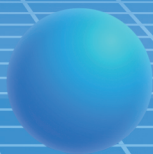




海通证券  
HAITONG

A股股票代码：600837

# 2024海通证券 半年度报告



2024

半年度报告  
海通证券股份有限公司



## 重要提示

- 一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证半年度报告内容的真实性、准确性、完整性，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、公司全体董事出席董事会会议。
- 三、本半年度报告未经审计。
- 四、公司负责人周杰、主管会计工作负责人张信军及会计机构负责人（会计主管人员）马中声明：保证半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、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司 2024 年中期利润分配采用现金分红的方式，以 2024 年中期分红派息股权登记日登记的总股本扣除公司回购专用证券账户的股份为基数，每 10 股分配现金红利人民币 0.3 元（含税）。若以审议 2024 年中期利润分配预案的董事会召开日公司总股本 13,064,200,000 股扣除公司回购专用证券账户的股份 77,074,467 股，即 12,987,125,533 股为基数计算，分配现金红利总额为人民币 389,613,765.99 元，占 2024 年 1-6 月合并口径归属于母公司股东净利润的 40.88%；公司 2024 年 1-6 月以现金为对价，采用集中竞价方式已实施的股份回购金额人民币 303,053,231.80 元（不含交易费用），现金分红和回购金额合计人民币 692,666,997.79 元，占 2024 年 1-6 月合并口径归属于母公司股东净利润的 72.68%。

### 六、前瞻性陈述的风险声明

本报告中所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描述不构成公司对投资者的承诺，敬请投资者注意投资风险。

### 七、是否存在被控股股东及其他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、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告的真实性和准确性

否

## 十、重大风险提示

本集团的业务高度依赖于中国及其他业务所处国家或地区的整体经济及市场状况，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将对本集团经营业绩产生重大影响。

本集团面临的主要风险包括：因违反法律法规和准则而使证券公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分等情形的法律及合规风险；因借款人、交易对手方或债务发行人无法履行其约定的财务义务而可能对经营造成损失的信用风险；因市场价格的不利变动而使自有资金投资业务发生损失的市场风险；由于内部流程不完善、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导致的操作风险；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所需资金的流动性风险；因经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方进行负面评价的声誉风险。以上各类风险将给本集团的经营和收益带来直接影响，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采取的具体措施，请投资者认真阅读半年度报告“管理层讨论与分析”中关于“可能面对的风险及应对措施”相关内容，并特别注意上述风险因素。

## 十一、其他

适用 不适用

# 目录

第一节 释义	1
第二节 公司简介和主要财务指标	4
第三节 管理层讨论与分析	13
第四节 公司治理	36
第五节 环境与社会责任	43
第六节 重要事项	48
第七节 股份变动及股东情况	60
第八节 债券相关情况	67
第九节 财务报告	84
第十节 证券公司信息披露	184

## 备查文件目录

载有本公司法定代表人签名的半年度报告文本
载有本公司法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名盖章的财务报告文本
报告期内在符合国务院证券监督管理机构规定条件的媒体上公开披露过的所有本公司文件的正本及公告原稿
其他有关资料

## 第一节 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
上海证监局	指	中国证券监督管理委员会上海监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
《上交所上市规则》	指	《上海证券交易所股票上市规则》
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 C3 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 C1《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	指	海通证券的公司章程
公司法	指	中华人民共和国公司法
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
ETF	指	交易型开放式指数基金
WIND	指	万得信息技术股份有限公司
IPO	指	首次公开发售
FICC	指	固定收益、外汇及大宗商品
新三板	指	全国中小企业股份转让系统
报告期	指	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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

#### 常用词语释义

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	指	海通国际证券集团有限公司
海通恒信	指	海通恒信国际融资租赁股份有限公司，于香港联交所上市，股份代号：1905
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
恒信金融集团	指	海通恒信金融集团有限公司
上海惟泰置业	指	上海惟泰置业管理有限公司
上海国盛集团	指	上海国盛（集团）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	李军
公司授权代表	周杰、裴长江
联席公司秘书	裴长江、黄慧玲
合规总监	赵慧文

### 注册资本和净资本

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
净资本	85,471,167,982.01	80,835,517,814.17

## 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

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. 开放式证券投资基金代销业务资格（证监基金〔2002〕076号）
4. 从事相关创新活动试点证券公司（中证协函〔2005〕079号）
5. 从事短期融资券承销业务资格（银发〔2005〕173号）
6. 上证基金通业务（2005.07）
7. 报价转让业务资格（中证协函〔2006〕3号）
8. 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）
9. 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）
10. 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）
11. 为期货公司提供中间介绍业务资格（证监许可〔2008〕第479号）
12. 开展直接投资业务试点资格（机构部部函〔2008〕421号）

13. 向保险机构投资者提供交易单元资格 (保监资金审证〔2009〕1号)
14. 融资融券业务资格 (证监许可〔2010〕315号)
15. 基金评价业务资格 (中证协发〔2010〕070号)
16. 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)
17. 全国社保基金理事会签约券商资格 (2011.08)
18. 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)
19. 约定购回式证券交易业务试点 (机构部部函〔2011〕512号)
20. 债券质押式报价回购业务试点 (机构部部函〔2011〕585号)
21. 中小企业私募债券承销业务试点资格 (中证协函〔2012〕561号)
22. 转融通业务试点资格 (中证金函〔2012〕113号)
23. 合伙企业独立托管业务试点 (机构部部函〔2012〕686号)
24. 柜台交易业务 (中证协函〔2012〕825号)
25. 证券业务外汇经营许可 (上海汇复〔2013〕014号)
26. 作为主办券商在全国股份转让系统从事推荐业务和经纪业务 (股转系统函〔2013〕61号)
27. 代销金融产品业务资格 (沪证监机构字〔2013〕180号)
28. 权益类收益互换业务和场外期权交易业务 (中证协函〔2013〕996号)
29. 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)
30. 军工涉密业务咨询服务 (2013.10)
31. 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)
32. 证券投资基金托管资格 (证监许可〔2013〕1643号)
33. 保险兼业代理人 (沪保监许可〔2013〕204号)
34. 代理证券质押登记业务资格 (2014.02)
35. 互联网证券业务试点 (中证协函〔2014〕358号)
36. 上市公司股权激励行权融资业务试点 (深证函〔2014〕321号)
37. 期权结算业务资格 (中国结算函字〔2015〕20号)
38. 股票期权做市业务资格 (证监许可〔2015〕153号)
39. 上证50ETF期权合约品种的主做市商 (上证函〔2015〕214号)
40. 境外自营业务资格 (机构部函〔2015〕1204号)
41. 单向视频开户创新方案的无异议函 (中国结算办字〔2015〕461号)
42. 银行间黄金询价业务资格 (上金交发〔2015〕120号)

43. 非金融企业债务融资工具主承销业务资质 (2016.08)
44. 场外期权业务二级交易商资格 (中证协发〔2018〕386号)
45. 信用衍生品业务资格 (机构部函〔2019〕469号)
46. 股指期权做市业务 (机构部函〔2019〕3073号)
47. 沪深300ETF期权主做市商 (2019.12)
48. 利率互换实时承接业务资格 (2020.03)
49. 受信用保护债券质押式回购业务合格创设机构资格 (中国结算函字〔2021〕201号)
50. 商品互换业务一级交易商 (2022.07)
51. 上交所中证500ETF期权一般做市商 (2022.09)
52. 深交所创业板ETF期权一般做市商 (2022.09)
53. 深交所中证500ETF期权一般做市商 (2022.09)
54. 上交所基金通做市业务资格 (2022.12)
55. 个人养老金基金销售资格 (2022.12)
56. 北交所融资融券业务资格 (2023.2)
57. 深交所基金通做市业务资格 (2023.3)
58. 上交所科创50ETF期权主做市商资格 (2023.06)
59. 中央债券借贷业务 (2023.12)

公司具备上交所、深交所和北交所会员资格，是中国证券业协会、上海清算所、上海黄金交易所等机构会员。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	裴长江	孙涛
联系地址	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场 (邮政编码: 200011)	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场 (邮政编码: 200011)
电话	8621-23180000	8621-23180000
传真	8621-63410627	8621-63410627
电子信箱	dshbgs@haitong.com	dshbgs@haitong.com

### 三、基本情况变更简介

公司注册地址	中国上海市广东路 689 号
公司注册地址的历史变更情况	中国上海市江西中路 200 号（1988 年）、中国上海市四川中路 480 号（1990 年）、中国上海市北海宁路 30 号（1994 年）、中国上海市唐山路 218 号（1998 年）、中国上海市淮海中路 98 号（2001 年）、中国上海市广东路 689 号海通证券大厦（2012 年）
公司办公地址	中国上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
公司办公地址的邮政编码	200011
公司网址	<a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>
电子信箱	haitong@haitong.com
香港主要营业地址	香港黄竹坑香叶道 2 号 One Island South 15 楼
营业执照统一社会信用代码	9131000013220921X6

### 四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的网站地址	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>
登载中期报告的香港联交所指定的网址	<a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>
公司半年度报告备置地点	中国上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
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> 、 <a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>

### 五、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、其他有关资料

适用 不适用

## 七、公司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	本报告期（1-6月）	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
营业收入	8,864,757,835.68	16,968,366,973.04	-47.76
归属于母公司股东的净利润	953,097,368.84	3,829,634,781.60	-75.11
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	545,596,471.79	3,212,220,025.91	-83.01
经营活动产生的现金流量净额	19,282,151,341.47	-10,742,192,791.84	-
其他综合收益的税后净额	291,108,290.69	795,560,056.64	-63.41
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减（%）
资产总额	721,414,534,571.73	754,586,792,234.64	-4.40
负债总额	550,222,979,374.09	579,787,232,518.31	-5.10
归属于母公司股东的权益	163,027,730,461.97	163,243,990,487.16	-0.13
所有者权益总额	171,191,555,197.64	174,799,559,716.33	-2.06

### (二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期（1-6月）	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
基本每股收益（元/股）	0.07	0.29	-75.86
稀释每股收益（元/股）	0.07	0.29	-75.86
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.04	0.25	-84.00
加权平均净资产收益率（%）	0.58	2.29	减少 1.71 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	0.33	1.92	减少 1.59 个百分点

公司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

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	85,471,167,982.01	80,835,517,814.17
净资产	155,446,130,921.35	153,271,166,148.86
风险覆盖率 (%)	204.13	197.71
资本杠杆率 (%)	21.18	17.68
流动性覆盖率 (%)	408.22	223.69
净稳定资金率 (%)	157.66	141.88
净资本 / 净资产 (%)	54.98	52.74
净资本 / 负债 (%)	33.19	28.96
净资产 / 负债 (%)	60.36	54.91
自营权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	14.99	16.92
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	234.39	229.18

## 八、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

## 九、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-877,698.65	
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、按照确定的标准享有、对公司损益产生持续影响的政府补助除外	490,669,491.73	主要是政府补助
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-223,149.24	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	76,536,135.02	
减：所得税影响额	137,880,660.40	
少数股东权益影响额（税后）	20,723,221.41	
合计	407,500,897.05	

对公司将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》未列举的项目认定为的非经常性损益项目且金额重大的，以及将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

适用 不适用

## 十、财务报表主要项目

### 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	2024年6月30日	2023年12月31日	增减幅度(%)
货币资金	147,350,960,191.27	142,730,777,859.05	3.24
拆出资金	831,818,601.45	330,294,865.04	151.84
融出资金	63,944,096,200.47	68,418,207,732.52	-6.54
应收款项	8,320,102,103.69	12,167,274,566.35	-31.62
交易性金融资产	211,398,285,277.46	221,273,089,992.22	-4.46
债权投资	4,712,994,209.36	6,797,779,540.34	-30.67
其他债权投资	57,213,247,473.03	61,310,746,563.80	-6.68
其他权益工具投资	10,416,425,857.16	8,010,844,169.78	30.03
长期应收款	73,101,760,386.66	79,516,505,296.66	-8.07
拆入资金	19,504,997,024.24	14,712,363,886.93	32.58
交易性金融负债	12,247,300,856.30	20,453,404,949.34	-40.12
卖出回购金融资产款	99,725,679,018.20	112,564,792,535.08	-11.41
代理买卖证券款	106,526,337,287.99	106,538,716,590.39	-0.01
长期借款	36,977,280,684.23	42,299,324,666.85	-12.58
应付债券	189,450,771,465.64	193,920,279,749.62	-2.30
递延所得税负债	546,508,277.17	835,047,755.22	-34.55
资本公积	75,877,536,528.89	75,764,593,348.84	0.15
其他综合收益	-823,033,615.97	-1,304,576,076.39	-
未分配利润	41,795,755,178.13	42,335,647,242.12	-1.28

项目	2024年1-6月	2023年1-6月	增减幅度(%)
手续费及佣金净收入	3,504,210,450.73	4,940,568,989.46	-29.07
利息净收入	1,770,804,207.17	2,184,402,807.96	-18.93
投资收益(损失以“-”号填列)	2,190,781,817.46	3,718,096,492.65	-41.08
其他收益	546,164,427.73	792,742,726.68	-31.10
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-470,977,537.23	48,516,768.26	-1,070.75
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-65,963,223.89	-205,419,634.21	-
其他业务收入	1,388,959,975.36	5,489,305,835.61	-74.70
业务及管理费	4,959,258,038.37	5,695,858,828.97	-12.93
信用减值损失	870,126,365.68	1,203,824,441.24	-27.72
其他资产减值损失	15,647,623.19	9,877,840.94	58.41
其他业务成本	1,017,534,717.51	4,763,462,030.79	-78.64
营业外收入	36,624,929.12	99,287,759.09	-63.11
所得税费用	676,352,013.39	1,326,992,645.72	-49.03
净利润(净亏损以“-”号填列)	1,229,524,063.23	3,924,731,802.09	-68.67
其他综合收益的税后净额	291,108,290.69	795,560,056.64	-63.41
综合收益总额	1,520,632,353.92	4,720,291,858.73	-67.79



## 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	2024年6月30日	2023年12月31日	增减幅度(%)
货币资金	85,606,918,763.17	79,625,885,997.64	7.51
融出资金	57,515,654,476.34	61,131,860,631.26	-5.92
存出保证金	2,705,418,719.74	5,961,707,957.91	-54.62
应收款项	1,857,275,766.87	7,131,698,579.32	-73.96
买入返售金融资产	28,876,077,498.82	31,788,485,388.71	-9.16
交易性金融资产	153,527,888,001.83	156,691,996,713.08	-2.02
其他债权投资	54,602,269,192.65	59,529,974,849.37	-8.28
其他权益工具投资	9,828,595,606.04	7,341,580,544.83	33.88
长期股权投资	45,436,519,334.66	47,524,308,319.81	-4.39
在建工程	105,382,387.14	69,369,174.98	51.92
递延所得税资产	240,722,168.24	986,294,745.59	-75.59
其他资产	7,603,968,059.13	3,941,336,582.95	92.93
拆入资金	17,250,038,488.89	12,373,421,049.99	39.41
交易性金融负债	7,535,956,205.73	12,960,092,783.48	-41.85
衍生金融负债	1,108,109,559.65	1,600,285,812.24	-30.76
卖出回购金融资产款	87,394,926,378.09	100,099,718,117.35	-12.69
代理买卖证券款	63,561,445,729.98	65,128,914,705.54	-2.41
应付款项	5,949,507,798.46	10,054,241,254.87	-40.83
应付债券	123,290,034,090.68	127,188,761,380.11	-3.07
其他负债	1,817,075,380.37	588,093,878.24	208.98
资本公积	74,757,884,043.68	74,757,884,043.68	-
其他综合收益	553,023,041.15	-145,958,672.15	-
未分配利润	36,622,356,278.95	34,844,750,010.95	5.10

项目	2024年1-6月	2023年1-6月	增减幅度(%)
手续费及佣金净收入	2,115,122,691.38	3,543,881,582.10	-40.32
利息净收入	756,634,800.74	1,211,799,389.53	-37.56
投资收益(损失以“-”号填列)	1,460,080,111.23	1,926,025,118.37	-24.19
其他收益	254,886,082.59	403,723,855.91	-36.87
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,143,128,978.77	381,397,252.22	461.92
汇兑收益(损失以“-”号填列)	1,026,787.22	-186,113,715.01	-
业务及管理费	2,821,701,390.56	3,248,664,360.21	-13.14
信用减值损失	71,334,729.48	34,303,152.25	107.95
营业外收入	7,060,151.89	14,311,030.13	-50.67
所得税费用	532,998,538.56	598,272,292.61	-10.91
净利润(净亏损以“-”号填列)	3,235,664,772.32	3,325,599,016.78	-2.70
其他综合收益的税后净额	541,085,227.96	242,874,800.72	122.78
综合收益总额	3,776,750,000.28	3,568,473,817.50	5.84

### 第三节 管理层讨论与分析



## 一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

报告期内，本集团所属行业情况请参见本节“三、经营情况的讨论与分析”。

集团主要业务有财富管理、投资银行、资产管理、交易及机构、融资租赁等，所从事的业务情况请参见本节“三、经营情况的讨论与分析”。

报告期内，集团实现营业收入 88.65 亿元、归属于母公司股东的净利润 9.53 亿元、总资产 7,214.15 亿元、归属于母公司股东的净资产 1,630.28 亿元。

## 二、报告期内核心竞争力分析

在长期经营过程中，公司逐步形成了具有自身特色的七大核心竞争力。

### 1. 聚焦新质生产力的服务价值链与客户生态圈

集团坚持践行国家发展战略，顺应深化金融体制改革和监管“两强两严”政策要求，深刻把握金融工作政治性、人民性，聚焦金融“五篇大文章”，坚守金融服务实体经济本源，推动培育新质生产力，成为国家战略的重要践行者和金融改革的重要探索者。有力融入“科技-产业-金融”循环，立足科创板聚焦支持科技创新，在半导体、高端装备、生物医药等众多“硬科技”创新领域打响海通品牌，形成市场影响力。顺应“绿色金融”新趋势，在投行、融资租赁及资产管理等各业务领域不断探索助力实现“碳达峰、碳中和”的金融服务手段，支持绿色产业和绿色项目发展。构建母基金生态圈与投资链，参与国家级基金、长三角产业基金的设立，聚焦推进临港新片区、上海先导产业等重点区域与行业服务。集团发挥专业力量，积极践行金融国企使命担当，以闭环的服务价值链，构建开放的客户生态圈，涌现了一批创新成果，成为持续提升公司竞争优势和品牌影响力的重要支撑。

### 2. 全功能布局的综合金融服务平台

以母公司业务出发，通过设立、收购专业子公司，集团不断扩充金融产品服务范围，延伸金融服务边界，已基本建成涵盖证券期货经纪、投行、自营、资产管理、私募股权投资、另类投资、融资租赁、境外银行等多个业务领域的金融服务集团。集团财富管理业务持续深化服务能级，提升资源整合效率；投资银行业务围绕科创企业全生命周期，发挥产融结合优势和资本市场功能，围绕关键产业链，在集成电路、生物医药等行业积极布局、重点开拓，业务排名行业前列；资产管理业务产品种类与管理规模持续提升；私募股权投资业务规模及品牌影响力行业领先；海外业务积极服务“一带一路”“粤港澳大湾区”等国家战略；融资租赁业务已确立并持续保持行业领先地位；研究服务市场影响力强。集团深入践行“一个海通”理念，深化“投、融、保、研”及财富管理业务线的协同联动，加强整体协同，有效推进业务落地。集团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

集团营业网点覆盖“纽、伦、新、港、沪、东”六大国际金融中心。截至报告期末，集团在中国境内拥有 345 家证券及期货营业部（其中证券营业部 311 家，期货营业部 34 家），遍布 30 个省、直辖市和自治区；境外方面，在亚洲、欧洲、北美洲、南美洲、大洋洲全球 5 大洲 15 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，集团得以建立庞大且稳定的客户群，截至报告期末，集团在境内外拥有超 2,500 万名客户。

### 4. 加速改革深化的国际跨境服务平台

通过收购整合海通国际、海通银行，设立上海自贸区分公司，集团建立了跨境综合金融服务平台，获得了亚太地区先发优势以及欧美地区的战略储备，伴随中国客户走出去、服务境外客户引进来，集团持续深化跨境业务深度协同。海通国际在 2024 年 1 月完成私有化的契机下，迈入新的发展阶段，在集团发展平台下不断夯实自身核心竞争力。港股 IPO 领域不断强化项目执行能力及品牌影响力，致力于提供全球范围的跨境投资银行服务；践行 ESG 理念，积极参与绿色及可持续发展债券发行；打造面向全球机构客户的全方位交易、研究与销售平台，持续优化面向企业家客户的私人财富管理模式，并着力布局环球家族办公室业务；资产管理领域业绩持续提升，率先探索产品创新。海通银行是深化集团国际化战略的重要储备，也是集团践行国家“一带一路”战略的重要承载平台，海通银行拥有在欧盟及南美市场上逾三十年的展业经验，具有全银行牌照，围绕企业银行、投资银行以及资产管理三大重点业务领域，在深耕本土业务的基础上，致力于开拓中国与欧洲、中国与拉丁美洲间的跨境业务合作。自贸区跨境业务方面，公司是首批加入上海自贸试验区 FTU（自贸区分账核算单元）体系的证券机构，持续助力上海自贸试验区金融高水平开放。2024 上半年，自贸区分公司围绕优化自由贸易账户功能，持续推动 FTU 业务拓展和集团内跨境业务联动。全方位多地区的国际业务平台有利于集团把握日益增长的跨境业务机会，满足客户的跨境业务需求，提升集团的国际影响力。

### 5. 领先的资本实力

公司通过 A+H 股上市、增发等多次战略性股权融资和债券融资，迅速增强并持续保持了雄厚的资本实力，净资产连续多年稳居行业前列。与机构投资者长期保持良好的合作关系，不断强化融资能力建设，有序推进各项融资计划，增强了公司流动性管理能力与风险防控能力，确保了境内外业务的健康有序发展。充足的资本为公司业务发展、满足客户的多元化金融服务需求、持续提升实体经济服务能力夯实了基础。

### 6. 稳健的经营理念

公司始终坚持“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念与“稳健乃至保守”的风险控制理念，在三十多年的经营中，成功渡过了多个市场和业务周期、监管改革和行业转型发展。公司基本建立了覆盖全集团的风险管理体系，落实全面风险管理要求，较为有效地管理市场风险、信用风险、流动性风险和操作风险等各类风险。公司依照监管规定，建立健全合规管理制度和组织体系，不断夯实合规审查、合规监测及合规检查等职能履行，保障与促进公司持续合规稳健发展。同时，公司始终坚持以风险为本的工作原则，严格按照反洗钱法律法规，采取相关措施，控制洗钱及恐怖融资风险。

## 7. 行业领先的金融科技创新能力

公司始终秉承“科技引领”发展战略，以建设“敏捷化、平台化、智能化、生态化”为核心特征的“数字海通 2.0”为目标，坚持关键技术自主可控，深入推进金融科技创新，已成为行业数字化转型的探索者、先行者。赋能业务成效持续深化，“e 海通财”打造集团生态、行业生态、用户生态于一体的综合财富服务入口，APP 月度活跃数继续保持行业前列；“e 海方舟”通过自研算法和市场主流算法相结合，打造海通特色的机构服务平台；“e 海通行”助力南北向跨境交易业务，为境内外机构投资者提供多样化、专业化的跨境投资交易及对冲工具；“e 海言道”大模型业务场景不断深入，推动金融服务提质升级；数字化底座持续夯实，证券公司中规模最大、设施最先进的自建科技园积极践行 ESG 理念，着力打造绿色低碳园区，成为行业首家上榜国家绿色数据中心名单的证券公司；数据治理水平持续提升，致力于构建价值驱动的高可信数据资产管理体系，通过数据管理能力国家标准认证，成为率先获评 DCMM 四级的证券公司之一；科技创新能力持续增强，截至报告期末，累计获得 38 项国家专利授权和 113 项软件著作权，数量位居行业前列。

## 三、经营情况的讨论与分析

### （一）总体经营情况

2024 年以来，公司以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，深入贯彻落实党的二十大、中央经济工作会议、中央金融工作会议等重要会议精神以及资本市场新“国九条”、证监会“两强两严”等政策文件精神，以建设金融强国为使命，以服务实体经济为己任，聚焦金融“五篇大文章”，做优做强主责主业，充分发挥综合金融服务优势和资本市场服务功能，有效行使直接融资“服务商”、资本市场“看门人”、社会财富“管理者”的职责，在深化业务改革创新、加强集团化业务协同、服务打造新质生产力等方面取得积极成效。

### （二）主营业务分析

#### 1. 财富管理业务

##### 市场环境：

报告期内，资本市场“1+N”政策体系逐步建立，高质量发展加速推进，引导财富管理业务秉承“以投资者为本”的经营理念，以提高专业水平和服务能力为立足点，在贯彻“强本强基”、适应“严监严管”中，加快推动向以客户为中心的买方服务模式转型，更好服务社会财富管理需求。

报告期内，股票市场延续震荡调整态势，股票、基金交投活跃度有所下滑，债券交易规模稳步增长。根据 WIND 数据，报告期内沪深两市股票、基金交易量达 230 万亿元，同比下降 7.62%；银行间和交易所市场债券结算量 1,280 万亿元，同比增长 4.05%。受股票市场波动影响，权益类基金规模有所下降，金融产品销售市场承压，根据 WIND 数据，报告期末股票型及混合型基金资产净值合计 6.16 万亿元，较上年末下降 2.05%。逆周期调节和监管政策不断落地，市场两融规模显著下降，根据 WIND 数据，报告期末市场融资融券余额达 1.48 万亿元，较上年末下降 10.30%。股票质押式回购业务持续回归服务实体经济本源，市场整体风险可控。

### 经营举措及业绩：

公司深耕客户需求，构建以客户为中心，以财富管理转型为方向，以资讯、产品、投研、投顾及工具为抓手的多层次客户服务体系，为零售客户、企业客户及同业客户提供综合金融解决方案。报告期内，公司股票、基金交易量合计 7.40 万亿元；期货代理交易量 13.09 万亿元（单边计算）；新开客户数量 69.60 万户，新开客户资产 767.26 亿元。报告期末，公司财富管理客户数量 1,875 万户，托管客户资产规模 2.61 万亿元。

### 公司代理交易额变化

	本报告期	上年同期
股票交易量（亿元）	58,360	66,514
基金交易量（亿元）	15,623	15,971
合计（亿元）	73,983	82,485

#### （1）零售业务

公司持续推进财富管理机构化转型，致力于全面提升面向客户全生命周期的综合金融服务能力。报告期内，公司加强国家重大发展战略区域网点覆盖，在北京、厦门等 6 个城市完成创新网点布设，已有 17 家综合创新网点正式开业，2 家网点正在筹建中。公司升级特色金融服务体系，发布园区金融服务方案，优化战略客户及区域合作生态和平台，与 29 家地方政府、园区、高校签署战略合作协议。公司构建企业家服务生态，组建长三角、京津冀、大湾区等五大区域企业家办公室，通过“投资银行 + 企业金融 + 私人金融”模式，优化存量客户服务体验，促进增量业务挖掘转换。公司基于买方投顾理念积极推动投顾业务布局和转型，不断提升“盈投顾”品牌影响力和服务能级，搭建“交易 + 理财 + 综合金融”立体式服务架构，强化以深度资讯、简讯、直播、策略会为代表的多层次、多维度、多元化客户服务工具，面向高净值客户持续推进“匠心 100”专户定制服务。

公司以“统一管理、自主可控、融合业务、引领发展”为指引，以高水平数字金融能力满足社会金融服务需求。报告期内，“e 海通财”APP9.0 以数字科技赋能客户交易、以智能策略驱动数字化运营，推动全链路“数智化”场景搭建，围绕 ETF 场景探索工具矩阵、内容社区、分级课程等线上特色服务，构建“指数投资到海通”品牌，为客户提供一站式线上财富管理服务；“e 海方舟”以全面支持机构交易场景为目标，通过提供软硬件极速柜台、算法商城等五大产品线构建贯穿交易全流程的一体化综合机构交易服务平台，通过金融科技赋能满足机构投资者通用性、专业性的需求，为机构投资者提供极致交易服务体验；通过打造机构业务“e 海方舟”和“乘舟听海”双品牌，助力公司机构业务生态发展。报告期内，“e 海通财”APP 月度活跃数 583 万人，行业排名第四；“e 海方舟”累计股票、基金交易量逾万亿元。

#### （2）金融产品销售业务

公司以优化客户体验为抓手提升产品保有量，通过强化销售组织、理顺沟通机制、优化系统平台、完善销售制度，不断加强与外部优质基金公司深度合作，并建立以产品细分为基础的专业化评估跟踪机制，覆盖公募、私募、资管等各类产品以及产品售前、售中和售后全生命周期。报告期内，公司构建以客户为中心的全光谱产品体系，在权益市场波动下通过固收类产品提前布局，金融产品保有规模实现稳中有增，同时发力“e 海通合”机构代销综合服务，机构客户产品保有量占比显著提升。报告期内，公司金融产品日均保有规模 1,304 亿元，同比增长 3.6%；债券型公募销售量 149 亿元，同比增长 108.9%；固定收益类私募产品销售量 113 亿元，同比增长 81.2%。

### (3) 融资类业务

公司融资类业务严格落实监管各项要求，强化业务逆周期调节，确保业务平稳有序发展。报告期内，融资融券业务坚持以合规为本，持续夯实业务基本盘，加强高净值客户和企业客户的拓展和服务，着力为客户需求提供综合解决方案，业务整体市占率稳中有升。股票质押业务聚焦金融服务实体经济定位，防范化解金融风险，积极引进优质项目，提升管理资产质量。报告期末，公司融资类业务规模 835.84 亿元，其中融资融券业务规模 608.53 亿元，股票质押式回购业务规模 227.00 亿元。

#### 公司融资类业务规模变化

	本报告期末	上年度末
融资融券余额（亿元）	608.53	655.62
股票质押余额（亿元） <sup>1</sup>	227.00	262.06
约定购回余额（亿元）	0.31	0.31
合计（亿元）	835.84	917.99

<sup>1</sup> 上表不含表外资管股票质押式回购业务，本报告期末表外资管股票质押式回购业务规模 48.03 亿元

### (4) 期货业务

海通期货各项业务稳步推进，市场地位持续巩固。报告期内，实现代理交易额 13.09 万亿元（单边计算），市场占比 4.65%，行业排名第四。报告期末，客户权益 422.08 亿元；期货资管业务规模 275.72 亿元，较年初增长 27%，行业排名第三。海通期货建立以衍生品类金融产品为核心的代销产品线，报告期内基金销售新增 15.35 亿元，同比增长 47.7%，集运（欧线）指数期货成交量 77 万手，金额 1,342 亿元，市场排名第二。公司荣获 2023 年度郑州商品交易所优秀会员、中国金融期货交易所优秀会员综合奖白金奖、上海期货交易所优秀会员等逾 40 项奖项。

### (5) 境外财富管理

海通国际财富管理团队不断优化产品与解决方案，以股票、债券、基金、衍生产品及另类投资产品的多元货架为基础，以专业投资顾问服务为抓手，提升全面的产品服务能力。报告期内，海通国际财富管理客户数量稳步提升，孖展规模有所下降，信用风险控制良好。

## 2. 投资银行业务

#### 市场环境：

报告期内，A 股市场发行节奏持续放缓，从严监管政策相继落地。根据 WIND 数据，全市场股权融资项目数量 159 家，同比下降 60.93%，融资金额 1,730 亿元，同比下降 73.90%；其中 IPO 项目数量 44 家，同比下降 74.57%，融资金额 325 亿元，同比下降 84.50%。北交所继续进行深化改革，新增上市公司 10 家，新三板新增挂牌企业 112 家，超过半数企业跻身创新层。

报告期内，我国债券发行增势不减，配置需求推动债市走强。根据 WIND 数据，各类债券发行合计 38.33 万亿元，同比增长 10.82%；其中利率债发行合计 12.24 万亿元，同比减少 1.46%；信用债发行合计 9.73 万亿元，同比增长 3.93%；同业存单发行合计 16.32 万亿元，同比增长 27.85%。

## 经营举措及业绩：

### (1) 股权融资

境内股权融资方面，公司积极落实国家战略和监管政策，持续建设功能性投资银行，着力服务科技创新和新质生产力发展，深入贯彻“行业化”“区域化”战略部署，继续强化品牌优势，稳固市场领先地位。同时，公司贯彻落实“一线要实、二线要专、三线要严”内部控制理念，进一步夯实合规风控建设，切实提高执业质量。报告期内，公司共完成股权融资项目 5 单，融资金额 29 亿元。公司坚定专业化路线，积极布局战略性新兴产业及未来产业，完成 4 单代表新质生产力的 IPO 项目，市场排名第一，融资金额 26 亿元，市场排名第五；其中，完成科创板 IPO 项目 1 单，市场排名第二，融资金额 6 亿元，市场排名第四。公司紧抓北交所深化改革、新三板挂牌增量机遇，报告期内完成新三板挂牌项目 2 单，申报新三板挂牌项目 12 单。公司大力推进申报工作，股权项目储备丰富，报告期末公司保荐的 IPO 在审及待发项目数量 24 家，再融资在审及待发项目数量 12 家。

#### 境内股权融资项目发行及项目储备情况

		本报告期	上年同期
首次公开发行	承销金额（亿元）	26.39	263.37
	承销家数	4	11
再融资发行	承销金额（亿元）	3.00	66.31
	承销家数	1	7
在审及待发项目数量	首次公开发行	24	67
	再融资发行	12	23

数据来源：WIND、中国证监会、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所

境外股权融资方面，海通国际致力于提供全方位的投资银行服务，发挥“一个海通”协同优势，在香港 IPO 保荐市场中保持领先地位。报告期内，海通国际完成香港联交所 IPO 保荐项目 4 单，项目数量和承销金额在香港所有中外资投行中分别排名第三和第四；完成香港 IPO 承销项目 3 单，港股二级股权融资承销项目 1 单。

### (2) 债券融资

境内债券融资方面，公司聚焦服务金融“五篇大文章”，持续助力金融强国建设。报告期内，公司主承销各类债券 560 只，承销金额 1,945 亿元。公司着力支持科技创新，主承销科技创新公司债券和科创票据 42 只，承销金额 106 亿元；持续支持绿色经济发展，主承销各品种绿色债券 19 只，承销金额 57 亿元；积极助力小微企业对接资本市场，主承销小微企业贷款专项金融债券 7 只，承销金额 49 亿元；拓宽金融创新渠道，助力发行全国首单总损失吸收能力（TLAC）非资本债券；支持人民币国际化进程，助力发行全球首笔非金融企业离岸人民币社会责任债券。

境外债券融资方面，海通国际作为核心主承销商，完成多笔具有代表性的明星交易，报告期内共完成债券发行项目 157 笔；积极推动可持续金融发展，深入践行 ESG 理念，完成 ESG 债券发行项目 22 笔，在 ESG 投融资领域保持中资金融机构领先地位；贯彻落实“一个海通”战略，通过境内外协同联动，完成 20 单境外发债项目及 1 单境内 ABS 项目；助力京东集团发行美元可换股优先票据 20 亿美元，助力公司发行全国最大规模兼首笔券商人民币玉兰债券，规模 35 亿元。



### 3. 资产管理业务

#### 市场环境：

报告期内，随着权益市场持续震荡，居民整体风险偏好降低，黄金、宽基指数、红利策略等安全资产需求旺盛，同时在利率下行、供给端增量节奏放缓的背景下，叠加手工补息暂停带来的“存款搬家”效果，债市需求强于供给，债牛行情推动固收类银行理财、公募基金产品规模持续增长。根据中国基金业协会数据，报告期末公募基金存续规模 31.08 万亿元，较上年末增长 12.62%。券商资管严格落实去通道、净值化的监管要求，资产管理规模持续压降。伴随券商资管主动管理能力的提升和业务结构的转型，在固收类产品的驱动下，券商资管私募产品规模企稳回升。根据中国基金业协会数据，报告期末证券期货经营机构私募资管存续规模 12.72 万亿元，较上年末增长 2.54%，其中证券公司及其资管子公司存量产品规模 5.80 万亿元，较上年末增长 9.30%。

#### 经营举措及业绩：

公司贯彻落实监管要求，持续提升主动管理能力，着力打造客户类型、投资市场以及投资策略全覆盖的产品体系，积极谋划资管业务转型并布局公募市场，推进资产管理业务高质量发展。报告期末，全集团资产管理业务总规模超 2.0 万亿元。

#### (1) 基金管理公司

报告期内，富国基金全面贯彻新“国九条”精神，重点围绕普惠金融、养老金融等推进业务高质量发展。报告期末，富国基金资产管理总规模约 1.5 万亿元。其中，公募基金规模逾 9,900 亿元，固收类产品增长显著；各类养老金业务有序推进，保持稳健增长态势，管理组合数量及管理规模续创新高。

报告期末，海富通基金资产管理总规模 4,221 亿元，较年初实现正增长，其中非货基金规模 1,145 亿元，较年初增长 11.7%。海富通基金债券 ETF 规模超 400 亿元，是目前国内市场中债券 ETF 数量最多、品类最全、管理规模最大以及投资运作经验最丰富的基金公司。

#### (2) 海通资管公司

海通资管公司顺应资管行业发展的大趋势，着力构建公募、私募产品条线，致力于打造投资策略全覆盖的资管产品体系。公募业务方面，17 只参公大集合产品已初步形成了产品风险等级由低到高、持有期限差异化的公募产品矩阵线，在充分控制投资风险的前提下，力求实现产品资产的增值。报告期内，在收益率下行的背景下，海通资管公司立足投资者需求，在精细化运作的基础上重点发力现金宝、安裕中短债、红利优选等产品，帮助客户在收益与风险间更好地实现平衡。私募业务方面，依托良好的投资历史业绩及市场口碑，以客户需求为导向，重点布局固定收益、量化、另类投资、组合投资和跨境资管的综合产品矩阵，为机构客户及高净值客户提供个性化、专业化、多元化的全方位服务。报告期内，海通资管公司面向高净值客户积极布局 FOF 产品，重点推进海外债券资产配置，成功发行公司首单集合 QDII 产品，为上海国际金融中心建设贡献力量。报告期末，海通资管公司资产管理规模 782 亿元，其中主动管理规模 771 亿元，占比达 98.60%，集合理财产品投资业绩市场排名前列。

## 海通资管公司业务规模及净收入变化

	本报告期		上年同期	
	资产管理规模 (亿元)	净收入 (万元)	资产管理规模 (亿元)	净收入 (万元)
集合资产管理	358	8,875	233	7,840
单一资产管理	142	2,302	187	2,084
专项资产管理	282	423	405	473
合计	782	11,600	825	10,397

### (3) 私募股权基金

公司私募股权投资基金始终牢记金融服务实体经济的本源，聚焦布局战略性新兴产业和未来产业，新增投资项目覆盖集成电路、新一代信息技术、新能源、新材料、航空航天等科技领域，有效践行“投早、投小、投硬科技”的投资理念。报告期内，新增投资项目 16 个，投资金额 10 亿元；完成 3 只基金的备案工作，合计认缴规模 38 亿元。报告期末，基金管理数量合计 63 只，基金管理规模合计 359 亿元。此外，积极探索赋能产业发展、助力产业升级的新模式，母基金业务加速开展，完成浦东新区引领区母基金和安徽海螺工业互联网母基金对 17 只子基金的投决工作，有效发挥海通母基金在培育耐心资本、助力科创企业发展方面的引领作用和放大效应。

报告期内，海通开元荣获“2023 年度中国最佳私募股权投资机构”“2023 年度中国最佳券商私募子公司”“2022-2023 年度中国最佳券商母基金”等奖项，获得市场广泛认可。

### 私募投资基金业务规模变化

	本报告期末	上年度末
管理基金数量	63	63
管理规模余额 (亿元)	359	333
累计投资项目数量	16	52
累计投资项目金额 (亿元)	10	31
项目退出 (含部分退出) 数量	35	64

### (4) 境外资产管理

海通国际资产管理团队强调客户导向，加速产品转型，优化资产结构，深度挖掘和服务客户在境内外市场的投资及配置需求，帮助海外机构客户投资中国市场。报告期内，围绕公司“海外产品中心与配置中心”战略定位，海通国际资产管理团队一方面持续深化战略转型，积极打造符合客户需求的市场化、标准化基金产品，提升外部客户资产管理规模；另一方面深入践行“一个海通”理念，加强跨境业务协同联动，助力打造投行生态圈和跨境生态圈。报告期内，外部客户资产管理规模新增约 20 亿港元，旗下基金产品荣获强积金评级、投资洞见与委托、亚洲资产管理等评选的多个奖项。海通银行进一步完善业务布局，资产管理子公司获得葡萄牙证监会批准从事可转让证券组合投资，澳门分行正式获批吸纳公共存款业务。

## 4. 交易与机构服务业务

### 市场环境：

报告期内，A股市场整体呈现先抑后扬再调整的走势，大小盘股分化显著，红利资产持续上行，上证指数、深证成指、创业板指分别下跌0.25%、7.10%、10.99%，沪深300小幅上涨0.89%。H股市场震荡上行，恒生指数上涨3.94%。央行货币政策相对宽松，债券市场总体走强，利率中枢持续下行，中债企业债总净价指数、中债国债总净价指数、中债总财富指数分别收涨1.49%、2.96%、3.83%。

### 经营举措及业绩：

#### (1) 交易业务

公司固定收益业务根据债券市场的变化，及时调整债券久期和结构，在实现较好投资收益的同时，积极服务国家战略，社会责任投资达163亿元。报告期内，公司荣获银行间市场外汇交易中心“X-Lending 活跃机构”、深交所“2023年度优秀利率债承销机构”、上交所“2023年度优秀债券投资机构（自营类）”等多个奖项。

公司权益投资业务以“防范风险、追求绝对收益”为目标，以“立足长期、追求稳健”为基调，通过专业化、精细化研究，做好即期利润和净资产增长的平衡。报告期内，公司坚持稳健的投资风格，以估值低、确定性强的高分红价值组合为基石，辅以部分成长型股票，更灵活地把握市场结构性机会。

公司衍生产品与交易业务通过场外衍生品工具提供丰富的表内非标准化衍生产品，解决客户策略管理、财富管理、全球资产配置和风险管理等全方位的需求。做市业务聚焦服务能级提升，积极践行社会责任，报告期末基金做市业务主做市品种超450只，头部基金公司全覆盖，做市标的类型涵盖股票型ETF、跨境ETF、债券ETF、货币基金、REITs等全部品种；股票做市业务积极发挥功能性作用，助力多层次资本市场发展，为76家新三板挂牌企业做市，市场排名第二；期权做市业务获得中金所“2023年度股指期货期权优秀做市商金奖”。

海通创新证券按照坚持“专业、专注”、坚持“两个聚焦”（聚焦重点行业、聚焦重点行业的头部企业）、践行“三个服务”（服务实体经济、服务国家科创战略、服务“一个海通”）的战略要求，积极推进优质项目储备，为可持续发展奠定基础。海通创新证券聚焦前沿科技领域，完善投资生态圈布局，参与设立上海三大先导产业母基金，认缴金额10亿元。

#### (2) 机构业务

公司机构业务完善顶层设计，围绕“信息共享、资源互补、专业协同”推出机构客户服务体系，成立机构业务委员会及业务部和区域中心，构建开放式机构客户经理、敏捷式机构销售团队、一站式机构客户服务，打造一支专业强、协同好、业绩优的高质量机构业务团队，提升公司机构客户综合服务能力和市场竞争力。公司推动研究体系改革，以链条化、国际化、立体化提升研究质量，构建“产研—投研—政研”研究新体系，积极发挥研究牵引和联动作用，加强研究与公司其他条线的合作力度，成为服务地方政府的智库、国企改革的智囊、区域发展的助手、企业成长的推手。此外，公司发挥海通国际海外研究和服务覆盖的优势，把握中资机构国际化发展迫切诉求和居民国际化配置资产需求，通过境内外多维度的属地化研究和调研，不断创新服务和产品，有力促进创收提升和价值挖潜，为机构客户充分展示海通机构业务的全球视角。

报告期内，公司机构业务发挥总分联动优势，形成北京、上海、广深三大区域中心，打通属地化和专业化的正向循环，在公募基金服务上保持高覆盖率，市场占有率稳中有升，保持市场前列，与银行理财子交易量、资管受托规模等取得突破。公司研究所对外发布报告 2,869 篇，举办电话会议 721 场，组织路演 14,542 余场，覆盖客户超 13 万人次。公司充分整合境内外研究和销售资源，举办“第二届香港科技医药策略会”“印度日”“日本日”“越南日”等主题论坛，为境内企业跨境投资和并购提供智库服务。

## 5. 融资租赁业务

### 市场环境：

报告期内，国家金融监督管理总局发布《金融租赁公司管理办法（征求意见稿）》，体现坚持回归租赁业务本源、严格准入标准和监管要求、坚持防控金融风险三大监管导向，对融资租赁行业的合规展业具备参考意义。国务院印发《推动大规模设备更新和消费品以旧换新行动方案》，围绕设备更新、消费品以旧换新、回收循环利用、标准提升四大行动部署具体措施，有利于提振内需，推动我国宏观经济延续回升向好态势。严监管为融资租赁行业健康发展提供有序的外部保障，扩需求为融资租赁业务发展提供了稳健的市场基础。融资租赁企业作为金融服务实体经济的纽带，立足租赁本源，在助力制造业升级，促进产业高端化、智能化、绿色化发展方面，具有广阔的市场前景。

### 经营举措及业绩：

报告期内，海通恒信紧抓服务国家战略主线，立足租赁本源，坚持金融服务实体经济的根本宗旨，围绕金融“五篇大文章”深耕产业细分赛道，不断深化产业化转型，助力国家现代产业体系建设。报告期内，海通恒信实现收入总额及其他收入 / 收益 40.29 亿元，实现期间溢利 8.12 亿元，海通恒信多措并举优化负债结构，持续降低负债成本，期间溢利较上年同期略有增长；生息资产平均收益率为 6.69%，加权平均净资产回报率为 8.55%。报告期末，海通恒信资产总额为 1,130.82 亿元，权益总额为 201.93 亿元。

### 报告期内公司经营情况的重大变化，以及报告期内发生的对公司经营情况有重大影响和预计未来会有重大影响的事项

适用 不适用

## 四、报告期内主要经营情况

截至 2024 年 6 月 30 日，集团总资产 7,214.15 亿元，归属于母公司净资产 1,630.28 亿元。2024 年上半年，集团实现营业收入 88.65 亿元，归属于母公司净利润 9.53 亿元；加权平均净资产收益率 0.58%。

## (一) 主营业务分析

### 1、财务报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	8,864,757,835.68	16,968,366,973.04	-47.76
营业成本	6,978,044,391.83	11,802,086,981.64	-40.87
经营活动产生的现金流量净额	19,282,151,341.47	-10,742,192,791.84	-
投资活动产生的现金流量净额	5,782,553,533.33	5,398,924,089.57	7.11
筹资活动产生的现金流量净额	-19,773,431,818.58	10,924,437,556.33	-281.00

