

公司代码：600837

公司简称：海通证券

海通证券股份有限公司 2021 年半年度报告

重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和罗兵咸永道会计师事务所分别根据中国和国际审阅准则出具了审阅意见。

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

本公司2021年上半年度未拟定利润分配预案和公积金转增股本预案。

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

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内容的真实性、准确性和完整性

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“可能面对的风险及风险应对措施”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.....	5
第二节	公司简介和主要财务指标.....	7
第三节	管理层讨论与分析.....	14
第四节	公司治理.....	39
第五节	环境与社会责任.....	45
第六节	重要事项.....	49
第七节	股份变动及股东情况.....	65
第八节	优先股相关情况.....	70
第九节	债券相关情况.....	71
第十节	财务报告.....	76
第十一节	证券公司信息披露.....	183

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兼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
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
全国社保基金	指	中国社会保障基金理事会
《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	香港上市规则附录十所载之《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》
守则	指	香港上市规则附录十四《企业管治守则》及《企业管治报告》
证券及期货条例	指	香港法例第 571 章证券及期货条例（经不时修订、补充或以其他方式修改）
公司章程或章程	指	海通证券的公司章程
香港	指	中国香港特别行政区
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
QDII	指	合格境内机构投资者
QFII	指	合格境外机构投资者
RQFII	指	人民币合格境外机构投资者
IPO	指	首次公开发售
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	2021 年 1 月 1 日至 2021 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
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，于香港联交所上市，股份代号：

		665
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
海富产业	指	海富产业投资基金管理有限公司
海富通基金	指	海富通基金管理有限公司
海通资管公司	指	上海海通证券资产管理有限公司
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	瞿秋平
公司授权代表	周杰、姜诚君
联席公司秘书	姜诚君、黄慧玲
合规总监	王建业

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】

注册资本和净资产

	本报告期末	上年度末
注册资本	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
净资产	82,171,716,407.94	84,129,715,034.91

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

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

12. 中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与者资格（中国结算函字[2008]22号）
13. 为期货公司提供中间介绍业务资格（沪证监机构字[2010]122号）
14. 开展直接投资业务试点资格（机构部部函[2008]421号）
15. 实施经纪人制度资格（沪证监机构字[2009]302号）
16. 向保险机构投资者提供交易单元的资格（保监资金审证[2009]1号）
17. 融资融券业务资格（证监许可[2010]315号）
18. 公司自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格（沪证监机构字[2010]372号）
19. 基金评价业务资格（中证协发[2010]070号）
20. 全国社保基金理事会签约券商资格（2011年8月）
21. 资产管理业务参与股指期货交易资格（沪证监机构字[2011]237号）
22. 约定购回式证券交易业务试点（机构部部函[2011]512号）（上证交字[2011]37号）
23. 发行境外上市外资股资格（证监许可[2011]1821号）（H股）
24. 债券质押式报价回购业务试点（机构部部函[2011]585号）
25. 合伙企业独立托管业务试点（机构部部函[2012]686号）
26. 柜台市场交易业务（中证协函[2012]825号）
27. 转融通业务试点资格（中证金函[2012]113号）
28. 中小企业私募债券承销业务试点资格（中证协函[2012]561号）
29. 证券业务外汇经营（SC201307）
30. 代销金融产品业务资格（沪证监机构字[2013]180号）
31. 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）
32. 2013年第十一批保险兼业代理人资格（沪保监许可[2013]204号）
33. 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）
34. 证券投资基金托管资格（证监许可[2013]1643号）
35. 代理证券质押登记业务资格（2014年2月）
36. 互联网证券业务试点（中证协函[2014]358号）
37. 黄金交易所会员资格（证书编号:T004）
38. 上市公司股权激励行权融资业务试点（深圳函[2014]321号）
39. 股票期权做市业务资格（证监许可[2015]153号）
40. 上证50ETF期权合约品种的主做市商（上证函[2015]214号）
41. 期权结算业务资格（中国结算函字[2015]20号）
42. 期货会员证书（证书编号：NO.G02008）
43. 中国证券投资基金业协会会员证书（证书编号：00000147）
44. 境外自营业务资格（机构部函[2015]1204号）
45. 单向视频开户创新方案的无异议函（中国结算办字[2015]461号）

46. 银行间黄金询价业务资格（上金交发[2015]120号）
47. 非金融企业债务融资工具主承销业务资质（2016年8月）
48. 票据交易资质（2016年11月）
49. 信用风险缓释工具相关业务资格（2017年1月）
50. 场外期权业务二级交易商资格（中证协发[2018]386号）
51. 信用衍生品业务资质（机构部函(2019)469号）
52. 军工涉密业务咨询服务安全保密条件备案证书（2019年10月）
53. 股指期货做市业务（机构部函[2019]3073号）
54. 利率互换实时承接业务资格（2020年3月）
55. 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）

公司具备上交所和深交所的会员资格，中国证券登记结算有限责任公司权证结算业务资格。公司附属子公司均依法，或经相关监管部门批准获得相应的业务资格后开展经营业务活动。

二、 联系人和联系方式

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

三、 基本情况变更简介

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	中国上海市广东路 689 号
公司办公地址的邮政编码	200001
公司网址	http://www.htsec.com
电子信箱	haitong@htsec.com
报告期内变更情况查询索引	http://www.sse.com.cn
香港主要营业地址	香港中环德辅道中189号李宝椿大厦21楼
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	http://www.sse.com.cn

	http://www.hkexnews.hk
公司半年度报告备置地点	中国上海市广东路689号海通证券大厦12层董事会办公室
报告期内变更情况查询索引	http://www.sse.com.cn

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	23,471,241,587.14	17,787,655,390.58	31.95
归属于母公司股东的净利润	8,170,194,923.98	5,483,192,354.93	49.00
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	7,897,352,076.35	5,108,829,157.68	54.58
经营活动产生的现金流量净额	34,758,418,207.39	245,972,614.25	14,031.01
其他综合收益的税后净额	-346,786,150.51	-308,105,561.23	-
	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	723,092,240,579.70	694,073,350,684.76	4.18
负债总额	549,798,941,196.63	525,947,038,849.00	4.54
归属于母公司股东的权益	158,178,625,453.82	153,448,467,827.53	3.08
所有者权益总额	173,293,299,383.07	168,126,311,835.76	3.07

(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)	0.63	0.48	31.25
稀释每股收益(元/股)	0.63	0.48	31.25
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.60	0.44	36.36
加权平均净资产收益率(%)	5.10	4.26	增加0.84个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	4.93	3.97	增加0.96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) 母公司的净资产及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资产	82,171,716,407.94	84,129,715,034.91
净资产	138,636,510,633.68	137,445,187,712.53
风险覆盖率 (%)	345.42	344.45
资本杠杆率 (%)	23.98	26.03
流动性覆盖率 (%)	292.13	208.11
净稳定资金率 (%)	157.80	157.16
净资产/净资产 (%)	59.27	61.21
净资产/负债 (%)	37.68	43.70
净资产/负债 (%)	63.57	71.39
自营权益类证券及其衍生品/净资产 (%)	27.63	30.06
自营非权益类证券及其衍生品/净资产 (%)	159.77	135.83

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

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-889,711.45	
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	541,838,473.83	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	21,582,404.81	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-4,407,004.39	
少数股东权益影响额	-26,126,307.05	
所得税影响额	-259,155,008.12	
合计	272,842,847.63	

十、 财务报表主要项目

适用 不适用

1. 合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日	增减幅度
货币资金	152,711,373,385.12	127,846,510,384.44	19.45%
融出资金	80,176,273,764.79	73,067,592,180.28	9.73%
衍生金融资产	1,161,148,867.42	1,837,911,549.28	-36.82%
应收款项	14,372,620,584.73	8,410,000,191.07	70.90%
买入返售金融资产	47,374,018,540.66	57,965,393,846.35	-18.27%
交易性金融资产	220,492,902,157.25	220,396,503,802.97	0.04%
其他债权投资	17,336,611,668.70	13,108,162,077.30	32.26%
其他权益工具投资	9,656,322,183.81	16,239,187,221.41	-40.54%
应收融资租赁款	41,302,243,616.26	48,411,402,490.40	-14.68%

长期应收款	41,493,096,835.38	35,214,476,098.67	17.83%
投资性房地产	57,122,929.38	111,591,512.78	-48.81%
短期借款	36,244,363,155.76	43,367,554,072.81	-16.43%
交易性金融负债	38,631,286,909.25	32,238,300,944.74	19.83%
卖出回购金融资产款	59,826,002,087.77	60,563,432,718.62	-1.22%
代理买卖证券款	115,515,984,832.05	108,167,567,969.29	6.79%
代理承销证券款	514,399,999.98	233,062,962.16	120.71%
应交税费	1,986,080,451.56	3,566,582,804.82	-44.31%
应付款项	21,148,375,027.68	11,590,061,915.13	82.47%
合同负债	234,485,990.86	131,039,010.16	78.94%
长期借款	51,378,459,686.52	49,363,002,740.67	4.08%
应付债券	156,332,095,029.79	147,838,209,538.34	5.75%
递延所得税负债	1,247,357,241.70	698,134,483.29	78.67%
资本公积	74,910,587,607.68	74,888,284,930.75	0.03%
未分配利润	46,052,540,159.72	41,222,398,224.28	11.72%

项目	2021年1-6月	2020年1-6月	增减幅度
手续费及佣金净收入	7,165,176,960.88	5,720,657,603.17	25.25%
利息净收入	3,361,957,910.21	2,208,910,396.51	52.20%
投资收益	6,089,788,843.43	4,448,877,621.85	36.88%
公允价值变动收益	1,324,130,957.42	1,663,100,685.20	-20.38%
汇兑收益	80,349,420.96	235,585,946.73	-65.89%
其他业务收入	4,918,695,749.61	2,952,852,352.19	66.57%
业务及管理费	6,439,255,745.70	4,742,902,575.10	35.77%
信用减值损失	1,024,765,121.75	2,900,271,089.20	-64.67%
其他业务成本	4,177,371,538.58	2,203,633,025.93	89.57%
所得税费用	2,772,210,076.66	1,918,026,512.84	44.53%
净利润	8,888,739,650.98	5,901,461,237.03	50.62%
其他综合收益的税后净额	-346,786,150.51	-308,105,561.23	-
综合收益总额	8,541,953,500.47	5,593,355,675.80	52.72%

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	2021年6月30日	2020年12月31日	增减幅度
货币资金	86,744,268,045.56	74,010,191,666.45	17.21%
结算备付金	22,032,675,464.64	17,748,028,149.83	24.14%
融出资金	70,200,583,599.52	62,585,416,116.49	12.17%
衍生金融资产	333,082,389.99	109,961,010.63	202.91%
存出保证金	5,558,442,334.48	3,815,156,298.46	45.69%
买入返售金融资产	38,162,713,360.89	46,043,557,098.07	-17.12%
交易性金融资产	128,371,097,306.80	118,954,600,639.95	7.92%
其他债权投资	15,395,804,050.29	11,767,722,804.51	30.83%
其他权益工具投资	9,564,122,034.39	15,984,455,967.50	-40.17%
长期股权投资	35,283,157,250.29	35,146,029,297.79	0.39%
其他资产	3,795,096,895.09	1,301,878,794.62	191.51%
应付短期融资款	8,800,446,263.23	14,954,952,895.91	-41.15%
交易性金融负债	19,034,920,857.27	8,319,118,224.27	128.81%
衍生金融负债	1,201,564,296.33	543,531,575.78	121.07%
卖出回购金融资产款	49,543,287,903.51	48,997,605,575.98	1.11%
代理买卖证券款	68,657,425,041.24	67,389,968,518.46	1.88%
代理承销证券款	564,399,999.98	323,062,962.16	74.70%
应交税费	688,314,830.49	1,761,215,662.79	-60.92%

应付款项	10,029,477,320.71	1,703,278,685.18	488.83%
应付债券	107,568,178,733.66	99,870,431,188.08	7.71%
其他负债	3,731,180,989.12	590,316,777.15	532.06%
资本公积	74,772,635,006.20	74,772,635,006.20	0.00%
其他综合收益	246,488,413.23	499,137,706.73	-50.62%
未分配利润	27,563,670,838.14	26,119,698,623.49	5.53%

项目	2021 年 1-6 月	2020 年 1-6 月	增减幅度
手续费及佣金净收入	3,990,032,781.63	3,194,742,627.21	24.89%
利息净收入	1,517,745,007.44	1,252,740,595.39	21.15%
投资收益	3,082,048,927.81	3,500,615,231.02	-11.96%
公允价值变动收益	573,817,040.48	390,329,758.08	47.01%
税金及附加	103,182,239.73	58,418,980.80	76.62%
业务及管理费	3,391,463,157.17	2,196,808,271.40	54.38%
信用减值损失	-75,034,174.19	1,253,031,347.41	-105.99%
所得税费用	1,440,643,943.84	959,418,210.44	50.16%
净利润	4,687,971,315.60	4,164,949,338.55	12.56%
其他综合收益的税后净额	-230,598,394.45	-213,255,355.90	-
综合收益总额	4,457,372,921.15	3,951,693,982.65	12.80%

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

(一) 报告期内公司主营业务情况说明

公司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。

财富管理业务主要是指向零售及高净值客户提供全面的金融服务和投资解决方案，提供的服务包括证券及期货经纪服务、投资顾问服务、理财策划服务、以及向客户提供融资融券、股票质押等融资类业务服务。

投资银行主要是指向企业和政府客户提供股票资本市场和债券资本市场融资活动的保荐和承销服务，为企业客户的收购兼并、资产重组等提供财务顾问服务，同时提供新三板服务。根据业务性质不同，将投资银行业务分为股权融资业务、债权融资业务、并购融资业务、新三板与结构融资业务，公司致力于为客户提供一站式的境内外投资银行服务。

资产管理主要是指向个人、企业和机构客户提供全面的多元产品投资管理服务，提供的服务包括资产管理、基金管理和公募、私募股权投资服务。海通资管公司的经营范围包括定向业务、集合业务、专项业务、QDII 业务和创新业务等；海富通基金、富国基金的主要业务包括共同基金（含 QDII）管理业务、企业年金、全国社保基金和特定客户资产管理等，为投资者提供专业化的基金投资理财服务；公司还具备一批私募股权投资业务（PE）的专业投资管理平台，经营范围为产业投资基金管理、投资咨询、发起设立投资基金等。

交易及机构主要是指向全球机构投资者提供全球主要金融市场的股票销售交易、大宗经纪、股票借贷、股票研究，以及固定收益产品、货币及商品产品、期货及期权、交易所买卖基金及衍生品等多种金融工具的发行、做市。同时通过投资基金及私募股权项目，发挥及增强公司各业务分部的协同优势，专注发掘合理资金回报的投资机会，进而拓展客户关系及促进公司业务的整体增长。

融资租赁主要是指向个人、企业和政府提供创新型金融服务解决方案，提供的服务包括融资租赁、经营租赁、保理、委托贷款和相关咨询服务。公司租赁业务主要由海通恒信经营，海通恒信目前在基础设施、交通物流、工业、教育、医疗、建筑与房地产及化工等诸多行业领域开展业务，充分运用丰富的行业经验及市场渠道，与国内外知名设备厂商展开合作，为客户的业务发展提供全面的融资解决方案及服务。近两年来，积极开拓有券商特色的融资租赁业务模式，推出了与股权、债权相结合的多样化产品组合，为客户提供更多的结构化创新融资方案。

其他分部主要是指为机构客户提供综合性金融及信息服务，提供的服务包括仓单服务、定价服务、做市业务及与风险管理服务相关的业务。

(二) 报告期内公司所属行业的发展阶段、周期性特点以及公司所处的行业地位

1. 市场环境

2021 年上半年，全球经济延续复苏势头，生产端逐渐接近疫情前水平，消费端加快复苏，商品和服务贸易持续稳定增长。全球金融市场流动性充裕，市场利率保持低位。美元指数低位震荡，大宗商品价格大幅上涨。A 股市场震荡上行，上证指数累计上涨 3.4%，深证成指和创业板指分别上涨 4.78% 和 17.22%，创业板指刷新 2015 年 6 月以来高位；债券指数缓慢上涨，中债总净价指数上涨 0.38%。

当前，世界经济格局正在发生深刻变革，疫情发展还充满不确定性，主要发达经济体实施大规模财政刺激和宽松的货币政策，一定程度上稳定了市场信心，扭转了经济下滑颓势，但也带来了流动性泛滥、资产价格大幅波动、国际金融市场脆弱性上升等问题。贸易保护主义继续扩散，全球产业链供应链受到冲击。各国都更加重视科技创新在经济转型中的关键作用，积极培育经济长期健康发展新动能。为实现经济高质量发展，我国正在构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局，深化供给侧结构性改革，加快实施创新驱动发展战略，努力推动科技、资本与实体经济高水平循环。资本市场的作用日益凸显，证券行业作为资本市场的重要参与者，在服务实体经济中迎来新的发展机遇期。

2. 行业格局

“十四五”时期将是中国资本市场实现“规范、透明、开放、有活力、有韧性”目标的关键时期，资本市场作为资源配置市场，不断支持战略新兴产业发展、碳达峰碳中和等国家战略推进。监管部门持续完善资本市场基础制度建设，坚持“建制度，不干预，零容忍”的工作方针，全面深化资本市场改革、推动资本市场高质量发展。在严监管、客户结构机构化、需求多元化，行业竞争白热化、发展同质化的形势下，证券行业不断守正创新，提升核心竞争力，回归金融本源，服务实体经济，做国家战略的推动者、践行者。

3. 公司所处行业地位

2021 年上半年，集团实现营业收入 234.71 亿元，归属于母公司股东的净利润 81.70 亿元；2021 年 6 月 30 日，总资产 7,230.92 亿元，归属于母公司股东的净资产 1,581.79 亿元，主要财务指标多年来一直保持行业前列。

二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

在长期经营过程中，公司逐步形成了具有自身特色的六大核心竞争力：

1. 雄厚的资本实力

2007 年至 2021 年，公司抓住市场机遇，通过 A+H 股上市、增发等多次战略性股权融资和债券融资，迅速增强并持续保持了雄厚的资本实力。2021 年上半年，公司完成多次债务融资，通过发行公司债、短期公司债、收益凭证等方式完成境内融资超过 400 亿元。通过多种债务融资工具并举，增强了资本实力及公司流动性管理能力与风险防控能力。另外，公司还积极拓展境外融资，确保了境外业务的健康有序发展。充足的资本为公司业务转型升级、满足境内外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。

2. 卓越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。集团经纪业务客户基础雄厚；投资银行业务排名行业前列；资产管理业务主动管理规模持续提升；私募股权投资业务规模及品牌影响力行业领先；在港业务多项数据排名行业首位；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。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、沪、港、新、东”六大国际金融中心。截至报告期末，集团在中国境内拥有 343 家证券及期货营业部（其中证券营业部 302 家，期货营业部 41 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、大洋洲等全球 5 大洲 14 个国家和地区设有分行或子公司。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过 1,850 万名客户。

4. 业内领先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，集团建立了业内领先的国际业务平台，获得了亚太地区先发优势以及欧美地区前瞻性的战略储备。

海通国际不断巩固在香港投行中的领先地位。股权融资方面，IPO 业务领先香港所有投行，并不断加强海外市场的项目执行能力及品牌影响力；环球债券融资方面，按承销数量在亚洲除日本外 G3 高收益债排名位于前列；衍生品业务保持持续增长；资产管理业务方面，产品线日趋完善，投资业绩突出；财富规划业务方面，持续打造私人财富管理顶级人才团队。

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的专业知识以及长达 20 多年的经验，具有全银行牌照，在深耕本土业务的基础上，加强业务拓展中的“中国元素”策略，为国家的“一带一路”倡议提供跨境的金融服务支持。

自贸区分公司是首批加入自贸区 FTU（自贸区分账核算单元）体系的证券机构，成功实施了国内券商首单 FT（自由贸易账户）项下跨境融资项目，并于 2016 年 5 月成为上海黄金交易所 A 类国际会员，2018 年 11 月成为中国外汇交易中心外币拆借会员。

业内领先、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. 稳健的经营理念、有效的合规与风险管理和内部控制体系

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，是中国境内二十世纪八十年代成立的证券公司中唯一一家至今仍在营运并且未更名、未被政府注资且未被收购重组过的

大型证券公司。公司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。

6. 坚持科技引领，十四五科技规划全面启动

公司长期秉承“科技引领”发展理念，科技投入持续保持行业前列。一是十四五科技发展规划正式发布，明确了以“敏捷化、平台化、智能化、生态化”为核心特征的数字海通 2.0 发展目标，奠定了公司数字化转型工作的总纲和主线。二是基础设施建设取得新进展，自建的张江科技园正式投入使用，先后获得国际 LEED V4.1 金级证书和国家 A 级机房证书，成为证券期货经营机构中唯一一家成功通过国际权威最新标准金级认证的数据中心。三是科技赋能业务发展取得新成效。公司全力打造的一站式机构客户综合服务平台 e 海通达正式上线，实现包括融券业务、金融产品、研究服务、投行专区、基金托管专区、企业图谱等多种功能；场外衍生品业务系统为近 500 个机构客户提供服务，场外衍生品管理系统实现对近 490 个客户交易协议书的的管理，以及期权、互换、信用衍生品等五个品种共近 3,600 个合约的簿记和估值，提供合约维度和部门项目组合维度的风险预警监控。四是前沿科技应用取得新突破。海通金融区块链平台应用于十多个业务场景，日均上链笔数 3 万笔，并通过中国电子标准院的功能测试和性能测试，成为行业首家区块链通过该院测评的证券公司。

三、经营情况的讨论与分析

（一）总体经营情况

2021 年上半年，公司经营工作平稳有序，取得了良好的经营业绩，主要财务指标继续排名行业前列。各业务线亮点纷呈：投行业务市场领先，保持强劲的发展势头；财富管理业务改革转型取得成效，费类业务收入大幅增长；海通国际战略转型见效明显，海通银行澳门分行设立获批，公司国际化战略向纵深推进；机构与国际业务表现亮眼，取得长足发展；场外衍生品业务稳健增长。

（二）主营业务分析

1. 财富管理业务

市场环境：

受流动性相对充裕以及市场分歧加大影响，2021 年上半年股基交易额在 2020 年高基数基础上依旧保持增长，开户数亦大幅增长。根据 WIND 数据显示，2021 年上半年沪深两市股票、基金日均成交 9,808 亿元，同比增加 21.2%；平均每月新增投资者 180.67 万人较去年同期增长 35.7%。伴随中国居民财富快速增长、居民财富结构调整，财富管理市场进入快速发展时期，证券公司财富管理转型初见成效。

截至 2021 年 6 月末，融资融券余额为 1.78 万亿元，同比增长 53%，较年初增长 10%；其中融资余额 1.63 万亿元，同比增长 44%，融券余额同比大幅增长 482%至 1,560 亿元。伴随注册制改革和转

融通机制优化持续发挥效力，社保基金、QFII、法人机构和产品更多参与转融通证券出借，市场券源供给进一步增加，融券投资者的多样化策略得以实施。

经营举措及业绩：

公司坚持“以客户为中心”，持续推进财富管理业务布局，夯实客户经理制，加快投资顾问团队及客户服务体系建设，提升交易服务、投资咨询以及基于资产配置的产品销售能力，打造差异化财富管理品牌。截至 2021 年 6 月末，公司财富管理客户数量（剔除休眠账户）1,386.5 万户，较报告期初增长 5.4%，期末客户总资产 2.64 万亿元，去年底增长 9.5%，报告期内，公司股票基金交易金额 8.19 万亿元，同比增加 11.8%。

2021 年 6 月末公司交易额变化

	本报告期	上年同期
股票交易量（亿元）	76,344	69,009
基金交易量（亿元） ¹	5,527	4,190
合计（亿元）	81,871	73,199

（1）零售经纪业务

2021 年上半年，公司全面加强零售客户服务的深度和广度，新增客户资产同比增长 131%，新开户的质量和产出有所提升；加快推进智慧运营建设，完成珠三角、京津冀等地区 12 家分公司的智慧通设备推广；以客户为中心，聚集企业家，全力培育精英理财师团队，构建差异化私人客户财富管理体系。公司全面提升客户分类服务能力，构建包含智能工具服务、投顾增值服务、基金推荐产品及基金持仓服务四个维度的“通盈财富”品牌服务。通过匹配通享会员分层体系，实现差异化客户服务，满足客户多元化的财富管理需求。借助金融科技优势，覆盖长尾海通零售客户，致力构建客户标签与画像体系，结合客户生命周期形成精准化运营闭环，实现匹配目标用户与目标产品，提升业务转化。

（2）互联网金融

截至 2021 年 6 月底，e 海通财移动平台用户总数超过 3,950 万；月度平台活跃数超 470 万，稳居行业前四。2021 年 e 海通财在交易、行情、资讯、理财、投顾、决策、资产配置等领域持续升级创新，通过大数据、人工智能等前沿科技，洞察行业趋势，紧贴用户需求，在功能深度和广度维度不断创新突破。2021 年上半年，e 海方舟-机构交易版完善了其六大特色功能模块，公司于 2021 年 1 月上线了 e 海方舟-量化交易版，与专注于实现手工交易客户高阶交易需求的 e 海方舟-机构交易版形成互补。2021 年上半年，e 海方舟股票基金交易量同比增长 49.47%，活跃客户数同比增长 123%。

（3）金融产品销售

公司成立金融产品委员会，布局金融产品业务的规划发展，在体制、机制方面进行改革创新，推动产品销售流程化管理，促进产品销售业务快速增长。2021 年上半年，公司重点推进公募券结、头部量化私募以及结构化产品的销售，加大 ETF 基金和指数类产品的配置，进一步为客户进行多元化资产

¹ 不含场内货币基金交易量，与市场交易口径不同

配置，分散风险。此外，公司推出单一资产配置专户，为高净值客户提供定制化产品。2021 年上半年，公司产品整体销售量 2,606 亿元，同比增长 17.6%，产品日均保有量 900 亿元，较 2020 年日均增长 32.4%。

(4) 融资类业务

截至 2021 年 6 月末，公司融资类业务规模 1,084.29 亿元(不含表外资管规模)，较年初新增 72.56 亿元。其中，融资融券余额较年初增加 88.72 亿元至 765.55 亿元，客户结构进一步优化。公司持续推动融券业务稳步发展，融券服务团队逐步扩大，在券源供给、客户服务及流程优化等方面强化工作，融券份额持续提升。公司股票质押业务规模下降至 316.13 亿元，资产质量保持较好水平。

2021 年 6 月末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）	765.55	676.83
股票质押余额（亿元） ¹	316.13	333.02
约定购回余额（亿元）	2.61	1.89
合计（亿元）	1,084.29	1,011.73

(5) 期货业务

海通期货各项业务稳步推进，发展势头良好。2021 年上半年，海通期货营业收入和净利润同比大幅增长，实现代理交易额 22.4 万亿元（单边计算），市场占比 7.83%，同比上升 1.51 个百分点，排名行业第二；2021 年 6 月末客户权益 423 亿元，较年初增长 30.2%，排名行业前列。

2. 投资银行业务

市场环境：

2021 年上半年，中国经济在疫情后稳健恢复，注册制改革带来了证券发行常态化，宏观经济向好与资本市场改革推进给 A 股市场以强力支撑，A 股融资市场整体依然延续较为良好的势头，共有 568 个融资项目，融资 7,874.7 亿元，同比分别增长 53%和 21%；其中，共有 245 只新股上市，融资 2,110 亿元，上市家数较去年同期增长一倍以上（106%），融资额同比上升 51%。再融资家数也比去年同期有较为明显的上升，2021 年上半年增发数量为 232 家，比 2020 年同期增长 90%，融资金额 3,679.67 亿元，较去年同期增长 2.3%，其中可转债上市数量为 73 家，融资金额 1,652 亿，数量比 2020 年同期下滑 20%，融资金额增长 74%。融资家数、融资金额增长的同时，市场结构也进一步优化，受注册制改革的积极影响，新上市公司以科创板、创业板为主，一批“硬科技”、具备较强发展潜力的创新创业企业登陆 A 股，为中国经济的高质量发展和资本市场高质量发展注入了新的活力。

2021 年上半年，各类债券发行共 29.39 万亿元，同比增长 13%；利率债发行总额 9.14 万亿元，同比增长 3%；信用债发行量较去年同期基本持平，发行量 9.33 万亿元。

经营举措及业绩：

(1) 股权融资

¹ 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 149.92 亿元

公司积极响应国家战略，抓住注册制改革机遇，在科创板、创业板领域积极布局、重点开拓，公司境内股权融资业务延续良好势头，全力推进项目进程，经营业绩亮眼。2021 年上半年，完成 35 个股权融资项目发行上市，共募资 402.7 亿元。其中，完成 11 单科创板项目挂牌，市场排名第一；完成 7 单创业板项目挂牌，市场排名第一；共完成 22 单 IPO 项目挂牌，发行金额 165.3 亿元，发行数量与金额均排名市场第二。同时，公司股权业务项目储备丰富，截至 2021 年 6 月末，IPO、再融资的在审及待发项目数量分别为 53 家与 22 家，均排名行业前列。2021 年上半年，公司不断加强投行业务合规风控和内部管理，培养与注册制相匹配的理念、组织和能力，发挥“看门人”的作用。

境内 IPO 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	金额（亿元）	165.3	48.7
	家数	22	4
再融资发行	金额（亿元）	237.4	64.2
	家数	13	8
在审及待发项目数量	首次公开发行	53	48
	再融资发行	22	17

数据来源：WIND、中国证监会、上海证券交易所、深圳证券交易所

在境外股权融资业务方面，海通国际在全球疫情反复下继续保持在香港投行中的领先地位，2021 年上半年完成了 22 个 IPO 项目，按承销数量和承销金额均位居香港所有投行第一。在海外资本市场共计完成 8 单股权融资项目，其中包括 5 单美股股权融资项目和 3 单印度股权融资项目，进一步加强公司在海外市场的项目执行能力及品牌影响力。

（2）债券融资

境内债券融资业务方面，各项经营指标保持稳定。公司于报告期内主承销各类债券 488 期，合计承销金额 2,378 亿元，市场排名行业前列。其中，企业债承销金额 260 亿元，继续排名行业第一；公司债承销金额 767 亿元，排名行业第五；服务国家战略，以创新驱动业务发展，发行中西部地区首单科技创新公司债，助力深圳地铁成功发行深交所首单碳中和债券。

境内主承销债券项目承销规模变化

		本报告期	上年同期
企业债	金额（亿元）	259.89	235.99
	家数	32	24
公司债	金额（亿元）	766.97	741.12
	家数	173	161
其他	金额（亿元）	919.17	1,281.48
	家数	227	254

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

数据来源：WIND

在境外债券融资业务方面，2021 年上半年海通国际共计完成了 136 个债券发行项目，包括 27 笔绿色债券；在亚洲除日本外 G3 高收益债排名中，按承销数量名列全球金融机构第二。海通银行继续秉持“本地业务”和“中国元素”跨境业务双轮驱动的策略，克服海外疫情影响，完成多单债券承销业务，协助完成瀚惠国际、水发国际、山东财经集团担保债券的发行。

3. 资产管理业务

市场环境：

2021 年是资管业务按“资管新规”要求整改的最后一年，各家资产管理机构积极谋求业务转型，持续压缩通道类业务规模，努力加强和提升主动管理能力，立足于居民财富管理需求，不断创新产品体系，推出和发行净值型资管产品，逐步丰富其净值型产品线。据中国证券业协会统计，截至 2021 年 6 月末，证券公司受托管理资金本金总额 10.45 万亿元，较资管新规发布前（2017 年末）已下降 39.5%，但主动管理规模较 2017 年末均有一定幅度的提高。同时，券商资管的公募化转型正在提速。据 wind 数据统计，目前已经累计有超 100 只券商集合产品完成了公募化改造，资产净值总计逾千亿元。

2021 年公募基金行业继续保持良好发展态势，市场规模持续增长。据 wind 数据统计，2021 年上半年度新成立的公募基金数量达 845 只，募集总规模达 1.63 万亿元。同时，公募基金的资产管理规模再创新高，据中国证券投资基金业协会统计，公募基金总规模 2021 年 6 月末突破 23 万亿，较 2020 年末增长了 15.8%。

经营举措及业绩：

公司资产管理业务抓住市场发展机遇，规模持续增长，取得了良好的经营业绩。截至 2021 年 6 月末，公司资产管理业务总规模超 1.86 万亿元，较年初增长 12%。

(1) 海通资管公司

海通资管公司积极顺应资管行业发展的大趋势，努力推进大集合资管计划向公募基金转型，拟以客户需求为导向、以市场风险收益为基础建立公私资管产品线，逐步丰富公司产品体系服务客户，公司着力培育和形成涵盖权益类投资、固收类投资、量化投资、跨境投资及其他另类投资等多类公、私募资管产品，全方位满足投资者的财富管理需求，并为投资者创造长期价值。截至 2021 年 6 月末，海通资管公司管理规模 1,882 亿元，其中主动管理规模 1,594 亿元，占比提升至 84.7%。

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	616	75,852	775	78,166
定向资产管理	920	9,796	1,631	7,888
专项资产管理	346	752	311	777
合计	1,882	86,400	2,717	86,831

(2) 基金管理公司

截至 2021 年 6 月末，海富通基金管理资产规模 3,480 亿元，其中公募基金管理规模 1,295 亿元，较年初增长 3.57%；养老金业务整体规模持续增长，由年初的 1,599 亿元增长至 1,771 亿元，较年初增长 10.8%。报告期内，海富通基金新发基金 7 只，募集规模 82.3 亿元；积极把握 ETF 发展趋势，成功发行港股通科技 ETF，募集规模 7.07 亿元。

截至 2021 年 6 月末，富国基金资产管理总规模超 1.2 万亿元，再创历史新高。其中，公募基金管理规模逾 7,900 亿元，较上年末增长超 34%。据中国基金业协会数据，非货币公募基金月均规模行业最新排名位列第 5。富国基金坚持大力推进产品创新，富国首创水务 REITs、富国中证科创创业 50ETF 等多只产品跻身行业首批成立之列。

(3) 私募投资基金

海通开元被国家中小企业发展基金选为首批子基金管理机构，完成了中小企业发展基金海通（合肥）合伙企业（有限合伙）的设立和首期缴款工作，基金总规模 20 亿元。截至 2021 年 6 月末，私募股权投资业务管理规模 264 亿元，2021 年上半年完成投资项目 18 个，投资金额 10.8 亿元；新增上市（含过会）项目 10 个，在会项目 15 个。

私募投资基金业务规模变化

	报告期末	上年度末
管理基金数量	48	45
管理规模余额（亿元）	264	254
累计投资项目数量	18	40
累计投资项目金额（亿元）	11	29
项目退出（含部分退出）数量	37	65

(4) 境外资产管理

海通国际持续打造专业的投资与管理体系统，结合市场环境和客户需求，不断丰富产品线和优化产品，为客户提供互联互通的全球资产管理方案，打造一站式的专业投资服务平台，截至 2021 年 6 月末，资产管理规模 520 亿港元。2021 年上半年，海通国际资产管理团队表现优秀，荣获《理柏基金香港年奖 2021》《指标》《投资洞见与委托》等颁发的多项业界大奖。

4. 交易与机构服务业务

市场环境：

2021 年上半年，A 股市场呈结构化行情，沪深 300 指数上涨 0.24%，创业板指数上涨 17.22%。债券市场各大指数保持缓慢上涨态势：中债总净价指数上涨 0.38%，其中，中债国债总净价指数涨幅 0.55%，中债企业债总净价指数较年初上涨 2.53%。

经营举措及业绩：

(1) 交易业务

2021 年上半年，公司固定收益投资择时运用趋势与利率中性策略，适度增加投资品种、降低投资集中度，提高资产质量，并逐步增加利率债配置规模。权益投资在今年市场波动中积极把握时机，调整持仓结构，不断开发量化趋势新策略，实现较好收益。

公司紧跟行业投资业务转型趋势，积极拓展权益类场外衍生产品业务，取得积极成果；报告期内，公司场外期权存续交易名义本金规模同比增长超过 250%，市占率超过 13%，排名行业前列；公司权益类场外衍生产品业务收入同比增长超过 150%。公司期权做市业务全面覆盖上交所、深交所、中金所权益类期权品种，盈利能力和做市评级不断提升。

2021 年上半年，公司直投业务新增 4 个直接股权投资项目，完成中国国有企业混改基金首期出资；完成 11 单科创板项目跟投，跟投金额 3.34 亿元。

海通国际坚持以客户为导向，为全球机构客户提供高效及专业的交易服务。2021 年上半年，现金股票交易额超过 3,000 亿港元，同比增长超过 40%。衍生产品方面，窝轮及牛熊证业务持续显著增长，获《彭博商业周刊》颁发的 2021 年度金融机构大奖 - 证券界别「年度金融衍生产品机构 - 卓越大奖」。

(2) 机构业务

公司坚持打造业内一流的研究品牌，在为客户提供专业化服务、支持公司业务发展等方面取得不俗的成绩，呈现出品牌化、国际化、信息化、销售模式多元化的良好态势。2021 年上半年，公司为机构客户组织路演、拜访活动 8,100 余场，外发报告 2,700 余篇，举办线上电话会议 769 场，服务客户人数超 15.3 万人次，得到客户的积极响应与广泛认可。

报告期内，公司继续保持在 QFII/RQFII 市场第一梯队，交易客户总数达 131 家，客户资产总额 936 亿元，同比增长 53%。托管业务通过拓展机构客户和产品挖掘，优化托管外包运营流程，深化综合服务转型，在券商结算模式基金、公募 ETF 基金等方面取得较好成绩。2021 年上半年，公司日均托管及外包规模 5,126 亿元，同比增长 53%，稳固了行业优势地位。

5. 融资租赁业务

市场环境：

2021 年上半年，融资租赁行业面临着市场增长放缓、同质化竞争日益激烈、资产质量与风险管控压力加大、经营战略与业务模式亟需调整等严峻挑战，行业发展延续了 2020 年的放缓趋势。从中长期来看，伴随着中国经济增长、产业结构升级、新型基础设施建设发力，叠加「十四五」新时期新兴行业的大力发展，中国融资租赁行业仍处于稳步增长阶段，行业活力依然较强。同时，随着各地方融资租赁行业监管规定的发布及具体监管措施的落地，经营异常、治理较不规范的租赁公司将被加速整合出清，行业集中度将进一步提升，治理完善、合规经营且实力雄厚的头部租赁企业将获得更为有利的经营环境及发展机遇。2021 年上半年，金融体系持续巩固统筹疫情防控和经济社会发展的重大战略成果，保持灵活精准、合理适度的稳健货币政策，持续优化金融机构资金结构，维持宏观杠杆率稳定，

