



目录 Contents

6
0
1
6
8
8
·
6
8
8
6
·
H
T
S
C
·
A
M
K

H
U
A
T
A
I
S
E
C
U
R
I
T
I
E
S

6
0
1
6
8
8
·
6
8
8
6
·
H
T
S
C
·
A
M
K

H
U
A
T
A
I
S
E
C
U
R
I
T
I
E
S

6
0
1
6
8
8
·
6
8
8
6
·
H
T
S
C
·
A
M
K

1 关于我们

- 004 | 重要提示
- 005 | 释义
- 006 | 公司简介
- 010 | 业绩概览
- 014 | 公司大事记

2 经营分析与战略

- 020 | 公司业务概要
- 030 | 经营层讨论与分析

3 公司治理

- 064 | 公司治理
- 072 | 环境与社会责任
- 074 | 重要事项
- 088 | 股份变动及股东情况
- 094 | 债券相关情况

4 财务报告及备查文件

- 108 | 半年度财务报告
- 254 | 补充资料
- 255 | 备查文件目录
- 255 | 证券公司信息披露
- 256 | 附录

1

关于我们
ABOUT US



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、未出席董事情况

未出席董事职务	未出席董事姓名	未出席董事的原因说明	被委托人姓名
董事	胡晓	公务原因	张伟
独立董事	彭冰	公务原因	王建文

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人张伟、主管会计工作负责人焦晓宁及会计机构负责人（会计主管人员）费雷声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案。

公司董事会在审议半年度报告时，未拟定利润分配预案、资本公积金转增股本预案。

六、前瞻性陈述的风险声明

本半年度报告涉及的未来计划、发展战略等前瞻性陈述不构成公司对投资者的实质承诺，请投资者注意投资风险。

七、本公司不存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况。

八、本公司不存在违反规定决策程序对外提供担保的情况。

九、本公司不存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告的真实性和完整性。

十、重大风险提示

国内外宏观经济及货币政策、金融及证券行业的法律法规、商业及金融行业的变化趋势等因素，均可能会对公司的业务产生影响。另一方面，与证券行业其他公司一样，市场波动、交易量等证券市场固有风险因素也可能会对公司的业务产生影响。

公司经营中面临的风险主要包括：因国家宏观调控措施，与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等变动，从而对证券公司经营产生不利影响的政策性风险；因公司或工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规或准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的合规风险；公司因未能遵循法律法规规定及要求，致使公司面临诉讼纠纷、赔偿、罚款，导致公司受损失的法律风险；由于市场价格（利率、汇率、股票价格和商品价格等）的波动而引起的公司资产发生损失的市场风险；因融资方、发行人或交易对手等违约导致公司损失的信用风险；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流动性风险；公司信息系统因内、外部原因发生技术故障或数据泄露，导致系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据安全等方面不能持续保障交易与业务管理稳定、高效、安全运行，从而造成损失的信息技术风险；由于不完善或有问题的内部程序、人员、系统或外部事件所造成公司损失的操作风险；由于公司行为或外部事件、及其工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害其品牌价值，不利其正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的声誉风险；公司的产品或服务被不法分子利用从事洗钱活动，进而对公司在法律、声誉、合规、经营等方面造成不利影响的洗钱风险；公司员工利用职权谋取私利给公司带来危害性或负面影响可能性的廉洁风险；此外，随着公司国际化战略的推进，公司业务进入到美国、英国、香港等其他国家和地区，公司面临的市场环境和监管要求更加复杂。

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

中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
江苏证监局	指	中国证券监督管理委员会江苏监管局
香港证监会	指	香港证券及期货事务监察委员会
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
香港交易所	指	香港交易及结算所有限公司
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
伦交所	指	伦敦证券交易所
江苏省国资委	指	江苏省政府国有资产监督管理委员会
国信集团	指	江苏省国信集团有限公司
交通控股	指	江苏交通控股有限公司
江苏高投	指	江苏高科技投资集团有限公司
华泰证券、本公司、公司、母公司	指	华泰证券股份有限公司
本集团	指	本公司及下属控股公司
华泰资管公司	指	华泰证券全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司
华泰国际	指	华泰证券全资子公司华泰国际金融控股有限公司
华泰紫金投资	指	华泰证券全资子公司华泰紫金投资有限责任公司
华泰创新投资	指	华泰证券全资子公司华泰创新投资有限公司
华泰期货	指	华泰证券全资子公司华泰期货有限公司
华泰联合证券	指	华泰证券控股子公司华泰联合证券有限责任公司
江苏股权交易中心	指	华泰证券控股子公司江苏股权交易中心有限责任公司
南方基金	指	南方基金管理股份有限公司
华泰柏瑞	指	华泰柏瑞基金管理有限公司
江苏银行	指	江苏银行股份有限公司
华泰金控（香港）	指	华泰国际全资子公司华泰金融控股（香港）有限公司
AssetMark	指	华泰国际全资子公司 AssetMark Financial Holdings, Inc.
华泰证券（美国）	指	华泰国际全资子公司华泰证券（美国）有限公司（Huatai Securities(USA),Inc.）
新加坡子公司	指	华泰国际全资子公司 Huatai Securities (Singapore) Pte. Limited
《上市规则》《香港上市规则》	指	《香港联合交易所有限公司证券上市规则》
《标准守则》	指	《香港上市规则》附录十《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》
CAGR	指	复合年增长率
VAR	指	风险价值
IPO	指	首次公开发售
OTC	指	柜台交易
A 股	指	公司每股面值人民币 1.00 元的内资股，于上交所上市并以人民币买卖
H 股	指	公司每股面值人民币 1.00 元的外资股，于香港联交所上市并以港元买卖
GDR	指	全球存托凭证（Global Depository Receipts）
TAMP	指	Turn-key Asset Management Platform，统包资产管理平台，提供投资产品及策略、资产组合管理、客户关系管理、资产托管、企业运营等服务的技术平台
AoP	指	Assets on Platform，平台资产规模
APP	指	Application，应用程序
月活数	指	月度活跃用户数
中国	指	中华人民共和国
香港	指	中国香港特别行政区
报告期	指	2023 年 1—6 月

2023 半年度报告中，部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异，这些差异是由于四舍五入造成的；同一科目变动比例在尾数上可能略有差异，这些差异是由于科目金额单位不同造成的。

公司简介

COMPANY PROFILE

一、公司信息

公司的中文名称
华泰证券股份有限公司

公司的中文简称
华泰证券

公司的外文名称
HUATAI SECURITIES CO., LTD.

公司的外文名称缩写
HTSC

公司的法定代表人
张伟

公司首席执行官、执行委员会主任
周易

公司的授权代表
周易、张辉

注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	9,075,589,027.00	9,075,589,027.00
净资产	93,158,894,331.82	92,975,958,998.68

公司的各单项业务资格情况

报告期内，根据公司收到的《关于华泰证券股份有限公司自营参与碳排放权交易的无异议函》，中国证监会对公司在境内合法交易场所自营参与碳排放权交易无异议。

根据江苏省市场监督管理局核发的营业执照，公司经营范围包括：许可项目：证券业务；证券投资咨询；公募证券投资基金销售；证券投资基金托管（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，具体经营项目以审批结果为准）一般项目：证券公司为期货公司提供中间介绍业务（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）

二、联系人和联系方式

董事会秘书	
姓名	张辉
联系地址	中国江苏省南京市江东中路 228 号 1 号楼 11 楼
电话	025-83387272、83387780、83389157
传真	025-83387784
电子信箱	zhanghui@htsc.com

联席公司秘书	联席公司秘书	
姓名	张辉	邱燕萍
联系地址	中国江苏省南京市江东中路 228 号 1 号楼 11 楼	中国香港湾仔皇后大道东 248 号大新金融中心 40 楼

三、基本情况变更简介

公司注册地址	中国江苏省南京市江东中路 228 号
公司注册地址的历史变更情况	2015 年 7 月，本公司办理了工商登记变更手续，注册地址由“中国江苏省南京市中山东路 90 号”变更为“中国江苏省南京市江东中路 228 号”
公司办公地址	中国江苏省南京市江东中路 228 号
公司办公地址的邮政编码	210019
香港主要营业地址	中国香港皇后大道中 99 号中环中心 62 楼
公司网址	http://www.htsc.com.cn
电子信箱	boardoffice@htsc.com
公司总机	025-83389999
客服热线	95597 或 4008895597
公司传真	025-83387784
营业执照统一社会信用代码	91320000704041011J
报告期内变更情况查询索引	报告期内无变更

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
登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.sse.com.cn
登载半年度报告的香港联交所指定网站的网址	http://www.hkexnews.hk
登载半年度报告的伦交所指定网站的网址	https://www.londonstockexchange.com
公司半年度报告备置地点(A股)	中国江苏省南京市江东中路228号
公司半年度报告备置地点(H股)	中国江苏省南京市江东中路228号；中国香港皇后大道中99号中环中心62楼
报告期内变更情况查询索引	报告期内无变更

五、公司股票 / 存托凭证简况

股票 / 存托凭证种类	上市交易所	证券简称	证券代码
A股	上交所	华泰证券	601688
H股	香港联交所	HTSC	6886
GDR	伦交所	Huatai Securities Co., Ltd.	HTSC

本公司未变更证券简称。

六、其他相关资料

(一) 会计师事务所

公司聘请的会计师事务所 (境内)	名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
	办公地址	中国上海市黄浦区延安东路222号30楼
公司聘请的会计师事务所 (香港)	名称	德勤·关黄陈方会计师行
	办公地址	中国香港金钟道88号太古广场一期35楼
公司聘请的会计师事务所 (英国)	名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
	办公地址	中国上海市黄浦区延安东路222号30楼

（二）法律顾问

公司聘请的法律顾问 (境内)	名称	北京市金杜律师事务所
	办公地址	中国北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心办公室东楼18层
公司聘请的法律顾问 (境外)	名称	高伟绅律师行
	办公地址	中国香港中环康乐广场1号怡和大厦27楼

（三）股份登记处

A股股份登记处	名称	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
	办公地址	中国上海市浦东新区杨高南路188号
H股股份登记处	名称	香港中央证券登记有限公司
	办公地址	中国香港湾仔皇后大道东183号合和中心17楼1712-1716号铺

业绩概览

SUMMARY OF THE RESULTS

一、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 (%)
		调整后	调整前	
营业收入	18,369,294,321.77	16,166,099,092.18	16,166,099,092.18	13.63
归属于母公司股东的净利润	6,555,640,254.37	5,375,963,043.99	5,375,208,155.54	21.94
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	7,016,616,781.88	5,307,510,769.45	5,306,755,881.00	32.20
经营活动产生的现金流量净额	-5,246,867,219.25	30,222,986,463.07	30,222,986,463.07	不适用
其他综合收益的税后净额	733,051,342.04	515,613,886.13	515,613,886.13	42.17

	本报告期末	上年度末		本报告期末比 上年度末增 减 (%)
		调整后	调整前	
资产总额	887,070,258,102.31	846,570,989,585.00	846,567,015,810.33	4.78
负债总额	716,556,907,935.83	678,714,379,592.03	678,718,306,851.82	5.58
归属于上市公司股东的净资产	167,504,156,660.42	165,095,101,823.43	165,087,200,788.97	1.46
股东权益总额	170,513,350,166.48	167,856,609,992.97	167,848,708,958.51	1.58

(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 (%)
		调整后	调整前	
基本每股收益 (元/股)	0.70	0.58	0.58	20.69
稀释每股收益 (元/股)	0.68	0.56	0.56	21.43

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 (%)
		调整后	调整前	
扣除非经常性损益后的基本每股收益 (元/股)	0.75	0.57	0.57	31.58
加权平均净资产收益率 (%)	4.23	3.69	3.69	增加 0.54 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率 (%)	4.54	3.64	3.64	增加 0.90 个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明：

根据财政部在 2022 年 11 月 30 日发布的《关于印发〈企业会计准则解释第 16 号〉的通知》(财会〔2022〕31 号)第一款的规定，公司自 2023 年 1 月 1 日起变更会计政策，并追溯调整以前年度会计报表，详情请参阅 2023 年 4 月 29 日披露的《华泰证券股份有限公司关于会计政策变更的公告》。

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

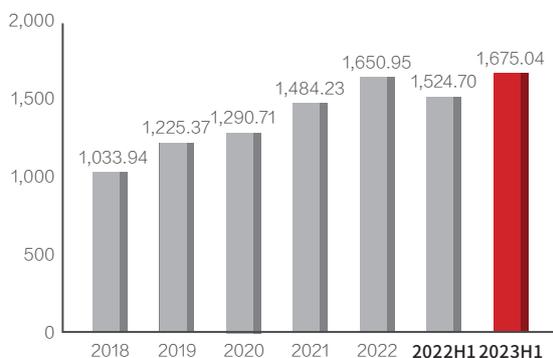
单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	93,158,894,331.82	92,975,958,998.68
净资产	145,041,485,952.12	143,638,401,461.64
风险覆盖率 (%)	246.50	240.14
净资本 / 净资产 (%)	64.23	64.73
净资本 / 负债 (%)	22.80	23.14
净资产 / 负债 (%)	35.49	35.76
自营权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	31.92	45.73
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	357.77	316.80
核心净资本	64,158,894,331.82	61,983,972,665.79
附属净资本	29,000,000,000.00	30,991,986,332.89
各项风险资本准备之和	37,793,273,517.11	38,717,728,473.17
表内外资产总额	490,513,862,767.84	483,308,624,857.94
资本杠杆率 (%)	14.24	14.10
流动性覆盖率 (%)	196.93	166.57
净稳定资金率 (%)	131.64	129.33

(四) 主要业绩指标

归属于母公司股东的权益

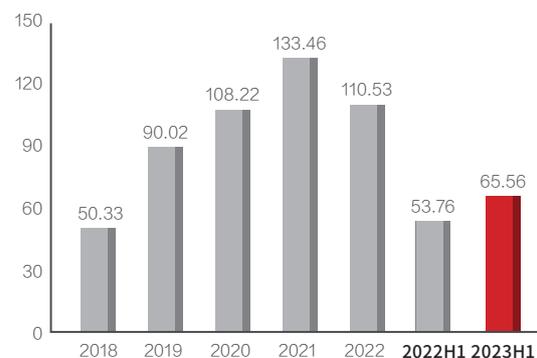
单位：亿元 币种：人民币



来源：公司定期报告

归属于母公司股东的净利润

单位：亿元 币种：人民币



来源：公司定期报告

财富管理业务	机构服务业务	投资管理业务	国际业务
股票基金交易量 人民币 19.59 万亿元  市场排名	股权承销金额 人民币 724.28 亿元  市场排名	资产管理总规模 人民币 4,570.01 亿元  市场排名	港股 IPO 保荐项目数量 2 单  市场排名
涨乐财富通月活数 890.64 万  市场排名	债券承销金额 人民币 5,649.02 亿元  市场排名	私募子公司私募基金月均规模 人民币 458.76 亿元  市场排名	GDR 发行项目数量 4 单  市场排名
融资融券业务余额 人民币 1,155.61 亿元  市场排名	并购重组家数 (经监管审核通过) 2 单  市场排名	企业资产证券化发行数量 58 单  市场排名	AssetMark AoP 1,007.62 亿美元  市场排名
非货币市场公募基金保有规模 人民币 1,517 亿元  市场排名	并购重组金额 (经监管审核通过) 人民币 103.20 亿元  市场排名	企业资产证券化发行规模 人民币 530.75 亿元  市场排名	AssetMark 市场占有率 11.9%  市场排名

说明：股票基金交易量引自沪深交易所会员统计数据、业务排名引自公司内部统计，涨乐财富通月活数与排名引自易观智库在 2023 年 6 月的统计数据，融资融券业务余额引自公司监管报表、业务排名引自公司内部统计，非货币市场公募基金保有规模与排名引自中国证券投资基金业协会截至 2023 年第二季度的统计；股权承销金额与排名、债券承销金额与排名引自 Wind 资讯，并购重组家数及金额与排名引自根据公开资料整理的经监管审核通过的并购重组交易数据；资产管理总规模引自华泰资管公司监管报表，私募子公司私募基金月均规模与排名引自中国证券投资基金业协会截至 2023 年第二季度的统计，企业资产证券化发行数量及规模与排名引自 Wind 资讯；港股 IPO 保荐项目数量与排名引自 Dealogic 截至 2023 年第二季度末以定价日为口径的情况统计，GDR 发行项目数量与排名引自公司内部截至 2023 年第二季度末根据相关上市公司公告信息的情况统计，AssetMark AoP 引自公司内部截至 2023 年第二季度末的统计，AssetMark 市场占有率与排名引自 Cerulli Associates 与相关公开信息截至 2023 年第一季度末的 TAMP 行业分析；无特殊说明的则为截至报告期末数据和报告期内数据。

二、境内外会计准则下会计数据差异

本集团按照中国企业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 2023 年 1—6 月及 2022 年 1—6 月的归属于上市公司股东的净利润、2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日的归属于上市公司股东的净资产无差异。

三、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额
非流动资产处置损益	-423,999.10
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	90,570,624.28
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-689,119,515.24
所得税影响额	137,695,917.52
少数股东权益影响额（税后）	300,445.03
合计	-460,976,527.51

四、其他

按《证券公司年度报告内容与格式准则（2013 年修订）》要求计算的主要财务数据与财务指标请参阅本报告“经营层讨论与分析”。

1991



华泰证券（时名江苏省证券公司）成立

2006



控股联合证券



成立华泰金融控股（香港）有限公司

2010



公司 A 股在上海证券交易所挂牌上市

2016



公司收购美国 ASSETMARK

1993



公开发行业江苏省第一支股票“太极实业”

2008



上线运营 CRM（客户关系管理）系统

2015



公司H股在香港联合交易所有限公司挂牌上市

2018

国企改革

国企改革三年行动方案

公司深化混合所有制改革试点总体方案获批



公司顺利完成A股定增



标准普尔和穆迪分别授予公司 BBB 和 Baa2 的长期发行人评级，评级展望稳定

2020



公司发布全市场首个开放式线上证券借贷交易平台“融券通”



公司基金投资顾问服务正式上线



公司获批正式实施并表监管试点

2022



“涨乐财富通”升级 8.0 新版本



“涨乐全球通”升级 4.0 新版本



“融券通 4.0”平台全新发布



机构客户服务平台“行知 3.0”正式发布



江苏省华泰公益基金会正式成立

2017



专业投资者综合金融服务平台 MATIC 上线



华泰资管公司首只公募基金亮相

2019



公司 GDR 在伦交所主板市场上市交易



AssetMark 在美国纽约证券交易所上市交易



华泰证券(美国)获得在美国开展经纪交易商业业务的资格



公司机构客户服务平台“行知”APP 上线

2021



公司基金投顾业务品牌“涨乐省心投”全新升级



公司完成 A 股限制性股票授予登记工作

2023



“涨乐财富通”注册下载量逾 7,200 万



公司首次参与国内碳排放权交易

A 601688.SH



H 6886.HK



G HTSC.LI



N AMK



2

经营分析与战略

OPERATING ANALYSIS AND STRATEGIES



公司业务概要

SUMMARY OF THE COMPANY'S BUSINESS

战略愿景 | 致力于成为兼具本土优势和全球影响力的一流投资银行

一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

本集团所属行业是证券行业。证券行业的营业收入和利润水平对证券市场变化趋势的依赖程度较高，具有较强的周期性与波动性特点。本集团的证券业务也依赖并受益于我国的经济增长及我国资本市场的发展及表现，受经济环境、监管环境、投资者情绪以及国际市场等多方面因素影响。

本集团是一家行业领先的科技驱动型证券集团，拥有高度协同的业务模式、先进的数字化平台以及广泛且紧密的客户资源。本集团从事的主要业务包括财富管理业务、机构服务业务、投资管理业务和国际业务。本集团搭建了客户导向的组织架构及机制，通过线上线下相结合的方式，为个人和机构客户提供全方位的证券及金融服务，并致力于成为兼具本土优势和全球影响力的一流投资银行。



财富管理业务

依托移动 APP 与 PC 端专业平台、分公司与证券期货营业部、华泰国际及其下属境外子公司，以线上线下和境内境外联动模式，向各类客户提供多元化财富管理业务，包括证券期货期权经纪、金融产品销售、基金投资顾问、资本中介等业务。证券期货期权经纪业务方面，主要代理客户买卖股票、基金、债券、期货及期权等，提供交易服务。金融产品销售业务方面，主要向客户提供各种金融产品销售服务和资产配置服务，相关金融产品由本集团及其他金融机构管理。基金投资顾问业务方面，主要是接受客户委托，在客户授权的范围内，按照协议约定为客户做出投资基金的具体品种、数量和买卖时机的选择，并代替客户进行基金产品申购、赎回、转换等交易申请。资本中介业务方面，向客户提供融资融券、股票质押式回购等多样化融资服务。财富管理业务主要业绩驱动因素包括手续费及佣金收入、利息收入等。

以机构销售为纽带，整合投资银行、机构投资者服务和投资交易业务资源，为各类企业及金融机构客户提供全方位的综合金融服务，主要包括投资银行业务、主经纪商业、研究与机构销售业务和投资交易业务。

(1) 投资银行业务主要包括境内外股权融资业务、债券融资业务、财务顾问业务、场外业务等。股权融资业务方面，为客户提供境内外首次公开发行股票、股权再融资、存托凭证等发行承销服务。债券融资业务方面，为客户提供境内外各类债券融资、资产证券化等服务。财务顾问业务方面，为客户提供包括国企改革、产业并购、股份收购、融资顾问、企业重整以及公募 REITs 财务顾问等服务。场外业务方面，为客户提供新三板挂牌及后续融资服务，以及江苏股权交易中心从事的相关场外业务。投资银行业务主要业绩驱动因素包括承销及保荐费、财务顾问费等。

机构服务业务

(2) 主经纪商业业务主要包括为私募基金、公募基金等各类资管机构提供资产托管和基金服务，包括结算、清算、报告和估值等。此外，亦向主经纪商客户提供融资融券、金融产品销售和其他增值服务。主经纪商业业务主要业绩驱动因素包括基金托管费及服务业务费等。

(3) 研究与机构销售业务主要包括研究业务和机构销售业务。研究业务方面，为客户提供各种专业化研究咨询服务。机构销售业务方面，向客户推广和销售证券产品及服务。研究与机构销售业务主要业绩驱动因素包括各类研究和金融产品的服务收入等。

(4) 投资交易业务主要包括权益交易、FICC 交易及场外衍生品交易。本集团以自有资金开展权益类、FICC 类及其他金融工具交易，通过各类交易策略和交易技术降低投资风险并提高回报。同时，为满足客户投融资与风险管理需求，亦从事做市业务和场外衍生品业务。权益交易方面，开展股票、ETF 和衍生工具的投资与交易，并从事科创板股票、金融衍生品及金融产品做市服务等。FICC 交易方面，开展银行间及交易所债券市场各类 FICC 和衍生工具的投资与交易，并从事银行间市场、交易所市场做市服务，以及碳排放权交易等。场外衍生品交易方面，为客户创设及交易 OTC 金融产品，主要包括权益类收益互换、场外期权和收益凭证等。投资交易业务主要业绩驱动因素包括权益、FICC 产品和衍生产品等各类投资收益、业务收入等。

投资管理业务

接受客户资金委托，依托专业化的投资研究平台和庞大的客户基础，创设和提供各类金融产品并管理客户资产，有效满足客户投融资需求，主要包括：证券公司资产管理、私募股权基金管理及基金公司资产管理业务等。证券公司资产管理业务方面，通过全资子公司华泰资管公司参与经营证券公司资产管理业务，包括集合资产管理业务、单一资产管理业务、专项资产管理业务和公募基金管理业务（与本集团旗下基金公司公募基金管理业务差异化经营）。私募股权基金管理业务方面，通过全资子公司华泰紫金投资开展私募股权基金业务，包括私募股权基金的投资与管理。基金公司资产管理业务方面，本集团持有两家公募基金管理公司（南方基金和华泰柏瑞）的非控股权益，通过其参与经营基金公司资产管理业务。资产管理业务主要业绩驱动因素包括管理费、业绩表现费及投资收益等。

国际业务

本集团通过全资子公司华泰国际及其持有的华泰金控（香港）、AssetMark、华泰证券（美国）等经营国际业务，业务范围覆盖香港和美国等国家和地区。此外，华泰国际于2022年9月在新加坡设立全资子公司，报告期内，相关业务牌照申请已获新加坡金融管理局原则性批复。

本集团香港业务主要由华泰国际全资子公司华泰金控（香港）经营，主要包括股权业务平台、固收业务平台、财富管理平台、基金平台和旗舰投行业务。股权业务平台方面，开展跨境股票衍生品交易、设计以及销售业务，为客户提供各类权益类资本中介服务；为全球机构客户提供境内外一体化、覆盖各行业的综合金融服务。固收业务平台方面，开展各类FICC和衍生工具的投资与交易，并为各类机构客户提供销售、交易和做市服务等FICC全产品品类的解决方案。财富管理平台方面，为客户提供涉及全球不同资产类别的客户经纪、孖展和财富管理服务，满足客户多层次全方位理财需求。基金平台方面，所管理的大湾区基金为客户提供杠杆收购、战略并购、上市前融资、业务扩张等定制化解决方案；中概股回归基金关注具有行业成长潜力的中后期投资、跨境并购、分拆和私有化投资机会。旗舰投行业务方面，打造全能跨境投行平台体系，向中国及国际客户提供股权及债券承销保荐服务、财务顾问服务。2019年9月，华泰金控（香港）获得了伦交所会员资格，并完成上交所沪伦通全球存托凭证英国跨境转换机构备案，能够为客户提供GDR发行与交易的全流程服务。2020年12月，华泰金控（香港）成为首家取得伦交所做市商资格的亚洲金融机构。2021年12月，华泰金控（香港）正式成为伦交所集团旗下绿宝石交易平台（Turquoise）会员。2022年，华泰金控（香港）正式取得香港联交所的特殊目的收购公司（SPAC）交易所参与者资格，是首批取得该资质的在港中资券商；获得深交所予以的互联互通全球存托凭证境外跨境转换机构备案，成为2022年沪伦通规则修订并双向拓宽适用范围后，首批获深交所备案开展跨境转换业务的机构。2023年，华泰金控（香港）成为卢森堡证券交易所上市和交易会员，并成为香港交易所认股证“窝轮”发行商。

本集团于2016年完成收购AssetMark。AssetMark是美国领先的统包资产管理平台，作为第三方金融服务机构，为投资顾问提供投资策略及资产组合管理、客户关系管理、资产托管等一系列服务和先进便捷的技术平台。2019年7月，AssetMark在美国纽约证券交易所完成挂牌上市。2021年7月，AssetMark完成对Voyant的收购，进一步优化技术平台及运营环境，保持在统包资产管理平台领域的领先地位。2022年12月，AssetMark完成对Adhesion Wealth的收购，持续打造领先的业务模式和先进的技术平台。

2018年9月，华泰国际于美国特拉华州注册设立了境外全资下属公司华泰证券（美国），推动国际业务发展。2019年6月，华泰证券（美国）经美国金融业监管局核准，获得美国经纪交易商牌照；2020年，获取美国自营交易牌照；2021年，获得在加拿大与机构投资者开展证券交易的业务资格；2022年，获得欧洲主要证券交易所的市场准入。

国际业务主要业绩驱动因素包括经纪佣金、承销保荐费、顾问费、利息收入及资产管理费等。

二、奖项与荣誉

财富管理业务

上海证券交易所：

🏆 公司荣获“2022年度十佳期权经纪商”等奖项

深圳证券交易所：

🏆 公司荣获“2022年度期权优秀经纪商奖”“2022年度期权新品种推广奖”等奖项

香港交易所：

🏆 公司荣获“2022年港股通卓越券商奖”

《中国证券报》举办的“第一届基金投顾金牛奖”评选：

🏆 公司荣获“基金投顾机构金牛奖”

易观智库统计数据：

🏆 “涨乐财富通”2023年上半年末月活数排名第一

《证券时报》举办的“首届中国证券业数字化转型君鼎奖”评选：

🏆 “涨乐财富通”荣获“中国证券业十大品牌APP”“中国证券业投顾服务APP”

《财资》杂志：

🏆 “涨乐全球通”荣获“香港地区最佳手机券商APP”

机构 服务 业务	<p>上海证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰联合证券荣获“2022 年度公司债券优秀承销商”“2022 年度产业债券优秀承销商”“2022 年度服务国家战略优秀承销商” <p>深圳证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰联合证券荣获“2022 年度优秀公司债券承销商”“2022 年度优秀固定收益产品存续期管理机构”等奖项 	<p>《新财富》举办的“第十六届最佳投行”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰联合证券荣获“本土最佳投行”“最佳践行 ESG 投行”“最佳股权承销投行”“最佳债权承销投行”“最佳再融资投行”“最佳 IPO 投行”“最佳并购投行”“海外市场能力最佳投行”等奖项
投资 管理 业务	<p>上海证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 公司荣获“2022 年度优秀科创板股票做市商”等奖项 🏆 华泰资管公司荣获“2022 年度资产证券化业务优秀管理人”“2022 年度优秀基础设施公募 REITs 参与者” 🏆 南方基金荣获“2022 年度优秀债券投资机构（其他资管类）” 🏆 华泰柏瑞荣获“十佳 ETF 管理人” <p>深圳证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰资管公司荣获“2022 年度优秀资产支持专项计划管理人” <p>香港中资基金业协会和彭博举办的“2022 年度离岸中资基金大奖”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰资管公司荣获“年度最佳跨境业务奖”“年度最佳创新产品奖”等奖项 	<p>投资中国举办的“投中 2022 年度榜”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰紫金投资荣获“中国最佳回报私募股权投资机构 TOP10”“中国最佳中资私募股权投资机构 TOP20”“中国最佳私募股权投资机构 TOP30”“中国最佳券商私募基金子公司 TOP5”“中国医疗及健康服务产业最佳医疗器械领域投资机构 TOP20”“中国医疗及健康服务产业最佳医疗服务领域投资机构 TOP10”等奖项 <p>《中国证券报》：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 南方基金荣获“基金投顾顾问服务金牛奖” <p>《证券时报》：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 南方基金荣获“三年被动投资明星基金公司奖” 🏆 华泰柏瑞荣获“十大明星基金公司奖”“三年被动投资明星基金公司奖”
国际 业务	<p>《彭博商业周刊》举办的“金融机构大奖”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰国际荣获“年度科技证券公司卓越大奖”“年度金融衍生产品机构卓越大奖”“优端客户级别产品及服务卓越大奖”“风险管理卓越大奖”“数码创新卓越大奖”“首次公开招股项目卓越大奖”“企业融资卓越大奖（中国大湾区）” <p>国际知名金融杂志《亚洲货币》举办的“2023 奖项榜单”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰国际荣获“香港地区最佳券商”“大湾区最具创新性投资银行” 	<p>国际知名私募债行业杂志《PDI(Private Debt Investor)》举办的“2022 年度奖项”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰国际荣获“最佳私募债投资机构(亚太区)”“最佳地产私募债投资基金经理(亚太区)”“最佳优先级私募债投资机构(亚太区)” <p>《财资》杂志举办的“2022 年度 AAA 国家奖(中国区)”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 华泰国际荣获“最佳本地企业及机构顾问奖(券商类)”“最佳私募债券顾问奖” <p>Cerulli Associates 及其他公开信息：</p> <ul style="list-style-type: none"> 🏆 截至 2023 年第一季度末，AssetMark 在美国 TAMP 行业中的市场占有率为 11.9%，排名第二

三、报告期内核心竞争力分析

科技驱动的中国证券行业转型开拓者

本集团致力将科技打造成为最核心的竞争力之一，围绕“成就客户、创新业务、优化运营、赋能员工”的总体目标，全面推进数字化转型，积极运用数字化思维和手段改造业务与管理模式，着力构建领先的自主掌控的信息技术研发体系，通过全方位科技赋能，实现科技与业务共创，打造数字化牵引下的商业模式创新与平台化支撑下的全业务链优势。在财富管理领域，依托“涨乐财富通 8.0”，通过多元内容的个性化、精细化运营，持续打造千人千面的财富管理平台；在机构服务领域，自主研发的机构客户服务数字化平台“行知 3.0”助力企业和机构投资者有效提升生产力，探索全新开放生态模式。持续赋能一线员工，依托“聊 TA”、青云、投行云等展业工作平台，有效提升员工效能，推动客户规模增长。加速向业务深度平台化目标迈进，持续推进 FICC 大象交易平台、分布式极速交易平台的建设，核心交易平台效能显著提升；依托信用分析管理系统（CAMS 系统）、融券通 4.0 等平台，持续赋能业务模式创新；着力打造、升级数智中台 3.0 以及睿思投研平台，构建集团一体化中台支撑能力。集团通过多年自主研发积累形成的技术底蕴和人才队伍，为本集团打造平台化、体系化的竞争优势奠定了坚实基础。同时，以股权投资为纽带，聚集优秀科技创新公司，加快构建金融科技生态，积极布局大数据、人工智能、区块链、云计算、RPA 安全等前沿领域，构筑面向未来的科技能力储备。

开放的数字化财富管理平台为大规模客户提供高效的专业服务

本集团打造了中国证券行业最具活力的财富管理平台之一，拥有 2,000 多万客户。本集团致力打造“人 + 平台”的一体化运营体系，建立总部驱动、总分联动、一体运营的财富管理运营体系，打造专业化、开放化的平台发展生态，不断汇聚专业的金融服务能力和专业的金融服务资讯，不断做大客户规模、生态伙伴规模，积极扩大品牌影响力。面向客户的移动服务平台“涨乐财富通”与面向投资顾问的工作云平台“聊 TA”在迭代升级中强化功能、深化贯通，高效、精准赋能投资顾问。截至报告期末，“涨乐财富通”累计下载量 7,223.69 万。根据易观智库统计数据，2023 年 6 月底，“涨乐财富通”月活数位居证券公司类 APP 第一名。自 2014 年以来，本集团股票基金交易量一直排名行业第一。深入推进买方投资顾问业务发展，构建覆盖资产、策略、产品的一体化投研模式和数字化平台，以及以客户盈利体验为核心的陪伴服务体系，打造“省心系列”买方投资顾问品牌。报告期内，本集团基金投资顾问业务的资产规模保持行业前列，资产配置、产品研究、策略运营、陪伴服务体系日臻完善。根据中国证券投资基金业协会 2023 年第二季度的统计，本公司股票及混合公募基金保有规模、非货币市场公募基金保有规模均排名证券行业第二。

全链条服务实体经济与客户成长的一流投资银行业务

本集团紧抓全面注册制不断推进落实的重大机遇，秉持“以客户为中心”的经营理念，以行业聚焦、区域布局和客户深耕为方向，加强境内境外、场内场外跨市场协同，全面提升全产品服务能力和综合服务快速响应能力。报告期内，本集团投资银行业务进一步巩固市场头部地位，业务实力进一步提升。本集团境内股权主承销规模、全品种债券主承销规模进一步提升，主承销规模均排名行业第三。本集团并购重组业务重点推进标杆性大型项目、创新项目，并积极拓展客户持续服务，始终处于行业前列，自 2012 年以来许可类并购重组项目累计交易数量位居市场第一。本集团不断加大行业深耕力度，在重点行业领域服务龙头客户，拥有高质量的客户基础，完成多单具有市场影响力的项目。

兼具规模优势与创新优势的综合性资产管理平台

依托集团庞大的客户基础和全业务链资源优势，充分发挥投行资产发现、风险定价与产品设计能力，本集团已建立起业内领先的资产管理平台之一。资产管理业务管理资产总规模位居行业前列，截至报告期末资产管理规模人民币 4,570.01 亿元。聚焦券商特色，以基于券商全业务链的投资资管和投行资管服务为抓手，一站式提供一流的投资产品、资产配置及整体金融服务解决方案，赋能客户的资产管理服务旅程。强化与集团双向驱动，立足投行基因优势，发挥数字化应用能力，不断提升主动管理能力，培育差异化的核心竞争力。同时，通过多资产、多策略定制化服务，为机构客户提供定制化的一揽子综合金融服务，通过固收类优势产品以及 FOF、MOM 等特色产品满足客户对产品形式、流动性以及风险收益的不同需求。本集团是业内 ABS 交易设计领导者，在基础资产、交易结构等层面不断创新，为行业树立了标杆，并在绿色金融等领域发行多单支持实体经济项目，业务规模持续排名行业前列。报告期内，本集团企业 ABS 发行数量与发行规模均排名行业第三。ATOMS 系统释放业务支撑能力，基本形成集团 ABS 分析体系和专业标准，成为国内首个 ABS 产品创设和专业分析及评价平台。

加快全球布局与打造跨境服务生态推动国际化发展迈上新台阶

本集团始终坚持伴随客户国际化发展，不断拓展国际业务布局，通过持续深化跨境一体化联动，优化跨境综合性金融服务平台体系，为集团客户嫁接全球资源，更好服务中国客户的境外拓展和国际投资者的境内投资。报告期内，国际评级机构标准普尔对本公司及子公司华泰国际的长期发行人评级维持“BBB+”，展望稳定，为中资券商最高水平。华泰国际依托集团境内资源，以跨境为抓手，回归券商本源，聚焦发展资本市场中介业务，通过跨境联动、业务协同、强化风控和平台运营，深耕以客户为中心的一体化、平台化跨境服务生态体系。截至报告期末，华泰国际资产规模近两千亿港元，综合实力持续提升，稳居香港中资券商第一梯队前列。报告期内，华泰国际积极拓展熊猫债、自贸债、点心债等人民币债券业务，并参与香港交易所推出的港币-人民币双柜台模式，助力人民币国际化。香港业务由股权业务平台、固收业务平台、财富管理平台、基金平台和旗舰投行业务共同搭建的“4+1”业务平台体系持续深化，通过不断拓展新产品、新市场，持续巩固和提升差异化竞争优势。报告期内，华泰金控（香港）完成2单港股IPO保荐项目，保荐数量位居市场第三，并以全球协调人身份完成4单GDR发行项目，发行数量和发行规模均位居市场第一，保持了在GDR业务方面的龙头优势。华泰金控（香港）成为卢森堡证券交易所上市和交易会员，并成为香港交易所认股证“窝轮”发行商。AssetMark保持运营独立性，通过领先的业务模式和先进的技术平台实现平台资产规模稳步增长，行业领先地位持续稳固，业务收入不断提升。新加坡子公司相关业务牌照申请已获新加坡金融管理局原则性批复。

