096.11     | 927,856,178.72     |
| 经营活动现金流入小计                   |      | 20,472,031,358.12  | 54,569,798,646.10  |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额 |      | 2,700,056,813.68   |                    |
| 回购业务资金净减少额                   |      | 29,346,726,906.21  | 50,864,798,085.35  |
| 融出资金净增加额                     |      | 3,301,969,084.07   |                    |
| 代理买卖证券支付的现金净额                |      | 13,942,796,567.37  | 27,516,480,070.48  |
| 支付利息、手续费及佣金的现金               |      | 3,242,800,988.89   | 4,577,982,821.18   |
| 支付给职工以及为职工支付的现金              |      | 3,526,002,096.41   | 3,859,192,503.48   |
| 支付的各项税费                      |      | 2,245,678,127.41   | 4,015,840,746.58   |
| 支付其他与经营活动有关的现金               |      | 2,909,392,366.99   | 1,924,665,548.37   |
| 经营活动现金流出小计                   |      | 61,215,422,951.03  | 92,758,959,775.44  |
| <b>经营活动产生的现金流量净额</b>         | (四)  | -40,743,391,592.91 | -38,189,161,129.34 |
| <b>二、投资活动产生的现金流量:</b>        |      |                    |                    |
| 收回投资所收到的现金                   |      | 22,307,433,046.18  | 15,576,570,002.91  |
| 取得投资收益收到的现金                  |      | 1,611,002,884.36   | 648,744,166.79     |
| 收到其他与投资活动有关的现金               |      | 4,672,919.79       | 7,049,848.63       |
| 投资活动现金流入小计                   |      | 23,923,108,850.33  | 16,232,364,018.33  |
| 投资支付的现金                      |      | 2,174,801,793.75   | 27,614,461,337.67  |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金     |      | 410,111,577.38     | 192,562,473.44     |
| 支付其他与投资活动有关的现金               |      |                    |                    |
| 投资活动现金流出小计                   |      | 2,584,913,371.13   | 27,807,023,811.11  |
| <b>投资活动产生的现金流量净额</b>         |      | 21,338,195,479.20  | -11,574,659,792.78 |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量:</b>        |      |                    |                    |
| 吸收投资收到的现金                    |      |                    |                    |
| 取得借款收到的现金                    |      | 514,780,000.00     | 113,452,540.00     |
| 发行债券收到的现金                    |      | 87,126,082,000.00  | 90,092,349,000.00  |
| 收到其他与筹资活动有关的现金               |      |                    |                    |
| 筹资活动现金流入小计                   |      | 87,640,862,000.00  | 90,205,801,540.00  |
| 偿还债务支付的现金                    |      | 82,246,546,500.00  | 75,077,307,620.00  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金            |      | 6,987,195,418.74   | 9,793,296,850.23   |
| 支付其他与筹资活动有关的现金               |      | 22,641,509.43      |                    |
| 筹资活动现金流出小计                   |      | 89,256,383,428.17  | 84,870,604,470.23  |
| <b>筹资活动产生的现金流量净额</b>         |      | -1,615,521,428.17  | 5,335,197,069.77   |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>    |      | -104,967,981.77    | 130,518,189.18     |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>        |      | -21,125,685,523.65 | -44,298,105,663.17 |
| 加: 期初现金及现金等价物余额              |      | 89,372,289,075.93  | 133,670,394,739.10 |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>        |      | 68,246,603,552.28  | 89,372,289,075.93  |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分

企业法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 李础前

会计机构负责人: 马中

**海通证券股份有限公司  
合并股东权益变动表  
2017 年度  
(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)**

| 项目                     | 本期金额              |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    | 少数股东权益            | 股东权益合计             |
|------------------------|-------------------|--------|----|--|-------------------|--------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|----|-------------------|--------------------|
|                        | 归属于母公司股东权益        |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
|                        | 股本                | 其他权益工具 |    |  | 资本公积              | 减: 库存股 | 其他综合收益           | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润             | 其他 |                   |                    |
|                        | 优先股               | 永续债    | 其他 |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 一、上年年末余额               | 11,501,700,000.00 |        |    |  | 56,338,469,573.57 |        | 108,737,230.40   | 5,085,156,596.54 | 10,764,424,543.26 | 26,331,639,342.89 |    | 11,828,274,085.25 | 121,958,401,371.91 |
| 加: 会计政策变更              |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 前期差错更正                 |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 同一控制下企业合并              |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 其他                     |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 二、本年初余额                | 11,501,700,000.00 |        |    |  | 56,338,469,573.57 |        | 108,737,230.40   | 5,085,156,596.54 | 10,764,424,543.26 | 26,331,639,342.89 |    | 11,828,274,085.25 | 121,958,401,371.91 |
| 三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列) |                   |        |    |  | 19,510,042.10     |        | 1,517,792,063.27 | 618,756,401.32   | 1,503,386,582.39  | 3,965,906,309.35  |    | 110,551,116.98    | 7,735,902,515.41   |
| (一) 综合收益总额             |                   |        |    |  |                   |        | 1,517,792,063.27 |                  |                   | 8,618,423,293.06  |    | 533,116,240.55    | 10,669,331,596.88  |
| (二) 股东投入和减少资本          |                   |        |    |  | 19,510,042.10     |        |                  |                  |                   |                   |    | 85,455,457.60     | 104,965,499.70     |
| 1. 股东投入的普通股            |                   |        |    |  | 186,483.27        |        |                  |                  |                   |                   |    | 115,939,019.01    | 116,125,502.28     |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本       |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额       |                   |        |    |  | 21,797,941.35     |        |                  |                  |                   |                   |    | -28,810,315.11    | -7,012,373.76      |
| 4. 其他                  |                   |        |    |  | -2,474,382.52     |        |                  |                  |                   |                   |    | -1,673,246.30     | -4,147,628.82      |
| (三) 利润分配               |                   |        |    |  |                   |        |                  | 618,756,401.32   | 1,503,386,582.39  | -4,652,516,983.71 |    | -508,020,581.17   | -3,038,394,581.17  |
| 1. 提取盈余公积              |                   |        |    |  |                   |        |                  | 618,756,401.32   |                   | -618,756,401.32   |    |                   |                    |
| 2. 提取一般风险准备            |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  | 1,503,386,582.39  | -1,503,386,582.39 |    |                   |                    |
| 3. 对股东的分配              |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   | -2,530,374,000.00 |    | -470,666,235.98   | -3,001,040,235.98  |
| 4. 其他                  |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    | -37,354,345.19    | -37,354,345.19     |
| (四) 股东权益内部结转           |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 1. 资本公积转增股本            |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 2. 盈余公积转增股本            |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 3. 盈余公积弥补亏损            |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 4. 其他                  |                   |        |    |  |                   |        |                  |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 四、本期期末余额               | 11,501,700,000.00 |        |    |  | 56,357,979,615.67 |        | 1,626,529,293.67 | 5,703,912,997.86 | 12,267,811,125.65 | 30,297,545,652.24 |    | 11,938,825,202.23 | 129,694,303,887.32 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。  
企业法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 李础前

会计机构负责人: 马中

**海通证券股份有限公司**  
**合并股东权益变动表（续）**  
**2017 年度**  
**（除特别注明外，金额单位均为人民币元）**

| 项目                    | 上期金额              |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    | 少数股东权益            | 股东权益合计             |
|-----------------------|-------------------|--------|----|--|-------------------|-------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|----|-------------------|--------------------|
|                       | 归属于母公司股东权益        |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   | 其他 |                   |                    |
|                       | 股本                | 其他权益工具 |    |  | 资本公积              | 减：库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润             |    |                   |                    |
|                       | 优先股               | 永续债    | 其他 |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 一、上年年末余额              | 11,501,700,000.00 |        |    |  | 56,375,748,807.13 |       | 503,444,968.27  | 4,512,689,057.15 | 9,480,977,721.24  | 25,319,984,185.00 |    | 9,233,126,214.85  | 116,927,670,953.64 |
| 加：会计政策变更              |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 前期差错更正                |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 同一控制下企业合并             |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 其他                    |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 二、本年初余额               | 11,501,700,000.00 |        |    |  | 56,375,748,807.13 |       | 503,444,968.27  | 4,512,689,057.15 | 9,480,977,721.24  | 25,319,984,185.00 |    | 9,233,126,214.85  | 116,927,670,953.64 |
| 三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列） |                   |        |    |  | -37,279,233.56    |       | -394,707,737.87 | 572,467,539.39   | 1,283,446,822.02  | 1,011,655,157.89  |    | 2,595,147,870.40  | 5,030,730,418.27   |
| （一）综合收益总额             |                   |        |    |  |                   |       | -394,707,737.87 |                  |                   | 8,043,334,519.30  |    | 1,563,474,794.85  | 9,212,101,576.28   |
| （二）股东投入和减少资本          |                   |        |    |  | -37,279,233.56    |       |                 |                  |                   |                   |    | 1,368,099,140.64  | 1,330,819,907.08   |
| 1. 股东投入的普通股           |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    | 123,965,278.92    | 123,965,278.92     |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额      |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    | 36,982,540.97     | 36,982,540.97      |
| 4. 其他                 |                   |        |    |  | -37,279,233.56    |       |                 |                  |                   |                   |    | 1,207,151,320.75  | 1,169,872,087.19   |
| （三）利润分配               |                   |        |    |  |                   |       |                 | 572,467,539.39   | 1,283,446,822.02  | -7,031,679,361.41 |    | -336,426,065.09   | -5,512,191,065.09  |
| 1. 提取盈余公积             |                   |        |    |  |                   |       |                 | 572,467,539.39   |                   | -572,467,539.39   |    |                   |                    |
| 2. 提取一般风险准备           |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  | 1,283,446,822.02  | -1,283,446,822.02 |    |                   |                    |
| 3. 对股东的分配             |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   | -5,175,765,000.00 |    | -336,426,065.09   | -5,512,191,065.09  |
| 4. 其他                 |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| （四）股东权益内部结转           |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 1. 资本公积转增股本           |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 2. 盈余公积转增股本           |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 3. 盈余公积弥补亏损           |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 4. 其他                 |                   |        |    |  |                   |       |                 |                  |                   |                   |    |                   |                    |
| 四、本期末余额               | 11,501,700,000.00 |        |    |  | 56,338,469,573.57 |       | 108,737,230.40  | 5,085,156,596.54 | 10,764,424,543.26 | 26,331,639,342.89 |    | 11,828,274,085.25 | 121,958,401,371.91 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。  
企业法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：李础前

会计机构负责人：马中

**海通证券股份有限公司**  
**股东权益变动表**  
**2017 年度**  
**(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)**

| 项 目                    | 本期金额              |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
|------------------------|-------------------|--------|-----|----|-------------------|--------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
|                        | 股本                | 其他权益工具 |     |    | 资本公积              | 减: 库存股 | 其他综合收益           | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润             | 股东权益合计             |
|                        |                   | 优先股    | 永续债 | 其他 |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 一、上年年末余额               | 11,501,700,000.00 |        |     |    | 56,486,198,528.36 |        | -660,702,446.08  | 5,085,156,596.54 | 10,170,313,193.08 | 18,662,316,148.54 | 101,244,982,020.44 |
| 加: 会计政策变更              |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 前期差错更正                 |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 其他                     |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 二、本年初余额                | 11,501,700,000.00 |        |     |    | 56,486,198,528.36 |        | -660,702,446.08  | 5,085,156,596.54 | 10,170,313,193.08 | 18,662,316,148.54 | 101,244,982,020.44 |
| 三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列) |                   |        |     |    |                   |        | 1,956,986,231.23 | 618,756,401.32   | 1,237,512,802.64  | 1,800,920,809.22  | 5,614,176,244.41   |
| (一) 综合收益总额             |                   |        |     |    |                   |        | 1,956,986,231.23 |                  |                   | 6,187,564,013.18  | 8,144,550,244.41   |
| (二) 股东投入和减少资本          |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 1. 股东投入的普通股            |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本       |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额       |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 4. 其他                  |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| (三) 利润分配               |                   |        |     |    |                   |        |                  | 618,756,401.32   | 1,237,512,802.64  | -4,386,643,203.96 | -2,530,374,000.00  |
| 1. 提取盈余公积              |                   |        |     |    |                   |        |                  | 618,756,401.32   |                   | -618,756,401.32   |                    |
| 2. 提取一般风险准备            |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  | 1,237,512,802.64  | -1,237,512,802.64 |                    |
| 3. 对股东的分配              |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   | -2,530,374,000.00 | -2,530,374,000.00  |
| 4. 其他                  |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| (四) 股东权益内部结转           |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 1. 资本公积转增股本            |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 2. 盈余公积转增股本            |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 3. 盈余公积弥补亏损            |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 4. 其他                  |                   |        |     |    |                   |        |                  |                  |                   |                   |                    |
| 四、本期末余额                | 11,501,700,000.00 |        |     |    | 56,486,198,528.36 |        | 1,296,283,785.15 | 5,703,912,997.86 | 11,407,825,995.72 | 20,463,236,957.76 | 106,859,158,264.85 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。  
企业法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 李础前

会计机构负责人: 马中

**海通证券股份有限公司**  
**股东权益变动表（续）**  
**2017 年度**  
**（除特别注明外，金额单位均为人民币元）**

| 项 目                   | 上期金额              |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
|-----------------------|-------------------|--------|-----|----|-------------------|-------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
|                       | 股本                | 其他权益工具 |     |    | 资本公积              | 减：库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润             | 股东权益合计             |
|                       |                   | 优先股    | 永续债 | 其他 |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 一、上年年末余额              | 11,501,700,000.00 |        |     |    | 56,486,198,528.36 |       | -237,093,490.11 | 4,512,689,057.15 | 9,025,378,114.30  | 19,830,808,372.86 | 101,119,680,582.56 |
| 加：会计政策变更              |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 前期差错更正                |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 其他                    |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 二、本年年初余额              | 11,501,700,000.00 |        |     |    | 56,486,198,528.36 |       | -237,093,490.11 | 4,512,689,057.15 | 9,025,378,114.30  | 19,830,808,372.86 | 101,119,680,582.56 |
| 三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列） |                   |        |     |    |                   |       | -423,608,955.97 | 572,467,539.39   | 1,144,935,078.78  | -1,168,492,224.32 | 125,301,437.88     |
| （一）综合收益总额             |                   |        |     |    |                   |       | -423,608,955.97 |                  |                   | 5,724,675,393.85  | 5,301,066,437.88   |
| （二）股东投入和减少资本          |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 1. 股东投入的普通股           |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 3. 股份支付计入股东权益的金额      |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 4. 其他                 |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| （三）利润分配               |                   |        |     |    |                   |       |                 | 572,467,539.39   | 1,144,935,078.78  | -6,893,167,618.17 | -5,175,765,000.00  |
| 1. 提取盈余公积             |                   |        |     |    |                   |       |                 | 572,467,539.39   |                   | -572,467,539.39   |                    |
| 2. 提取一般风险准备           |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  | 1,144,935,078.78  | -1,144,935,078.78 |                    |
| 3. 对股东的分配             |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   | -5,175,765,000.00 | -5,175,765,000.00  |
| 4. 其他                 |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| （四）股东权益内部结转           |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 1. 资本公积转增股本           |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 2. 盈余公积转增股本           |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 3. 盈余公积弥补亏损           |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 4. 其他                 |                   |        |     |    |                   |       |                 |                  |                   |                   |                    |
| 四、本期末余额               | 11,501,700,000.00 |        |     |    | 56,486,198,528.36 |       | -660,702,446.08 | 5,085,156,596.54 | 10,170,313,193.08 | 18,662,316,148.54 | 101,244,982,020.44 |

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。  
企业法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：李础前

会计机构负责人：马中

## 海通证券股份有限公司 2017 年度财务报表附注

### 一、 公司基本情况

#### (一) 公司概况

海通证券股份有限公司（以下简称“公司”或“海通证券”）前身为成立于 1988 年的上海海通证券公司，是国内最早成立的证券公司之一。1994 年 9 月，改制为全国性的有限责任公司，更名为“海通证券有限公司”，资本金增至 10 亿元。2000 年，增资至 37.46 亿元。2001 年 12 月，改制为股份有限公司，增资至 40.06 亿元，并于次月更名为“海通证券股份有限公司”。2002 年 11 月，资本金增至 87.34 亿元。

2007 年 6 月 7 日，公司与原都市股份(600837)吸收合并事宜获得中国证监会批准。吸收合并后存续公司股本变更为 33.89 亿元，并于 2007 年 7 月 31 日在上海证券交易所上市。2007 年经非公开发行股票，增加股本 7.25 亿元，公司股本变更为 41.14 亿元。根据海通证券 2007 年度利润分配及资本公积转增方案，每 10 股派送股票股利 3 股（含税）和以资本公积每 10 股转增 7 股，公司股本变更为 8,227,821,180.00 元。

2012 年 4 月 27 日，公司在香港联交所主板发行 1,229,400,000 股境外上市外资股（H 股）；次月因部分行使超额配售权，公司额外发行 127,500,000 股 H 股；另外，公司国有股股东的国有股减划转给全国社会保障基金理事会并转为上市外资股（H 股）合计 135,690,000 股。经过本次 H 股发行以及国有股减持后，公司股本变更为 9,584,721,180 股，其中，于上海证券交易所上市的 A 股 8,092,131,180 股、于香港交易所上市的 H 股 1,492,590,000 股。

2015 年 5 月，公司非公开发行境外上市外资股(H 股)，发行规模为 1,916,978,820 股。经过本次 H 股非公开发行后，公司股本变更为 11,501,700,000 股，其中，于上海证券交易所上市的 A 股 8,092,131,180 股、于香港交易所上市的 H 股 3,409,568,820 股。

截止 2017 年 12 月 31 日，公司股本总数为 11,501,700,000 股，均为无限售条件股份。

公司注册地和总部地址：上海市广东路 689 号。

公司经营范围为：证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；直接投资业务；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品；股票期权做市业务；中国证监会批准的其他业务，公司可以对外投资设立子公司从事金融产品等投资业务。

（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

截止 2017 年 12 月 31 日，公司经批准设立分公司 27 家，证券营业部 290 家。

## (二) 合并财务报表范围

公司合并财务报表范围包括直接或间接控制的子公司和结构化主体。

子公司包括通过以设立或投资等方式取得的海富通基金管理有限公司、海富产业投资基金管理有限公司、海通开元投资有限公司、海通创新证券投资有限公司、上海海通证券资产管理有限公司、海通国际控股有限公司、上海惟泰置业管理有限公司和通过非同一控制下企业合并取得的海通期货股份有限公司等子公司以及该等子公司控制的公司。

本期合并财务报表范围及其变动情况、在相关被投资单位权益的信息详见附注“六、合并范围的变更”和“七、在其他主体中的权益”。

## 二、 财务报表的编制基础

### (一) 编制基础

公司以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），以及中国证券监督管理委员会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》的披露规定编制财务报表。

### (二) 持续经营

公司对本报告期末起 12 个月内的持续经营能力进行评价，未发现对持续经营能力有重大不利的事项。

## 三、 重要会计政策及会计估计

### (一) 遵循企业会计准则的声明

公司所编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了报告期公司的财务状况、经营成果、现金流量等有关信息。

### (二) 会计期间

自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止为一个会计年度。

### (三) 营业周期

公司营业周期为 12 个月。

#### (四) 记账本位币

公司采用人民币为记账本位币。

境外子公司以其经营所处的主要经济环境中的货币为记账本位币，编制财务报表时折算为人民币。

#### (五) 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

##### 1、 同一控制下企业合并

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方资产、负债（包括最终控制方收购被合并方而形成的商誉）在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。被合并各方采用的会计政策与公司不一致的，公司在合并日按照公司会计政策进行调整，在此基础上按照调整后的账面价值确认。

在合并中取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积中的股本溢价。资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。

公司为进行企业合并而发生的各项直接相关费用，包括为进行企业合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费等，于发生时计入当期损益。

企业合并中发行权益性证券发生的手续费、佣金等，抵减权益性证券溢价收入，溢价收入不足冲减的，冲减留存收益。

##### 2、 非同一控制下的企业合并

公司在购买日对作为企业合并对价付出的资产、发生或承担的负债按照公允价值计量。公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。

公司在购买日对合并成本进行分配，确认所取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值。

公司对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，经复核后计入当期损益。

企业合并中取得的被购买方除无形资产外的其他各项资产（不仅限于被购买方原已确认的资产），其所带来的经济利益很可能流入公司且公允价值能够可靠计量的，单独确认并按公允价值计量；公允价值能够可靠计量的无形资产，单独确认为无形资产并按公允价值计量；取得的被购买方除或有负债以外的其他各项负债，履行有关义务很可能导致经济利益流出公司且公允价值能够可靠计量的，单独确认并按照公允价值计量；取得的被购买方或有负债，其公允价值

能可靠计量的，单独确认为负债并按照公允价值计量。

公司在企业合并中取得的被购买方的可抵扣暂时性差异，在购买日不符合递延所得税资产确认条件的，不予以确认。购买日后 12 个月内，如取得新的或进一步的信息表明购买日的相关情况已经存在，预期被购买方在购买日可抵扣暂时性差异带来的经济利益能够实现的，确认相关的递延所得税资产，同时减少商誉，商誉不足冲减的，差额部分确认为当期损益；除上述情况以外，确认与企业合并相关的递延所得税资产，计入当期损益。

非同一控制下企业合并，公司为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；公司作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

## (六) 合并财务报表的编制方法

### 1、 合并范围

公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，所有被母公司控制的主体（含企业、被投资单位中可分割的部分，以及企业所控制的结构化主体等，下同）均纳入合并财务报表。

### 2、 合并财务报表的编制方法

所有纳入合并财务报表合并范围的子公司所采用的会计政策、会计期间与公司一致，如子公司采用的会计政策、会计期间与公司不一致的，在编制合并财务报表时，按公司的会计政策、会计期间进行必要的调整。对于非同一控制下企业合并取得的子公司，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其财务报表进行调整。对于同一控制下企业合并取得的子公司，以其资产、负债（包括最终控制方收购该子公司而形成的商誉）在最终控制方财务报表中的账面价值为基础对其财务报表进行调整。公司以自身和各子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，编制合并财务报表。公司在编制合并财务报表时，将整个企业集团视为一个会计主体，依据相关企业会计准则的确认、计量和列报要求，按照统一的会计政策，反映本企业集团整体财务状况、经营成果和现金流量。

合并财务报表时抵销公司与各子公司、各子公司相互之间发生的内部交易对合并资产负债表、合并利润表、合并现金流量表、合并股东权益变动表的影响。子公司少数股东应占的权益和损益分别在合并资产负债表中股东权益项目下和合并利润表中净利润项目下、综合收益总额项目下单独列示。子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有份额

而形成的余额，冲减少数股东权益。

#### （1）增加子公司或业务

在报告期内，若因同一控制下企业合并增加子公司或业务的，则调整合并资产负债表的期初数；将子公司合并当期期初至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；将子公司合并当期期初至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表，同时对比较报表的相关项目进行调整，视同合并后的报告主体在以前期间一直存在。

因追加投资等原因能够对同一控制下的被投资方实施控制的，视同参与合并的各方在最终控制方开始控制时即以目前的状态存在进行调整。在取得被合并方控制权之前持有的股权投资，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一控制之日孰晚日起至合并日之间已确认有关损益、其他综合收益以及其他净资产变动，分别冲减比较报表期间的期初留存收益或当期损益。

在报告期内，若因非同一控制下企业合并增加子公司或业务的，则不调整合并资产负债表期初数；将子公司自购买日至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司自购买日至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表。

因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资方实施控制的，对于购买日之前持有的被购买方的股权，公司按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益。购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益以及除净损益、其他综合收益和利润分配之外的其他所有者权益变动的，与其相关的其他综合收益、其他所有者权益变动转为购买日所属当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

#### （2）处置子公司或业务

##### ①一般处理方法

在报告期内，公司处置子公司或业务，则该子公司或业务期初至处置日的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司期初至处置日的现金流量纳入合并现金流量表。因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权时，对于处置后的剩余股权投资，公司按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司自购买日开始持续计算的净资产的份额与商誉之和的差额，计入丧失控制权当期的投资收益。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益，在丧失控制权时转为当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

## ②分步处置子公司

通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，通常表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：

- i. 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；
- ii. 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；
- iii. 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；
- iv. 一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易属于一揽子交易的，公司将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易不属于一揽子交易的，在丧失控制权之前，按附注三（六）2、（4）“不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资”进行会计处理；在丧失控制权时，按处置子公司附注三（六）2、（2）①“一般处理方法”进行会计处理。

## （3）购买子公司少数股权

公司因购买少数股权新取得的长期股权投资与按照新增持股比例计算应享有子公司自购买日（或合并日）开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整合并资产负债表中的资本公积（股本溢价），资本公积不足冲减的，调整留存收益。

## （4）不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资

在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额的差额，调整合并资产负债表中的资本公积（股本溢价），资本公积不足冲减的，调整留存收益。

## （七）合营安排分类及共同经营会计处理方法

合营安排分为共同经营和合营企业。

当公司是合营安排的合营方，享有该安排相关资产且承担该安排相关负债时，为共

同经营。

公司确认与共同经营中利益份额相关的下列项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理：

- (1) 确认公司单独所持有的资产，以及按公司份额确认共同持有的资产；
- (2) 确认公司单独所承担的负债，以及按公司份额确认共同承担的负债；
- (3) 确认出售公司享有的共同经营产出份额所产生的收入；
- (4) 按公司份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；
- (5) 确认单独所发生的费用，以及按公司份额确认共同经营发生的费用。

公司对合营企业投资的会计政策见附注三（十四）长期股权投资

#### (八) 现金及现金等价物的确定标准

在编制现金流量表时，将公司库存现金以及可以随时用于支付的存款确认为现金。将同时具备期限短、流动性强、易于转换为已知现金、价值变动风险很小四个条件的投资，确定为现金等价物。

#### (九) 外币业务和外币报表折算

##### 1、 外币业务

公司对外币业务采用分账制进行核算。外币业务发生时，分别不同的币种按照原币记账。资产负债表日，分别外币货币性项目和外币非货币性项目进行处理：外币货币性项目按资产负债表日即期汇率（中国人民银行公布的人民币汇率中间价）折算，外币非货币性项目按交易日即期汇率折算，产生的汇兑差额计入当期损益。

##### 2、 境外经营实体外币财务报表的折算方法

境外经营实体的外币资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。外币利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日近似的汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，在编制合并财务报表时，在合并资产负债表中股东权益项目下“其他综合收益-外币报表折算差额”项目列示。

#### (十) 金融工具

金融工具包括金融资产、金融负债和权益工具。

权益工具是指能证明拥有公司在扣除所有负债后的资产中的剩余权益的合同。公司发行(含再融资)、回购、出售或注销权益工具作为权益的变动处理。公司不确认权

益工具的公允价值变动。与权益性交易相关的交易费用从权益中扣减。

## 1、金融资产和金融负债的分类

公司基于风险管理和投资策略及持有金融资产和承担金融负债的目的等原因、于初始确认时，将金融资产分为四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产；金融负债分为两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

## 2、金融资产和金融负债的确认依据和计量方法

### (1) 金融资产的确认依据和计量方法

#### A、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

公司持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，包括交易性金融资产、衍生金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

##### (a) 交易性金融资产

公司以赚取价差为目的而购入的股票、基金、债券等确认为交易性金融资产。这类金融资产按取得时的公允价值作为初始确认金额，交易费用均计入当期损益。支付的价款中包含已宣告发放的现金股利或债券利息，确认为应收项目。持有期间取得的利息或红利，确认为投资收益。资产负债表日，按期末公允价值与账面余额的差额确认公允价值变动损益，计入当期损益。处置时，其公允价值与初始入账金额之间的差额确认投资收益，同时调整公允价值变动损益。公司处置交易性金融资产，按加权平均法结转成本。

##### (b) 衍生金融资产

公司买入并持有的衍生性金融资产，如利率互换、场外期权、股指期货合约形成的资产等，确认为衍生金融资产。这类金融资产按取得时的公允价值作为初始确认金额，交易费用均计入当期损益。支付的价款中包含已宣告发放的现金股利或债券利息，确认为应收项目，持有期间取得的利息或红利，确认为投资收益。资产负债表日按期末公允价值与账面余额的差额确认公允价值变动损益，计入当期损益。处置时，其公允价值与初始入账金额之间的差额确认投资收益。

(c) 其他指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，同交易性金融资产的确认方法。

#### B、持有至到期投资

公司有明确意图持有至到期且具有固定或可确定收回金额及固定期限的非衍生性金融资产，确认为持有至到期投资。持有至到期投资按取得时实际支付价

款和相关交易费用之和作为初始确认金额。支付的价款中包含的已到付息期但尚未领取的债券利息，确认为应收项目。持有至到期投资在持有期间按照摊余成本和实际利率计算确认利息收入，计入投资收益。实际利率在取得时确定，在该预期存续期间或适用的更短期间内保持不变。实际利率与票面利率差别较小的，也可按票面利率计算利息收入，计入投资收益。

处置时，将所取得价款与该投资账面价值之间的差额计入投资收益。

#### C、贷款和应收款项

公司向客户发放的贷款和垫款以及通过信托公司、银行等投资的在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的信托产品、委托贷款、银行理财产品等非衍生金融资产，确认为贷款和应收款项，采用实际利率法，按摊余成本计量。公司通过提供服务或劳务，或代收代付证券清算款等业务形成的债权确认为应收款项。应收款项按向提供劳务对方应收的合同或协议价款，或代收代付金额等作为初始入账金额。公司收回应收款项后，按取得的价款与应收款项账面价值之间的差额，确认为当期损益。

#### D、可供出售金融资产

没有划分为上述三类金融资产的非衍生金融资产确认为可供出售金融资产。包括但不限于以下品种：①公司买入并持有的，未划分在上述三类金融资产的股票、基金、债券等；②公司持有的对上市公司不具有控制、共同控制或重大影响的限售股权；③公司持有的集合理财产品；④公司直接投资等业务形成的在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，确认为可供出售金融资产。

可供出售金融资产按取得时的公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额，支付的价款中包含已到付息期但尚未领取的债券利息或已宣告但尚未发放的现金股利，确认为应收项目。

可供出售金融资产持有期间取得的利息或现金股利，确认为投资收益。资产负债表日按期末公允价值与账面余额的差额确认其公允价值变动额，计入其他综合收益。

处置可供出售金融资产时，将取得的价款和该金融资产的公允价值之间的差额，计入投资收益。同时，将原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

### (2) 金融负债的确认依据和计量方法

#### A、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

公司承担的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债、衍生金融负债和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

负债。

金融负债按取得时的公允价值作为初始确认金额，交易费用计入当期损益。资产负债表日，按期末公允价值与账面余额的差额确认公允价值变动损益，计入当期损益。处置时，其公允价值与初始入账金额之间的差额确认投资收益。

#### B、其他金融负债

按其公允价值和相关交易费用之和作为初始确认金额。

以实际利率法计算的摊余成本进行后续计量。在其终止确认、摊销时产生的收益或损失，均计入当期损益。

(3) 公司有套期安排的、且符合套期保值会计运用条件的金融资产、金融负债，采用套期保值会计方法进行会计处理，确认为被套期项目或套期工具。

### 3、金融资产转移的确认依据和计量方法

公司发生金融资产转移时，如已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方，则终止确认该金融资产；如保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，则不终止确认该金融资产。

在判断金融资产转移是否满足上述金融资产终止确认条件时，采用实质重于形式的原则。公司将金融资产转移区分为金融资产整体转移和部分转移。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 所转移金融资产的账面价值；
- (2) 因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额（涉及转移的金融资产为可供出售金融资产的情形）之和。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 终止确认部分的账面价值；
- (2) 终止确认部分的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为可供出售金融资产的情形）之和。

金融资产转移不满足终止确认条件的，继续确认该金融资产，所收到的对价确认为一项金融负债。

#### 4、 金融负债终止确认条件

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，则终止确认该金融负债或其一部分；公司若与债权人签定协议，以承担新金融负债方式替换现存金融负债，且新金融负债与现存金融负债的合同条款实质上不同的，则终止确认现存金融负债，并同时确认新金融负债。

对现存金融负债全部或部分合同条款作出实质性修改的，则终止确认现存金融负债或其一部分，同时将修改条款后的金融负债确认为一项新金融负债。

金融负债全部或部分终止确认时，终止确认的金融负债账面价值与支付对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。公司若回购部分金融负债的，在回购日按照继续确认部分与终止确认部分的相对公允价值，将该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 5、 金融资产和金融负债公允价值的确定方法

金融资产及负债的市场活跃程度决定其流动性和市场价格有效性，而市场活跃程度又可以通过公允价值可观察程度体现出来。公司将金融资产及负债按照公允价值的可观察程度分为三个层次，并通过不同层次之间的转换，对损益、资产负债的影响，来评价目前金融资产及负债不同层次对公司整体流动性及市场价格有效性的影响。关于三个层次的具体内容详见本附注“八、公允价值的披露”。

#### 6、 金融资产（不含应收款项和融资类业务）减值准备计提

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产外，公司对资产负债表日相关金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明该金融资产发生减值的，则计提减值准备。

##### （1）持有至到期投资、贷款和应收款项的减值准备

公司对有客观证据表明发生减值的持有至到期投资或贷款和应收款项，根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间的差额计算确认减值准备。

##### （2）可供出售金融资产的减值准备

期末如果可供出售金融资产的公允价值发生较大幅度下降，或在综合考虑各种

相关因素后，预期这种下降趋势属于非暂时性的，例如可供出售金融资产的公允价值低于成本的 50%、或其公允价值低于成本的时间超过 1 年、或被投资单位经营所处的技术、市场、经济或法律环境等综合因素发生重大不利变化等，则该可供出售金融资产存在了客观减值证据，就认定其已发生减值，将原直接计入其他综合收益的公允价值下降形成的累计损失一并转出，确认减值损失。对于公司于中国证券金融股份有限公司设立的专户投资，鉴于该投资的目的、投资管理决策模式和处置的特殊性，公司以“出现持续 36 个月浮亏或资产负债表日浮亏 50%”，作为该投资计提减值准备的标准。

公司持有的在活跃市场中没有报价且公允价值不能可靠计量的存在减值迹象的权益工具投资，根据其账面价值与按类似金融资产当时市场收益率对未来现金流量折现确定的现值之间的差额确认减值损失，计入当期损益。

对于已确认减值损失的可供出售债务工具，在随后的会计期间公允价值已上升且客观上与确认原减值损失确认后发生的事项有关的，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。可供出售权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回。

#### (十一) 应收及其他应收款的坏账准备的确认标准、计提方法

##### 1、 坏账的确认标准

对因债务人撤销、破产，依照法律清偿程序后确实无法收回的应收及其他应收款；因债务人死亡，既无遗产可清偿，又无义务承担人，确实无法收回的应收及其他应收款；因债务人逾期未履行偿债义务并有确凿证据表明，确实无法收回的应收及其他应收款确认为坏账。

##### 2、 坏账损失的核算方法

采用备抵法核算。

##### 3、 坏账准备的计提方法和计提比例

期末如果有客观证据表明应收及其他应收款发生减值，则将其账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益。可收回金额是通过对其未来现金流量(不包括尚未发生的信用损失)按原实际利率折现确定。原实际利率是初始确认该应收及其他应收款时计算确定的实际利率。短期应收及其他应收款的预计未来现金流量与其现值相差很小，在确定相关减值损失时，不对其预计未来现金流量进行折现。

期末对于单项金额重大的应收及其他应收款单独进行减值测试。如有客观证据

表明其发生了重大减值的，根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，作为单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项，确认减值损失，计提坏账准备。

对于期末单项金额非重大的应收及其他应收款，采用与经单独测试后未减值的应收及其他应收款一起按类似信用风险特征划分为若干组合，再按这些应收及其他应收款组合在期末余额的一定比例（或可以单独进行减值测试）计算确定减值损失，计提坏账准备。信用风险组合以应收及其他应收款发生时间、历史经验和客户信用情况等为依据进行划分。

## (十二) 买入返售与卖出回购款项

买入返售交易按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括债券及票据），合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售按买入返售相关资产时实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”列示。卖出回购交易按照合同或协议，以一定的价格将相关的资产（包括债券和票据）出售给交易对手，到合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购按卖出回购相关资产时实际收到的款项入账，在资产负债表“卖出回购金融资产款”列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内，并按照相关的会计政策核算。

买入返售金融资产中，涉及向客户融出资金的，参照融资类业务的方法计提坏账准备。详见本附注三、“(三十三)融资融券业务”。

## (十三) 持有待售资产

公司将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：

- (1) 根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；
- (2) 出售极可能发生，即公司已经就一项出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。有关规定要求公司相关权力机构或者监管部门批准后方可出售的，已经获得批准。

## (十四) 长期股权投资

### 1、 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

共同控制，是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过公司与其他分享控制权的参与方一致同意后才能决策。公司与其他合营方一同对被投资单位实施共同控制且对被投资单位净资产享有权利的，被投资单位为公司的合营企业。

重大影响，是指对一个企业的财务和经营决策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。公司能够对被投资单位施加重大影响的，被投资单位为公司的联营企业。

## 2、投资成本确定

### (1) 企业合并形成的长期股权投资

同一控制下的企业合并：公司以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式以及以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的现金、转让的非现金资产以及所承担债务账面价值以及发行股份的面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。合并方以发行权益性证券作为合并对价的，应当在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份面值总额之间的差额，应当调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。合并发生的各项直接相关费用，包括为进行合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益。

非同一控制下的企业合并：公司按照购买日确定的合并成本作为长期股权投资的初始投资成本。合并成本为购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值。购买方为企业合并而发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用于发生时计入当期损益；作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

### (2) 其他方式取得的长期股权投资

以支付现金方式取得的长期股权投资，按照实际支付的购买价款作为初始投资成本。初始投资成本包括与取得长期股权投资直接相关的费用、税金及其他必要支出。

以发行权益性证券取得的长期股权投资，按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

在非货币性资产交换具备商业实质和换入资产或换出资产的公允价值能够可靠计量的前提下,非货币性资产交换换入的长期股权投资以换出资产的公允价值和应支付的相关税费为基础确定其初始投资成本,除非有确凿证据表明换入资产的公允价值更加可靠;不满足上述前提的非货币性资产交换,以换出资产的账面价值和应支付的相关税费作为换入长期股权投资的初始投资成本。

通过债务重组取得的长期股权投资,其初始投资成本按照公允价值为基础确定。公司以任何方式取得长期股权投资时,对于支付的对价中包含的应享有被投资单位已经宣告但尚未发放的现金股利或利润,确认为应收项目。

### 3、 后续计量及损益确认

#### (1) 后续计量

公司对被投资单位实施控制的长期股权投资,采用成本法核算,编制合并财务报表时按照权益法进行调整。采用成本法核算的长期股权投资应当按照初始投资成本计价。追加或收回投资应当调整长期股权投资的成本,其中追加或收回投资涉及对变更权益性投资核算方法的,参见下列“(3) 因部分追加长期股权投资涉及的投资成本的确定”、“(4) 长期股权投资的处置”对应的情形分别处理。

公司对被投资单位具有共同控制或重大影响的长期股权投资,采用权益法核算。初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的,不调整长期股权投资的初始投资成本;初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的,其差额计入当期损益,同时调整长期股权投资成本。

#### (2) 损益确认

成本法下,除取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润外,公司按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认投资收益。

权益法下,公司按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额,分别确认投资收益和其他综合收益,同时调整长期股权投资的账面价值;按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应享有的部分,相应减少长期股权投资的账面价值;对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动,应当调整长期股权投资的账面价值并计入所有者权益。

在确认被投资单位的净损益和其他综合收益的份额时，公司考虑以下因素：A、被投资单位采用的会计政策及会计期间一致或经调整后一致；B、被投资单位的折旧额或摊销额以取得投资时被投资单位固定资产、无形资产的公允价值为基础计提；C、抵销公司与联营企业、合营企业之间发生的未实现内部交易损益按照应享有的比例计算归属于公司的部分（合并财务报表还须考虑被合并子公司的相关影响）；D、相关资产减值损失的影响数。

在被投资单位发生的亏损时，按照以下顺序进行处理：A、冲减长期股权投资的账面价值，或其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益账面价值为限确认投资损失；B、按照投资合同或协议约定企业仍承担额外义务的，按预计承担的义务确认预计负债，计入当期投资损失。被投资单位以后期间实现盈利的，公司按与上述相反的顺序处理，减记已确认预计负债的账面余额、恢复其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益及长期股权投资的账面价值，同时确认投资收益。

### （3）因部分追加长期股权投资涉及的投资成本的确定

因追加投资等原因能够对被投资单位施加重大影响或实施共同控制但不构成控制的，在编制个别财务报表时，公司按照原持有的股权投资对应的金融资产公允价值加上新增投资成本之和，作为改按权益法核算的初始投资成本。原持有的股权投资分类为可供出售金融资产的，其公允价值与账面价值之间的差额，以及原计入其他综合收益的累计公允价值变动转入改按权益法核算的当期损益。

因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的，公司按照原持有的股权投资账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。控制日之前持有的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在处置该项投资时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。控制日之前持有的股权投资分类为可供出售金融资产的，原计入其他综合收益的累计公允价值变动在改按成本法核算时转入当期损益。公司按照会计政策规定编制合并财务报表。

### （4）长期股权投资的处置

#### ①长期股权投资处置的一般规定

处置长期股权投资，其账面价值与实际取得价款的差额，计入当期损益。采用权益法核算的长期股权投资，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础，按相应比例对原计入其他综合收益的部分进行会计处理。因被投资单

位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动而计入所有者权益的，处置该项投资时将原计入所有者权益的部分按相应比例转入当期损益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

②因部分处置长期股权投资，丧失了对原有子公司控制权的业务

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，在合并财务报表，按照合并财务报表的编制方法的相关规定进行会计处理；在个别财务报表，按处置投资的比例结转应终止确认的长期股权投资成本，对剩余股权则根据处置后的情况分别按权益法或金融资产进行确认。

处置后的剩余股权不能对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，改按可供出售金融资产进行确认和计量。

处置后的剩余股权能够对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，仍在长期股权投资中改按权益法核算，并对该剩余股权视同自取得时即采用权益法核算分别调整剩余长期股权投资的成本、投资收益和其他综合收益、其他账面价值变动。

丧失控制权之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。

③因部分处置长期股权投资，失去对被投资单位的共同控制或重大影响的业务因处置部分股权投资等原因丧失了对被投资单位的共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量，其在丧失共同控制或重大影响之日的公允价值与账面价值之间的差额计入当期损益。原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在终止采用权益法核算时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。因被投资方除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动而确认的所有者权益，在终止采用权益法核算时全部转入当期损益。

#### 4、 减值测试方法及减值准备计提方法

公司在资产负债表日判断长期股权投资是否存在可能发生减值的迹象。

除因企业合并形成的商誉以外的存在减值迹象的其他长期股权投资，如果可收回金额的计量结果表明，该长期股权投资的可收回金额低于其账面价值的，将差额确认为减值损失。

因企业合并形成的商誉，无论是否存在减值迹象，每年都进行减值测试。

长期股权投资减值损失一经确认，不再转回。

## (十五) 投资性房地产

投资性房地产是指为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产，包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权、已出租的建筑物（含自行建造或开发活动完成后用于出租的建筑物以及正在建造或开发过程中将来用于出租的建筑物）。

公司对投资性房地产采用成本模式计量。对按照成本模式计量的投资性房地产一出租用建筑物采用与公司固定资产相同的折旧政策，出租用土地使用权采用与无形资产相同的摊销政策。

公司在资产负债表日判断投资性房地产是否存在可能发生减值的迹象，对存在减值迹象的投资性房地产，估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的，将投资性房地产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为投资性房地产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的投资性房地产减值准备。

投资性房地产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

## (十六) 固定资产

### 1、 固定资产确认条件

固定资产指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有，并且使用寿命超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足下列条件时予以确认：

- (1)与该固定资产有关的经济利益很可能流入企业；
- (2)该固定资产的成本能够可靠地计量。

### 2、 各类固定资产的折旧方法

固定资产折旧采用年限平均法分类计提，根据固定资产类别、预计使用寿命和预计净残值率确定折旧率。

各类固定资产折旧年限、残值率和年折旧率如下：

| 类别          | 折旧年限（年） | 残值率（%） | 年折旧率（%）     |
|-------------|---------|--------|-------------|
| 房屋及建筑物      | 30-40   | 3-5    | 2.38-3.23   |
| 机器设备        | 5-11    | 3-10   | 8.82-19.40  |
| 交通运输设备      | 5-8     | 3-10   | 11.88-18.00 |
| 电子通讯设备      | 3-5     | 3-10   | 18.00-32.33 |
| 经营租赁固定资产(注) | 22      | 5-15   | 3.40-6.33   |

注：经营租赁固定资产为飞机，用于子公司开展经营租赁业务。子公司根据飞机的机型等实际情况，确定折旧年限、折旧方法及预计净残值。

如固定资产各组成部分的使用寿命不同或者以不同方式为企业 提供经济利益，则选择不同折旧率或折旧方法，分别计提折旧。

融资租赁方式租入的固定资产，能合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁资产尚可使用年限内计提折旧；无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，在租赁期与租赁资产尚可使用年限两者中较短的期间内计提折旧。

### 3、 固定资产的减值测试方法、减值准备计提方法

公司在资产负债表日判断固定资产是否存在可能发生减值的迹象。

固定资产存在减值迹象的，估计其可收回金额。可收回金额根据固定资产的公允价值减去处置费用后的净额与固定资产预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定。

当固定资产的可收回金额低于其账面价值的，将固定资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为固定资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的固定资产减值准备。

固定资产减值损失确认后，减值固定资产的折旧在未来期间作相应调整，以使该固定资产在剩余使用寿命内，系统地分摊调整后的固定资产账面价值（扣除预计净残值）。

固定资产的减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

有迹象表明一项固定资产可能发生减值的，公司以单项固定资产为基础估计其可收回金额。公司难以对单项固定资产的可收回金额进行估计的，以该固定资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。

## (十七) 在建工程

### 1、 在建工程的分类

在建工程按立项的项目分类进行会计核算。

### 2、 在建工程结转为固定资产的标准和时点

在建工程项目按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的全部支出，作为固定资产的入账价值。所建造的固定资产在建工程已达到预定可使用状态，但尚未办理竣工决算的，自达到预定可使用状态之日起，根据工程预算、造价或者工程实际成本等，按估计的价值转入固定资产，并按公司固定资产折旧政策计提固定资产的折旧，待办理竣工决算后，再按实际成本调整原来的暂估价值，但不调整原已计提的折旧额。

### 3、 在建工程的减值测试方法、减值准备计提方法

公司在资产负债表日判断在建工程是否存在可能发生减值的迹象。

在建工程存在减值迹象的，估计其可收回金额。可收回金额根据在建工程的公允价值减去处置费用后的净额与在建工程预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定。

当在建工程的可收回金额低于其账面价值的，将在建工程的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为在建工程减值损失，计入当期损益，同时计提相应的在建工程减值准备。

在建工程的减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

有迹象表明一项在建工程可能发生减值的，公司以单项在建工程为基础估计其可收回金额。公司难以对单项在建工程的可收回金额进行估计的，以该在建工程所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。

## (十八) 借款费用

借款费用，包括借款利息、折价或者溢价的摊销、辅助费用以及因外币借款而发生的汇兑差额等。

公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时根据其发生额确认为费用，计入当期损益。

符合资本化条件的资产，是指需要经过相当长时间的购建或者生产活动才能达到预定可使用或者可销售状态的固定资产、投资性房地产和存货等资产。

借款费用同时满足下列条件时开始资本化：

- (1) 资产支出已经发生，资产支出包括为购建或者生产符合资本化条件的资产而以支付现金、转移非现金资产或者承担带息债务形式发生的支出；
- (2) 借款费用已经发生；
- (3) 为使资产达到预定可使用或者可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

## (十九) 无形资产

### 1、 无形资产的计价方法

#### (1) 初始计量

无形资产一般按取得时的实际成本入账。

外购无形资产的成本，包括购买价款、相关税费以及直接归属于使该项资产达到预定用途所发生的其他支出。购买无形资产的价款超过正常信用条件延期支付，实质上具有融资性质的，无形资产的成本以购买价款的现值为基础确定。

债务重组取得债务人用以抵债的无形资产,以该无形资产的公允价值为基础确定其入账价值,并将重组债务的账面价值与该用以抵债的无形资产公允价值之间的差额,计入当期损益。

在非货币性资产交换具备商业实质且换入资产或换出资产的公允价值能够可靠计量的前提下,非货币性资产交换换入的无形资产以换出资产的公允价值为基础确定其入账价值,除非有确凿证据表明换入资产的公允价值更加可靠;不满足上述前提的非货币性资产交换,以换出资产的账面价值和应支付的相关税费作为换入无形资产的成本,不确认损益。

以同一控制下的企业吸收合并方式取得的无形资产按在最终控制方合并财务报表中的账面价值确定其入账价值;以非同一控制下的企业吸收合并方式取得的无形资产按公允价值确定其入账价值。