#### (1) 营业收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额	上年同期	本期金额较上年同期变动比例 (%)	主要原因
手续费及佣金净收入	3,504,210,450.73	4,940,568,989.46	-29.07	主要是投资银行业务、经纪业务手续费净收入减少
其中：经纪业务手续费净收入	1,690,678,470.69	1,971,925,520.74	-14.26	主要是证券经纪业务净收入减少
投资银行业务手续费净收入	854,277,846.30	1,949,290,370.16	-56.17	主要是证券承销业务净收入减少
资产管理业务手续费净收入	841,205,938.43	932,465,708.29	-9.79	/
利息净收入	1,770,804,207.17	2,184,402,807.96	-18.93	主要是长期应收款利息收入减少
投资收益和公允价值变动收益	1,719,804,280.23	3,766,613,260.91	-54.34	主要是金融工具投资收益减少
其他业务收入	1,388,959,975.36	5,489,305,835.61	-74.70	主要是子公司销售收入减少
其他	480,978,922.19	587,476,079.10	-18.13	/
合计	8,864,757,835.68	16,968,366,973.04	-47.76	

#### (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	营业支出	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业支出比上年增减 (%)	毛利率比上年增减
财富管理	3,592,358,119.80	2,273,188,778.70	36.72	-13.30	-5.60	减少 5.17 个百分点
投资银行	969,186,006.74	916,420,572.02	5.44	-54.83	-29.62	减少 33.87 个百分点
资产管理	1,231,246,634.47	596,312,885.99	51.57	-5.09	-11.53	增加 3.53 个百分点
交易及机构	32,260,399.31	1,005,730,312.80	-3,017.54	-98.57	-14.66	减少 3,065.29 个百分点
融资租赁	2,283,962,505.99	1,328,609,197.03	41.83	-10.05	-17.56	增加 5.31 个百分点
其他	755,744,169.37	857,782,645.29	-13.50	-83.53	-81.46	减少 12.62 个百分点
主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业支出	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业支出比上年增减 (%)	毛利率比上年增减
上海	327,832,330.54	170,647,189.83	47.95	-7.33	-0.52	减少 3.56 个百分点
浙江	177,603,454.40	70,593,536.89	60.25	-9.53	3.46	减少 4.99 个百分点
黑龙江	148,786,258.54	84,031,259.71	43.52	-8.35	-4.56	减少 2.25 个百分点
江苏	139,240,857.90	78,019,867.14	43.97	-5.76	-2.62	减少 1.80 个百分点
山东	97,552,110.25	49,479,846.25	49.28	-7.40	-7.71	增加 0.17 个百分点
其他地区分支机构	737,314,708.49	496,854,351.62	32.61	-6.91	8.72	减少 9.69 个百分点
公司总部及境内子公司	6,373,915,642.49	3,690,110,433.44	42.11	-47.89	-53.85	增加 7.48 个百分点
境内小计	8,002,245,362.61	4,639,736,484.88	42.02	-42.80	-47.95	增加 5.74 个百分点
境外业务	862,512,473.07	2,338,307,906.95	-171.10	-71.05	-19.03	减少 174.17 个百分点
合计	8,864,757,835.68	6,978,044,391.83	21.28	-47.76	-40.87	减少 9.17 个百分点

2024年上半年，集团财富管理业务营业收入35.92亿元，同比（41.44亿元）减少5.52亿元，减幅13.3%，主要是融资类业务净收入同比减少；公司紧紧围绕服务实体经济和新质生产力发展，不断完善产品和服务体系，发挥公司“投、融、保、研”与财富管理协同发力的综合金融服务优势，切实提升金融服务实体经济质效。投资银行业务营业收入9.69亿元，同比（21.45亿元）减少11.76亿元，减幅54.8%，主要是IPO融资金额同比下降，公司股权承销收入减少。资产管理业务营业收入12.31亿元，同比（12.97亿元）减少0.66亿元，减幅5.1%，主要是管理费率下降；公司深入推进业务和功能转型，不断提升产品创新力度和投研能力，资管规模稳步提升。交易及机构业务营业收入0.32亿元，同比（22.56亿元）减少22.24亿元，减幅98.6%，主要是市场行情波动，投资收益和公允价值变动收益减少。融资租赁业务营业收入22.84亿元，同比（25.39亿元）减少2.55亿元，减幅10.0%，公司紧抓传统产业转型升级、现代化产业体系加速建设的机遇，加强战略谋划和系统布局，持续优化资产结构，稳步推进业务发展。

### （3）营业支出

单位：元 币种：人民币

成本构成项目	本期金额	上年同期	本期金额较上年同期变动比例（%）	主要原因
税金及附加	115,477,647.08	129,063,839.70	-10.53	/
业务及管理费	4,959,258,038.37	5,695,858,828.97	-12.93	主要是职工费用减少
信用减值损失	870,126,365.68	1,203,824,441.24	-27.72	主要是融出资金减值损失减少
其他资产减值损失	15,647,623.19	9,877,840.94	58.41	/
其他业务成本	1,017,534,717.51	4,763,462,030.79	-78.64	主要是子公司销售成本减少
合计	6,978,044,391.83	11,802,086,981.64	-40.87	

### （4）现金流

经营活动产生的现金流量净额为192.82亿元，其中：现金流入416.44亿元，占现金流入总量的25.62%，主要是收取利息、手续费及佣金的现金101.85亿元，为交易目的而持有的金融资产净减少额47.71亿元，收到其他与经营活动有关的现金181.13亿元；现金流出223.62亿元，占现金流出总量的14.22%，主要是回购业务资金净减少额87.88亿元，支付其他与经营活动有关的现金55.21亿元。

投资活动产生的现金流量净额为57.83亿元，其中：现金流入359.70亿元，占现金流入总量的22.13%，主要是收回投资收到的现金345.27亿元；现金流出301.87亿元，占现金流出总量的19.19%，主要是投资支付的现金298.86亿元。

筹资活动产生的现金流量净额为-197.73亿元，其中：现金流入849.58亿元，占现金流入总量的52.26%，主要是发行债券收到的现金453.09亿元，取得借款收到的现金396.45亿元；现金流出1,047.31亿元，占现金流出总量的66.59%，主要是偿还债务支付的现金956.02亿元。

## 2、本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

## （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

### 1、资产及负债状况

单位：元 币种：人民币

项目名称	本期期末数	本期期末数 占总资产的 比例 (%)	上年期末数	上年期末数 占总资产的 比例 (%)	本期期末金额 较上年期末变 动比例 (%)	情况说明
拆出资金	831,818,601.45	0.12	330,294,865.04	0.04	151.84	主要是拆出资金规模增加
应收款项	8,320,102,103.69	1.15	12,167,274,566.35	1.61	-31.62	主要是应收清算款减少
债权投资	4,712,994,209.36	0.65	6,797,779,540.34	0.90	-30.67	主要是境外国债投资规模减少
其他权益工具投资	10,416,425,857.16	1.44	8,010,844,169.78	1.06	30.03	主要是非交易性权益工具规模增加
拆入资金	19,504,997,024.24	2.70	14,712,363,886.93	1.95	32.58	主要是银行拆入资金规模增加
交易性金融负债	12,247,300,856.30	1.70	20,453,404,949.34	2.71	-40.12	主要是交易性金融负债规模减少
递延所得税负债	546,508,277.17	0.08	835,047,755.22	0.11	-34.55	主要是金融工具公允价值变动收益减少

#### 其他说明

#### (1) 资产状况

2024年6月末，集团总资产7,214.15亿元，较上年末（7,545.87亿元）减少331.72亿元，减幅4.40%。主要变动情况是：交易性金融资产、债权投资、其他债权投资、其他权益工具投资等金融资产减少136.52亿元，长期应收款及应收融资租赁款减少84.33亿元，融出资金减少44.74亿元。

集团交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资等金融资产占集团总资产的39%，货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的26%，长期应收款及应收融资租赁款占总资产的13%，融出资金占总资产的9%，买入返售金融资产占总资产的5%，固定资产、使用权资产、在建工程及投资性房地产占集团总资产的3%，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。

#### (2) 负债状况

2024年6月末，集团负债总额5,502.23亿元，较上年末（5,797.87亿元）减少295.64亿元，减幅5.10%。主要变动情况是：卖出回购金融资产款减少128.39亿元，交易性金融负债减少82.06亿元，应付短期融资款及应付债券减少77.51亿元。

### 2、境外资产情况

#### (1) 资产规模

境外资产2,167.71亿元，占总资产的比例为30.05%。

#### (2) 境外资产占比较高的相关说明

适用 不适用

境外资产情况请参见本报告“第三节 管理层讨论与分析 四、报告期内主要经营情况（六）主要控股参股公司分析”的相关内容。

### 3、截至报告期末主要资产受限情况

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见本报告“第九节 财务报告 五、合并财务报表项目注释（一）货币资金，（八）买入返售金融资产，（九）交易性金融资产，（十）债权投资，（十一）其他债权投资，（十二）其他权益工具投资，（十三）应收融资租赁款及长期应收款，以及（十六）固定资产。”

### 4、其他说明

适用 不适用

## (四) 投资状况分析

### 1、对外股权投资总体分析

报告期末，集团长期股权投资 75.61 亿元，较上年末（81.16 亿元）减少 5.55 亿元，减幅 6.84%。子公司投资参见本报告“第九节 财务报告”中“五、合并财务报表项目注释（十四）长期股权投资”。

#### (1) 重大的股权投资

适用 不适用

#### (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

公允价值计量的金融资产参见本报告“第九节 财务报告”中“十三、其他重要事项（二）金融工具计量基础分类表”。

#### 证券投资情况

适用 不适用

#### 证券投资情况的说明

适用 不适用

#### 私募基金投资情况

适用 不适用

#### 衍生品投资情况

适用 不适用

证券投资、私募基金投资、衍生品投资为公司主营业务，交易频繁、交易品种类别较多，且公司已在本报告“第九节 财务报告”中披露了投资类别、公允价值变动、投资收益等情况，因此不再按照证券明细披露相关情况。



## (五) 重大资产和股权出售

适用 不适用

## (六) 主要控股参股公司分析

1. 海通创新证券, 注册资本 115 亿元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 海通创新证券总资产为 195.06 亿元, 净资产 192.78 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 -6.67 亿元, 净利润 -4.48 亿元。

2. 海通国际控股, 注册资本 111.80 亿港元, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 海通国际控股总资产为 1,126.96 亿港元, 净资产 13.82 亿港元; 2024 年上半年, 实现收入 -16.97 亿港元, 净利润 -28.73 亿港元。

3. 海通开元, 注册资本 55 亿元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 海通开元总资产为 81.41 亿元, 净资产 74.53 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 -3.97 亿元, 净利润 -3.37 亿元。

4. 恒信金融集团, 注册资本 41.46 亿港元, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 恒信金融集团的总资产为 1,139.16 亿元, 净资产 212.05 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 24.05 亿元, 净利润 8.24 亿元。

5. 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 2024 年 6 月 30 日, 海通资管公司的总资产为 59.88 亿元, 净资产 57.78 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 1.94 亿元, 净利润 0.49 亿元。

6. 上海惟泰置业, 注册资本 1,000 万元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 上海惟泰置业的总资产为 2.73 亿元, 净资产 0.16 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 0.12 亿元, 净利润 97.84 万元。

7. 海通期货, 注册资本 13.015 亿元人民币, 海通证券持有 83.22% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 海通期货总资产为 487.66 亿元, 净资产 37.86 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 13.37 亿元, 净利润 1.19 亿元。

8. 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 2024 年 6 月 30 日, 海富通基金总资产为 38.11 亿元, 净资产 26.58 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 4.54 亿元, 净利润 1.34 亿元。

9. 富国基金, 注册资本 5.2 亿元人民币, 海通证券持有 27.775% 的股权。截至 2024 年 6 月 30 日, 富国基金总资产为 133.69 亿元, 净资产 82.08 亿元; 2024 年上半年, 实现营业收入 29.18 亿元, 净利润 7.74 亿元。

## (七) 公司控制的结构化主体情况

公司对期末持有的结构化主体, 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 58 个结构化主体纳入合并报表范围。

## 五、其他披露事项

### (一) 可能面对的风险及应对措施

#### 1、风险管理概述

本集团一直以来注重对风险的防范与控制,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、风险管理优先的原则。

本集团根据《证券公司全面风险管理规范》等监管要求及内部制度,从全覆盖、可监测、能计量、有分析、能应对等方面持续完善全面风险管理体系建设,强化风控指标并表管理,健全集团 T+1 风险数据集市;搭建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、各单位,不断完善风险识别、评估、计量、监控、报告和应对;建立多层次风控指标体系,通过系统实现监控和预警,并通过开展压力测试评估极端风险影响;加强同一客户、同一业务风险管理,完善集团风险限额体系并向部门、子公司拆解;建立集团智能预警平台,提升风险预判预警能力;开展市场风险、信用风险、流动性风险计量,建立模型管理机制并持续对模型开展评估和验证;定期编制集团风险报告,针对重大风险事件编制专项报告;选择合适的应对策略,建立有效的应对机制以及具有可操作性的应急预案。此外,本集团从文化建设、制度建设、数据和系统建设、人才队伍建设、加强风控投入等方面为全面风险管理提供保障和支持。

#### 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》等法规及公司规章制度要求,搭建了多层次的风险管理组织架构,明确了董事会、监事会、经营层、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、经营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、评估及应对工作,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问题缺陷,审议处理公司重大风险事件,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,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,对风险管理中存在的问题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，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，督导公司各单位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，公司合规管理部负责管理公司合规风险、洗钱及恐怖融资风险，公司资金管理总部负责管理公司流动性风险，公司总经理办公室负责管理公司声誉风险，公司信息技术管理部门负责管理公司信息技术风险。

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本单位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。

公司稽核审计部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。

各子公司规范运作，依法经营。公司将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，对其风险管理工作实行垂直管理，每日开展风控指标并表管理，建立了集团 T+1 风险数据集市，并从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、重大事项审批、风险数据对接、风控指标并表、风险督导检查、风险考核评价等方面落实对子公司的垂直风险管理。

### 3、各类风险的应对措施及其报告期内表现

本集团业务经营活动面临的风险主要有：合规风险、洗钱及恐怖融资风险、信用风险、市场风险、操作风险、流动性风险、声誉风险，具体情况如下：

#### (1) 合规风险

合规风险是指因证券基金经营机构或其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证券基金经营机构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风险。

公司按照合规管理监管要求，并结合公司的实际情况，建立科学合理、职责分明的合规管理架构体系，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，合规部门、其他内控部门、公司下属单位分工明确，协调互动。公司制定《海通证券股份有限公司合规管理办法》及配套制度，配置合规管理人员队伍体系，通过合规事前审查、事中监测、事后检查、考核及问责，严格开展合规管理，同时加大合规宣导工作力度，积极培育“人人合规、主动合规”的经营环境。

报告期内，本公司在稳步有序开展合规审查、合规检查、合规监测等合规管理基础工作的基础上，坚持目标导向、问题导向，夯实对重点领域的执行保障支持力度，提升合规与业务的双向融合，加强集团合规管理建设，积极培育人人合规、主动合规、持续合规、全面合规的合规文化。

## （2）洗钱及恐怖融资风险

公司根据《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》，制定了《海通证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法》，建立健全董事会负责下的反洗钱组织架构，形成公司反洗钱领导小组统筹协调、合规部门牵头组织实施、相关业务部门和分支机构落实执行的反洗钱管理体系。公司建立了包括集团洗钱风险管理制度、公司反洗钱基本制度及其他配套制度和操作规程等在内的反洗钱管理制度体系，制定以“风险为本”的洗钱和恐怖融资风险管理策略，针对公司各业务条线面临的不同风险状况采取相应的风险管控措施，并通过培训和宣传促进洗钱风险管理文化传导，营造良好的洗钱风险管理文化氛围，积极防范洗钱和恐怖融资风险。

报告期内，本公司持续完善洗钱和恐怖融资风险管理机制，全面推进洗钱和恐怖融资风险管理文化宣导，提升公司洗钱和恐怖融资风险管理水平。一是进一步加强信息技术对洗钱和恐怖融资风险管理的支持，研究优化监测模型，提升监测和报告针对性和有效性。二是加强洗钱风险管理文化建设，开展反洗钱专项培训，提升一线单位反洗钱履职能力。三是积极履行反洗钱宣导义务，通过公司微信公众号发布宣传材料，结合5·15全国打击经济犯罪宣传日组织开展宣传活动，提高投资者洗钱和恐怖融资风险防范意识。

## （3）信用风险

信用风险是指因融资人、交易对手方或债务发行人无法履行其约定的财务义务或信用资质发生不利变化而可能造成损失的风险。本集团目前面临的信用风险主要集中在交易性融资业务（如融资融券、股票质押式回购、孖展交易）、信用债券交易与投资业务、融资租赁业务、场外衍生品业务等。

针对交易性融资业务，本集团通过制定和实施各项严格的制度和措施，主要从尽职调查、内部评级、项目评审、授信管理、逐日盯市、限额监控、贷后跟踪、补充增信、平仓处置、司法追索和拨备计提等环节实施管控。

针对信用债券交易与投资业务，本集团注重通过分散投资控制集中度风险，投资标的主要倾向于高信用评级资产，在信用风险管理中密切跟踪投资标的的经营情况和信用评级变化，落实内部评级和统一授信管理机制，建立健全债务发行人、行业和地域集中度等信用风险监控指标，在投后跟踪中及时根据财务指标变动、重大风险事件和负面舆情等信息更新债务发行人内部评级和授信限额指标，动态调整交易策略。

针对融资租赁业务，本集团坚守服务实体经济本源，坚持以行业与客户并重的策略确定信用风险管理政策。行业层面上，本集团就融资租赁客户所处行业的景气程度施行动态跟踪和评估，以此为基础制定相应的行业投放政策、管控行业集中度风险。客户层面上，本集团主要通过开展尽职调查、内部评级、授信审核、贷后资产巡检、风险预警与监测、集中度限额控制等措施对客户信用风险实施管控。

针对场外衍生品业务，本集团从交易对手准入和授信管理、标的证券管理、风险应对与处置等方面建立了完善的管理制度与流程，对存续期内的场外衍生品交易进行逐日盯市，并通过严格履行净额结算和履约保障等措施管理交易对手信用风险。同时，本集团关注信用风险和市场风险之间的相关性，对市场波动背景下的信用风险采取必要的监控和应对措施，包括但不限于交易保证金安排、交易对手内部评级与授信管理、未来潜在风险暴露计量、错向风险识别等。

本集团根据行业监管政策、资本市场环境和集团业务发展战略，持续完善信用风险管理体系。报告期内，本集团以信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作。一是依托集团智能预警中心的建设成果，制定信用风险预警管理制度，全面推广预警工作机制在全集团的应用，落实并完善业务事前、事中及事后的风险监测，赋能业务发展、增强风险预警预判能力；二是基于集团 T+1 风险数据集市，持续优化信用风险管理系统，完善内部评级体系，提升风险识别、计量与压力测试能力，从资产质量、风险抵补和集中度风险等多个维度完善信用风险限额体系；三是坚持风险管理关口前移的工作思路，全面修订法人客户信用评级管理办法，持续强化信用风险评估的前瞻性、及时性和规范化程度。报告期内，本集团核心信用风险监控指标运行平稳，整体信用风险可控。

针对融资类三项业务，公司主动优化业务结构，审慎评估新做项目，强化存续项目的跟踪、监控和管理，加大存量风险项目追偿力度并审慎、前瞻地计提信用减值准备，确保风险拨备计提充分。截至报告期末，公司融资融券存量负债客户的平均维持担保比例为 251.01%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为 288.24%，股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为 207.01%，融资人提供的担保品较为充足，信用风险整体可控。

#### (4) 市场风险

市场风险是指因市场价格的不利变动而使自有资金投资的相关业务发生损失的风险。市场风险的类别主要包括股票价格风险、利率风险、汇率风险和商品价格风险。

针对股票价格风险，本集团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，是本集团主要面对的市场风险类型之一。集团密切关注相关资产价格波动，并采取相应措施予以防范，通过每日跟踪证券持仓的投资规模和风险价值（VaR）变化情况进行监测和管控。集团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。

针对利率风险，本集团承担此类风险的业务主要包括债券投资业务和利率衍生品业务等。本集团对利率风险的控制，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。

针对汇率风险，本集团面对复杂多变的境外市场，持续跟踪研究外汇市场，不断完善制度建设和内部管理，通过套保等一系列措施对冲、缓释汇率风险。集团注重外币资产和负债的匹配，以控制外汇风险的敞口。

针对商品价格风险，本集团相关风险敞口较低，主要通过商品期货、期权等商品衍生工具进行对冲，以管理商品风险。

除上述风险因素之外，本集团所从事的境外投资交易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。报告期内，根据集团市场风险管理方法的有关要求，公司不断推进落实集团层面市场风险的识别、评估、计量、监测、应对和报告等程序，将子公司投资交易业务纳入整体市场风险管理体系内。对于集团下属子公司进行的投资交易业务，通过制定并分配风险价值限额、止损限额等市场风险限额指标进行管控，并基于 T+1 风险数据集市、集团市场风险管理系统、风险报告等工具或手段，对子公司市场风险状况和风险限额执行情况进行跟踪和监督。

本集团通过以风险价值为主的市场风险量化指标体系对各项投资交易类业务承担的市场风险情况进行计量和管控。风险价值指在一定的置信水平下，投资组合在未来特定前瞻期内因市场波动而产生的最大可能损失，是衡量市场风险的主要指标。本集团风险价值模型的具体计量参数为 95% 置信水平、1 日前瞻期，模型计量的覆盖范围包括集团层面持有的权益、利率、外汇等各类金融资产和衍生品。本集团通过返回检验等手段，持续监控和评估风险价值模型的有效性，并随着业务发展和风险管理的需要持续完善风险价值模型。此外，本集团建立压力测试管理机制作为风险价值模型的重要补充，通过构建各类历史情景和模拟情景以及相应的压力测试传导机制，衡量投资交易业务可能面临的极端损失情况，并评估损失是否在可承受范围内。报告期内，本公司各月月末风险价值占本公司净资产的比例、以及本集团风险价值占本集团净资产的比例均保持在 0.2% 以内，市场风险可控可承受。

#### （5）操作风险

操作风险是指由内部流程缺陷、人员失误或不当行为、信息系统缺陷或故障，以及外部因素等原因而造成损失的风险。操作风险贯穿于业务开展与日常运营过程中的各个环节，并可能导致法律风险、合规风险、声誉风险等其他风险。本集团以操作风险管理办法等制度为依据，利用风险与控制自我评估、关键风险指标、损失数据收集等风险管理工具开展操作风险识别、评估、监测、报告等工作。本集团每年开展年度风险与控制自我评估，并根据监管要求及新业务、新产品开展情况进行专项风险与控制自我评估。建立了覆盖集团主要部门及子公司的关键风险指标体系，对关键风险指标开展监测工作。在集团范围内开展操作风险事件收集工作，监控风险事件发生情况及进展，并针对风险事件揭示的问题及时排查分析并制定相应的整改措施。报告期内，本集团根据中国证券业协会发布《证券公司操作风险管理指引》，持续完善操作风险管理体系建设，进一步推进优化集团操作风险管理的机制流程，提升操作风险管理工具的应用实效。

信息技术风险是指在借助信息技术手段从事证券基金业务活动中，由于自然因素、人为因素、技术漏洞和管理缺陷产生的风险。本集团持续加强信息技术管理的制度建设，不断完善网络与信息安全事件应急预案，定期进行应急演练，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、系统建设、信息安全、科技管理等方面的信息技术相关情况进行监控和管理，防范信息技术风险。报告期内，本集团持续加强信息技术系统的建设和运维，严格按照操作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。

#### （6）流动性风险

流动性风险是指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。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，公司按照风险偏好及限额的要求，通过合理的监测和调控手段，始终确保流动性风险可测、可控和可承受，同时储备了充足的优质流动性资产，以保障公司业务的开展和到期负债的偿付。公司开展日间流动性和风险指标管理，结合资产端和负债端，构建资金、指标联动体系，完善了包括日间指标头寸跟进、月度指标前瞻分析和部门指标拆解在内的流动性风险分析框架，丰富了不同期限内流动性风险管理的工具，提升了公司流动性风险管理和预判的效率。

在中长期流动性风险管理方面，公司不断优化资产配置结构，强化对资产负债发展趋势的分析，从源头上把控流动性风险。一方面，公司成立资产负债配置委员会，积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势、潜在中长期资金需求，调整负债期限结构，保持资产负债的期限、规模的

合理匹配；另一方面，公司持续提升流动性精细化管理水平，负债端结构和到期日分布更趋合理，也保证资产端在安全性、流动性、收益性之间的平衡。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。

此外，公司稳步推进对集团和子公司流动性风险管理的要求，以集团流动性风险管理办法为指引，根据各子公司业务特点制定了较为科学有效的流动性风险管理策略，基本实现集团层面流动性风险的统一管理。首先，公司以流动性风险管理为基础，从风险和资产负债管理等方面持续对子公司实行分类管理，并从组织制度保障、风险管控框架、风险应对手段三个维度提出不同要求，指导子公司完善其流动性风险管理体系；其次，以流动性风险并表指标为基础，根据各子公司所处行业、地域和风险特征的差异，下发各子公司的限额管理要求，以更有效地监测各子公司的流动性风险实质情况；最后，为强化集团流动性风险处置能力，公司持续完善集团流动性支持体系，牢牢守住集团不发生流动性风险的底线。

报告期内，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。公司通过市场研判，抓住利率低位时点及时通过发债增加资金储备并续作各项到期负债，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。报告期内，公司核心流动性监管指标流动性覆盖率日均 344.57%，净稳定资金率日均 148.86%，均高于监管要求及预警标准。

#### (7) 声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件，以及工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害公司品牌价值，不利于公司正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。本集团不断加强舆情工作的前瞻性和主动性管理，持续满足监管部门关于声誉风险系统化管理的要求，通过修订制度、强化意识、打磨流程、巩固队伍等举措不断强化母子公司、境内境外协同处置效能。在中国内地和中国香港建立传播渠道，围绕经营亮点强化主动宣传，为集团发展营造良好的舆论环境。针对少数负面舆情，严格遵循全程全员、预防第一、审慎管理、快速响应的基本原则，科学研判、做足预案、主动应对，及时把握舆情走势。与主流媒体保持良好沟通，做好舆论引导，维护集团品牌形象。报告期内，集团总体舆论环境良好。

## (二) 其他披露事项

### 经营计划进展说明

2024年上半年，我国经济总量稳定，实现良好开局。在总体战略的指引下，公司深入践行“一个海通”理念，聚焦金融“五篇大文章”，发挥综合金融服务优势，深化改革、强基固本，做优做强主责主业，充分发挥资本市场服务功能。

在“科技金融”方面，公司围绕打造新质生产力，服务高水平科技自立自强。私募股权投资及直投业务线聚焦前沿科技领域，完善投资生态圈布局；投资银行业务线助力企业登陆科创板，主承销多只科技创新公司债和科创票据。在“绿色金融”方面，公司在 ESG 体系建设、绿色融资、绿色投资、绿色研究、绿色运营方面助力产业转型升级，服务国家“双碳”目标。在“普惠金融”方面，公司助力小微企业发展，满足居民财富管理需求。财富管理业务线产品持有客户数持续增长；大投行业务线积极助力小微企业对接资本市场；海通恒信持续深耕小微高端装备制造、小微工程机械、小微医疗等

融资租赁业务；海通期货不断丰富三农风险管控手段。在“养老金融”方面，公司支持多层次养老保障体系建设，通过递延养老基金产品、养老 FOF、“居家养老设备租赁产品”等产品积极引导科学养老与资本市场的良性互动，助推银发经济快速发展。在“数字金融”方面，公司以“统一管理、自主可控、融合业务、引领发展”为指引，以高水平数字金融能力满足社会金融服务需求，强化顶层设计，扎实推进公司数字化转型。与此同时，公司持续深化改革，机构业务改革不断向纵深推进，区域合作生态圈提速扩容，助力证券交易市场平稳发展，分支机构高质量发展迈上新台阶，境内外协同发展成效显著。公司回归本源，谋求发展新成效，做好直接融资“服务商”，做实社会财富“管理者”，当好资本市场“看门人”。公司推陈出新，打造“银证保”合作新模式，不断提升央企服务能级。公司强基固本，持续提升运营质效、管理能级。

2024 年下半年，公司将平衡功能性与盈利性，紧紧围绕服务实体经济和新质生产力发展，在做好金融“五篇大文章”方面持续加力，不断完善产品和服务体系，具体的业务重点包括：财富管理业务线以做大产品规模、提升产品服务能力为目标，组建创新型服务团队，建立长效服务机制。投资银行业务线加速推进并购重组业务开展，加大产业类债券、金融债等产品的投入力度，优化境内外协同机制，并进一步压实“三道防线”责任。资产管理业务线瞄准养老金融、普惠金融领域精准发力，打造具有市场竞争力的投研团队与满足不同投资者需求的全产品线。交易及机构业务线进一步提升投资管理能力，加强业务风险监测预警，通过链条化、国际化、立体化提升研究质量，打造差异化、精准化、专业化的服务策略。私募股权投资及直投业务线加强行业聚焦，深耕重点投资方向，并以投资上海三大先导产业母基金为契机，探索向科创策源前端延伸和布局。海外业务线巩固境外投行品牌优势，推进全业务链条“垂直”一体化管控，实现境内外业务的深度协同发展。融资租赁业务线加快产业化转型发展，扩大产业生态圈，促进政策利好领域的业务投放。与此同时，公司下半年还将围绕高质量的合规内控、科技运营、财资管理、集团化管理等体系建设，提升管理工作效能，护航公司高质量发展。



## 第四节 公司治理



## 一、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	会议决议
2023 年度股东大会	2024 年 6 月 12 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2024 年 6 月 13 日	详见下文“股东大会情况说明”
2024 年第一次临时股东大会	2024 年 7 月 18 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2024 年 7 月 19 日	详见下文“股东大会情况说明”

### 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

#### 股东大会情况说明

本报告期内，公司于 2024 年 6 月 12 日在海通外滩金融广场召开了 2023 年度股东大会，审议并通过 12 项议案：1. 公司 2023 年度董事会工作报告，2. 公司 2023 年度监事会工作报告，3. 公司 2023 年度独立董事述职报告，4. 公司 2023 年年度报告，5. 公司 2023 年度财务决算报告，6. 公司 2023 年度利润分配预案，7. 关于提请股东大会授权董事会决定公司 2024 年中期利润分配的议案，8. 关于预计公司 2024 年度自营投资业务配置规模的议案，9. 关于预计公司 2024 年度对外担保的议案，10. 关于预计公司 2024 年度日常关联 / 连交易的议案，11. 关于选举韩建新先生为公司董事的议案，12. 关于修订《公司章程》的议案。其中议案 1 至议案 11 为普通决议案，议案 12 为特别决议案。

本报告披露日前，公司于 2024 年 7 月 18 日在海通外滩金融广场召开了 2024 年第一次临时股东大会，审议并通过 2 项议案：1. 关于聘请 2024 年度会计师事务所的议案，2. 关于更换公司监事的议案。

上述股东大会决议公告于会议当日刊登在香港联交所披露易网站（<http://www.hkexnews.hk>），于会议次日刊登于上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》。

## 二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

姓名	担任的职务	变动情形
韩建新	董事	选举
谢维青	非职工代表监事	选举
李争浩	非职工代表监事	离任
姜诚君	副总经理	离任

### 公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

#### 1. 董事变更情况

2024 年 4 月 26 日，公司召开的第八届董事会第五次会议审议通过了《关于提名韩建新先生为公司董事候选人的议案》，同意提名韩建新先生为公司第八届董事会董事候选人。2024 年 6 月 12 日，公司召开的 2023 年度股东大会审议通过了《关于选举韩建新先生为公司董事的议案》，同意选举韩建新先生为公司第八届董事会董事，任期自股东大会审议通过之日起至第八届董事会任期届满之日止。详见公司 2024 年 4 月 27 日于上交所网站披露的《第八届董事会第五次会议决议公告》（公告编号：临 2024-023）和 2024 年 6 月 13 日于上交所网站披露的《公司 2023 年度股东大会决议公告》（公告编号：临 2024-037）。

## 2. 监事变更情况

2024年6月27日，公司召开的第八届监事会第六次会议（临时会议）审议通过了《关于更换公司监事的议案》，李争浩先生因工作调动原因，不再担任公司第八届监事会监事，同时推荐谢维青先生为公司第八届监事会监事候选人。该议案经2024年7月18日召开的公司2024年第一次临时股东大会审议通过，谢维青先生自2024年7月18日起担任公司第八届监事会监事，任期自股东大会审议通过之日起至第八届监事会任期届满之日止。详见公司2024年6月28日于上交所网站披露的《公司第八届监事会第六次会议（临时会议）决议公告》（公告编号：临2024-039）和2024年7月19日于上交所网站披露的《公司2024年第一次临时股东大会决议公告》（公告编号：临2024-046）。

## 3. 高级管理人员变更情况

姜诚君先生因个人原因向董事会申请辞去公司副总经理职务，其辞任自辞职报告送达公司董事会之日起生效。详见公司2024年8月1日于上交所网站披露的《关于副总经理辞职的公告》（公告编号：临2024-049）。

# 三、公司董事、监事、高级管理人员及员工其他情况说明

## （一）董事、监事及有关雇员之证券交易

本公司已采纳《标准守则》所订标准作为本公司董事、监事及相关雇员进行证券交易的行为准则。本公司经查询全体董事及监事后，已确认他们于本公司2024年1月1日起至2024年6月30日期间一直遵守上述《标准守则》的要求。本公司没有发现有关雇员违反指引。

## （二）董事、监事相关信息的重大变更

独立董事毛付根先生自2024年7月起不再担任中红普林医疗用品股份有限公司（于深交所上市，股票代码：300981）独立董事。

独立董事范仁达先生自2024年2月起不再担任金至尊集团（国际）有限公司（前称香港资源控股有限公司，于香港联交所上市，股份代号：2882）董事。

监事李争浩先生（已离任）自2024年1月起担任申能财产保险股份有限公司党委副书记，自2024年4月起不再担任申能（集团）有限公司财务部总经理，自2024年6月起不再担任申能股份有限公司董事，自2024年6月起不再担任上海燃气有限公司董事。

除上述披露者外，概无其他本公司之董事及监事的资料须根据香港上市规则第13.51B（1）条予以披露。

## （三）董事、监事服务合约的说明

本公司与本公司任何董事或监事以其各自作为董事／监事的身份而言，并无订立亦不拟订立任何

服务合约（于一年内届满或可由雇主于一年内终止而毋须支付赔偿（不包括法定赔偿）的合约除外）。

## （四）员工及薪酬政策

截至报告期末，集团员工人数 13,346 人。其中母公司员工人数 8,182 人，子公司员工人数 5,164 人。

公司重视人才的吸引、激励、培养和保留，不断检视和优化薪酬体系，坚持市场化分配、绩效导向、兼顾公平的激励原则，持续完善薪酬递延支付、追索扣回等机制。公司员工薪酬由固定薪酬、绩效薪酬和福利三部分构成。公司依据适用的相关法律法规，为员工建立各项社会保险（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各项社会保险费和住房公积金。公司建立企业年金计划，为员工提供补充养老保障，并为员工投保补充医疗保险和人身意外保险。

公司根据适用的相关法律法规，与员工签订劳动合同，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。

## （五）员工培训

2024 年上半年，培训工作坚持统筹规划、系统培养、训战结合、赋能发展，围绕公司战略布局、一个海通协同，依托海通党校和海通财富研修院两个平台，统筹开展实践历练、专题培训和在线传授。不断完善培养体系，推进首批公司总部中后台部门干部员工与业务部门、子公司干部员工进行轮岗交流。启动 2024 年“青年人才训练营”，选拔各层次人才进行跨单位岗位锻炼。分批次推动总部校招新员工到分支机构经受锻炼。不断优化培训形式，开展三期“学习贯彻习近平总书记考察上海重要讲话和在深入推进长三角一体化发展座谈会上的重要讲话精神”专题培训班，近 200 名领导干部参训。升级“蒲公英计划”，联合分、子公司开展专题培训。开展“海星计划”新员工培训，启动“海贝计划”分公司储备人才培养项目，开展集中培训和系统辅导。不断丰富培训内容，上半年，海通财富研修院共上线 578 门课程，设置专题学习课程，组织开展专题直播和主题活动，促进内部资源共享和协同共建。

# 四、利润分配或资本公积金转增预案

## （一）报告期实施的利润分配方案的执行或调整情况

公司于 2024 年 6 月 12 日召开 2023 年度股东大会，审议通过了公司 2023 年度利润分配预案；以截至股权登记日公司总股本 13,064,200,000 股扣除公司回购专用证券账户的股份 77,074,467 股，即 12,987,125,533 股为基数计算，共计派发现金红利人民币 1,298,712,553.30 元（含税）。其中 A 股股本为 9,577,556,713 股（扣除回购专用账户的股份），本次共计派发 A 股现金红利人民币 957,755,671.30 元（含税）；H 股股本为 3,409,568,820 股，本次共计派发 H 股现金红利港币 374,602,166.16 元（含税）。

公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、上交所网站、香港联交所披露易网站及公司网站刊登了 2023 年度利润分配实施的有关公告，并于 2024 年 8 月 8 日实施完毕。

## (二) 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	是
每 10 股送红股数 (股)	0
每 10 股派息数 (元) (含税)	0.30
每 10 股转增数 (股)	0

### 利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明

公司 2024 年 1-6 月合并报表 (未经审计) 中归属于母公司所有者的净利润为人民币 953,097,368.84 元。母公司 2024 年 1-6 月净利润为人民币 3,235,664,772.32 元, 根据有关规定, 公允价值变动收益部分不得用于现金分配, 扣除相关因素影响, 2024 年 1-6 月可供现金分配的利润为人民币 1,091,086,327.87 元; 母公司 2024 年 6 月末可供分配利润为人民币 36,622,356,278.95 元。

从股东利益和公司发展等综合因素考虑, 建议公司 2024 年中期利润分配预案如下:

1. 公司 2024 年中期利润分配采用现金分红的方式, 以 2024 年中期分红派息股权登记日登记的总股本扣除公司回购专用证券账户的股份为基数, 每 10 股分配现金红利人民币 0.3 元 (含税)。若以审议 2024 年中期利润分配预案的董事会召开日公司总股本 13,064,200,000 股扣除公司回购专用证券账户的股份 77,074,467 股, 即 12,987,125,533 股为基数计算, 分配现金红利总额为人民币 389,613,765.99 元, 占 2024 年 1-6 月合并口径归属于母公司股东净利润的 40.88%; 公司 2024 年 1-6 月以现金为对价, 采用集中竞价方式已实施的股份回购金额人民币 303,053,231.80 元 (不含交易费用), 现金分红和回购金额合计人民币 692,666,997.79 元, 占 2024 年 1-6 月合并口径归属于母公司股东净利润的 72.68%。

在本次董事会召开日至实施权益分派的股权登记日前公司总股本扣除公司回购专用证券账户的股份发生变动的, 拟维持每股分配比例不变, 相应调整分配总额。本次现金红利分配后的剩余可供投资者分配的利润将转入下一期。

2. 现金红利以人民币计值和宣布, 以人民币向公司 A 股股东支付, 以港币向公司 H 股股东支付。港币实际派发金额按照本次董事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。

根据公司 2023 年度股东大会对 2024 年度中期利润分配事宜的相关授权, 本次利润分配方案无需提交股东大会审议。公司将于本次董事会召开之日起两个月内派发 2024 年中期现金红利。

## 五、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

### (一) 相关股权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

## 六、公司治理的其他情况

报告期内，本公司经营和管理规范有序，符合《上市公司治理准则》《证券公司治理准则》《证券公司监督管理条例》以及中国证监会相关法律法规的要求，同时，于报告期内及截至本报告日期，本公司遵守《守则》，全面遵循《守则》中的所有守则条文（如适用），并符合其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 1 次，董事会 7 次，监事会 4 次，审计委员会 7 次，独立董事年报工作会议 2 次，提名与薪酬考核委员会 1 次，发展战略与 ESG 管理委员会 3 次，合规与风险管理委员会 1 次，独立董事专门会议 1 次，共计 27 次会议。

### （一）关于股东和股东大会

本公司严格按照《公司章程》和《公司股东大会议事规则》的要求召集、召开股东大会，确保所有股东享有平等地位，能够充分行使自己的权利。

### （二）关于董事和董事会

本公司严格按照《公司章程》的规定聘任和变更董事，董事人数构成和任职资格符合法律、法规的要求。截至 2024 年 6 月 30 日，公司董事会由 11 名董事组成，其中执行董事 3 名，分别为周杰先生、李军先生和韩建新先生；非执行董事 4 名，分别为屠旋旋先生、石磊先生、肖荷花女士及许建国先生；独立非执行董事 4 名，分别为周宇先生、范仁达先生、毛付根先生及毛惠刚先生。各位董事能够勤勉尽责地履行职责，维护本公司和全体股东的利益。董事会下设发展战略与 ESG 管理委员会、审计委员会、合规与风险管理委员会、提名与薪酬考核委员会，各委员会分工明确，权责分明，有效运作，四个委员会中，发展战略与 ESG 管理委员会主任委员由董事长周杰担任，合规与风险管理委员会主任委员由执行董事李军担任，另两个委员会的主任委员均由独立非执行董事担任。

公司董事会设有审计委员会，符合中国证监会、上交所的有关规定及香港上市规则第三章的规定，成员有 5 名，包括毛付根先生（主任委员）、肖荷花女士、许建国先生、周宇先生和范仁达先生。审计委员会主要负责本公司内、外部审计的沟通、监督及核查等工作，并向董事会提供专业意见。

### （三）关于监事和监事会

截至 2024 年 6 月 30 日，公司监事会由 8 名监事组成，其中监事会主席 1 名，职工代表监事 3 名，非职工代表监事 4 名；截至报告披露日，公司监事会由 9 名监事组成，其中监事会主席 1 名，职工代表监事 3 名，非职工代表监事 5 名。公司监事会人员任职资格和构成符合法律、法规的要求。本公司监事能够勤勉尽责地履行职责，本着对股东负责的精神，对本公司财务、董事会成员以及高级管理人员履行职责的合法合规性进行监督，并就有关事项向董事会和高级管理层提出建议和改进意见。

## （四）关于高级管理层

本公司高级管理层产生的程序符合《公司法》和《公司章程》的规定，本公司高级管理层能够依照法律、法规和董事会的授权，依法合规经营，努力实现股东利益和社会效益的最大化。

## （五）关于相关利益者

本公司充分尊重和维护相关利益者的合法权益，共同推进本公司持续健康发展。

## （六）关于信息披露和投资者关系管理

报告期内，本公司能够严格按照中国大陆和香港两个上市地的法律、法规及相关规范性文件的要求，真实、准确、完整、及时、公平地披露本公司的信息，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。

公司注重维护投资者关系，通过开展各类投资者关系活动，持续加强与投资者的信息沟通，切实保护投资者的合法权益，有效增进投资者对公司的了解和认同。为保障投资者关系管理工作规范化、制度化、流程化开展，公司已制定《投资者关系管理办法》等相关制度，通过公司官网、投资者热线、电子邮箱、投资者说明会、路演、分析师会议、接待来访及上证 e 互动平台等多种载体与投资者进行沟通交流，并建立健全投资者关系管理档案。

报告期内，公司顺利以视频结合网络互动的方式，召开面向境内外市场各类投资者的 2023 年度业绩说明会，管理层对公司发展战略和经营亮点进行全面介绍，并就市场热点问题与投资者及分析师充分交流，积极回应投资者关切，正确引导市场预期。公司建立投资者常态化沟通机制，实时更新公司官网投资者关系栏目和上证 e 互动平台内容，保持投资者热线畅通，及时处理投资者问询和建议。报告期内，公司接听投资者热线 279 起，回答上证 e 互动问题 60 个。公司不断丰富投资者沟通的渠道和形式，注重在信息披露范围内加强主动性和战略性沟通，多次以现场或电话方式接待境内外机构投资者及分析师调研，并多次受邀参加境内外卖方机构投资策略会，就公司经营情况和行业发展趋势与投资者及分析师沟通，并及时向董事会、管理层反馈资本市场的观点和期待，形成市场前瞻思维与公司发展战略的良性互动。

## （七）合规体系建设

报告期内，本公司严格按照中国证监会的要求，结合自身实际情况，不断完善本公司合规管理。本公司合规总监严格依法履行合规管理职责。本公司股东、董事和高级管理人员未发生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提供了人力、物力、财力和技术支持，为合规管理提供了保障。报告期内，本公司广泛传导《国务院关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（新“国九条”），围绕资本市场“1+N”政策体系，在稳步有序开展合规审查、合规检查、合规监测等合规管理工作的基础上，坚持目标导向、问题导向，夯实对重点领域的执行保障支持力度，提升合规与业务的双向融合，加强集团合规管理建设，积极培育人人合规、主动合规、持续合规、全面合规的合规文化。

## 第五节 环境与社会





## 一、环境信息情况

### (一) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其主要子公司的环保情况说明

适用 不适用

### (二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

#### 1、因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

本公司及子公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位。

本集团严格遵守《中华人民共和国环境保护法》《中华人民共和国水污染防治法》《中华人民共和国大气污染防治法》等环保方面的法律法规，报告期内未出现因违反环保相关法规而受到处罚的情况。

#### 2、参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

#### 3、未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

### (三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

### (四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

公司顺应“绿色金融”新趋势，从自身运营及绿色金融两方面履行企业环境责任，助力产业转型升级，服务国家“双碳”目标。自身运营层面，设定绿色环保目标，推进绿色数据中心建设，通过倡导无纸化办公、空调限温、绿色出行、按需用餐等方式涵育绿色文化，减少办公运营过程中的资源浪费和能源消耗。绿色金融层面，公司聚焦主责主业，不断加大对绿色经济、低碳经济、循环经济的服务支持力度，引导和激励更多社会资本投入绿色低碳转型产业，并积极开展绿色研究咨询、绿色金融行业交流，以实际行动践行 ESG 理念。凭借突出的 ESG 管理核心竞争力，公司成功入选中央广播电视总台“中国 ESG 上市公司先锋 100”榜单（2024）。

#### 1. 自身运营

绿色运营方面，公司持续开展节能降耗、提高资源利用率，调整工作场所照明时间及空调开闭时间；推动绿色数据中心建设，张江数据中心成功入选 2023 年度国家绿色数据中心名单，成为首家上榜的证券公司；持续优化办公协同信息系统，借助 RPA 智能流程自动化机器人、智能审核系统等搭建信息

化、无纸化办公模式，大量减少纸张使用和其他废弃物的产生；鼓励员工自觉做到人走灯灭、按需用餐，提倡绿色出行；优先采购节水器具、节能灯具，对用水、用能设备定期检修，有效减少资源与能源损耗。

绿色宣传方面，公司紧扣“双碳”、绿色金融等主题，依托公司官网、官微等宣传渠道，围绕“植树节”“3·15 投资者保护”“世界水日”“世界地球日”“世界环境日”等时点开展绿色主题宣传，展示公司 ESG 理念以及在能源管理、水资源管理、排放物及废弃物管理方面的目标举措。公司围绕减塑行动、废纸回收、物料循环、绿色出行、节能降耗等方面发出低碳倡议，并在总部园区设置塑料回收站与废纸回收处，倡导绿色生活理念，推动可再生产品的循环利用和纸张“零废弃”。