兼具专业和平台优势的全面风险管理体系

本集团秉承稳健的风险管理文化，以控风险、增质效、促发展为风险管理目标，坚持全员、覆盖、穿透的核心风险管理理念，持续以集团化、专业化、平台化思路提升风险管理核心竞争力。集团建立健全与公司全业务链一体化、国际化发展自适应的全面风险管理体系，不断完善风险治理架构，持续加强风险管理机制和管控措施，大力研发和迭代风险管理工具，高度重视信息科技在风险管理中的应用。报告期内，本集团紧跟市场情况变化，在稳固集团境内外一体化风险管理体系的基础上，持续提升风险预判能力，主动防范重点业务风险和强化高风险领域管控，同时继续深入推进风险管理系统建设，平台化赋能风险管理提质增效，助力本集团专业化、国际化发展的战略进阶。

打造持续赋能一流人才全面成长的发展平台

本集团秉持“开放、包容、创新、奋斗、担当”的文化内涵，持续激发华泰人“向新、向上”的活力和动力，不断升维人才价值，赋能人才成长。报告期内，本集团积极打造基于平台的专业化人才发展模式，推动优秀人才与组织共同成长，将人才优势转换为核心竞争优势。突出聚才集智，把人才工作放在公司改革发展和战略转型大局中同谋划、同推进，做好行业领军型人才、核心业务高端人才及优秀年轻人才的引进工作，不断增强人才厚度。在实战中推进优秀年轻人才培养，打造面向未来的管理后备人才梯队。始终把基层实践作为优秀年轻员工成长成才的主阵地，推进交流、挂职、轮岗等实践锻炼，在实战中培养和选拔，并以综合能力和业绩贡献为基础，拓宽职业发展空间，提升人才队伍创造力。持续完善激励体系，组织开展荣誉表彰，强化榜样力量，激发并凝聚人才奋斗热情。始终专注于打造与平台共进共赢的人才发展新模式，促进公司持续长期稳健发展。

243

家证券营业部

28

家证券分公司

省市及地区

证券营业部数量

江苏省	93
北京市	6
上海市	16
广东省	23
湖北省	29
浙江省	8
辽宁省	7
山东省	7
四川省	7
安徽省	5
黑龙江省	5
福建省	4
天津市	4
河南省	3
湖南省	3
吉林省	3
江西省	3
内蒙古自治区	3
广西壮族自治区	2
海南省	2
陕西省	2
重庆市	1
甘肃省	1
贵州省	1
河北省	1
宁夏回族自治区	1
青海省	1
山西省	1
新疆维吾尔自治区	1

中国香港 Hong Kong China

华泰国际作为公司国际业务控股平台，全方位对接集团全业务链体系，切实推进跨境联动，为境内外客户提供跨境综合金融服务。

新加坡 Singapore

2022年9月，华泰国际在新加坡设立了全资子公司 Huatai Securities (Singapore) Pte. Limited。

注释：本节所用地图和展示仅为公司业务覆盖展示，不代表标准地理地图。



伦敦 London

2019年6月，公司成功发行GDR并在伦交所上市，成为首家按照沪伦通业务规则登陆伦交所的中国公司，募集资金总额达16.92亿美元，创造英国乃至欧洲资本市场的多项融资记录。

ASSETMARK

加利福尼亚州 California

2016年，公司顺利完成AssetMark收购，为财富管理转型对接全球资源提供了强大的平台，国际化发展布局由此迈出关键一步。

2019年7月，AssetMark在美国纽约证券交易所成功上市，公司国际市场影响力进一步提升。

纽约 New York

2018年，华泰国际于美国注册成立了全资下属公司华泰证券（美国），并在纽约市设立办公室。

核心价值观

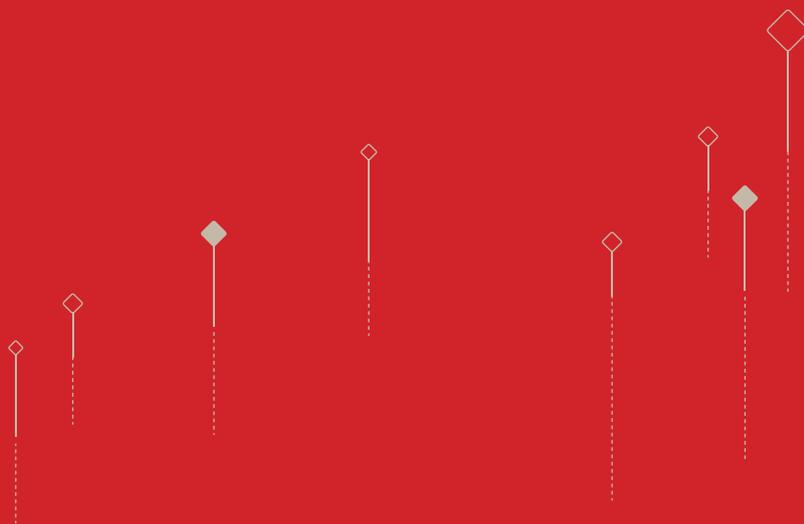
高效 ◆ 诚信 ◆ 稳健 ◆ 创新

文化理念

开放 ◆ 包容 ◆ 创新 ◆ 奋斗 ◆ 担当

战略愿景

致力于成为兼具本土优势和全球影响力的一流投资银行



经营层讨论与分析

MANAGEMENT DISCUSSION AND ANALYSIS

一、经营情况的讨论与分析

（一）财富管理业务

1、财富管理业务市场环境与行业趋势

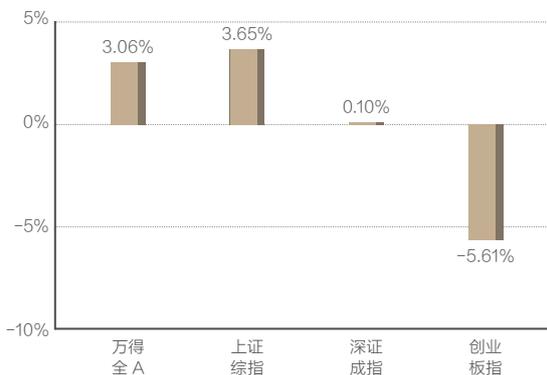
（1）我国财富管理市场纵深发展驱动业务转型升级，财富管理服务能力需要不断增强

随着我国经济社会全面恢复常态化运行、多层次资本市场持续发展完善以及居民财富配置需求不断跃迁升级，我国财富管理市场处于长期变革和快速发展的新阶段，以规范发展、专业化管理和客户体验升级为发展方向，服务于经济高质量发展和共同富裕成为新时代财富管理行业的新使命。深耕财富管理服务的专业性、精准度和智能化，专注洞察和理解客户需求，基于专业化配置理念满足客户多样化资产配置需求，以专业陪伴服务提升客户获得感，将成为证券公司财富管理业务强化核心竞争优势的关键。在双循环新发展格局持续构建、中国特色现代资本市场建设不断推进、财富管理行业渗透率不断提升、专业化业务需求日趋增加等背景下，我国财富管理市场正转向覆盖客户全生命周期的综合金融服务模式，一站式投资顾问服务和陪伴式客户服务体验将成为证券公司财富管理业务的发展趋势。财富管理机构应注重构建创新驱动的财富管理业务生态，加强客户导向的立体式客群经营，强化投资研究能力和财富管理能力建设，着力提供全方位、高质量、多层次的投资理财产品和综合解决方案，积极打造可持续发展的财富管理业务模式。

（2）客户资产配置需求与市场竞争态势的变化持续推动业务发展，财富管理业务进入专业化经营新阶段

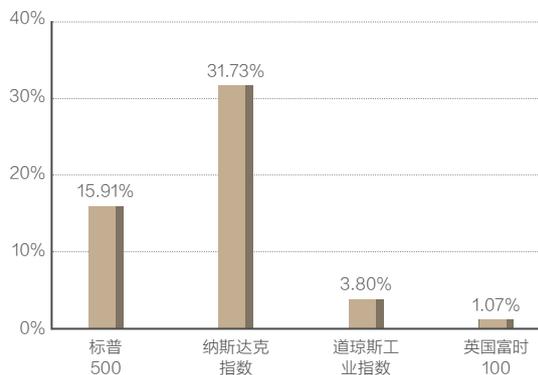
随着资本市场结构性变革深入推进、公募基金费率改革逐步落实、财富管理业务交易品种不断丰富、业务规则日趋复杂、客户财富配置结构更趋多样化，我国财富管理市场呈现普惠化、多元化、个性化、专业化特点，高质量的财富管理服务成为机构的核心竞争力。构建新生态下的财富管理服务模式，持续完善财富管理业务体系，不断提升财富管理业务整体运营管理能力，为客户提供覆盖全生命周期的综合金融服务将成为证券公司战略转型的重要方向。报告期内，国内股票市场结构分化，万得全 A 上涨 3.06%、上证综指上涨 3.65%、创业板指下跌 5.61%；国际主要指数方面，标普 500 上涨 15.91%、纳斯达克指数上涨 31.73%、道琼斯工业指数上涨 3.80%。在内外市场环境日益复杂以及以全面注册制为核心牵引的资本市场改革开放措施持续推进的背景下，财富管理市场深层次的价值挖掘需求不断升级，行业竞争愈发激烈，财富管理机构的 core 专业能力与陪伴客户的价值创造能力面临更大的挑战与更高的要求。构建数字化服务展业、平台式业务支撑、立体化需求洞察的全方位运营体系，充分发挥业务协同优势，实现客户服务全方位覆盖，提供一站式、全资产、全周期服务生态的财富管理机构将获得广泛发展空间。

2023 年上半年国内主要指数走势情况



来源: Wind

2023 年上半年国际主要指数走势情况



来源: Wind

(3) 金融科技赋能重塑运营管理模式，全面推进财富管理行业数字化转型与高质量发展

近年来，证券行业金融科技发展走向深水区，证券业务向数字化、智能化、敏捷化和生态化持续发展，证券行业步入科技赋能业务深层次变革及数字化转型发展全面铺开的新时期，以业务价值提升为导向布局金融科技、推动业务模式和管理模式革新升级，已成为证券行业高质量发展的下一个战略高地。以领先的金融科技提升数字化财富管理服务能力，实现金融科技与业务发展的深度融合共创，构建面向未来的线上化、平台化、智能化金融科技生态圈，为客户提供覆盖全生命周期的多方位、旅程式财富管理服务，将成为证券公司打造综合金融服务优势并形成创新模式增长点的核心驱动力。依托先进的金融科技，加快数字化转型，充分发挥数字化的能力沉淀、客户沉淀、资源整合、业务协同、风险管控和效能提升等方面作用，将对证券公司业务模式和经营效率带来全方位影响。构建共建、共治、共享的数字化财富管理生态，打造融合数字化优势和专业投研能力的、基于生态化和一体化专业服务的财富管理业务体系，全面升级财富管理效能，将成为大型证券公司打造差异化竞争优势和实现商业模式持续创新的必然选择。

2、财富管理业务经营举措及业绩

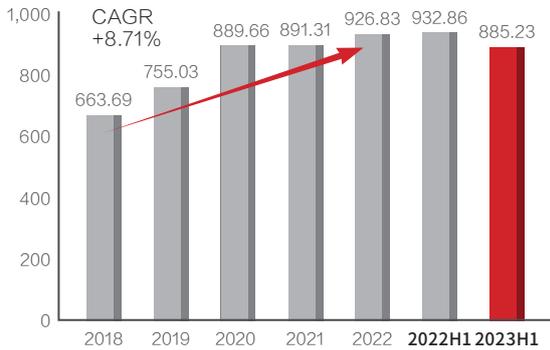
(1) 证券期货期权经纪业务

报告期内，本集团以客户为中心完善一体化经营体系，围绕数字化、平台化、生态化理念，搭建全生命周期财富客户交易体系与成长体系，坚持精细化运营与精准化营销，以优质的平台和服务不断优化用户体验，打造具有差异化竞争优势的财富管理平台，持续提升财富管理服务的覆盖率和满意度。构建完善总部驱动、总分联动、一体运营的财富管理运营体系，打造专业化、开放化的平台发展生态，持续迭代升级“涨乐财富通”平台与“聊 TA”平台功能，不断打磨优化双平台闭环运营模式，切实提升运营效率。积极推动客户服务模式升级和用户运营模式创新，以智能化、平台化方式不断提升服务承载能力、服务效率与服务体验，深度挖掘客户服务场景与业务机会，不断增强客户服务粘性。持续深化财富管理队伍运营的赋能支持，积极打造专业化分工、体系化培育的分层分级财富管理队伍体系，全面提升业务能力与服务效能，满足客户多元化财富管理需求。

本集团持续推进“涨乐财富通”平台产品与服务创新，不断优化内容运营模式，增强特色交易工具和策略服务的运营效能及场景化渗透力，持续升级理财及交易服务体系，有效提升客户粘性。报告期内，“涨乐财富通”下载量 217.68 万，自上线以来累计下载量 7,223.69 万；96.24% 的交易客户通过“涨乐财富通”进行交易。根据易观智库统计数据，报告期内，“涨乐财富通”平均月活数为 885.23 万，截至报告期末月活数为 890.64 万，月活数位居证券公司类 APP 第一名。同时，本集团不断夯实“涨乐全球通”平台基础交易服务能力，以专业的平台服务持续提升用户粘性，致力于为客户提供全球资产一站式投资管理服务，“涨乐全球通”自上线以来累计下载量 205.14 万。

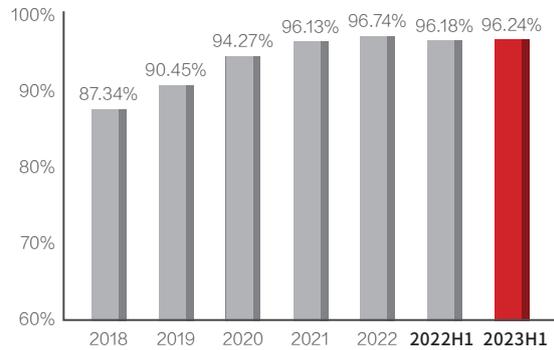
“涨乐财富通”平均月活数情况

单位: 万



来源: 易观智库统计数据

“涨乐财富通”交易客户占比情况



来源: 公司定期报告

本集团进一步强化基于先进平台的交易服务优势。根据沪深交易所会员统计数据, 本集团股票基金交易量合计人民币 19.59 万亿元, 行业排名第一。截至报告期末, 根据内部统计数据, 客户账户总资产规模达人民币 5.19 万亿元。

代理交易金额数据

币种: 人民币

2023 年 1-6 月		2022 年 1-6 月	
证券品种	代理交易金额 (亿元)	证券品种	代理交易金额 (亿元)
股票	160,298.23	股票	166,698.49
基金	35,590.70	基金	30,478.02
债券	245,681.69	债券	204,382.31
合计	441,570.62	合计	401,558.82

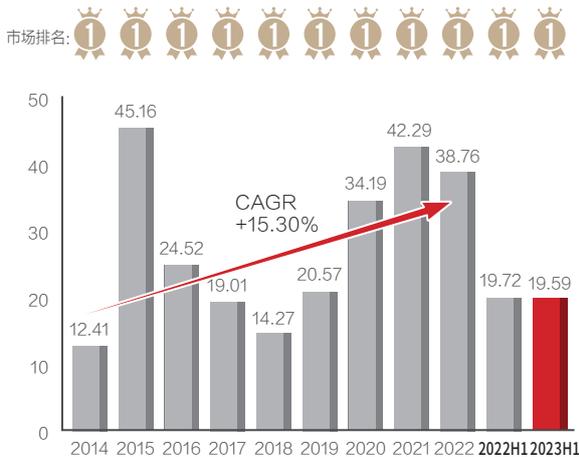
注: 代理交易金额数据引自沪深交易所会员统计数据, 其中, 基金数据包含上交所 ETF、货币 ETF、LOF、公募 REITs 交易量。

报告期内, 股票期权经纪业务不断提升交易技术支持能力, 持续培育合格投资者, 深化专业投资者服务, 业务继续保持市场领先优势。根据上交所统计数据, 报告期内, 本公司沪市股票期权经纪业务成交量市场份额行业排名第一。

期货经纪业务方面, 截至报告期末, 华泰期货共有 9 家期货分公司、42 家期货营业部, 遍及国内 4 个直辖市和 17 个省份, 代理交易品种 116 个。报告期内, 华泰期货实现代理成交量 34,646.91 万手, 成交金额人民币 263,675.36 亿元。证期业务进一步深度融合, 截至报告期末, 本集团获准从事期货 IB 业务的证券营业部共 237 家、期货 IB 业务总客户数 5.79 万户。

股票基金交易量情况

单位: 万亿元 币种: 人民币



来源: 公司定期报告

■ 交易量

(2) 金融产品销售与基金投资顾问业务

报告期内，本集团多角度推动以客户需求为中心的金融产品销售与基金投资顾问业务开展，以资产配置和金融产品投研为核心业务驱动，以平台化与专业化为牵引，积极构建基于买方视角的一体化资产配置服务体系，为客户提供符合其风险与收益需求的策略组合和金融产品，满足客户多层次的财富管理需求，持续优化客户体验。根据内部统计数据，报告期内，金融产品保有数量（除现金管理产品“天天发”外）10,342 只，金融产品销售规模（除现金管理产品“天天发”外）人民币 2,082.84 亿元。根据中国证券投资基金业协会 2023 年二季度的统计，本公司股票及混合公募基金保有规模人民币 1,297 亿元、非货币市场公募基金保有规模人民币 1,517 亿元，均排名证券行业第二。

报告期内，本集团围绕分层分级客户的差异化需求，以买方投资顾问业务为核心，持续丰富和完善金融产品供给体系，基于多重维度构建供给矩阵，积极打造覆盖资产、策略、产品的一体化投研模式，加强各类资产和策略趋势的研究判断，不断完善“省心家族”配置服务体系，提供从单产品优选到策略配置的多维度解决方案，满足客户多层次、差异化的资产配置需求。持续加强财富管理顾问服务体系建设，不断优化客户服务场景和客户服务方案，通过客户需求深度挖掘和持续客户运营，为客户提供全生命周期的立体式陪伴服务。强化数字化平台能力建设，持续升级迭代投研平台，不断优化因子研究体系，积极构建投研联动模式，提升投资研究效能，有效支持基金投资顾问策略投资生产和运营，增强业务整体效率与能力。

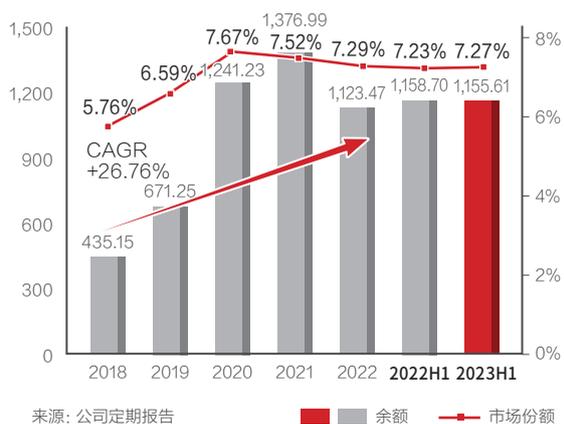
(3) 资本中介业务

报告期内，本集团围绕以客户需求为中心的经营理念，深化全业务链合作与联动，深入挖掘客户需求，及时响应客户反馈，积极构建多层次、差异化的客户服务体系，依托业务生态化建设和开放式融券通平台持续迭代的系统优势，不断增强差异化与专业化服务能力，业务发展态势良好。持续完善融券业务运营管理体系，不断丰富与持牌金融机构的合作模式，积极挖掘机构客户券源出借潜力，夯实券源开发基础，拓展券池规模，增强策略和服务供给效率，切实满足客户多层次的业务需求。加强数字化与平台化建设，不断迭代更新融券通平台，构建完善覆盖出借与融券业务全链路的证券借贷业务模式，提供智能、实时的交易体验及数字化、人性化的运营服务，为打造开放生态、创新业务场景、服务客户需求持续赋能。

根据监管报表数据口径，截至报告期末，母公司融资融券业务余额为人民币 1,155.61 亿元，市场份额达 7.27%，整体维持担保比例为 270.72%，其中，融券业务余额为人民币 164.79 亿元，市场份额达 17.72%；股票质押式回购业务待购回余额为人民币 274.47 亿元、平均履约保障比例为 228.81%，其中，表内业务待购回余额为人民币 68.23 亿元、平均履约保障比例为 226.26%，表外业务待购回余额为人民币 206.24 亿元。

融资融券业务规模情况

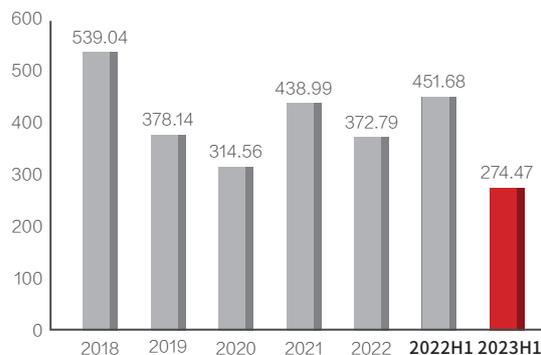
单位：亿元 币种：人民币



来源：公司定期报告

股票质押式回购业务规模情况

单位：亿元 币种：人民币



来源：公司定期报告

整体维持担保比例及平均履约保障比例情况



来源：公司定期报告

3、财富管理业务 2023 年下半年展望

财富管理业务承载着本集团规模化聚集、沉淀客户资源和客户资产的战略职能。2023 年下半年，本集团将继续抓住财富管理市场纵深发展的战略机遇，通过总部驱动、总分联动、线上线下一体的财富管理运营体系，不断做大客户与客户资产规模，推动财富管理业务向客户全生命周期服务模式转型，持续打造面向未来的全新竞争优势。

财富管理业务将围绕数字化、平台化、生态化理念，不断优化全业务链协同机制，做深做实平台运营和客户运营，构建新型客户增长与服务运营体系，打造财富管理业务新生态。优化完善分层分级的客户服务体系，迭代升级客户服务一体化运营模式，有效赋能财富管理队伍专业化服务能力培育与优质服务输出，持续创新运营方式，提高服务覆盖，创造长期服务价值。基于客户分层与多元化业务需求，构建完善专业化分工、体系化培育的分层分级财富管理队伍体系，不断提升财富管理效能，持续优化基于专业金融能力和运营能力的伴随客户全生命周期的增长体系。持续完善数字化、智能化平台底座，不断推进平台产品创新和服务能力升级，强化专业场景赋能和平台运营支撑，切实提升服务质量，优化客户体验。

金融产品销售与基金投资顾问业务将整合全业务链资源，继续加强数字化平台集群建设，不断提升平台化赋能水平，积极推进业务品牌建设及业务体系构建，持续丰富策略类型，优化服务场景，迭代升级配置模型，加强投资顾问和客户赋能工具建设，完善投顾一体化服务机制，增强投资研究专业能力，为客户提供综合金融解决方案。

资本中介业务将继续以客户需求为导向，不断深化产品服务内涵，积极创新业务运营模式，着眼于券源获取能力、客户服务能力和金融科技运用的差异化竞争点，为客户提供资券一体化、服务一站式的综合解决方案。继续深化全业务链合作，加强资源型客户开发以实现高质引流，持续推进融券通平台迭代更新，打造开放、高效的证券借贷行业生态，积极构建专业化、智能化、数字化的业务体系，不断增强融通品牌优势。

（二）机构服务业务

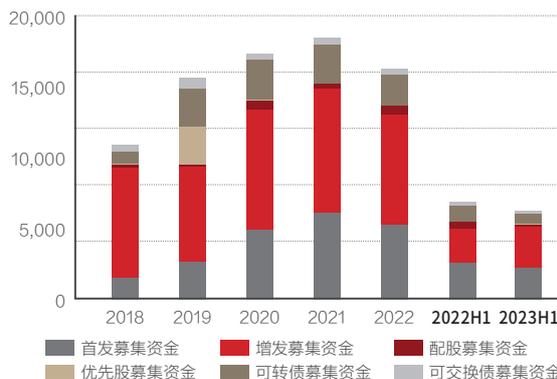
1、机构服务业务市场环境 with 行业趋势

（1）实体经济转型升级和资本市场全面深化改革为机构服务业务发展打开了更广阔空间

随着资本市场全面注册制改革稳步落地以及市场基础制度体系持续完善，资本市场战略定位不断提升，市场结构进一步机构化，机构服务业务迎来纵深发展的契机，围绕国家战略发展方向、经济结构升级需要及客户日益复杂的金融需求，贯彻以客户为中心的业务模式，注重业务协同并提供一体化综合金融服务和专业化金融产品的证券公司将更具有业务发展优势。在我国实体经济转型升级持续推进、资本市场改革全面深化的新发展格局下，资本市场生态不断优化、多层次资本市场体系不断完善、资本市场服务实体经济高质量发展功能不断提升，证券公司投资银行业务面临高阶转型的重大战略机遇，同时也对其资产价值甄别和发现能力、定价承销能力、高质量项目执行能力、客户服务能力、合规风控能力等提出更高要求，善于发现和服务代表经济转型和高质量发展方向的企业，积极推进全业务链体系建设，持续优化全生命周期综合金融服务模式，围绕客户多元化需求提供全方位、多层次、精准化综合金融服务的证券公司将获得更显著的竞争优势。证券公司应积极拓展业务和服务的深度和广度，构建体系化和平台化的专业实力，提升优质资产获取和价值发现能力，充分发挥全产品和高效率服务实体经济高质量发展和活跃资本市场的作用。

股票发行统计情况

单位：亿元 币种：人民币

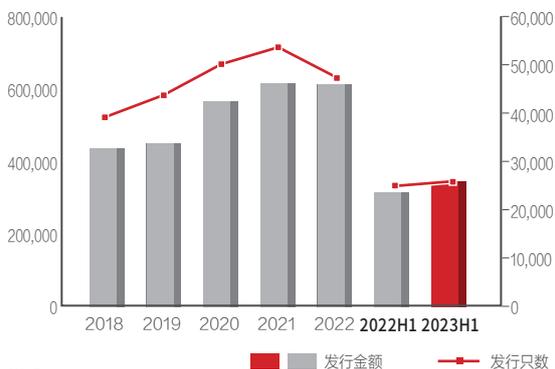


说明:

- 1、数据来源: Wind;
- 2、统计范围包括 IPO、增发(含发行股份购买资产)、配股、优先股、可转债、可交换债;
- 3、Wind 的统计口径为发行日。

债券发行统计情况

单位：亿元 币种：人民币

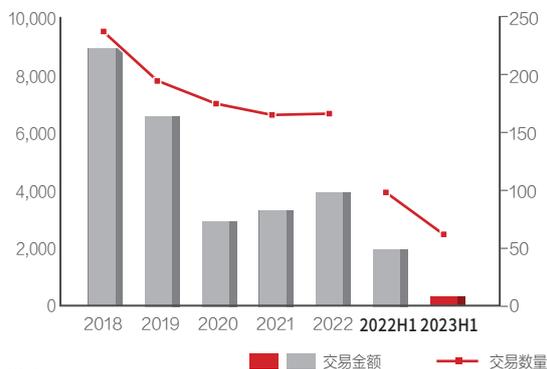


说明:

1. 数据来源: Wind;
2. 统计范围包括国债、地方政府债、央行票据、同业存单、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、定向工具、国际机构债、政府支持机构债、资产支持证券、可转债、可分离转债存债、可交换债;
3. Wind 的统计口径为发行日。

上市公司重大资产重组统计情况

单位：亿元 币种：人民币



说明:

1. 数据来源: Wind;
2. Wind 的统计口径为 A 股上市公司披露的重大资产重组交易情况。

(2) 资本市场机构化发展趋势重构市场新生态，对证券公司机构服务业务提出更高要求

近年来，我国资本市场市场化程度不断加强，投融资便利性持续提升，机构投资者持股占比和市场影响力显著提高，机构投资者作为市场参与主体是大势所趋，市场结构的深层次变化将重构资本市场新生态，证券公司机构服务业务发展潜力和空间可观，同时，也对证券公司专业能力、内部协同和资本实力提出更高要求。伴随个人养老金投资公募基金业务落地实施等资本市场改革的纵深推进，公募基金等专业机构投资者力量稳步增强，资本市场中长期资金来源持续扩大，居民财富配置向金融资产迁移的趋势持续强化，资本市场机构化进程进一步加快，机构服务业务将成为推动证券公司业绩增长的重要动力。此外，伴随着注册制改革持续推进下的市场扩容及制度优化、资本市场双向开放程度的不断加深、市场优势资源向优质机构的加速集聚，证券行业分化更趋明显，以数字科技和平台运营为依托、多市场和全业务领域协同发展、打造一站式机构服务业务生态圈的证券公司将迎来更大的发展空间。证券公司应积极打造平台化、一体化、生态化的机构投资者服务体系，以更强的综合实力以及全业务链资源整合能力，为机构投资者提供全产品、全链条、全周期的一站式综合金融服务。

(3) 证券公司机构服务业务可持续发展需要强有力的风险管理能力作为基础

在内外环境错综复杂、资本市场监管日趋严格、证券行业业务体系不断扩展、客户数量持续增长、信息传播方式不断变化的背景下，风险传播的隐蔽性和不可控性持续增加，证券公司的风险管理面临全新挑战。加强重点领域精准风险管控，夯实筑牢集团化风险管理体系基础，着力打造与自身发展战略及业务发展相匹配的风险管理能力，将成为证券公司提升跨业务全生命周期风险管控能力的关键。证券公司需要持续完善跨市场、跨行业、跨境风险监测、预警、防范和化解的长效机制，提档升级一体化风险管理体系，不断提升风险治理能力。有效管理金融风险需要证券公司不断完善风险管理框架及体系，积极打造境内外一体化风险态势感知与管控平台，实现数字化赋能和专业化风险管控；及时化解金融风险需要证券公司在具备较强资本实力的同时有效利用金融衍生品市场，不断提升风险应对综合效能。近年来，随着市场风险对冲和风险管理工具的持续丰富，证券行业对维护金融市场和资本市场平稳运行、健康发展的作用更为重要，证券公司应积极完善全方位的风控管理体系，以平台化技术为支撑，构建集团化风险管理模式和智能化风险管理工具，持续为资本市场提供有效的风险管理及资产配置工具，打造风险管理核心竞争力。

2、机构服务业务经营举措及业绩

(1) 投资银行业务

报告期内，本集团将服务实体经济作为自身的使命担当，秉持以优质客户为中心的经营理念，以行业聚焦、区域布局和客户深耕为方向，加强境内境外、场内场外跨市场协同，全面提升全产品服务能力和综合服务快速响应能力，投资银行业务持续保持市场头部地位，业务实力进一步提升。

合并数据

币种：人民币

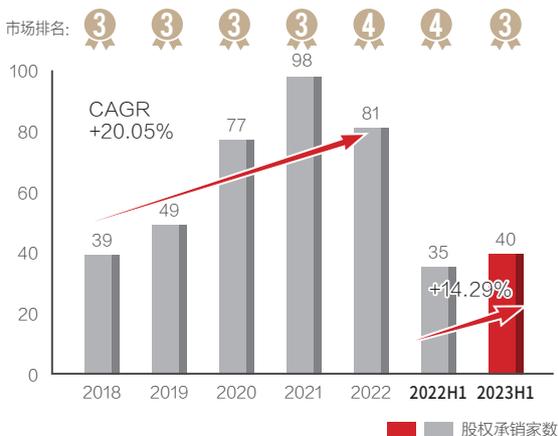
发行类别	主承销次数(次)		主承销金额(万元)		主承销收入(万元)	
	本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
新股发行	10	262	990,084.34	22,654,748.50	66,329.46	1,132,408.00
增发新股	16	300	2,167,061.38	47,992,218.84	19,134.98	360,113.75
配股	1	37	-	2,280,547.65	-	23,109.07
债券发行	1,165	6,860	22,883,607.87	270,513,302.35	47,723.89	683,816.53
合计	1,192	7,459	26,040,753.59	343,440,817.34	133,188.33	2,199,447.35

注：上表数据来源于监管报表，统计口径为项目发行完成日；增发新股内含优先股；债券发行含国债、金融债、企业债、公司债（含可交换债）、可转债、短期融资券、中期票据等，不含资产证券化项目。

① 股权融资业务

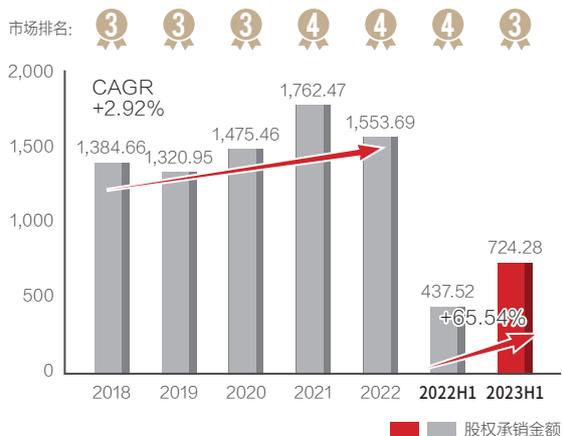
报告期内，股权融资业务以优质客户为中心，充分发挥全业务链体系和大投行境内外一体化平台优势，深耕区域，聚焦行业，为客户提供多产品、全周期、定制化的资本市场服务。根据 Wind 资讯统计数据，本集团股权主承销金额（含首次公开发行、增发、配股、优先股、可转债、可交换债）人民币 724.28 亿元，行业排名第三。

股权承销数量及排名情况



股权承销金额及排名情况

单位：亿元 币种：人民币



说明：

1、数据来源：Wind；

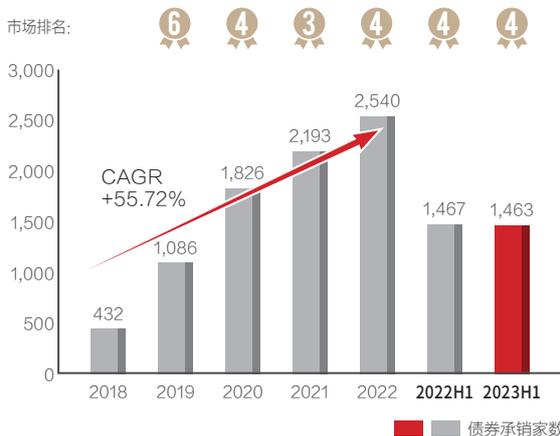
2、统计范围包括 IPO、增发（含配套融资及以资产认购的增发项目）、配股、优先股、可转债、可交换债；

3、Wind 的统计口径为发行日，公司报送监管报表的统计口径为缴款日，因此 Wind 数据和公司统计数据有差异。

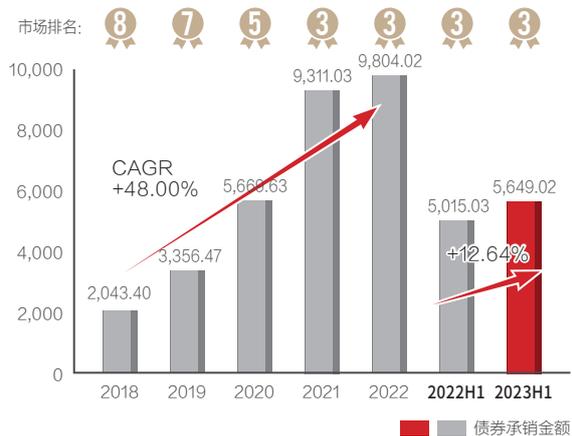
② 债券融资业务

报告期内，债券融资业务在严格控制风险的基础上，充分发挥全业务链优势，不断完善客户分层管理，积极培养核心客户群体，行业地位进一步巩固。根据 Wind 资讯统计数据，本集团全品种债券主承销金额人民币 5,649.02 亿元，行业排名第三。根据中国证券业协会统计数据，本集团主承销科技创新公司债券金额人民币 101.77 亿元，行业排名第四。

债券承销数量及排名情况



债券承销金额及排名情况



③ 财务顾问业务

报告期内，并购重组财务顾问业务充分发挥业务创新优势，聚焦高价值交易机会发现能力及交易撮合能力，积极拓展客户持续服务，并购重组业务品牌优势持续稳固。本集团担任独立财务顾问的经监管审核通过的并购重组交易家数 2 家，行业排名第二；交易金额人民币 103.20 亿元，行业排名第三。

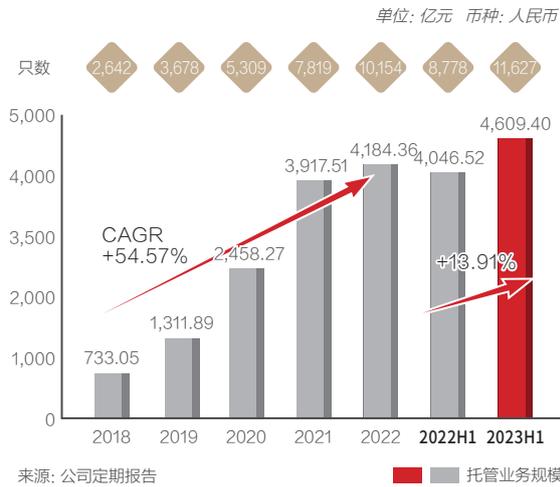
④ 场外业务

报告期内，本集团积极开拓以北交所上市为目标的新三板挂牌项目，充分发挥大投行一体化优势，持续为科技创新型成长性企业提供完善的资本市场服务。报告期内，本集团完成新三板挂牌项目 3 单、挂牌在审项目 1 单，完成挂牌企业股票定向发行项目 2 单，股票定向发行获准项目 1 单及在审项目 2 单。控股子公司江苏股权交易中心不断完善存续产品管理并持续探索业务模式创新，积极推动制度与业务创新试点方案申报，深化数字化转型，有效推进区块链平台功能的扩充和完善，不断提升中小微企业综合金融服务能力。截至报告期末，挂牌展示企业 15,395 家，纯托管企业 146 家，会员单位 230 家，各类投资者 79,975 户，报告期内为企业新增融资人民币 45.10 亿元。