(2) 后续计量

公司在取得无形资产时分析判断其使用寿命。

对于使用寿命有限的无形资产,在为企业带来经济利益的期限内按直线法摊销;无法预见无形资产为公司带来经济利益期限的,视为使用寿命不确定的无形资产,不予摊销。

**2、 使用寿命有限的无形资产的使用寿命估计情况**

| 项 目   | 预计使用寿命  | 依据          |
|-------|---------|-------------|
| 软件    | 3-10 年  | 合同约定或法定使用年限 |
| 房屋使用权 | 10-50 年 | 合同约定或法定使用年限 |
| 车位使用权 | 10 年    | 合同约定或法定使用年限 |
| 其他    | 5-10 年  | 合同约定或法定使用年限 |

每年末,对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核。

**3、 使用寿命不确定的无形资产的判断依据**

| 项 目   | 判断依据          |
|-------|---------------|
| 交易席位费 | 交易所-交易席位费管理规定 |

每年末,对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。

经复核,该类无形资产的使用寿命仍为不确定。

#### 4、 无形资产减值准备的计提

对于使用寿命有限的无形资产，如有确凿证据表明存在减值迹象的，在资产负债表日进行减值测试。

对于使用寿命不确定的无形资产，每年进行减值测试。

对无形资产进行减值测试，估计其可收回金额。可收回金额根据无形资产的公允价值减去处置费用后的净额与无形资产预计未来现金流量的现值两者之间较高者确定。

当无形资产的可收回金额低于其账面价值的，将无形资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为无形资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的无形资产减值准备。

无形资产减值损失确认后，减值无形资产的摊销费用在未来期间作相应调整，以使该无形资产在剩余使用寿命内，系统地分摊调整后的无形资产账面价值。无形资产的减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

若有迹象表明一项无形资产可能发生减值的，公司以单项无形资产为基础估计其可收回金额。公司难以对单项无形资产的可收回金额进行估计的，以该无形资产所属的资产组为基础确定无形资产组的可收回金额。

#### (二十) 长期待摊费用

长期待摊费用为已经发生但应由本期和以后各期负担的分摊期限在一年以上的各项费用。公司长期待摊费用包括预付经营租入固定资产的租金、经营租赁方式租入的固定资产改良支出。

##### 1、 摊销方法

长期待摊费用在受益期内平均摊销。

##### 2、 摊销年限

预付经营租入固定资产的租金，按租赁合同规定的期限平均摊销。

经营租赁方式租入的固定资产改良支出，按剩余租赁期与租赁资产尚可使用年限两者中较短的期限平均摊销。

融资租赁方式租入的固定资产的符合资本化条件的装修费用，按两次装修间隔期间、剩余租赁期与固定资产尚可使用年限三者中较短的期限平均摊销。

#### (二十一) 抵债资产

抵债资产是指债务重组取得的债务人用以抵债的非现金资产，该项资产尚未转为公司自用。抵债资产取得时按其公允价值入账，并将重组债权的账面价值与该抵债资产公允价值之间的差额，计入当期损益。

公司在资产负债表日判断抵债资产是否存在可能发生减值的迹象，对存在减值迹象的抵债资产，估计其可收回金额，可收回金额低于其账面价值的，将抵债资产的账面价值减记至可收回金额，减记的金额确认为抵债资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的抵债资产减值准备。

抵债资产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

## (二十二) 商誉

非同一控制下企业合并时，对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉。

商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。

公司对商誉不摊销，商誉至少在每年年度终了进行减值测试。

公司进行商誉减值测试，对于因企业合并形成的商誉的账面价值，自购买日起按照合理的方法分摊至相关的资产组；难以分摊至相关的资产组的，将其分摊至相关的资产组组合。在将商誉的账面价值分摊至相关的资产组或者资产组组合时，按照各资产组或者资产组组合的公允价值占相关资产组或者资产组组合公允价值总额的比例进行分摊。公允价值难以可靠计量的，按照各资产组或者资产组组合的账面价值占相关资产组或者资产组组合账面价值总额的比例进行分摊。

在对包含商誉的相关资产组或者资产组组合进行减值测试时，如与商誉相关的资产组或者资产组组合存在减值迹象的，先对不包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，计算可收回金额，并与相关账面价值相比较，确认相应的减值损失。再对包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，比较这些相关资产组或者资产组组合的账面价值（包括所分摊的商誉的账面价值部分）与其可收回金额，如相关资产组或者资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认商誉的减值损失。商誉减值损失在发生时计入当期损益，且在以后会计期间不予转回。

## (二十三) 递延所得税资产和递延所得税负债

对于可抵扣暂时性差异确认递延所得税资产，以未来期间很可能取得的用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。对于能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减，以很可能获得用来抵扣可抵扣亏损和税款抵减的未来应纳税所得额为限，确认相应的递延所得税资产。

对于应纳税暂时性差异，除特殊情况外，确认递延所得税负债。

不确认递延所得税资产或递延所得税负债的特殊情况包括：商誉的初始确认；除企业合并以外的发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）的其他交易或事项。

## (二十四) 职工薪酬

职工薪酬，是指企业为获得职工提供的服务或解除劳动关系而给予的各种形式的报酬或补偿。公司的职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

### 1、 短期薪酬

短期薪酬具体包括：职工工资、奖金、津贴和补贴，职工福利费，医疗保险费、工伤保险费和生育保险费等社会保险费，住房公积金，工会经费和职工教育经费，短期带薪缺勤，短期利润分享计划，非货币性福利以及其他短期薪酬。

在职工为公司提供服务的会计期间，公司将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

对预期不在资产负债表日后十二个月内支付的利润分享计划，公司按照其他长期职工福利的有关规定披露。

### 2、 离职后福利

公司实施离职后福利计划，包括为职工缴纳基本养老保险和失业保险、建立企业年金缴费制度。公司以当地规定的缴纳基数和比例计算的应缴纳金额、或按缴费计划应计缴的金额，确认负债，并计入当期损益或相关资产成本。

### 3、 辞退福利

公司在不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时，或确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时（两者孰早），确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益。

### 4、 其他长期职工福利

在职工提供服务的会计期间，公司为职工计提长效激励奖金，确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

## (二十五) 预计负债

### 1、 预计负债的确认标准

与或有事项相关的义务同时满足下列条件时，公司确认为预计负债：该义务是公司承担的现时义务；履行该义务很可能导致经济利益流出公司；该义务的金额能够可靠地计量。

## 2、 预计负债的计量方法

公司预计负债按履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。

公司在确定最佳估计数时，综合考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。对于货币时间价值影响重大的，通过对相关未来现金流出进行折现后确定最佳估计数。

最佳估计数分别以下情况处理：

所需支出存在一个连续范围（或区间），且该范围内各种结果发生的可能性相同的，则最佳估计数按照该范围的中间值即上下限金额的平均数确定。

所需支出不存在一个连续范围（或区间），或虽然存在一个连续范围但该范围内各种结果发生的可能性不相同的，如或有事项涉及单个项目的，则最佳估计数按照最可能发生金额确定；如或有事项涉及多个项目的，则最佳估计数按各种可能结果及相关概率计算确定。

公司清偿预计负债所需支出全部或部分预期由第三方补偿的，补偿金额在基本确定能够收到时，作为资产单独确认，确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

### (二十六) 股份支付

股份支付是为了获取职工或其他方提供服务而授予权益工具或者承担以权益工具为基础确定的负债的交易。公司下属公司施行的是以权益结算的股份支付，以授予职工权益工具的公允价值计量。

授予后即可行权的，在授予日按照公允价值计入相关成本或费用，相应增加资本公积；完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的，在等待期内每个资产负债表日，公司根据最新取得的可行权职工人数变动等后续信息对可行权权益工具数量作出最佳估计为基础，按照授予日的公允价值，将当期取得的服务计入相关成本或费用，相应增加资本公积。在可行权日之后不再对已确认的相关成本或费用和所有者权益总额进行调整。

公司将满足服务期限条件的期间作为等待期，在每个资产负债表日确认和计量股份支付相关的交易。

### (二十七) 盈余公积计提

公司按照净利润（减弥补亏损）的 10%计提法定盈余公积；按照公司章程或者股东大会决议提取任意盈余公积。

## (二十八) 一般风险准备计提

公司的一般风险准备分为一般（风险）准备和交易风险准备。公司按照净利润（减弥补亏损）的 10% 计提一般（风险）准备，按照不低于净利润（减弥补亏损）的 10% 计提交易风险准备。

## (二十九) 收入

### 1、 手续费及佣金收入

#### (1) 代理客户买卖证券的手续费收入

在与客户办理买卖证券款项清算时确认收入；手续费收取的依据和标准为根据成交金额及代买卖的证券品种按相应的费率收取。

#### (2) 证券承销业务收入

核算公司采用全额承购包销方式代理发行证券的发行收入，或采用代销方式和余额承购包销方式代理发行证券收取的手续费收入。它的确认主要以证券承销项目结束，根据承销协议、实际证券承销数量和收取比例等收取承销手续费后确认。

其中证券保荐业务收入和财务顾问收入于各项业务提供的相关服务完成时按权责发生制确认收入。

#### (3) 受托客户资产管理业务收入

于受托投资管理合同到期，与委托人结算时，按合同规定的比例计算应由公司享有的管理费收益，确认为当期收益；或合同中规定公司按约定比例收取管理费和业绩报酬，则在合同期内分期确认管理费和业绩报酬收益。

### 2、 利息收入

存款利息收入：在相关的收入金额能够可靠地计量，相关的经济利益可以收到时，按资金使用时间和实际利率确认利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

融资融券业务利息收入：根据与客户合约的约定，按出借资金或证券的时间和约定利率确认收入；

买入返售证券收入：在买入与返售在同一会计期间的，按返售价格与买入成本价格的差额，确认为当期收入；在不同会计期间的，按权责发生制计提利息确认为相关期间的收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率确认为当期收入。

### 3、 投资收益

公司持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售金融资产期间取得的红利、股息或现金股利确认当期收益；处置可供出售金融资产时所取得价款与该金融资产的账面价值之间的差额，计入投资收益；处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产其公允价值与初始入帐金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。

采用成本法核算长期股权投资的，按被投资单位宣告发放的现金股利或利润中属于公司的部分确认收益；采用权益法核算长期股权投资的，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

### 4、 公允价值变动损益

公司对以公允价值计量且其变动进入当期损益的金融资产或金融负债等在资产负债表日因公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债等时，将原计入该金融资产、金融负债的公允价值变动从公允价值变动损益转入投资收益。

### 5、 其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入，在同时满足：收入的金额能够可靠地计量、相关的经济利益很可能流入公司、交易的完工进度能够可靠地确定、交易中已发生和将发生的成本能够可靠地计量的条件下，按照有关合同或协议约定的收费时间和方法计算确认当期收入。

## (三十) 政府补助

### 1、 类型

政府补助，是公司从政府无偿取得的货币性资产与非货币性资产，分为与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。

### 2、 会计处理方法

政府补助在能够满足政府补助所附条件，并能够收到时，予以确认。公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助作为与资产相关的政府补助。公司取得的与资产相关之外的其他政府补助作为与收益相关的政府补助。与资产相关的政府补助，公司将其确认为递延收益，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。与收益相关的政府补助，如果用于补偿本集团以后期间的相关费用或损失的，公司将其确认为递延收益，并在确认相关费用的期间，计入当期损益；如果用于补偿公司已发生的相关费用或损失的，则直接计入当期损益。

与企业日常活动相关的政府补助，应当按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用。与企业日常活动无关的政府补助，应当计入营业外收支。

### (三十一) 租赁

出租人实质上转移了与资产所有权有关的全部风险和报酬的租赁为融资租赁。融资租赁以外的其他租赁为经营租赁。

#### 1、 融资租赁

##### (1) 融资租入资产：

在承租开始日，公司作为承租人，将租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值之间较低者，加上公司发生的初始直接费用，作为租入资产的入账价值；将最低租赁付款额作为长期应付款的入账价值，其差额作为未确认融资费用。

公司在资产租赁期间内，对未确认融资费用以实际利率法摊销，计入财务费用。

##### (2) 融资租出资产：

在租赁期开始日，公司作为出租人，将最低租赁收款额与初始直接费用之和确认为应收融资租赁款；将最低租赁收款额、初始直接费用及未担保余值之和，与租出资产价值的差额，确认为未实现融资收益

公司在租赁期内，对未实现融资收益以实际利率法分配确认相应期间的融资收入；或有租金于实际发生时计入当期损益。

售后租回交易是指资产卖主(承租人)将资产出售后再从买主(出租人)租回的交易。公司按照租赁准则的规定，将售后租回交易认定为融资租赁或经营租赁。

#### 2、 经营租赁

##### (1) 公司租入资产

作为承租人，公司租入资产所支付的租赁费，在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法进行分摊，计入当期费用。公司支付的与租赁交易相关的初始直接费用，计入当期费用。

资产出租方承担了应由公司承担的与租赁相关的费用时，公司将该部分费用从租金总额中扣除，按扣除后的租金费用在租赁期内分摊，计入当期费用。

##### (2) 公司出租资产

作为出租人，公司出租资产所收取的租赁费，在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法进行分摊，确认为租赁收入。公司支付的与租赁交易相关的初始直接费用，计入当期费用；如金额较大的，则予以资本化，在整个租赁期间内按照与租赁收入确认相同的基础分期计入当期收益。

公司承担了应由承租方承担的与租赁相关的费用时，公司将该部分费用从租金收入总额中扣除，按扣除后的租金费用在租赁期内分配。

### (三十二) 套期会计

套期保值分为公允价值套期、现金流量套期和境外经营净投资套期。

公司运用套期会计的条件：1、在套期开始时，公司对套期关系有正式指定，并准备了关于套期关系、风险管理目标和套期策略的正式书面文件。该文件载明了套期工具、被套期项目或交易，被套期风险的性质，以及公司对套期工具有效性评价方法。2、该套期预期高度有效，且符合公司最初为该套期关系所确定的风险管理策略。3、套期有效性能够可靠的计量，即被套期风险引起的被套期项目的公允价值以及套期工具的公允价值能够可靠地计量。4、公司持续地对套期有效性进行评价，并确保该套期在套期关系被指定的会计期间内高度有效。

套期满足下列条件之一的，公司终止运用套期会计：1、套期工具已到期、被出售、合同终止或已行使；2、该套期不再满足运用套期会计方法的条件；3、公司撤销了对套期关系的指定。

### (三十三) 融资融券业务

公司融资融券业务中，将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。融出资金按借给客户资金的本金计量。

公司融资融券业务中，将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，确认为融出证券。此项业务融出的证券不满足终止确认条件，继续确认该金融资产；同时确认一项债权（融出证券）。

融资融券利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等按期确认利息收入。

公司对融资类业务计提坏账准备，包括专项坏账准备和一般坏账准备。对于有充分客观证据、可识别具体损失的融资类项目，公司根据客户状况和可能损失金额，分析交易对手的资产运作、抵押证券、担保比例以及偿债能力等，采用专门的方法对资产进行单独减值测试，依此计提专项坏账准备。对未计提专项坏账准备的融资类业务，根据风险分类、按业务规模的一定比例计提一般坏账准备，用于弥补可能的损失。

### (三十四) 客户资产管理业务的核算方法

公司客户资产管理业务分为集合资产管理业务、定向资产管理业务及专项资产管理业务。

公司集合资产管理业务及专项资产管理业务的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行。对所管理的不同集合资产计划以每个产品为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务会计报告。不同集合资产计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

公司受托经营定向资产管理业务，按实际受托管理客户资产的金额，同时确认一项资产和一项负债；定向资产管理业务的客户资产进行证券买卖比照代买卖证券业务进行核算。

### (三十五) 关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可以为个人或企业。仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成公司的关联方。

### (三十六) 分部报告

公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。经营分部，是指公司内同时满足下列条件的组成部分：

- 1、该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 2、公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 3、公司能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部存在相似经济特征且同时具有相同或相似性的经营方式，可以合并为一个经营分部。

### (三十七) 资产证券化业务

公司将部分应收融资租赁款证券化，将基础资产出售给特定目的实体，由该实体向投资者发行优先级资产支持证券，公司认购次级资产支持证券，次级资产支持证券在优先级资产支持证券本息偿付完毕前不得转让。公司作为资产服务商，提供资产维护、日常管理和定期编制资产服务报告等服务。基础财产对应的应收融资租赁款在支付税负和相关费用之后，优先用于偿付优先级资产支持证券的本息，全部本息偿付之后剩余的基础财产对应的应收融资租赁款作为次级资产支持证券的收益，归公司所有。

在运用证券化金融资产的会计政策时，公司已考虑转移至其他实体的资产的风险和报酬转移程度，以及公司对该实体行使控制权的程度：

- ①当公司已转移该金融资产所有权上几乎全部风险和报酬时，公司将终止确认该金融资产；
- ②当公司保留该金融资产所有权上几乎全部风险和报酬时，公司将继续确认该金融资产；
- ③如公司既未转移也未保留该金融资产所有权上几乎全部风险和报酬，公司将考虑对该金融资产是否存在控制。如果公司并未保留控制权，公司将终止确认该金融资产，并把在转移中产生或保留的权利及义务分别确认为资产或负债。如公司保留控制权，则根据对金融资产的继续涉入程度确认金融资产，并相应确认有关负债。

### (三十八) 重要会计政策的确定依据以及会计估计中所采用的关键假设和不确定因素

#### 1、 重要会计政策的确定依据

公司重要会计政策的确定是依据财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和相关具体会计准则等配套文件，作为公司财务报表的编制基础。详见本附注“二、财务报表的编制基础”。

#### 2、 运用会计政策中，需要会计估计所采用的关键假设和不确定因素

##### (1) 金融资产和金融负债公允价值的确定方法

除存在活跃市场、且资产负债表日有成交市价的投资品种，公司对下列证券均采用估值方法。

- ①虽存在活跃市场，但资产负债表日无成交市价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的
- ②交易所首次发行未上市的股票、债券和权证等；
- ③非公开发行有明确锁定期的股票；
- ④对交易明显不活跃的、交易市价无法真实反映投资品种价值的或交易所停止交易的投资品种等。
- ⑤其他需要估值获取公允价值的金融产品。

针对上述项目，公司在谨慎性原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定该投资品种的公允价值。

##### (2) 金融资产（不含应收款项和融资类业务）的减值

公司对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，若有客观证据表明该金融资产发生减值的，则计提减值准备。其中权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回。

这些金融资产包括持有至到期投资、贷款和应收款项和可供出售金融资产的减值准备。公司对有减值迹象的持有至到期投资、贷款和应收款项，根据预计现金流量的现值估计减值金额；对有减值迹象的可供出售金融资产，根据公允价值下降形成的累计损失估计减值金额。具体详见本附注三、“(十)金融工具”之“6、金融资产（不含应收款项和融资类业务）减值准备计提”。

### (3) 商誉的减值

公司至少在每年年度终了测试商誉的减值。如与商誉相关的资产组或者资产组组合存在减值迹象的，如相关资产组或者资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认商誉的减值损失。具体详见本附注三、“(二十二)商誉”。

### (4) 应收及其他应收款项的坏账准备

公司应收及其他应收款项对结算资金往来，单独或按组合进行减值测试。根据预计未来的现金流量计算可收回金额，估计减值准备。可参见本附注三、“(十一)应收及其他应收款项的坏账准备的确认标准、计提方法”。

### (5) 融资类业务坏账准备

公司对融出资金业务和买入返售金融资产等融资类业务计提坏账准备。详见本附注三、“(三十三)融资融券业务”。

### (6) 所得税计算

在计提所得税时公司需进行大量的估计工作。日常经营活动中很多交易的最终税务处理存在不确定性。对于可预计的税务问题，公司基于是否需要缴纳额外税款的估计确认相应的负债。如果这些税务事项的最终结果同以往估计的金额存在差异，则该差异将对其认定期间的所得税和递延税款的确定产生影响。

## (三十九) 重要会计政策和会计估计的变更

本报告期公司无重大会计政策和会计估计变更。

关于会计政策变更的情况详见附注十三、“(五) 关于会计政策变更的议案”。

#### 四、 税项

##### 主要税种及税率

| 税 种     | 计税依据                                      | 税率              | 说明  |
|---------|---|-----------------|-----|
| 增值税     | 按应税收入为基础计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税 | 6%、11%、13%和 17% | 注 1 |
| 城市维护建设税 | 按实际缴纳的增值税计缴                               | 1%或 7%          |     |
| 教育费附加   | 按实际缴纳的增值税计缴                               | 3%              |     |
| 地方教育费附加 | 按实际缴纳的增值税计缴                               | 2%              |     |
| 企业所得税   | 按应纳税所得额计缴                                 | 25%、16.5%       | 注 2 |

注 1：增值税

1、根据财政部、国家税务总局财税 [2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，公司由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2、根据《关于简并增值税税率有关政策的通知财税》(2017) 37 号文件，自 2017 年 7 月 1 日起，简并增值税税率结构，取消 13%的增值税税率，纳税人销售或者进口农产品（含粮食）等货物，税率为 11%。

注 2：企业所得税

1、公司及所属境内子公司的企业所得税税率为 25%，所属香港子公司按 16.5%的综合利得税率执行，其他境外子公司按当地所得税税率缴纳。

2、根据《国家税务总局关于印发<跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法>的公告》（国家税务总局公告 2012 年第 57 号）文件的有关规定，公司实行“统一计算、分级管理、就地预缴、汇总清算、财政调库”的企业所得税征收管理办法。

#### 五、 合并财务报表项目注释

##### (一) 货币资金

##### 1、 按类别列示

| 项 目     | 期末余额              | 年初余额               |
|---------|-------------------|--------------------|
| 库存现金    | 438,761.45        | 336,330.28         |
| 银行存款    | 99,491,654,103.76 | 119,821,860,328.07 |
| 其中：客户存款 | 70,213,568,864.14 | 87,496,620,324.19  |
| 公司存款    | 29,278,085,239.62 | 32,325,240,003.88  |
| 其他货币资金  | 857,937,882.52    | 928,251,291.52     |

| 项 目            | 期末余额               | 年初余额               |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 存放中央银行款项       | 3,445,696,109.57   | 274,303,425.07     |
| 其中：存放中央银行法定准备金 | 29,781,380.43      | 14,102,116.30      |
| 存放中央银行超额存款准备金  | 3,415,914,729.14   | 260,201,308.77     |
| 合 计            | 103,795,726,857.30 | 121,024,751,374.94 |

## 2、 按币种列示

| 项 目      | 期末余额              |         |                   | 期初余额              |         |                   |
|----------|-------------------|---------|-------------------|-------------------|---------|-------------------|
|          | 外币金额              | 折算率     | 人民币金额             | 外币金额              | 折算率     | 人民币金额             |
| 库存现金：    |                   |         |                   |                   |         |                   |
| 人民币      |                   |         | 101,804.62        |                   |         | 62,684.07         |
| 美 元      | 315.36            | 6.5342  | 2,060.63          | 1,653.88          | 6.937   | 11,472.97         |
| 港 币      | 199,006.71        | 0.83591 | 166,351.70        | 220,513.64        | 0.89451 | 197,251.66        |
| 欧 元      | 8,905.37          | 7.8023  | 69,482.37         | 8,885.09          | 7.3068  | 64,921.58         |
| 其 他      |                   |         | 99,062.13         |                   |         |                   |
| 小 计      |                   |         | 438,761.45        |                   |         | 336,330.28        |
| 银行存款：    |                   |         |                   |                   |         |                   |
| 其中：客户资金： |                   |         |                   |                   |         |                   |
| 人民币      |                   |         | 49,656,403,765.11 |                   |         | 64,011,914,713.82 |
| 美 元      | 568,444,203.50    | 6.5342  | 3,714,328,114.51  | 1,163,385,356.18  | 6.937   | 8,070,404,215.82  |
| 港 币      | 14,389,697,890.10 | 0.83591 | 12,028,492,363.31 | 11,830,126,200.24 | 0.89451 | 10,582,166,187.38 |
| 其 他      |                   |         | 597,500,516.61    |                   |         | 91,142,076.71     |
| 小 计      |                   |         | 65,996,724,759.54 |                   |         | 82,755,627,193.73 |
| 客户信用资    |                   |         |                   |                   |         |                   |
| 金：       |                   |         |                   |                   |         |                   |
| 人民币      |                   |         | 4,216,844,104.60  |                   |         | 4,740,993,130.46  |
| 小 计      |                   |         | 4,216,844,104.60  |                   |         | 4,740,993,130.46  |
| 客户存款合计   |                   |         | 70,213,568,864.14 |                   |         | 87,496,620,324.19 |
| 公司自有资金：  |                   |         |                   |                   |         |                   |
| 人民币      |                   |         | 24,458,133,479.70 |                   |         | 24,859,211,060.73 |
| 美 元      | 244,629,739.59    | 6.5342  | 1,598,459,644.43  | 355,169,778.95    | 6.937   | 2,463,812,756.58  |
| 港 币      | 3,037,576,177.60  | 0.83591 | 2,539,140,302.62  | 4,857,095,433.16  | 0.89451 | 4,344,720,435.92  |
| 欧 元      | 33,965,010.11     | 7.8023  | 265,005,198.38    | 78,116,625.37     | 7.3068  | 570,782,558.25    |

| 项 目       | 期末余额           |         |                    | 期初余额          |         |                    |
|-----------|----------------|---------|--------------------|---------------|---------|--------------------|
|           | 外币金额           | 折算率     | 人民币金额              | 外币金额          | 折算率     | 人民币金额              |
| 其 他       |                |         | 417,346,614.49     |               |         | 86,713,192.40      |
| 小 计       |                |         | 29,278,085,239.62  |               |         | 32,325,240,003.88  |
| 公司存款合计    |                |         | 29,278,085,239.62  |               |         | 32,325,240,003.88  |
| 其他货币资金:   |                |         |                    |               |         |                    |
| 人民币       |                |         | 370,999,144.26     |               |         | 890,611,482.30     |
| 美 元       | 74,521,538.92  | 6.5342  | 486,938,639.61     | 4,732,646.17  | 6.937   | 32,830,366.48      |
| 港 币       | 118.02         | 0.83591 | 98.65              | 5,376,622.67  | 0.89451 | 4,809,442.74       |
| 其 他       |                |         |                    |               |         |                    |
| 小 计       |                |         | 857,937,882.52     |               |         | 928,251,291.52     |
| 存放中央银行款项: |                |         |                    |               |         |                    |
| 人民币       |                |         |                    |               |         |                    |
| 美 元       |                |         |                    | 20,132.75     | 6.937   | 139,660.89         |
| 欧 元       | 438,668,224.48 | 7.8023  | 3,422,621,087.86   | 37,518,332.95 | 7.3068  | 274,138,955.20     |
| 其 他       |                |         | 23,075,021.71      |               |         | 24,808.98          |
| 小 计       |                |         | 3,445,696,109.57   |               |         | 274,303,425.07     |
| 合 计       |                |         | 103,795,726,857.30 |               |         | 121,024,751,374.94 |

3、 截止 2017 年 12 月 31 日，受限制的货币资金为 2,136,165,665.51 元（2016 年 12 月 31 日：1,803,289,985.69 元），主要为风险准备专户存款、借款保证金存款及质押定期存款等。

(二) 结算备付金

1、 按类别列示

| 项 目   | 期末余额             | 年初余额              |
|-------|------------------|-------------------|
| 客户备付金 | 7,607,858,552.05 | 9,325,892,434.58  |
| 公司备付金 | 374,870,092.42   | 2,866,006,839.21  |
| 合 计   | 7,982,728,644.47 | 12,191,899,273.79 |

2、按币种列示

| 类别       | 期末余额          |         |                  | 年初余额          |         |                   |
|----------|---------------|---------|------------------|---------------|---------|-------------------|
|          | 外币金额          | 折算率     | 人民币金额            | 外币金额          | 折算率     | 人民币金额             |
| 客户普通备付金: |               |         |                  |               |         |                   |
| 人民币      |               |         | 6,117,108,429.10 |               |         | 7,377,991,251.51  |
| 美元       | 19,349,594.37 | 6.5342  | 126,434,119.53   | 21,804,174.82 | 6.937   | 151,255,560.73    |
| 港币       | 88,281,570.85 | 0.83591 | 73,795,447.89    | 86,446,763.69 | 0.89451 | 77,327,494.59     |
| 其他       |               |         | 22,139,759.74    |               |         | 7,608,541.06      |
| 小计       |               |         | 6,339,477,756.26 |               |         | 7,614,182,847.89  |
| 客户信用备付金: |               |         |                  |               |         |                   |
| 人民币      |               |         | 1,268,380,795.79 |               |         | 1,711,709,586.69  |
| 小计       |               |         | 1,268,380,795.79 |               |         | 1,711,709,586.69  |
| 客户备付金合计  |               |         | 7,607,858,552.05 |               |         | 9,325,892,434.58  |
| 公司自有备付金: |               |         |                  |               |         |                   |
| 人民币      |               |         | 374,870,092.42   |               |         | 2,866,006,839.21  |
| 小计       |               |         | 374,870,092.42   |               |         | 2,866,006,839.21  |
| 公司备付金合计  |               |         | 374,870,092.42   |               |         | 2,866,006,839.21  |
| 合计       |               |         | 7,982,728,644.47 |               |         | 12,191,899,273.79 |

(三) 拆出资金

| 项目   | 期末余额           | 年初余额           |
|------|----------------|----------------|
| 拆放银行 | 679,091,978.14 | 705,848,143.60 |
| 合计   | 679,091,978.14 | 705,848,143.60 |

(四) 融出资金

1、按类别列示

| 项目        | 期末余额              | 年初余额              |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 融出资金      | 48,006,284,109.61 | 44,704,315,025.54 |
| 香港孖展融资业务等 | 13,883,144,907.63 | 18,712,156,326.29 |
| 合计        | 61,889,429,017.24 | 63,416,471,351.83 |

| 项 目    | 期末余额              | 年初余额              |
|--------|-------------------|-------------------|
| 减：减值准备 | 328,476,374.53    | 203,551,549.68    |
| 融出资金净值 | 61,560,952,642.71 | 63,212,919,802.15 |

注：上述融出资金中因收益权转让受限金额为 104.15 亿元。

## 2、按账龄分析

| 账龄     | 期末余额              |           |                |           | 年初余额              |           |                |           |
|--------|-------------------|-----------|----------------|-----------|-------------------|-----------|----------------|-----------|
|        | 账面余额              |           | 坏账准备           |           | 账面余额              |           | 坏账准备           |           |
|        | 金额                | 比例<br>(%) | 金额             | 比例<br>(%) | 金额                | 比例<br>(%) | 金额             | 比例<br>(%) |
| 1-3 个月 | 23,010,154,324.39 | 37.18     | 40,304,830.37  | 12.27     | 39,979,466,092.40 | 63.04     | 129,639,130.32 | 63.69     |
| 3-6 个月 | 37,088,496,966.50 | 59.93     | 88,383,854.93  | 26.91     | 4,751,726,202.84  | 7.49      | 7,901,911.72   | 3.88      |
| 6 个月以上 | 1,790,777,726.35  | 2.89      | 199,787,689.23 | 60.82     | 18,685,279,056.59 | 29.47     | 66,010,507.64  | 32.43     |
| 合计     | 61,889,429,017.24 | 100.00    | 328,476,374.53 | 100.00    | 63,416,471,351.83 | 100.00    | 203,551,549.68 | 100.00    |

## 3、按客户列示

| 项 目 | 期末账面余额            | 年初账面余额            |
|-----|-------------------|-------------------|
| 个人  | 44,525,659,967.50 | 40,266,692,391.30 |
| 机构  | 17,363,769,049.74 | 23,149,778,960.53 |
| 合 计 | 61,889,429,017.24 | 63,416,471,351.83 |

## 4、融资融券业务担保物情况

| 担保物类别 | 期末公允价值             | 年初公允价值             |
|-------|--------------------|--------------------|
| 资金    | 5,383,645,631.02   | 6,179,196,374.00   |
| 债券    | 80,550,250.60      | 727,957,879.39     |
| 基金    | 417,065,950.90     | 986,410,462.94     |
| 股票    | 208,508,214,862.95 | 220,524,535,878.17 |
| 合 计   | 214,389,476,695.47 | 228,418,100,594.50 |

(五) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

1、按项目列示

| 项 目 | 期末余额              |                           |                   |                   |                           |                   |
|-----|-------------------|---------------------------|-------------------|-------------------|---------------------------|-------------------|
|     | 公允价值              |                           |                   | 初始投资成本            |                           |                   |
|     | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计            | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 初始投资成本合计          |
| 债券  | 53,886,954,602.88 | 9,279,809,602.78          | 63,166,764,205.66 | 54,724,126,621.30 | 9,460,246,154.72          | 64,184,372,776.02 |
| 基金  | 12,589,072,662.10 | 1,908,294,944.24          | 14,497,367,606.34 | 12,482,934,849.93 | 1,905,119,419.39          | 14,388,054,269.32 |
| 股票  | 12,637,664,117.12 | 3,221,188,412.31          | 15,858,852,529.43 | 11,981,772,185.75 | 2,531,433,135.14          | 14,513,205,320.89 |
| 其他  | 542,948,830.26    | 5,790,761,664.22          | 6,333,710,494.48  | 535,442,259.22    | 5,456,752,224.36          | 5,992,194,483.58  |
| 合 计 | 79,656,640,212.36 | 20,200,054,623.55         | 99,856,694,835.91 | 79,724,275,916.20 | 19,353,550,933.61         | 99,077,826,849.81 |

| 项 目 | 期初余额              |                         |                   |                   |                         |                   |
|-----|-------------------|-------------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|-------------------|
|     | 公允价值              |                         |                   | 初始投资成本            |                         |                   |
|     | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计            | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 初始投资成本合计          |
| 债券  | 49,811,131,714.72 | 3,521,753,638.35        | 53,332,885,353.07 | 49,606,534,209.51 | 3,350,083,039.37        | 52,956,617,248.88 |
| 基金  | 13,749,786,531.00 | 3,305,156,749.31        | 17,054,943,280.31 | 13,732,692,837.71 | 3,304,637,675.67        | 17,037,330,513.38 |
| 股票  | 5,478,728,863.32  | 9,058,906,197.96        | 14,537,635,061.28 | 5,800,988,881.09  | 7,319,326,103.52        | 13,120,314,984.61 |
| 其他  | 286,444,369.37    | 7,135,585,490.95        | 7,422,029,860.32  | 289,810,352.93    | 7,947,514,188.55        | 8,237,324,541.48  |
| 合 计 | 69,326,091,478.41 | 23,021,402,076.57       | 92,347,493,554.98 | 69,430,026,281.24 | 21,921,561,007.11       | 91,351,587,288.35 |

**2、 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中已融出证券情况**

| 项目名称 | 期末公允价值        |
|------|---------------|
| 股票   | 12,005,422.85 |
| 合 计  | 12,005,422.85 |

期末融出证券担保情况详见附注五、（四）4。

**3、 有承诺条件的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产**

| 项 目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 期末余额              |
|-----|------------------|-------------------|
| 债券  | 卖出回购交易           | 20,249,553,984.91 |
| 债券  | 债券借贷业务质押         | 4,929,377,656.96  |
| 债券  | 银行借款质押           | 4,006,676,910.00  |
| 股票  | 卖出回购交易           | 1,732,175,552.45  |
| 股票  | 证券已融出            | 12,005,422.85     |
| 合 计 |                  | 30,929,789,527.17 |

(六) 衍生金融工具

| 类 别             | 期 末      |      |    |                    |                  |                  | 年 初      |      |    |                    |                  |                  |
|-----------------|----------|------|----|--------------------|------------------|------------------|----------|------|----|--------------------|------------------|------------------|
|                 | 套期工具     |      |    | 非套期工具              |                  |                  | 套期工具     |      |    | 非套期工具              |                  |                  |
|                 | 名义<br>金额 | 公允价值 |    | 名义金额               | 公允价值             |                  | 名义<br>金额 | 公允价值 |    | 名义金额               | 公允价值             |                  |
|                 |          | 资产   | 负债 |                    | 资产               | 负债               |          | 资产   | 负债 |                    | 资产               | 负债               |
| 利率衍生工具(注 1、注 3) |          |      |    | 51,929,925,453.75  | 1,532,747,878.35 | 1,602,469,454.31 |          |      |    | 71,965,006,848.64  | 2,717,682,748.40 | 1,827,642,165.38 |
| 货币衍生工具          |          |      |    | 2,095,183,589.97   | 18,990,392.39    | 6,975,023.66     |          |      |    | 1,581,079,056.18   | 41,788,387.64    | 52,557,940.92    |
| 权益衍生工具<br>(注 2) |          |      |    | 196,246,446,174.98 | 596,338,893.10   | 1,762,858,492.87 |          |      |    | 507,459,488,746.57 | 456,460,959.54   | 405,149,369.31   |
| 信用衍生工具          |          |      |    | 1,285,834,590.25   | 34,771,256.42    | 2,432,508.18     |          |      |    | 2,327,059,105.70   | 66,534,044.07    | 44,686,437.40    |
| 其他衍生工具(注 4)     |          |      |    | 5,600,830,844.13   | 427,763,882.02   | 120,718,799.18   |          |      |    | 10,199,712,427.24  | 652,605,209.16   | 263,973,368.95   |
| 合 计             |          |      |    |                    | 2,610,612,302.28 | 3,495,454,278.20 |          |      |    |                    | 3,935,071,348.81 | 2,594,009,281.96 |

注 1：公司持有的利率互换业务按结算方式分为每日无负债结算和非每日无负债结算。每日无负债结算下的利率互换按抵销后的净额列示，为人民币零元。2017 年 12 月 31 日，公司的这类利率互换的名义金额为 1,079,000.00 万元，公允价值浮动为公允价值浮亏 7,433,312.22 元（2016 年 12 月 31 日，名义金额为 2,454,700.00 万元，公允价值浮亏为 9,535,523.70 元）。非每日无负债结算的利率互换业务以全额列示。2017 年 12 月 31 日公司相关业务的名义金额为 3,663,443.07 万元，公允价值浮盈为 1,532,747,878.35 元，公允价值浮亏为 1,602,469,454.31 元（2016 年 12 月 31 日，名义金额为 4,621,088.41 万元，公允价值浮盈为 2,717,682,748.40 元，公允价值浮亏为 1,827,642,165.38 元）。

注 2: 在每日无负债结算制度下, 公司于 2017 年 12 月 31 日的股指期货投资按抵销后的净额列示, 为人民币零元。2017 年 12 月 31 日, 公司持有的用于非套期的未到期股指期货合约的公允价值浮盈为 3,358,260.00 元, 公允价值浮亏为 106,860.00 元 (2016 年 12 月 31 日公允价值浮盈为 1,257,420.00 元, 公允价值浮亏为 2,063,300.00 元), 与应付款项股指期货待结算款相互抵销。

注 3: 在每日无负债结算制度下, 公司于 2017 年 12 月 31 日所持有的国债期货投资按抵销后的净额列示, 为人民币零元。2017 年 12 月 31 日, 公司持有的未到期国债期货合约的公允价值为浮亏 11,826,400.00 元 (2016 年 12 月 31 日公允价值浮盈 17,123,150.00 元), 与应付款项国债期货待结算款相互抵销。

注 4: 在每日无负债结算制度下, 2017 年 12 月 31 日, 公司持有的未到期商品期货合约的公允价值为零元 (2016 年 12 月 31 日公允价值为浮盈 325,700.00 元), 与应付款项商品期货待结算款相互抵销; 在非每日无负债结算制度下公司持有的未到期商品期货合约的公允价值为浮盈 68,037,320.90 元。

(七) 买入返售金融资产

1、按标的物类别列示

| 项 目    | 期末余额              | 年初余额              |
|--------|-------------------|-------------------|
| 股票     | 76,442,210,044.02 | 54,215,364,917.28 |
| 债券     | 20,101,753,145.08 | 13,303,922,950.46 |
| 基金     | 219,156.00        | 580,076.00        |
| 其他     | 350,000,000.00    | 17,183,460,150.11 |
| 合 计    | 96,894,182,345.10 | 84,703,328,093.85 |
| 减：减值准备 | 344,313,802.93    | 180,102,534.10    |
| 账面价值   | 96,549,868,542.17 | 84,523,225,559.75 |

注：上述买入返售金融资产受限金额为 7.83 亿元。

2、按业务类别列示

| 项 目        | 期末余额              | 年初余额              | 备注 |
|------------|-------------------|-------------------|----|
| 约定购回式证券    | 1,575,247,000.00  | 6,523,980,057.71  |    |
| 股票质押式回购    | 74,528,923,165.02 | 52,821,449,326.28 |    |
| 其他买入返售金融资产 | 20,790,012,180.08 | 25,357,898,709.86 |    |
| 合 计        | 96,894,182,345.10 | 84,703,328,093.85 |    |

3、约定购回式证券、股票质押式回购等的剩余期限

(1) 约定购回式证券的剩余期限

| 年末剩余期限   | 期末余额             | 年初余额             |
|----------|------------------|------------------|
| 一个月以内    | 265,003,000.00   | 2,989,180,284.30 |
| 一个月至三个月内 | 514,684,000.00   | 2,849,196,773.41 |
| 三个月至一年内  | 795,560,000.00   | 685,603,000.00   |
| 合 计      | 1,575,247,000.00 | 6,523,980,057.71 |

(2) 股票质押式回购的剩余期限

| 年末剩余期限   | 期末余额              | 年初余额              |
|----------|-------------------|-------------------|
| 一个月以内    | 3,851,312,817.36  | 2,613,565,584.91  |
| 一个月至三个月内 | 6,799,310,984.09  | 3,994,048,590.00  |
| 三个月至一年内  | 42,606,698,003.31 | 26,533,580,143.01 |
| 一年以上     | 21,271,601,360.26 | 19,680,255,008.36 |
| 合 计      | 74,528,923,165.02 | 52,821,449,326.28 |

4、 买入返售金融资产的担保物信息

| 担保物类别 | 期末公允价值             | 年初公允价值             |
|-------|--------------------|--------------------|
| 权益工具  | 195,657,102,206.64 | 177,842,307,223.34 |
| 债务工具  | 19,930,843,485.60  | 23,125,736,436.33  |
| 合计    | 215,587,945,692.24 | 200,968,043,659.67 |

(八) 应收款项

1、 按明细列示

| 项目        | 期末余额             | 年初余额             |
|-----------|------------------|------------------|
| 应收清算款     | 5,576,951,468.01 | 5,657,278,350.32 |
| 应收手续费及管理费 | 1,350,289,099.25 | 870,520,813.69   |
| 其他        | 630,827,973.05   | 475,942,681.88   |
| 应收款项余额    | 7,558,068,540.31 | 7,003,741,845.89 |
| 减：减值准备    | 116,068,914.97   | 74,204,662.70    |
| 应收款项账面价值  | 7,441,999,625.34 | 6,929,537,183.19 |

2、 按账龄分析

| 账龄            | 期末余额             |        |                |        | 年初余额             |        |               |        |
|---------------|------------------|--------|----------------|--------|------------------|--------|---------------|--------|
|               | 账面余额             |        | 坏账准备           |        | 账面余额             |        | 坏账准备          |        |
|               | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) | 金额               | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 1 年以内 (含 1 年) | 7,305,422,574.82 | 96.66  | 16,177,500.43  | 13.94  | 6,501,593,553.23 | 92.83  | 3,208,171.91  | 4.32   |
| 1-2 年 (含 2 年) | 74,944,072.67    | 0.99   | 4,015,278.75   | 3.46   | 290,699,764.29   | 4.15   | 60,704.50     | 0.08   |
| 2-3 年 (含 3 年) | 55,493,826.34    | 0.73   | 30,126,539.17  | 25.95  | 95,786,300.24    | 1.37   | 55,045,090.66 | 74.18  |
| 3 年以上         | 122,208,066.48   | 1.62   | 65,749,596.62  | 56.65  | 115,662,228.13   | 1.65   | 15,890,695.63 | 21.42  |
| 合计            | 7,558,068,540.31 | 100    | 116,068,914.97 | 100    | 7,003,741,845.89 | 100    | 74,204,662.70 | 100    |

### 3、按评估方式列示

| 账龄       | 期末余额             |        |                |        | 年初余额             |        |               |        |
|----------|------------------|--------|----------------|--------|------------------|--------|---------------|--------|
|          | 账面余额             |        | 坏账准备           |        | 账面余额             |        | 坏账准备          |        |
|          | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) | 金额               | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 单项计提减值准备 | 286,167,477.47   | 3.79   | 100,655,626.28 | 86.72  | 164,056,973.81   | 2.34   | 69,676,249.12 | 93.90  |
| 组合计提减值准备 | 7,271,901,062.84 | 96.21  | 15,413,288.69  | 13.28  | 6,839,684,872.08 | 97.66  | 4,528,413.58  | 6.10   |
| 合计       | 7,558,068,540.31 | 100    | 116,068,914.97 | 100    | 7,003,741,845.89 | 100    | 74,204,662.70 | 100    |

### (九) 应收利息

| 项目     | 期末余额             | 年初余额             |
|--------|------------------|------------------|
| 债券投资   | 2,142,661,670.50 | 5,501,302,738.92 |
| 存放金融同业 | 599,336,785.05   | 416,074,710.99   |
| 融资融券   | 402,613,028.23   | 694,678,955.35   |
| 买入返售   | 311,337,457.99   | 269,588,381.13   |
| 信托理财   | 5,626,791.77     | 26,853,446.45    |
| 其他     | 242,323,202.20   | 513,561,966.36   |
| 合计     | 3,703,898,935.74 | 7,422,060,199.20 |

### (十) 存出保证金

#### 1、项目列示

| 项目     | 期末余额             | 年初余额             |
|--------|------------------|------------------|
| 交易保证金  | 373,184,666.70   | 393,665,820.20   |
| 信用保证金  | 46,896,058.48    | 54,391,696.12    |
| 转融通保证金 | 188,381,904.14   | 121,760,757.08   |
| 期货保证金  | 5,492,453,650.52 | 6,278,435,103.86 |
| 履约保证金  | 1,180,615,486.67 | 1,623,483,311.30 |
| 其他     | 1,247,143,414.42 | 480,294,616.46   |
| 合计     | 8,528,675,180.93 | 8,952,031,305.02 |

2、按币种列示

| 类别      | 期末余额           |         |                  | 年初余额           |         |                  |
|---------|----------------|---------|------------------|----------------|---------|------------------|
|         | 外币金额           | 折算率     | 人民币金额            | 外币金额           | 折算率     | 人民币金额            |
| 交易保证金:  |                |         |                  |                |         |                  |
| 人民币     |                |         | 233,132,270.20   |                |         | 191,995,714.93   |
| 美元      | 7,890,226.29   | 6.5342  | 51,556,316.62    | 5,919,017.00   | 6.937   | 41,060,220.93    |
| 港币      | 64,939,150.74  | 0.83591 | 54,283,285.50    | 80,879,720.13  | 0.89451 | 72,347,718.45    |
| 欧元      | 2,627,198.55   | 7.8023  | 20,498,191.25    | 12,070,320.31  | 7.3068  | 88,195,416.44    |
| 其他      |                |         | 13,714,603.13    |                |         | 66,749.45        |
| 小计      |                |         | 373,184,666.70   |                |         | 393,665,820.20   |
| 信用保证金:  |                |         |                  |                |         |                  |
| 人民币     |                |         | 46,896,058.48    |                |         | 54,391,696.12    |
| 欧元      |                |         |                  |                |         |                  |
| 小计      |                |         | 46,896,058.48    |                |         | 54,391,696.12    |
| 转融通保证金: |                |         |                  |                |         |                  |
| 人民币     |                |         | 188,381,904.14   |                |         | 121,760,757.08   |
| 小计      |                |         | 188,381,904.14   |                |         | 121,760,757.08   |
| 期货保证金:  |                |         |                  |                |         |                  |
| 人民币     |                |         | 5,467,860,321.01 |                |         | 6,265,820,616.50 |
| 港币      | 10,472,920.00  | 0.83591 | 8,754,418.56     | 14,102,120.00  | 0.89451 | 12,614,487.36    |
| 欧元      | 2,030,031.01   | 7.8023  | 15,838,910.95    |                |         |                  |
| 小计      |                |         | 5,492,453,650.52 |                |         | 6,278,435,103.86 |
| 履约保证金:  |                |         |                  |                |         |                  |
| 人民币     |                |         |                  |                |         | 355,481,912.28   |
| 美元      | 5,406,326.08   | 6.5342  | 35,326,015.87    | 8,843,353.42   | 6.937   | 61,346,342.67    |
| 欧元      | 122,094,905.00 | 7.8023  | 952,621,077.28   | 147,955,000.00 | 7.3068  | 1,081,077,594.00 |
| 其他      |                |         | 192,668,393.52   |                |         | 125,577,462.35   |
| 小计      |                |         | 1,180,615,486.67 |                |         | 1,623,483,311.30 |
| 其他:     |                |         |                  |                |         |                  |
| 人民币     |                |         | 1,172,553,310.24 |                |         | 307,261,609.72   |
| 美元      |                |         |                  | 499,623.93     | 6.937   | 3,465,891.20     |
| 港币      | 60,532,855.50  | 0.83591 | 50,600,019.24    | 1,816,306.90   | 0.89451 | 1,624,704.69     |

| 类 别 | 期末余额         |        |                  | 年初余额          |        |                  |
|-----|--------------|--------|------------------|---------------|--------|------------------|
|     | 外币金额         | 折算率    | 人民币金额            | 外币金额          | 折算率    | 人民币金额            |
| 欧 元 | 3,074,745.26 | 7.8023 | 23,990,084.94    | 22,984,399.58 | 7.3068 | 167,942,410.85   |
| 小 计 |              |        | 1,247,143,414.42 |               |        | 480,294,616.46   |
| 合 计 |              |        | 8,528,675,180.93 |               |        | 8,952,031,305.02 |