推动实际贷款利率进一步降低；2021 年上半年融资租赁行业债券发行规模突破 3,000 亿元，利用资本市场开展多元化且稳定的直接融资已成为头部租赁企业的重要融资手段。

经营举措及业绩：

2021 年上半年，海通恒信紧跟国家战略及政策导向，探索产融结合新途径，持续优化业务方向，保障规模与收入稳定，有效提升盈利水平。2021 年上半年，海通恒信实现业务投放 291.7 亿元；实现收入总额 40.5 亿元，同比增长 4.0%；实现净利润 6.9 亿元，同比增长 10.3%。截至 2021 年 6 月 30 日，海通恒信资产总额为 1,109.0 亿元，较 2020 年 12 月 31 日增长 2.6%；不良资产率 1.08%，不良资产拨备覆盖率 273.35%。海通恒信积极响应政府号召，以普惠金融扶持实体经济发展，助力小微企业健康成长；践行社会责任，以金融助力产业脱贫；同时，海通恒信持续完善全面风险管理体系，增强主动风险管理能力，推动公司高质量、可持续发展。

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 2021 年 6 月 30 日，集团总资产 7,230.92 亿元，归属于母公司净资产 1,581.79 亿元。2021 年上半年，集团实现营业收入 234.71 亿元，归属于母公司净利润 81.70 亿元；加权平均净资产收益率 5.10%。其中，子公司实现收入 143.22 亿元，占比 60%；境外业务实现收入 52.78 亿元，占比 22%。

(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	23,471,241,587.14	17,787,655,390.58	31.95
营业成本	11,837,101,306.29	9,964,777,113.53	18.79
经营活动产生的现金流量净额	34,758,418,207.39	245,972,614.25	14,031.01
投资活动产生的现金流量净额	-116,433,695.31	-4,400,850,650.83	-
筹资活动产生的现金流量净额	-7,659,631,253.41	10,748,753,503.70	-171.26

(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	7,165,176,960.88	5,720,657,603.17	25.25	主要是投资银行业务、经纪业务和资产管理业务手续费收入增加
其中：经纪业务手续费净收入	2,624,722,675.27	2,234,602,303.53	17.46	主要是证券经纪业务净收入增加
投资银行业务手续费净收入	2,524,747,356.00	1,700,920,219.27	48.43	主要是证券承销业务净收入

				增加
资产管理业务手续费净收入	1,832,908,069.19	1,639,664,003.38	11.79	主要是基金管理业务净收入增加
利息净收入	3,361,957,910.21	2,208,910,396.51	52.20	主要是融出资金利息收入增加和借款利息支出减少
投资收益和公允价值变动收益	7,413,919,800.85	6,111,978,307.05	21.30	主要是金融工具投资收益增加
其他业务收入	4,918,695,749.61	2,952,852,352.19	66.57	主要是子公司销售收入增加
其他	611,491,165.59	793,256,731.66	-22.91	/
合计	23,471,241,587.14	17,787,655,390.58	31.95	/

(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	5,189,483,318.31	1,936,581,172.06	62.68	4.92	-33.86	21.88
投资银行	3,007,570,572.44	1,367,055,736.59	54.55	45.60	40.48	1.65
资产管理	2,415,765,932.99	903,072,911.38	62.62	36.98	32.28	1.33
交易及机构	6,472,615,931.43	2,009,913,866.77	68.95	36.92	12.22	6.84
融资租赁	2,421,897,705.32	1,624,820,081.31	32.91	10.59	9.33	0.77
其他	3,963,908,126.65	3,995,657,538.18	-0.80	89.21	89.92	-0.37
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	357,713,120.20	152,035,868.07	57.50	3.28	17.92	-5.28
浙江	210,931,054.76	70,660,863.50	66.50	-9.15	13.53	-6.69
黑龙江	180,816,628.95	84,387,526.31	53.33	-10.47	15.18	-10.39
江苏	154,017,294.94	77,519,092.54	49.67	-3.28	17.32	-8.84
山东	113,116,418.69	50,271,350.44	55.56	-5.57	14.87	-7.91
其他地区分支机构	850,255,331.49	435,836,618.71	48.74	-4.16	19.25	-10.06
公司总部及境内子公司	16,326,792,660.41	7,639,610,426.60	53.21	43.04	31.90	3.95
境内小计	18,193,642,509.44	8,510,321,746.17	53.22	36.17	30.30	2.11
境外业务	5,277,599,077.70	3,326,779,560.12	36.96	19.22	-3.10	14.51
合计	23,471,241,587.14	11,837,101,306.29	49.57	31.95	18.79	5.59

2021 年上半年,集团财富管理业务营业收入 51.89 亿元,同比(49.46 亿元)增加 2.43 亿元,增幅 4.92%,主要是稳步推进财富管理转型,核心客户服务能力提升显著;投资银行业务营业收入 30.08 亿元,同比(20.66 亿元)增加 9.42 亿元,增幅 45.60%,主要是全力推进股权融资项目进程,加强优质客户网络建设,深度挖掘核心机构,承销规模大幅提升;资产管理业务营业收入 24.16 亿元,同比(17.64 亿元)增加 6.52 亿元,增幅 36.98%,主要是提升主动管理能力,主动管理规模占比增长;交易及机构业务营业收入 64.73 亿元,同比(47.27 亿元)增加 17.46 亿元,增幅 36.92%,主要是积极把握时机,优化投资策略,实现较好收益;融资租赁业务营业收入 24.22 亿元,同比(21.90 亿元)增加 2.32

亿元，增幅 10.59%，主要是持续构建专业化生态圈，深化业务联动，项目收益显著；其他业务营业收入 39.64 亿元，同比（20.95 亿元）增加 18.69 亿元，增幅 89.21%。

(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	151,625,754.50	107,513,070.62	41.03	/
业务及管理费	6,439,255,745.70	4,742,902,575.10	35.77	主要是职工薪酬增加
信用减值损失	1,024,765,121.75	2,900,271,089.20	-64.67	主要是买入返售金融资产减值损失减少
其他资产减值损失	44,083,145.76	10,457,352.68	321.55	/
其他业务成本	4,177,371,538.58	2,203,633,025.93	89.57	主要是子公司销售成本增加
合计	11,837,101,306.29	9,964,777,113.53	18.79	/

(4) 现金流

经营活动产生的现金流量净额为 347.58 亿元，其中：现金流入 676.43 亿元，占现金流入总量的 35.17%，主要是为交易目的而持有的金融资产净减少额 166.62 亿元，收取利息、手续费及佣金的现金 155.67 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 137.97 亿元；现金流出 328.85 亿元，占现金流出总量的 19.89%，主要是融出资金净增加额 74.20 亿元，支付其他与经营活动有关的现金 131.98 亿元。

投资活动产生的现金流量净额为-1.16 亿元，其中：现金流入 130.68 亿元，占现金流入总量的 6.79%，主要是收回投资收到的现金 116.14 亿元；现金流出 131.85 亿元，占现金流出总量的 7.97%，主要是投资支付的现金 123.91 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额为-76.60 亿元，其中：现金流入 1,116.11 亿元，占现金流入总量的 58.03%，主要是发行债券收到的现金 655.67 亿元，取得借款收到的现金 457.49 亿元；现金流出 1,192.71 亿元，占现金流出总量的 72.14%，主要是偿还债务支付的现金 1,144.07 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

适用 不适用

1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上年期末数	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
衍生金融资产	1,161,148,867.42	0.16	1,837,911,549.28	0.26	-36.82	主要是其他衍生金融资产减少
应收款项	14,372,620,584.73	1.99	8,410,000,191.07	1.21	70.90	主要是应收清算款增加

其他债权投资	17,336,611,668.70	2.40	13,108,162,077.30	1.89	32.26	主要是其他债权投资规模增加
其他权益工具投资	9,656,322,183.81	1.34	16,239,187,221.41	2.34	-40.54	主要是其他权益工具投资规模减少
投资性房地产	57,122,929.38	0.01	111,591,512.78	0.02	-48.81	主要是投资性房地产转入固定资产
代理承销证券款	514,399,999.98	0.07	233,062,962.16	0.03	120.71	主要是代理承销规模增加
应交税费	1,986,080,451.56	0.27	3,566,582,804.82	0.51	-44.31	主要是应交企业所得税减少
应付款项	21,148,375,027.68	2.92	11,590,061,915.13	1.67	82.47	主要是应付清算款增加
递延所得税负债	1,247,357,241.70	0.17	698,134,483.29	0.10	78.67	主要是金融工具公允价值变动收益增加

其他说明

(1) 资产状况

2021 年 6 月末，集团总资产 7,230.92 亿元，较上年末（6,940.73 亿元）增加 290.19 亿元，增幅 4.18%。主要变动情况是：货币资金、结算备付金及存出保证金增加 289.77 亿元，融出资金增加 71.09 亿元，买入返售金融资产减少 105.91 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 35%，货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的 26%，融出资金占总资产的 11%，长期应收款及应收融资租赁款占总资产的 11%，买入返售金融资产占总资产的 7%，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 2%，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

2021 年 6 月末，集团负债总额 5,497.99 亿元，较上年末（5,259.47 亿元）增加 238.52 亿元，增幅 4.54%。主要变动情况是：应付款项增加 95.58 亿元，代理买卖证券款增加 73.48 亿元，交易性金融负债增加 63.93 亿元，应付短期融资款及应付债券增加 21.83 亿元，短期借款及长期借款减少 51.08 亿元。

2. 境外资产情况

√适用 □不适用

(1) 资产规模

其中：境外资产 3,082.41 亿港币，折合人民币为 2,564.81 亿元，占总资产的比例为 35.47%。

(2) 境外资产相关说明

√适用 □不适用

2021 年 6 月末，境外总资产 3,082.41 亿港币，较上年末（3,165.84 亿港币）减少 83.43 亿港币，减幅 2.64%。主要变动情况是：交易性金融资产减少 131.42 亿港币，应收款项增加 71.26 亿港币。

3. 截至报告期末主要资产受限情况

√适用 □不适用

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见“第十节 财务报告 四、合并财务报表项目附注 1 货币资金，7 买入返售金融资产，8 交易性金融资产，10 其他债权投资，11 其他权益工具投资，12 应收融资租赁款及长期应收款，以及 15 固定资产”的相关内容。

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

适用 不适用

报告期末，集团长期股权投资 47.08 亿元，较上年末（44.28 亿元）增加 2.80 亿元，增幅 6.32%。

子公司投资参见“第十节 财务报告”中“四、合并财务报表项目注释 13. 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

适用 不适用

以公允价值计量的金融资产参见“第十节 财务报告”中“十三、其他重要事项 2 金融工具计量基础分类表”。

(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

适用 不适用

1. 海通开元，注册资本 75 亿元人民币，海通证券持有 100%的股权。截至 2021 年 6 月 30 日，海通开元总资产为 145.81 亿元，净资产 128.87 亿元；2021 年上半年，实现营业收入 14.92 亿元，净利润 10.88 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 2021 年 6 月 30 日，海通国际控股总资产为 3,082.41 亿港元，净资产 392.43 亿港元；2021 年上半年，实现收入 63.34 亿港元，净利润 18.47 亿港元。

3. 海通创新证券，注册资本 93 亿元人民币，海通证券持有 100%的股权。截至 2021 年 6 月 30 日，海通创新证券总资产为 164.41 亿元，净资产 159.11 亿元；2021 年上半年，实现营业收入 13.28 亿元，净利润 10.24 亿元。

4. 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 2021 年 6 月 30 日，海通资管公司的总资产为 102.46 亿元，净资产 49.10 亿元；2021 年上半年，实现营业收入 10.00 亿元，净利润 5.55 亿元。

5. 上海泽春, 注册资本 1 亿元人民币, 海通证券持有 100%的股权。截至 2021 年 6 月 30 日, 上海泽春的总资产为 4.06 亿元, 净资产 1.29 亿元; 2021 年上半年, 实现营业收入 2.81 万元, 净利润 -787.38 万元。

6. 上海惟泰置业, 注册资本 1000 万元人民币, 海通证券持有 100%的股权。截至 2021 年 6 月 30 日, 上海惟泰置业的总资产为 1.48 亿元, 净资产 0.10 亿元; 2021 年上半年, 实现营业收入 0.30 亿元, 净利润-8.41 万元。

7. 海富产业, 注册资本 1 亿元人民币, 海通证券持有 67%的股权。截至 2021 年 6 月 30 日, 海富产业总资产为 3.20 亿元, 净资产 1.91 亿元; 2021 年上半年, 实现营业收入 0.58 亿元, 净利润 0.18 亿元。

8. 海通期货, 注册资本 13.015 亿元人民币, 海通证券持有 66.667%的股权。截至 2021 年 6 月 30 日, 海通期货总资产为 481.04 亿元, 净资产 30.43 亿元; 2021 年上半年, 实现营业收入 45.00 亿元, 净利润 2.05 亿元。

9. 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 2021 年 6 月 30 日, 海富通基金总资产为 30.06 亿元, 净资产 16.88 亿元; 2021 年上半年, 实现营业收入 6.37 亿元, 净利润 1.72 亿元。

10. 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 2021 年 6 月 30 日, 富国基金总资产为 95.91 亿元, 净资产 57.32 亿元; 2021 年上半年, 实现营业收入 39.98 亿元, 净利润 12.42 亿元。

(七) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

公司对由子公司作为管理人的结构化主体, 综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报, 或承担的风险敞口等因素, 认定将 70 个结构化主体纳入合并报表范围。

(八) 募集资金使用情况

经中国证券监督管理委员会《关于核准海通证券股份有限公司非公开发行股票的批复》(证监许可[2020]1038 号文)核准, 公司非公开发行人民币普通股(A股)1,562,500,000 股, 于 2020 年 8 月 5 日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕登记托管手续, 每股发行价格为人民币 12.80 元, 募集资金总额为人民币 20,000,000,000.00 元, 扣除发行费用人民币 159,829,525.00 元(含增值税)后, 实际募集资金净额为人民币 19,840,170,475.00 元。上述非公开发行 A 股募集资金已于 2020 年 7 月 27 日到位, 全部存入公司开立的募集资金专户, 已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证并出具德师报(验)字(20)第 00354 号验资报告。

公司关于非公开发行 A 股股票申请文件中承诺募集资金主要用于以下方面:

- (1) 不超过 60 亿元将用于发展资本中介业务, 提升金融服务能力;
- (2) 不超过 100 亿元将用于扩大 FICC 投资规模, 优化资产负债结构;

- (3) 不超过 15 亿元将用于加大信息系统建设，提升公司信息化水平；
- (4) 不超过 20 亿元将用于增加投行业务资金投入，促进投行业务发展；
- (5) 不超过 5 亿元将用于补充营运资金。

截至报告期末，募集资金已全部使用完毕，其中发展资本中介业务使用 60 亿元，FICC 投资使用 100 亿元，信息系统建设使用 15 亿元，投行业务资金投入 20 亿元，补充营运资金约 3.4 亿元。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险及风险应对措施

√适用 □不适用

1. 风险管理概述

公司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。

公司根据《证券公司全面风险管理规范》等监管要求及内部制度，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，推进集团风险管理向纵深发展：公司搭建了层级分明的风险管理组织架构，覆盖各风险类别、各业务条线、各部门/分支机构/子公司，不断完善风险识别、评估、计量、监控、报告和应对等风险管理流程，规范各类业务开展，加强风险的事前防范、事中监控和事后检查处置；公司建立了监管指标、风险容忍度和风险限额指标、业务风控指标等三层风险控制指标体系，通过系统实现动态监控和自动预警，开展压力测试以评估极端风险，同时以同一业务、同一客户管理为框架，建立集团风险限额体系，向部门、子公司进行拆解，并开展日常监控工作；公司针对市场风险、信用风险、流动性风险开展计量，建立模型管理机制和流程，并持续对模型开展评估和验证；公司将子公司风险纳入报告范围，定期编制集团风险日报、月报、季报、半年/年报，并针对重大风险事件编制专项报告；公司根据风险评估和预警的结果，选择合适的应对策略，建立了有效的应对机制以及具有可操作性的应急预案。此外，公司从风险文化宣导、风险管理制度建设、风险管理信息系统搭建、风险数据治理、风险管理人才队伍建设、风险管理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、经理层建立和实施风险管理及内部控制的情况进行监督，并履行公司章程规定的其他职责。

公司经营层根据董事会的授权，负责建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的政策、规章和制度，贯彻执行公司整体风险偏好和风险容忍度政策，组织实施各类风险的识别、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，公司合规法务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的信息技术风险。

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具体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。

子公司风险管理方面，各子公司规范运作，依法经营，公司通过各项机制将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，具体从子公司风险管理负责人提名、下达风险限额指标、风险事件及风险评估报告、重大事项审批、风险数据纳入公司统一管理、督导与检查、风险管理考核等方面切实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

公司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

《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》所称合规风险，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（包括各部门、各分支机构、各子公司）分工明确，协调互动。公司已制定《海通证券股份有限公司合规管理办法》及相关配套合规管理制度，并配置合规管理人员队伍体系，严格对各业务条线进行合规管理，通过合规事前审查、事中监控、事后检查、考核及问责，努力提高各项制度、机制及流程的执行力度，同时，公司加大政策传导及合规宣导工作力度，积极培育“人人合规、主动合规”的经营环境。

2021 年上半年，为有效防范公司合规风险，推动公司合规管理有效运行，促进公司持续、健康、合规发展，公司不断强化合规事前审查、事中监控、事后检查、考核及问责等职能履行，继续夯实集团合规管理，推进集团中央控制室及信息隔离墙建设，加强集团规章制度梳理，加大合规检查力度，对证券业务合规管理要求开展广泛宣导，持续培育一线“人人合规、主动合规”的环境。

（2）洗钱及恐怖融资风险

《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》中包含了洗钱、恐怖融资和扩散融资风险管理的具体要求。公司面临的洗钱、恐怖融资和扩散融资风险是指公司的产品或服务被不法分子利用从事洗钱、恐怖融资、扩散融资等活动的可能性。

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。公司已制定较为完备的反洗钱内控制度体系，其中包含反洗钱基本制度、实施细则以及多项反洗钱专项制度，并在公司档案管理、合规考核、处罚细则等保障制度中涵盖反洗钱相关内容。公司已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。

2021 年上半年，公司启动反洗钱 V8 系统升级项目，实现以“客户”为单位开展客户洗钱风险等级划分管理和可疑交易监测分析工作，进一步完善系统功能和优化系统监测模型，以提升反洗钱工作效率。同时，公司进一步深入开展客户数据治理工作，持续督导分支机构做好客户身份识别工作。另外，公司逐步研究、探索新科技在反洗钱领域的应用，不断提高反洗钱工作效率和履职能力。面对全面依法从严的监管环境，公司不断加强反洗钱履职能力，提升反洗钱合规管理水平。

（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对本集团经营造成损失的风险。

A、存放在其他金融机构的自有货币资金、经纪业务相关风险

公司的货币资金主要存放在国有商业银行或信誉良好的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，此类现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。经纪业务采取全额保证金结算，切实规避相关信用风险。

B、交易性融资业务相关风险

本集团开展的交易性融资业务主要包括：融资融券、股票质押式回购、孖展交易、约定购回式证券交易等。相关主体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。报告期内，本集团相关主体持续强化授信和集中度管理机制，动态优化针对特定客户类群的信用评级和担保证券折算率模型，将环境、社会和公司治理风险评估纳入风险评估环节，主动调整资产组合结构和推进风险化解程序。

C、信用债券交易与投资业务相关风险

公司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。

D、融资租赁业务相关风险

本集团在开展融资租赁业务、支持实体经济发展时，坚持以行业与客户并重的策略确定信用风险管理政策。行业信用风险管理方面，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。客户信用风险管控方面，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。

E、债券回购等同业短期拆借、场外衍生品业务相关风险

针对债券回购等同业短期拆借业务，公司以交易对手准入和授信管理为抓手，审慎筛选信用资质良好的交易对手和信用等级较高的担保证券，从源头上控制信用风险水平。针对场外衍生品业务，公司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。公司同业短期拆借和场外衍生品业务的交易对手主要是商业银行、证券公司、资产管理计划等主体，公司在开展此类业务的过程中，合理选择业务模式、严格控制业务规模并采取合理的风控措施。同时，公司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，持续完善集团化信用风险管理体系。报告期内，集团各主体以集团信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的集团化信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作，包括以集团 T+1 风险数据集市为依托，建立健全可覆盖母子公司业务的集团化信用风险管理信息系统，通过提升风险识别、计量与压力测试能力在集团层面持续完善资产质量、风险抵补和集中度风险等维度的信用风险限额体系，着力推进集团化统一评级与集中授信管理机制，搭建以金融科技为支撑的客户关系图谱、舆情风险监控及高风险客户管控工具，强化集团各主体信用类业务风险资产系统化报送程序，以此实现对集团整体信用风险状况和风险限额执行情况的有效跟踪和监控。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，加强存续项目的跟踪、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 281.74%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为 236.69%，股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为 304.54%，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。

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。

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。

C、汇率风险。汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。报告期内，本集团国际化布局不断完善，面对复杂多变的境外市场，主动降低境外资产杠杆水平，整体外币资产规模有所减少，汇率风险敞口也相应降低。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，以缩小外汇风险的敞口，

还采用境外经营净投资套期等方法平滑外汇敞口对集团经营成果的影响。截至报告期末，本集团的汇率风险对财务报表无重大影响。

除上述风险因素之外，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办法的有关要求，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，要求子公司在日常经营活动中严格落实执行，并按要求向母公司提交风险报告。本集团基于 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 0.3%以内，市场风险可控可承受。

（5）操作风险

操作风险指由内部流程缺陷、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给公司造成损失的风险。操作风险贯穿于公司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。

公司根据操作风险管理办法，利用风险与控制自我评估、关键风险指标、损失数据收集等工具，开展操作风险识别、评估、监测、应对、报告等工作。公司在集团范围内开展风险与控制自我评估，梳理更新业务流程，识别主要业务流程中的风险点，评估固有风险等级、控制措施有效性及剩余风险等级；建立了覆盖集团主要部门、单位的关键风险指标体系，定期收集指标值并监测其动态变化；在集团范围内开展操作风险损失数据收集，汇总分析相关信息并跟进风险缓释措施的进展。

报告期内，公司及相关子公司因违反银行间市场相关自律管理规则及在开展债券投资顾问、私募资产管理业务过程中的违规行为被监管机构及银行间交易商协会采取监管措施。公司对此高度重视，及时根据监管要求全面、深入落实相关整改工作。

信息技术风险方面，公司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故应急预案，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。公司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，报告期内未发生重大信息技术风险事件。

(6) 流动性风险

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

在日间流动性风险管理方面，公司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，始终将流动性风险敞口控制在合理范围内，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，保持资产负债期限错配始终处于合理范围；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，凸显集团在管理调控信息方面的优势，公司以集团流动性支持管理办法作为整体管理方针，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 327.51%，净稳定资金率日均 162.96%，均高于监管要求及预警标准。

(7) 声誉风险

声誉风险是指由证券公司经营管理及其他行为或外部事件导致证券公司股东、员工、客户、第三方合作机构及监管机构等对证券公司的公开负面评价的风险。

公司高度重视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，加强境内外舆情信息监测，在中国内地和中国香港建立传播渠道，争取宣传主动，为公司发展营造良好的舆论环境。报告期内，公司开展持续有效的舆情监测和应对工作。针对少数负面舆情，能够科学判断、快速反应、主动应对。实时掌握舆情动态和趋势，与主流媒体保持良好互动，积极做好舆论引导。围绕公司经营业绩和业务发展情况，有节奏有重点地在各类主流媒体刊发文章，切实维护公司声誉，传播品牌形象。报告期内，集团总体舆论环境良好。

(二) 其他披露事项

√适用 □不适用

经营计划进展说明

2021 上半年，在总体战略的指引下，公司深入践行服务国家战略和实体经济，扎实做深服务价值链和客户生态圈，经营工作平稳有序，疫情防控严密有效，收入结构持续改善，重点业务取得突破、精细化管理工作稳步推进，为“十四五”开好局起好步打下坚实基础。在大投行业务条线，积极把握“销售为王”时代的脉搏，深化全能投行建设；公司股权融资业务进一步强化承揽与销售定价能力建设，深度挖掘核心机构，精准把握发行窗口，全力推进项目进程；债券融资业务加强合规管理和质量控制，各项经营指标保持稳定；并购融资业务克服市场活跃度不断下降的不利影响，抓住国资国企并购和控制权收购的市场机遇，积极承揽、逆势布局。在财富管理业务条线，公司经纪业务稳中求进，全面加强了机构客户营销及零售客户服务的深度和广度，核心客户服务能力取得突破；金融产品业务在体制、机制的改革创新上做了尝试，推动产品销售流程化管理；融资类业务资产质量保持较好水平，风险处置取得实质进展，尤其是融资融券业务快速发展；期货业务总体继续保持行业前列。在交易及机构业务条线，公司继续保持在 QFII/RQFII 市场第一梯队；权益、固定收益投资收益均表现良好，并重点发力资本中介业务；基金托管外包业务优化运营流程、深化综合服务转型；研究服务持续打造品牌化、国际化战略优势。在资产管理业务条线，资管子公司主动管理规模占比进一步提升，大集合产品按公募产品标准改造顺利推进；公募基金子公司积极把握市场机遇，继续保持良好的发展态势；私募基金子公司继续深化集中统一管理，稳步推进基金“募投管退”。在国际业务与租赁业务条线，海通国际坚持稳健经营，继续保持在港投行标杆地位；海通银行克服海外疫情不利影响，整体经营状况持续改善，在澳门设立分行事项获得澳门特别行政区行政长官的许可；海通恒信坚持回归租赁本源，保持战略定力，持续构建专业化生态圈服务实体经济。报告期内，公司各个业务条线均取得了不俗成绩的同时，在管理工作方面，公司不断提升财务资金精细化管理水平，全面强化合规风控工作，持续

推进科技规划实施，切实加强人力资源保障，并大力推动基建和后勤管理工作，为公司持续健康发展打下坚实的基础。

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
2020 年度股东大会	2021 年 6 月 18 日	http://www.sse.com.cn	2021 年 6 月 19 日	详见下文“股东大会情况说明”

注：上述会议决议公告请参阅会议当日的香港交易所披露易网站，次日的上交所网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》及本公司网站。

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

适用 不适用

本报告期内，公司于 2021 年 6 月 18 日在海通证券大厦召开了 2020 年度股东大会，审议并通过 8 项议案：1. 公司 2020 年度董事会工作报告；2. 公司 2020 年度监事会工作报告；3. 公司 2020 年年度报告；4. 公司 2020 年度财务决算报告；5. 公司 2020 年度利润分配预案；6. 公司关于续聘会计师事务所的议案；7. 关于预计公司 2021 年度日常关联/连交易的议案；8. 关于提请股东大会给予董事会认可、分配或发行 A 股及/或 H 股股份的一般性授权的议案。其中议案 1 至议案 7 为普通决议案，议案 8 为特别决议案。以上议案均经审议通过。相关决议公告于会议当日刊登在香港联交所网站（<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

适用 不适用

姓名	担任的职务	变动情形
赵永刚	职工代表监事，监事会副主席	选举
吴红伟	职工代表监事，监事会副主席	离任

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

公司于 2021 年 6 月 11 日发布了《关于变更职工代表监事的公告》（公告编号：临 2021-020），吴红伟先生因工作调动原因，于 2021 年 6 月 11 日辞去公司第七届监事会副主席及职工代表监事职务。公司于 2021 年 6 月 11 日以通讯方式召开了第四届职工代表大会第十一次会议，选举赵永刚先生为公司第七届监事会职工代表监事；同日，公司召开第七届监事会第十次会议（临时会议），选举赵永刚先生为公司第七届监事会副主席。赵永刚先生自 2021 年 6 月 11 日起担任公司第七届监事会职工代表监事及监事会副主席。

三、董事、监事、高级管理人员及公司治理其他情况说明

（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 2021 年 1 月 1 日起至 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

董事屠旋旋先生自 2021 年 3 月起不再担任上海正浩资产管理有限公司董事长、法定代表人。屠旋旋先生自 2021 年 3 月起担任上海临港经济发展（集团）有限公司董事。

董事周东辉先生自 2021 年 1 月起担任中国太平洋保险（集团）股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 601601；于香港联交所上市，股份代号为 02601）非执行董事。

董事许建国先生自 2021 年 3 月起不再担任东方证券股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600958；于香港联交所上市，股份代号为 03958）非执行董事。许建国先生自 2021 年 2 月起担任上海电气香港有限公司执行董事。

独立董事张鸣先生自 2021 年 6 月起担任上海张江高科技园区开发股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600895）独立董事。

独立董事林家礼先生自 2021 年 3 月起不再担任奥柏中国集团有限公司（该公司于香港联交所上市，股份代号为 8148）独立非执行董事；自 2021 年 6 月起不再担任 Sunwah International Limited（该公司于多伦多证券交易所上市，股份代号为 SWH）独立董事。林家礼先生自 2021 年 6 月起担任麦格里集团亚洲区高级顾问；自 2021 年 5 月起担任香港航天科技集团有限公司（该公司于香港联交所上市，股份代号为 1725）非执行董事。

独立董事朱洪超先生自 2021 年 2 月起担任三盛控股（集团）有限公司（该公司于香港联交所上市，股份代号为 2183）独立非执行董事；2021 年 6 月起担任上海百联集团股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600827）独立董事。

监事阮峰先生自 2021 年 6 月起担任绿色发展基金私募股权投资管理（上海）有限公司监事。

除上述披露者外，概无其他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

根据香港上市规则第 19A.54 及 19A.55 条，本公司已与各董事及监事就（其中包括）遵守相关法律及法规和遵从公司章程及仲裁条文订立合约。除上述披露者外，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，本集团雇员人数 11,433 人。其中本公司雇员人数 6,077 人，子公司雇员人数 5,356 人。

本公司重视人才的吸引、激励、培养和保留，不断检视和优化公司薪酬体系，坚持市场化分配、绩效导向、兼顾公平的激励原则。本公司雇员薪酬由固定薪酬、绩效薪酬和福利三部分构成。依据适用的中国法律法规，本公司为雇员建立各项社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险及生育保险）、住房公积金，并依据法规足额缴纳上述各项社会保险费和住房公积金。本公司建立企业年金计划，为雇员提供补充养老保障，并为雇员投保补充医疗保险和人身意外保险。

根据适用的中国法律法规，本公司与每位雇员签订劳动合同，建立劳动关系。劳动合同包含关于合同期限、工作时间和休息休假、劳动报酬和保险福利、劳动保护和劳动条件、合同的变更及解除等条款。

（五）员工培训

2021 年上半年，公司培训工作坚持创新发展，统筹管理，坚持平台思维、共建共享，通过线上线下相结合的系统化管理和整体化运营，着力建设全流程、系统化、多维度的素质培养体系，积极构建集团层面培训生态圈，助力公司人才发展及梯队建设。海通财富管理学院充分发挥桥梁纽带作用，分别从“功能上新、活动上新、内容上新”三个方面综合运维，有效支持各类线上业务培训的有效开展，助力员工专业素质能力的持续提升；重点培训项目做精做细，新任干部培训紧扣主题强调实战实效，新员工培训创新形式突出行业文化；海通财富讲堂线上线下同步举办，内容涵盖宏观视野、时政热点、通用技能等多元化主题；“蒲公英计划”在统筹开发内部精品课的基础上，做到专题培训的定制化和个性化，有力促进了内部的业务交流和协同；“听书训练营”、“劳动最光荣”等线上主题活动持续举办，积极打造学习文化。

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2021年6月18日召开2020年度股东大会，审议通过了公司2020年度利润分配预案：以截至2020年12月31日本公司A股和H股总股本共计13,064,200,000股为基数，向全体股东每股派发现金红利人民币0.25元（含税），共计派发现金红利人民币3,266,050,000.00元（含税）；其中A股股本为9,654,631,180股，本次共计派发A股现金红利人民币2,413,657,795.00元；H股股本为3,409,568,820股，本次共计派发H股现金红利港币1,032,872,275.18元。

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、香港联交所网站及本公司网站刊登了2020年度利润分配实施的有关公告，并于2021年7月29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	否
---------	---

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

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

于截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间，海通国际在 2015 年购股权计划下有 1,350,000 份购股权获行使；另有 20,781,095 份购股权于期内因购股权行使期限届满及员工辞职等原因失效。

于 2021 年 6 月 30 日，海通国际已发行但未获行使的购股权情况如下：

购股权计划	已发行但未获行使购股权数量（注）	每股行使价（注）	行权期限
2015 年购股权计划	8,409,204 份	5.002 港元	2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日
	14,433,016 份	2.898 港元	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
	8,384,184 份	2.554 港元	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
	8,745,000 份	1.727 港元	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
合计	39,971,404 份		

注：购股权数量及购股权行使价格可因供股、以股代息、红股发行或公司股本的其他类似变动而进行调整。

根据 2015 年购股权计划尚未行使的购股权约占海通国际 2021 年 6 月 30 日已发行股份约 0.66%，若余下购股权获悉数行使，在海通国际目前的资本结构下，将须额外发行 39,971,404 股海通国际普

通股，而海通国际的股本将额外增加约 3,997,000 港元，股本溢价约为 116,408,000 港元（未扣除发行开支）。详情请参阅海通国际（股份代号：665）于香港联交所网站刊发的 2021 年中期报告。

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 3 次，监事会 3 次，审计委员会 3 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，发展战略与投资管理委员会 1 次，合规与风险管理委员会 2 次，共计 16 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 2021 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，非执行董事 4 名，独立非执行董事 4 名。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投资管理委员会、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，发展战略与投资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瞿秋平担任，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，包括张鸣先生（主任委员）、余莉萍女士、许建国先生、林家礼先生和周宇先生。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。审计委员会已审阅并确认本集团截至 2021 年 6 月 30 日六个月的中期业绩及半年度财务报告，未对本集团所采用的会计政策及常规提出异议。

（三）关于监事和监事会

截至 2021 年 6 月 30 日，公司监事会由 8 名监事组成，其中职工代表监事 3 名，非职工代表监事 5 名，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。2021 年上半年，公司通过创新沟通渠道，利用电话会议、网络互动等方式持续加强与投资者沟通，围绕本公司所处历史方位、战略选择和资本市场改革等思考，向境内外投资者和分析师全面、深入地介绍本公司的经营业绩和经营战略背后的逻辑和策略。报告期内，公司举办 2020 年度业绩发布会，公司管理层高度重视与投资者沟通交流工作，董事长、总经理出席发布会，详细解答投资者所关注的问题。此外，公司受邀参加多家境内外投行举办的投资者论坛，接待境内外投资者现场及电话调研余 40 次，并通过接听数投资者热线，回复上证 e 互动留言等措施有效满足了境内外投资者、分析师与本公司的交流需求。

（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和合规管理提供了人力、物力、财力和技术支持，为合规管理提供了保障。报告期内，本公司加强合规事前审查、事中监测、事后检查、考核及问责等，努力提高各项制度、机制及流程的执行力度，稳步有序开展合规管理基础工作。同时，本公司继续夯实集团合规管理，推进集团中央控制室建设，加强规章制度梳理，加大合规检查力度，对证券业务合规管理要求开展广泛宣导，贯彻“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，持续培育一线“人人合规、主动合规”的环境。

第五节 环境与社会责任

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

适用 不适用

1. 因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

经核查，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

适用 不适用

公司倡导绿色低碳办公，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》等法律法规，号召全体员工将节能环保理念融入工作和生活，致力于节约资源、保护环境、减少污染。

公司鼓励员工节约用水，优先采购节水器具，发现跑冒滴漏后及时维修，下班后由巡视员检查关闭水龙头，避免水资源浪费；同时，公司严格按照《上海市生活垃圾管理条例》对废弃物进行分类处理。对于办公及生活垃圾，由公司物业统一收集后进行清运；对于电子废弃物、硒鼓墨盒、碳粉盒等有害废弃物，公司设置定点存放，定期委托有资质的公司进行回收处置。

此外，随着信息技术水平的不断提升，公司借助协同办公系统、RPA 智能流程自动化机器人、投行类业务工作底稿管理系统、场外衍生品管理系统、智能审核系统等，营造信息化、无纸化的办公模式，在提升工作效率的同时，减少纸张等的使用。

报告期内，公司顺利投产了新一代协同办公系统，以即时通讯、知识检索、报表门户等为亮点功能，为员工提供统一的智慧办公协同平台；以新闻、协同、知识等无形资产和能力为核心管理要素，

实现无纸化，全面支撑各类协作业务。报告期内，办公系统日均在线超过 4,000 人，其中移动端日均在线超过 1,400 人；视频会议总共召开超过 1,450 场，总共线上会议时长约 2,300 小时；在线总计处理各类流程业务单 120 万余次。公司智能审核系统于报告期累计完成 1,500 余篇文档审核、50 余万项数据检查，节省人工近 60%的复核时间，同时将传统的线下审核场景线上化，每个项目减少近 1,000 张打印文档。

(五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

√适用 □不适用

作为金融服务企业，公司碳排放的主要来源为日常运营过程中耗电、天然气以及公务用车耗油产生的碳排放。报告期内，公司大力推行节能减排措施，以实际行动践行环保理念。

在办公过程中，公司倡导合理用电，夏天空调温度不低于 26℃，冬天不高于 20℃；办公设备未使用时设置休眠，避免灯光及办公设备的无效运作；定期保养自有车辆，以保障车辆性能，提高汽油利用率；合理利用视频会议系统，减少差旅出行频次，降低因差旅产生的温室气体排放。

与此同时，公司积极响应《关于加强绿色数据中心建设的指导意见》，加快绿色数据中心建设。数据中心充分利用云计算、虚拟化技术的优势，将规模化和智能化有机结合，建设的混合金融云平台具有智能按需配置、动态管控资源的特点，可以最大化利用硬件平台的各类资源，进一步降低设备能耗。

