

渤海证券股份有限公司 2023 年度 证券公司短期融资券发行安排说明

根据中国人民银行发布的《证券公司短期融资券管理办法》（中国人民银行公告〔2021〕第 10 号）和全国银行间同业拆借中心发布的《银行间市场证券公司短期融资券发行交易规程》（中汇交发〔2021〕294 号），本机构（渤海证券股份有限公司，以下简称“公司”或“我公司”）拟在银行间市场发行证券公司短期融资券（以下简称“短期融资券”），具体发行安排说明如下：

一、发行人基本情况

1、发行人基本信息

公司的中文名称	渤海证券股份有限公司
公司的中文简称	渤海证券
公司的英文名称	Bohai Securities Co., Ltd.
公司的英文简称	Bohai Securities
注册资本	8,037,194,486 元
公司的法定代表人	安志勇
注册地址：	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

公司经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；中国证监会批准的其他业务；融资融券业务；代销金融产品业务。

（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）

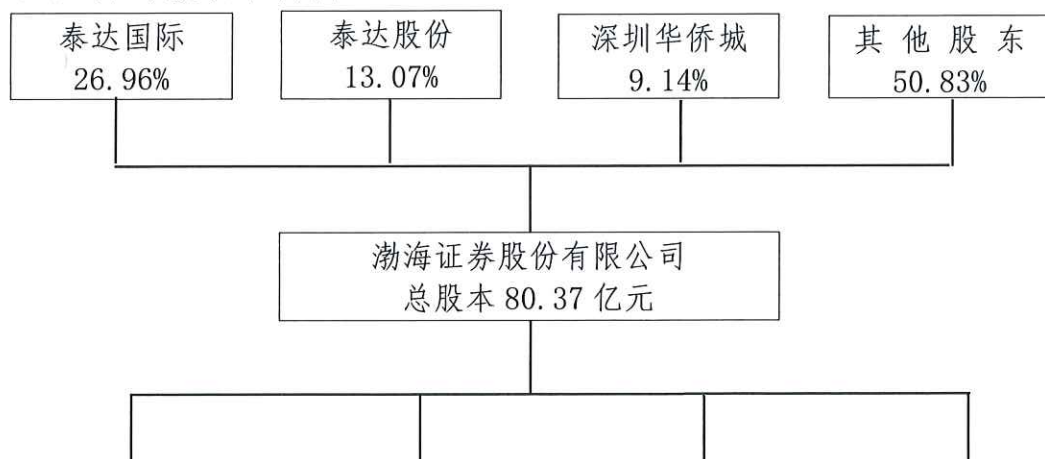
2、公司股权结构

(1) 截至 2022 年 9 月 30 日，公司前十名股东持股情况如下表：

序号	股东名称	持股数（股）	持股比例（%）
1	天津市泰达国际控股（集团）有限公司	2,166,741,007	26.96
2	天津泰达股份有限公司	1,050,459,700	13.07
3	深圳华侨城股份有限公司	734,844,816	9.14
4	天津渤海国有资产经营管理有限公司	509,720,721	6.34
5	天津保税区投资控股集团有限公司	500,000,000	6.22
6	天津津融投资服务集团有限公司	368,739,106	4.59
7	天津天保控股有限公司	300,000,000	3.73
8	正荣集团有限公司	250,000,000	3.11
9	天津渤海津镭产业结构调整股权投资基金有限公司	213,594,048	2.66
10	深圳市锐盈创富资本管理合伙企业（有限合伙）	182,000,000	2.26
	合计	6,276,099,398	78.08

天津市国资委为公司实际控制人，控制的股权比例合计为 63.28%。

(2) 公司股权结构图：



和融期货 100.00%	博正资本 100.00%	渤海创富 100.00%	渤海汇金 100.00%
-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

3、经营情况

截止 2022 年 9 月末，公司累计实现合并营业收入 8.96 亿元，同比下降 65.10%。累计实现合并利润总额 2.45 亿元，同比下降 87.18%。公司加权净资产收益率 1.34%，同比下降 81.36%。