(十一) 可供出售金融资产

1、 按投资品种类别列示

| 项目名称     | 期末                |                  |                |                   | 年初                |                   |                |                   |
|----------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|
|          | 初始成本              | 公允价值变动           | 减值准备           | 账面价值              | 初始成本              | 公允价值变动            | 减值准备           | 账面价值              |
| 债券       | 5,104,833,633.60  | 56,365,427.02    | 201,836,060.34 | 4,959,363,000.28  | 12,396,765,786.79 | 396,311,063.94    | 229,387,251.80 | 12,563,689,598.93 |
| 基金       | 4,950,593,617.33  | 172,958,988.58   | 105,524,451.36 | 5,018,028,154.55  | 7,795,619,273.65  | -342,696,312.82   | 112,941,903.56 | 7,339,981,057.27  |
| 股票/股权    | 7,177,002,020.40  | 1,005,842,382.35 | 426,759,289.42 | 7,756,085,113.33  | 10,268,239,472.73 | 1,740,325,229.07  | 368,612,761.82 | 11,639,951,939.98 |
| 证券公司理财产品 | 2,951,737,338.31  | -103,665,227.36  | 819,998.20     | 2,847,252,112.75  | 3,668,942,170.31  | 223,717,270.20    | 46,012,720.24  | 3,846,646,720.27  |
| 其他（注 2）  | 18,985,183,792.53 | 1,662,843,832.07 |                | 20,648,027,624.60 | 23,765,365,132.98 | -1,089,449,983.28 | 37,346,637.96  | 22,638,568,511.74 |
| 合计       | 39,169,350,402.17 | 2,794,345,402.66 | 734,939,799.32 | 41,228,756,005.51 | 57,894,931,836.46 | 928,207,267.11    | 794,301,275.38 | 58,028,837,828.19 |

注 1：公允价值计量的可供出售金融资产，公允价值变动累计计入其他综合收益 2,794,345,402.66 元，已计提减值准备 734,939,799.32 元。

注 2：可供出售金融资产-其他包括公司对中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）的专户投资。该专户由公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险和分享投资收益，由证金公司进行统一运作与投资管理。截至 2017 年 12 月 31 日，公司对该项专户的投资成本为人民币 150 亿元。

2、可供出售金融资产中已融出证券情况

| 项目 | 期末公允价值       | 年初公允价值       |
|----|--------------|--------------|
| 基金 | 1,516,930.50 | 4,164,517.67 |
| 合计 | 1,516,930.50 | 4,164,517.67 |

期末融出证券担保情况详见附注五、（四）4。

3、可供出售金融资产减值准备情况

本期内可供出售金融资产减值的变动情况

| 可供出售金融资产分类    | 可供出售<br>权益工具   | 可供出售<br>债务工具   | 合计             |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 期初已计提减值金额     | 564,914,023.58 | 229,387,251.80 | 794,301,275.38 |
| 本年增加          | 68,966,685.86  | 178,996,019.58 | 247,962,705.44 |
| 其中：从其他综合收益转入  |                |                |                |
| 本年减少          | 100,776,970.46 | 206,547,211.04 | 307,324,181.50 |
| 其中：期后公允价值回升转回 |                |                |                |
| 期末已计提减值金额     | 533,103,738.98 | 201,836,060.34 | 734,939,799.32 |

4、存在限售期限及有承诺条件的可供出售金融资产情况

(1) 存在限售期限的可供出售金融资产

| 明细品种 | 限售期截止日    | 期末公允价值           |
|------|-----------|------------------|
| 股票   | 限售期内，明细见下 | 1,732,080,450.56 |
| 合计   |           | 1,732,080,450.56 |

其中：存在限售期限的可供出售金融资产-股票明细

| 证券名称 | 证券代码   | 限售期截止日      |
|------|--------|-------------|
| 大唐电信 | 600198 | 2018年5月12日  |
| 大唐电信 | 600198 | 2019年5月12日  |
| 恺英网络 | 002517 | 2018年12月18日 |
| 恺英网络 | 002517 | 2018年9月14日  |
| 恺英网络 | 002517 | 2019年9月14日  |
| 保隆科技 | 603197 | 2018年5月20日  |
| 瑞斯康达 | 603803 | 2018年4月20日  |
| 东珠景观 | 603359 | 2018年9月1日   |

| 证券名称 | 证券代码   | 限售期截止日           |
|------|--------|------------------|
| 泰瑞机器 | 603289 | 2018 年 10 月 31 日 |
| 上海雅仕 | 603329 | 2018 年 12 月 29 日 |

(2) 存在有承诺条件的可供出售金融资产

| 明细品种 | 承诺条件内容 | 期末公允价值           |
|------|--------|------------------|
| 债券   | 卖出回购交易 | 2,446,012,510.56 |
| 基金   | 证券已融出  | 1,516,930.50     |

(十二) 融券业务情况

1、 项目列示

| 项 目                     | 期末公允价值        | 年初公允价值        |
|-------------------------|---------------|---------------|
| 融出证券                    | 26,295,684.23 | 20,941,047.44 |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 12,005,422.85 | 13,939,498.58 |
| -可供出售金融资产               | 1,516,930.50  | 4,164,517.67  |
| - 转融通融入证券               | 12,773,330.88 | 2,837,031.19  |
| 转融通融入证券总额               | 22,191,128.00 | 3,482,800.00  |

融出证券期末明细情况具体见附注五、(五) 2 及 (十一) 2。

2、 融券业务违约概率情况

本期融券业务无违约情况。

(十三) 持有至到期投资

| 项 目 | 期 末           |                  |               |               | 年 初           |                  |               |               |
|-----|---------------|------------------|---------------|---------------|---------------|------------------|---------------|---------------|
|     | 账面余额          | 减<br>值<br>准<br>备 | 账面价值          | 公允价值          | 账面余额          | 减<br>值<br>准<br>备 | 账面价值          | 公允价值          |
| 公司债 | 78,718,210.79 |                  | 78,718,210.79 | 78,867,431.07 | 83,508,859.69 |                  | 83,508,859.69 | 82,678,664.79 |
| 合 计 | 78,718,210.79 |                  | 78,718,210.79 | 78,867,431.07 | 83,508,859.69 |                  | 83,508,859.69 | 82,678,664.79 |

(十四) 长期股权投资

| 被投资单位                               | 年初<br>余额         | 本期增、减变动          |                 |                 |                |                |                  |            |                 | 期末<br>余额         | 减值准备<br>期末余额 |
|-------------------------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|------------------|------------|-----------------|------------------|--------------|
|                                     |                  | 追加投资             | 减少投资            | 权益法下确认<br>的投资收益 | 其他综合收<br>益调整   | 公司享有其<br>他权益变动 | 公司享有的现金<br>股利或利润 | 计提减值<br>准备 | 其他              |                  |              |
| 一、合营企业                              |                  |                  |                 |                 |                |                |                  |            |                 |                  |              |
| Multi-Tranche 基金系列（注）               | 3,944,923,252.42 | 1,231,395,339.83 | -744,380,933.17 | 408,741,491.50  |                |                |                  |            | -257,939,621.34 | 4,582,739,529.24 |              |
| Harveston Asset Management Pte. Ltd | 9,799,361.99     |                  | -9,799,361.99   |                 |                |                |                  |            |                 |                  |              |
| 贵安恒信融资租赁(上海)有限公司                    |                  | 600,000,000.00   |                 | 20,970,407.18   |                |                |                  |            | -22,008,448.40  | 598,961,958.78   |              |
| 小计                                  | 3,954,722,614.41 | 1,831,395,339.83 | -754,180,295.16 | 429,711,898.68  |                |                |                  |            | -279,948,069.74 | 5,181,701,488.02 |              |
| 二、联营企业                              |                  |                  |                 |                 |                |                |                  |            |                 |                  |              |
| 富国基金管理有限公司                          | 681,741,315.14   |                  |                 | 201,664,118.94  | -1,721,018.10  |                |                  |            | -91,657,500.00  | 790,026,915.98   |              |
| 吉林省现代农业和新兴产业投资基金<br>有限公司            | 442,166,478.65   |                  |                 | 1,199,673.95    | -18,909,988.23 |                |                  |            |                 | 424,456,164.37   |              |
| 西安航天新能源产业基金投资有限公<br>司               | 414,273,904.54   |                  |                 | 24,662,656.35   | 14,125,046.47  |                |                  |            | -9,265,000.00   | 443,796,607.36   |              |
| 上海文化产业股权投资基金合伙企业<br>(有限合伙)          | 701,319,203.35   |                  | -52,628,185.53  | 33,208,843.89   | 13,672,001.93  |                |                  |            | -67,922,721.84  | 627,649,141.80   |              |
| 上海并购股权投资基金合伙企业（有<br>限合伙）            | 1,093,025,806.91 |                  |                 | 28,296,527.21   | -35,282,167.00 |                |                  |            | -14,678,031.66  | 1,071,362,135.46 |              |

| 被投资单位  | 年初<br>余额       | 本期增、减变动       |                 |                 |              |                |                  |               |                | 期末<br>余额       | 减值准备<br>期末余额 |
|--|----------------|---------------|-----------------|-----------------|--------------|----------------|------------------|---------------|----------------|----------------|--------------|
|  |                | 追加投资          | 减少投资            | 权益法下确认<br>的投资收益 | 其他综合收<br>益调整 | 公司享有其<br>他权益变动 | 公司享有的现金<br>股利或利润 | 计提减值<br>准备    | 其他             |                |              |
| 海通(吉林)现代服务业创业投资基金<br>合伙企业(有限合伙)                    | 96,263,821.39  |               |                 | -1,379,766.31   |              |                |                  |               |                | 94,884,055.08  |              |
| 西安海创之星创业投资有限合伙企业                                   | 16,055,165.75  |               | -6,000,000.00   | -55,165.75      |              |                |                  |               | -10,000,000.00 |                |              |
| 海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金<br>(有限合伙)                         | 255,873,328.01 | 1,000,000.00  |                 | -1,536,392.86   | 6,434,053.80 |                |                  |               |                | 261,770,988.95 |              |
| 海通齐东(威海)股权投资基金合伙企<br>业(有限合伙)                       | 228,837,578.73 | 10,000,000.00 |                 | -3,404,635.83   |              |                |                  |               |                | 235,432,942.90 |              |
| 广东南方媒体融合发展投资基金(有<br>限合伙)                           | 306,028,386.20 |               | -13,479,445.48  | 7,378,392.34    |              |                |                  | -4,087,852.60 |                | 295,839,480.46 |              |
| 海通(吉林)股权投资基金合伙企业<br>(有限合伙)                         | 33,349,568.12  |               |                 | 67,770.25       | -82,371.39   |                |                  |               |                | 33,334,966.98  |              |
| 西安军融电子卫星基金投资有限公司                                   | 150,100,000.00 |               | -100,000.00     | 1,544,234.05    |              |                |                  |               |                | 151,544,234.05 |              |
| 上海彤关投资管理合伙企业(有限合<br>伙)                             | 100,100,000.00 |               |                 | -7,920.46       | 1,805,054.06 |                |                  |               |                | 101,897,133.60 |              |
| Trinitus Asset Management Limited                  | 3,973,652.94   |               |                 | -2,557,042.01   |              |                |                  |               | -260,316.89    | 1,156,294.04   |              |
| Diamond Head Capital International, Ltd<br>Class E | 223,600,889.91 |               | -223,600,889.91 |                 |              |                |                  |               |                |                |              |

| 被投资单位   | 年初<br>余额         | 本期增、减变动          |                   |                 |                |                |                  |            |                 | 期末<br>余额          | 减值准备<br>期末余额 |
|---|------------------|------------------|-------------------|-----------------|----------------|----------------|------------------|------------|-----------------|-------------------|--------------|
|   |                  | 追加投资             | 减少投资              | 权益法下确认<br>的投资收益 | 其他综合收<br>益调整   | 公司享有其<br>他权益变动 | 公司享有的现金<br>股利或利润 | 计提减值<br>准备 | 其他              |                   |              |
| HTI Investment Fund SPC - Fund I SP                                 |                  | 337,990,963.65   |                   | -12,699,046.51  |                |                |                  |            |                 | 325,291,917.14    |              |
| Salgar Investments  | 18,871,552.21    |                  | -20,158,625.84    |                 |                |                |                  |            | 1,287,073.63    |                   |              |
| Fundo Espírito Santo IBERIA I                                       | 25,459,481.86    |                  | -4,049,297.68     | 2,734,351.46    | -3,865,114.84  |                |                  |            | 1,515,500.31    | 21,794,921.11     | 2,650,185.82 |
| MCO2 - Sociedade gestora de Fundos de Investimento Mobiliário, S.A. | 3,829,123.23     |                  | -3,315,977.65     | -341,906.56     |                |                |                  |            | 259,672.24      | 430,911.26        |              |
| 小计  | 4,794,869,256.94 | 348,990,963.65   | -323,332,422.09   | 278,774,692.15  | -23,824,503.30 |                | -187,611,106.10  |            | -7,198,070.71   | 4,880,668,810.54  | 2,650,185.82 |
| 合计  | 8,749,591,871.35 | 2,180,386,303.48 | -1,077,512,717.25 | 708,486,590.83  | -23,824,503.30 |                | -187,611,106.10  |            | -287,146,140.45 | 10,062,370,298.56 | 2,650,185.82 |

注：Multi-Tranche 基金系列包含 HT Freedom Multi-Tranche Bond F、HT HYB Multi -Tranche Fund S.P.和 HT Multi Tranche Inv F II SP。

(十五) 投资性房地产

| 项 目                     | 年初余额          | 本期增加              | 本期减少 | 期末余额          |
|-------------------------|---------------|-------------------|------|---------------|
| 1. 账面原值合计               | 37,609,994.25 |                   |      | 37,609,994.25 |
| (1) 房屋、建筑物              | 37,609,994.25 |                   |      | 37,609,994.25 |
| (2) 土地使用权               |               |                   |      |               |
| 2. 累计折旧和累计摊销合计          | 19,550,781.80 | 1,195,140.12      |      | 20,745,921.92 |
| (1) 房屋、建筑物              | 19,550,781.80 | 1,195,140.12      |      | 20,745,921.92 |
| (2) 土地使用权               |               |                   |      |               |
| 3. 投资性房地产净值合计           | 18,059,212.45 | -<br>1,195,140.12 |      | 16,864,072.33 |
| (1) 房屋、建筑物              | 18,059,212.45 | -<br>1,195,140.12 |      | 16,864,072.33 |
| (2) 土地使用权               |               |                   |      |               |
| 4. 投资性房地产减值准备累计<br>金额合计 |               |                   |      |               |
| (1) 房屋、建筑物              |               |                   |      |               |
| (2) 土地使用权               |               |                   |      |               |
| 5. 投资性房地产账面价值合计         | 18,059,212.45 | -<br>1,195,140.12 |      | 16,864,072.33 |
| (1) 房屋、建筑物              | 18,059,212.45 | -<br>1,195,140.12 |      | 16,864,072.33 |
| (2) 土地使用权               |               |                   |      |               |

截止 2017 年 12 月 31 日公司无作为抵押或担保的投资性房地产。

(十六) 固定资产

1、 账面价值

| 项 目        | 期末余额             | 年初余额             |
|------------|------------------|------------------|
| 固定资产原价     | 4,388,168,808.92 | 2,977,065,644.60 |
| 减：累计折旧     | 1,700,510,826.99 | 1,525,926,840.31 |
| 固定资产减值准备   | 30,381,872.93    | 30,381,872.93    |
| 固定资产账面价值合计 | 2,657,276,109.00 | 1,420,756,931.36 |

2、 固定资产增减变动表

| 项 目        | 房屋及建筑物           | 电子通讯设备           | 交通运输工具         | 机器设备           | 经营租赁固定资产         | 合计               |
|------------|------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 一、原价：      |                  |                  |                |                |                  |                  |
| 1.年初余额     | 1,110,295,731.57 | 1,143,233,911.13 | 176,394,124.46 | 268,274,477.44 | 278,867,400.00   | 2,977,065,644.60 |
| 2.本期增加     | 148,292,441.94   | 192,202,599.87   | 14,484,763.43  | 22,255,113.12  | 1,151,730,348.00 | 1,528,965,266.36 |
| (1) 本期购置   | 143,393,673.30   | 158,882,352.64   | 14,190,093.43  | 21,587,504.55  | 1,151,730,348.00 | 1,489,783,971.92 |
| (2) 在建工程转入 | 4,898,768.64     | 17,456,786.82    |                | 667,608.57     |                  | 23,023,164.03    |
| (3) 其他增加   |                  | 15,863,460.41    | 294,670.00     |                |                  | 16,158,130.41    |
| 3.本期减少     | 5,125,383.90     | 74,927,788.88    | 16,596,351.34  | 17,721,727.85  |                  | 114,371,251.97   |
| (1) 转让和出售  | 5,125,383.90     | 7,815,187.48     | 821,019.80     | 5,613,608.76   |                  | 19,375,199.94    |
| (2) 清理报废   |                  | 67,074,344.16    | 15,457,584.54  | 12,108,119.09  |                  | 94,640,047.79    |
| (3) 其他减少   |                  | 38,257.24        | 317,747.00     |                |                  | 356,004.24       |
| 4.外币报表折算差额 | -4,474,162.67    | 5,803,486.08     | -1,699,961.09  | -3,120,212.39  |                  | -3,490,850.07    |
| 5.期末余额     | 1,248,988,626.94 | 1,266,312,208.20 | 172,582,575.46 | 269,687,650.32 | 1,430,597,748.00 | 4,388,168,808.92 |
| 二、累计折旧：    |                  |                  |                |                |                  |                  |
| 年初余额       | 394,575,734.24   | 809,807,390.41   | 120,188,575.30 | 200,457,271.82 | 897,868.54       | 1,525,926,840.31 |
| 本期新增       |                  |                  |                |                |                  |                  |
| 本期计提       | 34,181,888.00    | 173,795,545.37   | 16,000,561.80  | 22,594,641.33  | 23,191,604.43    | 269,764,240.93   |
| 本期减少       |                  | 70,400,991.06    | 15,380,722.35  | 14,971,812.71  |                  | 100,753,526.12   |
| 外币报表折算差额   | -78,931.00       | 5,654,041.14     | -101,760.43    | 99,922.16      |                  | 5,573,271.87     |

| 项 目            | 房屋及建筑物         | 电子通讯设备         | 交通运输工具         | 机器设备           | 经营租赁固定资产         | 合计               |
|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 期末余额           | 428,678,691.24 | 918,855,985.86 | 120,706,654.32 | 208,180,022.60 | 24,089,472.97    | 1,700,510,826.99 |
| <b>三、减值准备:</b> |                |                |                |                |                  |                  |
| 年初余额           | 30,381,872.93  |                |                |                |                  | 30,381,872.93    |
| 本期计提           |                |                |                |                |                  |                  |
| 本期减少           |                |                |                |                |                  |                  |
| 外币报表折算差额       |                |                |                |                |                  |                  |
| 期末余额           | 30,381,872.93  |                |                |                |                  | 30,381,872.93    |
| <b>四、账面价值:</b> |                |                |                |                |                  |                  |
| 1.期末账面价值       | 789,928,062.77 | 347,456,222.34 | 51,875,921.14  | 61,507,627.72  | 1,406,508,275.03 | 2,657,276,109.00 |
| 2.年初账面价值       | 685,338,124.40 | 333,426,520.72 | 56,205,549.16  | 67,817,205.62  | 277,969,531.46   | 1,420,756,931.36 |

期末公司无作为抵押或担保的固定资产。

### 3、 期末未办妥产权证书的固定资产情况

| 项 目           | 账面原价          | 累计折旧         | 账面价值          | 未办妥产权证书原因 |
|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------|
| 鞍山市二道街 90 号   | 1,249,800.00  | 868,819.50   | 380,980.50    | 注 1       |
| 鞍山市二道街 90 号   | 2,896,604.00  | 2,081,342.23 | 815,261.77    | 注 2       |
| 哈尔滨市松北大道 58 号 | 40,000,000.00 | 6,333,333.60 | 33,666,666.40 | 注 3       |
| 合 计           | 44,146,404.00 | 9,283,495.33 | 34,862,908.67 |           |

注 1：该房产属交通银行鞍山分行于 1988 年向“鞍山物贸大厦”购买，当时未取得房屋所有权证（购房发票在交行财务部）。1995 年交通银行鞍山分行证券部改制成为海通鞍山营业部，该处房产作为改制移交资产，现为营业部营业用房。因“鞍山物贸大厦”已经解体，致使无法办理产权证，目前与相关部门交涉，寻找解决方法。

注 2：该房产于 1997 年公司鞍山营业部向鞍山市地方税务局购买，现为鞍山营业部营业用房。因历史原因一直无法办妥房屋所有权证。

注 3：该房产于 2012 年 12 月办妥入住手续，但由于开发商尚未取得工程验收许可证，无法办理房产证。

## (十七) 在建工程

### 1、 在建工程账面价值

| 项 目     | 期末余额          |      |               | 年初余额          |      |               |
|---------|---------------|------|---------------|---------------|------|---------------|
|         | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          |
| 营业办公楼装修 | 40,511,386.03 |      | 40,511,386.03 | 32,817,073.79 |      | 32,817,073.79 |
| 软件系统    | 8,063,067.77  |      | 8,063,067.77  | 14,744,200.25 |      | 14,744,200.25 |
| 合 计     | 48,574,453.80 |      | 48,574,453.80 | 47,561,274.04 |      | 47,561,274.04 |

### 2、 在建工程项目变动情况

| 工程名称    | 资金来源 | 年初余额          | 本期增加          | 本期减少          |               | 期末余额          |
|---------|------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
|         |      |               |               | 本期转入固定资<br>产  | 其他减少          |               |
| 营业办公楼装修 | 自有资金 | 32,817,073.79 | 51,395,870.59 | 23,023,164.03 | 20,678,394.32 | 40,511,386.03 |
| 软件系统    | 自有资金 | 14,744,200.25 | 9,274,342.31  |               | 15,955,474.79 | 8,063,067.77  |
| 合 计     |      | 47,561,274.04 | 60,670,212.90 | 23,023,164.03 | 36,633,869.11 | 48,574,453.80 |

(十八) 无形资产

1、 无形资产增减变动表

| 项 目         | 房屋使用权          | 软件               | 交易席位费          | 车位使用权         | 其他            | 合计               |
|-------------|----------------|------------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| <b>原价</b>   |                |                  |                |               |               |                  |
| 年初余额        | 40,166,151.96  | 957,871,413.85   | 222,931,377.88 | 32,039,678.00 | 58,125,681.44 | 1,311,134,303.13 |
| 本期增加        | 832,440,829.50 | 151,274,511.38   | 1,400,000.00   | 10,714,285.71 |               | 995,829,626.59   |
| 本期减少        |                | 29,042,116.66    |                |               | 290,000.00    | 29,332,116.66    |
| 外币报表折算差额    |                | -2,136,632.00    | -387,272.46    |               | -2,589,991.00 | -5,113,895.46    |
| 期末余额        | 872,606,981.46 | 1,077,967,176.57 | 223,944,105.42 | 42,753,963.71 | 55,245,690.44 | 2,272,517,917.60 |
| <b>累计摊销</b> |                |                  |                |               |               |                  |
| 年初余额        | 13,844,936.49  | 664,079,733.25   | 117,200,323.50 | 32,039,678.00 | 15,960,021.14 | 843,124,692.38   |
| 本期增加        | 17,731,665.19  | 121,242,528.59   |                | 803,571.39    | 4,802,928.53  | 144,580,693.70   |
| 本期减少        |                | 27,665,490.16    |                |               | 207,833.62    | 27,873,323.78    |
| 外币报表折算差额    |                | -3,302,299.28    |                |               | -23,436.54    | -3,325,735.82    |
| 期末余额        | 31,576,601.68  | 754,354,472.40   | 117,200,323.50 | 32,843,249.39 | 20,531,679.51 | 956,506,326.48   |
| <b>减值准备</b> |                |                  |                |               |               |                  |
| 年初余额        |                |                  |                |               |               |                  |
| 本期增加        |                |                  |                |               |               |                  |
| 本期减少        |                |                  |                |               |               |                  |
| 外币报表折算差额    |                |                  |                |               |               |                  |
| 期末余额        |                |                  |                |               |               |                  |
| <b>账面价值</b> |                |                  |                |               |               |                  |
| 年初余额        | 26,321,215.47  | 293,791,680.60   | 105,731,054.38 |               | 42,165,660.30 | 468,009,610.75   |
| 期末余额        | 841,030,379.78 | 323,612,704.17   | 106,743,781.92 | 9,910,714.32  | 34,714,010.93 | 1,316,011,591.12 |

2、 期末用于抵押或担保的无形资产情况见附注十一、(二) 1。

(十九) 商誉

| 被投资单位名称   | 年初余额             | 期末余额             | 期末减值准备 |
|---|------------------|------------------|--------|
| 非同一控制下企业合并-合并海通期货股份有限公司（注 1）  | 5,896,464.26     | 5,896,464.26     |        |
| 非同一控制下企业合并-合并海通国际证券集团有限公司（注 1）、（注 2）  | 702,173,228.57   | 656,173,350.21   |        |
| 非同一控制下企业合并-合并海通恒信金融集团有限公司（注 1）、（注 3）  | 2,240,012,614.19 | 2,093,267,760.37 |        |
| 非同一控制下企业合并-合并 Haitong International Holdings (UK) Limited（注 1）、（注 4）                    | 132,247,558.96   | 123,583,925.29   |        |
| 非同一控制下企业合并-合并海通银行（注 1）、（注 5）  | 1,038,404,292.08 | 979,980,994.32   |        |
| 非同一控制下企业合并-合并 Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.（注 1）、（注 6） |                  | 4,617,705.03     |        |
| 合计  | 4,118,734,158.06 | 3,863,520,199.48 |        |

注 1：因非同一控制下企业合并形成的商誉账面价值按照预计未来现金流量现值进行计算其可收回金额高于账面价值，未发生减值。

注 2：海通国际控股以每股收购价港币 4.88 元非同一控制下企业合并海通国际证券形成的商誉为 HK\$784,980,859.43 元，按 2016 年 12 月 31 日期末汇率 0.89451 折合人民币为 702,173,228.57 元，本期末该商誉按 2017 年 12 月 31 日期末汇率 0.83591 折合人民币为 656,173,350.21 元。

注 3：海通国际控股收购非同一控制下企业合并恒信金融集团有限公司形成的商誉为 HK\$2,504,178,392.85 元，按 2016 年 12 月 31 日期末汇率 0.89451 折合人民币为 2,240,012,614.19 元，本期末该商誉按 2017 年 12 月 31 日期末汇率 0.83591 折合人民币 2,093,267,760.37 元。

注 4：海通国际证券集团有限公司收购非同一控制下企业合并 Haitong International Holdings (UK) Limited (原 Japaninvest Group plc)(简称"Japaninvest")形成的商誉为

HK\$147,843,578.00 元，该商誉按 2016 年 12 月 31 日期末汇率 0.89451 折合人民币为 132,247,558.96 元，本期末该商誉按 2017 年 12 月 31 日期末汇率 0.83591 折合人民币 123,583,925.29 元。

注 5：海通国际控股收购非同一控制下企业合并海通银行（原葡萄牙圣灵投资银行）形成的商誉为 HK\$ 1,080,339,878.12 元和 € 9,857,873.11 元。该商誉根据 2016 年 12 月 31 日期末汇率折合人民币为 1,038,404,292.08 元，本期末该商誉按 2017 年 12 月 31 日期末汇率折合人民币为 979,980,994.32 元。

注 6：海通国际证券集团有限公司收购非同一控制下企业合并 Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.形成的商誉为 HK\$ 5,524,165.32 元。本期末该商誉按 2017 年 12 月 31 日期末汇率折合人民币为 4,617,705.03 元。

## (二十) 其他资产

### 1、 项目列示

| 项 目       | 期末余额              | 年初余额              |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 其他应收款     | 798,666,637.91    | 2,279,758,358.62  |
| 应收款项类投资   | 17,563,921,550.33 | 33,698,565,383.79 |
| 长期待摊费用    | 164,582,089.88    | 162,265,020.43    |
| 抵债资产      | 29,098,672.43     | 51,992,911.52     |
| 长期应收款     | 43,536,175,683.50 | 36,555,220,298.19 |
| 应收保理款     | 10,502,498,885.15 | 3,873,072,274.96  |
| 发放贷款和垫款   | 4,838,272,238.93  | 5,612,288,771.59  |
| 委托贷款及其他贷款 | 1,180,154,112.37  | 899,780,914.86    |
| 其他        | 1,239,410,332.44  | 752,888,142.76    |
| 合 计       | 79,852,780,202.94 | 83,885,832,076.72 |

### 2、 其他应收款

#### (1) 其他应收款明细列示

| 项 目           | 期末余额           | 年初余额           |
|---------------|----------------|----------------|
| 浙江斯文新技术投资有限公司 | 440,894,056.51 | 440,894,056.51 |

| 项 目     | 期末余额             | 年初余额             |
|---------|------------------|------------------|
| 暂付款项    | 680,050,339.62   | 1,585,010,773.07 |
| 其他      | 143,629,323.39   | 715,662,823.63   |
| 其他应收款余额 | 1,264,573,719.52 | 2,741,567,653.21 |
| 减：坏账准备  | 465,907,081.61   | 461,809,294.59   |
| 其他应收款净值 | 798,666,637.91   | 2,279,758,358.62 |

(2) 其他应收款按账龄分析

| 账龄   | 期末余额             |        |                |        | 年初余额             |        |                |        |
|------|------------------|--------|----------------|--------|------------------|--------|----------------|--------|
|      | 账面余额             |        | 坏账准备           |        | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|      | 金额               | 比例(%)  | 金额             | 比例(%)  | 金额               | 比例(%)  | 金额             | 比例(%)  |
| 1年以内 | 645,280,700.65   | 51.03  | 265,398.86     | 0.06   | 1,919,103,585.65 | 70.00  | 931,287.52     | 0.20   |
| 1-2年 | 72,914,191.63    | 5.77   | 921,499.97     | 0.20   | 283,936,233.29   | 10.36  | 2,711,431.32   | 0.59   |
| 2-3年 | 50,588,069.77    | 4.00   | 6,753,777.55   | 1.45   | 51,572,413.84    | 1.88   | 1,653,683.47   | 0.36   |
| 3年以上 | 495,790,757.47   | 39.20  | 457,966,405.23 | 98.29  | 486,955,420.43   | 17.76  | 456,512,892.28 | 98.85  |
| 合计   | 1,264,573,719.52 | 100.00 | 465,907,081.61 | 100.00 | 2,741,567,653.21 | 100.00 | 461,809,294.59 | 100.00 |

(3) 其他应收款按种类分析

| 种 类                              | 期末余额             |        |                |        | 年初余额             |        |                |        |
|----------------------------------|------------------|--------|----------------|--------|------------------|--------|----------------|--------|
|                                  | 账面余额             |        | 坏账准备           |        | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|                                  | 金额               | 比例(%)  | 金额             | 比例(%)  | 金额               | 比例(%)  | 金额             | 比例(%)  |
| 单项金额重大的其他应收款                     | 440,894,056.51   | 34.87  | 440,894,056.51 | 94.63  | 1,430,894,056.51 | 52.19  | 440,894,056.51 | 95.47  |
| 单项金额不重大但按信用风险特征组合后该组合的风险较大的其他应收款 |                  |        |                |        |                  |        |                |        |
| 其他不重大其他应收款                       | 823,679,663.01   | 65.13  | 25,013,025.10  | 5.37   | 1,310,673,596.70 | 47.81  | 20,915,238.08  | 4.53   |
| 合计                               | 1,264,573,719.52 | 100.00 | 465,907,081.61 | 100.00 | 2,741,567,653.21 | 100.00 | 461,809,294.59 | 100.00 |

(4) 期末单项金额重大的其他应收款坏账准备计提

| 其他应收款内容               | 账面余额           | 坏账准备金额         | 计提比例(%) | 理由 |
|-----------------------|----------------|----------------|---------|----|
| 应收浙江斯文新技术投资有限公司往来款(注) | 440,894,056.51 | 440,894,056.51 | 100.00  |    |
| 合计                    | 440,894,056.51 | 440,894,056.51 |         |    |

注：该款项是公司通过浙江斯文新技术投资有限公司存放在广东证券的保证金，公司已根据可收回情况计提了 100%的坏账准备。

(5) 期末其他应收款金额前五名情况

| 项目            | 金额             | 年限    | 占其他应收款总额比例(%) | 性质或内容 |
|---------------|----------------|-------|---------------|-------|
| 浙江斯文新技术投资有限公司 | 440,894,056.51 | 3 年以上 | 34.87%        | 往来款   |
| 海通国际暂付款       | 302,453,390.67 | 1 年以内 | 23.92%        | 暂付款项  |
| 海通期货暂付款       | 24,802,876.34  | 1 年以内 | 1.96%         | 暂付款项  |
| 上海泽春投资发展有限公司  | 20,000,000.00  | 1 年以内 | 1.58%         | 意向金   |
| 海通资管暂付款       | 19,409,903.06  | 1 年以内 | 1.53%         | 暂付款项  |

(6) 期末其他应收款项余额中无持公司 5%以上(含 5%)表决权股份的股东单位欠款。

3、 应收款项类投资

| 项目        | 期末余额              | 年初余额              |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 银行理财产品    | 1,754,999,746.48  | 18,068,740,400.00 |
| 信托理财投资    | 623,000,000.00    | 916,800,000.00    |
| 资产管理计划    | 2,461,567,013.09  | 6,094,314,994.14  |
| 债项投资      | 11,906,618,001.55 | 7,361,330,062.28  |
| 其他类投资     | 1,034,613,639.48  | 1,438,120,000.00  |
| 应收款项类投资余额 | 17,780,798,400.60 | 33,879,305,456.42 |
| 减：减值准备    | 216,876,850.27    | 180,740,072.63    |
| 应收款项类投资净值 | 17,563,921,550.33 | 33,698,565,383.79 |

#### 4、 长期待摊费用

| 项 目      | 年初余额           | 本期增加额         | 本期摊销额         | 其他减少 | 期末余额           |
|----------|----------------|---------------|---------------|------|----------------|
| 装修及布线改造等 | 162,265,020.43 | 72,113,388.53 | 69,796,319.08 |      | 164,582,089.88 |

#### 5、 长期应收款

(1) 长期应收款均为恒信金融集团应收融资租赁款。

| 项 目       | 期末余额              | 年初余额              |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 最低租赁收款额   | 49,240,967,657.31 | 42,203,603,505.84 |
| 减：未实现融资收益 | 4,222,749,337.92  | 4,336,323,472.92  |
| 应收融资租赁款余额 | 45,018,218,319.39 | 37,867,280,032.92 |
| 减：减值准备    | 1,482,042,635.89  | 1,312,059,734.73  |
| 应收融资租赁款净额 | 43,536,175,683.50 | 36,555,220,298.19 |

注：期末应收融资租赁款中银行借款质押受限金额为 215.89 亿元。

(2) 最低租赁收款额按到期日期限分析

| 项 目   | 期末余额              |       | 期初余额              |       |
|-------|-------------------|-------|-------------------|-------|
|       | 金额                | 比例(%) | 金额                | 比例(%) |
| 1 年以内 | 24,140,952,272.51 | 49.03 | 16,758,151,761.87 | 39.71 |
| 1-2 年 | 15,305,577,236.69 | 31.08 | 12,958,309,721.04 | 30.70 |
| 2-3 年 | 6,932,952,455.45  | 14.08 | 7,614,175,306.49  | 18.04 |
| 3 年以上 | 2,861,485,692.66  | 5.81  | 4,872,966,716.44  | 11.55 |
| 合 计   | 49,240,967,657.31 | 100   | 42,203,603,505.84 | 100   |

(3) 应收融资租赁款余额按行业分类

| 项 目  | 期末余额              |       | 期初余额             |       |
|------|-------------------|-------|------------------|-------|
|      | 金额                | 比例(%) | 金额               | 比例(%) |
| 基础设施 | 11,093,532,847.40 | 24.64 | 9,783,717,171.80 | 25.84 |
| 交通物流 | 14,867,619,395.49 | 33.03 | 8,211,751,949.27 | 21.69 |
| 工业   | 8,167,711,154.85  | 18.14 | 5,937,409,000.32 | 15.68 |
| 教育   | 2,095,141,607.86  | 4.65  | 4,477,152,501.68 | 11.82 |
| 医疗   | 2,782,855,809.30  | 6.18  | 3,443,781,417.67 | 9.09  |
| 化工   | 1,220,223,988.21  | 2.71  | 1,819,747,181.31 | 4.81  |

| 项 目    | 期末余额              |       | 期初余额              |       |
|--------|-------------------|-------|-------------------|-------|
|        | 金额                | 比例(%) | 金额                | 比例(%) |
| 建筑与房地产 | 1,880,033,293.72  | 4.18  | 1,240,515,011.82  | 3.28  |
| 其他     | 2,911,100,222.56  | 6.47  | 2,953,205,799.05  | 7.79  |
| 合计     | 45,018,218,319.39 | 100   | 37,867,280,032.92 | 100   |

## 6、 应收保理款

| 项 目                | 期末余额              | 年初余额             |
|--------------------|-------------------|------------------|
| 资产负债表日后第 1 年       | 7,472,561,073.56  | 2,512,709,738.81 |
| 资产负债表日后第 2 年       | 2,396,081,615.55  | 1,101,341,669.47 |
| 资产负债表日后第 3 年       | 860,934,534.00    | 285,994,182.26   |
| 以后年度               | 852,903,956.63    | 479,695,218.88   |
| 应收保理款合计            | 11,582,481,179.74 | 4,379,740,809.42 |
| 减：利息调整             | 805,607,464.59    | 425,734,434.02   |
| 应收保理款余额            | 10,776,873,715.15 | 3,954,006,375.40 |
| 减：减值准备             | 274,374,830.00    | 80,934,100.44    |
| 其中：单项计提数           | 43,650,000.00     |                  |
| 组合计提数              | 230,724,830.00    | 80,934,100.44    |
| 应收保理款净额            | 10,502,498,885.15 | 3,873,072,274.96 |
| 其中： 1 年内到期的应收保理款净额 | 6,760,884,014.34  | 2,222,027,934.50 |
| 1 年后到期的应收保理款净额     | 3,741,614,870.81  | 1,651,044,340.46 |

## 7、 发放贷款和垫款

| 项 目     | 期末余额             | 年初余额             |
|---------|------------------|------------------|
| 个人贷款和垫款 | 2,290,506.02     | 2,703,760.68     |
| -信用卡    |                  |                  |
| -住房抵押贷款 |                  |                  |
| -其他     | 2,290,506.02     | 2,703,760.68     |
| 企业贷款和垫款 | 5,754,184,830.77 | 7,473,234,123.51 |
| -贷款     | 5,754,184,830.77 | 7,473,234,123.51 |
| -贴现     |                  |                  |
| -其他     |                  |                  |
| 贷款和垫款总额 | 5,756,475,336.79 | 7,475,937,884.19 |

| 项 目       | 期末余额             | 年初余额             |
|-----------|------------------|------------------|
| 减：贷款损失准备  | 918,203,097.86   | 1,863,649,112.60 |
| 其中：单项计提数  | 901,164,997.64   | 1,842,454,773.10 |
| 组合计提数     | 17,038,100.22    | 21,194,339.50    |
| 贷款和垫款账面价值 | 4,838,272,238.93 | 5,612,288,771.59 |

## 8、 委托贷款及其他贷款

| 项 目                  | 期末余额             | 年初余额           |
|----------------------|------------------|----------------|
| 委托贷款及其他贷款余额          | 1,207,197,006.22 | 924,677,312.07 |
| 减：减值准备               | 27,042,893.85    | 24,896,397.21  |
| 委托贷款及其他贷款净额          | 1,180,154,112.37 | 899,780,914.86 |
| 其中：一年内到期的委托贷款及其他贷款净额 | 825,309,850.07   | 385,153,213.61 |
| 一年后到期的委托贷款及其他贷款净额    | 354,844,262.30   | 514,627,701.25 |
| 合 计                  | 1,180,154,112.37 | 899,780,914.86 |

## (二十一) 递延所得税资产和递延所得税负债

### 1、 递延所得税资产

| 项 目                    | 期末余额              |                  | 年初余额              |                  |
|------------------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|
|                        | 可抵扣暂时性差异          | 递延所得税资产          | 可抵扣暂时性差异          | 递延所得税资产          |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 391,069,409.82    | 96,544,859.95    | 4,425,482.72      | 1,106,370.68     |
| 可供出售金融资产               | 312,071,566.08    | 78,017,891.52    | 1,282,355,540.01  | 320,588,885.00   |
| 衍生金融负债                 | 133,256,984.63    | 33,314,246.16    | 150,956,275.52    | 37,739,068.88    |
| 衍生金融资产                 | 5,877,181.16      | 1,469,295.29     |                   |                  |
| 融出资金                   | 472,837,516.56    | 118,209,379.14   | 292,089,306.81    | 73,022,326.70    |
| 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债  | 10,189,993.36     | 2,547,498.34     |                   |                  |
| 应付未付款项可抵扣税款            | 3,783,405,845.41  | 945,851,461.36   | 3,833,292,270.62  | 958,323,067.67   |
| 其他资产（注）                | 4,798,226,482.40  | 1,258,543,532.75 | 4,264,503,546.05  | 1,066,125,886.51 |
| 无形资产、固定资产及长期待摊费用       | 241,226.04        | 60,306.51        |                   |                  |
| 可抵扣亏损等（注）              | 1,915,051,753.07  | 316,891,997.03   | 1,917,371,941.56  | 316,906,511.28   |
| 合 计                    | 11,822,227,958.53 | 2,851,450,468.05 | 11,744,994,363.29 | 2,773,812,116.72 |

## 2、 递延所得税负债

| 项 目                    | 期末余额             |                | 年初余额             |                |
|------------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|
|                        | 应纳税暂时性差异         | 递延所得税负债        | 应纳税暂时性差异         | 递延所得税负债        |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 661,598,857.31   | 165,399,714.33 | 125,686,152.11   | 31,421,538.03  |
| 可供出售金融资产               | 2,685,987,393.15 | 675,789,356.58 | 1,810,759,521.41 | 446,251,567.51 |
| 衍生金融资产                 | 6,599,705.00     | 1,649,926.26   | 304,638,327.35   | 52,227,484.20  |
| 无形资产、固定资产及长期待摊费用(注)    | 103,065,378.54   | 18,169,015.93  | 100,234,992.32   | 16,560,185.61  |
| 权益法核算合伙企业利润            |                  |                | 9,337,044.71     | 2,334,261.02   |
| 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债  | 21,288,508.30    | 5,322,127.07   |                  |                |
| 其他(注)                  | 3,651,958.98     | 989,522.51     | 52,587,528.75    | 8,676,942.24   |
| 合 计                    | 3,482,191,801.28 | 867,319,662.68 | 2,403,243,566.65 | 557,471,978.61 |

注：此项递延所得税资产和递延所得税负债主要由境外子公司形成的，其中香港子公司 2017 年度的综合利得税率为 16.50%，其他境外子公司按当地所得税税率。

## (二十二) 资产减值准备变动表

| 项 目          | 年初余额             | 本期增加           | 本期减少           |                  |      | 期末余额             |
|--------------|------------------|----------------|----------------|------------------|------|------------------|
|              |                  |                | 转回             | 转销               | 其他减少 |                  |
| 应收款项坏账准备     | 74,204,662.70    | 78,716,488.54  | 30,399,983.55  | 6,452,252.72     |      | 116,068,914.97   |
| 其他应收款坏账准备    | 461,809,294.59   | 4,480,917.58   | 383,130.56     |                  |      | 465,907,081.61   |
| 可供出售金融资产减值准备 | 794,301,275.38   | 248,164,027.70 | 201,322.26     | 307,324,181.50   |      | 734,939,799.32   |
| 固定资产减值准备     | 30,381,872.93    |                |                |                  |      | 30,381,872.93    |
| 融出资金减值准备     | 203,551,549.68   | 124,924,824.86 |                |                  |      | 328,476,374.54   |
| 买入返售金融资产减值准备 | 180,102,534.10   | 164,211,268.83 |                |                  |      | 344,313,802.93   |
| 贷款损失准备       | 1,863,649,112.60 | 733,655,675.48 | 279,076,064.39 | 1,400,025,625.83 |      | 918,203,097.86   |
| 应收融资租赁款减值准备  | 1,312,059,734.73 | 393,139,161.29 |                | 223,156,260.13   |      | 1,482,042,635.89 |

| 项 目         | 年初余额             | 本期增加             | 本期减少           |                  |      | 期末余额             |
|-------------|------------------|------------------|----------------|------------------|------|------------------|
|             |                  |                  | 转回             | 转销               | 其他减少 |                  |
| 应收保理款坏账准备   | 80,934,100.44    | 193,440,729.56   |                |                  |      | 274,374,830.00   |
| 委托贷款减值准备    | 24,896,397.21    | 2,146,496.64     |                |                  |      | 27,042,893.85    |
| 应收款项类投资减值准备 | 180,740,072.63   | 67,199,708.97    |                | 31,062,931.33    |      | 216,876,850.27   |
| 长期股权投资减值准备  | 43,329,376.29    |                  |                | 40,679,190.47    |      | 2,650,185.82     |
| 其他资产减值准备    | 237,339,631.60   | 83,809,429.09    | 11,071,585.76  | 85,122,535.23    |      | 224,954,939.70   |
| 合 计         | 5,487,299,614.88 | 2,093,888,728.54 | 321,132,086.52 | 2,093,822,977.21 |      | 5,166,233,279.69 |

(二十三) 短期借款

| 项 目  | 期末余额              | 年初余额              |
|------|-------------------|-------------------|
| 信用借款 | 25,716,875,697.77 | 28,577,996,033.51 |
| 质押借款 | 4,995,954,328.40  | 9,957,771,147.50  |
| 保证借款 |                   | 29,000,000.00     |
| 合 计  | 30,712,830,026.17 | 38,564,767,181.01 |

注：短期借款质押情况详见附注十一、（二）1。

(二十四) 应付短期融资款

| 类 型    | 发行日期                  | 到期日期                  | 票面利率         | 年初账面余额            | 本期增加              | 本期减少              | 期末账面余额            |
|--------|-----------------------|-----------------------|--------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 短期收益凭证 | 2017-1-4 至 2017-12-29 | 2018-1-1 至 2018-12-27 | 2.90%至 5.80% | 19,864,117,000.00 | 55,001,506,000.00 | 52,968,402,000.00 | 21,897,221,000.00 |
| 短期融资券  | 2017/3/6              | 2018/3/7              | 4.63%        |                   | 999,549,647.30    |                   | 999,549,647.30    |
| 中期票据   | 2017/5/26             | 2018/5/24             | 3.20%        |                   | 650,206,863.26    |                   | 650,206,863.26    |
| 中期票据   | 2017/9/1              | 2018/8/27             | 3.20%        |                   | 782,311,148.77    |                   | 782,311,148.77    |
| 超短期融资券 | 2017/8/3              | 2018/4/30             | 4.66%        |                   | 999,367,680.92    |                   | 999,367,680.92    |
| 超短期融资券 | 2017/10/16            | 2018/7/15             | 4.88%        |                   | 999,125,673.88    |                   | 999,125,673.88    |
| 超短期融资券 | 2017/10/23            | 2018/7/22             | 4.95%        |                   | 999,115,513.67    |                   | 999,115,513.67    |
| 超短期融资券 | 2017/11/15            | 2018/8/17             | 5.25%        |                   | 998,974,336.95    |                   | 998,974,336.95    |
| 超短期融资券 | 2017/12/18            | 2018/5/20             | 5.49%        |                   | 599,625,000.00    |                   | 599,625,000.00    |
| 短期融资券  | 2017/3/2              | 2018/3/2              | 5.60%        |                   | 200,506,220.88    |                   | 200,506,220.88    |
| 短期融资券  | 2017/12/8             | 2018/12/7             | 5.36%        |                   | 300,759,331.32    |                   | 300,759,331.32    |
| 合 计    |                       |                       |              | 19,864,117,000.00 | 62,531,047,416.95 | 52,968,402,000.00 | 29,426,762,416.95 |

(二十五) 拆入资金

| 项 目     | 期末余额              | 年初余额             |
|---------|-------------------|------------------|
| 银行拆入    | 6,811,638,917.40  | 7,509,461,725.51 |
| 转融通业务融入 | 5,000,000,000.00  | 1,300,000,000.00 |
| 合 计     | 11,811,638,917.40 | 8,809,461,725.51 |

公司转融通融入资金的剩余期限及利率区间如下表所示：

| 项 目      | 期末余额             | 利率    | 年初余额             |
|----------|------------------|-------|------------------|
| 3 个月以内   | 2,000,000,000.00 | 5.10% | 1,300,000,000.00 |
| 3 至 6 个月 | 3,000,000,000.00 | 5.10% |                  |
| 合 计      | 5,000,000,000.00 |       | 1,300,000,000.00 |