截至报告期，混合金融云平台桌面云使用了 82 台计算资源主机节点，运行桌面虚拟机 4,100 个，半年实现节电约 46 万度；测试云和生产云平台共使用宿主机约 600 台，运行虚拟机 4,800 余台，有序回收主机 800 多台，半年节约用电约 216 万度。

此外，公司张江数据中心采用水冷系统供冷，并配置制冷量大小不等的 1 台螺杆式冷水机组及 2 台离心式冷水机组，在不同 IT 负载情况下，可选择最优方式开启对应的冷水机组节能运行。系统配置了 2 台换热量为 5,800KW 的板式热交换器，冬季低温环境下，可充分利用自然冷源节能运行。同时，系统中冷却塔、冷却水泵、冷冻水泵均配置了变频器，可根据 IT 负载，通过水冷群控系统，实时调整运行频率，节能降耗。

二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

√适用 □不适用

2021 年是中国共产党成立 100 周年，也是国家从脱贫攻坚战略向乡村振兴战略衔接的关键之年。在中国证监会、上海市委市政府的正确领导下，海通证券继续深入推进“一司一县”和“双一百”结对帮扶工作，助力安徽利辛、安徽舒城、江西宁都、云南西畴、新疆叶城等五个脱贫县，以及云南西畴三个脱贫村巩固脱贫攻坚成果，结合“我为群众办实事”实践活动，开展“建党百年，志愿礼赞”系列公益活动，努力解决脱贫县群众实际问题，助力脱贫县区域经济提升，实现高质量发展。

(一) 续写情谊，做好帮扶支援工作

2020 年 11 月，海通证券党委与云南省西畴县中寨村、么铺子村和王家塘村续签“百企帮百村”结对协议，与云南西畴、新疆叶城、安徽利辛和舒城、江西宁都等 5 个脱贫县签订乡村振兴结对帮扶协议。2021 年上半年，公司认真贯彻党中央“四不摘”要求，持续向结对县投入帮扶资金，其中向“双一百”结对村划付 150 万元，支持三村开展烤烟产业、山泉水加工产业发展，支持当地教育基础设施建设；向江西宁都划付 100 万元，支持当地长盛中心卫生院建设；支持安徽舒城三线文化保护建设项目；支持新疆叶城教育事业，完成建设安全教室、舞蹈教室、幼儿园运动场地建设，支持“宝叶助研”教研水平提升项目。

（二）金融赋能，为帮扶县注入发展动力

2019 年，公司为安徽利辛成功发行业内首单“扶贫债+信用保护凭证”，以海通信用赋能利辛县通过市场化手段募集资金，并于 2020 年帮助利辛县成功发行第二期。2021 年上半年，公司结合前期项目调研，为利辛县政府撰写了一份县域发展报告，入选中国证券业协会帮扶报告汇编。

（三）消费助力，将帮扶工作融入企业文化建设

2020 年，公司挖掘云南西畴优质药材“三七”，制作公司特色扶贫礼品“海通三七粉”，暗合海通证券“600837”的股票代码，获得合作伙伴和客户的认可和欢迎。2021 年上半年，公司又采购了价值 299,000 元的云南特色“针棒”、“针好”茶叶作为公司礼品。子公司惟泰置业积极采购特色农产品作为员工食堂原材料。

（四）学史力行，认真落实 2021 年“爱在海通”公益清单

2021 年 3 月，公司启动“爱在海通 志愿礼赞”系列公益项目，结合党史学习教育，按照“学党史 悟思想 办实事 开新局”的要求，充分利用组织覆盖“点多面广”的特点，组织公司系统全体党工团组织认真落实“爱在海通”公益清单项目。依托海通证券国家级投资者教育基地平台优势，公司各级党团组织走进全国 30 个省市自治区的 50 余所学校，为 37,110 名学生开展了“彩虹课堂”青少年财商教育，为脱贫地区青少年从小建立正确的理财观和金融风险防范意识。公司继续在新疆喀什和西藏日喀则地区开展“爱在海通·美丽助学”公益行动，截至目前累计结对帮助 50 名藏族大学生和 100 名喀什地区小学生。公司积极向合作伙伴和客户企业传递“爱在海通”公益理念，2021 年 6 月携手 TCL 公司向新疆喀什地区的叶城县、莎车县和巴楚县 30 所幼儿园捐赠了市场价值 60 万元的多媒体教学一体机设备。2021 年“爱在海通·美丽庭院”项目也在河南省兰考县顺利推进，为建设美丽乡村贡献力量。

下一步，海通证券将继续在上级领导下，坚持履行国有金融企业社会责任，为助力乡村振兴战略贡献更大力量。

三、积极履行社会责任的其他工作

2021 年 7 月，河南郑州等地遭遇有记录以来史上最强降雨，防汛形势异常严峻。面对汹涌而来的汛情，海通证券党委认真学习贯彻习近平总书记关于防汛救灾工作的重要指示精神，高度重视、积极应对，在全力保障在豫员工生命安全的同时，积极履行国有金融企业的责任担当。公司党委研究决定，

捐赠 500 万元救灾资金，并组织专门力量，将公益资金转化为一线紧缺物资，全力驰援河南抗汛救灾。截至 2021 年 7 月底，海通证券累计向河南受灾地区捐赠了价值近 200 万元的抗汛和慰问物资，有力支援了当地的抗汛救灾工作，帮助受灾群众重建家园。

为了做好精准救助，发挥救灾资金的最大效能，公司党委总揽全局、协调各方，指导河南分公司党总支第一时间排摸受灾地区实际情况登记需求清单，动员各业务条线、职能部门、分支机构积极配合，从客户企业中寻找物资资源。最终，通过在河南市场“急”采和向全国客户企业“集”采相结合的方式，公司第一时间向河南捐赠了 360 余台发电机、500 余台排水泵等紧缺救灾设备，5000 平方米无纺土工布、5200 平方米反渗水布、10 条皮划艇等防汛救援物资，以及饮用水、粮油等救灾食品和医疗用品。党员突击队风雨逆行五昼夜，奔赴周口扶沟、鹤壁浚县、新乡卫辉等三个洪涝重灾区，抢在河南疫情散发前的窗口期，分别于 2021 年 7 月 27 日、29 日和 30 日，将救灾物资分三批送达受灾地区。

下一步，公司将结合疫情防控常态化要求，完成后续物资采购捐赠工作。

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

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	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
与再融资相关的承诺	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	是	-	-
	股份限售	上海海烟投资管理有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 18 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 18 个月	是	是	-	-
	股份限售	光明食品（集团）有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 18 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 18 个月	是	是	-	-
	股份限售	上海电气（集团）总公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 18 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 18 个月	是	是	-	-
	股份限售	UBS AG	自本次非公开发行的股票上市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日起 6 个月	是	是	-	-
	股份限售	嘉实国际资产管理有限公司	自本次非公开发行的股票上市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日起 6 个月	是	是	-	-
	股份限售	中国华融资产管理股份有限公司	自本次非公开发行的股票上市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日起 6 个月	是	是	-	-
	股份限售	上海兰生股份有限公司	自本次非公开发行的股票上市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日起 6 个月	是	是	-	-
	股份限售	上海城投控股股份有限公司	自本次非公开发行的股票上市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日起 6 个月	是	是	-	-
	股份限售	富安达基金管理有限公司	自本次非公开发行的股票上市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日起 6 个月	是	是	-	-
股份限售	JPMorgan Chase	自本次非公开发行的股票上	自 2020 年 8 月 5 日	是	是	-	-	

		Bank , National Ass ociation	市之日起锁定 6 个月	起 6 个月				
股份限售		齐鲁中泰私募基金 管理有限公司	自本次非公开发行的股票上 市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日 起 6 个月	是	是	-	-
股份限售		湾区产融投资（广 州）有限公司	自本次非公开发行的股票上 市之日起锁定 6 个月	自 2020 年 8 月 5 日 起 6 个月	是	是	-	-
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 续推出公司股权激励政策，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	是	-	-
资产注入		公司	自本承诺出具之日至本次募 集资金使用完毕前或募集资 金到位 36 个月内，本公司不 再新增对类金融业务的资金 投入（包含增资、借款、担保 等各种形式的资金投入）	自 2019 年 9 月 26 日 起至本次募集资金 使用完毕前或募集 资金到位 36 个月 内	是	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、半年报审计情况

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：

公司与南一农公司、红太阳集团、南京世界村质押式证券回购纠纷案

因南京第一农药集团有限公司（简称“南一农公司”）拒绝依约履行股票质押购回义务，公司向上海金融法院起诉，要求融资人南一农公司支付本金人民币 30,000 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，要求担保人红太阳集团有限公司（简称“红太阳集团”）、南京世界村汽车动力有限公司（简称“南京世界村”）承担保证责任。2020 年 5 月 19 日，上海金融法院正式受理本案，并于 2020 年 11 月 12 日开庭，2021 年 4 月上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。2021 年 6 月南一农公司已被南京高淳区法院裁定破产重整，公司将根据南一农公司破产重整进展进行债权申报、参加债权人会议等。

公司与红太阳集团、南一农公司、杨寿海、杨柳、南京振邦、江苏振邦融资融券交易纠纷案

因红太阳集团融资融券期限到期后未能按照《融资融券合同》约定按时归还融资本金、证券及利息等相关费用，构成违约。公司向上海金融法院起诉，要求融资人红太阳集团支付融资负债本金人民币 25,771.18 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，并要求南一农公司、杨寿海、杨柳、南京振邦投资发展有限公司（简称“南京振邦”）、江苏振邦农作物科技有限公司（简称“江苏振邦”）承担相应担保责任。2021 年 1 月 13 日，上海金融法院正式受理本案，目前尚未开庭。

海通资管与孙军质押式证券回购纠纷案

因孙军质押其持有的吉药控股（证券代码：300108）股票并向上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资管”）管理的资管计划融入资金，质押交易违约，海通资管向上海金融法院起诉，要求债务人支付本金 10,800 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等。2020 年 4 月 1 日，法院正式受理该案件，2020 年 11 月 19 日一审开庭，2021 年 1 月 21 日，法院作出一审判决，支持海通资管诉讼请求。海通资管已申请强制执行。

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（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及包括上海富诚海富通资产管理有限公司（简称“富诚海富通”）在内的相关中介机构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 52,657.98 万元以及相应的利息等。2020 年 11 月 12 日，法院正式受理本案，并于 2021 年 7 月 9 日第一次开庭。目前法院尚未作出一审判决。

上述案件中涉及的潜在损失已根据相关规定进行了充分计提。

海通资管与南京第一农药集团有限公司质押式证券回购纠纷案

因南京第一农药集团有限公司质押其持有的红太阳（证券代码：000525）股票并向上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资管”）管理的资管计划融入资金，质押交易违约，海通资管向上海金融法院起诉，要求债务人支付本金人民币 32,000 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等。2020 年 1 月 2 日，法院正式受理该案件，2020 年 8 月 7 日一审开庭，2020 年 12 月 31 日，法院作出一审判决，支持海通资管诉讼请求。南京第一农药集团有限公司后上诉至上海市高级人民法院，上海市高级人民法院已于 2021 年 6 月 23 日维持原判。南京市高淳区人民法院已于 2021 年 6 月 3 日受理南京第一农药集团有限公司破产重整申请，法院已指定管理人。后续海通资管将代表资管计划向管理人申报债权。该案件涉及的潜在损失已在交易之前予以充分考虑，未来对本公司及海通资管的潜在损失风险较小。

海通资管与王悦质押式证券回购纠纷案

因王悦质押其持有的恺英网络（证券代码：002517）股票并向上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资管”）管理的资管计划融入资金，质押交易违约，公司向上海金融法院起诉，要求债务人支付本金人民币 13,000 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等。2020 年 5 月 11 日，法院正式受理该案，2020 年 10 月 29 日一审开庭，2021 年 2 月 25 日，法院作出一审判决，支持海通资管诉讼请求。海通资管已申请强制执行。该案件涉及的潜在损失已在交易之前予以充分考虑，未来对本公司及海通资管的潜在损失风险较小。

除上述案件外，集团内（除境外上市子公司）尚处于执行阶段的案件共 8 起，涉及案件金额 132,382.54 万元。公司境外上市子公司的重大诉讼、仲裁事宜由其按照相关上市规则自行履行信息披露

露义务。

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

√适用 □不适用

1. 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、被司法机关或纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会立案调查或行政处罚、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门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。

2. 报告期内，公司及个别分支机构存在以下被中国证监会或其派出机构采取行政监管措施的情况：

2021 年 2 月，中国证监会出具《关于对海通证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定》（〔2021〕14 号），对公司采取监管谈话措施。该监管函认定公司在履行重组上市持续督导职责过程中，未按规定履行定期回访、现场检查等程序，未按规定对所利用的会计师工作进行审慎核查；在担任财务顾问过程中，未通过函证、访谈等方式对上市公司对外担保情况等进行检查。公司收到上该监管函后，高度重视，及时进行整改，并将加强合规培训及合规检查力度，督导员工勤勉尽责，提升持续督导业务能力，夯实工作底稿，切实提高执业水平。

2021 年 2 月，中国证监会出具《关于对海通证券股份有限公司出具警示函措施的决定》（〔2021〕16 号），对公司采取警示函措施。该监管函认定公司对挂牌公司内控情况、股权情况等核查不充分。公司收到该监管函后，高度重视，及时进行整改，并将增强合规培训及合规检查力度，督导员工勤勉尽责，提升执业水平。

2021 年 3 月，中国证监会上海监管局对海通证券、海通资管在开展投资顾问、私募资产管理业务过程中相关违规行为为行政监管措施，其中对海通证券采取责令暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务 12 个月、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的监管措施；对海通资管采取责令暂停为证券期货经营机构私募资管产品提供投资顾问服务 12 个月，以及暂停新增私募资管产品备案 6 个月的监管措施；对多名直接责任人及负有管理责任的人员采取认定为不适当人选 2 年等监管措施。公司在收到上述监管函件后高度重视，及时根据监管要求进行整改，组织各相关部门及子公司深入检视业务运作情况、深刻检讨业务管控缺陷，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。

2021 年 4 月，中国证监会出具《关于对海通证券股份有限公司及江煌、张舒采取出具警示函监管措施的决定》（〔2021〕32 号），对公司及两名保荐代表人采取出具警示函的措施。该监管函认定公司及两名保荐代表人对发行人报送的非公开发行股票申请文件中，发行预案披露的收购对象间接股东的股权结构与发行保荐工作报告载明的股权结构不一致。公司收到该监管函后，高度重视，及时进行

整改，并将在其他项目执行中特别关注发行人股权结构复杂的披露，加强与监管部门的事前沟通，督导员工勤勉尽责，夯实工作底稿，切实提高执业水平。

2021 年 4 月，中国证监会出具《关于对海通证券股份有限公司及李明嘉、朱文杰采取出具警示函监管措施的决定》（〔2021〕34 号），对公司及两名保荐代表人采取出具警示函的措施。该监管函认定公司及两名保荐代表人在发行人报送的非公开发行股票申请文件中，发行预案披露的收购对象间接股东的股权结构与发行保荐工作报告载明的股权结构不一致。公司收到该监管函后，高度重视，及时进行整改，并将在其他项目执行中特别关注发行人股权结构复杂的披露，加强与监管部门的事前沟通，督导员工勤勉尽责，夯实工作底稿，切实提高执业水平。

2021 年 5 月，中国证监会江苏监管局出具《关于对海通证券股份有限公司南通人民中路证券营业部采取责令改正措施的决定》（〔2021〕46 号），对公司南通人民中路证券营业部采取责令改正措施的决定。该监管函认定南通营业部在异常交易预警、监控及处理，员工系统权限及客户交易委托记录要素等方面存在不足。公司收到该函件后高度重视，督促营业部立即整改，完善异常交易有关管控机制，持续推进对交易系统的完善，确保员工信息系统用户权限设置符合要求，切实加强异常交易监控管理和内控管理。

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

适用 不适用

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关联交易实施指引》《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 2020 年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2021 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联交易

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 10.1.3 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联人。

公司于 2020 年 8 月 6 日与上海国盛集团签署《证券和金融产品交易及服务框架协议》（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 2020 至 2022 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十次会议（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连交易执行情况如下：

单位：人民币万元

交易内容	2021 年度预计交易上限	2021 年 1-6 月实际发生金额
证券及金融产品交易		
流入 ⁽¹⁾	290,000.00	21,174.00
流出 ⁽²⁾	540,000.00	5,000.00
证券及金融服务		
本集团向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	7,000.00	101.00
本集团接受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	2,000.00	-

(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管理有限公司的关联交易

单位：人民币万元

交易内容	2021 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	52.64	0.01%	向关联人收取的投资银行业务等手续费收入
手续费及佣金收入	9.81	0.00%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	8.74	0.00%	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 (注)	(151.10)	-0.02%	报告期内名义本金发生金额 0.88 亿元，期末名义本金余额 0.88 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。

单位：人民币万元

往来项目	2021 年 6 月 30 日余额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
应收账款	90.00	0.01%	应向关联人收取的债券承销服务费余额
代理买卖证券款	55.82	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额

(2) 与持有公司重要下属子公司 10%以上股权的公司发生的关联交易

1) 与上海盛源房地产（集团）有限公司的关联交易

截至 2021 年 6 月 30 日，上海盛源房地产（集团）有限公司持有公司重要子公司海通期货 5.36% 的股权，但过去十二个月内持有海通期货股权比例超 10%，根据《上海证券交易所上市公司关联交易实施指引》第八条（五）款、第十一条第（二）款的规定，上海盛源房地产（集团）有限公司仍属于公司的关联法人。

单位：人民币万元

交易内容	2021 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	19.49	0.00%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	0.72	0.00%	关联人保证金产生的利息净收入

单位：人民币万元

往来项目	2021 年 6 月 30 日余额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
代理买卖证券款	0.01	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额

2) 与长江经济联合发展（集团）股份有限公司及其一致行动人的关联交易

截至 2021 年 6 月 30 日，长江经济联合发展（集团）股份有限公司及其一致行动人合计持有公司重要子公司海通期货 13.86% 的股权，根据《上海证券交易所上市公司关联交易实施指引》第八条（五）款的规定，长江经济联合发展（集团）股份有限公司及其一致行动人为公司关联法人。

单位：人民币万元

交易内容	2021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	1.23	0.00%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	2.78	0.00%	关联人保证金产生的利息净收入

单位：人民币万元

往来项目	2021年6月30日余额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
代理买卖证券款	1,518.5	0.01%	关联人存放公司的客户保证金余额

(3) 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：人民币万元

交易内容	2021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	12,263.50	1.71%	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	147.66	0.02%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	0.46	0.00%	关联人保证金产生的利息净收入
利息支出	2.00	0.00%	向关联人支付的带息负债利息支出
业务及管理费	0.93	0.00%	向关联人支付的销售服务费等
衍生金融工具交易净损益(注)	(261.13)	-0.04%	报告期内，名义本金发生额19.53亿元，期末名义本金余额12.96亿元

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。

单位：人民币万元

往来项目	2021年6月30日余额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
应收账款	2,226.00	0.15%	应收关联人各项业务报酬余额
应付账款	2.42	0.00%	应付关联人销售服务费余额
代理买卖证券款	275.49	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额

另外，部分商业银行、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 5.64 亿元。

(4) 与关联自然人的关联交易

报告期内，公司全体关联自然人与公司合计发生手续费及佣金收入 2.72 万元、利息净收入 0.9 万元、代理买卖证券款 170.49 万元。

(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

适用 不适用

十一、 重大合同及其履行情况

1 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

2 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
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	4,601,708,962
报告期末对子公司担保余额合计（B）	22,260,423,155
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	22,260,423,155
担保总额占公司净资产的比例（%）	12.85
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	0
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）	17,045,430,914
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）	0
上述三项担保金额合计（C+D+E）	17,045,430,914
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	无
担保情况说明	1. 2020年8月28日，公司召开第七届董事会第十一次会议，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附属公司海通银行或其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。

2. 公司全资子公司海通开元将所持有的海通恒信 2,440,846,824 股内资股划转给公司全资子公司海通创新证券。海通开元将注册资本从人民币 106.50 亿元减至人民币 75 亿元，减资人民币 31.50 亿元。公司为海通开元减资过程中未清偿债务 105,502.08 万元提供一般保证担保。此担保事项经过公司于 2021 年 1 月 29 日召开的第七届董事会第十四次会议（临时会议）审议通过。

截止 2021 年 6 月 30 日，公司的该项担保责任余额为 41,499.22 万元。

3. 2019 年 4 月 25 日，公司召开第六届董事会第三十七次会议，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 Haitong International Holdings Limited 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 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。

4. 2018 年 8 月 29 日，公司召开第六届董事会第三十一次会议，审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。公司于 2019 年 3 月 22 日作为担保人签署《贷款协议》，为境外间接全资附属公司 Haitong Investment

Ireland Public Limited Company 的银团贷款提供 3.75 亿欧元连带责任保证担保。

5. 2017 年 8 月 29 日，公司召开第六届董事会第二十五次会议，审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。公司 2018 年 5 月 14 日作为担保人签署《贷款协议》，为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供 6 亿美元连带责任保证担保。

6. 2017 年 4 月 27 日，公司召开的第六届董事会第二十四次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。公司 2017 年 6 月 8 日作为担保人签署《贷款协议》，为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供 2 亿欧元连带责任保证担保。

截止 2021 年 6 月 30 日，公司的该项担保责任余额为 1.6 亿欧元。

7. 2016 年 8 月 29 日，公司第六届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管追加净资本担保承诺及对其增加注册资本的议案》，同意公司对海通资管追加不超过人民币 40 亿元的净资本担保承诺。公司为海通资管提供最高额度为人民币 40 亿元的净资本担保承诺，并承诺当海通资管开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资本担保事宜，海通资管已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）。

8. 公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》，董事会同意本公司随时对海通资管公司提供不超过十五亿元的净资本担保承诺，以保证其净资本保持充足。2013年6月9日，上海证监局下

	发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资产担保承诺书的无异议函》（沪证监机构字[2013]145号），同意本公司向海通资管公司提供8亿元的担保承诺。本公司扣减了8亿元净资产，并相应增加海通资管公司8亿元净资产。
--	--

注：1. 报告期内子公司海通银行对外担保发生额合计（不包括对子公司的担保）为 39,160,151 欧元，按 2021 年 6 月 30 日银行间外汇市场人民币汇率中间价 1 欧元对人民币 7.6862 元换算，合计为 300,992,752 元人民币。报告期末对外担保余额合计（不包括对子公司的担保）为 105,434,880 欧元，按 2021 年 6 月 30 日银行间外汇市场人民币汇率中间价 1 欧元对人民币 7.6862 元换算，合计为 810,393,574 元人民币。

2. 截至报告期末，按 2021 年 6 月 30 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 0.83208 元、1 美元对人民币 6.4601 元、1 新加坡元对人民币 4.8027 元换算，海通国际对子公司担保余额合计 8,198,481,520 元人民币。

3 其他重大合同

适用 不适用

十二、 其他重大事项的说明

适用 不适用

海通恒信股权划转

公司第七届董事会第十三次会议（临时会议）审议通过了《关于调整限期海通开元转让海通恒信股权方案的议案》，详见公司 2020 年 12 月 30 日于上交所网站刊登的公司第七届董事会第十三次会议（临时会议）决议公告。2021 年 2 月，海通开元将所持有的全部海通恒信 2,440,846,824 股内资股划转给海通创新证券，划转对应金额为划转当月末海通开元所持有上述股份对应的账面价值。

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

适用 不适用

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5日
上海海烟投资管理有限公司	234,375,000	0	0	234,375,000	非公开发行股份限售	2022年2月7日
上海电气（集团）总公司	78,203,125	0	0	78,203,125	非公开发行股份限售	2022年2月7日
光明食品（集团）有限公司	78,125,000	0	0	78,125,000	非公开发行股份限售	2022年2月7日
UBS AG	116,406,250	116,406,250	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
嘉实国际资产管理有限公司	62,890,625	62,890,625	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
中国华融资产管理股份有限公司	39,062,500	39,062,500	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
上海兰生股份有限公司	39,062,500	39,062,500	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
上海城投控股股份有限公司	35,156,250	35,156,250	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
富安达基金管理有限公司	31,250,000	31,250,000	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
JPMorgan Chase Bank , National Association	27,734,375	27,734,375	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日
齐鲁中泰私募基金管理有限公司	23,359,375	23,359,375	0	0	非公开发行股份限售	2021年2月5日

湾区产融投资（广州）有限公司	15,625,000	15,625,000	0	0	非公开发行 股份限售	2021年2月5日
合计	1,562,500,000	390,546,875	0	1,171,953,125	/	/

二、股东情况

(一) 股东总数:

截止报告期末普通股股东总数(户)	315,236 (其中, A股 315,087; H股 149)
------------------	-------------------------------------

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

单位: 股

前十名股东持股情况							
股东名称 (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	33,200	3,408,850,695	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	234,375,000	无	0	国有法人
光明食品(集团)有限公司	-28,186,300	452,088,700	3.46	78,125,000	无	0	国有法人
申能(集团)有限公司	-27,097,000	283,485,086	2.17	0	无	0	国有法人
上海电气(集团)总公司	36,975,800	262,789,118	2.01	78,203,125	无	0	国家
中国证券金融股份有限公司	-85,797,235	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	0	235,247,280	1.80	0	无	0	国有法人
上海百联集团股份有限公司	0	214,471,652	1.64	0	无	0	国有法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
香港中央结算(代理人)有限公司	3,408,850,695	境外上市外资股	3,408,850,695				
上海海烟投资管理有限公司	400,709,623	人民币普通股	400,709,623				
光明食品(集团)有限公司	373,963,700	人民币普通股	373,963,700				
申能(集团)有限公司	283,485,086	人民币普通股	283,485,086				
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				
上海百联集团股份有限公司	214,471,652	人民币普通股	214,471,652				
上海电气(集团)总公司	184,585,993	人民币普通股	184,585,993				
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	182,241,054	人民币普通股	182,241,054				
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(集团)总公司持有本公司A股和H股共计44,080.19万股,占公司总股本的3.37%。

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

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

√适用 □不适用

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5日	-	限售期 48个月
2	上海海烟投资管理有限公司	234,375,000	2022年2月7日	-	限售期 18个月
3	上海电气（集团）总公司	78,203,125	2022年2月7日	-	限售期 18个月
4	光明食品（集团）有限公司	78,125,000	2022年2月7日	-	限售期 18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于2021年2月5日限售期届满并解禁，具体内容详见2021年1月30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：临2021-004）。截至报告期末，公司股份总数中无限售条件的流通股为11,892,246,875，有限售条件的流通股为1,171,953,125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2021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2)/淡仓(注3)/可供借出的股份
1.	Maunakai Capital Partners (Hong Kong) Limited	H股	投资经理	272,590,000	2.09	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

序号	主要股东名称	股份类别	权益性质	持有的股份数目(股)	占本公司已发行股份总数的比例 (%)	占本公司已发行A股/H股总数的比例 (%)	好仓(注2)/淡仓(注3)/可供借出的股份
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4)	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(集团)总公司	H股	实益拥有人	170,658,800	1.31	5.01	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: 如股东对股份本身持有权益, 包括透过持有、沽出或发行金融文书(包括衍生工具)而持有权益, 并因而具有如下的权利与责任, 该股东便属于持有「好仓」: (i) 其有权购入相关股份; (ii) 其有责任购入相关股份; (iii) 如相关股份价格上升, 其有权收取款项; 或(iv) 如相关股份价格上升, 其有权避免或减低损失。

注3: 如股东根据证券借贷协议借入股份, 或如股东因持有、沽出或发行金融文书(包括衍生工具)而具有以下权利与责任, 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4: 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2021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)于本公司股份或相关股份中拥有根据《证券及期货条例》第336条规定须记录于登记册内之权益或淡仓。

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

于2021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

五、购回、出售或赎回上市证券

报告期内，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 优先股相关情况

适用 不适用

第九节 债券相关情况

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

√适用 □不适用

(一) 企业债券

□适用 √不适用

(二) 公司债券

√适用 □不适用

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	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易所	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 (第一期)	13 海通 03	122282	2013/11/25	2013/11/25	2023/11/25	23.9	6.18	单利按年计息	上交所	社会公众投资者、机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2013 年公司债券 (第二期)	13 海通 06	122313	2014/07/14	2014/07/14	2024/07/14	8	5.85	单利按年计息	上交所	社会公众投资者、机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2016 年非公开发行次级债券 (第一期)	16 海通 C2	145180	2016/11/17	2016/11/17	2021/11/17	20	3.40	单利按年计息	上交所	合格机构投资者	报价、询价、协议交易	否
面向合格投资者公开发行 2017 年公司债券 (第一期)	17 海通 02	143232	2017/08/09	2017/08/11	2022/08/11	10	4.80	单利按年计息	上交所	合格投资者	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	2017/09/20	2017/09/22	2027/09/22	55	4.99	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行 2018 年公司债券（第五期）	18 海通 05	155038	2018/11/21	2018/11/22	2021/11/22	30	3.88	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2019 年非公开发行次级债券（第一期）	19 海通 C1	151202	2019/02/27	2019/02/28	2022/02/28	33	4.09	单利按年计息	上交所	合格机构投资者	报价、询价、协议交易	否
面向合格投资者公开发行 2019 年公司债券（第一期）	19 海通 01	155316	2019/04/10	2019/04/11	2022/04/11	50	3.75	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行 2019 年公司债券（第二期）	19 海通 02	155830	2019/11/14	2019/11/15	2022/11/15	45	3.52	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券（第一期）	20 海通 01	163148	2020/02/26	2020/02/27	2023/02/27	50	3.01	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券（第二期）	20 海通 02	163290	2020/03/18	2020/03/19	2023/03/19	35	2.99	单利按年计息	上交所	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）（品种一）	20 海通 04	163507	2020/04/29	2020/04/30	2023/04/30	56	2.38	单利按年计息	上交所	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 2020 年公司债券（第一期）（品种二）	20 海通 05	163508	2020/04/29	2020/04/30	2025/04/30	7	2.88	单利按年计息	上交所	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 2020 年公司债券（第二期）	20 海通 06	163568	2020/05/22	2020/05/25	2023/05/25	67	2.70	单利按年计息	上交所	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 2020 年公司债券（第三期）	20 海通 08	163903	2020/08/10	2020/08/11	2023/08/11	60	3.53	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2020 年非公开发行公司债券（第一期）（品种一）	20 海通 F1	167896	2020/10/20	2020/10/21	2021/10/23	50	3.50	到期一次还本付息	上交所	合格机构投资者	报价、询价、协议交易	否

2020 年非公开发行公司债券（第一期）（品种二）	20 海通 F2	167897	2020/10/20	2020/10/21	2022/10/21	50	3.82	单利按年计息	上交所	合格机构投资者	报价、询价、协议交易	否
2020 年非公开发行公司债券（第二期）	20 海通 F3	177170	2020/11/18	2020/11/19	2022/01/13	50	3.70	到期一次还本付息	上交所	合格机构投资者	报价、询价、协议交易	否
面向专业投资者公开发行 2021 年公司债券（第一期）	21 海通 01	175630	2021/01/12	2021/01/13	2024/01/13	60	3.58	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2021 年公开发行短期公司债券（第一期）	21 海通 S1	163863	2021/01/27	2021/01/28	2021/12/19	60	3.10	到期一次还本付息	上交所	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（第二期）	21 海通 02	175741	2021/02/05	2021/02/08	2024/02/08	54	3.79	单利按年计息	上交所	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（第三期）	21 海通 03	175975	2021/04/22	2021/04/23	2024/04/23	50	3.45	单利按年计息	上交所	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（第四期）	21 海通 04	188150	2021/05/26	2021/05/27	2024/05/27	28	3.35	单利按年计息	上交所	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（第五期）	21 海通 05	188202	2021/06/09	2021/06/10	2024/06/10	21	3.40	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2021 年公开发行短期公司债券（第二期）	21 海通 S2	163885	2021/07/09	2021/07/12	2022/06/16	60	2.82	到期一次还本付息	上交所	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	2021/07/28	2021/07/29	2024/07/29	20	3.14	单利按年计息	上交所	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）（品种一）	21 海通 S3	163895	2021/07/28	2021/07/29	2022/07/29	50	2.72	到期一次还本付息	上交所	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	2021/08/19	2021/08/20	2024/08/20	30	3.04	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

公司所有债券不存在终止上市交易的风险。

逾期未偿还债券

适用 不适用

公司不存在逾期未偿还债券。

关于逾期债项的说明

适用 不适用

2. 发行人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

4. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响

适用 不适用

(1) 担保情况

上述债券均为无担保债券。

(2) 偿债计划

公司将按时履行各期公司债券年度付息及到期还本付息义务。公司偿债能力良好，偿债资金将主要来源于公司日常盈利积累、经营活动所产生的现金流、继续负债以及股本融资活动。

(3) 其他偿债保障措施

公司 2019 年 6 月 18 日的股东大会审议通过《关于公司发行境内外债务融资工具一般性授权的议案》，其中约定偿债保障措施。即“公司发行境内外债务融资工具授权董事会并同意董事会授权其获授权人士共同或分别在出现预计不能按期偿付境内外债务融资工具本息或者到期未能按期偿付境内外债务融资工具本息时，至少采取如下措施：①不向股东分配利润；②暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施；③调减或停发公司董事和高级管理人员的工资和奖金；④主要责任人员不得调离。”

5. 公司债券其他情况的说明

适用 不适用

(三) 其他债券

单位:亿元 币种:见明细表

债券名称	简称	代码	债券余额	利率(%)	发行日期	兑付日期	还本付息方式	交易场所
金融债(境外)	海通证券 4.5% B2023	5482	3 亿美元	4.50	2018/12/13	2023/12/13	单利按半年计息	香港联交所
金融债(境外)	海通证券 FRN B2023	5483	2.3 亿欧元	3M EURIBOR	2018/12/13	2023/12/13	单利按季计息	香港联交所

				+1.65				
2019 年第一期 金融债券	19 海通证券金 融债 01	09190 0022	70 亿人民币	3.39	2019/08/29	2022/08/29	单利按年计息	银行间市场

(四) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

(五) 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

(六) 主要会计数据和财务指标

适用 不适用

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	2.07	1.96	5.61	
速动比率	2.07	1.96	5.61	
资产负债率 (%)	71.48	71.30	0.25	
	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	78.97	51.09	54.58	净利润增加
EBITDA 全部债务比	0.05	0.04	25.00	
利息保障倍数	3.06	2.20	39.09	利润增加、利息 支出减少
现金利息保障倍数	7.92	1.40	465.71	经营活动产生的 现金净流入额增加
EBITDA 利息保障倍数	3.17	2.29	38.43	利润增加、利息 支出减少
贷款偿还率 (%)	100	100	-	
利息偿付率 (%)	100	100	-	

注：扣除非经常性损益的净利润即归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润。

二、可转换公司债券情况

适用 不适用

第十节 财务报告

一、审计报告

适用 不适用

审阅报告

普华永道中天阅字(2021)第 0061 号

海通证券股份有限公司全体股东：

我们审阅了后附的海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”)的中期财务报表，包括 2021 年 6 月 30 日的合并及公司资产负债表，截至 2021 年 6 月 30 日止六个月期间的中期合并及公司利润表、合并及公司股东权益变动表、合并及公司现金流量表以及中期财务报表附注。按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制中期财务报表是海通证券管理层的责任，我们的责任是在实施审阅工作的基础上对中期财务报表出具审阅报告。

我们按照《中国注册会计师审阅准则第 2101 号—财务报表审阅》的规定执行了审阅业务。该准则要求我们计划和实施审阅工作，以对中期财务报表是否不存在重大错报获取有限保证。审阅主要限于询问公司有关人员和对财务数据实施分析程序，提供的保证程度低于审计。我们没有实施审计，因而不发表审计意见。

根据我们的审阅，我们没有注意到任何事项使我们相信上述中期财务报表没有在所有重大方面按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制。

2021 年 6 月 30 日合并及公司资产负债表的比较信息基于 2020 年 12 月 31 日经审计的财务报表。截至 2020 年 6 月 30 日止六个月期间的中期合并及公司利润表、合并及公司股东权益变动表和合并及公司现金流量表以及相关中期财务报表附注未经审计或审阅。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

许康玮

中国·上海市
2021 年 8 月 26 日

注册会计师

刘伟

二、财务报表

合并及公司资产负债表
2021 年 6 月 30 日

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

资产	合并			母公司		
	附注四	2021 年 6 月 30 日 (未经审计)	2020 年 12 月 31 日 (经审计)	附注十四	2021 年 6 月 30 日 (未经审计)	2020 年 12 月 31 日 (经审计)
资产:						
货币资金	1	152,711,373,385.12	127,846,510,384.44		86,744,268,045.56	74,010,191,666.45
其中: 客户存款		101,364,709,651.97	91,691,751,326.06		60,098,373,872.29	57,107,099,896.87
结算备付金	2	14,144,755,957.03	11,852,300,703.44		22,032,675,464.64	17,748,028,149.83
其中: 客户备付金		10,260,017,393.16	8,439,499,702.35		9,357,040,865.46	8,787,695,278.74
拆出资金		40,909,354.48	22,619,003.50		-	-
融出资金	3	80,176,273,764.79	73,067,592,180.28		70,200,583,599.52	62,585,416,116.49
衍生金融资产	4	1,161,148,867.42	1,837,911,549.28		333,082,389.99	109,961,010.63
存出保证金	5	19,194,202,709.26	17,374,851,216.38		5,558,442,334.48	3,815,156,298.46
应收款项	6	14,372,620,584.73	8,410,000,191.07		1,809,058,299.28	1,458,058,794.21
买入返售金融资产	7	47,374,018,540.66	57,965,393,846.35		38,162,713,360.89	46,043,557,098.07
持有待售资产		126,757.96	126,757.96		-	-
金融投资:						
交易性金融资产	8	220,492,902,157.25	220,396,503,802.97		128,371,097,306.80	118,954,600,639.95
债权投资	9	3,769,778,679.69	3,763,499,007.04		-	-
其他债权投资	10	17,336,611,668.70	13,108,162,077.30		15,395,804,050.29	11,767,722,804.51
其他权益工具投资	11	9,656,322,183.81	16,239,187,221.41		9,564,122,034.39	15,984,455,967.50
应收融资租赁款	12	41,302,243,616.26	48,411,402,490.40		-	-
长期应收款	12	41,493,096,835.38	35,214,476,098.67		-	-
长期股权投资	13	4,708,370,730.75	4,428,306,984.21	1	35,283,157,250.29	35,146,029,297.79
投资性房地产	14	57,122,929.38	111,591,512.78		12,766,450.03	13,278,651.97
固定资产	15	14,078,971,145.83	14,286,537,337.68		5,950,572,867.26	5,971,363,529.79
在建工程	16	441,502,898.24	384,734,625.27		374,061,592.84	316,873,644.40
无形资产	17	1,234,349,351.70	1,292,412,549.02		299,403,648.77	311,261,069.99
使用权资产	18	985,804,662.48	1,043,725,022.09		501,901,491.78	500,414,323.31
商誉	19	3,840,849,044.51	3,884,909,888.02		-	-
递延所得税资产	20	4,092,069,770.39	4,282,160,088.28		1,544,461,856.00	1,654,578,148.20
其他资产	21	30,426,814,983.88	28,848,436,146.92		3,795,096,895.09	1,301,878,794.62
资产总计		723,092,240,579.70	694,073,350,684.76		425,933,268,937.90	397,692,826,006.17