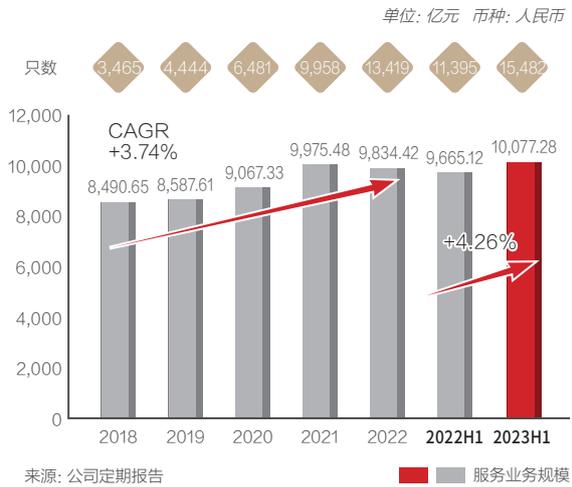
(2) 主经纪商 (PB) 业务

报告期内，本集团认真贯彻以客户运营为核心的服务理念，围绕客户全生命周期的综合金融服务需求，充分发挥数字化赋能与全业务链服务体系优势，打造具有核心竞争力的一体化服务平台，为专业机构投资者提供跨场内外、境内外的一站式综合主经纪商交易及服务。截至报告期末，基金托管业务累计上线产品 11,627 只，托管业务规模人民币 4,609.40 亿元；基金服务业务累计上线产品 15,482 只（含资管子公司产品 827 只），服务业务规模人民币 10,077.28 亿元（含资管子公司业务规模人民币 3,630.74 亿元）。根据中国证券投资基金业协会截至 2023 年第二季度的统计，本集团私募基金托管业务备案存续产品数量行业排名第四。

基金托管业务累计上线产品数量及业务规模情况



基金服务业务累计上线产品数量及业务规模情况



(3) 研究与机构销售业务

报告期内, 研究业务坚定推进业务模式转型, 积极践行全业务链战略, 不断深化业务协同效能, 持续完善跨境研究服务体系, 打造研究业务竞争优势。持续升级迭代数字服务平台“行知”和智能研究平台“RIS”, 不断夯实投研底座, 沉淀投研数据资产, 优化完善产品生产和管理流程, 不断提升平台生产效率和服务质量, 有效拓展研究成果触达范围和深度。聚焦头部机构客户, 通过加强多行业研究联动、深入研究价值挖掘, 着力发挥研究业务支撑和牵引作用, 多渠道、多平台、多方式开展研究服务活动, 满足客户专业化的研究业务需求。机构销售业务以客户为中心, 依托全业务链优势, 推进“行知”服务平台及机构投资者工作平台建设和功能迭代, 做实全面覆盖、分层分级的机构客户池, 构建以交易和产品为中心的机构服务生态圈, 重塑机构业务一体化服务体系, 深入对接机构投资者多样化需求, 提供一站式交易及服务解决方案。报告期内, 本集团积极开展多种形式的研究服务活动, 发布研究报告 4,650 篇, 组织研究路演服务 16,890 场、专题电话会议 392 场, 通过线上或线上线下相结合方式举办投资峰会、研讨会等专题会议 13 场。报告期内, 公募基金分仓交易量人民币 6,478.09 亿元。

(4) 投资交易业务

① 权益交易业务

报告期内, 本集团不断完善策略交易体系, 持续提升宏观策略交易能力, 深度挖掘重点投资交易品种, 积极把握市场投资交易机会, 优化加强以大数据交易业务、宏观基本面业务和创新投资业务为核心的绝对收益一体化投资体系, 持续拓展权益基础研究的广度、深度和力度, 扩充交易模式, 丰富业务场景, 控制回撤风险, 持续完善联动发展的多市场、多层次、立体式的多元业务模式, 积极打造投资交易核心能力。全面落实数字化和平台化建设, 持续推进平台的迭代升级, 不断提升关键节点性能, 强化业务运营监控能力, 全面提升系统平台业务效能。科创板股票做市交易业务方面, 本集团持续加强人才体系建设, 不断完善交易系统, 迭代做市策略, 完备风控体系, 业务运营稳健, 业务规模有序扩张, 截至报告期末累计报备做市股票 45 只。

② FICC 交易业务

报告期内, 本集团继续坚定推进 FICC 量化交易战略转型, 持续构建以客户需求为导向、以交易为核心的 FICC 业务模式。固定收益自营投资业务积极开展模型、策略和产品等多层次的量化创新实践, 不断提升量化策略丰富度, 充分发挥市场前瞻和风险控制优势, 打磨稳健盈利能力。FICC 代客业务以客户需求引领业务创新, 持续扩充产品类型, 业务布局不断完善, 产品规模不断提升。做市业务实现跨市场、跨品种延展, 量化做市报价战略转型成效显著, 做市交易量、品种覆盖等维度实现突破。大宗商品和外汇业务持续推进业务创新, 落地首单碳排放权交易, 业务多元化发展基础不断夯实, 客户服务能力稳步提升。积极推进业务数字化转型, 不断扩充 HEADS 大象平台应用场景, 持续优化 CAMS 信用分析

管理系统标准化产品服务形态，体系化、平台化提升投资交易能力和风险管理能力。根据中国证券业协会统计数据，本集团创设信用保护工具规模人民币 11.87 亿元，行业排名第三。

③ 场外衍生品交易业务

报告期内，本集团着力构建以客户为导向的场外衍生品业务体系，不断提升业务创新能力和交易定价能力，积极扩展客户覆盖的深度和广度，以更加多元化的投资与风险管理工具为客户提供全方位的衍生品交易服务。凭借交易驱动、平台赋能的核心竞争力，持续完善业务模式并不断开拓创新，充分发挥金融科技优势，推动实现核心业务能力的沉淀、升级与转化，积极打造持续驱动业务高质量发展的强力引擎，全面提升客户综合价值创造能力。根据监管报表 SAC 协议数据口径，截至报告期末，收益互换业务存续合约笔数 7,536 笔，存续规模人民币 1,120.74 亿元；场外期权业务存续合约笔数 1,861 笔，存续规模人民币 1,185.66 亿元。报告期内，本集团通过中证机构间报价系统和柜台市场发行私募产品 1,899 只，合计规模人民币 144.29 亿元。

3、机构服务业务 2023 年下半年展望

机构服务业务致力为产业及金融机构客户提供全业务链服务，是驱动本集团迈向高质量发展的重要战略领域。2023 年下半年，本集团将继续分类聚焦重点客群的金融服务需求，持续推进体系化的服务模式，不断增强业务协同机制，实施客户价值综合运营，打造平台化、产品化及生态化的机构客户服务新模式，实现与客户交互赋能、共同成长。

投资银行业务将持续推进平台化展业和数字化转型，深入贯彻以优质客户为中心的经营理念，围绕客户全生命周期，积极打造满足客户一体化需求的全业务链服务体系，切实发挥好资本市场与实体经济的桥梁作用。股权融资业务将继续践行重点行业聚焦和区域深耕战略，输送更多优质企业登陆资本市场；债券融资业务将在保持发行规模和行业地位的基础上，深耕区域、聚焦行业、专注产品，不断提升营销开发能力和专业服务能力，更好服务国家战略导向；并购重组财务顾问业务将坚持交易创新引领市场，持续拓展业务类型，积极打造具有市场影响力的并购交易项目。

主经纪商业务将不断强化以客户为中心的经营理念，加大力度推进业务开拓，持续推动数字化转型与运营效能提升，有效联通内外部业务生态赋能客户，以平台化、数字化、一体化模式为客户提供综合金融服务，实现业务价值多元变现。

研究与机构销售业务将持续健全境内外一体化的机构客户服务体系，着力打造具备综合服务能力的专业队伍，积极推进数字化平台系统建设，充分发挥全业务链协同效能，围绕机构投资者需求打造全方位、一站式金融服务生态圈，持续增强市场竞争力和行业地位。

投资交易业务将持续打造平台化、体系化的投资交易能力，切实向掌握资产定价权和交易能力产品化的目标升级转型，积极打造面向未来的核心竞争力，推动盈利模式多元化。权益交易业务将不断增强系统平台效能，持续提升大数据交易业务、宏观基本面业务和创新投资业务专业化投资能力，在控制回撤的基础上稳步扩大业务规模，打造规模化稳定盈利的权益投资与交易业务体系；FICC 交易业务将继续加强业务系统化建设与开发，不断提升 HEADS 大象平台和 CAMS 信用分析管理系统的客户服务能力，积极打造核心定价能力，持续丰富量化交易策略，创新业务增长模式，加快驱动业务转型；场外衍生品交易业务将凭借业务的先发优势、具有市场竞争力的系统建设以及领先的创新能力、交易对冲能力、产品设计与定价能力、风险控制与合规运营能力，不断创新业务模式与产品结构，巩固竞争优势。

（三）投资管理业务

1、投资管理业务市场环境与行业趋势

（1）资产管理业务制度体系不断健全，行业进入高质量发展的新阶段

随着我国金融改革持续深化、多层次资本市场体系不断完善、金融市场创新更趋活跃、资管业务制度体系不断健全以及个人养老金实施办法和相关配套政策陆续出台，资产管理业务生态向高质量发展转型，深度竞合的资产管理业务新格局加速形成，各类资产管理机构应持续加强投资研究体系建设，充分发挥价值发现与资产定价功能，锻造提升资管业务核心竞争力。在资产管理市场专业化、多元化、高质量发展的背景下，资产管理业务规范转型稳步推进，行业结构深刻调整，客户服务需求日益多元化与综合化，金融科技的发展和充分应用或将成为资管大时代的新变量，资产管理机构也将迎来更多的机遇与挑战。根据中国证券投资基金业协会统计数据，截至 2023 年一季度末，基金管理公司及其子公司、证券公司及其子公司、期货公司及其资管子公司、私募基金管理人管理的资产管理业务总规模约人民币 67.28 万亿元，其中，证券公司及其子公司私募资产管理业务规模人民币 6.45 万亿元。面对注册制改革持续推进下的新市场生态，资产管理机构应持续加强投研核心能力和投研团队建设，打造专业化分工、协同共享的投研平台，丰富完善全资产类别产品线，构建多层次、多元化的资管业务生态，稳步提高产品创新能力、全面风险管理能力和战略机遇把握能力，切实为实体经济的投融资需求和居民资产保值增值提供专业服务。

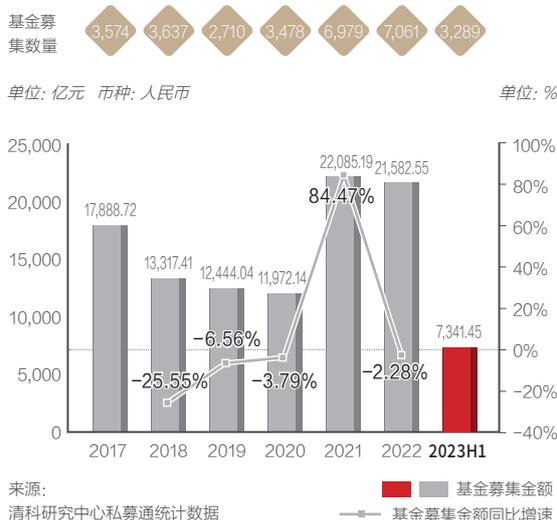
（2）我国股权投资市场整体延续放缓态势，行业竞争激烈，集聚效应凸显

在国际形势错综复杂、行业监管环境日益趋严等背景下，我国股权投资市场面临严峻考验，募资市场整体体量收缩，投资市场节奏延续减缓，退出市场交易数量减少，市场整体趋于平缓。同时，优质项目竞争激烈，优秀人才和增量资金向具有强大专业能力、资源整合能力的投资管理机构集聚的效应更加凸显。根据清科研究中心私募通统计数据，2023 年上半年，中国股权投资市场新募基金数量 3,289 支，新募基金规模人民币 7,341.45 亿元，较 2022 年同期减少 23.5%；中国股权投资市场投资案例数 3,638 起，投资总金额人民币 2,929.65 亿元，较 2022 年同期减少 42.0%。随着实体经济的恢复发展、金融服务基础设施的不断优化、全面注册制改革的落地实施、私募基金法规体系等行业监管机制的日趋完善，多层次资本市场融资和资源配置效率不断增强，我国股权投资市场迎来新的发展机遇，同时也对股权投资机构的管理能力提出更高要求。长期来看，我国股权投资市场在服务实体经济高质量发展，打造全生命周期、全链条企业服务生态，满足居民资产配置需求的同时，在推动要素资源向科技创新领域聚集，实现科技自立自强、创新驱动发展等方面发挥着日益重要的基础性、战略性作用。股权投资机构应依托科学的投资决策、专业的投后管理以及优质的增值服务，积极打造股权投资全产业链服务能力，以全方位的综合金融服务为企业提供全生命周期的资本运作方案。

证券公司及其子公司私募资产管理业务规模及同比增速情况



中国股权投资市场新募基金数量与金额及同比增速情况



中国股权投资市场投资案例数量与金额及同比增速情况



2、投资管理业务经营举措及业绩

(1) 证券公司资产管理业务

报告期内, 本集团全资子公司华泰资管公司主动适应市场及监管环境变化, 坚持以客户为中心, 以投资资管和投行资管服务为抓手, 一站式提供一流的投资产品、资产配置及整体金融服务解决方案, 赋能客户的资产管理服务旅程, 培育差异化的核心竞争力。依托集团全业务链资源, 强化与集团双向驱动, 立足投行基因优势, 充分发挥数字化应用能力, 不断夯实主动管理能力, 持续完善合规化、便利化、一体化、多样化、高效化的综合资产管理服务体系。根据监管报表数据口径, 截至报告期末, 华泰资管公司资产管理总规模人民币 4,570.01 亿元。根据 Wind 资讯统计数据, 报告期内, 华泰资管公司企业 ABS (资产证券化) 发行数量 58 单、发行规模人民币 530.75 亿元, 均排名行业第三。

报告期内, 证券公司资产管理业务继续向主动管理方向转型, 持续打磨平台运营、一体联动的核心竞争力, 充分发挥资产发现、风险定价与产品设计能力, 积极构建规模化、差异化且覆盖不同风险收益特征的产品体系。集合资产管理业务合计管理集合资管计划 184 只, 合计管理规模人民币 566.47 亿元。单一资产管理业务加快探索净值型委外业务, 合计管理单一资管计划 429 只, 合计管理规模人民币 1,134.69 亿元。专项资产管理业务持续推进产品创新, 不断提升全链条服务能力, 合计管理专项资管计划 214 只, 合计管理规模人民币 1,929.57 亿元。公募基金管理业务积极打造针对投资者不同需求的净值化理财解决方案, 合计管理公募基金产品 38 只, 合计管理规模人民币 939.28 亿元。

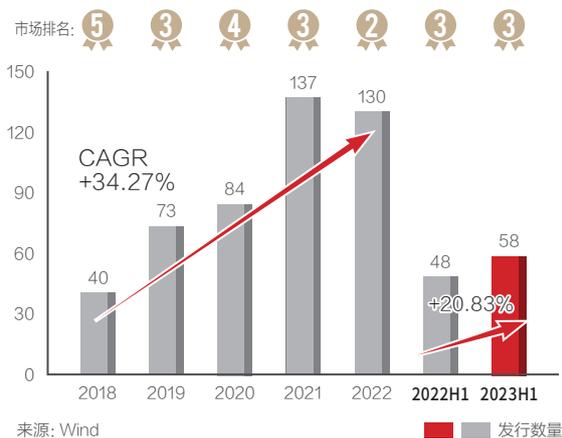
证券公司资产管理业务规模和收入情况如下表所示:

币种: 人民币

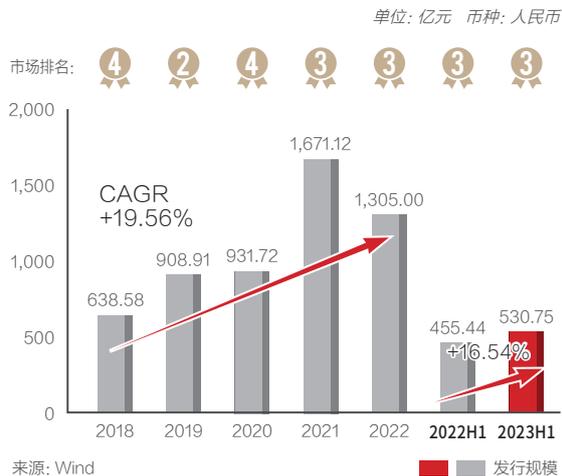
项目	2023 年 1—6 月		2022 年 1—6 月	
	受托规模 (亿元)	净收入 (万元)	受托规模 (亿元)	净收入 (万元)
集合资产管理业务	566.47	5,689.56	701.96	9,595.17
单一资产管理业务	1,134.69	14,200.17	1,480.75	11,161.15
专项资产管理业务	1,929.57	6,623.30	1,861.06	6,478.05
公募基金管理业务	939.28	43,080.13	972.36	37,900.88

注: 上表数据来源于监管报表。

企业 ABS (资产证券化) 发行数量及排名情况



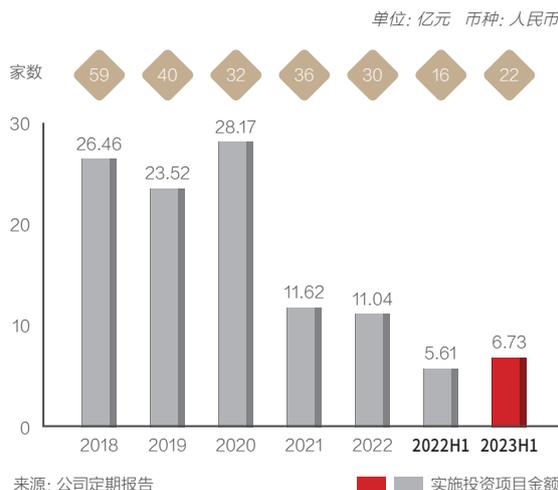
企业 ABS (资产证券化) 发行规模及排名情况



(2) 私募股权基金管理业务

报告期内，私募股权基金管理业务围绕自身优势赛道，专注行业研究，深入布局重点行业，巩固行业影响力，积极推动已投企业借助全面注册制改革契机实现上市退出，同时加强与大型国有企业、行业龙头企业、上市公司等开展合作，推进专注于母基金、医疗健康基金、TMT 基金等各类基金的募集设立，扩大基金管理规模，持续做好投资业务项目储备。截至报告期末，华泰紫金投资及其二级子公司作为管理人在中国证券投资基金业协会备案存续的私募股权投资基金合计 27 只，合计认缴规模人民币 606.29 亿元，合计实缴规模人民币 454.27 亿元。报告期内，上述私募股权投资基金实施投资项目合计 22 个，投资金额合计人民币 6.73 亿元，均为股权投资类项目。根据中国证券投资基金业协会截至 2023 年第二季度的统计，华泰紫金投资私募基金月均规模行业排名第三。

私募股权投资基金实施投资项目家数及金额情况



(3) 基金公司资产管理业务

报告期内，本集团旗下基金公司坚持合规管理与业务发展并重，积极推动产品创新，不断拓宽业务领域与产品线布局，着力完善智能化系统建设，不断研发多元投资模型，多类别、跨周期的综合资产管理能力进一步提升，资产管理总规模继续保持增长。南方基金资产管理业务方面，截至报告期末，南方基金管理资产规模合计人民币 18,832.37 亿元，其中，公募业务管理基金数量合计 337 个，管理资产规模合计人民币 11,389.00 亿元；非公募业务管理资产规模合计人民币 7,443.37 亿元。华泰柏瑞资产管理业务方面，截至报告期末，华泰柏瑞管理资产规模合计人民币 3,559.02 亿元，其中，公募业务管理基金数量合计 136 个，管理资产规模合计人民币 3,348.66 亿元；非公募业务管理资产规模合计人民币 210.36 亿元。(南方基金以及华泰柏瑞的股权投资损益计入在分部报告中的其他分部中)

(4) 期货公司资产管理业务

报告期内，本集团全资子公司华泰期货不断强化内部资源整合与业务协同，积极推进科技引领的数字化转型及创新引领的业务转型，多元化稳步拓展以 FOF 为主、主动管理为辅的产品线，不断提升专业化服务水平并积极打造竞争优势，满足客户差异化的风险偏好和资产配置需求。截至报告期末，存续期内资产管理计划合计 35 只，资产管理总规模人民币 145,470.48 万元，期货端权益规模人民币 69,103.64 万元。

（五）另类投资业务

本集团通过全资子公司华泰创新投资开展另类投资业务。报告期内，根据监管要求及集团业务布局，华泰创新投资充分发挥业务协同效能，着力发展金融科技股权投资和科创板跟投业务，稳步探索创业板跟投业务和北交所战略配售业务。截至报告期末，存续投资项目 40 个，投资规模人民币 200,829.58 万元，投资性质主要包括科创板跟投、股权投资等。

3、投资管理业务 2023 年下半年展望

投资管理业务承载着资产管理者和资产服务者的双重战略角色，是本集团金融产品创新和客户资产管理的重要领域。2023 年下半年，本集团将继续发挥资产发现、风险定价与产品创设的专业能力，充分依托全业务链资源优势，积极打造全品种、规模化与特色化的金融产品体系，对接客户差异化需求，构建一流的投资管理平台，不断强化行业领先地位。

证券公司资产管理业务将立足全业务链平台，发挥券商资管特色资源优势，强化差异化的发展禀赋，夯实平台化的基础设施能力底座，不断将全业务场景、内外部资源深度融入平台，以差异化展业构建竞争壁垒、以平台化运营推动业务破局和转型超越。发挥大平台优势，紧扣市场需求做大客户规模、传承投行基因做强优势资产、立足券商优势领域做精特色赛道，践行差异化发展思路，树立良好品牌效应。

私募股权基金管理业务将继续坚持以行业研究为先，在重点行业深耕细作、深度布局，积极挖掘优质项目，同时围绕基金打造的生态圈，链接产业链上下游，推动项目协同合作，做好投后管理及相关增值服务；发挥集团全业务链优势，持续开拓探索新业务，积极开展基金募集工作，不断扩大基金管理规模，推动业务结构与盈利模式多元化。

基金公司资产管理业务将持续加强合规风控管理和人才梯队建设，继续保持新业务探索与新产品开发，着力构建多层次、有特色、差异化的产品线，不断夯实跨资产、多策略的核心能力，持续打造全流程、精细化的客户陪伴体系，积极构建数智化系统平台，全面赋能业务发展。

期货公司资产管理业务将积极把握获批投资场外期权等衍生品业务的发展机遇，不断完善产品供应体系，构建以科技创新驱动业务发展的新模式，加强基于大平台的全资产、全策略线、全投资工具的投资团队配备，优化投资决策与管理机制，推动业务质量提升和规模增长。

另类投资业务将不断完善制度机制及业务操作流程，深化金融科技生态建设，审慎推进股权投资、科创板跟投和其他新业务的开展，有效管控存量业务风险并妥善处理投后管理事项，稳步提高资金使用效率和资产回报率。

（四）国际业务

1、国际业务市场环境 with 行业趋势

（1）资本市场制度型双向开放纵深发展加速推进证券行业国际化进程，客户跨境服务需求推动证券公司国际化服务能力提升

随着我国资本市场高水平制度型和系统性开放举措的渐次落地，境内外资本市场互联互通机制不断优化，基础交易制度不断完善，国际化产品体系不断丰富，跨境投融资渠道不断拓宽，境内外资本市场的相互融合和协同持续深化，资本市场全球资源配置和服务实体经济的能力不断增强。当前，全球财富管理多元化资产配置的重要性日益凸显，在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加快构建的战略背景下，资本市场枢纽地位日益提升，我国证券行业迎来新一轮发展机遇，国际业务也成为证券公司拓展发展空间、增加新的利润增长点、促进业务结构升级的前沿领域。大型证券公司应积极把握资本市场高水平开放新格局加快形成的重大机遇，不断优化国际业务布局并持续加强跨境生态圈建设，积极打造精细化、专业化、全面高效的境内外一体化客户运营体系，实现全渠道交互融合、多层次协同联动，不断提升国际化运营能力、跨市场服务能力和跨境风险管理能力，增强全球产业链资源与重要资本配置能力，更好地为国内及全球客户提供多市场、全方位、多层次、高质量的全产业链投融资综合金融解决方案。

（2）美国财富管理行业独立渠道增长势头良好，利好 TAMP 市场长期发展

从整体行业发展来看，美国财富管理行业目前主要包括独立渠道（注册投资顾问、双重注册和独立经纪交易商及保险经纪交易商等）和传统渠道（全国和区域经纪交易商、银行经纪交易商和商业银行顾问等），独立渠道的财富管理市场份额相比传统渠道增长更加迅速，且该趋势仍在持续。根据麦肯锡统计数据，独立注册投资顾问渠道在 2022 年的净流入

份额与其他渠道相比更具有绝对优势，占行业总净流入的 22%，同时也高于其在 2021 年 16% 的份额。随着佣金收入大幅下降和企业持续专注于整体财务规划，收取管理费的账户数得到了迅速增长。根据 Cerulli 统计数据，目前，管理费模式的账户所覆盖资产规模占所有投资顾问管理资产规模的一半以上。从业务发展趋势来看，投资者资金呈现向低成本、低费率的投资产品转移的态势，TAMP 行业通过领先的金融科技水平持续赋能财富管理业务，能够为客户带来规模化的成本优势，有利于把握当下的发展机遇。根据 Cerulli 统计数据，2016 年至 2021 年间，TAMP 市场年复合增长率为 19.1%，显著高于同期整体投资顾问市场 11.6% 的年复合增长率。

2、国际业务经营举措及业绩

报告期内，作为本集团国际业务的控股平台，华泰国际全方位对接集团全业务链体系，夯实资本市场中介定位，深耕以客户为中心的一体化、平台化跨境服务生态，严格控制风险、丰富产品种类、拓展市场渠道、优化客户体验，满足客户全球资产配置需求，实现业绩稳步向上和国际化业务布局持续深化，境外市场影响力持续扩大。截至报告期末，华泰国际资产规模近两千亿港元，综合实力持续提升，稳居香港中资券商第一梯队前列。此外，华泰国际于 2022 年 9 月在新加坡设立全资子公司，报告期内，相关业务牌照申请已获新加坡金融管理局原则性批复。

(1) 香港业务

本集团香港业务坚持券商本源，以跨境业务为抓手，打造全方位的综合性跨境金融服务平台体系，在波动的市场环境下凭借持续升级的平台实力和风险管控能力，保持业务规模及收入正向增长，报告期内包括股权业务平台、固收业务平台、财富管理平台、基金平台和旗舰投行业务的业务平台体系持续深化，差异化竞争优势巩固提升。股权衍生品业务充分发挥集团平台优势，不断丰富产品类别，跨境业务规模稳中有进，同业领先地位持续巩固；股票销售交易业务专注“现券+跨境主经纪商+QFII”一站式跨境综合金融服务，以高频度及全业务链多触角式服务提升客户粘性，持续扩大差异化竞争优势；FICC 业务前瞻性布局多元化业务，严格把控风险底线，完善以客需为导向的跨境销售交易体系，业务保持稳健发展态势；财富管理业务持续提升线上线下平台化、一体化运营，不断优化“涨乐全球通”平台功能和运营能力，通过强化产品实力、深化业务联动、完善销售管理体系，大幅提升财富产品销量；基金业务严格防控风险，持续深化研究能力，积极拓展新市场，推进新产品落地，首个主动管理型基金产品正式投资运营；投资银行业务切实加强跨市场执行和服务能力，充分发挥多产品线布局优势，持续完善以客户为中心的全能跨境投行服务平台体系。根据内外统计数据，报告期内，华泰金控（香港）完成 2 单港股 IPO 保荐项目，保荐数量位居市场第三，并以全球协调人身份完成 4 单 GDR 发行项目，发行数量和发行规模均位居市场第一。

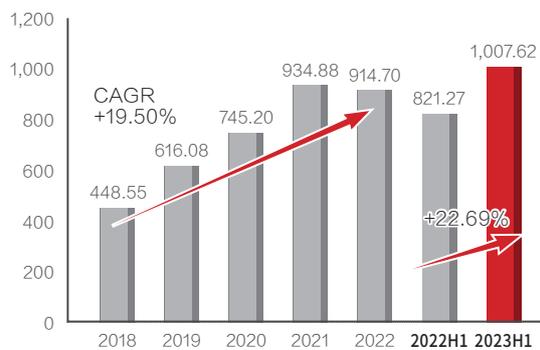
报告期内，本集团香港业务保持健康均衡发展，证券交易方面，华泰金控（香港）托管资产总量港币 859.92 亿元、股票交易总量港币 1,265.49 亿元；就证券提供意见方面，积极为客户提供研究报告及咨询服务；就机构融资提供意见方面，参与完成上市、再融资及 GDR 项目 12 个，债券发行项目 59 个，总交易发行规模港币 146.79 亿元；提供证券保证金融资方面，累计授信金额港币 35.31 亿元。报告期内，华泰金控（香港）成为卢森堡证券交易所上市和交易会员，并成为香港交易所认股证“窝轮”发行商。

(2) AssetMark

AssetMark 的愿景是致力于于独立投资顾问及其服务的投资者的生活带来改变。AssetMark 的核心业务亮点包括：一体化的技术平台、可定制化和规模化的服务，以及先进的投资管理能力。清晰的战略有助于 AssetMark 明确短期和长期工作目标，找准服务客户的关键并促使 AssetMark 在 TAMP 行业中脱颖而出。截至 2023 年第一季度末，根据 Cerulli Associates 及其他公开信息显示，AssetMark 在美国 TAMP 行业中的市场占有率为 11.9%，排名第二。

报告期内，AssetMark 通过领先的业务模式和先进的技术平台实现平台资产规模稳步增长，行业领先地位

AssetMark 平台资产规模 (AoP) 情况 单位: 亿美元



来源: 公司定期报告

■ 资产规模

持续稳固，业务收入不断提升。截至报告期末，AssetMark 平台资产总规模 1,007.62 亿美元，较 2022 年年末增长 10.16%；AssetMark 平台总计服务 9,323 名独立投资顾问，其中管理 500 万美元以上资产规模的活跃投资顾问 3,032 名，较 2022 年年末增长 5.20%；AssetMark 平台总计服务的终端账户覆盖了近 24.8 万个家庭，较 2022 年年末增长 2.85%。报告期内，新增 354 名投资顾问与 AssetMark 签订合作协议。



(3) 华泰证券（美国）

华泰证券（美国）于 2019 年经美国金融业监管局核准，获得经纪交易商牌照，可在美国开展经纪交易商业务，包括证券承销、面向机构投资者的证券经纪、并购财务顾问等业务；于 2020 年获得自营牌照；于 2021 年获得在加拿大与机构投资者开展证券交易的业务资格；并于 2022 年获得欧洲主要证券交易所的市场准入。报告期内，华泰证券（美国）继续完善系统平台和基础设施建设，不断拓展交易产品种类和市场通道，积极推进 FICC 业务布局，不断优化美国本土业务与境内及香港业务跨境联动协同机制，为全球投资者提供一体化服务。报告期内，华泰证券（美国）作为承销商积极参与中国企业美股上市交易和国际化知名企业大宗交易业务。

3、国际业务 2023 年下半年展望

国际业务是本集团打造境内外一体化平台的桥梁，也是本集团高阶发展和创造盈利的新引擎。2023 年下半年，本集团将继续深化跨境一体化管理机制，不断强化团队、平台、资源的有效联动，着力打造跨市场的资本服务能力，为客户提供境内外一体化的综合金融服务，全面提升国际业务竞争力与影响力。

华泰国际将坚持以客户需求为导向，积极打造一体化、生态化、平台化的综合性跨境金融服务平台，加强业务协同合作，丰富产品链条和对客全流程服务，强化风险前置管控能力，持续增强全业务链平台化内在合力。

香港业务将持续完善客户服务体系，通过境内境外贯通、股权债权结合、机构财富互补、一级二级联动的业务策略，夯实跨境资本市场中介定位，为客户提供一站式金融服务。股权衍生品业务将持续巩固业务优势，拓展新业务、新市场，全方位强化对客服务水平；股票销售交易业务将不断完善产品线，持续维护和加深客户关系，夯实主经纪商业务服务基础，不断提高市场份额；FICC 业务将不断提升数字化水平，借助平台升级迭代强化销售和交易一体化能力，匹配客户多层次的境内外投资和交易需求；财富管理业务将以提升客户核心体验为导向夯实平台交易功能和资产配置功能，通过深度挖掘存量客户和吸收引入第三方合作机构的模式，进一步提高服务水平；基金业务将持续深化一二级联动、投投联动，依托全产业链资源优势赋能客户，同时积极开拓离岸人民币类融资，提供人民币产品方案；投资银行业务将充分发挥境

内外一体化优势，积极开发优质客户，打造标杆项目，提升项目储备，为客户提供全产业链的一站式综合金融服务。

AssetMark 将继续把握核心业务亮点，打造一体化的技术平台、提升可定制化和规模化的服务、加强先进的投资管理能力，构建灵活且专业的财富管理生态圈。不断深化与现有投资顾问客户的合作关系，通过专注客户需求、提供差异化服务和帮助客户成长展业以进一步扩大投资顾问客户基数。不断升级数字化工具和平台赋能投资顾问，优化交互体验和协同办公，助力投资顾问护航客户财务健康计划。积极拓展客户渠道，致力于通过推动业务规模化和推广上市公司社会责任实践来提升运营效率和降低经营风险。此外，AssetMark 将持续关注优质的战略并购契机，推动外延式增长。

华泰证券（美国）将积极把握跨境业务机会，不断提升中国内地、香港和美国三地的业务协同能力，扩大全球机构投资者覆盖的深度和广度。持续完善跨境 FICC 交易平台，不断拓展产品与业务种类，积极拓宽服务辐射渠道，为满足全球投资者资产配置及风险对冲需求提供全方位服务。

（五）业务创新情况与对公司经营业绩和未来发展的影响，以及风险控制情况

报告期内，公司持续开展业务创新活动，推动新业务、新产品、服务及管理模式创新，不断提高创新能力。创新业务的开展是对现有产品线和业务范围的补充，能够有效释放业务空间，扩大客户资源和收入来源，增强盈利能力，也有利于改善客户结构和业务经营模式，满足客户全方位、多元化的业务需求，进一步提升品牌影响力。

报告期内，公司持续完善新业务风险管理机制，优化新业务评估流程，以系统支持并驱动新业务质控、台账管理、定期回溯等管理机制的有效执行；组织开展新业务专项回溯自查工作，保障新业务风险管控措施及相关制度的有效执行，确保风险可测、可控、可承受。

报告期内，公司新增沪深交易所债券做市业务、北交所股票做市业务、碳排放权投资业务，新增科创 50ETF 期权做市资格，及郑州商品交易所、上海期货交易所、大连商品交易所部分商品期货 / 期权品种的做市资格，为市场提供流动性。公司结合业务特点制定各类策略级和公司级风控指标，对风险敞口、持仓限额等进行统一管控，并进一步完善做市业务配套的系统建设与管控机制，将新增业务纳入风险管理体系，保障业务平稳运行。

（六）报告期内公司经营情况无重大变化，以及报告期内未发生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

二、报告期内主要经营情况

（一）主营业务分析

1、财务报表相关科目变动分析表

单位: 亿元 币种: 人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	183.69	161.66	13.63
营业成本	96.82	93.70	3.33
营业利润	86.87	67.96	27.83
归属于母公司股东的净利润	65.56	53.76	21.95
经营活动产生的现金流量净额	-52.47	302.23	不适用
投资活动产生的现金流量净额	-62.28	-39.13	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	59.81	-163.68	不适用
现金及现金等价物净增加额	-45.06	111.65	不适用

2、收入分析

(1) 收入分析

单位：万元 币种：人民币

业务类别	本期数	占总收入比例 (%)	上年同期数	上年同期占总收入比例 (%)	占比增减
财富管理业务	680,163.50	37.03	839,621.08	51.94	减少 14.91 个百分点
机构服务业务	407,867.66	22.20	251,734.20	15.57	增加 6.63 个百分点
投资管理业务	154,013.47	8.38	6,416.10	0.40	增加 7.98 个百分点
国际业务	387,531.76	21.10	316,250.90	19.56	增加 1.54 个百分点
其他	207,353.04	11.29	202,587.64	12.53	减少 1.24 个百分点

报告期内,本集团合计实现营业收入人民币 183.69 亿元,同比增加 13.63%。其中,财富管理业务收入人民币 68.02 亿元,同比减少 18.99%,主要是受市场波动影响,证券经纪业务收入有所下降所致;机构服务业务收入人民币 40.79 亿元,同比增加 62.02%,主要是由于平台化、策略化投资交易能力的迭代升级,投资交易业务收入增加所致;投资管理业务收入人民币 15.40 亿元,同比增加 2,300.42%,主要是私募股权基金及另类投资项目估值同比增加所致;国际业务收入人民币 38.75 亿元,同比增加 22.54%,主要是受益于华泰金控(香港)及 AssetMark 业绩的提升。

(2) 主营业务分行业、分地区情况

单位：万元 币种：人民币

分行业	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年同期增减 (%)	营业成本比上年同期增减 (%)	毛利率比上年同期增减
财富管理业务	680,163.50	277,546.30	59.19	-18.99	-30.72	增加 6.90 个百分点
机构服务业务	407,867.66	191,831.31	52.97	62.02	12.31	增加 20.82 个百分点
投资管理业务	154,013.47	53,810.16	65.06	2,300.42	32.04	增加 600.24 个百分点
国际业务	387,531.76	292,757.33	24.46	22.54	53.78	减少 15.34 个百分点
其他	207,353.04	152,286.13	26.56	2.35	13.31	减少 7.10 个百分点
合计	1,836,929.43	968,231.23	47.29	13.63	3.34	增加 5.25 个百分点

单位：万元 币种：人民币

分地区	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年同期增减 (%)	营业成本比上年同期增减 (%)	毛利率比上年同期增减
江苏地区	906,298.64	328,734.62	63.73	38.05	18.67	增加 5.93 个百分点
北京地区	15,075.49	13,183.35	12.55	280.48	-31.61	增加 399.05 个百分点
上海地区	158,731.93	59,945.17	62.23	20.74	74.67	减少 11.67 个百分点
广东地区	316,821.74	233,073.24	26.43	-28.99	-38.06	增加 10.77 个百分点
湖北地区	10,055.45	7,861.19	21.82	-8.27	-0.22	减少 6.31 个百分点
其他地区	42,414.42	32,676.33	22.96	-17.35	2.77	减少 15.08 个百分点
香港及海外	387,531.76	292,757.33	24.46	22.54	53.78	减少 15.34 个百分点
合计	1,836,929.43	968,231.23	47.29	13.63	3.34	增加 5.25 个百分点