(二十六) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

| 项 目     | 期末公允价值           |                           |                   |
|---------|------------------|---------------------------|-------------------|
|         | 为交易目的而持有的金融负债    | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 公允价值合计            |
| 结构化主体   |                  | 1,342,317,882.24          | 1,342,317,882.24  |
| 结构化收益产品 |                  | 10,260,931,007.43         | 10,260,931,007.43 |
| 其他      | 7,739,121,184.85 | 1,401,129,092.18          | 9,140,250,277.03  |
| 合 计     | 7,739,121,184.85 | 13,004,377,981.85         | 20,743,499,166.70 |

| 项 目     | 期初公允价值           |                           |                   |
|---------|------------------|---------------------------|-------------------|
|         | 为交易目的而持有的金融负债    | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 公允价值合计            |
| 结构化主体   |                  | 12,655,009,214.25         | 12,655,009,214.25 |
| 结构化收益产品 |                  | 13,058,951,032.81         | 13,058,951,032.81 |
| 其他      | 8,492,150,757.26 | 4,433,520,000.00          | 12,925,670,757.26 |
| 合 计     | 8,492,150,757.26 | 30,147,480,247.06         | 38,639,631,004.32 |

(二十七) 卖出回购金融资产款

1、 按金融资产种类列示

| 项 目 | 期末账面余额            | 年初账面余额            |
|-----|-------------------|-------------------|
| 股票  | 1,504,888,773.00  |                   |
| 债券  | 17,264,987,956.85 | 32,995,726,557.56 |
| 其他  | 14,275,850,000.00 | 10,736,000,000.00 |
| 合 计 | 33,045,726,729.85 | 43,731,726,557.56 |

2、 按业务类别列示

| 项 目         | 期末余额              | 年初余额              | 备注 |
|-------------|-------------------|-------------------|----|
| 债券质押式报价回购   | 164,449,000.00    | 290,193,000.00    |    |
| 其他质押式回购     | 16,912,002,981.14 | 32,609,577,064.41 |    |
| 买断式回购       | 1,693,424,748.71  | 95,956,493.15     |    |
| 其他卖出回购金融资产款 | 14,275,850,000.00 | 10,736,000,000.00 |    |
| 合 计         | 33,045,726,729.85 | 43,731,726,557.56 |    |

3、 债券质押式报价回购的剩余期限和利率区间

| 剩余期限     | 期末余额           | 利率区间      | 年初余额           | 利率区间        |
|----------|----------------|-----------|----------------|-------------|
| 一个月以内    | 153,423,000.00 | 2.7%-3.7% | 284,589,000.00 | 1.38%-4.73% |
| 一个月至三个月内 | 11,026,000.00  |           | 5,604,000.00   |             |
| 三个月至一年内  |                |           |                |             |
| 一年以上     |                |           |                |             |
| 合 计      | 164,449,000.00 |           | 290,193,000.00 |             |

4、 卖出回购金融资产款的担保物信息

| 担保物类别 | 期末公允价值            | 年初公允价值            |
|-------|-------------------|-------------------|
| 债券    | 27,213,049,106.13 | 27,131,616,130.40 |
| 其他    | 14,728,200,000.04 | 19,516,818,688.83 |
| 合 计   | 41,941,249,106.17 | 46,648,434,819.23 |

(二十八) 代理买卖证券款

| 项 目    | 期末余额              | 年初余额               |
|--------|-------------------|--------------------|
| 普通经纪业务 | 78,390,781,936.39 | 97,564,647,847.59  |
| -个人    | 54,668,398,984.15 | 67,417,932,108.78  |
| -机构    | 23,722,382,952.24 | 30,146,715,738.81  |
| 信用业务   | 5,383,606,424.87  | 6,494,638,852.99   |
| -个人    | 4,869,869,422.03  | 5,856,547,730.09   |
| -机构    | 513,737,002.84    | 638,091,122.90     |
| 合 计    | 83,774,388,361.26 | 104,059,286,700.58 |

(二十九) 代理承销证券款

| 项 目     | 期末余额 | 年初余额             |
|---------|------|------------------|
| 代理承销股票款 |      | 1,054,351,430.62 |
| 合 计     |      | 1,054,351,430.62 |

(三十) 应付职工薪酬

1、应付职工薪酬列示

| 项 目             | 期末余额             | 年初余额             |
|-----------------|------------------|------------------|
| 短期薪酬            | 4,380,521,657.26 | 4,299,854,369.66 |
| 离职后福利-设定提存计划    | 1,737,548.02     | 2,496,306.06     |
| 辞退福利            |                  |                  |
| 离职后福利-设定受益计划净负债 |                  | 24,740,811.21    |
| 其他长期职工福利        | 508,082,080.73   | 395,439,224.10   |
| 合 计             | 4,890,341,286.01 | 4,722,530,711.03 |

2、短期薪酬及其他长期职工福利列示

| 项 目               | 年初数              | 本期增加额            | 本期支付额            | 期末余额             |
|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 一、工资、奖金、津贴和<br>补贴 | 4,644,461,659.74 | 4,997,680,310.23 | 4,817,511,346.58 | 4,824,630,623.39 |
| 二、职工福利费           | 704,450.16       | 142,129,409.35   | 130,045,369.43   | 12,788,490.08    |
| 三、社会保险费           | 7,884,982.54     | 234,903,247.61   | 238,539,278.93   | 4,248,951.22     |
| 四、住房公积金           | 392,247.78       | 161,443,070.55   | 161,270,515.79   | 564,802.54       |
| 五、工会经费和职工教育       | 41,850,253.54    | 72,393,658.54    | 77,229,293.84    | 37,014,618.24    |

| 项 目            | 年初数              | 本期增加额            | 本期支付额            | 期末余额             |
|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 经费             |                  |                  |                  |                  |
| 六、非货币性福利       |                  |                  |                  |                  |
| 七、因解除劳动关系给予的补偿 |                  | 1,984,561.60     | 1,984,561.60     | -                |
| 八、其他           |                  | 197,426,708.77   | 188,070,456.25   | 9,356,252.52     |
| 其中：以现金结算的股份支付  |                  | 7,525,154.00     |                  | 7,525,154.00     |
| 合 计            | 4,695,293,593.76 | 5,807,960,966.65 | 5,614,650,822.42 | 4,888,603,737.99 |
| 其中：短期薪酬        | 4,299,854,369.66 |                  |                  | 4,380,521,657.26 |
| 其他长期职工福利       | 395,439,224.10   |                  |                  | 508,082,080.73   |

### 3、设定提存计划

| 项 目    | 年初余额         | 本期增加           | 本期减少           | 期末余额         |
|--------|--------------|----------------|----------------|--------------|
| 基本养老保险 | 2,295,501.29 | 321,396,317.90 | 322,016,910.55 | 1,674,908.64 |
| 失业保险费  | 200,804.77   | 8,545,541.69   | 8,683,707.08   | 62,639.38    |
| 企业年金缴费 |              | 269,687,841.25 | 269,687,841.25 |              |
| 合 计    | 2,496,306.06 | 599,629,700.84 | 600,388,458.88 | 1,737,548.02 |

### (三十一) 应交税费

| 税费项目          | 期末余额             | 年初余额             | 报告期执行的法定税率   |
|---------------|------------------|------------------|--------------|
| 增值税           | 172,747,051.12   | 266,878,992.10   | 6%、11%和 17%  |
| 城建税           | 4,548,855.48     | 18,916,038.34    | 1%或 7%       |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 3,310,165.55     | 15,936,080.86    | 2%或 3%       |
| 企业所得税         | 2,198,612,673.55 | 1,748,845,662.97 | 16.5%、25%（注） |
| 个人所得税         | 159,316,731.88   | 308,643,781.77   |              |
| 其他            | 72,510,874.21    | 32,417,791.14    |              |
| 合 计           | 2,611,046,351.79 | 2,391,638,347.18 |              |

注：公司及境内子公司的企业所得税税率为 25%，香港子公司按 16.5%的综合利得税率执行，其他境外子公司按当地所得税税率缴纳。

(三十二) 应付款项

| 项 目     | 期末余额             | 年初余额             |
|---------|------------------|------------------|
| 应付各类清算款 | 6,232,356,249.64 | 4,927,226,982.35 |
| 应付票据    | 156,222,790.00   | 3,376,786,551.92 |
| 其他      | 53,375,621.54    | 603,921,583.08   |
| 合 计     | 6,441,954,661.18 | 8,907,935,117.35 |

期末余额中无欠持公司 5%以上（含 5%）表决权股份的股东单位款项。

(三十三) 应付利息

| 项 目        | 期末余额             | 年初余额             |
|------------|------------------|------------------|
| 客户资金       | 7,615,987.05     | 7,794,209.60     |
| 短期借款       | 76,085,552.76    | 445,158,773.02   |
| 拆入资金       | 59,011,408.38    | 12,634,439.04    |
| 其中：转融通融入资金 | 58,650,000.00    | 12,410,958.90    |
| 应付债券       | 2,359,390,155.74 | 2,362,077,783.74 |
| 卖出回购证券款    | 114,551,704.75   | 35,049,362.19    |
| 长期借款       | 304,036,654.10   | 430,229,919.97   |
| 应付短期融资款    | 445,359,251.46   | 197,090,047.67   |
| 应付黄金租赁利息   | 3,093,079.94     | 49,145,741.71    |
| 其他         | 7,548,379.94     | 29,049,998.38    |
| 合 计        | 3,376,692,174.12 | 3,568,230,275.32 |

(三十四) 预计负债

| 项 目      | 期末余额           | 年初余额           | 形成原因         |
|----------|----------------|----------------|--------------|
| 对外提供担保   | 14,484,272.88  | 12,047,516.41  |              |
| 产品相关预计负债 | 60,774,323.38  | 60,213,781.82  |              |
| 其他       | 92,084,308.59  | 52,360,223.12  | 境外子公司可能税项损失等 |
| 合 计      | 167,342,904.85 | 124,621,521.35 |              |

(三十五) 长期借款

| 项 目  | 期末余额              | 年初余额              | 利率区间                     |
|------|-------------------|-------------------|--------------------------|
| 质押借款 | 21,657,133,610.51 | 20,650,429,717.83 | 1M Hibor+100bps 至 5.795% |
| 信用借款 | 7,391,565,896.10  | 1,933,358,500.00  | 2.9291%-5.32%            |

| 项 目  | 期末余额              | 年初余额              | 利率区间          |
|------|-------------------|-------------------|---------------|
| 担保借款 | 1,560,460,069.80  |                   | 1.29%+Euribor |
| 合 计  | 30,609,159,576.41 | 22,583,788,217.83 |               |

注：长期借款质押情况详见附注十一、（二）1。

(三十六) 应付债券

| 债券类型   | 面值                | 发行日期                       | 到期日期                       | 发行金额              | 票面利率         | 期末账面余额            | 年初账面余额            | 注   |
|--------|-------------------|----------------------------|----------------------------|-------------------|--------------|-------------------|-------------------|-----|
| 公司债券   | 2,350,000,000.00  | 2013-11-25                 | 2018-11-25                 | 2,350,000,000.00  | 6.15%        | 2,348,359,810.41  | 2,346,540,147.17  | 注 1 |
| 公司债券   | 2,390,000,000.00  | 2013-11-25                 | 2023-11-25                 | 2,390,000,000.00  | 6.18%        | 2,379,073,640.83  | 2,377,223,004.59  | 注 1 |
| 公司债券   | 5,650,000,000.00  | 2014-7-14                  | 2017-7-14                  | 5,650,000,000.00  | 5.25%        |                   | 5,650,000,000.00  | 注 2 |
| 公司债券   | 4,550,000,000.00  | 2014-7-14                  | 2019-7-14                  | 4,550,000,000.00  | 5.45%        | 4,550,000,000.00  | 4,550,000,000.00  | 注 2 |
| 公司债券   | 800,000,000.00    | 2014-7-14                  | 2024-7-14                  | 800,000,000.00    | 5.85%        | 800,000,000.00    | 800,000,000.00    | 注 2 |
| 次级债券   | 15,000,000,000.00 | 2015-4-8                   | 2020-4-8                   | 15,000,000,000.00 | 5.50%        | 14,997,054,246.64 | 14,985,854,246.60 | 注 3 |
| 次级债券   | 15,000,000,000.00 | 2015-6-12                  | 2017-6-12                  | 15,000,000,000.00 | 5.30%        |                   | 14,995,368,493.15 | 注 4 |
| 次级债券   | 5,000,000,000.00  | 2015-6-12                  | 2020-6-12                  | 5,000,000,000.00  | 5.38%        | 4,998,764,931.54  | 4,995,964,931.52  | 注 4 |
| 次级债券   | 4,000,000,000.00  | 2016-11-17                 | 2019-11-17                 | 4,000,000,000.00  | 3.30%        | 4,000,000,000.00  | 4,000,000,000.00  | 注 5 |
| 次级债券   | 2,000,000,000.00  | 2016-11-17                 | 2021-11-17                 | 2,000,000,000.00  | 3.40%        | 2,000,000,000.00  | 2,000,000,000.00  | 注 5 |
| 公司债券   | 15,000,000,000.00 | 2016-5-18                  | 2020-5-17                  | 15,000,000,000.00 | 3.60%        | 15,000,000,000.00 | 15,000,000,000.00 | 注 6 |
| 公司债券   | 5,000,000,000.00  | 2016-5-18                  | 2021-5-17                  | 5,000,000,000.00  | 3.80%        | 5,000,000,000.00  | 5,000,000,000.00  | 注 6 |
| 收益凭证   | 13,724,576,000.00 | 2017-1-16 至<br>2018-1-2    | 2018-1-14 至<br>2019-12-30  | 13,724,576,000.00 | 3.40%-5.35%  | 13,994,798,990.32 | 10,117,362,746.26 |     |
| 收益凭证   | 447,300,000.00    | 2016-11-11 至<br>2016-11-18 | 2017-11-20 至<br>2017-11-30 | 447,300,000.00    | 4.20%至 4.50% |                   | 447,300,000.00    |     |
| 资产支持债券 | 2,000,000,000.00  | 2017/11/17                 | 2019/5/17                  | 2,000,000,000.00  | 5.20%        | 1,900,000,000.00  |                   | 注 7 |
| 次级债券   | 4,500,000,000.00  | 2017/3/16                  | 2020/3/16                  | 4,500,000,000.00  | 4.80%        | 4,500,000,000.00  |                   | 注 8 |
| 公司债券   | 5,000,000,000.00  | 2017/8/11                  | 2020/8/11                  | 5,000,000,000.00  | 4.63%        | 4,991,716,878.94  |                   | 注 9 |

| 债券类型  | 面值                        | 发行日期                      | 到期日期                     | 发行金额                      | 票面利率         | 期末账面余额           | 年初账面余额           | 注    |
|-------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|---------------------------|--------------|------------------|------------------|------|
| 公司债券  | 1,000,000,000.00          | 2017/8/11                 | 2022/8/11                | 1,000,000,000.00          | 4.80%        | 998,244,272.76   |                  | 注 9  |
| 公司债券  | 5,500,000,000.00          | 2017/9/22                 | 2027/9/22                | 5,500,000,000.00          | 4.99%        | 5,489,843,213.05 |                  | 注 10 |
| 公司债券  | 500,000,000.00            | 2017/10/25                | 2020/10/25               | 500,000,000.00            | 4.77%        | 499,110,532.39   |                  | 注 11 |
| 可转换债券 | HK\$1,008,000,000.00      | 2013-7-18                 | 2018-7-18                | HK\$1,019,600,000.00      | 1.25%        |                  | 1,935,683.80     | 注 12 |
| 可转换债券 | HK\$1,164,000,000.00      | 2014-11-4                 | 2019-11-4                | HK\$1,146,540,000.00      | 1.25%        | 115,515,733.94   | 120,927,478.41   | 注 12 |
| 担保债券  | US\$600,000,000.00        | 2014-9-11                 | 2019-9-11                | US\$592,854,000.00        | 3.99%        | 3,896,282,953.16 | 4,123,318,700.13 | 注 13 |
| 担保债券  | US\$700,000,000.00        | 2015-1-29                 | 2020-1-29                | US\$700,000,000.00        | 4.20%        | 4,512,400,301.01 | 4,776,231,215.64 | 注 14 |
| 公司债券  | US\$900,000,000.00        | 2013-10-29                | 2018-10-29               | US\$896,166,000.00        | 3.95%        | 5,826,645,289.77 | 6,119,401,537.30 | 注 15 |
| 担保债券  | US\$670,000,000.00        | 2015-4-21                 | 2020-4-20                | US\$670,000,000.00        | 3.50%        | 4,369,258,552.24 | 4,634,840,022.07 | 注 16 |
| 中期票据  | 500,000,000.00            | 2014-5-30                 | 2017-5-30                | 495,795,040.95            | 5.80%        |                  | 499,368,154.39   |      |
| 中期票据  | 1,600,000,000.00          | 2014-9-18                 | 2017-9-18                | 1,594,351,433.34          | 5.60%        |                  | 1,598,502,130.12 |      |
| 中期票据  | 400,000,000.00            | 2014-11-18                | 2017-11-20               | 399,200,000.00            | 5.39%        |                  | 399,244,550.07   |      |
| 资产证券化 | 1,362,000,000.00          | 2015-5-7                  | 2019-7-23                | 1,362,000,000.00          | 5.6%至 6.55%  | 100,158,166.92   | 454,353,417.73   | 注 17 |
| 中期票据  | 1,000,000,000.00          | 2015-7-2                  | 2018-7-2                 | 1,000,000,000.00          | 5.15%        | 999,055,112.52   | 997,501,073.76   | 注 18 |
| 中期票据  | 折 CNY<br>897,578,679.54   | 2015-02-26 至<br>2016-6-16 | 2018/2/26 至<br>2019/6/13 | 折 CNY<br>897,578,679.54   | 3.88%至 5.28% | 897,578,679.54   | 2,279,116,812.69 |      |
| 金融债券  | 折 CNY<br>20,607,954.19    | 2013/6/6 至<br>2017-12-18  | 2018/1/9 至<br>2020-11-9  | 折 CNY<br>20,607,954.19    | 0 至 8.53%    | 192,352,584.47   | 162,884,019.55   | 注 19 |
| 中期票据  | 折 CNY<br>1,085,485,108.52 | 2009/3/10 至<br>2017-12-28 | 2018/3/8 至<br>2022-12-15 | 折 CNY<br>1,085,485,108.52 | 0 至 9.70%    | 1,673,536,018.60 | 2,310,944,112.88 | 注 19 |

| 债券类型              | 面值                   | 发行日期       | 到期日期       | 发行金额                 | 票面利率  | 期末账面余额           | 年初账面余额           | 注    |
|-------------------|----------------------|------------|------------|----------------------|-------|------------------|------------------|------|
| 次级债券              | 500,000,000.00       | 2015-12-15 | 2021-12-14 | 500,000,000.00       | 4.94% | 498,799,921.24   | 498,659,717.81   | 注 20 |
| 可转换债券             | HK\$3,880,000,000.00 | 2016-10-25 | 2021-10-25 | HK\$3,880,000,000.00 | 0.00% | 3,116,347,924.13 | 3,278,538,921.92 | 注 21 |
| 公司债券              | € 100,000,000.00     | 2016-5-18  | 2021-5-17  | € 100,000,000.00     | 1.60% | 1,710,946,370.97 | 1,600,803,425.38 | 注 22 |
| 公司债券              | € 120,000,000.00     | 2016-5-26  | 2021-5-26  | € 120,000,000.00     | 1.60% |                  |                  |      |
| 资产证券化             | 1,200,000,000.00     | 2016-4-22  | 2019-3-14  | 1,200,000,000.00     | 4.50% | 1,137,153,514.56 | 1,134,888,671.63 | 注 23 |
| 中期票据              | 600,000,000.00       | 2016-6-3   | 2021-6-3   | 600,000,000.00       | 4.07% | 598,239,990.82   | 597,226,256.73   | 注 24 |
| 中期票据              | 400,000,000.00       | 2016-1-19  | 2019-1-19  | 400,000,000.00       | 3.60% | 399,054,216.20   | 398,154,219.47   | 注 25 |
| 境外私募债             | US\$24,000,000.00    | 2016-9-28  | 2019-2-28  | US\$24,000,000.00    | 2.90% | 415,643,086.78   | 442,630,346.74   | 注 26 |
| 境外私募债             | US\$40,000,000.00    | 2016-9-28  | 2019-9-24  | US\$40,000,000.00    | 3.00% |                  |                  |      |
| 中期票据              | 600,000,000.00       | 2016-7-15  | 2021-7-15  | 600,000,000.00       | 3.70% | 598,279,452.46   | 597,344,184.82   | 注 27 |
| 资产证券化             | 1,500,000,000.00     | 2016-11-15 | 2019-10-21 | 1,500,000,000.00     | 3.72% | 1,420,883,360.12 | 1,418,841,522.05 | 注 28 |
| 公司债               | 1,000,000,000.00     | 2017-7-21  | 2020-7-21  | 1,000,000,000.00     | 4.70% | 995,078,400.15   |                  | 注 29 |
| 公司债               | 1,500,000,000.00     | 2017-6-21  | 2020-6-21  | 1,500,000,000.00     | 4.95% | 1,491,472,141.08 |                  | 注 30 |
| 资产支持证券            | 1,650,000,000.00     | 2017-8-4   | 2020-6-12  | 1,650,000,000.00     | 5.40% | 1,558,884,346.80 |                  | 注 31 |
| 资产支持票据            | 1,430,000,000.00     | 2017-11-22 | 2020-9-19  | 1,430,000,000.00     | 5.80% | 1,352,992,051.35 |                  | 注 32 |
| 非公开定向债务融资工具 (PPN) | 800,000,000.00       | 2017-9-9   | 2020-11-13 | 800,000,000.00       | 5.80% | 796,401,148.49   |                  | 注 33 |
| 次级债券              | 1,000,000,000.00     | 2015-11-9  | 2020-11-9  | 1,000,000,000.00     | 4.95% | 850,000,000.00   | 400,000,000.00   | 注 34 |
| PPN 私募债           | 200,000,000.00       | 2015-5-15  | 2018-5-14  | 200,000,000.00       | 5.90% | 199,912,613.33   | 199,679,893.33   | 注 35 |

| 债券类型 | 面值               | 发行日期      | 到期日期      | 发行金额             | 票面利率  | 期末账面余额             | 年初账面余额             | 注    |
|------|------------------|-----------|-----------|------------------|-------|--------------------|--------------------|------|
| 公司债券 | 1,400,000,000.00 | 2015-12-3 | 2020-12-3 | 1,400,000,000.00 | 4.25% | 1,390,698,736.55   | 1,388,366,489.71   | 注 36 |
| 公司债券 | 600,000,000.00   | 2015-12-3 | 2018-12-3 | 600,000,000.00   | 3.90% | 597,731,633.41     | 595,876,134.86     | 注 36 |
| 合 计  |                  |           |           |                  |       | 130,158,268,817.49 | 128,295,192,262.28 |      |

注 1：公司于 2013 年 11 月 25 日发行了面值为人民币 120 亿元的公司债券，本期债券分为 3 年期固定利率、5 年期固定利率和 10 年期固定利率三个品种，最终发行规模分别为人民币 72.6 亿元、人民币 23.5 亿元和人民币 23.9 亿元。

注 2：公司于 2014 年 7 月 14 日发行了面值为人民币 110 亿元的公司债券，本期债券分为 3 年期固定利率、5 年期固定利率和 10 年期固定利率三个品种，最终发行规模分别为人民币 56.5 亿元、人民币 45.5 亿元和人民币 8 亿元。

注 3：公司于 2015 年 4 月 8 日发行了面值为人民币 150 亿元的次级债券，期限为 5 年期固定利率（在第 3 年末附发行人赎回权），最终发行规模为人民币 150 亿元。

注 4：公司于 2015 年 6 月 12 日发行了面值为人民币 200 亿元的次级债券，本期债券分为 3 年期固定利率（在第 2 年末附发行人赎回权）和 5 年期固定利率（在第 3 年末附发行人赎回权）两个品种，最终发行规模分别为人民币 150 亿元和人民币 50 亿元。本公司于 2017 年 6 月 12 日行使了次级债券发行人赎回选择权，对赎回登记日登记在册的“15 海通 C2”进行了全部赎回。

注 5：公司于 2016 年 11 月 17 日发行了面值为人民币 60 亿元的次级债券，本期债券分为 3 年期固定利率和 5 年期固定利率两个品种，最终发行规模分别为人民币 40 亿元和人民币 20 亿元。

注 6：公司于 2016 年 5 月 18 日发行了面值为人民币 200 亿元的非公开发行公司债券，本期债券分为 4 年期固定利率（在第 3 年末附发行人赎回选择权）和 5 年期固定利率两个品种，最终发行规模分别为人民币 150 亿元和人民币 50 亿元。

注 7：公司于 2017 年 11 月 17 日发行了总面值为人民币 20 亿元的资产支持证券，并自行购买了其中人民币 1 亿元的资产支持证券；发行的该资产支持证券实际收到的认购款为人民币 19 亿元。

注 8：公司于 2017 年 3 月 16 日发行了面值为人民币 45 亿元的次级债券，本期债券为 3 年期固定利率，最终发行规模为人民币 45 亿元。

注 9：公司于 2017 年 8 月 11 日发行了面值为人民币 60 亿元的公司债券，本期债券分为 3 年期固定利率和 5 年期固定利率两个品种，最终发行规模分别为人民币 50 亿

元和人民币 10 亿元。

注 10: 公司于 2017 年 9 月 22 日发行了面值为人民币 55 亿元的公司债券, 本期债券为 10 年期固定利率, 最终发行规模为人民币 55 亿元。

注 11: 公司于 2017 年 10 月 25 日发行了面值为人民币 5 亿元的公司债券, 本期债券为 3 年期固定利率, 最终发行规模为人民币 5 亿元。

注 12: 公司子公司海通国际证券集团有限公司在 2013 年和 2014 年分别发行了面值为港币 10.08 亿元和港币 11.64 亿元上市可转换债券。上述可转换债券固定年利率为 1.25%, 5 年到期。债务部分和权益部分的总价值于债券发行之日确定。截止 2017 年 12 月 31 日, 海通国际证券 2013 年和 2014 年发行的可转债转换价格分别被调整为港币 2.76 元/股和港币 4.61 元/股。2017 年度, 没有于 2013 及 2014 年由公司发行的可转换债券被转换为普通股。

注 13: 公司子公司 Haitong International Finance Holdings 2014 Limited 于 2014 年 9 月 11 日发行了面值为美元 6 亿元的上市担保债券, 到期还本。公司为上述债券提供了维好协议。根据维好协议, 公司将督促海通国际控股有限公司在任何时候均有偿付能力, 并且拥有足够的流动性以按时偿付债券条款中约定的与该债券相关的应付款项。

注 14: 公司子公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 于 2015 年 1 月 29 日发行了面值为美元 7 亿元的上市担保债券, 到期还本。公司为上述债券提供了维好协议。根据维好协议, 公司将督促海通国际控股有限公司在任何时候均有偿付能力, 并且拥有足够的流动性以按时偿付债券条款中约定的与该债券相关的应付款项。

注 15: 公司子公司 Haitong International Finance Holdings Limited 于 2013 年 10 月 29 日, 在香港交易所发行了面值为美元 9 亿元的公司债券, 到期期限为 5 年。该债券由中国银行新加坡分行开立备用信用证担保。债券的面值将于到期日全额赎回。公司为上述债券提供了维好协议。根据维好协议, 公司将督促海通国际控股有限公司在任何时候均有偿付能力, 并且拥有足够的流动性以按时偿付债券条款中约定的与该债券相关的应付款项。

注 16: 公司的债券发行主体 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 于

2015年4月21日发行了面值为美元6.7亿元的企业债券，到期期限为5年。该债券每半年付息一次，付息日为每年的4月21日以及10月21日。

注17：公司子公司海通恒信国际租赁有限公司于2015年5月7日发行了总面值为人民币13.62亿元的资产支持专项计划，并自行购买了其中人民币0.14亿元的次级资产支持证券；该专项计划实际收到的优先级资产支持证券的认购款为人民币13.48亿元。

注18：Unican Limited于2015年7月2日发行了面值为人民币10亿元的固定利率中期票据，到期期限为3年。

注19：截至2017年12月31日，海通银行欧元债券的余额为折合人民币18.66亿元。

注20：公司子公司海通期货股份有限公司于2015年12月15日发行了面值总额为人民币5亿元的次级债券，债券为6年期，在第3年末附发行人赎回权。

注21：公司子公司海通国际证券集团有限公司于2016年10月25日发行了面值为港币38.80亿元零息可转换债券，到期期限为5年。债务部分和权益部分总价值于债券发行之日确定。截止2017年12月31日，海通国际证券2016年发行的可转债转换价格分别被调整为港币6.53元每股，2017年度，没有于2016年由公司发行的可转换债券被转换为普通股。

注22：公司子公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited分别于2016年5月18日和2016年5月26日在境外发行了面值分别为欧元1亿元固定利率债券和欧元1.2亿元固定利率债券，期限为5年。上述债券由本公司担保。

注23：公司子公司海通恒信国际租赁有限公司于2016年4月22日发行了总面值为人民币12亿元的资产支持专项计划，并自行购买了其中人民币0.6亿元的次级资产支持证券。

注24：公司子公司海通恒信国际租赁有限公司于2016年6月3日发行了总面值为人民币6亿元的固定利率中期票据，期限为5年(3+2)，附第3年末发行人调整票面利率选择权和投资者回售选择权，年利率为4.07%。

注 25: 公司子公司海通恒信国际租赁有限公司于 2016 年 1 月 19 日发行了总面值为人民币 4 亿元的固定利率中期票据, 期限为 3 年, 年利率为 3.6%。

注 26: 公司子公司 Unican Limited 于 2016 年 9 月 28 日在香港股票交易所发行了总面值为美元 6,400.00 万元的固定利率境外私募债, 其中美元 2,400.00 万元的发行利率为 2.90%, 期限为 29 个月; 美元 4,000.00 万元的发行利率为 3.00%, 期限为 36 个月。

注 27: 公司子公司海通恒信国际租赁有限公司于 2016 年 7 月 15 日发行了总面值为人民币 6 亿元的固定利率中期票据, 期限为 5 年 (3+2), 附第 3 年末发行人调整票面利率选择权和投资者回售选择权, 年利率为 3.7%。

注 28: 公司子公司海通恒信国际租赁有限公司于 2016 年 11 月 15 日发行了总面值为人民币 15 亿元的资产支持专项计划, 并自行购买了其中人民币 0.75 亿元的次级资产支持证券。

注 29: 公司子公司海通恒信国际租赁股份有限公司于 2017 年 7 月 21 日发行了总面值为人民币 10 亿元的公司债, 期限为 3 年, 发行利率为 4.70%。

注 30: 公司子公司海通恒信国际租赁股份有限公司于 2017 年 6 月 21 日发行了总面值为人民币 15 亿元的公司债, 期限为 3 年, 发行利率为 4.95%。

注 31: 公司子公司海通恒信国际租赁股份有限公司于 2017 年 8 月 4 日发行了总面值为人民币 16.5 亿元的资产支持专项计划。海通恒信国际租赁有限公司自行购买了其中 0.83 亿元的次级资产支持证券。

注 32: 公司子公司海通恒信国际租赁股份有限公司于 2017 年 11 月 22 日发行了总面值为人民币 14.3 亿元的资产支持票据, 并持有了其中 0.70 亿元的次级资产支持票据, 占比 4.90%。

注 33: 公司子公司海通恒信国际租赁股份有限公司于 2017 年 9 月 9 日发行了总面值为人民币 8 亿元的非公开定向债务融资工具, 期限为 3 年, 发行利率为 5.80%。

注 34: 公司子公司上海海通证券资产管理有限公司于 2015 年 11 月 9 日发行了总面值为人民币 10 亿元的次级债券, 到期期限为 5 年, 并自行认购了其中人民币 1.5 亿元的次级债券。

注 35: 公司子公司海通开元投资有限公司于 2015 年 5 月 15 日发行了总面值为人民币 2 亿元的非公开定向债务融资工具, 到期期限为 3 年。

注 36: 公司子公司海通开元投资有限公司于 2015 年 12 月 3 日公开发行了总面值为人民币 20 亿元的公司债券, 本期债券分为 3 年期固定利率和 5 年期固定利率两个品种, 最终发行规模为人民币 6 亿元和人民币 14 亿元。

### (三十七) 其他负债

#### 1、 按类别列示

| 项 目           | 期末余额              | 年初余额              |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 其他应付款         | 2,096,236,455.17  | 1,332,505,300.31  |
| 应付股利          | 19,198,493.27     | 7,535,561.12      |
| 代理兑付债券款       | 17,570,214.02     | 17,582,361.22     |
| 长期应付款         | 6,012,258,617.85  | 3,539,520,706.04  |
| 中央银行款项及国家外汇存款 | 468,138,020.94    | 438,407,759.39    |
| 吸收存款          | 3,750,620,967.50  | 4,757,573,279.19  |
| 同业存放          | 293,733,007.20    | 14,586,297.89     |
| 其他            | 221,847,795.48    | 330,974,200.74    |
| 合 计           | 12,879,603,571.43 | 10,438,685,465.90 |

#### 2、 其他应付款

##### (1) 明细列示

| 项 目              | 期末余额             | 期初余额             |
|------------------|------------------|------------------|
| 应付投资者保护基金及风险准备金等 | 362,025,639.07   | 266,225,279.51   |
| 应付服务费            | 21,214,014.53    | 47,318,849.02    |
| 以前年度待处理应付款       | 13,434,225.85    | 13,345,742.48    |
| 应付代理承销证券款        | 2,300,000.00     | 4,549,195.08     |
| 其他               | 1,697,262,575.72 | 1,001,066,234.22 |
| 合 计              | 2,096,236,455.17 | 1,332,505,300.31 |

(2) 期末数中无欠持公司 5%以上 (含 5%) 表决权股份的股东单位款项。

### 3、 应付股利

| 项 目      | 期末余额          | 年初余额         |
|----------|---------------|--------------|
| 应付公司股东股利 | 19,198,493.27 | 7,535,561.12 |
| 合 计      | 19,198,493.27 | 7,535,561.12 |

### 4、 代理兑付债券款

| 项 目  | 年初余额          | 本期收到兑付 |  | 本期已兑付<br>债券 | 本期手续费<br>收入 | 期末金额          |
|------|---------------|--------|--|-------------|-------------|---------------|
|      |               | 现金     |  |             |             |               |
| 国债   | 11,037,480.71 |        |  | 12,147.20   |             | 11,025,333.51 |
| 企业债券 | 2,540,588.04  |        |  |             |             | 2,540,588.04  |
| 金融债券 | 6,425.00      |        |  |             |             | 6,425.00      |
| 其他债券 | 3,997,867.47  |        |  |             |             | 3,997,867.47  |
| 合 计  | 17,582,361.22 |        |  | 12,147.20   |             | 17,570,214.02 |

### 5、 长期应付款

| 项 目    | 期末余额             | 年初余额             |
|--------|------------------|------------------|
| 承租人保证金 | 5,361,704,449.14 | 3,312,227,867.97 |
| 其他     | 650,554,168.71   | 227,292,838.07   |
| 合 计    | 6,012,258,617.85 | 3,539,520,706.04 |

### 6、 中央银行款项及国家外汇存款

| 项 目    | 期末余额           | 年初余额           |
|--------|----------------|----------------|
| 中央银行款项 | 468,138,020.94 | 438,407,759.39 |
| 合 计    | 468,138,020.94 | 438,407,759.39 |

### 7、 吸收存款

| 项 目         | 期末余额             | 年初余额             |
|-------------|------------------|------------------|
| 活期存款        | 475,574,150.20   | 136,624,643.40   |
| -公司         | 473,690,120.23   | 134,728,000.24   |
| -个人         | 1,884,029.97     | 1,896,643.16     |
| 定期存款(含通知存款) | 3,275,046,817.30 | 4,620,948,635.79 |

| 项 目 | 期末余额             | 年初余额             |
|-----|------------------|------------------|
| -公司 | 2,425,291,471.40 | 4,376,873,702.22 |
| -个人 | 849,755,345.90   | 244,074,933.57   |
| 合 计 | 3,750,620,967.50 | 4,757,573,279.19 |

(三十八) 股本

| 项 目          | 年初余额              | 本期变动增 (+) 减 (-) |    |       |         |    | 期末余额              |
|--------------|-------------------|-----------------|----|-------|---------|----|-------------------|
|              |                   | 发行新股            | 送股 | 国有股减持 | 限售股上市流通 | 小计 |                   |
| 1. 有限售条件股份   |                   |                 |    |       |         |    |                   |
| (1)国家持股      |                   |                 |    |       |         |    |                   |
| (2)国有法人持股    |                   |                 |    |       |         |    |                   |
| (3)其他境内法人持股  |                   |                 |    |       |         |    |                   |
| 有限售条件股份合计    |                   |                 |    |       |         |    |                   |
| 2. 无限售条件流通股份 |                   |                 |    |       |         |    |                   |
| A 股          | 8,092,131,180.00  |                 |    |       |         |    | 8,092,131,180.00  |
| H 股          | 3,409,568,820.00  |                 |    |       |         |    | 3,409,568,820.00  |
| 无限售条件流通股份合计  | 11,501,700,000.00 |                 |    |       |         |    | 11,501,700,000.00 |
| 合 计          | 11,501,700,000.00 |                 |    |       |         |    | 11,501,700,000.00 |

(三十九) 资本公积

| 项 目                         | 年初余额              | 本期增加          | 本期减少         | 期末余额              |
|-----------------------------|-------------------|---------------|--------------|-------------------|
| 资本溢价 (股本溢价)                 |                   |               |              |                   |
| (1)投资者投入的资本                 | 56,646,345,516.23 |               |              | 56,646,345,516.23 |
| (2)非同一控制下企业合并后购买子公司少数股权的影响等 | -307,875,942.66   | 21,984,424.62 | 2,474,382.52 | -288,365,900.56   |
| 合 计                         | 56,338,469,573.57 | 21,984,424.62 | 2,474,382.52 | 56,357,979,615.67 |

(四十) 其他综合收益

| 项 目                                     | 年初余额            | 本期发生金额           |                        |                |                  |                     | 期末余额             |
|---|-----------------|------------------|------------------------|----------------|------------------|---------------------|------------------|
|   |                 | 本期所得税前<br>发生额    | 减：前期计入其他综合<br>收益当期转入损益 | 减：所得税费<br>用    | 税后归属于<br>母公司     | 税后归属于<br>少数股东       |                  |
| 1. 以后不能重分类进损益的其他综合收益                    | -79,708,337.70  | 5,293,351.27     |                        | 1,455,671.60   | 3,837,679.67     |                     | -75,870,658.03   |
| 其中：重新计算设定受益计划净负债和净资产的变动                 | -79,708,337.70  | 5,293,351.27     |                        | 1,455,671.60   | 3,837,679.67     |                     | -75,870,658.03   |
| 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的<br>其他综合收益中享有的份额     |                 |                  |                        |                |                  |                     |                  |
| 2. 以后将重分类进损益的其他综合收益                     | 188,445,568.10  | 2,853,891,853.80 | 1,588,353,394.39       | 475,647,412.46 | 1,513,954,383.60 | -<br>724,063,336.65 | 1,702,399,951.70 |
| 其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的<br>其他综合收益中享有的份额 | 217,640,755.72  | -23,824,503.30   |                        |                | -23,824,503.30   |                     | 193,816,252.42   |
| 可供出售金融资产公允价值变动损益                        | 670,198,964.46  | 3,467,349,642.10 | 1,588,353,394.39       | 475,647,412.46 | 1,321,575,623.38 | 81,773,211.87       | 1,991,774,587.84 |
| 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益                   |                 |                  |                        |                |                  |                     |                  |
| 现金流量套期损益的有效部分                           |                 |                  |                        |                |                  |                     |                  |
| 外币财务报表折算差额                              | -675,698,568.87 | -582,371,789.31  |                        |                | 230,423,879.62   | -<br>812,795,668.93 | -445,274,689.25  |
| 其他                                      | -23,695,583.21  | -7,261,495.69    |                        |                | -14,220,616.10   | 6,959,120.41        | -37,916,199.31   |
| 其他综合收益合计                                | 108,737,230.40  | 2,859,185,205.07 | 1,588,353,394.39       | 477,103,084.06 | 1,517,792,063.27 | -<br>724,063,336.65 | 1,626,529,293.67 |

(四十一) 盈余公积

| 项 目    | 年初余额             | 本期增加           | 本期减少 | 期末余额             |
|--------|------------------|----------------|------|------------------|
| 法定盈余公积 | 5,085,156,596.54 | 618,756,401.32 |      | 5,703,912,997.86 |
| 合 计    | 5,085,156,596.54 | 618,756,401.32 |      | 5,703,912,997.86 |

注：盈余公积提取情况详见附注五、（四十三）注 1。

(四十二) 一般风险准备

| 项 目    | 年初余额              | 本期增加             | 本期减少 | 期末余额              |
|--------|-------------------|------------------|------|-------------------|
| 一般风险准备 | 5,679,267,946.72  | 884,630,181.07   |      | 6,563,898,127.79  |
| 交易风险准备 | 5,085,156,596.54  | 618,756,401.32   |      | 5,703,912,997.86  |
| 合 计    | 10,764,424,543.26 | 1,503,386,582.39 |      | 12,267,811,125.65 |

注：一般风险准备和交易风险准备提取情况详见附注五、（四十三）注 1。

(四十三) 未分配利润

| 项 目                | 本期                | 上期                | 提取或分配比例 |
|--------------------|-------------------|-------------------|---------|
| 年初未分配利润            | 26,331,639,342.89 | 25,319,984,185.00 |         |
| 加：会计政策变更对年初未分配利润影响 |                   |                   |         |
| 本期归属于母公司股东的净利润     | 8,618,423,293.06  | 8,043,334,519.30  |         |
| 减：提取法定盈余公积         | 618,756,401.32    | 572,467,539.39    | 10%，注 1 |
| 提取一般风险准备           | 1,503,386,582.39  | 1,283,446,822.02  | 20%，注 1 |
| 应付普通股股利            | 2,530,374,000.00  | 5,175,765,000.00  | 注 2     |
| 期末未分配利润            | 30,297,545,652.24 | 26,331,639,342.89 |         |

注 1：公司每年末对税后净利润根据《公司法》规定计提 10%法定盈余公积，根据《金融企业财务规则》计提 10%一般（风险）准备，根据《证券法》计提 10%交易风险准备。一般风险准备还包括公司下属子公司根据所属行业或所属地区适用法规提取的一般风险准备。

注 2：根据海通证券 2016 年度股东大会决议，公司以实施分红股权登记日总股本 11,501,700,000 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金股利 2.20 元（含税），共计分配现金股利 2,530,374,000.00 元，现金股利发放日为 2017 年 7 月 27 日。

(四十四) 手续费及佣金净收入

1、 按类别列示

| 项 目               | 本期金额              | 上期金额              |
|-------------------|-------------------|-------------------|
| <b>手续费及佣金收入</b>   | 11,225,082,527.74 | 12,711,293,177.52 |
| <b>1.经纪业务收入</b>   | 5,470,202,819.84  | 6,957,664,509.31  |
| 其中：证券经纪业务收入       | 4,958,295,723.81  | 6,406,529,280.34  |
| 其中：代理买卖证券业务       | 4,316,581,621.65  | 5,628,260,004.27  |
| 交易单元席位租赁          | 587,630,731.09    | 680,081,526.49    |
| 代销金融产品业务          | 54,083,371.07     | 98,187,749.58     |
| 期货经纪业务收入          | 511,907,096.03    | 551,135,228.97    |
| <b>2.投资银行业务收入</b> | 3,362,185,876.60  | 3,403,549,605.09  |
| 其中：证券承销业务         | 2,415,937,393.23  | 2,576,387,634.24  |
| 保荐服务业务            | 51,119,757.08     | 42,912,200.75     |
| 财务顾问业务            | 895,128,726.29    | 784,249,770.10    |
| <b>3.投资咨询业务收入</b> | 245,006,334.72    | 676,733,909.79    |
| <b>4.资产管理业务收入</b> | 654,239,042.41    | 589,726,513.36    |
| <b>5.基金管理业务收入</b> | 1,444,109,857.26  | 1,052,128,250.51  |
| <b>6.杠杆外汇业务收入</b> | 48,775,069.39     | 30,828,311.42     |
| <b>7.黄金买卖业务收入</b> | 563,527.52        | 662,078.04        |
| <b>手续费及佣金支出</b>   | 1,668,883,800.66  | 1,746,284,322.95  |
| <b>1.经纪业务支出</b>   | 1,528,927,567.38  | 1,643,254,705.02  |
| 其中：证券经纪业务支出       | 1,449,945,812.55  | 1,560,534,076.09  |
| 其中：代理买卖证券业务       | 1,449,945,812.55  | 1,560,534,076.09  |
| 交易单元席位租赁          |                   |                   |
| 代销金融产品业务          |                   |                   |
| 期货经纪业务支出          | 78,981,754.83     | 82,720,628.93     |
| <b>2.投资银行业务支出</b> | 32,293,340.61     | 47,530,045.03     |
| 其中：证券承销业务         | 32,258,623.63     | 32,926,271.39     |
| 保荐服务业务            |                   |                   |
| 财务顾问业务            | 34,716.98         | 14,603,773.64     |
| <b>3.投资咨询业务支出</b> | 104,495,002.40    | 45,616,280.46     |
| <b>4.资产管理业务支出</b> |                   |                   |

| 项 目        | 本期金额             | 上期金额              |
|------------|------------------|-------------------|
| 5.基金管理业务支出 | 460,080.27       | 1,032,334.31      |
| 6.杠杆外汇业务支出 | 1,315,148.61     | 4,617,408.93      |
| 7.黄金买卖业务支出 | 1,392,661.39     | 4,233,549.20      |
| 手续费及佣金净收入  | 9,556,198,727.08 | 10,965,008,854.57 |

## 2、 财务顾问业务净收入按类别列示

| 项 目                  | 本期发生额          | 上期发生额          |
|----------------------|----------------|----------------|
| 并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司 | 171,644,686.29 | 134,843,396.21 |
| 并购重组财务顾问业务净收入-其他     | 364,746,588.86 | 250,079,666.20 |
| 其他财务顾问业务净收入          | 358,702,734.16 | 384,722,934.05 |
| 合 计                  | 895,094,009.31 | 769,645,996.46 |

## 3、 代理销售金融产品业务收入情况

| 代理销售金融<br>产品业务 | 本期                 |               | 上期                 |               |
|----------------|--------------------|---------------|--------------------|---------------|
|                | 销售总金额              | 销售总收入         | 销售总金额              | 销售总收入         |
| 基金             | 21,728,129,188.59  | 50,611,595.38 | 16,635,465,242.89  | 85,657,160.36 |
| 证券公司理财产品       | 223,121,875,734.58 | 2,481,949.22  | 261,846,840,042.93 | 11,506,948.74 |
| 其他             | 68,726,082,000.00  | 989,826.47    | 71,209,259,000.00  | 1,023,640.48  |
| 合 计            | 313,576,086,923.17 | 54,083,371.07 | 349,691,564,285.82 | 98,187,749.58 |

## 4、 资产管理业务净收入情况

| 项 目       | 集合资产管理业务          | 定向资产管理业务           | 专项资产管理业务         |
|-----------|-------------------|--------------------|------------------|
| 期末产品数量    | 96                | 224                | 4                |
| 期末客户数量    | 137,336           | 224                | 61               |
| 其中：个人客户   | 136,968           | 31                 |                  |
| 机构客户      | 368               | 193                | 61               |
| 年初受托资金    | 74,117,583,800.82 | 768,219,771,094.24 | 780,500,000.00   |
| 其中：自有资金投入 | 1,825,472,492.52  |                    |                  |
| 个人客户      | 34,836,076,463.23 | 1,298,030,065.74   |                  |
| 机构客户      | 39,281,507,337.59 | 766,921,741,028.50 | 780,500,000.00   |
| 期末受托资金    | 52,135,511,201.93 | 267,929,462,537.43 | 5,087,400,000.00 |

| 项 目                 | 集合资产管理业务          | 定向资产管理业务           | 专项资产管理业务         |
|---------------------|-------------------|--------------------|------------------|
| 其中：自有资金投入           | 2,340,025,131.77  |                    |                  |
| 个人客户                | 35,105,710,202.46 | 2,447,634,185.61   |                  |
| 机构客户                | 17,029,800,999.47 | 265,481,828,351.82 | 5,087,400,000.00 |
| <b>期末主要受托资产初始成本</b> | 52,781,638,589.53 | 279,140,682,504.93 | 5,138,016,948.84 |
| 其中：股票               | 5,461,008,988.83  | 12,453,392,471.15  |                  |
| 基金                  | 1,791,177,599.43  | 1,332,423,038.81   |                  |
| 国债                  |                   |                    |                  |
| 其他债券                | 24,495,458,858.84 | 15,150,340,828.59  |                  |
| 资产支持证券              | 196,173,583.57    | 434,837,605.87     |                  |
| 期货                  | 11,111,499.60     |                    |                  |
| 银行理财计划              | 404,086,746.96    | 14,005,024,781.46  |                  |
| 信托计划                | 546,657,027.80    | 37,979,810,357.08  |                  |
| 专项资产管理计划            | 229,000,000.00    | 44,456,798,530.15  |                  |
| 银行承兑汇票              |                   | 1,794,357,611.19   |                  |
| 资产收益权               |                   | 69,619,723,694.71  |                  |
| 其他（买入返售、协议存款、回购）    | 19,646,964,284.50 | 81,913,973,585.92  | 5,138,016,948.84 |
| <b>当期资产管理业务净收入</b>  | 396,522,072.27    | 255,431,297.55     | 2,285,672.59     |