4、财务状况

截止 2022 年 9 月末，公司合并资产总额 620.09 亿元，同比下降 2.25%，主要为公司自营投资资产规模及融出资金规模的变动。公司合并负债总额 400.10 亿元，同比下降 4.48%，主要为回购融资业务规模、交易性金融负债、应付债券以及短期融资款的变动；剔除客户资金 71.49 亿元后，自有负债为 328.61 亿元。期末公司净资产 219.99 亿元，同比增长 2.10%。

5、合规管理情况

(1) 合规管理组织架构

公司建立了以董事会为合规管理工作最高决策机构，以监事会为监督机构，以经营层负责合规风险的有效管理，以合规总监为合规工作指导，由专职的合规管理部门和合规管理人员为合规政策的督导执行，由管理、支持、保障部门（财务、资金、结算托管、信息技术、人力资源、总裁办公室、董事会办公室）及业务经营部门（经纪业务、投资银行、证

券投资、资产管理等)和公司各分支机构、各层级子公司为具体落实部门,由稽核总部为合规管理工作评估部门的多层级的合规管理体系。

(2) 合规管理制度体系

公司建立了以《渤海证券股份有限公司合规管理办法》为基本制度,以《合规审查管理规定》《合规咨询管理规定》《工作人员职务通讯行为监测办法》《工作人员证券投资行为管理办法》《信息隔离墙管理办法》等为专项管理制度,以公司各部门、子公司、分支机构管理制度为具体操作制度的管理体系,合规管理制度体系不断完善。

(3) 合规管理执行情况

公司合规管理机制运行良好有效,公司董监高各层级、各下属单位、员工在经营决策、运营管理和执业行为过程中充分履行相应合规管理职责,营造良好合规文化。公司积极支持合规总监及合规部门开展工作,为合规人员履职提供了人力、物力、财力的有效保障。

公司持续完善合规管理信息系统,系统涵盖公司经营管理部门所有部门,合规系统实现了与柜台交易系统、恒生系统、风控系统、研究报告系统等周边生产系统的对接和数据采集功能。

合规管理总部通过合规审查、合规检查、合规咨询、合规培训、合规监测、合规报告等合规职能的履行,将合规管

理覆盖到各业务的各个环节，以确保业务开展的合法合规。合规管理总部开展专项检查和相关业务的例行检查，检查范围涵盖重点业务领域和环节，排查合规风险和隐患，有效推动了公司合规管理水平的提升。同时，定期追踪证券监管机构最新规定，利用工作联系单、不定期督导、常态化培训等形式，就违规案例、监管精神等进行宣导，培育合规文化。公司设有合规专员，切实发挥一线合规管理职能。公司制定系列合规考核制度与机制，明确考核标准、量化考核分值，进一步完善合规管理约束机制。

6、风险管理情况

(1) 风险管理组织架构

公司建立了包括董事会、监事会、经营层、各部门、分支机构及子公司在内的多层次、相互衔接、有效制衡的风险管理组织架构，建立了以董事会为风险管理的最高决策机构，以董事会风险控制委员会为风险管理工作指导机构，以经营层负责风险管理主体责任，以首席风险官负责风险管理工作具体推动落实，由专职的风险管理部门为风险管理的督导执行部门，由业务支持部门、职能部门及业务部门、各分支机构、所有子公司为风险管理的具体落实部门，由稽核总部为全面风险管理的内部审计部门的多层级的全面风险管理体系。

公司风险管理总部履行日常风险管理职责，在首席风险

官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。

公司各业务部门、分支机构及子公司是公司风险管理工作的第一道防线，执行具体的风险管理职责；公司各中台支持保障部门作为风险管理的中间环节，承担本部门内部的一线风险管理职责；公司稽核总部是公司风险管理的内部审计部门，向公司董事会负责。

（2）风险管理制度体系

公司建立了较为完备的风险管理制度体系，在董事会层面、经营层层面、业务层面以及市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等风险管理层面建立了较为健全的风险管理工作机制，有效防范和化解经营风险，保障公司持续稳健运行。

公司制定了基础性制度《渤海证券全面风险管理规定》，对公司全面开展风险管理各项工作具有指导和规范作用。在基本风险管理制度基础上，根据不同风险类型，分别制定了《渤海证券市场风险管理办法》《渤海证券信用风险管理办法》《渤海证券流动性风险管理办法》《渤海证券操作风险管理办法》《渤海证券声誉风险管理办法》等风险管理制度。