3、成本分析

单位: 万元 币种: 人民币

业务类别	成本构成项目	本期金额	本期占总成本比例 (%)	上年同期金额	上年同期占总成本比例 (%)	本期金额较上年同期变动比例 (%)
财富管理业务		277,546.30	28.67	400,621.68	42.76	-30.72
机构服务业务		191,831.31	19.81	170,810.38	18.23	12.31
投资管理业务	营业支出	53,810.16	5.56	40,753.72	4.35	32.04
国际业务		292,757.33	30.24	190,373.73	20.32	53.78
其他		152,286.13	15.72	134,401.25	14.34	13.31

4、费用总体情况对比

单位: 万元 币种: 人民币

项目	本期数	上年同期数	增减金额	增减比例 (%)
业务管理费	863,046.39	761,188.39	101,858.00	13.38
所得税费用	133,495.14	122,110.18	11,384.96	9.32

报告期内, 本集团业务管理费为人民币 86.30 亿元, 同比增加人民币 10.19 亿元, 主要是由于员工成本及研发费用增加所致。

5、现金流分析

报告期内, 本集团现金流量如下表:

单位: 亿元 币种: 人民币

项目	本期数	上年同期数	增减金额	增减比例 (%)
经营活动产生的现金流量净额	-52.47	302.23	-354.70	不适用
投资活动产生的现金流量净额	-62.28	-39.13	-23.15	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	59.81	-163.68	223.49	不适用
现金及现金等价物净增加额	-45.06	111.65	-156.71	不适用

报告期内, 本集团经营活动产生的现金流量净额为人民币 -52.47 亿元, 同比减少人民币 354.70 亿元, 主要是本期拆入资金净增加额减少及融出资金净减少额减少所致。投资活动产生的现金流量净额为人民币 -62.28 亿元, 同比减少人民币 23.15 亿元, 主要是投资所支付的现金增加所致。筹资活动产生的现金流量净额为人民币 59.81 亿元, 同比增加人民币 223.49 亿元, 主要是偿还债务支付的现金减少所致。

报告期内, 本集团经营活动产生现金流量净额与本期净利润存在重大差异, 主要与本集团所处行业的现金流变动特点相关, 本集团的客户资金、投资交易、债券融资以及同业拆借等业务涉及的现金流量巨大, 且变动频繁, 经营活动的现金流变动与本期净利润关联度不高。

6、本集团业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

单位：亿元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数	变动比例(%)	主要影响因素
营业收入	183.69	161.66	13.63	投资交易收入增加
营业支出	96.82	93.70	3.33	业务及管理费增加
营业利润	86.87	67.96	27.83	营业收入增加
利润总额	79.97	67.74	18.05	营业收入增加
净利润	66.62	55.53	19.97	营业收入增加
项目	期末余额	期初余额	变动比例(%)	主要影响因素
资产	8,870.70	8,465.71	4.78	金融投资增加
负债	7,165.57	6,787.14	5.58	有息负债增加
股东权益	1,705.13	1,678.57	1.58	当年利润实现
归属母公司股东权益	1,675.04	1,650.95	1.46	当年利润实现

(二) 本集团无非主营业务导致利润重大变化的说明

(三) 资产、负债情况分析

1、资产及负债状况

单位：亿元 币种：人民币

项目名称	本期期末数	本期期末数 占总资产的 比例(%)	上年同期末数	上年同期末数 占总资产的 比例(%)	本期期末金额 较上年同期末变 动比例(%)	情况说明
货币资金	1,640.62	18.49	1,556.12	18.38	5.43	客户资金增加所致
存出保证金	401.95	4.53	427.07	5.04	-5.88	信用保证金下降所致
应收款项	99.62	1.12	78.04	0.92	27.65	应收经纪、交易商及结算所 款项增加所致
买入返售金融资产	173.90	1.96	348.24	4.11	-50.06	债券质押回购规模减少所致
交易性金融资产	3,892.20	43.88	3,515.46	41.53	10.72	投资交易规模增加所致
其他债权投资	153.94	1.74	105.04	1.24	46.55	投资交易规模增加所致
其他权益工具投资	2.71	0.03	2.42	0.03	11.98	投资交易规模增加所致
在建工程	4.20	0.05	1.96	0.02	114.29	在建工程增加所致
使用权资产	14.87	0.17	14.10	0.17	5.46	使用权资产增加所致
递延所得税资产	7.87	0.09	6.00	0.07	31.17	可抵扣暂时性差异增加所致
其他资产	22.38	0.25	24.58	0.29	-8.95	其他应收款减少所致

单位: 亿元 币种: 人民币

项目名称	本期期末数	本期期末数 占总负债的 比例 (%)	上年期末数	上年期末数 占总负债的 比例 (%)	本期期末金额 较上年期末变 动比例 (%)	情况说明
短期借款	136.64	1.91	79.97	1.18	70.86	信用借款增加所致
拆入资金	346.90	4.84	258.78	3.81	34.05	银行拆入资金增加所致
交易性金融负债	427.22	5.96	485.76	7.16	-12.05	交易性债务工具规模下降所致
衍生金融负债	139.24	1.94	96.38	1.42	44.47	权益类衍生金融负债增加所致
代理承销证券款	1.73	0.02	1.50	0.02	15.33	承销结算款增加所致
应付职工薪酬	105.95	1.48	118.93	1.75	-10.91	应付职工薪酬减少所致
应交税费	10.88	0.15	9.99	0.15	8.91	应交企业所得税增加所致
应付款项	1,127.22	15.73	1,052.98	15.51	7.05	应付交易款项增加所致
合同负债	2.77	0.04	2.19	0.03	26.48	合同负债增加所致
长期借款	6.58	0.09	8.05	0.12	-18.26	长期借款兑付所致
预计负债	7.12	0.10	-	-	-	预计负债增加所致
递延所得税负债	24.58	0.34	22.00	0.32	11.73	应纳税暂时性差异增加所致
其他负债	65.63	0.92	16.81	0.25	290.42	应付股利增加所致

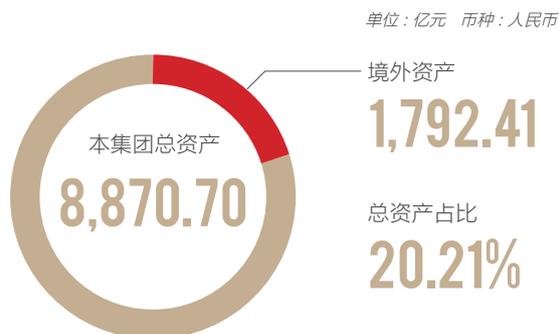
单位: 亿元 币种: 人民币

利润表项目	2023年 1—6月	2022年 1—6月	本期金额 较上期金额 变动比例 (%)	变动原因
经纪业务手续费净收入	31.53	35.54	-11.28	经纪业务手续费收入减少所致
投资银行业务手续费净收入	16.10	16.91	-4.79	投资银行业务手续费收入减少所致
资产管理业务手续费净收入	20.85	16.69	24.93	资产管理手续费增加所致
利息收入	72.63	67.58	7.47	金融投资利息收入增加所致
利息支出	-66.22	-53.73	不适用	有息负债利息支出增加所致
投资收益	93.52	7.41	1,162.08	金融工具投资收益增加所致
其他收益	0.91	1.14	-20.18	其他收益减少所致
公允价值变动收益	-22.86	34.77	不适用	公允价值变动损益减少所致
汇兑收益/(损失)	16.10	8.81	82.75	汇兑收益增加所致
其他业务收入	14.14	20.39	-30.65	大宗商品销售收入减少所致
税金及附加	0.97	1.05	-7.62	税金及附加减少所致
业务及管理费	86.30	76.12	13.37	员工成本及研发费增加所致

利润表项目	2023 年 1—6 月	2022 年 1—6 月	本期金额 较上期金额 变动比例 (%)	变动原因
信用减值损失	-4.18	-3.38	不适用	信用减值转回增加所致
其他业务成本	13.72	19.90	-31.06	大宗商品销售成本减少所致
营业外收入	0.32	0.01	3,100.00	营业外收入增加所致
营业外支出	7.21	0.24	2,904.17	营业外支出增加所致
所得税费用	13.35	12.21	9.34	所得税费用增加所致

2、境外资产情况

截至报告期末，本集团总资产为人民币 8,870.70 亿元，其中：境外资产人民币 1,792.41 亿元，占总资产的比例为 20.21%。



3、截至报告期末主要资产受限情况

报告期内，主要资产受限情况请参阅本报告财务报表附注十六、其他重要事项 -3 其他需要披露的重要事项 - (5) 所有权或使用权受到限制的资产。

4、资产结构和资产质量

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团归属于母公司的股东权益合计为人民币 1,675.04 亿元，较 2022 年年末增加人民币 24.09 亿元，增幅为 1.46%。

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团总资产为人民币 8,870.70 亿元，较年初增加人民币 404.99 亿元，增幅为 4.78%，主要是交易性金融资产、货币资金等增加所致。其中，本集团货币资金及结算备付金为人民币 2,029.88 亿元，占总资产的比率为 22.88%；存出保证金为人民币 401.95 亿元，占总资产的比率为 4.53%；融出资金为人民币 1,054.12 亿元，占总资产的比率为 11.88%；交易性金融资产为人民币 3,892.20 亿元，占总资产的比率为 43.88%；债权投资和其他债权投资为人民币 657.17 亿元，占总资产的比率为 7.41%；投资性房地产、固定资产、在建工程、使用权资产及无形资产占总资产的比率为 1.60%，大部分资产的变现能力较强，本集团资产流动性强，资产结构相对合理。

报告期内，本集团资产负债水平略有上升。截至 2023 年 6 月 30 日，本集团负债为人民币 7,165.57 亿元，较年初增加人民币 378.43 亿元，增幅为 5.58%，主要是本报告期内短期借款、拆入资金、应付款项等增加所致。截至 2023 年 6 月 30 日，本集团扣除代理买卖证券款、代理承销证券款后的资产负债率为 76.56%，同比增加 0.75 个百分点。

5、盈利能力情况分析

2023 年上半年，本集团坚定践行科技赋能下的财富管理和机构服务“双轮驱动”的核心战略，不断提升数字化运营能力，经营业绩同比大幅提升，综合实力稳居行业前列。

6、比较式会计报表中变动幅度超过 30% 以上项目的情况

比较式会计报表中变动幅度超过 30% 以上项目的情况请参阅本报告“经营层讨论与分析”“报告期内主要经营情况”“资产、负债情况分析”“资产及负债状况”中变动幅度超过 30% 以上项目的情况。

7、报表合并范围变更的说明

报告期内，报表合并范围变更的说明请参阅本报告财务报表附注六、合并范围的变更。

8、所得税政策情况分析

报告期内，公司所得税执行《中华人民共和国企业所得税法》和《中华人民共和国企业所得税法实施条例》。所得税的计算缴纳按照国家税务总局公告[2012]57号《国家税务总局关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的公告》的通知执行。本公司及本公司的境内子公司适用的所得税率为25%，本公司享受研究开发费用加计扣除优惠政策，本公司的香港子公司适用的利得税率为16.5%，本公司的其他境外子公司适用于其所在地当地所规定的所得税税率。

9、融资渠道和融资能力等情况分析

<p>融资渠道</p>	<p>从融资方式来看，公司的融资渠道有股权融资和债权融资两种方式。境内，公司的短期融资渠道包括通过银行间市场进行信用拆借，通过银行间市场和交易所市场进行债券回购，发行短期公司债券，通过机构间私募产品报价与服务系统和自建柜台市场发行收益凭证，向证金公司进行转融资等；中长期融资渠道包括发行公司债券、非公开公司债券、次级债券、永续次级债券以及股权再融资等融资方式。同时，公司还可以通过发行境外债券、中期票据，银团贷款等方式，融入境外资金，支持公司业务的发展。通过多年来卓有成效的努力，公司探索并建立了短、中、长相结合的多元化融资渠道，在公司业务发展过程中发挥关键作用。</p>
<p>负债结构</p>	<p>截至2023年6月30日，本集团总负债为人民币7,165.57亿元，扣除代理买卖证券款、代理承销证券款后，本集团自有负债为人民币5,570.29亿元。自有负债主要包括：短期借款、拆入资金及应付短期融资款（短期公司债、短期收益凭证等）为人民币751.17亿元，占比13.49%；卖出回购金融资产款为人民币1,459.65亿元，占比26.20%；长期借款及应付债券（公司债、次级债、长期收益凭证等）为人民币1,433.01亿元，占比25.73%；交易性金融负债及衍生金融负债为人民币566.46亿元，占比10.17%；应付款项为人民币1,127.22亿元，占比20.24%。</p> <p>报告期内，公司负债规模小幅增长，公司不断加强流动性管理，采取多项有效措施防范流动性风险。目前，公司无到期未偿还的债务，公司整体偿债能力较强，流动性风险可控。</p>
<p>流动性管理政策和措施</p>	<p>公司一贯重视流动性管理，资金管理坚持以“全额集中、统一调配、分类计价、及时监控”的原则，在经营发展战略上注重业务规模与负债相匹配，通过合理的资产配置和多元化的负债融资，确保资产负债的期限、规模的合理配比，确保公司保持适度流动性。</p> <p>公司按照集中管理、分层防控的管理模式，遵循全面性、审慎性、预见性的总体原则进行流动性风险管理，依托全面风险管理架构建立流动性风险管理组织体系，建立健全与公司战略相适应的流动性风险管理体系，贯彻实施偏好为“稳健安全”的流动性风险管理政策，即公司确保不发生对持续经营造成重大影响的流动性风险，全力保障公司各项业务稳健、安全发展。</p> <p>为确保流动性安全，公司采取的主要措施包括：一是持续完善资金计划体系，建立流动性日监控体系，并通过平台实现资金头寸管理和现金流量日间监控，确保日间流动性安全；二是加强资产负债期限匹配管理，建立优质流动资产储备，提高融资的多元化和稳定程度；三是升级改造司库管理平台，实现通过信息系统对流动性风险实施有效的识别、计量、监测和控制，确保流动性风险可测、可控和可承受；四是分析压力情景下公司的现金流量和流动性风险监管指标，评估公司的流动性风险承受能力，并对压力测试结果进行分析，不断提升公司流动性风险应对能力；五是以并表监管为抓手，持续加强对子公司流动性风险的辅导力度，并对境外子公司实行资金及流动性风险的垂直管理，对核心风险点提出一揽子管控措施，增强子公司的流动性风险应对能力，提升集团流动性风险防控水平；六是组织流动性风险应急计划的制定、演练和评估，提升公司的流动性风险应急能力；七是完善流动性风险报告体系，确保管理层及时了解集团流动性风险水平及其管理状况。</p> <p>报告期内，公司流动性覆盖率（LCR）和净稳定资金率（NSFR）持续满足监管要求，并保有足够的安全空间。</p>

融资能力及融资策略分析

公司经营规范，信誉良好，资本实力、盈利能力和偿债能力较强，与商业银行保持良好的合作关系，有充足的银行授信额度。截至报告期末，公司获得商业银行的授信总额度约人民币 5,700 亿元，具备较强的短期和中长期融资能力。截至报告期末，经联合资信评估股份有限公司评定，本公司主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定；经上海新世纪资信评估投资服务有限公司综合评定，本公司主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。经标准普尔综合评定，本公司主体长期评级为 BBB+，评级展望为稳定；经穆迪综合评定，本公司主体长期评级为 Baa1，评级展望为稳定。作为上市券商，公司也可以通过股权再融资的方式，解决长期发展的资金需求。

就公司而言，为兼顾流动性和收益性，持有一定金额的固定收益产品，利率变动将对公司持有现金所获利息收入、所持有债券投资的市场价格及投资收益等带来直接影响；融资融券等资本中介业务、公司债券融资等与利率直接相关，给相应的利息收入和融资利息支出等带来直接影响；同时，公司的股票投资也受到利率变动的间接影响。此外，因公司有境外注册的子公司，以外币投入资本金，公司持有外币资金和资产，汇率的变动将对公司财务状况产生一定影响。公司通过及时调整各类资产结构，优化资产负债配置结构，加强对利率和汇率市场的研究，运用相应的利率、汇率等衍生金融工具来规避风险和减轻上述因素的影响。

（四）投资状况分析

1、对外股权投资总体分析

截至报告期末，本集团长期股权投资人民币 201.49 亿元，较期初人民币 192.41 亿元增加人民币 9.08 亿元，增幅为 4.72%。本集团对外股权投资总体情况请参阅本报告财务报表附注五、合并财务报表项目注释—12、长期股权投资。

（1）本公司重大的股权投资

本公司重大的股权投资情况请参阅本报告财务报表附注十七、母公司财务报表主要项目注释—1、长期股权投资。

（2）本公司无重大的非股权投资

（3）以公允价值计量的金融资产

单位：元 币种：人民币

资产类别	期初数	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	本期变动	期末数
交易性金融资产	351,546,008,749.87	4,364,568,690.44	-	-	37,673,866,602.40	389,219,875,352.27
其他债权投资	10,504,379,072.24	-	49,369,717.77	44,079,879.70	4,889,845,754.43	15,394,224,826.67
其他权益工具投资	241,586,793.58	-	19,511,192.72	-	29,191,493.66	270,778,287.24
衍生金融工具	6,150,175,729.69	-6,616,689,943.93	41,749,661.01	-	-5,034,085,254.33	1,116,090,475.36
合计	368,442,150,345.38	-2,252,121,253.49	110,630,571.50	44,079,879.70	37,558,818,596.16	406,000,968,941.54

本集团证券投资情况和私募基金投资情况请参阅本报告财务报表附注五、合并财务报表项目注释—8、交易性金融资产，衍生品投资情况请参阅本报告财务报表附注五、合并财务报表项目注释—4、衍生金融工具。

（4）报告期内，本公司不存在重大资产重组整合情况

2、募集资金使用情况

(1) 募集资金总体使用情况

① A 股募集资金总体使用情况

(a) A 股首次公开发行股票募集资金使用情况

经中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》(证监许可[2010]138号)核准,本公司于2010年2月9日向社会公众公开发行人民币普通股股票784,561,275股,每股面值人民币1.00元,每股发行价格人民币20.00元,共募集资金人民币15,691,225,500.00元。扣除承销费和保荐费人民币130,000,000.00元后的募集资金为人民币15,561,225,500.00元,上述募集资金于2010年2月12日全部到位,并经江苏天衡会计师事务所有限公司以“天衡验字(2010)009号”验资报告验证。截至2012年12月31日,公司首发募集资金本金已全部使用完毕,累计使用募集资金人民币156.81亿元(含募集资金利息人民币11,980.82万元),公司募集资金专用账户已全部办理销户结息手续。

(b) A 股非公开发行股票募集资金使用情况

经中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司非公开发行股票的批复》(证监许可[2018]315号)核准,本公司于2018年7月完成非公开发行人民币普通股(A股)股票发行,共计发行普通股(A股)股票1,088,731,200股,每股面值人民币1.00元,每股发行价格人民币13.05元,共募集资金人民币14,207,942,160.00元。扣除与本次非公开发行相关的发行费用(包括承销保荐费、律师费、会计师费、信息披露费、发行登记费、印花税等费用)人民币74,736,488.79元后募集资金净额为人民币14,133,205,671.21元,上述募集资金已于2018年7月31日全部到位,并经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)以“毕马威华振验字第1800286号”验资报告验证。截至2019年12月31日,公司非公开发行募集资金已全部使用完毕,累计使用募集资金人民币141.84亿元(含募集资金利息),募集资金专用账户已办理销户手续。

② H 股募集资金总体使用情况

经中国证监会核准,本公司于2015年完成H股股票发行,H股募集资金已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具毕马威华振验字第1501031号验资报告。根据毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)出具的《验资报告》,公司2015年首次公开发行H股共募集资金净额折合人民币30,587,689,604.94元(扣除相关上市费用),扣除承销发行费用后共募集资金折合人民币30,015,054,696.76元。截至2020年12月31日,本公司H股募集资金已全部使用完毕,累计使用H股募集资金折合人民币306.66亿元(含募集资金产生的利息收入),相关账户已办理销户手续。

③ GDR 募集资金总体使用情况

经中国证监会《关于核准华泰证券股份有限公司发行全球存托凭证并在伦敦证券交易所上市的批复》(证监许可[2018]1993号)核准,本公司于2019年6月完成GDR发行,共计发行82,515,000份GDR,每份GDR发行价格为20.50美元,共募集资金美元1,691,557,500.00元,扣除与本次GDR相关的发行费用美元39,961,513.72元后募集资金净额为美元1,651,595,986.28元,按照募集资金到账日人民币兑美元中间价折算为人民币11,313,036,931.20元。上述募集资金已于2019年6月28日全部到位,并经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,出具了毕马威华振验字第1900393号验资报告。截至2021年12月31日,本公司GDR募集资金已全部使用完毕,累计使用GDR募集资金美元16.74亿元(含募集资金产生的利息收入),相关账户已办理销户手续。

募集资金总体使用情况

单位：万元 币种：人民币

募集年份	募集方式	募集资金总额	本报告期已使用募集资金总额	已累计使用募集资金总额	尚未使用募集资金总额	尚未使用募集资金用途及去向
2019年	GDR 发行	1,131,303.69	-	1,158,666.14	-	-
2018年	非公开发行（A股）	1,420,794.22	-	1,418,421.26	-	-
2015年	首次发行（H股）	3,058,768.96	-	3,066,604.63	-	-
2010年	首次发行（A股）	1,556,122.55	-	1,568,103.37	-	-
合计	-	7,166,989.42	-	7,211,795.40	-	-

(2) 报告期内，本公司不存在募集资金承诺项目情况

(3) 报告期内，本公司不存在募集资金变更项目情况

3、非募集资金项目情况

报告期内，公司不存在项目投资总额超过上年度末经审计净资产 10% 的非募集资金投资项目。

4、报告期内，本公司不存在重大资产和股权出售情况

5、报告期内，本公司不存在破产重整，兼并或分立，重大的资产处置、收购、置换、剥离，重组其他公司情况等



6、主要控股参股公司分析

名称	公司持股比例	地址	设立时间	注册资本	总资产	净资产	营业收入	利润总额	净利润
华泰证券(上海)资产管理有限公司	100%	中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室	2014/10/16	260,000.00	920,615.66	817,495.43	99,370.96	71,715.87	54,917.11
主营业务: 证券资产管理业务, 公开募集证券投资基金管理业务。(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)。									
华泰国际金融控股有限公司	100%	中国香港皇后大道中99号中环中心62楼	2017/4/5	10,200,000,002.00元	19,386,740.62万元	1,911,130.78万元	684,582.47万元	90,689.36万元	65,912.40万元
主营业务: 控股公司。									
华泰紫金投资有限责任公司	100%	中国江苏省南京市汉中中路180号	2008/8/12	600,000.00	1,371,919.09	999,227.18	18,253.83	10,447.94	7,185.27
主营业务: 股权投资, 股权投资, 投资于与股权投资、股权投资相关的其他投资基金; 股权投资、股权投资的投资顾问、投资管理、财务顾问服务。(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)。									
华泰创新投资有限公司	100%	中国上海市市长宁区武夷路234号	2013/11/21	350,000.00	433,166.52	389,902.98	18,157.67	10,676.47	8,594.97
主营业务: 一般项目: 以自有资金从事投资活动; 投资管理; 金属链条及其他金属制品销售; 酒店管理; 健身休闲活动【分支机构经营】; 干洗服务【分支机构经营】; 打字复印【分支机构经营】; 停车场服务【分支机构经营】; 会议及展览服务【分支机构经营】; 旅游开发项目策划咨询【分支机构经营】; 票务代理服务【分支机构经营】。(除依法须经批准的项目外, 凭营业执照依法自主开展经营活动)。许可项目: 住宿服务【分支机构经营】; 餐饮服务【分支机构经营】; 食品销售【分支机构经营】; 高危险性体育运动(游泳)【分支机构经营】。(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, 具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准)。									
华泰期货有限公司	100%	中国广州市南沙区横沥镇明珠三街1号10层1001-1004、1011-1016房	1995/7/10	393,900.00	7,627,357.44	480,679.90	148,812.58	19,870.37	14,473.49
主营业务: 商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售。(依法须经批准的项目, 经相关部门批准后方可开展经营活动)。									
华泰联合证券有限责任公司	99.92%	中国深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇B7栋401	1997/9/5	99,748.00	695,201.27	459,219.51	149,054.81	8,043.82	6,260.67
主营业务: 证券承销与保荐业务(国债、非金融企业债务融资工具、金融债券承销业务除外); 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问; 中国证监会批准的其他业务。									
江苏股交交易中心有限责任公司	52%	中国江苏省南京市建邺区江东中路377号金融城10号楼3层	2013/7/4	20,000.00	51,343.31	45,344.05	1,705.16	630.51	471.61
主营业务: 为非上市公司股权、债券、资产和相关金融及其衍生品的批准募集挂牌、登记、托管、交易、融资、结算、过户、分红、质押等提供场所、设施和服务, 组织和监督交易市场活动, 发布市场信息, 代理本交易市场内挂牌产品买卖服务, 为市场参与方提供咨询服务。(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)。									
南方基金管理股份有限公司	41.16%	中国深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼	1998/3/6	36,172.00	1,368,605.53	931,595.10	352,131.39	130,082.49	98,480.85
主营业务: 基金募集、基金销售、资产管理和国务院证券监督管理机构许可的其他业务。									
华泰柏瑞基金管理有限公司	49%	中国(上海)自由贸易试验区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层	2004/11/18	20,000.00	246,480.25	159,669.36	81,635.64	30,993.38	23,747.93
主营业务: 基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。									
江苏银行股份有限公司	5.59%	中国江苏省南京市中华路26号	2007/1/22	1,154,445.00	329,458,271.00	23,830,223.50	3,884,287.10	2,243,365.90	1,762,596.40
主营业务: 吸收公众存款; 发放短期、中期和长期贷款; 办理国内结算; 办理票据承兑与贴现; 发行金融债券; 代理发行、代理兑付、承销政府债券; 承销短期融资券; 买卖政府债券、金融债券; 从事同业拆借; 提供信用证服务及担保; 代理收付款项及代理保险业务; 代客理财、代理销售贵金属、代理收付和保管集合资金信托计划; 提供保险箱业务; 办理委托贷款业务; 从事银行卡业务; 外汇存款; 外汇贷款; 外汇汇款; 外币兑换; 结售汇; 代理远期结售汇; 国际结算; 自营及代客外汇买卖; 同业外汇拆借; 买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券; 资信调查、咨询、见证业务; 网上银行; 经银行业监督管理机构和有关部门批准的其他业务。(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: 1、2023年8月, 公司通过北京产权交易所以摘牌方式受让了华泰联合证券另一股东中国东方航空集团有限公司所持有的华泰联合证券0.0812%股权。目前, 华泰联合证券正在办理股权变更涉及的工商变更登记等手续。
 2、2023年7月6日, 江苏银行发布《关于变更注册资本本获监管机构核准的公告》, 江苏银保监会同意其注册资本因配股、可转债转股由人民币11,544,450,000元变更为人民币14,769,656,700元。同月, 江苏银行根据《江苏银保监会关于江苏银行变更注册资本的批复》完成了相关变更手续的办理。
 3、2023年2月22日, 江苏银行召开2023年第一次临时股东大会, 审议通过《关于修订江苏银行股份有限公司章程的议案》, 其中涉及及经营范围修订, 该事项尚需国家金融监督管理总局江苏监管局核准。

7、报告期内取得和处置子公司的情况

报告期内取得和处置子公司的情况请参阅本报告财务报表附注六、合并范围的变更。

8、公司控制的结构化主体情况

本集团合并的结构化主体主要是指本集团同时作为管理人和 / 或投资者的资产管理计划。本集团综合评估本集团因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的报酬是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。于 2023 年 6 月 30 日，本集团共合并 61 个结构化主体，合并结构化主体的总资产为人民币 83,093,634,934.18 元。本集团在上述合并结构化主体中的持有的权益体现在资产负债表中交易性金融资产的金额为人民币 76,808,656,261.05 元。

三、其他披露事项

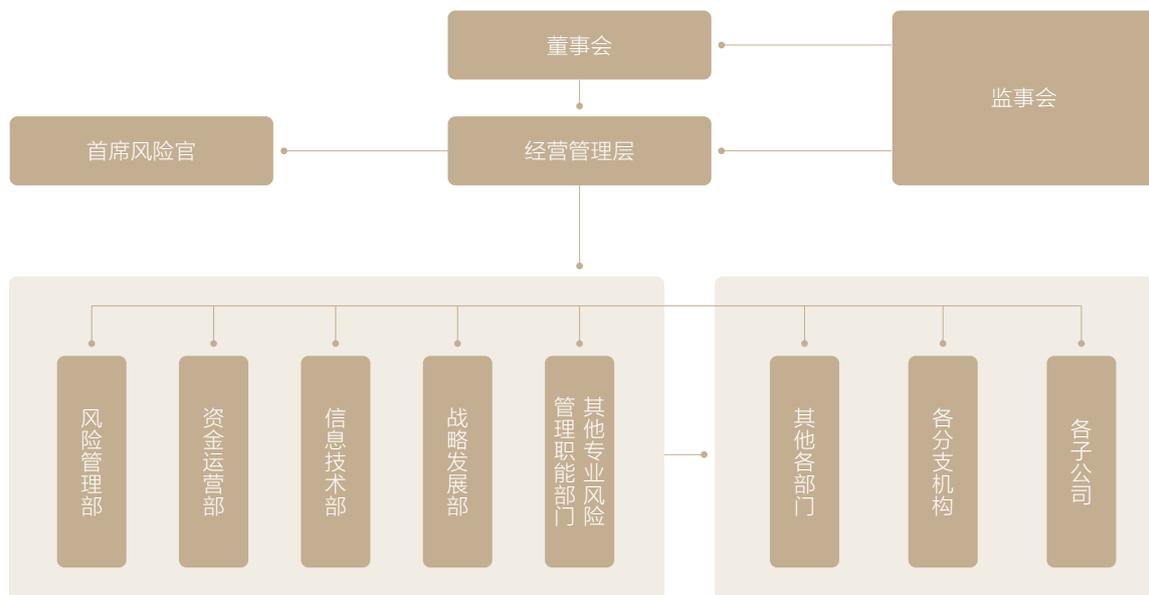
（一）可能面对的风险及风险防范措施

1、风险管理概况

公司高度重视风险管理工作，根据监管要求及业务发展实际情况，以全员、覆盖、穿透为核心理念，建立了较为完善的全面风险管理体系。公司风险管理组织架构健全有效、职责定位清晰，各层级有效履职；公司制定了风险偏好和容忍度体系，与公司发展战略有机结合，建立了多层级完备的风险管理制度体系，覆盖业务经营及管理的各环节；公司大力推进集团化风险管理技术系统的建设，构建集中、时效、量化、穿透的风险管理技术支柱，提升集团风险管理效果，进一步增强集团总体风险识别、量化评估和控制的能力。公司将各子公司纳入集团全面风险管理体系，探索构建有效的子公司风险管理模式，大力深化专业风险条线集中统一穿透管理。公司全面风险管理体系运行有效，切实保障了公司各项业务的持续健康发展。

报告期内，公司持续深入重点业务和风险领域强化管控，提升风险管理体系有效性，平台化赋能风险管理提质增效。公司强化业务风险前瞻识别，提升重点业务领域风险监测和管控能力，打造深入业务全生命周期的风险管理能力。公司进一步夯实跨境一体化的风险管理体系和能力，持续升级与业务发展相匹配的专业风险管理体系，提升管理精细度，深化管理穿透度。公司持续推动跨区域、多市场、多品种、一体化的风险管理平台建设，重点升级风险分析评估和监测预警等核心功能模块，加大风险计量引擎建设力度，平台化赋能风险管理价值创造职能，保障业务平稳健康发展。

2、风险管理架构



公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及合规与风险管理委员会，监事会，经营管理层及风险控制委员会，风险管理部及各类专业风险管理部门，其他各部门、分支机构及子公司。

公司董事会承担公司全面风险管理的最终责任，负责审议批准公司全面风险管理的基本制度，批准公司的风险偏好、风险容忍度及重大风险限额，审议公司定期风险评估报告等。公司董事会设合规与风险管理委员会，对风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的风险评估报告进行审议并提出意见等。

公司监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。公司经营管理层根据董事会的授权和批准，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，公司经营管理层对全面风险管理承担主要责任。公司经营管理层下设风险控制委员会，根据经营管理层授权负责经营过程中风险管理事项的决策，并对各业务条线进行风险承担的授权。公司设首席风险官，负责分管领导公司全面风险管理工作。

公司指定风险管理部履行全面风险管理职责，并牵头管理公司的市场风险、信用风险和操作风险；指定资金运营部负责牵头管理公司的流动性风险；指定信息技术部负责牵头管理公司的信息技术风险；指定战略发展部负责牵头管理公司的声誉风险。公司其他各部门、分支机构及子公司对各自条线的各类风险管理工作负责，负责落实公司及各类专业风险牵头管理部门制定的各项政策、流程和措施，接受各类风险牵头管理部门的指导以及对各类风险管理、执行责任的分解。稽查部将全面风险管理纳入审计范畴，对全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价，并负责牵头或委托外部专业机构定期对公司全面风险管理体系进行评估。

3、市场风险

市场风险是指由于股价、利率、汇率、商品等风险因子波动导致公司资产损失的风险。

报告期内，受硅谷银行破产危机、美联储加息预期变化等因素影响，全球资本市场波动显著。公司坚持交易创造价值、对冲控制风险的理念，积极控制风险敞口，通过各项风险管控措施管理持仓资产的市场风险。公司持续优化统一的风险限额体系，及时评估新业务风险，并从市场风险价值（VAR）、止损、压力测试、敏感性等多个维度对各业务进行管控。公司持续完善压力测试体系，定期计量各类极端风险影响，及时发现并评估尾部风险承受能力。权益类证券投资方面，公司主动通过多种对冲方式管理风险敞口，规避市场大幅波动，同时在控制投资组合下行风险的前提下，积极发掘交易机会，并注重投资标的的市场流动性及持仓资产的高度分散化。固定收益类证券投资方面，公司通过利率衍生品有效对冲市场风险，调整持仓结构以应对期限结构上利率波动对投资组合带来的冲击，在控制整体久期、基点价值及 VAR 值的基础上，积极寻找定价偏差机会以增厚整体收益。衍生品业务方面，公司的场外衍生品业务采取市场中性的策略，将 Delta、Gamma、Vega 等希腊值敞口风险控制可在承受范围内，在风险可控的前提下创造盈利机会。

市场风险价值（VAR）情况

币种：人民币

前瞻期：1 日，置信度 95%，历史模拟法，单位（万元）

	本公司		本集团	
	2023 年中期末	2022 年中期末	2023 年中期末	2022 年中期末
权益敏感性金融工具	7,453	8,637	13,009	15,251
利率敏感性金融工具	5,106	3,998	5,124	4,300
商品敏感性金融工具	200	282	127	396
整体组合风险价值	9,246	9,308	13,401	15,994

数据来源：公司内部统计。

报告期内，市场风险价值（VAR）序列描述性统计量情况

币种：人民币

前瞻期：1 日，置信度 95%，历史模拟法，单位（万元）

	期初	期末	最大值	最小值
本集团	14,378	13,401	21,022	8,452
本公司	7,849	9,246	14,115	6,243

数据来源：公司内部统计。

4、信用风险

信用风险是指因融资方、发行人或交易对手等违约导致损失的风险。

融资类业务信用风险管理方面，公司执行严格的风险客户与风险资产持续监控、及时化解的管理措施，强化动态的逆周期调节机制，建立市场系统性风险监测及应对机制，以控制业务常规风险、防范底线风险、灵活调节业务结构。发行人信用风险管理方面，公司建立信用债发行人统一监控平台，实现集团各业务信用债标的的统一监控，同时公司深化信用债全流程风险管控，建立常态化的风险券筛查处置机制，持续强化持仓债券监控预警机制，提升集团发行人信用风险防控成效。交易对手信用风险管理方面，公司持续推进交易对手统一管理体系及管理系统优化建设，并根据内外部舆情进一步加强对交易对手授信管理，严控尾部风险，对于担保交收类业务，持续完善风险指标设计的前端管控并推进系统化建设，强化风险事件处理和风险传导管控能力。公司持续优化完善信用风险统一管理体系，提升应对外部复杂信用环境的能力，为各类信用业务发展提供强有力的风控保障。报告期内，公司未发生重大信用风险事件，各项业务平稳运行。

5、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。

公司一贯重视流动性安全，并秉持“稳健安全”的流动性风险偏好，遵循全面性、重要性、适用性、有效性、审慎性和预见性的总体原则，按照集中管理、分层防控的管理模式，持续强化流动性风险的识别、计量、监测和控制机制，提升公司流动性风险管理水平。在掌握整体流动性风险的基础上，公司通过定期的存量流动性风险梳理和不定期的新业务评估，识别各条业务线潜在的流动性风险，并提出针对性的管控措施。公司搭建了包括现金流在内的流动性指标分析框架，并适当设置风险限额，通过信息技术系统实施每日监控，提升流动性风险的监控频率和控制水平。同时，公司不断完善资金计划体系，强化资金头寸管理和建立流动性日间监控体系，及时掌握业务用款情况及日间支付进度，进一步将流动性风险防控的阵线前移。公司定期和不定期开展流动性风险专项压力测试，从现金流量和流动性指标角度评估公司在压力情境下的流动性风险承受能力，并针对性改进和提升公司流动性风险抗压能力。为确保在压力情景下能够及时满足流动性需求，公司根据风险偏好建立规模适当的优质流动性资产储备，同时，多角度拓宽负债融资渠道和额度，以及持续提升公司的常规和应急融资能力。公司建立了流动性风险应急预案并定期开展演练，根据公司情况持续优化流动性应急处置机制。此外，公司以并表监管试点为抓手持续加强对子公司流动性风险管理的辅导力度，尤其是对香港子公司进行垂直管理，加大对其流动性的管理力度，提高子公司的流动性风险应对能力，提升集团整体流动性风险防控水平。报告期内，公司流动性覆盖率（LCR）和净稳定资金率（NSFR）持续满足监管要求，并保有足够的安全空间。