5、 手续费及佣金净收入本期发生额比上期发生额减少 14.09 亿元，减少 12.85%，主要是证券经纪业务净收入减少。

#### (四十五) 利息净收入

##### 按类别列示

| 项 目           | 本期金额              | 上期金额              |
|---------------|-------------------|-------------------|
| <b>利息收入</b>   | 15,124,317,313.26 | 16,180,547,566.55 |
| 存放金融同业利息收入    | 2,897,112,976.93  | 3,164,933,385.99  |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 1,146,844,696.24  | 1,289,277,721.03  |
| 客户资金存款利息收入    | 1,750,268,280.69  | 1,875,655,664.96  |
| 融资融券利息收入      | 4,135,956,190.39  | 5,047,766,520.32  |
| 买入返售金融资产利息收入  | 4,265,940,952.85  | 4,743,988,725.02  |
| 其中：约定购回利息收入   | 117,384,266.17    | 61,677,088.07     |

| 项 目          | 本期金额                     | 上期金额                     |
|--------------|--------------------------|--------------------------|
| 股票质押回购利息收入   | 3,241,803,754.57         | 2,611,733,044.08         |
| 融资租赁利息收入     | 2,675,751,612.44         | 2,401,560,137.06         |
| 客户贷款利息收入     | 830,782,753.80           | 694,180,454.41           |
| 其他利息收入       | 318,772,826.85           | 128,118,343.75           |
| <b>利息支出</b>  | <b>11,458,391,781.30</b> | <b>12,340,937,211.15</b> |
| 客户资金存款利息支出   | 282,433,369.53           | 345,376,669.44           |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 1,804,898,663.09         | 2,627,624,880.92         |
| 其中：报价回购利息支出  | 4,337,757.83             | 4,951,241.93             |
| 借款利息支出       | 2,395,040,913.27         | 2,768,182,362.77         |
| 拆入资金利息支出     | 353,269,480.64           | 367,073,495.50           |
| 其中：转融通融资利息支出 | 89,211,263.34            | 22,926,514.47            |
| 应付债券利息支出     | 5,957,070,232.32         | 6,038,402,242.25         |
| 其他利息支出       | 665,679,122.45           | 194,277,560.27           |
| <b>利息净收入</b> | <b>3,665,925,531.96</b>  | <b>3,839,610,355.40</b>  |

#### (四十六) 投资收益

##### 1、 按类别列示

| 项 目                     | 本期金额                    | 上期金额                    |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 权益法核算的长期股权投资收益          | 708,486,590.83          | 200,434,890.72          |
| 处置长期股权投资产生的投资收益         | 24,565,547.27           |                         |
| <b>金融工具投资收益</b>         | <b>9,933,611,765.53</b> | <b>5,333,121,506.52</b> |
| 其中：持有期间取得的收益            | 4,918,164,020.87        | 5,421,087,079.50        |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 4,535,102,084.41        | 4,911,460,714.88        |
| -持有至到期投资                | 3,887,513.00            | 7,759,205.53            |
| -可供出售金融资产               | 584,607,354.05          | 927,332,992.12          |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | -205,432,930.59         | -425,465,833.03         |
| 处置金融工具取得的收益             | 5,015,447,744.66        | -87,965,572.98          |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 2,736,957,317.48        | -1,371,932,923.25       |
| -持有至到期投资                |                         | 35,938.36               |

| 项 目                         | 本期金额                     | 上期金额                    |
|-----------------------------|--------------------------|-------------------------|
| -可供出售金融资产                   | 2,524,774,050.82         | 1,631,264,881.42        |
| -衍生金融工具                     | -16,247,467.25           | 496,784,554.92          |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的<br>金融负债 | -230,036,156.39          | -844,118,024.43         |
| <b>应收款项类投资的投资收益</b>         | <b>614,120,189.52</b>    | <b>942,231,822.52</b>   |
| <b>其他</b>                   | <b>84,735,017.05</b>     | <b>63,903,827.59</b>    |
| <b>合 计</b>                  | <b>11,365,519,110.20</b> | <b>6,539,692,047.35</b> |

## 2、 按权益法核算的长期股权投资收益

本期按权益法核算的长期股权投资收益总数为 708,486,590.83 元, 详见附注五、(十四)。

| 被投资单位                               | 本期金额                  | 上期金额                  | 本期比上期增减变<br>动的的原因 |
|-------------------------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|
| 富国基金管理有限公司                          | 201,664,118.94        | 208,841,073.22        | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| Multi-Tranche 基金系列                  | 408,741,491.50        | -49,317,994.86        | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| 西安航天新能源产业基金投资有限公司                   | 24,662,656.35         | 7,491,759.00          | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| 上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合<br>伙)          | 33,208,843.89         | -1,655,299.23         | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| 上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)                | 28,296,527.21         | 33,136,891.58         | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| 贵安恒信融资租赁(上海)有限公司                    | 20,970,407.18         |                       | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| HTI Investment Fund SPC - Fund I SP | -12,699,046.51        |                       | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| 其他                                  | 3,641,592.27          | 1,938,461.01          | 被投资单位净利润发生变<br>动  |
| <b>合 计</b>                          | <b>708,486,590.83</b> | <b>200,434,890.72</b> |                   |

## 3、 投资收益汇回限制情况

除受外汇管制外, 投资收益汇回无重大限制, 详见附注七、(一)、4。

- 4、 投资收益本期发生额比去上期发生额增加 48.26 亿元，上涨 73.79%。主要是处置金融工具产生的投资收益增加。

(四十七) 资产处置收益

| 项目        | 本期发生额         | 上期发生额       | 计入当期非经常性损益的金额 |
|-----------|---------------|-------------|---------------|
| 非流动资产处置收益 | -6,782,409.58 | -650,711.81 | -6,782,409.58 |
| 合计        | -6,782,409.58 | -650,711.81 | -6,782,409.58 |

(四十八) 公允价值变动收益

| 产生公允价值变动收益的来源                  | 本期发生额             | 上期发生额             |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值变动损益 | -238,839,784.46   | -3,864,813,334.91 |
| 衍生工具公允价值变动损益                   | -1,007,083,460.72 | 2,143,590,099.44  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债公允价值变动损益 | -83,487,621.42    | 1,489,889,494.28  |
| 合计                             | -1,329,410,866.60 | -231,333,741.19   |

公允价值变动收益本期发生额比去上期发生额减少 10.98 亿元，下降 474.67%。主要是衍生工具公允价值变动损益减少。

(四十九) 其他业务收入

| 项目   | 本期金额             | 上期金额             |
|------|------------------|------------------|
| 出租收入 | 99,588,908.52    | 21,622,631.77    |
| 销售收入 | 4,225,817,812.25 | 5,917,019,492.92 |
| 其他   | 870,281,966.85   | 901,896,314.74   |
| 合计   | 5,195,688,687.62 | 6,840,538,439.43 |

(五十) 税金及附加

| 项目            | 本期发生额         | 上期发生额         | 计缴标准   |
|---------------|---------------|---------------|--------|
| 城建税           | 60,392,181.15 | 68,364,965.99 | 1%或 7% |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 43,022,316.33 | 48,347,345.30 | 3%及 2% |
| 房产税           | 11,267,225.75 | 9,216,086.34  |        |

| 项 目 | 本期发生额          | 上期发生额          | 计缴标准 |
|-----|----------------|----------------|------|
| 印花税 | 7,951,134.28   | 7,388,780.76   |      |
| 其他  | 43,340,070.06  | 357,368,548.30 |      |
| 合 计 | 165,972,927.57 | 490,685,726.69 |      |

(五十一) 业务及管理费

| 项 目     | 本期发生额            | 上期发生额            |
|---------|------------------|------------------|
| 职工薪酬    | 6,400,065,513.57 | 6,168,039,704.52 |
| 租赁费     | 473,804,960.09   | 407,757,501.24   |
| 咨询费     | 301,681,199.46   | 217,841,130.57   |
| 固定资产折旧费 | 246,572,636.50   | 217,114,584.80   |
| 电子设备运转费 | 224,030,824.11   | 182,510,783.32   |
| 差旅费     | 206,835,632.34   | 204,332,975.44   |
| 聘请中介机构费 | 196,234,784.32   | 173,393,922.67   |
| 邮电通讯费   | 164,361,874.01   | 192,653,389.26   |
| 业务招待费   | 151,999,570.05   | 154,235,303.15   |
| 公杂费     | 149,186,070.42   | 231,278,026.12   |
| 其他      | 1,240,343,939.86 | 1,414,385,006.69 |
| 合 计     | 9,755,117,004.73 | 9,563,542,327.78 |

(五十二) 资产减值损失

| 项 目        | 本期金额             | 上期金额             |
|------------|------------------|------------------|
| 可供出售金融资产   | 247,962,705.44   | 240,545,714.47   |
| 应收账款及其他应收款 | 52,286,511.59    | -23,043,826.58   |
| 融出资金       | 130,875,959.16   | 62,843,272.09    |
| 买入返售金融资产   | 164,162,263.50   | 57,840,678.45    |
| 发放贷款和垫款    | 369,619,707.22   | 373,760,689.00   |
| 应收融资租赁款    | 393,139,161.29   | 507,743,356.07   |
| 应收保理款      | 193,440,729.56   | 59,189,288.36    |
| 其他         | 135,171,252.17   | 140,613,548.87   |
| 合 计        | 1,686,658,289.93 | 1,419,492,720.73 |

(五十三) 其他业务成本

| 项 目  | 本期发生额            | 上期发生额            |
|------|------------------|------------------|
| 销售成本 | 4,210,656,510.63 | 5,863,536,149.05 |
| 出租成本 | 39,440,019.34    | 3,829,547.67     |
| 其他   | 76,737,969.3     | 21,562,411.56    |
| 合 计  | 4,326,834,499.27 | 5,888,928,108.28 |

(五十四) 营业外收入

1、 按类别列示

| 项 目       | 本期发生额          | 上期发生额          | 计入本期非经常性<br>损益的金额 |
|-----------|----------------|----------------|-------------------|
| 非流动资产处置利得 | 3,485,169.71   | 1,581,810.17   | 3,485,169.71      |
| 政府补助      | 648,512,045.00 | 568,028,571.86 | 648,512,045.00    |
| 其他        | 32,048,521.55  | 21,983,296.61  | 32,048,521.55     |
| 合 计       | 684,045,736.26 | 591,593,678.64 | 684,045,736.26    |

2、 政府补助明细

| 项 目            | 本期发生金额         | 上期发生金额         |
|----------------|----------------|----------------|
| 公司收到拨付的扶持资金    | 474,265,535.41 | 396,120,819.15 |
| 子公司收到重点企业扶持基金等 | 174,246,509.59 | 171,907,752.71 |
| 合 计            | 648,512,045.00 | 568,028,571.86 |

(五十五) 营业外支出

| 项 目       | 本期发生额         | 上期发生额         | 计入本期非经常性<br>损益的金额 |
|-----------|---------------|---------------|-------------------|
| 非流动资产处置损失 | 5,814,229.74  | 2,124,250.25  | 5,814,229.74      |
| 捐赠支出      | 9,876,532.03  | 8,681,413.92  | 9,876,532.03      |
| 罚款支出      | 8,515,061.38  | 1,001,089.29  | 8,515,061.38      |
| 其他        | 57,527,351.31 | 66,425,641.91 | 57,527,351.31     |
| 合 计       | 81,733,174.46 | 78,232,395.37 | 81,733,174.46     |

(五十六) 所得税费用

1、 所得税费用表

| 项 目     | 本期发生额            | 上期发生额            |
|---------|------------------|------------------|
| 当期所得税费用 | 3,348,274,923.37 | 2,391,025,912.23 |
| 递延所得税费用 | -334,480,789.98  | -159,817,172.34  |
| 合 计     | 3,013,794,133.39 | 2,231,208,739.89 |

2、 会计利润与所得税费用调整过程

| 项 目                | 本期金额              | 上期金额              |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| 利润总额               | 12,889,397,003.65 | 11,161,726,994.30 |
| 按法定[或适用]税率计算的所得税费用 | 3,222,349,250.91  | 2,790,431,748.57  |
| 子公司适用不同税率的影响       | -246,221,618.56   | -164,853,280.99   |
| 对以前期间所得税的调整影响      | -15,315,249.80    | -46,582,463.77    |
| 归属于合营企业和联营企业的损益    | -160,107,500.91   | -53,111,042.81    |
| 不征税、减免税收入          | -521,840,140.18   | -986,764,675.81   |
| 不得税前扣除的成本、费用和损失    | 764,179,573.24    | 667,132,350.37    |
| 其他                 | -29,250,181.31    | 24,956,104.33     |
| 所得税费用              | 3,013,794,133.39  | 2,231,208,739.89  |

所得税费用本期发生额比上期发生额增加 7.83 亿元，增加 35.07%，主要是应税收入增加所致。

(五十七) 现金流量表项目注释

1、 收到的其他与经营活动有关的现金

| 项 目          | 本期金额             | 上期金额              |
|--------------|------------------|-------------------|
| 其他业务收入       | 5,195,688,687.62 | 6,840,538,439.43  |
| 营业外收入        | 680,560,566.55   | 590,011,868.47    |
| 存出保证金收回      | 423,356,124.09   |                   |
| 收回发放的客户贷款及垫款 | 319,436,921.57   | 1,171,998,473.24  |
| 吸收存款的增加      |                  | 1,938,413,799.02  |
| 其他           | 2,650,292,327.14 | 4,904,702,031.21  |
| 合 计          | 9,269,334,626.97 | 15,445,664,611.37 |

**2、 支付的其他与经营活动有关的现金**

| 项 目        | 本期金额              | 上期金额              |
|------------|-------------------|-------------------|
| 保理、贷款支付的款项 | 6,532,702,928.34  | 2,796,510,632.75  |
| 其他业务成本     | 4,287,394,479.93  | 5,887,732,968.16  |
| 日常经营费用等    | 2,872,416,673.47  | 2,976,405,177.46  |
| 融资租赁支付的款项  | 2,810,785,563.65  | 6,070,662,730.02  |
| 吸收存款的减少    | 1,006,952,311.69  |                   |
| 存出保证金增加    |                   | 1,393,402,248.52  |
| 其他         | 4,305,186,514.70  | 3,600,236,603.19  |
| 合 计        | 21,815,438,471.78 | 22,724,950,360.10 |

**3、 收到的其他与投资活动有关的现金**

| 项 目              | 本期金额         | 上期金额          |
|------------------|--------------|---------------|
| 处置固定资产等长期资产收到的现金 | 6,383,049.12 | 31,535,973.88 |
| 合 计              | 6,383,049.12 | 31,535,973.88 |

**4、 支付的其他与投资活动有关的现金**

| 项 目          | 本期金额         | 上期金额 |
|--------------|--------------|------|
| 处置子公司支付的现金净额 | 1,442,008.42 |      |
| 合 计          | 1,442,008.42 |      |

**5、 支付其他与筹资活动有关的现金**

| 项 目          | 本期金额           | 上期金额           |
|--------------|----------------|----------------|
| 发行债券支付的承销费用等 | 110,763,312.31 | 84,725,554.95  |
| 向少数股东购买子公司股份 |                | 233,430,636.71 |
| 合 计          | 110,763,312.31 | 318,156,191.66 |

**(五十八) 现金流量表补充资料**

**1、 现金流量表补充资料**

| 项 目               | 本期金额             | 上期金额             |
|-------------------|------------------|------------------|
| 1、将净利润调节为经营活动现金流量 |                  |                  |
| 净利润               | 9,875,602,870.26 | 8,930,518,254.41 |
| 加：资产减值准备          | 1,686,658,289.93 | 1,419,492,720.73 |

| 项 目   | 本期金额               | 上期金额               |
|---|--------------------|--------------------|
| 固定资产折旧                                      | 270,959,381.05     | 218,309,724.92     |
| 无形资产摊销                                      | 144,580,693.70     | 97,145,786.63      |
| 长期待摊费用摊销                                    | 69,796,319.08      | 63,633,355.33      |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失<br>(收益以“-”号填列)        | 9,111,469.61       | 1,193,151.89       |
| 固定资产报废损失 (收益以“-”号填列)                        |                    |                    |
| 公允价值变动损失 (收益以“-”号填列)                        | 1,329,410,866.60   | 231,333,741.19     |
| 利息支出  | 8,352,111,145.59   | 8,806,584,605.02   |
| 汇兑损失 (收益以“-”号填列)                            | 1,561,443,060.11   | -1,530,590,010.21  |
| 投资损失 (收益以“-”号填列)                            | -4,545,176,262.54  | -3,772,963,558.26  |
| 递延所得税资产减少 (增加以“-”号填列)                       | -323,762,270.34    | -13,650,682.39     |
| 递延所得税负债增加 (减少以“-”号填列)                       | 80,309,895.00      | -133,531,564.07    |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产<br>等等的减少 (增加以“-”号填列) | -24,508,839,942.38 | 23,844,586,030.65  |
| 经营性应收项目的减少 (增加以“-”号填列)                      | -20,089,915,880.75 | -15,018,408,206.72 |
| 经营性应付项目的增加 (减少以“-”号填列)                      | -32,728,891,180.82 | -73,321,334,817.62 |
| 其他  |                    |                    |
| 经营活动产生的现金流量净额                               | -58,816,601,545.90 | -50,177,681,468.50 |
| 2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动                         |                    |                    |
| 债务转为资本                                      |                    |                    |
| 一年内到期的可转换公司债券                               |                    |                    |
| 融资租入固定资产                                    |                    |                    |
| 3、现金及现金等价物净变动情况                             |                    |                    |
| 现金的期末余额                                     | 109,642,289,836.26 | 131,153,159,354.26 |
| 减：现金的年初余额                                   | 131,153,159,354.26 | 178,023,172,588.34 |
| 加：现金等价物的期末余额                                |                    |                    |
| 减：现金等价物的年初余额                                |                    |                    |
| 现金及现金等价物净增加额                                | -21,510,869,518.00 | -46,870,013,234.08 |

**2、 现金和现金等价物的构成：**

| 项 目    | 期末余额               | 年初余额               |
|--------|--------------------|--------------------|
| (1) 现金 | 109,642,289,836.26 | 131,153,159,354.26 |

| 项 目                             | 期末余额               | 年初余额               |
|---------------------------------|--------------------|--------------------|
| 其中：库存现金                         | 438,761.45         | 336,330.28         |
| 可随时用于支付的银行存款                    | 97,674,141,145.49  | 118,709,331,263.43 |
| 可随时用于支付的其他货币资金                  | 569,066,555.72     | 251,592,486.76     |
| 存放中央银行款项                        | 3,415,914,729.14   |                    |
| 结算备付金                           | 7,982,728,644.47   | 12,191,899,273.79  |
| (2) 现金等价物                       |                    |                    |
| (3) 期末现金及现金等价物余额                | 109,642,289,836.26 | 131,153,159,354.26 |
| 其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和<br>现金等价物 |                    |                    |

(五十九) 受托客户资产管理业务

| 项 目             | 期末余额               | 年初余额               |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 银行存款—受托管理客户存款   | 103,067,199.31     | 208,901,710.72     |
| 结算备付金—受托管理客户备付金 | 801,368,128.30     | 2,484,469,109.88   |
| 存出与托管客户资金       | 5,155,441,149.21   | 6,843,951,254.48   |
| 应收款项            | 136,843,002.68     | 1,124,520,156.16   |
| 受托投资            | 320,425,143,396.81 | 835,566,924,741.29 |
| 其中：投资成本         | 324,063,160,789.56 | 839,656,315,612.22 |
| 已实现未结算损益（注）     | -3,638,017,392.75  | -4,089,390,870.93  |
| 代理业务资产总计        | 326,621,862,876.31 | 846,228,766,972.53 |
| 受托资金            | 325,152,373,739.36 | 843,117,854,895.06 |
| 应付款项            | 1,469,489,136.95   | 3,110,912,077.47   |
| 其他负债            |                    |                    |
| 代理业务负债总计        | 326,621,862,876.31 | 846,228,766,972.53 |

注：“已实现未结算损益”亏损为正数，盈利为负数。

(六十) 所有权或使用权受到限制的资产

| 项 目                        | 期末账面价值(亿元) | 受限原因       |
|----------------------------|------------|------------|
| 货币资金                       | 21.36      | 详见附注五、（一）3 |
| 融出资金                       | 104.15     | 详见附注五、（四）1 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金<br>融资产 | 309.30     | 详见附注五、（五）3 |

| 项 目        | 期末账面价值(亿元) | 受限原因        |
|------------|------------|-------------|
| 买入返售金融资产   | 7.83       | 详见附注五、（七）1  |
| 可供出售金融资产   | 41.80      | 详见附注五、（十一）4 |
| 固定资产       | 0.35       | 详见附注五、（十六）3 |
| 无形资产       | 8.16       | 详见附注五、（十八）2 |
| 其他资产-长期应收款 | 215.89     | 详见附注五、（二十）5 |
| 合 计        | 708.84     |             |

## 六、 合并范围的变更

### （一） 非同一控制下企业合并

2017 年 2 月 28 日，公司通过全资子公司 Haitong International Securities Group (Singapore) Pte. Ltd.（以下简称“Haitong Singapore”），完成了对 Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.（“Haitong Financial Services”）的收购。

Haitong Singapore 于 2016 年 12 月 12 日签订了买卖协议，以 Haitong Financial Services 2016 年 9 月 30 日的有形资产净值为基础、受让其已发行的所有股份，支付的现金对价共计新加坡币 1,249 万元（约折合人民币 6,021 万元）。

Haitong Financial Services 成立于 1998 年，是一家经新加坡金融管理局许可，为交易所交易期货期权、场外杠杆式外汇、贵金属和远期合约等业务提供相关金融服务的机构。

通过本次收购共取得的净资产折港币约为 6,250 万元。本次收购转让对价高于取得的净资产部分形成商誉为港币 552 万元。

### （二） 同一控制下企业合并

公司本期无通过同一控制下企业合并取得的子公司。

### （三） 处置子公司

#### 1、 单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

|           |                    |
|-----------|--------------------|
| 子公司名称     | 西安海通安元投资管理有<br>限公司 |
| 股权处置价款    | 5,495,000.00       |
| 股权处置比例（%） | 100                |

|                                    |                           |
|------------------------------------|---------------------------|
| 子公司名称                              | 西安海通安元投资管理有<br>限公司        |
| 股权处置方式                             | 出售                        |
| 丧失控制权的时点                           | 2017 年 12 月 28 日          |
| 丧失控制权时点的确定依据                       | 收到全部股权转让款，并<br>办理了财产权交接手续 |
| 处置价款与处置投资对应的合并财务报表层面享有该子公司净资产份额的差额 | 56,490.35                 |

(四) 其他原因的合并范围变动

1、 新设子公司

本期新设 8 家子公司，主要为海通恒信金融集团有限公司下设飞机租赁业务特殊目的主体 5 家及海通恒信租赁（香港）有限公司、海通恒信融资租赁控股有限公司和 Haitong UT Leasing Irish Holding Corporation Limited。

2、 通过购买子公司收购资产

于 2017 年 3 月 31 日，公司完成上海惟泰置业管理有限公司的全部股权及债权收购，共支付现金 8.58 亿元，其中为取得净资产支付现金 7.56 亿元。该交易被视为公司正常经营过程中获取的财产。

本次收购扣除收购惟泰置业货币资金 0.02 亿元，收购所产生的现金净流出为 8.56 亿元。

收购日惟泰置业净资产

单位：万元

|          |           |
|----------|-----------|
| 资产：      |           |
| 货币资金     | 186.62    |
| 无形资产     | 83,244.08 |
| 在建工程     | 2,367.51  |
| 负债：      |           |
| 其他负债     | 10,191.60 |
| 净资产      | 75,606.61 |
| 减：少数股东权益 |           |
| 取得的净资产   | 75,606.61 |

### 3、 注销子公司

本期注销 2 家子公司。

### 4、 结构化主体或通过受托经营等方式形成控制权的经营实体

公司对由子公司作为管理人的结构化主体,综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报,或承担的风险敞口等因素,认定将 22 个结构化主体纳入合并报表范围。

本年新增 11 个结构化主体纳入合并报表范围;因持有份额变化等原因丧失控制权减少 8 个结构化主体。

七、 在其他主体中的权益

(一) 在子公司中的权益

1、 企业集团的构成

| 子公司全称                 | 注册及营业地 | 注册资本            | 业务性质   | 期末实际<br>出资额     | 持股比例(%) |       | 表决权比例(%) |       | 取得方式     |
|-----------------------|--------|-----------------|--------|-----------------|---------|-------|----------|-------|----------|
|                       |        |                 |        |                 | 直接      | 间接    | 直接       | 间接    |          |
| 海富通基金管理有限公司           | 上海     | RMB30,000 万元    | 基金管理   | RMB6,700 万元     | 51      |       | 51       |       | 设立或投资等方式 |
| 海富通资产管理(香港)有限公司       | 香港     | HK\$6,000 万元    | 资产管理   | HK\$6,000 万元    |         | 51    |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 上海富诚海富通资产管理有限公司       | 上海     | RMB18,000 万元    | 资产管理   | RMB10,000 万元    |         | 51    |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 海富产业投资基金管理有限公司        | 上海     | RMB10,000 万元    | 基金管理   | RMB6,365 万元     | 67      |       | 67       |       | 设立或投资等方式 |
| 海通开元投资有限公司            | 上海     | RMB1,065,000 万元 | 股权投资   | RMB1,065,000 万元 | 100     |       | 100      |       | 设立或投资等方式 |
| 海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司    | 上海     | RMB5,000 万元     | 股权投资管理 | RMB2,550 万元     |         | 51    |          | 51    | 设立或投资等方式 |
| 海通创新资本管理有限公司          | 上海     | RMB5,000 万元     | 投资管理   | RMB2,550 万元     |         | 51    |          | 51    | 设立或投资等方式 |
| 海通创意资本管理有限公司          | 上海     | RMB12,000 万元    | 股权投资管理 | RMB6,390 万元     |         | 53.25 |          | 53.25 | 设立或投资等方式 |
| 海通新能源股权投资管理有限公司       | 上海     | RMB 5,000 万元    | 股权投资管理 | RMB 2,550 万元    |         | 51    |          | 51    | 设立或投资等方式 |
| 辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司 | 沈阳     | RMB 100,000 万元  | 股权投资   | RMB51,000 万元    |         | 51    |          | 51    | 设立或投资等方式 |
| 海通并购资本管理(上海)有限公司      | 上海     | RMB10,000 万元    | 投资业务   | RMB5,100 万元     |         | 51    |          | 51    | 设立或投资等方式 |
| 上海海通旭禹股权投资有限公司        | 上海     | RMB 50,000 万元   | 股权投资   | RMB 50,000 万元   |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 杭州辽通鼎能股权投资合伙企业(有限合伙)  | 杭州     | RMB 39,250 万元   | 股权投资   | RMB 25,050 万元   |         | 32.55 |          | 63.82 | 设立或投资等方式 |
| 海通新创投资管理有限公司          | 上海     | RMB 5,000 万元    | 股权投资   | RMB 600 万元      |         | 60    |          | 60    | 设立或投资等方式 |

| 子公司全称   | 注册及营业地  | 注册资本           | 业务性质        | 期末实际<br>出资额    | 持股比例(%) |       | 表决权比例(%) |       | 取得方式     |
|---|---------|----------------|-------------|----------------|---------|-------|----------|-------|----------|
|   |         |                |             |                | 直接      | 间接    | 直接       | 间接    |          |
| 上海海通创世投资管理有限公司  | 上海      | RMB 100 万元     | 股权投资        | RMB 100 万元     |         | 53.25 |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 西安航天军民融合先导基金有限公司  | 西安      | RMB 15,000 万元  | 投资服务        | RMB 8,000 万元   |         | 53.33 |          | 53.33 | 设立或投资等方式 |
| 海通齐东(威海)股权投资基金管理有限公司  | 山东      | RMB 1,000 万元   | 股权投资        | RMB 615 万元     |         | 61.5  |          | 61.5  | 设立或投资等方式 |
| 广东省海通粤科投资管理有限公司   | 深圳      | RMB 1,000 万元   | 股权投资        | RMB 153 万元     |         | 51    |          | 51    | 设立或投资等方式 |
| 海通众投金融服务(上海)有限责任公司  | 上海      | RMB10,000 万元   | 金融服务        | RMB 5,000 万元   |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 合肥海通兴泰新兴产业投资管理有限公司  | 安徽      | RMB1,000 万元    | 股权投资        | RMB 300 万元     |         | 60    |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 海通昆仑股权投资管理(上海)有限公司  | 上海      | RMB2,000 万元    | 投资管理        | RMB1,100 万元    |         | 28.05 |          | 55    | 设立或投资等方式 |
| 海通创新证券投资有限公司  | 上海      | RMB350,000 万元  | 投资管理        | RMB350,000 万元  | 100     |       | 100      |       | 设立或投资等方式 |
| 上海海通证券资产管理有限公司  | 上海      | RMB220,000 万元  | 证券资产管理      | RMB220,000 万元  | 100     |       | 100      |       | 设立或投资等方式 |
| 上海惟泰置业管理有限公司  | 上海      | RMB 1,000 万元   | 物业管理, 房地产开发 | RMB75,607 万元   | 100     |       | 100      |       | 收购       |
| 海通国际控股有限公司  | 香港      | HK\$885,000 万元 | 投资业务        | HK\$885,000 万元 | 100     |       | 100      |       | 设立或投资等方式 |
| 海通开元国际投资有限公司  | 香港      | HK\$10,000 元   | 投资业务        | HK\$1 元        |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| Haitong Innovation International Capital Management Co.,Ltd | 开曼群岛    | US\$50,000 元   | 投资业务        | US\$50,000 元   |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| Haitong Capital International Investment Fund L.P.          | 开曼群岛    | US\$3,901 万元   | 投资业务        | US\$3,901 万元   |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 上海海通创新成长股权投资基金合伙企业(有限合伙)                                    | 上海      | US\$3,501 万元   | 投资业务        | US\$3,501 万元   |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| 仪征海之创管理咨询有限公司   | 江苏仪征    | US\$3,900 万元   | 投资业务        | US\$3,490 万元   |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| Haitong International Strategic Investment Limited          | 英属维尔京群岛 | US\$50,000 元   | 投资业务        | US\$1 元        |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |
| Haitong International Strategic Investment Europe Limited   | 英属维尔京群岛 | US\$50,000 元   | 投资业务        | US\$1 元        |         | 100   |          | 100   | 设立或投资等方式 |

| 子公司全称   | 注册及营业地 | 注册资本   | 业务性质 | 期末实际<br>出资额   | 持股比例(%) |        | 表决权比例(%) |       | 取得方式       |
|---|--------|--|------|---|---------|--------|----------|-------|------------|
|   |        |  |      |   | 直接      | 间接     | 直接       | 间接    |            |
| Haitong International Global Strategic Investment Limited | 开曼群岛   | US\$50,000 元   | 投资业务 | US\$1 元   |         | 100    |          | 100   | 设立或投资等方式   |
| 海通期货股份有限公司  | 上海     | RMB130,000 万元  | 期货代理 | RMB136,919.18 万<br>元  | 66.667  |        | 66.667   |       | 非同一控制下企业合并 |
| 上海海通资源管理有限公司  | 上海     | RMB20,000 万元   | 资源管理 | RMB20,000 万元  |         | 66.667 |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通期货香港有限公司  | 香港     | HK\$7,000 万元   | 期货经纪 | HK\$7,000 万元  |         | 66.667 |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际证券集团有限公司  | 百慕达    | HK\$55,009 万元  | 投资控股 | HK\$1,311,620 万元  |         | 62.43  |          | 62.43 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际投资经理有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$4,700 万元   | 资产管理 | HK\$4,700 万元  |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际资产管理有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$1,300 万元   | 证券业务 | HK\$1,300 万元  |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通资产管理(香港)有限公司(注 1)                                       | 香港     | HK\$2,000 万元   | 证券业务 | HK\$2,000 万元  |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际证券有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$1,150,000 万元   | 证券业务 | HK\$1,150,000 万元  |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际证券代理有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$2 元  | 服务业  | HK\$2 元   |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际期货有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$40,000 万元  | 期货业务 | HK\$40,000 万元   |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际财务有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$300,000,002 元<br>(无投票权递延股<br>HK\$100,700,001 元)<br>(注 2) | 证券业务 | HK\$300,000,002 元<br>(无投票权递延股<br>HK\$100,700,001<br>元)(注 2) |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际信贷有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$600 万元   | 投资控股 | HK\$600 万元  |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际金融产品有限公司(注 1)   | 香港     | HK\$5,000 万元   | 证券业务 | HK\$5,000 万元  |         | 62.43  |          | 100   | 非同一控制下企业合并 |

| 子公司全称   | 注册及营业地  | 注册资本              | 业务性质     | 期末实际<br>出资额       | 持股比例(%) |       | 表决权比例(%) |     | 取得方式       |
|---|---------|-------------------|----------|-------------------|---------|-------|----------|-----|------------|
|   |         |                   |          |                   | 直接      | 间接    | 直接       | 间接  |            |
| 海通国际金融服务有限公司(注 1)   | 香港      | HK\$100 万元        | 金融解决方案服务 | HK\$100 万元        |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通融资(香港)有限公司(注 1)   | 香港      | HK\$1,000 万元      | 企业融资     | HK\$1,000 万元      |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际资本有限公司(注 1)   | 香港      | HK\$2,000 万元      | 咨询服务     | HK\$2,000 万元      |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通国际研究有限公司(注 1)   | 香港      | HK\$100 万元        | 研究服务     | HK\$100 万元        |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong International Japaninvest K.K.(注 1)                 | 日本      | JPY1,000 万元       | 研究服务     | JPY1,000 万元       |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong International Securities (UK) Limited(注 1)          | 英国      | GPB560 元          | 研究服务     | GPB560 元          |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong International Securities (USA) Inc. (注 1)           | 美国      | US\$12,612,245 元  | 研究服务     | US\$12,612,245 元  |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong International Securities Group (Singapore) Pte Ltd. | 新加坡     | SG\$730,550,721 元 | 投资控股     | SG\$730,550,721 元 |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong International Products & Solutions Limited (注 1)    | 英属维尔京群岛 | US\$1 元           | 投资控股     | US\$1 元           |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Securities India Private Limited(注 1)               | 印度      | INR260,732,520 元  | 证券业务     | INR260,732,520 元  |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong International Holdings (Australia) Pty Ltd.(注 1)    | 澳大利亚    | AUD100 元          | 投资控股     | AUD100 元          |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| iBest Finance Group Limited(注 1)                            | 开曼群岛    | US\$25,641,027 元  | 投资控股     | US\$25,641,027 元  |         | 62.43 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通恒信金融集团有限公司  | 香港      | HK\$414,616 万元    | 投资       | HK\$822,709 万元    |         | 100   |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通恒信国际租赁股份有限公司  | 上海      | RMB700,000 万元     | 融资租赁     | RMB 648,374 万元    |         | 100   |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通恒运国际租赁有限公司  | 天津      | RMB21,000 万元      | 融资租赁     | RMB21,000 万元      |         | 100   |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 上海泛圆投资发展有限公司  | 上海      | RMB10,000 万元      | 贸易服务     | RMB10,000 万元      |         | 100   |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Unican limited  | 英属维尔京群岛 | US\$1 元           | 债券发行主体   | US\$1 元           |         | 100   |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |

| 子公司全称  | 注册及营业地 | 注册资本            | 业务性质                            | 期末实际<br>出资额     | 持股比例(%) |     | 表决权比例(%) |     | 取得方式       |
|--|--------|-----------------|---------------------------------|-----------------|---------|-----|----------|-----|------------|
|  |        |                 |                                 |                 | 直接      | 间接  | 直接       | 间接  |            |
| 海通恒信融资租赁(上海)有限公司                                     | 上海     | RMB136,000 万元   | 融资租赁                            | RMB120,000 万元   |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Unitrust No.1 Limited                        | 爱尔兰    | USD1 元          | 飞机租赁特殊目的主体                      | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Unitrust No.2 Limited                        | 爱尔兰    | USD1 元          | 飞机租赁特殊目的主体                      | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Unitrust No.3 Limited                        | 爱尔兰    | USD1 元          | 飞机租赁特殊目的主体                      | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Unitrust No.4 Limited                        | 爱尔兰    | USD1 元          | 飞机租赁特殊目的主体                      | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Unitrust No.5 Limited                        | 爱尔兰    | USD1 元          | 飞机租赁特殊目的主体                      | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Unitrust No.6 Limited                        | 爱尔兰    | USD1 元          | 飞机租赁特殊目的主体                      | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通恒信租赁(香港)有限公司                                       | 香港     | USD100 万元       | 经营租赁; 融资租赁                      | USD100 万元       |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| 海通恒信融资租赁控股有限公司                                       | 香港     | USD100 万元       | 租赁                              | USD100 万元       |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong UT Leasing Irish Holding Corporation Limited | 爱尔兰    | USD1 元          | 围绕飞机及飞机引擎开展的投资、持有、出租、处置、管理等金融服务 | USD0 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Bank, S.A.                                   | 葡萄牙    | EUR 844,769,000 | 投资控股                            | HK\$ 7,801,635K |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Investment Ireland PLC                       | 爱尔兰    | EUR82.5 万元      | 非银行金融业务                         | EUR82.5 万元      |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Capital - SCR, S.A.                          | 葡萄牙    | EUR2,500 万元     | 风险投资                            | EUR4,266 万元     |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |

| 子公司全称   | 注册及营业地 | 注册资本             | 业务性质      | 期末实际<br>出资额          | 持股比例(%) |     | 表决权比例(%) |     | 取得方式       |
|---|--------|------------------|-----------|----------------------|---------|-----|----------|-----|------------|
|   |        |                  |           |                      | 直接      | 间接  | 直接       | 间接  |            |
| SES Iberia  | 西班牙    | EUR30 万元         | 资产管理-投资基金 | EUR3.33 万元           |         | 50  |          | 50  | 非同一控制下企业合并 |
| WindPart, Lda   | 葡萄牙    | EUR1,000 元       | 投资控股      | EUR95.89 万元          |         | 20  |          | 20  | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong (UK) Limited  | 英国     | EUR 1,977.07 万元  | 投资控股      | EUR 1.7152 亿元        |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Securities (UK) Limited   | 英国     | EUR 447.46 万元    | 证券经纪      | EUR 1,045.29 万元      |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Clear Info-Analytic Private Ltd   | 印度     | EUR 105          | 研究服务      | EUR 8,017 元          |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.                                | 巴西     | EUR 10,571.62 万元 | 投资银行      | EUR 17,449.63 万<br>元 |         | 80  |          | 80  | 非同一控制下企业合并 |
| FI Multimercado Treasury  | 巴西     | EUR 494.58 万元    | 投资基金      | EUR 301.65 万元        |         | 80  |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong do Brasil Participações Ltda  | 巴西     | EUR 1,026.45 万元  | 资产管理      | EUR 921.31 万元        |         | 80  |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Negócios, SA  | 巴西     | EUR 100.68 万元    | 投资控股      | EUR 122.33 万元        |         | 80  |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Securities do Brasil Corretora de Câmbio e Valores Mobiliários S.A. | 巴西     | EUR 2,517.05 万元  | 证券经纪      | EUR 864.45 万元        |         | 80  |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong Securities USA  | 美国     | EUR 1,145.54 万元  | 证券经纪      | EUR 1,219.95 万元      |         | 100 |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |
| Haitong do Brasil Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.       | 巴西     | EUR 487.68 万元    | 资产管理      | EUR 483.54 万元        |         | 80  |          | 100 | 非同一控制下企业合并 |

注 1：上述公司均为海通国际证券集团有限公司下属子公司。

注 2：海通国际财务有限公司的无投票权递延股不附带享有股息、出席股东大会或于会上投票的权利，也无权收取资本归还、清盘或其他情况下的首 1,000,000 亿港币之任何盈余款项。

## 2、 重要的非全资子公司

| 子公司名称            | 少数股东<br>持股比例 (%) | 本期归属于少数<br>股东的损益 (万元) | 本期向少数股东<br>宣告分派的股利<br>(万元) | 期末少数股东<br>权益余额 (万<br>元) |
|------------------|------------------|-----------------------|----------------------------|-------------------------|
| 海通国际证券<br>集团有限公司 | 37.57%           | 95,116.37             | 31,438.53                  | 796,681.76              |

## 3、 重要非全资子公司的主要财务信息

单位：万元

| 海通国际证券集团有限公司 | 期末余额          | 年初余额          |
|--------------|---------------|---------------|
| 流动资产         | 9,292,234.52  | 9,708,383.15  |
| 非流动资产        | 1,593,306.32  | 2,054,892.79  |
| 资产合计         | 10,885,540.84 | 11,763,275.94 |
| 流动负债         | 7,437,741.86  | 8,432,146.28  |
| 非流动负债        | 1,327,272.61  | 1,323,042.01  |
| 负债合计         | 8,765,014.47  | 9,755,188.29  |

单位：万元

| 海通国际证券集团有限公司 | 本期发生额       | 上期发生额       |
|--------------|-------------|-------------|
| 营业收入         | 601,439.00  | 478,635.93  |
| 净利润          | 253,171.06  | 150,297.81  |
| 综合收益总额       | 263,700.18  | 160,749.53  |
| 经营活动现金流量     | -441,586.93 | -293,559.04 |

## 4、 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制

公司在香港的子公司海通国际控股由于受境内外汇管制的约束，向母公司转移资金或其他资产受到一定的限制，其涉及合并财务报表中的资产金额 1,486.09 亿元。其中，海通国际控股所控制的海通国际证券由于受境内外汇管制的约束，向公司本部转移资金或其他资产受到重大限制，涉及合并财务报表中的资产金额 1,088.55 亿元。海通国际控股所控制的海通银行由于受境内外汇管制的约束，向公司本部转移资金或其他资产受到重大限制，涉及合并财务报表中的资产金额 255.60 亿元。

公司合并财务报表范围包括 22 个结构化主体，其持有的资产具有专门用途，涉及的合并财务报表中的资产金额 16.67 亿元。

**5、 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持**

在纳入合并财务报表范围的结构化主体中，包括 5 家分级产品，公司认购其风险级产品。按照资产管理计划的约定，当风险级资产管理产品净值总额占该产品净值总额低于约定的比例时，风险级可为优先级提供增信支持。该产品涉及的公司合并范围内企业持有的风险级资产管理产品净值总额 40.90 亿元。

**(二) 在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易**

子公司海通国际证券股份少数股东行使购股权以及中期股息以股代息。

子公司西安航天军民融合先导基金有限公司向少数股东出售部分股权以及子公司海通齐东（威海）股权投资基金管理有限公司购买少数股东股权。

上述交易调整增加合并报表资本公积 18.65 万元，调整减少未分配利润 1.34 万元。

**(三) 在合营安排或联营企业中的权益**

**1、 重要的合营企业或联营企业**

| 合营企业或联营企业名称 | 主要经营地 | 注册地 | 业务性质 | 持股比例(%) |    | 对合营企业或联营企业投资的会计处理方法 |
|-------------|-------|-----|------|---------|----|---------------------|
|             |       |     |      | 直接      | 间接 |                     |
| 富国基金管理有限公司  | 上海    | 上海  | 基金管理 | 27.775  |    | 权益法                 |

**2、 重要联营企业的主要财务信息**

| 富国基金管理有限公司      | 期末余额/本期发生额       | 年初余额/上期发生额       |
|-----------------|------------------|------------------|
| 资产总额            | 4,227,515,799.32 | 4,289,660,110.51 |
| 负债总额            | 1,383,134,463.65 | 1,835,145,924.57 |
| 归属于母公司股东权益总额    | 2,844,381,335.67 | 2,454,514,185.94 |
| 少数股东权益          |                  |                  |
| 按持股比例计算的净资产份额   | 790,026,915.98   | 681,741,315.14   |
| 调整事项-其他         |                  |                  |
| 对联营企业权益投资的账面价值  | 790,026,915.98   | 681,741,315.14   |
| 营业收入            | 2,367,617,782.38 | 2,469,504,829.42 |
| 净利润             | 726,063,434.47   | 751,903,053.90   |
| 其他综合收益          | -6,196,284.74    | -43,979,947.80   |
| 综合收益总额          | 719,867,149.73   | 707,923,106.10   |
| 本年度收到的来自联营企业的股利 | 91,657,500.00    | 214,978,500.00   |

**3、 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息**

|                 | 期末余额/本期发生额       | 年初余额/上期发生额       |
|-----------------|------------------|------------------|
| 合营企业:           |                  |                  |
| 投资账面价值合计        | 5,181,701,488.02 | 3,954,722,614.41 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 |                  |                  |
| —净利润            | 429,711,898.68   | -23,243,331.81   |
| —其他综合收益         |                  |                  |
| —综合收益总额         | 429,711,898.68   | -23,243,331.81   |
| 联营企业:           |                  |                  |
| 投资账面价值合计        | 4,090,641,894.56 | 4,113,127,941.80 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 |                  |                  |
| —净利润            | 77,110,573.21    | 14,837,149.31    |
| —其他综合收益         | -22,103,485.20   | 86,477,537.71    |
| —综合收益总额         | 55,007,088.01    | 101,314,687.02   |

**4、 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明**

公司无合营企业或联营企业向公司转移资金能力受到限制的情况。

**5、 合营企业或联营企业发生的超额亏损**

公司合营企业或联营企业未发生超额亏损。

**6、 与合营企业投资相关的未确认承诺**

公司无与合营企业投资相关的未确认承诺。

**7、 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债**

公司无与合营企业或联营企业投资相关的或有负债。

**(四) 在结构化主体中的权益**

**1、 在纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益**

公司对由子公司作为管理人的结构化主体,综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报,或承担的风险敞口等因素,认定将 22 个结构化主体纳入合并报表范围。

公司及其子公司持有的上述纳入合并财务报表范围的结构化主体份额的账面价值为 119.18 亿元，增加合并财务报表中的资产金额 16.67 亿元，增加净利润 4.20 亿元。

上述结构化主体的资产总额为 135.57 亿元，当期净利润为 8.35 亿元。

## 2、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

公司及其子公司持有的未纳入合并财务报表范围的结构化主体份额的账面价值为 90.69 亿元，最大损失敞口与账面价值相近。

公司的子公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的结构化主体中获取的管理费收入为 15.93 亿元。

## 八、公允价值的披露

根据有关确定金融资产公允价值的会计政策，公司对公允价值计量的输入值划分为三个层次。

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。活跃市场，是指相关资产或负债的交易量和交易频率足以持续提供定价信息的市场。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

这些输入值参考产品的净值或折现现金流确定。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。这些输入值参考折现现金流，考虑市场报价及缺少流动性，根据限制条件给予一定的折价确定。

### (一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

| 项 目                         | 期末公允价值            |                   |                |                   |
|-----------------------------|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|
|                             | 第一层次公允价值计量        | 第二层次公允价值计量        | 第三层次公允价值计量     | 合计                |
|                             | 人民币元              | 人民币元              | 人民币元           | 人民币元              |
| (一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产   | 28,267,893,138.71 | 70,773,098,130.53 | 815,703,566.67 | 99,856,694,835.91 |
| 1. 交易性金融资产                  | 25,891,162,381.24 | 53,337,717,538.89 | 427,760,292.23 | 79,656,640,212.36 |
| (1) 债券                      | 10,201,463,321.36 | 43,350,561,391.96 | 334,929,889.56 | 53,886,954,602.88 |
| (2) 股票                      | 11,701,858,196.88 | 842,975,517.57    | 92,830,402.67  | 12,637,664,117.12 |
| (3) 基金                      | 3,987,840,863.00  | 8,601,231,799.10  |                | 12,589,072,662.10 |
| (4) 其他                      |                   | 542,948,830.26    |                | 542,948,830.26    |
| 2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 2,376,730,757.47  | 17,435,380,591.64 | 387,943,274.44 | 20,200,054,623.55 |
| (1) 债券                      |                   | 9,279,809,602.78  |                | 9,279,809,602.78  |

| 项 目                         | 期末公允价值           |                   |                  |                   |
|-----------------------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|
|                             | 第一层次公允价值计量       | 第二层次公允价值计量        | 第三层次公允价值计量       | 合计                |
|                             | 人民币元             | 人民币元              | 人民币元             | 人民币元              |
| (2) 股票                      | 2,376,730,757.47 | 456,514,380.40    | 387,943,274.44   | 3,221,188,412.31  |
| (3) 基金                      |                  | 1,908,294,944.24  |                  | 1,908,294,944.24  |
| (4) 其他                      |                  | 5,790,761,664.22  |                  | 5,790,761,664.22  |
| (二) 可供出售金融资产                | 2,924,764,388.17 | 30,782,444,732.35 | 7,521,546,884.99 | 41,228,756,005.51 |
| (1) 债券                      | 2,332,696,235.19 | 2,068,884,312.57  | 557,782,452.52   | 4,959,363,000.28  |
| (2) 股票/股权                   | 559,943,852.02   | 661,798,437.08    | 6,534,342,824.23 | 7,756,085,113.33  |
| (3) 基金                      | 32,124,300.96    | 4,556,482,245.35  | 429,421,608.24   | 5,018,028,154.55  |
| (4) 其他                      |                  | 23,495,279,737.35 |                  | 23,495,279,737.35 |
| (三) 衍生金融资产                  | 466,542,398.68   | 2,144,069,903.60  |                  | 2,610,612,302.28  |
| (四) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债   | 1,907,401,542.26 | 18,561,442,590.00 | 274,655,034.44   | 20,743,499,166.70 |
| 1.交易性金融负债                   | 1,829,905,546.59 | 5,909,215,638.26  |                  | 7,739,121,184.85  |
| 2.指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 77,495,995.67    | 12,652,226,951.74 | 274,655,034.44   | 13,004,377,981.85 |
| (五) 衍生金融负债                  | 1,024,866,713.59 | 2,470,587,564.61  |                  | 3,495,454,278.20  |