公司针对不同业务所面临的风险进一步细化了管理，制定了业务风险管理制度，包括《渤海证券经纪业务风险监控

制度》《渤海证券融资融券业务风险管理制度》《渤海证券自营业务风险监控管理制度》《渤海证券投资银行类业务风险管理制度》等多项制度。除此之外，公司制定了《渤海证券新业务评估管理办法》等制度，进一步加强公司对新业务的风险管理。

另外，公司还制定了《渤海证券重大风险事项报告制度》《渤海证券授权管理办法》《数据治理与数据质量管理办法》《网络安全事件应急预案》《信息技术外包服务管理办法》《渤海证券风控专员管理办法》等制度规定，从风险的报告及应对、授权管理、信息治理与系统安全、外包管理等各方面进行了规范。

（3）主要风险的管理措施

① 市场风险管理

公司制定了《渤海证券市场风险管理办法》等制度，建立了市场风险管理体系，通过确定总体风险容忍度、优化风险管控机制、加强限额管理（制定规模限额、止损限额、风险限额）等，有效管理市场风险。董事会确定公司总体风险偏好及风险容忍度；公司经营层确定相关业务部门的投资规模和风险限额；投资决策委员会确定单个项目的投资规模、止损限额；公司投资部门严格按照制度进行投资交易，通过事前充分研究评估、事中跟踪市场及时调整投资策略、组合分散投资、衍生品对冲等手段积极防控市场风险，进行逐日

盯市，加强估值管理，严格执行止损制度，有效管理市场风险；风险管理总部通过风险管理系统进行动态监控，每日计量市场风险控制指标报送公司经营层，同时及时进行风险提示，督促业务部门进行风险处置。公司通过分散投资、限额管理、风险对冲等方式管理证券自营业务市场风险，公司整体市场风险可控。

②信用风险管理

公司制定了《渤海证券信用风险管理办法》等制度，对所涉及到信用风险的业务统筹管理。针对融资类业务，公司构建了多层级的业务管理体系，并通过事前评估、事中监控和事后处置报告来实现对信用风险的管理。针对固定收益类证券投资业务，公司按照自身风险偏好建立了内部评级体系及准入标准，重视投前评估与投后跟踪监控，同时根据《证券公司风险控制指标管理办法》等要求设置集中度、低评级信用债占比、信用债久期等指标，以分散投资信用风险。针对交易对手信用风险，公司建立了债券投资交易的交易对手管理相关制度，对交易对手进行分类授信管理，定期或不定期维护交易对手名单，加强交易监测。针对投资银行类业务发行人债券违约的信用风险，公司制定了《公司债券存续期信用风险管理实施细则》等，加强风险监测与预警，持续履行债券存续期信用风险管理职责。

③流动性风险管理

公司制定了《渤海证券流动性风险管理办法》《渤海证券流动性风险管理实施细则》等制度，采用集中管理、分级实施、适当储备、统一应对的管理思路和目标组织实施流动性风险管理，通过加强日间流动性管理和日常融资管理，实施流动性风险限额管理，优化公司负债结构，持续拓展融资渠道，建立健全流动性风险管理信息系统等手段，积极防范和控制流动性风险。对流动性风险限额具体分解到各业务条线，并关注各业务条线的日常执行情况。对于公司的重资产业务，包括证券自营业务、融资融券业务等，在分析各项数据的基础上，运用敏感性分析、风险值分析等风险评估方法，对其流动性风险指标进行动态风险监测，并关注不同风险间的转化和传递，对超过流动性警戒值和突发性风险放大情况，及时向公司经营层汇报，并采取相应措施控制风险。

④操作风险管理

公司制定了《渤海证券操作风险管理办法》等制度，通过有效识别操作风险点并进行风险分级、完善内部管理制度、流程及环节，扎实开展岗位培训增强员工责任意识，加强过程中复核和检查，强化内部管理机制；加大内外部风险案例学习及警示教育培训力度，有效提升风险管控意识，确保业务操作的准确性和合规性；提升操作风险数据分析能力，不断优化流程设计及管控手段，以达到既定业务收入下操作风险的最小化。