(续)

合并及公司资产负债表(续)
2021年6月30日

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

负债和股东权益	合并			母公司		
	附注四	2021年6月30日 (未经审计)	2020年12月31日 (经审计)	附注十四	2021年6月30日 (未经审计)	2020年12月31日 (经审计)
负债:						
短期借款	25	36,244,363,155.76	43,367,554,072.81		-	-
应付短期融资款	26	19,408,105,298.65	25,718,522,701.47		8,800,446,263.23	14,954,952,895.91
拆入资金	27	16,041,065,078.27	15,069,512,517.55		10,014,946,666.66	8,801,861,666.67
交易性金融负债	28	38,631,286,909.25	32,238,300,944.74		19,034,920,857.27	8,319,118,224.27
衍生金融负债	4	2,518,106,310.72	2,672,278,930.69		1,201,564,296.33	543,531,575.78
卖出回购金融资产款	29	59,826,002,087.77	60,563,432,718.62		49,543,287,903.51	48,997,605,575.98
代理买卖证券款	30	115,515,984,832.05	108,167,567,969.29		68,657,425,041.24	67,389,968,518.46
代理承销证券款		514,399,999.98	233,062,962.16		564,399,999.98	323,062,962.16
应付职工薪酬	31	6,885,384,065.97	6,478,180,676.07		4,825,459,559.67	4,388,230,717.06
应交税费	32	1,986,080,451.56	3,566,582,804.82		688,314,830.49	1,761,215,662.79
应付款项	33	21,148,375,027.68	11,590,061,915.13		10,029,477,320.71	1,703,278,685.18
合同负债		234,485,990.86	131,039,010.16		-	-
预计负债	34	135,345,870.49	141,083,942.89		-	-
长期借款	35	51,378,459,686.52	49,363,002,740.67		2,146,364,694.43	2,114,295,863.89
应付债券	36	156,332,095,029.79	147,838,209,538.34		107,568,178,733.66	99,870,431,188.08
租赁负债	18	1,000,364,776.25	1,052,413,502.19		490,791,147.92	489,767,980.26
递延所得税负债	20	1,247,357,241.70	698,134,483.29		-	-
其他负债	37	20,751,679,383.36	17,058,097,418.11		3,731,180,989.12	590,316,777.15
负债合计		549,798,941,196.63	525,947,038,849.00		287,296,758,304.22	260,247,638,293.64
股东权益:						
股本	38	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00		13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
资本公积	39	74,910,587,607.68	74,888,284,930.75		74,772,635,006.20	74,772,635,006.20
其他综合收益	40	(867,590,244.72)	(650,570,845.59)		246,488,413.23	499,137,706.73
盈余公积	41	7,663,172,125.37	7,663,172,125.37		7,663,172,125.37	7,663,172,125.37
一般风险准备	42	17,355,715,805.77	17,260,983,392.72		15,326,344,250.74	15,326,344,250.74
未分配利润	43	46,052,540,159.72	41,222,398,224.28		27,563,670,838.14	26,119,698,623.49
归属于母公司股东权益合计		158,178,625,453.82	153,448,467,827.53		138,636,510,633.68	137,445,187,712.53
少数股东权益		15,114,673,929.25	14,677,844,008.23		-	-
股东权益合计		173,293,299,383.07	168,126,311,835.76		138,636,510,633.68	137,445,187,712.53
负债和股东权益总计		723,092,240,579.70	694,073,350,684.76		425,933,268,937.90	397,692,826,006.17

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

合并及公司利润表
2021年1-6月

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

项目	合并			母公司		
	附注四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
一、营业总收入		23,471,241,587.14	17,787,655,390.58		9,544,364,476.53	8,605,155,154.33
手续费及佣金净收入	44	7,165,176,960.88	5,720,657,603.17	2	3,990,032,781.63	3,194,742,627.21
其中: 经纪业务手续费净收入		2,624,722,675.27	2,234,602,303.53		2,033,632,830.76	1,924,618,507.75
投资银行业务手续费净收入		2,524,747,356.00	1,700,920,219.27		1,834,945,545.00	1,155,783,371.80
资产管理业务手续费净收入		1,832,908,069.19	1,639,664,003.38		-	-
利息净收入	45	3,361,957,910.21	2,208,910,396.51	3	1,517,745,007.44	1,252,740,595.39
其中: 金融资产利息收入		7,499,427,313.78	7,004,258,892.40		4,603,997,287.48	4,115,296,011.29
融资租赁收入		1,771,580,592.67	1,985,141,606.08		-	-
利息支出		(5,909,049,996.24)	(6,780,490,101.97)		(3,086,252,280.04)	(2,862,555,415.90)
投资收益	46	6,089,788,843.43	4,448,877,621.85	4	3,082,048,927.81	3,500,615,231.02
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		624,744,561.18	264,232,554.18		337,663,452.50	162,206,000.00
其他收益	47	561,491,888.57	570,016,434.17		280,614,259.08	335,478,718.49
公允价值变动收益	48	1,324,130,957.42	1,663,100,685.20	5	573,817,040.48	390,329,758.08
汇兑收益(损失)		80,349,420.96	235,585,946.73		96,016,824.45	(73,687,838.93)
其他业务收入	49	4,918,695,749.61	2,952,852,352.19		3,965,219.13	4,934,791.99
资产处置(损失)/收益		(30,350,143.94)	(12,345,649.24)		124,416.51	1,271.08
二、营业总支出		11,837,101,306.29	9,964,777,113.53		3,420,123,424.65	3,508,856,169.67
税金及附加	50	151,625,754.50	107,513,070.62		103,182,239.73	58,418,980.80
业务及管理费	51	6,439,255,745.70	4,742,902,575.10	6	3,391,463,157.17	2,196,808,271.40
信用减值损失	52	1,024,765,121.75	2,900,271,089.20		(75,034,174.19)	1,253,031,347.41
其他资产减值损失		44,083,145.76	10,457,352.68		-	-
其他业务成本	53	4,177,371,538.58	2,203,633,025.93		512,201.94	597,570.06
三、营业利润		11,634,140,280.85	7,822,878,277.05		6,124,241,051.88	5,096,298,984.66
加: 营业外收入	54	52,052,247.22	44,443,375.23		18,347,644.78	41,049,140.59
减: 营业外支出	55	25,242,800.43	47,833,902.41		13,973,437.22	12,980,576.26
四、利润总额		11,660,949,727.64	7,819,487,749.87		6,128,615,259.44	5,124,367,548.99
减: 所得税费用	56	2,772,210,076.66	1,918,026,512.84		1,440,643,943.84	959,418,210.44
五、净利润		8,888,739,650.98	5,901,461,237.03		4,687,971,315.60	4,164,949,338.55
(一)按经营持续性分类:						
1.持续经营净利润		8,888,707,373.39	5,902,319,820.40		4,687,971,315.60	4,164,949,338.55
2.终止经营净利润(亏损)		32,277.59	(858,583.37)		-	-
(二)按所有权归属分类:						
1.归属于母公司股东的净利润		8,170,194,923.98	5,483,192,354.93		4,687,971,315.60	4,164,949,338.55
2.少数股东损益		718,544,727.00	418,268,882.10		-	-
六、其他综合收益的税后净额		(346,786,150.51)	(308,105,561.23)		(230,598,394.45)	(213,255,355.90)
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		(194,968,500.08)	(515,060,219.61)		(230,598,394.45)	(213,255,355.90)
(一)不能重分类进损益的其他综合收益		(305,876,106.79)	(363,956,643.43)		(349,852,379.58)	(357,045,619.74)
1.重新计量设定受益计划变动额		48,007,409.46	16,938,593.74		-	-
2.其他权益工具投资公允价值变动		(353,883,516.25)	(380,895,237.17)		(349,852,379.58)	(357,045,619.74)
(二)将重分类进损益的其他综合收益		110,907,606.71	(151,103,576.18)		119,253,985.13	143,790,263.84
1.权益法下可转损益的其他综合收益		-	(45,696,279.79)		-	642,980.59
2.其他债权投资公允价值变动		528,562,235.82	118,052,808.54		519,473,397.11	140,003,044.07
3.其他债权投资信用损失准备		(389,952,653.09)	1,579,828.63		(400,219,411.98)	3,144,239.18
4.现金流量套期储备		37,600,183.83	(99,651,097.39)		-	-
5.外币财务报表折算差额		(65,302,159.85)	(125,388,836.17)		-	-
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		(151,817,650.43)	206,954,658.38		-	-
七、综合收益总额		8,541,953,500.47	5,593,355,675.80		4,457,372,921.15	3,951,693,982.65
归属于母公司股东的综合收益总额		7,975,226,423.90	4,968,132,135.32		4,457,372,921.15	3,951,693,982.65
归属于少数股东的综合收益总额		566,727,076.57	625,223,540.48		-	-
八、每股收益:						
(一)基本每股收益(元/股)		0.63	0.48		-	-
(二)稀释每股收益(元/股)		0.63	0.48		-	-

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 张信军

会计机构负责人: 马中

合并及公司现金流量表
2021年1-6月

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

项目	附注四	合并		附注十四	母公司	
		本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)		本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
一、经营活动产生的现金流量:						
收取利息、手续费及佣金的现金		15,566,609,930.91	13,131,319,827.85		9,604,126,966.71	7,973,767,688.12
为交易目的而持有的金融资产净减少额		16,662,072,493.85	-		5,609,666,748.77	-
拆入资金净增加额		914,739,122.04	-		1,200,000,000.00	-
回购业务资金净增加额		13,357,236,927.06	9,785,366,895.60		12,045,853,345.07	23,118,886,813.79
代理买卖证券收到的现金净额		7,345,445,679.30	17,660,695,547.81		1,267,970,977.77	10,625,921,297.83
收到其他与经营活动有关的现金	57	13,796,889,828.08	7,798,115,819.56		2,982,092,096.84	856,424,006.98
经营活动现金流入小计		67,642,993,981.24	48,375,498,090.82		32,709,710,135.16	42,574,999,806.72
为交易目的而持有的金融资产净增加额		-	12,858,024,655.77		-	16,968,230,438.52
拆入资金净减少额		-	10,888,992,909.95		-	11,019,048,611.11
融出资金净增加额		7,420,032,403.14	5,591,516,530.13		7,695,851,425.92	6,335,451,312.01
支付利息、手续费及佣金的现金		3,474,293,295.23	3,380,427,247.27		1,927,835,750.86	1,783,510,355.73
支付给职工以及为职工支付的现金		3,898,351,122.77	3,568,699,028.74		2,063,926,123.76	1,831,243,778.39
支付的各项税费		4,893,599,565.66	2,705,274,227.12		3,122,795,924.46	1,762,583,211.60
支付其他与经营活动有关的现金	57	13,198,299,387.05	9,136,590,877.59		3,350,245,234.92	1,822,838,529.65
经营活动现金流出小计		32,884,575,773.85	48,129,525,476.57		18,160,654,459.92	41,522,906,237.01
经营活动产生的现金流量净额	58	34,758,418,207.39	245,972,614.25	7	14,549,055,675.24	1,052,093,569.71
二、投资活动(使用)/产生的现金流量:						
收回投资收到的现金		11,613,541,819.35	5,288,135,298.58		11,013,331,453.69	2,355,671,605.68
取得投资收益收到的现金		1,453,753,255.02	533,735,574.63		1,918,933,243.61	454,298,688.72
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		779,807.03	8,143,448.80		1,712,733.63	246,225.71
投资活动现金流入小计		13,068,074,881.40	5,830,014,322.01		12,933,977,430.93	2,810,216,520.11
投资支付的现金		12,390,843,764.22	3,270,237,288.16		9,495,517,601.13	3,000,324,943.66
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		793,664,812.49	6,960,627,684.68		484,082,272.07	3,940,235,946.81
投资活动现金流出小计		13,184,508,576.71	10,230,864,972.84		9,979,599,873.20	6,940,560,890.47
投资活动(使用)/产生的现金流量净额		(116,433,695.31)	(4,400,850,650.83)		2,954,377,557.73	(4,130,344,370.36)
三、筹资活动(使用)/产生的现金流量:						
吸收投资收到的现金		295,543,406.11	15,100,261.12		-	-
其中:子公司吸收少数股东投资收到的现金		295,543,406.11	15,100,261.12		-	-
取得借款收到的现金		45,748,721,187.61	53,710,935,280.47		-	-
发行债券收到的现金		65,566,997,309.19	81,282,341,710.85		39,949,643,300.00	62,475,050,000.00
筹资活动现金流入小计		111,611,261,902.91	135,008,377,252.44		39,949,643,300.00	62,475,050,000.00
偿还债务支付的现金		114,406,839,122.19	118,296,747,806.11		38,572,599,878.18	53,181,632,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		4,468,797,773.06	5,379,833,329.54		1,768,593,989.67	1,875,156,972.33
其中:子公司支付给少数股东的股利、利润		405,802,023.10	311,532,355.81		-	-
支付其他与筹资活动有关的现金	57	395,256,261.07	583,042,613.09		96,999,350.65	118,229,230.16
筹资活动现金流出小计		119,270,893,156.32	124,259,623,748.74		40,438,193,218.50	55,175,018,202.49
筹资活动(使用)/产生的现金流量净额		(7,659,631,253.41)	(10,748,753,503.70)		(488,549,918.50)	7,300,031,797.51
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		(383,061,199.34)	453,411,203.54		(11,632,297.37)	19,170,182.40
五、现金及现金等价物净增加额	58	26,599,292,059.33	7,047,286,670.66	7	17,003,251,017.10	4,240,951,179.26
加:期初现金及现金等价物余额		137,311,262,918.57	123,829,492,862.52		91,698,084,523.06	81,892,823,582.56
六、期末现金及现金等价物余额	58	163,910,554,977.90	130,876,779,533.18		108,701,335,540.16	86,133,774,761.82

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人:周杰

主管会计工作负责人:张信军

会计机构负责人:马中

合并股东权益变动表
2021 年 1-6 月

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

项目	2021 年 1-6 月							少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益								
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
一、2020 年 12 月 31 日余额(经审计)	13,064,200,000.00	74,888,284,930.75	(650,570,845.59)	7,663,172,125.37	17,260,983,392.72	41,222,398,224.28	14,677,844,008.23	168,126,311,835.76	
二、本期增减变动金额	-	22,302,676.93	(217,019,399.13)	-	94,732,413.05	4,830,141,935.44	436,829,921.02	5,166,987,547.31	
(一)综合收益总额	-	-	(194,968,500.08)	-	-	8,170,194,923.98	566,727,076.57	8,541,953,500.47	
(二)股东投入和减少资本	-	22,302,676.93	-	-	-	-	274,583,393.01	296,886,069.94	
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	
2. 其他权益工具持有者投入资本和减少资本	-	-	-	-	-	-	271,330,188.69	271,330,188.69	
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	8,211,382.35	-	-	-	-	44,862,380.42	53,073,762.77	
4. 其他	-	14,091,294.58	-	-	-	-	(41,609,176.10)	(27,517,881.52)	
(三)利润分配	-	-	-	-	94,732,413.05	(3,362,103,887.59)	(404,480,548.56)	(3,671,852,023.10)	
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	94,732,413.05	(94,732,413.05)	-	-	
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(3,266,050,000.00)	(405,802,023.10)	(3,671,852,023.10)	
4. 其他	-	-	-	-	-	(1,321,474.54)	1,321,474.54	-	
(四)股东权益内部结转	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-	-	
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	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-	-	
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	
三、2021 年 6 月 30 日余额(未经审计)	13,064,200,000.00	74,910,587,607.68	(867,590,244.72)	7,663,172,125.37	17,355,715,805.77	46,052,540,159.72	15,114,673,929.25	173,293,299,383.07	

(续)

合并股东权益变动表
2020 年 1-6 月

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

项目	2020 年 1-6 月						少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益							
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、2019 年 12 月 31 日余额(经审计)	11,501,700,000.00	56,526,248,966.71	(888,898,605.19)	6,935,712,199.87	15,156,735,176.65	36,859,495,812.92	15,027,749,581.74	141,118,743,132.70
二、本期增减变动金额	-	74,137,882.89	(490,492,728.55)	416,494,933.86	1,219,722,539.31	3,822,378,260.04	68,829,035.81	5,111,069,923.36
(一)综合收益总额	-	-	(515,060,219.61)	-	-	5,483,192,354.93	625,223,540.48	5,593,355,675.80
(二)股东投入和减少资本	-	74,137,882.89	-	-	-	-	(244,872,177.81)	(170,734,294.92)
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	-	-	-	-	-	-	13,457,406.91	13,457,406.91
4. 其他	-	74,137,882.89	-	-	-	-	(258,329,584.72)	(184,191,701.83)
(三)利润分配	-	-	-	416,494,933.86	1,219,722,539.31	(1,636,246,603.83)	(311,522,326.86)	(311,551,457.52)
1. 提取盈余公积	-	-	-	416,494,933.86	-	(416,494,933.86)	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	1,219,722,539.31	(1,219,722,539.31)	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	(311,522,326.86)	(311,522,326.86)
4. 其他	-	-	-	-	-	(29,130.66)	-	(29,130.66)
(四)股东权益内部结转	-	-	24,567,491.06	-	-	(24,567,491.06)	-	-
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	-	-	24,567,491.06	-	-	(24,567,491.06)	-	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
三、2020 年 6 月 30 日余额(未经审计)	11,501,700,000.00	56,600,386,849.60	(1,379,391,333.74)	7,352,207,133.73	16,376,457,715.96	40,681,874,072.96	15,096,578,617.55	146,229,813,056.06

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 张信军

会计机构负责人: 马中

公司股东权益变动表
2021 年 1-6 月

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

项目	2021 年 1-6 月						
	股本	资本公积	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、2020 年 12 月 31 日余额(经审计)	13,064,200,000.00	74,772,635,006.20	499,137,706.73	7,663,172,125.37	15,326,344,250.74	26,119,698,623.49	137,445,187,712.53
二、本期增减变动金额	-	-	(252,649,293.50)	-	-	1,443,972,214.65	1,191,322,921.15
(一)综合收益总额	-	-	(230,598,394.45)	-	-	4,687,971,315.60	4,457,372,921.15
(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	-	-	-	-	-	(3,266,050,000.00)	(3,266,050,000.00)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(3,266,050,000.00)	(3,266,050,000.00)
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(四)股东权益内部结转	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-
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	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-
三、2021 年 6 月 30 日余额(未经审计)	13,064,200,000.00	74,772,635,006.20	246,488,413.23	7,663,172,125.37	15,326,344,250.74	27,563,670,838.14	138,636,510,633.68

(续)

公司股东权益变动表
2020 年 1-6 月

编制单位:海通证券股份有限公司

单位:人民币元

项目	2020 年 1-6 月						
	股本	资本公积	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、2019 年 12 月 31 日余额(经审计)	11,501,700,000.00	56,486,198,528.36	183,998,809.87	6,935,712,199.87	13,871,424,399.74	24,708,236,893.88	113,687,270,831.72
二、本期增减变动金额	-	-	(188,687,864.84)	416,494,933.86	832,989,867.72	2,890,897,045.91	3,951,693,982.65
(一)综合收益总额	-	-	(213,255,355.90)	-	-	4,164,949,338.55	3,951,693,982.65
(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	-	-	-	416,494,933.86	832,989,867.72	(1,249,484,801.58)	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	416,494,933.86	-	(416,494,933.86)	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	832,989,867.72	(832,989,867.72)	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(四)股东权益内部结转	-	-	24,567,491.06	-	-	(24,567,491.06)	-
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	-	-	24,567,491.06	-	-	(24,567,491.06)	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-
三、2020 年 6 月 30 日余额(未经审计)	11,501,700,000.00	56,486,198,528.36	(4,689,054.97)	7,352,207,133.73	14,704,414,267.46	27,599,133,939.79	117,638,964,814.37

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人: 周杰

主管会计工作负责人: 张信军

会计机构负责人: 马中

二〇二一年中期财务报表附注

一、 公司基本情况

1、 公司概况

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

2007年6月7日,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29日,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2021年6月30日止,本公司股本总数为13,064,200,000股,其中无限售条件股份为11,501,700,000股,有限售条件股份为1,562,500,000股。

本公司注册地和总部地址:上海市广东路689号。

截至2021年6月30日止,本公司经批准设立分公司29家,证券营业部302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,本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)。

一、 公司基本情况(续)

2、 合并财务报表范围

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，本中期合并财务报表范围及其变动情况、在相关被投资单位权益的信息详见附注“五、合并范围的变更”和“六、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》、各项具体会计准则及相关规定(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》和中国证券监督管理委员会颁布的《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 2020 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、 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 2021 年 6 月 30 日的合并及公司财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的合并及公司经营成果和现金流量。

四、 合并财务报表项目附注

1、 货币资金

(1) 按类别列示

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
库存现金	326,714.53	344,529.64
银行存款	148,217,627,789.56	123,170,405,904.67
其中：客户存款	101,364,709,651.97	91,691,751,326.06
公司存款	46,852,918,137.59	31,478,654,578.61
其他货币资金	1,267,677,225.46	961,878,718.83
存放中央银行款项	3,234,787,019.57	3,716,130,431.09
其中：存放中央银行法定准备金	25,093,897.75	28,654,880.83
存放中央银行超额存款准备金	3,209,693,121.82	3,687,475,550.26
小计	152,720,418,749.12	127,848,759,584.23
减：减值准备	9,045,364.00	2,249,199.79
合计	152,711,373,385.12	127,846,510,384.44

四、 合并财务报表项目附注(续)

1、 货币资金(续)

(2) 按币种列示

项目	2021年6月30日			2020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			48,030.69			50,684.22
美元	4,704.97	6.4601	30,394.58	4,704.91	6.5249	30,699.07
港币	43,422.47	0.83208	36,130.97	54,651.72	0.84164	45,997.07
欧元	8,618.59	7.6862	66,244.21	6,799.98	8.0250	54,569.84
其他			145,914.08			162,579.44
小计			326,714.53			344,529.64
银行存款						
其中：客户资金						
人民币			78,061,607,011.02			68,211,764,877.26
美元	723,477,172.77	6.4601	4,673,734,883.81	962,651,780.40	6.5249	6,281,206,601.93
港币	13,091,826,336.66	0.83208	10,893,446,858.21	10,712,904,112.65	0.84164	9,016,408,617.37
欧元	10,430,633.81	7.6862	80,171,937.59	13,797,269.45	8.0250	110,723,087.34
其他			251,313,610.12			727,000,577.49
小计			93,960,274,300.75			84,347,103,761.39
客户信用资金						
人民币			7,404,435,351.22			7,344,647,564.67
小计			7,404,435,351.22			7,344,647,564.67
客户存款合计			101,364,709,651.97			91,691,751,326.06
公司自有资金						
人民币			39,096,843,065.25			25,773,131,978.73
美元	673,219,907.06	6.4601	4,349,067,921.60	235,953,316.72	6.5249	1,539,571,796.27
港币	3,627,006,846.57	0.83208	3,017,959,856.89	4,236,718,082.40	0.84164	3,565,791,406.87
欧元	5,456,341.06	7.6862	41,938,528.66	24,443,502.99	8.0250	196,159,111.49
其他			347,108,765.19			404,000,285.25
小计			46,852,918,137.59			31,478,654,578.61
公司存款合计			46,852,918,137.59			31,478,654,578.61
其他货币资金						
人民币			870,979,787.21			642,484,585.99
美元	51,153,900.25	6.4601	330,459,311.01	48,915,234.15	6.5249	319,167,011.31
港币	79,605,479.33	0.83208	66,238,127.24	4,990.61	0.84164	4,200.30
欧元	-	-	-	3,075.27	8.0250	24,679.04
其他			-			198,242.19
小计			1,267,677,225.46			961,878,718.83
存放中央银行款项						
欧元	413,255,781.35	7.6862	3,176,366,586.61	446,544,963.16	8.0250	3,583,523,329.36
其他			58,420,432.96			132,607,101.73
小计			3,234,787,019.57			3,716,130,431.09
合计			152,720,418,749.12			127,848,759,584.23

(3) 2021年6月30日，受限制的货币资金为人民币 2,692,049,414.08 元(2020年12月31日：人民币 2,228,062,463.43 元)，主要为风险准备专户存款、借款保证金存款及质押定期存款等。

四、合并财务报表项目附注(续)

2、 结算备付金

(1) 按类别列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
客户备付金	10,260,017,393.16	8,439,499,702.35
公司备付金	3,884,738,563.87	3,412,801,001.09
合计	14,144,755,957.03	11,852,300,703.44

(2) 按币种列示

类别	2021年6月30日			2020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			8,273,280,271.80			6,633,037,050.24
美元	27,537,094.64	6.4601	177,892,385.08	6,221,373.46	6.5249	40,593,839.69
港币	104,414,775.72	0.83208	86,881,446.58	101,637,250.33	0.84164	85,541,975.37
其他			442.67			253,299.80
小计			8,538,054,546.13			6,759,426,165.10
客户信用备付金						
人民币			1,721,962,847.03			1,680,073,537.25
小计			1,721,962,847.03			1,680,073,537.25
客户备付金合计			10,260,017,393.16			8,439,499,702.35
公司自有备付金						
人民币			3,884,738,563.87			3,412,801,001.09
小计			3,884,738,563.87			3,412,801,001.09
公司备付金合计			3,884,738,563.87			3,412,801,001.09
合计			14,144,755,957.03			11,852,300,703.44

3、 融出资金

(1) 按类别列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
境内		
其中：个人	56,748,161,253.43	52,926,922,817.15
机构	14,595,067,360.61	10,727,805,939.41
减：减值准备	1,142,645,014.52	1,069,312,640.07
小计	70,200,583,599.52	62,585,416,116.49
境外		
其中：个人	2,111,163,326.20	2,889,831,450.42
机构	8,410,624,475.88	8,608,045,539.47
减：减值准备	546,097,636.81	1,015,700,926.10
小计	9,975,690,165.27	10,482,176,063.79
合计	80,176,273,764.79	73,067,592,180.28

四、 合并财务报表项目附注(续)

3、 融出资金(续)

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2020年12月31日	32,759,988.42	5,838,258.22	2,046,415,319.53	2,085,013,566.17
本期计提	16,352,263.11	33,245,801.28	235,393,161.05	284,991,225.44
本期核销	-	-	(670,385,707.26)	(670,385,707.26)
阶段转移	(3,908,319.92)	1,943,355.02	1,964,964.90	-
外汇变动	(306,496.64)	(56,588.01)	(10,513,348.37)	(10,876,433.02)
于2021年6月30日	44,897,434.97	40,970,826.51	1,602,874,389.85	1,688,742,651.33

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2021年6月30日	77,058,736,283.41	1,692,209,081.03	3,114,071,051.68	81,865,016,416.12
于2020年12月31日	69,521,901,849.11	2,188,383,279.89	3,442,320,617.45	75,152,605,746.45

(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	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
资金	9,182,025,463.13	8,634,303,520.99
债券	649,094,944.22	615,587,954.24
基金	8,080,903,477.35	7,207,075,937.08
股票	263,904,285,048.55	248,018,168,458.75
合计	281,816,308,933.25	264,475,135,871.06

四、 合并财务报表项目附注(续)

4、 衍生金融工具

类别	2021 年 6 月 30 日					
	非套期工具(注 1)			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
人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	
利率衍生工具	54,023,867,130.23	488,381,051.42	465,340,716.31	3,029,638,997.50	1,892,323.75	108,686,797.71
货币衍生工具	33,149,563,712.71	168,080,717.92	165,479,347.78	2,272,863,907.63	227,117.07	114,178,689.54
权益衍生工具	250,829,426,741.12	439,204,674.50	1,581,088,908.85	-	-	-
信用衍生工具	609,727,013.00	-	1,965,207.72	-	-	-
其他衍生工具	17,160,647,019.04	63,362,982.76	81,366,642.81	-	-	-
合计		1,159,029,426.60	2,295,240,823.47		2,119,440.82	222,865,487.25

类别	2020 年 12 月 31 日					
	非套期工具(注 1)			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
人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	
利率衍生工具	51,120,707,299.13	693,137,037.32	675,547,326.18	3,625,569,698.69	-	160,674,131.15
货币衍生工具	7,764,105,443.77	391,524,364.45	176,648,143.11	3,280,104,496.47	1,209,412.27	199,236,051.93
权益衍生工具	137,962,161,516.53	415,755,004.64	1,078,237,608.26	-	-	-
信用衍生工具	459,935,375.00	-	4,222,670.03	-	-	-
其他衍生工具	48,589,414,604.87	336,285,730.60	377,713,000.03	-	-	-
合计		1,836,702,137.01	2,312,368,747.61		1,209,412.27	359,910,183.08

注 1：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消后的净额列示，为人民币零元。于 2021 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 326,234,738.46 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 51,944,898.33 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 41,274,411.61 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 38,862,957.33 元)。

注 2：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 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团符合现金流量套期有效的部分净收益人民币 44,235,541.97 元计入其他综合收益(截至 2020 年 6 月 30 日止 6 个月期间：净亏损人民币 117,553,077.14 元)。

5、 存出保证金

(1) 项目列示

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
交易保证金	532,763,944.29	512,744,833.40
信用保证金	73,982,052.98	65,633,792.15
转融通保证金	1,051,245,504.60	1,142,873,545.52
期货保证金	12,184,544,316.12	12,790,309,407.67
履约保证金	481,484,082.40	948,945,451.94
其他	4,870,182,808.87	1,914,344,185.70
合计	19,194,202,709.26	17,374,851,216.38

四、 合并财务报表项目附注(续)

5、 存出保证金(续)

(2) 按币种列示

类别	2021年6月30日			2020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			508,866,214.87			484,330,977.55
美元	270,000.00	6.4601	1,744,227.00	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港币	7,500,000.00	0.83208	6,240,600.00	7,500,000.00	0.84164	6,312,300.00
欧元	2,070,321.15	7.6862	15,912,902.42	2,534,558.61	8.0250	20,339,832.85
小计			532,763,944.29			512,744,833.40
信用保证金						
人民币			73,982,052.98			65,633,792.15
小计			73,982,052.98			65,633,792.15
转融通保证金						
人民币			1,051,245,504.60			1,142,873,545.52
小计			1,051,245,504.60			1,142,873,545.52
期货保证金						
人民币			12,179,840,980.59			12,765,753,817.54
美元	-	-	-	2,886,637.00	6.5249	18,835,017.76
港币	5,652,504.00	0.83208	4,703,335.53	6,796,935.00	0.84164	5,720,572.37
小计			12,184,544,316.12			12,790,309,407.67
履约保证金						
美元	5,636,610.94	6.4601	36,413,070.33	7,567,255.25	6.5249	49,375,583.78
欧元	55,532,333.68	7.6862	426,832,623.13	109,202,251.00	8.0250	876,348,064.28
其他			18,238,388.94			23,221,803.88
小计			481,484,082.40			948,945,451.94
其他						
人民币			4,795,864,948.79			1,819,103,360.91
美元	1,500,232.47	6.4601	9,691,651.78	1,499,902.86	6.5249	9,786,716.17
港币	65,783,797.00	0.83208	54,737,381.81	101,084,248.00	0.84164	85,076,546.49
欧元	1,286,568.98	7.6862	9,888,826.49	47,048.24	8.0250	377,562.13
小计			4,870,182,808.87			1,914,344,185.70
合计			19,194,202,709.26			17,374,851,216.38

6、 应收款项

(1) 按明细列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
应收清算款	11,143,460,336.67	5,539,896,378.44
应收手续费及管理费	2,340,763,678.29	1,973,851,642.14
其他	1,095,993,108.00	1,072,737,580.15
应收款项余额	14,580,217,122.96	8,586,485,600.73
减：减值准备	207,596,538.23	176,485,409.66
应收款项账面价值	14,372,620,584.73	8,410,000,191.07

四、合并财务报表项目附注(续)

6、 应收款项(续)

(2) 按账龄分析

账龄	2021年6月30日				2020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
	人民币元	%	人民币元	%	人民币元	%	人民币元	%
1年以内(含1年)	13,968,184,100.38	95.80	46,201,399.85	22.26	8,008,652,948.11	93.27	16,815,835.48	9.53
1-2年(含2年)	317,755,926.19	2.18	25,117,461.51	12.10	304,024,259.25	3.54	37,384,872.72	21.18
2-3年(含3年)	197,309,707.71	1.35	64,418,755.26	31.03	174,622,194.84	2.03	46,809,503.50	26.52
3年以上	96,967,388.68	0.67	71,858,921.61	34.61	99,186,198.53	1.16	75,475,197.96	42.77
合计	14,580,217,122.96	100.00	207,596,538.23	100.00	8,586,485,600.73	100.00	176,485,409.66	100.00

7、 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
股票	32,606,339,093.44	34,486,174,198.08
债券	16,441,221,977.52	25,274,705,755.09
小计	49,047,561,070.96	59,760,879,953.17
减：减值准备	1,673,542,530.30	1,795,486,106.82
合计	47,374,018,540.66	57,965,393,846.35

(2) 按业务类别列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
约定购回式证券	266,864,213.33	192,007,349.99
股票质押式回购(6)	32,181,471,994.24	33,915,585,448.39
债券质押式回购	12,180,388,831.34	18,668,627,176.94
债券买断式回购	4,260,833,146.18	6,606,078,578.15
其他买入返售金融资产	158,002,885.87	378,581,399.70
小计	49,047,561,070.96	59,760,879,953.17
减：减值准备	1,673,542,530.30	1,795,486,106.82
合计	47,374,018,540.66	57,965,393,846.35

(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 (未发生信用减值)	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2020 年 12 月 31 日	9,692,790.34	7,881,265.01	1,777,912,051.47	1,795,486,106.82
本期转回	(4,599,510.14)	(4,227,284.85)	(124,541,020.26)	(133,367,815.25)
阶段转移	528,015.03	(2,507,677.72)	1,979,662.69	-
外汇变动及其他	(4,005.92)	-	11,428,244.65	11,424,238.73
于 2021 年 6 月 30 日	5,617,289.31	1,146,302.44	1,666,778,938.55	1,673,542,530.30

四、 合并财务报表项目附注(续)

7、 买入返售金融资产(续)

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2021 年 6 月 30 日	42,929,220,163.44	556,473,212.66	5,561,867,694.86	49,047,561,070.96
于 2020 年 12 月 31 日	51,446,026,539.37	1,801,368,311.97	6,513,485,101.83	59,760,879,953.17

(5) 买入返售金融资产的担保物信息

担保物类别	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
担保物	128,958,154,377.21	132,197,246,509.12
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	5,157,485,977.43	8,687,439,103.14
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	665,218,025.62	542,833,091.47

(6) 股票质押式回购业务

(i) 股票质押式回购剩余期限

剩余期限	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
1 个月以内	9,451,793,882.35	9,235,691,326.24
1 个月以上到 3 个月内	5,908,881,578.60	4,000,242,345.03
3 个月以上到 1 年以内	15,982,891,841.31	18,481,154,428.63
1 年以上	837,904,691.98	2,198,497,348.49
合计	32,181,471,994.24	33,915,585,448.39

(ii) 股票质押式回购信用风险敞口

2021 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 (未发生信用减值)	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
账面余额	26,063,131,086.71	556,473,212.66	5,561,867,694.87	32,181,471,994.24
减值准备	5,568,912.60	1,146,302.44	1,666,778,938.55	1,673,494,153.59
担保物价值	102,075,252,585.88	1,989,932,761.19	6,477,603,616.05	110,542,788,963.12

2020 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
账面余额	25,600,732,034.59	1,801,368,311.97	6,513,485,101.83	33,915,585,448.39
减值准备	9,590,375.70	7,881,265.02	1,777,912,051.47	1,795,383,692.19
担保物价值	89,531,709,815.32	3,508,697,788.87	7,878,605,490.83	100,919,013,095.02

四、 合并财务报表项目附注(续)

8、 交易性金融资产

(1) 按项目列示

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				
项目	2021 年 6 月 30 日		2020 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
债券	99,593,042,775.55	101,104,587,185.96	110,363,692,726.37	111,634,530,391.80
公募基金	31,160,187,627.32	30,487,783,671.70	24,484,484,315.79	23,839,049,235.59
股票/股权	37,636,083,203.46	33,025,024,952.53	31,241,194,612.61	28,503,436,433.71
银行理财产品	2,530,819,082.83	2,528,992,200.00	3,647,179,471.79	3,644,470,000.00
券商资管产品	3,131,394,610.65	2,956,881,365.55	2,784,039,930.83	2,549,869,100.08
信托计划	1,602,100,133.21	1,623,750,762.36	735,020,423.34	721,315,889.54
其他	44,839,274,724.23	42,184,580,807.97	47,140,892,322.24	44,764,696,216.68
合计	220,492,902,157.25	213,911,600,946.07	220,396,503,802.97	215,657,367,267.40

- (2) 2021 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、债券借贷业务和转融通业务等，其公允价值为人民币 49,988,613,625.10 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 58,297,529,251.01 元)，其中包括存在限售期限的交易性金融资产，其公允价值为人民币 2,441,151,169.06 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 1,703,712,150.02 元)。

交易性金融资产中用于借款质押的资产情况详见附注十、1、(1)。

- (3) 2021 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 5,999,506,751.75 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 4,453,309,982.89 元)。