## 2. 绿色金融

绿色融资方面，公司承销绿色债券、绿色资产支持证券 19 只，融资规模 244 亿元；助力绿色科技材料龙头企业中仑新材成功登陆创业板；海通恒信作为首批融资租赁机构入驻上海绿色金融服务平台，实现首单工商业储能直租业务投放。

绿色投资方面，公司以自有资金参与绿色债券投资 64 笔，投资规模 38 亿元；完成对功率器件龙头企业中车时代半导体以及光伏设备供应商红太阳光电的股权投资，投资金额超 2.2 亿元；海富通基金正式成立“海富通 ESG 领先股票型证券投资基金”，为践行绿色金融和 ESG 投资理念提供良好投资工具；截至报告期末，海富通碳中和主题基金总规模达 4.54 亿元。

绿色研究咨询方面，公司围绕负责任投资、ESG 策略、绿色金融等主题，通过提供 ESG 研究咨询累计服务 605 家机构客户。研究所发布《国内外 ESG 体系对比研究与政策建议》，借鉴国际经验为促进中国 ESG 发展提供政策建议；富国基金《印度 ESG 发展趋势及对中国的启示》入选中国证券投资基金业协会“声音”专栏。

绿色金融交流方面，公司参加中国品牌全球行与 ESG 可持续发展会议，“以科技赋能数据中心绿色高质量发展”案例入选《中国企业 ESG 发展调研报告》“绿色低碳实践案例”；与上海市国资委联合牵头“ESG 实践披露结果的应用研究”课题，积极探索 ESG 的理念和实践与企业发展、城市建设、社会运行紧密结合；公司制作的《ESG 理念下证券公司高质量发展》课程入选中国证券业协会 2024 年远程培训共建课程，聚焦券商如何在 ESG 理念下高质量开展相关业务提出建议与参考。

## (五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

公司碳排放的主要来源为日常运营过程中使用电力和天然气以及公务用车耗油产生的碳排放。公司通过绿色数据中心运营、绿色办公、低碳出行等方式减少自身运营的碳排放量，推进能源管理。

公司秉承绿色发展理念，推进绿色数据中心建设，推进并开展了一系列节能降耗措施，包括进一步部署光伏设备、搭建 AI 节能制冷调优平台、实现机房楼整体智能照明环境、持续优化机房气流组织、试点应用绿色装备、首次部署应用节水装置、试点运行配电巡检机器人等。相较上一年度同期能耗，在 IT 用能增加约 55% 的情况下，动力用能下降约 20%。2024 年 6 月，工业和信息化部网站正式发布 2023 年度国家绿色数据中心名单，公司张江数据中心成功入选，成为首家上榜的证券公司。报告期内，公司南外滩总部园区、张江科技园及广东路大楼总能耗同比下降约 243.4 万千瓦时。

## 二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

2024年上半年，海通证券持续开展“一司一县”“百企帮百村”结对帮扶工作，助力云南西畴、新疆叶城、江西宁都、安徽利辛、安徽舒城等五个脱贫县巩固脱贫攻坚成果，积极开展援疆援藏援青工作，扎实做好上海市农村综合帮扶和城乡党组织结对帮扶工作，努力解决帮扶地区群众实际问题，持续助力乡村振兴国家战略。

### （一）落实结对帮扶，多措并举推动乡村振兴

公司以项目建设为导向，依托分支机构，持续加强与云南西畴、新疆叶城、江西宁都、安徽利辛、安徽舒城等结对县的沟通交流，持续助力结对帮扶县经济社会发展。聚焦对口帮扶地区，开展公益帮扶项目，比如，重点面向云南西畴、新疆叶城、江西宁都、安徽利辛、安徽舒城共12所中小学等，开展“海通·爱健康”公益项目，捐赠运动健康器材等，助力当地青少年体育教育。立足金融帮扶、智力帮扶、产业帮扶，开展“金融大讲堂”走进江西宁都公益活动，面向县直相关单位、县属国有企业、民营企业等开展金融培训，紧扣当前经济社会重点，结合宁都特色产业，围绕新能源电池产业与宁都发展机会分析、国内债券市场现状、区域合作赋能区域经济发展以及加大资本招商优化产业资金布局等主题进行授课，为推动当地经济发展贡献智慧和力量。

### （二）坚持金融赋能，为乡村振兴注入发展动力

公司积极发挥专业能力和资源整合优势，帮助帮扶地区企业规范公司治理，改善融资状况。助力中广核风电成功发行长年限碳中和绿色科技创新乡村振兴公司债券，共计发行规模30亿元。公司还助力克拉玛依市城市建设投资发展有限责任公司发行2024年度第一期超短期融资债券，发行规模5亿元。此外，子公司海通期货持续探索开展“保险+期货”金融帮扶模式，比如，投入40.5万元公益资金在甘肃礼县开展苹果“保险+期货”乡村振兴项目，帮助农户规避苹果价格波动风险，保障收益。此外，公司积极推进消费帮扶，依托各级工会、物业后勤，采购内蒙古、黑龙江、福建等帮扶地区特色农产品，以购代捐，促进消费，助力当地农户增收。

### （三）完善公益体系，传递“爱在海通”公益理念

公司坚持以“爱在海通”党建公益品牌为引领，广泛凝聚爱心力量，以慈善公益助力乡村振兴。一是做好上海爱在海通公益基金会（以下简称“基金会”）的管理运营。按照上海市民政局工作要求，做好年检年报工作，持续完善基金会各项内部制度，持续完善基金会慈善信息公开，全面夯实基金会管理基础。二是加强志愿者队伍建设，年初成立海通证券“爱在海通”志愿服务总队，并组建20余支分队，进一步统筹各方志愿力量，集结起更加专业、协同的志愿者队伍。三是认真落实“爱在海通”公益清单。持续推进“海通·爱健康”品牌公益项目，面向新疆、西藏、云南、青海、江西、安徽、河南、浦东等地35所中小学校等，捐赠体育用品等，助力健康中国建设。其中，在由克拉玛依市政府、上海援克前方指挥部主办的2024年“引客入克”暨沪克航旅推介会上，“海通·爱健康”助力克拉玛依健身公益项目入选2024年沪克文旅交通十大合作联动项目。公司还应邀参加上海报业集团、上海宣传通讯主办的“2023美丽西藏助学证书锦旗发放仪式”及座谈会，与上海市援藏干部人才联络组、

上海慈善基金会等分享“爱在海通·美丽西藏”公益项目成果，进一步讲好“爱在海通”公益故事。此外，各子公司、分支机构积极开展“爱在海通 志愿先锋”主题活动，围绕公益投教、低碳环保、社区服务等方面开展志愿公益和捐赠帮扶行动，展现了“爱在海通”公益合力。

#### （四）参与综合帮扶，积极开展农村综合帮扶、城乡党组织结对帮扶

公司积极参加上海市农村综合帮扶对口帮扶工作会议，按照工作部署，做好公司与崇明区对口帮扶工作；公司进一步强化帮扶慰问工作机制，节日期间做好困难群众关心慰问工作，赴公司城乡党组织结对帮扶村，开展结对共建和走访慰问活动，为助力当地乡村振兴贡献力量。此外，公司积极开展智力帮扶，输送干部担任浦东卫民村驻村第一书记，驻村干部助力当地农产品品牌建设，帮助提升农业产值，提升产业层次，有效带动当地集体经济发展。

下一步，公司将继续坚决贯彻落实党中央关于乡村振兴的重大决策部署，认真履行金融国企职责使命，为助力乡村振兴战略贡献更大力量。一是进一步深化结对帮扶工作机制，立足新发展阶段，持续优化完善金融、产业、智力、消费、公益等帮扶模式，以更精准的帮扶措施，持续助力结对帮扶地区实现更高质量发展。二是持续发挥专业优势，创新运用多层次资本市场融资方式，精准对接帮扶地区企业融资需求，为帮扶地区提供多渠道、多品种、全方位的金融服务。三是不断完善“四个一”公益体系，在“爱在海通”公益理念指引下，依托上海爱在海通公益基金会载体，集结“爱在海通”志愿者队伍，广泛凝聚爱心力量，丰富拓展“爱在海通”年度公益清单项目，积极助力乡村振兴，持续擦亮“爱在海通”公益品牌。

## 第六节 重要事项



## 一、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

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间	是否有履行期限	承诺期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
	股份限售	上海国盛(集团)有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 48 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 48 个月	是	48 个月	是	-	-
与再融资相关的承诺	其他	董事、高级管理人员	1. 承诺不无偿或以不公平条件向其它单位或者个人输送利益,也不采用其它方式损害公司利益; 2. 承诺对职务消费行为进行约束; 3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动; 4. 承诺由董事会或提名与薪酬考核委员会制定的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩; 5. 若公司后续推出公司重要交易和事项政策, 承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩	作为公司董事、高级管理人员期间	是	作为公司董事、高级管理人员期间	是	-	-

## 二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

## 三、违规担保情况

适用 不适用

## 四、聘任、解聘会计师事务所情况

### (一) 聘任、解聘会计师事务所的情况说明

公司于 2024 年 7 月 18 日召开的 2024 年第一次临时股东大会审议通过了《公司关于聘请 2024 年度会计师事务所的议案》, 同意公司聘请立信会计师事务所(特殊普通合伙)(简称立信)为公司 2024 年度境内审计师, 聘任德勤·关黄陈方会计师行(简称德勤香港)为公司 2024 年度境外审计师。由立信负责对按照中国企业会计准则编制的财务报表及内部控制提供相关的境内审计及审阅服务, 由德勤香港负责对按照国际财务报告准则编制的财务报表提供相关的境外审计及审阅服务。本次变更会计师事务所主要是考虑公司现有业务状况、发展需求及整体审计需要, 公司不存在与前任会计师事务所

所在工作安排、收费、意见等方面存在分歧的情形。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

## (二) 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、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

适用 不适用

## 六、破产重整相关事项

适用 不适用

## 七、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司不存在《上交所上市规则》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。

自报告期初至本报告披露日，本集团尚未披露的新增（金额超过人民币 1 亿元）或已披露且有新进展的诉讼、仲裁事项如下：

### 宁波浙金钢材有限公司与华泰证券股份有限公司、公司等侵权责任纠纷案

因侵权责任纠纷，宁波浙金钢材有限公司向杭州市中级人民法院起诉，要求公司等四名被告承担连带赔偿责任，赔偿原告损失本金人民币 0.95 亿元及相应利息等。2024 年 6 月，浙江省杭州市中级人民法院受理本案。

### 张方杰与雷根大数据科技有限公司、公司等财产损害赔偿纠纷案

因财产损害赔偿纠纷，张方杰向上海金融法院起诉，要求李金龙等十五名被告连带赔偿原告张方杰人民币 1.22 亿元及相应利息，要求公司等三名被告以前述金额为限承担补充赔偿责任。2023 年 10 月，上海金融法院受理本案。

### 四川信托与海通资管公司、公司等金融委托理财合同纠纷案

因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司（以下简称四川信托）向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司（以下简称海通资管公司）、公司等八名被告返还或赔偿原告委托财产人民币 5.15 亿元及相应利息。2021 年 9 月 13 日，四川省成都市中级人民法院受理本案，并于 2023 年 9 月 27 日作出一审判决。四川信托提起上诉，四川省高级人民法院于 2024 年 3 月 1 日对案件进行开庭审理，目前案件尚未判决。

### 邮储银行与富诚海富通等证券虚假陈述责任纠纷案

因“华泰美吉特灯都资产支持专项计划”发生实质性违约，专项计划持有人之一中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称邮储银行）向上海金融法院起诉，要求原始权益人昆山美吉特灯都管理有限公司、上海富诚海富通资产管理有限公司（以下简称富诚海富通）等五名被告对其全部损失承担连带赔偿责任，其诉请金额为本金人民币 5.27 亿元以及相应的利息等。2020 年 11 月，上海金融法院受理本案，并于 2023 年 4 月 14 日作出一审判决。原告邮储银行及富诚海富通等被告向上海市高级人民法院提起上诉。目前，该案正在二审审理中。

除上述案件外，集团内尚处于执行阶段的案件共 4 起，涉及案件金额人民币 11.57 亿元。

公司境外上市子公司和主要经营地在境外的子公司（海通恒信、海通国际、海通银行及上述公司的附属公司）的重大诉讼、仲裁事宜由其按照所在地的监管规则和相关上市规则（如涉及）自行向法定对象披露相关信息。

## 八、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人涉嫌违法违规、受到处罚及整改情况

1. 截至报告期末，本公司无控股股东且无实际控制人。

2. 报告期内，公司董事、监事、高级管理人员、第一大股东不存在被有权机关调查、被司法机关或纪检监察机关采取强制措施、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给予重大行政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。

3. 公司不存被司法机关或纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或纪检部门追究刑事责任情形，不存在被其他行政管理部门给予重大行政处罚的情形。

报告期内，公司及公司董事、高级管理人员存在以下被中国证监会立案调查、行政处罚、被中国证监会或其派出机构采取行政监管措施、被证券交易所采取纪律处分的情况：

2024 年 1 至 2 月，上海证监局出具《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决〔2024〕17 号）等监管函件，认定公司存在境外子公司合规管理和风险管理不到位、场外期权业务相关内部控制不健全，以及场外衍生品业务相关风险指标体系不健全等情况，对公司采取责令改正、责令处分有关人员措施，对公司相关时任分管高级管理人员采取监管谈话等措施。公司在收到上述监管函件后，高度重视，第一时间对相关人员进行内部问责程序，深刻检讨业务管控不足，全面落实相关整改工作，确保各业务环节严格遵循法律法规与自律准则。



2024年4月，中国证监会出具《行政处罚决定书》（〔2024〕45号），责令海通证券改正，没收违法所得人民币789,445.21元，并处以人民币6,975,000元罚款。处罚决定书认定公司以自己名义按照中信中证的报价指令认购中核钛白非公开发行股票，客观上帮助中信中证及其客户取得股票收益，使得定增套利行为得以实现。相关情况详见公告编号为临2024-021、临2024-022、临2024-029的公司公告。公司高度重视，及时进行整改，强化客户尽职调查与交易目的核查，完善适当性管理要求和 workflows，切实履行勤勉尽责义务。

2024年4月，广东证监局出具《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》（〔2024〕36号），对公司采取责令改正措施。该函件认定公司在格力地产股份有限公司债券承销业务中存在对部分事项尽职调查不充分等情况。公司收到该监管函件后，高度重视，及时采取措施进行整改，加强法规文件学习，修订债券融资业务制度和指引，提高项目尽调标准，切实提高执业水平。

2024年4月，新疆证监局出具《关于对海通证券股份有限公司乌鲁木齐友好北路证券营业部、苗苗采取出具警示函措施的决定》（〔2024〕9号），对乌鲁木齐友好北路证券营业部及苗苗采取出具警示函措施。该监管函件认定营业部存在为他人使用客户相关证券账户提供便利；未及时重新评估客户风险承受能力，提供与投资者当时风险承受能力不匹配的融资展期服务等情形。公司收到该监管函件后，高度重视，督促营业部立即整改，加强合规培训，督导员工勤勉尽责，提升执业水平，细化落实客户身份识别工作。

2024年4月，上海证监局出具《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决〔2024〕180号）等监管函件，认定公司存在未审慎评估个别股票质押标的风险及资金用途、未审慎开展收益互换业务、个别风险债券投资内部控制程序不健全、另类投资子公司投资的个别私募基金实际投资标的超出另类投资子公司业务范围等情况，对公司采取责令改正措施，对公司相关时任分管高级管理人员采取监管谈话等措施。公司在收到上述监管函件后，高度重视，及时进行整改，完善公司内控管理，深化集团一体化管控举措，确保切实落实整改要求。

2024年5月，上海证券交易所出具《关于对海通证券股份有限公司予以通报批评的决定》（〔2024〕82号），给予公司通报批评的纪律处分。该监管函件认定公司在保荐工作中，存在核查工作履职尽责不到位、内部控制质量存在薄弱环节的情形。公司收到该监管函件后，高度重视，及时进行整改，加强项目内控审核及跟踪管理，定期组织开展专项培训，督导员工勤勉尽责，夯实工作底稿，切实提高执业水平。

2024年5月，中国证监会出具《关于对海通证券股份有限公司及保荐代表人朱桢、周磊采取出具警示函监管措施的决定》（〔2024〕16号），对公司及两名保荐代表人采取出具警示函措施。该监管函件认定公司在保荐工作中，存在未勤勉尽责履行相关职责等情形。公司在收到该监管函件后，高度重视，及时进行整改，加强法规文件学习，提高项目尽调标准，强化尽职调查核查力度。

## 九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

截至报告期末，本公司无控股股东且无实际控制人。报告期内，公司及第一大股东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、重大关联交易

### (一) 与日常经营相关的关联交易

#### 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、日常关联 / 连交易

公司建立了基本完整的关联 / 连交易制度体系，构建了较为科学完善的关联 / 连交易组织管理框架，相关内部控制总体有效。公司按照《公司法》《证券法》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 5 号——交易与关联交易》《香港上市规则》《上交所上市规则》等相关法律和监管规则，依据《公司章程》《关联交易管理办法》《关联（连）交易管理实施细则（试行）》等内部规章，严格履行关联 / 连交易审议流程及信息披露要求，对各项业务的关联 / 连交易形成了恰当的约束机制。

报告期内，公司严格按照 2023 年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2024 年度日常关联 / 连交易的议案》，开展日常关联 / 连交易。

本章节所载关联 / 连交易的披露系依据《上交所上市规则》与香港上市规则确定，与财务报表附注中的关联交易数额（依据企业会计准则编制）可能存在差异。

相关执行情况如下：

##### ● 香港上市规则项下的持续性关连交易

截至报告期末，上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产管理有限公司合计持有公司 10.38% 的股份。根据《上交所上市规则》第 6.3.3 条第（四）款，上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产管理有限公司为公司关联人；根据香港上市规则第 14A.07 条，上海国盛集团及其联系人为公司关连人。

公司于 2022 年 12 月 30 日与上海国盛集团签署《上海国盛（集团）有限公司与海通证券股份有限公司之关联交易 / 关连交易框架协议》（以下简称框架协议）。框架协议明确关连交易及相关服务的范围、定价基准、管控流程等内容，并对 2023 至 2025 年持续关连交易的年度上限进行预计。

上述框架协议经公司第七届董事会第三十四次会议（临时会议）审议通过。关联董事屠旋旋先生已根据有关法律法规及公司内部规定回避表决，公司独立董事已针对框架协议的签署发表事前认可意见和独立意见。相关董事会审议结果及框架协议签署公告均按照上海证券交易所及香港联合交易所的相关要求进行披露。

报告期内集团与上海国盛集团及其联系人之间涉及证券和金融产品交易及证券和金融服务相关的持续关联交易执行情况如下：

单位：万元 币种：人民币

交易内容	2024 年度预计交易上限	2024 年 1-6 月实际发生金额
证券及金融产品交易		
流入 <sup>(1)</sup>	270,000.00	1,028.29
流出 <sup>(2)</sup>	220,000.00	-
证券及金融服务		
本集团向上海国盛集团及其联系人提供证券和金融服务收取的收入总额	12,000.00	230.23
本集团接受上海国盛集团及其联系人提供证券和金融服务产生的支出总额	3,000.00	-

(1) “流入”是指本集团从证券和金融产品交易产生的现金流入总额，包括固定收益产品和权益类产品销售、固定收益产品相关的衍生产品所得利息及通过融资交易的借入 / 购回所产生的现金流入总额。

(2) “流出”是指本集团从证券和金融产品交易产生的现金流出总额，包括固定收益产品及权益类产品购买、固定收益产品相关的衍生产品所付利息及通过融资交易的借出 / 买入返售所产生的现金流出总额。

### ● 上交所上市规则项下的日常关联交易

#### (1) 与上海国盛（集团）有限公司及上海国盛集团资产有限公司的关联交易

单位：万元 币种：人民币

交易内容	2024 年 1-6 月发生金额	占同类交易金额的比例	备注
手续费及佣金净收入	37.55	0.01%	向关联人收取的资产管理手续费及佣金收入
手续费及佣金净收入	33.64	0.01%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	95.41	0.05%	关联人保证金产生的利息净收入
衍生金融工具交易净损益 <sup>(注)</sup>	48.21	-0.13%	报告期内，名义本金发生额 0.61 亿元，期末名义本金余额 0.50 亿元。

注：关联人作为交易对手方与公司进行衍生品交易产生的已实现及未实现投资收益，亏损以负值列示。

单位：万元 币种：人民币

往来项目	2024 年 6 月 30 日余额	占同类交易金额的比例	备注
应收账款	7.51	0.00%	应向关联人收取的各项服务手续费余额
应付账款	5,103.31	0.45%	公司应付关联人衍生金融工具保证金余额
代理买卖证券款	181.46	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额
衍生金融资产	152.48	0.07%	与关联人开展衍生品交易产生的衍生金融资产余额

#### (2) 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

单位：万元 币种：人民币

交易内容	2024 年 1-6 月发生金额	占同类交易金额的比例	备注
手续费及佣金收入	6,507.18	1.86%	向关联人收取的资产管理业务收入、销售服务费收入、投资咨询服务费收入等
手续费及佣金收入	551.13	0.16%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
保证金利息收入	8.39	0.00%	关联人保证金产生的利息收入
银行存款利息收入	4,360.20	2.33%	关联人银行存款产生的利息收入
信用拆借交易利息支出	62.44	0.28%	报告期内，信用拆借交易规模 42 亿元，期限：1-7 天
债券借贷交易利息支出	245.73	0.63%	报告期内，债券借贷交易规模 67.8 亿元，期限：1 天 -11 个月
回购交易利息支出	5.18	0.00%	报告期内，回购交易规模 10 亿元，期限：1 天
黄金租赁利息支出	6,414.45	16.49%	报告期内，黄金租赁规模 88.24 亿元，期限：341-365 天
银行贷款利息支出	5,924.71	3.63%	向关联人支付的银行贷款利息支出
业务及管理费	18.67	0.00%	向关联人支付的基金销售服务费等支出
衍生金融工具交易净损益 <sup>(注)</sup>	7,449.72	-19.61%	报告期内，名义本金发生额 44.76 亿元，期末名义本金余额 54.24 亿元。

注：关联人作为交易对手方与公司进行衍生品交易产生的已实现及未实现投资收益，亏损以负值列示。

单位：万元 币种：人民币

往来项目	2024年6月30日余额	占同类交易金额的比例	备注
银行存款	369,070.48	2.61%	公司存放关联人的银行存款余额
应收账款	2.31	0.00%	应收关联人各项业务报酬及预付业务保证金余额等
衍生金融资产	9,504.60	4.57%	与关联人进行衍生品交易产生的衍生金融资产余额
代理买卖证券款	273.12	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额
短期借款	182,536.00	5.47%	关联人向公司发放的短期借款余额
长期借款	70,576.96	1.91%	关联人向公司发放的长期借款余额
应付账款	6.40	0.00%	应付关联人各项业务服务费及待付业务保证金余额
卖出回购金融资产	456,643.55	4.58%	与关联人进行黄金租赁业务产生的卖出回购金融资产余额
衍生金融负债	1,781.02	1.45%	与关联人进行衍生品交易产生的衍生金融负债余额
交易性金融负债	913.06	0.07%	与关联人进行衍生品交易产生的交易性金融负债余额

另外，部分证券公司等关联法人作为合格交易对手方与公司开展现券买卖交易，报告期内累计成交金额 329.64 亿元。

## (二) 资产收购或股权收购、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) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务

适用 不适用

## (六) 其他重大关联交易

适用 不适用

## (七) 其他

### 与公司第一大股东共同参与投资设立基金

公司全资子公司海通创新证券拟出资人民币 10 亿元，与公司第一大股东上海国盛集团及其全资子公司上海国经投资发展有限公司参与投资设立上海国投先导集成电路私募投资基金合伙企业（有限合伙）（暂定名，以下简称集成电路母基金），与上海国经投资发展有限公司参与投资设立上海国投先导生物医药私募投资基金合伙企业（有限合伙）（暂定名，以下简称生物医药母基金）、上海国投先导人工智能私募投资基金合伙企业（有限合伙）（暂定名，以下简称人工智能母基金）（以下合称上海三大先导产业母基金）。

上海三大先导产业母基金的形式为有限合伙企业，分别对应集成电路、生物医药和人工智能三大重点方向，上海国投先导私募基金管理有限公司作为基金管理人。集成电路母基金规模为人民币 450.01 亿元，其中海通创新证券拟作为有限合伙人出资人民币 5 亿元，持股比例 1.1111%，出资来源为自有资金；上海国盛集团拟作为有限合伙人出资人民币 20 亿元，持股比例 4.4443%；上海国经投资发展有限公司拟作为有限合伙人出资人民币 200 亿元，持股比例 44.4435%。生物医药母基金规模为人民币 215.01 亿元，其中海通创新证券拟作为有限合伙人出资人民币 2.5 亿元，持股比例 1.1627%，出资来源为自有资金；上海国经投资发展有限公司拟作为有限合伙人出资人民币 100 亿元，持股比例 46.5095%。人工智能母基金规模为人民币 225.01 亿元，其中海通创新证券拟作为有限合伙人出资人民币 2.5 亿元，持股比例 1.1111%，出资来源为自有资金；上海国经投资发展有限公司拟作为有限合伙人出资人民币 100 亿元，持股比例 44.4425%。

根据《上交所上市规则》的相关规定，上海国盛集团持有公司 5% 以上股份，为公司的关联人；根据《香港上市规则》有关规定，上海国盛集团为公司的主要股东，因此上海国盛集团及其全资子公司上海国经投资发展有限公司为公司关连人士，上述交易构成关联 / 连交易。

此次关联 / 连交易的具体情况参见公司 2024 年 7 月 6 日于上海证券交易所披露的公告《关于公司全资子公司参与设立基金暨关联 / 连交易的公告》以及香港联交所披露的公告《关连交易 成立合伙企业》。

## 十一、重大合同及其履行情况

### (一) 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

### (二) 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

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）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	-
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	-
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	4,645,422,359
报告期末对子公司担保余额合计（B）	31,587,307,218
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	31,587,307,218
担保总额占公司净资产的比例（%）	18.45
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	-
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）	22,055,409,500
担保总额超过净资产 50% 部分的金额（E）	-
上述三项担保金额合计（C+D+E）	22,055,409,500
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	

担保情况说明

1. 2023年，经公司第七届董事会第四十一次会议审议通过，同意公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过5亿美元债务融资本金（含5亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过7年（含7年）。

公司于2024年3月1日签署《担保契据》，为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为35亿元人民币、于2027年到期的债券提供连带责任保证担保。

2. 2022年，经公司第七届董事会第三十二次会议审议通过，同意公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过10亿美元债务融资本金（含10亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过7年（含7年）。

公司于2023年4月20日签署《担保协议》，为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为40亿元人民币、于2026年到期的债券提供连带责任保证担保。

公司于2023年5月18日签署《担保协议》，为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为28亿元人民币、于2026年到期的债券提供连带责任保证担保。

3. 2021年，经公司第七届董事会第十五次会议审议通过，同意公司为在境外的全资子公司海通银行Haitong Bank,S.A.或其附属公司境外债券融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过7.5亿欧元债券本金（含7.5亿欧元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过9年（含9年）。

公司于2022年2月8日签署《担保函》，为公司境外全资附属公司海通银行发行金额为2.3亿欧元、于2025年到期的欧元债券提供连带责任保证担保。

公司于2022年5月31日签署《担保协议》，为境外全资附属公司海通银行发行金额为1.5亿美元、于2027年到期的债券提供连带责任保证担保，担保期限66个月。

4. 2020年，经公司第七届董事会第十一次会议审议通过，同意公司为在境外的全资附属公司海通银行或其附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过3.75亿欧元债务融资本金（含3.75亿欧元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过6年（含6年）。

公司于2021年5月17日作为担保人签署《贷款协议》，为境外全资附属公司海通银行3.75亿欧元（含3.75亿欧元或等值其他货币）银团贷款提供连带责任保证担保。截至2024年6月30日，公司的该项担保责任余额为2.25亿欧元。

5. 2019年，经公司第六届董事会第三十七次会议审议通过，同意公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过6.7亿美元债务融资本金（含6.7亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过10年（含10年）。

公司于2020年3月12日签署《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6.7亿美元、于2025年到期、票面利率为2.107%的美元债券，提供连带责任保证担保。

6. 2012年，经公司第五届董事会第十二次会议审议通过，同意公司对海通资管公司提供不超过十五亿元的净资本担保承诺。2013年6月，根据上海证监局下发的《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），公司向海通资管公司提供8亿元的担保承诺。

2016年，经公司第六届董事会第十八次会议审议通过，同意公司对海通资管公司追加不超过人民币40亿元的净资本担保承诺。就本次净资本担保事宜，海通资管公司已获得中国证监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）。

2021年12月，公司对海通资管公司减少提供净资本担保承诺金额18亿元。就本次净资本担保减少事宜，海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《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减少提供部分净资本担保承诺事项的无异议函》（沪证监机构字[2021]532号）。

2024年4月，公司对海通资管公司减少提供净资本担保承诺金额20亿元。就本次净资本担保减少事宜，海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《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减少提供部分净资本担保承诺事项的无异议函》（沪证监机构字[2024]106号）。

截至2024年6月30日，公司对海通资管公司提供净资本担保承诺金额为人民币10亿元。

7. 公司全资子公司海通开元将注册资本从人民币75亿元减至人民币55亿元，减资人民币20亿元。公司为海通开元减资过程中未清偿债14,542.24万元提供一般保证担保。上述担保事项已经公司于2024年4月26日召开的第八届董事会第五次会议审议通过。截至2024年6月30日，公司的该项担保责任余额为13,980.51万元。

8. 公司子公司海通恒信于2024年3月19日签署《担保协议》，为其境外全资子公司Haitong UT Brilliant Limited发行金额为10亿元人民币、于2027年3月到期的债券提供连带责任保证担保。

9. 公司子公司海通恒信于2022年4月27日签署《担保协议》，为其境外全资子公司Haitong UT Brilliant Limited发行金额为2亿美元、于2025年4月到期的债券提供连带责任保证担保。

注：报告期内子公司海通国际为子公司业务开展向银行提供担保，担保限额按2024年6月28日中国外汇交易中心公布的人民币汇率中间价公告1港元对人民币0.91268元换算，合计为8,392,092,600元人民币，截至报告期末，实际提贷的担保余额合计为60,000,000元人民币。

报告期内子公司海通国际及其子公司为其附属公司在多项于国际衍生品框架协议（ISDA）、全球总回购协议（GMRA）、全球证券借贷主协议（GMSLA）等协议项下开展的交易提供担保。其中，部分担保为无限额担保，此类担保是遵循国际银行业及资本市场惯例做出的，以保障相关业务的正常开展。同时，鉴于担保主体为有限责任公司，该等担保的实质担保上限为担保主体的资产净值，且其出具目的与风险属性亦有别于债务融资担保。

### （三）其他重大合同

适用 不适用

## 十二、募集资金使用进展说明

适用 不适用

## 十三、其他重大事项的说明

### 1. 海通国际完成私有化

2023年9月26日，公司第七届董事会第四十二次会议（临时会议）审议通过《关于海通国际控股有限公司对海通国际证券集团有限公司进行私有化的议案》，同意批准海通国际控股对海通国际的私有化方案。2024年1月11日上午9点整海通国际撤销在香港联交所的上市地位生效，已正式退市。

### 2. 注销上海泽春投资发展有限公司

2021年8月26日，公司第七届董事会第十八次董事会审议通过《关于吸收合并上海泽春投资发展有限公司的议案》，同意以海通证券为主体吸收合并上海泽春投资发展有限公司，被合并方上海泽春投资发展有限公司依法解散并注销。2024年2月26日，上海泽春投资发展有限公司吸收合并及注销程序全部完成。

### 3. 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

2024年3月28日，公司第八届董事会第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》，同意公司为在境外的全资子公司海通国际控股有限公司及其全资附属公司境外债务融资（包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式）提供连带责任保证担保，担保金额不超过6.7亿美元债务融资本金（含6.7亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过7年（含7年）；同意公司为在境外的全资子公司Haitong Bank, S.A.及其分行或全资附属公司境外债务融资（包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式）提供连带责任保证担保，担保金额不超过2.3亿欧元债务融资本金（含2.3亿欧元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过5年（含5年）。

### 4. 变更为境外子公司境外债务融资提供维好支持额度

2024年4月26日，公司第八届董事会第五次会议审议通过了《关于变更为境外子公司境外债务融资提供维好支持额度的议案》，将公司第七届董事会第三十六次会议《关于为境外子公司境外债务融资提供维好支持额度的议案》变更为：同意公司将为境外子公司海通国际控股有限公司、海通国际证券集团有限公司及其全资附属公司境外债务融资提供担保或维好支持，额度合计不超过160亿（含）港币（或等值币种），担保期限不超过7年（含），维好期限不超过5年（含），其中担保额度不超过总额度的50%。

### 5. 海通开元投资有限公司减资

2024年4月26日，公司第八届董事会第五次会议经审议通过了《关于公司全资子公司海通开元投资有限公司减资及公司为其减资过程中未清偿债务提供担保的议案》，同意子公司海通开元的注册资本从人民币75亿元减至人民币55亿元。2024年6月13日，该减资事项完成工商变更。



## 第七节 股份变动及股东情况



## 一、股本变动情况

### (一) 股份变动情况表

#### 1、股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。公司的股份总数为 13,064,200,000 股，其中，A 股为 9,654,631,180 股，H 股为 3,409,568,820 股。

#### 2、股份变动情况说明

适用 不适用

报告期内，公司无股份变动情况。

#### 3、报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、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

单位：股

股东名称	期初限售股数	报告期解除限售股数	报告期增加限售股数	报告期末限售股数	限售原因	解除限售日期
上海国盛（集团）有限公司	781,250,000	0	0	781,250,000	非公开发行股份限售	2024 年 8 月 15 日*
合计	781,250,000	0	0	781,250,000	/	/

\* 上海国盛（集团）有限公司持有的锁定期限 48 个月的限售股原本于 2024 年 8 月 5 日解禁，考虑公司 2023 年度权益分派实施期间限售股解禁上市对权益分派实施的影响，前述限售股解除限售日期变更为 2024 年 8 月 15 日，自 2024 年 8 月 15 日起公司无限售股。详见公司 2024 年 8 月 9 日于上交所网站披露的《公司非公开发行限售股上市流通公告》（公告编号：临 2024-051）。

## 二、股东情况

### (一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数（户）	244,569
	（其中 A 股 244,422；H 股 147）

## (二) 截至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（不含通过转融通出借股份）								
股东名称（全称）	报告期内增减	期末持股数量	比例（%）	持有有限售条件股份数量	质押、标记或冻结情况		股东性质	
					股份状态	数量		
香港中央结算（代理人）有限公司	316,400	3,409,025,756	26.09	0	未知	-	境外法人	
上海国盛（集团）有限公司	0	862,489,059	6.60	781,250,000	无	0	国有法人	
上海海烟投资管理有限公司	0	635,084,623	4.86	0	无	0	国有法人	
光明食品（集团）有限公司	0	480,275,000	3.68	0	无	0	国有法人	
上海电气控股集团有限公司	-478,600	343,767,818	2.63	0	无	0	国家	
申能（集团）有限公司	0	322,162,086	2.47	0	无	0	国有法人	
中国证券金融股份有限公司	0	258,104,024	1.98	0	无	0	其他	
上海国盛集团资产有限公司	0	238,382,008	1.82	0	无	0	国有法人	
上海久事（集团）有限公司	5,162,900	235,247,280	1.80	0	无	0	国有法人	
香港中央结算有限公司	69,399,390	234,083,689	1.79	0	无	0	境外法人	
前十名无限售条件股东持股情况（不含通过转融通出借股份）								
股东名称	持有无限售条件流通股的数量		股份种类及数量					
	数量		种类	数量				
香港中央结算（代理人）有限公司	3,409,025,756		境外上市外资股	3,409,025,756				
上海海烟投资管理有限公司	635,084,623		人民币普通股	635,084,623				
光明食品（集团）有限公司	480,275,000		人民币普通股	480,275,000				
上海电气控股集团有限公司	343,767,818		人民币普通股	343,767,818				
申能（集团）有限公司	322,162,086		人民币普通股	322,162,086				
中国证券金融股份有限公司	258,104,024		人民币普通股	258,104,024				
上海国盛集团资产有限公司	238,382,008		人民币普通股	238,382,008				
上海久事（集团）有限公司	235,247,280		人民币普通股	235,247,280				
香港中央结算有限公司	234,083,689		人民币普通股	234,083,689				
中国建设银行股份有限公司 - 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	217,735,748		人民币普通股	217,735,748				
前十名股东中回购专户情况说明	-							
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	-							
上述股东关联关系或一致行动的说明	上海国盛集团资产有限公司为上海国盛（集团）有限公司的全资子公司，此外，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。							
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	-							

注：

1. 人民币普通股（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。
2. 上表中，境外上市外资股为 H 股。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。
3. 上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产有限公司持有本公司 A 股和 H 股共计 135,632.75 万股，占公司总股本的 10.38%；上海电气控股集团有限公司持有本公司 A 股和 H 股共计 64,643.02 万股，占公司总股本的 4.95%。
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。

## 持股 5% 以上股东、前十名股东及前十名无限售流通股股东参与转融通业务出借股份情况

单位：股

持股 5% 以上股东、前十名股东及前十名无限售流通股股东参与转融通业务出借股份情况								
股东名称（全称）	期初普通账户、信用账户持股		期初转融通出借股份且尚未归还		期末普通账户、信用账户持股		期末转融通出借股份且尚未归还	
	数量合计	比例（%）	数量合计	比例（%）	数量合计	比例（%）	数量合计	比例（%）
上海电气控股集团 有限公司	344,246,418	2.6350	300,000	0.0023	343,767,818	2.6314	778,600	0.0060
上海久事（集团） 有限公司	230,084,380	1.7612	5,162,900	0.0395	235,247,280	1.8007	0	0
中国建设银行股份 有限公司 - 国泰中 证全指证券公司交 易型开放式指数证 券投资基金	208,194,248	1.5936	1,468,400	0.0112	217,735,748	1.6667	440,600	0.0034

前十名股东及前十名无限售流通股股东因转融通出借 / 归还原因导致较上期发生变化

 适用  不适用

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

 适用  不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	上海国盛（集团）有限公司	781,250,000	2024 年 8 月 15 日	-	限售期 48 个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		无			

2020 年 8 月 5 日，公司向上海国盛集团等 13 家特定对象非公开发行人民币普通股（A 股）1,562,500,000 股完成后，公司的股份总数由 11,501,700,000 股增加至 13,064,200,000 股，其中，H 股仍为 3,409,568,820 股，A 股从 8,092,131,180 股增加到 9,654,631,180 股。增发完成后，公司无限售条件流通股为 11,501,700,000 股，有限售条件流通股为 1,562,500,000 股（均为本次非公开发行的 A 股股票）。公司非公开发行的部分限售股已分别于 2021 年 2 月 5 日、2022 年 2 月 7 日、2024 年 8 月 15 日解禁，具体内容详见 2021 年 1 月 30 日、2022 年 1 月 22 日、2024 年 8 月 9 日公司于上交所网站披露的《非公开发行限售股上市流通公告》（公告编号分别为：临 2021-004、临 2022-001、临 2024-051）。截至报告披露日，公司股份总数中无限售条件的流通股为 13,064,200,000 股，有限售条件的流通股为 0 股。

### (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

于2024年6月30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）于股份及相关股份中，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3)/淡仓(注4)/可供借出的股份
1.	Maunakai Capital Partners (Hong Kong) Limited	H 股	投资经理	272,590,000	2.09	7.99	好仓
2.	BSA Strategic Fund I	H 股	实益拥有人	272,590,000	2.09	7.99	好仓
3.	史静	H 股	酌情信托的成立人	228,000,000	1.75	6.69	好仓
4.	Wickhams Cay Trust Company Limited	H 股	受托人(注1)	228,000,000	1.75	6.69	好仓
5.	Abhaya Limited	H 股	受控制的法团的权益(注1)	228,000,000	1.75	6.69	好仓
6.	Heyday Trend Limited	H 股	实益拥有人(注1)	228,000,000	1.75	6.69	好仓
7.	上海国盛(集团)有限公司(注5)	H 股	实益拥有人	241,206,000	1.85	7.07	好仓
		A 股	实益拥有人	1,100,871,067	8.43	11.40	好仓
8.	上海电气控股集团有限公司	H 股	实益拥有人及受控制的法团的权益(注2)	307,409,200	2.35	9.02	好仓
9.	中国烟草总公司	A 股	实益拥有人	635,084,623	4.86	6.58	好仓

注1: Heyday Trend Limited 持有本公司 228,000,000 股 H 股。Abhaya Limited 透过其全资拥有的 Heyday Trend Limited 持有本公司 228,000,000 股 H 股。Abhaya Limited 由 Wickhams Cay Trust Company Limited 全资拥有，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 228,000,000 股 H 股中拥有权益。

注2: 上海电气集团香港有限公司持有本公司 4,746,800 股 H 股。上海电气集团香港有限公司由上海电气控股集团有限公司全资拥有，故上海电气控股集团有限公司被视为于上海电气集团香港有限公司持有的 4,746,800 股 H 股中拥有权益。

注3: 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4: 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。

注5: 为免疑议，因上述权益披露的范围不限于有关股东实际持有的股份，本表格中显示的有关股东持有权益的股份数目及比例与中期报告其他部分所披露的有关股东实质持有的股份数目和比例可能存在差异。

除上述披露外，于2024年6月30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）于本公司股份及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的权益或淡仓。

#### 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

于2024年6月30日，就本公司所获得的资料及据董事所知，概无本公司董事、监事或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。

#### (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

### 三、董事、监事和高级管理人员情况

#### (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情况

适用 不适用

#### (二) 董事、监事、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

#### (三) 其他说明

适用 不适用

### 四、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

公司无控股股东且无实际控制人，公司第一大股东上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产管理有限公司持有本公司股份比例为 10.38%，公司第一大股东情况如下：

名称	上海国盛（集团）有限公司
单位负责人或法定代表人	叶劲松
成立日期	2007 年 9 月 26 日
主要经营业务	开展以非金融为主，金融为辅的投资，资本运作与资产管理，产业研究，社会经济咨询。【依法经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

## 五、购回、出售或赎回上市证券

2024年1月30日，公司召开的第八届董事会第三次会议（临时会议）审议通过了《关于以集中竞价交易方式回购公司A股股份方案的议案》，该次回购是公司自2023年8月以来实施的第二次股份回购计划，已于2024年4月30日完成。具体实施情况详见下表：

回购股份方案名称	海通证券股份有限公司关于以集中竞价交易方式回购公司A股股份方案的公告（第二次）
回购股份方案披露时间	2024年1月31日
拟回购股份数量及占总股本的比例（%）	按照本次回购金额下限人民币3亿元、回购价格上限12.78元/股进行测算，拟回购数量约为2,347万股，约占公司总股本的0.18%；按照本次回购金额上限人民币6亿元、回购价格上限12.78元/股进行测算，拟回购数量约为4,695万股，约占公司总股本的0.36%。
拟回购金额	不低于人民币3亿元（含），不超过人民币6亿元（含）
拟回购期间	自公司董事会审议通过本次回购A股股份方案之日起不超过3个月
回购用途	维护公司价值及股东权益
已回购数量（股）	2024年4月30日，公司回购期限到期，实际回购公司A股股份35,567,000股，占公司总股本的0.2722%。
已回购数量占股权激励计划所涉及的标的股票的比例（%）（如有）	不适用
公司采用集中竞价交易方式减持回购股份的进展情况	不适用

报告期内，除上表所述内容，本公司及其附属公司未有购回、出售或赎回本公司的任何上市证券（惟代表本公司或附属公司的客户以代理人身份进行买卖者除外）。

## 第八节 债券相关情况





# 一、公司债券（含企业债券）和非金融企业债务融资工具

## （一）公司债券（含企业债券）

### 1、公司债券基本情况

以下为公司在半年度报告批准报出日存续的公司债券情况。

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	2024年 8月31 日后的最 近回售日	到期日	债券 余额	利率(%)	还本付 息方式	交易 场所	主承 销商	受托 管理人	投资者适 当性安排 (如有)	交易机制	是否存在 终止上市 交易的 风险
2013年公司债券(第二期) (10年期)	13海通06	122313	2014/7/14	2014/7/14	-	2024/7/14	-	5.85	单利按 年计息	上交所	中信	中信	社会公众投资者、机构投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向合格投资者公开发行 2017年公司债券(第二期)	17海通03	143301	2017/9/20	2017/9/22	-	2027/9/22	55	4.99	单利按 年计息	上交所	中信	中信	合格投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2020年公司债券(第一期) (品种二)	20海通05	163508	2020/4/29	2020/4/30	-	2025/4/30	7	2.88	单利按 年计息	上交所	中信	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司债券(第六期) (品种二)	21海通06	188458	2021/7/28	2021/7/29	-	2024/7/29	-	3.14	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司债券(第七期)	21海通07	188571	2021/8/19	2021/8/20	-	2024/8/20	-	3.04	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司债券(第八期) (品种一)	21海通08	188663	2021/8/27	2021/8/30	-	2024/8/30	-	3.10	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司债券(第八期) (品种二)	21海通09	188664	2021/8/27	2021/8/30	-	2026/8/30	20	3.43	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司债券(第九期)	21海通10	188962	2021/11/9	2021/11/10	-	2024/11/10	50	3.10	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司债券(第十期)	21海通11	185010	2021/11/19	2021/11/22	-	2024/11/22	50	3.09	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向专业投资者公开 发行次级债券(第一期)	22海通C1	185219	2022/1/11	2022/1/12	-	2025/1/12	50	3.18	单利按 年计息	上交所	中信	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向专业投资者公开 发行公司债券(第一期)	22海通01	185285	2022/1/19	2022/1/20	-	2024/12/25	50	2.84	单利按 年计息，到 期一次还 本付息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向专业投资者公开 发行公司债券(第二期)	22海通02	185359	2022/2/17	2022/2/21	-	2025/2/21	29	2.90	单利按 年计息	上交所	中信、 国信、 中信建 投、申 万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	2024年 8月31 日后的最 近回售日	到期日	债券 余额	利率(%)	还本付 息方式	交易 场所	主承 销商	受托 管理人	投资者适 当性安排 (如有)	交易机制	是否存在 终止上市 交易的 风险
2022年面向专业投资者公开发行次级债券(第二期)	22海通C2	185400	2022/2/24	2022/2/25	-	2025/2/25	20	3.15	单利按年计息	上交所	中信	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	22海通03	185448	2022/3/4	2022/3/7	-	2025/3/7	5	3.03	单利按年计息	上交所	中信、国信、中信建投、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行次级债券(第三期)	22海通C3	185472	2022/3/8	2022/3/9	-	2025/3/9	24.8	3.29	单利按年计息	上交所	中信	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第四期)	22海通04	137555	2022/7/25	2022/7/26	-	2025/7/26	50	2.75	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第五期)	22海通05	137799	2022/9/8	2022/9/9	-	2025/9/9	50	2.53	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第六期)	22海通06	137904	2022/10/13	2022/10/14	-	2025/10/14	47	2.60	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第七期)	22海通07	138571	2022/11/9	2022/11/10	-	2025/11/10	30	2.61	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种一)(第一期)	23海通01	138869	2023/2/7	2023/2/8	-	2025/2/8	25	2.95	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种二)(第一期)	23海通02	138870	2023/2/7	2023/2/8	-	2026/2/8	30	3.23	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种一)(第二期)	23海通03	115003	2023/3/3	2023/3/6	-	2025/3/6	25	3.11	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种二)(第二期)	23海通04	115004	2023/3/3	2023/3/6	-	2026/3/6	17	3.26	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种一)(第三期)	23海通05	115104	2023/3/21	2023/3/22	-	2025/3/22	33	2.97	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种二)(第三期)	23海通06	115105	2023/3/21	2023/3/22	-	2026/3/22	27	3.10	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种一)(第四期)	23海通07	115272	2023/4/21	2023/4/24	-	2025/4/24	20	2.89	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种二)(第四期)	23海通08	115273	2023/4/21	2023/4/24	-	2026/4/24	40	3.05	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(品种一)(第五期)	23海通09	115362	2023/5/17	2023/5/18	-	2026/5/18	36	2.94	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	2024年8月31日后的最近回售日	到期日	债券余额	利率(%)	还本付息方式	交易场所	主承销商	受托管理人	投资者适当性安排(如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第五期)(品种二)	23海通10	115363	2023/5/17	2023/5/18	-	2028/5/18	14	3.10	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	23海通11	115487	2023/6/14	2023/6/15	-	2026/6/15	30	2.73	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	23海通12	115488	2023/6/14	2023/6/15	-	2028/6/15	20	3.07	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第七期)(品种一)	23海通13	115618	2023/7/24	2023/7/25	-	2026/7/25	20	2.72	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第七期)(品种二)	23海通14	115619	2023/7/24	2023/7/25	-	2028/7/25	27	3.05	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第八期)	23海通15	155828	2023/8/17	2023/8/18	-	2026/8/18	32	2.67	单利按年计息	上交所	中信、申万宏源	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行短期公司债券(第一期)	23海通S1	240048	2023/11/14	2023/11/15	-	2024/10/25	50	2.68	到期一次还本付息	上交所	广发、财通、中银国际	广发	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第九期)	23海通16	240306	2023/11/23	2023/11/24	-	2026/11/24	18	2.95	单利按年计息	上交所	中信、广发、国信	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2024年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	24海通01	240454	2024/2/21	2024/2/22	-	2027/2/22	10	2.58	单利按年计息	上交所	中信、广发、华泰联合	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2024年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	24海通02	240587	2024/2/21	2024/2/22	-	2029/2/22	50	2.75	单利按年计息	上交所	中信、广发、华泰联合	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2024年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	24海通03	240643	2024/3/4	2024/3/5	-	2027/3/5	17	2.50	单利按年计息	上交所	中信、广发	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2024年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	24海通04	240644	2024/3/4	2024/3/5	-	2029/3/5	33	2.70	单利按年计息	上交所	中信、广发	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2024年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	24海通05	240748	2024/3/19	2024/3/20	-	2027/3/20	41	2.55	单利按年计息	上交所	中信、光大、国信	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2024年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	24海通06	240749	2024/3/19	2024/3/20	-	2029/3/20	30	2.69	单利按年计息	上交所	中信、光大、国信	中信	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