⑤声誉风险管理

公司针对声誉风险制定了《渤海证券声誉风险管理制度》。通过建立声誉风险管理机制，主动有效地识别、评估、控制、监测、应对和报告声誉风险，最大程度地防范和减少声誉事件对公司及利益相关方、行业造成的损失和负面影响。公司对经营管理各领域的声誉风险进行事前评估，主动防范声誉风险。

7、公司治理情况

公司依据《公司法》《证券法》《证券公司监督管理条例》等法律、法规及规范性文件的要求，制定了《公司章程》，建立了由公司股东大会、董事会、监事会和公司经营层组成的公司治理结构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和公司经营层之间权责明确、运作规范的相互协调和相互制衡的机制，为公司高效、稳健经营提供了组织保证。

为了进一步完善公司法人治理结构，公司根据相关法律、法规及《公司章程》制定了《股东大会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》以及独立董事和各专门委员会工作制度等相关制度，为公司法人治理的规范化运行提供了制度保证。公司董事会下设战略发展委员会、审计委员会、风险控制委员会、薪酬与提名委员会四个专门委员会，分别负责战略发展研究、内控与审计、风险防范与监督控制、董事和高级管理人员的提名、甄选、管理和考核等工作，为公司

董事会科学决策提供支持。

公司通过建立清晰的机构设置、明确权责分配、强化内部审计职责、制定合理科学的人力资源政策、建设并确立公司上下认同的企业文化、确定清晰的公司发展战略，来指导内部控制的有效运行和规范经营。公司在各业务流程中均建立了合理的内部控制及必要的监督机制，为公司经营管理的合法合规、资产安全、财务报告及相关信息的真实完整、提高经营效率提供了合理保障。

（1）独立经营情况

公司严格按照《公司法》《证券法》等有关法律、法规和《公司章程》的规定规范运作，在资产、人员、财务、机构、业务方面均独立于公司控股股东及其控制的其他企业，具有完整的业务体系和面向市场独立经营的能力。

①资产完整性

公司是由有限责任公司整体变更设立而来，原有限责任公司的资产由公司依法承继。公司拥有开展证券业务所必备的独立完整的业务体系和相关资产，包括房产、交易席位、经营许可证和域名等。公司对所有资产拥有控制权和支配权，不存在公司主要股东违规占用公司资金、资产及其他资源的情况。

②人员独立性

公司总裁、副总裁、合规总监、首席风险官、财务负责

人、董事会秘书和首席信息官等高级管理人员均在公司工作并领取报酬，未在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业中担任除董事、监事以外的其他职务，未在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业领薪；公司的财务人员未在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业中兼职。

③财务独立性

公司设有独立的财务部门，配备专职财务人员，建立了独立的财务会计核算体系，能够独立作出财务决策，具有规范的财务会计制度和对分公司、子公司的财务管理制度。公司有独立的银行账户，不存在与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业共用银行账户的情形。公司作为独立的纳税人，单独办理税务登记，依法独立纳税，不存在与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业混合纳税的现象。

④机构独立性

公司严格按照《公司法》《证券法》《公司章程》等规定，完善了以股东大会、董事会和监事会为基础的公司治理结构，聘任了总裁、副总裁、合规总监、首席风险官、财务负责人、董事会秘书和首席信息官等高级管理人员。公司已建立适应自身发展需要和市场规范要求的职能机构，各职能机构在人员、办公场所和管理制度等方面均完全独立，不存在与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业机构混同、合署办公的情况。

⑤业务独立性

公司独立自主地开展证券经营业务，各项业务具有完整的业务流程和独立的经营场所。公司的业务独立于控股股东、实际控制人及其控制的其他企业，与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业间无显失公平的关联交易。

(2) 内部控制制度建设情况

公司已根据《公司法》《证券法》《证券公司治理准则》和其他有关法律法规的规定，遵循《企业内部控制基本规范》《证券公司内部控制指引》等规范指引的要求，建立了恰当的内部控制目标与原则，并从内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督五方面不断健全公司内部控制体系。结合自身具体情况，公司已建立起一套较为完善的内部控制制度，主要涵盖公司治理、业务管理、合规和风险管理、综合管理等四类基本制度。