9、 债权投资

(1) 按项目列示

项目名称	2021 年 6 月 30 日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
公司债	1,682,538,179.05	11,766,142.68	5,851,961.73	1,688,452,360.00
境外国债	1,540,912,869.87	23,753,811.84	1,243,664.35	1,563,423,017.36
金融债	388,959,577.55	2,537,161.05	989,004.42	390,507,734.18
其他	111,131,100.00	19,871,030.97	3,606,562.82	127,395,568.15
合计	3,723,541,726.47	57,928,146.54	11,691,193.32	3,769,778,679.69

项目名称	2020 年 12 月 31 日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
公司债	1,940,087,713.46	13,555,772.82	85,815,810.06	1,867,827,676.22
境外国债	1,638,762,421.30	46,196,483.11	1,339,794.15	1,683,619,110.26
金融债	149,891,776.14	1,938,718.50	116,064.82	151,714,429.82
其他	52,730,000.00	9,402,480.75	1,794,690.01	60,337,790.74
合计	3,781,471,910.90	71,093,455.18	89,066,359.04	3,763,499,007.04

四、合并财务报表项目附注(续)

9、 债权投资(续)

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2020年12月31日	11,013,521.34	-	78,052,837.70	89,066,359.04
本期计提	994,179.37	-	2,330,422.71	3,324,602.08
本期其他终止确认	-	-	(77,000,080.19)	(77,000,080.19)
外汇变动	(316,507.39)	-	(3,383,180.22)	(3,699,687.61)
于2021年6月30日	11,691,193.32	-	-	11,691,193.32

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2021年6月30日	3,781,469,873.01	-	-	3,781,469,873.01
于2020年12月31日	3,633,746,084.56	-	218,819,281.52	3,852,565,366.08

10、 其他债权投资

(1) 按项目列示

项目名称	2021年6月30日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
境外及境内国债	7,143,384,265.64	104,314,835.16	27,765,063.35	7,275,464,164.15	1,997,044.42
金融债	1,088,713,785.80	18,530,808.23	1,749,954.20	1,108,994,548.23	2,527,740.20
企业债	1,048,070,684.32	26,787,825.73	3,070,685.68	1,077,929,195.73	27,182,316.77
公司债	3,596,178,256.17	115,660,620.21	(118,200,550.67)	3,593,638,325.71	74,614,862.91
其他	4,185,979,505.81	108,100,356.17	(13,494,427.10)	4,280,585,434.88	85,096,558.67
合计	17,062,326,497.74	373,394,445.50	(99,109,274.54)	17,336,611,668.70	191,418,522.97

项目名称	2020年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
境外及境内国债	2,931,673,820.62	60,071,008.49	5,013,430.84	2,996,758,259.95	737,302.18
金融债	329,485,309.69	3,691,394.52	(1,717,603.48)	331,459,100.73	1,745,808.36
企业债	912,781,454.07	21,343,317.25	(1,703,084.07)	932,421,687.25	9,778,699.02
公司债	5,033,655,074.55	142,693,981.64	(808,576,590.95)	4,367,772,465.24	679,420,489.59
其他	4,416,087,874.22	105,158,518.50	(41,495,828.59)	4,479,750,564.13	56,072,853.09
合计	13,623,683,533.15	332,958,220.40	(848,479,676.25)	13,108,162,077.30	747,755,152.24

四、 合并财务报表项目附注(续)

10、 其他债权投资(续)

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2020 年 12 月 31 日	45,422,698.38	99,440,622.52	602,891,831.34	747,755,152.24
本期计提/(转回)	55,283.70	45,798,326.37	(8,153,647.55)	37,699,962.52
本期核销	(21,758.65)	-	-	(21,758.65)
阶段转移	(7,802,281.18)	7,802,281.18	-	-
本期其他终止确认	-	-	(601,324,048.01)	(601,324,048.01)
外汇变动及其他	(20,135.83)	2,090.25	7,327,260.45	7,309,214.87
于 2021 年 6 月 30 日	37,633,806.42	153,043,320.32	741,396.23	191,418,522.97

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2021 年 6 月 30 日	14,198,710,302.77	3,169,163,827.87	67,846,812.60	17,435,720,943.24
于 2020 年 12 月 31 日	10,194,330,209.72	2,048,499,449.32	1,713,812,094.51	13,956,641,753.55

(4) 存在有承诺条件的其他债权投资

2021 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、债券借贷业务质押等，其公允价值为人民币 6,467,455,738.23 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 5,670,131,890.96 元)。

11、 其他权益工具投资

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
证金公司专户投资	-	15,732,411,551.18
非交易性权益工具	9,656,322,183.81	506,775,670.23
合计	9,656,322,183.81	16,239,187,221.41

于 2021 年 6 月 30 日，其他权益工具投资包括本公司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。由于本公司战略调整，本集团对部分其他权益工具进行处置，相应的税后收益人民币 22,050,899.05 元从其他综合收益重分类为留存收益。

2021 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 2,415,406,467.74 元(2020 年 12 月 31 日：无)。

四、 合并财务报表项目附注(续)

12、 应收融资租赁款及长期应收款

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
应收融资租赁款(1)	41,302,243,616.26	48,411,402,490.40
长期应收款(2)	41,493,096,835.38	35,214,476,098.67
合计	82,795,340,451.64	83,625,878,589.07

(1) 应收融资租赁款

(i) 应收融资租赁款列示如下:

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
资产负债表日后第一年	28,909,895,504.52	31,181,156,887.84
资产负债表日后第二年	14,075,442,397.20	16,998,642,710.89
资产负债表日后第三年	2,926,786,720.19	5,451,618,868.54
资产负债表日后第四年	353,021,914.79	480,911,594.85
资产负债表日后第五年	247,006,935.43	295,766,030.73
以后年度	498,111,801.38	501,855,201.23
最低租赁收款额合计	47,010,265,273.51	54,909,951,294.08
减: 未实现融资收益	4,200,283,081.50	4,980,779,508.82
应收融资租赁款余额	42,809,982,192.01	49,929,171,785.26
减: 减值准备	1,507,738,575.75	1,517,769,294.86
应收融资租赁款净额	41,302,243,616.26	48,411,402,490.40
其中: 一年内到期的应收融资租赁款净额	25,439,566,325.39	27,660,126,875.40
一年后到期的应收融资租赁款净额	15,862,677,290.87	20,751,275,615.00

2021 年 6 月 30 日, 本集团应收融资租赁款净额计人民币 2,665,805,757.54 元(2020 年 12 月 31 日: 人民币 3,588,312,120.72 元)质押用于借款。

(ii) 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2020 年 12 月 31 日	707,111,347.68	429,307,953.15	381,349,994.03	1,517,769,294.86
本期(转回)/计提	(73,031,823.14)	180,670,850.38	389,923,398.28	497,562,425.52
本期核销	-	-	(227,005,509.24)	(227,005,509.24)
阶段转移	(553,911.20)	(119,105,163.48)	119,659,074.68	-
收回以前年度核销	-	-	24,242,654.83	24,242,654.83
本期其他终止确认	-	-	(304,830,290.22)	(304,830,290.22)
于 2021 年 6 月 30 日	633,525,613.34	490,873,640.05	383,339,322.36	1,507,738,575.75

四、 合并财务报表项目附注(续)

12. 应收融资租赁款及长期应收款(续)

(1) 应收融资租赁款(续)

(iii) 应收融资租赁款现值分析如下:

	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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
2021 年 6 月 30 日	40,133,654,571.27	1,991,317,694.02	685,009,926.72	42,809,982,192.01
2020 年 12 月 31 日	46,916,653,776.72	2,177,676,364.90	834,841,643.64	49,929,171,785.26

(2) 长期应收款

(i) 长期应收款列示如下:

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
资产负债表日后第一年	20,486,002,660.38	16,834,046,793.67
资产负债表日后第二年	13,856,851,048.54	11,662,334,594.32
资产负债表日后第三年	7,832,855,623.19	6,632,982,152.48
资产负债表日后第四年	2,757,517,488.22	3,127,211,439.25
资产负债表日后第五年	1,043,260,783.04	1,009,281,248.73
以后年度	105,704,837.05	43,031,371.07
长期应收款总额	46,082,192,440.42	39,308,887,599.52
减: 利息调整	3,993,305,806.61	3,617,227,110.08
长期应收款余额	42,088,886,633.81	35,691,660,489.44
减: 减值准备	595,789,798.43	477,184,390.77
长期应收款净额	41,493,096,835.38	35,214,476,098.67
其中: 一年内到期的长期应收款净额	18,440,204,663.23	15,082,174,015.16
一年后到期的长期应收款净额	23,052,892,172.15	20,132,302,083.51

2021 年 6 月 30 日, 本集团长期应收款净额计人民币 10,384,675,359.89 元(2020 年 12 月 31 日: 人民币 9,757,834,904.70 元)质押用于借款。

四、 合并财务报表项目附注(续)

12. 应收融资租赁款及长期应收款(续)

(2) 长期应收款(续)

(ii) 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2020年12月31日	455,567,589.35	11,127,298.42	10,489,503.00	477,184,390.77
本期计提	98,869,537.64	19,244,721.91	13,794,027.79	131,908,287.34
本期核销	-	-	(5,367,552.13)	(5,367,552.13)
阶段转移	(1,874,981.01)	(3,733,510.00)	5,608,491.01	-
收回以前年度核销	-	-	53,900.00	53,900.00
本期其他终止确认	-	-	(7,989,227.55)	(7,989,227.55)
于2021年6月30日	552,562,145.98	26,638,510.33	16,589,142.12	595,789,798.43

(iii) 长期应收款现值分析如下:

	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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
2021年6月30日	41,924,757,283.11	128,214,562.26	35,914,788.44	42,088,886,633.81
2020年12月31日	35,612,607,997.23	57,603,949.90	21,448,542.31	35,691,660,489.44

四、合并财务报表项目附注(续)

13、长期股权投资

被投资单位	2020年12月31日	本期增、减变动						2021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	公司享有的宣告发放 现金股利或利润	其他		
一、合营企业									
上海彤关投资管理合伙企业(有限合伙)	78,072,414.74	-	-	5,409,425.98	-	-	-	83,481,840.72	-
小计	78,072,414.74	-	-	5,409,425.98	-	-	-	83,481,840.72	-
二、联营企业									
富国基金管理有限公司	1,448,468,781.79	-	-	337,663,452.50	-	(200,535,500.00)	-	1,585,596,734.29	-
吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	142,397,513.87	-	-	(10,474,713.73)	-	-	-	131,922,800.14	-
西安航天新能源产业基金投资有限公司	331,724,595.41	-	-	166,773,993.63	-	-	-	498,498,589.04	-
上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	306,216,860.07	-	-	50,237,393.53	-	-	-	356,454,253.60	-
上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)	462,370,355.22	-	(65,147,545.45)	30,153,377.18	-	(16,982,156.83)	-	410,394,030.12	-
海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	69,507,328.82	-	-	(6,304,984.44)	-	-	-	63,202,344.38	-
海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金(有限合伙)	177,704,093.48	-	-	(5,463,890.10)	-	(96,040.26)	-	172,144,163.12	-
海通齐东(威海)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	164,434,063.01	-	(19,908,700.00)	31,910,853.80	-	(1,495,629.89)	-	174,940,586.92	-
海通(吉林)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	36,392,101.06	-	-	5,928,349.81	-	-	-	42,320,450.87	-
广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)	244,178,214.60	-	(11,466,811.44)	(2,732,587.80)	-	(29,040,482.37)	-	200,938,332.99	-
西安军融电子卫星基金投资有限公司	80,318,543.72	-	-	(1,028,361.18)	-	-	-	79,290,182.54	-
嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业(有限合伙)	69,317,237.11	-	-	19,907,648.63	-	-	-	89,224,885.74	-
上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	151,804,500.16	-	-	328,358.90	-	-	-	152,132,859.06	-
辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业(有限合伙)	298,224,766.20	-	-	(1,397,265.28)	-	-	-	296,827,500.92	-
许昌海通创新股权投资基金合伙企业(有限合伙)	15,013,515.49	-	-	19,914.27	-	-	-	15,033,429.76	-
湖州赞通股权投资合伙企业(有限合伙)	9,762,552.30	-	-	(2,042,808.33)	-	-	-	7,719,743.97	-
吉林海通创新卫星投资中心(有限合伙)	30,000,000.00	-	-	-	-	-	-	30,000,000.00	-
合肥市海通徽银股权投资合伙企业(有限合伙)	62,005,126.67	-	-	(1,818,784.39)	-	-	-	60,186,342.28	-
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	250,394,419.61	-	-	7,667,240.68	-	-	-	258,061,660.29	-
Fundo Espírito Santo IBERIA I(注 1)	0.88	-	(7,936.99)	7,947.52	-	-	(11.41)	-	-
小计	4,350,234,569.47	-	(96,530,993.88)	619,335,135.20	-	(248,149,809.35)	(11.41)	4,624,888,890.03	-
合计	4,428,306,984.21	-	(96,530,993.88)	624,744,561.18	-	(248,149,809.35)	(11.41)	4,708,370,730.75	-

注 1: Fundo Espírito Santo IBERIA I 注册地为葡萄牙, 已于 2021 年 5 月终止经营。

注 2: 在合营和联营企业中的权益相关信息详见附注六、2。

四、合并财务报表项目附注(续)

14、投资性房地产

项目	房屋、建筑物
	人民币元
一、账面原值	
1、2020年12月31日	143,239,142.17
2、本期增加金额	-
3、本期减少金额	58,310,502.24
4、外币报表折算差额	(669,945.69)
5、2021年6月30日	84,258,694.24
二、累计折旧和累计摊销	
1、2020年12月31日	31,647,629.39
2、本期增加金额	1,919,094.42
3、本期减少金额	6,430,958.95
4、外币报表折算差额	-
5、2021年6月30日	27,135,764.86
三、账面价值	
1、2021年6月30日	57,122,929.38
2、2020年12月31日	111,591,512.78

于 2021 年 6 月 30 日，本集团无用于抵押或担保的投资性房地产(2020 年 12 月 31 日：同)。

15、固定资产

(1) 账面价值

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
固定资产原值	16,972,754,814.80	16,860,275,873.68
减：累计折旧	2,836,210,638.88	2,543,356,663.07
固定资产减值准备	57,573,030.09	30,381,872.93
固定资产账面价值合计	14,078,971,145.83	14,286,537,337.68

四、合并财务报表项目附注(续)

15、固定资产(续)

(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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一、账面原值：						
2020年12月31日	9,070,468,008.43	1,474,674,236.73	162,437,163.16	269,661,615.65	5,883,034,849.71	16,860,275,873.68
本期增加	58,310,502.24	117,490,075.64	2,993,148.79	39,718,870.13	-	218,512,596.80
(1)本期购置	-	102,288,202.41	2,993,148.79	15,000,559.39	-	120,281,910.59
(2)在建工程转入	-	15,201,873.23	-	24,718,310.74	-	39,920,183.97
(3)其他转入	58,310,502.24	-	-	-	-	58,310,502.24
本期减少	-	23,536,507.54	6,474,231.20	4,787,545.21	-	34,798,283.95
(1)转让和出售	-	-	1,080,571.50	-	-	1,080,571.50
(2)清理报废	-	23,536,507.54	5,393,659.70	4,787,545.21	-	33,717,712.45
(3)其他减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	(4,198,136.24)	(5,916,697.08)	(6,682.44)	(2,688,338.53)	(58,425,517.44)	(71,235,371.73)
2021年6月30日	9,124,580,374.43	1,562,711,107.75	158,949,398.31	301,904,602.04	5,824,609,332.27	16,972,754,814.80
二、累计折旧：						
2020年12月31日	689,638,499.50	1,081,583,361.95	133,959,905.20	205,570,956.73	432,603,939.69	2,543,356,663.07
本期转入	6,430,958.95	-	-	-	-	6,430,958.95
本期计提	123,889,794.34	87,491,733.33	4,681,177.24	10,814,444.47	105,257,121.73	332,134,271.11
本期减少	-	22,443,695.33	6,155,427.29	4,529,642.85	-	33,128,765.47
外币报表折算差额	(341,261.13)	(5,442,227.61)	(3,628.08)	(2,367,831.77)	(4,427,540.19)	(12,582,488.78)
2021年6月30日	819,617,991.66	1,141,189,172.34	132,482,027.07	209,487,926.58	533,433,521.23	2,836,210,638.88
三、减值准备：						
2020年12月31日	30,381,872.93	-	-	-	-	30,381,872.93
本期计提	-	-	-	-	27,191,157.16	27,191,157.16
本期减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-	-
2021年6月30日	30,381,872.93	-	-	-	27,191,157.16	57,573,030.09
四、账面价值：						
2021年6月30日	8,274,580,509.84	421,521,935.41	26,467,371.24	92,416,675.46	5,263,984,653.88	14,078,971,145.83
2020年12月31日	8,350,447,636.00	393,090,874.78	28,477,257.96	64,090,658.92	5,450,430,910.02	14,286,537,337.68

(3) 期末用于抵押或担保的固定资产情况见附注十、1、(1)。

(4) 于2021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30,060,393.95元(2020年12月31日：人民币30,660,707.15元)。

四、合并财务报表项目附注(续)

16、在建工程

(1) 在建工程账面价值

项目	2021年6月30日			2020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
办公楼装修及设备改造	414,461,060.31	-	414,461,060.31	357,580,408.68	-	357,580,408.68
软件系统	27,041,837.93	-	27,041,837.93	27,154,216.59	-	27,154,216.59
合计	441,502,898.24	-	441,502,898.24	384,734,625.27	-	384,734,625.27

(2) 在建工程项目变动情况

工程名称	资金来源	2020年12月31日	本期增加	本期减少			外币报表折算差额	2021年6月30日
				本期转入固定资产	本期转入无形资产	本期转入长期待摊费用		
办公楼装修及设备改造	自有资金	357,580,408.68	115,411,644.09	39,920,183.97	-	18,093,878.97	(516,929.52)	414,461,060.31
软件系统	自有资金	27,154,216.59	696,586.33	-	224,853.21	-	(584,111.78)	27,041,837.93
合计		384,734,625.27	116,108,230.42	39,920,183.97	224,853.21	18,093,878.97	(1,101,041.30)	441,502,898.24

17、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	其他	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一、账面原值					
2020年12月31日	832,440,829.50	1,614,795,768.74	224,225,296.82	134,079,142.50	2,805,541,037.56
本期增加	-	51,904,671.81	-	-	51,904,671.81
本期减少	-	369,455.87	-	-	369,455.87
外币报表折算差额	-	(15,363,070.35)	(72,758.72)	(723,605.77)	(16,159,434.84)
2021年6月30日	832,440,829.50	1,650,967,914.33	224,152,538.10	133,355,536.73	2,840,916,818.66
二、累计摊销					
2020年12月31日	77,829,833.83	1,231,501,563.12	116,600,323.50	87,196,768.09	1,513,128,488.54
本期增加	10,151,717.46	94,573,914.37	-	3,358,066.60	108,083,698.43
本期减少	-	369,455.87	-	-	369,455.87
外币报表折算差额	-	(13,679,317.14)	-	(595,947.00)	(14,275,264.14)
2021年6月30日	87,981,551.29	1,312,026,704.48	116,600,323.50	89,958,887.69	1,606,567,466.96
三、减值准备					
2020年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-
2021年6月30日	-	-	-	-	-
四、账面价值					
2021年6月30日	744,459,278.21	338,941,209.85	107,552,214.60	43,396,649.04	1,234,349,351.70
2020年12月31日	754,610,995.67	383,294,205.62	107,624,973.32	46,882,374.41	1,292,412,549.02

(2) 期末无用于抵押或担保的无形资产。

四、合并财务报表项目附注(续)

18、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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一、账面原值					
2020年12月31日	2,070,078,661.54	758,957.67	5,303,239.38	2,308,116.26	2,078,448,974.85
本期增加	193,155,665.99	706,726.80	509,320.97	295,408.85	194,667,122.61
本期减少	180,283,905.26	579,441.22	407,122.36	397,145.81	181,667,614.65
外币报表折算差额	(7,795,280.82)	(32,042.26)	(124,390.87)	468.66	(7,951,245.29)
2021年6月30日	2,075,155,141.45	854,200.99	5,281,047.12	2,206,847.96	2,083,497,237.52
二、累计折旧					
2020年12月31日	1,029,951,745.35	567,846.78	3,039,358.45	1,165,002.18	1,034,723,952.76
本期增加	225,719,408.27	110,859.57	709,817.21	244,877.72	226,784,962.77
本期减少	158,901,493.17	559,410.46	392,631.68	397,145.81	160,250,681.12
外币报表折算差额	(3,503,352.22)	(3,244.74)	(59,270.78)	208.37	(3,565,659.37)
2021年6月30日	1,093,266,308.23	116,051.15	3,297,273.20	1,012,942.46	1,097,692,575.04
三、减值准备					
2020年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-
2021年6月30日	-	-	-	-	-
四、账面价值					
2021年6月30日	981,888,833.22	738,149.84	1,983,773.92	1,193,905.50	985,804,662.48
2020年12月31日	1,040,126,916.19	191,110.89	2,263,880.93	1,143,114.08	1,043,725,022.09

(2) 租赁负债

租赁负债的到期期限分析如下：

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
1年以内	338,499,319.97	352,544,235.99
1-2年	230,634,368.56	254,445,205.35
2-5年	210,243,220.85	223,003,754.86
5年以上	220,987,866.87	222,420,305.99
合计	1,000,364,776.25	1,052,413,502.19

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并厘定合同可强制执行的期间。

四、合并财务报表项目附注(续)

18. 使用权资产与租赁负债(续)

(2) 租赁负债(续)

2021 年上半年，租赁资金流出总额达人民币 27,656.51 万元(2020 年上半年：人民币 30,156.11 万元)。

2021 年上半年，租赁负债利息支出人民币 2,026.89 万元(2020 年上半年：人民币 2,028.10 万元)。

截至 2021 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 2021 年 6 月 30 日，本集团无已签署协议，但尚未达到租赁期开始日的除短期租赁和低价租赁外的租赁。

19. 商誉

被投资单位名称	2020 年 12 月 31 日	汇兑调整	2021 年 6 月 30 日	期末减值准备
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
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	660,671,290.53	(7,504,417.02)	653,166,873.51	-
海通恒信金融集团有限公司	2,107,616,702.56	(23,939,945.44)	2,083,676,757.12	-
Haitong International Holdings(UK) Limited	124,431,068.99	(1,413,384.61)	123,017,684.38	-
Haitong Bank,S.A.	981,645,003.19	(11,150,285.43)	970,494,717.76	-
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	4,649,358.49	(52,811.01)	4,596,547.48	-
合计	3,884,909,888.02	(44,060,843.51)	3,840,849,044.51	-

20. 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 未经抵消的递延所得税资产

项目	2021 年 6 月 30 日		2020 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
资产减值准备	9,500,664,534.66	2,391,769,899.65	10,315,014,132.15	2,603,868,171.94
应付未付款项可抵扣税款	6,017,659,051.47	1,506,604,242.66	5,290,608,681.22	1,324,938,161.95
可抵扣亏损	2,472,642,361.98	561,948,951.51	2,343,042,893.83	520,655,022.37
交易性金融负债	227,250,980.06	56,812,745.02	54,747,446.22	13,686,861.56
交易性金融资产	157,629,282.57	39,407,320.64	100,150,216.65	25,037,554.16
其他债权投资	56,853,974.75	14,604,414.58	748,104,127.52	187,026,031.88
衍生金融工具	43,306,343.81	14,686,346.97	172,080,675.98	54,798,815.10
其他权益工具投资	-	-	12,740,877.96	1,973,816.77
无形资产、固定资产及长期待摊费用	562,667.17	140,666.79	562,667.17	140,666.78
其他	81,255,546.60	29,710,318.57	106,542,939.19	32,509,721.96
合计	18,557,824,743.07	4,615,684,906.39	19,143,594,657.89	4,764,634,824.47

四、 合并财务报表项目附注(续)

20、 递延所得税资产和递延所得税负债(续)

(2) 未经抵销的递延所得税负债

项目	2021年6月30日		2020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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
交易性金融资产	6,305,104,843.86	1,575,742,521.92	3,592,737,091.28	898,184,272.84
无形资产、固定资产及长期待摊费用	659,586,261.53	86,731,523.54	613,875,868.57	81,748,702.97
其他权益工具投资	190,875,659.80	47,718,914.95	734,793,418.86	182,679,810.07
衍生金融工具	32,474,212.35	8,118,553.09	2,272,553.07	568,138.27
其他	218,895,951.55	52,660,864.20	77,924,260.16	17,428,295.33
合计	7,406,936,929.09	1,770,972,377.70	5,021,603,191.94	1,180,609,219.48

(3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债:

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
递延所得税资产	4,092,069,770.39	4,282,160,088.28
递延所得税负债	(1,247,357,241.70)	(698,134,483.29)

21、 其他资产

(1) 项目列示

项目	注释	2021年6月30日	2020年12月31日
		人民币元	人民币元
其他应收款	(2)	4,155,595,245.53	1,361,144,100.17
长期待摊费用	(3)	220,929,976.01	231,255,960.38
发放贷款和垫款	(4)	3,849,754,868.00	3,820,126,939.73
其他贷款和应收款	(5)	17,479,455,559.61	20,120,007,448.42
政府合作项目长期应收款项		658,323,673.43	458,506,840.68
回收融资租赁设备		225,081,402.39	179,685,619.97
抵债资产		98,773,901.33	82,915,424.83
存货		702,161,582.04	268,965,373.05
其他		3,036,738,775.54	2,325,828,439.69
合计		30,426,814,983.88	28,848,436,146.92

四、 合并财务报表项目附注(续)

21、 其他资产(续)

(2) 其他应收款

(i) 其他应收款明细列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
应收项目保证金及待结算款	2,463,423,375.81	-
预付款项	1,369,643,814.59	1,206,333,252.06
浙江斯文新技术投资有限公司	440,894,056.51	440,894,056.51
其他	373,032,155.46	196,111,721.74
其他应收款余额	4,646,993,402.37	1,843,339,030.31
减：坏账准备	491,398,156.84	482,194,930.14
其他应收款账面价值	4,155,595,245.53	1,361,144,100.17

(ii) 其他应收款按账龄分析

账龄	2021年6月30日				2020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
	人民币元	%	人民币元	%	人民币元	%	人民币元	%
1年以内	3,827,665,130.20	82.37	7,693,311.80	1.56	1,159,084,232.30	62.88	1,414,798.42	0.29
1-2年	219,723,278.61	4.73	3,233,557.22	0.66	106,147,723.89	5.76	4,979,044.27	1.03
2-3年	51,819,597.06	1.11	8,145,835.54	1.66	47,500,151.88	2.58	6,486,855.48	1.35
3年以上	547,785,396.50	11.79	472,325,452.28	96.12	530,606,922.24	28.78	469,314,231.97	97.33
合计	4,646,993,402.37	100.00	491,398,156.84	100.00	1,843,339,030.31	100.00	482,194,930.14	100.00

注：其他应收款坏账准备主要是公司通过浙江斯文新技术投资有限公司存放在广东证券的保证金人民币 440,894,056.51 元，公司已根据可收回情况计提了 100%的坏账准备。

(iii) 期末其他应收款项余额中无持公司 5%以上(含 5%)表决权股份的股东单位欠款。

四、 合并财务报表项目附注(续)

21、 其他资产(续)

(3) 长期待摊费用

项目	2020年12月31日	本期增加额	本期摊销额	其他减少	2021年6月30日
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
装修及布线改造等	231,255,960.38	63,947,190.36	54,225,569.40	20,047,605.33	220,929,976.01

(4) 发放贷款和垫款

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
个人贷款和垫款	3,036,235.80	3,402,832.70
企业贷款和垫款	3,937,553,537.23	3,924,168,254.60
小计	3,940,589,773.03	3,927,571,087.30
减：贷款损失准备	90,834,905.03	107,444,147.57
合计	3,849,754,868.00	3,820,126,939.73

(i) 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2020年12月31日	14,888,502.89	59,466,655.55	33,088,989.13	107,444,147.57
本期计提/(转回)	3,380,831.58	(20,359,256.33)	3,703,238.05	(13,275,186.70)
本期核销	-	(414,848.27)	(2,919,186.42)	(3,334,034.69)
阶段转移	(412,349.45)	(1,441,455.86)	1,853,805.31	-
外汇变动	9,523.38	(48,504.95)	38,960.42	(21.15)
于2021年6月30日	17,866,508.40	37,202,590.14	35,765,806.49	90,834,905.03

(ii) 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于2021年6月30日	3,037,417,778.95	606,515,501.70	296,656,492.38	3,940,589,773.03
于2020年12月31日	2,599,476,256.90	1,164,583,513.36	163,511,317.04	3,927,571,087.30

四、 合并财务报表项目附注(续)

21、 其他资产(续)

(5) 其他贷款和应收款

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
应收保理款	7,457,646,868.60	7,480,392,111.18
境内委托贷款及其他贷款	766,087,698.29	798,422,004.32
境外贷款和应收款项	10,113,163,686.09	12,720,031,555.29
小计	18,336,898,252.98	20,998,845,670.79
减：减值准备	857,442,693.37	878,838,222.37
合计	17,479,455,559.61	20,120,007,448.42

(i) 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2020 年 12 月 31 日	161,118,510.42	394,662,132.95	323,057,579.00	878,838,222.37
本期计提	11,801,660.89	42,991,940.19	106,179,184.53	160,972,785.61
阶段转移	(12,460,463.84)	(89,105,474.74)	101,565,938.58	-
本期其他终止确认	-	-	(180,034,317.28)	(180,034,317.28)
外汇变动	(426,377.85)	(90,284.89)	(1,817,334.59)	(2,333,997.33)
于 2021 年 6 月 30 日	160,033,329.62	348,458,313.51	348,951,050.24	857,442,693.37

(ii) 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
于 2021 年 6 月 30 日	12,601,683,280.36	3,680,012,978.95	2,055,201,993.67	18,336,898,252.98
于 2020 年 12 月 31 日	17,566,347,026.50	1,724,497,070.45	1,708,001,573.84	20,998,845,670.79

22、 融券业务情况

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
融出证券	8,283,768,871.36	6,370,290,121.94
交易性金融资产	3,092,343,845.58	2,491,174,604.41
其中：股票	2,609,769,142.52	2,001,078,932.92
基金	482,574,703.06	490,095,671.49
其他权益工具投资-股票	2,415,406,467.74	-
转融通融入证券	2,776,018,558.04	3,879,115,517.53
转融通融入证券总额	4,569,580,011.58	5,263,508,713.00

注：本期融券业务无违约情况(2020 年 12 月 31 日：同)。

四、 合并财务报表项目附注(续)

23、 资产减值准备变动表

项目	年初余额	本期增加 (含汇率变动)		本期减少			期末余额
		计提	其他增加	转回	核销	其他减少	
		人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	
货币资金减值准备	2,249,199.79	7,358,761.18	(10,281.89)	552,315.08	-	-	9,045,364.00
融出资金减值准备	2,085,013,566.17	285,225,362.12	(10,876,433.02)	234,136.68	670,385,707.26	-	1,688,742,651.33
应收款项坏账准备	176,485,409.66	40,600,590.22	(1,658,799.83)	3,808,608.84	4,022,052.98	-	207,596,538.23
其他应收款坏账准备	482,194,930.14	9,712,489.40	(4,587.49)	504,675.21	-	-	491,398,156.84
买入返售金融资产减值准备	1,795,486,106.82	91,648,479.61	11,424,238.73	225,016,294.86	-	-	1,673,542,530.30
发放贷款和垫款损失准备	107,444,147.57	10,240,258.03	(21.15)	23,515,444.73	3,334,034.69	-	90,834,905.03
应收融资租赁款减值准备	1,517,769,294.86	497,562,425.52	-	-	202,762,854.41	304,830,290.22	1,507,738,575.75
长期应收款减值准备	477,184,390.77	131,908,287.34	-	-	5,313,652.13	7,989,227.55	595,789,798.43
其他贷款和应收款项减值准备	878,838,222.37	181,412,037.90	(2,333,997.33)	20,439,252.29	-	180,034,317.28	857,442,693.37
其他债权投资减值准备	747,755,152.24	48,613,247.82	7,309,214.87	10,913,285.30	21,758.65	601,324,048.01	191,418,522.97
债权投资减值准备	89,066,359.04	6,710,843.39	(3,699,687.61)	3,386,241.31	-	77,000,080.19	11,691,193.32
其他资产减值准备	56,865,030.23	4,418,473.93	(3,212,721.65)	2,275,880.41	-	-	55,794,902.10
金融工具及其他项目信用减值准备小计	8,416,351,809.66	1,315,411,256.46	(3,063,076.37)	290,646,134.71	885,840,060.12	1,171,177,963.25	7,381,035,831.67
长期股权投资减值准备	2,725,827.51	-	(111,314.71)	-	2,614,512.80	-	-
固定资产减值准备	30,381,872.93	27,191,157.16	-	-	-	-	57,573,030.09
其他资产减值准备	12,976,812.44	16,891,988.60	89,281.26	-	2,879,068.91	-	27,079,013.39
其他资产减值准备小计	46,084,512.88	44,083,145.76	(22,033.45)	-	5,493,581.71	-	84,652,043.48
合计	8,462,436,322.54	1,359,494,402.22	(3,085,109.82)	290,646,134.71	891,333,641.83	1,171,177,963.25	7,465,687,875.15

四、 合并财务报表项目附注(续)

24、 金融工具及其他项目预期信用损失准备表

金融工具类别	2021年6月30日			
	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)	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
货币资金减值准备	9,045,364.00	-	-	9,045,364.00
融出资金减值准备	44,897,434.97	40,970,826.51	1,602,874,389.85	1,688,742,651.33
应收款项坏账准备	-	161,414,828.42	46,181,709.81	207,596,538.23
其他应收款坏账准备	3,764,138.75	46,739,960.58	440,894,057.51	491,398,156.84
买入返售金融资产减值准备	5,617,289.31	1,146,302.44	1,666,778,938.55	1,673,542,530.30
发放贷款和垫款损失准备	17,866,508.40	37,202,590.14	35,765,806.49	90,834,905.03
应收融资租赁款减值准备	633,525,613.34	490,873,640.05	383,339,322.36	1,507,738,575.75
长期应收款减值准备	552,562,145.98	26,638,510.33	16,589,142.12	595,789,798.43
其他贷款和应收款项减值准备	160,033,329.62	348,458,313.51	348,951,050.24	857,442,693.37
其他债权投资减值准备	37,633,806.42	153,043,320.32	741,396.23	191,418,522.97
债权投资减值准备	11,691,193.32	-	-	11,691,193.32
其他资产减值准备	14,003,073.01	655,824.41	41,136,004.68	55,794,902.10
合计	1,490,639,897.12	1,307,144,116.71	4,583,251,817.84	7,381,035,831.67

金融工具类别	2020年12月31日			
	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)	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
货币资金减值准备	2,249,199.79	-	-	2,249,199.79
融出资金减值准备	32,759,988.42	5,838,258.22	2,046,415,319.53	2,085,013,566.17
应收款项坏账准备	-	126,268,370.28	50,217,039.38	176,485,409.66
其他应收款坏账准备	-	37,274,169.22	444,920,760.92	482,194,930.14
买入返售金融资产减值准备	9,692,790.34	7,881,265.01	1,777,912,051.47	1,795,486,106.82
发放贷款和垫款损失准备	14,888,502.89	59,466,655.55	33,088,989.13	107,444,147.57
应收融资租赁款减值准备	707,111,347.68	429,307,953.15	381,349,994.03	1,517,769,294.86
长期应收款减值准备	455,567,589.35	11,127,298.42	10,489,503.00	477,184,390.77
其他贷款和应收款项减值准备	161,118,510.42	394,662,132.95	323,057,579.00	878,838,222.37
其他债权投资减值准备	45,422,698.38	99,440,622.52	602,891,831.34	747,755,152.24
债权投资减值准备	11,013,521.34	-	78,052,837.70	89,066,359.04
其他资产减值准备	8,759,181.42	4,580,296.12	43,525,552.69	56,865,030.23
合计	1,448,583,330.03	1,175,847,021.44	5,791,921,458.19	8,416,351,809.66

25、 短期借款

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
信用借款	32,092,794,249.95	37,565,046,083.55
质押借款	4,151,568,905.81	5,722,206,190.64
保证借款	-	80,301,798.62
合计	36,244,363,155.76	43,367,554,072.81

注： 短期借款质押物情况详见附注十、1、(1)。

四、 合并财务报表项目附注(续)

26、 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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
					人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
海通证券股份有限公司	短期融资券	2020年10月15日	2021年1月13日	2.88%	5,030,772,602.74	4,734,246.58	5,035,506,849.32	-
海通证券股份有限公司	公司债券	2020年6月5日	2021年3月2日	2.20%	1,012,657,534.25	3,616,465.75	1,016,274,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	2021年1月28日	2021年12月19日	3.10%	-	6,078,476,712.33	-	6,078,476,712.33
海通证券股份有限公司	短期收益凭证	2020年7月6日	2022年6月28日	2.00%-8.18%	8,911,522,758.92	10,989,577,644.55	17,179,130,852.57	2,721,969,550.90
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2020年7月16日	2021年1月15日	1.73%	1,007,865,368.88	663,561.64	1,008,528,930.52	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2020年8月6日	2021年1月29日	1.85%	1,007,362,486.99	1,419,178.07	1,008,781,665.06	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2020年8月27日	2021年1月22日	1.85%	503,140,853.72	532,191.78	503,673,045.50	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2020年9月18日	2021年5月26日	2.40%	503,144,901.42	4,767,123.29	507,912,024.71	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2020年10月29日	2021年2月5日	1.95%	1,003,163,168.18	1,869,863.02	1,005,033,031.20	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	短期融资券	2020年11月27日	2021年11月27日	4.17%	501,167,032.73	10,789,694.56	-	511,956,727.29
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2020年12月3日	2021年4月17日	3.05%	1,001,752,336.44	8,857,534.25	1,010,609,870.69	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年2月2日	2021年8月27日	3.60%	-	507,184,521.69	-	507,184,521.69
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年2月3日	2021年7月30日	3.80%	-	507,619,625.92	-	507,619,625.92
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年3月17日	2021年8月13日	3.20%	-	504,501,479.26	-	504,501,479.26
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年4月22日	2021年10月15日	3.25%	-	1,005,700,507.03	-	1,005,700,507.03
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年4月30日	2022年1月21日	3.35%	-	1,004,764,130.04	-	1,004,764,130.04
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年5月21日	2022年1月21日	3.25%	-	1,002,686,956.63	-	1,002,686,956.63
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年5月24日	2022年2月18日	3.30%	-	501,181,866.46	-	501,181,866.46
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年1月8日	2021年5月25日	3.05%	-	1,011,447,945.21	1,011,447,945.21	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年1月19日	2021年3月19日	2.78%	-	502,246,849.32	502,246,849.32	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年1月27日	2021年4月24日	3.20%	-	1,007,627,397.26	1,007,627,397.26	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年2月18日	2021年2月16日	LIBOR + 0.85%	195,970,487.29	-	195,970,487.29	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年2月24日	2021年2月22日	LIBOR + 0.85%	202,476,199.09	-	202,476,199.09	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年3月3日	2021年3月2日	LIBOR + 0.85%	293,822,394.78	-	293,822,394.78	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年4月23日	2021年4月21日	2.50%	320,779,596.33	-	320,779,596.33	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年4月29日	2021年4月28日	2.75%	332,176,528.66	-	332,176,528.66	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年5月26日	2021年5月25日	2.40%	468,936,053.87	-	468,936,053.87	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年5月28日	2021年5月27日	2.30%	971,048,057.79	-	971,048,057.79	-