(二) 以公允价值计量的资产和负债的期初公允价值

| 项 目                         | 期初公允价值            |                   |                  |                   |
|-----------------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|
|                             | 第一层次公允价值计量        | 第二层次公允价值计量        | 第三层次公允价值计量       | 合计                |
|                             | 人民币元              | 人民币元              | 人民币元             | 人民币元              |
| (一) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产   | 21,657,820,169.73 | 67,055,289,965.91 | 3,634,383,419.34 | 92,347,493,554.98 |
| 1. 交易性金融资产                  | 16,997,303,239.92 | 52,129,842,142.56 | 198,946,095.93   | 69,326,091,478.41 |
| (1) 债券                      | 8,884,065,245.61  | 40,728,120,373.18 | 198,946,095.93   | 49,811,131,714.72 |
| (2) 股票                      | 4,744,403,304.96  | 734,325,558.36    |                  | 5,478,728,863.32  |
| (3) 基金                      | 3,368,834,689.35  | 10,380,951,841.65 |                  | 13,749,786,531.00 |
| (4) 其他                      |                   | 286,444,369.37    |                  | 286,444,369.37    |
| 2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 4,660,516,929.81  | 14,925,447,823.35 | 3,435,437,323.41 | 23,021,402,076.57 |
| (1) 债券                      |                   | 3,521,753,638.35  |                  | 3,521,753,638.35  |
| (2) 股票                      | 4,660,512,355.81  | 962,956,518.74    | 3,435,437,323.41 | 9,058,906,197.96  |
| (3) 基金                      | 4,574.00          | 3,305,152,175.31  |                  | 3,305,156,749.31  |
| (4) 其他                      |                   | 7,135,585,490.95  |                  | 7,135,585,490.95  |
| (二) 可供出售金融资产                | 6,272,789,226.32  | 43,022,657,165.00 | 4,022,968,149.99 | 53,318,414,541.31 |
| (1) 债券                      | 2,687,992,887.02  | 9,376,534,733.84  | 499,161,978.07   | 12,563,689,598.93 |
| (2) 股票                      | 3,489,249,638.99  | 1,749,433,583.99  | 1,690,845,430.12 | 6,929,528,653.10  |
| (3) 基金                      | 95,546,700.31     | 7,067,004,401.88  | 177,429,955.08   | 7,339,981,057.27  |

| 项 目                         | 期初公允价值         |                   |                  |                   |
|-----------------------------|----------------|-------------------|------------------|-------------------|
|                             | 第一层次公允价值计量     | 第二层次公允价值计量        | 第三层次公允价值计量       | 合计                |
|                             | 人民币元           | 人民币元              | 人民币元             | 人民币元              |
| (4) 其他                      |                | 24,829,684,445.29 | 1,655,530,786.72 | 26,485,215,232.01 |
| (三) 衍生金融资产                  | 385,102,997.24 | 3,549,968,351.57  |                  | 3,935,071,348.81  |
| (四) 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债   | 325,272,918.47 | 36,404,811,885.11 | 1,909,546,200.74 | 38,639,631,004.32 |
| 1.交易性金融负债                   | 323,126,320.11 | 8,169,024,437.15  |                  | 8,492,150,757.26  |
| 2.指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 2,146,598.36   | 28,235,787,447.96 | 1,909,546,200.74 | 30,147,480,247.06 |
| (五) 衍生金融负债                  | 47,497,203.43  | 2,546,512,078.53  |                  | 2,594,009,281.96  |

本期和上期合并财务报表按公允价值计量的金融工具在第一层次和第二层次之间无重大转移。

**(三) 持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据**

合并财务报表持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

**(四) 持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息**

| 项 目   | 2017年12月31日的<br>公允价值 | 2016年12月31日<br>公允价值 | 估值技术    | 输入值                    |
|-------|----------------------|---------------------|---------|------------------------|
| 债券    | 54,699,255,307.31    | 53,626,408,745.37   | 现金流量折现法 | 债券收益率                  |
| 股票/股权 | 1,961,288,335.05     | 3,446,715,661.09    | 最近交易价格  | 同一上市企业发行的相关上市权益证券/做市报价 |

| 项目                    | 2017年12月31日的<br>公允价值 | 2016年12月31日<br>公允价值 | 估值技术                  | 输入值                                     |
|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|---|
| 基金                    | 15,066,008,988.69    | 20,753,108,418.84   | 市价组合法                 | 投资标的市价及相关费用                             |
| 其他                    | 29,828,990,231.83    | 32,251,714,305.61   | 现金流量折现法/市价组合法         | 远期利率/折现率/投资标的市价及相关费用                    |
| 衍生金融资产                |                      |                     |                       |   |
| -利率衍生工具               | 1,532,747,878.35     | 2,717,682,748.40    | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/合同利率                           |
| -货币衍生工具               | 18,990,392.39        | 41,788,387.64       | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/合同利率                           |
| -权益衍生工具               | 129,796,494.42       | 71,357,962.30       | 期权定价模型/现金流量折现法        | 标的权益工具波动率/折现率                           |
| -信用衍生工具               | 34,771,256.42        | 66,534,044.07       | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/合同利率                           |
| -其他衍生工具               | 427,763,882.02       | 652,605,209.16      | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/基础权益工具和债券工具的报价                 |
| 合计                    | 103,699,612,766.48   | 113,627,915,482.48  |                       |   |
| 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债 | 18,561,442,590.00    | 36,404,811,885.11   | 市价组合法/现金流量折现法/标的资产的价格 | 投资标的市价及相关费用/黄金单价/折现率/标的资产的市场交易价格和最近市场价格 |
| 衍生金融负债                |                      |                     |                       |   |
| -利率衍生工具               | 1,602,469,454.31     | 1,827,642,165.38    | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/合同利率                           |
| -货币衍生工具               | 6,975,023.66         | 52,557,940.92       | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/合同利率                           |
| -权益衍生工具               | 737,991,779.28       | 357,652,165.88      | 期权定价模型/现金流量折现法        | 标的权益工具波动率/折现率                           |
| -信用衍生工具               | 2,432,508.18         | 44,686,437.40       | 现金流量折现法               | 远期利率/折现率/合同利率                           |
| -其他衍生工具               | 120,718,799.18       | 263,973,368.95      | 现金流量折现法               | 远期外汇汇率/远期黄金单价                           |
| 合计                    | 21,032,030,154.61    | 38,951,323,963.64   |                       |   |

(五) 持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

| 项 目                          | 2017 年 12 月 31 日的公允价值 | 估值技术          | 重大不可观察输入值         | 对公允价值的影 响        |
|------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------|------------------|
| 债券                           | 892,712,342.08        | 内部估值模型或 第三方报价 | 不适用               | 不适用              |
| 股票/股权                        | 7,015,116,501.34      | 折扣法/现金流 量折现法  | 考虑流通性， 对相关市价进 行折扣 | 折扣越高，公允 价值越低     |
| 基金                           | 429,421,608.24        | 内部估值模型或 第三方报价 | 不适用               | 不适用              |
| 其他                           |                       | 现金流量折现法       | 违约损失率             | 违约损失率越 高，公允价值越 低 |
| 合 计                          | 8,337,250,451.66      |               |                   |                  |
| 指定为以公允价值 计量且其变动计入 当期损益的金融负 债 | 274,655,034.44        | 现金流量折现法       | 考虑流通性， 对相关市价进 行折扣 | 折扣越高，公允 价值越低     |
| 合 计                          | 274,655,034.44        |               |                   |                  |

| 项 目      | 2016 年 12 月 31 日的公允价值 | 估值技术          | 重大不可观察输入值         | 对公允价值的影 响        |
|----------|-----------------------|---------------|-------------------|------------------|
| 债券       | 698,108,074.00        | 内部估值模型或 第三方报价 | 不适用               | 不适用              |
| 股票       | 5,126,282,753.53      | 折扣法/现金流 量折现法  | 考虑流通性， 对相关市价进 行折扣 | 折扣越高，公允 价值越低     |
| 基金       | 177,429,955.08        | 内部估值模型或 第三方报价 | 不适用               | 不适用              |
| 其他       | 1,655,530,786.72      | 现金流量折现法       | 违约损失率             | 违约损失率越 高，公允价值越 低 |
| 合 计      | 7,657,351,569.33      |               |                   |                  |
| 指定为以公允价值 | 1,909,546,200.74      | 现金流量折现法       | 考虑流通性，            | 折扣越高，公允          |

| 项 目                 | 2016 年 12 月 31 日的公允价值 | 估值技术 | 重大不可观察输入值  | 对公允价值的影 响 |
|---------------------|-----------------------|------|------------|-----------|
| 计量且其变动计入 当期损益的金融负 债 |                       |      | 对相关市价进 行折扣 | 价值越低      |
| 合 计                 | 1,909,546,200.74      |      |            |           |

(六) 持续第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值之间的调节信息

| 项 目                   | 年初余额             | 转入第三层次           | 转出第三层次          | 当期利得或损失总额       |                 | 购买、发行、出售和结算    |    |    |                  | 其他      | 期末余额             | 对于在报告期末持有的资产，计入损益的当期未实现利得或变动 |
|-----------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|----|----|------------------|---------|------------------|------------------------------|
|                       |                  |                  |                 | 计入损益            | 计入其他综合收益        | 购买             | 发行 | 出售 | 结算               | 收购子公司转入 |                  |                              |
| 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 3,634,383,419.34 | 121,956,389.88   |                 | -194,206,715.57 |                 | 441,597,343.44 |    |    | 3,188,026,870.41 |         | 815,703,566.67   |                              |
| 可供出售金融资产              | 4,022,968,149.99 | 4,361,649,979.47 | -360,269,670.09 | -230,427,632.41 | -193,188,908.49 | 779,468,315.34 |    |    | 858,653,348.82   |         | 7,521,546,884.99 |                              |
| 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债 | 1,909,546,200.74 |                  |                 | -126,548,170.15 |                 | 213,219,664.70 |    |    | 1,721,562,660.85 |         | 274,655,034.44   |                              |

**(七) 不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况**

除以上以公允价值计量的金融资产和金融负债外，公司持有的其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债，如持有至到期投资等，根据公司会计政策规定的计量属性进行计量。

**九、 关联方及关联交易**

**(一) 持有公司 5%以上股份的股东情况**

截至 2017 年 12 月 31 日，无持有公司 5%以上股份的股东。

**(二) 公司的子公司情况**

本公司子公司的情况详见附注“七、在其他主体中的权益”。

**(三) 公司的合营和联营企业情况**

本公司重要的合营或联营企业详见附注“七、在其他主体中的权益”。

**(四) 其他关联方情况**

| 其他关联方名称            | 其他关联方与公司的关系             |
|--------------------|-------------------------|
| 法国巴黎投资管理 BE 控股公司   | 是持有子公司 10%以上股权的公司       |
| 法国巴黎银行(中国) 公司      | 是持有子公司 10%以上股权的公司控制的公司  |
| 法国巴黎投资管理（日本）公司     | 是持有子公司 10%以上股权的公司控制的公司  |
| 法国巴黎投资管理(新加坡)公司    | 是持有子公司 10%以上股权的公司控制的公司  |
| 法国巴黎财富管理银行         | 与持有子公司 10%以上股权的公司受同一方控制 |
| 法国巴黎瑞士投资管理有限公司     | 与持有子公司 10%以上股权的公司受同一方控制 |
| 法国巴黎银行             | 与持有子公司 10%以上股权的公司受同一方控制 |
| 法国巴黎投资管理（香港）公司     | 与持有子公司 10%以上股权的公司受同一方控制 |
| 新韩法国巴黎资产(香港)运用株式会社 | 与持有子公司 10%以上股权的公司受同一方控制 |
| 法国巴黎投资管理(ASIA)公司   | 与持有子公司 10%以上股权的公司受同一方控制 |
| 上海盛源房地产（集团）有限公司    | 是持有子公司 10%以上股权的公司       |
| 中国-比利时直接股权投资基金     | 子公司管理的基金                |

**(五) 关联方交易**

1、 公司与关联方之间的交易按照市场价格进行，无任何高于或低于正常交易价格的情况发生。

2、 存在控制关系且已纳入公司合并财务报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

3、 向关联方收取的手续费及佣金收入

| 关联方名称                       | 关联交易内容        | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-----------------------------|---------------|----------------|----------------|
| 法国巴黎银行及公司股东同系公司             | 管理费收入等        | 10,414,907.15  | 15,914,016.23  |
| 富国基金管理有限公司                  | 代理销售金融产品收入等   | 23,813,912.54  | 53,007,059.72  |
| 海通（吉林）现代服务业创业投资基金合伙企业（有限合伙） | 管理费收入、佣金收入    | 5,549,528.56   | 5,659,493.21   |
| 西安航天新能源产业基金投资有限公司           | 管理费收入、业绩报酬收入等 | 18,886,791.91  | 30,095,406.84  |
| 上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙）        | 管理费收入等        | 60,724,642.30  | 60,251,745.88  |
| 上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）      | 管理费收入等        | 31,928,768.45  | 38,122,356.86  |
| 海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）      | 管理费收入等        | 18,889,790.28  | 19,297,675.75  |
| 中国-比利时直接股权投资基金              | 管理费收入等        | 108,228,845.89 | 172,344,452.05 |
| 吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司        | 管理费收入等        | 19,877,779.99  | 21,158,309.80  |
| 广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）        | 管理费收入等        | 8,305,662.25   | 6,464,584.21   |
| 海通（吉林）股权投资基金合伙企业（有限合伙）      | 管理费收入等        | 2,129,330.14   | 632,721.70     |
| 西安海创之星创业投资有限合伙企业            | 管理费收入等        | 1,202,830.19   | 1,877,022.34   |
| 海通齐东（威海）股权投资基金合伙企业（有限合伙）    | 管理费收入等        | 22,229,687.48  |                |
| 其他（注）                       | 管理费收入         |                | 2,185.97       |

4、 向关联方支付的业务及管理费

| 关联方名称           | 关联交易内容               | 本期发生额      | 上期发生额        |
|-----------------|----------------------|------------|--------------|
| 法国巴黎银行及公司股东同系公司 | 基金销售和维持费及投资咨询服务费、托管费 | 121,698.31 | 1,464,549.66 |
| 上海盛源房地产（集团）有限公司 | 业务及管理费               | 96,903.56  |              |

5、 向关联方支付的利息支出

| 关联方名称                | 关联交易内容   | 本期发生额 | 上期发生额         |
|----------------------|----------|-------|---------------|
| 上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 收益凭证利息支出 |       | 17,282,124.22 |

| 关联方名称 | 关联交易内容   | 本期发生额 | 上期发生额     |
|-------|----------|-------|-----------|
| 其他（注） | 收益凭证利息支出 |       | 27,151.75 |

#### 6、 向关联方收取的利息收入

| 关联方名称                | 关联交易内容 | 本期发生额 | 上期发生额      |
|----------------------|--------|-------|------------|
| 上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 利息结转   |       | 71,455.28  |
| 上海盛源房地产（集团）有限公司      | 利息结转   |       | 566,975.26 |
| 其他（注）                | 利息结转   |       | 168,891.77 |

#### 7、 向关联方取得的投资收益

| 关联方名称                  | 关联交易内容 | 本期发生额         | 上期发生额 |
|------------------------|--------|---------------|-------|
| 上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 投资收益   | 12,186,930.35 |       |

#### 8、 与关联方进行的债券交易

| 关联方名称           | 关联交易内容 | 本期发生额          | 上期发生额            |
|-----------------|--------|----------------|------------------|
| 法国巴黎银行及公司股东同系公司 | 现券交易   | 310,000,000.00 | 1,624,485,900.00 |

#### 9、 与关联方进行的利率互换

| 关联方名称           | 关联交易内容 | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-----------------|--------|----------------|----------------|
| 法国巴黎银行及公司股东同系公司 | 利率互换   | 340,000,000.00 | 660,000,000.00 |

#### 10、 与关联方进行的回购交易

| 关联方名称           | 关联交易内容 | 本期发生额          | 上期发生额 |
|-----------------|--------|----------------|-------|
| 法国巴黎银行及公司股东同系公司 | 质押回购   | 190,120,000.00 |       |

注：其他包括西安航天新能源产业基金投资有限公司、上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）、富国基金管理有限公司、中国-比利时直接股权投资基金、海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）、吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司、西安海创之星创业投资有限合伙企业、海通（吉林）现代服务业创业投资基金合伙企业（有限合伙）、上海盛源房地产（集团）有限公司。

### 11、关键管理人员薪酬

单位：万元

| 项 目      | 本期发生额    | 上期发生额    |
|----------|----------|----------|
| 关键管理人员薪酬 | 8,488.77 | 7,972.02 |

### (六) 关联方应收应付款项

#### 1、 应收关联方款项

| 项目名称 | 关联方             | 期末余额         |      | 年初余额           |      |
|------|-----------------|--------------|------|----------------|------|
|      |                 | 账面余额         | 坏账准备 | 账面余额           | 坏账准备 |
| 应收款项 | 法国巴黎银行及公司股东同系公司 | 2,133,413.57 |      | 3,734,388.22   |      |
| 应收款项 | 中国-比利时直接股权投资基金  |              |      | 112,200,000.00 |      |

#### 2、 应付关联方款项

| 项目名称    | 关联方名称                       | 期末余额          | 年初余额           |
|---------|-----------------------------|---------------|----------------|
| 应付款项    | 法国巴黎银行及公司股东同系公司             | 10,145,734.79 | 268,102.40     |
| 应付短期融资券 | 上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙）        |               | 670,000,000.00 |
| 应付短期融资券 | 海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）      | 14,000,000.00 | 14,000,000.00  |
| 应付短期融资券 | 西安军融电子卫星基金投资有限公司            |               | 49,000,000.00  |
| 应付短期融资券 | 西安海创之星创业投资有限合伙企业            |               | 15,050,000.00  |
| 代理买卖证券款 | 富国基金管理有限公司                  | 20,212.71     | 30,868,494.04  |
| 代理买卖证券款 | 海通（吉林）现代服务业创业投资基金合伙企业（有限合伙） | 56,244.19     |                |
| 代理买卖证券款 | 海通齐东（威海）股权投资基金合伙企业（有限合伙）    | 3,579,106.34  |                |
| 代理买卖证券款 | 海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）      | 32,758.14     |                |
| 代理买卖证券款 | 吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司        | 2,014,790.60  |                |
| 代理买卖证券款 | 上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙）        | 18,177.90     |                |
| 代理买卖证券款 | 上海盛源房地产（集团）有限公司             | 3,083.13      |                |
| 代理买卖证券款 | 上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）      | 10,177.37     |                |

## 十、 分部报告

公司以内部组织结构、管理要求等为依据确定经营分部，并以经营分部为基础确定报告分部。

| 2017 年    | 证券及期货经纪业务          | 投资银行业务           | 资产管理业务           | 自营业务              | 直投业务              | 管理部门及其他            | 海外业务               | 融资租赁业务            | 抵销                 | 合计                 |
|-----------|--------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| 一、营业收入    | 6,697,871,230.78   | 2,049,736,453.52 | 2,310,203,087.41 | 6,570,874,632.14  | 2,416,250,606.27  | 2,418,685,902.31   | 4,872,838,427.88   | 2,589,245,082.13  | -1,704,038,259.09  | 28,221,667,163.35  |
| 手续费及佣金净收入 | 3,606,992,155.14   | 2,092,802,974.64 | 1,876,476,733.67 | 111,160,681.11    | 14,464,150.54     | 97,342,362.90      | 1,870,431,105.74   |                   | -113,471,436.66    | 9,556,198,727.08   |
| 其他收入      | 3,090,879,075.64   | -43,066,521.12   | 433,726,353.74   | 6,459,713,951.03  | 2,401,786,455.73  | 2,321,343,539.41   | 3,002,407,322.14   | 2,589,245,082.13  | -1,590,566,822.43  | 18,665,468,436.27  |
| 二、营业支出    | 2,924,060,677.28   | 887,147,438.72   | 965,688,412.36   | 4,593,938,303.10  | 268,482,341.07    | 1,639,401,351.45   | 3,663,211,845.01   | 1,117,805,845.33  | -125,153,492.82    | 15,934,582,721.50  |
| 业务及管理费    | 2,655,030,702.00   | 871,681,218.77   | 999,957,535.48   | 286,919,699.18    | 216,990,805.56    | 1,614,751,389.61   | 2,748,549,479.33   | 482,543,482.87    | -121,307,308.07    | 9,755,117,004.73   |
| 其他支出      | 269,029,975.28     | 15,466,219.95    | -34,269,123.12   | 4,307,018,603.92  | 51,491,535.51     | 24,649,961.84      | 914,662,365.68     | 635,262,362.46    | -3,846,184.75      | 6,179,465,716.77   |
| 三、营业利润    | 3,773,810,553.50   | 1,162,589,014.80 | 1,344,514,675.05 | 1,976,936,329.04  | 2,147,768,265.20  | 779,284,550.86     | 1,209,626,582.87   | 1,471,439,236.80  | -1,578,884,766.27  | 12,287,084,441.85  |
| 四、利润总额    | 3,791,043,372.94   | 1,163,985,629.68 | 1,381,004,256.76 | 1,985,260,123.89  | 2,178,037,168.40  | 1,250,629,480.94   | 1,156,124,688.71   | 1,562,197,048.60  | -1,578,884,766.27  | 12,889,397,003.65  |
| 五、资产总额    | 147,046,482,805.80 | 795,443,503.69   | 9,478,054,769.33 | 49,580,465,667.56 | 19,391,425,053.30 | 136,629,906,992.51 | 148,608,587,501.66 | 62,045,171,883.84 | -38,869,205,387.88 | 534,706,332,789.81 |
| 分部资产：     | 147,046,482,805.80 | 795,443,503.69   | 9,305,013,604.52 | 49,547,795,859.55 | 19,391,411,828.30 | 135,593,120,372.73 | 147,521,487,110.50 | 61,543,961,946.12 | -38,889,834,709.45 | 531,854,882,321.76 |
| 递延所得税资产   |                    |                  |                  |                   |                   |                    |                    |                   |                    | 2,851,450,468.05   |
| 六、负债总额    | 69,846,217,146.34  | 625,940,940.06   | 2,177,001,702.27 | 15,049,354,116.79 | 3,033,015,695.66  | 134,242,776,257.79 | 136,827,138,753.38 | 50,416,730,376.35 | -7,206,146,086.15  | 405,012,028,902.49 |
| 分部负债      | 69,842,331,985.23  | 625,940,940.06   | 2,175,330,611.79 | 15,048,385,272.82 | 2,814,299,273.47  | 133,643,943,392.94 | 136,788,409,171.01 | 50,413,309,116.14 | -7,207,240,523.65  | 404,144,709,239.81 |
| 递延所得税负债   |                    |                  |                  |                   |                   |                    |                    |                   |                    | 867,319,662.68     |
| 七、补充信息    |                    |                  |                  |                   |                   |                    |                    |                   |                    |                    |
| 1、折旧与摊销费用 | 100,098,205.27     | 6,664,813.57     | 20,633,439.03    | 5,327,851.55      | 289,613.79        | 194,062,728.56     | 148,456,901.75     | 8,607,700.19      |                    | 484,141,253.71     |
| 2、资本性支出   | 82,741,754.99      | 4,534,019.50     | 23,457,381.52    | 4,034,411.07      | 261,568.74        | 344,069,651.47     | 107,807,396.02     | 1,258,537,967.91  |                    | 1,825,444,151.22   |
| 3、资产减值损失  | 180,599,913.63     | 44,835.32        | -48,193,253.85   | 82,467,761.23     | 45,331,894.93     | 13,061,850.39      | 827,297,893.69     | 589,893,579.34    | -3,846,184.75      | 1,686,658,289.93   |

| 2016 年    | 证券及期货经纪业务          | 投资银行业务           | 资产管理业务            | 自营业务              | 直投业务              | 管理部门及其他            | 海外业务               | 融资租赁业务            | 抵销                 | 合计                 |
|-----------|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| 一、营业收入    | 8,514,445,749.64   | 2,171,389,825.68 | 1,800,319,429.71  | 8,325,350,756.37  | 1,013,605,189.62  | 530,169,483.05     | 3,953,225,118.22   | 1,985,475,512.91  | -282,966,470.69    | 28,011,014,594.51  |
| 手续费及佣金净收入 | 4,965,536,291.08   | 2,301,555,804.04 | 1,503,507,289.37  | 475,131,248.95    | 6,639,712.59      | 113,515,695.13     | 1,626,031,169.35   |                   | -26,908,355.94     | 10,965,008,854.57  |
| 其他收入      | 3,548,909,458.56   | -130,165,978.36  | 296,812,140.34    | 7,850,219,507.42  | 1,006,965,477.03  | 416,653,787.92     | 2,327,193,948.87   | 1,985,475,512.91  | -256,058,114.75    | 17,046,005,739.94  |
| 二、营业支出    | 3,366,630,130.75   | 965,055,060.49   | 881,788,478.13    | 6,181,786,489.07  | 184,979,361.24    | 1,592,735,976.16   | 3,255,222,736.35   | 961,307,360.66    | -26,856,709.37     | 17,362,648,883.48  |
| 业务及管理费    | 3,003,642,036.70   | 904,356,522.94   | 849,906,775.45    | 243,204,548.92    | 89,256,495.02     | 1,652,469,868.83   | 2,466,104,867.68   | 381,457,921.61    | -26,856,709.37     | 9,563,542,327.78   |
| 其他支出      | 362,988,094.05     | 60,698,537.55    | 31,881,702.68     | 5,938,581,940.15  | 95,722,866.22     | -59,733,892.67     | 789,117,868.67     | 579,849,439.05    |                    | 7,799,106,555.70   |
| 三、营业利润    | 5,147,815,618.89   | 1,206,334,765.19 | 918,530,951.58    | 2,143,564,267.30  | 828,625,828.38    | -1,062,566,493.11  | 698,002,381.87     | 1,024,168,152.25  | -256,109,761.32    | 10,648,365,711.03  |
| 四、利润总额    | 5,176,971,559.80   | 1,207,082,571.90 | 923,418,917.50    | 2,155,202,382.35  | 834,612,138.78    | -675,930,506.44    | 679,294,535.72     | 1,117,185,156.01  | -256,109,761.32    | 11,161,726,994.30  |
| 五、资产总额    | 137,763,972,706.15 | 866,787,329.30   | 18,514,890,266.54 | 47,414,545,834.88 | 18,562,406,014.45 | 166,374,657,363.49 | 165,303,327,001.08 | 48,480,428,257.13 | -42,415,168,622.70 | 560,865,846,150.32 |
| 分部资产：     | 137,762,027,565.09 | 866,787,329.30   | 18,415,373,068.74 | 47,389,875,466.70 | 18,562,400,014.45 | 165,201,493,813.89 | 164,182,598,611.75 | 48,127,298,986.38 | -42,415,820,822.70 | 558,092,034,033.60 |
| 递延所得税资产   |                    |                  |                   |                   |                   |                    |                    |                   |                    | 2,773,812,116.72   |
| 六、负债总额    | 111,096,920,272.92 | 1,665,598,499.70 | 10,438,188,424.64 | 21,158,161,062.86 | 2,873,644,616.58  | 109,728,947,932.79 | 153,398,853,717.01 | 37,957,839,073.31 | -9,410,708,821.40  | 438,907,444,778.41 |
| 分部负债      | 111,094,778,068.15 | 1,665,598,499.70 | 10,436,208,840.79 | 21,132,849,085.59 | 2,464,639,285.59  | 109,662,689,578.97 | 153,314,725,239.13 | 37,957,839,073.31 | -9,379,354,871.43  | 438,349,972,799.80 |
| 递延所得税负债   |                    |                  |                   |                   |                   |                    |                    |                   |                    | 557,471,978.61     |
| 七、补充信息    |                    |                  |                   |                   |                   |                    |                    |                   |                    |                    |
| 1、折旧与摊销费用 | 113,536,891.04     | 5,288,243.64     | 18,452,652.25     | 5,211,384.21      | 339,923.10        | 147,862,330.72     | 82,994,968.35      | 4,207,340.38      |                    | 377,893,733.69     |
| 2、资本性支出   | 48,222,950.83      | 1,331,947.82     | 21,852,000.03     | 828,620.14        | 228,469.96        | 158,117,800.68     | 198,273,615.76     | 23,575,286.28     |                    | 452,430,691.50     |
| 3、资产减值损失  | 35,883,513.02      | 558,136.52       | 310,606.33        | 22,135,116.77     | 92,775,221.91     | -23,512,581.57     | 728,310,818.13     | 563,031,889.62    |                    | 1,419,492,720.73   |

## 十一、或有事项、承诺及表外事项

### (一) 或有事项

#### 1、未决诉讼或仲裁形成的或有负债及其财务影响

报告期末，公司经纪业务交易纠纷等未涉及重大诉讼案件。

#### 2、其他或有负债

预计负债期末余额人民币 1.67 亿元，详见附注五、(三十四)。

### (二) 重大承诺事项

#### 1、银行借款质押情况

期末公司的银行质押借款余额合计港币 14.13 亿元（折合人民币 11.81 亿元），该款项部分系公司在客户同意下，以其给予客户的融资款而取得的质押品（持有的上市公司股份）作为质押借入，截止 2017 年 12 月 31 日，该质押品期末市值为港币 129.51 亿元（折合人民币 108.26 亿元）。另一部分质押借款港币 6.21 亿元（折合人民币 5.19 亿元）以公司持有的债券作为质押，截止 2017 年 12 月 31 日，该质押品期末市值为港币 14.28 亿元（折合人民币 11.94 亿元）。

期末公司持有港币 60.25 亿元（折合人民币 50.37 亿元）借款，以下属于子公司股权作为质押。

期末公司持有港币 5.79 亿元（折合人民币 4.84 亿元）借款，以公司持有的人民币 5.5 亿元定期存款作为质押。

期末公司持有美元 1 亿元（折合人民币 6.53 亿元）借款，以公司持有的债券作为质押。截止 2017 年 12 月 31 日，该质押品公允价值为人民币 7.81 亿元。

期末公司持有人民币 5.15 亿元借款，以公司持有的上海惟泰置业管理有限公司的外滩街道 169 街坊 4/2 丘的土地作及持有上海惟泰置业管理有限公司的 100%的股权为抵押物。

期末公司持有人民币 2.0067 亿元借款，以公司持有的定期存单人民币 2 亿元及保证金存款人民币 2 万元作为质押。

期末公司持有短期及长期借款合计人民币 137.96 亿元，以应收融资租赁款项作为质押，截止 2017 年 12 月 31 日，应收融资租赁款项质押品价值为人民币 215.89 亿元。

期末公司持有短期借款港币 24 亿元（折合人民币 20.06 亿元），以持有大成海通中国债券基金 1 号作为抵押，截止 2017 年 12 月 31 日，该质押物公允价值为人民币 25.99 亿。

期末公司持有的长期借款港币 24.54 亿元（折合人民币 20.51 亿元），以公司持有的债券作为质押，截止 2017 年 12 月 31 日，该质押品公允价值为美元 3.11 亿元（折合人民币 20.32 亿元）。

## 2、 有关公司为发行首期境外债券提供反担保情况

根据第五届董事会第二十一次会议决议，公司就发行的首期境外债券开立的备用信用证向中国银行出具反担保函，反担保金额为发行的首期境外债券本金、利息及其他相关费用。保证方式为连带责任保证，保证期结束日期为备用信用证有效期届满之日起六个月。

## 3、 有关公司为境外全资附属公司发行美元债提供连带责任保证担保

公司于 2015 年 4 月 13 日以通讯表决方式召开第六届董事会第三次会议（临时会议），审议通过了《关于为境外全资附属公司发行美元债提供连带责任保证担保的议案》。公司就境外的全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 6.7 亿美元、于 2020 年到期、票面利率为 3.5% 的美元债券，提供连带责任保证担保。

## 4、 有关公司为境外全资附属公司提供融资担保

2016 年 5 月 31 日，公司境外间接全资附属公司 Haitong Investment Ireland Public Limited Company（以下简称“HIIP”）向银团贷款，签订了《融资协议》。同日，公司就该贷款签署《担保协议》为 HIIP 提供担保，担保内容为 7.5 亿欧元的贷款本金、利息、前端费、借款人应当承担的其他费用等，担保期限为 5 年。

公司第六届董事会第十五次会议决议以及 2016 年 5 月 26 日股东大会对董事会的授权，公司可以为海通银行及其下属子公司提供金额不超过 8 亿欧元、期限不超过 5 年的融资担保。

2017年4月27日，公司召开的第六届董事会第二十四次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。公司2017年6月8日作为担保人签署《贷款协议》，为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供2亿欧元连带责任保证担保。

#### 5、 有关公司为境外全资附属公司发行欧元债提供连带责任保证担保

2015年6月5日，公司以通讯方式召开第六届董事会第六次会议（临时会议）审议通过了《关于为境外全资附属公司发行欧元债提供连带责任保证担保的议案》。鉴于本次发行的实际情况，本次发行将分两次交割，因此将分两次签署《担保协议》。

公司于2016年5月18日签署第一份《担保协议》，为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为1亿欧元、于2021年到期、票面利率为1.6%的欧元债券，提供连带责任保证担保。

公司于2016年5月26日签署第二份《担保协议》，为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为1.2亿欧元、于2021年到期、票面利率为1.6%的欧元债券，提供连带责任保证担保。

#### 6、 有关公司为海通资管提供和追加净资本担保承诺

公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》，董事会同意公司随时对资产管理子公司提供不超过15亿元的净资本担保承诺，以保证其净资本保持充足。2013年6月9日，上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》（沪证监机构字[2013]145号），同意公司向资产管理子公司提供8亿元的担保承诺。

2016年8月29日，经公司第六届董事会十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管追加净资本担保承诺及对其增加注册资本的议案》，同意公司对海通资管追加不超过人民币40亿元的净资本担保承诺。公司为海通资管提供最高额度为人民币40亿元的净资本担保承诺，并承诺当海通资管开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资本担保事宜，海通资管已于2016年9月27日获得中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》（沪证监机构字[2016]325号）。

## 7、 资本承诺

单位：万元

| 项 目                   | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------------|------------------|
| 已签约但未拨付的购建长期资产承诺      | 9,039.00         | 7,917.33         |
| 已签约但尚未于财务报表中确认的对外投资承诺 |                  | 60,000.00        |

## 8、 经营租赁

根据与出租人已签订的不可撤销的经营性租赁合同，未来最低应支付租金汇总如下：

单位：万元

| 项 目          | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
|--------------|------------------|------------------|
| 一年以内         | 34,155.96        | 22,785.11        |
| 二年至五年（含首尾两年） | 45,298.24        | 30,984.57        |
| 5 年以上        | 3,170.27         | 1,999.99         |
| 合 计          | 82,624.46        | 55,769.67        |

根据与承租人已签订的不可撤销的经营性租赁合同，未来最低应收取租金汇总如下：

单位：万元

| 项 目          | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
|--------------|------------------|------------------|
| 一年以内         | 16,568.76        | 1,200.67         |
| 二年至五年（含首尾两年） | 59,291.27        | 2,500.91         |
| 5 年以上        | 34,459.97        | 492.10           |
| 合 计          | 110,320.00       | 4,193.68         |

## 9、 其他承诺事项

其他存在限售期及有承诺条件的资产为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产，详见附注五、（五）3 及附注五、（十一）4。

(三) 表外事项

单位：万元

| 项 目      | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------|------------------|
| 保函和备用信用证 | 136,084.64       | 160,764.83       |
| 不可撤销信贷承诺 | 10,875.61        | 11,603.23        |
| 合 计      | 146,960.25       | 172,368.06       |

注 1: 保函和备用信用证属于发生代付情况下才可能导致公司资本流出的银行业务。

注 2: 不可撤销信贷承诺为向银行客户提供信贷协议（如未使用的信贷额度）。这些协议通常约定了固定期限或其他要素，且需要客户支付一定的手续费。所有的信贷承诺在授信时都需要客户维持一定的已核实的条件。

十二、资产负债表日后事项

(一) 资产负债表日后利润分配情况说明

根据公司 2018 年 3 月 27 日第六届董事会第二十九次会议决议，以 2017 年 12 月 31 日的 A 股和 H 股总股本 11,501,700,000 股为基数，向公司股权登记日登记在册的 A 股和 H 股股东每 10 股派发现金股利 2.30 元(含税)，共计分配现金股利 2,645,391,000 元。本次现金股利分配后母公司的未分配利润 17,817,845,957.76 元结转下一年度。现金股利以人民币计值和宣布，以人民币向 A 股股东支付，以港币向 H 股股东支付。港币实际发放金额按照公司 2017 年度股东大会召开日前五个工作日中国人民银行公布的人民币兑换港币平均基准汇率计算。

公司 2017 年度利润分配议案经年度股东大会审议通过后，将于该次股东大会召开之日起二个月内进行现金股利分配。

(二) 子公司上市申请

2017 年 6 月 27 日，公司的子公司海通恒信国际租赁股份有限公司通过联席保荐人向香港联合交易所有限公司呈交上市申请（A1 表格），申请海通恒信 H 股股份于香港联交所主板上市及批准买卖。由于自上市申请之日起六个月期间已届满，上市申请于 2018 年 2 月 28 日获重续。

(三) 子公司挂牌新三板

公司控股子公司海通期货股份有限公司于 2017 年 12 月 29 日获批在全国中小企业股份转让系统挂牌，并于 2018 年 3 月 6 日完成正式挂牌。

### 十三、其他重要事项

#### (一) 海通国际证券集团购股权计划

##### 1、 2002 年购股权计划

2002 年 8 月 23 日，海通国际证券经股东批准采纳一项购股权计划（「2002 年购股权计划」），由采纳之日起计有效期为 10 年，已于 2012 年 8 月 22 日届满。根据 2002 年购股权计划，购股权可授予海通国际证券或其任何附属（子）公司或联营公司的任何全职员工、执行董事及非执行董事。购股权行使价由海通国际证券董事确定，不得低于下列各项的最高值：(I) 公司股票于要约日期在联交所的收盘价；(II) 公司股票于要约日期前 5 个交易日在联交所的平均收盘价；及 (III) 公司股票面值。购股权持有人无权收取股息或于股东大会上投票。

2017 年度，海通国际证券购股权持有人在 2002 年购股权计划下共行使 3,327,798 份购股权。

##### 2、 2015 年购股权计划

2015 年 6 月 8 日，海通国际证券股东特别大会审议批准采纳新购股权计划（「2015 年购股权计划」），该购股权计划于采纳日期起十年内有效及生效。根据 2015 年购股权计划，购股权可授予海通国际证券或其任何附属（子）公司或联营公司的任何全职员工、执行董事及非执行董事。购股权行使价由海通国际证券董事确定，不得低于下列各项的最高值：(I) 公司股票于要约日期在联交所的收盘价的 110% 的价格；(II) 公司股票于要约日期前 5 个交易日在联交所的平均收盘价；及 (III) 公司股票面值。购股权持有人无权收取股息或于股东大会上投票。

2017 年度，海通国际证券在 2015 年购股权计划下授出并获接纳合共 13,350,000 份购股权。另有 1,951,274 份购股权于期内因员工辞职失效。

截至 2017 年 12 月 31 日，海通国际证券已发行但未获行使的购股权情况如下：

| 购股权计划       | 已发行但未获行使购<br>股权数量（注） | 每股行使价<br>（注） | 行权期限                             |
|-------------|----------------------|--------------|----------------------------------|
| 2002 年购股权计划 | 5,812,110 份          | 2.764 港元     | 2011 年 3 月 3 日至 2019 年 3 月 2 日   |
| 2015 年购股权计划 | 15,878,100 份         | 4.667 港元     | 2016 年 12 月 8 日至 2021 年 5 月 11 日 |
|             | 13,350,000 份         | 5.038 港元     | 2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日  |
| 合计          | 35,040,210 份         |              |                                  |

注：购股权数量及购股权行使价格可因供股、以股代息、红股发行或公司股本的其

他类似变动而进行调整。

上述根据 2002 年及 2015 年购股权计划尚未获行使的购股权约占海通国际证券 2017 年 12 月 31 日已发行股份约 0.64%，如余下的购股权获悉数行使，在海通国际证券目前的股本结构下，将须额外发行 35,040,210 股海通国际证券普通股，而海通国际证券的股本将增加 350 万港元，股本溢价将增加 15,392 万港元（未扣除发行开支）。

## (二) 恒信金融集团购股权计划

海通国际控股子公司恒信金融集团于 2014 年 5 月 27 日采纳了一项股票期权激励计划，有效期 5 年。根据该计划，激励对象为恒信金融集团董事会认定的恒信金融集团及其附属公司的董事、高级管理人员、经营管理骨干、核心技术及业务人员等，总计不超过 50 人。该计划拟授予激励对象不超过 97,321,500 份股票期权，2015 年 1 月 19 日按决议要约向该计划下 28 名合格参与者分配购股权，以根据购股权计划认购恒信金融集团股本中合共不超过 85,980,375 股普通股。

考虑到中国现行法律法规的要求及海通恒信战略发展和经营管理的需要，经恒信金融集团董事会决策，基于海通证券股东大会于 2014 年 5 月 27 日对恒信金融集团董事会的授权，对股票期权计划下已授予但未获行权的股票期权进行退出性安排。在拟定此安排时，已充分考虑股权激励计划有关条文和相关员工对海通恒信所作出的贡献。

## (三) 以公允价值计量的资产和负债

单位：折合人民币元

| 项目                       | 年初余额               | 本期公允价值            | 计入权益的累计          | 本期计提的          | 期末余额               |
|--------------------------|--------------------|-------------------|------------------|----------------|--------------------|
|                          |                    | 变动损益              | 公允价值变动           | 减值             |                    |
| 金融资产                     |                    |                   |                  |                |                    |
| 1.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 92,347,493,554.98  | -238,839,784.46   |                  |                | 99,856,694,835.91  |
| 2.衍生金融资产                 | 3,935,071,348.81   | -1,321,374,835.96 |                  |                | 2,610,612,302.28   |
| 3.可供出售金融资产               | 53,318,414,541.31  |                   | 2,794,345,402.66 | 247,962,705.44 | 41,228,756,005.51  |
| 金融资产合计                   | 149,600,979,445.10 | -1,560,214,620.42 | 2,794,345,402.66 | 247,962,705.44 | 143,696,063,143.70 |
| 金融负债                     |                    |                   |                  |                |                    |
| 1.以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 38,639,631,004.32  | -83,487,621.42    |                  |                | 20,743,499,166.70  |

| 项目       | 年初余额              | 本期公允价值<br>变动损益 | 计入权益的累计<br>公允价值变动 | 本期计提的<br>减值 | 期末余额              |
|----------|-------------------|----------------|-------------------|-------------|-------------------|
| 债        |                   |                |                   |             |                   |
| 2.衍生金融负债 | 2,594,009,281.96  | 314,291,375.24 |                   |             | 3,495,454,278.20  |
| 金融负债合计   | 41,233,640,286.28 | 230,803,753.82 |                   |             | 24,238,953,444.90 |

注：本表不存在必然的勾稽关系。

#### (四) 外币金融资产和外币金融负债

单位：折合人民币元

| 项目   | 年初余额              | 本期公允价值<br>变动损益    | 计入权益的累计<br>公允价值变动 | 本期计提的<br>减值    | 期末余额              |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 1.以公允价值计量且其变动<br>计入当期损益的金融资产<br>(不含衍生金融资产) | 48,333,366,989.00 | -425,112,644.12   |                   |                | 54,365,143,648.61 |
| 2.衍生金融资产                                   | 3,905,039,429.87  | -852,430,312.88   |                   |                | 2,523,822,592.28  |
| 3.贷款和应收款                                   | 7,269,300,462.39  |                   |                   | 90,818,943.80  | 11,841,949,482.55 |
| 4.可供出售金融资产                                 | 21,952,976,412.83 |                   | 315,049,995.94    | 189,819,544.61 | 10,402,453,888.40 |
| 5.持有至到期投资                                  | 83,508,859.69     |                   |                   |                | 78,718,210.79     |
| 金融资产合计                                     | 81,544,192,153.78 | -1,277,542,956.99 | 315,049,995.94    | 280,638,488.41 | 79,212,087,822.63 |
| 1.以公允价值计量且其变动<br>计入当期损益的金融负债               | 24,921,440,189.95 | -137,995,315.53   |                   |                | 22,821,318,216.46 |
| 2.衍生金融负债                                   | 2,368,011,993.59  | -121,817,192.27   |                   |                | 2,862,122,450.11  |
| 金融负债合计                                     | 27,289,452,183.54 | -259,812,507.80   |                   |                | 25,683,440,666.57 |

注：本表不存在必然的勾稽关系。

#### (五) 关于会计政策变更的议案

海通证券股份有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会第二十九次会议审议通过了《关于会计政策变更的议案》。

本次会计政策变更的依据是财政部 2017 年修订的下述企业会计准则，主要包括：

《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》；

《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》；

《企业会计准则第 24 号——套期会计》；

《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》；

《企业会计准则第 14 号——收入》；

《企业会计准则第 42 号——持有待售的非流动资产、处置组和终止经营》；  
《企业会计准则第 16 号——政府补助》。

## 1、 金融工具相关会计政策变更

根据财政部修订的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》规定，本次变更的主要内容包括：依据持有金融资产的“业务模式”和“金融资产合同现金流量特征”，金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产三类；金融资产减值由“已发生损失法”改为“预期损失法”，并且扩大了计提范围；套期会计方面扩大了符合条件的被套期项目和套期工具范围，以定性的套期有效性要求取代了定量要求，引入套期关系的“再平衡”机制；金融工具披露要求相应调整。

根据财政部规定，公司应于 2018 年 1 月 1 日起执行上述新准则。根据准则衔接规定，企业应当按照新准则重新编制 2018 年 1 月 1 日的资产负债表，无需重述前期可比数。2018 年 1 月 1 日及以后会计期间，公司按新会计准则的要求进行会计核算和相关列报，不重述 2017 年比较期间数据。

实施上述新准则对会计核算和相关列报的主要影响有：根据新准则，对公司金融资产进行分类和计量，包括对估值方法进行必要的调整；对相关金融资产运用预期损失法进行减值测试，并重新计量其账面价值；相应调整其他综合收益和期初留存收益。基于公司年末金融资产持仓情况和上述变更的测算，金融资产分类、计量及减值方法等变更预计将对公司财务报表产生广泛影响，但对公司的总资产和净资产未产生重大影响。

## 2、 收入相关会计政策变更

根据财政部修订的《企业会计准则第 14 号——收入》，将原收入准则和建造合同准则统一纳入收入确认的模型；以控制权转移替代风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准；对于包含多重交易安排的合同的会计处理提供更明确的指引；对于某些特定交易（或事项）的收入确认和计量给出了明确规定。

根据财政部规定，公司应于 2018 年 1 月 1 日起执行上述新准则。根据衔接规定，首次执行本准则的企业，应当根据首次执行本准则的累积影响数，调整首次执行本准则当年年初留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整。此次变更对公司净利润、总资产和净资产未产生重大影响。

其余会计政策已于 2017 年生效，对 2017 年财务报告未产生重大影响。

**(六) 融资融券业务**

| 项目                          | 期末余额              |
|-----------------------------|-------------------|
| 融出资金                        | 61,560,952,642.71 |
| 融出证券-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 12,005,422.85     |
| 融出证券-可供出售金融资产               | 1,516,930.50      |
| 融出证券-转融通融入证券                | 12,773,330.88     |
| 转融通融入证券总额                   | 22,191,128.00     |

注：融出资金详见附注五（四）；融出证券详见附注五（十二）

**(七) 社会责任**

2017 年在环保公益项目、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等公益性方面的投入金额共计 987.65 万元。

**2017 年公益性投入构成明细**

单位：万元

| 项目   | 本期发生额  |
|------|--------|
| 慈善捐赠 | 987.65 |
| 其他   |        |
| 合计   | 987.65 |

**十四、 风险管理**

**(一) 风险管理政策及组织架构**

**1、 风险管理政策**

海通证券一直以来注重对风险的防范与控制，公司确立了“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，树立了“稳健乃至保守”的风险控制理念，经营管理实行合规优先、风险控制优先。

公司严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了完整有效的风险管理架构体系。在日常管理中，公司面临的主要风险包括：信用风险、市场风险、操作风险、流动性风险、声誉风险等。公司采用征信、久期分析、外汇敞口分析、风险价值分析、敏感性分析等方法对风险进行计量，建立净资本等风险控制指标的监控体系，稳健配置资产，规范业务流程，全面加强对各类风险的事前防范、事中监控和事后控制管理。