治理类的制度包括《公司章程》《股东大会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》《独立董事工作制度》《董事会风险控制委员会工作制度》《董事会审计委员会工作制度》《董事会薪酬与提名委员会工作制度》《董事会战略发展委员会工作制度》《关联交易管理办法》等。

业务管理类制度主要涵盖各业务部门，涉及证券经纪业务、证券自营业务、投资银行类业务、信用业务、私募股权投资基金、期货经纪、另类投资、资产管理等一系列业务管

理制度。

风险管理及合规管理类制度包括《渤海证券全面风险管理规定》《渤海证券流动性风险管理办法》《渤海证券合规管理办法》《渤海证券重大合规风险事项报告制度》《渤海证券压力测试工作管理办法》《渤海证券风险控制指标管理办法》等公司制度。

综合类制度包括财务、人力、后勤等，主要包括《会计基础工作规范》《发票收据管理办法》《自有资金管理办法》《银行结算账户管理规范》《财务检查制度》《绩效考核管理办法》《总监绩效考核管理办法》《公司总部电子耗材采购管理办法》《信息技术类采购供应商管理办法》等。

公司各类制度能够保证内部控制活动基本涵盖公司所有营运环节，包括但不限于内部经营管理、投资决策、关联交易、资金管理、合规管理等方面，具有较强的可操作性，以确保有关内部控制制度能有效执行。

（3）董事会

董事会是公司的决策机构，向股东大会负责并报告工作。负责执行股东大会的决议、决定公司的经营计划和投资方案、制订公司的年度财务预算方案及决算方案、决定公司内部管理机构的设置、制定公司的基本管理制度、决定公司聘请会计师事务所事项、承担全面风险管理的最终责任等。

截至目前，公司董事会由 13 名董事组成，其中包括 5 名

独立董事。董事会设董事长1名，董事长由董事会以全体董事的过半数选举产生。公司制定了《董事会议事规则》，对董事会会议的召集和主持、召开、记录以及决议的执行作出了明确规定。

自设立以来，公司董事会一直严格按照有关法律、法规和规范性文件、《公司章程》及《董事会议事规则》的规定规范运作。公司历次董事会的召集、召开和表决程序等均符合《公司法》《公司章程》及《董事会议事规则》的规定，所作决议合法、合规、真实、有效。

8、公司董事、监事及高级管理人员情况

(1) 董事

截至目前，公司共有13名董事，其中独立董事5名。公司董事由股东大会选举或更换，每届任期为三年，任期届满可连选连任，独立董事连任不得超过6年。

公司现任董事会成员列表如下：

姓名	职务	本届任职期限
安志勇	董事长	2020年12月29日至2023年12月28日
崔雪松	董事	2020年12月29日至2023年12月28日
孟哲	董事	2020年12月29日至2023年12月28日
李志勇	董事	2020年12月29日至2023年12月28日
宋家俊	董事	2022年12月27日至2023年12月28日
焦勇	董事	2020年12月29日至2023年12月28日
董光沛	董事	2020年12月29日至2023年12月28日
陈坚	董事	2020年12月29日至2023年12月28日

李聪聆	独立董事	2020年12月29日至2023年12月28日
卢静	独立董事	2020年12月29日至2023年12月28日
刘志猛	独立董事	2020年12月29日至2023年12月28日
张圣平	独立董事	2020年12月29日至2023年12月28日
杨莹	独立董事	2022年12月27日至2023年12月28日

(2) 监事

截至目前，公司监事会由5名监事组成，其中股东代表监事3名，职工代表监事2名。监事会设监事会主席1名。股东代表监事由股东大会选举产生，职工代表监事由职工代表大会、职工大会或者其他形式民主选举产生。监事任期为3年，任期届满可连选连任。

公司现任监事会成员列表如下：

姓名	职务	任期
孙勇	监事会主席、 职工代表监事	2020年12月29日至2023年12月28日
王维	监事	2020年12月29日至2023年12月28日
蒋建明	监事	2020年12月29日至2023年12月28日
欧国伟	监事	2020年12月29日至2023年12月28日
朱雨良	职工代表监事	2020年12月29日至2023年12月28日