四、 合并财务报表项目附注(续)

26、 应付短期融资款(续)

(续上表)

发行主体	类型	起息日期	到期日期	票面利率	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
					人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年8月7日	2021年2月5日	1.16%	424,295,607.94	-	424,295,607.94	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年8月10日	2021年8月9日	1.45%	245,662,099.13	2,482,219.49	2,790,419.86	245,353,898.76
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年9月8日	2021年9月7日	0.00%	322,908,330.84	2,920,601.07	3,667,843.31	322,161,088.60
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年9月17日	2021年9月16日	1.18%	653,672,916.64	5,613,673.65	7,424,924.05	651,861,666.24
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年11月9日	2021年8月9日	0.00%	608,190,912.46	5,141,807.44	6,908,304.17	606,424,415.73
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2020年11月9日	2021年2月9日	1.10%	196,034,472.38	-	196,034,472.38	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年1月8日	2021年4月8日	0.90%	-	744,698,447.94	744,698,447.94	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年1月12日	2021年4月13日	0.90%	-	712,338,022.58	712,338,022.58	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年1月13日	2021年12月15日	1.20%	-	1,299,456,673.41	-	1,299,456,673.41
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年2月22日	2021年5月24日	0.70%	-	258,901,350.40	258,901,350.40	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年2月25日	2021年11月30日	0.90%	-	647,801,698.00	-	647,801,698.00
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年2月25日	2021年12月8日	0.90%	-	647,784,646.38	-	647,784,646.38
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年3月9日	2021年9月9日	0.75%	-	317,697,094.72	-	317,697,094.72
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年3月15日	2021年6月15日	0.63%	-	407,704,725.09	407,704,725.09	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年4月8日	2022年1月10日	0.72%	-	323,522,039.26	-	323,522,039.26
合计					25,718,522,701.47	30,036,328,494.07	36,346,745,896.89	19,408,105,298.65

注：于 2021 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、短期融资券以及原始期限为 1 年以内的收益凭证。于 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本集团发行的应付短期融资款没有出现本金、利息或赎回款项的违约情况。

四、 合并财务报表项目附注(续)

27、 拆入资金

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
银行拆入	7,026,181,744.94	14,069,196,961.99
转融通业务融入	9,014,883,333.33	1,000,315,555.56
合计	16,041,065,078.27	15,069,512,517.55

本公司转融通融入资金的剩余期限及利率如下表所示：

项目	2021年6月30日	利率	2020年12月31日	利率
	人民币元	%	人民币元	%
1个月以内	3,014,466,666.66	2.80	-	
1至3个月	-		1,000,315,555.56	2.80
3至12个月	6,000,416,666.67	2.50	-	
合计	9,014,883,333.33		1,000,315,555.56	

28、 交易性金融负债

2021年6月30日			
项目	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1)	公允价值合计
	人民币元	人民币元	人民币元
归属结构化主体其他份额持有人的利益	-	7,225,199,290.96	7,225,199,290.96
结构化收益产品(注3)	-	18,535,055,113.98	18,535,055,113.98
其他(注4)	1,597,202,845.44	11,273,829,658.87	12,871,032,504.31
合计	1,597,202,845.44	37,034,084,063.81	38,631,286,909.25

2020年12月31日			
项目	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1)	公允价值合计
	人民币元	人民币元	人民币元
黄金期权(注2)	-	203,316,548.92	203,316,548.92
归属结构化主体其他份额持有人的利益	-	6,002,904,137.61	6,002,904,137.61
结构化收益产品(注3)	-	16,857,901,077.88	16,857,901,077.88
其他(注4)	4,412,068,287.96	4,762,110,892.37	9,174,179,180.33
合计	4,412,068,287.96	27,826,232,656.78	32,238,300,944.74

注1：于2021年6月30日和2020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。

四、 合并财务报表项目附注(续)

28、 交易性金融负债(续)

注 2：黄金期权交易系集团通过一揽子挂钩黄金价格的期权合同，合并形成互相之间抵销黄金标的市场价格波动的目的，本集团将这一揽子黄金期权交易指定为以公允价值计量变动进入当期损益的金融资产或负债。

注 3：于 2021 年 6 月 30 日和 2020 年 12 月 31 日，本集团指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债中包括本集团发行的结构化收益产品，通常以票据或掉期合约的形式发行，其回报与上市股权投资、债务投资、非上市投资基金、非上市金融产品、非上市股权投资以及合伙企业的回报或价值相关。由这些结构化产品引起的经济风险主要通过指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产来对冲，详见附注四、8。这些结构化产品是集团以公允价值管理风险的投资组合的一部分，本集团作为合约对手方所面临的风险以公允价值为基础，向关键管理人员报告。

注 4：本集团指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债中包括本集团发行的收益凭证，合约包含一种或以上嵌入式衍生工具，例如股票价格指数，整份合约在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入损益的金融负债。

29、 卖出回购金融资产款

(1) 按金融资产种类列示

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
股票	4,747,987,416.01	4,028,550,224.07
债券	44,384,076,986.06	45,162,927,261.33
黄金	10,693,937,685.70	11,371,955,233.22
合计	59,826,002,087.77	60,563,432,718.62

(2) 按业务类别列示

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
债券质押式报价回购	104,013,627.32	109,339,805.95
其他质押式回购	41,783,369,683.72	40,967,747,884.55
买断式回购	7,244,681,091.03	8,114,389,794.90
黄金掉期业务	10,693,937,685.70	11,371,955,233.22
合计	59,826,002,087.77	60,563,432,718.62

四、 合并财务报表项目附注(续)

29、 卖出回购金融资产款(续)

(3) 债券质押式报价回购的剩余期限和利率区间

剩余期限	2021年6月30日		2020年12月31日	
	人民币元	利率区间	人民币元	利率区间
一个月以内	88,015,474.84	1.90%-4.20%	97,140,147.34	2.00%-3.20%
一个月至三个月内	15,998,152.48		11,146,566.29	
三个月至一年以内	-		1,053,092.32	
合计	104,013,627.32		109,339,805.95	

(4) 卖出回购金融资产款的担保物信息

担保物类别	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
股票	5,215,087,338.21	4,750,323,338.49
债券	50,000,580,703.01	56,943,544,150.53
其他	10,096,632,000.00	11,468,425,000.00
合计	65,312,300,041.22	73,162,292,489.02

30、 代理买卖证券款

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
普通经纪业务		
-个人	65,437,799,299.22	67,681,678,575.23
-机构	40,895,574,743.69	31,853,255,422.65
小计	106,333,374,042.91	99,534,933,997.88
信用业务		
-个人	7,014,449,920.46	6,797,543,925.88
-机构	2,168,160,868.68	1,835,090,045.53
小计	9,182,610,789.14	8,632,633,971.41
合计	115,515,984,832.05	108,167,567,969.29

31、 应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
短期薪酬(2)	6,460,300,969.40	6,057,406,416.76
离职后福利设定提存计划(3)	17,981,084.10	13,672,246.84
其他长期职工福利(2)	407,102,012.47	407,102,012.47
合计	6,885,384,065.97	6,478,180,676.07

四、合并财务报表项目附注(续)

31、应付职工薪酬(续)

(2) 短期薪酬及其他长期职工福利列示

项目	2020年 12月31日	本期增加额	本期减少额	2021年 6月30日
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一、工资、奖金、津贴和补贴	6,415,368,748.08	3,472,074,498.32	3,067,749,030.57	6,819,694,215.83
二、职工福利费	15,096,787.16	60,409,469.07	62,276,927.47	13,229,328.76
三、社会保险费	11,236,656.34	168,026,652.40	165,188,941.21	14,074,367.53
其中：医疗保险费	6,894,504.07	111,327,248.72	110,275,611.88	7,946,140.91
工伤保险费	164,742.49	1,953,221.97	1,916,968.01	200,996.45
生育保险费	161,054.30	1,437,895.86	1,271,589.97	327,360.19
四、住房公积金	515,533.36	124,973,344.49	117,921,401.53	7,567,476.32
五、工会经费和职工教育经费	22,290,704.29	53,568,808.19	63,021,919.05	12,837,593.43
六、因解除劳动关系给予的补偿	-	21,971,829.88	21,971,829.88	-
七、其他	-	77,199,771.53	77,199,771.53	-
合计	6,464,508,429.23	3,978,224,373.88	3,575,329,821.24	6,867,402,981.87
其中：短期薪酬	6,057,406,416.76	3,978,224,373.88	3,575,329,821.24	6,460,300,969.40
其他长期职工福利	407,102,012.47	-	-	407,102,012.47

(3) 设定提存计划

项目	2020年 12月31日	本期增加	本期减少	2021年 6月30日
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
基本养老保险	13,164,383.71	161,903,535.71	159,706,157.68	15,361,761.74
失业保险费	444,856.73	5,909,626.05	5,337,869.79	1,016,612.99
企业年金缴费	63,006.40	159,516,977.03	157,977,274.06	1,602,709.37
合计	13,672,246.84	327,330,138.79	323,021,301.53	17,981,084.10

32、应交税费

税费项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
增值税	99,381,856.93	112,403,590.02
城建税	7,376,749.58	6,677,289.19
教育费附加及地方教育费附加	5,334,761.40	4,938,545.62
企业所得税	1,423,230,884.06	2,986,566,540.54
个人所得税	367,939,152.59	258,293,831.19
其他	82,817,047.00	197,703,008.26
合计	1,986,080,451.56	3,566,582,804.82

四、 合并财务报表项目附注(续)

33、 应付款项

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
应付各类清算款	15,655,576,526.94	8,814,406,466.72
应付票据	2,636,347,870.60	2,030,279,553.71
收益互换保证金	1,534,283,414.53	603,929,620.25
其他	1,322,167,215.61	141,446,274.45
合计	21,148,375,027.68	11,590,061,915.13

期末余额中无欠持公司 5%以上(含 5%)表决权股份的股东单位款项。

34、 预计负债

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	人民币元	人民币元
对外提供担保	7,523,562.68	10,781,768.57
未决诉讼及其他	127,822,307.81	130,302,174.32
合计	135,345,870.49	141,083,942.89

35、 长期借款

项目	2021 年 6 月 30 日	利率区间	2020 年 12 月 31 日	利率区间
	人民币元		人民币元	
信用借款	25,194,207,271.61	1.45%-5.45%	24,096,100,630.37	1.71%-5.45%
抵质押借款	21,064,018,067.17	1.05%-5.23%	20,053,004,663.31	1.16%-5.32%
保证借款	5,120,234,347.74	1.29%-1.59%	5,213,897,446.99	1.29%-1.62%
合计	51,378,459,686.52		49,363,002,740.67	

注： 长期借款质押物情况详见附注十、1、(1)。

四、合并财务报表项目附注(续)

36、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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,390,000,000.00	2013年11月25日	2023年11月25日	6.18%	2,399,603,151.29	74,094,866.01	-	2,473,698,017.30
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2014年7月14日	2024年7月14日	5.85%	821,925,479.45	23,207,671.23	-	845,133,150.68
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2016年5月18日	2021年5月18日	3.80%	5,118,684,931.51	71,315,068.49	5,190,000,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2017年8月11日	2022年8月11日	4.80%	1,018,147,805.16	24,000,101.71	-	1,042,147,906.87
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,500,000,000.00	2017年9月22日	2027年9月22日	4.99%	5,568,411,210.54	136,570,180.97	-	5,704,981,391.51
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2018年3月8日	2021年3月8日	5.15%	3,126,563,013.70	27,936,986.30	3,154,500,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2018年3月22日	2021年3月22日	5.14%	3,120,402,739.73	33,797,260.27	3,154,200,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2018年5月10日	2021年5月10日	4.70%	3,091,167,123.29	49,832,876.71	3,141,000,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2018年8月6日	2021年8月6日	3.98%	3,048,414,246.58	59,209,315.06	-	3,107,623,561.64
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2018年11月22日	2021年11月22日	3.88%	3,012,756,164.38	57,721,643.84	-	3,070,477,808.22
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2019年4月11日	2022年4月11日	3.75%	5,136,130,136.99	92,979,452.05	187,500,000.00	5,041,609,589.04
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,500,000,000.00	2019年11月15日	2022年11月15日	3.52%	4,520,396,712.33	78,549,041.09	-	4,598,945,753.42
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年2月27日	2023年2月27日	3.01%	5,127,061,475.41	74,567,291.71	150,500,000.00	5,051,128,767.12
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,500,000,000.00	2020年3月19日	2023年3月19日	2.99%	3,582,573,150.68	51,894,931.51	104,650,000.00	3,529,818,082.19
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,600,000,000.00	2020年4月30日	2023年4月30日	2.38%	5,689,827,068.49	66,092,273.98	133,280,000.00	5,622,639,342.47
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	700,000,000.00	2020年4月30日	2025年4月30日	2.88%	713,587,287.67	9,997,150.69	20,160,000.00	703,424,438.36

四、合并财务报表项目附注(续)

36、应付债券(续)

(续上表)

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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,700,000,000.00	2020年5月25日	2023年5月25日	2.70%	6,809,531,232.88	89,706,575.34	180,900,000.00	6,718,337,808.22
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2020年8月11日	2023年8月11日	3.53%	6,082,979,178.08	105,029,589.04	-	6,188,008,767.12
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年10月21日	2021年10月23日	3.50%	5,034,520,547.95	86,780,821.91	-	5,121,301,369.86
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年10月21日	2022年10月21日	3.82%	5,037,676,712.33	94,715,068.49	-	5,132,391,780.82
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年11月19日	2022年1月13日	3.70%	5,021,794,520.55	91,739,726.03	-	5,113,534,246.58
海通证券股份有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2018年12月13日	2023年12月13日	4.50%	1,955,818,118.74	161,923,499.98	180,625,137.84	1,937,116,480.88
海通证券股份有限公司	公司债券	欧元	230,000,000.00	2018年12月13日	2023年12月13日	Euribor+165bps	1,846,828,379.44	61,932,664.58	140,020,386.22	1,768,740,657.80
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2021年1月13日	2024年1月13日	3.58%	-	6,099,455,342.47	-	6,099,455,342.47
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,400,000,000.00	2021年2月8日	2024年2月8日	3.79%	-	5,480,181,863.01	-	5,480,181,863.01
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年4月23日	2024年4月23日	3.45%	-	5,032,609,589.04	-	5,032,609,589.04
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,800,000,000.00	2021年5月27日	2024年5月27日	3.35%	-	2,808,994,520.55	-	2,808,994,520.55
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,100,000,000.00	2021年6月10日	2024年6月10日	3.40%	-	2,104,107,945.21	-	2,104,107,945.21
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,000,000,000.00	2016年11月17日	2021年11月17日	3.40%	2,008,383,561.64	33,720,547.95	-	2,042,104,109.59
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	3,300,000,000.00	2019年2月28日	2022年2月28日	4.09%	3,413,581,311.48	66,871,729.62	134,970,000.00	3,345,483,041.10
海通证券股份有限公司	收益凭证	人民币	676,460,700.00	2019年7月25日至 2021年6月30日	2021年7月1日至 2023年6月27日	0.00%-3.70%	482,398,804.50	1,614,019,499.35	1,411,176,819.07	685,241,484.78
海通证券股份有限公司	金融债券	人民币	7,000,000,000.00	2019年8月29日	2022年8月29日	3.39%	7,081,267,123.29	117,674,794.52	-	7,198,941,917.81

四、合并财务报表项目附注(续)

36、应付债券(续)

(续上表)

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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
上海海通证券资产管理有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年11月4日	2025年11月4日	3.85%	1,006,012,328.77	19,091,780.81	-	1,025,104,109.58
上海海通证券资产管理有限公司	次级债券	人民币	1,000,000,000.00	2018年4月4日	2023年4月4日	6.05%	1,045,084,931.46	16,620,547.98	960,500,000.00	101,205,479.44
上海海通证券资产管理有限公司	次级债券	人民币	1,000,000,000.00	2018年10月31日	2023年10月31日	5.34%	1,009,070,684.99	26,480,547.97	-	1,035,551,232.96
海通国际控股有限公司	公司债券	欧元	220,000,000.00	2016年5月18日及 2016年5月26日	2021年5月17日及 2021年5月26日	1.60%	1,782,341,829.00	71,300,854.03	1,853,642,683.03	-
海通国际控股有限公司	公司债券	美元	670,000,000.00	2020年3月12日	2025年3月11日	2.11%	4,389,271,630.87	60,230,985.28	102,651,564.79	4,346,851,051.36
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	2018年9月21日	2021年9月21日	5.05%	809,888,972.23	20,961,726.32	-	830,850,698.55
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	400,000,000.00	2018年10月26日	2021年10月26日	4.85%	402,978,023.97	9,967,187.17	-	412,945,211.14
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	2019年2月28日	2022年2月28日	5.20%	520,649,544.45	12,821,917.80	25,456,880.14	508,014,582.11
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	2019年7月24日	2022年7月24日	4.83%	509,221,763.87	12,627,117.53	-	521,848,881.40
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	2020年9月17日	2023年9月17日	4.20%	1,006,515,613.51	22,065,180.09	-	1,028,580,793.60
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,200,000,000.00	2020年7月28日	2023年7月28日	4.00%	1,214,346,658.13	24,975,148.53	-	1,239,321,806.66
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	2020年10月30日	2023年10月30日	4.15%	801,294,909.85	17,207,143.98	-	818,502,053.83
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	2020年5月11日	2023年5月11日	3.50%	1,018,242,702.20	17,356,164.39	34,142,935.88	1,001,455,930.71
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	2020年9月10日	2022年9月10日	4.40%	1,008,260,286.06	23,519,155.21	-	1,031,779,441.27
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	700,000,000.00	2020年6月19日	2022年6月19日	3.95%	711,483,092.81	13,711,369.85	26,433,719.08	698,760,743.58
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4月26日	2025年4月26日	4.10%	-	1,002,393,082.95	-	1,002,393,082.95

四、合并财务报表项目附注(续)

36、应付债券(续)

(续上表)

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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
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6月18日	2025年6月18日	3.85%	-	796,227,906.30	-	796,227,906.30
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	境外私募债	美元	150,000,000.00	2019年7月31日	2022年7月31日	3.80%	990,682,488.46	14,447,305.89	23,386,145.41	981,743,648.94
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	美元	100,000,000.00	2021年6月3日	2024年6月3日	3.00%	-	597,893,003.83	-	597,893,003.83
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	600,000,000.00	2016年6月7日	2021年6月7日	4.07%	189,168,977.65	3,238,716.45	192,407,694.10	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	600,000,000.00	2016年7月15日	2021年7月15日	4.10%	295,302,747.33	6,069,657.61	-	301,372,404.94
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	2018年3月23日	2021年3月23日	5.77%	1,044,832,062.81	12,804,657.52	1,057,636,720.33	-
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	2018年4月27日	2021年4月27日	5.23%	828,123,863.91	13,297,095.87	841,420,959.78	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	500,000,000.00	2020年8月31日	2023年8月31日	4.20%	504,822,351.73	10,845,970.73	-	515,668,322.46
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	2020年11月6日	2022年11月6日	3.97%	1,002,953,424.00	20,531,834.27	-	1,023,485,258.27
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	500,000,000.00	2021年1月20日	2023年1月20日	4.00%	-	507,549,931.37	-	507,549,931.37
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	2018年12月26日	2021年5月8日	5.90%	82,575,123.35	1,143,943.72	83,719,067.07	-
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	2019年11月11日	2022年3月19日	4.57%	174,185,168.81	2,630,539.67	145,137,139.66	31,678,568.82
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	2020年3月25日	2022年11月19日	3.10%-4.10%	477,518,386.32	7,145,565.42	200,200,940.40	284,463,011.34
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	970,000,000.00	2021年6月25日	2021年11月22日	3.25%	-	968,324,552.83	-	968,324,552.83
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	190,000,000.00	2020年4月7日	2023年2月13日	5.00%	189,804,007.32	4,710,958.92	4,361,473.18	190,153,493.06
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	926,000,000.00	2019年12月24日	2022年8月26日	4.35%-4.60%	383,510,866.10	6,752,866.01	185,824,426.49	204,439,305.62

四、合并财务报表项目附注(续)

36、应付债券(续)

(续上表)

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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021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	2020年4月15日	2023年2月27日	2.95%-3.40%	515,085,302.85	6,634,910.35	214,392,873.76	307,327,339.44
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	880,000,000.00	2020年5月28日	2022年7月26日	2.84%-3.40%	565,255,304.23	6,814,316.94	192,277,938.89	379,791,682.28
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	950,000,000.00	2020年6月17日	2023年2月27日	3.60%-3.70%	667,648,763.74	10,085,599.20	240,079,706.22	437,654,656.72
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	950,000,000.00	2020年7月28日	2023年5月26日	3.85%-4.10%	723,444,125.69	11,962,742.17	241,011,538.27	494,395,329.59
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	2020年9月9日	2023年4月26日	3.45%-4.20%	788,694,099.34	12,601,315.21	242,738,370.59	558,557,043.96
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	2020年10月22日	2023年6月26日	3.69%-4.30%	768,510,504.36	14,044,528.10	238,230,551.08	544,324,481.38
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	2020年12月9日	2023年7月26日	4.17%-4.30%	942,576,476.74	16,203,200.43	282,319,355.30	676,460,321.87
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	1,440,000,000.00	2019年2月27日	2021年11月18日	5.00%	174,770,090.42	2,349,542.14	165,828,910.31	11,290,722.25
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	1,490,000,000.00	2019年4月16日	2021年6月8日	4.40%	156,047,685.80	2,172,241.68	158,219,927.48	-
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	1,440,000,000.00	2019年6月14日	2022年2月24日	4.50%	347,594,124.48	5,279,225.30	229,134,858.74	123,738,491.04
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	1,390,000,000.00	2019年8月27日	2022年3月26日	4.45%	345,294,907.12	5,958,350.19	237,796,459.71	113,456,797.60
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	2019年10月31日	2022年5月26日	4.60%	252,182,461.30	3,736,460.85	189,045,472.61	66,873,449.54
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	2020年11月24日	2022年7月26日	3.98%-4.30%	947,871,596.54	13,221,161.44	446,192,357.15	514,900,400.83
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	950,000,000.00	2019年5月31日	2021年1月19日	4.34%	66,710,375.72	157,452.46	66,867,828.18	-
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	2019年8月8日	2021年4月20日	4.80%	142,962,705.11	653,327.54	143,616,032.65	-
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	2019年12月26日	2021年7月26日	4.60%	244,056,685.64	2,165,599.97	244,142,190.35	2,080,095.26

四、合并财务报表项目附注(续)

36、应付债券(续)

(续上表)

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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021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	2020年3月24日	2021年11月26日	3.65%	394,241,404.25	4,993,047.21	265,246,994.91	133,987,456.55
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	2020年6月19日	2022年1月26日	3.54%-3.80%	595,774,105.51	6,889,685.47	319,670,181.52	282,993,609.46
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	2020年8月14日	2022年4月26日	3.68%-3.99%	712,935,504.25	9,555,981.71	313,793,633.25	408,697,852.71
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	2021年2月2日	2023年8月28日	3.60%-4.55%	-	958,631,314.25	273,590,610.00	685,040,704.25
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	2021年3月25日	2023年8月28日	3.58%-4.50%	-	952,759,386.71	194,746,980.00	758,012,406.71
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	2021年4月29日	2023年9月26日	3.60%-4.50%	-	950,048,279.59	172,679,920.00	777,368,359.59
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	2021年6月17日	2023年8月28日	3.45%-4.40%	-	943,009,517.07	-	943,009,517.07
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	950,000,000.00	2021年5月31日	2023年1月26日	3.59%-4.35%	-	946,837,963.18	-	946,837,963.18
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	2021年3月31日	2022年11月28日	3.70%-4.40%	-	953,577,220.73	270,064,850.00	683,512,370.73
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	600,000,000.00	2018年2月12日	2021年2月12日	6.35%	633,665,575.96	4,279,726.03	637,945,301.99	-
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	800,000,000.00	2018年11月30日	2021年11月30日	5.20%	802,532,098.33	21,230,460.26	-	823,762,558.59
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	500,000,000.00	2018年6月19日	2021年6月19日	6.50%	517,068,317.80	15,047,945.21	532,116,263.01	-
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	300,000,000.00	2019年4月23日	2022年4月23日	4.65%	309,091,433.75	6,917,671.23	13,734,274.70	302,274,830.28
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	1,400,000,000.00	2019年12月4日	2022年12月4日	4.50%	1,400,590,057.55	32,217,823.27	-	1,432,807,880.82
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	2019年5月31日	2022年5月31日	4.70%	1,025,514,174.59	23,306,849.31	46,232,030.87	1,002,588,993.03
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6月4日	2023年6月4日	3.95%	-	999,511,578.19	-	999,511,578.19

四、 合并财务报表项目附注(续)

36、 应付债券(续)

(续上表)

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	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2021年5月20日	2026年5月20日	2.13%	-	1,936,289,844.74	-	1,936,289,844.74
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	700,000,000.00	2019年7月19日	2024年7月19日	3.38%	4,617,603,963.35	10,085,068.63	52,450,327.80	4,575,238,704.18
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5月18日	3.13%	2,600,552,037.05	6,258,362.51	29,539,087.35	2,577,271,312.21
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	400,000,000.00	2020年7月2日	2023年7月2日	2.13%	2,626,435,460.24	6,401,857.30	29,833,091.35	2,603,004,226.19
海通国际证券集团有限公司	可转换债券	港币	3,880,000,000.00	2016年10月25日	2021年10月25日	0.00%	105,529,048.49	891,763.25	1,198,680.80	105,222,130.94
Haitong Investment Ireland PLC	中期票据	欧元	9,135,865.00	2011年12月20日至2018年8月30日	2020年4月12日至2026年1月23日	0.98%-3.98%	58,881,669.72	931,163.47	7,545,046.18	52,267,787.01
Haitong Bank,S.A.	金融债券	巴西雷亚尔	413,436,462.78	2018年5月21日至2021年6月25日	2021年5月24日至2024年6月25日	1.43%-6.98%	520,515,850.38	91,016,141.78	114,331,101.14	497,200,891.02
合计							147,838,209,538.34	38,320,902,930.08	29,827,017,438.63	156,332,095,029.79

注：于 2021 年 6 月 30 日，应付债券较上年末增长人民币 8,493,885,491.45 元，增长比例为 5.75%，主要是由于本集团长期债务工具发行规模增加所致。

四、 合并财务报表项目附注(续)

37、 其他负债

(1) 按类别列示

项目	注释	2021年6月30日	2020年12月31日
		人民币元	人民币元
其他应付款	(2)	3,206,459,992.19	3,120,581,019.82
代理兑付债券款		17,567,398.02	17,567,398.02
长期应付款	(3)	7,214,075,954.89	8,005,920,453.71
中央银行款项及国家外汇存款		834,238,452.87	887,565,413.02
吸收存款	(4)	5,339,500,034.07	4,413,388,246.32
应付股利		3,343,220,370.29	7,535,561.12
同业存放		65,224,245.42	63,104,416.48
其他		731,392,935.61	542,434,909.62
合计		20,751,679,383.36	17,058,097,418.11

(2) 其他应付款

(i) 明细列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
应付投资者保护基金及风险准备金等	580,280,880.24	543,004,825.41
应付服务费	61,679,521.26	258,239,522.61
其他	2,564,499,590.69	2,319,336,671.80
合计	3,206,459,992.19	3,120,581,019.82

(ii) 期末无欠持公司 5% 以上(含 5%)表决权股份的股东单位款项。

四、合并财务报表项目附注(续)

37、其他负债(续)

(3) 长期应付款

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
承租人保证金	6,652,620,550.45	7,505,669,434.85
其他	561,455,404.44	500,251,018.86
合计	7,214,075,954.89	8,005,920,453.71

(4) 吸收存款

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
	人民币元	人民币元
活期存款	329,136,403.67	246,035,274.20
公司	320,930,355.23	229,122,373.55
个人	8,206,048.44	16,912,900.65
定期存款(含通知存款)	5,010,363,630.40	4,167,352,972.12
公司	3,287,083,618.81	2,399,463,120.35
个人	1,723,280,011.59	1,767,889,851.77
合计	5,339,500,034.07	4,413,388,246.32

38、股本

项目	2020年12月31日	本期变动增(+)/减(-)	2021年6月30日
	人民币元	人民币元	人民币元
无限售条件流通股份-A股	8,092,131,180.00	-	8,092,131,180.00
有限售条件流通股份-A股	1,562,500,000.00	-	1,562,500,000.00
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

39、资本公积

	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
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	(44,497,063.32)	22,302,676.93	-	(22,194,386.39)
合计	74,888,284,930.75	22,302,676.93	-	74,910,587,607.68

四、合并财务报表项目附注(续)

40、其他综合收益

项目	2020年12月31日 归属于母公司股东 的其他综合收益	本期发生金额					2021年6月30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	税后归属于 母公司	税后归属于 少数股东	
		人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	
1. 不能重分类进损益的其他综合收益	352,642,901.96	(425,902,811.70)	(117,845,122.84)	-	(305,876,106.79)	(2,181,582.07)	46,766,795.17
其中：重新计量设定受益计划变动额	(125,080,844.68)	48,007,409.46	-	-	48,007,409.46	-	(77,073,435.22)
其他权益工具投资公允价值变动	477,723,746.64	(473,910,221.16)	(117,845,122.84)	-	(353,883,516.25)	(2,181,582.07)	123,840,230.39
2. 以后将重分类进损益的其他综合收益	(1,005,671,832.53)	(623,611,263.28)	43,045,269.12	(627,928,070.75)	110,907,606.71	(149,636,068.36)	(894,764,225.82)
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	(4,168,874.84)	-	-	-	-	-	(4,168,874.84)
其他债权投资公允价值变动和信用减值准备	3,778,858.55	(443,474,733.01)	42,887,902.47	(627,928,070.75)	138,609,582.73	2,955,852.54	142,388,441.28
现金流量套期	(62,105,970.12)	44,392,908.62	157,366.65	-	37,600,183.83	6,635,358.14	(24,505,786.29)
外币财务报表折算差额	(932,948,367.17)	(224,529,438.89)	-	-	(65,302,159.85)	(159,227,279.04)	(998,250,527.02)
其他	(10,227,478.95)	-	-	-	-	-	(10,227,478.95)
3. 其他综合收益结转留存收益	2,458,084.98	(29,401,198.73)	(7,350,299.68)	-	(22,050,899.05)	-	(19,592,814.07)
其他综合收益合计	(650,570,845.59)	(1,078,915,273.71)	(82,150,153.40)	(627,928,070.75)	(217,019,399.13)	(151,817,650.43)	(867,590,244.72)

四、合并财务报表项目附注(续)

41、 盈余公积

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 6 月 30 日
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
法定盈余公积	7,663,172,125.37	-	-	7,663,172,125.37
合计	7,663,172,125.37	-	-	7,663,172,125.37

42、 一般风险准备

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 6 月 30 日
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一般风险准备	9,226,196,046.87	94,732,413.05	-	9,320,928,459.92
交易风险准备	8,034,787,345.85	-	-	8,034,787,345.85
合计	17,260,983,392.72	94,732,413.05	-	17,355,715,805.77

43、 未分配利润

项目	2021 年 1-6 月	2020 年度
	人民币元	人民币元
期/年初未分配利润	41,222,398,224.28	36,859,495,812.92
加：本期归属于母公司股东的净利润	8,170,194,923.98	10,875,396,346.26
其他	20,729,424.51	(22,809,793.33)
减：提取法定盈余公积	-	727,459,925.50
提取一般风险准备(注 1)	94,732,413.05	2,104,248,216.07
应付普通股股利(注 2)	3,266,050,000.00	3,657,976,000.00
期/年末未分配利润	46,052,540,159.72	41,222,398,224.28

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：根据海通证券 2021 年 6 月 18 日召开的 2020 年股东大会审议批准向全体股东宣派 2020 年度现金股利每 10 股人民币 2.50 元(含税)，宣派总额为人民币 32.66 亿元(含税)。于 2021 年 7 月 29 日，该现金股利已发放。

四、合并财务报表项目附注(续)

44、手续费及佣金净收入

(1) 按类别列示

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
证券经纪业务净收入	2,355,596,659.65	2,073,866,935.48
——证券经纪业务收入	3,328,721,209.19	3,054,816,239.28
其中：代理买卖证券业务	2,672,958,766.75	2,644,072,496.81
交易单元席位租赁	512,902,621.48	369,971,717.45
代销金融产品业务	142,859,820.96	40,772,025.02
——证券经纪业务支出	973,124,549.54	980,949,303.80
其中：代理买卖证券业务	973,124,549.54	980,949,303.80
期货经纪业务净收入	269,126,015.62	160,735,368.05
——期货经纪业务收入	1,199,576,989.51	706,627,884.51
——期货经纪业务支出	930,450,973.89	545,892,516.46
投资银行业务净收入	2,524,747,356.00	1,700,920,219.27
——投资银行业务收入	2,571,577,276.15	1,783,801,251.52
其中：证券承销业务	2,324,436,550.77	1,591,002,098.28
证券保荐业务	68,467,924.51	13,603,773.58
财务顾问业务	178,672,800.87	179,195,379.66
——投资银行业务支出	46,829,920.15	82,881,032.25
其中：证券承销业务	25,596,275.31	50,581,354.51
证券保荐业务	-	-
财务顾问业务	21,233,644.84	32,299,677.74
资产管理业务净收入	863,690,952.73	887,410,008.01
——资产管理业务收入	863,690,952.73	887,410,008.01
——资产管理业务支出	-	-
基金管理业务净收入	969,217,116.46	752,253,995.37
——基金管理业务收入	982,202,426.37	765,076,946.88
——基金管理业务支出	12,985,309.91	12,822,951.51
投资咨询业务净收入	112,764,785.90	83,125,174.99
——投资咨询业务收入	112,764,785.90	83,646,435.71
——投资咨询业务支出	-	521,260.72
其他手续费及佣金净收入	70,034,074.52	62,345,902.00
——其他手续费及佣金收入	72,764,327.09	69,060,708.08
——其他手续费及佣金支出	2,730,252.57	6,714,806.08
合计	7,165,176,960.88	5,720,657,603.17
其中：手续费及佣金收入合计	9,131,297,966.94	7,350,439,473.99
手续费及佣金支出合计	1,966,121,006.06	1,629,781,870.82

四、 合并财务报表项目附注(续)

44、 手续费及佣金净收入(续)

(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
	人民币元	人民币元
并购重组财务顾问业务净收入境内上市公司	7,386,792.50	36,053,868.65
并购重组财务顾问业务净收入其他	35,224,277.31	52,716,886.61
其他财务顾问业务净收入	114,828,086.22	58,124,946.66
合计	157,439,156.03	146,895,701.92

45、 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
利息收入		
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,485,798,226.91	1,472,401,917.35
融出资金利息收入	2,638,593,143.87	1,976,853,006.00
买入返售金融资产利息收入	1,119,155,273.72	1,489,063,555.92
其中：约定购回利息收入	6,067,213.83	2,663,816.98
股权质押回购利息收入	933,935,505.42	1,307,247,685.23
债权投资利息收入	17,373,148.57	21,967,832.14
其他债权投资利息收入	311,083,315.96	225,675,513.38
长期应收款利息收入	1,248,140,123.09	906,794,875.59
贷款和应收款利息收入	678,899,566.93	880,022,330.77
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	384,514.73	31,479,861.25
小计	7,499,427,313.78	7,004,258,892.40
融资租赁收入	1,771,580,592.67	1,985,141,606.08
收入合计	9,271,007,906.45	8,989,400,498.48
利息支出		
其中：借款利息支出	1,325,051,134.63	1,861,092,925.99
应付短期融资款利息支出	190,468,800.92	357,357,739.53
拆入资金利息支出	166,732,695.48	276,259,874.46
其中：转融通利息支出	78,267,777.68	114,656,250.07
卖出回购金融资产款利息支出	718,687,832.20	880,398,579.52
其中：报价回购利息支出	2,085,130.96	979,071.16
代理买卖证券款利息支出	255,851,237.26	243,517,854.52
应付债券利息支出	2,889,587,603.07	2,881,921,394.95
其中：次级债券利息支出	143,693,373.52	225,114,910.87
租赁负债	20,268,884.87	20,281,022.60
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	342,401,807.81	259,660,710.40
支出合计	5,909,049,996.24	6,780,490,101.97
利息净收入	3,361,957,910.21	2,208,910,396.51

四、合并财务报表项目附注(续)

46、投资收益

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
权益法核算的长期股权投资收益	624,744,561.18	264,232,554.18
处置长期股权投资产生的投资收益	-	-
金融工具投资收益	5,465,044,282.25	4,184,645,067.67
(1)持有期间取得的收益	3,865,514,934.74	3,033,097,777.50
交易性金融工具	2,863,734,300.43	3,032,671,378.53
其他权益工具投资	1,001,780,634.31	426,398.97
其他	-	-
(2)处置金融工具取得的收益	1,599,529,347.51	1,151,547,290.17
交易性金融工具	1,414,991,574.06	935,793,247.26
其他债权投资	(771,469,867.92)	(888,808.15)
衍生金融工具	1,176,095,185.11	214,088,039.76
其他	(220,087,543.74)	2,554,811.30
合计	6,089,788,843.43	4,448,877,621.85