6、操作风险

操作风险是指由不完善或有问题的内部程序、人员、系统或外部事件所造成公司损失的风险。

报告期内，公司以制度及流程管控为基础，持续强化操作风险识别梳理精细度，多途径提升集团操作风险管控质效。公司以高剩余风险领域飞行测试及专项检查为抓手，通过强化对重点业务、重点环节以及新业务开展情况的回溯自查和检查，保障风险管控措施的有效落地；以过程管控为手段，实现贯穿风险感知、识别评估、应对处置、整改跟踪的闭环管控链路；以操作风险管理工具为基础，深化与子公司的沟通及分析机制，加大待优化事项分析及跟踪力度，督办整改进展，力抓落实；以风险文化宣导为路径，输入输出相结合，多措并举强化操作风险文化宣导力度，赋能业务发展，推动操作风险管理文化在集团入脑入心。

7、合规风险

合规风险是指因公司或工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规或准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。

报告期内，公司持续完善合规管理体系，优化合规管理机制，从制度、理念、方式等维度不断提升。进一步加强数字合规体系能力建设，搭建专业、高效的数字合规能力基座，持续丰富数字合规工具；持续完善业务合规管理机制，加大对重点业务的管控和支持力度，加强对业务实质的深刻理解，促进新业务、新模式稳妥落地；强化合规人员能力建设和合

规协同，多措并举强化员工合规执业意识。

8、信息技术风险

信息技术风险是指公司信息系统因内、外部原因发生技术故障或数据泄露，导致系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据安全等方面不能持续保障交易与业务管理稳定、高效、安全运行，从而造成损失的风险。

公司各项业务及中后台管理均高度依赖于信息技术系统，信息系统已成为支撑公司业务运转的关键保障。报告期内，公司持续推进信息技术管理制度建设，加强信息技术重点领域风险管控，不断完善管理技术和手段，完善风险监测预警机制，并通过专项检查、考核评价、风险文化宣导等措施，进一步提升信息技术风险管理能力和有效性。公司持续加强信息系统安全建设，制定了完备的网络和信息安全事件应急预案，定期或不定期开展应急预案评估与应急演练。报告期内，公司重要信息系统安全平稳运行，未发生重大信息技术风险事件。

9、声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件、及其工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害其品牌价值，不利其正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。

报告期内，公司声誉风险管理机制运行平稳，未发生重大声誉风险事件。公司围绕战略和重点业务，持续加强声誉风险的防范、监测和处置工作，为公司发展营造良好的媒体环境。同时，持续强化集团化管理、事前管理、快速响应机制，进一步提升声誉风险防范意识和应对能力。

10、模型风险

模型风险是指错误或不适当的模型设计、开发或使用对公司业务造成不良后果或损失的风险。

报告期内，公司针对模型的全生命周期，进行全面和主动管理，通过模型验证、评估和事中监测等方法与措施，持续加强模型风险管控。公司不断建立健全与自身业务发展相适应的模型风险管理体系，完善管理制度和组织架构，完善模型信息数据库功能。

(二) 报告期内，本公司无其他应披露而未披露的事项

3

公司治理
Corporate Governance



公司治理

CORPORATE GOVERNANCE

一、股东大会、董事会、监事会会议情况简介

1、报告期内召开的股东大会有关情况

会议届次	召开日期	会议议案	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
2022 年 度股东大会	2023 年 6 月 30 日	1、审议公司 2022 年度董事会工作报告； 2、审议公司 2022 年度监事会工作报告； 3、审议公司 2022 年度财务决算报告； 4、审议关于公司 2022 年度报告的议案； 5、审议关于公司 2022 年度利润分配的议案； 6、审议关于预计公司 2023 年日常关联交易的议案； 7、审议关于预计公司 2023 年自营投资额度的议案； 8、审议关于公司续聘会计师事务所的议案； 9、审议公司独立董事 2022 年度履职报告； 10、审议关于公司回购注销部分 A 股限制性股票的议案； 11、审议关于延长公司境内外债务融资工具一般性授权决议有效期的议案； 12、听取关于公司董事 2022 年度绩效考核和薪酬情况的报告； 13、听取关于公司监事 2022 年度绩效考核和薪酬情况的报告； 14、听取关于公司高级管理人员 2022 年度履行职责、绩效考核和薪酬情况的报告。	http://www.sse.com.cn/ http://www.hkexnews.hk/ http://www.londonstockexchange.com/ http://www.htsc.com.cn/	2023 年 7 月 1 日	所有 议案 均审 议通 过
2023 年 第二次 A 股类别股 东会	2023 年 6 月 30 日	审议关于公司回购注销部分 A 股限制性股票的议案。	http://www.sse.com.cn/ http://www.hkexnews.hk/ http://www.londonstockexchange.com/ http://www.htsc.com.cn/	2023 年 7 月 1 日	议案 审议 通过

会议 届次	召开 日期	会议 议案	决议刊登的指定网站 的查询索引	决议刊 登的披 露日期	会议 决议
2023 年 第二次 H 股类别股 东会	2023 年 6 月 30 日	审议关于公司回购注销部分 A 股限制性股票的议案。	http://www.sse.com.cn/ http://www.hkexnews.hk/ http://www. londonstockexchange.com/ http://www.htsc.com.cn/	2023 年 7 月 1 日	议案 审议 通过

股东大会情况说明

公司于 2023 年 2 月 7 日公告，原计划于 2023 年 2 月 10 日召开的公司 2023 年第一次临时股东大会、2023 年第一次 A 股类别股东会、2023 年第一次 H 股类别股东会延期召开。

2、报告期内召开的董事会有关情况

会议 届次	召开 日期	会议形式 及地点	会议议案	会议 决议
第六届董事 会第二次会 议	2023 年 3 月 30 日	现场及视频会议 方式。 地点：南京市江 东中路 228 号华 泰证券广场一号 楼十二楼大会议 室、北京市西城 区丰盛胡同 28 号 太平洋保险大厦 A 座 18 层第六会 议室、上海市浦 东新区东方路 18 号保利大厦 25 层 华泰证券上海分 公司仿真会议室、 香港皇后大道中 99 号中环中心 62 楼华泰金融控股 (香港)有限公司 仿真视频北京会 议室。	1、审议公司 2022 年度经营管理层工作报告； 2、审议公司 2022 年度财务决算报告； 3、审议公司 2023 年度财务预算报告； 4、审议关于公司 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件 成就的议案； 5、审议关于公司回购注销部分 A 股限制性股票的议案； 6、审议关于公司 2022 年度利润分配的预案； 7、审议公司 2022 年度董事会工作报告； 8、审议关于公司 2022 年度报告的议案； 9、审议关于公司 2022 年度合规报告的议案； 10、审议关于公司 2022 年度风险管理报告的议案； 11、审议关于公司 2022 年度内部控制评价报告的议案； 12、审议关于公司 2022 年度信息技术管理专项报告的议案； 13、审议关于公司 2022 年度社会责任报告的议案； 14、审议关于预计公司 2023 年日常关联交易的预案； 15、审议关于预计公司 2023 年自营投资额度的预案； 16、审议公司 2023 年度内部审计工作计划； 17、审议关于公司续聘会计师事务所的议案； 18、审议关于延长公司境内外债务融资工具一般性授权决议有效期的议案； 19、审议关于《公司对标世界一流企业价值创造行动实施方案》的议案； 20、审议关于公司董事 2022 年度绩效考核和薪酬情况的报告； 21、审议关于公司高级管理人员 2022 年度履行职责、绩效考核和薪酬情况 的报告； 22、审议公司独立董事 2022 年度履职报告； 23、审议关于召开公司年度股东大会、A 股类别股东会及 H 股类别股东会的 议案； 24、听取公司董事会审计委员会 2022 年度履职情况报告； 25、听取公司 2022 年度合规总监工作报告； 26、听取公司 2022 年度反洗钱工作报告； 27、听取关于公司 2022 年度内部审计工作情况的报告； 28、审查关于公司 2022 年度净资产等风险控制指标具体情况的报告。	所有 议案 均审 议通 过

会议届次	召开日期	会议形式及地点	会议议案	会议决议
第六届董事会第三次会议	2023年4月28日	现场及视频会议方式。 地点：南京市江东中路228号华泰证券广场一号楼十二楼大会议室、北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦A座18层第六会议室、上海市浦东新区东方路18号保利大厦25层华泰证券上海分公司仿真会议室、香港皇后大道中99号中环中心62楼华泰金融控股(香港)有限公司仿真视频北京会议室。	1、审议关于变更公司会计政策的议案； 2、审议关于公司2023年第一季度报告的议案。	所有议案均审议通过

3、报告期内召开的监事会有关情况

会议届次	召开日期	会议形式及地点	会议议案	会议决议
第六届监事会第二次会议	2023年3月30日	现场方式。 地点：南京市江东中路228号华泰证券广场一号楼十二楼小会议室。	1、审议公司2022年度监事会工作报告； 2、审议关于公司A股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件成就的议案； 3、审议关于公司回购注销部分A股限制性股票的议案； 4、审议关于公司2022年度利润分配的预案； 5、审议关于公司2022年度报告的议案； 6、审议关于公司2022年度内部控制评价报告的议案； 7、审议关于公司监事2022年度绩效考核和薪酬情况的报告； 8、听取关于公司2022年度内部审计工作情况的报告； 9、听取公司2023年度内部审计工作计划。	所有议案均审议通过
第六届监事会第三次会议	2023年4月28日	现场及视频会议方式。 地点：南京市江东中路228号华泰证券广场一号楼十二楼小会议室。	1、关于变更公司会计政策的议案； 2、关于公司2023年第一季度报告的议案。	所有议案均审议通过

二、董事会审计委员会及审计事项

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联交所《上市规则》的规定。公司第六届董事会审计委员会由独立董事与股东单位派驻的董事组成。截至报告期末，公司审计委员会共 3 人，独立董事占多数，成员包括王兵先生、丁锋先生、谢涌海先生，其中王兵先生为审计委员会主任委员（召集人）。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。

报告期内，公司董事会审计委员会共召开了 4 次会议。具体情况如下：

- 1、公司第六届董事会审计委员会 2023 年第一次会议于 2023 年 1 月 17 日以现场及视频会议方式召开，会议听取了德勤事务所相关人员关于公司 2022 年 A+H+G 股年度审计工作安排及预审工作情况的汇报等。
- 2、公司第六届董事会审计委员会 2023 年第二次会议于 2023 年 2 月 24 日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于公司 2022 年度审计计划的议案》。
- 3、公司第六届董事会审计委员会 2023 年第三次会议于 2023 年 3 月 28 日以现场及视频会议方式召开，会议审议通过了《公司 2022 年度财务决算报告》《公司 2023 年度财务预算报告》《关于公司 2022 年度利润分配的预案》《关于公司 2022 年度财务报表的议案》《关于公司 2022 年度报告的预案》《关于公司 2022 年度内部控制评价报告的议案》《关于预计公司 2023 年日常关联交易的预案》《关于公司续聘会计师事务所的预案》《公司董事会审计委员会 2022 年度履职情况报告》《公司 2022 年度关联交易专项审计报告》《关于公司 2022 年度募集资金使用、提供担保、关联交易等重大事项的专项审计报告》《公司 2023 年度内部审计工作计划》，审阅了公司 2022 年度审计报告“关键审计事项”等涉及的重要事项，并听取了《关于公司 2022 年度反洗钱内部审计的报告》《关于公司 2022 年度内部审计工作情况的报告》。
- 4、公司第六届董事会审计委员会 2023 年第四次会议于 2023 年 4 月 27 日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于变更公司会计政策的议案》《关于公司 2023 年 1—3 月份财务报表的议案》。

三、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

报告期内，公司未发生新聘或解聘董事、监事及高级管理人员情况。同时，根据《上市规则》第 13.51(2) 条须予披露有关董事、监事及最高行政人员之任何资料并无变动。

四、利润分配或资本公积金转增预案

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
每 10 股送红股数（股）	-
每 10 股派息数（元）（含税）	-
每 10 股转增数（股）	-

利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明

公司董事会审议半年度报告时，未拟定利润分配预案、资本公积金转增股本预案。

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

事项概述	查询索引
<p>1、公司 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售并上市</p> <p>2023 年 3 月 30 日，公司第六届董事会第二次会议及第六届监事会第二次会议分别审议通过了《关于公司 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件成就的议案》。公司按照相关规定为 770 名激励对象合计持有的 14,222,943 股限制性股票办理了解除限售相关手续，上述股份于 2023 年 4 月 24 日解除限售上市流通。</p>	<p>公告编号：临 2023-022</p> <p>公告编号：临 2023-023</p> <p>公告编号：临 2023-025</p> <p>公告编号：临 2023-029</p>
<p>2、将回购注销部分 A 股限制性股票</p> <p>报告期内，公司第六届董事会第二次会议、第六届监事会第二次会议以及公司 2022 年年度股东大会、2023 年第二次 A 股类别股东会、2023 年第二次 H 股类别股东会分别审议通过了《关于公司回购注销部分 A 股限制性股票的议案》。公司将回购并注销激励对象中因存在个人绩效条件未完全达标、与公司解除或终止劳动关系等情况的 137 人已获授但尚未解除限售的部分或全部限制性股票，共计 925,692 股，回购价格为人民币 8.25 元/股，本次回购的资金总额为人民币 7,636,959.00 元。</p>	<p>公告编号：临 2023-022</p> <p>公告编号：临 2023-023</p> <p>公告编号：临 2023-026</p> <p>公告编号：临 2023-055</p>

(二) 其他激励措施

本集团控股公司 AssetMark 采用的员工激励措施请参见本报告“财务报告”“十二、股份支付”。

六、员工及薪酬政策

（一）薪酬政策

公司贯彻稳健经营理念，将薪酬管理与风险管理紧密结合，注重合规底线要求，充分考虑市场周期波动影响、行业特征及公司业务发展趋势，将“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念融入薪酬管理，建立着眼长期发展薪酬激励机制，促进公司和行业高质量可持续发展。

公司注重薪酬激励的外部竞争性和内部公平性，实行以市场水平为定薪依据、以业绩考核结果为分配导向、与合规风险管理匹配衔接的薪酬激励分配体系。公司薪酬由基本薪酬、绩效奖金、股权激励及福利体系构成。公司根据国家法律法规，制定并实施了 A 股限制性股票股权激励计划，建立健全中长期激励约束机制，打造市场化的体制机制和发展平台，集聚核心优秀人才。

根据相关法律法规，公司为员工依法足额缴纳了各项社会保险和住房公积金。与此同时，公司为员工建立了补充医疗保险计划和企业年金计划，提升员工补充医疗保障和退休待遇水平。

（二）培训

为适应行业创新转型发展趋势，公司培训工作围绕战略文化、综合素质、专业能力、职业操守、科技赋能、国际视野等方面开展，年度培训计划有序实施。公司开展行业文化、发展战略、企业文化价值观培训，促进文化建设与业务发展相融合；组织实施针对管理者的“BAL 星战营”项目、针对成熟员工的“HIPO”项目、针对新员工的“华泰星”项目等职业发展类培训，支持员工职业生涯发展；联合业务部门举办财富管理、机构业务、金融科技、合规风控等业务类培训，提升员工专业能力，强化员工职业操守；此外，公司有效利用云端学习平台，持续优化平台功能，提升员工使用体验，报告期内组织直播 264 场，平台学习人次 46.3 万人次，学习时长 13.3 万学时，人均 13.9 学时。

（三）员工人数

截至 2023 年 6 月底，集团员工人数为 16,644 人（含劳务派遣、经纪人等），其中母公司 11,561 人（含劳务派遣、经纪人等）。

七、其他公司治理相关情况说明

作为境内外上市的公众公司，公司严格按照境内外上市地的法律、法规及规范性文件的要求，规范运作，不断致力于维护和提升公司良好的市场形象。报告期内，公司严格依照《公司法》《证券法》《证券公司监督管理条例》《证券公司治理准则》《上市公司治理准则》《香港上市规则》附录十四《企业管治守则》等相关法律法规以及公司《章程》的规定，按照建立现代企业制度的目标，健全和完善公司法人治理结构、合规风控制度和内控管理体系，形成了股东大会、董事会、监事会和经营管理层相互分离、相互制衡的公司治理结构，使各层次在各自的职责、权限范围内，各司其职，各负其责，确保了公司的稳健经营和规范运作。

（一）企业管治政策以及就企业管治而言董事会的职责

公司严格遵照《香港上市规则》，以《企业管治守则》中所列的所有原则作为企业管治政策。就企业管治职能而言，董事会的职权范围至少包括：

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

（二）符合《香港上市规则》附录十四《企业管治守则》的要求

报告期内，公司召开股东大会 3 次，董事会 2 次，监事会 2 次，审计委员会 4 次，合规与风险管理委员会 1 次，发展战略委员会 2 次，薪酬与考核委员会 1 次，共计 15 次会议，公司股东大会、董事会、监事会的召集、召开及表决程序规范合法有效。报告期内，公司不断加强投资者关系管理及信息披露工作，公司投资者关系管理工作规范专业，信息披露真实、准确、完整、及时、公平，公司透明度持续提高。

根据《企业管治守则》第 C.2.1 条的规定，主席及行政总裁之角色应有所区分，而且不应由一人同时兼任。2022 年 12 月 30 日，公司第六届董事会第一次会议选举张伟先生为公司第六届董事会董事长，继续聘任周易先生为公司首席执行官、执行委员会主任。董事会认为此管理层架构对本公司营运而言乃属有效且有足够的制衡。

根据《企业管治守则》第 C.1.6 条的规定，独立非执行董事以及其他非执行董事应出席股东大会。本公司部分独立非执行董事及部分非执行董事因公务原因未能出席本公司于 2023 年 6 月 30 日召开的 2022 年度股东大会、2023 年第二次 A 股类别股东会、2023 年第二次 H 股类别股东会。

公司长期以来致力于公司治理结构和制度建设的不断完善。公司治理结构不断规范，公司治理水平不断提高，公司治理的实际状况与《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。同时，除以上披露外，公司严格遵守《企业管治守则》中的所有守则条文，达到了《企业管治守则》中所列明的绝大多数建议最佳常规条文的要求。

（三）董事、监事及有关雇员之证券交易

报告期内，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守则。根据境内监管要求，2014年11月25日，公司第三届董事会第十三次会议审议通过了《公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份管理制度》，以规范公司董事、监事和高级管理人员持有本公司股份及买卖本公司股份的行为。2015年3月6日，为满足公司H股挂牌上市相关监管要求，公司对该《管理制度》进行了修订，并经公司第三届董事会第十六次会议审议通过。2022年10月28日，为加强对公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动的管理，公司对该《管理制度》进行了修订，并经公司第五届董事会第二十七次会议审议通过。《管理制度》与《标准守则》中的强制性规定相比更加严格。根据对公司董事、监事及高级管理人员的专门查询后，公司所有董事、监事及高级管理人员均已确认其于报告期内严格遵守了《管理制度》及《标准守则》的相关规定。公司董事会将不时检查公司的公司治理及运作，以符合《香港上市规则》有关规定并保障股东的利益。本公司于报告期内也没有发现有关雇员违反指引。

（四）独立非执行董事

本公司已根据《香港上市规则》的规定委任足够人数、并具备适当的专业资格、或具备适当的会计或相关财务管理专长的独立非执行董事。截至报告期末，本公司共委任五名独立非执行董事，分别为王建文先生、王全胜先生、彭冰先生、王兵先生、谢涌海先生。

（五）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，本公司并无及并不建议与本公司任何董事或监事以其各自作为董事/监事的身份订立任何服务合约（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）。

环境与社会责任

ENVIRONMENT AND SOCIAL RESPONSIBILITY

一、环境信息情况

(一) 公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

公司为金融业企业，不属于环境保护部门公布的重点排污单位及其重要子公司。公司每年均委托有资质的第三方机构对总部办公场所废水、废气、噪声进行检测，各项检测均符合国家的标准。

针对气候变化可能导致的暴雨、台风等极端天气事件，公司及时向各部门及分支机构发布预警通知，相关人员第一时间做好各项防风、防水浸措施，检查清理排洪设施，准备沙包、雨衣等应急设备；极端天气过程中，相关人员对防风、防水浸关键区域和部位加强巡视，对发现的设备故障，及时予以解决。

(三) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

公司积极响应《南京市生活垃圾管理条例》，每个楼层均设置垃圾分类投放点，通过在公共场所醒目位置张贴垃圾分类宣传海报、电梯厅循环播放垃圾分类宣传视频等方式，向员工宣贯垃圾分类的理念和做法，营造“垃圾分类，人人参与”的浓厚氛围，养成主动分类、自觉投放的良好习惯。公司办公垃圾由物业统一清运，电子垃圾、光管、碳粉盒、硒鼓墨盒等有害废弃物委托有资质的单位进行回收，由回收方进行处置或再利用。

公司在车辆管理制度中明确规定，公司实物保障用车及经营业务用车优先考虑购置新能源汽车，践行低碳环保运营方式。总部办公园区地下车库配备有新能源汽车充电桩和电瓶车充电桩，鼓励员工选择绿色出行方式，倡导绿色环保理念。

公司在营业及办公用房装修改造中，通过规定最短装修周期（除特殊情况外未超过最短装修周期的不允许实施装修改造）、提升装修改造项目质量等措施，延长营业用房装修使用寿命，减少装修频次，降低装修改造带来的污染。公司在装修改造中采用新型建筑材料，实现环保和建筑一体化。在幕墙、内装修、景观等方面，遵循绿色、新颖、环保的理念，办公空间照明着力普及低能耗的LED照明，较大幅度节约日常办公照明用电；大幅度降低油漆类装修材料的使用，使用环保免漆材料代替；办公家具大量采用板式家具，基本杜绝油漆家具的使用；加大装修后空气检测及治理的力度，提升办公环境空气质量，为员工办公提供安全、舒适的良好环境。

2023年3月，华泰联合证券作为独家保荐机构及主承销商，助力江苏联合水务科技股份有限公司正式登陆上交所主板，积极推动供水、污水处理和水生态修复等项目能力提升，更好地服务国家环境治理政策方针。华泰联合证券将继续践行

金融企业的社会责任，为更多节能环保领域企业搭建资本桥梁，为持续深入打好蓝天、碧水、净土保卫战贡献力量。

2023年8月，华泰证券深入践行ESG理念，制定并对外披露了《华泰证券股份有限公司信息及数据保护声明》和《华泰证券股份有限公司检举及检举者保护相关制度》两份治理文件，分别阐述了公司数据安全与个人信息保护的工作要求，以及公司在检举控告、检举者保护等方面的举措，旨在着力提升员工信息安全意识，更好地守护客户的隐私安全及合法权益，同时，进一步构建合规、诚信、廉洁的企业文化氛围。

（四）在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

公司深入贯彻习近平生态文明思想，紧扣碳达峰碳中和目标任务，实施全面节约战略，通过节能宣传周、低碳日活动、“地球一小时”等活动广泛开展节能降碳宣传教育，积极营造节能降碳浓厚氛围，进一步推进形成勤俭节约、合理用能的社会风尚。

公司总部园区装配有光伏发电系统，2023年上半年通过该系统节约电量达46,084千瓦时，每月功率因数均达到供电部门奖励标准。在办公园区运行中，通过日照光诱导照明装置系统、空调冰蓄冷系统、地送风系统、办公区智能化照明控制等多种措施减少碳排放，为低碳经济带来良好的社会效益。

华泰证券广场绿化率为27.9%，高于一般商务办公区绿化水平，围绕着花园办公的理念，通过中央绿化、垂直绿化、屋顶花园等多层次的景观打造，不断扩大绿植种植面积，减少碳排放，助力碳中和。

公司在装修改造建设项目中积极落实绿建指标，并推进利旧措施，合理把握改造的“量”和“度”，在为员工打造优美和舒适办公空间的同时，选择更环保装修材料并减少原有装饰装修材料的拆除以及新装饰装修材料的生产、运输、安装所产生的温室气体排放。

2023年2月，华泰证券自营参与碳排放权交易资格申请获得中国证监会批复。此次获批，是公司参与国内碳市场交易，助力绿色低碳发展，支持国家双碳目标实现迈出的重要一步。公司将全面构建面向国内绿色产业客户和投资机构的碳市场产品与服务能力，为可持续发展贡献更大力量。

2023年2月，华泰-吉利曹操出行3期资产支持专项计划（碳中和）于上交所成功发行。本期专项计划基础资产涉及项目将全部属于“绿色交通”类绿色低碳产业项目。本期专项计划的发行将有效促进新能源汽车的生产、消费与推广，带来良好的环境效益与社会效益。

2023年3月，华泰证券联合北京市企业家环保基金会、金陵图书馆共同主办《从城市到荒野：生物多样性主题展》“地球一小时”特别沙龙活动，通过创意手工和观影等趣味形式传递环保理念，提高员工、公众对气候变化及生物多样性保护等议题的关注。同时，华泰证券以“推广合作伙伴”的身份加入“地球一小时”活动，以实际行动减少企业碳足迹。

2023年6月，华泰联合证券作为独家保荐人及主承销商，助力常州时创能源股份有限公司登陆上交所科创板，进一步推动光伏行业发展，服务国家现代能源体系建设。基于对能源与环保产业链的多年耕耘和深刻理解，华泰联合证券积极响应国家“双碳”政策，以光伏、锂电池等新能源及节能环保领域为支点，已为多家优质实体企业搭建资本市场桥梁，为“双碳”目标的实现贡献金融力量。

二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

报告期内，公司持续深化“一司一县”结对帮扶，组织精干力量，赴金寨县开展调研，全方位推进结对帮扶工作；积极参与江苏省“五方挂钩”定点帮扶，推进高效农业设施项目落地见效；扎实推进与苏中苏北地区的“村企联建”，以乡村文旅研学项目促进集体增收；全力支持“东西部协作帮扶”，继续实施消费帮扶、支持对口支援地区2022至2023两年行动计划，采购江苏省对口支援地区的消费帮扶产品。坚持以人为本，2023年上半年累计走访慰问帮扶地区困难家庭235户。坚持定期跟踪督导，最大限度调动各方参与乡村振兴工作的积极性、主动性、创造性，引导分支机构、子公司发挥专业优势服务乡村振兴，积极参与云南澜沧县、河南桐柏县、贵州玉屏县等地的乡村振兴工作，通过“保险+期货”、开展专业培训、带动就业等形式服务乡村振兴。

重要事项

MAJOR EVENTS

一、承诺事项履行情况

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

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行
其他对公司中小股东所作承诺	解决同业竞争	国信集团	国信集团及附属公司或者附属企业在今后的任何时间不会以任何方式（包括但不限于自营、合资或联营）参与或进行与华泰证券主营业务存在竞争的业务活动（锦泰期货有限公司除外）。凡国信集团及附属公司或者附属企业有任何商业机会可从事、参与或入股任何可能会与华泰证券生产经营构成竞争的业务，国信集团会将上述商业机会让予华泰证券（锦泰期货有限公司除外）。	承诺出具日：2014年6月27日；到期日：长期	否	是

二、报告期内，公司无控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

三、报告期内，公司无违规担保情况

四、公司半年报未经审计

五、公司上年年度报告不存在非标准审计意见

六、报告期内，公司无破产重整相关事项

七、重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》中要求披露的涉案金额超过人民币 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。

(一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

事项概述及类型	查询索引
公司与四川圣达集团有限公司债权债务纠纷案	可在 2021 年至 2022 年年报中查询
华泰联合证券与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案	可在 2011 年至 2022 年年报中查询
华泰联合证券与北京华资银团集团债权债务纠纷案	可在 2011 年至 2022 年年报中查询
华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司、华诚投资管理有限 公司债权债务纠纷案	可在 2011 年至 2022 年年报中查询
华泰资管公司集合资产管理计划项下债券违约合同纠纷案件	可在 2021 年至 2022 年年报中查询
华泰资管公司资本创新招商 3 号定向资产管理计划股票质押式回购合 同纠纷案	可在 2022 年年报中查询
华泰期货公司客户张晓东期货账户穿仓案	可在 2013 至 2022 年年报中查询

(二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

报告期内，公司尚未披露的新增（金额超过人民币 1 亿元）或已披露且有进展的诉讼、仲裁事项：

1、公司与程曦股权转让纠纷案

2016 年，公司取得漳州三利达环保科技股份有限公司（证券代码：833329，以下简称“利达股份”）股票用于做市。2018 年 7 月，利达股份称计划从全国股转系统摘牌赴海外发展，其股东程曦同意在摘牌后受让公司所持有的利达股份的全部股票。利达股份及其股东程曦向公司出具了《承诺函》，承诺在利达股份终止挂牌后通过支付现金方式受让公司持有的利达股份全部股票 1,407,000 股，转让总金额不低于人民币 63,315,000 元。利达股份终止挂牌后，程曦未支付股票转让价款。公司于 2022 年 11 月 14 日向厦门市中级人民法院提交诉状材料，请求被告程曦支付股权转让款、违约金、逾期利息共计人民币 108,363,622.50 元（截至 2022 年 10 月 20 日）。法院于 2022 年 11 月 15 日立案，2023 年 6 月 5 日，厦门市中级人民法院一审判决程曦向华泰证券支付股份转让款人民币 63,315,000 元、违约金人民币 12,663,000 元、保全费人民币 5,000 元。

2、质押式证券回购纠纷案

事项	详情
公司与楚金甫、唐付君、河南森源集团有限公司质押式证券回购纠纷案	因楚金甫股票质押式回购交易违约，公司于2020年7月向南京市中级人民法院提起诉讼，请求法院判令楚金甫支付欠付本金人民币57,180万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，判令唐付君承担连带清偿责任，判令公司对楚金甫、河南森源集团有限公司（以下简称“森源集团”）质押给公司的相关股份、股权及相应孳息的折价、拍卖或变卖价款在相关付款义务的范围内优先受偿。2021年6月24日，公司收到南京市中级人民法院一审判决，判决被告楚金甫向公司偿还融资本金、利息及违约金，并支付律师代理费，公司有权对楚金甫、森源集团质押给公司的相关股份、股权及相应孳息的折价、拍卖或变卖价款在上述付款义务的范围内优先受偿，唐付君对楚金甫的给付义务承担连带责任。2021年7月8日，森源集团、唐付君上诉至江苏省高级人民法院。2021年12月23日，公司收到江苏省高级人民法院二审判决，驳回上诉，维持原判。判决生效后公司向法院申请执行，报告期内共执行回款人民币323,225,614.19元。2023年3月6日，南京市栖霞区人民法院裁定终结执行程序。
公司与河南森源集团有限公司、楚金甫质押式证券回购纠纷案	因森源集团股票质押式回购交易违约，公司于2020年7月向南京市中级人民法院提起诉讼，请求法院判令森源集团支付欠付本金人民币30,000万元以及相应的违约金、债权实现费用等，判令楚金甫承担连带清偿责任，判令公司对森源集团质押给公司的相关股份、股权及相应孳息的折价、拍卖或变卖价款在相关付款义务的范围内优先受偿。2021年6月24日，公司收到南京市中级人民法院一审判决，判决被告森源集团向公司偿还融资本金、违约金，并支付律师代理费，公司有权对森源集团质押给公司的相关股份、股权及相应孳息处置所得价款在上述付款义务的范围内优先受偿，楚金甫对森源集团的上述付款义务承担连带清偿责任。2021年7月8日，森源集团上诉至江苏省高级人民法院。2021年12月23日，公司收到江苏省高级人民法院二审判决，驳回上诉，维持原判。判决生效后公司向法院申请执行，报告期内共执行回款人民币107,410,774.17元。2023年1月5日，南京市栖霞区人民法院裁定终结执行程序。
公司与韩华、杨立军质押式证券回购纠纷案	因韩华股票质押式回购交易违约，公司于2020年8月向南京市中级人民法院提起诉讼，请求法院判令韩华支付欠付本金人民币16,190.56万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，判令杨立军承担连带清偿责任，判令公司对韩华质押给公司的相关股份及相应孳息的折价、拍卖或变卖价款在相关付款义务的范围内优先受偿。2021年6月16日，公司收到南京市中级人民法院一审判决，判决韩华向公司支付股票回购交易价款及违约金，公司有权对韩华质押的相关股份处置所得价款优先受偿，杨立军对韩华的债务承担共同清偿责任。判决生效后公司向法院申请执行，2022年执行回款人民币24,007,579.91元。报告期内新增执行回款人民币46,357,909.33元。2023年3月31日，南京市建邺区人民法院裁定终结执行程序。
公司与杨立军、韩华质押式证券回购纠纷案	因杨立军股票质押式回购交易违约，公司于2020年9月向南京市中级人民法院提起诉讼，请求法院判令杨立军支付欠付本金人民币10,126.83万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，判令韩华承担连带清偿责任，判令公司对杨立军质押给公司的相关股份及相应孳息的折价、拍卖或变卖价款在相关付款义务的范围内优先受偿。2021年7月12日，公司收到南京市中级人民法院一审判决，判决杨立军向公司支付股票回购交易价款及违约金，公司有权对杨立军质押的相关股份处置所得价款优先受偿，韩华对杨立军的债务承担共同清偿责任。判决生效后公司向法院申请执行，共执行回款人民币4,153,182.67元。2022年11月30日，南京市建邺区人民法院裁定终结执行程序。

3、华泰联合证券与邮储银行关于美吉特项目纠纷案

“华泰美吉特灯都资产支持专项计划”（以下简称“美吉特ABS”）由上海富诚海富通资产管理有限公司担任计划管理人，华泰联合证券担任财务顾问。2020年9月21日，上海金融法院下发《应诉通知书》，并于2020年9月25日送达华泰联合证券。原告中国邮政储蓄银行因投资“美吉特ABS”未得到全额兑付，诉至法院要求判令五被告连带赔偿原告投资损失人民币5.27亿元及相关利息，判令诉讼费用由五被告承担，华泰联合证券被列为第五被告。上海金融法院于2023年4月14日一审判决华泰联合证券承担连带赔偿责任，华泰联合证券已提交上诉申请，一审判决尚未生效。

4、华泰联合证券与 16 亿阳债投资者纠纷案

亿阳集团股份有限公司 2015 年获准向合格投资者公开分期发行面值不超过人民币 25 亿元的公司债券（简称“16 亿阳债”）。华泰联合证券为联席主承销商。

2022 年 3 月，原告上海仟富来资产管理有限公司以证券虚假陈述为由起诉发行人亿阳集团股份有限公司要求赔付债券本金及利息合计约人民币 509.81 万元，并起诉主承销商、联席主承销商、会计师事务所、信用评级机构及律师事务所承担连带赔偿责任。北京金融法院裁定本案移送哈尔滨市中级人民法院处理。原告不服裁定上诉，2022 年 8 月，本案在北京市高级人民法院二审裁定驳回上诉，维持原裁定。2023 年 3 月 6 日，哈尔滨市中级人民法院作出（2023）黑 01 民初 527 号民事裁定书，本案按上海仟富来资产管理有限公司撤回起诉处理。

5、华泰资管公司关于华泰慧泽 1 号集合产品合同纠纷案

2021 年 6 月，华泰慧泽 1 号集合资产管理计划某投资者以金融委托理财合同纠纷为由向上海金融法院起诉管理人华泰资管公司并要求承担赔偿责任，诉讼赔偿金额为人民币 8,631 万元。2021 年 11 月，原告方变更诉讼请求，将诉讼赔偿金额调整为人民币 14,416 万元。2022 年 9 月，一审法院判决驳回原告方全部诉讼请求。2023 年 2 月，上海高院作出二审判决，驳回该投资者上诉请求，维持原判。

6、华泰紫金投资旗下伊犁基金因投资河南义腾项目与德尔集团及其实控人汝继勇的履约纠纷案

华泰紫金投资旗下伊犁苏新投资基金合伙企业（有限合伙）（简称“伊犁基金”）于 2020 年 6 月向南京仲裁委员会申请仲裁，要求德尔集团有限公司（简称“德尔集团”）实控人汝继勇履行股权回购义务。南京仲裁委员会于 2022 年 8 月 19 日、2023 年 2 月 24 日分别开庭审理，目前尚未作出裁决。2022 年 11 月 11 日，伊犁基金向南京市建邺区人民法院对德尔集团提起诉讼，要求其因伊犁基金因德尔未来股票质押担保无效而产生的损失承担赔偿责任（赔偿损失人民币 275,966,101 元，其中投资本金损失为人民币 142,372,881 元，利息损失为人民币 133,593,220 元）。2022 年 11 月 28 日，根据伊犁基金的申请，南京市建邺区人民法院冻结德尔集团所持有 54,919,622 股德尔未来股票。2023 年 2 月 2 日，因管辖权问题，南京市建邺区人民法院作出民事判决，裁定将该案件移送至新疆维吾尔自治区高级人民法院伊犁哈萨克自治州分院处理。现该案已报最高人民法院，请示最高人民法院指定法院管辖。

（三）公司本报告期被处罚和公开谴责的情况

1、2023 年 2 月，江苏证监局对公司出具了《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2023〕25 号），对公司研究所制度建设及执行不规范的相关问题采取责令改正的行政监管措施。针对存在的问题，公司组织排查研判制作及审查流程，梳理完善管控措施，加大员工业务培训，并通过科技赋能强化审核机制，促进整改落到实处。

2、2023 年 6 月，河南证监局对公司河南分公司出具《关于对华泰证券股份有限公司河南分公司采取出具警示函的行政监管措施》（〔2023〕33 号），认定河南分公司经纪业务管理存在以下问题：一是证券经纪人登记执业地域与委托合同约定执业地域不一致；二是未将证券经纪人执业行为的合规性纳入考核范围；三是部分经纪关系确认单缺失，证券经纪人执业留痕不完整；四是个别客户业务办理资料留存不完整，决定对该分公司采取出具警示函的行政监管措施。公司已督促河南分公司及时整改、按监管要求提交书面整改报告，河南分公司针对函件反映的问题采取相关措施进一步加强经纪人执业行为等环节的管理、提升规范运作水平。