注：中信全名中信证券股份有限公司、中信建投全名中信建投证券股份有限公司、国信全名国信证券股份有限公司、申万宏源全名申万宏源证券有限公司、广发全名广发证券股份有限公司、财通全名财通证券股份有限公司、中银国际全名中银国际证券股份有限公司、华泰联合全名华泰联合证券有限责任公司、光大全名光大证券股份有限公司。

截至公司半年度报告报出日，13海通06、21海通06、21海通07、21海通08已完成兑付摘牌。

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

## 2、公司或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

## 3、信用评级结果调整情况

适用 不适用

其他说明

无

## 4、担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的变更、变化和执行情况及其影响

现状	执行情况	是否发生变更	变更后情况	变更原因	变更是否已取得有权机构批准	变更对债券投资者权益的影响
存续的公司债券均为无担保债券。	正常	否	-	-	-	-
严格按照债券募集说明书中有关偿债计划的约定履行兑付兑息职责。	正常	否	-	-	-	-
偿债保障措施包括制定《债券持有人会议规则》、设立专门的偿付工作小组、充分发挥受托管理人的作用、严格履行信息披露义务等。	正常	否	-	-	-	-

其他说明

未发生变更。

## 5、为债券发行及存续期业务提供服务的中介机构

中介机构名称	办公地址	服务内容	联系人 / 签字会计师	联系电话
中信证券股份有限公司	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 22、23 层	受托管理人	聂磊、祁继华、康雅然	010-60838888 010-60833046
广发证券股份有限公司	上海市浦东新区南泉北路 429 号泰康保险大厦 41 楼	受托管理人	马茜、张毅斌	021-38003800
普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	2020-2023 年度 A 股审计机构	许康玮、刘伟、王以彬	021-23238888
上海市锦天城律师事务所	上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 11、12 层	法律顾问	裴振宇、肖文艳	021-20511000
中诚信国际信用评级有限责任公司	北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101	资信评级机构	乔爽	010-66428877

中介机构名称	变更原因	履行程序	对债券投资者权益的影响
立信会计师事务所 (特殊普通合伙)	考虑公司现有业务状况、发展需求及整体审计需要, 选聘 2024 年度 A 股审计机构。	2024 年 6 月 27 日第八届董事会第九次会议、2024 年 7 月 18 日 2024 年第一次临时股东大会审议通过。	-

## (二) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

### (三) 公司债券募集资金情况

本公司所有公司债券在报告期内均不涉及募集资金使用或者整改  公司债券在报告期内涉及募集资金使用或者整改

债券代码：240454

债券简称：24 海通 01

#### 1、基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券全称	海通证券股份有限公司 2024 年面向专业机构投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）
是否为专项品种债券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
专项品种债券的具体类型	-
募集资金总额	10
报告期末募集资金余额	0
报告期末募集资金专项账户余额	0

#### 2、募集资金用途变更调整

约定的募集资金用途（请全文列示）	用于偿还到期公司债券本金和置换偿还到期公司债券本金的自有资金。
是否变更调整募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
变更调整募集资金用途履行的程序，该程序是否符合募集说明书的约定	-
变更调整募集资金用途的信息披露情况	-
变更调整后的募集资金用途及其合法合规性	-

#### 3、募集资金实际使用情况（此处不含临时补流）

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金实际使用金额	10
3.1.1 偿还有息债务（不含公司债券）金额	-
3.1.2 偿还有息债务（不含公司债券）情况	-
3.2.1 偿还公司债券金额	10
3.2.2 偿还公司债券情况	置换偿还 GC 海通 01 的自有资金
3.3.1 补充流动资金金额	-
3.3.2 补充流动资金情况	-
3.4.1 固定资产项目投资金额	-
3.4.2 固定资产项目投资情况	-
3.5.1 股权投资、债权投资或资产收购金额	-
3.5.2 股权投资、债权投资或资产收购情况	-
3.6.1 其他用途金额	-
3.6.2 其他用途具体情况	-

#### 4、募集资金用于特定项目

4.1 募集资金是否用于固定资产投资项目或者股权投资、债权投资或者资产收购等其他特定项目	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.1.1 项目进展情况	-
4.1.2 项目运营效益	-
4.1.3 项目抵押或质押事项办理情况（如有）	-
4.2 报告期内项目是否发生重大变化，或可能影响募集资金投入使用计划	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.2.1 项目变化情况	-
4.2.2 项目变化的程序履行情况	-
4.2.3 项目变化后，募集资金用途的变更情况（如有）	-
4.3 报告期末项目净收益是否较募集说明书等文件披露内容下降 50% 以上，或者报告期内发生其他可能影响项目实际运营情况的重大不利事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.3.1 项目净收益变化情况	-
4.3.2 项目净收益变化对公司偿债能力和投资者权益的影响、应对措施等	-
4.4 其他项目建设需要披露的事项	-

#### 5、临时补流情况

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金是否用于临时补充流动资金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
临时补流金额	-
临时补流情况，包括但不限于临时补流用途、开始和归还时间、履行的程序	-

#### 6、募集资金合规情况

截至报告期末募集资金实际用途（包括实际使用和临时补流）	置换偿还 GC 海通 01 的自有资金
实际用途与约定用途（含募集说明书约定用途和合规变更后的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
报告期内募集资金账户管理和使用是否合规	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
违规的具体情况（如有）	-
募集资金违规被处罚处分情况（如有）	-
募集资金违规的，是否已完成整改及整改情况（如有）	-
募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用
募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	-

债券代码：240587

债券简称：24 海通 02

#### 1、基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券全称	海通证券股份有限公司 2024 年面向专业机构投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）
是否为专项品种债券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
专项品种债券的具体类型	-
募集资金总额	50
报告期末募集资金余额	0
报告期末募集资金专项账户余额	0

## 2、募集资金用途变更调整

约定的募集资金用途（请全文列示）	用于偿还到期公司债券本金和置换偿还到期公司债券本金的自有资金。
是否变更调整募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
变更调整募集资金用途履行的程序，该程序是否符合募集说明书的约定	-
变更调整募集资金用途的信息披露情况	-
变更调整后的募集资金用途及其合法合规性	-

## 3、募集资金实际使用情况（此处不含临时补充）

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金实际使用金额	50
3.1.1 偿还有息债务（不含公司债券）金额	-
3.1.2 偿还有息债务（不含公司债券）情况	-
3.2.1 偿还公司债券金额	50
3.2.2 偿还公司债券情况	17 亿置换偿还 GC 海通 01 的自有资金，33 亿置换偿还 21 海通 01 的自有资金
3.3.1 补充流动资金金额	-
3.3.2 补充流动资金情况	-
3.4.1 固定资产项目投资金额	-
3.4.2 固定资产项目投资情况	-
3.5.1 股权投资、债权投资或资产收购金额	-
3.5.2 股权投资、债权投资或资产收购情况	-
3.6.1 其他用途金额	-
3.6.2 其他用途具体情况	-

## 4、募集资金用于特定项目

4.1 募集资金是否用于固定资产投资项目或者股权投资、债权投资或资产收购等其他特定项目	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.1.1 项目进展情况	-
4.1.2 项目运营效益	-
4.1.3 项目抵押或质押事项办理情况（如有）	-
4.2 报告期内项目是否发生重大变化，或可能影响募集资金投入使用计划	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.2.1 项目变化情况	-
4.2.2 项目变化的程序履行情况	-
4.2.3 项目变化后，募集资金用途的变更情况（如有）	-
4.3 报告期末项目净收益是否较募集说明书等文件披露内容下降 50% 以上，或者报告期内发生其他可能影响项目实际运营情况的重大不利事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.3.1 项目净收益变化情况	-
4.3.2 项目净收益变化对公司偿债能力和投资者权益的影响、应对措施等	-
4.4 其他项目建设需要披露的事项	-

## 5、临时补充情况

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金是否用于临时补充流动资金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
临时补充金额	-
临时补充情况，包括但不限于临时补充用途、开始和归还时间、履行的程序	-

## 6、募集资金合规情况

截至报告期末募集资金实际用途（包括实际使用和临时补流）	17 亿置换偿还 GC 海通 01 的自有资金，33 亿置换偿还 21 海通 01 的自有资金
实际用途与约定用途（含募集说明书约定用途和合规变更后的用途）是否一致	√是 □否
报告期内募集资金账户管理和使用是否合规	√是 □否
违规的具体情况（如有）	-
募集资金违规被处罚处分情况（如有）	-
募集资金违规的，是否已完成整改及整改情况（如有）	-
募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	□是 □否 √不适用
募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	-

债券代码：240643

债券简称：24 海通 03

### 1、基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券全称	海通证券股份有限公司 2024 年面向专业机构投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）
是否为专项品种债券	□是 √否
专项品种债券的具体类型	-
募集资金总额	17
报告期末募集资金余额	0
报告期末募集资金专项账户余额	0

### 2、募集资金用途变更调整

约定的募集资金用途（请全文列示）	用于置换偿还到期公司债券本金的自有资金
是否变更调整募集资金用途	□是 √否
变更调整募集资金用途履行的程序，该程序是否符合募集说明书的约定	-
变更调整募集资金用途的信息披露情况	-
变更调整后的募集资金用途及其合法合规性	-

### 3、募集资金实际使用情况（此处不含临时补流）

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金实际使用金额	17
3.1.1 偿还有息债务（不含公司债券）金额	-
3.1.2 偿还有息债务（不含公司债券）情况	-
3.2.1 偿还公司债券金额	17
3.2.2 偿还公司债券情况	置换偿还 21 海通 01 的自有资金
3.3.1 补充流动资金金额	-
3.3.2 补充流动资金情况	-
3.4.1 固定资产项目投资金额	-
3.4.2 固定资产项目投资情况	-
3.5.1 股权投资、债权投资或资产收购金额	-
3.5.2 股权投资、债权投资或资产收购情况	-
3.6.1 其他用途金额	-
3.6.2 其他用途具体情况	-



#### 4、募集资金用于特定项目

4.1 募集资金是否用于固定资产投资项目或者股权投资、债权投资或者资产收购等其他特定项目	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.1.1 项目进展情况	-
4.1.2 项目运营效益	-
4.1.3 项目抵押或质押事项办理情况（如有）	-
4.2 报告期内项目是否发生重大变化，或可能影响募集资金投入使用计划	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.2.1 项目变化情况	-
4.2.2 项目变化的程序履行情况	-
4.2.3 项目变化后，募集资金用途的变更情况（如有）	-
4.3 报告期末项目净收益是否较募集说明书等文件披露内容下降 50% 以上，或者报告期内发生其他可能影响项目实际运营情况的重大不利事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.3.1 项目净收益变化情况	-
4.3.2 项目净收益变化对公司偿债能力和投资者权益的影响、应对措施等	-
4.4 其他项目建设需要披露的事项	-

#### 5、临时补流情况

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金是否用于临时补充流动资金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
临时补流金额	-
临时补流情况，包括但不限于临时补流用途、开始和归还时间、履行的程序	-

#### 6、募集资金合规情况

截至报告期末募集资金实际用途（包括实际使用和临时补流）	置换偿还 21 海通 01 的自有资金
实际用途与约定用途（含募集说明书约定用途和合规变更后的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
报告期内募集资金账户管理和使用是否合规	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
违规的具体情况（如有）	-
募集资金违规被处罚处分情况（如有）	-
募集资金违规的，是否已完成整改及整改情况（如有）	-
募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用
募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	-

**债券代码：240644**
**债券简称：24 海通 04**

#### 1、基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券全称	海通证券股份有限公司 2024 年面向专业机构投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）
是否为专项品种债券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
专项品种债券的具体类型	-
募集资金总额	33
报告期末募集资金余额	0
报告期末募集资金专项账户余额	0

## 2、募集资金用途变更调整

约定的募集资金用途（请全文列示）	用于置换偿还到期公司债券本金的自有资金
是否变更调整募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
变更调整募集资金用途履行的程序，该程序是否符合募集说明书的约定	-
变更调整募集资金用途的信息披露情况	-
变更调整后的募集资金用途及其合法合规性	-

## 3、募集资金实际使用情况（此处不含临时补流）

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金实际使用金额	33
3.1.1 偿还有息债务（不含公司债券）金额	-
3.1.2 偿还有息债务（不含公司债券）情况	-
3.2.1 偿还公司债券金额	33
3.2.2 偿还公司债券情况	10 亿置换偿还 21 海通 01 的自有资金，23 亿置换偿还 21 海通 02 的自有资金
3.3.1 补充流动资金金额	-
3.3.2 补充流动资金情况	-
3.4.1 固定资产项目投资金额	-
3.4.2 固定资产项目投资情况	-
3.5.1 股权投资、债权投资或资产收购金额	-
3.5.2 股权投资、债权投资或资产收购情况	-
3.6.1 其他用途金额	-
3.6.2 其他用途具体情况	-

## 4、募集资金用于特定项目

4.1 募集资金是否用于固定资产投资项目或者股权投资、债权投资或资产收购等其他特定项目	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.1.1 项目进展情况	-
4.1.2 项目运营效益	-
4.1.3 项目抵押或质押事项办理情况（如有）	-
4.2 报告期内项目是否发生重大变化，或可能影响募集资金投入使用计划	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.2.1 项目变化情况	-
4.2.2 项目变化的程序履行情况	-
4.2.3 项目变化后，募集资金用途的变更情况（如有）	-
4.3 报告期末项目净收益是否较募集说明书等文件披露内容下降 50% 以上，或者报告期内发生其他可能影响项目实际运营情况的重大不利事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.3.1 项目净收益变化情况	-
4.3.2 项目净收益变化对公司偿债能力和投资者权益的影响、应对措施等	-
4.4 其他项目建设需要披露的事项	-

## 5、临时补流情况

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金是否用于临时补充流动资金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
临时补流金额	-
临时补流情况，包括但不限于临时补流用途、开始和归还时间、履行的程序	-

## 6、募集资金合规情况

截至报告期末募集资金实际用途（包括实际使用和临时补流）	10 亿置换偿还 21 海通 01 的自有资金，23 亿置换偿还 21 海通 02 的自有资金
实际用途与约定用途（含募集说明书约定用途和合规变更后的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
报告期内募集资金账户管理和使用是否合规	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
违规的具体情况（如有）	-
募集资金违规被处罚处分情况（如有）	-
募集资金违规的，是否已完成整改及整改情况（如有）	-
募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用
募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	-

债券代码：240748

债券简称：24 海通 05

### 1、基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券全称	海通证券股份有限公司 2024 年面向专业机构投资者公开发行公司债券（第三期）（品种一）
是否为专项品种债券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
专项品种债券的具体类型	-
募集资金总额	41
报告期末募集资金余额	0
报告期末募集资金专项账户余额	0

### 2、募集资金用途变更调整

约定的募集资金用途（请全文列示）	用于偿还到期公司债券本金和置换偿还到期公司债券本金的自有资金
是否变更调整募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
变更调整募集资金用途履行的程序，该程序是否符合募集说明书的约定	-
变更调整募集资金用途的信息披露情况	-
变更调整后的募集资金用途及其合法合规性	-

### 3、募集资金实际使用情况（此处不含临时补流）

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金实际使用金额	41
3.1.1 偿还有息债务（不含公司债券）金额	-
3.1.2 偿还有息债务（不含公司债券）情况	-
3.2.1 偿还公司债券金额	41
3.2.2 偿还公司债券情况	31 亿置换偿还 21 海通 02 的自有资金，10 亿偿还 21 海通 03 的自有资金
3.3.1 补充流动资金金额	-
3.3.2 补充流动资金情况	-
3.4.1 固定资产项目投资金额	-
3.4.2 固定资产项目投资情况	-
3.5.1 股权投资、债权投资或资产收购金额	-
3.5.2 股权投资、债权投资或资产收购情况	-
3.6.1 其他用途金额	-
3.6.2 其他用途具体情况	-

#### 4、募集资金用于特定项目

4.1 募集资金是否用于固定资产投资项目或者股权投资、债权投资或者资产收购等其他特定项目	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.1.1 项目进展情况	-
4.1.2 项目运营效益	-
4.1.3 项目抵押或质押事项办理情况（如有）	-
4.2 报告期内项目是否发生重大变化，或可能影响募集资金投入使用计划	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.2.1 项目变化情况	-
4.2.2 项目变化的程序履行情况	-
4.2.3 项目变化后，募集资金用途的变更情况（如有）	-
4.3 报告期末项目净收益是否较募集说明书等文件披露内容下降 50% 以上，或者报告期内发生其他可能影响项目实际运营情况的重大不利事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.3.1 项目净收益变化情况	-
4.3.2 项目净收益变化对公司偿债能力和投资者权益的影响、应对措施等	-
4.4 其他项目建设需要披露的事项	-

#### 5、临时补流情况

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金是否用于临时补充流动资金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
临时补流金额	-
临时补流情况，包括但不限于临时补流用途、开始和归还时间、履行的程序	-

#### 6、募集资金合规情况

截至报告期末募集资金实际用途（包括实际使用和临时补流）	31 亿置换偿还 21 海通 02 的自有资金，10 亿偿还 21 海通 03 的自有资金
实际用途与约定用途（含募集说明书约定用途和合规变更后的用途）是否一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
报告期内募集资金账户管理和使用是否合规	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
违规的具体情况（如有）	-
募集资金违规被处罚处分情况（如有）	-
募集资金违规的，是否已完成整改及整改情况（如有）	-
募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用
募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	-

**债券代码：240749**
**债券简称：24 海通 06**

#### 1、基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券全称	海通证券股份有限公司 2024 年面向专业机构投资者公开发行公司债券（第三期）（品种二）
是否为专项品种债券	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
专项品种债券的具体类型	-
募集资金总额	30
报告期末募集资金余额	0
报告期末募集资金专项账户余额	0

## 2、募集资金用途变更调整

约定的募集资金用途（请全文列示）	用于偿还到期公司债券本金和置换偿还到期公司债券本金的自有资金
是否变更调整募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
变更调整募集资金用途履行的程序，该程序是否符合募集说明书的约定	-
变更调整募集资金用途的信息披露情况	-
变更调整后的募集资金用途及其合法合规性	-

## 3、募集资金实际使用情况（此处不含临时补流）

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金实际使用金额	30
3.1.1 偿还有息债务（不含公司债券）金额	-
3.1.2 偿还有息债务（不含公司债券）情况	-
3.2.1 偿还公司债券金额	30
3.2.2 偿还公司债券情况	偿还 21 海通 03 的自有资金
3.3.1 补充流动资金金额	-
3.3.2 补充流动资金情况	-
3.4.1 固定资产项目投资金额	-
3.4.2 固定资产项目投资情况	-
3.5.1 股权投资、债权投资或资产收购金额	-
3.5.2 股权投资、债权投资或资产收购情况	-
3.6.1 其他用途金额	-
3.6.2 其他用途具体情况	-

## 4、募集资金用于特定项目

4.1 募集资金是否用于固定资产投资项目或者股权投资、债权投资或资产收购等其他特定项目	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.1.1 项目进展情况	-
4.1.2 项目运营效益	-
4.1.3 项目抵押或质押事项办理情况（如有）	-
4.2 报告期内项目是否发生重大变化，或可能影响募集资金投入使用计划	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.2.1 项目变化情况	-
4.2.2 项目变化的程序履行情况	-
4.2.3 项目变化后，募集资金用途的变更情况（如有）	-
4.3 报告期末项目净收益是否较募集说明书等文件披露内容下降 50% 以上，或者报告期内发生其他可能影响项目实际运营情况的重大不利事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
4.3.1 项目净收益变化情况	-
4.3.2 项目净收益变化对公司偿债能力和投资者权益的影响、应对措施等	-
4.4 其他项目建设需要披露的事项	-

## 5、临时补流情况

单位：亿元 币种：人民币

报告期内募集资金是否用于临时补充流动资金	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
临时补流金额	-
临时补流情况，包括但不限于临时补流用途、开始和归还时间、履行的程序	-

## 6、募集资金合规情况

截至报告期末募集资金实际用途（包括实际使用和临时补充）	偿还 21 海通 03 的自有资金
实际用途与约定用途（含募集说明书约定用途和合规变更后的用途）是否一致	√是 □否
报告期内募集资金账户管理和使用是否合规	√是 □否
违规的具体情况（如有）	-
募集资金违规被处罚处分情况（如有）	-
募集资金违规的，是否已完成整改及整改情况（如有）	-
募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	□是 □否 √不适用
募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	-

## (四) 专项品种债券应当披露的其他事项

适用 不适用

## (五) 报告期内公司债券相关重要事项

### 1、非经营性往来占款和资金拆借

适用 不适用

### 2、负债情况

#### (1) 有息债务及其变动情况

##### 1.1 公司债务结构情况

报告期初和报告期末，公司（非公司合并范围口径）有息债务余额分别为 2,521.52 亿元和 2,394.64 亿元，报告期内有息债务余额同比变动 -5.03%。

单位：亿元 币种：人民币

有息债务类别	到期时间			金额合计	金额占有息债务的占比 (%)
	已逾期	6 个月以内 (含)	6 个月以上		
公司信用类债券	-	296.64	982.80	1,279.44	53.43
银行贷款	-	-	-	-	-
非银行金融机构贷款	-	-	-	-	-
其他有息债务	-	1,012.91	102.29	1,115.20	46.57
合计	-	1,309.55	1,085.09	2,394.64	-

注：有息债务科目包括短期借款、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、长期借款和应付债券

报告期末公司存续的公司信用类债券中，公司债券余额 1,279.44 亿元，企业债券余额 0 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0 亿元，且共有 200 亿元公司债券在 2024 年 9 至 12 月内到期或回售偿付。

## 1.2 公司合并口径有息债务结构情况

报告期初和报告期末，公司合并报表范围内公司有息债务余额分别为 4,134.04 亿元和 3,946.27 亿元，报告期内有息债务余额同比变动 -4.54%。

单位：亿元 币种：人民币

有息债务类别	到期时间			金额合计	金额占有息债务的占比 (%)
	已逾期	6 个月以内 (含)	6 个月以上		
公司信用类债券	-	360.75	1,191.80	1,552.55	39.34
银行贷款	-	385.77	313.78	699.55	17.73
非银行金融机构贷款	-	1.78	2.41	4.19	0.11
其他有息债务	-	1,226.34	463.64	1,689.98	42.82
合计	-	1,974.64	1,971.63	3,946.27	-

注：有息债务科目包括短期借款、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、长期借款和应付债券

报告期末，公司合并口径存续的公司信用类债券中，公司债券余额 1,400.48 亿元，企业债券余额 0 亿元，非金融企业债务融资工具余额 152.07 亿元，且共有 240 亿元公司信用类债券在 2024 年 9 至 12 月内到期或回售偿付。

## 1.3 境外债券情况

截至报告期末，公司合并报表范围内发行的境外债券余额 319.82 亿元人民币，且在 2024 年 9 至 12 月内到期的境外债券余额为 4.74 亿元人民币。

**(2) 报告期末公司及其子公司存在逾期金额超过 1000 万元的有息债务或者公司信用类债券逾期情况**

适用  不适用

## (3) 主要负债情况及其变动原因

单位：亿元 币种：人民币

负债项目	本期末余额	2023 年余额	变动比例 (%)	变动比例超过 30% 的，说明原因
短期借款	333.96	310.54	7.54	
应付短期融资款	155.71	188.53	-17.41	
拆入资金	195.05	147.12	32.58	银行拆入增加
卖出回购金融资产款	997.26	1,125.65	-11.41	
长期借款	369.77	422.99	-12.58	
应付债券	1,894.51	1,939.20	-2.30	
代理买卖证券款	1,065.26	1,065.39	-0.01	

## (4) 可对抗第三人的优先偿付负债情况

截至报告期末，公司合并报表范围内存在可对抗第三人的优先偿付负债：

适用  不适用

## (六) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

适用  不适用

## (七) 主要会计数据和财务指标

单位：亿元 币种：人民币

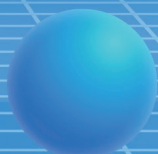
主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减 (%)	变动原因
流动比率	1.93	1.81	6.63	
速动比率	1.93	1.81	6.63	
资产负债率 (%)	72.16	73.03	-1.19	
	本报告期 (1-6 月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)	变动原因
扣除非经常性损益后净利润	5.46	32.12	-83.01	利润减少
EBITDA 全部债务比	0.02	0.03	-33.33	利润减少
利息保障倍数	1.27	1.69	-24.85	
现金利息保障倍数	3.91	-0.10	不适用	
EBITDA 利息保障倍数	1.40	1.80	-22.22	
贷款偿还率 (%)	100	100	-	
利息偿付率 (%)	100	100	-	

## 二、可转换公司债券情况

适用 不适用



## 第九节 财务报告



## 审计报告

□适用 √不适用

## 财务报表

### 合并资产负债表

2024年6月30日

单位：人民币元

资产	附注五	2024年6月30日（未经审计）	2023年12月31日（经审计）
<b>资产：</b>			
货币资金	(一)	147,350,960,191.27	142,730,777,859.05
其中：客户存款		80,750,247,335.61	87,407,094,246.01
结算备付金	(二)	15,900,997,855.89	15,584,377,719.97
其中：客户备付金		10,359,667,970.74	10,144,093,909.65
拆出资金	(三)	831,818,601.45	330,294,865.04
融出资金	(四)	63,944,096,200.47	68,418,207,732.52
衍生金融资产	(五)	2,079,841,813.63	2,278,555,353.41
存出保证金	(六)	20,862,505,578.13	23,643,821,500.73
应收款项	(七)	8,320,102,103.69	12,167,274,566.35
买入返售金融资产	(八)	32,836,520,013.53	36,783,232,348.48
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	(九)	211,398,285,277.46	221,273,089,992.22
债权投资	(十)	4,712,994,209.36	6,797,779,540.34
其他债权投资	(十一)	57,213,247,473.03	61,310,746,563.80
其他权益工具投资	(十二)	10,416,425,857.16	8,010,844,169.78
应收融资租赁款	(十三)	17,874,083,292.27	19,892,444,035.52
长期应收款	(十三)	73,101,760,386.66	79,516,505,296.66
长期股权投资	(十四)	7,560,571,821.52	8,115,625,880.46
投资性房地产	(十五)	2,502,580,909.15	2,635,840,880.51
固定资产	(十六)	15,665,940,349.68	15,966,032,047.33
在建工程	(十七)	287,646,178.09	239,974,752.42
使用权资产	(十八)	962,267,683.87	1,057,984,935.91
无形资产	(十九)	1,316,983,317.54	1,368,436,800.26
其中：数据资源		4,135,609.17	
商誉	(二十)	3,476,949,986.46	3,468,588,623.00
递延所得税资产	(二十一)	3,302,173,659.10	4,187,114,227.47
其他资产	(二十二)	19,495,781,812.32	18,809,242,543.41
<b>资产总计</b>		<b>721,414,534,571.73</b>	<b>754,586,792,234.64</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

## 合并资产负债表（续）

2024年6月30日

单位：人民币元

负债和股东权益	附注五	2024年6月30日（未经审计）	2023年12月31日（经审计）
<b>负债：</b>			
短期借款	(二十六)	33,396,442,371.46	31,053,895,350.17
应付短期融资款	(二十七)	15,571,430,187.50	18,853,059,412.54
拆入资金	(二十八)	19,504,997,024.24	14,712,363,886.93
交易性金融负债	(二十九)	12,247,300,856.30	20,453,404,949.34
衍生金融负债	(五)	1,230,667,052.14	1,190,945,093.92
卖出回购金融资产款	(三十)	99,725,679,018.20	112,564,792,535.08
代理买卖证券款	(三十一)	106,526,337,287.99	106,538,716,590.39
应付职工薪酬	(三十二)	2,322,489,011.52	2,583,856,817.20
应交税费	(三十三)	876,577,928.82	1,251,942,089.10
应付款项	(三十四)	11,371,856,610.63	15,134,315,108.69
合同负债		19,174,311.93	19,174,311.93
预计负债	(三十五)	158,579,313.54	193,964,285.02
长期借款	(三十六)	36,977,280,684.23	42,299,324,666.85
应付债券	(三十七)	189,450,771,465.64	193,920,279,749.62
租赁负债	(十八)	1,003,285,896.96	1,097,164,887.46
递延所得税负债	(二十一)	546,508,277.17	835,047,755.22
其他负债	(三十八)	19,293,602,075.82	17,084,985,028.85
<b>负债合计</b>		<b>550,222,979,374.09</b>	<b>579,787,232,518.31</b>
<b>股东权益：</b>			
股本	(三十九)	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
资本公积	(四十)	75,877,536,528.89	75,764,593,348.84
减：库存股	(四十一)	717,407,703.67	414,335,029.18
其他综合收益	(四十二)	-823,033,615.97	-1,304,576,076.39
盈余公积	(四十三)	10,388,208,598.52	10,388,208,598.52
一般风险准备	(四十四)	23,442,471,476.07	23,410,252,403.25
未分配利润	(四十五)	41,795,755,178.13	42,335,647,242.12
归属于母公司股东权益合计		163,027,730,461.97	163,243,990,487.16
少数股东权益		8,163,824,735.67	11,555,569,229.17
<b>股东权益合计</b>		<b>171,191,555,197.64</b>	<b>174,799,559,716.33</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>721,414,534,571.73</b>	<b>754,586,792,234.64</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

## 母公司资产负债表

2024年6月30日

单位：人民币元

资产	附注十四	2024年6月30日(未经审计)	2023年12月31日(经审计)
<b>资产：</b>			
货币资金		85,606,918,763.17	79,625,885,997.64
其中：客户存款		53,467,939,190.06	52,936,067,450.78
结算备付金		17,560,089,033.27	24,107,689,062.10
其中：客户备付金		8,360,462,995.77	8,926,721,343.02
融出资金		57,515,654,476.34	61,131,860,631.26
衍生金融资产		1,611,035,479.44	2,024,912,793.00
存出保证金		2,705,418,719.74	5,961,707,957.91
应收款项		1,857,275,766.87	7,131,698,579.32
买入返售金融资产		28,876,077,498.82	31,788,485,388.71
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产		153,527,888,001.83	156,691,996,713.08
其他债权投资		54,602,269,192.65	59,529,974,849.37
其他权益工具投资		9,828,595,606.04	7,341,580,544.83
长期股权投资	(一)	45,436,519,334.66	47,524,308,319.81
投资性房地产		11,469,523.87	12,006,782.35
固定资产		8,418,340,176.09	8,581,654,531.70
在建工程		105,382,387.14	69,369,174.98
使用权资产		583,742,080.34	599,460,576.88
无形资产		435,755,369.68	460,239,723.71
其中：数据资源		4,135,609.17	
递延所得税资产		240,722,168.24	986,294,745.59
其他资产		7,603,968,059.13	3,941,336,582.95
<b>资产总计</b>		<b>476,527,121,637.32</b>	<b>497,510,462,955.19</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

## 母公司资产负债表（续）

2024年6月30日

单位：人民币元

负债和股东权益	附注十四	2024年6月30日（未经审计）	2023年12月31日（经审计）
<b>负债：</b>			
应付短期融资款		11,528,907,735.71	12,490,340,611.93
拆入资金		17,250,038,488.89	12,373,421,049.99
交易性金融负债		7,535,956,205.73	12,960,092,783.48
衍生金融负债		1,108,109,559.65	1,600,285,812.24
卖出回购金融资产款		87,394,926,378.09	100,099,718,117.35
代理买卖证券款		63,561,445,729.98	65,128,914,705.54
应付职工薪酬		928,635,714.86	990,231,068.60
应交税费		136,360,736.17	170,024,777.28
应付款项		5,949,507,798.46	10,054,241,254.87
应付债券		123,290,034,090.68	127,188,761,380.11
租赁负债		579,992,897.38	595,171,366.70
其他负债		1,817,075,380.37	588,093,878.24
<b>负债合计</b>		<b>321,080,990,715.97</b>	<b>344,239,296,806.33</b>
<b>股东权益：</b>			
股本		13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
资本公积		74,757,884,043.68	74,757,884,043.68
减：库存股		717,407,703.67	414,335,029.18
其他综合收益		553,023,041.15	-145,958,672.15
盈余公积		10,388,208,598.52	10,388,208,598.52
一般风险准备		20,777,866,662.72	20,776,417,197.04
未分配利润		36,622,356,278.95	34,844,750,010.95
<b>股东权益合计</b>		<b>155,446,130,921.35</b>	<b>153,271,166,148.86</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>476,527,121,637.32</b>	<b>497,510,462,955.19</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

## 合并利润表

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	附注五	本期发生额（未经审计）	上期发生额（未经审计）
<b>一、营业总收入</b>		8,864,757,835.68	16,968,366,973.04
手续费及佣金净收入	(四十六)	3,504,210,450.73	4,940,568,989.46
其中：经纪业务手续费净收入		1,690,678,470.69	1,971,925,520.74
投资银行业务手续费净收入		854,277,846.30	1,949,290,370.16
资产管理业务手续费净收入		841,205,938.43	932,465,708.29
利息净收入	(四十七)	1,770,804,207.17	2,184,402,807.96
其中：金融资产利息收入		8,187,999,722.54	9,320,529,028.84
融资租赁收入		765,501,167.53	781,924,708.86
利息支出		-7,182,696,682.90	-7,918,050,929.74
投资收益（损失以“-”号填列）	(四十八)	2,190,781,817.46	3,718,096,492.65
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		-71,235,100.98	479,771,270.73
其他收益	(四十九)	546,164,427.73	792,742,726.68
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	(五十)	-470,977,537.23	48,516,768.26
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-65,963,223.89	-205,419,634.21
其他业务收入	(五十一)	1,388,959,975.36	5,489,305,835.61
资产处置收益（损失以“-”号填列）		777,718.35	152,986.63
<b>二、营业总支出</b>		6,978,044,391.83	11,802,086,981.64
税金及附加	(五十二)	115,477,647.08	129,063,839.70
业务及管理费	(五十三)	4,959,258,038.37	5,695,858,828.97
信用减值损失	(五十四)	870,126,365.68	1,203,824,441.24
其他资产减值损失	(五十五)	15,647,623.19	9,877,840.94
其他业务成本	(五十一)	1,017,534,717.51	4,763,462,030.79
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>		1,886,713,443.85	5,166,279,991.40
加：营业外收入	(五十六)	36,624,929.12	99,287,759.09
减：营业外支出	(五十七)	17,462,296.35	13,843,302.68
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,905,876,076.62	5,251,724,447.81
减：所得税费用	(五十八)	676,352,013.39	1,326,992,645.72
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,229,524,063.23	3,924,731,802.09
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,229,524,063.23	3,924,731,802.09
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. 归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列）		953,097,368.84	3,829,634,781.60
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		276,426,694.39	95,097,020.49

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

## 合并利润表（续）

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	附注五	本期发生额（未经审计）	上期发生额（未经审计）
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		291,108,290.69	795,560,056.64
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		323,645,975.08	551,978,256.34
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		59,285,093.53	58,291,960.75
1. 重新计量设定受益计划变动额		10,627,495.90	-2,265,927.31
2. 其他权益工具投资公允价值变动		48,657,597.63	60,557,888.06
（二）将重分类进损益的其他综合收益		264,360,881.55	493,686,295.59
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		669,581.57	2,986,155.20
2. 其他债权投资公允价值变动		400,631,687.53	245,048,485.52
3. 其他债权投资信用损失准备		12,615,023.57	-28,194,730.21
4. 现金流量套期储备		10,858,576.04	46,582,152.62
5. 外币财务报表折算差额		-160,413,987.16	227,264,232.46
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		-32,537,684.39	243,581,800.30
<b>七、综合收益总额</b>		1,520,632,353.92	4,720,291,858.73
归属于母公司股东的综合收益总额		1,276,743,343.92	4,381,613,037.94
归属于少数股东的综合收益总额		243,889,010.00	338,678,820.79
<b>八、每股收益</b>			
（一）基本每股收益（元/股）		0.07	0.29
（二）稀释每股收益（元/股）		0.07	0.29

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

## 母公司利润表

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	附注十四	本期发生额（未经审计）	上期发生额（未经审计）
<b>一、营业总收入</b>		6,737,515,324.00	7,285,907,605.02
手续费及佣金净收入	(二)	2,115,122,691.38	3,543,881,582.10
其中：经纪业务手续费净收入		1,445,893,148.02	1,721,378,711.90
投资银行业务手续费净收入		566,546,465.69	1,753,920,625.71
利息净收入	(三)	756,634,800.74	1,211,799,389.53
其中：金融资产利息收入		4,004,265,727.17	4,741,396,853.52
利息支出		-3,247,630,926.43	-3,529,597,463.99
投资收益（损失以“-”号列示）	(四)	1,460,080,111.23	1,926,025,118.37
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		214,844,433.28	295,914,926.63
其他收益		254,886,082.59	403,723,855.91
公允价值变动收益（损失以“-”号列示）	(五)	2,143,128,978.77	381,397,252.22
汇兑收益（损失以“-”号列示）		1,026,787.22	-186,113,715.01
其他业务收入		5,805,671.53	4,967,542.46
资产处置收益（损失以“-”号填列）		830,200.54	226,579.44
<b>二、营业总支出</b>		2,962,618,098.09	3,365,095,490.43
税金及附加		69,044,719.57	81,590,719.49
业务及管理费	(六)	2,821,701,390.56	3,248,664,360.21
信用减值损失		71,334,729.48	34,303,152.25
其他业务成本		537,258.48	537,258.48
<b>三、营业利润（亏损以“-”号列示）</b>		3,774,897,225.91	3,920,812,114.59
加：营业外收入		7,060,151.89	14,311,030.13
减：营业外支出		13,294,066.92	11,251,835.33
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号列示）</b>		3,768,663,310.88	3,923,871,309.39
减：所得税费用		532,998,538.56	598,272,292.61
<b>五、净利润（净亏损以“-”号列示）</b>		3,235,664,772.32	3,325,599,016.78
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		3,235,664,772.32	3,325,599,016.78
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		541,085,227.96	242,874,800.72
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		134,474,000.78	41,850,695.17
1. 其他权益工具投资公允价值变动		134,474,000.78	41,850,695.17
（二）将重分类进损益的其他综合收益		406,611,227.18	201,024,105.55
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		669,581.57	2,986,155.20
2. 其他债权投资公允价值变动		394,268,715.22	234,729,644.60
3. 其他债权投资信用损失准备		11,672,930.39	-36,691,694.25
<b>七、综合收益总额</b>		3,776,750,000.28	3,568,473,817.50

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人



## 合并现金流量表

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	附注五	本期发生额（未经审计）	上期发生额（未经审计）
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
收取利息、手续费及佣金的现金		10,184,790,446.56	12,548,486,872.67
为交易目的而持有的金融资产净减少额		4,770,564,185.90	5,931,017,211.27
拆入资金净增加额		4,315,629,186.22	2,931,754,889.53
融出资金净减少额		4,257,481,552.93	894,483,092.29
代理买卖证券收到的现金净额		2,591,435.96	4,358,453,331.21
收到其他与经营活动有关的现金	(五十九)	18,113,016,671.43	11,618,107,910.63
经营活动现金流入小计		41,644,073,479.00	38,282,303,307.60
回购业务资金净减少额		8,788,038,732.78	27,055,244,203.71
支付利息、手续费及佣金的现金		3,835,086,252.85	3,733,270,070.74
支付给职工及为职工支付的现金		3,332,147,267.75	3,940,097,697.87
支付的各项税费		885,812,610.62	2,897,082,585.26
支付其他与经营活动有关的现金	(五十九)	5,520,837,273.53	11,398,801,541.86
经营活动现金流出小计		22,361,922,137.53	49,024,496,099.44
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	<b>(六十)</b>	<b>19,282,151,341.47</b>	<b>-10,742,192,791.84</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		34,526,670,217.31	19,361,060,634.66
取得投资收益收到的现金		1,326,517,149.13	1,059,824,674.06
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		116,542,826.07	2,850,209.12
投资活动现金流入小计		35,969,730,192.51	20,423,735,517.84
投资支付的现金		29,885,558,347.53	14,680,185,809.59
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		301,618,311.65	344,625,618.68
投资活动现金流出小计		30,187,176,659.18	15,024,811,428.27
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>5,782,553,533.33</b>	<b>5,398,924,089.57</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		3,010,000.00	64,301,720.50
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		3,010,000.00	64,301,720.50
取得借款收到的现金		39,645,188,965.97	42,526,736,614.21
发行债券收到的现金		45,309,376,401.52	68,877,961,409.37
筹资活动现金流入小计		84,957,575,367.49	111,468,999,744.08
偿还债务支付的现金		95,602,337,316.05	94,810,967,367.70
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		5,592,909,778.61	5,460,455,381.98
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			278,192,179.57
支付其他与筹资活动有关的现金	(五十九)	3,535,760,091.41	273,139,438.07
筹资活动现金流出小计		104,731,007,186.07	100,544,562,187.75
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-19,773,431,818.58</b>	<b>10,924,437,556.33</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		<b>-15,277,662.16</b>	<b>772,761,713.21</b>
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	<b>(六十)</b>	<b>5,275,995,394.06</b>	<b>6,353,930,567.27</b>
加：期初现金及现金等价物余额		154,862,040,644.88	176,699,519,071.53
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	<b>(六十)</b>	<b>160,138,036,038.94</b>	<b>183,053,449,638.80</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

## 母公司现金流量表

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	附注十四	本期发生额（未经审计）	上期发生额（未经审计）
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
收取利息、手续费及佣金的现金		6,342,420,830.76	8,717,408,703.13
为交易目的而持有的金融资产净减少额		2,263,371,593.90	3,652,340,665.08
拆入资金净增加额		4,900,000,000.00	3,700,000,000.00
融出资金净减少额		3,491,608,833.54	
代理买卖证券收到的现金净额			3,553,667,013.30
收到其他与经营活动有关的现金		3,502,606,416.66	3,805,553,012.20
经营活动现金流入小计		20,500,007,674.86	23,428,969,393.71
回购业务资金净减少额		9,667,115,246.44	30,387,425,386.95
代理买卖证券支付的现金净额		1,567,468,975.56	
融出资金净增加额			705,326,518.53
支付利息、手续费及佣金的现金		1,848,085,355.40	2,084,343,933.70
支付给职工及为职工支付的现金		1,866,787,544.85	2,307,010,499.08
支付的各项税费		267,300,582.09	727,425,229.32
支付其他与经营活动有关的现金		6,189,784,413.50	1,572,419,677.44
经营活动现金流出小计		21,406,542,117.84	37,783,951,245.02
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	(七)	-906,534,442.98	-14,354,981,851.31
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		33,598,186,956.44	17,129,888,267.08
取得投资收益收到的现金		2,475,305,856.23	735,049,796.43
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		12,247,166.87	5,169,323.60
投资活动现金流入小计		36,085,739,979.54	17,870,107,387.11
投资支付的现金		28,185,297,361.86	11,184,346,738.66
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		246,991,879.52	267,702,350.89
投资活动现金流出小计		28,432,289,241.38	11,452,049,089.55
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		7,653,450,738.16	6,418,058,297.56
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
发行债券收到的现金		29,596,806,000.00	38,728,039,700.00
筹资活动现金流入小计		29,596,806,000.00	38,728,039,700.00
偿还债务支付的现金		34,121,646,700.00	30,049,692,700.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,405,118,847.22	2,236,249,611.58
支付其他与筹资活动有关的现金		414,973,478.97	104,539,715.63
筹资活动现金流出小计		36,941,739,026.19	32,390,482,027.21
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-7,344,933,026.19	6,337,557,672.79
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		7,590,179.18	48,107,836.94
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	(七)	-590,426,551.83	-1,551,258,044.02
加：期初现金及现金等价物余额		103,638,468,270.99	125,324,821,911.95
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	(七)	103,048,041,719.16	123,773,563,867.93