47、其他收益

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
政府补助/财政补贴	543,328,270.87	529,405,745.96
其他	18,163,617.70	40,610,688.21
合计	561,491,888.57	570,016,434.17

48、公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
交易性金融资产	1,658,547,256.68	1,440,451,371.22
衍生金融工具	201,306,930.05	195,985,370.76
交易性金融负债	(535,723,229.31)	26,663,943.22
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	(319,797,704.27)	133,809,690.43
合计	1,324,130,957.42	1,663,100,685.20

四、 合并财务报表项目附注(续)

49、 其他业务收入

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
大宗商品销售收入	3,974,659,849.42	2,040,264,946.15
服务收入	588,160,675.03	547,121,265.81
出租收入	239,302,793.83	251,754,508.07
其他	116,572,431.33	113,711,632.16
合计	4,918,695,749.61	2,952,852,352.19

50、 税金及附加

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
城建税	47,561,376.74	39,976,751.69
教育费附加及地方教育费附加	34,107,032.09	28,057,572.76
房产税	42,508,985.15	14,246,826.41
印花税	8,551,319.97	4,561,733.52
其他	18,897,040.55	20,670,186.24
合计	151,625,754.50	107,513,070.62

51、 业务及管理费

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
职工费用	4,299,088,761.77	2,954,268,457.06
咨询费	242,643,795.14	216,968,585.67
固定资产折旧费	226,877,149.37	125,495,719.32
使用权资产折旧	226,784,962.77	245,284,385.77
基金销售费	170,950,676.72	161,168,510.31
电子设备运转费	167,257,055.72	154,781,456.22
聘请中介机构费	124,216,390.99	66,410,475.24
邮电通讯费	111,894,059.00	75,790,372.52
无形资产摊销	108,083,698.43	101,652,654.29
交易所设施使用费	98,692,305.83	77,372,152.49
其他	662,766,889.96	563,709,806.21
合计	6,439,255,745.70	4,742,902,575.10

四、合并财务报表项目附注(续)

52、信用减值损失

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
货币资金	6,806,446.10	4,305,278.17
融出资金	284,991,225.44	664,476,962.37
应收款项	36,791,981.38	9,844,107.05
其他应收款	9,207,814.19	(2,598,479.35)
买入返售金融资产	(133,367,815.25)	672,654,804.06
发放贷款和垫款	(13,275,186.70)	15,340,305.21
应收融资租赁款	497,562,425.52	614,555,585.15
长期应收款	131,908,287.34	78,126,512.65
其他贷款和应收款项	160,972,785.61	823,639,098.41
其他债权投资	37,699,962.52	3,735,818.62
债权投资	3,324,602.08	2,423,882.71
其他金融资产	2,142,593.52	13,767,214.15
合计	1,024,765,121.75	2,900,271,089.20

53、其他业务成本

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
大宗商品销售成本	3,918,072,326.46	2,054,475,884.68
出租成本	107,176,216.15	120,272,513.04
其他	152,122,995.97	28,884,628.21
合计	4,177,371,538.58	2,203,633,025.93

54、营业外收入

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
	人民币元	人民币元	人民币元
非流动资产处置利得	620,435.54	395,481.96	620,435.54
其他	51,431,811.68	44,047,893.27	51,431,811.68
合计	52,052,247.22	44,443,375.23	52,052,247.22

55、营业外支出

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
	人民币元	人民币元	人民币元
非流动资产处置损失	1,510,146.99	1,488,318.21	1,510,146.99
捐赠支出	18,787,040.60	15,998,267.19	18,787,040.60
其他	4,945,612.84	30,347,317.01	4,945,612.84
合计	25,242,800.43	47,833,902.41	25,242,800.43

四、 合并财务报表项目附注(续)

56、 所得税费用

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
当期所得税费用	1,970,154,153.83	1,732,631,318.54
递延所得税费用	802,055,922.83	185,395,194.30
合计	2,772,210,076.66	1,918,026,512.84

57、 现金流量表项目注释

(1) 收到的其他与经营活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
其他业务收入	4,918,695,749.61	2,952,852,352.19
融资租赁收到款项净额	3,214,165,512.74	-
收回发放的其他贷款和应收款项	2,606,867,869.19	2,925,201,341.40
吸收存款的增加	926,111,787.75	194,337,288.63
营业外收入及其他收益	612,923,700.25	614,064,327.44
存放央行的净减少额	-	708,546,025.04
其他	1,518,125,208.54	403,114,484.86
合计	13,796,889,828.08	7,798,115,819.56

(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
	人民币元	人民币元
其他业务成本	4,070,195,322.43	2,103,958,338.40
存出保证金增加	1,819,351,492.88	3,124,800,699.05
日常经营费用等	1,478,786,715.61	1,260,702,895.85
保理、贷款支付的款项净额	125,214,408.58	324,991,476.80
融资租赁支付的款项净额	-	1,200,968,039.53
其他	5,704,751,447.55	1,121,169,427.96
合计	13,198,299,387.05	9,136,590,877.59

四、合并财务报表项目附注(续)

57、现金流量表项目注释(续)

(3) 支付其他与筹资活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
偿还租赁负债款	245,567,799.91	264,193,973.55
发行债券支付的承销费用等	149,688,461.16	115,836,599.54
子公司购买股份用于股份奖励计划	-	203,012,040.00
合计	395,256,261.07	583,042,613.09

58、现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
1、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	8,888,739,650.98	5,901,461,237.03
加：信用减值损失	1,024,765,121.75	2,900,271,089.20
其他资产减值损失	44,083,145.76	10,457,352.68
固定资产及投资性房地产折旧	334,053,365.53	225,170,406.85
使用权资产折旧	226,784,962.77	245,284,385.77
无形资产摊销	108,083,698.43	101,652,654.29
长期待摊费用摊销	54,225,569.40	42,041,055.90
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失/(收益)	889,711.45	(1,883,800.17)
公允价值变动收益	(1,324,130,957.42)	(1,663,100,685.20)
利息支出	4,096,919,958.96	4,873,009,737.52
汇兑损失/(收益)	383,061,199.34	(453,411,203.54)
投资收益	(868,132,432.24)	(726,049,576.96)
递延所得税资产减少/(增加)	102,224,259.92	(112,523,244.89)
递延所得税负债增加	549,222,758.41	264,181,741.86
交易性金融资产等的减少/(增加)	11,260,721,849.34	(16,676,540,128.42)
经营性应收项目的增加	(122,132,370.80)	(15,141,596,181.21)
经营性应付项目的增加	9,999,038,715.81	20,457,547,773.54
经营活动产生的现金流量净额	34,758,418,207.39	245,972,614.25

四、 合并财务报表项目附注(续)

58、 现金流量表补充资料(续)

(1) 现金流量表补充资料(续)

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
3、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	163,910,554,977.90	130,876,779,533.18
减：现金的年初余额	137,311,262,918.57	123,829,492,862.52
加：现金等价物的期末余额	-	-
减：现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	26,599,292,059.33	7,047,286,670.66

(2) 现金和现金等价物的构成

项目	2021年6月30日	2020年6月30日
	人民币元	人民币元
现金	163,910,554,977.90	130,876,779,533.18
其中：库存现金	326,714.53	600,733.52
可随时用于支付的银行存款	146,528,636,637.42	115,856,703,323.41
可随时用于支付的其他货币资金	27,142,547.10	4,881,023.86
存放中央银行款项	3,209,693,121.82	4,185,037,972.87
结算备付金	14,144,755,957.03	10,829,556,479.52
现金等价物	-	-
现金及现金等价物合计	163,910,554,977.90	130,876,779,533.18

59、 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，具体参见附注四、1 货币资金，7 买入返售金融资产，8 交易性金融资产，10 其他债权投资，11 其他权益工具投资，12 应收融资租赁款及长期应收款，以及 15 固定资产。

四、合并财务报表项目附注(续)

60、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2021年6月30日止，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107.77亿元(2020年12月31日：人民币104.67亿元)。

(2) 资产支持票据

本集团发行了以应收融资租赁款和应收保理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应收保理款，并将收到的对价确认为金融负债。

截至2021年6月30日止，本集团未予终止确认的已转移应收融资租赁款和应收保理款的账面价值为人民币11.91亿元(2020年12月31日：人民币10.76亿元)。

五、合并范围的变更

1、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。

2、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。

六、 在其他主体中的权益

1、 在子公司中的权益

(1) 企业集团的重要子公司

子公司全称	注册及营业地	注册资本	业务性质	年末实际出资额	持股比例(%)		取得方式
					直接	间接	
海富通基金管理有限公司	上海	人民币 30,000 万元	基金管理	人民币 6,700 万元	51.00	-	设立或投资等方式
海富通资产管理(香港)有限公司	香港	港币 6,000 万元	资产管理	港币 6,000 万元	-	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	上海	人民币 20,000 万元	资产管理	人民币 20,000 万元	-	51.00	设立或投资等方式
海富产业投资基金管理有限公司	上海	人民币 10,000 万元	基金管理	人民币 6,365 万元	67.00	-	设立或投资等方式
海通开元投资有限公司	上海	人民币 750,000 万元	私募股权投资管理	人民币 750,000 万元	100.00	-	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	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理	人民币 2,550 万元	-	51.00	设立或投资等方式
海通创新私募基金管理有限公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理	人民币 2,550 万元	-	51.00	设立或投资等方式
海通创意私募基金管理有限公司	上海	人民币 12,000 万元	股权投资管理	人民币 6,390 万元	-	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	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理	人民币 2,550 万元	-	51.00	设立或投资等方式
辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	沈阳	人民币 100,000 万元	股权投资	人民币 51,000 万元	-	51.00	设立或投资等方式
海通并购资本管理(上海)有限公司	上海	人民币 10,000 万元	股权投资管理	人民币 5,100 万元	-	51.00	设立或投资等方式
上海海通旭禹股权投资有限公司	上海	人民币 35,000 万元	股权投资	人民币 35,000 万元	-	100.00	设立或投资等方式
海通新创投资管理有限公司	上海	人民币 10,000 万元	股权投资管理	人民币 600 万元	-	60.00	设立或投资等方式
上海海通创世投资管理有限公司	上海	人民币 100 万元	股权投资管理	人民币 100 万元	-	53.25	设立或投资等方式
海通齐东(威海)股权投资基金管理有限公司	山东	人民币 1,000 万元	股权投资管理	人民币 615 万元	-	61.50	设立或投资等方式
合肥海通兴泰新兴产业投资管理有限公司	安徽	人民币 1,000 万元	股权投资管理	人民币 400 万元	-	60.00	设立或投资等方式
珠海海通华媒投资管理有限公司	广东	人民币 1,000 万元	股权投资管理	-	-	51.00	设立或投资等方式
海通创新证券投资有限公司	上海	人民币 930,000 万元	金融产品投资、股权投资、证券投资	人民币 1,145,000 万元	100.00	-	设立或投资等方式
上海海通证券资产管理有限公司	上海	人民币 220,000 万元	证券资产管理	人民币 220,000 万元	100.00	-	设立或投资等方式
上海惟泰置业管理有限公司	上海	人民币 1,000 万元	物业管理、房地产开发经营、餐饮企业管理	人民币 75,607 万元	100.00	-	收购
上海泽春投资发展有限公司	上海	人民币 10,000 万元	实业投资, 房地产开发与经营, 投资管理	人民币 86,834 万元	100.00	-	收购
海通国际控股有限公司	香港	港币 1,117,973 万元	投资控股	港币 1,117,973 万元	100.00	-	设立或投资等方式
Haitong Investment Ireland PLC	爱尔兰	欧元 825,000 元	非银行金融公司	港币 10,451 万元	-	100.00	非同一控制下企业合并
海通期货股份有限公司	上海	人民币 130,150 万元	期货代理	人民币 137,619.18 万元	66.67	-	非同一控制下企业合并
上海海通资源管理有限公司	上海	人民币 100,000 万元	资源管理	人民币 60,000 万元	-	66.67	非同一控制下企业合并
海通期货香港有限公司	香港	港币 7,000 万元	期货经纪	港币 7,000 万元	-	66.67	非同一控制下企业合并
海通国际证券集团有限公司*	百慕达	港币 60,374 万元	投资控股	港币 1,450,172 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际投资经理有限公司	香港	港币 4,700 万元	资产管理	港币 4,700 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际资产管理有限公司	香港	港币 1,300 万元	资产管理	港币 1,300 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际资产管理(香港)有限公司	香港	港币 2,000 万元	资产管理	港币 2,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际证券有限公司	香港	港币 1,150,000 万元	经纪业务	港币 1,150,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际证券代理人有限公司	香港	港币 2 元	经纪业务	港币 2 元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际期货有限公司	香港	港币 40,000 万元	经纪业务	港币 40,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际金融产品有限公司	香港	港币 5,000 万元	FICC 及衍生品	港币 5,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际金融服务有限公司	香港	港币 100 万元	FICC 及衍生品	港币 100 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并

六、 在其他主体中的权益(续)

1、 在子公司中的权益(续)

(1) 企业集团的重要子公司(续)

子公司全称	注册及营业地	注册资本	业务性质	年末实际出资额	持股比例(%)		取得方式
					直接	间接	
海通国际融资(香港)有限公司	香港	港币 1,000 万元	企业融资	港币 1,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际资本有限公司	香港	港币 2,000 万元	企业融资	港币 2,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通国际研究有限公司	香港	港币 100 万元	研究服务	港币 100 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
Haitong International (Japan) K.K.	日本	日元 1,000 万元	研究服务	日元 1,000 万元	-	64.89	非同一控制下企业合并
Haitong International(UK) Limited	英国	英镑 8,334,563 元	研究服务	英镑 8,334,563 元	-	64.89	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities(USA) Inc.	美国	美元 12,654,319 元	研究服务	美元 12,654,319 元	-	64.89	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities Group(Singapore) Pte Ltd.	新加坡	新加坡元 730,550,721 元	投资控股	新加坡元 730,550,721 元	-	64.89	非同一控制下企业合并
Haitong Securities India Private Limited	印度	印度卢比 260,732,520 元	证券业务	印度卢比 260,732,520 元	-	64.89	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities(Australia) Pty Ltd.	澳大利亚	澳元 1,380,435 元	经纪业务	澳元 1,380,435 元	-	64.89	非同一控制下企业合并
海通恒信金融集团有限公司	香港	港币 414,616 万元	投资控股	港币 822,709 万元	-	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*	上海	人民币 823,530 万元	租赁	人民币 648,374 万元	-	85.00	非同一控制下企业合并
海通恒运国际租赁有限公司	天津	人民币 21,000 万元	租赁	人民币 21,000 万元	-	85.00	非同一控制下企业合并
上海泛圆投资发展有限公司	上海	人民币 10,000 万元	贸易	人民币 10,000 万元	-	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	上海	人民币 136,000 万元	租赁	人民币 120,000 万元	-	85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信租赁(香港)有限公司	香港	美元 23,243 万元	租赁	美元 25,196 万元	-	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	上海	人民币 150,000 万元	租赁	人民币 155,000 万元	-	85.00	非同一控制下企业合并
上海鼎洁建设发展有限公司	上海	人民币 2,000 万元	政府购买服务相关业务及 PPP 项目管理	人民币 2,000 万元	-	85.00	非同一控制下企业合并
Haitong Bank, SA.	葡萄牙	欧元 84,476.9 万元	银行	港币 780,163 万元	-	100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Capital-SCR,S.A.	葡萄牙	欧元 2,500 万元	风险投资	欧元 4,266 万元	-	100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	巴西	欧元 6,871.95 万元	投资银行	欧元 17,449.63 万元	-	80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Negócios, SA	巴西	欧元 1,822.41 万元	投资控股	欧元 2,291.52 万元	-	80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Securities do Brasil Corretora de Câmbio Valores Mobiliários S.A.	巴西	欧元 1,636.18 万元	证券经纪	欧元 561.93 万元	-	80.00	非同一控制下企业合并
Haitong do Brasil Distribuidora de Titulose Valores Mobiliários S.A.	巴西	欧元 849.18 万元	资产管理	欧元 846.49 万元	-	80.00	非同一控制下企业合并

*海通国际证券集团有限公司和海通恒信国际融资租赁股份有限公司均为香港上市公司，其所控制的子公司均被纳入合并范围。

(2) 重要的非全资子公司

子公司全称	持股比例	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	期末少数股东权益余额
	%	%	人民币亿元	人民币亿元	人民币亿元
海通国际证券集团有限公司	64.89	35.11	3.16	2.07	82.67
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	85.00	15.00	1.02	0.19	22.99

六、 在其他主体中的权益(续)

1、 在子公司中的权益(续)

(3) 重要非全资子公司的主要财务信息

项目	海通国际证券集团有限公司		海通恒信国际租赁股份有限公司	
	期末余额	年初余额	期末余额	年初余额
	人民币百万元	人民币百万元	人民币百万元	人民币百万元
流动资产	99,739.51	104,379.78	61,545.90	55,862.27
非流动资产	12,983.43	18,872.10	49,353.93	52,279.20
资产合计	112,722.94	123,251.88	110,899.83	108,141.47
流动负债	76,398.85	88,808.76	50,284.38	48,362.56
非流动负债	12,368.40	10,610.25	43,906.78	43,925.11
负债合计	88,767.25	99,419.01	94,191.16	92,287.67

项目	海通国际证券集团有限公司		海通恒信国际租赁股份有限公司	
	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额
	人民币百万元	人民币百万元	人民币百万元	人民币百万元
营业收入	3,119.34	3,219.56	4,238.75	3,894.59
净利润	900.38	476.36	685.04	620.96
综合收益总额	914.84	381.36	722.14	475.42
经营活动现金流量	5,728.79	(1,867.72)	994.66	(2,470.59)

2、 在合营企业或联营企业中的权益

(1) 重要的合营企业或联营企业

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
富国基金管理有限公司	上海	上海	基金管理	27.775	-	权益法

(2) 重要联营企业的主要财务信息

富国基金管理有限公司	期末余额/ 本期发生额	年初余额/ 上期发生额
	人民币百万元	人民币百万元
资产总额	9,590.77	8,745.65
负债总额	3,858.50	3,530.64
归属于母公司股东权益总额	5,732.27	5,215.01
营业收入	3,998.34	1,987.89
净利润	1,241.94	628.48
其他综合收益	(2.58)	2.31
综合收益总额	1,239.36	630.80
本期收到的来自联营企业的股利	200.54	100.27

六、 在其他主体中的权益(续)

2、 在合营企业或联营企业中的权益(续)

(3) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

	期末余额/ 本期发生额	年初余额/ 上期发生额
	人民币百万元	人民币百万元
合营企业:		
投资账面价值合计	83.48	78.07
下列各项按持股比例计算的合计数		
—净利润/(亏损)	5.41	(5.96)
—其他综合收益	-	(13.36)
—综合收益总额	5.41	(19.32)
联营企业:		
投资账面价值合计	3,039.29	2,901.77
下列各项按持股比例计算的合计数		
—净利润	281.67	107.99
—其他综合收益	-	(32.98)
—综合收益总额	281.67	75.01

3、 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 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日的财务状况，2021 上半年及 2020 上半年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 2021 年 6 月 30 日，本集团于所有合并结构化主体之直接权益的公允价值为人民币 341.80 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 278.79 亿元)。该等直接权益包括本集团于分级产品中认购的风险级产品，本集团作为风险级产品持有人为优先级产品持有人提供增信支持。于 2021 年 6 月 30 日，本集团认购的上述风险级产品公允价值为人民币 2.85 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 2.97 亿元)。

被合并结构化主体其他权益份额持有人持有的权益分别列示在利润表的投资收益和资产负债表的交易性金融负债。

(2) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

对于本集团担任管理人或持有的结构化主体，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或不拥有对被投资者的权力。因此，本集团没有合并这些结构化主体。

六、 在其他主体中的权益(续)

3、 在结构化主体中的权益(续)

(2) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益(续)

于 2021 年 6 月 30 日，由本集团担任投资管理人且持有的未合并结构化主体的权益的账面价值为人民币 143.77 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 182.35 亿元)，本集团所面临风险敞口与账面价值相若。2021 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 17.22 亿元(2020 年上半年：人民币 15.79 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有关的最大风险敞口接近于各自的账面价值。

七、 关联方及关联交易

1、 持有公司 5%以上股份的股东情况

股东名称	关联关系	企业类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	股东对本公司的持股比例 (%)	股东对本公司的表决权比例 (%)	社会统一信用代码
上海国盛(集团)有限公司	第一大股东	国有控股	上海市	寿伟光	商务服务	人民币 200.66 亿元	6.60%	6.60%	91310000667805050M

2、 公司的子公司情况

本公司子公司的情况详见附注“六、1、在子公司中的权益”。

3、 公司的合营和联营企业情况

本公司合营或联营企业详见附注“四、13、长期股权投资”。

4、 其他关联方交易情况

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

七、 关联方及关联交易(续)

5、 关联方交易

- (1) 本公司与关联方之间的交易按照市场价格进行，无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本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
		人民币元	人民币元
富国基金管理有限公司	佣金收入等	80,261,223.72	35,835,291.08
海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金(有限合伙)	管理费收入等	14,208,543.44	8,018,864.22
上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)	管理费收入等	12,939,114.87	18,013,794.03
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	-
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、业绩报酬收入	12,404,505.79	7,880,953.56
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	8,490,566.04
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	7,438,356.15	7,009,046.25
西安航天新能源产业基金投资有限公司	管理费收入等	4,754,487.15	6,792,452.64
西安军融电子卫星基金投资有限公司	管理费收入等	4,505,456.06	4,028,301.78
嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业(有限合伙)	管理费收入等	2,442,452.76	-
广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)	管理费收入等	2,087,951.74	2,828,240.88
海通(吉林)股权投资基金合伙企业(有限合伙)	管理费收入等	1,103,881.11	1,132,075.47
海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	管理费收入等	924,048.52	1,584,905.68
上海国盛(集团)有限公司	债券承销收入等	624,531.44	1,004,716.98
上海电气(集团)总公司	管理费收入等	280,591.58	-
许昌海通创新股权投资基金合伙企业(有限合伙)	托管业务收入等	94,400.00	-
上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	管理费收入等	17,466.98	4,176,371.59
贵安恒信融资租赁(上海)有限公司	投资咨询服务收入	-	11,320.75

(4) 向关联方支付的手续费及佣金支出

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
		人民币元	人民币元
上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)	手续费及佣金支出	-	23,030,200.09

七、 关联方及关联交易(续)

5、 关联方交易(续)

(5) 向关联方收取的利息收入

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
		人民币元	人民币元
上海电气(集团)总公司	利息收入	134,877.62	-
上海国盛(集团)有限公司	利息收入	87,358.86	-
贵安恒信融资租赁(上海)有限公司	利息收入	-	30,615,513.63
其他(注)	利息收入	47,341.35	19,582.59

注：“其他”包含海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)、吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司、嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业(有限合伙)、上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)、上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)、西安航天新能源产业基金投资有限公司、广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)、上海彤关投资管理合伙企业(有限合伙)、上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)、湖州赆通股权投资合伙企业(有限合伙)、富国基金管理有限公司。

(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
		人民币元	人民币元
上海国盛(集团)有限公司	衍生金融工具公允价值变动收益	(1,511,002.74)	-

(7) 关键管理人员薪酬

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币万元	人民币万元
关键管理人员薪酬	1,839.35	2,725.19

七、 关联方及关联交易(续)

6、 关联方应收应付款项

(1) 应收关联方款项

项目名称	关联方名称	2021年6月30日	2020年12月31日
		人民币元	人民币元
应收款项	上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)	13,438,995.30	-
应收款项	上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	7,884,657.55	-
应收款项	上海国盛(集团)有限公司	900,000.00	810,000.00
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	-
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)	20,000.00	20,000.00
应收款项	辽宁中德产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	20,000.00	20,000.00

(2) 应付关联方款项

项目名称	关联方名称	2021年6月30日	2020年12月31日
		人民币元	人民币元
代理买卖证券款	上海电气(集团)总公司	179,735,384.50	-
代理买卖证券款	上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)	53,899,812.67	-
代理买卖证券款	上海彤关投资管理合伙企业(有限合伙)	6,843,970.56	-
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	1,702,511.21	841,633.51
代理买卖证券款	上海国盛(集团)有限公司	558,195.74	-
代理买卖证券款	富国基金管理有限公司	-	36,240,430.31
代理买卖证券款	西安航天新能源产业基金投资有限公司	1,169.40	1,690,331.93
代理买卖证券款	其他(注)	870,985.08	-
应付款项	上海国盛(集团)有限公司	88,100,000.00	-
其他负债	吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	3,487,500.00	-
其他负债	海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金(有限合伙)	8,499,999.98	-
其他负债	西安航天新能源产业基金投资有限公司	3,056,931.51	-
其他负债	海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	1,365,395.62	-

注：“其他”包含嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业(有限合伙)、海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)、上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)、广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)、湖州赞通股权投资合伙企业(有限合伙)、上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)、西安军融电子卫星基金投资有限公司。

(3) 其他关联方款项

项目名称	关联方名称	2021年6月30日	2020年12月31日
		人民币元	人民币元
衍生金融负债	上海国盛(集团)有限公司	1,511,002.74	-

八、 风险管理

1、 风险管理政策及组织架构

(1) 风险管理政策

公司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。公司严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了完整有效的全面风险管理架构体系。公司时刻牢记合规底线，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；建立了净资产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。集团层面，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，强化子公司现场检查和风险考核，深入推进集团化风险管理全覆盖。

公司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，公司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，并且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》等规定及公司章程，规范运作，根据业务发展、风险管理工作的需求，搭建了多层次的风险管理组织架构，明确了董事会、监事会、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、经理层建立和实施风险管理及内部控制的情况进行监督，并履行公司章程规定的其他职责。

公司经营层根据董事会的授权，负责建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的政策、规章和制度，贯彻执行公司整体风险偏好和风险容忍度政策，组织实施各类风险的识别与评估工作，建立健全和有效执行风险管理制度和机制，及时处理或者改正存在的缺陷或问题，审议处理公司重大风险事件，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。

八、 风险管理(续)

1、 风险管理政策及组织架构(续)

(2) 风险治理组织架构(续)

公司设首席风险官，由董事长提名、董事会聘任。首席风险官是负责公司全面风险管理工作的高级管理人员，负责组织实施董事会、经营层确定的风险管理政策、规章和制度，组织对公司建立健全各项业务风险管理制度进行督导、审查和评估，组织对公司风险管理政策和流程的执行情况进行监督和检查，对存在的问题提出处理意见并督促整改，对重大风险或风险隐患，及时向公司有关机构、部门或子公司提出处理意见并督促整改，组织评估和完善风险管理的工具和方法，定期组织对公司面临主要风险水平及其管理状况进行评估，并向经营层、董事会及监管部门提交评估报告，组织对子公司风险管理工作负责人的提名和考核等。

公司设立风险管理部，在首席风险官的领导下履行风险管理职责，负责拟定公司风险管理的政策、规章和制度，督导公司各部门制定业务风险管理制度和流程，对相关业务的主要风险进行识别和评估，组织对各项业务风险管理制度执行情况的监督、检查，定期对公司整体风险水平及其风险管理状况进行评估和报告，对重大风险隐患或风险事件，及时报告并提出风险处置建议等。此外，公司合规法务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的信息技术风险。

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。

子公司风险管理方面，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，具体从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、子公司重大事项审批、风险数据对接、督导与检查、风险管理考核等方面切实落实对子公司的垂直风险管理。报告期内，公司修订了子公司全面风险管理办法，从风险识别、评估与计量、报告与应对等方面完善了具体要求，进一步细化重大风险事件认定标准，完成子公司风险限额指标年度更新，强化子公司现场检查，严格执行子公司风险考核，并以 T+1 风控指标并表管理、集团 T+1 风险数据集市为抓手，持续提升集团风险管理的精细程度，引导子公司切实履行风险管理一道防线职责。

八、 风险管理(续)

2、 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对本集团经营造成损失的风险。

A、存放在其他金融机构的自有货币资金、经纪业务相关风险

公司的货币资金主要存放在国有商业银行或信誉良好的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，此类现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。经纪业务采取全额保证金结算，切实规避相关信用风险。

B、交易性融资业务相关风险

本集团开展的交易性融资业务主要包括：融资融券、股票质押式回购、孖展交易、约定购回式证券交易等。相关主体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。报告期内，本集团相关主体持续强化授信和集中度管理机制，动态优化针对特定客户类群的信用评级和担保证券折算率模型，将环境、社会和公司治理风险评估纳入风险评估环节，主动调整资产组合结构和推进风险化解程序。

C、信用债券交易与投资业务相关风险

公司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。

D、融资租赁业务相关风险

本集团在开展融资租赁业务、支持实体经济发展时，坚持以行业与客户并重的策略确定信用风险管理政策。行业信用风险管理方面，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。客户信用风险管控方面，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。

八、 风险管理(续)

2、 信用风险管理(续)

E、 债券回购等同业短期拆借、场外衍生品业务相关风险

针对债券回购等同业短期拆借业务，公司以交易对手准入和授信管理为抓手，审慎筛选信用资质良好的交易对手和信用等级较高的担保证券，从源头上控制信用风险水平。针对场外衍生品业务，公司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。公司同业短期拆借和场外衍生品业务的交易对手主要是商业银行、证券公司、资产管理计划等主体，公司在开展此类业务的过程中，合理选择业务模式、严格控制业务规模并采取合理的风控措施。同时，公司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，持续完善集团化信用风险管理体系。报告期内，本集团各主体以集团信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的集团化信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作，包括以集团 T+1 风险数据集市为依托，建立健全可覆盖母子公司业务的集团化信用风险管理信息系统，通过提升风险识别、计量与压力测试能力在集团层面持续完善资产质量、风险抵补和集中度风险等维度的信用风险限额体系，着力推进集团化统一评级与集中授信管理机制，搭建以金融科技为支撑的客户关系图谱、舆情风险监控及高风险客户管控工具，强化集团各主体信用类业务风险资产系统化报送程序，以此实现对集团整体信用风险状况和风险限额执行情况的有效跟踪和监控。

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。

八、 风险管理(续)

2、 信用风险管理(续)

预期信用损失计量(续)

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，公司对除应收账款外的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；

八、 风险管理(续)

2、 信用风险管理(续)

信用风险显著增加的判断标准(续)

- 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；
- 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”。

八、 风险管理(续)

2、 信用风险管理(续)

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，是在某一时间点上进行估计。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。

八、 风险管理(续)

2、 信用风险管理(续)

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 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)增速、广义货币供应量(M2)增速、固定资产投资完成额增速等，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，在 2021 年 6 月 30 日，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。

八、 风险管理(续)

2、 信用风险管理(续)

敏感性分析(续)

同时，公司还对信用风险阶段分类进行了敏感性分析。于 2021 年 6 月 30 日，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。公司经理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。

八、 风险管理(续)

3、 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。计量口径包含母公司及海通银行、海通国际等主要子公司。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	2021年上半年 VaR95%			
	本公司风险价值 (万元)	本集团风险价值 (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	30,890.61	37,893.23	0.22%	0.22%
报告期最低月末值	15,445.21	26,740.55	0.11%	0.16%
报告期平均月末值	25,551.99	34,756.97	0.18%	0.20%
2021年6月30日值	30,890.61	37,893.23	0.22%	0.22%

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0.3%以内，市场风险可控可承受。

(1) 股票价格风险

股票价格风险主要指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。

本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。

(2) 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。公司对利率风险的控制，主要采用规模控制和投资组合等方法，合理配置资产，匹配负债与资产的期限结构，并通过定期测算投资组合久期、凸性、DV01等指标衡量利率风险。

八、 风险管理(续)

3、 市场风险管理(续)

(3) 汇率风险

汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。报告期内集团国际化布局不断完善，面对复杂多变的境外市场，集团主动降低境外资产杠杆水平，整体外币资产规模有所减少，汇率风险敞口也相应降低。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，以缩小外汇风险的敞口。集团还采用境外经营净投资套期等方法平滑外汇敞口对集团经营成果的影响。

4、 流动性风险管理

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

在日间流动性风险管理方面，公司始终秉承“稳健乃至保守”的风控理念，持续按照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，始终将流动性风险敞口控制在合理范围内。公司严格按照内部相关规定和办法，储备了充足的优质流动性资产，保障了公司业务的顺利开展和到期负债的顺利偿付。此外，公司持续推进日间流动性和风险指标管控机制，结合公司资产端和负债端，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，从更深层次强化了公司对流动性风险的科学管控和预判的效率。

在中长期流动性风险管控方面，公司继续优化资产配置结构，强化对资产负债发展趋势的分析，从源头上强化对公司流动性风险的管控。一方面，公司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及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构，保持资产负债期限错配始终处于合理范围；另一方面，公司加强了流动性精细化管理体系，负债端结构和到期日分布更趋合理，同时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。

八、 风险管理(续)

4、 流动性风险管理(续)

集团流动性风险管控方面，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两个条线出发，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，同时有助于公司向上传递流动性风险偏好；最后，为强化集团流动性风险处置能力，凸显集团在管理调控信息方面的优势，公司以集团流动性支持管理办法作为整体管理方针，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。

5、 风险控制指标监控

公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》的要求编制公司的风险控制指标监管报表，并将净资本等风控指标纳入日常监控范围。对各项影响净资本及风险控制指标的业务、因素进行及时的监测与控制，使其达到合规要求。报告期间，公司的净资本及各项风险控制指标均符合监管要求。

2021 年 6 月末公司主要风控指标与监管标准对照表

风控指标	2021 年 6 月 30 日	监管标准
核心净资本(亿元)	821.72	
附属净资本(亿元)	-	
净资本(亿元)	821.72	
净资产(亿元)	1,386.37	
各项风险资本准备之和(亿元)	237.89	
表内外资产总额(亿元)	3,778.20	
风险覆盖率	345.42%	不得低于 100%
资本杠杆率	23.98%	不得低于 8%
流动性覆盖率	292.13%	不得低于 100%
净稳定资金率	157.80%	不得低于 100%
净资本/净资产	59.27%	不得低于 20%
净资本/负债	37.68%	不得低于 8%
净资产/负债	63.57%	不得低于 10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	27.63%	不得高于 100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	159.77%	不得高于 500%

公司在进行股利分配、重大投资、开展创新业务等重要事项时，高度重视上述事项对净资本及风险控制指标的影响。在实施上述事项之前，公司对净资本等风险控制指标进行敏感性分析或压力测试，只有在满足净资本等风险控制指标监管要求的情况下，公司才实施上述重要事项。

八、 风险管理(续)

5、 风险控制指标监控(续)

另外，公司每半年针对未来经营计划进行展望，充分考虑经营规模达到最大、市场状况出现负面逆转等条件，对净资本等风险控制指标进行敏感性分析和压力测试，确保未来各项风险控制指标满足监管要求。

报告期内，公司未出现净资本等各项风险控制指标超过监管标准的情况。

九、 公允价值的披露

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，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。

九、公允价值的披露(续)

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

项目	2021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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
(一)交易性金融资产	29,045,771,839.32	161,943,252,561.17	29,503,877,756.76	220,492,902,157.25
(1)债券	1,199,560,286.30	92,789,218,003.22	5,604,264,486.03	99,593,042,775.55
(2)公募基金	6,241,782,260.16	24,766,121,505.31	152,283,861.85	31,160,187,627.32
(3)股票/股权	21,369,186,718.22	838,806,289.40	15,428,090,195.84	37,636,083,203.46
(4)银行理财产品	-	2,530,819,082.83	-	2,530,819,082.83
(5)券商资管产品	-	3,131,394,610.65	-	3,131,394,610.65
(6)信托计划	-	803,116,345.59	798,983,787.62	1,602,100,133.21
(7)其他	235,242,574.64	37,083,776,724.17	7,520,255,425.42	44,839,274,724.23
(二)以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	9,984,088,945.82	15,088,427,810.87	1,920,417,095.82	26,992,933,852.51
(1)其他债权投资	788,244,726.60	15,088,427,810.87	1,459,939,131.23	17,336,611,668.70
(2)其他权益工具投资	9,195,844,219.22	-	460,477,964.59	9,656,322,183.81
(三)衍生金融资产	102,219,321.58	991,162,004.28	67,767,541.56	1,161,148,867.42
(四)交易性金融负债	833,717,718.01	36,962,139,987.10	835,429,204.14	38,631,286,909.25
(1)为交易目的而持有的金融负债	833,717,718.01	756,160,899.63	7,324,227.80	1,597,202,845.44
(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	-	36,205,979,087.47	828,104,976.34	37,034,084,063.81
(五)衍生金融负债	17,977,455.66	1,764,524,874.12	735,603,980.94	2,518,106,310.72

2、以公允价值计量的资产和负债的上年末公允价值

项目	2020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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
(一)交易性金融资产	22,128,714,817.26	172,109,041,553.50	26,158,747,432.21	220,396,503,802.97
(1)债券	1,867,103,097.39	102,164,518,436.75	6,332,071,192.23	110,363,692,726.37
(2)公募基金	3,341,593,707.45	20,877,396,474.62	265,494,133.72	24,484,484,315.79
(3)股票/股权	16,920,018,012.42	1,244,510,045.94	13,076,666,554.25	31,241,194,612.61
(4)银行理财产品	-	3,647,179,471.79	-	3,647,179,471.79
(5)券商资管产品	-	2,784,039,930.83	-	2,784,039,930.83
(6)信托计划	-	124,067,623.87	610,952,799.47	735,020,423.34
(7)其他	-	41,267,329,569.70	5,873,562,752.54	47,140,892,322.24
(二)以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	336,470,295.03	25,644,197,413.26	3,366,681,590.42	29,347,349,298.71
(1)其他债权投资	252,155,489.91	9,756,367,596.97	3,099,638,990.42	13,108,162,077.30
(2)其他权益工具投资	84,314,805.12	15,887,829,816.29	267,042,600.00	16,239,187,221.41
(三)衍生金融资产	17,601,765.57	1,819,410,513.35	899,270.36	1,837,911,549.28
(四)交易性金融负债	494,796,746.91	31,411,674,642.13	331,829,555.70	32,238,300,944.74
(1)为交易目的而持有的金融负债	494,796,746.91	3,917,271,541.05	-	4,412,068,287.96
(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	-	27,494,403,101.08	331,829,555.70	27,826,232,656.78
(五)衍生金融负债	42,732,275.66	2,615,053,021.92	14,493,633.11	2,672,278,930.69