## 2、 风险管理架构

公司依据《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司全面风险管理规范》等规定及公司章程，规范运作，根据业务发展、风险管理工作的需求，搭建了多层次的风险管理组织架构，明确了董事会、监事会、管理层、首席风险官、风险管理部门、业务及管理部门、分支机构、子公司等各层级在风险管理工作中的具体职责。

公司董事会是公司风险管理战略目标的制定者和授权人。负责审议批准公司风险管理的总体目标、基本政策和重要制度、公司整体风险偏好和风险容忍度、重大风险的解决方案、定期风险评估报告，监督公司风险管理政策的实施，任免考核首席风险官，建立与首席风险官的直接沟通机制，及公司章程规定的其他职责。公司董事会设合规与风险管理委员会，具体履行董事会风险管理职责。公司监事会是公司风险管理和内部控制体系的监督者，负责对董事会、经理层建立和实施风险管理及内部控制的情况进行监督，并履行公司章程规定的其他职责。

公司经营层根据董事会的授权，负责建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的政策、规章和制度，贯彻执行公司整体风险偏好和风险容忍度政策，组织实施各类风险的识别与评估工作，建立健全和有效执行风险管理制度和机制，及时处理或者改正存在的缺陷或问题，审议处理公司重大风险事故，建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系，建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制，及董事会授予的其他风险管理职责。

公司设首席风险官，由董事长提名、董事会聘任。首席风险官是负责公司全面风险管理工作的高级管理人员。首席风险官负责组织实施董事会、经营层确定的风险管理政策、规章和制度，组织对公司建立健全各项业务风险管理制度进行督导、审查和评估，组织对公司风险管理政策和流程的执行情况进行监督和检查，对存在的问题提出处理意见并督促整改，对重大风险或风险隐患，及时向公司有关机构、部门或子公司提出处理意见并督促整改，组织评估和完善风险管理的工具和方法，定期组织对公司面临主要风险水平及其管理状况进行评估，并向经营层、董事会及监管部门提交评估报告，组织对子公司风险管理工作负责人的提名和考核等。

公司设立风险管理部门，在首席风险官的领导下履行风险管理职责。负责拟定公司风险管理的政策、规章和制度，督导公司各部门制定业务风险管理制度和流程，对相关业务的主要风险进行识别和评估，组织对各项业务风险管理制度执行情况的监督、检查，定期对公司整体风险水平及其风险管理状况进行评估和报告，对重大风险隐患或风险事件，及时报告并提出风险处置建议等。此外，公司设立资金管理部门管理公司流动性风险。

公司各部门、分支机构和子公司负责其经营管理范围内的风险管理工作，建立

健全相应的风险管理制度和流程，落实公司风险管理政策，组织实施相应的风险管理工作。公司各部门、各分支机构和子公司负责人承担风险管理有效性的直接责任。公司各部门、各分支机构和子公司指定专人负责本单位的风险管理工作，对风险管理政策和制度的执行情况进行监督、检查和报告，履行一线风险管理职责。

公司内部审计部门负责定期对公司风险管理工作进行稽核检查，定期评估风险管理体系的有效性，并根据评估结果提出改进建议。

## (二) 信用风险管理

信用风险指公司融资类客户、交易对手或公司持有证券的发行人无法履行合同义务的情况下给本公司造成损失的风险，或者本公司持有第三方当事人发行的证券，在该方信用质量发生恶化情况下给本公司造成损失的风险。信用风险和市场风险具有一定的相关性，在市场波动的情况下，公司部分金融产品因持有或交易产生的信用风险暴露程度将随之发生变化。对此，公司对市场波动采取必要的监控和防范措施，以实现信用风险的有效管理。

公司面临的信用风险主要涉及存放在其他金融机构的自有货币资金，经纪业务代理客户买卖证券的交易结算，为客户提供融资融券、约定购回式证券交易和股票质押式回购交易等融资类业务，债券投资、衍生品交易等自营业务，上述业务因为客户、交易对手无法履约使公司面临产生损失的风险。

公司的货币资金主要存放在国有商业银行或信誉良好的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。经纪业务采取全额保证金结算方式可以切实规避相关信用风险。融资融券、约定购回式证券交易和股票质押式回购业务方面，公司通过制定和实施各项严格的制度和措施从尽职调查、征信、授信、逐日盯市、强制平仓、司法追索等环节对涉及的信用风险进行控制。公司对信用类固定收益证券投资注重分散投资，投资的信用产品主要为高信用评级产品，并密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，投资标的信用风险控制良好。场外衍生品业务方面，公司从客户准入、标的证券管理、交易对手授信管理、风险处置流程等方面建立了比较完善的制度规范，对存续期内的每笔场外衍生品业务逐日盯市，并通过严格履行预警、止损等措施管理信用风险。此外，子公司在开展融资类业务、投资业务、租赁业务、场外衍生品等业务过程中，也面临信用风险。公司已按照集团全面风险管理的总体规划，逐步强化和完善集团层面的信用风险管理。

除上述风险因素外，集团个别子公司在开展融资类业务、投资业务、租赁业务、场外衍生品等业务过程中，也面临信用风险。相关子公司在公司统一的风险偏好下，根据其业务特点制定了信用风险管控的制度、措施和流程，并针对信用风险暴露情

况制定了风险限额,经公司审核后执行。公司已按照集团全面风险管理的总体规划,从制度建设、限额体系、监控机制、信息系统、风险报告等各方面逐步强化和完善集团层面的信用风险管理。

为配合新金融工具准则的实施,提升减值准备的风险敏感度,确保新准则下的减值准备计提工作与公司信用风险管理目标相一致,公司持续优化以预期信用损失为基础的金融工具减值计量方法,包括金融工具的风险分类、概率加权风险参数的评估、资金的时间价值、抵质押物估值以及前瞻性分析等。

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下,代表本集团及本公司在资产负债表日最大风险敞口的金额如下:

本集团:

单位: 万元

| 涉及信用风险的项目              | 2017 年末       |
|------------------------|---------------|
| 货币资金                   | 10,379,572.69 |
| 结算备付金                  | 798,272.86    |
| 存出保证金                  | 852,867.52    |
| 拆出资金                   | 67,909.20     |
| 融出资金                   | 6,156,095.26  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 6,316,676.42  |
| 衍生金融资产                 | 261,061.23    |
| 买入返售金融资产               | 9,654,986.85  |
| 应收款项                   | 744,199.96    |
| 可供出售金融资产               | 495,936.30    |
| 持有至到期投资                | 7,871.82      |
| 应收利息                   | 370,389.89    |
| 其他资产                   | 7,965,909.94  |
| 合 计                    | 44,071,749.94 |

本公司:

单位: 万元

| 涉及信用风险的项目 | 2017 年末      |
|-----------|--------------|
| 货币资金      | 5,914,719.33 |
| 结算备付金     | 964,941.02   |
| 存出保证金     | 106,228.75   |
| 融出资金      | 4,787,776.04 |

| 涉及信用风险的项目              | 2017 年末       |
|------------------------|---------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 2,762,364.90  |
| 买入返售金融资产               | 8,885,791.38  |
| 应收款项                   | 68,515.97     |
| 应收利息                   | 129,536.39    |
| 可供出售金融资产               | 39,659.93     |
| 其他资产                   | 69,625.40     |
| 合 计                    | 23,729,159.11 |

### (三) 市场风险

市场风险主要指在公司的经营活动中，因市场价格（股票价格、利率、汇率等）的不利变动而使公司自有资金投资的相关业务发生损失的风险。

本集团采用风险价值(VaR)方法对各类投资金融工具及持仓组合的市场风险进行评估和分析。计量口径包含母公司及主要投资业务子公司，含海通银行、海通国际、海通创新投资等。集团所使用的风险价值模型方法为历史模拟法，置信度为 95%，目标期间为下个交易日。具体如下：

| 项目           | 2017 年 VaR 95%  |                 |                 |                 |
|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|              | 本公司风险价值<br>(万元) | 本集团风险价值<br>(万元) | 本公司风险价值<br>/净资本 | 本公司风险价值<br>/净资产 |
| 报告期最高月末<br>值 | 9,342.73        | 16,357.25       | 0.12%           | 0.09%           |
| 报告期最低月末<br>值 | 6,032.62        | 12,429.53       | 0.08%           | 0.06%           |
| 报告期平均月末<br>值 | 7,102.82        | 14,563.85       | 0.09%           | 0.07%           |
| 2017 年年末值    | 6,444.70        | 13,375.33       | 0.09%           | 0.06%           |

报告期内，本公司风险价值与净资产之比始终在 0.2% 以内，市场风险控制情况良好。年末母公司及集团主要子公司风险价值占集团净资产比例在 0.2% 以内，市场风险可控可承受。

#### 1、 股票价格风险

股票价格风险主要指公司所投资的权益类证券市场价格发生变化致使本公司承受损失的风险。

①对于集团的价格风险，主要采用第一层级内证券价格波动对报告期内净利润及其他综合收益的影响进行分析。

假设其他相关变量不变的前提下，有关权益类资产的市场价格上升或下降 10%，

对本集团的净利润及和其他综合收益的影响如下：

单位：万元

| 市场价格变动幅度 | 2017 年      |           |
|----------|-------------|-----------|
|          | 净利润         | 其他综合收益    |
| 上升 10%   | 121,192.71  | 4,440.51  |
| 下降 10%   | -121,192.71 | -4,440.51 |

②对于子公司的价格风险，主要采用第一层级内证券价格波动对报告期内净利润及归属于母公司股东的其他综合收益的影响进行分析。

假设其他相关变量不变的前提下，有关权益类资产的市场价格上升或下降 10%，

对本集团的净利润及归属于母公司股东的其他综合收益的影响如下：

单位：万元

| 市场价格变动幅度 | 2017 年     |                     |
|----------|------------|---------------------|
|          | 净利润        | 归属于母公司股东的<br>其他综合收益 |
| 上升 10%   | 59,138.97  | 3,930.53            |
| 下降 10%   | -59,138.97 | -3,930.53           |

## 2、 利率风险

利率风险是指因市场利率变动而导致的风险。公司利率风险主要来自银行存款、结算备付金、存出保证金、融出资金、应收融资租赁款等固定收益类证券投资等。

本集团利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具。

假设其他相关变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点对本集团净利润、股东权益的影响如下：

单位：万元

| 项 目           | 2017 年    |           |
|---------------|-----------|-----------|
|               | 净利润       | 股东权益      |
| 市场利率上升 25 个基点 | -3,223.90 | -3,348.96 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 3,223.90  | 3,348.96  |

本公司固定收益业务持仓组合主要风险控制指标情况如下：

| 项 目      | 2017 年  |       |          |
|----------|---------|-------|----------|
|          | 修正久期（年） | 凸性    | 基点价值（万元） |
| 报告期最高月末值 | 2.62    | 18.93 | 840.46   |
| 报告期最低月末值 | 1.75    | 12.51 | 654.92   |
| 报告期平均月末值 | 2.10    | 15.32 | 746.77   |
| 2017 年年末 | 2.62    | 18.93 | 734.18   |

公司根据债券市场的走势及判断，以及流动性管理需要，灵活调整非权益类证券的配置，2017 年公司整体非权益类证券投资规模呈现稳中有增的趋势。整体组合久期得到控制，各个月末的久期变化幅度不大，相对稳定。2017 年年末的久期为 2.62。2017 年，公司在规模、风险可控的前提下继续开展利率互换、国债期货业务，进一步丰富了利率风险的管理工具。

### 3、 汇率风险

汇率风险是指公司资产或者负债因汇率变动导致损失的可能性。

随着国际化战略目标的实施以及国家金融政策进一步开放，公司境外业务、上海自贸区分公司业务、租赁业务等涉及外币资产或负债的项目逐步增加，因此面临汇率风险的可能性有所增加。公司要求各子公司、业务部门开展与外汇相关的业务时，应对外汇风险予以关注，做到识别风险、管理风险和规避风险。针对所面临的汇率风险敞口，公司积极通过外汇远期对冲、外债续借、资产负债匹配等方式，缓释汇率变化可能对公司产生的冲击，并将其控制在合理的范围内。

期末，本集团所面临的汇率风险主要是境外全资子公司海通国际控股所持有的资产及所承担的负债由于汇率波动而遭受损失的风险。假设其他变量保持不变的前提下，如果人民币对其他外汇币种升值或贬值 5%，本集团净利润将相应变动不超过人民币 3.43 亿元，占当期利润的比例较小。

#### (四) 操作风险管理

操作风险是指由内部流程不完善、员工操作失误及不当行为、信息系统故障缺陷以及外部事件所造成损失的风险。其中，信息技术风险是指因系统中断或者运行缓慢导致信息系统的可用性、完整性丧失的风险，以及信息系统被外部攻击等原因导致信息系统机密性丧失的风险。信息技术风险是目前操作风险的一个重要组成部分，信息技术对于证券交易、清算和服务等多个方面的业务发展和管理至关重要，系统不可靠、网络技术不完善、数据误差都会造成公司的损失。此外，公司还面临因公司或公司工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规和准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的合规风险。

公司坚持不断健全内部控制管理机制，完善操作流程，加强检查稽核，强化问责制度，以降低操作风险发生的可能性、积极应对并妥善处置其不利影响。公司根据中国证监会《证券公司内部控制指引》等监管规定以及公司内部管理需要，制定了较为完善的内部控制制度，确保操作风险管理有制度可依。公司根据《企业内部控制基本规范》要求制定了涵盖各部门各业务条线的内部控制矩阵，每年组织对内部控制矩阵执行情况的自查，公司稽核部门对内部控制矩阵的执行情况进行评估。公司通过建立集团范围内的重大操作风险事件信息沟通机制并加强内部控制管理，不断提升操作风险管理水平。尽管如此，仍不能保证完全避免因操作差错和主观不作为可能引发的操作风险事件及损失。此外，员工发生违法犯罪行为，将会给公司造成财务损失，给公司声誉造成不利影响。公司一直坚持实施精细化管理，不断规范完善业务流程，加强对员工的职业操守和职业道德教育，努力控制和减少操作风险事件的发生。公司持续加强信息技术管理的制度建设和系统建设，不断完善信息技术风险应急预案，并采用定期或不定期的监测、专项检查等多种手段对系统运行情况、应用研发情况、信息安全情况、科技管理情况等方面的信息技术管理情况进行监控和管理，防范信息技术风险。公司不断加强对下属单位、各业务条线及员工的合规管理，提升各项制度、机制及流程的执行力度，以有效防范公司合规风险，推动公司合规管理有效运行，促进公司持续、健康、合规发展。

报告期内，公司未发生重大操作风险事件。

#### (五) 流动性风险管理

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。由于公司自营业务规模及融资类业务规模较大，公司经营过程中易受宏观政策、市场变化、经营状况、客户信用

等因素影响，并可能因资产负债结构不匹配而引发流动性风险。

在日间流动性风险管理方面，公司始终秉承“稳健乃至保守”的风控理念，持续按照前期所确定的流动性风险偏好及风险指标限额的要求，通过合理的监测机制和调控手段，始终将流动性风险敞口控制在合理范围内。为进一步提升对流动性风险的精细化管理的水平，公司严格按照内部相关规定和办法，储备了充足的优质流动性资产，保障了公司业务的顺利展开和到期负债的顺利偿付。此外，公司继续完善日间流动性和风险指标的管控机制，建立了包括年度风险展望分析、月度指标研判预测和日间指标头寸跟进在内的流动性及风险分析框架，丰富了不同期限内流动性风险管理的工具，从更深层次强化了公司对流动性风险的科学管控和预判的效率。

在中长期流动性风险管控方面，公司继续优化资本配置结构，强化对资产负债发展趋势的分析，从源头上强化对公司流动性风险的管控。一方面，公司在融资负债统一归口管理的基础上积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构，保持资产负债期限错配始终处于合理范围；另一方面，公司及时完善负债规划，负债结构和到期日分布更趋合理。报告期内，公司重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持融资渠道畅通。集团层面的负债统一归口管理工作也在逐步推进，大额融资已基本完成集团管控。

报告期内，伴随着监管部门金融去杠杆总体政策的推进，权益、债券均呈现出持续震荡的态势，此外，公司 2017 年有公司债、次级债、收益权转让等在内的多个品种负债需偿付或续作。外部市场的变化与公司资产负债的调整叠加，共同构成了报告期内公司流动性风险压力的主要来源。面对市场环境的变化和公司内部资金需求的转化，公司积极筹划，从多个方面着手，通过事前风险识别、事中风险缓释、事后改进等措施，不断强化对流动性风险的管控。公司核心流动性风险指标均满足监管所设定的预警要求，各期限结构内流动性风险敞口始终保持在合理的范围内，可保证在压力情景下持稳健运营，整体流动性风险可控。

本集团 2017 年末持有的金融负债剩余到期期限情况：

单位：万元

| 项 目                    | 即期            | 3 个月以内       | 3 个月至 1 年    | 1 至 5 年       | 5 年以上        | 合计            | 账面价值          |
|------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|---------------|---------------|
| 短期借款                   |               | 2,583,569.47 | 597,628.35   |               |              | 3,181,197.82  | 3,071,283.00  |
| 应付短期融资券                |               | 1,190,542.80 | 1,837,224.10 |               |              | 3,027,766.90  | 2,942,676.24  |
| 拆入资金                   | -             | 250,233.78   | 315,300.56   | 605,418.61    | 76,389.71    | 1,247,342.66  | 1,181,163.89  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 1,775,492.27  | 107,073.90   | 120,972.40   | 71,240.00     |              | 2,074,778.57  | 2,074,349.92  |
| 卖出回购金融资产款              | 168,463.90    | 1,889,752.75 | 1,251,391.89 | 40,606.56     |              | 3,350,215.10  | 3,304,572.67  |
| 代理买卖证券款                | 8,377,438.84  |              |              |               |              | 8,377,438.84  | 8,377,438.84  |
| 应付款项                   | 509,685.80    | 81,824.09    | 47,135.94    | 5,549.63      |              | 644,195.46    | 644,195.46    |
| 应付债券                   |               | 188,579.40   | 1,851,485.30 | 11,137,997.90 | 1,030,430.40 | 14,208,493.00 | 13,015,826.88 |
| 代理承销证券款                |               |              |              |               |              |               |               |
| 其他负债                   | 253,612.60    | 140,158.81   | 334,182.76   | 548,624.87    | 12,360.90    | 1,288,939.94  | 1,287,960.36  |
| 长期借款                   |               | 151,291.13   | 465,332.56   | 2,824,170.63  |              | 3,440,794.32  | 3,060,915.96  |
| 衍生金融负债                 | 114,978.80    | 41,654.23    | 31,705.70    | 56,137.10     | 105,069.60   | 349,545.43    | 349,545.43    |
| 合 计                    | 11,199,672.21 | 6,624,680.36 | 6,852,359.56 | 15,289,745.30 | 1,224,250.61 | 41,190,708.04 | 39,309,928.65 |

## (六) 声誉风险管理

声誉风险指由公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价的风险。声誉风险与其他金融风险不同，难以直接测算，难以与其他风险分离和进行独立处理。良好的声誉是公司多年发展积累的重要资源，是维护良好的投资者关系、客户关系等诸多重要关系的保证。良好的声誉风险管理对于公司增强竞争优势，提升盈利能力和实现长期战略目标起着不可忽视的作用。

公司面临的声誉风险主要包括公司经营出现问题，影响公司形象和客户信心；公司由于出现合规风险被监管部门采取监管举措或处罚；公司由于媒体的不实报道或负面报道导致声誉受损，直接或间接影响公司品牌形象及业务发展；公司员工未经规定的流程审批，擅自接受媒体采访且内容违反法定信息披露规定；以及可能对公司造成重大负面影响的其他负面声誉突发事件。

对此，公司采取必要的监控和防范措施，以实现声誉风险的有效管理。公司建立声誉风险预警机制，加强舆情监控，负面声誉突发事件发生时第一时间向公司管理层报告，对于严重的负面声誉突发事件，公司总经理办公室根据《海通证券股份有限公司突发事件应对实施办法》以及《海通证券有限公司重大事项报告暂行办法》相关规定，向上级主管部门、监管部门报告，并会同公司相关部门制订沟通策略，统一宣传口径，由公司新闻发言人对外发布信息或对事件作出回应。负面声誉突发事件平息后，相关单位积极采取声誉公关修复措施，对负面声誉突发事件处理过程进行分析报告，并密切关注新问题、新情况，避免舆情出现反复。同时加强与媒体的沟通与联系，通过推广正面形象等多种途径开展公司形象修复工作。公司员工接受媒体采访前，须按照《海通证券股份有限公司宣传信息工作规定》相关要求，通过办公系统发起媒体采访流程，经公司审核同意后方可发表，发表稿件提交总经理办公室备案。

报告期内，公司总体舆论环境健康。针对少数负面新闻报道，公司根据《海通证券股份有限公司宣传信息工作规定》相关要求，有步骤地开展应对措施，有效遏制了负面报道的影响，未发生重大声誉风险事件。

## (七) 风险控制指标监控

公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》的要求编制公司的风险控制指标监管报表，并将净资本等风控指标纳入日常监控范围。对各项影响净资本及风险控制指标的业务、因素进行及时的监测与控制，使其达到合规要求。报告期间，公司的净资本及各项风险控制指标均符合监管要求。报告期末，公司净资本为 752.92 亿元，风险覆盖率 249.31%，资本杠杆率 27.06%，流动性覆盖率 188.90%，净稳定资金率 135.49%，公司整体资产质量较好，资本充足率较高，风险承受力较强，各项风险控制指标均符合监管要求（见下表）。

2017 年末公司主要风控指标与监管标准对照表

| 风控指标              | 2017 年末  | 监管标准      |
|-------------------|----------|-----------|
| 核心净资本 (亿元)        | 681.42   |           |
| 附属净资本 (亿元)        | 71.50    |           |
| 净资本 (亿元)          | 752.92   |           |
| 净资产 (亿元)          | 1,068.59 |           |
| 各项风险资本准备之和 (亿元)   | 302.00   |           |
| 表内外资产总额 (亿元)      | 2,842.52 |           |
| 风险覆盖率             | 249.31%  | 不得低于 100% |
| 资本杠杆率             | 27.06%   | 不得低于 8%   |
| 流动性覆盖率            | 188.90%  | 不得低于 100% |
| 净稳定资金率            | 135.49%  | 不得低于 100% |
| 净资本/净资产           | 70.46%   | 不得低于 20%  |
| 净资本/负债            | 50.16%   | 不得低于 8%   |
| 净资产/负债            | 71.20%   | 不得低于 10%  |
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本  | 30.78%   | 不得高于 100% |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本 | 57.72%   | 不得高于 500% |

公司在进行股利分配、重大投资、开展创新业务等重要事项时，高度重视上述事项对净资本及风险控制指标的影响。在实施上述事项之前，公司对净资本等风险控制指标进行敏感性分析或压力测试，只有在满足净资本等风险控制指标监管要求，公司才实施上述重要事项。

另外，公司每半年针对未来经营计划进行展望，充分考虑经营规模达到最大、市场状况出现负面逆转等条件，对净资本等风险控制指标进行敏感性分析和压力测试，确保未来各项风险控制指标满足监管要求。

报告期内，公司未出现净资本等各项风险控制指标超过监管标准的情况。

(八) 子公司风险管理

为更好地推进公司全面风险管理、整合集团优势，公司加强了对旗下子公司的垂直化风险管理，要求各子公司规范运作、依法经营，通过各项机制将子公司风险管理纳入公司全面风险管理体系。报告期内，公司印发了子公司全面风险管理要求，从人员配备、制度建设、风险限额及监测、内部控制、系统建设、并表监管、风险报告和考核等多方面实现了对子公司风险管理的有效覆盖，公司首席风险官对子公司风险管理工作负责人进行考核，考核权重不低于 50%。公司进一步完善了子公司风险管理沟通协调机制，配专人专岗负责境内外子公司风险管理的日常沟通和报告事宜，

下发了匹配各子公司业务特点的风险限额体系和风险管理信息报告模板，定期跟踪并汇总子公司风控指标运行情况，明确了重大风险事件标准，建立了子公司重大风险事件库，定期跟踪重大风险事件处置进展，确保经理层及时、充分了解子公司风险状况。报告期内，各子公司的经营管理工作均顺利开展，经营风险可防可控。

## 十五、 母公司财务报表主要项目注释

### (一) 长期股权投资

#### 1、 长期股权投资分类如下

| 项目   | 期末余额              |      |                   | 年初余额              |      |                   |
|------|-------------------|------|-------------------|-------------------|------|-------------------|
|      | 账面余额              | 减值准备 | 账面价值              | 账面余额              | 减值准备 | 账面价值              |
| 子公司  | 26,022,222,341.36 |      | 26,022,222,341.36 | 25,266,156,277.61 |      | 25,266,156,277.61 |
| 联营企业 | 790,026,915.98    |      | 790,026,915.98    | 681,741,315.14    |      | 681,741,315.14    |
| 合计   | 26,812,249,257.34 |      | 26,812,249,257.34 | 25,947,897,592.75 |      | 25,947,897,592.75 |

## 2、对子公司投资

| 被投资单位          | 初始投资成本            | 年初余额              | 本期增加           | 本期减少 | 期末余额              | 本期计提减值准备 | 减值准备期末余额 |
|----------------|-------------------|-------------------|----------------|------|-------------------|----------|----------|
| 海富通基金管理有限公司    | 76,500,000.00     | 76,500,000.00     |                |      | 76,500,000.00     |          |          |
| 海富产业投资基金管理有限公司 | 63,650,000.00     | 63,650,000.00     |                |      | 63,650,000.00     |          |          |
| 海通期货股份有限公司     | 1,369,191,777.61  | 1,369,191,777.61  |                |      | 1,369,191,777.61  |          |          |
| 海通国际控股有限公司     | 7,406,814,500.00  | 7,406,814,500.00  |                |      | 7,406,814,500.00  |          |          |
| 海通开元投资有限公司     | 10,650,000,000.00 | 10,650,000,000.00 |                |      | 10,650,000,000.00 |          |          |
| 海通创新证券投资有限公司   | 3,500,000,000.00  | 3,500,000,000.00  |                |      | 3,500,000,000.00  |          |          |
| 上海海通资产管理有限公司   | 2,200,000,000.00  | 2,200,000,000.00  |                |      | 2,200,000,000.00  |          |          |
| 上海惟泰置业管理有限公司   | 756,066,063.75    |                   | 756,066,063.75 |      | 756,066,063.75    |          |          |
| 合计             | 26,022,222,341.36 | 25,266,156,277.61 | 756,066,063.75 |      | 26,022,222,341.36 |          |          |

## 3、对联营、合营企业投资

| 被投资单位      | 年初余额           | 本期增、减变动 |      |                |               |            |                |        |    | 期末余额           | 减值准备期末余额 |
|------------|----------------|---------|------|----------------|---------------|------------|----------------|--------|----|----------------|----------|
|            |                | 追加投资    | 减少投资 | 权益法下确认的投资收益    | 其他综合收益调整      | 公司享有其他权益变动 | 公司享有的现金股利或利润   | 计提减值准备 | 其他 |                |          |
| 一、合营企业     |                |         |      |                |               |            |                |        |    |                |          |
| 二、联营企业     |                |         |      |                |               |            |                |        |    |                |          |
| 富国基金管理有限公司 | 681,741,315.14 |         |      | 201,664,118.94 | -1,721,018.10 |            | -91,657,500.00 |        |    | 790,026,915.98 |          |
| 合计         | 681,741,315.14 |         |      | 201,664,118.94 | -1,721,018.10 |            | -91,657,500.00 |        |    | 790,026,915.98 |          |

## 4、公司无向投资企业转移资金能力受到限制的情况。

(二) 手续费及佣金净收入

1、 手续费及佣金净收入按类别列示

| 项 目         | 本期金额             | 上期金额             |
|-------------|------------------|------------------|
| 手续费及佣金收入    | 6,879,451,989.11 | 8,876,297,805.84 |
| 1.经纪业务收入    | 4,408,838,418.16 | 5,873,497,205.34 |
| 其中：证券经纪业务收入 | 4,408,838,418.16 | 5,873,497,205.34 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 3,767,124,316.00 | 5,095,227,929.27 |
| 交易单元席位租赁    | 587,630,731.09   | 680,081,526.49   |
| 代销金融产品业务    | 54,083,371.07    | 98,187,749.58    |
| 2.投资银行业务收入  | 2,269,073,600.42 | 2,379,961,076.20 |
| 其中：证券承销业务   | 1,918,835,603.92 | 2,062,198,243.81 |
| 保荐服务业务      | 51,119,757.08    | 42,912,200.75    |
| 财务顾问业务      | 299,118,239.42   | 274,850,631.64   |
| 3.投资咨询业务收入  | 201,539,970.53   | 622,839,524.30   |
| 4.资产管理业务收入  |                  |                  |
| 手续费及佣金支出    | 1,358,814,415.07 | 1,431,268,440.91 |
| 1.经纪业务支出    | 1,183,469,449.67 | 1,383,738,395.88 |
| 其中：证券经纪业务支出 | 1,183,469,449.67 | 1,383,738,395.88 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 1,183,469,449.67 | 1,383,738,395.88 |
| 交易单元席位租赁    |                  |                  |
| 代销金融产品业务    |                  |                  |
| 2.投资银行业务支出  | 175,344,965.40   | 47,530,045.03    |
| 其中：证券承销业务   | 90,011,922.55    | 32,926,271.39    |
| 保荐服务业务      |                  |                  |
| 财务顾问业务      | 85,333,042.85    | 14,603,773.64    |
| 3.投资咨询业务支出  |                  |                  |
| 手续费及佣金净收入   | 5,520,637,574.04 | 7,445,029,364.93 |

2、 财务顾问业务净收入按类别列示

| 项 目                  | 本期发生额          | 上期发生额          |
|----------------------|----------------|----------------|
| 并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司 | 171,644,686.29 | 134,843,396.21 |
| 并购重组财务顾问业务净收入-其他     |                | 766,037.74     |
| 其他财务顾问业务净收入          | 42,140,510.28  | 124,637,424.05 |
| 合 计                  | 213,785,196.57 | 260,246,858.00 |

### 3、 代理销售金融产品业务收入情况

| 代理销售金融产品业务 | 本期                 |               | 上期                 |               |
|------------|--------------------|---------------|--------------------|---------------|
|            | 销售总金额              | 销售总收入         | 销售总金额              | 销售总收入         |
| 基金         | 21,728,129,188.59  | 50,611,595.38 | 16,635,465,242.89  | 85,657,160.36 |
| 证券公司理财产品   | 223,121,875,734.58 | 2,481,949.22  | 261,846,840,042.93 | 11,506,948.74 |
| 其他         | 68,726,082,000.00  | 989,826.47    | 71,209,259,000.00  | 1,023,640.48  |
| 合计         | 313,576,086,923.17 | 54,083,371.07 | 349,691,564,285.82 | 98,187,749.58 |

### (三) 投资收益

#### 1、 投资收益按类别列示

| 项目                      | 本期金额             | 上期金额              |
|-------------------------|------------------|-------------------|
| 成本法核算的长期股权投资收益          | 876,338,514.19   | 59,820,864.48     |
| 权益法核算的长期股权投资收益          | 201,664,118.94   | 208,841,073.22    |
| 金融工具投资收益                | 2,786,509,328.08 | 1,933,632,638.09  |
| 其中：持有期间取得的收益            | 2,826,278,643.09 | 3,302,631,471.90  |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 2,534,104,823.11 | 2,781,609,458.55  |
| -可供出售金融资产               | 292,173,819.98   | 521,022,013.35    |
| 处置金融工具取得的收益             | -39,769,315.01   | -1,368,998,833.81 |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | -372,833,758.00  | -1,488,030,334.00 |
| -可供出售金融资产               | 209,206,955.90   | 216,503,283.12    |
| -衍生金融工具                 | 218,306,097.54   | 444,530,514.50    |
| -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | -94,448,610.45   | -542,002,297.43   |
| 应收款项类投资的投资收益            | 166,290,646.76   | 261,571,923.15    |
| 其他                      | 26,193,396.23    | -8,116,339.78     |
| 合计                      | 4,056,996,004.20 | 2,455,750,159.16  |

#### 2、 按成本法核算的长期股权投资收益前五名情况

| 被投资单位          | 本期金额           | 上期金额          | 本期比上期增减变动的原因 |
|----------------|----------------|---------------|--------------|
| 海通开元投资有限公司     | 600,000,000.00 |               | 被投资单位分红发生变动  |
| 海通期货股份有限公司     | 161,462,800.00 |               | 被投资单位分红发生变动  |
| 上海海通证券资产管理公司   | 50,000,000.00  |               | 被投资单位分红发生变动  |
| 海富产业投资基金管理有限公司 | 46,900,000.00  | 32,763,000.00 | 被投资单位分红发生变动  |

| 被投资单位       | 本期金额           | 上期金额          | 本期比上期增减变动的原因 |
|-------------|----------------|---------------|--------------|
| 海富通基金管理有限公司 | 17,975,714.19  | 27,057,864.48 | 被投资单位分红发生变动  |
| 合 计         | 876,338,514.19 | 59,820,864.48 |              |

### 3、 按权益法核算的长期股权投资收益

| 被投资单位      | 本期金额           | 上期金额           | 本期比上期增减变动的原因 |
|------------|----------------|----------------|--------------|
| 富国基金管理有限公司 | 201,664,118.94 | 208,841,073.22 | 被投资单位净利润发生变动 |
| 合 计        | 201,664,118.94 | 208,841,073.22 |              |

4、 投资收益本期发生额比上期发生额增加 16.01 亿元，上升 65.20%，主要为子公司分红和处置金融工具产生的投资收益增加。

#### (四) 现金流量表补充资料

| 项 目  | 本期金额              | 上期金额              |
|--|-------------------|-------------------|
| 1、将净利润调节为经营活动现金流量                          |                   |                   |
| 净利润  | 6,187,564,013.18  | 5,724,675,393.85  |
| 加：资产减值准备                                   | 289,052,846.02    | 12,929,067.97     |
| 固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧                    | 172,904,549.61    | 157,868,577.11    |
| 无形资产摊销                                     | 54,529,847.76     | 46,225,298.15     |
| 长期待摊费用摊销                                   | 39,948,077.38     | 43,101,300.77     |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失<br>(收益以“－”号填列)       | 909,696.07        | 2,171,000.36      |
| 固定资产报废损失 (收益以“－”号填列)                       |                   |                   |
| 公允价值变动损失 (收益以“－”号填列)                       | -141,669,042.93   | 310,812,964.46    |
| 利息支出                                       | 4,724,753,798.62  | 4,654,885,854.62  |
| 汇兑损失 (收益以“－”号填列)                           | 104,967,981.77    | -130,518,189.18   |
| 投资损失 (收益以“－”号填列)                           | -1,745,674,055.76 | -1,259,642,817.54 |
| 递延所得税资产减少 (增加以“－”号填列)                      | -89,082,836.24    | 130,459,437.10    |
| 递延所得税负债增加 (减少以“－”号填列)                      | 105,131,860.62    | -177,786,857.02   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产<br>等的减少 (增加以“－”号填列) | -4,963,043,472.07 | 16,665,704,614.86 |
| 经营性应收项目的减少 (增加以“－”号填列)                     | -                 | 18,499,121,497.09 |
|  | 26,769,245,171.03 |                   |

| 项 目                   | 本期金额                   | 上期金额               |
|-----------------------|------------------------|--------------------|
| 经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列） | -<br>18,714,439,685.91 | -82,869,168,271.94 |
| 其他                    |                        |                    |
| 经营活动产生的现金流量净额         | -<br>40,743,391,592.91 | -38,189,161,129.34 |
| 2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动   |                        |                    |
| 债务转为资本                |                        |                    |
| 一年内到期的可转换公司债券         |                        |                    |
| 融资租入固定资产              |                        |                    |
| 3、现金及现金等价物净变动情况       |                        |                    |
| 现金的期末余额               | 68,246,603,552.28      | 89,372,289,075.93  |
| 减：现金的年初余额             | 89,372,289,075.93      | 133,670,394,739.10 |
| 加：现金等价物的期末余额          |                        |                    |
| 减：现金等价物的年初余额          |                        |                    |
| 现金及现金等价物净增加额          | -<br>21,125,685,523.65 | -44,298,105,663.17 |

## 十六、补充资料

### (一) 当期非经常性损益明细表

| 项 目  | 金额             | 说明 |
|--|----------------|----|
| 非流动资产处置损益  | -9,111,469.61  |    |
| 越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免                                 |                |    |
| 计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）        | 648,512,045.00 |    |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费                                |                |    |
| 企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益 |                |    |
| 非货币性资产交换损益   |                |    |
| 委托他人投资或管理资产的损益                                       |                |    |
| 因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备                          |                |    |
| 债务重组损益   |                |    |
| 企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等                                |                |    |

| 项 目   | 金 额            | 说 明 |
|---|----------------|-----|
| 交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益   |                |     |
| 同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益   |                |     |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益   | -560,541.57    |     |
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益 |                | 注   |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回   |                |     |
| 对外委托贷款取得的损益   |                |     |
| 采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益  |                |     |
| 根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响  |                |     |
| 受托经营取得的托管费收入  |                |     |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出  | -43,309,881.60 |     |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目   |                |     |
| 所得税影响额  | -72,036,493.26 |     |
| 少数股东权益影响额（税后）   | -877,137.78    |     |
| 合 计   | 522,616,521.18 |     |

注：公司持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益不作为非经常性损益披露的原因：公司作为证券经营机构，上述业务均属于公司正常经营业务。

公司 2017 年持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益明细：

| 项 目                               | 涉 及 金 额         |
|-----------------------------------|-----------------|
| 持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产产生的公允价值变动 | -238,839,784.46 |

| 项 目                                 | 涉及金额              |
|-------------------------------------|-------------------|
| 损益                                  |                   |
| 持有衍生工具产生的公允价值变动损益                   | -1,007,083,460.72 |
| 持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债产生的公允价值变动损益 | -83,487,621.42    |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得的投资收益     | 2,736,957,317.48  |
| 处置衍生工具取得的投资收益                       | -16,247,467.25    |
| 处置可供出售金融资产取得的投资收益                   | 2,524,774,050.82  |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债取得的投资收益     | -230,036,156.39   |
| 合 计                                 | 3,686,036,878.06  |

(二) 境内外会计准则下会计数据差异

公司按照中国会计准则编制的合并财务报表及按照国际财务报告准则编制的合并财务报表中列示的 2017 年及 2016 年的净利润和于 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的净资产并无差异。

(三) 净资产收益率及每股收益

| 报告期利润                   | 加权平均净资产<br>收益率(%) | 每股收益 (元) |        |
|-------------------------|-------------------|----------|--------|
|                         |                   | 基本每股收益   | 稀释每股收益 |
| 归属于公司普通股股东的净利润          | 7.56              | 0.75     | 0.74   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 7.11              | 0.70     | 0.69   |

1、 计算过程

上述数据采用以下计算公式计算而得：

加权平均净资产收益率

$$\text{加权平均净资产收益率} = P_0 / (E_0 + NP \div 2 + E_i \times M_i \div M_0 - E_j \times M_j \div M_0 \pm E_k \times M_k \div M_0)$$

其中：P<sub>0</sub> 分别对应于归属于公司普通股股东的净利润、扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润；NP 为归属于公司普通股股东的净利润；E<sub>0</sub> 为归属于公司普通股股东的期初净资产；E<sub>i</sub> 为报告期发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产；E<sub>j</sub> 为报告期回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产；M<sub>0</sub> 为报告期月份数；M<sub>i</sub> 为新增净资产次月起至报告期期末的累计月数；M<sub>j</sub> 为减少净资产次月起至报告期期末的累计月数；E<sub>k</sub> 为因其他交易或事项引起的、归属于公司普通股股东的净资产增减变动；M<sub>k</sub> 为发生其他净资产增减变动次月起至报告期期末的累计月数。

### 基本每股收益

$$\text{基本每股收益} = P0 \div S$$

$$S = S0 + S1 + Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk$$

其中：P0 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于普通股股东的净利润；S 为发行在外的普通股加权平均数；S0 为期初股份总数；S1 为报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数；Si 为报告期因发行新股或债转股等增加股份数；Sj 为报告期因回购等减少股份数；Sk 为报告期缩股数；M0 报告期月份数；Mi 为增加股份次月起至报告期期末的累计月数；Mj 为减少股份次月起至报告期期末的累计月数。

### 稀释每股收益

$$\text{稀释每股收益} = P1 / (S0 + S1 + Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk + \text{认股权证、股份期权、可转换债券等增加的普通股加权平均数})$$

其中，P1 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润，并考虑稀释性潜在普通股对其影响，按《企业会计准则》及有关规定进行调整。公司在计算稀释每股收益时，应考虑所有稀释性潜在普通股对归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润和加权平均股数的影响，按照其稀释程度从大到小的顺序计入稀释每股收益，直至稀释每股收益达到最小值。

- 2、 资产负债表日至财务报告批准报出日之间，公司发行在外普通股或潜在普通股股数未发生重大变化。

## 十七、 财务报表的批准报出

本财务报表业经公司董事会于 2018 年 3 月 27 日批准报出。

## 第十二节 备查文件目录

|        |  |
|--------|--|
| 备查文件目录 | 载有本公司法定代表人签名的年度报告文本。                     |
| 备查文件目录 | 载有本公司法定代表人、主管会计工作负责人兼会计机构负责人签名盖章的财务报告文本。 |
| 备查文件目录 | 载有会计师事务所盖章、注册会计师签名盖章的审计报告文本。             |
| 备查文件目录 | 报告期内中国证监会指定报纸上公开披露过的所有公司文件的正本及公告原稿。      |
| 备查文件目录 | 在其它证券市场公布的年度报告。                          |
| 备查文件目录 | 其他有关资料。                                  |

董事长：周杰

董事会批准报送日期：2018 年 3 月 27 日

### 修订信息

适用 不适用

## 第十三节 证券公司信息披露

### 一、公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

#### (一) 报告期内营业部行政许可情况

| 营业部新设 | 分公司迁址 | 营业部迁址 |
|-------|-------|-------|
| 0     | 2     | 17    |

#### 1、报告期内分公司迁址行政许可情况

| 序号 | 迁址前分公司名称         | 迁址后分公司名称         | 新址                           | 获得许可证日期         |
|----|------------------|------------------|------------------------------|-----------------|
| 1  | 海通证券股份有限公司黑龙江分公司 | 海通证券股份有限公司黑龙江分公司 | 哈尔滨市南岗区中山路 111 号齐鲁国际大酒店 10 层 | 2017 年 3 月 13 日 |
| 2  | 海通证券股份有限公司山东分公司  | 海通证券股份有限公司山东分公司  | 山东省济南市市中区舜耕路 28 号舜华园 D 楼二层   | 2017 年 3 月 30 日 |

#### 2、报告期内营业部迁址行政许可情况

| 序号 | 迁址前营业部名称                | 迁址后营业部名称                | 新址                                    | 获得许可证日期         |
|----|-------------------------|-------------------------|---------------------------------------|-----------------|
| 1  | 海通证券股份有限公司萍乡公园中路证券营业部   | 海通证券股份有限公司萍乡楚萍东路证券营业部   | 江西省萍乡市安源区楚萍东路 98 号综合楼 1、27 楼          | 2017 年 1 月 4 日  |
| 2  | 海通证券股份有限公司盘锦人民路证券营业部    | 海通证券股份有限公司盘锦双兴路证券营业部    | 辽宁省盘锦市兴隆台区双兴南路 177 号                  | 2017 年 1 月 5 日  |
| 3  | 海通证券股份有限公司深圳深南大道证券营业部   | 海通证券股份有限公司深圳深南大道证券营业部   | 深圳市南山区深南大道 9030 号世纪假日广场 A 座 2912-2915 | 2017 年 1 月 11 日 |
| 4  | 海通证券股份有限公司哈尔滨果戈里大街证券营业部 | 海通证券股份有限公司哈尔滨果戈里大街证券营业部 | 哈尔滨市南岗区果戈里大街 278 号 3-4 层              | 2017 年 2 月 13 日 |
| 5  | 海通证券股份有限公司深圳望海路证券营业部    | 海通证券股份有限公司深圳梅林路证券营业部    | 深圳市福田区梅林街道梅林路卓越梅林中心广场南区 2 期 A 栋       | 2017 年 3 月 3 日  |
| 6  | 海通证券股份有限公司常德朗州路证券营业部    | 海通证券股份有限公司常德朗州路证券营业部    | 湖南省常德市武陵区穿紫河街道办事处滨湖社区朗州路 619 号 1      | 2017 年 3 月 31 日 |
| 7  | 海通证券股份有限公司成县东大街证券营业部    | 海通证券股份有限公司成县东滨河中路证券营业部  | 甘肃省陇南市成县东滨河中路观水丽景商住楼 3 单元 3 楼 21 号    | 2017 年 4 月 26 日 |
| 8  | 海通证券股份有限公司弥勒冉翁路证券营业部    | 海通证券股份有限公司弥勒冉翁路证券营业部    | 云南省红河州弥勒市冉翁西路一心小区商铺                   | 2017 年 5 月 5 日  |
| 9  | 海通证券股份有限公司上海桂林路证券营业部    | 海通证券股份有限公司上海徐汇区柳州路证券营业部 | 上海市徐汇区柳州路 138 号 109、703-2、704 室       | 2017 年 5 月 16 日 |
| 10 | 海通证券股份有限公司自贡丹桂大街证券营业部   | 海通证券股份有限公司自贡丹桂街证券营业部    | 四川省自贡市自流井区丹桂街 80 号泰丰商业会展中心 4 层 407    | 2017 年 7 月 14 日 |
| 11 | 海通证券股份有限公司晋宁昆阳街证券营业部    | 海通证券股份有限公司昆明红锦路证券营业部    | 云南省昆明市五华区江东安康园 26 幢 1 单元 101 号        | 2017 年 7 月 20 日 |

|    |                       |                       |                                    |                  |
|----|-----------------------|-----------------------|------------------------------------|------------------|
| 12 | 海通证券股份有限公司东营东三路证券营业部  | 海通证券股份有限公司东营北一路证券营业部  | 山东省东营市东营区北一路 730 号 E-106           | 2017 年 7 月 26 日  |
| 13 | 海通证券股份有限公司宁波百丈东路证券营业部 | 海通证券股份有限公司宁波中山东路证券营业部 | 浙江省宁波市鄞州区中山东路 922 号 (2-1) 室        | 2017 年 8 月 1 日   |
| 14 | 海通证券股份有限公司邵阳戴家路证券营业部  | 海通证券股份有限公司邵阳敏州路证券营业部  | 邵阳市大祥区敏州东路邵阳市粮食局 2 楼               | 2017 年 8 月 30 日  |
| 15 | 海通证券股份有限公司大同永宁街证券营业部  | 海通证券股份有限公司大同向阳街证券营业部  | 大同市城区向阳西街 14 号                     | 2017 年 10 月 13 日 |
| 16 | 海通证券股份有限公司义乌丹溪北路证券营业部 | 海通证券股份有限公司义乌宾王路证券营业部  | 浙江省义乌市稠城街道宾王路 226 号 1-3 层          | 2017 年 11 月 6 日  |
| 17 | 海通证券股份有限公司金寨红军大道证券营业部 | 海通证券股份有限公司六安球拍东路证券营业部 | 六安市金安区球拍东路万达广场室外步行街 S2-1022、2022 铺 | 2017 年 12 月 21 日 |

(二) 董事、监事、高管任职行政许可事项

| 序号 | 时间          | 内容   |
|----|-------------|--|
| 1  | 2017 年 3 月  | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准林家礼证券公司独立董事任职资格的批复》(沪证监许可[2017]30 号), 核准林家礼先生证券公司独立董事任职资格。           |
| 2  | 2017 年 3 月  | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准姜诚君证券公司经理层高级管理人员任职资格的批复》(沪证监许可[2017]33 号), 核准姜诚君先生证券公司经理层高级管理人员任职资格。 |
| 3  | 2017 年 5 月  | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准杜洪波证券公司经理层高级管理人员任职资格的批复》(沪证监许可[2017]41 号), 核准杜洪波先生证券公司经理层高级管理人员任职资格。 |
| 4  | 2017 年 5 月  | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准潘光韬证券公司经理层高级管理人员任职资格的批复》(沪证监许可[2017]42 号), 核准潘光韬先生证券公司经理层高级管理人员任职资格。 |
| 5  | 2017 年 8 月  | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准郭跃舟证券公司董事任职资格的批复》(沪证监许可[2017]73 号), 核准郭跃舟先生证券公司董事任职资格。               |
| 6  | 2017 年 12 月 | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准吴红伟证券公司监事任职资格的批复》(沪证监许可[2017]104 号), 核准吴红伟先生证券公司监事任职资格。              |
| 7  | 2017 年 12 月 | 中国证监会上海监管局向本公司下发了《关于核准芮政先证券公司监事任职资格的批复》(沪证监许可[2017]103 号), 核准芮政先先生证券公司监事任职资格。              |

(三) 其他行政许可事项

| 日期             | 业务资格        | 批复单位     | 批文名称        | 批文号 |
|----------------|-------------|----------|-------------|-----|
| 2017 年 1 月 1 日 | 内部资料性出版物准印证 | 上海市新闻出版局 | 准印证号(K)0772 | 无   |