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

## 合并股东权益变动表

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	2024年1-6月(未经审计)							股东权益合计	
	归属于母公司股东权益								
	股本	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	少数股东权益	
一、2023年12月31日余额	13,064,200,000.00	75,764,593,348.84	414,335,029.18	-1,304,576,076.39	10,388,208,598.52	23,410,252,403.25	42,335,647,242.12	11,555,569,229.17	174,799,559,716.33
二、2024年1月1日余额	13,064,200,000.00	75,764,593,348.84	414,335,029.18	-1,304,576,076.39	10,388,208,598.52	23,410,252,403.25	42,335,647,242.12	11,555,569,229.17	174,799,559,716.33
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)		112,943,180.05	303,072,674.49	481,542,460.42		32,219,072.82	-539,892,063.99	-3,391,744,493.50	-3,608,004,518.69
(一) 综合收益总额				323,645,975.08			953,097,368.84	243,889,010.00	1,520,632,353.92
(二) 股东投入和减少资本		112,943,180.05	303,072,674.49				-4,197,788.37	-3,515,789,142.37	-3,710,116,425.18
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									-470,000,000.00
(三) 利润分配									
1. 提取盈余公积									
2. 提取一般风险准备									
3. 对股东的分配									
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. 设定受益计划变动额结转留存收益									
5. 其他综合收益结转留存收益									
6. 其他									
四、2024年6月30日余额	13,064,200,000.00	75,877,536,528.89	717,407,703.67	-823,033,615.97	10,388,208,598.52	23,442,471,476.07	41,795,755,178.13	8,163,824,735.67	171,191,555,197.64

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

## 合并股东权益变动表（续）

2023年1-6月

单位：人民币元

项目	2023年1-6月（未经审计）							少数股东权益	股东权益合计
	股本	资本公积	减：库存股	归属于母公司股东权益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、2022年12月31日余额	13,064,200,000.00	75,007,558,592.52		其他综合收益	9,656,101,246.57	21,782,272,819.21	46,699,136,993.48	13,030,101,186.89	177,622,057,617.14
二、2023年1月1日余额	13,064,200,000.00	75,007,558,592.52		其他综合收益	9,656,101,246.57	21,782,272,819.21	46,699,136,993.48	13,030,101,186.89	177,622,057,617.14
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）		802,099,914.56			586,213,224.82	52,958,263.16	986,406,684.30	-181,203,901.70	2,246,474,185.14
（一）综合收益总额					551,978,256.34	3,829,634,781.60		338,678,820.79	4,720,291,858.73
1. 股东投入和减少资本		802,099,914.56				-12,545,349.52		-241,690,542.92	547,864,022.12
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		542,948.13							480,000,000.00
4. 其他		801,556,966.43							4,755,202.55
（二）利润分配									
1. 提取盈余公积									
2. 提取一般风险准备									
3. 对股东的分配									
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. 设定受益计划变动额结转留存收益									
5. 其他综合收益结转留存收益									
6. 其他									
四、2023年6月30日余额	13,064,200,000.00	75,809,658,507.08			9,656,101,246.57	21,835,231,082.37	47,685,543,677.78	12,848,897,285.19	179,868,531,802.28

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

张信军

马中

法定代表人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 母公司股东权益变动表

2024年1-6月

单位：人民币元

项目	2024年1-6月金额（未经审计）						股东权益合计
	股本	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	
一、2023年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,757,884,043.68	414,335,029.18	-145,958,672.15	10,388,208,598.52	20,776,417,197.04	153,271,166,148.86
二、2024年1月1日余额	13,064,200,000.00	74,757,884,043.68	414,335,029.18	-145,958,672.15	10,388,208,598.52	20,776,417,197.04	153,271,166,148.86
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）							
（一）综合收益总额			303,072,674.49	698,981,713.30		1,449,465.68	2,174,964,772.49
（二）股东投入和减少资本			303,072,674.49	541,085,227.96		3,235,664,772.32	3,776,750,000.28
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			303,072,674.49			1,449,465.68	-303,072,674.49
（三）利润分配							
1. 提取盈余公积							
2. 提取一般风险准备							
3. 对股东的分配							
4. 其他							
（四）股东权益内部结转							
1. 资本公积转增股本				157,896,485.34			
2. 盈余公积转增股本							
3. 盈余公积弥补亏损							
4. 设定受益计划变动额结转留存收益							
5. 其他综合收益结转留存收益							
6. 其他							
四、2024年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,757,884,043.68	717,407,703.67	553,023,041.15	10,388,208,598.52	20,777,866,662.72	155,446,130,921.35

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

## 母公司股东权益变动表 (续)

2023年1-6月

单位: 人民币元

项目	2023年1-6月(未经审计)							
	股本	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
一、2022年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,709,020,563.14		-393,603,061.50	9,656,101,246.57	19,312,202,493.14	32,697,861,656.85	149,045,782,898.20
二、2023年1月1日余额	13,064,200,000.00	74,709,020,563.14		-393,603,061.50	9,656,101,246.57	19,312,202,493.14	32,697,861,656.85	149,045,782,898.20
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)				283,041,607.37			541,950,210.13	824,991,817.50
(一) 综合收益总额				242,874,800.72			3,325,599,016.78	3,568,473,817.50
(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								
1. 提取盈余公积								
2. 提取一般风险准备								
3. 对股东的分配								
4. 其他								
(四) 股东权益内部结转								
1. 资本公积转增股本				40,166,806.65				
2. 盈余公积转增股本								
3. 盈余公积弥补亏损								
4. 设定受益计划变动额结转留存收益								
5. 其他综合收益结转留存收益				40,166,806.65				
6. 其他								
四、2023年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,709,020,563.14		-110,561,454.13	9,656,101,246.57	19,312,202,493.14	33,239,811,866.98	149,870,774,715.70

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

## 2024 年半年度财务报表附注

(除特殊注明外, 金额单位均为人民币元)

### 一、公司的基本情况

#### (一) 公司概况

海通证券股份有限公司(以下简称“本公司”、“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。2002年1月28日,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,整体变更为股份有限公司,并更名为“海通证券股份有限公司”,资本金增至40.06亿元。2002年11月,资本金增至87.34亿元。

2007年6月7日,本公司与原都市股份(600837)吸收合并事宜获得中国证券监督管理委员会(以下简称“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,本公司股本变更为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,本公司股本变更为8,227,821,180.00元。

2012年4月27日,本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,本公司额外发行127,500,000股H股;另外,本公司国有股股东的国有股减持划转给全国社会保障基金理事会并转为境外上市外资股(H股)合计135,690,000股。经过本次H股发行以及国有股减持后,本公司股份变更为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、于香港联交所上市的H股1,492,590,000股。

2015年5月,本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,本公司股份变更为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、于香港联交所上市的H股3,409,568,820股。

2020年8月5日,本公司向13家特定对象非公开发行普通股股票(A股),发行规模为1,562,500,000股。经过本次A股非公开发行后,本公司股份变更为13,064,200,000股,其中,于上海证券交易所上市的A股9,654,631,180股、于香港联交所上市的H股3,409,568,820股。

截至2024年6月30日,本公司股本总数为13,064,200,000股,其中无限售条件股份为12,282,950,000股,有限售条件股份为781,250,000股。

本公司注册地:上海市广东路689号,总部地址:上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场。

截至2024年6月30日,本公司经批准设立分公司29家,证券营业部311家。

本公司经营范围为: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】

## (二) 合并财务报表范围

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。

子公司包括通过设立或投资等方式取得的海富通基金管理有限公司（以下简称“海富通基金”）、海通开元投资有限公司（以下简称“海通开元”）、海通创新证券投资有限公司（以下简称“海通创新”）、上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“海通资管”）、海通国际控股有限公司（以下简称“海通国际控股”）、海通恒信金融集团有限公司（以下简称“海通恒信”）、上海惟泰置业管理有限公司（以下简称“惟泰置业”）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（以下简称“海通期货”）等子公司以及该等子公司控制的公司。本公司、子公司以及合并范围内的结构化主体以下合称“本集团”。

本年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、中期财务报表的编制基础

本中期财务报表按照中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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”）编制。

本中期财务报表根据财政部颁布的《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》和中国证监会颁布的《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式》（2021 年修订）的要求列示和披露有关财务信息。本中期财务报表应与本集团经审计的 2023 年度财务报表一并阅读。

本中期财务报表以持续经营为基础编制。

## 三、重要会计政策及会计估计

本中期财务报表所采用的重要会计政策及会计估计与编制 2023 年度财务报表所采用的重要会计政策及会计估计一致。

## 四、遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》的要求，真实、完整地反映了本集团及本公司于 2024 年 6 月 30 日的合并及母公司财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的合并及母公司经营成果和现金流量。



## 五、合并财务报表项目注释

### (一) 货币资金

#### 1、按类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
库存现金	42,294.16	59,782.58
银行存款	141,206,483,783.41	137,287,529,597.34
其中：客户存款	80,750,247,335.61	87,407,094,246.01
公司存款	60,456,236,447.80	49,880,435,351.33
其他货币资金	745,341,060.00	1,190,988,784.99
存放中央银行款项	5,399,093,053.70	4,252,199,694.14
其中：存放中央银行法定准备金	26,230,603.57	14,160,710.19
存放中央银行超额存款准备金	5,372,862,450.13	4,238,038,983.95
合计	147,350,960,191.27	142,730,777,859.05

注：于2024年6月30日，本集团货币资金的预期信用损失减值准备为人民币20,494,596.66元（2023年12月31日：人民币17,765,450.34元）。

#### 2、按币种列示

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	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			15,979.67			14,483.58
美元	83.99	7.1268	598.58	85.74	7.0827	607.27
港币	8.75	0.91268	7.99	8.75	0.90622	7.93
欧元	803.73	7.6617	6,157.94	1,995.52	7.8592	15,683.19
其他			19,549.98			29,000.61
小计			42,294.16			59,782.58
客户资金						
人民币			67,800,160,819.82			74,716,594,532.21
美元	415,388,454.29	7.1268	2,960,390,436.03	360,250,713.04	7.0827	2,551,547,725.25
港币	4,077,561,715.12	0.91268	3,721,509,026.16	4,754,873,722.86	0.90622	4,308,961,665.13
欧元	1,959,648.65	7.6617	15,014,240.06	2,645,801.98	7.8592	20,793,886.92
其他			53,288,812.05			56,143,784.80
小计			74,550,363,334.12			81,654,041,594.31
客户信用资金						
人民币			6,199,884,001.49			5,753,052,651.70
小计			6,199,884,001.49			5,753,052,651.70
客户存款合计			80,750,247,335.61			87,407,094,246.01
公司自有资金						
人民币			46,014,076,207.89			41,580,039,507.52
美元	1,298,126,171.72	7.1268	9,251,485,600.61	632,077,071.17	7.0827	4,476,812,271.98
港币	5,252,194,051.55	0.91268	4,793,572,466.97	3,439,948,628.71	0.90622	3,117,350,246.31
欧元	5,021,237.70	7.6617	38,471,216.89	40,399,891.78	7.8592	317,510,829.48
其他			358,630,955.44			388,722,496.04
小计			60,456,236,447.80			49,880,435,351.33
公司存款合计			60,456,236,447.80			49,880,435,351.33

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
其他货币资金						
人民币			486,411,218.97			838,733,347.51
美元	36,191,119.82	7.1268	257,926,872.73	49,734,626.27	7.0827	352,255,437.48
港币	1,098,926.57	0.91268	1,002,968.30			
小计			745,341,060.00			1,190,988,784.99
存放中央银行款项						
欧元	703,541,849.97	7.6617	5,390,326,591.92	540,251,579.20	7.8592	4,245,945,211.25
其他			8,766,461.78			6,254,482.89
小计			5,399,093,053.70			4,252,199,694.14
合计			147,350,960,191.27			142,730,777,859.05

3、2024年6月30日，受限制的货币资金为人民币2,817,130,515.06元（2023年12月31日：人民币3,146,194,159.65元），主要为风险准备专户存款、银行承兑汇票保证金存款及飞机维修基金等。

## (二) 结算备付金

### 1、按类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
客户备付金	10,359,667,970.74	10,144,093,909.65
公司备付金	5,541,329,885.15	5,440,283,810.32
合计	15,900,997,855.89	15,584,377,719.97

### 2、按币种列示

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	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			9,138,157,325.43			8,888,601,506.30
美元	16,808,549.67	7.1268	119,791,171.79	10,606,696.88	7.0827	75,124,051.99
港币	107,407,467.12	0.91268	98,028,647.09	72,893,747.42	0.90622	66,057,771.79
小计			9,355,977,144.31			9,029,783,330.08
客户信用备付金						
人民币			1,003,690,826.43			1,114,310,579.57
小计			1,003,690,826.43			1,114,310,579.57
客户备付金合计			10,359,667,970.74			10,144,093,909.65
公司自有备付金						
人民币			5,541,329,885.15			5,440,283,810.32
小计			5,541,329,885.15			5,440,283,810.32
公司备付金合计			5,541,329,885.15			5,440,283,810.32
合计			15,900,997,855.89			15,584,377,719.97

### (三) 拆出资金

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
境外银行同业	831,889,561.51	330,415,943.38
减：减值准备	70,960.06	121,078.34
合计	831,818,601.45	330,294,865.04

### (四) 融出资金

#### 1、按类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
境内		
其中：个人	48,826,894,061.44	52,241,414,866.18
机构	10,016,551,289.38	10,185,918,236.03
减：减值准备	1,327,790,874.48	1,295,472,470.95
账面价值小计	57,515,654,476.34	61,131,860,631.26
境外		
其中：个人	1,002,450,119.85	1,194,832,043.19
机构	7,686,049,913.70	8,258,172,087.95
减：减值准备	2,260,058,309.42	2,166,657,029.88
账面价值小计	6,428,441,724.13	7,286,347,101.26
账面价值合计	63,944,096,200.47	68,418,207,732.52

#### 2、减值准备调节表

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 1 月 1 日	34,619,343.78	16,479,493.50	3,411,030,663.55	3,462,129,500.83
本年（转回）/计提	-2,866,303.07	4,122,556.35	108,687,744.97	109,943,998.25
阶段转移	-730,026.00	-2,489,259.04	3,219,285.04	
外汇变动及其他	36,256.00	49,684.71	15,689,744.11	15,775,684.82
于 2024 年 6 月 30 日	31,059,270.71	18,162,475.52	3,538,627,437.67	3,587,849,183.90

#### 3、信用风险敞口

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 6 月 30 日	52,290,165,411.59	8,237,075,350.74	7,004,704,622.04	67,531,945,384.37
于 2023 年 12 月 31 日	58,562,127,223.16	6,935,008,552.70	6,383,201,457.49	71,880,337,233.35

#### 4、客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

担保物类别	2024年6月30日	2023年12月31日
资金	4,694,501,677.99	6,816,255,432.88
债券	1,579,038,851.46	1,145,467,501.17
基金	6,575,827,366.13	10,004,065,254.10
股票	163,654,159,536.66	200,508,786,205.95
合计	176,503,527,432.24	218,474,574,394.10

## (五) 衍生金融工具

2024年6月30日						
项目	套期工具(注1)			非套期工具(注2)		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具	1,402,374,618.56	48,417,920.93	292,881,373,732.40	228,700,016.83	177,598,887.96	
货币衍生工具	1,013,460,711.27	56,422,830.44	43,516,134.91	4,982,962,316.54	76,578,825.39	22,866,891.14
权益衍生工具				39,299,375,043.10	1,310,691,043.73	743,142,683.23
信用衍生工具				325,000,000.00	3,002,595.00	707,800.00
其他衍生工具				42,691,322,748.50	356,028,581.31	242,834,654.90
合计		104,840,751.37	43,516,134.91		1,975,001,062.26	1,187,150,917.23

2023年12月31日						
项目	套期工具(注1)			非套期工具(注2)		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具	1,525,629,429.45	53,778,758.72	233,656,036,311.48	245,935,490.70	214,691,605.72	
货币衍生工具	904,601,833.79	34,496,226.04	5,719,273.43	4,266,901,475.11	11,652,031.85	37,634,832.46
权益衍生工具				136,912,382,513.22	1,821,553,758.69	812,146,864.17
信用衍生工具				2,740,000,000.00	2,131,720.00	203,210.00
其他衍生工具				77,286,888,106.54	109,007,367.41	120,549,308.14
合计		88,274,984.76	5,719,273.43		2,190,280,368.65	1,185,225,820.49

注1：本集团利用套期衍生工具对利率风险及汇率风险导致的现金流量波动进行套期保值。被套期项目为借款及借款利息。截至2024年6月30日止六个月期间，本集团现金流量套期产生的计入其他综合收益的税前净收益为人民币18,942,418.24元（截至2023年6月30日止六个月：净收益人民币72,403,261.13元），考虑所得税影响后的计入其他综合收益的净收益为人民币12,774,804.47元（截至2023年6月30日止六个月：净收益人民币54,802,571.64元）；其中本集团因汇率和利率波动从其他综合收益转入损益金额为人民币29,149,608.41元（截至2023年6月30日止六个月：人民币63,942,196.31元）。现金流量套期中确认的套期无效部分产生的损益不重大，且不存在由于很可能发生的预期现金流不再预计会发生而导致的终止使用套期会计的情况。

注2：在每日无负债结算制度下，非套期衍生金融工具项下的期货合约和在上海清算所集中清算的利率互换合约按抵销后的净额列示，为人民币零元。于2024年6月30日，本集团未到期的期货合约的公允价值为人民币3,520,550.00元（2023年12月31日：人民币-461,317,100.00元），本集团未到期的在上海清算所集中清算的利率互换的公允价值为人民币-46,867,266.82元（2023年12月31日：人民币11,918,710.75元）。

## (六) 存出保证金

### 1、按类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
交易保证金	401,922,895.37	430,184,798.87
信用保证金	329,491,008.02	479,370,749.04
期货保证金	17,960,645,393.27	20,861,916,726.85
履约保证金	2,170,446,281.47	1,872,349,225.97
合计	20,862,505,578.13	23,643,821,500.73

## 2、按币种列示

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	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			313,174,631.70			328,859,285.57
美元	1,819,960.01	7.1268	12,970,491.00	1,819,721.99	7.0827	12,888,544.94
港币	65,510,218.93	0.91268	59,789,866.61	54,672,120.34	0.90622	49,544,968.89
欧元	2,086,730.89	7.6617	15,987,906.06	4,948,595.21	7.8592	38,891,999.47
小计			401,922,895.37			430,184,798.87
信用保证金						
人民币			329,491,008.02			479,370,749.04
小计			329,491,008.02			479,370,749.04
期货保证金						
人民币			17,918,358,910.18			20,825,811,742.41
港币	11,375,525.00	0.91268	10,382,214.16	14,332,746.00	0.90622	12,988,621.08
欧元	4,164,124.01	7.6617	31,904,268.93	2,941,312.52	7.8592	23,116,363.36
小计			17,960,645,393.27			20,861,916,726.85
履约保证金						
人民币			2,044,793,119.77			1,725,683,611.31
欧元	14,990,427.53	7.6617	114,852,158.61	17,092,787.10	7.8592	134,335,632.38
其他			10,801,003.09			12,329,982.28
小计			2,170,446,281.47			1,872,349,225.97
合计			20,862,505,578.13			23,643,821,500.73

## (七) 应收款项

### 1、按明细列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
应收清算款项	5,116,034,636.60	7,279,755,141.12
场外业务预付金	1,743,422,410.31	3,300,682,248.15
应收手续费及管理费	1,518,828,152.47	1,564,888,147.76
其他	432,318,319.92	421,671,542.90
合计	8,810,603,519.30	12,566,997,079.93
减：坏账准备	490,501,415.61	399,722,513.58
账面价值合计	8,320,102,103.69	12,167,274,566.35

### 2、按账龄分析

账龄	2024年6月30日				2023年12月31日			
	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)	7,686,054,120.95	87.23	114,106,723.89	23.26	11,452,538,228.33	91.12	81,812,518.39	20.47
1-2年(含2年)	617,233,320.20	7.01	100,172,468.42	20.42	688,202,320.75	5.48	102,929,918.87	25.75
2-3年(含3年)	170,073,539.82	1.93	54,329,196.52	11.08	121,427,886.69	0.97	20,184,194.61	5.05
3年以上	337,242,538.33	3.83	221,893,026.78	45.24	304,828,644.16	2.43	194,795,881.71	48.73
合计	8,810,603,519.30	100.00	490,501,415.61	100.00	12,566,997,079.93	100.00	399,722,513.58	100.00

## (八) 买入返售金融资产

### 1、按业务类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
约定购回式证券	31,650,975.00	32,507,445.00
股票质押式回购(6)	22,871,597,219.03	26,377,363,065.33
债券质押式回购	9,886,863,627.93	10,434,646,133.26
债券买断式回购	766,184,176.31	602,017,381.50
合计	33,556,295,998.27	37,446,534,025.09
减: 减值准备	719,775,984.74	663,301,676.61
账面价值合计	32,836,520,013.53	36,783,232,348.48

### 2、按标的物类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
股票	22,903,248,194.03	26,409,870,510.33
债券	10,653,047,804.24	11,036,663,514.76
合计	33,556,295,998.27	37,446,534,025.09
减: 减值准备	719,775,984.74	663,301,676.61
账面价值合计	32,836,520,013.53	36,783,232,348.48

### 3、减值准备调节表

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2024年1月1日	11,418,098.44	21,981,005.63	629,902,572.54	663,301,676.61
本年(转回)/计提	-4,814,616.93	-6,688,582.89	67,977,831.30	56,474,631.48
阶段转移	2,911,664.18	-4,169,222.55	1,257,558.37	
外汇变动及其他	-323.35			-323.35
于2024年6月30日	9,514,822.34	11,123,200.19	699,137,962.21	719,775,984.74

### 4、信用风险敞口

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2024年6月30日	28,902,176,728.99	2,820,581,087.53	1,833,538,181.75	33,556,295,998.27
于2023年12月31日	31,431,856,069.40	4,109,439,315.35	1,905,238,640.34	37,446,534,025.09

### 5、买入返售金融资产的担保物信息

担保物类别	2024年6月30日	2023年12月31日
担保物	69,363,163,966.75	83,560,426,214.42
其中: 可出售或可再次向外抵押的担保物	896,558,916.04	981,086,866.27
其中: 已出售或已再次向外抵押的担保物	410,738,986.77	588,448,497.17

## 6、股票质押式回购业务

### (1) 股票质押式回购剩余期限

剩余期限	2024年6月30日	2023年12月31日
1个月以内	4,395,322,937.42	3,890,535,773.99
1个月以上至3个月内	4,377,970,150.06	3,847,036,545.53
3个月以上至1年内	13,291,090,981.56	16,614,803,589.48
1年以上	807,213,149.99	2,024,987,156.33
合计	22,871,597,219.03	26,377,363,065.33

### (2) 股票质押式回购信用风险敞口

2024年6月30日	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
账面余额	18,217,477,949.75	2,820,581,087.53	1,833,538,181.75	22,871,597,219.03
减值准备	9,497,641.03	11,123,200.19	699,137,962.21	719,758,803.43
担保物价值	50,516,000,973.37	5,200,571,930.64	2,131,778,853.09	57,848,351,757.10

2023年12月31日	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
账面余额	20,362,685,109.64	4,109,439,315.35	1,905,238,640.34	26,377,363,065.33
减值准备	10,750,892.96	21,981,005.63	629,902,572.54	662,634,471.13
担保物价值	60,265,866,049.45	7,829,278,037.08	3,507,115,388.26	71,602,259,474.79

## (九) 交易性金融资产

### 1、按项目列示

项目	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产			
	2024年6月30日		2023年12月31日	
	公允价值	初始投资成本	公允价值	初始投资成本
债券	113,792,720,381.97	118,756,578,421.78	124,194,489,494.53	129,011,243,057.10
公募基金	52,400,523,974.04	52,818,549,149.46	40,639,853,550.95	41,343,814,266.04
股票/股权	23,848,589,411.60	23,574,352,881.67	35,718,418,020.71	34,028,263,858.30
银行理财产品	5,781,242,832.89	5,773,644,632.40	3,777,443,533.72	3,661,918,207.12
券商资管产品	888,809,289.36	824,724,271.20	251,148,523.57	219,714,560.06
信托计划	1,774,237,590.27	2,164,642,948.99	1,835,554,751.35	2,189,238,484.79
其他	12,912,161,797.33	16,186,506,217.94	14,856,182,117.39	16,559,267,985.57
合计	211,398,285,277.46	220,098,998,523.44	221,273,089,992.22	227,013,460,418.98

2、2024年6月30日，交易性金融资产中有承诺条件的金融资产，系用于卖出回购业务、债券借贷业务、转融通业务、融出证券业务和衍生业务等，其公允价值为人民币46,243,396,000.10元（2023年12月31日：人民币64,197,081,042.70元）。

3、2024年6月30日，存在限售期限的交易性金融资产账面价值合计人民币1,486,182,833.01元（2023年12月31日：人民币3,494,015,100.95元）。

## (十) 债权投资

### 1、按项目列示

项目	2024年6月30日				2023年12月31日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
公司债	1,711,133,375.64	27,901,251.42	16,228,513.30	1,722,806,113.76	2,100,751,841.02	43,578,397.72	20,222,769.99	2,124,107,468.75
境外国债	2,270,192,292.48	39,182,134.51	2,561,441.65	2,306,812,985.34	3,586,886,095.14	65,384,497.09	2,993,603.53	3,649,276,988.70
金融债	486,958,624.21	6,702,710.58	614,492.96	493,046,841.83	652,232,738.26	9,802,291.01	920,384.41	661,114,644.86
其他	191,611,903.57	4,389,728.53	5,673,363.67	190,328,268.43	372,303,773.36	1,589,786.02	10,613,121.35	363,280,438.03
合计	4,659,896,195.90	78,175,825.04	25,077,811.58	4,712,994,209.36	6,712,174,447.78	120,354,971.84	34,749,879.28	6,797,779,540.34

### 2、减值准备调节表

减值准备	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 1 月 1 日	23,375,966.20	255,015.78	11,118,897.30	34,749,879.28
本期转回	-5,462,023.38	-254,780.76	-1,618,332.95	-7,335,137.09
外汇变动及其他	-1,279,793.34	-235.02	-1,056,902.25	-2,336,930.61
于 2024 年 6 月 30 日	16,634,149.48		8,443,662.10	25,077,811.58

### 3、信用风险敞口

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2023 年 12 月 31 日	6,745,085,454.54	66,139,314.16	21,304,650.92	6,832,529,419.62
于 2024 年 6 月 30 日	4,720,144,925.19		17,927,095.75	4,738,072,020.94

### 4、存在有承诺条件的债权投资

2024年6月30日，债权投资中有承诺条件的金融资产，系用于卖出回购、向葡萄牙央行融资等，其账面价值为人民币3,065,528,239.23元（2023年12月31日：人民币4,954,090,380.62元）。



## (十一) 其他债权投资

### 1、按项目列示

项目	2024年6月30日				2023年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
境外及境内国债	15,748,944,484.04	299,675,023.10	116,788,204.19	16,165,407,711.33	1,248,126.21	20,235,031,922.78	89,423,560.62	20,711,360,540.55	783,913.98
金融债	1,626,301,925.12	15,898,292.08	-7,844,707.89	1,634,355,509.31	4,157,447.82	556,002,219.29	-10,841,911.64	554,713,951.85	1,704,166.27
企业债	3,400,266,608.35	99,225,470.89	210,311,314.65	3,709,803,393.89	33,445,284.92	3,505,133,782.60	81,692,902.40	3,680,040,666.78	27,691,274.67
公司债	4,926,972,523.14	83,789,243.19	41,177,769.18	5,051,939,535.51	50,998,334.26	3,910,098,184.43	-7,415,077.02	4,014,565,811.88	50,407,404.75
地方政府债	19,778,716,790.84	269,931,810.31	456,293,424.54	20,504,942,025.69	28,209,821.37	26,609,486,504.81	166,581,088.83	27,066,634,359.44	26,503,267.40
其他	9,948,278,226.52	118,081,150.94	80,439,919.84	10,146,799,297.30	27,735,668.49	5,118,173,042.65	122,798,521.34	5,283,431,233.30	27,570,063.53
合计	55,429,480,558.01	886,600,990.51	897,165,924.51	57,213,247,473.03	145,794,683.07	59,933,925,656.56	1,014,920,674.74	61,310,746,563.80	134,660,090.60

### 2、减值准备调节表

减值准备	阶段 1		阶段 2		阶段 3		合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	未来 12 个月预期信用损失 (已发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
于 2024 年 1 月 1 日	69,369,613.70	47,710,241.20	47,710,241.20	17,580,235.70			134,660,090.60
本期 (转回) / 计提	23,533,543.65	-3,988,909.34	-3,988,909.34		-3,038,633.94		16,506,000.37
阶段转移	-157,140.98	157,140.98					
外汇变动及其他	-2,542,038.83	7,558.00	7,558.00		-2,836,927.07		-5,371,407.90
于 2024 年 6 月 30 日	90,203,977.54	43,886,030.84	43,886,030.84	11,704,674.69			145,794,683.07

### 3、信用风险敞口

	阶段 1		阶段 2		阶段 3		合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	未来 12 个月预期信用损失 (已发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
于 2023 年 12 月 31 日	58,922,530,353.63	1,983,748,789.84	1,983,748,789.84	42,567,187.83			60,948,846,331.30
于 2024 年 6 月 30 日	54,786,684,831.17	1,489,987,038.15	1,489,987,038.15	39,409,679.20			56,316,081,548.52

#### 4、存在有承诺条件的其他债权投资

2024年6月30日，其他债权投资中有承诺条件的金融资产，系用于卖出回购业务、债券借贷业务质押、转融通业务、衍生业务和向葡萄牙央行融资等，其公允价值为人民币43,387,066,367.20元（2023年12月31日：人民币48,325,434,742.65元）。

## (十二) 其他权益工具投资

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
非交易性权益工具	10,416,425,857.16	8,010,844,169.78

注：于2024年6月30日，其他权益工具投资包括本集团持有的非交易性股权及股票。

由于上述权益工具并非为交易目的而持有，本集团将其指定为其他权益工具投资。由于战略调整，本集团对部分其他权益工具进行处置，相应的税后亏损人民币157,896,485.34元从其他综合收益重分类为未分配利润。

2024年6月30日，其他权益工具中有承诺条件的金融资产，系用于融出证券业务，其公允价值为人民币1,244,426,296.25元；

2023年12月31日，其他权益工具中有承诺条件的金融资产，系用于融出证券业务和转融通业务，其公允价值为人民币1,204,013,815.91元。

## (十三) 应收融资租赁款及长期应收款

项目	注释	2024年6月30日	2023年12月31日
应收融资租赁款	1	17,874,083,292.27	19,892,444,035.52
长期应收款	2	73,101,760,386.66	79,516,505,296.66
合计		90,975,843,678.93	99,408,949,332.18

### 1、应收融资租赁款

(1) 应收融资租赁款列示如下

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
资产负债表日后第一年	9,362,733,116.68	10,513,720,689.35
资产负债表日后第二年	5,586,614,652.56	5,835,744,161.78
资产负债表日后第三年	2,782,824,010.89	3,275,979,639.48
资产负债表日后第四年	1,287,029,140.19	1,513,910,846.16
资产负债表日后第五年	712,530,420.87	779,672,322.19
以后年度	1,720,380,438.69	1,967,554,153.79
最低租赁收款额合计	21,452,111,779.88	23,886,581,812.75
减：未实现融资收益	2,746,505,402.26	3,077,167,051.88
应收融资租赁款余额	18,705,606,377.62	20,809,414,760.87
减：减值准备	831,523,085.35	916,970,725.35
应收融资租赁款净额	17,874,083,292.27	19,892,444,035.52
其中：一年内到期的应收融资租赁款净额	7,716,322,010.94	8,644,404,298.23
一年后到期的应收融资租赁款净额	10,157,761,281.33	11,248,039,737.29

注：2024年6月30日用于抵押或担保的资产情况见附注十、（一）、1。

(2) 应收融资租赁款减值准备调节表如下

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 1 月 1 日	358,786,610.65	380,220,485.20	177,963,629.50	916,970,725.35
本年 (转回) / 计提	-78,431,024.82	145,964,518.77	159,172,382.62	226,705,876.57
本年核销			-268,063,258.49	-268,063,258.49
阶段转移	53,796,264.90	-140,373,657.82	86,577,392.92	
收回以前年度核销			59,792,013.92	59,792,013.92
本年其他终止确认			-103,882,272.00	-103,882,272.00
于 2024 年 6 月 30 日	334,151,850.73	385,811,346.15	111,559,888.47	831,523,085.35

(3) 应收融资租赁款余额分析如下

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 6 月 30 日	17,245,529,171.69	1,305,858,869.56	154,218,336.37	18,705,606,377.62
于 2023 年 12 月 31 日	19,138,397,691.34	1,394,426,786.59	276,590,282.94	20,809,414,760.87

2、长期应收款

(1) 长期应收款列示如下

项目	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
资产负债表日后第一年	41,663,144,053.43	43,518,244,830.26
资产负债表日后第二年	23,607,944,025.91	26,126,128,864.68
资产负债表日后第三年	11,379,515,024.12	12,174,278,942.33
资产负债表日后第四年	2,963,946,655.06	4,641,182,117.22
资产负债表日后第五年	1,077,929,471.93	1,329,793,374.27
以后年度	1,265,725,570.14	1,076,325,974.33
长期应收款总额	81,958,204,800.59	88,865,954,103.09
减：利息调整	6,761,329,025.57	7,475,894,644.47
长期应收款余额	75,196,875,775.02	81,390,059,458.62
减：减值准备	2,095,115,388.36	1,873,554,161.96
长期应收款净额	73,101,760,386.66	79,516,505,296.66
其中：一年内到期的长期应收款净额	37,017,927,584.52	38,923,317,259.18
一年后到期的长期应收款净额	36,083,832,802.14	40,593,188,037.48

注：2024 年 6 月 30 日用于抵押或担保的资产情况见附注十、(一)、1。

(2) 长期应收款减值准备调节表如下

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 1 月 1 日	1,003,946,478.02	658,068,545.36	211,539,138.58	1,873,554,161.96
本年(转回)/计提	-77,347,279.92	188,504,519.62	166,029,124.93	277,186,364.63
本年核销			-47,301,757.57	-47,301,757.57
阶段转移	129,622,210.40	-133,550,217.57	3,928,007.17	
收回以前年度核销			2,190,832.74	2,190,832.74
本年其他终止确认			-10,516,586.75	-10,516,586.75
外汇变动及其他	2,373.35			2,373.35
于 2024 年 6 月 30 日	1,056,223,781.85	713,022,847.41	325,868,759.10	2,095,115,388.36

(3) 长期应收款余额分析如下

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 6 月 30 日	71,701,978,793.30	2,944,139,664.55	550,757,317.17	75,196,875,775.02
于 2023 年 12 月 31 日	77,943,628,325.16	2,953,791,518.65	492,639,614.81	81,390,059,458.62

### (十四) 长期股权投资

被投资单位	2024年1月1日					本期增减变动				2024年6月30日	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	其他权 益变动	宣告发放现金股利 或利润	计提减 值准备	其他				
联营企业												
富国基金管理有限公司	2,367,564,502.38		214,844,433.28	669,581.57		-303,303,000.00				2,279,775,517.23		
央视融媒体产业投资基金(有限合伙)	665,479,271.77		1,027,612.41			-17,696,907.67				648,809,976.51		
辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	647,947,803.90		-75,827,807.91							572,119,995.99		
合肥海通中小基金合伙企业(有限合伙)	534,638,004.17		-4,731,116.26							529,906,887.91		
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	623,417,418.57		-1,48,594,638.24							474,822,780.33		
辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业(有限合伙)	334,287,035.53		-2,120,482.80							332,166,552.73		
上海浦东引领区海通私募投资基金合伙企业(有限合伙)	325,449,726.63		1,679,886.99							327,129,613.62		
西安航天新能源产业基金投资有限公司	271,055,399.97	-6,826,000.00	-15,626,592.30							248,602,807.67		
安徽海通海通工业互联网母基金合伙企业(有限合伙)	229,359,829.40		347,261.80							229,707,091.20		
上海海通煥新私募投资基金合伙企业(有限合伙)	228,097,455.03		-1,391,254.36							226,706,200.67		
广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)	182,448,424.66	-7,354,018.22	-11,489,085.63							163,605,320.81		
安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业(有限合伙)	150,965,065.08		5,217,752.74							156,182,817.82		
广州海科创新创业投资基金合伙企业(有限合伙)	152,000,000.00		108,871.64							152,108,871.64		
合肥市海通徽银股权投资合伙企业(有限合伙)	117,465,996.82		31,790,018.24							149,256,015.06		
盐城中韩产业园二期投资基金(有限合伙)	120,391,929.37		654,357.61							121,046,286.98		
西安军融电子卫星基金投资有限公司	113,192,626.70		-2,238,653.91							110,953,972.79		
海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金(有限合伙)	123,191,468.05	-15,106,276.01	-1,920,204.29							106,164,987.75		
吉林海创长新投资中心(有限合伙)	99,878,665.33		1,711,683.17							101,590,348.50		
海通齐东(威海)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	173,780,165.66	-8,387,399.99	-62,592,572.93			-8,503,984.48				94,296,208.26		
上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	138,320,894.97	-43,288,321.91	-4,302,702.96			-5,240,131.08				85,509,739.02		
上海海通伊泰一期私募基金合伙企业(有限合伙)	74,454,590.05		46,494.82							74,501,084.87		
湖北省海通高质转型升级并购投资基金合伙企业(有限合伙)	60,000,000.00		-386,228.86							59,613,771.14		
吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	57,323,911.05		-1,315,125.93							56,008,785.12		
陕西空天创新投资基金合伙企业(有限合伙)	45,000,000.00		208,038.29							45,208,038.29		
上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	86,030,909.55	-56,661,862.52	15,691,949.11							45,060,996.14		
嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业(有限合伙)	63,439,790.60	-5,531,271.69	-13,002,376.73			-6,609,365.96				38,296,776.22		
吉林海通创新卫星投资中心(有限合伙)	29,154,311.89		75,516.37							29,229,828.26		
许昌海通创新股权投资基金合伙企业(有限合伙)	22,228,873.86		-311,760.98							21,917,112.88		
海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	19,884,458.85		-7,046.45							19,877,412.40		

被投资单位	本期增减变动							减值准备 期末余额		
	2024年1月1日	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	其他权 益变动	宣告发放现金股利 或利润		计提减 值准备	其他
海通(吉林)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	17,790,488.13			3,730.57						17,794,218.70
金华市海通重点产业发展招商并购投资合伙企业(有限合伙)	15,749,673.40			1,469,561.46						17,219,234.86
南昌政通股权投资基金合伙企业(有限合伙)	16,505,757.58			-236,764.85						16,268,992.73
上海海通智达私募投资基金合伙企业(有限合伙)	4,080,325.51			21,470.88						4,101,796.39
山东省新旧动能转换海通奥咨达健康产业投资合伙企业(有限合伙)	2,000,971.12			2,034.85						2,003,005.97
上海开腾股权投资基金合伙企业(有限合伙)	1,688,395.04			-2,687.37						1,665,707.67
西安航大海通创新新材料股权投资合伙企业(有限合伙)	1,373,569.67			-38,672.45						1,334,897.22
海通(临沂)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	8,170.17									8,170.17
合计	8,115,625,880.46	-143,135,150.34	-71,235,100.98	669,581.57	-341,353,389.19					7,560,571,821.52

注：在联营企业中的权益相关信息详见附注七、(三)。

## (十五) 投资性房地产

项目	房屋及建筑物
一、账面原值	
2024年1月1日	2,773,327,273.24
本期增加金额	
本期减少金额	106,048,078.67
外币报表折算差额	13,099,512.60
2024年6月30日	2,680,378,707.17
二、累计折旧和累计摊销	
2024年1月1日	132,333,510.35
本期增加金额	39,246,373.22
本期减少金额	4,767,509.65
外币报表折算差额	2,090,799.93
2024年6月30日	168,903,173.85
三、减值准备	
2024年1月1日	5,152,882.38
本期增加金额	3,741,741.79
本期减少金额	
外币报表折算差额	
2024年6月30日	8,894,624.17
四、账面价值	
2024年6月30日	2,502,580,909.15
2024年1月1日	2,635,840,880.51

于2024年6月30日，本集团投资性房地产的公允价值为人民币2,714,092,486.76元（2023年12月31日：人民币3,315,687,230.75元）。系参考相同或相似地点及状况的类似物业的近期市价厘定公允价值。

于2024年6月30日，本集团无用于抵押或担保的投资性房地产（2023年12月31日：同）。

## (十六) 固定资产

### 1、账面价值

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
固定资产原值	20,479,228,027.83	20,411,711,661.05
减：累计折旧	4,725,959,404.18	4,358,708,379.60
减：固定资产减值准备	87,328,273.97	86,971,234.12
固定资产账面价值合计	15,665,940,349.68	15,966,032,047.33

## 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、账面原值						
2024年1月1日	11,565,483,759.89	2,091,402,455.17	148,883,813.04	327,662,582.38	6,278,279,050.57	20,411,711,661.05
本期增加	48,862,782.93	47,543,829.45	3,642,697.87	4,595,370.91		104,644,681.16
(1) 本期购置	48,862,782.93	45,812,263.28	3,642,697.87	3,637,681.19		101,955,425.27
(2) 在建工程转入		1,731,566.17		957,689.72		2,689,255.89
本期减少		46,152,501.10	7,068,640.95	24,538,248.84		77,759,390.89
(1) 清理报废		46,152,501.10	7,068,640.95	24,538,248.84		77,759,390.89
外币报表折算差额	3,261,822.35	-752,066.80	4,515.54	-974,516.56	39,091,321.98	40,631,076.51
2024年6月30日	11,617,608,365.17	2,092,041,716.72	145,462,385.50	306,745,187.89	6,317,370,372.55	20,479,228,027.83
二、累计折旧						
2024年1月1日	1,547,476,430.76	1,407,693,833.58	126,618,559.91	206,590,622.61	1,070,328,932.74	4,358,708,379.60
本期转入						
本期计提	159,009,635.59	143,454,869.54	2,808,833.17	15,929,646.73	113,732,007.60	434,934,992.63
本期减少		43,531,111.46	6,738,915.25	23,492,848.92		73,762,875.63
外币报表折算差额	592,241.81	-527,055.64	4,289.76	-965,343.32	6,974,774.97	6,078,907.58
2024年6月30日	1,707,078,308.16	1,507,090,536.02	122,692,767.59	198,062,077.10	1,191,035,715.31	4,725,959,404.18
三、减值准备						
2024年1月1日	30,381,872.93	4,490,170.13		708,547.31	51,390,643.75	86,971,234.12
本期计提						
本期减少						
外币报表折算差额		32,008.23		5,050.91	319,980.71	357,039.85
2024年6月30日	30,381,872.93	4,522,178.36		713,598.22	51,710,624.46	87,328,273.97
四、账面价值						
2024年6月30日	9,880,148,184.08	580,429,002.34	22,769,617.91	107,969,512.57	5,074,624,032.78	15,665,940,349.68
2024年1月1日	9,987,625,456.20	679,218,451.46	22,265,253.13	120,363,412.46	5,156,559,474.08	15,966,032,047.33

3、期末用于抵押或担保的固定资产情况见附注十、（一）、1。

4、于2024年6月30日，尚未办妥产权证书的固定资产账面价值为人民币26,458,514.75元（2023年12月31日：人民币27,058,827.95元）。

## (十七) 在建工程

### 1、在建工程账面价值

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
办公室装修及设备改造	260,680,575.20		260,680,575.20	211,784,169.88		211,784,169.88
软件系统	26,965,602.89		26,965,602.89	28,190,582.54		28,190,582.54
合计	287,646,178.09		287,646,178.09	239,974,752.42		239,974,752.42



## 2、在建工程项目本期变动情况

项目	资金来源	2024年 1月1日	本期增加	本期减少			外币报表 折算差额	2024年 6月30日
				转入固定资产	转入无形资产	转入长期 待摊费用		
办公室装修 及设备改造	自有资金	211,784,169.88	75,001,801.91	2,689,255.89		23,416,140.70		260,680,575.20
软件系统	自有资金	28,190,582.54	5,017,219.27		5,348,761.48		-893,437.44	26,965,602.89
合计		239,974,752.42	80,019,021.18	2,689,255.89	5,348,761.48	23,416,140.70	-893,437.44	287,646,178.09

## (十八) 使用权资产与租赁负债

### 1、使用权资产

项目	房屋及建筑物	电子通讯设备	交通运输工具	其他	合计
一、账面原值					
2024年1月1日	2,037,095,650.25	803,513.56	2,180,108.26	2,186,359.96	2,042,265,632.03
本期增加	115,530,381.13	288,953.90	64,368.41	1,071,905.23	116,955,608.67
本期减少	182,009,046.94		132,657.24	1,238,664.72	183,380,368.90
外币报表折算差额	-4,533,131.68	-20,192.27	-54,785.24	44,424.70	-4,563,684.49
2024年6月30日	1,966,083,852.76	1,072,275.19	2,057,034.19	2,064,025.17	1,971,277,187.31
二、累计折旧					
2024年1月1日	980,888,954.20	572,442.41	1,180,007.73	1,639,291.78	984,280,696.12
本期增加	199,038,034.40	87,390.81	239,887.89	240,334.75	199,605,647.85
本期减少	170,533,486.33	7.63	130,406.26	1,238,664.72	171,902,564.94
外币报表折算差额	-2,949,523.53	-14,737.22	-30,094.23	20,079.39	-2,974,275.59
2024年6月30日	1,006,443,978.74	645,088.37	1,259,395.13	661,041.20	1,009,009,503.44
三、减值准备					
2024年1月1日					
本期增加					
本期减少					
外币报表折算差额					
2024年6月30日					
四、账面价值					
2024年6月30日	959,639,874.02	427,186.82	797,639.06	1,402,983.97	962,267,683.87
2024年1月1日	1,056,206,696.05	231,071.15	1,000,100.53	547,068.18	1,057,984,935.91

### 2、租赁负债

租赁负债的到期期限分析如下：

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
1年以内	293,550,997.93	319,896,231.22
1-2年	165,047,319.34	220,130,373.22
2-5年	351,351,141.69	355,289,348.92
5年以上	193,336,438.00	201,848,934.10
合计	1,003,285,896.96	1,097,164,887.46

本集团租赁了多项资产，包括房屋及建筑物和交通运输设备等。租赁条款系在个别基础上磋商，包括各种不同条款及条件。在厘定租赁期及评估不可撤销期间的长度时，本集团应用合同的定义及相关事实和情况并厘定合同可强制执行的期间。