3、2023 年 2 月 2 日及 2023 年 3 月 23 日，华泰联合证券分别收到江苏证监局下发的《关于对华泰联合证券有限责任公司、孙圣虎、董雪松采取出具警示函措施的决定》和上交所下发的《关于对江苏浩欧博生物医药股份有限公司持续督导机构及保荐代表人予以监管警示的决定》。2021 年 7 月，江苏浩欧博生物医药股份有限公司（以下简称“浩欧博”）发生关联方非经营性资金占用事项，涉及关联交易未按规定披露，浩欧博于 2022 年 2 月披露该资金占用相关情况。江苏证监局对浩欧博进行了立案调查，并对华泰联合证券负责的浩欧博持续督导工作进行了延伸检查。江苏证监局认定华泰联合证券在履行持续督导职责中未能尽到勤勉尽责义务，包括：未能及时发现浩欧博资金占用违规行为；在知晓资金占用事项后未能及时向中国证监会报告；所出具的报告存在相关描述与事实不符，未能真实、准确的反映浩欧博违规问题等，根据《证券发行上市保荐业务管理办法》第六十五条的规定，对华泰联合证券及相关人员采取出具警示函的监督监管措

施。上交所根据上述警示函及《科创板股票上市规则》等相关规定，对华泰联合证券及相关人员采取出具予以监管警示的自律监管措施。华泰联合证券对照公司制度进行了相应的内部问责，要求责任部门对保荐业务项目持续督导、人员安排等情况进行全面梳理、自查自纠，华泰联合证券将进一步加强项目持续督导管理，避免类似事件再次发生。

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

报告期内，公司董事、监事、高级管理人员、持有 5% 以上股份的股东、实际控制人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、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚以及被证券交易所公开谴责的情形。

报告期内，公司受到处罚及整改情况请参见本报告本节“重大诉讼、仲裁事项”“(三) 公司本报告期被处罚和公开谴责的情况”。

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

报告期内，公司及其实际控制人诚信状况良好，不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十、重大关联交易

本公司严格按照《上海证券交易所股票上市规则》及《香港上市规则》开展关联交易，关联交易的开展遵循公平、公正、公允的原则，关联交易协议的签订遵循平等、自愿、等价、有偿的原则，按照市场价格进行。

报告期内，本公司日常关联交易按照公司 2022 年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2023 年日常关联交易的议案》执行。

本章节所载关联交易的披露依据《上海证券交易所股票上市规则》及《香港上市规则》的规定，与后附财务报告中的关联交易数据（依据企业会计准则编制）可能存在差异。

(一) 与日常经营相关的关联交易

1、报告期内，没有已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

(1) 佣金收入

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	2023 年 1-6 月	2022 年 1-6 月
南方基金管理股份有限公司	席位费分仓佣金及销售服务费	54,279,064.46	66,441,951.16
南方东英资产管理有限公司	席位费分仓佣金及销售服务费	230,441.89	17,007.73
富安达基金管理有限公司	席位费分仓佣金及销售服务费	79,548.98	-
江苏省国信集团有限公司	证券代理买卖佣金	-	27,731.87
江苏舜天国际集团有限公司	证券代理买卖佣金	-	232.82
江苏锦盈资本管理有限公司	证券代理买卖佣金	4,856,386.44	5,360,961.55
江苏舜天股份有限公司	证券代理买卖佣金	2.83	-

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏宁沪高速公路股份有限公司	证券代理买卖佣金	17.90	49.39
江苏宁沪投资发展有限责任公司	证券代理买卖佣金	46.64	53.10
南方基金管理股份有限公司	证券代理买卖佣金	883.47	603.62
江苏省苏豪控股集团有限公司	证券代理买卖佣金	23,157.41	-
江苏省国信集团有限公司	债券承销收入	2,884,905.66	-
江苏省港口集团有限公司	债券承销收入	-	4,292,452.83
江苏宁沪高速公路股份有限公司	债券承销收入	-	1,415,094.34
南京银行股份有限公司	债券承销收入	2,396,132.47	230,319.10
南京银行股份有限公司	财务顾问收入	-	1,080,000.00
江苏银行股份有限公司	债券承销及保荐收入	137,200.00	195,903.14

(2) 利息净收入

单位:元 币种:人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏省港口集团有限公司	债权投资利息收入	-	123,504.93
江苏银行股份有限公司	质押式回购利息支出	-4,447,257.35	-4,326,814.27
江苏银行股份有限公司	拆入资金利息支出	-3,286,433.30	-5,448,555.56
江苏银行股份有限公司	银行存款利息收入	12,790,405.33	3,820,175.05
江苏银行股份有限公司	债券借贷利息支出	-2,057,695.87	-
南京银行股份有限公司	质押式正回购利息支出	-12,308,555.39	-10,116,503.20
南京银行股份有限公司	拆入资金利息支出	-	-607,777.78
南京银行股份有限公司	银行存款利息收入	6,846,757.62	6,953,808.02
招银理财有限责任公司	质押式正回购利息支出	-212,383.56	-
招银理财有限责任公司	质押式逆回购利息收入	660,328.79	3,725,875.87

(3) 投资收益

单位:元 币种:人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏省国信集团有限公司	持有及处置交易性金融资产收益	-	912,972.58
江苏交通控股有限公司	持有及处置交易性金融资产收益	812,886.59	1,463,813.91
江苏省苏豪控股集团有限公司	持有及处置交易性金融资产收益	1,469.23	-
江苏银行股份有限公司	持有及处置交易性金融资产收益	262,568.68	136,696.13
南京银行股份有限公司	持有及处置金融资产(损失)/收益	-2,271,068.46	292,458.99
江苏宁沪高速公路股份有限公司	持有及处置交易性金融资产收益	827,282.25	-
江苏金融租赁股份有限公司	持有及处置交易性金融资产收益	144,361.06	-

(4) 关联租赁

单位: 元 币种: 人民币

承租方	租赁资产种类	2023年1-6月	2022年1-6月
南方基金管理股份有限公司	房屋建筑物	1,094,507.26	1,619,067.02
出租方	租赁资产种类		
南方基金管理股份有限公司	房屋建筑物	20,911,309.58	23,084,282.80
南方基金管理股份有限公司	其他	2,110,619.46	2,698,407.36

(5) 本集团净认购/(赎回)关联方发行债券情况

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏省国信集团有限公司	净赎回企业债	-	-40,072,249.60
江苏交通控股有限公司	净认购/(赎回)企业债	77,146,592.22	-30,037,593.25
江苏金融租赁股份有限公司	净认购企业债	879,885.81	-
江苏宁沪高速公路股份有限公司	净认购企业债	21,184,816.44	-
南京银行股份有限公司	净认购企业债	-	60,225,224.11
江苏高科技投资集团有限公司	净认购企业债	10,774,892.74	-

(6) 与关联方开展质押式回购及资金拆借业务情况

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏银行股份有限公司	拆入资金	39,970,000,000.00	49,350,000,000.00
江苏银行股份有限公司	质押式正回购	53,167,260,000.00	67,679,258,000.00
南京银行股份有限公司	质押式正回购	148,258,560,000.00	130,652,685,000.00
南京银行股份有限公司	质押式逆回购	-800,000,000.00	-13,188,191,000.00
南京银行股份有限公司	拆入资金	-	2,800,000,000.00

(7) 关联方投资本集团发行的结构化票据情况

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
南方基金管理股份有限公司	净赎回结构化票据	-	-102,729,346.39
南方基金管理股份有限公司	支付结构化票据投资收益	-	9,074,810.78

(8) 关联方认购本集团发行债券

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
南方东英资产管理有限公司	认购本集团发行债券	1,642,822,600.00	-
南方东英资产管理有限公司	支付债券利息	-3,972,694.63	-

(9) 与关联方开展债券交易情况

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏省国际信托有限责任公司	购买关联方管理的信托计划持有的债券	92,573,943.83	-
江苏省国际信托有限责任公司	向关联方管理的信托计划分销债券	-	60,000,000.00
江苏银行股份有限公司	债券借贷	1,930,000,000.00	-

(10) 外汇衍生金融工具汇兑损益

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
南京银行股份有限公司	外汇衍生金融工具汇兑损益	-76,096.17	-274,626.32

(11) 存管服务支出

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	2023年1-6月	2022年1-6月
江苏银行股份有限公司	银行存管费支出	-197,295.74	-200,530.03
南京银行股份有限公司	银行存管费支出	-684,935.79	-362,949.39

3、临时公告未披露的事项

单位：元 币种：人民币

关联交易方	关联关系	关联交易类型	关联交易内容	关联交易定价原则	关联交易价格	关联交易金额	占同类交易金额的比例 (%)
江苏银行股份有限公司	其他	其他流入	证券代理买卖佣金	市价原则	不适用	56,929.33	-
江苏高投鑫海创业投资有限公司	其他	其他流入	证券代理买卖佣金	市价原则	不适用	2,749.91	-
南京白鹭高速客运股份有限公司	其他	其他流入	证券代理买卖佣金	市价原则	不适用	27.84	-
紫金财产保险股份有限公司	其他	其他流入	证券代理买卖佣金	市价原则	不适用	173,908.06	-
江苏省华泰公益基金会	其他	其他流入	投资顾问收入	市价原则	不适用	1,745.72	-
苏州中方财团控股股份有限公司	其他	其他流入	持有及处置交易性金融资产收益	市价原则	不适用	2,358.49	-
江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	其他	其他流出	广告服务支出	市价原则	不适用	-199,000.00	-
合计				/	/	38,719.35	-
大额销货退回的详细情况					不适用		
关联交易的说明					无		

(二) 报告期内, 公司无资产或股权收购、出售发生的关联交易

(三) 报告期内, 公司无共同对外投资的重大关联交易

(四) 关联债权债务往来

1、报告期内, 没有已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

2、已在临时公告披露, 但有后续实施的进展或变化的事项

(1) 应收关联方款项

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日		2022年12月31日	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
南方基金管理股份有限公司	基金分仓佣金及销售服务费	29,101,485.70	145,507.43	63,929,962.28	319,649.81
富安达基金管理有限公司	席位费分仓佣金及销售服务费	14,088.18	70.44	-	-
江苏银行股份有限公司	承销保荐费	209,488.89	1,047.44	119,600.00	1,176.00
南方基金管理股份有限公司	食堂费用分摊	31,300.34	156.50	281,696.12	1,408.48
南方基金管理股份有限公司	租赁押金	2,271,852.45	6,752.96	2,815,267.44	271,883.96
江苏宁沪高速公路股份有限公司	预付款项	1,000.00	-	1,000.00	-
通昌置业南通有限公司	租赁押金	40,000.00	200.00	40,000.00	200.00
南京银行股份有限公司	承销保荐费	43,621.95	218.11	1,237,650.00	7,088.25

(2) 关联方资金拆借

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	2023年6月30日	2022年12月31日
江苏银行股份有限公司	拆入资金	1,100,179,666.67	500,143,055.56

(3) 与关联方开展质押式回购

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	2023年6月30日	2022年12月31日
招银理财有限责任公司	质押式逆回购	700,149,315.09	280,323,890.42
南京银行股份有限公司	质押式正回购	-	298,810,963.36

(4) 承租关联方租赁

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日	2022年12月31日
		使用权资产	使用权资产
南方基金管理股份有限公司	房屋建筑物	49,662,228.27	49,802,749.74
南方基金管理股份有限公司	其他	2,306,402.31	4,612,804.20
通昌置业南通有限公司	房屋建筑物	397,299.76	482,435.44

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日	2022年12月31日
		租赁负债	租赁负债
南方基金管理股份有限公司	房屋建筑物	58,874,674.80	59,994,280.69
南方基金管理股份有限公司	其他	2,092,207.63	4,141,322.95
通昌置业南通有限公司	房屋建筑物	354,981.04	348,470.76

(5) 应付关联方款项

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	2023年6月30日	2022年12月31日
江苏省国信集团有限公司	应付款项	3,211,190.78	3,211,190.78

3、报告期内，本公司无临时公告未披露的事项

(五) 报告期内，本公司与存在关联关系的财务公司之间无金融业务，且公司无控股财务公司

(六) 其他

报告期内，公司子公司向江苏省华泰公益基金会捐款人民币 84.22 万元，用于开展乡村振兴、环境保护项目。

十一、重大合同及其履行情况

1、报告期内，本公司无托管、承包、租赁事项

2、报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

单位：亿元 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	-
报告期末对子公司担保余额合计（B）	371.05
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	371.05
担保总额占公司净资产的比例（%）	22.16
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	-
直接或间接为资产负债率超过 70% 的被担保对象提供的债务担保金额（D）	322.05
担保总额超过净资产 50% 部分的金额（E）	-
上述三项担保金额合计（C+D+E）	322.05
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	承担债券的本金、利息及其他相关费用

1、本公司担保事项

(1) 2017年，经公司第四届董事会第五次会议及2016年年度股东大会审议通过，本公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币19亿元的净资本担保。报告期内，人民币19亿元净资本担保尚未使用。

(2) 2018年，经本公司第四届董事会第十六次会议审议通过，公司为华泰联合证券提供最高额度为人民币20亿元的净资本担保承诺，自2019年7月1日起正式启用。2022年，中国证监会深圳监管局批准公司于2022年6月21日起将2019年对华泰联合证券提供的净资本担保承诺金额由人民币20亿元调整为人民币10亿元。报告期末，公司合计为华泰联合证券提供人民币10亿元的净资本担保。

(3) 2020年，经本公司第五届董事会第七次会议审议通过，公司为华泰联合证券提供不超过人民币20亿元的流动性担保承诺，报告期内尚未使用。

(4) 2020年，经公司第五届董事会第二次会议审议通过，公司作为担保人与花旗国际有限公司（作为受托人）签署担保协议，为华泰国际下属公司Pioneer Reward Limited发行的4亿美元债券提供无条件及不可撤销的保证担保，债券已于2023年2月到期兑付全部本息，担保自然终止。

(5) 2021年，经公司第五届董事会第十一次会议和2021年第一次临时股东大会审议通过，由公司境内外债务融资工具一般性授权的获授权人士签署相关决定，公司作为担保人与花旗国际有限公司（作为受托人）签署担保协议，为华泰国际下属公司Pioneer Reward Limited发行的13亿美元债券和后续增发的1亿美元债券提供无条件及不可撤销的保证担保。

(6) 2022年，公司作为担保人与花旗国际有限公司（作为受托人）签署担保协议，为公司华泰国际下属公司Pioneer Reward Limited发行的10亿美元债券以及50亿元人民币债券提供无条件及不可撤销的保证担保。

2、子公司的担保事项

报告期内，华泰国际及其子公司存在担保事项，相关担保均是对其下属子公司提供，且为满足下属子公司业务开展而进行的，主要为企业债担保、中期票据担保以及与交易对手方签署国际衍生品框架协议涉及的交易担保等。截至报告期末，上述担保金额约合人民币371.05亿元。

3、前述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为人民币322.05亿元，包括：1）公司为华泰国际下属公司Pioneer Reward Limited发行的24亿美元债券及50亿元人民币债券所提供的保证担保；2）华泰国际及其子公司为满足下属子公司业务开展需要提供的担保。

3、其他重大合同

(1) 根据《上海证券交易所股票上市规则》及《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号—年度报告的内容与格式（2021年修订）》，报告期内本集团未签署重大合同。

(2) 已披露的有关重要合同在报告期内进展如下：

报告期内《华泰证券广场室内装饰装修二标段工程施工合同》正常履行，公司已按约支付内装饰装修二标段工程施工合同价人民币73.91万元。截至报告期末，公司已按约累计支付内装饰装修二标段工程施工合同价款人民币14,038.89万元（不含承诺扣除的财政复审扣减金额人民币67.15万元和税率调整费用），本合同已履约完毕。

十二、其他重大事项的说明

1、报告期内，公司完成了经营范围工商变更登记，并取得了江苏省市场监督管理局换发的《营业执照》，变更后的经营范围为：许可项目：证券业务；证券投资咨询；公募证券投资基金销售；证券投资基金托管（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，具体经营项目以审批结果为准）一般项目：证券公司为期货公司提供中间介绍业务（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）

2、报告期内，各证券营业部及分公司新设、迁址、撤销等变化情况

(1) 报告期内，公司证券营业部及分公司无新设、撤销情况

(2) 报告期内，分公司迁址情况

序号	迁址前名称	迁址后名称	迁址后地址	获得许可证日期
1	江西分公司	江西分公司	江西省南昌市红谷滩区丽景路 95 号出版中心裙楼一层 101 号商铺 -3# 以及写字楼第 16 层 1603、1604、1605、1606、1607 号	2023 年 1 月 30 日

(3) 报告期内，证券营业部迁址情况

序号	迁址前名称	迁址后名称	迁址后地址	获得许可证日期
1	南京市鱼市街证券营业部	南京中山东路证券营业部	南京市玄武区中山东路 301 号 801 室	2023 年 2 月 15 日
2	北京苏州街证券营业部	北京苏州街证券营业部	北京市海淀区苏州街 29 号维亚大厦 9 层 901、902、903、911、912 室	2023 年 4 月 7 日
3	深圳龙岗大道证券营业部	深圳龙岗大道证券营业部	深圳市龙岗区龙城街道尚景社区万科时代广场 2 栋 101S、102S（龙岗大道与龙城大道交汇处）	2023 年 4 月 17 日
4	深圳竹子林四路证券营业部	深圳平安金融中心证券营业部	深圳市福田区福田街道福安社区益田路 5033 号平安金融中心 70 层 04、05 单元	2023 年 4 月 23 日
5	昆山黑龙江北路证券营业部	昆山黑龙江北路证券营业部	昆山开发区黑龙江北路 8 号御景苑 3 号楼 1 楼 3 室 -1、3 楼 20 室	2023 年 5 月 5 日
6	南京中央路第三证券营业部	南京江宁苏源大道证券营业部	南京市江宁经济技术开发区苏源大道 19 号江宁九龙湖国际企业总部园 A1 幢 1 层南侧	2023 年 5 月 5 日
7	泰州高港金港南路证券营业部	泰州永定东路证券营业部	泰州市永定东路 288 号 3 号楼 2 层	2023 年 6 月 6 日
8	沈阳青年大街证券营业部	沈阳青年大街证券营业部	沈阳市和平区青年大街 318 号（1 门）、320 号（群楼 201）	2023 年 6 月 12 日
9	武汉首义路证券营业部	武汉高新大道证券营业部	武汉市东湖新技术开发区高新大道 768 号慧谷大厦 A 座 1 层 A103-A111、2 层 A205-A208	2023 年 6 月 12 日

3、控股参股公司重大事项说明

(1) 华泰紫金投资

报告期内，华泰紫金投资发起设立了南京华泰金斯瑞生物医药创业投资合伙企业（有限合伙）。截至报告期末，总认缴规模为人民币 100,000 万元，华泰紫金投资作为基金管理人、执行事务合伙人和普通合伙人认缴出资人民币 16,000 万元。

(2) 华泰国际

报告期内，华泰国际于香港新设全资子公司 HS Carbon Neutrality & Energy Transition Investment Limited。

报告期内，华泰国际子公司 Huatai HK Investment (Cayman) Limited 更名为 Huatai International Private Equity Investment Management Limited。

(3) 华泰创新投资

报告期内，华泰创新投资注册地址由“北京市西城区丰盛胡同 28 号楼 7 层 701-8 至 701-11”变更为“上海市长宁区武夷路 234 号”。

4、报告期内，公司已在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》以及上交所网站（www.sse.com.cn）上披露的其他重大事项见附录。

5、报告期内与股东沟通以及投资者关系工作开展情况

投资者关系是公司规范发展、合规经营的重要工作之一，公司董事会高度重视投资者关系管理工作。公司以高度负责的精神策划、安排和组织各类投资者关系管理活动，包括协调来访接待，保持与监管机构、投资者、中介机构及新闻媒体的联系等。

报告期内，公司维护好公司网站“投资者关系”栏目，并做好上交所网站e互动平台投资者咨询问题答复工作；报告期内共接待境内外多家券商和基金公司等机构共19批次约213名研究员和投资人员的现场调研或电话访谈；认真做好日常投资者咨询工作，详细回答投资者提出的问题。同时，为配合定期报告的公布，公司举行了1次业绩发布会和1次e互动业绩说明会，并积极参加境内外证券经营机构举办的策略报告会与投资论坛。报告期内共参加3场策略报告会与投资论坛与39名投资者和研究员就行业发展趋势、公司经营业绩及业务发展战略等问题进行了充分的沟通与交流，有效促进了投资者和研究员对公司经营情况和业绩表现的深入了解，全面推介了公司业务发展优势，有效引导了市场预期。公司坚持对机构投资者、研究员提出的各种问题进行归纳分析整理，以不断提高公司投资者关系管理工作的专业性和规范性，提升投资者关系管理工作质量。

报告期内公司接待调研、沟通、采访等工作开展情况：

序号	接待时间	会议名称	接待方式	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料
1	2023年1月2日	投资者/分析师调研	电话访谈	摩根大通、摩根士丹利、中信证券、国泰君安、复兴国际、申万宏源、华创证券等（139人次）	
2	2023年1月4日	投资者/分析师调研	电话访谈	星展银行（1人次）	
3	2023年2月21日	投资者/分析师调研	电话访谈	BlackRock Investment（4人次）	
4	2023年3月31日	华泰证券2022年度业绩发布会	电话访谈	摩根士丹利、摩根大通、瑞银证券、花旗银行、汇丰银行、中信证券、中金公司、中信建投、国泰君安、申万宏源等（超1000人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
5	2023年4月3日	投资者/分析师调研	电话访谈	仁桥资产（1人次）	
6	2023年4月11日	投资者/分析师调研	现场访谈	Citadel International Equities（1人次）	
7	2023年4月13日	投资者/分析师调研	电话访谈	威灵顿资管（2人次）	
8	2023年4月17日	投资者/分析师调研	电话访谈	景林资产（2人次）	
9	2023年4月20日	投资者/分析师调研	电话访谈	摩根大通（1人次）	

序号	接待时间	会议名称	接待方式	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料
10	2023年4月21日	投资者/分析师调研	电话访谈	星展银行（1人次）	
11	2023年4月25日	投资者/分析师调研	现场访谈	兴业证券、路博迈、泰康资产、国泰基金、西部利得、宁泉资产、富国基金等（8人次）	
12	2023年5月8日	投资者/分析师调研	电话访谈	申万宏源、中银基金、财通证券、广发证券、南京证券、景林资产等（24人次）	
13	2023年5月9日	投资者/分析师调研	现场访谈	中金公司（3人次）	
14	2023年5月12日	投资者/分析师调研	现场访谈	睿远基金（1人次）	
15	2023年5月15日	投资者/分析师调研	现场访谈	长城证券等（7人次）	
16	2023年5月17日	天风证券 2023年中期策略会	电话访谈	天风证券、中信证券、景林资产、兴业银行、汇添富基金、工银瑞信、平安理财等（28人次）	公司业务发展情况、创新业务开展情况及公司长远发展战略等
17	2023年5月18日	投资者/分析师调研	现场访谈	长江证券、旌安投资（3人次）	
18	2023年5月25日	广发证券策略会	现场访谈	广发证券、宁银理财、德汇投资、太保资产（5人次）	
19	2023年6月1日	中信证券 2023年资本市场论坛	现场访谈	中信证券、长江养老、双安资产、果实资本、淡水泉投资（6人次）	
20	2023年6月12日	投资者/分析师调研	现场访谈	瑞银证券、国泰君安、申万宏源（5人次）	
21	2023年6月14日	投资者/分析师调研	现场访谈	华创证券（5人次）	
22	2023年6月15日	投资者/分析师调研	现场访谈	广发证券（4人次）	
23	2023年6月16日	投资者/分析师调研	现场访谈	太平洋证券（1人次）	

股份变动及股东情况

CHANGES IN SHARES AND SHAREHOLDERS

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、股份变动情况表

单位：股

	本次变动前		本次变动增减(+, -)					本次变动后	
	数量	比例(%)	发行 新股	送股	公积 金转 股	其他	小计	数量	比例(%)
一、有限售条件股份	44,427,027	0.49	-	-	-	-14,222,943	-14,222,943	30,204,084	0.33
1、国家持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2、国有法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3、其他内资持股	44,427,027	0.49	-	-	-	-14,222,943	-14,222,943	30,204,084	0.33
其中：境内非国有 法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
境内自然人持股	44,427,027	0.49	-	-	-	-14,222,943	-14,222,943	30,204,084	0.33
4、外资持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：境外法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
境外自然人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
二、无限售条件流通股份	9,031,162,000	99.51	-	-	-	14,222,943	14,222,943	9,045,384,943	99.67
1、人民币普通股	7,312,116,320	80.57	-	-	-	14,222,943	14,222,943	7,326,339,263	80.73
2、境内上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3、境外上市的外资股	1,719,045,680	18.94	-	-	-	-	-	1,719,045,680	18.94
4、其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
三、股份总数	9,075,589,027	100.00	-	-	-	-	-	9,075,589,027	100.00

2、股份变动情况说明

2023年4月，公司A股限制性股票激励计划首次授予部分第一个限售期解除限售条件成就，共计14,222,943股限制性股票解除限售为无限售条件流通股。

3、报告期内公司股份变动未对每股收益、每股净资产等财务指标产生影响

4、报告期内无公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

(二) 限售股份变动情况

单位：股

股东名称	期初 限售股数	报告期解除限 售股数	报告期增加 限售股数	报告期末限售 股数	限售原因	解除限售 日期
A股限制性股票激励对象	44,427,027	14,222,943	-	30,204,084	A股限制性股票 激励计划	2023年4 月24日
合计	44,427,027	14,222,943	-	30,204,084	/	/

注：根据2021年2月9日公司披露的《华泰证券股份有限公司A股限制性股票股权激励计划》的规定，激励计划授予的限制性股票自相应授予部分股票登记完成之日起满24个月后，满足解除限售条件的，激励对象可以在未来36个月内按33%、33%、34%的比例分三期解除限售。本激励计划中限制性股票的登记日为2021年4月6日，第一个限售期于2023年4月5日届满。本次解锁股票数量为14,222,943股，本次解锁股票上市流通日期为2023年4月24日。

二、股东情况

(一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数（户）	256,953
截至报告期末表决权恢复的优先股股东总数（户）	-

截至报告期末普通股股东总数中，A股股东249,914户，H股登记股东7,039户。

(二) 截至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	
江苏省国信集团有限公司	-	1,373,481,636	15.13	-	无	-	国有法人
香港中央结算（代理人）有限公司	-8,407,409	1,266,027,718	13.95	-	无	-	境外法人
江苏交通控股有限公司	-	489,065,418	5.39	-	无	-	国有法人
江苏高科技投资集团有限公司	100,000	356,183,206	3.92	-	无	-	国有法人
江苏省苏豪控股集团有限公司	27,038,803	283,264,288	3.12	-	无	-	国有法人
香港中央结算有限公司	96,564,475	269,638,900	2.97	-	无	-	境外法人
阿里巴巴（中国）网络技术有限公司	-	268,199,233	2.96	-	无	-	境内非国有法人
中国证券金融股份有限公司	-	152,906,738	1.68	-	无	-	未知
江苏苏豪国际集团股份有限公司	1,979,200	137,838,367	1.52	-	无	-	国有法人
江苏宏图高科技股份有限公司	-	123,169,146	1.36	-	无	123,169,146	境内非国有法人

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
江苏省国信集团有限公司	1,373,481,636	人民币普通股	1,271,072,836
		境外上市外资股	102,408,800
香港中央结算（代理人）有限公司	1,266,027,718	境外上市外资股	1,266,027,718
		人民币普通股	452,065,418
江苏交通控股有限公司	489,065,418	境外上市外资股	37,000,000
		人民币普通股	341,978,006
江苏高科技投资集团有限公司	356,183,206	境外上市外资股	14,205,200
		人民币普通股	81,851,288
江苏省苏豪控股集团有限公司	283,264,288	境外上市外资股	201,413,000
		人民币普通股	269,638,900
香港中央结算有限公司	269,638,900	人民币普通股	269,638,900
阿里巴巴（中国）网络技术有限公司	268,199,233	人民币普通股	268,199,233
中国证券金融股份有限公司	152,906,738	人民币普通股	152,906,738

前十名无限售条件股东持股情况

江苏苏豪国际集团股份有限公司	137,838,367	人民币普通股	43,132,567
		境外上市外资股	94,705,800
江苏宏图高科技股份有限公司	123,169,146	人民币普通股	123,169,146
前十名股东中回购专户情况说明	前十名股东中无回购专户。		
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	上述股东不存在委托表决权、受托表决权、放弃表决权的情况。		
上述股东关联关系或一致行动的说明	国信集团、交通控股、江苏高投和江苏省苏豪控股集团有限公司均为江苏省国资委所属独资企业。江苏省苏豪控股集团有限公司是江苏苏豪国际集团股份有限公司的控股股东。此外，公司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	公司无优先股股东。		

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、本公司境外上市外资股（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。截至报告期末，国信集团、交通控股、江苏高投、江苏省苏豪控股集团有限公司和江苏苏豪国际集团股份有限公司通过港股通分别购入了本公司H股股份102,408,800股、37,000,000股、14,205,200股、201,413,000股和94,705,800股，此部分股份亦为香港中央结算（代理人）有限公司代为持有。本报告披露时，特将此部分股份单独列出，若将此部分股份包含在内，香港中央结算（代理人）有限公司实际代为持有股份为1,715,760,518股，占公司总股本的18.91%。

3、截至报告期末，江苏高投持有的50,000股A股股票因参与转融通业务仍出借在外，若全部归还，则实际持有公司342,028,006股A股股份及14,205,200股H股股份，占公司总股本的3.93%。

4、香港中央结算有限公司是沪股通投资者所持有公司A股股份的名义持有人。

5、Citibank, National Association 为公司GDR存托人，GDR对应的境内基础A股股票依法登记在其名下。根据存托人统计，截至报告期末公司GDR存续数量为134,745份，占中国证监会核准发行数量的0.16%。

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

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	周易	482,400	详见附注	-	详见附注
2	韩臻聪	402,000	详见附注	-	详见附注
3	李世谦	402,000	详见附注	-	详见附注
4	孙含林	402,000	详见附注	-	详见附注
5	姜健	402,000	详见附注	-	详见附注
6	张辉	402,000	详见附注	-	详见附注
7	陈天翔	402,000	详见附注	-	详见附注
8	焦晓宁	335,000	详见附注	-	详见附注
9	焦凯	335,000	详见附注	-	详见附注
10	王翀	335,000	详见附注	-	详见附注

上述股东关联关系或一致行动的说明 公司未知关联关系或者一致行动安排

注：上述有限售条件股份为公司因实施A股限制性股票激励计划向激励对象授予的股份，可上市交易情况和限售条件等内容详见公司于2021年2月9日在上交所网站披露的《A股限制性股票股权激励计划》相关公告。

(三) 不存在战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东的情况

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情况无变动

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内未被授予股权激励

四、本公司无控股股东及实际控制人变更的情况

五、主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

截至 2023 年 6 月 30 日，据本公司和董事合理查询所知，以下人士（并非本公司董事、监事或最高行政人员）于股份或相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 2 及第 3 分部须向本公司披露并根据《证券及期货条例》第 336 条已记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓：

序号	主要股东名称	股份类别	权益性质	持有的股份数目(股)	占本公司已发行股份总数的比例(%)	占本公司已发行 A 股 / H 股总数的比例(%)	好仓 / 淡仓 / 可供借出的股份
1	江苏省国信集团有限公司	A 股	实益拥有人	1,271,072,836	14.01	17.28	好仓
		H 股 (港股通)	实益拥有人	102,408,800	1.13	5.96	好仓
2	江苏交通控股有限公司	A 股	实益拥有人	452,065,418	4.98	6.15	好仓
		H 股 (港股通)	实益拥有人	37,000,000	0.41	2.15	好仓
3	江苏省苏豪控股集团有限公司	A 股	实益拥有人	81,851,288	0.90	1.11	好仓
			受控法团权益	43,132,567	0.48	0.59	好仓
		H 股 (港股通)	实益拥有人	201,413,000	2.22	11.72	好仓
			受控法团权益	94,705,800	1.04	5.51	好仓

注 1：根据《证券及期货条例》第 336 条，倘若若干条件达成，则本公司股东须呈交披露权益表格。倘股东于本公司的持股量变更，除非若干条件已达成，否则股东毋须知会本公司及香港联交所，故主要股东于本公司之最新持股量可能与呈交予香港联交所的持股量不同。

江苏省苏豪控股集团有限公司直接持有本公司 81,851,288 股 A 股好仓及 201,413,000 股 H 股好仓，并通过受其控制的法团江苏苏豪国际集团股份有限公司间接持有本公司 43,132,567 股 A 股好仓及 94,705,800 股 H 股好仓。

注 2：如股东对股份本身持有权益，包括透过持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而持有权益，并因而具有如下的权利与责任，该股东便属于持有好仓：

(i) 其有权购入相关股份；(ii) 其有责任购入相关股份；(iii) 如相关股份价格上升，其有权收取款项；或 (iv) 如相关股份价格上升，其有权避免或减低损失。

注 3：如股东根据证券借贷协议借入股份，或如股东因持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而具有以下的权利与责任，该股东便属于持有淡仓：(i) 其有权要求另一个人购入相关股份；(ii) 其有责任交付相关股份；(iii) 如相关股份价格下降，其有权收取款项；或 (iv) 如相关股份价格下降，其有权避免或减低损失。

除上述披露外，于 2023 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。

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

截至报告期末，因公司实施 A 股限制性股票激励计划，本公司董事持有的股票情况如下：

序号	姓名	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/淡仓/可供借出的股份
1	周易	A 股	实益拥有人	720,000	0.008	0.010	好仓

除上述披露外，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司并不知悉其他本公司董事、监事及最高行政人员在本公司或其相联法团的股份、相关股份或债权证中拥有任何根据《证券及期货条例》第 XV 部及第 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。

七、购回出售或赎回本公司及附属公司的上市证券

公司于 2022 年 1 月 13 日非公开发行含回售选择权的公司债券，简称“22 华泰 F1”，发行规模人民币 40 亿元，票面利率 2.75%，并于上交所挂牌。2022 年 12 月 16 日，公司对 22 华泰 F1 行使发行人调整票面利率选择权，投资人选择全额回售，公司对回售债券不进行转售，于 2023 年 1 月 17 日全额支付了人民币 40 亿元回售资金，并支付了人民币 1.1 亿元期间利息（含税）。

除上述披露外，报告期内本公司及附属公司未购回、出售或赎回本公司及附属公司的任何上市证券。

八、董事及监事购买股份或债券之安排

报告期内，本公司、其控股公司或其任何附属公司或同系附属公司概无订立任何安排，致使董事及监事借购买本公司或任何其他法人团体股份或债券而获益。

九、报告期内公司无优先股相关情况

债券相关情况

BONDS

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

(一) 报告期内公司无企业债券

(二) 公司债券

1. 公司债券基本情况

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
华泰证券股份有限公司 2018年面向合格投资者公开发行 公司债券(第一期) (品种二)	18华泰G2	155048	2018-11-22	2018-11-26	2023-11-26	10	4.17	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限公司 2020年面向合格投资者公开发行 公司债券(第二期)	20华泰G3	163482	2020-04-27	2020-04-29	2025-04-29	35	2.90	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限公司 2020年面向合格投资者公开发行 公司债券(第三期)	20华泰G4	163558	2020-05-19	2020-05-21	2025-05-21	30	3.20	到期还本, 按年付息

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
华泰证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)	20 华泰 C1	175409	2020-11-11	2020-11-13	2025-11-13	50	4.48	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)	20 华泰 G7	175473	2020-11-20	2020-11-24	2023-11-24	35	3.90	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	20 华泰 G9	175535	2020-12-07	2020-12-09	2023-12-09	40	3.79	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	21 华泰 G1	175648	2021-01-18	2021-01-20	2024-01-20	40	3.58	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)	21 华泰 C1	175721	2021-01-27	2021-01-29	2026-01-29	90	4.50	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	21 华泰 G3	188047	2021-04-22	2021-04-26	2024-04-26	50	3.42	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	21 华泰 G4	188106	2021-05-13	2021-05-17	2026-05-17	60	3.71	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	21 华泰 G5	188134	2021-05-20	2021-05-24	2024-05-24	40	3.28	到期还本,按年付息

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
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第四期) (品种二)	21 华泰 G6	188140	2021-05-20	2021-05-24	2026-05-24	20	3.63	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第五期) (品种一)	21 华泰 G7	188239	2021-06-10	2021-06-15	2024-06-15	20	3.40	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第六期) (品种一)	21 华泰 09	188282	2021-06-17	2021-06-21	2024-06-21	25	3.45	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第七期) (品种一)	21 华泰 11	188324	2021-09-03	2021-09-07	2024-09-07	15	3.03	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第七期) (品种二)	21 华泰 12	188325	2021-09-03	2021-09-07	2031-09-07	27	3.78	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 永续次级债券(第一 期)	21 华泰 Y1	188785	2021-09-15	2021-09-17	-	30	3.85	在发行人 不行使递 延支付利 息权的情 况下,每 年付息一 次
华泰证券股份有限 公司 2021 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第八期) (品种一)	21 华泰 13	188874	2021-10-14	2021-10-18	2024-10-18	21	3.25	到期还本, 按年付息

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
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第八期) (品种二)	21 华泰 14	188875	2021-10-14	2021-10-18	2031-10-18	34	3.99	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第九期) (品种一)	21 华泰 15	188926	2021-10-21	2021-10-25	2024-10-25	22	3.22	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第九期) (品种二)	21 华泰 16	188927	2021-10-21	2021-10-25	2031-10-25	11	3.94	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行永续次级债券 (第二期)	21 华泰 Y2	188942	2021-10-26	2021-10-28	-	50	4.00	在发行人不行使递延支付利息权的情况下, 每年付息一次
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行永续次级债券 (第三期)	21 华泰 Y3	185019	2021-11-16	2021-11-18	-	20	3.80	在发行人不行使递延支付利息权的情况下, 每年付息一次
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券 (第一期)	22 华泰 Y1	185337	2022-01-24	2022-01-26	-	27	3.49	在发行人不行使递延支付利息权的情况下, 每年付息一次