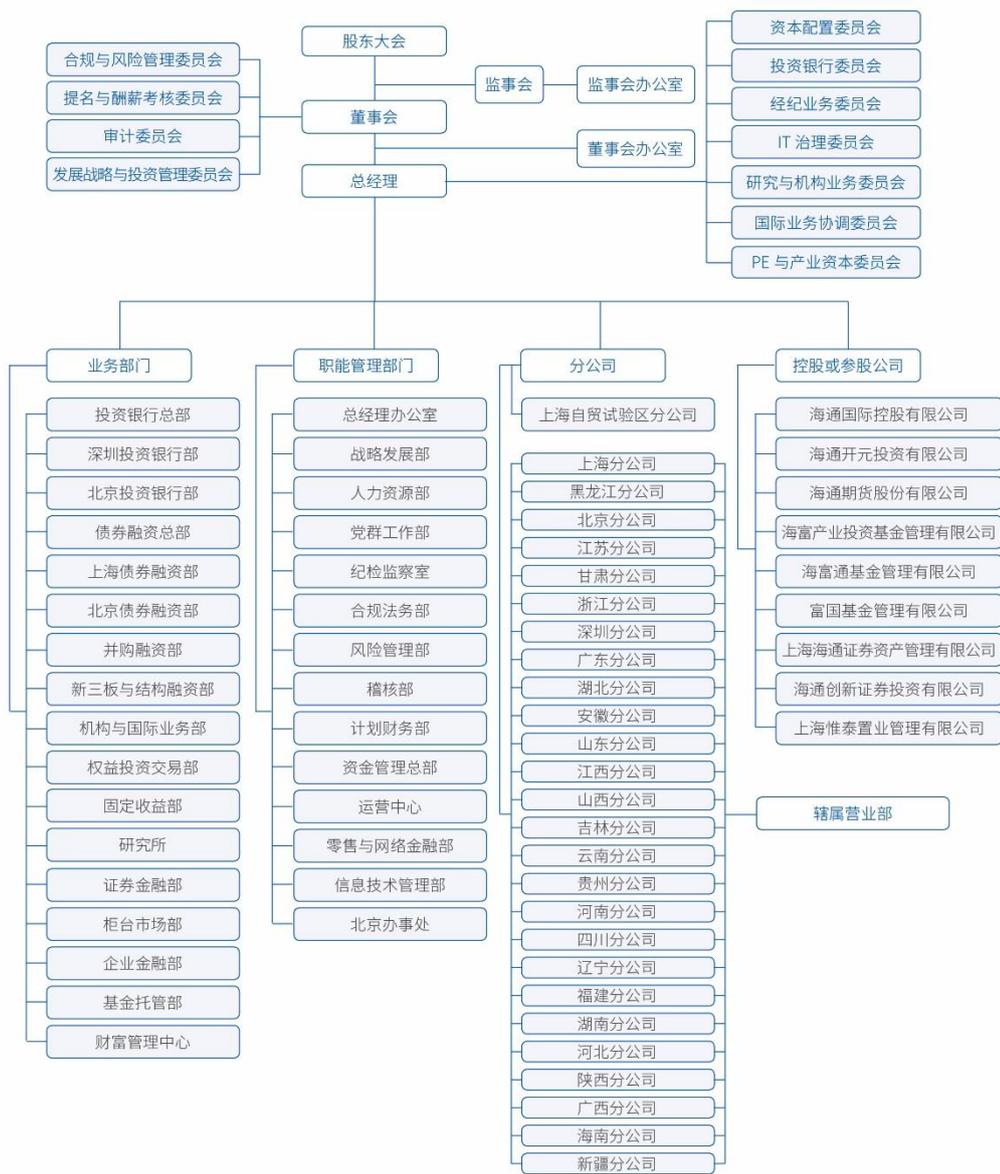
|                 |                   |                |  |   |
|-----------------|-------------------|----------------|--|---|
| 2017 年 5 月 25 日 | 无线电台执照            | 上海市无线电管理局      | 执照编号:310020020183/E0001<br>网络编号:AM-844-006 | 无 |
| 2017 年 9 月 1 日  | 深交所网络版增强行情经营许可证   | 深交所            | 经营许可证号:SZP2017-047(有效期)                    | 无 |
| 2017 年 9 月 11 日 | 95553 电信网码号资源使用证书 | 中华人民共和国工业和信息化部 | 号[2017]00125-A02/号<br>[2017]00550-A01      | 无 |

## 二、 监管部门对公司的分类结果

适用 不适用

2017 年，公司在证券公司分类评价中获 A 类 AA 级。

报告附录一：海通证券股份有限公司组织结构图



## 报告附录二

## 分公司一览表

| 序号 | 分公司        | 地址  | 设立时间   | 负责人 |
|----|------------|---|--------|-----|
| 1  | 上海分公司      | 上海市徐汇区建国西路 285 号 19、20 楼                        | 2009 年 | 曹雪松 |
| 2  | 浙江分公司      | 浙江省杭州市上城区解放路 138 号 B 部裙楼四楼                      | 2009 年 | 金晓阳 |
| 3  | 江苏分公司      | 江苏省南京市广州路 188 号                                 | 2009 年 | 赵建祥 |
| 4  | 深圳分公司      | 深圳市福田区福华三路 88 号时代财富大厦 49 楼 B、C、D、E 室            | 2009 年 | 吴国华 |
| 5  | 广东分公司      | 广州市天河区珠江西路 8 号 9 楼 901-902 房                    | 2009 年 | 蔡昭鹏 |
| 6  | 北京分公司      | 北京市海淀区中关村南大街甲 56 号方圆大厦六层 601 室                  | 2009 年 | 李建生 |
| 7  | 黑龙江分公司     | 哈尔滨市南岗区中山路 111 号齐鲁国际大酒店 10 层                    | 2009 年 | 胡海斌 |
| 8  | 甘肃分公司      | 甘肃省兰州市城关区武都路 157 号综合楼第 10 层                     | 2009 年 | 韩钢  |
| 9  | 湖北分公司      | 湖北省武汉市江岸区二七街赵家条 144 号                           | 2009 年 | 王宋  |
| 10 | 安徽分公司      | 安徽省合肥市包河区黄山路与宿松路交口兴都大厦六楼                        | 2009 年 | 孙伟  |
| 11 | 吉林分公司      | 长春市南关区兴兰小区 4 号楼（大经路 550 号）                      | 2011 年 | 孟庆录 |
| 12 | 江西分公司      | 江西省南昌市红谷滩新区绿茵路 129 号联发广场写字楼 4504、4505、4506 室    | 2011 年 | 肖萍萍 |
| 13 | 山西分公司      | 太原市杏花岭区新建路 92 号                                 | 2011 年 | 王刚  |
| 14 | 云南分公司      | 云南省昆明市东风西路 162 号                                | 2011 年 | 张崇德 |
| 15 | 贵州分公司      | 贵州省贵阳市云岩区富水北路天恒城市花园天恒大厦南北楼北座 12-14 层 1 号        | 2011 年 | 钟健  |
| 16 | 河南分公司      | 河南省郑州市金水区经七路 16 号海通证券大楼 6 楼                     | 2011 年 | 孙晓东 |
| 17 | 山东分公司      | 山东省济南市市中区舜耕路 28 号舜华园 D 楼二层                      | 2011 年 | 林鹏  |
| 18 | 四川分公司      | 成都市青羊区小河街 12 号                                  | 2011 年 | 刘宏志 |
| 19 | 辽宁分公司      | 辽宁省沈阳市大西路 364 号                                 | 2011 年 | 张龙  |
| 20 | 福建分公司      | 福建省福州市台江区茶亭街道群众路 278 号日月星花园（现源利公寓）1#楼 3 层 01 商场 | 2011 年 | 林毓鹏 |
| 21 | 广西分公司      | 广西南宁市兴宁区民主路 18 号邕州饭店 3 号楼二楼                     | 2012 年 | 卢向阳 |
| 22 | 湖南分公司      | 长沙市芙蓉区五一大道 618 号银华大酒店 6 楼                       | 2012 年 | 宋家清 |
| 23 | 陕西分公司      | 西安市西新街 11 号海星智能广场 10 层西区                        | 2012 年 | 孟立亚 |
| 24 | 河北分公司      | 石家庄市桥西区师范街 2 号                                  | 2012 年 | 刘涛  |
| 25 | 海南分公司      | 海口市龙昆北路 15 号中航大厦                                | 2014 年 | 邢维畅 |
| 26 | 新疆分公司      | 新疆乌鲁木齐高新技术产业开发区（新市区）新医路 359 号                   | 2014 年 | 林海  |
| 27 | 上海自贸试验区分公司 | 中国（上海）自由贸易试验区基隆路 6 号 14 楼 1401 室                | 2014 年 | 许莉  |

证券营业部一览表

| 序号 | 营业部名称          | 地址  | 负责人 |
|----|----------------|---|-----|
| 1  | 安庆湖心北路证券营业部    | 安徽省安庆市开发区湖心北路西侧香樟里·那水岸 7 幢 1-2 室                | 汪怀其 |
| 2  | 蚌埠中荣街证券营业部     | 安徽省蚌埠市中荣街 146 号天源大厦                             | 王凌巍 |
| 3  | 亳州希夷大道证券营业部    | 亳州希夷大道 442 号                                    | 侯运动 |
| 4  | 滁州天长东路证券营业部    | 安徽省滁州市天长东路 549 号                                | 万浩  |
| 5  | 阜阳清河东路证券营业部    | 安徽省阜阳市颍州区清河东路颐清园 1 号楼                           | 吴侃  |
| 6  | 合肥黄山路证券营业部     | 安徽省合肥市包河区黄山路 262 号兴都大厦 4 楼                      | 陈洁  |
| 7  | 淮北相山路证券营业部     | 淮北市相山路 122 号惠园小区 1017-1018, 2014-2018           | 黄保宏 |
| 8  | 淮南洞山中路证券营业部    | 淮南市田家庵区洞山街道中兴社区中建四局第六建筑工程有限公司办公楼                | 赵陟峰 |
| 9  | 金寨红军大道证券营业部    | 安徽省六安市金寨县梅山镇红军大道                                | 曲乐  |
| 10 | 马鞍山湖东中路证券营业部   | 安徽省马鞍山市花山区湖东中路中央花园 9-302                        | 王尚钟 |
| 11 | 铜陵长江中路证券营业部    | 安徽省铜陵市铜官山区长江中路 1112 号 203 室                     | 李涛  |
| 12 | 芜湖文化路证券营业部     | 安徽省芜湖市文化路 44 号                                  | 夏斯清 |
| 13 | 宿州汴河路证券营业部     | 安徽省宿州市埇桥区汴河路中央广场西门二楼                            | 倪士旭 |
| 14 | 宣城敬亭路证券营业部     | 安徽省宣城市敬亭路 299 号                                 | 张海波 |
| 15 | 合肥翡翠路证券营业部     | 安徽省合肥市经济技术开发区石门路 2666 号中环城 E2 地块商业 1 幢 301 号    | 陈可  |
| 16 | 北京光华路证券营业部     | 北京市朝阳区光华路甲 8 号和乔大厦 C 座 3 层 302                  | 白汝斌 |
| 17 | 北京工人体育场北路证券营业部 | 北京市东城区工人体育场北路 66 号一号楼三层 301、302A 单元             | 马晖  |
| 18 | 北京中关村南大街证券营业部  | 北京市海淀区中关村南大街甲 56 号                              | 刘毅  |
| 19 | 北京知春路证券营业部     | 北京海淀区知春路甲 63 号卫星大厦五层                            | 王宋  |
| 20 | 北京平谷金乡路证券营业部   | 北京市平谷区金乡路营业部 1 号 1 层、3 层                        | 熊军  |
| 21 | 北京密云鼓楼东大街证券营业部 | 北京市密云县鼓楼东大街 19 号-7 东侧门                          | 郭冉  |
| 22 | 北京阜外大街证券营业部    | 北京市西城区阜成门外大街 2 号 A2010                          | 孟秀娟 |
| 23 | 北京亮马桥路证券营业部    | 北京市朝阳区亮马桥路 50 号 1 号楼 S109A                      | 林鹤  |
| 24 | 福安阳头广场北路证券营业部  | 福建省福安市城区阳头广场北路 6 号水岸明珠 1 幢 5 层 B05 写字楼          | 汤永彬 |
| 25 | 福州群众路证券营业部     | 福建省福州市台江区茶亭街道群众路 278 号日月星花园（现源利公寓）1#楼 3 层 01 商场 | 翁航  |
| 26 | 泉州田安路证券营业部     | 福建省泉州市田安路青年大厦 4 楼                               | 朱承凯 |
| 27 | 厦门乐海北里证券营业部    | 福建省厦门市集美区乐海北里 98 号-103 号                        | 刘雁翔 |
| 28 | 三明列东街证券营业部     | 福建省三明市梅列区牡丹新村 11 幢十七层 1701、1703 号               | 管娜  |
| 29 | 福清清昌大道证券营业部    | 福建省福州市福清市清昌大道万达广场 A2 写字楼 1206 室                 | 薛立  |
| 30 | 龙岩龙腾中路证券营业部    | 福建省龙岩市新罗区西陂镇龙腾中路 488 号（城市中心花园三期）56-61 幢 2 层 03  | 苏伟建 |

|    |               |   |     |
|----|---------------|---|-----|
| 31 | 成县东大街证券营业部    | 甘肃省陇南市成县城关镇东大街 34 号                     | 郝续鸣 |
| 32 | 嘉峪关新华中路证券营业部  | 甘肃省嘉峪关市新华中路 28 号                        | 王保林 |
| 33 | 金昌长春路证券营业部    | 金昌市长春路中国盐政大厦                            | 周有学 |
| 34 | 兰州东岗东路证券营业部   | 甘肃省兰州市城关区东岗东路 2070 号                    | 杨俊峰 |
| 35 | 兰州武都路证券营业部    | 甘肃省兰州市城关区武都路 157 号                      | 沈自强 |
| 36 | 兰州天水路证券营业部    | 甘肃省兰州市城关区定西南路 376 号                     | 苏艺  |
| 37 | 兰州西津西路证券营业部   | 甘肃省兰州市七里河区西津西路 9 号                      | 徐毅  |
| 38 | 兰州万新南路证券营业部   | 甘肃省兰州市安宁区万新南路 744 号                     | 王维达 |
| 39 | 庆阳西大街证券营业部    | 甘肃省庆阳市西峰区西大街 22 号                       | 刘儒  |
| 40 | 天水大众路证券营业部    | 甘肃省天水市秦州区大众路（兰天城市广场一楼内街家电区）             | 周军  |
| 41 | 武威建国街证券营业部    | 甘肃省武威市凉州区建国街邮政大厦三楼                      | 武勇  |
| 42 | 西宁五四西路证券营业部   | 青海省西宁市城西区五四西路 22 号 1 幢 2 层              | 郭燕霏 |
| 43 | 东莞胜和路证券营业部    | 广东省东莞市南城区胜和路胜和广场 B 座 3 楼                | 王铁平 |
| 44 | 佛山顺德新宁路证券营业部  | 广东省佛山市顺德区大良新宁路 60 号时代大厦首层               | 林培贵 |
| 45 | 广州东风西路证券营业部   | 广州市东风西路 195 号 B 座 11、12 楼               | 庄益群 |
| 46 | 广州宝岗大道证券营业部   | 广东省广州市海珠区宝岗大道 498 号广百新一城 6 楼北面          | 潘淑明 |
| 47 | 广州珠江西路证券营业部   | 广东省广州市天河区珠江西路 8 号 9 楼 903-906 房         | 田向明 |
| 48 | 惠州演达一路证券营业部   | 惠州市演达一路西侧大石湖 3 号小区泰安居第 6 层 F05 商场       | 朱伟英 |
| 49 | 揭阳普宁新河东路证券营业部 | 广东省揭阳市普宁市流沙新河东路中信华府西向门市南起第 6-7 间        | 黄烁林 |
| 50 | 汕头中山中路证券营业部   | 广东省汕头市中山路 205 号富都大厦 203、303 房           | 张镇文 |
| 51 | 韶关文化街证券营业部    | 韶关市浚江区文化街大哥大楼附楼一层                       | 邓紫薇 |
| 52 | 中山悦来南路证券营业部   | 广东省中山市石岐区悦来南路 18 号 A1 座一层第 8 卡、二层       | 李晓翔 |
| 53 | 珠海九洲大道东证券营业部  | 广东省珠海市香洲区吉大九洲大道东 1159 号之一商场 F 室         | 马楚峰 |
| 54 | 广州花都凤凰北路证券营业部 | 广州市花都区新华镇凤凰北路 41 号永愉花园酒店 418 室          | 黄海翔 |
| 55 | 江门迎宾大道西证券营业部  | 江门市迎宾大道西 3 号东方广场大厦 108 室                | 卢雄斌 |
| 56 | 桂林漓江路证券营业部    | 桂林市七星区漓江路 4 号 4 层                       | 张宁  |
| 57 | 南宁民主路证券营业部    | 南宁市兴宁区民主路 18 号邕州饭店 1 层、2 层              | 邓钦华 |
| 58 | 柳州桂中大道证券营业部   | 柳州市桂中大道南端 2 号阳光壹佰城市广场 7 栋 3-1 号         | 段广军 |
| 59 | 钦州子材西大街证券营业部  | 钦州市子材西大街 69 号 1 号楼 119 铺                | 张林刚 |
| 60 | 毕节碧阳大道证券营业部   | 毕节市七星关区洪南路御景华庭正二层 2-4a#、2-4b#（流仓办大兰社区）  | 邹杨  |
| 61 | 贵阳富水北路证券营业部   | 贵州省贵阳市云岩区富水北路 66 号天恒城市花园                | 章凯  |
| 62 | 贵阳长岭北路证券营业部   | 贵阳市观山湖区长岭北路 6 号大唐东原财富广场 1 号栋 12 层 4、5 号 | 李福辉 |

|    |                |   |     |
|----|----------------|---|-----|
| 63 | 六盘水麒麟路证券营业部    | 贵州省六盘水市钟山区钟山中路与麒麟大道交汇路口东北角名都商业广场裙楼 1 楼商铺 16 号门面 | 周洪  |
| 64 | 遵义中华南路证券营业部    | 遵义市龙井沟综合楼三楼                                     | 黄志义 |
| 65 | 海口龙昆北路证券营业部    | 海南省海口市龙昆北路 15 号中航大厦                             | 肖蓉  |
| 66 | 秦皇岛迎宾路证券营业部    | 秦皇岛市海港区迎宾路 100 号                                | 谷悦  |
| 67 | 保定东风东路证券营业部    | 保定市北市区东风东路 215 号仁和宜佳公寓底商                        | 刘涛  |
| 68 | 石家庄师范街证券营业部    | 河北省石家庄市师范街 2 号                                  | 薛成彬 |
| 69 | 石家庄翟营南大街证券营业部  | 河北省石家庄市裕华区翟营南大街 41 号财库国际商务中心商务综合楼 302 室         | 马骁勇 |
| 70 | 沧州署西街证券营业部     | 河北省沧州市运河区阳光国际 10 号楼 104                         | 杨海滨 |
| 71 | 洛阳体育场路证券营业部    | 河南省洛阳市西工区体育场路 13 号                              | 毛赞  |
| 72 | 商丘民主路证券营业部     | 商丘市梁园区民主路华联国贸 1309A、1310A                       | 田冬  |
| 73 | 许昌建设路证券营业部     | 河南省许昌市建设路春秋广场天伦大厦 3、4、5 楼                       | 龚岚  |
| 74 | 郑州经七路证券营业部     | 河南省郑州市经七路 16 号                                  | 冻逸兴 |
| 75 | 郑州航海东路证券营业部    | 郑州经济技术开发区航海东路 1394 号富田财富广场 1 号楼 2207 室          | 孙世杰 |
| 76 | 焦作塔南路证券营业部     | 焦作市山阳区站前路 225 号华融国际六楼 602 室                     | 孟信可 |
| 77 | 大庆乘风大街证券营业部    | 黑龙江省大庆市让胡路区乘风大街 126 号                           | 刘亚轩 |
| 78 | 加格达奇人民路证券营业部   | 黑龙江省大兴安岭地区加格达奇区人民路 168 号                        | 尤明哲 |
| 79 | 佳木斯保卫路证券营业部    | 黑龙江省佳木斯前进区保卫路保卫社区宜福都市公寓门市 115 号                 | 韩民  |
| 80 | 大庆昆仑大街证券营业部    | 黑龙江省大庆市让胡路区昆仑大街 184 号                           | 周国洪 |
| 81 | 大庆市经六街证券营业部    | 黑龙江省大庆市萨尔图区经六街 47 号                             | 李高平 |
| 82 | 大庆经三街证券营业部     | 大庆市萨尔图区经三街 29 号 D 栋商服 1-1、2、3、4 及 2、3、4 号商服     | 宋俊颀 |
| 83 | 大庆红岗南路证券营业部    | 黑龙江省大庆市红岗区南路 11 号二楼半层（203、204、205）及 402 室       | 王希斌 |
| 84 | 哈尔滨和平路证券营业部    | 黑龙江省哈尔滨市香坊区和平路 2 号和平大厦                          | 赵群  |
| 85 | 哈尔滨长江路证券营业部    | 哈尔滨市南岗区长江路 99-5 号                               | 郭威  |
| 86 | 哈尔滨果戈里大街证券营业部  | 哈尔滨市南岗区果戈里大街 200 号                              | 曲谱  |
| 87 | 哈尔滨一曼街证券营业部    | 黑龙江省哈尔滨市南岗区一曼街 80 号                             | 赵家  |
| 88 | 哈尔滨通江街证券营业部    | 哈尔滨市道里区通江街 218 号                                | 刘松涛 |
| 89 | 哈尔滨西大直街证券营业部   | 哈尔滨西大直街 40 号                                    | 邹祺  |
| 90 | 哈尔滨新阳路证券营业部    | 哈尔滨市道里区新阳路 240 号                                | 孙雷  |
| 91 | 哈尔滨中山路证券营业部    | 哈尔滨市南岗区中山路 111 号                                | 李延立 |
| 92 | 哈尔滨呼兰北二道街证券营业部 | 哈尔滨市呼兰区胜利街四委二组（北二道街 135 号）                      | 田然  |

|     |                 |  |     |
|-----|-----------------|--|-----|
| 93  | 哈尔滨双城龙化街证券营业部   | 双城市双城镇龙化街世纪现代城 11 栋 2 层 28、29、30 号商服     | 姚海涛 |
| 94  | 鹤岗东解放路证券营业部     | 黑龙江省鹤岗市东解放路 27 号                         | 惠鹏鹰 |
| 95  | 黑河中央街证券营业部      | 黑龙江省黑河市爱辉区中央街 258 号                      | 侍伟  |
| 96  | 黑河北安交通路证券营业部    | 黑龙江省黑河市北安市交通路 81 号                       | 张弛  |
| 97  | 黑河嫩江嫩兴路证券营业部    | 黑龙江省黑河市嫩江县嫩兴路 8 号                        | 王楠  |
| 98  | 鸡西虎林红旗街证券营业部    | 黑龙江省鸡西市虎林市虎林镇红旗街道中心委                     | 何明  |
| 99  | 鸡西中心大街证券营业部     | 鸡西市中心大街 110 号                            | 郭海峰 |
| 100 | 鸡西密山东安街证券营业部    | 黑龙江省鸡西市密山市密山镇东安街 75 号                    | 王勇  |
| 101 | 大兴安岭漠河振兴路证券营业部  | 黑龙江省大兴安岭地区漠河县西林吉镇振兴路邮政大楼                 | 尹子光 |
| 102 | 牡丹江牡丹街证券营业部     | 黑龙江省牡丹江市西安区牡丹街 1 号                       | 包修勇 |
| 103 | 牡丹江平安街证券营业部     | 黑龙江省牡丹江市西安区西平安街 7 号                      | 刘威  |
| 104 | 牡丹江东宁繁荣街证券营业部   | 黑龙江省牡丹江市东宁县东宁镇繁荣街 75 号                   | 苏兴利 |
| 105 | 牡丹江海林林海路证券营业部   | 黑龙江省牡丹江市海林市林海路 65 号（中行大厦二楼）              | 姚厚宇 |
| 106 | 牡丹江绥芬河山城路证券营业部  | 黑龙江省牡丹江市绥芬河市山城路 101 号                    | 庚成  |
| 107 | 齐齐哈尔讷河中心大街证券营业部 | 黑龙江省齐齐哈尔市讷河市中心大街 393 号                   | 张彦东 |
| 108 | 七台河大同街证券营业部     | 黑龙江省七台河市桃山区大同街 98 号                      | 董涛  |
| 109 | 齐齐哈尔卜奎大街证券营业部   | 黑龙江省齐齐哈尔市龙沙区卜奎大街 42 号                    | 王宏伟 |
| 110 | 齐齐哈尔和平路证券营业部    | 黑龙江省齐齐哈尔市富拉尔基区和平路 81 号                   | 刘义  |
| 111 | 齐齐哈尔安顺路证券营业部    | 齐齐哈尔市龙沙区安顺路 6 号                          | 田玉坤 |
| 112 | 双鸭山五马路证券营业部     | 黑龙江省双鸭山市尖山区五马路 9 号                       | 王晓飞 |
| 113 | 绥化安达牛街证券营业部     | 黑龙江省绥化市安达市牛街 235 号                       | 王喜臣 |
| 114 | 绥化康庄路证券营业部      | 黑龙江省绥化市北林区康庄路世纪方舟 16 幢                   | 程世海 |
| 115 | 伊春新兴中路证券营业部     | 黑龙江省伊春市伊春区新兴中路 90 号（市人大办公楼）              | 顾春明 |
| 116 | 天门西湖路证券营业部      | 天门市竟陵办事处西湖路天门新城银座帝景湾（天门 CBD）2 号楼 4 层部分面积 | 付国鹏 |
| 117 | 麻城金桥大道证券营业部     | 湖北省麻城市金桥大道 61 号（发改局办公楼一楼靠东边三间临街房）        | 李小中 |
| 118 | 武汉赵家条证券营业部      | 武汉市江岸区二七街赵家条 144 号                       | 顾红  |
| 119 | 武汉中北路证券营业部      | 武昌区中北路 259 号                             | 周丽华 |
| 120 | 武汉十升路证券营业部      | 湖北省武汉市汉阳区十升路特一号 A 座 6 楼                  | 柏丽丽 |
| 121 | 咸宁潜山路证券营业部      | 湖北省咸宁市咸安区潜山路 6 号                         | 黄莉  |
| 122 | 岳阳巴陵中路证券营业部     | 岳阳市岳阳楼区巴陵中路 450 号海川大厦 7 楼 703            | 胡明  |

|     |               |                                     |     |
|-----|---------------|-------------------------------------|-----|
| 123 | 郴州南岭大道证券营业部   | 郴州市北湖区南岭大道 63 号子矜酒店一层               | 李杰  |
| 124 | 常德朗州路证券营业部    | 常德市武陵区朗州路 137 号凯利大厦 4 楼             | 刘建乐 |
| 125 | 衡阳蒸阳南路证券营业部   | 衡阳市雁峰区蒸阳南路 2 号崇业商业广场写字楼六楼 604-607 室 | 曹松涛 |
| 126 | 邵阳戴家路证券营业部    | 邵阳市大祥区戴家路翡翠星城旁建设银行二楼                | 邓家斌 |
| 127 | 长沙五一大道证券营业部   | 湖南省长沙市五一大道 618 号银华大厦 1 楼、6 楼        | 张文忠 |
| 128 | 东丰东风路证券营业部    | 吉林省东丰县东丰镇东风路天星名郡 2 号楼 1-4           | 秦靖波 |
| 129 | 吉林南京街证券营业部    | 吉林省吉林市南京街 104 号                     | 宋宝红 |
| 130 | 辽源人民大街证券营业部   | 吉林省辽源市龙山区人民大街 2853 号                | 李颖  |
| 131 | 松原乌兰大街证券营业部   | 吉林省松原市宁江区乌兰大街 2356 号                | 马鸣  |
| 132 | 长春大经路证券营业部    | 吉林省长春市南关区大经路 550 号                  | 李勇  |
| 133 | 南通海安中坝南路证券营业部 | 江苏省南通市海安县海安镇中坝南路 19 号               | 张富贵 |
| 134 | 常熟海虞北路证券营业部   | 江苏省常熟市海虞北路 20 号                     | 苏加宏 |
| 135 | 常州健身路证券营业部    | 江苏省常州市健身路 16 号                      | 陈志平 |
| 136 | 常州广电西路证券营业部   | 江苏省常州市武进区广电西路 310 号                 | 张蕾  |
| 137 | 丹阳东方路证券营业部    | 江苏省丹阳市东方路东方嘉园 2 栋 5、6 号门市           | 马跃峰 |
| 138 | 淮安淮海北路证券营业部   | 江苏省淮安市淮海北路 50 号 1、4、5 楼             | 唐大权 |
| 139 | 江都龙川南路证券营业部   | 江苏省扬州市江都区仙女镇龙川南路 139 号              | 邢翼  |
| 140 | 江阴朝阳路证券营业部    | 江苏省江阴市朝阳路 55 号一楼                    | 梁正  |
| 141 | 昆山同丰路证券营业部    | 昆山开发区同丰路 347、349 号                  | 徐建强 |
| 142 | 溧阳燕山中路证券营业部   | 溧阳市溧城镇燕山中路 28 号福田中心一层 A1009-A1012   | 姜怡  |
| 143 | 连云港巨龙南路证券营业部  | 江苏省连云港市巨龙南路 66 号君悦财富广场 5 号楼 110 室   | 王建国 |
| 144 | 南京常府街证券营业部    | 江苏省南京市秦淮区常府街 85-7 号                 | 张颂杰 |
| 145 | 南京广州路证券营业部    | 江苏省南京市鼓楼区广州路 188 号                  | 钱敬星 |
| 146 | 南通人民中路证券营业部   | 江苏省南通市人民中路 23-6 号                   | 缪鹏飞 |
| 147 | 苏州南园北路证券营业部   | 江苏省苏州南园北路 31 号                      | 岳岚  |
| 148 | 太仓人民南路证券营业部   | 江苏省太仓市人民南路 168 号 107 室              | 黄颖达 |
| 149 | 泰兴东润路证券营业部    | 泰兴市东润路 96 号                         | 唐凡兴 |
| 150 | 泰州鼓楼南路证券营业部   | 泰州市鼓楼南路 315 号                       | 乔雷璋 |
| 151 | 无锡解放东路证券营业部   | 江苏省无锡市解放东路 1008 号                   | 吴国华 |
| 152 | 宿迁发展大道证券营业部   | 江苏省宿迁市发展大道 64 号                     | 陶冶  |
| 153 | 徐州中山北路证券营业部   | 江苏省徐州市鼓楼区中山北路 12 号龙泰大厦三层            | 严旭东 |
| 154 | 盐城建军中路证券营业部   | 江苏省盐城市建军中路 68 号综合楼 201 室 (1)        | 丁振东 |

|     |               |   |     |
|-----|---------------|---|-----|
| 155 | 扬州汶河南路证券营业部   | 江苏省扬州市汶河南路 69 号                                   | 薛晓雁 |
| 156 | 宜兴洑滨南路证券营业部   | 宜兴市宜城街道洑滨大道 63、65、67 号                            | 梁樑  |
| 157 | 张家港东环路证券营业部   | 杨舍镇东环路 123 号                                      | 朱翠红 |
| 158 | 镇江中山西路证券营业部   | 江苏省镇江市中山西路 53 号                                   | 成剑  |
| 159 | 苏州笠泽路证券营业部    | 吴江区松陵镇振泰小区 4 幢 102 室                              | 赵宏  |
| 160 | 扬州宝应苏中南路证券营业部 | 宝应县金桥生活广场 6-1038 号                                | 崔俊岚 |
| 161 | 盐城阜宁阜城大街证券营业部 | 阜宁县阜城大街 296 号                                     | 徐其俊 |
| 162 | 鹰潭五洲路证券营业部    | 江西省鹰潭市五洲路西侧西湖嘉苑 1 号楼 9 号                          | 艾迪生 |
| 163 | 景德镇瓷都大道证券营业部  | 江西省景德镇市昌江区瓷都大道 1279 号二楼                           | 梁巍  |
| 164 | 九江浔阳东路证券营业部   | 江西省九江市浔阳区浔阳东路 93 号工商银行九江分行浔东支行                    | 洪海燕 |
| 165 | 抚州赣东大道证券营业部   | 江西省抚州市赣东大道南延伸段 1533 号                             | 钟瑾璞 |
| 166 | 赣州红旗大道证券营业部   | 江西省赣州市章贡区红旗大道 25 号一栋 1-4 楼                        | 梁小辉 |
| 167 | 南昌南京东路证券营业部   | 江西省南昌市青山湖区南京东路 399 号天御国际大厦-写字楼 211、212、213 室（第二层） | 肖芳生 |
| 168 | 萍乡公园中路证券营业部   | 萍乡市公园中路 123 号                                     | 余立  |
| 169 | 上饶中山西路证券营业部   | 江西省上饶市信州区中山西路 65 号 2-1                            | 李勇  |
| 170 | 新余劳动南路证券营业部   | 江西省新余市劳动南路 1 号                                    | 朱发荣 |
| 171 | 新余分宜府前路证券营业部  | 江西省分宜县府前路 5 号                                     | 费俊  |
| 172 | 宜春袁山中路证券营业部   | 江西省宜春市袁州区袁山中路 695 号                               | 李国华 |
| 173 | 营口昆仑大街证券营业部   | 营口市鲅鱼圈区昆仑大街中段（05-交通银行南侧部分营业楼）                     | 于文才 |
| 174 | 丹东兴五路证券营业部    | 丹东市振兴区兴五路坝外 1 号楼                                  | 杨洪滨 |
| 175 | 鞍山二道街证券营业部    | 鞍山市铁东区二道街 90 号                                    | 刘娜  |
| 176 | 鞍山岫岩证券营业部     | 辽宁省鞍山市岫岩满族自治县岫岩镇一街道（位于颐华园 2 号楼西七单元、西八单元）          | 王世东 |
| 177 | 大连天津街证券营业部    | 大连市中山区天津街 91 号                                    | 卫春敏 |
| 178 | 盘锦人民路证券营业部    | 辽宁省盘锦市兴隆台区人民路财贸小区 1-48-6 号                        | 赵宏  |
| 179 | 沈阳大西路证券营业部    | 沈阳市沈河区大西路 364 号                                   | 王群  |
| 180 | 营口辽河大街证券营业部   | 辽宁省营口市站前区辽河广场 9 号                                 | 乔文选 |
| 181 | 呼和浩特新华东街证券营业部 | 内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 395 号和成信息大厦综合楼 3 层              | 许道宾 |
| 182 | 潍坊东风西街证券营业部   | 山东省潍坊市潍城区东风西街 277 号 1 号楼 2-04                     | 吕志成 |
| 183 | 临沂涑河南街证券营业部   | 山东省临沂市兰山区涑河南街 49-3 号                              | 杨雷  |
| 184 | 东营东三路证券营业部    | 山东省东营市东营区东三路 171 号 B 幢 109                        | 许永健 |
| 185 | 肥城新城路证券营业部    | 山东省肥城市新城路 039 号                                   | 张勇  |
| 186 | 济南泉城路证券营业部    | 济南市泉城路 13 号                                       | 张东  |

|     |                |  |     |
|-----|----------------|--|-----|
| 187 | 济南洪家楼南路证券营业部   | 山东省济南市洪家楼南路 25 号   | 于洪泉 |
| 188 | 青岛杭州路证券营业部     | 青岛市杭州路 20 号  | 李小林 |
| 189 | 青岛湛山一路证券营业部    | 青岛市湛山一路 25 号   | 崔宁  |
| 190 | 青岛九水东路证券营业部    | 青岛市李沧区九水东路 9 号   | 刘洪顺 |
| 191 | 泰安岱宗大街证券营业部    | 泰安市岱宗大街 10 号   | 项颖  |
| 192 | 威海高山街证券营业部     | 威海高山街-2 号  | 刘昌波 |
| 193 | 烟台解放路证券营业部     | 山东省烟台市解放路 164 号  | 齐洁云 |
| 194 | 枣庄燕山路证券营业部     | 枣庄市薛城燕山路燕山国际 D 区 1 号楼 22 号                               | 焦学福 |
| 195 | 淄博石化证券营业部      | 山东省淄博市临淄区齐鲁化工商城 69 号                                     | 姜山  |
| 196 | 淄博通济街证券营业部     | 山东省淄博市淄川区通济街 140 号                                       | 戚思敏 |
| 197 | 淄博桓台东岳路证券营业部   | 山东省淄博市桓台县东岳路 1251 号齐商银行大楼北栋二、三层                          | 刘善顺 |
| 198 | 聊城东昌路证券营业部     | 山东省聊城经济技术开发区东昌路 10 号                                     | 王鹏飞 |
| 199 | 晋城黄华街证券营业部     | 山西省晋城市城区黄华街宏翔小区 5 号楼底商 3 号房                              | 都玉清 |
| 200 | 太原新建路证券营业部     | 太原市杏花岭区新建路 92 号  | 刘虹  |
| 201 | 太原迎泽西大街证券营业部   | 太原市万柏林区迎泽西大街 386 号                                       | 张滨  |
| 202 | 太原北大街证券营业部     | 太原市杏花岭区北大街 109 号   | 冯冰  |
| 203 | 太原平阳路证券营业部     | 山西省太原市小店区平阳路 105 号                                       | 衡宇峰 |
| 204 | 大同永宁街证券营业部     | 山西省大同市城区永宁街馨和园一号楼二号商铺                                    | 李玮  |
| 205 | 宝鸡经二路证券营业部     | 宝鸡市渭滨区经二路 45 号   | 刘昭  |
| 206 | 汉中天汉大道证券营业部    | 汉中市汉台区天汉大道中银大厦   | 陈剑飞 |
| 207 | 西安西新街证券营业部     | 西安市西新街 11 号海星智能广场 10 层 (1 幢 11001 号、11002 号)             | 何倩  |
| 208 | 咸阳沈兴北路证券营业部    | 陕西省咸阳市沈兴北路 1 号国际商会大厦 3 层                                 | 孟立亚 |
| 209 | 榆林榆阳证券营业部      | 榆林市榆阳区上郡北路 112 号 3 层 01 号                                | 陈剑  |
| 210 | 银川文化西街证券营业部    | 银川市兴庆区文化西街 106 号银川国际贸易中心 B 栋 12 层 B07 室                  | 王伟  |
| 211 | 上海宣化路证券营业部     | 上海市长宁区宣化路 300 号 709-711 室                                | 陆凯谊 |
| 212 | 上海余姚路证券营业部     | 上海市余姚路 420 号   | 朱江力 |
| 213 | 上海黄浦区福州路证券营业部  | 上海市黄浦区福州路 536、542 号、浙江中路 188 弄 1 号 P04 室                 | 杜峻  |
| 214 | 上海嘉定区福海路证券营业部  | 上海市嘉定区福海路 758 号一楼  | 徐俊  |
| 215 | 上海乳山路证券营业部     | 浦东新区乳山路 233 号 202、204 室                                  | 高燕华 |
| 216 | 上海牡丹江路证券营业部    | 上海市牡丹江路 263-265 号  | 陆雁  |
| 217 | 上海共和新路证券营业部    | 上海市闸北区共和新路 3703 号 101 室                                  | 卢志泉 |
| 218 | 上海种德桥路证券营业部    | 上海市种德桥路 2 号  | 茅佳俊 |
| 219 | 上海普陀区大华一路证券营业部 | 上海市普陀区大华一路 239 弄 6 号 1 层 101、102、103、104, 2 层 201、202 单元 | 王园  |
| 220 | 上海崑山路证券营业部     | 中国 (上海) 自由贸易试验区崑山路 619 号一楼、二楼                            | 张颖侠 |

|     |                |  |     |
|-----|----------------|--|-----|
| 221 | 上海平武路证券营业部     | 上海市平武路 38 号  | 杨红  |
| 222 | 上海普陀区宜川路证券营业部  | 上海市普陀区宜川路 363 号一层、二层                                     | 赵辉  |
| 223 | 上海建国西路证券营业部    | 上海市建国西路 285 号  | 周杰  |
| 224 | 上海虹口区新建路证券营业部  | 上海市虹口区新建路 207、211 号底层、二层                                 | 谢闻博 |
| 225 | 上海杨浦区政本路证券营业部  | 上海市杨浦区政本路 141 号  | 于永浩 |
| 226 | 上海普陀区澳门路证券营业部  | 上海市普陀区澳门路 351 号 4 楼                                      | 杜霜  |
| 227 | 上海周家嘴路证券营业部    | 周家嘴路 3255 号  | 李建新 |
| 228 | 上海合肥路证券营业部     | 上海市黄浦区合肥路 293 号  | 王轶  |
| 229 | 上海天平路证券营业部     | 上海市天平路 137 号   | 张峰  |
| 230 | 上海玉田支路证券营业部    | 上海市玉田支路 11 号 1-3 层                                       | 林佳  |
| 231 | 上海金山区卫清西路证券营业部 | 上海市金山区卫清西路 612 号   | 王雅君 |
| 232 | 上海南桥证券营业部      | 上海市奉贤区南桥镇南星路 381 号                                       | 张成  |
| 233 | 上海普陀区铜川路证券营业部  | 上海市普陀区铜川路 1601-1613 号(单)102、125、335-345 室                | 徐岚  |
| 234 | 上海闵行区吴中路证券营业部  | 上海市闵行区吴中路 1059 号 6 幢 B 号 B101、四楼                         | 司安祥 |
| 235 | 上海长宁区天山西路证券营业部 | 上海市长宁区天山西路 169 号 1 楼、2 楼                                 | 谷红漫 |
| 236 | 上海桂林路证券营业部     | 上海市徐汇区桂林路 46 号   | 吴宏志 |
| 237 | 上海普陀区枣阳路证券营业部  | 上海市普陀区枣阳路 182 号 1 号楼第 3 层                                | 杨娜  |
| 238 | 上海南翔镇证券营业部     | 上海市南翔镇德园路 681 号 1 楼、德园路 685 弄 3 号 2 楼                    | 孟佳佳 |
| 239 | 上海松江区人民北路证券营业部 | 上海市松江区人民北路 171 弄 5 号、6 号、7 号、8 号                         | 彭霄彤 |
| 240 | 上海青浦区青湖路证券营业部  | 上海市青浦区青湖路 780 号  | 徐凤  |
| 241 | 上海浦东新区成山路证券营业部 | 上海市浦东新区成山路 1250 号  | 张任慈 |
| 242 | 上海崇明县北门路证券营业部  | 上海市崇明县城桥镇北门路 408 号                                       | 桑佳磊 |
| 243 | 深圳宝源路证券营业部     | 深圳市宝安区西乡街道宝源财富港大厦 D 座 1902F                              | 陈晓  |
| 244 | 深圳海德三道证券营业部    | 深圳市南山区后海大道以东天利中央商务广场 8 层 801-805、806A、810A、811、812 室     | 曾韵蓓 |
| 245 | 深圳分公司红岭中路证券营业部 | 深圳市罗湖区桂园街道红岭中路 2068 号中深国际大厦三楼                            | 王磊  |
| 246 | 深圳分公司华富路证券营业部  | 深圳市福田区深南中路华富路口南光大厦 5-东西座(500 房) 11 层东西座 1-3(1116-1138 房) | 包卫华 |
| 247 | 深圳分公司红岭南路证券营业部 | 深圳市福田区红岭南路红岭大厦 4 栋 5 栋裙楼第三层 B 号商铺                        | 万兰明 |
| 248 | 深圳福华三路证券营业部    | 深圳市福田区福华三路市中心区南部 88 号时代财富大厦 3 层 B 号                      | 黄琨  |
| 249 | 深圳景田路证券营业部     | 深圳市福田区景田路瑞达苑二楼   | 沈志敬 |
| 250 | 深圳深南大道证券营业部    | 深圳市南山区深南大道 9030 号世纪假日广场 A 座 1208                         | 刘婵吉 |
| 251 | 深圳高新南四道证券营业部   | 深圳市南山区高新南四道 13 号中兴通讯研发大楼 6 楼                             | 林新孟 |

|     |                |                                |     |
|-----|----------------|--------------------------------|-----|
| 252 | 深圳望海路证券营业部     | 深圳市南山区蛇口望海路招商局广场 09 层          | 聂静  |
| 253 | 成都人民西路证券营业部    | 成都市人民西路 96 号                   | 刘宏志 |
| 254 | 成都温江区杨柳东路证券营业部 | 四川省成都市温江区杨柳东路北段 31 号、34 号、83 号 | 徐建强 |
| 255 | 双流棠湖南路证券营业部    | 成都市双流区东升街道棠湖南路二段 244 号天马大厦三楼   | 郎妍妍 |
| 256 | 乐山通悦路证券营业部     | 乐山市市中区通悦路 26 号 2 楼 1 号         | 杨焱  |
| 257 | 绵阳长虹大道证券营业部    | 绵阳市涪城区长虹大道北段 21 号（未来城 4 栋 2 楼） | 杨洲  |
| 258 | 自贡丹桂大街证券营业部    | 自贡市自流井区丹桂大街 508 号 6 室          | 陈雪峰 |
| 259 | 天津霞光道证券营业部     | 天津市南开区霞光道 1 号宁泰广场 8 层          | 任宇  |
| 260 | 乌鲁木齐新医路证券营业部   | 乌鲁木齐市新医路 359 号                 | 何群  |
| 261 | 克拉玛依准噶尔路证券营业部  | 新疆克拉玛依市准噶尔路 220 号（新天地商业街八号楼）   | 刘层层 |
| 262 | 石河子北一路证券营业部    | 新疆石河子市北一路 4 小区 240 号           | 周建强 |
| 263 | 大理洱河南路证券营业部    | 大理市下关中民城市广场二层 Aa2-11 至 Aa2-13  | 都帅  |
| 264 | 弥勒冉翁路证券营业部     | 弥勒市冉翁西路 618 号二层                | 陈俊骏 |
| 265 | 景洪嘎兰中路证券营业部    | 云南省景洪市嘎兰中路 100 号               | 顾建新 |
| 266 | 昆明东风西路证券营业部    | 昆明市东风西路 162 号                  | 郑莉  |
| 267 | 晋宁昆阳街证券营业部     | 晋宁县昆阳镇郑和商业广场 1 幢第 2 层 13 号房    | 王冠珩 |
| 268 | 丽水城东路证券营业部     | 浙江省丽水市莲都区城东路 34、36-1 号         | 何峥  |
| 269 | 新昌七星路证券营业部     | 新昌县七星路 166 号                   | 张敏华 |
| 270 | 杭州解放路证券营业部     | 浙江省杭州市解放路 138 号                | 汪峥  |
| 271 | 杭州环城西路证券营业部    | 浙江省杭州市下城区环城西路 46-2 号           | 马劫  |
| 272 | 杭州文化路证券营业部     | 浙江省杭州市萧山区城厢街道文化路 208 号         | 陈建荣 |
| 273 | 杭州瓜沥东灵北路证券营业部  | 浙江省杭州市萧山区瓜沥镇东灵北路 160 号         | 缪苗  |
| 274 | 湖州吴兴商城西路证券营业部  | 湖州市织里镇商城西路 119 号               | 金斌  |
| 275 | 湖州苕溪西路证券营业部    | 湖州市吴兴区苕溪商住楼苕溪西路 265 号一层、二层     | 王辉  |
| 276 | 嘉兴中山西路证券营业部    | 浙江省嘉兴市中山西路 850、852 号           | 王宏雷 |
| 277 | 宁波百丈东路证券营业部    | 宁波市江东区百丈东路 787 号 11 楼          | 王甬  |
| 278 | 宁波解放北路证券营业部    | 宁波市海曙区解放北路 136-148 号           | 梅文胜 |
| 279 | 慈溪北二环东路证券营业部   | 慈溪市古塘街道北二环东路 204-206 号 108 室   | 曹静波 |
| 280 | 上虞市民大道证券营业部    | 浙江省绍兴市上虞区百官街道市民大道 678 号 1-3 层  | 潘伟  |
| 281 | 绍兴劳动路证券营业部     | 浙江省绍兴市劳动路 158 号                | 陈青  |
| 282 | 嵊州西前街证券营业部     | 浙江省嵊州市西前街 89 号                 | 邹宁  |
| 283 | 温州锦绣路证券营业部     | 温州市鹿城区锦绣路瑞康商务楼 1 幢 106 室       | 崔海红 |

|     |              |   |     |
|-----|--------------|---|-----|
| 284 | 义乌丹溪北路证券营业部  | 浙江省义乌市北苑街道丹溪北路 222 号 1-3 层              | 徐登富 |
| 285 | 舟山环城西路证券营业部  | 舟山市定海区环城西路 96 号                         | 曾宏开 |
| 286 | 诸暨艮塔东路证券营业部  | 诸暨市暨阳街道艮塔东路 24 号                        | 陈新天 |
| 287 | 金华八一南街证券营业部  | 浙江省金华市婺城区八一南街 288 号金华商城 A 区 2 楼         | 汪海琴 |
| 288 | 台州市市府大道证券营业部 | 台州市市府大道 251-1、251-2                     | 潘然  |
| 289 | 重庆龙华大道证券营业部  | 重庆市渝北区龙溪街道龙华大道 107 号附 9 号财信城市国际 3 幢 6-2 | 李国静 |
| 290 | 重庆中山三路证券营业部  | 重庆市渝中区上清寺中山三路 152 号                     | 苑登锋 |