2024年上半年，租赁资金流出总额达人民币23,974.73万元（2023年上半年：人民币22,730.97万元）。

2024年上半年，租赁负债利息支出人民币2,075.20万元（2023年上半年：人民币2,363.34万元）。

截至2024年6月30日止，除本集团向出租人支付的押金作为租入资产的担保权益外，租赁协议不附加任何其他担保条款。租入资产不可被用于借款担保。

于2024年6月30日，本集团未订立任何尚未开始的重大租赁。

## (十九) 无形资产

### 1、无形资产增减变动表

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	数据资源	其他	合计
一、账面原值						
2024年1月1日	832,440,829.50	2,211,995,984.43	222,716,798.73		130,390,656.17	3,397,544,268.83
本期增加		80,132,464.66		4,253,769.44		84,386,234.10
本期减少		9,754,500.52				9,754,500.52
外币报表折算差额		-2,472,042.39	49,165.42		192,677.57	-2,230,199.40
2024年6月30日	832,440,829.50	2,279,901,906.18	222,765,964.15	4,253,769.44	130,583,333.74	3,469,945,803.01
二、累计摊销						
2024年1月1日	138,741,132.91	1,672,733,039.31	115,400,323.50		102,232,972.85	2,029,107,468.57
本期增加	10,151,966.04	122,255,955.21		118,160.27	980,166.68	133,506,248.20
本期减少		7,559,262.22				7,559,262.22
外币报表折算差额		-2,326,717.22			234,748.14	-2,091,969.08
2024年6月30日	148,893,098.95	1,785,103,015.08	115,400,323.50	118,160.27	103,447,887.67	2,152,962,485.47
三、减值准备						
2024年1月1日						
本期增加						
本期减少						
外币报表折算差额						
2024年6月30日						
四、账面价值						
2024年6月30日	683,547,730.55	494,798,891.10	107,365,640.65	4,135,609.17	27,135,446.07	1,316,983,317.54
2024年1月1日	693,699,696.59	539,262,945.12	107,316,475.23		28,157,683.32	1,368,436,800.26

## 2、确认为无形资产的数据资源

项目	自行开发的数据资源
一、账面原值	
2024年1月1日	
本期增加	4,253,769.44
本期减少	
2024年6月30日	4,253,769.44
二、累计摊销	
2024年1月1日	
本期增加	118,160.27
本期减少	
2024年6月30日	118,160.27
三、减值准备	
2024年1月1日	
本期增加	
本期减少	
2024年6月30日	
四、账面价值	
2024年6月30日	4,135,609.17
2024年1月1日	

3、2024年6月30日无用于抵押或担保的无形资产。

## (二十) 商誉

被投资单位名称	2024年1月1日	本期变动	外币报表折算	2024年6月30日
原值				
海通期货股份有限公司	5,896,464.26			5,896,464.26
海通国际证券集团有限公司	711,365,354.43		5,070,976.36	716,436,330.79
海通恒信金融集团有限公司	2,289,745,597.07			2,289,745,597.07
Haitong International Holdings (UK) Limited	133,978,807.26		955,069.51	134,933,876.77
Haitong Bank, S.A.	1,056,967,747.24		7,534,607.10	1,064,502,354.34
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	5,006,109.10		35,686.10	5,041,795.20
小计	4,202,960,079.36		13,596,339.07	4,216,556,418.43
减值准备				
海通国际证券集团有限公司	142,276,540.00		1,014,220.00	143,290,760.00
Haitong International Holdings (UK) Limited	133,978,807.26		955,069.51	134,933,876.77
Haitong Bank, S.A.	453,110,000.00		3,230,000.00	456,340,000.00
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	5,006,109.10		35,686.10	5,041,795.20
小计	734,371,456.36		5,234,975.61	739,606,431.97
账面价值	3,468,588,623.00		8,361,363.46	3,476,949,986.46

## (二十一) 递延所得税资产和递延所得税负债

### 1、未经抵销的递延所得税资产

项目	2024年6月30日		2023年12月31日	
	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
资产减值准备	11,879,592,458.68	2,978,712,036.42	12,667,537,189.36	3,179,209,273.42
可抵扣亏损	3,613,243,399.61	883,592,650.15	3,268,614,577.45	818,166,784.05
应付未付款项可抵扣税款	1,825,571,625.54	458,376,993.68	2,286,510,939.47	573,674,375.91
租赁负债	1,299,508,389.36	324,877,097.34	1,455,219,426.37	364,465,877.18
交易性金融资产	734,188,483.51	183,547,120.89	662,453,900.66	165,613,475.19
其他权益工具投资	376,454,693.72	94,113,673.43	766,282,008.55	191,570,502.14
衍生金融工具	193,798,127.83	48,449,531.96	239,342,656.51	59,835,664.13
其他债权投资	49,929,978.91	17,404,433.25	57,847,841.33	17,933,261.59
其他	250,238,317.24	71,598,991.80	312,133,996.58	86,590,907.43
合计	20,222,525,474.40	5,060,672,528.92	21,715,942,536.28	5,457,060,121.04

### 2、未经抵销的递延所得税负债

项目	2024年6月30日		2023年12月31日	
	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
交易性金融资产	2,407,485,815.39	601,871,453.85	4,023,284,721.37	1,005,760,147.49
交易性金融负债	2,195,060,266.68	548,922,282.90	874,649,668.60	218,802,048.86
使用权资产	1,284,968,388.98	321,242,097.24	1,389,409,179.47	347,352,294.87
衍生金融工具	900,307,786.67	242,566,027.95	304,234,005.63	101,557,286.71
其他债权投资	967,179,034.51	241,794,758.63	441,487,414.21	110,371,853.55
无形资产、固定资产及长期待摊费用	747,696,846.51	95,233,737.62	693,902,703.44	88,549,692.02
其他	971,545,528.70	253,376,788.80	898,625,060.31	232,600,325.29
合计	9,474,243,667.44	2,305,007,146.99	8,625,592,753.03	2,104,993,648.79

### 3、以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
递延所得税资产	3,302,173,659.10	4,187,114,227.47
递延所得税负债	546,508,277.17	835,047,755.22

## (二十二) 其他资产

### 1、按项目列示

项目	注释	2024年6月30日	2023年12月31日
其他应收款	2	1,836,136,825.57	1,148,570,874.04
长期待摊费用	3	274,586,476.38	296,303,826.38
发放贷款和垫款	4	5,617,503,852.85	5,615,659,373.97
其他贷款和应收款	5	5,298,344,423.84	5,290,231,787.62
政府合作项目长期应收款项		1,470,716,739.34	1,460,794,285.37
回收融资租赁设备		56,709,441.60	57,373,602.62
抵债资产		38,850,867.88	42,563,390.15
存货		664,636,626.56	143,608,928.28
其他		4,238,296,558.30	4,754,136,474.98
合计		19,495,781,812.32	18,809,242,543.41

### 2、其他应收款

#### (1) 其他应收款明细列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
预付款项	1,258,139,243.47	1,155,113,902.58
浙江斯文新技术投资有限公司	429,993,924.48	429,993,924.48
其他	718,200,732.01	156,540,055.94
其他应收款余额	2,406,333,899.96	1,741,647,883.00
减：坏账准备	570,197,074.39	593,077,008.96
其他应收款账面价值	1,836,136,825.57	1,148,570,874.04

#### (2) 其他应收款按账龄分析

账龄	2024年6月30日				2023年12月31日			
	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)	1,323,410,097.58	55.00	3,962,449.33	0.69	843,367,275.57	48.42	6,208,822.55	1.05
1-2年(含2年)	232,666,293.45	9.67	5,198,040.91	0.91	222,357,486.30	12.77	69,880,701.37	11.78
2-3年(含3年)	303,912,818.55	12.63	97,481,125.66	17.10	143,584,540.11	8.24	40,328,442.85	6.80
3年以上	546,344,690.38	22.70	463,555,458.49	81.30	532,338,581.02	30.57	476,659,042.19	80.37
合计	2,406,333,899.96	100.00	570,197,074.39	100.00	1,741,647,883.00	100.00	593,077,008.96	100.00

注：于2024年6月30日，其他应收款坏账准备主要为本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人民币429,993,924.48元，公司已根据可收回情况计提了100%的坏账准备。

(3) 2024年6月30日其他应收款项余额中无持本公司5%以上(含5%)表决权股份的股东单位欠款。

### 3、长期待摊费用

项目	2024年1月1日	本期增加额	本期摊销额	其他减少	2024年6月30日
装修及布线改造等	296,303,826.38	45,792,967.04	57,562,114.90	9,948,202.14	274,586,476.38
合计	296,303,826.38	45,792,967.04	57,562,114.90	9,948,202.14	274,586,476.38

### 4、发放贷款和垫款

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
企业贷款和垫款	5,671,468,011.52	5,675,515,664.95
减：贷款损失准备	53,964,158.67	59,856,290.98
合计	5,617,503,852.85	5,615,659,373.97

(1) 发放贷款和垫款减值准备调节表如下

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2024年1月1日	22,688,735.02	5,925,878.55	31,241,677.41	59,856,290.98
本年转回	-2,863,564.11	-8,662.49	-733,848.59	-3,606,075.19
外汇变动及其他	-573,965.21	-230,525.10	-1,481,566.81	-2,286,057.12
于2024年6月30日	19,251,205.70	5,686,690.96	29,026,262.01	53,964,158.67

(2) 发放贷款和垫款风险敞口如下

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2024年6月30日	5,227,680,451.68	383,032,837.29	60,754,722.55	5,671,468,011.52
于2023年12月31日	5,205,801,082.19	405,302,591.69	64,411,991.07	5,675,515,664.95

### 5、其他贷款和应收款

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
境外贷款和应收款项	6,242,537,236.61	6,100,873,472.06
境内委托贷款及其他贷款	384,140,604.62	425,918,698.09
小计	6,626,677,841.23	6,526,792,170.15
减：减值准备	1,328,333,417.39	1,236,560,382.53
合计	5,298,344,423.84	5,290,231,787.62

(1) 其他贷款和应收款减值准备调节表如下

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2024年1月1日	1,670,256.84		1,234,890,125.69	1,236,560,382.53
本年(转回)/计提	-1,073,934.94		94,177,085.41	93,103,150.47
外汇变动及其他	7,897.50		-1,338,013.11	-1,330,115.61
于2024年6月30日	604,219.40		1,327,729,197.99	1,328,333,417.39

(2) 其他贷款和应收款风险敞口如下

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2024 年 6 月 30 日	1,055,517,013.34		5,571,160,827.89	6,626,677,841.23
于 2023 年 12 月 31 日	1,015,896,705.41		5,510,895,464.74	6,526,792,170.15

## (二十三) 融券业务情况

项目	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
融出证券	2,699,911,893.45	3,917,467,759.07
交易性金融资产	832,800,045.30	1,284,217,716.52
其中：股票	250,737,200.57	219,508,743.39
基金	582,062,844.73	1,064,708,973.13
其他权益工具投资 - 股票	1,244,426,296.25	912,863,815.91
转融通融入证券	622,685,551.90	1,720,386,226.64
转融通融入证券总额	1,087,642,937.06	5,630,968,720.00

注：本年融券业务无违约情况（2023 年：同）。

## (二十四) 资产减值

### 1、各项资产减值准备变动表

类别	2024 年 1 月 1 日	本期增加		本期减少		2024 年 6 月 30 日
		(转回) / 计提	其他增加	核销	其他减少	
货币资金减值准备	17,765,450.34	2,636,255.23	92,891.09			20,494,596.66
融出资金减值准备	3,462,129,500.83	109,943,998.25	15,775,684.82			3,587,849,183.90
应收款项坏账准备	399,722,513.58	91,022,377.75			243,475.72	490,501,415.61
买入返售金融资产减值准备	663,301,676.61	56,474,631.48			323.35	719,775,984.74
债权投资减值准备	34,749,879.28	-7,335,137.09			2,336,930.61	25,077,811.58
其他债权投资信用损失准备	134,660,090.60	16,506,000.37			5,371,407.90	145,794,683.07
应收融资租赁款减值准备	916,970,725.35	226,705,876.57		208,271,244.57	103,882,272.00	831,523,085.35
长期应收款减值准备	1,873,554,161.96	277,186,364.63		45,110,924.83	10,514,213.40	2,095,115,388.36
发放贷款和垫款损失准备	59,856,290.98	-3,606,075.19			2,286,057.12	53,964,158.67
其他贷款和应收款减值准备	1,236,560,382.53	93,103,150.47			1,330,115.61	1,328,333,417.39
其他应收款坏账准备	593,077,008.96	-23,242,848.13	453,941.22	91,027.66		570,197,074.39
其他金融资产减值准备	157,478,689.32	30,731,771.34			3,045,545.90	185,164,914.76
<b>金融工具及其他项目信用减值准备小计</b>	<b>9,549,826,370.34</b>	<b>870,126,365.68</b>	<b>16,322,517.13</b>	<b>253,473,197.06</b>	<b>129,010,341.61</b>	<b>10,053,791,714.48</b>
投资性房地产减值准备	5,152,882.38	3,741,741.79				8,894,624.17
固定资产减值准备	86,971,234.12		357,039.85			87,328,273.97
商誉减值准备	734,371,456.36		5,234,975.61			739,606,431.97
其他资产减值准备	77,465,050.33	11,905,881.40			352,084.66	89,018,847.07
<b>其他资产减值准备小计</b>	<b>903,960,623.19</b>	<b>15,647,623.19</b>	<b>5,592,015.46</b>		<b>352,084.66</b>	<b>924,848,177.18</b>
合计	10,453,786,993.53	885,773,988.87	21,914,532.59	253,473,197.06	129,362,426.27	10,978,639,891.66

## 2、金融工具及其他项目预期信用损失准备情况表

金融工具类别	2024年6月30日			合计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期信用 损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用 损失(已发生信用减值)	
货币资金减值准备	20,494,596.66			20,494,596.66
融出资金减值准备	31,059,270.71	18,162,475.52	3,538,627,437.67	3,587,849,183.90
应收款项坏账准备	116,649,580.64	107,114,723.35	266,737,111.62	490,501,415.61
买入返售金融资产减值准备	9,514,822.34	11,123,200.19	699,137,962.21	719,775,984.74
债权投资减值准备	16,634,149.48		8,443,662.10	25,077,811.58
其他债权投资信用损失准备	90,203,977.54	43,886,030.84	11,704,674.69	145,794,683.07
应收融资租赁款减值准备	334,151,850.73	385,811,346.15	111,559,888.47	831,523,085.35
长期应收款减值准备	1,056,223,781.85	713,022,847.41	325,868,759.10	2,095,115,388.36
发放贷款和垫款损失准备	19,251,205.70	5,686,690.96	29,026,262.01	53,964,158.67
其他贷款和应收款减值准备	604,219.40		1,327,729,197.99	1,328,333,417.39
其他应收款坏账准备	64,082,551.74	9,689,646.97	496,424,875.68	570,197,074.39
其他金融资产减值准备	29,157,909.82	44,967,693.18	111,039,311.76	185,164,914.76
合计	1,788,027,916.61	1,339,464,654.57	6,926,299,143.30	10,053,791,714.48

金融工具类别	2023年12月31日			合计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期信用 损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用 损失(已发生信用减值)	
货币资金减值准备	17,765,450.34			17,765,450.34
融出资金减值准备	34,619,343.78	16,479,493.50	3,411,030,663.55	3,462,129,500.83
应收款项坏账准备	77,663,001.69	102,525,747.26	219,533,764.63	399,722,513.58
其他应收款坏账准备	63,607,892.75	9,343,402.26	520,125,713.95	593,077,008.96
买入返售金融资产减值准备	11,418,098.44	21,981,005.63	629,902,572.54	663,301,676.61
发放贷款和垫款损失准备	22,688,735.02	5,925,878.55	31,241,677.41	59,856,290.98
应收融资租赁款减值准备	358,786,610.65	380,220,485.20	177,963,629.50	916,970,725.35
长期应收款减值准备	1,003,946,478.02	658,068,545.36	211,539,138.58	1,873,554,161.96
其他贷款和应收款减值准备	1,670,256.84		1,234,890,125.69	1,236,560,382.53
其他债权投资减值准备	69,369,613.70	47,710,241.20	17,580,235.70	134,660,090.60
债权投资减值准备	23,375,966.20	255,015.78	11,118,897.30	34,749,879.28
其他资产减值准备	31,563,665.13	49,309,415.49	76,605,608.70	157,478,689.32
合计	1,716,475,112.56	1,291,819,230.23	6,541,532,027.55	9,549,826,370.34

## (二十五) 所有权或使用权受到限制的资产

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见附注五、（一）货币资金，（八）买入返售金融资产，（九）交易性金融资产，（十）债权投资，（十一）其他债权投资，（十二）其他权益工具投资，（十三）应收融资租赁款及长期应收款，以及（十六）固定资产。



## (二十六) 短期借款

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
信用借款	30,670,412,185.73	31,053,895,350.17
质押借款	2,726,030,185.73	
合计	33,396,442,371.46	31,053,895,350.17

注：短期借款质押物情况详见附注十、（一）、1。

## (二十七) 应付短期融资款

发行主体	类型	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本年增加	本年减少	2024年6月30日
海通证券股份有限公司	短期公司债券	2023年11月15日	2024年10月25日	2.68%	5,017,254,794.52	66,816,438.36		5,084,071,232.88
海通证券股份有限公司	短期收益凭证	2023年7月4日至 2024年6月28日	2024年7月1日至 2025年6月26日	0.00%-3.00%	7,473,085,817.41	11,536,536,342.57	12,564,785,657.15	6,444,836,502.83
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	短期融资券	2023年01月10日	2024年01月10日	3.41%	1,033,166,340.36	840,821.92	1,034,007,162.28	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年04月26日	2024年01月19日	2.56%	1,017,489,663.46	1,211,108.59	1,018,700,772.05	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年08月22日	2024年03月08日	2.40%	1,008,471,073.85	4,369,728.28	1,012,840,802.13	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年09月04日	2024年05月24日	2.50%	1,007,782,017.70	9,813,795.94	1,017,595,813.64	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年09月20日	2024年06月07日	2.68%	1,007,173,282.55	11,548,735.69	1,018,722,018.24	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年11月22日	2024年08月16日	2.81%	1,002,689,050.81	14,304,027.31		1,016,993,078.12
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	短期融资券	2024年01月08日	2025年01月08日	2.78%		1,012,916,131.97		1,012,916,131.97
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2024年01月17日	2024年09月25日	2.65%		1,011,764,469.84		1,011,764,469.84
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2024年06月05日	2025年02月25日	2.15%		1,000,848,771.86		1,000,848,771.86
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2023年02月09日	2024年02月08日	4.70%	285,947,371.88	2,038,378.74	287,985,750.62	
合计					18,853,059,412.54	14,673,008,751.07	17,954,637,976.11	15,571,430,187.50

注：于2024年6月30日，应付短期融资款包括未到期偿付的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券以及原初始期限为1年以内的收益凭证。于2024年6月30日及2023年12月31日，本集团发行的应付短期融资券没有出现本金、利息或赎回款项的违约情况。

## (二十八) 拆入资金

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
银行拆入	8,156,136,379.80	3,339,204,803.61
转融通业务融入	11,348,860,644.44	11,373,159,083.32
合计	19,504,997,024.24	14,712,363,886.93

本公司转融通融入资金的剩余期限及利率如下表所示：

剩余期限	2024年6月30日		2023年12月31日	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1个月以内	4,546,980,000.00	2.43%	4,546,440,000.00	2.16%
1至3个月	3,801,373,144.44	2.15%-2.43%	6,826,719,083.32	2.12%-2.30%
3至12个月	3,000,507,500.00	2.03%		
合计	11,348,860,644.44		11,373,159,083.32	

## (二十九) 交易性金融负债

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	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(注)	合计	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(注)	合计
债券	1,232,436,915.42		1,232,436,915.42	545,333,959.85		545,333,959.85
股票		47,556,040.19	47,556,040.19	808,695,950.62		808,695,950.62
黄金期权		955,313,789.94	955,313,789.94		1,333,761,698.09	1,333,761,698.09
归属结构化主体其他份额持有人的权益		1,757,570,995.30	1,757,570,995.30		1,930,669,506.04	1,930,669,506.04
结构化收益产品		5,893,302,083.44	5,893,302,083.44		11,925,443,860.20	11,925,443,860.20
其他	934,796,000.00	1,426,325,032.01	2,361,121,032.01	815,303,000.00	3,094,196,974.54	3,909,499,974.54
合计	2,167,232,915.42	10,080,067,940.88	12,247,300,856.30	2,169,332,910.47	18,284,072,038.87	20,453,404,949.34

注：于2024年6月30日和2023年12月31日，本集团的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的公允价值与按合同到期日应支付持有人的金额的差异并不重大；由于本集团自身信用风险变化导致上述金融负债公允价值变化的金额并不重大。本集团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主要为本集团发行的结构化收益产品、收益凭证以及纳入合并范围内的结构化主体中归属于第三方权益等。

## (三十) 卖出回购金融资产款

### 1、按业务类别列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
债券质押式报价回购	6,703,905,462.83	6,414,542,091.88
其他质押式回购	68,833,209,637.90	83,770,306,950.70
买断式回购	16,241,941,572.41	12,726,688,632.60
黄金掉期业务	7,946,622,345.06	9,653,254,859.90
合计	99,725,679,018.20	112,564,792,535.08

## 2、按金融资产种类列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
股票	1,676,739,528.23	2,172,629,234.24
债券	90,102,317,144.91	100,738,908,440.94
黄金	7,946,622,345.06	9,653,254,859.90
合计	99,725,679,018.20	112,564,792,535.08

## 3、卖出回购金融资产款的担保物信息

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
股票	1,909,353,553.42	2,503,832,161.93
债券	91,491,100,071.42	103,162,670,731.87
其他	16,482,797,194.80	18,789,647,650.74
合计	109,883,250,819.64	124,456,150,544.54

## 4、报价回购融入资金按剩余期限分类

剩余期限	2024年6月30日	利率区间	2023年12月31日	利率区间
一个月内	1,977,394,743.13	0.59%-8.16%	1,041,115,042.84	0.50%-8.18%
一个月至三个月内	1,549,450,966.28		429,175,843.56	
三个月至一年内	3,177,059,753.42		4,944,251,205.48	
合计	6,703,905,462.83		6,414,542,091.88	

## (三十一) 代理买卖证券款

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
普通经纪业务		
个人	59,616,943,352.78	60,261,638,722.52
机构	39,613,126,808.26	39,460,458,314.35
小计	99,230,070,161.04	99,722,097,036.87
信用业务		
个人	5,999,285,120.68	4,933,497,886.15
机构	1,296,982,006.27	1,883,121,667.37
小计	7,296,267,126.95	6,816,619,553.52
合计	106,526,337,287.99	106,538,716,590.39

## (三十二) 应付职工薪酬

### 1、应付职工薪酬列示

项目	注释	2024年6月30日	2023年12月31日
短期薪酬	2	1,797,842,639.86	2,059,018,004.70
离职后福利 - 设定提存计划	3	25,582,160.10	25,774,600.94
其他长期职工福利	2	499,064,211.56	499,064,211.56
合计		2,322,489,011.52	2,583,856,817.20

## 2、短期薪酬、辞退福利及其他长期职工福利列示

项目	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
一、工资、奖金、津贴和补贴	2,503,214,913.29	2,059,340,875.53	2,320,754,746.11	2,241,801,042.71
二、职工福利费	12,148,343.35	68,160,637.32	80,218,980.67	90,000.00
三、社会保险费	18,413,090.83	163,289,320.99	168,834,497.06	12,867,914.76
其中：医疗保险费	14,927,618.91	133,747,674.02	136,122,113.09	12,553,179.84
工伤保险费	317,285.02	2,922,865.91	2,943,052.67	297,098.26
生育保险费	16,874.64	1,063,318.05	1,062,556.03	17,636.66
四、住房公积金	15,722,354.93	186,878,930.48	186,616,126.89	15,985,158.52
五、工会经费和职工教育经费	8,583,513.86	44,329,760.22	41,943,911.85	10,969,362.23
六、辞退福利		8,880,648.15	8,880,648.15	
七、其他		53,702,720.35	38,509,347.15	15,193,373.20
合计	2,558,082,216.26	2,584,582,893.04	2,845,758,257.88	2,296,906,851.42
其中：短期薪酬	2,059,018,004.70			1,797,842,639.86
其他长期职工福利	499,064,211.56			499,064,211.56

## 3、设定提存计划列示

项目	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
基本养老保险	24,286,153.53	238,578,668.94	240,912,679.95	21,952,142.52
失业保险费	802,444.46	8,175,935.96	8,242,401.99	735,978.43
企业年金缴费	686,002.95	206,771,344.96	204,563,308.76	2,894,039.15
合计	25,774,600.94	453,525,949.86	453,718,390.70	25,582,160.10

## (三十三) 应交税费

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
企业所得税	590,432,807.40	851,562,104.60
个人所得税	105,856,808.52	167,968,995.06
增值税	51,947,069.41	85,453,380.24
城市维护建设税	3,461,910.38	3,594,395.08
教育费附加及地方教育费附加	2,469,948.56	2,593,526.48
其他	122,409,384.55	140,769,687.64
合计	876,577,928.82	1,251,942,089.10

## (三十四) 应付款项

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
收益互换保证金	3,721,528,085.40	7,433,072,859.67
应付各类清算款	3,784,711,850.31	2,279,663,919.62
应付票据	1,538,066,159.72	2,027,860,736.10
其他	2,327,550,515.20	3,393,717,593.30
合计	11,371,856,610.63	15,134,315,108.69

### (三十五) 预计负债

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
对外提供担保	17,072,359.89	15,630,412.97
未决诉讼及其他	141,506,953.65	178,333,872.05
合计	158,579,313.54	193,964,285.02

### (三十六) 长期借款

项目	2024年6月30日		2023年12月31日	
	余额	利率区间	余额	利率区间
信用借款	32,077,682,410.18	0.10%-4.20%	34,483,414,965.31	0.10%-5.56%
质押押借款	4,899,598,274.05	3.25%-7.11%	7,815,909,701.54	2.95%-7.35%
合计	36,977,280,684.23		42,299,324,666.85	

注：长期借款质押物情况详见附注十、(一)、1。

### (三十七) 应付债券

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2014年07月14日	2024年07月14日	5.85%	821,782,587.55	23,349,514.20		845,132,101.75
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,500,000,000.00	2017年09月22日	2027年09月22日	4.99%	5,566,825,705.28	137,570,499.84		5,704,396,205.12
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	700,000,000.00	2020年04月30日	2025年04月30日	2.88%	713,193,863.68	10,166,218.58	20,160,000.00	703,200,082.26
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2021年01月13日	2024年01月13日	3.58%	6,207,611,546.62	7,188,453.38	6,214,800,000.00	
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,400,000,000.00	2021年02月08日	2024年02月08日	3.79%	5,582,991,945.74	21,668,054.26	5,604,660,000.00	
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年04月23日	2024年04月23日	3.45%	5,118,251,509.52	54,248,490.48	5,172,500,000.00	
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,800,000,000.00	2021年05月27日	2024年05月27日	3.35%	2,855,405,361.03	38,394,638.97	2,893,800,000.00	
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,100,000,000.00	2021年06月10日	2024年06月10日	3.40%	2,139,399,569.58	32,000,430.42	2,171,400,000.00	
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年07月29日	2024年07月29日	3.14%	2,026,032,707.17	31,864,215.10		2,057,896,922.27
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2021年08月20日	2024年08月20日	3.04%	3,032,173,734.96	46,303,066.15		3,078,476,801.11
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年08月30日	2024年08月30日	3.10%	2,020,159,360.28	31,465,286.30		2,051,624,646.58
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年08月30日	2026年08月30日	3.43%	2,021,197,805.54	34,480,270.58		2,055,678,076.12
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年11月10日	2024年11月10日	3.10%	5,019,278,250.11	78,657,708.54		5,097,935,958.65
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年11月22日	2024年11月22日	3.09%	5,014,037,073.57	78,408,120.84		5,092,445,194.41

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年01月20日	2024年12月25日	2.84%	5,131,286,616.55	72,470,788.93	142,000,000.00	5,061,757,405.48
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,900,000,000.00	2022年02月21日	2025年02月21日	2.90%	2,970,237,976.73	42,765,350.44	84,100,000.00	2,928,903,327.17
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2022年03月07日	2025年03月07日	3.03%	512,040,880.15	7,704,257.15	15,150,000.00	504,595,137.30
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年07月26日	2025年07月26日	2.75%	5,054,739,889.01	69,936,700.53		5,124,676,589.54
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年09月09日	2025年09月09日	2.53%	5,034,022,050.96	64,464,240.05		5,098,486,291.01
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,700,000,000.00	2022年10月14日	2025年10月14日	2.60%	4,721,031,873.45	62,230,306.38		4,783,262,179.83
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2022年11月10日	2025年11月10日	2.61%	3,007,572,063.71	39,869,650.96		3,047,441,714.67
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,500,000,000.00	2023年02月08日	2025年02月08日	2.95%	2,563,428,891.60	37,874,541.77	73,750,000.00	2,527,553,433.37
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2023年02月08日	2026年02月08日	3.23%	3,082,780,067.98	49,141,109.00	96,900,000.00	3,035,021,176.98
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,500,000,000.00	2023年03月06日	2025年03月06日	3.11%	2,561,124,325.74	39,909,607.99	77,750,000.00	2,523,283,933.73
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,700,000,000.00	2023年03月06日	2026年03月06日	3.26%	1,743,215,770.02	28,132,435.53	55,420,000.00	1,715,928,205.55
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,300,000,000.00	2023年03月22日	2025年03月22日	2.97%	3,372,466,663.35	50,364,912.98	98,010,000.00	3,324,821,576.33
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,700,000,000.00	2023年03月22日	2026年03月22日	3.10%	2,761,354,757.55	42,518,173.20	83,700,000.00	2,720,172,930.75
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2023年04月24日	2025年04月24日	2.89%	2,037,293,557.38	29,710,060.80	57,800,000.00	2,009,203,618.18
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,000,000,000.00	2023年04月24日	2026年04月24日	3.05%	4,078,118,031.65	61,959,922.17	122,000,000.00	4,018,077,953.82
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,600,000,000.00	2023年05月18日	2026年05月18日	2.94%	3,660,496,463.31	53,771,851.84	105,840,000.00	3,608,428,315.15
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,400,000,000.00	2023年05月18日	2028年05月18日	3.10%	1,424,700,315.46	21,845,366.47	43,400,000.00	1,403,145,681.93
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2023年06月15日	2026年06月15日	2.73%	3,040,085,653.07	41,856,751.16	81,900,000.00	2,999,842,404.23
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2023年06月15日	2028年06月15日	3.07%	2,030,161,048.47	30,895,419.26	61,400,000.00	1,999,656,467.73
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2023年07月25日	2026年07月25日	2.72%	2,020,535,459.58	27,663,201.95		2,048,198,661.53
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,700,000,000.00	2023年07月25日	2028年07月25日	3.05%	2,731,317,968.72	41,428,795.63	2,772,746,764.35	2,772,746,764.35
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,200,000,000.00	2023年08月18日	2026年08月18日	2.67%	3,226,427,050.42	43,464,141.95	3,269,891,192.37	3,269,891,192.37
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,800,000,000.00	2023年11月24日	2026年11月24日	2.95%	1,802,211,498.04	26,877,119.34	1,829,088,617.38	1,829,088,617.38
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2024年02月22日	2027年02月22日	2.58%		1,007,491,335.58		1,007,491,335.58
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2024年02月22日	2029年02月22日	2.75%		5,040,027,969.81		5,040,027,969.81
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,700,000,000.00	2024年03月05日	2027年03月05日	2.50%		1,710,863,558.09		1,710,863,558.09
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,300,000,000.00	2024年03月05日	2029年03月05日	2.70%		3,322,952,835.55		3,322,952,835.55
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,100,000,000.00	2024年03月20日	2027年03月20日	2.55%		4,122,382,668.27		4,122,382,668.27
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2024年03月20日	2029年03月20日	2.69%		3,017,346,894.47		3,017,346,894.47
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年01月12日	2025年01月12日	3.18%	5,150,913,388.27	80,655,668.25	159,000,000.00	5,072,569,056.52
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,000,000,000.00	2022年02月25日	2025年02月25日	3.15%	2,052,035,157.83	31,983,662.47	63,000,000.00	2,021,018,820.30
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,480,000,000.00	2022年03月09日	2025年03月09日	3.29%	2,544,551,102.32	41,424,067.52	81,592,000.00	2,504,383,169.84

发行主体	债类类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
海通证券股份有限公司	收益凭证	人民币	422,584,000.00	2022年7月5日至 2024年5月30日	2024年7月1日至 2026年1月5日	0.00%-3.10%	736,271,838.16	30,206,646.75	336,450,269.31	430,028,215.60
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年04月26日	2025年04月26日	3.65%	698,538,847.64	11,766,664.43	24,820,000.00	685,485,512.07
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	美元	100,000,000.00	2021年06月03日	2024年06月03日	3.00%	701,080,733.83	11,582,887.99	712,663,621.82	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2021年06月18日	2025年06月18日	3.36%	581,160,589.14	9,248,602.58	19,152,000.00	571,257,191.72
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	600,000,000.00	2021年08月12日	2024年08月12日	3.90%	608,394,654.55	12,197,816.90		620,592,471.45
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,000,000,000.00	2021年11月11日	2024年11月11日	4.19%	1,004,496,102.62	21,637,880.66		1,026,133,983.28
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2021年12月09日	2024年12月09日	3.70%	1,000,754,868.94	19,269,748.20		1,020,024,617.14
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年12月24日	2024年12月24日	3.70%	999,423,337.88	19,136,473.26		1,018,559,811.14
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	800,000,000.00	2022年01月13日	2025年01月13日	3.64%	826,741,849.77	14,520,109.60	28,468,657.89	812,793,301.48
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2022年03月10日	2024年05月27日	3.50%	57,072,619.86	374,516.30	57,447,136.16	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,500,000,000.00	2022年04月21日	2024年04月21日	3.48%	1,535,324,135.62	15,731,506.81	1,551,055,642.43	
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	美元	200,000,000.00	2022年04月27日	2025年04月27日	4.20%	1,423,922,349.71	38,655,529.61	28,689,153.60	1,433,888,725.72
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	935,000,000.00	2022年04月28日	2024年12月27日		113,891,691.06		86,210,675.28	27,681,015.78
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2022年05月05日	2025年05月05日	3.57%	510,700,194.67	8,851,643.79	17,473,324.04	502,078,514.42
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2022年05月27日	2025年05月27日	3.42%	1,018,290,654.42	16,959,452.13	33,407,903.42	1,001,842,203.13
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2022年06月21日	2024年06月21日	3.16%	1,015,506,079.68	14,804,383.55	1,030,310,463.23	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年06月29日	2025年02月26日	3.19%、3.60%	235,482,128.06	2,883,216.76	146,606,348.66	91,758,996.16
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	600,000,000.00	2022年07月07日	2025年07月07日	3.44%	608,481,330.72	10,782,275.22		619,263,605.94

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	943,000,000.00	2022年07月07日	2025年09月15日	3.50%、4.30%	240,283,986.30	1,163,050.70	136,541,753.00	104,905,284.00
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年07月12日	2024年05月27日	3.00%、3.03%	113,104,495.20	520,905.42	113,625,400.62	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,200,000,000.00	2022年08月10日	2025年08月10日	3.25%	1,212,279,356.80	20,395,025.61		1,232,674,382.41
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年09月08日	2024年08月26日	2.80%	285,491,816.97	2,433,033.97	255,794,671.27	32,130,179.67
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,425,000,000.00	2022年09月16日	2027年09月27日	4.10%	1,405,854,036.07	29,132,465.75	24,477,069.17	1,410,509,432.65
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年09月21日	2025年08月26日	2.98%、3.40%	375,541,621.79	4,629,711.54	178,698,015.95	201,473,317.38
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2022年10月21日	2025年10月21日	3.13%	1,003,137,784.08	16,418,044.75		1,019,555,828.83
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	984,000,000.00	2022年10月28日	2025年08月15日	3.43%、4.00%	278,404,932.61	1,364,826.65	143,753,644.00	136,016,115.26
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年11月25日	2024年11月26日	3.50%、3.60%	407,117,497.00	4,936,834.19	291,776,777.98	120,277,553.21
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2022年12月14日	2025年12月14日	4.13%	999,571,045.92	21,283,870.05		1,020,854,915.97
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,425,000,000.00	2022年12月23日	2027年12月27日	4.48%	1,409,133,240.62	31,832,547.96	27,934,183.43	1,413,031,605.15
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年01月13日	2025年08月26日	4.50%、4.70%	512,726,947.13	9,734,303.26	198,522,168.00	323,939,082.39
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2023年02月23日	2026年02月23日	4.20%	1,033,586,123.85	20,942,465.75	41,460,211.83	1,013,068,377.77
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年03月08日	2025年01月26日	3.63%、3.70%	503,643,267.25	5,811,645.12	298,051,587.30	211,403,325.07
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	737,000,000.00	2023年03月10日	2025年10月23日	3.92%、4.80%	292,895,904.45	2,186,102.48	136,439,400.00	158,642,606.93



发行主体	债项类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年03月16日	2025年07月28日	3.70%、4.00%	507,707,534.60	7,074,564.33	208,126,526.20	306,655,572.73
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2023年04月10日	2024年05月26日	3.29%	154,282,389.09	1,272,141.50	155,554,530.59	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2023年04月17日	2026年04月17日	3.90%	1,024,966,204.06	19,339,725.69	38,437,415.77	1,005,868,513.98
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年05月16日	2025年03月26日	3.28%、3.43%	535,305,144.87	7,179,897.96	310,779,471.58	231,705,571.25
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年05月24日	2025年12月26日	3.48%、3.62%	586,338,661.04	8,602,403.62	274,817,581.08	320,123,483.58
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2023年06月06日	2026年06月06日	3.81%	1,019,109,848.76	18,997,808.22	37,554,882.56	1,000,552,774.42
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年06月07日	2026年03月26日	3.38%、3.58%	573,652,256.72	9,075,814.98	152,280,045.97	430,448,025.73
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2023年06月26日	2028年06月26日	3.80%	1,017,090,097.54	18,947,945.20	37,502,620.41	998,535,422.33
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年06月27日	2025年06月26日	3.18%、3.41%	699,304,894.73	9,300,137.71	344,783,948.41	363,821,084.03
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	955,000,000.00	2023年07月19日	2024年01月18日	2.80%	966,793,328.36	1,245,424.67	968,038,753.03	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2023年07月25日	2028年07月25日	3.63%	1,013,260,787.18	18,593,763.71		1,031,854,550.89
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年08月08日	2026年03月26日	3.16%、3.30%	637,207,533.54	9,007,982.23	192,289,265.61	453,926,250.16
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2023年08月24日	2026年08月24日	3.46%	1,008,992,890.03	17,909,665.11		1,026,902,555.14
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年09月01日	2025年04月26日	2.55%-3.09%	1,146,322,033.17	9,395,854.84	687,102,742.69	468,615,145.32

发行主体	债款类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2023年09月15日	2024年03月08日	2.97%	957,335,920.93	5,179,191.77	962,515,112.70	
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2023年10月24日	2027年10月24日	3.47%	1,004,466,727.03	17,913,442.99		1,022,380,170.02
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年11月03日	2026年04月27日	2.90%-3.50%	949,167,703.27	11,052,314.64	370,165,964.99	590,054,052.92
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年12月15日	2025年12月26日	3.09%-3.45%	947,093,940.61	12,155,255.44	475,775,311.77	483,473,884.28
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年12月20日	2025年12月26日	2.94%-3.32%	1,134,823,093.80	14,645,893.79	523,947,484.78	625,521,502.81
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,350,000,000.00	2023年12月22日	2026年11月26日	3.10%-3.60%	1,185,257,189.06	174,488,121.13	451,972,131.78	907,773,178.41
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2024年01月15日	2028年01月15日	3.03%		1,012,297,077.30		1,012,297,077.30
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	873,000,000.00	2024年02月07日	2026年02月24日	3.20%、3.85%		880,043,141.45	330,562,172.00	549,480,969.45
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2024年03月06日	2027年03月06日	2.80%		1,005,999,423.70		1,005,999,423.70
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2024年03月19日	2027年03月19日	3.65%		1,006,798,483.54		1,006,798,483.54
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2024年04月15日	2029年04月15日	2.60%		1,003,327,048.67		1,003,327,048.67
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2024年05月20日	2029年05月20日	2.48%		999,604,571.46		999,604,571.46
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2024年05月28日	2026年11月26日	2.18%-2.39%		946,996,066.60		946,996,066.60
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2024年06月25日	2029年06月25日	2.29%		996,462,248.64		996,462,248.64
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	金融债券	巴西雷亚尔	1,240,368,328.33	2021年6月25日至2024年3月25日	2024年1月10日至2026年7月28日	5.28%-13.25%	2,109,545,925.52	120,395,505.46	757,507,180.87	1,472,434,250.11
Haitong Bank, S.A.	金融债券	欧元	230,000,000.00	2022年02月08日	2025年02月08日	5.28%	1,818,072,832.91	1,502,218.99	45,687,728.27	1,773,887,323.63
Haitong Bank, S.A.	金融债券	美元	150,000,000.00	2022年05月23日	2027年05月29日	4.00%	1,068,515,286.55	7,034,239.26		1,075,549,525.81

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
Haitong International Finance Holdings 2015 Limited	公司债券	美元	670,000,000.00	2020年03月12日	2025年03月11日	2.11%	4,772,462,521.18	93,404,136.20	62,057,643.41	4,803,809,013.97
Haitong International Finance Holdings Limited	公司债券	人民币	4,000,000,000.00	2023年04月20日	2026年04月20日	3.40%	4,089,036,508.96	108,992,668.52	176,043,487.09	4,021,985,710.39
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	700,000,000.00	2019年07月19日	2024年07月19日	3.38%	5,028,926,965.80	35,848,765.42	692,140.26	5,064,083,590.96
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	400,000,000.00	2019年11月18日	2025年05月18日	3.13%	2,836,151,997.22	20,542,942.80		2,856,694,940.02
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2021年05月20日	2026年05月20日	2.13%	2,124,942,409.57	15,147,677.13	659,778.50	2,139,430,308.20
Haitong International Finance Holdings Limited	公司债券	人民币	2,800,000,000.00	2023年05月18日	2026年05月18日	3.20%	2,803,351,519.20	73,365,225.78	71,878,927.60	2,804,837,817.38
Haitong International Finance Holdings Limited	公司债券	人民币	3,500,000,000.00	2024年03月01日	2027年03月01日	3.30%		3,562,762,244.51	33,756,933.50	3,529,005,311.01
合计							193,920,279,749.62	32,700,843,575.83	37,170,351,859.81	189,450,771,465.64

注：于2024年6月30日及2023年12月31日，本集团发行的应付债券没有出现本金、利息或赎回款项的违约情况。

## (三十八) 其他负债

### 1、按项目列示

项目	注释	2024年6月30日	2023年12月31日
其他应付款	2	2,459,870,872.31	2,546,434,952.84
代理兑付债券款		17,563,483.02	17,563,483.02
长期应付款	3	6,380,022,134.32	6,807,584,162.27
中央银行款项及国家外汇存款		89,002,356.49	89,568,195.33
吸收存款	4	7,843,148,966.05	6,409,915,166.10
应付股利		1,466,314,043.05	206,184,198.39
其他		1,037,680,220.58	1,007,734,870.90
合计		19,293,602,075.82	17,084,985,028.85

### 2、其他应付款

#### (1) 明细列示

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
应付投资者保护基金及风险准备金等	766,997,936.08	749,978,753.50
应付服务费	39,341,135.88	50,635,094.28
其他	1,653,531,800.35	1,745,821,105.06
合计	2,459,870,872.31	2,546,434,952.84

(2) 2024年6月30日无欠持公司5%以上(含5%)表决权股份的股东单位款项。

### 3、长期应付款

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
承租人保证金及递延收益	5,642,014,634.30	6,082,613,991.28
其他	738,007,500.02	724,970,170.99
合计	6,380,022,134.32	6,807,584,162.27

### 4、吸收存款

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
活期存款	228,020,779.01	252,275,112.85
其中：公司	215,414,381.66	241,612,791.34
个人	12,606,397.35	10,662,321.51
定期存款(含通知存款)	7,615,128,187.04	6,157,640,053.25
其中：公司	3,223,639,548.37	3,164,474,819.98
个人	4,391,488,638.67	2,993,165,233.27
合计	7,843,148,966.05	6,409,915,166.10

## (三十九) 股本

流通股	2024年1月1日	本期变动	2024年6月30日
无限售条件流通股份 -A 股	8,873,381,180.00		8,873,381,180.00
有限售条件流通股份 -A 股	781,250,000.00		781,250,000.00
无限售条件流通股份 -H 股	3,409,568,820.00		3,409,568,820.00
合计	13,064,200,000.00		13,064,200,000.00

注：截至 2024 年 6 月 30 日，公司无限售条件流通股为 12,282,950,000 股，有限售条件流通股为 781,250,000 股。

## (四十) 资本公积

项目	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
资本溢价（股本溢价）				
(1) 投资者投入的资本	74,932,781,994.07			74,932,781,994.07
(2) 其他	831,811,354.77	112,943,180.05		944,754,534.82
合计	75,764,593,348.84	112,943,180.05		75,877,536,528.89

## (四十一) 库存股

项目	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
股份回购	414,335,029.18	303,072,674.49		717,407,703.67
合计	414,335,029.18	303,072,674.49		717,407,703.67

注：截至 2024 年 6 月 30 日的六个月内，公司通过上海证券交易所回购了自身普通股 35,567,000 股（截至 2023 年 12 月 31 日的十二个月内回购了 41,507,467 股），回购总对价为人民币 303,072,674.49 元（截至 2023 年 12 月 31 日的十二个月内支付的总对价为人民币 414,335,029.18 元）。截至 2024 年 6 月 30 日，公司持有的库存股数量为 77,074,467 股（截至 2023 年 12 月 31 日为 41,507,467 股）。

## (四十二) 其他综合收益

项目	2024年1月1日				本期发生额				2024年6月30日 归属于母公司股东的 其他综合收益
	归属于母公司股东的 其他综合收益	本期所得税前 发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他 综合收益当期 转入损益	减：前期计入其他 综合收益当期 转入损益	减：前期计入其他 综合收益当期转入 留存收益	税后归属于母公司	税后归属于 少数股东	
1、不能重分类进损益的其他 综合收益	-913,128,689.63	104,109,760.46	44,824,666.93		-157,896,485.34	217,181,578.87			-695,947,110.76
其中：重新计量设定受益计 划变动额	-40,508,245.93	10,627,495.90				10,627,495.90			-29,880,750.03
其他权益工具投资公允 价值变动	-872,620,443.70	93,482,264.56	44,824,666.93		-157,896,485.34	206,554,082.97			-666,066,360.73
2、以后将重分类进损益的其 他综合收益	-391,447,386.76	564,545,210.81	141,554,614.13		191,167,399.52	264,360,881.55			-127,086,505.21
其中：权益法下可转损益的 其他综合收益	3,336,215.77	669,581.57				669,581.57			4,005,797.34
其他债权投资公允价值 变动和信用减值准备	436,046,168.64	709,705,479.95	135,387,000.35		162,017,791.11	413,246,711.10			849,292,879.74
现金流量套期	82,649,257.21	48,092,026.66	6,167,613.78		29,149,608.41	10,858,576.04			93,507,833.25
外币财务报表折算差额	-903,251,549.43	-193,921,877.37				-160,413,987.16			-1,063,665,536.59
其他	-10,227,478.95								-10,227,478.95
其他综合收益合计	-1,304,576,076.39	668,654,971.27	186,379,281.06		191,167,399.52	481,542,460.42			-823,033,615.97