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
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	22华泰G1	185364	2022-02-10	2022-02-14	2025-02-14	50	2.79	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第二期)	22华泰Y2	185388	2022-07-07	2022-07-11	-	30	3.59	在发行人不行使递延支付利息权的情况下,每年付息一次
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	22华泰G2	137666	2022-08-11	2022-08-15	2024-08-15	20	2.43	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	22华泰G3	137732	2022-08-24	2022-08-26	2024-08-26	30	2.33	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)	22华泰G4	137780	2022-09-01	2022-09-05	2025-09-05	20	2.52	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)	22华泰G5	137814	2022-09-08	2022-09-13	2025-09-13	30	2.50	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第三期)	22华泰Y3	137604	2022-10-19	2022-10-21	-	35	3.20	在发行人不行使递延支付利息权的情况下,每年付息一次

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
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	22 华泰 G6	138597	2022-11-17	2022-11-21	2024-11-21	36	2.87	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	22 华泰 G7	138598	2022-11-17	2022-11-21	2027-11-21	14	3.18	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第七期)(品种一)	22 华泰 G8	138679	2022-12-01	2022-12-05	2024-12-05	15	2.87	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第八期)(品种一)	22 华泰 10	138709	2022-12-08	2022-12-12	2025-12-12	20	3.35	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第八期)(品种二)	22 华泰 11	138710	2022-12-08	2022-12-12	2027-12-12	5	3.49	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第九期)(品种一)	22 华泰 12	138737	2022-12-20	2022-12-22	2024-12-22	40	3.24	到期还本,按年付息
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	23 华泰 G1	138816	2023-01-06	2023-01-10	2025-01-10	40	2.92	到期还本,按年付息

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
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第二期) (品种一)	23 华泰 G2	138844	2023-01-12	2023-01-16	2025-01-16	8	3.00	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第二期) (品种二)	23 华泰 G3	138845	2023-01-12	2023-01-16	2028-01-16	20	3.48	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第三期)	23 华泰 G4	138857	2023-02-02	2023-02-06	2026-02-06	45	3.23	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第四期)	23 华泰 G5	138886	2023-02-09	2023-02-13	2028-02-13	40	3.39	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第五期) (品种一)	23 华泰 G6	138915	2023-02-23	2023-02-27	2026-02-27	15	3.14	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券(第五期) (品种二)	23 华泰 G7	138916	2023-02-23	2023-02-27	2028-02-27	22	3.36	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向 专业投资者公开发 行短期公司债券(第 一期)	23 华泰 S1	115083	2023-03-15	2023-03-17	2023-09-15	50	2.65	到期一次 还本付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向 专业投资者公开发 行短期公司债券(第 二期)	23 华泰 S2	115117	2023-03-21	2023-03-23	2023-10-25	50	2.65	到期一次 还本付息

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
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券 (第六期) (品种一)	23 华泰 G8	115346	2023-05-08	2023-05-10	2025-07-10	17	2.82	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券 (第六期) (品种二)	23 华泰 G9	115347	2023-05-08	2023-05-10	2028-05-10	7	3.07	到期还本, 按年付息
华泰证券股份有限 公司 2023 年面向专 业投资者公开发行 公司债券 (第七期)	23 华泰 10	115367	2023-08-22	2023-08-24	2026-08-24	20	2.64	到期还本, 按年付息

注: 1、上述公司债券面向专业投资者公开发行, 专业投资者应当具备相应的风险识别和承担能力, 知悉并自行承担公司债券的投资风险, 并符合《公司债券发行与交易管理办法》《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》及相关法律法规的规定(法律、法规禁止购买者除外)。投资者不得非法利用他人账户或资金账户进行认购, 也不得违规融资或替代违规融资认购。投资者认购上述公司债券应遵守相关法律法规和中国证监会的有关规定, 并自行承担相应的法律责任。

2、上述公司债券在上交所上市, 根据《上海证券交易所债券交易规则》, 可采取匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交的交易方式。

3、上述公司债券的主承销商、受托管理人等信息参见债券募集说明书。

4、21 华泰 Y1、21 华泰 Y2、21 华泰 Y3、22 华泰 Y1、22 华泰 Y2、22 华泰 Y3 均设发行人续期选择权、发行人赎回权、满足特定条件时发行人赎回选择权、发行人递延支付利息权。存续的前 5 个计息年度的票面利率通过簿记建档方式确定, 在前 5 个计息年度内保持不变, 自第 6 个计息年度起, 每 5 年重置一次票面利率。如果发行人不行使赎回权, 则从第 6 个计息年度开始票面利率调整为当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点, 在第 6 个计息年度至第 10 个计息年度内保持不变。此后每 5 年重置票面利率为当期基准利率加上初始利差再加 300 个基点。初始利差为前 5 个计息年度的票面利率与初始基准利率之间的差值。

5、华泰国际下属公司 Pioneer Reward Limited 于 2023 年 7 月 31 日设立本金总额最高为 30 亿美元(或等值其他货币)的境外中期票据计划。2023 年 8 月 9 日, Pioneer Reward Limited 在该中期票据计划下发行第一笔中期票据, 发行金额为 8 亿美元, 期限 3 年, 票面利率为 5.25%, 还本付息方式为每半年付息, 到期还本, 上市地点为香港联交所。

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

公司发行的 21 华泰 Y1、21 华泰 Y2、21 华泰 Y3、22 华泰 Y1、22 华泰 Y2、22 华泰 Y3 均设发行人续期选择权、发行人赎回权, 截至本报告披露日尚未到发行人续期选择权行权日; 设满足特定条件时发行人赎回选择权、设发行人递延支付利息权, 截至本报告披露日均未触发。

截至本报告披露日, 公司按照公司债券募集说明书的约定, 严格执行投资者保护条款、偿债保障措施的相关约定, 并按时、足额兑付各项债券的本金和 / 或利息。

3. 报告期末募集资金使用情况

报告期末，公司存续债券的募集资金使用情况如下：

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	募集资金总金额	已使用金额	未使用金额
18 华泰 G2	10	10	-
20 华泰 G3	35	35	-
20 华泰 G4	30	30	-
20 华泰 C1	50	50	-
20 华泰 G7	35	35	-
20 华泰 G9	40	40	-
21 华泰 G1	40	40	-
21 华泰 C1	90	90	-
21 华泰 G3	50	50	-
21 华泰 G4	60	60	-
21 华泰 G5	40	40	-
21 华泰 G6	20	20	-
21 华泰 G7	20	20	-
21 华泰 09	25	25	-
21 华泰 11	15	15	-
21 华泰 12	27	27	-
21 华泰 Y1	30	30	-
21 华泰 14	34	34	-
21 华泰 13	21	21	-
21 华泰 16	11	11	-
21 华泰 15	22	22	-
21 华泰 Y2	50	50	-
21 华泰 Y3	20	20	-
22 华泰 Y1	27	27	-
22 华泰 G1	50	50	-
22 华泰 Y2	30	30	-
22 华泰 G2	20	20	-
22 华泰 G3	30	30	-
22 华泰 G4	20	20	-

债券名称	募集资金总金额	已使用金额	未使用金额
22 华泰 G5	30	30	-
22 华泰 Y3	35	35	-
22 华泰 G6	36	36	-
22 华泰 G7	14	14	-
22 华泰 G8	15	15	-
22 华泰 10	20	20	-
22 华泰 11	5	5	-
22 华泰 12	40	40	-
23 华泰 G1	40	40	-
23 华泰 G2	8	8	-
23 华泰 G3	20	20	-
23 华泰 G4	45	45	-
23 华泰 G5	40	40	-
23 华泰 G6	15	15	-
23 华泰 G7	22	22	-
23 华泰 S1	50	50	-
23 华泰 S2	50	50	-
23 华泰 G8	17	17	-
23 华泰 G9	7	7	-

注：根据《公司债券发行与交易管理办法》的要求，为确保募集资金的使用与募集说明书一致，保证债券持有人的合法权力，公司在监管银行对募集资金设立募集资金使用专项账户，由监管银行对账户进行监管。公司债券募集资金已使用完毕，募集资金的使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

4. 报告期内，公司无信用评级结果调整情况

5. 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其影响

现状	执行情况	是否发生变更
公司存续的公司债券均采用无担保方式发行，根据公司债券募集说明书的约定，履行偿债计划。根据公司债券募集说明书的约定，公司偿债保障措施包括但不限于制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、设立专门的偿付工作小组、严格履行信息披露义务、设置专项偿债账户等内容。	公司严格履行募集说明书中有关偿债计划的约定，按时兑付公司债券利息和 / 或本金，及时披露公司相关信息，以保障投资者的合法权益。	否

6. 公司债券其他情况的说明

(1) 报告期末有息负债金额及种类

单位: 亿元 币种: 人民币

项目	本公司		本集团	
	金额	占比	金额	占比
短期借款	-	-	136.64	3.75%
应付短期融资款	169.61	5.89%	267.62	7.34%
拆入资金	336.06	11.68%	346.90	9.52%
卖出回购金融资产款	1,150.03	39.97%	1,459.65	40.06%
应付债券	1,221.85	42.46%	1,426.44	39.15%
长期借款	-	-	6.58	0.18%
合计	2,877.55	100.00%	3,643.83	100.00%

注: 报告期末, 公司永续次级债券本金 192 亿元, 已计入权益工具, 未包含在有息负债中。集团发行的一笔境外债本金 19.75 亿元计入交易性金融负债, 未包含在上述有息负债中。

(2) 报告期末有息负债剩余期限结构

单位: 亿元 币种: 人民币

项目	本公司		本集团	
	一年以内(含一年)	一年以上	一年以内(含一年)	一年以上
短期借款	-	-	136.64	-
应付短期融资款	169.61	-	267.62	-
拆入资金	336.06	-	346.90	-
卖出回购金融资产款	1,150.03	-	1,459.65	-
应付债券	267.24	954.61	332.41	1,094.03
长期借款	-	-	-	6.58
合计	1,922.94	954.61	2,543.22	1,100.61

注: 报告期末, 公司永续次级债券本金为 192 亿元, 剩余期限均为 1 年以上。集团发行的一笔境外债本金 19.75 亿元计入交易性金融负债, 剩余期限为 1 年以上, 未包含在上述有息负债中。

(三) 报告期内, 公司无银行间债券市场非金融企业债务融资工具

(四) 报告期内, 公司无合并报表范围亏损超过上年末净资产 10% 的情况

(五) 主要会计数据和财务指标

单位: 万元 币种: 人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减 (%)	变动原因
流动比率	1.35	1.40	-3.57	
速动比率	1.35	1.40	-3.57	
资产负债率 (%)	76.57	75.81	增加 0.76 个百分点	
	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
扣除非经常损益后净利润	701,661.68	530,751.08	32.20	主要系营业收入增长所致
EBITDA 全部债务比 (%)	3.71	3.18	增加 0.53 个百分点	
利息保障倍数	2.29	2.32	-1.29	
现金利息保障倍数	-0.15	6.64	不适用	
EBITDA 利息保障倍数	2.44	2.46	-0.81	
贷款偿还率 (%)	100.00	100.00	-	
利息偿付率 (%)	100.00	100.00	-	

二、报告期内, 公司无可转换公司债券

4

财务报告及备查文件

Financial Report and Documents for Inspection



半年度财务报告

自 2023 年 1 月 1 日
至 2023 年 6 月 30 日止期间财务报表
(按中国企业会计准则编制)

合并及母公司资产负债表 2023 年 6 月 30 日

	附注五	本集团		本公司	
		2023 年 6 月 30 日 人民币元 (未经审计)	2022 年 12 月 31 日 人民币元 (经审计, 经重述)	2023 年 6 月 30 日 人民币元 (未经审计)	2022 年 12 月 31 日 人民币元 (经审计, 经重述)
资产					
货币资金	1	164,061,684,330.57	155,611,751,475.45	93,789,024,374.47	86,574,567,028.52
其中: 客户资金存款		116,550,537,451.23	110,431,006,423.76	79,072,500,587.64	75,070,055,377.94
结算备付金	2	38,926,809,547.46	38,745,845,328.92	43,800,513,043.05	47,135,809,813.24
其中: 客户备付金		32,133,166,514.16	30,029,339,793.32	32,124,095,310.57	30,027,968,209.45
融出资金	3	105,412,167,380.85	100,648,374,713.73	102,156,818,730.68	98,360,566,463.53
衍生金融资产	4	15,039,940,496.99	15,788,300,794.08	11,153,165,024.15	12,910,011,934.59
存出保证金	5	40,195,073,997.40	42,706,776,632.52	12,460,103,828.21	14,777,245,320.04
应收款项	6	9,961,846,848.94	7,804,340,649.41	3,317,474,756.36	2,966,173,370.43
买入返售金融资产	7	17,389,635,416.53	34,824,221,391.64	14,803,129,374.11	31,917,344,380.69
金融投资:		455,207,238,519.42	410,844,544,832.63	328,988,241,418.20	301,759,051,795.38
交易性金融资产	8	389,219,875,352.27	351,546,008,749.87	267,482,681,195.72	246,047,565,553.30
债权投资	9	50,322,360,053.24	48,552,570,216.94	50,066,186,443.79	48,304,074,062.34
其他债权投资	10	15,394,224,826.67	10,504,379,072.24	11,386,679,918.66	7,354,718,319.71
其他权益工具投资	11	270,778,287.24	241,586,793.58	52,693,860.03	52,693,860.03
长期股权投资	12	20,149,043,027.91	19,241,162,729.26	39,836,043,138.23	38,917,299,297.22
投资性房地产	13	210,526,964.89	217,585,767.44	954,795,762.45	974,805,994.60
固定资产	14	4,514,373,440.07	4,681,670,244.49	2,814,524,772.83	2,943,337,515.13
在建工程	15	419,627,981.52	195,750,312.31	397,313,853.89	175,102,258.39
使用权资产	16	1,486,994,867.90	1,409,962,145.45	824,812,331.45	845,707,943.95
无形资产	17	7,581,157,975.22	7,439,816,303.97	842,034,492.91	831,803,455.44
商誉	18	3,489,002,215.26	3,352,218,983.68	-	-
递延所得税资产	19	787,069,994.86	600,473,004.83	-	-
其他资产	20	2,238,065,096.52	2,458,194,275.19	10,324,810,525.96	11,062,451,831.63
资产总计		<u>887,070,258,102.31</u>	<u>846,570,989,585.00</u>	<u>666,462,805,426.95</u>	<u>652,151,278,402.78</u>

合并及母公司资产负债表 - 续

2023 年 6 月 30 日

	附注五	本集团		本公司	
		2023 年 6 月 30 日 人民币元 (未经审计)	2022 年 12 月 31 日 人民币元 (经审计, 经重述)	2023 年 6 月 30 日 人民币元 (未经审计)	2022 年 12 月 31 日 人民币元 (经审计, 经重述)
负债和股东权益					
负债:					
短期借款	22	13,664,406,676.41	7,997,434,369.44	-	-
应付短期融资款	23	26,762,349,965.71	25,772,603,803.83	16,961,163,914.36	18,203,723,106.60
拆入资金	24	34,690,063,707.60	25,877,713,063.31	33,605,843,855.35	25,877,713,063.31
交易性金融负债	25	42,722,423,687.24	48,575,558,959.92	15,383,107,128.78	17,530,156,482.53
衍生金融负债	4	13,923,850,021.63	9,638,125,064.39	10,908,268,281.26	11,673,223,630.40
卖出回购金融资产款	26	145,964,883,118.45	144,117,998,464.81	115,002,692,930.24	121,317,309,490.13
代理买卖证券款	27	159,354,314,296.21	152,551,723,234.45	105,587,990,546.44	101,426,766,181.33
代理承销证券款	28	173,451,206.49	150,460,486.80	10,783,649.58	5,357,400.00
应付职工薪酬	29	10,595,185,158.88	11,892,625,022.61	6,623,697,537.34	6,825,116,805.64
应交税费	30	1,088,366,633.19	999,459,547.41	371,100,199.98	342,482,669.24
应付款项	31	112,722,381,912.00	105,297,640,231.52	87,609,389,016.20	86,294,506,980.69
合同负债	32	276,677,098.17	218,942,583.42	-	-
长期借款	33	657,557,638.84	804,902,959.53	-	-
应付债券	34	142,643,834,650.98	139,419,337,853.75	122,185,101,158.43	116,784,393,390.12
租赁负债	35	1,583,520,140.27	1,518,585,619.09	837,869,158.82	862,487,499.59
预计负债	36	711,874,512.35	101,047.62	101,047.62	101,047.62
递延所得税负债	19	2,458,360,904.98	2,199,928,166.60	503,999,107.88	138,320,675.01
其他负债	37	6,563,406,606.43	1,681,239,113.53	5,830,211,942.55	1,231,218,518.93
负债合计		<u>716,556,907,935.83</u>	<u>678,714,379,592.03</u>	<u>521,421,319,474.83</u>	<u>508,512,876,941.14</u>

合并及母公司资产负债表 – 续

2023年6月30日

	附注五	本集团		本公司	
		2023年6月30日 人民币元 (未经审计)	2022年12月31日 人民币元 (经审计, 经重述)	2023年6月30日 人民币元 (未经审计)	2022年12月31日 人民币元 (经审计, 经重述)
负债和股东权益 (续)					
股东权益:					
股本	38	9,075,589,027.00	9,075,589,027.00	9,075,589,027.00	9,075,589,027.00
其他权益工具	39	19,200,000,000.00	19,200,000,000.00	19,200,000,000.00	19,200,000,000.00
其中: 永续债		19,200,000,000.00	19,200,000,000.00	19,200,000,000.00	19,200,000,000.00
资本公积	40	70,335,857,426.28	70,482,060,067.29	68,757,687,701.72	68,927,381,060.43
减: 库存股	41	(1,071,809,845.70)	(1,202,324,401.85)	(1,071,809,845.70)	(1,202,324,401.85)
其他综合收益	42	1,430,985,697.89	793,229,852.41	93,313,271.34	47,145,460.89
盈余公积	43	7,791,328,623.91	7,791,328,623.91	7,791,328,623.91	7,791,328,623.91
一般风险准备	44	21,070,304,578.82	21,026,132,943.39	15,796,226,489.83	15,795,892,112.32
未分配利润	45	39,671,901,152.22	37,929,085,711.28	25,399,150,684.02	24,003,389,578.94
归属于母公司股东权益合计		167,504,156,660.42	165,095,101,823.43	145,041,485,952.12	143,638,401,461.64
少数股东权益		3,009,193,506.06	2,761,508,169.54	-	-
股东权益合计		170,513,350,166.48	167,856,609,992.97	145,041,485,952.12	143,638,401,461.64
负债和股东权益总计		887,070,258,102.31	846,570,989,585.00	666,462,805,426.95	652,151,278,402.78

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。
此财务报表已获董事会批准。

张伟
法定代表人

焦晓宁
主管会计工作负责人

费雷
会计机构负责人

合并及母公司利润表

2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间

	附注五	本集团		本公司	
		2023 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2022 年 1-6 月 人民币元 (未经审计, 经重述)	2023 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2022 年 1-6 月 人民币元 (未经审计, 经重述)
一、营业总收入		18,369,294,321.77	16,166,099,092.18	11,166,165,223.29	8,423,597,344.98
手续费及佣金净收入	46	7,547,798,988.07	7,528,898,374.50	3,114,059,978.95	3,483,455,455.95
其中:					
经纪业务手续费净收入		3,153,003,608.38	3,553,669,459.63	2,810,275,081.91	3,197,961,338.62
投资银行业务手续费净收入		1,610,043,779.94	1,690,578,024.73	173,042,670.22	174,281,551.13
资产管理业务手续费净收入		2,085,349,230.46	1,669,276,065.41	-	-
利息净收入	47	641,229,202.05	1,385,350,333.80	1,334,519,439.24	1,233,799,436.28
其中: 利息收入		7,262,841,120.95	6,758,476,513.09	6,284,480,528.54	6,064,704,178.55
利息支出		(6,621,611,918.90)	(5,373,126,179.29)	(4,949,961,089.30)	(4,830,904,742.27)
投资收益	48	9,352,441,369.51	740,794,662.28	5,429,771,591.10	1,342,938,269.58
其中:					
对联营及合营企业的投资收益		1,247,912,552.83	463,472,674.51	1,437,820,733.98	1,150,635,784.52
其他收益	49	90,570,624.28	113,650,014.40	71,825,624.88	57,947,274.16
公允价值变动(损失)/收益	50	(2,286,063,308.00)	3,477,109,453.94	1,217,047,384.97	1,687,388,785.75
汇兑收益/(损失)		1,609,504,338.56	881,434,733.84	(38,699,398.54)	562,184,868.43
其他业务收入	51	1,413,803,117.13	2,038,672,932.04	37,634,986.38	55,752,320.99
资产处置收益	52	9,990.17	188,587.38	5,616.31	130,933.84
二、营业总支出		(9,682,312,285.01)	(9,369,607,619.91)	(4,207,168,200.34)	(3,574,162,508.88)
税金及附加	53	(97,439,721.42)	(105,128,036.36)	(72,322,718.28)	(76,446,416.36)
业务及管理费	54	(8,630,463,888.33)	(7,611,883,947.90)	(4,589,077,171.09)	(3,762,709,137.48)
信用减值损失	55	418,011,596.95	337,624,465.17	472,441,045.31	284,512,183.82
其他业务成本	56	(1,372,420,272.21)	(1,990,220,100.82)	(18,209,356.28)	(19,519,138.86)
三、营业利润		8,686,982,036.76	6,796,491,472.27	6,958,997,022.95	4,849,434,836.10
加: 营业外收入	57	31,662,491.57	1,046,559.74	31,645,584.06	508,292.71
减: 营业外支出	57	(721,215,996.08)	(23,542,078.70)	(7,627,370.77)	(20,416,167.08)
四、利润总额		7,997,428,532.25	6,773,995,953.31	6,983,015,236.24	4,829,526,961.73
减: 所得税费用	58	(1,334,951,414.53)	(1,221,101,811.40)	(818,266,575.65)	(941,858,951.16)
五、净利润		6,662,477,117.72	5,552,894,141.91	6,164,748,660.59	3,887,668,010.57
(一) 按所有权归属分类					
归属于母公司股东的净利润		6,555,640,254.37	5,375,963,043.99	6,164,748,660.59	3,887,668,010.57
少数股东损益		106,836,863.35	176,931,097.92	-	-
(二) 按持续经营分类					
持续经营净利润		6,662,477,117.72	5,552,894,141.91	6,164,748,660.59	3,887,668,010.57

合并及母公司利润表 – 续

2023年1月1日至6月30日止期间

	附注五	本集团		本公司	
		2023年1-6月 人民币元 (未经审计)	2022年1-6月 人民币元 (未经审计, 经重述)	2023年1-6月 人民币元 (未经审计)	2022年1-6月 人民币元 (未经审计, 经重述)
六、其他综合收益的税后净额	42	733,051,342.04	515,613,886.13	46,167,810.45	(2,736,274.65)
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		637,755,845.48	413,387,602.36	46,167,810.45	(2,736,274.65)
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益		14,703,496.99	(29,568,067.84)	-	-
其他权益工具投资公允价值变动		14,703,496.99	(29,568,067.84)	-	-
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		623,052,348.49	442,955,670.20	46,167,810.45	(2,736,274.65)
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		(5,664,644.96)	(2,439,141.72)	(5,664,644.96)	(2,439,141.72)
2. 其他债权投资公允价值变动		35,323,324.05	(102,705,818.43)	51,827,739.97	(105,051.02)
3. 其他债权投资信用损失准备		36,806,165.13	(57,320,803.44)	4,715.44	(192,081.91)
4. 现金套期储备		41,749,661.01	580,601,197.30	-	-
5. 外币财务报表折算差额		514,837,843.26	24,820,236.49	-	-
归属于少数股东的其他综合收益税后净额		95,295,496.56	102,226,283.77	-	-
七、综合收益总额		<u>7,395,528,459.76</u>	<u>6,068,508,028.04</u>	<u>6,210,916,471.04</u>	<u>3,884,931,735.92</u>
归属于母公司股东的综合收益总额		<u>7,193,396,099.85</u>	<u>5,789,350,646.35</u>	<u>6,210,916,471.04</u>	<u>3,884,931,735.92</u>
归属于少数股东的综合收益总额		<u>202,132,359.91</u>	<u>279,157,381.69</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

合并及母公司利润表 - 续

2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间

	附注五	本集团		本公司	
		2023 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2022 年 1-6 月 人民币元 (未经审计, 经重述)	2023 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2022 年 1-6 月 人民币元 (未经审计, 经重述)
八、每股收益					
(一) 基本每股收益	59	0.70	0.58	-	-
(二) 稀释每股收益	59	0.68	0.56	-	-

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。
此财务报表已获董事会批准。

张伟
法定代表人

焦晓宁
主管会计工作负责人

费雷
会计机构负责人

合并及母公司现金流量表

2023年1月1日至6月30日止期间

	附注五	本集团		本公司	
		2023年1-6月 人民币元 (未经审计)	2022年1-6月 人民币元 (未经审计)	2023年1-6月 人民币元 (未经审计)	2022年1-6月 人民币元 (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		17,357,753,195.93	17,711,770,614.41	10,294,276,507.07	11,061,086,376.11
拆入资金净增加额		8,813,116,952.35	29,310,556,362.93	7,728,897,100.10	28,933,929,082.27
回购业务资金净增加额		4,535,439,809.40	4,929,065,217.81	-	8,217,884,269.10
融出资金净减少额		-	13,937,115,367.08	-	14,259,456,832.14
代理买卖证券收到的现金净额		6,802,591,061.76	11,275,700,993.31	4,161,224,365.11	7,522,768,882.10
收到其他与经营活动有关的现金	60(1)	13,446,729,499.02	11,199,580,217.37	4,379,279,770.87	7,106,807,105.16
经营活动现金流入小计		50,955,630,518.46	88,363,788,772.91	26,563,677,743.15	77,101,932,546.88
融出资金净增加额		(4,744,070,924.96)	-	(3,768,133,886.55)	-
回购业务资金净减少额		-	-	(5,148,766,473.80)	-
为交易目的而持有的金融工具净增加额		(29,622,567,192.77)	(25,428,931,856.72)	(15,300,563,621.59)	(28,481,962,963.65)
支付利息、手续费及佣金的现金		(5,974,152,111.31)	(5,343,532,555.02)	(3,909,001,912.83)	(3,705,831,240.61)
支付给职工及为职工支付的现金		(6,165,452,378.71)	(6,615,613,896.49)	(2,637,615,633.04)	(2,972,111,951.10)
支付的各项税费		(1,390,676,068.02)	(2,594,947,730.66)	(644,552,783.98)	(1,215,150,323.31)
支付其他与经营活动有关的现金	60(2)	(8,305,579,061.94)	(18,157,776,270.95)	(2,118,786,771.65)	(6,134,146,168.23)
经营活动现金流出小计		(56,202,497,737.71)	(58,140,802,309.84)	(33,527,421,083.44)	(42,509,202,646.90)
经营活动（使用）/产生的现金流量净额	60(4)	(5,246,867,219.25)	30,222,986,463.07	(6,963,743,340.29)	34,592,729,899.98

合并及母公司现金流量表 - 续

2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间

	附注五	本集团		本公司	
		2023 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2022 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2023 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)	2022 年 1-6 月 人民币元 (未经审计)
二、投资活动产生的现金流量：					
收回投资所收到的现金		11,224,895,675.15	6,697,960,420.69	9,972,000,000.00	5,825,000,000.00
取得投资收益收到的现金		1,540,696,430.94	1,478,885,077.54	1,095,917,452.71	1,339,743,586.08
收到其他与投资活动有关的现金	60(3)	7,890,485.67	33,882,735.51	2,500,383.16	5,797,098.11
投资活动现金流入小计		<u>12,773,482,591.76</u>	<u>8,210,728,233.74</u>	<u>11,070,417,835.87</u>	<u>7,170,540,684.19</u>
投资所支付的现金		(18,344,810,864.95)	(11,676,608,282.96)	(15,652,919,513.99)	(11,562,179,922.20)
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金		(656,913,762.11)	(447,126,155.50)	(423,933,418.77)	(159,598,241.79)
取得子公司及其他营业单位支付的现金		-	-	(1,291,455.84)	(300,000,000.00)
投资活动现金流出小计		<u>(19,001,724,627.06)</u>	<u>(12,123,734,438.46)</u>	<u>(16,078,144,388.60)</u>	<u>(12,021,778,163.99)</u>
投资活动使用的现金流量净额		<u>(6,228,242,035.30)</u>	<u>(3,913,006,204.72)</u>	<u>(5,007,726,552.73)</u>	<u>(4,851,237,479.80)</u>
三、筹资活动产生的现金流量：					
吸收投资收到的现金		-	2,698,446,226.42	-	2,697,045,283.02
其中：发行永续债收到的现金		-	2,698,446,226.42	-	2,697,045,283.02
发行债券证券收到的现金		43,840,619,942.65	44,296,841,730.95	33,662,404,755.10	25,264,308,580.44
取得借款收到的现金		13,657,462,753.80	6,457,459,250.20	-	-
筹资活动现金流入小计		<u>57,498,082,696.45</u>	<u>53,452,747,207.57</u>	<u>33,662,404,755.10</u>	<u>27,961,353,863.46</u>
偿还债务支付的现金		(47,534,593,743.39)	(66,126,566,514.14)	(28,677,139,977.15)	(51,298,560,151.00)
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		(3,626,470,925.83)	(3,411,433,129.80)	(3,262,655,204.08)	(1,860,248,319.69)
偿还租赁负债支付的现金		(355,975,890.07)	(283,104,055.86)	(177,853,152.34)	(140,858,346.87)
筹资活动现金流出小计		<u>(51,517,040,559.29)</u>	<u>(69,821,103,699.80)</u>	<u>(32,117,648,333.57)</u>	<u>(53,299,666,817.56)</u>
筹资活动产生 / (使用) 的现金流量净额		<u>5,981,042,137.16</u>	<u>(16,368,356,492.23)</u>	<u>1,544,756,421.53</u>	<u>(25,338,312,954.10)</u>
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响					
		<u>987,807,052.14</u>	<u>1,223,014,631.65</u>	<u>(368,806,773.16)</u>	<u>562,184,868.43</u>

合并及母公司现金流量表 - 续
2023年1月1日至6月30日止期间

	附注五	本集团		本公司	
		2023年1-6月 人民币元 (未经审计)	2022年1-6月 人民币元 (未经审计)	2023年1-6月 人民币元 (未经审计)	2022年1-6月 人民币元 (未经审计)
五、现金及现金等价物净(减少)/增加额	60(5)	(4,506,260,065.25)	11,164,638,397.77	(10,795,520,244.65)	4,965,364,334.51
加: 期初现金及现金等价物余额		215,921,297,118.14	189,399,437,061.37	159,509,159,372.69	142,329,317,203.81
六、期末现金及现金等价物余额	60(6)	<u>211,415,037,052.89</u>	<u>200,564,075,459.14</u>	<u>148,713,639,128.04</u>	<u>147,294,681,538.32</u>

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。
此财务报表已获董事会批准。

张伟
法定代表人

焦晓宁
主管会计工作负责人

费雷
会计机构负责人

合并股东权益变动表 2023年1月1日至6月30日止期间

2023年1-6月

附注	归属于母公司股东权益									
	股本 人民币元 (未经审计)	其他权益工具 人民币元 (未经审计)	资本公积 人民币元 (未经审计)	减：库存股 人民币元 (未经审计)	其他综合收益 人民币元 (未经审计)	盈余公积 人民币元 (未经审计)	一般风险准备 人民币元 (未经审计)	未分配利润 人民币元 (未经审计)	少数股东权益 人民币元 (未经审计)	股东权益合计 人民币元 (未经审计)
一、2023年1月1日	9,075,589,027.00	19,200,000,000.00	70,482,060,067.29	(1,202,324,401.85)	793,229,852.41	7,790,909,135.02	21,024,437,148.19	37,923,299,960.91	2,761,508,169.54	167,848,708,958.51
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	419,488.89	1,695,795.20	5,785,750.37	-	7,901,034.46
二、本期末初余额	9,075,589,027.00	19,200,000,000.00	70,482,060,067.29	(1,202,324,401.85)	793,229,852.41	7,791,328,623.91	21,026,132,943.39	37,929,085,711.28	2,761,508,169.54	167,856,609,992.97
三、本期增减变动金额	-	-	-	-	637,755,845.48	-	-	6,555,640,254.37	202,132,359.91	7,395,528,459.76
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(二) 股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	95,053,145.82	130,514,556.15	-	-	-	-	21,621,926.58	247,189,628.55
3. 其他	-	-	(241,255,786.83)	-	-	-	-	-	24,741,050.03	(216,514,736.80)
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	44,171,635.43	(44,171,635.43)	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-	(4,063,223,178.00)	(810,000.00)	(4,064,033,178.00)
4. 永续债利息	-	-	-	-	-	-	-	(705,430,000.00)	-	(705,430,000.00)
四、2023年6月30日	9,075,589,027.00	19,200,000,000.00	70,335,857,426.28	(1,071,809,845.70)	1,430,985,697.89	7,791,328,623.91	21,070,304,578.82	39,671,901,152.22	3,009,193,506.06	170,513,350,166.48

合并股东权益变动表 - 续 2022年1月1日至6月30日止期间

附注	2022年1-6月									
	归属于母公司股东权益									
	股本 人民币元 (未经审计)	其他权益工具 人民币元 (未经审计)	资本公积 人民币元 (未经审计)	减: 库存股 人民币元 (未经审计)	其他综合收益 人民币元 (未经审计)	盈余公积 人民币元 (未经审计)	一般风险准备 人民币元 (未经审计)	未分配利润 人民币元 (未经审计)	少数股东权益 人民币元 (未经审计)	股东权益合计 人民币元 (未经审计)
一、2022年1月1日	9,076,650,000.00	9,996,424,528.28	70,562,359,520.68	(1,231,547,029.10)	(2,16,821,635.27)	6,569,922,031.25	18,106,043,631.71	35,559,778,869.82	3,612,974,034.50	152,035,785,951.67
加: 会计政策变更	-	-	-	-	-	465,801.73	1,446,063.73	4,698,508.36	-	6,610,373.82
二、本期初余额	9,076,650,000.00	9,996,424,528.28	70,562,359,520.68	(1,231,547,029.10)	(2,16,821,635.27)	6,570,387,832.98	18,107,489,695.44	35,564,477,377.98	3,612,974,034.50	152,042,394,325.49
三、本期增减变动金额	-	-	-	-	413,387,602.36	-	-	5,375,963,043.99	279,157,381.69	6,068,508,028.04
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(二) 股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	89,122,439.66	19,992,162.15	-	-	-	-	30,820,219.36	139,934,821.17
3. 发行永续债	-	2,698,446,226.42	-	-	-	-	-	-	-	2,698,446,226.42
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	42,950,963.89	(42,950,963.89)	-	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	(4,063,639,739.40)	-	-	(4,063,639,739.40)
4. 永续债利息	-	-	-	-	-	-	(485,730,000.00)	-	-	(485,730,000.00)
四、2022年6月30日	9,076,650,000.00	12,694,870,754.70	70,651,481,960.34	(1,211,554,866.95)	196,565,967.09	6,570,387,832.98	18,150,440,659.33	36,348,119,718.68	3,922,951,635.55	156,399,913,661.72

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。
此财务报表已获董事会批准。

张伟 法定代表人
焦晓宁 主管会计工作负责人
裴雷 会计机构负责人

母公司股东权益变动表

2023年1月1日至6月30日止期间

2023年1-6月

	股本 人民币元 (未经审计)	其他权益工具 人民币元 (未经审计)	资本公积 人民币元 (未经审计)	减：库存股 人民币元 (未经审计)	其他综合收益 人民币元 (未经审计)	盈余公积 人民币元 (未经审计)	一般风险准备 人民币元 (未经审计)	未分配利润 人民币元 (未经审计)	股东权益合计 人民币元 (未经审计)
一、2023年1月1日	9,075,589,027.00	19,200,000,000.00	68,927,381,060.43	(1,202,324,401.85)	47,145,460.89	7,790,909,135.02	15,795,053,134.54	24,000,453,156.70	143,634,206,572.73
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	419,488.89	838,977.78	2,936,422.24	4,194,888.91
二、本期末余额	9,075,589,027.00	19,200,000,000.00	68,927,381,060.43	(1,202,324,401.85)	47,145,460.89	7,791,328,623.91	15,795,892,112.32	24,003,389,578.94	143,638,401,461.64
三、本期增减变动金额	-	-	-	-	46,167,810.45	-	-	6,164,748,660.59	6,210,916,471.04
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(二) 股东投入和减少资本	-	-	47,434,340.16	130,514,556.15	-	-	-	-	177,948,896.31
1. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-	(217,127,698.87)	-	-	-	-	-	(217,127,698.87)
2. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	334,377.51	-	334,377.51	(334,377.51)	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-	(4,063,223,178.00)	(4,063,223,178.00)
4. 永续债利息	-	-	-	-	-	-	-	(705,430,000.00)	(705,430,000.00)
四、2023年6月30日	9,075,589,027.00	19,200,000,000.00	68,757,687,701.72	(1,071,809,845.70)	93,313,271.34	7,791,328,623.91	15,796,226,489.83	25,399,150,684.02	145,041,485,952.12

母公司股东权益变动表 - 续
2022年1月1日至6月30日止期间

2022年1-6月

	股本 人民币元 (未经审计)	其他权益工具 人民币元 (未经审计)	资本公积 人民币元 (未经审计)	减: 库存股 人民币元 (未经审计)	其他综合收益 人民币元 (未经审计)	盈余公积 人民币元 (未经审计)	一般风险准备 人民币元 (未经审计)	未分配利润 人民币元 (未经审计)	股东权益合计 人民币元 (未经审计)
一、2022年1月1日	9,076,650,000.00	9,989,056,603.76	68,902,889,053.54	(1,231,547,029.10)	39,119,068.75	6,569,922,031.25	13,352,459,851.82	20,003,532,244.85	126,702,081,824.87
加: 会计政策变更	-	-	-	-	-	465,801.73	931,603.46	3,260,612.13	4,658,017.32
二、本期末余额	9,076,650,000.00	9,989,056,603.76	68,902,889,053.54	(1,231,547,029.10)	39,119,068.75	6,570,387,832.98	13,353,391,455.28	20,006,792,856.98	126,706,739,842.19
三、本期增减变动金额	-	-	-	-	(2,736,274.65)	-	-	3,887,668,010.57	3,884,931,735.92
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(二) 股东投入和减少资本	-	-	62,811,350.87	19,992,162.15	-	-	-	-	82,803,513.02
1. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 发行永续债	-	2,697,045,283.02	-	-	-	-	-	-	2,697,045,283.02
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	269,521.56	(269,521.56)	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	-	-	(4,063,639,739.40)	(4,063,639,739.40)
4. 永续债利息	-	-	-	-	-	-	-	(485,730,000.00)	(485,730,000.00)
四、2022年6月30日	9,076,650,000.00	12,686,101,886.78	68,965,700,404.41	(1,211,554,866.95)	36,382,794.10	6,570,387,832.98	13,353,660,976.84	19,344,821,606.59	128,822,150,634.75