本期和上期合并财务报表按公允价值计量的金融工具在第一层次和第二层次之间无重大转移。

九、公允价值的披露(续)

3、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。

4、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。

5、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。

九、公允价值的披露(续)

6、持续第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值之间的调节信息

项目	2020 年 12 月 31 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	2021 年 6 月 30 日
				计入损益	计入其他综合收益			
交易性金融资产	26,158,747,432.21	702,087,873.73	(333,940,871.54)	1,572,945,187.52	-	3,312,973,802.73	(1,908,935,667.89)	29,503,877,756.76
其他债权投资	3,099,638,990.42	-	(205,374,670.52)	19,086,371.44	(20,318,929.28)	377,561,932.14	(1,810,654,562.97)	1,459,939,131.23
其他权益工具投资	267,042,600.00	-	-	-	193,435,364.59	-	-	460,477,964.59
衍生金融工具	(13,594,362.75)	23,907,510.49	-	(25,948,311.21)	-	(652,201,275.91)	-	(667,836,439.38)
交易性金融负债	(331,829,555.70)	(516,685,830.30)	-	475,149,646.90	-	(462,063,465.04)	-	(835,429,204.14)

项目	2019 年 12 月 31 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	2020 年 12 月 31 日
				计入损益	计入其他综合收益			
交易性金融资产	9,158,764,272.26	11,970,810,784.55	(491,559,689.34)	676,024,201.29	-	7,096,312,888.85	(2,251,605,025.40)	26,158,747,432.21
其他债权投资	1,193,001,479.26	1,238,661,256.77	-	(3,831,145.28)	75,634,353.22	887,166,709.89	(290,993,663.44)	3,099,638,990.42
其他权益工具投资	266,099,400.00	-	-	-	943,200.00	-	-	267,042,600.00
衍生金融工具	(27,330,755.67)	-	-	13,354,724.47	-	381,668.45	-	(13,594,362.75)
交易性金融负债	(354,619,594.84)	-	-	22,790,039.14	-	-	-	(331,829,555.70)

7、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

下表概述了在集团合并报表中未以公允价值列示、预期公允价值有明显偏差金融资产和负债：

项目	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	账面价值	公允价值	账面价值	公允价值
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
金融资产				
债权投资	3,769,778,679.69	3,775,770,225.64	3,763,499,007.04	3,764,352,347.22
金融负债				
应付债券-非可转换债券	156,226,872,898.85	155,652,605,102.50	147,732,680,489.85	161,831,219,475.18

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。

十、或有事项、承诺及表外事项

1、重大承诺事项

(1) 银行借款质押情况

截止 2021 年 6 月 30 日，约有人民币 7.64 亿元借款(2020 年 12 月 31 日：人民币 7.69 亿元)以本公司持有的上海市黄浦区中山南路 888 号绿地外滩中心 B3 办公楼作为抵押。

截止 2021 年 6 月 30 日，约有人民币 13.43 亿元借款(2020 年 12 月 31 日：人民币 13.43 亿元)以本公司持有的上海市黄浦区中山南路 858 号绿地外滩中心 B2 办公楼作为抵押。

截止 2021 年 6 月 30 日，约有人民币 19.97 亿元的流动借款(2020 年 12 月 31 日：人民币 25.25 亿元)以子公司持有的大成海通中国债券基金 1 号作为抵押，该抵押品的公允价值约为人民币 33.83 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 36.15 亿元)。

截止 2021 年 6 月 30 日，约有人民币 70.17 亿元的银行贷款(2020 年 12 月 31 日：人民币 56.47 亿元)以本公司下属子公司海通恒信金融集团有限公司和海通银行的股权作为质押。

截止 2021 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 13.09 亿元(折合人民币 10.89 亿元)(2020 年 12 月 31 日：港币 9.49 亿元，折合人民币 7.99 亿元)，该款项系在客户同意下，以对该客户的融出资金而取得的质押品(持有的上市公司股份)作为质押借入，截至 2021 年 6 月 30 日止，该质押品期末市值为港币 49.43 亿元(折合人民币 41.13 亿元)(2020 年 12 月 31 日：港币 49.34 亿元，折合人民币 41.53 亿元)。

截止 2021 年 6 月 30 日，约有人民币 129.66 亿元的借款(2020 年 12 月 31 日：人民币 146.87 亿元)，以应收融资租赁款项、长期应收款项、下属子公司股权作为质押及自有房产、飞机租赁固定资产作为抵押。截至 2021 年 6 月 30 日止，质押的应收融资租赁款项账面价值为人民币 26.66 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 35.88 亿元)，质押的长期应收款项账面价值为人民币 103.85 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 97.58 亿元)，抵押的自有房产账面价值为人民币 12.56 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 12.71 亿元)，抵押的飞机租赁固定资产的账面价值为人民币 50.07 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 52.30 亿元)。

十、或有事项、承诺及表外事项(续)

1、重大承诺事项(续)

(2) 有关公司为境外全资附属公司提供融资担保

2017年4月27日,本公司召开的第六届董事会第二十四次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。本公司2017年6月8日作为担保人签署《贷款协议》,为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供2亿欧元连带责任保证担保。截至2021年6月30日止,该项担保责任余额为1.6亿欧元。

2017年8月29日,本公司召开第六届董事会第二十五次会议,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》。本公司2018年5月14日作为担保人签署《贷款协议》,为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供6亿美元连带责任保证担保。

2018年8月29日,本公司召开第六届董事会第三十一次会议,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》。本公司于2019年3月22日作为担保人签署《贷款协议》,为境外间接全资附属公司HIIP的银团贷款提供3.75亿欧元连带责任保证担保。

本公司于2019年4月25日召开第六届董事会第三十七次会议,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》,同意本公司为在境外的全资子公司海通国际控股有限公司Haitong International Holdings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。

2020年8月28日,公司召开第七届董事会第十一次会议,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附属公司海通银行或其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。

十、或有事项、承诺及表外事项(续)

1、重大承诺事项(续)

(3) 有关公司为上海海通证券资产管理有限公司提供和追加净资本担保承诺

本公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》，董事会同意本公司随时对资产管理子公司提供不超过 15 亿元的净资本担保承诺，以保证其净资本保持充足。2013 年 6 月 9 日，上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司(以下简称“海通资管公司”)出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2013]145 号)，同意本公司向资产管理子公司提供 8 亿元的担保承诺。

2016 年 8 月 29 日，经本公司第六届董事会十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管公司追加净资本担保承诺及其增加注册资本的议案》，同意本公司对海通资管公司追加不超过人民币 40 亿元的净资本担保承诺。本公司为海通资管公司提供最高额度为人民币 40 亿元的净资本担保承诺，并承诺当海通资管公司开展业务需要现金支持时，本公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资本担保事宜，海通资管公司已于 2016 年 9 月 27 日获得中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2016]325 号)。

(4) 有关公司为海通开元投资有限公司减资过程中未清偿债务提供一般保证担保

本公司全资子公司海通开元投资有限公司(以下简称“海通开元”)将所持有的海通恒信国际融资租赁股份有限公司(以下简称“海通恒信”)2,440,846,824 股内资股划转给公司全资子公司海通创新证券投资有限公司(以下简称“海通创新证券”)。海通开元将注册资本从人民币 106.50 亿元减至人民币 75 亿元，减资人民币 31.50 亿元。公司为海通开元减资过程中未清偿债务人民币 105,502.08 万元提供一般保证担保。此担保事项经过公司于 2021 年 1 月 29 日召开的第七届董事会第十四次会议(临时会议)审议通过。截止 2021 年 6 月 30 日，本公司的该项担保责任余额为人民币 41,499.22 万元。

(5) 资本承诺

单位：人民币万元

项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
已签约但未拨付的购建长期资产承诺	305,896.62	368,592.36

(6) 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	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
一年以内	69,400.83	68,301.28
一至二年	59,186.20	60,522.44
二至三年	56,068.74	58,674.21
三至四年	48,717.42	52,043.80
四至五年	41,796.74	47,666.21
五年以上	78,109.80	98,146.13
合计	353,279.73	385,354.07

十、或有事项、承诺及表外事项(续)

1、重大承诺事项(续)

(7) 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、其他债权投资和其他权益工具投资，详见附注四、8，附注四、10及附注四、11。

2、表外事项

单位：人民币万元

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
保函和备用信用证(注1)	92,644.79	114,571.64
不可撤销贷款承诺(注2)	49,110.43	51,016.17
合计	141,755.22	165,587.81

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。

十一、资产负债表日后事项

期后公开发行公司债券

经上海证券交易所审核通过，并经中国证券监督管理委员会注册(证监许可[2020]2869号)，本公司于2020年11月2日获准面向专业投资者公开发行面值不超过人民币700亿元的公司债券。

本公司于2021年7月12日完成了公开发行2021年短期公司债券(第二期)，发行规模为人民币60亿元，期限339天，票面利率为2.82%。

本公司于2021年7月29日完成了公开发行2021年公司债券(第六期)，发行规模为人民币70亿元。其中品种一发行规模为人民币50亿元，期限1年，票面利率为2.72%；品种二发行规模为人民币20亿元，期限3年，票面利率为3.14%。

本公司于2021年8月20日完成了公开发行2021年公司债券(第七期)，发行规模为人民币30亿元，期限3年，票面利率为3.04%。

吸收合并子公司的董事会决议

本公司于2021年8月26日召开第七届董事会第十八次会议，同意以本公司为主体吸收合并上海泽春投资发展有限公司。吸收合并完成后，合并方本公司将承继上海泽春投资发展有限公司的资产和负债等，被合并方上海泽春投资发展有限公司将依法解散并注销。

除以上披露事项外，于2021年6月30日后至本中期财务报表批准报出日，本集团无其他重大资产负债表日后事项。

十二、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、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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一、营业总收入	5,189,483,318.31	3,007,570,572.44	2,415,765,932.99	6,472,615,931.43	2,421,897,705.32	3,963,908,126.65	23,471,241,587.14
手续费及佣金净收入	1,856,754,463.10	2,523,756,800.15	1,804,111,571.15	980,554,126.48	-	-	7,165,176,960.88
其他收入	3,332,728,855.21	483,813,772.29	611,654,361.84	5,492,061,804.95	2,421,897,705.32	3,963,908,126.65	16,306,064,626.26
二、营业总支出	1,936,581,172.06	1,367,055,736.59	903,072,911.38	2,009,913,866.77	1,624,820,081.31	3,995,657,538.18	11,837,101,306.29
三、营业利润	3,252,902,146.25	1,640,514,835.85	1,512,693,021.61	4,462,702,064.66	797,077,624.01	(31,749,411.53)	11,634,140,280.85
四、利润总额	3,264,417,160.26	1,632,068,175.92	1,515,178,575.28	4,488,112,838.27	792,920,182.47	(31,747,204.56)	11,660,949,727.64
五、资产总额	246,004,403,006.14	19,581,263,992.98	18,580,066,133.90	321,100,756,129.61	110,007,864,239.09	3,725,817,307.59	723,092,240,579.70
其中：分部资产	246,004,403,006.14	19,581,263,992.98	18,580,066,133.90	321,100,756,129.61	110,007,864,239.09	3,725,817,307.59	719,000,170,809.31
递延所得税资产							4,092,069,770.39
六、负债总额	186,851,090,097.61	18,161,955,076.62	10,687,625,426.18	228,303,745,287.19	102,724,709,184.14	1,822,458,883.19	549,798,941,196.63
其中：分部负债	186,851,090,097.61	18,161,955,076.62	10,687,625,426.18	228,303,745,287.19	102,724,709,184.14	1,822,458,883.19	548,551,583,954.93
递延所得税负债							1,247,357,241.70
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	163,434,658.75	103,886,117.89	75,453,136.25	181,390,436.16	171,854,425.41	27,207,898.55	723,226,673.01
2、资本性支出	259,467,770.55	90,390,979.49	7,708,037.86	145,315,314.59	290,742,000.00	40,710.00	793,664,812.49
3、信用减值损失	58,574,999.42	(66,388.02)	80,643,870.46	58,202,788.84	827,190,332.87	219,518.18	1,024,765,121.75
4、其他减值损失	-	-	-	-	39,555,500.41	4,527,645.35	44,083,145.76

十二、分部报告(续)

上期发生额/上年末余额	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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
一、营业总收入	4,946,269,689.17	2,065,699,884.65	1,763,586,711.95	4,727,251,142.24	2,189,922,128.45	2,094,925,834.12	17,787,655,390.58
手续费及佣金净收入	1,837,413,347.62	1,748,673,596.62	1,572,735,877.07	561,834,781.86	-	-	5,720,657,603.17
其他收入	3,108,856,341.55	317,026,288.03	190,850,834.88	4,165,416,360.38	2,189,922,128.45	2,094,925,834.12	12,066,997,787.41
二、营业总支出	2,927,865,720.78	973,102,077.02	682,702,521.03	1,791,050,457.77	1,486,155,860.86	2,103,900,476.07	9,964,777,113.53
三、营业利润	2,018,403,968.39	1,092,597,807.63	1,080,884,190.92	2,936,200,684.47	703,766,267.59	(8,974,641.95)	7,822,878,277.05
四、利润总额	2,019,056,667.80	1,092,683,672.36	1,060,286,110.36	2,955,862,225.60	700,565,384.76	(8,966,311.01)	7,819,487,749.87
五、资产总额	231,235,481,650.56	22,255,417,224.14	18,095,411,158.53	307,923,457,486.86	107,122,489,844.14	3,158,933,232.25	694,073,350,684.76
其中：分部资产	231,235,481,650.56	22,255,417,224.14	18,095,411,158.53	307,923,457,486.86	107,122,489,844.14	3,158,933,232.25	689,791,190,596.48
递延所得税资产							4,282,160,088.28
六、负债总额	177,785,461,261.52	21,494,501,068.76	10,855,872,732.11	212,465,257,261.49	101,198,686,667.59	1,449,125,374.24	525,947,038,849.00
其中：分部负债	177,785,461,261.52	21,494,501,068.76	10,855,872,732.11	212,465,257,261.49	101,198,686,667.59	1,449,125,374.24	525,248,904,365.71
递延所得税负债							698,134,483.29
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	149,997,417.64	91,488,627.95	70,803,916.06	109,698,915.69	211,295,138.93	1,462,312.05	634,746,328.32
2、资本性支出	1,479,316,130.11	632,982,564.13	17,134,335.24	2,084,335,982.67	2,745,301,032.74	1,557,639.79	6,960,627,684.68
3、信用减值损失	1,341,269,927.57	51,456,015.04	(499,885.84)	595,199,393.10	912,546,164.10	299,475.23	2,900,271,089.20
4、其他减值损失	-	3,678,399.12	-	-	4,925,589.04	1,853,364.52	10,457,352.68

十三、其他重要事项

1、海通国际证券集团购股权计划

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划

2015 年 6 月 8 日(收购日)，海通国际证券集团有限公司(以下简称“海通国际证券”)股东通过了一项新的购股权计划(“2015 购股权计划”)。作为海通国际控股有限公司的控股公司，海通国际证券集团有限公司的控制方，海通证券以及香港联交所上市委员会，也分别于 2015 年 6 月 8 日以及 2015 年 6 月 12 日通过了该计划。

2020 年 5 月 29 日，根据 2015 年购股权计划，海通国际证券以每股港币 1.727 元的价格授予了 10,645,000 股份给予员工，此前 10,645,000 的股份已经被授予。此项计划的有效期间是 2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日。所有的购股权的等待期间是授予日起的 6 个月内。海通国际证券的股份的收盘价为每股港币 1.57 元。

在 2020 年 5 月 29 日授权日，根据 2015 年购股权计划授予股权的估计公允价值折合港币 3.2 百万元，这个价格是用二项式期权定价模型得出的，关键数据如下：

项目	2020
授予日之加权平均股价	港元 1.57
初始行权价格	港元 1.727
预期波动	49.389%
预期授权期限	5 年
无风险折现率	0.520%
预期股息率	11.439%
提前行权乘数-海通国际证券董事	1.69
提前行权乘数-海通国际证券员工	1.94

预期波动是由海通国际证券股权在授予日之前 5 年内的历史价格决定的。

截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间，根据 2015 年购股权计划，本海通国际证券于综合损益表中并无权益结算的股份支付(截至 2020 年 6 月 30 日止 6 个月期间：港币 537,000 元，折合人民币 490,517 元)。

下表披露年内本海通国际证券 2015 年购股权计划授予其董事及雇员的购股权的变动：

	2021 上半年度		2020 年度	
	加权平均行使价 每股港币	配股权数目 千份	加权平均行使价 每股港币	配股权数目 千份
于期/年初	3.369	62,102	3.728	54,106
期/年内授予及接受的购股权	-	-	1.727	10,645
期/年内调整(注)	-	-	3.717	95
期/年内行使	1.727	(1,350)	-	-
期/年内没收	4.161	(20,781)	3.950	(2,744)
于期/年末	3.012	39,971	3.369	62,102

十三、其他重要事项(续)

1、海通国际证券集团购股权计划(续)

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 购股权计划(续)

截止各报告日期未行使购股权的行使价及行使期如下：

购股权数目 千份	行使价 每股港币 (注)	行权期
2021 年 6 月 30 日		
8,409	5.002	2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日
14,433	2.898	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
8,384	2.554	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
8,745	1.727	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
<u>39,971</u>		
2020 年 12 月 31 日		
12,611	4.635	2016 年 12 月 8 日至 2021 年 5 月 11 日
11,078	5.002	2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日
17,610	2.898	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
10,158	2.554	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
10,645	1.727	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
<u>62,102</u>		

注：购股权的行使价可就供股、股利或红股发行或海通国际证券股本的其他类似变动而作出调整。

截止到 2021 年 6 月 30 日，海通国际证券在 2015 购股权计划中拥有 39,971,404 份(2020 年 12 月 31 日：62,102,499 份)购股权，大约占到海通国际证券当天发行股票的 0.66%(2020 年 12 月 31 日：1.03%)。

根据海通国际证券现有的资本结构，行使所有剩余的股票期权会使海通国际证券发行额外普通股 39,971,404 股(2020 年：62,102,499 股)，发行额外股本港币 3,997,000 元，折合人民币 3,325,823.76 元(2020 年：港币 6,210,000 元，折合人民币 5,226,584.40 元)，股本溢价港币 116,408,000 元，折合人民币 96,860,768.64 元(2020 年：港币 203,016,000 元，折合人民币 170,866,386.24 元)(不包括发行费用)。

十三、其他重要事项(续)

1、 海通国际证券集团购股权计划(续)

(2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划

在 2014 年 12 月 19 日，海通国际证券董事会通过了一项为期 10 年股份奖励计划(“该计划”)，以激励选定的员工或董事(“计划参与者”)为集团作出的贡献并为集团的进一步发展吸引合适人才。

在 2021 年 6 月 30 日被授予和失效的股票的信息如下：

授予股份的日期	授予股份的数量	可行权股份的数量	已失效授予股份的数量(附注(g))	未及可行权日股份的数量	可行权日期	被授予日的公允价值(港元)
2018 年 5 月 11 日	7,010,493	5,923,076	1,087,417	-	附注 (a)	32,108,000
2019 年 3 月 25 日	6,848,366	4,057,693	984,177	1,806,496	附注 (b)	21,024,000
2019 年 10 月 29 日	8,175,000	5,000,000	1,135,000	2,040,000	附注 (c)	18,557,000
2020 年 3 月 25 日	14,294,205	4,359,028	1,669,453	8,265,724	附注 (d)	28,731,000
2020 年 7 月 3 日	7,700,000	7,700,000	-	-	附注 (e)	16,016,000
2021 年 3 月 25 日	29,000,000	29,000,000	-	-	附注 (f)	69,890,000

授予股权的公允价值以海通国际证券股票的市价衡量。截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团于综合损益表中确认该计划的权益结算股份支付共计港币 79,037,000 元(截至 2020 年 6 月 30 日止 6 个月期间：港币 14,196,000 元)。

于 2021 年 6 月 30 日，海通国际证券无 2018 年 5 月 11 日被授权但未及可行权日的股份(2020 年 12 月 31 日：1,860,031 股)。截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间于 2018 年 5 月 11 日授权的 108,413 股失效(截至 2020 年 6 月 30 日止 6 个月期间：131,545 股)，于 2018 年 5 月 11 日授权的 1,751,618 股可行权(截至 2020 年 6 月 30 日止 6 个月期间：1,971,575 股)。

十三、其他重要事项(续)

1、海通国际证券集团购股权计划(续)

(2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划(续)

于2021年6月30日，海通国际证券持有2019年3月25日被授权但未及可行权日的股份1,806,496股(2020年12月31日：3,988,774股)。截至2021年6月30日止6个月期间，于2019年3月25日授权的248,307股失效(截至2020年6月30日止6个月期间：108,143股)，于2019年3月25日授权的1,933,971股可行权(截至2020年6月30日止6个月期间：2,123,722股)。

于2021年6月30日，海通国际证券持有2019年10月29日被授权但未及可行权日的股份2,040,000股(2020年12月31日：4,760,000股)。截至2021年6月30日止6个月期间，于2019年10月29日授权的335,000股失效(截至2020年6月30日止6个月期间：150,000股)，于2019年10月29日授权的2,385,000股可行权(截至2020年6月30日止6个月期间：2,615,000股)。

于2021年6月30日，海通国际证券持有2020年3月25日被授权但未及可行权日的股份8,265,724股(2020年12月31日：13,463,223股)。截至2021年6月30日止6个月期间，于2020年3月25日授权的838,471股失效(截至2020年6月30日止6个月期间：235,671股)。于2020年3月25日授权的4,359,028股可行权(截至2020年6月30日止6个月期间：无)。

于2021年6月30日及2020年12月31日，海通国际证券未持有2020年7月3日被授权但未及可行权日的股份。于上年度，于2020年7月3日授权的所有7,700,000股可行权。

于2021年6月30日，海通国际证券未持有2021年3月25日被授权但未及可行权日的股份。截至2021年6月30日止6个月期间，于2021年3月25日授权的所有29,000,000股可行权。

附注：

(a) 按照商定的条款，于2018年5月11日授予的三分之一激励股权的行权日是2019年5月13日，而于2018年5月11日授予的另外三分之一激励股权的行权日是2020年5月13日，最后剩余的三分之一激励股权的行权日是2021年5月13日。

十三、其他重要事项(续)

1、海通国际证券集团购股权计划(续)

(2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划(续)

附注(续):

(b) 按照商定的条款，于2019年3月25日授予的三分之一激励股权的行权日是2020年3月23日，而于2019年3月25日授予的另外三分之一激励股权的行权日是2021年3月23日，最后剩余的三分之一激励股权的行权日是2022年3月23日。

(c) 按照商定的条款，于2019年10月29日授予的三分之一激励股权的行权日是2020年1月2日，而于2019年10月29日授予的另外三分之一激励股权的行权日是2021年1月2日，最后剩余的三分之一激励股权的行权日是2022年1月2日。

(d) 按照商定的条款，于2020年3月25日授予的三分之一激励股权的行权日是2021年3月24日，而于2020年3月25日授予的另外三分之一激励股权的行权日是2022年3月24日，最后剩余的三分之一激励股权的行权日是2023年3月24日。

(e) 按照商定的条款，于2020年7月3日授予的所有激励股权的行权日是2020年7月15日。

(f) 按照商定的条款，于2021年3月25日授予的所有激励股权的行权日是2021年4月30日。

(g) 由于员工离职，被授予的股票在他们的期权到期之前就已经失效。根据协议，已到期的股份由受托人持有，经行政委员会批准，可重新选择任何被选定的参与者。如简明综合权益变动表的披露所示，股份已从股票奖励储备转至股票溢价。

下表披露本期在该计划下的股权的变动：

	2021上半年度		2020年度	
	港币千元	股份数量	港币千元	股份数量
期/年初数	389,986	172,705,979	207,210	62,273,142
本期/年购买	-	-	230,980	126,069,000
本期/年失效并且转出	(83,802)	(39,429,617)	(48,204)	(15,636,163)
汇兑损益	-	-	-	-
期/年末数	306,184	133,276,362	389,986	172,705,979

十三、其他重要事项(续)

2、 金融工具计量基础分类表

金融资产计量基础分类表										
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	
	期末数 人民币元	年初数 人民币元	期末数 人民币元	年初数 人民币元	期末数 人民币元	年初数 人民币元	期末数 人民币元	年初数 人民币元	期末数 人民币元	年初数 人民币元
货币资金	152,711,373,385.12	127,846,510,384.44								
结算备付金	14,144,755,957.03	11,852,300,703.44								
拆出资金	40,909,354.48	22,619,003.50								
融出资金	80,176,273,764.79	73,067,592,180.28								
衍生金融资产							1,159,029,426.60	1,836,702,137.01	2,119,440.82	1,209,412.27
存出保证金	19,194,202,709.26	17,374,851,216.38								
应收款项	14,372,620,584.73	8,410,000,191.07								
买入返售金融资产	47,374,018,540.66	57,965,393,846.35								
交易性金融资产							220,492,902,157.25	220,396,503,802.97		
债权投资	3,769,778,679.69	3,763,499,007.04								
其他债权投资			17,336,611,668.70	13,108,162,077.30						
其他权益工具投资					9,656,322,183.81	16,239,187,221.41				
长期应收款	41,493,096,835.38	35,214,476,098.67								
其他资产(金融资产)	26,143,129,346.57	25,759,785,329.00								
合计	399,420,159,157.71	361,277,027,960.17	17,336,611,668.70	13,108,162,077.30	9,656,322,183.81	16,239,187,221.41	221,651,931,583.85	222,233,205,939.98	2,119,440.82	1,209,412.27

十三、其他重要事项(续)

2、 金融工具计量基础分类表(续)

金融负债计量基础分类表								
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	
	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
短期借款	36,244,363,155.76	43,367,554,072.81						
应付短期融资款	19,408,105,298.65	25,718,522,701.47						
拆入资金	16,041,065,078.27	15,069,512,517.55						
交易性金融负债			1,597,202,845.44	4,412,068,287.96	37,034,084,063.81	27,826,232,656.78		
衍生金融负债			2,295,240,823.47	2,312,368,747.61			222,865,487.25	359,910,183.08
卖出回购金融资产款	59,826,002,087.77	60,563,432,718.62						
代理买卖证券款	115,515,984,832.05	108,167,567,969.29						
代理承销证券款	514,399,999.98	233,062,962.16						
应付款项	21,148,375,027.68	11,590,061,915.13						
长期借款	51,378,459,686.52	49,363,002,740.67						
应付债券	156,332,095,029.79	147,838,209,538.34						
其他负债(金融负债)	16,659,498,679.44	16,490,559,549.35						
合计	493,068,348,875.91	478,401,486,685.39	3,892,443,668.91	6,724,437,035.57	37,034,084,063.81	27,826,232,656.78	222,865,487.25	359,910,183.08

十三、其他重要事项(续)

3、 社会责任

2021 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 2,295 万元。

2021 年 1-6 月公益性投入构成明细

单位：万元

项目	本期发生额
慈善捐赠、教育资助、救灾捐款等	2,295
合计	2,295

4、 与子公司相关的其他披露

本集团的子公司在开展业务中可能成为或已经成为涉及诉讼或仲裁的主体。本集团的子公司的法律顾问将全程参与相关事项。本集团认为相关事项导致可能的经济利益流出对合并财务报表的影响不重大。

十四、母公司财务报表项目注释

1、 长期股权投资

(1) 长期股权投资分类如下

项目	2021 年 6 月 30 日			2020 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
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
子公司	33,697,560,516.00	-	33,697,560,516.00	33,697,560,516.00	-	33,697,560,516.00
联营企业	1,585,596,734.29	-	1,585,596,734.29	1,448,468,781.79	-	1,448,468,781.79
合计	35,283,157,250.29	-	35,283,157,250.29	35,146,029,297.79	-	35,146,029,297.79

十四、母公司财务报表项目注释(续)

1、 长期股权投资(续)

(2) 对子公司投资

被投资单位	初始投资成本	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日	本期计提减值准备	减值准备期末余额
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
海富通基金管理有限公司	76,500,000.00	76,500,000.00	-	-	76,500,000.00	-	-
海富产业投资基金管理有限公司	63,650,000.00	63,650,000.00	-	-	63,650,000.00	-	-
海通期货股份有限公司	1,376,191,777.61	1,376,191,777.61	-	-	1,376,191,777.61	-	-
海通国际控股有限公司	9,406,814,500.00	9,406,814,500.00	-	-	9,406,814,500.00	-	-
海通开元投资有限公司	10,650,000,000.00	10,650,000,000.00	-	3,150,000,000.00	7,500,000,000.00	-	-
海通创新证券投资咨询有限公司	8,300,000,000.00	8,300,000,000.00	3,150,000,000.00	-	11,450,000,000.00	-	-
上海海通资产管理有限公司	2,200,000,000.00	2,200,000,000.00	-	-	2,200,000,000.00	-	-
上海惟泰置业管理有限公司	756,066,063.75	756,066,063.75	-	-	756,066,063.75	-	-
上海泽春投资发展有限公司	868,338,174.64	868,338,174.64	-	-	868,338,174.64	-	-
合计	33,697,560,516.00	33,697,560,516.00	3,150,000,000.00	3,150,000,000.00	33,697,560,516.00	-	-

(3) 对联营企业投资

被投资单位	2020年12月31日	本期增、减变动								2021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	公司享有其他权益变动	公司享有的宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
联营企业											
富国基金管理有限公司	1,448,468,781.79	-	-	337,663,452.50	-	-	(200,535,500.00)	-	-	1,585,596,734.29	-
合计	1,448,468,781.79	-	-	337,663,452.50	-	-	(200,535,500.00)	-	-	1,585,596,734.29	-

(4) 公司无向投资企业转移资金能力受到限制的情况。

十四、母公司财务报表项目注释(续)

2、 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
	人民币元	人民币元
证券经纪业务净收入	2,033,632,830.76	1,924,618,507.75
——证券经纪业务收入	2,852,829,912.82	2,675,521,686.16
其中：代理买卖证券业务	2,194,260,990.78	2,195,682,133.17
交易单元席位租赁	512,902,621.48	369,971,717.45
代销金融产品业务	145,666,300.56	109,867,835.54
——证券经纪业务支出	819,197,082.06	750,903,178.41
其中：代理买卖证券业务	819,197,082.06	750,903,178.41
投资银行业务净收入	1,834,945,545.00	1,155,783,371.80
——投资银行业务收入	1,860,560,499.51	1,216,284,358.38
其中：证券承销业务	1,742,635,946.04	1,132,004,742.34
证券保荐业务	68,467,924.51	13,603,773.58
财务顾问业务	49,456,628.96	70,675,842.46
——投资银行业务支出	25,614,954.51	60,500,986.58
其中：证券承销业务	25,596,275.31	60,493,911.11
财务顾问业务	18,679.20	7,075.47
投资咨询业务净收入	67,215,118.90	62,858,652.01
——投资咨询业务收入	67,215,118.90	62,858,652.01
——投资咨询业务支出	-	-
其他手续费及佣金净收入	54,239,286.97	51,482,095.65
——其他手续费及佣金收入	55,770,975.39	54,733,012.79
——其他手续费及佣金支出	1,531,688.42	3,250,917.14
合计	3,990,032,781.63	3,194,742,627.21
其中：手续费及佣金收入合计	4,836,376,506.62	4,009,397,709.34
手续费及佣金支出合计	846,343,724.99	814,655,082.13

(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
	人民币元	人民币元
并购重组财务顾问业务净收入境内上市公司	7,386,792.50	36,053,868.65
并购重组财务顾问业务净收入其他	-	3,505,660.38
其他财务顾问业务净收入	42,051,157.26	31,109,237.96
合计	49,437,949.76	70,668,766.99

十四、母公司财务报表项目注释(续)

3、利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
利息收入	4,603,997,287.48	4,115,296,011.29
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,030,306,587.82	1,028,155,975.26
融出资金利息收入	2,224,619,593.02	1,496,587,465.53
买入返售金融资产利息收入	1,039,243,477.18	1,367,249,748.61
其中：约定购回利息收入	6,067,213.83	2,663,816.98
股票质押回购利息收入	907,656,150.99	1,290,247,802.79
债权投资利息收入	-	4,102,459.02
其他债权投资利息收入	303,201,259.37	211,865,984.05
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	6,626,370.09	7,334,378.82
利息支出	3,086,252,280.04	2,862,555,415.90
其中：借款利息支出	37,068,830.54	7,983,222.69
应付短期融资款利息支出	144,534,664.90	258,743,862.65
拆入资金利息支出	105,576,069.42	177,227,167.43
其中：转融通利息支出	78,267,777.68	114,656,250.07
卖出回购金融资产利息支出	641,049,344.82	598,629,675.08
其中：报价回购利息支出	2,085,130.96	979,071.16
代理买卖证券利息支出	123,691,006.13	115,046,693.85
应付债券利息支出	1,914,956,836.72	1,640,990,504.71
其中：次级债券利息支出	100,592,277.57	144,998,739.72
租赁负债利息支出	9,351,458.97	7,107,767.04
其他按实际利率法计算的金融负债利息支出	110,024,068.54	56,826,522.45
利息净收入	1,517,745,007.44	1,252,740,595.39

4、投资收益

(1) 投资收益按类别列示

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
成本法核算的长期股权投资收益(2)	126,584,144.65	891,326,181.64
权益法核算的长期股权投资收益	337,663,452.50	162,206,000.00
金融工具投资收益	2,617,801,330.66	2,447,083,049.38
(1)持有期间取得的收益	2,715,470,198.91	2,091,342,874.49
交易性金融工具	1,713,192,470.20	2,090,916,475.52
其他权益工具投资	1,001,780,634.31	426,398.97
其他	497,094.40	-
(2)处置金融工具取得的收益	(97,668,868.25)	355,740,174.89
交易性金融工具	(168,837,712.62)	126,075,670.26
其他债权投资	(686,546,848.46)	3,509,566.56
衍生金融工具	1,178,560,845.36	226,154,938.07
其他	(420,845,152.53)	-
合计	3,082,048,927.81	3,500,615,231.02

十四、母公司财务报表项目注释(续)

4、 投资收益(续)

(2) 按成本法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原因
	人民币元	人民币元	
海通期货股份有限公司	-	136,224,190.00	被投资单位分红发生变动
上海海通证券资产管理公司	-	200,000,000.00	被投资单位分红发生变动
海富通基金管理有限公司	93,754,144.65	23,611,991.64	被投资单位分红发生变动
海富产业投资基金管理有限公司	32,830,000.00	31,490,000.00	被投资单位分红发生变动
海通开元投资有限公司	-	500,000,000.00	被投资单位分红发生变动
合计	126,584,144.65	891,326,181.64	

5、 公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
交易性金融资产	622,676,234.31	(33,756,613.87)
衍生金融工具	123,644,340.01	444,619,144.03
交易性金融负债	(172,503,533.84)	(20,532,772.08)
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	(172,678,133.84)	88,512,863.32
合计	573,817,040.48	390,329,758.08

6、 业务及管理费

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
职工费用	2,493,153,941.37	1,482,825,694.56
固定资产折旧费	155,685,513.11	86,177,608.28
电子设备运转费	102,616,407.98	97,801,164.92
使用权资产折旧	87,183,890.87	106,342,824.34
邮电通讯费	81,277,546.89	47,483,653.89
业务招待费	64,466,668.50	34,390,782.44
咨询费	51,747,641.81	53,731,727.45
无形资产摊销	51,219,588.16	41,854,401.08
证券投资者保护基金	44,865,728.66	38,753,205.75
差旅费	44,724,872.11	23,932,174.34
其他	214,521,357.71	183,515,034.35
合计	3,391,463,157.17	2,196,808,271.40

十四、母公司财务报表项目注释(续)

7、 现金流量表补充资料

项目	本期发生额	上期发生额
	人民币元	人民币元
1、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	4,687,971,315.60	4,164,949,338.55
加：信用减值损失	(75,034,174.19)	1,253,031,347.41
固定资产及投资性房地产折旧	156,197,715.05	86,775,178.34
使用权资产折旧	87,183,890.87	106,342,824.34
无形资产摊销	51,219,588.16	41,854,401.08
长期待摊费用摊销	27,817,665.88	20,035,998.24
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	1,798,167.69	765,419.56
公允价值变动收益	(573,817,040.48)	(390,329,758.08)
利息支出	1,798,440,223.44	1,698,856,914.02
汇兑收益	(96,016,824.45)	(19,170,182.40)
投资收益	(779,915,394.28)	(1,057,041,748.20)
递延所得税资产减少/(增加)	194,332,723.36	(54,786,307.25)
交易性金融资产等的减少/(增加)	3,130,494,067.90	(19,465,055,268.62)
经营性应收项目的增加	(4,903,649,546.68)	(5,755,082,666.54)
经营性应付项目的增加	10,842,033,297.37	20,420,948,079.26
经营活动产生的现金流量净额	14,549,055,675.24	1,052,093,569.71
2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
3、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	108,701,335,540.16	86,133,774,761.82
减：现金的年初余额	91,698,084,523.06	81,892,823,582.56
加：现金等价物的期末余额	-	-
减：现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	17,003,251,017.10	4,240,951,179.26

十五、财务报表的批准报出

本中期财务报表业经本公司董事会于 2021 年 8 月 26 日批准报出。

补充资料

1、 非经常性损益明细表

项目	本期发生额
非流动资产处置损益	(889,711.45)
计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关,按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外)	541,838,473.83
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	21,582,404.81
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	(4,407,004.39)
所得税影响额	(259,155,008.12)
少数股东权益影响额(税后)	(26,126,307.05)
合计	272,842,847.63

注：本集团交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具产生等投资的公允价值变动损益，交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具、债券投资及其他债权投资等投资的投资收益，均不作为非经常性损益项目，而界定为经常性损益项目。本集团作为证券经营机构和金融企业，上述业务均属于本集团的正常经营业务。

2、 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 2021 年 1-6 月及 2020 年 1-6 月的净利润和 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日的净资产并无差异。

3、 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	5.10	0.63	0.63
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	4.93	0.60	0.60

修订信息

适用 不适用

第十一节 证券公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

公司行政许可事项如下：

日期	批复标题	批复单位	批文号
2021年1月1日	内部资料性出版物准印证	上海市新闻出版局	准印证号(K)0772

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2021年，公司在证券公司分类监管评价中被评为B类BBB级。