项目	2023年1月1日				2023年12月31日			
	归属于母公司股东的其他综合收益	本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	归属于母公司股东的其他综合收益	税后归属于母公司少数股东	税后归属于母公司少数股东	归属于母公司股东的其他综合收益
1、不能重分类进损益的其他综合收益	-806,515,450.24	-482,822,963.21	-82,003,814.28	-264,600,431.50	-913,128,689.63	-29,605,478.04	-29,605,478.04	-913,128,689.63
其中：重新计量设定受益计划变动额	-5,593,338.21	-34,914,907.72		-34,914,907.72	-40,508,245.93			-40,508,245.93
其他权益工具投资公允价值变动	-800,922,112.03	-447,908,055.49	-82,003,814.28	-264,600,431.50	-872,620,443.70	-29,605,478.04	-29,605,478.04	-872,620,443.70
2、以后将重分类进损益的其他综合收益	-810,797,771.29	848,269,799.55	123,039,000.45	196,924,471.87	-391,447,386.76	108,955,942.70	108,955,942.70	-391,447,386.76
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	1,973,978.03	1,362,237.74		1,362,237.74	3,336,215.77			3,336,215.77
其他债权投资公允价值变动和信用减值准备	133,366,754.87	534,596,891.39	103,740,478.48	127,473,823.36	436,046,168.64	703,175.78	703,175.78	436,046,168.64
现金流量套期	57,259,212.51	118,619,832.64	19,298,521.97	69,450,648.51	82,649,257.21	4,480,617.46	4,480,617.46	82,649,257.21
外币财务报表折算差额	-993,170,237.75	193,690,837.78			-903,251,549.43	103,772,149.46	103,772,149.46	-903,251,549.43
其他	-10,227,478.95				-10,227,478.95			-10,227,478.95
其他综合收益合计	-1,617,313,221.53	365,446,836.34	41,035,186.17	196,924,471.87	-1,304,576,076.39	312,737,145.14	79,350,464.66	-1,304,576,076.39

### (四十三) 盈余公积

项目	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
法定盈余公积	10,388,208,598.52			10,388,208,598.52
合计	10,388,208,598.52			10,388,208,598.52

### (四十四) 一般风险准备

项目	2024年1月1日	本期增加	本期减少	2024年6月30日
一般风险准备	12,512,910,418.18	32,219,072.82		12,545,129,491.00
交易风险准备	10,897,341,985.07			10,897,341,985.07
合计	23,410,252,403.25	32,219,072.82		23,442,471,476.07

### (四十五) 未分配利润

项目	2024年1-6月	2023年度
年初未分配利润	42,335,647,242.12	46,699,136,993.48
加：本期归属于母公司股东的净利润	953,097,368.84	1,008,406,316.27
其他	-162,057,806.71	-268,327,131.64
减：提取法定盈余公积（注1）		732,107,351.95
提取一般风险准备（注1）	32,219,072.82	1,627,979,584.04
应付普通股股利（注2）	1,298,712,553.30	2,743,482,000.00
期末未分配利润	41,795,755,178.13	42,335,647,242.12

注1：本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本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：本公司2024年6月12日召开的2023年度股东大会审议批准了《2023年度利润分配预案》，向全体股东宣派2023年度现金股利每10股人民币1.00元（含税）。宣派总额为人民币12.98亿元（含税）。于2024年8月8日，该现金股利已发放。



## (四十六) 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	本期发生额	上期发生额
<b>证券经纪业务净收入</b>	1,550,175,374.32	1,811,543,716.95
——证券经纪业务收入	2,113,509,824.84	2,579,599,103.73
其中：代理买卖证券业务	1,754,001,600.42	2,039,877,831.87
交易单元席位租赁	277,333,445.46	402,104,235.78
代销金融产品业务	82,174,778.96	137,617,036.08
——证券经纪业务支出	563,334,450.52	768,055,386.78
其中：代理买卖证券业务	563,334,450.52	768,055,386.78
<b>期货经纪业务净收入</b>	140,503,096.37	160,381,803.79
——期货经纪业务收入	970,090,277.76	859,279,481.17
——期货经纪业务支出	829,587,181.39	698,897,677.38
<b>投资银行业务净收入</b>	854,277,846.30	1,949,290,370.16
——投资银行业务收入	867,262,517.40	1,974,909,744.28
其中：证券承销业务	740,559,776.61	1,798,502,295.26
证券保荐业务	10,444,339.62	29,298,113.20
财务顾问业务	116,258,401.17	147,109,335.82
——投资银行业务支出	12,984,671.10	25,619,374.12
其中：证券承销业务	2,301,068.24	13,873,486.68
财务顾问业务	10,683,602.86	11,745,887.44
<b>资产管理业务净收入</b>	280,671,327.26	181,176,892.17
——资产管理业务收入	280,671,327.26	181,176,892.17
<b>基金管理业务净收入</b>	560,534,611.17	751,288,816.12
——基金管理业务收入	590,803,247.79	778,463,577.31
——基金管理业务支出	30,268,636.62	27,174,761.19
<b>投资咨询业务净收入</b>	80,933,962.88	41,508,439.37
——投资咨询业务收入	81,110,067.20	41,508,439.37
——投资咨询业务支出	176,104.32	
<b>其他手续费及佣金净收入</b>	37,114,232.43	45,378,950.90
——其他手续费及佣金收入	38,309,052.88	47,125,349.99
——其他手续费及佣金支出	1,194,820.45	1,746,399.09
<b>合计</b>	<b>3,504,210,450.73</b>	<b>4,940,568,989.46</b>
——手续费及佣金收入合计	4,941,756,315.13	6,462,062,588.02
——手续费及佣金支出合计	1,437,545,864.40	1,521,493,598.56

## 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	5,377,358.49	8,088,679.25
并购重组财务顾问业务净收入 -- 其他	5,281,129.82	25,232,379.55
其他财务顾问业务净收入	94,916,310.00	102,042,389.58
合计	105,574,798.31	135,363,448.38

## (四十七) 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
<b>利息收入</b>		
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,872,960,286.56	1,977,916,990.08
融出资金利息收入	1,821,576,662.46	2,116,167,728.91
买入返售金融资产利息收入	719,699,813.05	931,069,356.00
其中：约定购回利息收入	806,124.33	6,996,004.73
股权质押回购利息收入	589,398,682.33	769,143,335.18
债权投资利息收入	130,569,566.57	115,835,004.14
其他债权投资利息收入	752,023,555.92	871,432,429.52
长期应收款利息收入	2,528,571,371.52	2,831,408,464.21
贷款和应收款利息收入	326,270,864.57	469,823,663.70
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	36,327,601.89	6,875,392.28
小计	8,187,999,722.54	9,320,529,028.84
<b>融资租赁收入</b>	765,501,167.53	781,924,708.86
<b>收入合计</b>	<b>8,953,500,890.07</b>	<b>10,102,453,737.70</b>
<b>利息支出</b>		
其中：借款利息支出	1,631,463,988.79	2,088,012,810.29
应付短期融资款利息支出	214,262,265.31	208,060,457.23
拆入资金利息支出	221,438,330.50	156,082,941.70
其中：转融通利息支出	138,850,944.48	63,508,333.37
卖出回购金融资产款利息支出	1,307,752,610.36	1,406,249,962.02
其中：报价回购利息支出	90,953,080.55	36,155,726.94
代理买卖证券款利息支出	237,161,276.13	305,090,416.53
应付债券利息支出	3,160,836,790.86	3,305,306,402.08
其中：次级债券利息支出	154,063,398.24	153,359,514.48
租赁负债利息支出	20,751,994.39	23,633,356.53
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	389,029,426.56	425,614,583.36
<b>支出合计</b>	<b>7,182,696,682.90</b>	<b>7,918,050,929.74</b>
<b>利息净收入</b>	<b>1,770,804,207.17</b>	<b>2,184,402,807.96</b>

## (四十八) 投资收益

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	-71,235,100.98	479,771,270.73
<b>金融工具投资收益</b>	<b>2,262,016,918.44</b>	<b>3,238,325,221.92</b>
其中：持有期间取得的收益	3,041,237,089.37	2,537,849,221.18
—交易性金融工具	2,707,883,663.31	2,470,564,031.87
—其他权益工具投资	333,353,426.06	67,285,189.31
处置金融工具取得的收益	-779,220,170.93	700,476,000.74
—交易性金融工具	-573,911,278.56	35,855,510.26
—其他债权投资	194,261,009.40	135,549,726.60
—衍生金融工具	-419,387,814.60	525,435,693.60
—其他	19,817,912.83	3,635,070.28
<b>合计</b>	<b>2,190,781,817.46</b>	<b>3,718,096,492.65</b>

## (四十九) 其他收益

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助 / 财政补贴	490,529,491.73	729,330,191.62
其他	55,634,936.00	63,412,535.06
<b>合计</b>	<b>546,164,427.73</b>	<b>792,742,726.68</b>

## (五十) 公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	-2,317,259,450.19	759,724,079.99
交易性金融负债	1,806,798,108.85	-1,373,761,997.58
其中：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	2,034,059,212.54	-1,224,135,951.28
衍生金融工具	39,483,804.11	662,554,685.85
<b>合计</b>	<b>-470,977,537.23</b>	<b>48,516,768.26</b>

## (五十一) 其他业务收入和其他业务成本

### 1、其他业务收入

项目	本期发生额	上期发生额
大宗商品销售收入	816,223,987.23	4,577,360,327.76
服务收入	127,554,655.17	383,248,601.73
出租收入	309,441,026.00	314,703,304.53
其他	135,740,306.96	213,993,601.59
<b>合计</b>	<b>1,388,959,975.36</b>	<b>5,489,305,835.61</b>

## 2、其他业务成本

项目	本期发生额	上期发生额
大宗商品销售成本	810,890,141.88	4,565,499,760.39
出租成本	182,058,612.71	141,313,348.35
其他	24,585,962.92	56,648,922.05
合计	1,017,534,717.51	4,763,462,030.79

## (五十二) 税金及附加

项目	本期发生额	上期发生额
房产税	45,236,907.65	35,745,754.13
城市维护建设税	26,360,881.15	35,966,432.87
教育费附加及地方教育费附加	19,004,373.92	26,407,265.64
印花税	3,342,532.29	7,270,320.68
其他	21,532,952.07	23,674,066.38
合计	115,477,647.08	129,063,839.70

## (五十三) 业务及管理费

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	3,038,108,842.90	3,651,013,289.68
固定资产折旧费	321,202,985.03	297,778,870.71
电子设备运转费	222,537,029.71	269,621,473.15
使用权资产折旧	199,605,647.85	198,451,445.41
无形资产摊销	133,506,248.20	121,489,570.48
差旅费	120,075,805.31	133,346,880.55
咨询费	117,505,246.13	147,046,819.95
邮电通讯费	107,355,246.40	103,159,105.49
聘请中介机构费	105,750,824.98	108,416,110.12
销售服务费	81,771,836.36	74,757,924.64
其他	511,838,325.50	590,777,338.79
合计	4,959,258,038.37	5,695,858,828.97

## (五十四) 信用减值损失

类别	本期发生额	上期发生额
货币资金	2,636,255.23	-1,152,281.67
融出资金	109,943,998.25	287,492,253.01
应收款项	91,022,377.75	33,729,680.98
其他应收款	-23,242,848.13	12,603,240.83
买入返售金融资产	56,474,631.48	54,392,254.36
发放贷款和垫款	-3,606,075.19	-362,159.85
应收融资租赁款	226,705,876.57	145,668,145.85
长期应收款	277,186,364.63	459,552,320.16
其他贷款和应收款项	93,103,150.47	235,335,618.09
其他债权投资	16,506,000.37	-40,469,462.12
债权投资	-7,335,137.09	7,282,850.15
其他金融资产	30,731,771.34	9,751,981.45
合计	870,126,365.68	1,203,824,441.24

## (五十五) 其他资产减值损失

类别	本期发生额	上期发生额
投资性房地产减值损失	3,741,741.79	1,757,605.04
其他资产减值损失	11,905,881.40	8,120,235.90
合计	15,647,623.19	9,877,840.94

## (五十六) 营业外收入

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
非流动资产处置利得	559,431.46	559,116.54	559,431.46
其他	36,065,497.66	98,728,642.55	36,065,497.66
合计	36,624,929.12	99,287,759.09	36,624,929.12

## (五十七) 营业外支出

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
非流动资产处置损失	2,214,848.46	8,389,446.73	2,214,848.46
捐赠支出	2,432,579.51	408,520.68	2,432,579.51
其他	12,814,868.38	5,045,335.27	12,814,868.38
合计	17,462,296.35	13,843,302.68	17,462,296.35

## (五十八) 所得税费用

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	369,622,329.05	1,101,737,432.30
递延所得税费用	306,729,684.34	225,255,213.42
合计	676,352,013.39	1,326,992,645.72

## (五十九) 现金流量表项目

### 1、收到的其他与经营活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
融资租赁收到的款项净额	11,420,927,930.09	2,065,948,223.29
其他业务收入	1,388,959,975.36	5,489,305,835.61
存出保证金减少	2,781,315,922.60	1,197,090,030.29
营业外收入及其他收益	569,595,466.69	891,471,369.23
其他贷款和应收款净减少额		296,260,666.23
吸收存款的增加	1,433,233,799.95	143,887,562.32
其他	518,983,576.74	1,534,144,223.66
合计	18,113,016,671.43	11,618,107,910.63

### 2、支付的其他与经营活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
应收客户清算款净增加	1,727,106,310.43	
日常经营费用等	1,207,307,241.05	1,363,272,135.82
其他业务成本	864,556,336.69	4,622,148,682.44
发放的客户贷款及垫款净增加额		1,041,151,572.50
央行存放款项的净减少额	565,838.84	1,543,939,447.35
其他	1,721,301,546.52	2,828,289,703.75
合计	5,520,837,273.53	11,398,801,541.86

### 3、支付的其他与筹资活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
少数股东收回投资款	2,932,662,566.06	
偿还租赁负债款	220,108,789.60	183,106,373.12
回购股份支付款项	303,072,674.49	
发行债券支付的承销费用等	79,916,061.26	90,033,064.95
合计	3,535,760,091.41	273,139,438.07

## (六十) 现金流量表补充资料

### 1、现金流量表补充资料

补充资料	本期发生额	上期发生额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	1,229,524,063.23	3,924,731,802.09
加：信用减值损失	870,126,365.68	1,203,824,441.24
其他资产减值损失	15,647,623.19	9,877,840.94
固定资产折旧及投资性房地产折旧	474,181,365.85	439,092,219.06
使用权资产折旧	199,605,647.85	198,451,445.41
无形资产摊销	133,506,248.20	121,489,570.48
长期待摊费用摊销	57,562,114.90	58,555,366.19
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	877,698.65	7,677,343.56
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	470,977,537.23	-48,516,768.26
利息支出	4,144,721,916.86	4,637,745,592.47
汇兑损失	65,963,223.89	205,419,634.21
投资损失（收益以“-”号填列）	-476,197,247.31	-751,887,179.63
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	650,098,256.31	105,838,497.42
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	-288,539,478.05	107,141,984.08
交易性金融资产等的减少（增加以“-”号填列）	1,320,437,695.72	564,367,158.65
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	22,015,328,950.27	-8,693,849,399.37
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-11,601,670,641.00	-12,832,152,340.38
经营活动产生的现金流量净额	19,282,151,341.47	-10,742,192,791.84
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		
承担租赁负债方式取得使用权资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	160,138,036,038.94	183,053,449,638.80
减：现金的期初余额	154,862,040,644.88	176,699,519,071.53
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	5,275,995,394.06	6,353,930,567.27

### 2、现金及现金等价物的构成

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
一、现金	160,138,036,038.94	154,862,040,644.88
其中：库存现金	42,294.16	59,782.58
可随时用于支付的银行存款	138,859,331,892.58	135,001,728,964.49
可随时用于支付的其他货币资金	6,479,403.87	39,244,228.33
可随时用于存放中央银行款项	5,371,184,592.44	4,236,629,949.51
可随时用于支付的结算备付金	15,900,997,855.89	15,584,377,719.97
二、现金等价物		
三、期末现金及现金等价物余额	160,138,036,038.94	154,862,040,644.88

## (六十一) 政府补助

### 1、报告期末按应收金额确认的政府补助

本集团报告期末按应收金额确认的政府补助为人民币 618,610,000.00 元。

### 2、计入当期损益的政府补助

类型	本期发生额	上期发生额
与收益相关的政府补助	490,669,491.73	798,374,572.90
合计	490,669,491.73	798,374,572.90

## (六十二) 金融资产转移

### 1、资产支持证券

本集团发行了以应收融资租赁款和长期应收款为基础资产的资产支持证券。由于本集团持有全部的次级资产并对该资产支持证券提供差额支付承诺，该等资产支持证券的基础资产不符合金融资产终止确认条件，本集团未终止确认已转移的应收融资租赁款和长期应收款，并将收到的对价确认为金融负债。

截至 2024 年 6 月 30 日，本集团未予终止确认的已转移应收融资租赁款和长期应收款的账面价值为人民币 112.23 亿元（2023 年 12 月 31 日：人民币 136.42 亿元）。

### 2、资产支持票据

本集团发行了以应收融资租赁款和长期应收款为基础资产的资产支持票据。由于本集团持有全部的次级资产并对该资产支持票据提供差额支付承诺，该等资产支持票据的基础资产不符合金融资产终止确认条件，本集团未终止确认已转移的应收融资租赁款和长期应收款，并将收到的对价确认为金融负债。

截至 2024 年 6 月 30 日，本集团无未予终止确认的已转移应收融资租赁款和长期应收款（2023 年 12 月 31 日：人民币 18.62 亿元）。

### 3、融出证券

本集团与客户订立协议，融出股票及基金予客户，以客户的证券或押金为抵押，由于本集团仍保留有关证券的全部风险，因此并未于资产负债表终止确认该等证券。于 2024 年 6 月 30 日，上述转让资产的账面价值为人民币 20.77 亿元（2023 年 12 月 31 日：人民币 21.97 亿元）。

## 六、合并范围的变更

### (一) 非同一控制下企业合并

公司本期无通过非同一控制下企业合并取得的子公司。



## (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。

## 七、在其他主体中的权益

### (一) 在子公司中的权益

#### 1、企业集团的重要子公司

本集团综合考虑子公司是否为上市公司、子公司净资产占本集团合并净资产的比例、子公司净利润占本集团合并净利润的比例等因素，确定重要的子公司，列示如下：

子公司名称	注册资本	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
					直接	间接	
海富通基金管理有限公司	人民币 30,000 万元	上海	上海	基金管理	51.00		设立或投资等方式
上海富诚海富通资产管理有限公司	人民币 20,000 万元	上海	上海	资产管理		51.00	设立或投资等方式
海通开元投资有限公司	人民币 550,000 万元	上海	上海	私募股权投资管理	100.00		设立或投资等方式
海富产业投资基金管理有限公司	人民币 10,000 万元	上海	上海	基金管理		67.00	设立或投资等方式
海通吉禾私募股权投资基金管理有限责任公司	人民币 5,000 万元	上海	上海	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
海通创新私募基金管理有限公司	人民币 5,000 万元	上海	上海	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
海通创意私募基金管理有限公司	人民币 12,000 万元	上海	上海	股权投资管理		53.25	设立或投资等方式
海通新能源私募股权投资管理有限公司	人民币 5,000 万元	上海	上海	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
海通并购（上海）私募基金管理有限公司	人民币 10,000 万元	上海	上海	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
上海海通旭禹股权投资有限公司	人民币 35,000 万元	上海	上海	股权投资		100.00	设立或投资等方式
上海海通创世投资管理有限公司	人民币 100 万元	上海	上海	股权投资管理		53.25	设立或投资等方式
海通创新证券投资有限公司	人民币 1,150,000 万元	上海	上海	金融产品投资、股权投资、证券投资	100.00		设立或投资等方式
上海海通证券资产管理有限公司	人民币 220,000 万元	上海	上海	证券资产管理	100.00		设立或投资等方式
上海惟泰置业管理有限公司	人民币 1,000 万元	上海	上海	物业管理、房地产开发经营、餐饮企业管理	100.00		收购
海通国际控股有限公司	港币 1,117,973 万元	香港	香港	投资控股	100.00		设立或投资等方式
Haitong Investment Ireland PLC	欧元 825,000 元	爱尔兰	爱尔兰	非银行金融公司	100.00		非同一控制下企业合并
海通期货股份有限公司	人民币 130,150 万元	上海	上海	期货代理	83.22		非同一控制下企业合并
上海海通资源管理有限公司	人民币 100,000 万元	上海	上海	资源管理		83.22	非同一控制下企业合并
海通国际证券集团有限公司	港币 84,382 万元	香港	百慕达	投资控股	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际投资经理有限公司	港币 4,700 万元	香港	香港	资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际资产管理有限公司	港币 1,300 万元	香港	香港	资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际资产管理（香港）有限公司	港币 2,000 万元	香港	香港	资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际证券有限公司	港币 1,150,000 万元	香港	香港	经纪业务	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际证券代理人有限公司	港币 2 元	香港	香港	经纪业务	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际期货有限公司	港币 40,000 万元	香港	香港	经纪业务	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际金融产品有限公司	港币 5,000 万元	香港	香港	FICC 及衍生品	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际金融服务有限公司	港币 100 万元	香港	香港	FICC 及衍生品	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际融资（香港）有限公司	港币 1,000 万元	香港	香港	企业融资	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际资本有限公司	港币 2,000 万元	香港	香港	企业融资	100.00		非同一控制下企业合并
海通国际研究有限公司	港币 100 万元	香港	香港	研究服务	100.00		非同一控制下企业合并
Haitong International (Japan) K.K.	日元 1,000 万元	日本	日本	研究服务	100.00		非同一控制下企业合并
Haitong International (UK) Limited	英镑 8,334,563 元	英国	英国	研究服务	100.00		非同一控制下企业合并

子公司名称	注册资本	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
					直接	间接	
Haitong International Securities (USA) Inc.	美元 12,654,319 元	美国	美国	研究服务		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities Group (Singapore) Pte Ltd.	新加坡元 730,550,721 元	新加坡	新加坡	投资控股		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Securities India Private Limited	印度卢比 260,732,520 元	印度	印度	证券业务		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (Australia) Pty Ltd.	澳元 1,380,435 元	澳大利亚	澳大利亚	经纪业务		100.00	非同一控制下企业合并
演天资讯科技（深圳）有限公司	港币 1,000 万元	中国	中国	提供软件开发服务		100.00	非同一控制下企业合并
海通恒信金融集团有限公司	港币 414,616 万元	香港	香港	投资控股	100.00		非同一控制下企业合并
海通恒信国际融资租赁股份有限公司（注）	人民币 823,530 万元	上海	上海	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信国际融资租赁（天津）有限公司	人民币 21,000 万元	天津	天津	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
上海泛圆投资发展有限公司	人民币 10,000 万元	上海	上海	物业管理、单位后勤管理服务、餐饮管理		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒运融资租赁（上海）有限公司	人民币 136,000 万元	上海	上海	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信租赁（香港）有限公司	美元 25,315 万元	香港	香港	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信小微融资租赁（上海）有限公司	人民币 150,000 万元	上海	上海	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
Haitong Bank, SA.	欧元 87,127 万元	葡萄牙	葡萄牙	银行		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Global Asset Management, SGOIC, S.A.	欧元 2,500 万元	葡萄牙	葡萄牙	资产管理		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	雷亚尔 42,000 万元	巴西	巴西	投资银行		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Negócios, SA	雷亚尔 11,138 万元	巴西	巴西	投资控股		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Securities do Brasil Corretora de Câmbio e Valores Mobiliários S.A.	雷亚尔 10,000 万元	巴西	巴西	证券经纪		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong do Brasil Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.	雷亚尔 5,190 万元	巴西	巴西	资产管理		80.00	非同一控制下企业合并

注：海通恒信国际融资租赁股份有限公司为香港上市公司，股票代码（01905.HK）。

## 2、重要的非全资子公司

本集团综合考虑子公司是否为上市公司、其少数股东权益占本集团合并股东权益的比例、少数股东损益占本集团合并净利润的比例等因素，确定重要的非全资子公司，列示如下：

单位：人民币百万元

子公司名称	少数股东持股比例 (%)	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	2024年6月30日少数股东权益余额
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	15.00	178.15	51.88	5,588.64

## 3、重要非全资子公司的主要财务信息

单位：人民币百万元

项目	海通恒信国际融资租赁股份有限公司	
	2024年6月30日	2023年12月31日
流动资产	55,515.55	59,694.21
非流动资产	57,566.30	63,656.92
资产合计	113,081.85	123,351.13
流动负债	47,881.21	53,865.00
非流动负债	45,007.86	49,240.81
负债合计	92,889.07	103,105.81

单位：人民币百万元

项目	海通恒信国际融资租赁股份有限公司	
	本期发生额	上期发生额
营业收入	2,395.14	2,684.25
净利润	812.17	807.63
综合收益总额	831.47	906.53
经营活动现金流量	10,525.28	291.96

## (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

交易对于少数股东权益及归属于母公司股东权益的影响

于2023年9月26日，公司董事会通过了《关于海通国际控股有限公司对海通国际证券集团有限公司进行私有化的议案》。2024年1月11日，海通国际证券集团有限公司正式退市。

单位：人民币百万元

海通国际证券集团有限公司	
购买成本	
— 现金	2,932.66
购买成本合计	2,932.66
减：按取得的股权比例计算的子公司净资产份额	3,048.32
差额	-115.66
其中：调整资本公积	115.66
调整盈余公积	
调整未分配利润	

## (三) 在联营企业中的权益

### 1、重要的联营企业

本集团综合考虑联营企业是否为上市公司、其账面价值占本集团合并总资产的比例、权益法核算的长期股权投资收益占本集团合并净利润的比例等因素，确定重要的联营企业，列示如下：

联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		对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

单位：人民币百万元

富国基金管理有限公司	2024年6月30日 / 本期发生额	2023年12月31日 / 上期发生额
资产合计	13,369.00	13,770.42
负债合计	5,161.07	5,246.42
归属于母公司股东权益	8,207.93	8,524.00
营业收入	2,918.32	3,648.08
净利润	773.52	1,065.40
其他综合收益	2.41	10.75
综合收益总额	775.93	1,076.15
本年度收到的来自联营企业的股利	303.30	288.86

## 3、不重要的联营企业的汇总财务信息

单位：人民币百万元

	2024年6月30日 / 本期发生额	2023年12月31日 / 上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	5,280.80	5,748.06
下列各项按持股比例计算的合计数		
—净利润	-286.08	183.86
—其他综合收益		
—综合收益总额	-286.08	183.86

## (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

本集团合并了部分结构化主体,这些主体主要包括资产管理计划等。对于本集团持有的结构化主体,本集团评估其所持份额连同管理人报酬和信用增级及其他利益使其面临的可变回报的风险敞口是否足够重大,从而表明本集团为主要责任人。如果本集团担任主要责任人的角色,则需将这些结构化主体纳入合并范围。

本集团持有的上述纳入合并财务报表范围的结构化主体对本集团于2024年6月30日及2023年12月31日的财务状况及2024上半年及2023年度的经营成果和现金流量影响并不重大,因此,本集团未对这些被合并结构化主体的财务信息进行单独披露。

于2024年6月30日,本集团纳入合并资产负债表的结构化主体的资产总额为人民币508.48亿元(2023年12月31日:人民币579.60亿元),于所有合并结构化主体之直接权益的公允价值为人民币449.31亿元(2023年12月31日:人民币504.51亿元)。

## 2、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

对于本集团持有的结构化主体，除上述已经合并的结构化主体以外，本集团认为，本集团所面临的可变回报并不重大。因此，本集团没有合并这些结构化主体。

于2024年6月30日，由本集团担任投资管理人且持有权益之未合并结构化主体（不包含分类为联营企业的主体）的账面价值为人民币85.71亿元（2023年12月31日：人民币54.44亿元），本集团所面临风险敞口与账面价值相若。2024年上半年，本集团作为投资管理人，于未纳入合并范围的结构化主体获取的管理费收入为人民币8.45亿元（2023年上半年：人民币8.00亿元）。

除上述披露的本集团管理的未纳入合并范围的结构化主体中的权益之外，本集团还在其不作为投资管理人的未纳入合并范围的结构化主体中享有权益。与本集团在结构化产品和信托产品有关的最大风险敞口接近于各自的账面价值。

## 八、公允价值的披露

本集团部分金融资产和金融负债是以公允价值计量的。本集团董事建立了相关过程来确定公允价值计量中合适的估值技术和输入值。本集团董事定期复核相关过程以及公允价值确定的合适性。

确定金融资产及金融负债公允价值的方式如下：

- 附标准条款和条件且在活跃流动市场交易的金融资产的公允价值分别参照所报市场竞价确定；
- 衍生工具的公允价值以报价计算。如无报价，非期权衍生工具以工具年期的适用收益曲线进行贴现现金使用分析，期权衍生工具则以期权定价模式进行贴现现金使用分析；
- 其他金融资产及金融负债（不包括上述那些）的公允价值根据普遍采纳的定价模式如贴现现金使用分析、市场可比法等。

当无法从公开市场获取报价时，本集团通过估值技术来确定金融工具的公允价值。

本集团在金融工具估值技术中使用的主要参数包括债券价格、利率、汇率、权益及股票价格、波动水平、相关性、提前还款率及交易对手信用差价等，均为可观察到的且可从公开市场获取的参数。

根据有关确定金融资产公允价值的会计政策，本集团对公允价值计量的输入值划分为三个层次。

对于本集团持有的第三层次的金融工具，管理层已评估了宏观经济变动，外部评估师估值及损失覆盖率等参数的影响。若根据合理可能替代假设改变一个或多个不可观察参数，将不会对这些金融工具的公允价值评估产生重大影响。本集团已建立相关内部控制程序监控集团对此类金融工具的敞口。

## (一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

项目	2024年6月30日			
	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
(一) 交易性金融资产	12,321,827,391.44	159,642,576,222.20	39,433,881,663.82	211,398,285,277.46
(1) 债券	461,237,991.40	99,831,886,555.05	13,499,595,835.52	113,792,720,381.97
(2) 公募基金	2,847,688,476.87	49,504,102,981.93	48,732,515.24	52,400,523,974.04
(3) 股票 / 股权	9,012,900,923.17	177,572,624.82	14,658,115,863.61	23,848,589,411.60
(4) 银行理财产品		5,781,242,832.89		5,781,242,832.89
(5) 券商资管产品		888,809,289.36		888,809,289.36
(6) 信托计划		15,950,500.00	1,758,287,090.27	1,774,237,590.27
(7) 其他		3,443,011,438.15	9,469,150,359.18	12,912,161,797.33
(二) 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	10,950,180,232.83	55,278,515,458.93	1,400,977,638.43	67,629,673,330.19
(1) 其他债权投资	1,377,949,220.70	55,278,515,458.93	556,782,793.40	57,213,247,473.03
(2) 其他权益工具投资	9,572,231,012.13		844,194,845.03	10,416,425,857.16
(三) 衍生金融资产	180,726,780.00	615,795,898.32	1,283,319,135.31	2,079,841,813.63
(四) 交易性金融负债	993,182,187.59	5,976,688,683.89	5,277,429,984.82	12,247,300,856.30
(1) 为交易目的而持有的金融负债	945,626,147.40	1,221,606,768.02		2,167,232,915.42
(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	47,556,040.19	4,755,081,915.87	5,277,429,984.82	10,080,067,940.88
(五) 衍生金融负债	16,705,787.00	735,731,294.58	478,229,970.56	1,230,667,052.14

## (二) 以公允价值计量的资产和负债的上年末公允价值

项目	2023年12月31日			
	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
(一) 交易性金融资产	30,843,605,533.39	147,653,828,541.02	42,775,655,917.81	221,273,089,992.22
(1) 债券	614,516,469.19	110,063,862,256.56	13,516,110,768.78	124,194,489,494.53
(2) 公募基金	12,252,817,596.68	28,356,378,487.46	30,657,466.81	40,639,853,550.95
(3) 股票 / 股权	17,976,266,680.02	506,311,180.92	17,235,840,159.77	35,718,418,020.71
(4) 银行理财产品		3,777,443,533.72		3,777,443,533.72
(5) 券商资管产品		251,148,523.57		251,148,523.57
(6) 信托计划		22,935,406.43	1,812,619,344.92	1,835,554,751.35
(7) 其他	4,787.50	4,675,749,152.36	10,180,428,177.53	14,856,182,117.39
(二) 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	8,044,219,491.36	59,865,735,846.98	1,411,635,395.24	69,321,590,733.58
(1) 其他债权投资	936,773,140.11	59,865,735,846.98	508,237,576.71	61,310,746,563.80
(2) 其他权益工具投资	7,107,446,351.25		903,397,818.53	8,010,844,169.78
(三) 衍生金融资产	141,098,584.95	381,115,290.38	1,756,341,478.08	2,278,555,353.41
(四) 交易性金融负债	1,658,365,180.27	8,292,910,720.55	10,502,129,048.52	20,453,404,949.34
(1) 为交易目的而持有的金融负债	1,630,647,103.28	538,685,807.19		2,169,332,910.47
(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	27,718,076.99	7,754,224,913.36	10,502,129,048.52	18,284,072,038.87
(五) 衍生金融负债	2,899,360.00	514,795,948.10	673,249,785.82	1,190,945,093.92

本期和上年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

合并财务报表持续第二层次公允价值计量项目估值通常基于底层投资（投资组合中的债务证券或公开交易的权益工具）的公允价值计算得出，或由第三方（如中央结算公司）基于现金流贴现模型提供估值。所有重大输入值均为市场中直接或间接可观察的输入值。

### (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

合并财务报表持续第三层次公允价值计量项目估值采用管理层自对手方处获取估值报价，或使用估值技术确定其公允价值，包括现金流贴现分析、净资产价值、市场可比法和期权定价模型等。这些金融工具的公允价值可能基于对估值有重大影响的不可观测输入值，因此公司将其分为第三层次。不可观测输入值包括流动性折扣、风险调整折扣、经调整的波动率和市场乘数等。合并财务报表持续第三层次公允价值计量项目对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

### (六) 持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息

#### 1、本期期初与期末账面价值间的调节信息

项目	2024年1月1日	转入第三层次	转出第三层次	当期利得或损失总额		增加	减少	2024年6月30日
				计入损益	计入其他综合收益			
交易性金融资产	42,775,655,917.81	674,120,593.97	1,462,535,539.40	-2,166,760,475.68		340,748,560.36	727,347,393.24	39,433,881,663.82
其他债权投资	508,237,576.71	9,104,026.50		-4,700,304.96	7,086,826.58	156,496,838.76	119,442,170.19	556,782,793.40
其他权益工具投资	903,397,818.53				-59,202,973.50			844,194,845.03
衍生金融工具	1,083,091,692.26	135,730,015.25	1,268,569.94	723,316,689.99			1,135,780,662.81	805,089,164.75
交易性金融负债	-10,502,129,048.52			2,435,231,842.08		-32,710,909.50	-2,822,178,131.12	-5,277,429,984.82

#### 2、上年期初与期末账面价值间的调节信息

项目	2023年1月1日	转入第三层次	转出第三层次	当期利得或损失总额		增加	减少	2023年12月31日
				计入损益	计入其他综合收益			
交易性金融资产	46,172,573,146.31	2,948,735,479.67	2,892,259,063.26	-5,259,853,109.38		11,890,177,239.28	10,083,717,774.81	42,775,655,917.81
其他债权投资	842,891,803.12	4,345,288.52	137,105,668.01	91,418,760.88	814,344.14	238,810,920.76	532,937,872.70	508,237,576.71
其他权益工具投资	994,826,875.36	561,640.00			-93,390,696.83	1,400,000.00		903,397,818.53
衍生金融工具	422,853,485.41	14,943,821.73		60,176,096.75		-8,560,834.22	-593,679,122.59	1,083,091,692.26
交易性金融负债	-18,864,214,449.39			-299,734,926.59		-4,878,721,772.74	-13,540,542,100.20	-10,502,129,048.52

注：截至 2024 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团将部分股权投资从第三层次转移至第一层次，其主要原因为该部分投资已解除上市流通的限制，且其公允价值基于未经流动性折扣调整的活跃市场报价进行确定。此外，本集团亦将部分金融工具转入第三层次，原因为该部分金融工具的估值技术方法转变为基于重大不可观察输入值的估值技术方法。本集团按公允价值计量的金融工具截至 2024 年 6 月 30 日止 6 个月期间未发生其他于第一、第二及第三层次间的重大转移（2023 年：同）。

## (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

项目	2024 年 6 月 30 日		2023 年 12 月 31 日	
	账面价值	公允价值	账面价值	公允价值
<b>金融资产</b>				
债权投资	4,712,994,209.36	4,644,757,035.39	6,797,779,540.34	6,712,822,521.83
<b>金融负债</b>				
应付债券 - 非可转换债券	189,450,771,465.64	191,357,424,766.78	193,920,279,749.62	194,829,867,063.11

除此以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值和账面金额差异不重大。

## 九、关联方及关联交易

### (一) 持有公司 5% 以上股份的股东情况

股东名称	关联关系	注册地	业务性质	注册资本 (亿元)	股东对本公司的 持股比例 (%)	股东对本公司的 表决权比例 (%)
上海国盛（集团）有限公司	第一大股东	上海市	商务服务	200.66	8.56	8.56

### (二) 本公司的子公司情况

本公司子公司的情况详见本附注“七、（一）在子公司中的权益”。

### (三) 本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本附注“五、（十四）长期股权投资”。

### (四) 其他关联方情况

其他关联方名称	其他关联方与本公司的关系
上海电气控股集团有限公司	重大影响
光明食品（集团）有限公司	重大影响



## (五) 关联交易情况

- 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
央视融媒体产业投资基金（有限合伙）	管理费收入等	34,396,549.50	40,305,052.99
富国基金管理有限公司	佣金收入等	27,809,154.09	71,698,846.37
辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	12,735,849.06	12,735,849.06
合肥海通中小基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	9,561,320.75	5,867,924.53
上海海通焕新私募投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	8,584,905.66	8,415,611.26
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	8,490,566.04	8,525,828.38
上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	7,915,868.11	7,500,000.94
西安军融电子卫星基金投资有限公司	管理费收入等	5,491,698.11	3,773,584.90
辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	管理费收入等	4,999,999.98	21,985.93
上海电气控股集团有限公司	佣金收入等	4,521,988.68	22,500.00
安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	3,518,403.96	2,422,667.36
上海浦东引领区海通私募投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	3,118,878.24	
吉林海创长新投资中心（有限合伙）	管理费收入等	2,474,835.00	1,403,463.42
湖北省海通高质量转型升级并购投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	1,969,529.41	
海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）	管理费收入等	1,665,809.98	
许昌海通创新股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	1,509,433.96	1,509,433.92
广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）	管理费收入等	1,230,850.78	1,960,143.61
西安航天新能源产业基金投资有限公司	管理费收入等	943,396.23	2,455.75
金华市海通重点产业发展招商并购投资合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	752,654.90	823,902.82
上海国盛（集团）有限公司	管理费收入等	711,991.03	1,137,577.01
南昌政通股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	703,437.58	
吉林海通创新卫星投资中心（有限合伙）	管理费收入等	636,792.45	701,731.72
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	59,431.25	1,924,528.30
光明食品（集团）有限公司	佣金收入等		1,415,094.34
其他	管理费收入等	6,765.39	323,145.55

### 4、向关联方收取的利息净收入

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	利息收入	2,021,077.59	183,413.63
上海国盛（集团）有限公司	利息收入	954,082.69	344,882.65
辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	利息收入	637,562.47	57,217.02
上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	利息收入	144,767.56	0.89
西安航天新能源产业基金投资有限公司	利息收入	96,764.65	88,987.64
嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业（有限合伙）	利息收入	70,610.29	165,988.24
光明食品（集团）有限公司	利息收入	69,329.66	141,471.99
上海电气控股集团有限公司	利息收入	7,425.11	98,415.96
其他	利息收入	112,191.96	90,507.13

## 5、向关联方收取的投资收益

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛（集团）有限公司	投资收益	548,388.02	-1,188,918.94

## 6、其他关联方交易

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛（集团）有限公司	公允价值变动收益	-66,272.70	-1,470,447.62

## 7、关键管理人员薪酬

项目	本期发生额（万元）	上期发生额（万元）
关键管理人员薪酬	873.85	1,290.75

## (六) 关联方应收应付款项

### 1、应收项目

项目名称	关联方名称	2024年6月30日	2023年12月31日
应收款项	西安航天新能源产业基金投资有限公司	38,573,789.39	38,573,789.39
应收款项	辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	26,088,927.64	31,388,927.66
应收款项	辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业（有限合伙）	13,560,000.00	60,000.00
应收款项	合肥海通中小基金合伙企业（有限合伙）	10,455,841.26	20,270,000.00
应收款项	上海海通焕新私募投资基金合伙企业（有限合伙）	9,100,000.02	
应收款项	上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	4,625,149.81	
应收款项	安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业（有限合伙）	3,729,508.20	
应收款项	上海浦东引领区海通私募投资基金合伙企业（有限合伙）	3,306,010.93	
应收款项	湖北省海通高质量转型升级并购投资基金合伙企业（有限合伙）	2,087,701.17	
应收款项	金华市海通重点产业发展招商并购投资合伙企业（有限合伙）	797,814.19	
应收款项	上海国盛（集团）有限公司	75,080.08	494,893.26
应收款项	辽宁中德产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	60,000.12	60,000.00
应收款项	嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业（有限合伙）		934,215.74
应收款项	许昌海通创新股权投资基金合伙企业（有限合伙）		100,000.00

## 2、应付项目

项目名称	关联方名称	2024年6月30日	2023年12月31日
代理买卖证券款	广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）	10,136,285.17	11,461.66
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）	8,193,634.80	35,993,438.41
代理买卖证券款	西安航天新能源产业基金投资有限公司	3,168,738.58	36,115,070.09
代理买卖证券款	上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	2,509,513.88	196,287.17
代理买卖证券款	上海国盛（集团）有限公司	1,814,555.28	200.76
代理买卖证券款	西安军融电子卫星基金投资有限公司	728,360.12	0.12
代理买卖证券款	上海电气控股集团有限公司	651,773.83	293,842.04
代理买卖证券款	辽宁中德产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	303,549.40	339,075,274.20
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）	267,727.38	267,455.40
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	203,286.29	797,146.12
代理买卖证券款	光明食品（集团）有限公司	14,235.35	39,949,114.98
代理买卖证券款	嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业（有限合伙）	2,530.52	43,756,245.61
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）		149,995,386.83
代理买卖证券款	辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司		106,940,851.69
代理买卖证券款	其他	6,372.33	6,086.07
应付账款	上海国盛（集团）有限公司	51,033,063.91	51,614,355.21

## 3、其他关联方款项

项目名称	关联方名称	2024年6月30日	2023年12月31日
衍生金融资产	上海国盛（集团）有限公司	1,524,810.96	1,591,083.66

# 十、承诺及或有事项

## （一）重大承诺事项

### 1、银行借款抵押情况

截至2024年6月30日，本公司下属子公司海通国际的银行质押借款余额合计港币0.64亿元（折合人民币0.59亿元）（2023年12月31日：无），该款项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，截至2024年6月30日，该质押品期末市值为港币13.44亿元（折合人民币12.27亿元）。

截至2024年6月30日，本集团约有人民币26.67亿元的银行贷款以本公司下属子公司海通国际证券集团有限公司的70%股权作为质押。截至2023年12月31日，约有人民币17.78亿元的银行贷款以本公司下属子公司海通银行的股权作为质押。

截至2024年6月30日，本集团约有人民币49.00亿元借款（2023年12月31日：人民币60.38亿元），以应收融资租赁款项、长期应收款、下属子公司股权作为质押，及房屋、飞机租赁固定资产作为抵押。截至2024年6月30日，质押的应收融资租赁款项账面价值为人民币3.08亿元（2023年12月31日：人民币6.19亿元），质押的长期应收款账面价值为人民币8.13亿元（2023年12月31日：人民币14.21亿元），抵押的房屋及飞机租赁固定资产账面价值为人民币62.07亿元（2023年12月31日：人民币63.03亿元）。

## 2、有关本公司为境外全资附属公司提供融资担保

2019年，经本公司第六届董事会第三十七次会议审议通过，同意本公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过6.7亿美元债务融资本金（含6.7亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过10年（含10年）。公司于2020年3月12日签署《担保协议》，为本公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited发行金额为6.7亿美元、于2025年到期、票面利率为2.107%的美元债券，提供连带责任保证担保。

2020年，经本公司第七届董事会第十一次会议审议通过，同意本公司为在境外的全资附属公司海通银行或其附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过3.75亿欧元债务融资本金（含3.75亿欧元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过6年（含6年）。本公司于2021年5月17日作为担保人签署《贷款协议》，为境外全资附属公司海通银行3.75亿欧元（含3.75亿欧元或等值其他货币）银团贷款提供连带责任保证担保。截至2024年6月30日，公司的该项担保责任余额为2.25亿欧元。

2021年，经本公司第七届董事会第十五次会议审议通过，同意本公司为在境外的全资子公司海通银行Haitong Bank,S.A.或其附属公司境外债券融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过7.5亿欧元债券本金（含7.5亿欧元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过9年（含9年）。本公司于2022年2月8日签署《担保函》，为本公司境外全资附属公司海通银行发行金额为2.3亿欧元、于2025年到期的欧元债券提供连带责任保证担保。本公司于2022年5月31日签署《担保协议》，为境外全资附属公司海通银行发行金额为1.5亿美元、于2027年到期的债券提供连带责任保证担保，担保期限66个月。

2022年，经本公司第七届董事会第三十三次会议审议通过，同意本公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过10亿美元债务融资本金（含10亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过7年（含7年）。本公司于2023年4月20日签署《担保协议》，为本公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为40亿元人民币、于2026年到期的债券提供连带责任保证担保。本公司于2023年5月18日签署《担保协议》，为本公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为28亿元人民币、于2026年到期的债券提供连带责任保证担保。

2023年，经本公司第七届董事会第四十一次会议审议通过，同意本公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保，担保金额不超过5亿美元债务融资本金（含5亿美元或等值其他币种）、利息、借款人应当承担的其他费用等，担保期限不超过7年（含7年）。本公司于2024年3月1日签署《担保契据》，为本公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为35亿元人民币、于2027年到期的债券提供连带责任保证担保。

### 3、有关本公司为海通资管提供和追加 / 减少净资产担保承诺

2012年，经本公司第五届董事会第十二次会议审议通过，同意本公司对海通资管公司提供不超过十五亿元的净资产担保承诺。2013年6月，根据上海证监局下发的《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产担保承诺书的无异议函》（沪证监机构字[2013]145号），本公司向海通资管公司提供8亿元的担保承诺。

2016年，经本公司第六届董事会第十八次会议审议通过，同意本公司对海通资管公司追加不超过人民币40亿元的净资产担保承诺。就本次净资产担保事宜，海通资管公司已获得中国证监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产担保承诺书的无异议函》（沪证监机构字[2016]325号）。

2021年12月，本公司对海通资管公司减少提供净资产担保承诺金额18亿元。就本次净资产担保减少事宜，海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《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减少提供部分净资产担保承诺事项的无异议函》（沪证监机构字[2021]532号）。

2024年4月，本公司对海通资管公司减少提供净资产担保承诺金额20亿元。就本次净资产担保减少事宜，海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《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减少提供部分净资产担保承诺事项的无异议函》（沪证监机构字[2024]106号）。