(3) 高级管理人员

公司现任高级管理人员如下：

姓名	职务
徐克非	总裁
余红	总会计师、财务负责人

李辉	副总裁
陶林	副总裁
杨亮	副总裁
李江	首席信息官
徐海军	董事会秘书兼合规总监
李颖	首席风险官
齐朝晖	信用业务总监
景鸿	法律事务总监
马彦平	行政总监
孙军	首席战略官

9、重大诉讼和仲裁事项

截至本发行安排说明签署日,不存在对公司的生产经营、偿债能力或投资者权益可能产生重大影响的未决诉讼或仲裁事项。

二、评级信息

我公司信用评级机构为中诚信国际信用评级有限责任公司。根据中诚信国际 2022 年 5 月 25 日为我公司出具的《2022 年度渤海证券股份有限公司信用评级报告》(信评委函字[2022]1410M 号),我公司主体信用等级为 AAA,评级展望为稳定,该等级有效期一年。

三、发行安排

1、发行方式

本年度短期融资券发行通过全国银行间同业拆借中心（以下简称“交易中心”）发行系统报价发行及招标发行模块进行。各投资者在发行系统规定的各自用户终端投标或认购。

2、登记托管机构

本年度短期融资券在银行间市场清算所股份有限公司（以下简称“上海清算所”）登记托管。交易中心将缴款结果传输至上海清算所进行登记和托管。

四、发行公告

本年度短期融资券的发行公告由交易中心发行系统自动生成。发行人将该信息在中国货币网进行披露，并由交易中心传输至上海清算所进行披露。披露内容包括每只短期融资券的发行要素和发行约束条件。

五、应急措施

如在发行过程中，发生由于技术性或其他不可抗力产生的发行系统故障，发行人、投资者可向交易中心申请进行录入/修改、投标或申购等应急服务。相关应急表单可从中国货币网下载，填写完成加盖公章（或预留印鉴）后，传真至交易中心。

六、缴款信息

投资者应根据本发行人在发行系统发出的缴款通知书载明的金额与日期将款项支付至以下账户：

收款账户名称：渤海证券股份有限公司

收款人账号：12001615300052505720

汇入行名称：中国建设银行股份有限公司天津和平支行

支付系统清算行行号：105110035019

本发行人确保向发行系统提交的资金账户信息与上述披露信息一致，若不一致的，投资者可向任一账户中的任何一个付款，本发行人均予以确认。

七、信息披露

本年度短期融资券的发行安排说明及各只短期融资券的发行公告、发行情况公告、定期报告等信息通过中国货币网 (<http://www.chinamoney.com.cn/>) 进行披露。本机构承诺遵循诚实信用原则向投资者披露信息，保证所披露的信息真实、准确、完整、及时，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏情形。短期融资券存续期内，如本机构公司治理、注册资本、股权结构、业务经营、财务状况、诉讼和仲裁、重要岗位、审计机构及其他可能影响债务偿还能力和投资者权益的事项发生重大变化的，将及时向投资者披露。

八、发行规则

本年度短期融资券发行遵照交易中心发布的《银行间市场证券公司短期融资券发行交易规程》(中汇交发〔2021〕294号) 执行。

九、发行承诺

本机构短期融资券发行严格遵循《证券公司短期融资券管理办法》(中国人民银行公告〔2021〕第10号)、《银行间

市场证券公司短期融资券发行交易规程》(中汇交发〔2021〕294 号)等相关要求,本机构确保短期融资券发行额度任何时点均符合短期融资券余额上限等要求,同时确保短期融资券与其他短期工具待偿还余额之和不超过净资本的 60%。

十、发行联系人

姓名:胡晨甦、赵璐、王莉

电话:022-28451695 022-28453216 022-23839099

邮箱:hucs@bhzq.com、zhaolu@bhzq.com、

wangli3464@bhzq.com

(以下无正文)

（此页无正文，为《渤海证券股份有限公司 2023 年度
证券公司短期融资券发行安排说明》之盖章页。）

渤海证券股份有限公司

2022 年 12 月 30 日