截至2024年6月30日，本公司对海通资管公司提供净资产担保承诺金额为人民币10亿元。

### 4、有关本公司对海通开元减少投资及提供担保承诺

本公司全资子公司海通开元将注册资本从人民币75亿元减至人民币55亿元，减资人民币20亿元。本公司为海通开元减资过程中未清偿债14,542.24万元提供一般保证担保。上述担保事项已经本公司于2024年4月26日召开的第八届董事会第五次会议审议通过。截至2024年6月30日，该公司的该项担保责任余额为13,980.51万元。

### 5、有关本公司子公司海通恒信对境外全资附属公司提供担保承诺

本公司子公司海通恒信于2024年3月19日签署《担保协议》，为其境外全资子公司 Haitong UT Brilliant Limited 发行金额为10亿元人民币、于2027年3月到期的债券提供连带责任保证担保。

本公司子公司海通恒信于2022年4月27日签署《担保协议》，为其境外全资子公司 Haitong UT Brilliant Limited 发行金额为2亿美元、于2025年4月到期的债券提供连带责任保证担保。

### 6、资本承诺

单位：人民币万元

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
已签约但未拨付的购建长期资产承诺	39,270.21	55,542.33

## 7、经营租赁

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：人民币万元

项目	2024年6月30日	2023年12月31日
1年以内	56,748.21	56,311.77
1至2年	52,010.53	54,330.83
2至3年	51,139.72	50,216.09
3至4年	32,260.62	37,426.61
4至5年	18,486.74	22,714.55
5年以上	59,296.04	62,637.76
合计	269,941.86	283,637.61

## 8、其他承诺事项

其他存在限售期及有承诺条件的资产为交易性金融资产、债权投资、其他债权投资和其他权益工具投资，详见附注五、（九），附注五、（十），附注五、（十一）及附注五、（十二）。

# 十一、资产负债表日后事项

2024年8月29日，公司第八届董事会第十二次会议审议通过《公司2024年中期利润分配预案》，同意采用现金分红的方式，向股东派发2024年中期股利，每10股分配人民币0.3元（含税），分配总额为人民币3.89亿元（含税）。根据公司2023年度股东大会对2024年度中期利润分配事宜的相关授权，本次利润分配方案无需提交股东大会审议。

除上述披露的事项外，本公司自2024年6月30日至本报告日无其他重大事项。

# 十二、风险管理

## （一）风险管理政策及组织架构

### 1、风险管理政策

本集团始终注重风险防范与控制，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、风险管理优先。本集团严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了完整有效的全面风险管理架构体系。本集团时刻牢记合规底线，通过各类合规管理工具以及合规监测手段，防范合规风险和洗钱及恐怖融资风险；采用征信授信、久期分析、外汇敞口分析、风险价值分析、最短生存期和现金缺口分析、敏感性分析、压力测试等方法进行风险计量；建立了净资本等风控指标监控体系，稳健配置资产，规范各类业务流程，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。子公司层面，公司将各境内外子公司的风险管理纳入统一体系，对其风险管理工作实行垂直管理，并每日开展风控指标并表管理，建立了集团T+1风险数据集市，强化子公司风险检查和考核评价，深入推进集团化风险管理体系建设。

本集团在使用金融工具时主要面临信用风险、市场风险及流动性风险。为有效管理上述风险，本集团制定了风险管理政策和程序并严格落实，及时开展风险识别与评估，严格执行风险限额管理及内部控制流程，科学使用量化模型实施计量并审慎考虑模型局限性，完善专业风险管理信息系统和风险数据治理工作，为风险管理工作提供有效支撑。

## 2、风险治理组织架构

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》等法规及公司规章制度要求，搭建了多层次的风险管理组织架构，明确了董事会、监事会、经营层、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、经营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、评估及应对工作，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问题缺陷，审议处理公司重大风险事件，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，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，对风险管理中存在的问题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，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，督导公司各单位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，公司合规管理部负责管理公司合规风险、洗钱及恐怖融资风险，公司资金管理总部负责管理公司流动性风险，公司总经理办公室负责管理公司声誉风险，公司信息技术管理部门负责管理公司信息技术风险。

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本单位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。

公司稽核审计部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。

各子公司规范运作，依法经营。公司将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，对其风险管理工作实行垂直管理，每日开展风控指标并表管理，建立了集团 T+1 风险数据集市，并从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、重大事项审批、风险数据对接、风控指标并表、风险督导检查、风险考核评价等方面落实对子公司的垂直风险管理。

## (二) 信用风险管理

信用风险是指因融资人、交易对手方或债务发行人无法履行其约定的财务义务或信用资质发生不利变化而可能造成损失的风险。本集团目前面临的信用风险主要集中在交易性融资业务（如融资融券、股票质押式回购、孖展交易）、信用债券交易与投资业务、融资租赁业务、场外衍生品业务等。

针对交易性融资业务，本集团通过制定和实施各项严格的制度和措施，主要从尽职调查、内部评级、项目评审、授信管理、逐日盯市、限额监控、贷后跟踪、补充增信、平仓处置、司法追索和拨备计提等环节实施管控。

针对信用债券交易与投资业务，本集团注重通过分散投资控制集中度风险，投资标的主要倾向于高信用评级资产，在信用风险管理中密切跟踪投资标的的经营情况和信用评级变化，落实内部评级和统一授信管理机制，建立健全债务发行人、行业和地域集中度等信用风险监控指标，在投后跟踪中及时根据财务指标变动、重大风险事件和负面舆情等信息更新债务发行人内部评级和授信限额指标，动态调整交易策略。

针对融资租赁业务，本集团坚守服务实体经济本源，坚持以行业与客户并重的策略确定信用风险管理政策。行业层面上，本集团就融资租赁客户所处行业的景气程度实行动态跟踪和评估，以此为基础制定相应的行业投放政策、管控行业集中度风险。客户层面上，本集团主要通过开展尽职调查、内部评级、授信审核、贷后资产巡检、风险预警与监测、集中度限额控制等措施对客户信用风险实施管控。

针对场外衍生品业务，本集团从交易对手准入和授信管理、标的证券管理、风险应对与处置等方面建立了完善的管理制度与流程，对存续期内的场外衍生品交易进行逐日盯市，并通过严格履行净额结算和履约保障等措施管理交易对手信用风险。同时，本集团关注信用风险和市场风险之间的相关性，对市场波动背景下的信用风险采取必要的监控和应对措施，包括但不限于交易保证金安排、交易对手内部评级与授信管理、未来潜在风险暴露计量、错向风险识别等。

本集团根据行业监管政策、资本市场环境和集团业务发展战略，持续完善信用风险管理体系。报告期内，本集团以信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作。一是依托集团智能预警中心的建设成果，制定信用风险预警管理制度，全面推广预警工作机制在全集团的应用，落实并完善业务事前、事中及事后的风险监测，赋能业务发展、增强风险预警预判能力；二是基于集团 T+1 风险数据集市，持续优化信用风险管理系统，完善内部评级体系，提升风险识别、计量与压力测试能力，从资产质量、风险抵补和集中度风险等多个维度完善信用风险限额体系；三是坚持风险管理关口前移的工作思路，全面修订法人客户信用评级管理办法，持续强化信用风险评估的前瞻性、及时性和规范化程度。报告期内，本集团核心信用风险监控指标运行平稳，整体信用风险可控。



针对融资类三项业务，公司主动优化业务结构，审慎评估新做项目，强化存续项目的跟踪、监控和管理，加大存量风险项目追偿力度并审慎、前瞻地计提信用减值准备，确保风险拨备计提充分。截至报告期末，公司融资融券存量负债客户的平均维持担保比例为 251.01%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为 288.24%，股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为 207.01%，融资人提供的担保品较为充足，信用风险整体可控。

#### 预期信用损失计量

公司基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行调整。针对不同业务类型，公司制定明确的阶段划分标准，包括但不限于债务人主体的财务和运营情况、信用评级变动情况、担保资产变动情况、重大负面舆情、司法诉讼、逾期信息等因素，以全面揭示业务风险程度、动态反映债务人主体履约的可靠性，为减值阶段划分提供依据。公司金融工具减值共分为三个阶段：

##### ①第一阶段：

在资产负债表日信用风险较低的金融工具，或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）预期信用损失的金额计量其损失准备。

##### ②第二阶段：

自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

##### ③第三阶段：

初始确认后已发生信用减值的金融工具，公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。金融工具已发生信用减值的证据包括但不限于以下可观察信息：

- 债务人发生重大财务困难；
- 债务人违反合同，如：偿付利息或本金违约或逾期超过（含）90 个自然日；
- 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- 因债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 债务人明显缺乏或已丧失清偿能力，被法院指定管理人或已开始相关的诉讼程序；
- 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在其他任何情况下都不会做出的让步，包括但不限于债务减免、以物抵债和债转股；
- 债务人已停止经营活动，被有权机关依法注销、吊销营业执照；
- 债务人依法宣告破产、关闭、解散，并终止法人资格。

金融工具发生信用减值时，有可能是多个事件的共同作用所致，未必是可单独识别的事件所致。

### 信用风险显著增加的判断标准

在每个报告期末，公司对金融工具自初始确认之后信用风险是否显著增加作出评估。公司基于金融工具本身的性质以及债务人的风险因素，对信用风险进行综合性评估考虑。当评估信用风险是否显著增加时，本公司认为应考虑的因素包括但不限于以下几点：

- 自初始确认后债务人实际或预期的内部信用风险级次显著下调，或内部用于评估信用风险的行为评分显著下降；
- 初始确认时债务人在中国境内评级机构 AA 以上（含）的主体或债项评级发生下调，且下调后等级在 AA 以下（不含）；国际三大评级机构 BBB-/Baa3 以上（含）的主体或债项评级发生下调，且下调后等级在 BBB-/Baa3 以下（不含）；
- 初始确认时债务人在中国境内评级机构 AA 以下的主体或债项评级发生下调；国际三大评级机构 BBB-/Baa3 以下的主体或债项评级发生下调；
- 债务人未按照规定时间支付约定的款项，既包括本金不能按时足额支付的情形，也包括利息和其他合约项下的债务义务不能按时足额支付的情形，且该类情形持续时间超过（含）30 个自然日，除非公司以合理成本即可获得合理且有依据的信息，证明即使超过 30 个自然日，债务人的信用风险仍未显著增加；
- 作为债务抵押的担保物价值或第三方提供的担保的显著变化，可能降低债务人按合同规定期限还款的经济动机，或影响发生违约的概率；例如，若因质押证券的价值下跌而导致债务人的履约保障能力弱化，债务人无法在合理时间内按照合同约定补充担保物或将有更大的动机拖欠债务；
- 预期将导致债务人按照合约规定履行债务义务的经济动机或能力发生显著变化的经营、财务或宏观经济状况的不利变化；
- 特定金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险外部市场指标发生显著变化；例如：债务人的信用利差、针对债务人的信用违约互换价格或与债务人相关的其他市场信息；
- 担保人所提供的信用支持质量的实际或预期显著变化，可能降低债务人按合同约定期限还款的经济动机；例如，若担保人不再向债务人提供财务支持而导致后者将面临破产或破产管理，或导致该债务人有限支付经营所需款项（如薪资和关键供货商款项），而将金融负债的支付义务排在较低优先级，导致这些负债违约发生的概率增加；
- 对于证券化中发行的债券，其信用增级或支持的质量发生实际或预期的显著变化，可能导致相关次级权益吸收预期信用损失的能力降低；
- 其他可表明金融工具预计存续期内违约风险的相对变化，而非违约风险变动的绝对值的情形。

公司融资融券和股票质押式回购业务根据融资主体或合约的维持担保比例及担保证券处置难易程度等情况，综合考虑融资主体在报告期末的运营情况、还款能力、司法诉讼、逾期信息等因素，最终得出减值阶段划分结论。针对维持担保比例，公司参照融资主体在交易时的信用状况、担保证券所属板块、流动性、限售情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的预警线和平仓线。其中，预警线分布在 150%-170% 区间，平仓线分布在 130%-150% 区间。在评估减值阶段时，公司为审慎评估担保证券处置风险，根据担保证券处置难易程度确定不同融资主体或合约的穿仓警示线，穿仓警示线分布在 110%- 平仓线之间。

- 维持担保比例高于或等于预警线的，划分为“第一阶段”；
- 维持担保比例介于预警线与穿仓警示线之间，或满足其他“信用风险显著增加”条件的，划分为“第二阶段”；
- 维持担保比例低于穿仓警示线，或存在其他“已发生信用减值”证据的，划分为“第三阶段”。

#### 预期信用损失计量的参数和估值技术

公司计量预期信用损失使用的关键输入值如下：

- 违约概率 (Probability of Default, PD)；
- 违约损失率 (Loss Given Default, LGD)；
- 违约风险敞口 (Exposure at Default, EAD)

如上所述，关键参数通常来源于本公司内部开发的风险计量模型和其他历史数据，且通过调整以反映概率加权的前瞻性信息。

违约概率 PD 为在给定的时间范围内违约可能性的估计值，是在某一时点上进行估计。违约损失率 LGD 为违约产生的损失的估计值，乃基于到期合同现金流量与本公司预期收到金额之间的差额，同时考虑担保品的预期未来可回收现金流量。违约风险敞口 EAD 为在某未来违约日期风险敞口的估计值，考虑了报告日后风险敞口的预期变动，如本金和利息还款、预期从承诺融资协议提用的贷款。

公司采取以违约概率 PD、违约损失率 LGD 和违约风险敞口 EAD 三项关键风险指标为基础的预期信用损失模型，用于第一阶段和第二阶段金融工具的减值准备计量，三项指标的乘积即为金融工具的预期信用损失。其中，违约概率 PD 是以内部或外部信用评级，或基于内部历史数据得出的迁徙率或滚动率为基础，经前瞻性调整后计量得到的。在评估违约损失率 LGD 时，公司充分考虑担保证券的预期处置周期和担保证券在预期处置周期内的价值波动影响，包括担保证券的可处置数量、日均交易量、流通受限条件、减持规则和历史波动性等因素，再考虑相关税费后得到担保证券的可回收现金流量。公司的违约风险敞口 EAD 反映了假设各类金融工具在相应计量期间发生违约时的未付余额。

针对第三阶段金融工具，公司全部采用单项减值测试方法评估预期信用损失。具体而言，公司根据单一项目的特定风险情况，在充分考虑债务人主体和担保证券标的上市公司的财务和经营可持续性状况、司法诉讼、减持限制、重大负面舆情、退市风险等因素的前提下，合理评估担保证券的处置变现价值；同时结合债务人主体提供的其他补充增信资产的估值情况，综合评判债务人主体的预期可回收现金流量，折现后预期仍不足以覆盖其风险敞口的部分计入减值准备。

### 前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。

对于债券投资类金融资产，公司定性选取关键经济指标作为前瞻因子，识别出影响信用风险及预期信用损失的关键经济指标主要包括广义货币供应量 (M2) 累计同比增速、国内生产总值 (GDP) 累计同比增速、工业生产者出厂价格指数 (PPI) 累计同比增速、社会消费品零售总额累计同比增速等。对于融资类金融资产，违约概率前瞻采用回归分析方法，构建违约概率与宏观经济指标的相关性模型，利用该模型与预测的宏观经济指标来推断未来的违约概率变动情形。宏观经济指标包括但不限于国内生产总值 (GDP) 累计同比增速、广义货币供应量 (M2) 累计同比增速、工业生产者出厂价格指数 (PPI) 累计同比增速、固定资产投资完成额累计同比增速等，通过构建这些经济指标与业务风险特征之间的关系，最终实现对融资类金融资产的预期信用损失进行前瞻性调整。

除了提供基准经济情景外，公司管理层也结合市场预期提供了其他可能的情景及对应权重。公司针对主要业务或产品类别的风险特征设定不同的情景，以合理评估相关金融资产在不同经济情景下可能出现的风险变迁。公司在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及其特征。

公司认为，对于公司的信用类金融资产组合，应当考虑应用乐观、基准及悲观这三种不同情景来合理反映选定经济指标对预期信用损失可能产生的影响。公司结合统计分析及专家判断来确定情景权重，也同时考虑了各情景所代表的可能结果的范围。目前本公司使用的基准情景权重超过其他情形权重之和。

公司以加权的 12 个月预期信用损失(阶段一)或加权的整个存续期预期信用损失(阶段二及阶段三)计量相关的损失准备。上述加权的信用损失是由各情景下预期信用损失乘以相应情景的权重计算得出。

与其他经济预测类似，对预计经济指标和发生可能性的估计具有高度的固有不确定性，因此实际结果可能同预测存在重大差异。公司认为这些预测体现了公司对可能结果的最佳估计。

### 敏感性分析

预期信用损失计量模型会使用到模型参数、前瞻性预测的宏观经济变量、经济场景权重及运用专家判断时考虑的其他因素等，上述参数、假设和判断的变化将对信用风险显著增加以及预期信用损失计量产生影响。公司每年定期对模型进行重检并根据具体情况对模型中使用的假设和参数进行适当的修正，本年对模型及参数的调整对预期信用损失结果的影响不重大。

公司对前瞻性计量所使用的经济指标进行了敏感性分析，当乐观、悲观情景权重变动 10% 时，对公司已计提的预期信用损失的影响不重大。

同时，公司还对信用风险阶段分类进行了敏感性分析。假设信用风险自初始确认后未发生显著变化，导致阶段二的金融工具全部进入阶段一，则对资产负债表中确认的预期信用损失影响不重大。

### 担保物及其他信用增级措施

公司采用一系列政策和信用增级措施来降低信用风险敞口至可接受水平。其中，最为普遍的方法是提供抵押物或担保。公司根据交易对手的信用风险评估决定所需的担保物金额及类型。融出资金和买入返售协议下的担保物主要为股票、债券和基金等。公司定期检查担保物的市场价值，根据相关协议要求追加担保物，并在进行损失准备的充足性审查时监视担保物的市场价值变化。

### 金融工具减值管理

为保证金融工具减值准备计提工作的有效性，公司建立了一套与金融工具信用风险管理目标相一致的减值准备计提政策和流程。公司已在各业务主管部门、风险管理部门和财务部门之间建立起相互制衡与协作的工作机制，并清晰划分各部门职责，以确保对金融工具信用风险的计量和信用减值准备的计提是及时、准确、合理的。公司经营层和被授权机构负责通过下述措施管理本公司的金融工具减值工作：

- 基于公司战略和风险偏好建立起一个权责分明、制度完善的金融工具信用风险管理架构，并及时进行调整；
- 组织并完善资产负债表日金融工具的减值评估工作，确保减值模型的验证、发展和维护得到有效保障；
- 评估本公司金融工具的减值状况和潜在财务影响，并及时向董事会汇报；
- 复核确认本公司对于主要减值事件所作出的决策；
- 建立金融工具减值的综合化信息系统和数据质量控制机制；
- 董事会承诺的其他信用风险管理职责。

报告期内，公司以《海通证券股份有限公司金融工具减值管理办法》为基础，持续优化用于信用减值准备计量的预期信用损失模型，保证模型运行稳健，对信用风险变化的反应灵敏，预期信用损失的计量能够动态刻画债务人的信用资质变化、市场行情波动及宏观经济变动等因素的影响，各项金融工具减值管理相关政策和流程落实到位，为公司信用减值准备计提的合理性与时效性提供了保障。

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，代表本集团在资产负债表日最大信用风险敞口的金额如下：

单位：人民币万元

涉及信用风险的项目	2024年6月30日	2023年12月31日
货币资金	14,735,096.02	14,273,077.79
结算备付金	1,590,099.79	1,558,437.77
存出保证金	2,086,250.56	2,364,382.15
拆出资金	83,181.86	33,029.49
融出资金	6,394,409.62	6,841,820.77
交易性金融资产	12,134,820.08	12,980,748.78
衍生金融资产	207,984.18	227,855.54
买入返售金融资产	3,283,652.00	3,678,323.23
应收款项	832,010.21	1,216,727.46
其他债权投资	5,721,324.75	6,131,074.66
债权投资	471,299.42	679,777.95
应收融资租赁款	1,787,408.33	1,989,244.40
长期应收款	7,310,176.04	7,951,650.53
其他资产	1,705,426.77	1,694,507.10
合计	58,343,139.63	61,620,657.62

表外项目信用风险如下：

单位：人民币万元

涉及信用风险的项目	2024年6月30日	2023年12月31日
保函和备用信用证（注1）	106,369.59	108,270.62
不可撤销信贷承诺（注2）	57,746.44	59,235.00
合计	164,116.03	167,505.62

注1：保函和备用信用证属于发生代付情况下才可能导致子公司资本流出的银行业务。

注2：不可撤销信贷承诺为向客户提供信贷协议（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条件。

### （三）市场风险管理

市场风险主要指在本集团的经营活动中，因市场价格（股票价格、利率、汇率及商品价格等）的不利变动而使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。计量口径包含集团范围内以交易为目的的自有资金投资组合。集团所使用的风险价值模型置信度为95%，目标期间为下个交易日。具体如下：

项目	2024年上半年 VaR 95%			
	本公司风险价值 (人民币万元)	本集团风险价值 (人民币万元)	本公司风险价值 / 公司净资产	本集团风险价值 / 集团净资产
报告期最高月末值	23,168.00	34,674.53	0.15%	0.20%
报告期最低月末值	13,167.31	22,813.65	0.08%	0.13%
报告期平均月末值	16,490.17	28,959.46	0.11%	0.17%
报告期末值	13,167.31	22,813.65	0.08%	0.13%

报告期内，公司各月月末风险价值占公司净资产比例以及集团风险价值占集团净资产比例始终处于 0.2% 以内，市场风险可控可承受。

本集团和本公司按风险类别分类的风险价值（VaR）分析概括如下：

单位：人民币万元

项目	本公司		本集团	
	2024年6月30日	2023年6月30日	2024年6月30日	2023年6月30日
权益风险价值	14,625.82	8,849.65	29,333.94	20,344.70
利率风险价值	10,360.61	6,315.15	10,702.93	6,906.93
商品风险价值	117.90	288.37	305.36	283.09
汇率风险价值	1,385.93	847.33	2,544.80	4,080.27
整体组合风险价值	13,167.31	11,534.92	22,813.65	23,207.42

单位：人民币万元

项目	本公司					
	2024年上半年度			2023年上半年度		
	平均	最高	最低	平均	最高	最低
权益风险价值	16,921.07	23,097.56	13,506.09	13,278.57	18,252.52	8,849.65
利率风险价值	9,105.98	10,626.09	7,581.26	7,820.11	8,984.37	6,315.15
商品风险价值	142.77	203.43	100.15	242.18	456.03	89.33
汇率风险价值	1,011.43	1,412.61	669.24	833.83	895.21	795.00
整体组合风险价值	16,490.17	23,168.00	13,167.31	14,893.09	19,448.88	11,534.92

A、股票价格风险。股票价格风险主要指集团所投资的权益类证券市场价格发生变化致使本集团承受损失的风险。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，是本集团主要面对的市场风险类型之一。集团密切关注相关资产价格波动，并采取相应措施予以防范，通过每日跟踪证券持仓的投资规模和风险价值（VaR）变化情况进行监测和管控。集团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。

本集团的股票价格风险源于分类为交易性金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的股权投资。公司董事会密切监控投资组合以管理风险敞口，并通过订立衍生品合约进行风险对冲。

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其他综合收益的影响如下：

单位：人民币万元

市场价格变动幅度	2024 年 6 月 30 日		2023 年 12 月 31 日	
	净利润	其他综合收益	净利润	其他综合收益
上升 10%	98,668.28	71,841.69	247,723.71	53,305.85
下降 10%	-98,668.28	-71,841.69	-247,723.71	-53,305.85

B、利率风险。利率风险是指因市场收益率曲线或信用价差等因素变动导致的风险，承担此类风险的业务主要包括债券投资业务和利率衍生品业务等。本集团对利率风险的控制，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。

本集团采用敏感性分析衡量利率变化对公司利息净收入，公允价值变动损益和权益的可能影响（税后）。利息净收入的敏感性是基于一定利率变动对期末持有的预计未来一年内进行利率重定的金融资产及负债的影响所产生的利息净收入的影响。公允价值变动损益敏感性和权益敏感性的计算是基于在一定利率变动时对期末持有的固定利率交易性金融资产和其他债权投资进行重估的影响。

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、其他综合收益的影响如下：

单位：人民币万元

市场利率变动幅度	2024 年 6 月 30 日		2023 年 12 月 31 日	
	净利润	其他综合收益	净利润	其他综合收益
上升 25 个基点	-24,790.13	-36,850.90	-23,622.12	-30,361.96
下降 25 个基点	25,718.85	37,476.44	26,223.41	30,581.85

C、汇率风险。汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。面对复杂多变的境外市场，本集团持续跟踪研究外汇市场，不断完善制度建设和内部管理，通过套保等一系列措施对冲、缓释汇率风险。集团注重外币资产和负债的匹配，以控制外汇风险的敞口。假设其他变量保持不变的前提下，如果人民币对其他外币升值或贬值 5%，本集团于 2024 年 6 月 30 日权益将减少或增加人民币 4.86 亿元（2023 年 12 月 31 日：人民币 3.77 亿元）。

D、商品价格风险。商品价格风险是由各类商品价格发生不利变动引起。报告期内，本集团商品类市场风险敞口相对较低，主要通过商品期货、期权等商品衍生工具进行对冲，有效管理商品风险。



## （四）流动性风险管理

流动性风险是指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。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，公司按照制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，始终确保流动性风险可测、可控和可承受，同时按照管理要求，储备了充足的优质流动性资产，保障了公司业务的顺利开展和到期负债的顺利偿付。公司持续开展日间流动性和风险指标管理，结合资产端和负债端，构建资金、指标联动体系，完善了包括日间指标头寸跟进、月度指标前瞻分析和部门指标拆解在内的流动性风险分析框架，丰富了不同期限内流动性风险管理的工具，提升了公司流动性风险管理和预判的效率。

在中长期流动性风险管理方面，公司不断优化资产配置结构，强化对资产负债发展趋势的分析，从源头上把控流动性风险。一方面，公司成立资产负债配置委员会，积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势、潜在中长期资金需求，调整负债期限结构，保持资产负债的期限、规模的合理匹配；另一方面，公司持续提升流动性精细化管理水平，负债端结构和到期日分布更趋合理，也保证资产端在安全性、流动性、收益性之间的平衡。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。

此外，公司稳步推进对集团和子公司流动性风险管理的要求，以集团流动性风险管理办法为指引，根据各子公司业务特点制定了较为科学有效的流动性风险管理策略，基本实现集团层面流动性风险的统一管理。首先，公司以流动性风险管理为基础，从风险和资产负债管理等方面持续对子公司实行分类管理，并从组织制度保障、风险管控框架、风险应对手段三个维度提出不同要求，指导子公司完善其流动性风险管理体系；其次，以流动性风险并表指标为基础，根据各子公司所处行业、地域和风险特征的差异，下发各子公司的限额管理要求，以更有效地监测各子公司的流动性风险实质情况；最后，为强化集团流动性风险处置能力，公司持续完善集团流动性支持体系，牢牢守住集团不发生流动性风险的底线。

本集团持有的金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

单位：人民币万元

项目	2024年6月30日						合计	账面价值
	即期	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上			
短期借款		2,634,543	729,337				3,363,880	3,339,644
应付短期融资款		345,441	1,226,706				1,572,147	1,557,143
拆入资金		1,461,886	315,616	183,204	39,165		1,999,871	1,950,500
交易性金融负债	216,723	290,815	515,536	201,656			1,224,730	1,224,730
卖出回购金融资产款	648,817	8,008,264	1,259,311	80,427			9,996,819	9,972,568
代理买卖证券款	10,652,634						10,652,634	10,652,634
应付款项	285,066	131,725	715,221	4,106	1,068		1,137,186	1,137,186
应付债券		1,783,059	6,519,126	11,585,409			19,887,594	18,945,077
衍生金融负债	47,872	31,061	15,363	18,285	10,486		123,067	123,067
长期借款		480,816	1,432,108	1,888,141	87,837		3,888,902	3,697,728
租赁负债		9,539	22,512	58,503	19,238		109,792	100,329
其他负债	201,675	525,728	471,144	762,016	49,302		2,009,865	1,929,360
合计	12,052,787	15,702,877	13,221,980	14,781,747	207,096		55,966,487	54,629,966

单位：人民币万元

项目	2023年12月31日						合计	账面价值
	即期	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上			
短期借款		2,529,161	599,443				3,128,604	3,105,390
应付短期融资款		781,671	1,124,461				1,906,132	1,885,306
拆入资金		1,239,379	50,142	197,460	24,800		1,511,781	1,471,236
交易性金融负债	212,632	580,906	519,503	731,634	665		2,045,340	2,045,340
卖出回购金融资产款	207,706	10,011,985	960,043	100,340			11,280,074	11,256,479
代理买卖证券款	10,653,872						10,653,872	10,653,872
应付款项	235,922	112,058	1,162,664	1,720	1,068		1,513,432	1,513,432
应付债券		2,109,987	5,942,915	12,798,219			20,851,121	19,392,028
衍生金融负债	18,911	27,430	44,543	13,706	14,505		119,095	119,095
长期借款		505,186	1,397,932	2,460,099	106,582		4,469,799	4,229,932
租赁负债		9,914	26,789	64,525	23,719		124,947	109,716
其他负债	206,177	344,266	437,343	698,279	46,353		1,732,418	1,708,499
合计	11,535,220	18,251,943	12,265,778	17,065,982	217,692		59,336,615	57,490,325

## 十三、其他重要事项

### (一) 分部报告

根据本公司战略规划及内部管理要求，本公司确定六大经营分部：财富管理、投资银行、资产管理、交易及机构、融资租赁及其他。财富管理分部主要提供经纪服务、投资顾问服务、财富管理服务等；融资类业务服务等；投资银行分部主要提供保荐和承销服务、财务顾问服务、新三板服务等；资产管理分部主要提供资产管理、基金管理和股权投资服务等；交易及机构分部主要提供股票销售交易、大宗经纪、股票借贷、股票研究等；融资租赁分部主要提供融资租赁服务等；其他分部主要提供仓单服务等其他服务。

本期发生额 / 期末余额	财富管理	投资银行	资产管理	交易及机构	融资租赁	其他	合计
一、营业总收入	3,592,358,119.80	969,186,006.74	1,231,246,634.47	32,260,399.31	2,283,962,505.99	755,744,169.37	8,864,757,835.68
手续费及佣金净收入	1,273,046,490.28	854,807,284.74	826,108,039.90	550,248,635.81			3,504,210,450.73
其他收入	2,319,311,629.52	114,378,722.00	405,138,594.57	-517,988,236.50	2,283,962,505.99	755,744,169.37	5,360,547,384.95
二、营业总支出	2,273,188,778.70	916,420,572.02	596,312,885.99	1,005,730,312.80	1,328,609,197.03	857,782,645.29	6,978,044,391.83
三、营业利润	1,319,169,341.10	52,765,434.72	634,933,748.48	-973,469,913.49	955,353,308.96	-102,038,475.92	1,886,713,443.85
四、利润总额	1,317,113,169.38	61,984,685.05	634,537,262.38	-960,499,738.64	954,778,539.53	-102,037,841.08	1,905,876,076.62
五、资产总额							721,414,534,571.73
分部资产	207,769,034,336.16	8,224,781,509.34	14,870,263,109.88	369,762,439,738.26	114,327,198,533.24	3,158,643,685.75	718,112,360,912.63
递延所得税资产							3,302,173,659.10
六、负债总额							550,222,979,374.09
分部负债	172,157,706,595.28	2,878,444,578.86	5,253,681,097.89	270,923,287,795.94	97,677,421,094.32	785,929,934.63	549,676,471,096.92
递延所得税负债							546,508,277.17
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	313,379,724.23	119,021,304.59	92,138,575.93	162,478,304.97	174,150,731.66	3,686,735.42	864,855,376.80
2、资本性支出	85,175,913.21	9,286,455.30	20,570,964.27	165,925,715.63	6,214,555.10	14,444,708.14	301,618,311.65
3、信用减值损失	126,080,322.44	-14,761,853.62	50,062,120.52	163,148,452.99	545,578,191.42	19,131.93	870,126,365.68
4、其他减值损失					9,002,293.56	6,645,329.63	15,647,623.19

上期发生额 / 上年年末余额	财富管理	投资银行	资产管理	交易及机构	融资租赁	其他	合计
一、营业总收入	4,143,603,125.88	2,145,474,447.90	1,297,312,947.97	2,255,538,889.63	2,539,015,616.30	4,587,421,945.36	16,968,366,973.04
手续费及佣金净收入	1,481,184,470.19	1,963,826,265.90	829,204,276.76	666,353,976.61			4,940,568,989.46
其他收入	2,662,418,655.69	181,648,182.00	468,108,671.21	1,589,184,913.02	2,539,015,616.30	4,587,421,945.36	12,027,797,983.58
二、营业总支出	2,407,940,166.20	1,302,178,291.65	674,050,697.44	1,178,458,158.36	1,611,660,105.70	4,627,799,562.29	11,802,086,981.64
三、营业利润	1,735,662,959.68	843,296,156.25	623,262,250.53	1,077,080,731.27	927,355,510.60	-40,377,616.93	5,166,279,991.40
四、利润总额	1,736,550,081.78	908,222,469.93	623,611,506.70	1,096,332,806.57	927,310,734.36	-40,303,151.53	5,251,724,447.81
五、资产总额							754,586,792,234.64
分部资产	212,754,874,370.95	10,826,869,528.20	15,800,004,669.68	383,032,063,556.10	125,071,640,317.98	2,914,225,564.26	750,399,678,007.17
递延所得税资产							4,187,114,227.47
六、负债总额							579,787,232,518.31
分部负债	171,369,687,714.76	4,600,060,000.06	5,993,741,836.22	290,485,537,001.43	105,565,765,421.23	937,392,789.39	578,952,184,763.09
递延所得税负债							835,047,755.22
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	233,042,741.32	123,314,833.73	92,768,452.40	174,505,886.60	170,500,616.40	23,456,070.69	817,588,601.14
2、资本性支出	93,807,167.03	60,801,859.55	27,011,125.48	150,071,499.03	12,926,867.59	7,100.00	344,625,618.68
3、信用减值损失	339,747,880.76	15,772,951.86	39,179,780.94	86,276,926.23	722,838,002.56	8,898.89	1,203,824,441.24
4、其他减值损失					8,189,822.02	1,688,018.92	9,877,840.94

## (二) 金融工具项目计量基础分类表

### 1、金融资产计量基础分类表

2024年6月30日账面价值					
金融资产项目	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益	
		分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则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
货币资金	147,350,960,191.27				
结算备付金	15,900,997,855.89				
拆出资金	831,818,601.45				
融出资金	63,944,096,200.47				
衍生金融资产				1,975,001,062.26	104,840,751.37
存出保证金	20,862,505,578.13				
应收款项	8,320,102,103.69				
买入返售金融资产	32,836,520,013.53				
交易性金融资产				211,398,285,277.46	
债权投资	4,712,994,209.36				
其他债权投资		57,213,247,473.03			
其他权益工具投资			10,416,425,857.16		
长期应收款	73,101,760,386.66				
其他资产(金融资产)	14,222,701,841.60				
合计	382,084,456,982.05	57,213,247,473.03	10,416,425,857.16	213,373,286,339.72	104,840,751.37

2023年12月31日账面价值

金融资产项目	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益	
		分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则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
货币资金	142,730,777,859.05				
结算备付金	15,584,377,719.97				
拆出资金	330,294,865.04				
融出资金	68,418,207,732.52				
衍生金融资产				2,190,280,368.65	88,274,984.76
存出保证金	23,643,821,500.73				
应收款项	12,167,274,566.35				
买入返售金融资产	36,783,232,348.48				
交易性金融资产				221,273,089,992.22	
债权投资	6,797,779,540.34				
其他债权投资		61,310,746,563.80			
其他权益工具投资			8,010,844,169.78		
长期应收款	79,516,505,296.66				
其他资产（金融资产）	13,515,256,321.00				
合计	399,487,527,750.14	61,310,746,563.80	8,010,844,169.78	223,463,370,360.87	88,274,984.76

2、金融负债计量基础分类表

2024年6月30日账面价值

金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则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	按照《套期会计》准则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
短期借款	33,396,442,371.46			
应付短期融资款	15,571,430,187.50			
拆入资金	19,504,997,024.24			
交易性金融负债		2,167,232,915.42	10,080,067,940.88	
衍生金融负债		1,187,150,917.23		43,516,134.91
卖出回购金融资产款	99,725,679,018.20			
代理买卖证券款	106,526,337,287.99			
应付款项	11,371,856,610.63			
长期借款	36,977,280,684.23			
应付债券	189,450,771,465.64			
其他负债（金融负债）	16,772,044,329.17			
合计	529,296,838,979.06	3,354,383,832.65	10,080,067,940.88	43,516,134.91

2023年12月31日账面价值

金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	
		按照《金融工具确认和计量》准则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	按照《套期会计》准则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
短期借款	31,053,895,350.17		
应付短期融资款	18,853,059,412.54		
拆入资金	14,712,363,886.93		
交易性金融负债		2,169,332,910.47	18,284,072,038.87
衍生金融负债		1,185,225,820.49	5,719,273.43
卖出回购金融资产款	112,564,792,535.08		
代理买卖证券款	106,538,716,590.39		
应付款项	15,134,315,108.69		
长期借款	42,299,324,666.85		
应付债券	193,920,279,749.62		
其他负债（金融负债）	15,853,502,476.54		
合计	550,930,249,776.81	3,354,558,730.96	18,284,072,038.87 5,719,273.43

### (三) 社会责任

2024年1-6月在环保公益项目、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248.83万元。

2024年1-6月公益性投入构成明细：

单位：人民币万元

项目	本期发生额
慈善捐赠、教育资助、救灾捐款等	248.83
合计	248.83

## 十四、母公司财务报表主要项目注释

### (一) 长期股权投资

项目	2024年6月30日			2023年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	43,156,743,817.43		43,156,743,817.43	45,156,743,817.43		45,156,743,817.43
对联营企业投资	2,279,775,517.23		2,279,775,517.23	2,367,564,502.38		2,367,564,502.38
合计	45,436,519,334.66		45,436,519,334.66	47,524,308,319.81		47,524,308,319.81

#### 1、对子公司投资

被投资单位	2024年1月1日	减值准备 期初余额	本期增减变动				2024年6月30日	减值准备 期末余额
			追加 投资	减少投资	计提减 值准备	其他		
海富通基金管理有限公司	76,500,000.00					76,500,000.00		
海通期货股份有限公司	2,190,938,863.68					2,190,938,863.68		
海通开元投资有限公司	7,500,000,000.00			-2,000,000,000.00		5,500,000,000.00		
海通国际控股有限公司	9,406,814,500.00					9,406,814,500.00		
海通创新证券投资有限公司	14,650,000,000.00					14,650,000,000.00		
上海海通证券资产管理有限 公司	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		
海通恒信金融集团有限公司	8,376,424,390.00					8,376,424,390.00		
合计	45,156,743,817.43			-2,000,000,000.00		43,156,743,817.43		

#### 2、对联营企业投资

被投资单位	2024年1月1日	减值 准备 期初 余额	本期增减变动							2024年 6月30日	减值 准备 期末 余额	
			追加 投资	减少 投资	权益法下确认的 投资损益	其他综合收益调整	其他权 益变动	宣告发放现金股利 或利润	计提减 值准备			其他
富国基金管 理有限公司	2,367,564,502.38				214,844,433.28	669,581.57			-303,303,000.00		2,279,775,517.23	
合计	2,367,564,502.38				214,844,433.28	669,581.57			-303,303,000.00		2,279,775,517.23	

#### 3、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	本期发生额	上期发生额
<b>证券经纪业务净收入</b>	1,445,893,148.02	1,721,378,711.90
——证券经纪业务收入	1,941,828,258.75	2,351,928,120.11
其中：代理买卖证券业务	1,563,261,387.27	1,809,457,730.63
交易单元席位租赁	277,333,445.46	402,104,235.78
代销金融产品业务	101,233,426.02	140,366,153.70
——证券经纪业务支出	495,935,110.73	630,549,408.21
其中：代理买卖证券业务	495,935,110.73	630,549,408.21
<b>投资银行业务净收入</b>	566,546,465.69	1,753,920,625.71
——投资银行业务收入	568,847,533.92	1,768,046,235.03
其中：证券承销业务	513,897,302.02	1,707,966,979.19
证券保荐业务	10,444,339.62	29,298,113.20
财务顾问业务	44,505,892.28	30,781,142.64
——投资银行业务支出	2,301,068.23	14,125,609.32
其中：证券承销业务	2,301,068.23	13,873,486.68
财务顾问业务		252,122.64
<b>投资咨询业务净收入</b>	65,530,324.17	23,203,293.59
——投资咨询业务收入	65,534,324.17	23,203,293.59
——投资咨询业务支出	4,000.00	
<b>其他手续费及佣金净收入</b>	37,152,753.50	45,378,950.90
——其他手续费及佣金收入	38,309,052.88	47,125,349.99
——其他手续费及佣金支出	1,156,299.38	1,746,399.09
<b>合计</b>	2,115,122,691.38	3,543,881,582.10
——手续费及佣金收入合计	2,614,519,169.72	4,190,302,998.72
——手续费及佣金支出合计	499,396,478.34	646,421,416.62

### 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	5,377,358.49	8,088,679.25
其他财务顾问业务净收入	39,128,533.79	22,440,340.75
合计	44,505,892.28	30,529,020.00



### (三) 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
<b>利息收入</b>		
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,055,564,777.59	1,239,313,387.97
融出资金利息收入	1,593,083,917.60	1,824,367,198.41
买入返售金融资产利息收入	662,917,577.32	865,575,911.48
其中：约定购回利息收入	800,042.45	6,996,004.73
股权质押回购利息收入	589,327,137.00	769,143,335.18
其他债权投资利息收入	677,728,528.42	782,929,735.50
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	14,970,926.24	29,210,620.16
<b>收入合计</b>	<b>4,004,265,727.17</b>	<b>4,741,396,853.52</b>
<b>利息支出</b>		
其中：应付短期融资款利息支出	144,042,522.19	84,112,000.95
拆入资金利息支出	154,308,423.57	102,823,866.44
其中：转融通利息支出	138,850,944.48	63,508,333.37
卖出回购金融资产款利息支出	854,438,428.54	1,013,891,682.04
其中：报价回购利息支出	90,953,080.55	36,155,726.94
代理买卖证券款利息支出	70,079,298.87	95,098,258.12
应付债券利息支出	1,925,756,859.38	2,077,004,257.49
其中：次级债券利息支出	154,063,398.24	153,359,514.48
租赁负债利息支出	10,952,174.23	9,395,756.45
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	88,053,219.65	147,271,642.50
<b>支出合计</b>	<b>3,247,630,926.43</b>	<b>3,529,597,463.99</b>
<b>利息净收入</b>	<b>756,634,800.74</b>	<b>1,211,799,389.53</b>

### (四) 投资收益

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	214,844,433.28	295,914,926.63
金融工具投资收益	1,245,235,677.95	1,630,110,191.74
其中：持有期间取得的收益	2,320,795,777.12	1,920,886,649.37
—交易性金融工具	1,987,442,351.06	1,853,601,460.06
—其他权益工具投资	333,353,426.06	67,285,189.31
处置金融工具取得的收益	-1,075,560,099.17	-290,776,457.63
—交易性金融工具	-626,759,154.49	-852,040,228.34
—其他债权投资	188,304,538.08	133,638,624.44
—衍生金融工具	-637,105,482.76	423,990,076.02
—其他		3,635,070.25
合计	1,460,080,111.23	1,926,025,118.37

## (五) 公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	370,850,918.77	1,355,775,101.88
交易性金融负债	1,313,982,260.55	-1,397,116,106.30
其中：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	1,458,993,904.85	-1,362,524,419.48
衍生金融工具	458,295,799.45	422,738,256.64
合计	2,143,128,978.77	381,397,252.22

## (六) 业务及管理费

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	1,788,969,445.65	2,137,496,475.37
固定资产折旧费	244,498,089.00	210,587,796.58
电子设备运转费	141,914,263.32	177,411,172.42
使用权资产折旧	101,488,657.47	92,604,650.66
无形资产摊销	91,902,774.98	74,572,304.93
邮电通讯费	71,278,307.23	67,610,136.85
差旅费	63,942,713.17	71,672,599.14
物业管理费	47,533,573.85	47,190,860.50
业务招待费	38,366,200.47	47,670,479.64
长期待摊费用摊销	37,940,789.30	35,458,558.62
其他	193,866,576.12	286,389,325.50
合计	2,821,701,390.56	3,248,664,360.21

## (七) 现金流量表补充资料

补充资料	本期发生额	上期发生额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	3,235,664,772.32	3,325,599,016.78
加：信用减值损失	71,334,729.48	34,303,152.25
固定资产及投资性房地产折旧	245,035,347.48	211,125,055.06
使用权资产折旧	101,488,657.47	92,604,650.66
无形资产摊销	91,902,774.98	74,572,304.93
长期待摊费用摊销	37,940,789.30	35,458,558.62
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”号填列)	596,125.57	7,503,562.20
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-2,143,128,978.77	-381,397,252.22
利息支出	1,403,023,027.38	1,387,582,279.39
汇兑损失(收益以“-”号填列)	-1,026,787.22	186,113,715.01
投资损失(收益以“-”号填列)	-736,502,397.42	-496,838,740.38
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	569,325,005.34	157,293,482.26
交易性金融资产等的减少(增加以“-”号填列)	-195,197,826.76	-293,890,307.89
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	10,080,583,855.08	-5,724,060,481.02
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	-13,667,573,537.21	-12,970,950,846.96
经营活动产生的现金流量净额	-906,534,442.98	-14,354,981,851.31
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		
承担租赁负债方式取得使用权资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	103,048,041,719.16	123,773,563,867.93
减：现金的期初余额	103,638,468,270.99	125,324,821,911.95
现金及现金等价物净增加额	-590,426,551.83	-1,551,258,044.02

## 十五、财务报告的批准报出

本财务报表经本公司董事会于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

## 补充资料

### (一) 当期非经常性损益明细表

项目	本期发生额
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-877,698.65
计入当期损益的政府补助，但公司正常经营业务密切相关、符合国家政策规定、按照确定的标准享有、对公司损益产生持续影响的政府补助除外	490,669,491.73
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-223,149.24
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	76,536,135.02
小计	566,104,778.86
减：所得税影响额	137,880,660.40
少数股东权益影响额（税后）	20,723,221.41
合计	407,500,897.05

当期非经常性损益明细表是本公司按照中国证券监督管理委员会颁布的《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益（2023 年修订）》的有关规定而编制的。

### (二) 净资产收益率及每股收益

本净资产收益率和每股收益计算表是本公司按照中国证券监督管理委员会颁布的《公开发行证券公司信息披露编报规则第 9 号净资产收益率和每股收益的计算及披露》（2010 年修订）的有关规定而编制的。

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	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	0.58	0.07	0.07
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	0.33	0.04	0.04

### (三) 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 2024 年 1-6 月及 2023 年 1-6 月的净利润和 2024 年 6 月 30 日及 2023 年 12 月 31 日的净资产并无差异。

## 第十节 证券公司信息披露



## 公司重大行政许可事项的相关情况

日期	批复标题	批复单位	批文号
2024年1月29日	关于同意海通证券股份有限公司向专业投资者公开发行次级公司债券注册的批复	中国证监会	证监许可〔2024〕157号