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。
此财务报表已获董事会批准。

张伟 法定代表人
曹雷 会计机构负责人

曹雷 主管会计工作负责人

曹雷

华泰证券股份有限公司

财务报表附注

一、公司基本情况

华泰证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）原为江苏省证券公司，系经中国人民银行总行批准，于1991年4月9日在江苏省工商行政管理局登记注册，总部设在江苏省南京市。

于1999年12月经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）“证监机构字[1999]152号”文批准，公司更名为“华泰证券有限责任公司”。于2007年11月29日经证监会《关于华泰证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》（证监机构字[2007]311号）批准，公司改制为股份有限公司。

本公司于2010年2月公开发行人民币普通股（A股）784,561,275股，并在上海证券交易所挂牌上市，每股面值人民币1元。

本公司于2015年6月在香港联合交易所有限公司（“香港联交所”）完成境外上市外资股（“H股”）的首次公开发售，共向公众发售1,562,768,800股每股面值人民币1元的新股。本公司于2015年7月14日更换了注册号为32000000000192的《企业法人营业执照》。

本公司于2018年7月非公开发行A股1,088,731,200股并于2018年8月完成新增股份登记，每股面值人民币1元。本公司于2018年9月11日更换了统一社会信用代码为91320000704041011J的《企业法人营业执照》。

本公司于2019年6月在伦敦证券交易所发行全球存托凭证（Global Depository Receipts, “GDR”），共向公众发售82,515,000份GDR，并在伦敦证券交易所上市，其中每份GDR代表10股公司A股股票，相应新增基础A股股票825,150,000股。本公司于2019年9月3日与2019年12月19日分别更换了统一社会信用代码为91320000704041011J的《企业法人营业执照》。

截至2023年6月30日，本公司累计发行股本总额为人民币9,075,589,027.00元，注册资本为人民币9,075,589,027.00元。

本公司及子公司（以下简称“本集团”）主要经营范围：证券业务，证券资产管理业务，证券承销保荐业务，证券投资咨询，证券公司为期货公司提供中间介绍业务，公募证券投资基金销售，证券投资基金托管，公开募集证券投资基金管理业务，直接投资业务，创新投资业务，期货经纪业务以及证监会批准的其他业务。

截至2023年6月30日，本公司经批准设立分公司28家，证券营业部243家，本公司下设子公司情况参见附注七、1。

二、财务报表的编制基础

1 编制基础

本公司以持续经营为基础编制财务报表。

2 持续经营

本公司自本报告期末至少12个月内具备持续经营能力，无影响持续经营能力的重大事项。

三、公司重要会计政策、会计估计

1 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集团及本公司2023年6月30日的合并财务状况和财务状况、2023年1月1日至6月30日止期间的合并经营成果和经营成果及合并现金流量和现金流量。

此外，本公司的财务报表同时符合证监会2014年修订的《公开发行证券的公司信息披露编报规则第15号——财务报告的一般规定（2014年修订）》（证监会公告[2014]54号）有关财务报表及其附注的披露要求。

2 会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

3 营业周期

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

4 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本公司及本公司子公司选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。本公司的部分子公司采用本公司记账本位币以外的货币作为记账本位币，在编制本财务报表时，这些子公司的外币财务报表按照附注三、8 进行了折算。

5 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

本集团取得对另一个或多个企业（或一组资产或净资产）的控制权且其构成业务的，该交易或事项构成企业合并。企业合并分为同一控制下的企业合并和非同一控制下的企业合并。

对于非同一控制下的交易，购买方在判断取得的资产组合等是否构成一项业务时，将考虑是否选择采用“集中度测试”的简化判断方式。如果该组合通过集中度测试，则判断为不构成业务。如果该组合未通过集中度测试，仍应按照业务条件进行判断。合并方在合并中取得的组合应当至少同时具有一项投入和一项实质性加工处理过程，且二者相结合对产出能力有显著贡献，该组合才构成业务。

当本集团取得了不构成业务的一组资产或净资产时，应将购买成本按购买日所取得各项可辨认资产、负债的相对公允价值基础进行分配，不按照以下企业合并的会计处理方法进行处理。

(1) 同一控制下的企业合并

参与合并的企业在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时性的，为同一控制下的企业合并。合并方在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。为进行企业合并发生的直接相关费用，于发生时计入当期损益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

(2) 非同一控制下的企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下的企业合并。本集团作为购买方，为取得被购买方控制权而付出的资产（包括购买日之前所持有的被购买方的股权）、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和，减去合并中取得的被购买方可辨认净资产于购买日公允价值份额的差额，如为正数则确认为商誉（参见附注三、16）；如为负数则计入当期损益。本集团将作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。本集团为进行企业合并发生的其他各项直接费用计入当期损益。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。本集团在购买日按公允价值确认所取得的被购买方符合确认条件的各项可辨认资产、负债及或有负债。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。

通过多次交易分步实现非同一控制企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方的股权，本集团会按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益或其他综合收益。购买日之前持有的被购买方的股权涉及的以后可重分类进损益的其他综合收益及权益法核算下的其他所有者权益变动（参见附注三、10(2)(b)）于购买日转入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的，购买日之前确认的其他综合收益于购买日转入留存收益。

6 合并财务报表的编制方法

(1) 总体原则

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制，是指本集团拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本集团是否拥有对被投资方的权力时，本集团仅考虑与被投资方相关的实质性权利（包括本集团自身所享有的及其他方所享有的实质性权利）。子公司的财务状况、经营成果和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

子公司少数股东应占的权益、损益和综合收益总额分别在合并资产负债表的股东权益中和合并利润表的净利润及综合收益总额项目后单独列示。

如果子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的，其余额仍冲减少数股东权益。

当子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时，合并时已按照本公司的会计期间或会计政策对子公司财务报表进行必要的调整。合并时所有集团内部交易及余额，包括未实现内部交易损益均已抵销。集团内部交易发生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

(2) 合并取得子公司

对于通过同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以被合并子公司的各项资产、负债在最终控制方财务报表中的账面价值为基础，视同被合并子公司在本公司最终控制方对其开始实施控制时纳入本集团合并范围，并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。其自报告期最早期间期初或同受最终控制方控制之日起的经营成果和现金流量已适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

对于通过非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以购买日确定的被购买子公司各项可辨认资产、负债的公允价值为基础自购买日起将被购买子公司纳入本公司合并范围。其自购买日（取得控制权的日期）起的经营成果及现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

(3) 处置子公司

本集团丧失对原有子公司控制权时，由此产生的任何处置收益或损失，计入丧失控制权当期的投资收益。对于剩余股权投资，本集团按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量，由此产生的任何收益或损失，也计入丧失控制权当期的投资收益。

对于本集团处置的子公司，处置日（丧失控制权的日期）前的经营成果和现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

通过多次交易分步处置对子公司长期股权投资直至丧失控制权的，按下述原则判断是否为一揽子交易：

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

如果各项交易不属于一揽子交易的，则在丧失对子公司控制权以前的各项交易，按照不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资的会计政策进行处理（参见附注三、6(4)）。

如果各项交易属于一揽子交易的，本集团将各项交易作为一项处置原有子公司并丧失控制权的交易进行处理，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司自购买日开始持续计算的净资产账面价值的份额之间的差额，在合并财务报表中计入其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

(4) 少数股东权益变动

本集团因购买少数股权新取得的长期股权投资成本与按照新增持股比例计算应享有子公司的净资产份额之间的差额，以及在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司净资产的差额，均调整合并资产负债表中的资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）不足冲减的，调整留存收益。

7 现金及现金等价物的确定标准

现金及现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

8 外币业务和外币报表折算

本集团收到投资者以外币投入资本时按当日即期汇率折合为人民币，其他外币交易在初始确认时按交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折合为人民币。

即期汇率是中国人民银行公布的人民币外汇牌价。即期汇率的近似汇率是按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的当期平均汇率。

于资产负债表日，外币货币性项目采用该日的即期汇率折算，除与购建符合资本化条件资产有关的专门借款本金和利息的汇兑差额（参见附注三、14）外，其他汇兑差额计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，由此产生的汇兑差额，属于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的差额，计入其他综合收益；其他差额计入当期损益。

编制合并财务报表涉及境外经营的，如有实质上构成对境外经营净投资的外币货币性项目，因汇率变动而产生的汇兑差额，列入其他综合收益的“外币报表折算差额”项目；处置境外经营时，计入处置当期损益。

对境外经营的财务报表进行折算时，资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，股东权益项目中除未分配利润及其他综合收益中的外币财务报表折算差额项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，在其他综合收益中列示。

在处置本集团在境外经营的全部所有者权益或因处置部分股权投资或其他原因丧失了对境外经营控制权时，将资产负债表中股东权益项目下列示的、与该境外经营相关的归属于母公司所有者权益的外币报表折算差额，全部转入处置当期损益。

9 金融工具

本集团的金融工具包括货币资金、债券投资、除长期股权投资（参见附注三、10）以外的股权投资、应收款项、应付款项、借款、应付债券及股本等。

(1) 金融资产及金融负债的确认和计量

金融资产和金融负债在本集团成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

除不具有重大融资成分的应收账款外，在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收账款，本集团按照根据附注三、23的会计政策确定的交易价格进行初始计量。

(2) 金融资产的分类和后续计量

(a) 本集团金融资产的分类

本集团通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

除非本集团改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本集团将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本集团管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本集团将同时符合下列条件且未被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，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：

- 本集团管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

对于非交易性权益工具投资，本集团可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本集团将其余所有的金融资产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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本集团可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地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。

管理金融资产的业务模式，是指本集团如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本集团所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本集团以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本集团对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本集团对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 本集团金融资产的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。股利收入计入损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(3) 金融负债的分类和后续计量

本集团将金融负债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及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的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 财务担保负债

财务担保合同指，当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求本集团向蒙受损失的合同持有人赔付特定

金额的合同。

初始确认后，财务担保合同相关收益依据附注三、23 所述会计政策的规定分摊计入当期损益。财务担保负债以按照依据金融工具的减值原则（参见附注三、9(6)）所确定的损失准备金额以及其初始确认金额扣除财务担保合同相关收益的累计摊销额后的余额孰高进行后续计量。

— 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(4) 抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本集团具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是当前可执行的；
- 本集团计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

(5) 金融资产和金融负债的终止确认

满足下列条件之一时，本集团终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本集团将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本集团既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本集团将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 被转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资）之和。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本集团终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(6) 金融资产的减值

本集团以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产；
- 合同资产；
- 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资；
- 非以公允价值计量且其变动计入当期损益的财务担保合同。

本集团持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型，包括以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资或权益工具投资，指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资，以及衍生金融资产。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本集团按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本集团需考虑的最长期限为企业面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生

的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款和合同资产，本集团始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。本集团基于历史信用损失经验计算上述金融资产的预期信用损失，相关历史经验根据资产负债表日借款人的特定因素、以及对当前状况和未来经济状况预测的评估进行调整。

除应收账款和合同资产外，本集团对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

具有较低的信用风险

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，并且即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

信用风险显著增加

本集团通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本集团考虑无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。本集团考虑的信息包括：

- 债务人未能按合同到期日支付本金和利息的情况；
- 已发生的或预期的金融工具的外部或内部信用评级（如有）的严重恶化；
- 已发生的或预期的债务人经营成果的严重恶化；
- 现存的或预期的技术、市场、经济或法律环境变化，并将对债务人对本集团的还款能力产生重大不利影响。

根据金融工具的性质，本集团以单项金融工具或金融工具组合为基础评估信用风险是否显著增加。以金融工具组合为基础进行评估时，本集团可基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，例如逾期信息和信用风险评级。

本集团认为金融资产在下列情况发生违约：

- 借款人不大可能全额支付其对本集团的欠款，该评估不考虑本集团采取例如变现抵押品（如果持有）等追索行动。

已发生信用减值的金融资产

本集团在资产负债表日评估以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资是否已发生信用减值。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或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等；
- 本集团出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本集团在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，本集团在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

核销

如果本集团不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本集团确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本集团催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

(7) 权益工具

本公司发行权益工具收到的对价扣除交易费用后，计入股东权益。回购本公司权益工具支付的对价和交易费用，减少股东权益。

回购本公司股份时，回购的股份作为库存股管理，回购股份的全部支出转为库存股成本，同时进行备查登记。库存股不参与利润分配，在资产负债表中作为股东权益的备抵项目列示。

库存股注销时，按注销股票面值总额减少股本，库存股成本超过面值总额的部分，应依次冲减资本公积（股本溢价）、盈余公积和未分配利润；库存股成本低于面值总额的，低于面值总额的部分增加资本公积（股本溢价）。

库存股转让时，转让收入高于库存股成本的部分，增加资本公积（股本溢价）；低于库存股成本的部分，依次冲减资本公积（股本溢价）、盈余公积、未分配利润。

(8) 永续债

本集团根据所发行的永续债的合同条款及其所反映的经济实质，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将这些金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。

本集团对于其发行的应归类为权益工具的永续债，按照实际收到的金额，计入权益。存续期间分派股利或利息的，作为利润分配处理。按合同条款约定赎回永续债的，按赎回价格冲减权益。

10 长期股权投资

(1) 长期股权投资投资成本确定

(a) 通过企业合并形成的长期股权投资

— 对于同一控制下的企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照合并日取得的被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付对价账面价值之间的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本，按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。通过非一揽子的多次交易分步实现的同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按上述原则确认的长期股权投资的初始投资成本与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。

— 对于非同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照购买日取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值，作为该投资的初始投资成本。通过非一揽子的多次交易分步实现的非同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，其初始投资成本为本公司购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和。

(b) 其他方式取得的长期股权投资

— 对于通过企业合并以外的其他方式取得的长期股权投资，在初始确认时，对于以支付现金取得的长期股权投资，本集团按照实际支付的购买价款作为初始投资成本；对于发行权益性证券取得的长期股权投资，本集团按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

(2) 长期股权投资后续计量及损益确认方法

(a) 对子公司的投资

在本公司个别财务报表中，本公司采用成本法对子公司的长期股权投资进行后续计量，除非投资符合持有待售的条件（参见附注三、31）。对被投资单位宣告分派的现金股利或利润由本公司享有的部分确认为当期投资收益，但取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润除外。

对子公司的投资按照成本减去减值准备后在资产负债表内列示。

对子公司投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见附注三、18。

在本集团合并财务报表中，对子公司按附注三、6 进行处理。

(b) 对合营企业和联营企业的投资

合营企业指本集团与其他合营方共同控制（参见附注三、10(3)）且仅对其净资产享有权利的一项安排。

联营企业指本集团能够对其施加重大影响（参见附注三、10(3)）的企业。

后续计量时，对合营企业和联营企业的长期股权投资采用权益法核算，除非投资符合持有待售的条件（参见附注三、31）。

本集团在采用权益法核算时的具体会计处理包括：

- 对于长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，以前者作为长期股权投资的成本；对于长期股权投资的初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，以后者作为长期股权投资的成本，长期股权投资的成本与初始投资成本的差额计入当期损益。
- 取得对合营企业和联营企业投资后，本集团按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资损益和其他综合收益并调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。对合营企业或联营企业除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动（以下简称“其他所有者权益变动”），本集团按照应享有或应分担的份额计入股东权益，并同时调整长期股权投资的账面价值。
- 在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益、其他综合收益及所有者权益的其他变动的份额时，本集团以取得投资时被投资单位可辨认净资产公允价值为基础，按照本集团的会计政策或会计期间进行必要调整后确认投资收益和其他综合收益等。本集团与联营企业及合营企业之间内部交易产生的未实现损益按照应享有的比例计算归属于本集团的部分，在权益法核算时予以抵销。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。
- 本集团对合营企业或联营企业发生的净亏损，除本集团负有承担额外损失义务外，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对合营企业或联营企业净投资的长期权益减记至零为限。合营企业或联营企业以后实现净利润的，本集团在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

本集团对合营企业和联营企业投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见附注三、18。

(3) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的判断标准

共同控制指按照合同约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动（即对安排的回报产生重大影响的活动）必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。

重大影响指本集团对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。

11 投资性房地产

本集团将持有的为赚取租金或资本增值，或两者兼有的房地产划分为投资性房地产。本集团采用成本模式计量投资性房地产，即以成本减累计折旧及减值准备后在资产负债表内列示。本集团将投资性房地产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在使用寿命内按年限平均法计提折旧，除非投资性房地产符合持有待售的条件。减值测试方法及减值准备计提方法参见附注三、18。

投资性房地产的使用寿命、残值率和年折旧率分别为：

项目	使用寿命 (年)	残值率 (%)	年折旧率 (%)
房屋及建筑物	30 - 35 年	3%	2.77% - 3.23%

当投资性房地产被处置，或者永久退出使用且预计不能从其处置中取得经济利益时，终止确认该项投资性房地产。

投资性房地产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

12 固定资产

(1) 固定资产确认条件

固定资产指本集团为经营管理或提供劳务而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。

外购固定资产的初始成本包括购买价款、相关税费以及使该资产达到预定可使用状态前所发生的可归属于该项资产的支出。自行建造固定资产按附注三、13 确定初始成本。

对于构成固定资产的各组成部分，如果各自具有不同使用寿命或者以不同方式为本集团提供经济利益，适用不同折旧率或折旧方法的，本集团分别将各组成部分确认为单项固定资产。

对于固定资产的后续支出，包括与更换固定资产某组成部分相关的支出，在与支出相关的经济利益很可能流入本集团且成本能够可靠地计量时资本化计入固定资产成本，同时将被替换部分的账面价值扣除；与固定资产日常维护相关的支出在发生时计入当期损益。

固定资产以成本减累计折旧及减值准备后在资产负债表内列示。

(2) 固定资产的折旧方法

本集团将固定资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在其使用寿命内按年限平均法计提折旧，除非固定资产符合持有待售的条件。

各类固定资产的使用寿命、残值率和年折旧率分别为：

类别	使用寿命 (年)	残值率 (%)	年折旧率 (%)
房屋及建筑物	30 - 35 年	3%	2.77% - 3.23%
运输工具	5 - 8 年	3%	12.13% - 19.40%
电子设备	5 年	3%	19.40%
办公设备及其他设备	5 年	3%	19.40%

本集团至少在每年年度终了对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核。

(3) 减值测试方法及减值准备计提方法参见附注三、18。

(4) 固定资产处置

固定资产满足下述条件之一时，本集团会予以终止确认。

- 固定资产处于处置状态；
- 该固定资产预期通过使用或处置不能产生经济利益。

固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

13 在建工程

自行建造的固定资产的成本包括工程用物资、直接人工、符合资本化条件的借款费用和使该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出。

自行建造的固定资产于达到预定可使用状态时转入固定资产，此前列于在建工程，且不计提折旧。

在建工程以成本减减值准备（参见附注三、18）在资产负债表内列示。

14 借款费用

本集团发生的可直接归属于符合资本化条件的资产的购建的借款费用，予以资本化并计入相关资产的成本，其他借款费用均于发生当期确认为财务费用。

在资本化期间内，本集团按照下列方法确定每一会计期间的利息资本化金额（包括折价或溢价的摊销）：

- 对于为购建符合资本化条件的资产而借入的专门借款，本集团以专门借款按实际利率计算的当期利息费用，减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额确定专门借款应予资本化的利息金额。
- 对于为购建符合资本化条件的资产而占用的一般借款，本集团根据累计资产支出超过专门借款部分的资产支出的加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。资本化率是根据一般借款加权平均的实际利率计算确定。

本集团确定借款的实际利率时，是将借款在预期存续期间或适用的更短期间内的未来现金流量，折现为该借款初始确认时确定的金额所使用的利率。

在资本化期间内，外币专门借款本金及其利息的汇兑差额，予以资本化，计入符合资本化条件的资产的成本。而除外币专门借款之外的其他外币借款本金及其利息所产生的汇兑差额作为财务费用，计入当期损益。

资本化期间是指本集团从借款费用开始资本化时点到停止资本化时点的期间，借款费用暂停资本化的期间不包括在内。当资本支出和借款费用已经发生及为使资产达到预定可使用状态所必要的购建活动已经开始时，借款费用开始资本化。当购建符合资本化条件的资产达到预定可使用状态时，借款费用停止资本化。对于符合资本化条件的资产在购建过程中发生非正常中断、且中断时间连续超过3个月的，本集团暂停借款费用的资本化。

15 无形资产

无形资产按成本进行初始计量。无形资产以成本减累计摊销（仅限于使用寿命有限的无形资产）及减值准备（参见附注三、18）后在资产负债表内列示。对于使用寿命有限的无形资产，本集团将无形资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后按直线法在预计使用寿命期内摊销，除非该无形资产符合持有待售的条件。

各项无形资产的摊销年限为：

项目	摊销年限（年）
土地使用权	40 - 50 年
交易席位费	使用寿命不确定
与现有经纪商的关系	使用寿命不确定
与现有客户的关系	使用寿命不确定
商标	11 - 20 年
软件及其他	2 - 14 年

本集团至少在每年年度终了对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核。

本集团将无法预见未来经济利益期限的无形资产视为使用寿命不确定的无形资产，并对这类无形资产不予摊销。本集团在每个会计期间对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。如果有证据表明无形资产的使用寿命是有限的，则估计其使用寿命，并按上述使用寿命有限的无形资产处理。

16 商誉

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额。

本集团对商誉不摊销，以成本减累计减值准备（参见附注三、18）在资产负债表内列示。商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。

17 长期待摊费用

长期待摊费用在受益期限内分期平均摊销。各项费用的摊销期限分别为：

项目	摊销期限
租赁资产改良支出	1 - 5 年
其他	1 - 10 年

18 除金融资产外的其他资产减值

本集团在资产负债表日根据内部及外部信息以确定下列资产是否存在减值的迹象，包括：

- 固定资产
- 在建工程
- 使用权资产
- 无形资产
- 采用成本模式计量的投资性房地产
- 长期股权投资
- 商誉
- 长期待摊费用等

本集团对存在减值迹象的资产进行减值测试，估计资产的可收回金额。此外，无论是否存在减值迹象，本集团于每年年度终了对商誉及使用寿命不确定的无形资产估计其可收回金额。本集团依据相关资产组或者资产组组合能够从企业合并的协同效应中的受益情况分摊商誉账面价值，并在此基础上进行商誉减值测试。

可收回金额是指资产（或资产组、资产组组合，下同）的公允价值（参见附注三、20）减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间较高者。

资产组由创造现金流入相关的资产组成，是可以认定的最小资产组合，其产生的现金流入基本上独立于其他资产或者资产组。

资产预计未来现金流量的现值，按照资产在持续使用过程中和最终处置时所产生的预计未来现金流量，选择恰当的折现率对其进行折现后的金额加以确定。

可收回金额的估计结果表明，资产的可收回金额低于其账面价值的，资产的账面价值会减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。与资产组或者资产组组合相关的减值损失，先抵减分摊至该资产组或者资产组组合中商誉的账面价值，再根据资产组或者资产组组合中除商誉之外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值，但抵减后的各资产的账面价值不得低于该资产的公允价值减去处置费用后的净额（如可确定的）、该资产预计未来现金流量的现值（如可确定的）和零三者之中最高者。

资产减值损失一经确认，在以后会计期间不会转回。

19 买入返售金融资产和卖出回购金融资产款

买入返售金融资产，是指本集团按返售协议先买入再按固定价格返售金融资产所融出的资金。卖出回购金融资产款，是指本集团按回购协议先卖出再按固定价格回购金融资产所融入的资金。

买入返售金融资产和卖出回购金融资产款按业务发生时实际支付或收到的款项入账并在资产负债表中反映。买入返售的已购入标的资产不予以确认，在表外记录；卖出回购的标的资产在资产负债表中不终止确认。

本集团对买入返售金融资产的减值准备计提参见附注三、9(6)。对于买入返售和卖出回购业务的买卖差价在相关交易期间以实际利率法摊销，分别确认为利息收入和利息支出。

本集团针对买入返售金融资产中的股票质押式回购业务减值准备计提方案详见附注八、2(1)。

20 公允价值的计量

除特别声明外，本集团按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本集团估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

21 预计负债

如果与或有事项相关的义务是本集团承担的现时义务，且该义务的履行很可能导致经济利益流出本集团，以及有关金额能够可靠地计量，则本集团会确认预计负债。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。对于货币时间价值影响重大的，预计负债以预计未来现金流量折现后的金额确定。在确定最佳估计数时，本集团综合考虑了与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。

所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

- 或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定；
- 或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

本集团在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核，并按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

22 股份支付

(1) 股份支付的种类

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团的股份支付包括以权益结算的股份支付及以现金结算的股份支付。

(2) 实施股份支付计划的相关会计处理

- 以现金结算的股份支付

对于以现金结算的股份支付，本集团承担以股份或其他权益工具为基础计算确定交付现金或其他资产来换取职工提供服务时，以相关权益工具为基础计算确定的负债的公允价值计量换取服务的价格。对于授予后完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的股份支付交易，在等待期内的每个资产负债表日，本集团以对可行权情况的最佳估计数为基础，按照本集团承担负债的公允价值金额，将当期取得的服务计入成本或费用，并相应计入负债。在相关负债结算前的每个资产负债表日和结算日，对负债的公允价值重新计量，其变动计入损益。

当本集团接受服务且有结算义务，并且授予职工的是本公司最终控制方或其控制的除本集团外的子公司的权益工具时，本集团将此股份支付计划作为现金结算的股份支付处理。

– 以权益结算的股份支付

本集团以股份或其他权益工具作为对价换取职工提供服务时，以授予职工权益工具在授予日公允价值计量。对于授予后完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的股份支付交易，本集团在等待期内的每个资产负债表日，根据最新取得的可行权职工人数变动等后续信息对可行权权益工具数量作出最佳估计，以此基础按照权益工具授予日的公允价值，将当期取得的服务计入相关成本或费用，并相应计入资本公积。

当本集团接受服务但没有结算义务，并且授予职工的是本公司最终控制方或其控制的除本集团外的子公司的权益工具时，本集团将此股份支付计划作为权益结算的股份支付处理。

23 收入

收入是本集团在日常活动中形成的、会导致股东权益增加且与股东投入资本无关的经济利益的总流入。

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。

合同中包含两项或多项履约义务的，本集团在合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务，按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。单独售价，是指本集团向客户单独销售商品或提供服务的价格。单独售价无法直接观察的，本集团综合考虑能够合理取得的全部相关信息，并最大限度地采用可观察的输入值估计单独售价。

交易价格是本集团因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项。本集团确认的交易价格不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。预期将退还给客户的款项作为退货负债，不计入交易价格。合同中存在重大融资成分的，本集团按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，本集团预计客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

满足下列条件之一时，本集团属于在某一段时间内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：

- 客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益；
- 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；
- 本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，本集团在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，本集团已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。

对于在某一时点履行的履约义务，本集团在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品或服务控制权时，本集团会考虑下列迹象：

- 本集团就该商品或服务享有现时收款权利；
- 本集团已将该商品的实物转移给客户；
- 本集团已将该商品的法定所有权或所有权上的主要风险和报酬转移给客户；

客户已接受该商品或服务。

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值（参见附注三、9(6)）。本集团拥有的、无条件（仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示。本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务作为合同负债列示。

与本集团取得收入的主要活动相关的具体会计政策描述如下：

手续费及佣金收入

手续费及佣金收入的金额按照本集团在日常经营活动中提供劳务时，已收或应收合同或协议价款的公允价值确定。

本集团履行了合同中的履约义务，客户取得相关商品或服务的控制权时，确认相关的手续费及佣金收入：

(a) 经纪业务收入

代理买卖证券业务手续费收入及期货经纪业务手续费收入在交易日确认为收入。

(b) 投资银行业务收入

承销收入于本集团完成承销合同中的履约义务时确认收入。

根据合约条款，保荐收入在本集团履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

(c) 咨询服务业务收入

根据咨询服务的性质及合约条款，咨询服务业务收入在本集团履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

(d) 资产管理及基金管理业务收入

根据合同条款，受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入在本集团履行履约义务的过程中，根据合同或协议约定的收入计算方法，且已确认的累计收入金额很可能不会发生重大转回时，确认为当期收入。

24 合同成本

合同成本包括为取得合同发生的增量成本及合同履约成本。

为取得合同发生的增量成本是指本集团不取得合同就不会发生的成本（如销售佣金等）。该成本预期能够收回的，本集团将其作为合同取得成本确认为一项资产。本集团为取得合同发生的、除预期能够收回的增量成本之外的其他支出于发生时计入当期损益。

为履行合同发生的成本，不属于存货等其他企业会计准则规范范围且同时满足下列条件的，本集团将其作为合同履约成本确认为一项资产：

- 该成本与一份当前或预期取得的合同直接相关；
- 该成本增加了本集团未来用于履行履约义务的资源；
- 该成本预期能够收回。

合同取得成本确认的资产和合同履约成本确认的资产（以下简称“与合同成本有关的资产”）采用与该资产相关的商品或服务收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。合同取得成本确认的资产摊销期限不超过一年的，在发生时计入当期损益。

当与合同成本有关的资产的账面价值高于下列两项的差额时，本集团对超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失：

- 本集团因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价；
- 为转让该相关商品或服务估计将要发生的成本。

与合同成本相关的资产计提减值准备后，如果以前期间减值的因素发生变化，使得上述两项差额高于该资产账面价值的，转回原已计提的资产减值准备，并计入当期损益，但转回后的资产账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该资产在转回日的账面价值。

25 职工薪酬

(1) 短期薪酬

本集团在职工提供服务的会计期间，将实际发生或按规定的基准和比例计提的职工工资、奖金、医疗保险费、工伤保险费和生育保险费等社会保险费和住房公积金，确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 离职后福利 - 设定提存计划

本集团所参与的设定提存计划包括：

- 按照中国有关法规要求，本集团职工参加的由政府机构设立管理的社会保障体系中的基本养老保险和失业保险。基本养老保险和失业保险的缴费金额按国家规定的基准和比例计算；
- 本集团向中国大陆以外的若干国家或司法管辖区全职员工提供了政府或当地劳工法规定的相应养老保险计划（包括香港强积金及其他中国大陆以外若干国家的法定计划）；
- 本集团向中国大陆合格员工另外提供依据国家企业年金制度的相关政策建立的企业年金计划（“年金计划”），本集团按员工工资总额的一定比例向年金计划缴款。

(3) 辞退福利

本集团在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或者为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，在下列两者孰早日，确认辞退福利产生的负债，同时计入当期损益。

- 本集团不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；
- 本集团有详细、正式的涉及支付辞退福利的重组计划；并且，该重组计划已开始实施，或已向受其影响的各方通告了该计划的主要内容，从而使各方形成了对本集团将实施重组的合理预期时。

(4) 其他长期职工福利

本集团的其他长期职工福利为报告期末 12 个月内不需支付的递延发放奖金，本集团根据职工提供服务而获取的未来报告期间预计获得的福利金额，将其予以折现后的现值确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

26 政府补助

政府补助是本集团从政府无偿取得的货币性资产或非货币性资产，但不包括政府以投资者身份向本集团投入的资本。

政府补助在能够满足政府补助所附条件，并能够收到时，予以确认。

政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量。

本集团取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助作为与资产相关的政府补助。本集团取得的与资产相关之外的其他政府补助作为与收益相关的政府补助。与资产相关的政府补助，本集团将其确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入其他收益或营业外收入。与收益相关的政府补助，如果用于补偿本集团以后期间的相关费用或损失的，本集团将其确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入其他收益或营业外收入；否则直接计入其他收益或营业外收入。

与本集团日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益。与本集团日常活动无关的政府补助，计入营业外收入。

27 所得税

除因企业合并和直接计入股东权益（包括其他综合收益）的交易或者事项产生的所得税外，本集团将当期所得税和递延所得税计入当期损益。

当期所得税是按本期应税所得额，根据税法规定的税率计算的预期应交所得税，加上以往年度应付所得税的调整。

资产负债表日，如果本集团拥有以净额结算的法定权利并且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行，那么当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列示。

递延所得税资产与递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减。递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

如果不属于企业合并交易且交易发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损），则该项交易中产生的暂时性差异不会产生递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生相关的递延所得税。

资产负债表日，本集团根据递延所得税资产和负债的预期收回或结算方式，依据已颁布的税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量该递延所得税资产和负债的账面金额。

资产负债表日，本集团对递延所得税资产的账面价值进行复核。如果未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的利益，则减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，减记的金额予以转回。

资产负债表日，递延所得税资产及递延所得税负债在同时满足以下条件时以抵销后的净额列示：

- 纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；
- 递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债。

28 租赁

租赁，是指在一定期间内，出租人将资产的使用权让与承租人以获取对价的合同。

在合同开始日，本集团评估合同是否为租赁或者包含租赁。如果合同中一方让渡了在一定期间内控制一项或多项已识别资产使用的权利以换取对价，则该合同为租赁或者包含租赁。

为确定合同是否让渡了在一定期间内控制已识别资产使用的权利，本集团进行如下评估：

- 合同是否涉及已识别资产的使用。已识别资产可能由合同明确指定或在资产可供客户使用时隐性指定，并且该资产在物理上可区分，或者如果资产的某部分产能或其他部分在物理上不可区分但实质上代表了该资产的全部产能，从而使客户获得因使用该资产所产生的几乎全部经济利益。如果资产的供应方在整个使用期间拥有对该资产的实质性替换权，则该资产不属于已识别资产；
- 承租人是否有权获得在使用期间内因使用已识别资产所产生的几乎全部经济利益；
- 承租人是否有权在该使用期间主导已识别资产的使用。

合同中同时包含多项单独租赁的，承租人和出租人将合同予以分拆，并分别对各项单独租赁进行会计处理。合同中同时包含租赁和非租赁部分的，承租人和出租人将租赁和非租赁部分进行分拆。在分拆合同包含的租赁和非租赁部分时，承租人按照各租赁部分单独价格及非租赁部分的单独价格之和的相对比例分摊合同对价。出租人按附注三、23 所述会计政策中关于交易价格分摊的规定分摊合同对价，分摊的基础为租赁部分和非租赁部分各自的单独价格。

(1) 本集团作为承租人

作为承租人，本集团租用许多资产，其中大部分为房屋及建筑物。在租赁期开始日，本集团对租赁确认使用权资产和租赁负债。使用权资产按照成本进行初始计量，包括租赁负债的初始计量金额、在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额（扣除已享受的租赁激励相关金额），发生的初始直接费用以及为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。

本集团使用直线法对使用权资产计提折旧。对能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，本集团在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。否则，租赁资产在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。使用权资产按附注三、18 所述的会计政策计提减值准备。

租赁负债按照租赁期开始日尚未支付的租赁付款额的现值进行初始计量，折现率为租赁内含利率。无法确定租赁内含利率的，采用本集团增量借款利率作为折现率。

本集团按照固定的周期性利率计算租赁负债在租赁期内各期间的利息费用，并计入当期损益或相关资产成本。未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益或相关资产成本。

租赁期开始日后，发生下列情形的，本集团按照变动后租赁付款额的现值重新计量租赁负债：

- 根据担保余值预计的应付金额发生变动；
- 用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动；

- 因租赁期变化或购买选择权的评估结果发生变化的，本集团按变动后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债。

在对租赁负债进行重新计量时，本集团相应调整使用权资产的账面价值。使用权资产的账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，本集团将剩余金额计入当期损益。

本集团已选择对短期租赁（租赁期不超过 12 个月且不包含购买选择权的租赁）和低价值资产租赁不确认使用权资产和租赁负债，并将相关的租赁付款额在租赁期内各个期间按照直线法计入当期损益或相关资产成本。

(2) 本集团作为出租人

在租赁开始日，本集团将租赁分为融资租赁和经营租赁。融资租赁是指无论所有权最终是否转移但实质上转移了与租赁资产所有权有关的几乎全部风险和报酬的租赁。经营租赁是指除融资租赁以外的其他租赁。

本集团作为转租出租人时，基于原租赁产生的使用权资产，而不是原租赁的标的资产，对转租进行分类。如果原租赁为短期租赁且本集团选择对原租赁应用上述短期租赁的简化处理，本集团将该转租分类为经营租赁。

经营租赁的租赁收款额在租赁期内按直线法确认为租金收入。本集团将其发生的与经营租赁有关的初始直接费用予以资本化，在租赁期内按照与租金收入确认相同的基础进行分摊，分期计入当期损益。未计入租赁收款额的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

29 融出资金和融出证券

融资融券业务，是指本集团向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。本集团发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

本集团融资融券业务所融出的资金确认为应收债权，作为融出资金列示并确认相应利息收入；为融券业务购入的金融资产在融出前按照附注三、9(1) 的相关规定进行列示，融出后在资产负债表中不终止确认，继续按照附注三、9(1) 的相关规定进行会计处理，同时将相应收入计入当期损益。

本集团在资产负债表日，以预期信用损失模型对融资融券业务计提减值准备详见附注三、9(6)。

30 转融通业务核算方法

本集团通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由本集团享有或承担，不将其计入资产负债表。本集团根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

31 持有待售和终止经营

(1) 持有待售

本集团主要通过出售而非持续使用一项非流动资产或处置组收回其账面价值时，将该非流动资产或处置组划分为持有待售类别。

处置组，是指在一项交易中作为整体通过出售或其他方式一并处置的一组资产，以及在该交易中转让的与这些资产直接相关的负债。

本集团将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：

- 根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，该非流动资产或处置组在其当前状况下即可立即出售；
- 出售极可能发生，即本集团已经就一项出售计划作出决议且已与其他方签订了具有法律约束力的购买协议，预计出售将在一年内完成。

本集团按账面价值与公允价值（参见附注三、20）减去出售费用后净额之孰低者对持有待售的非流动资产（不包括金融资产（参见附注三、9）及递延所得税资产（参见附注三、27）或处置组进行初始计量和后续计量，账面价值高于公允价值（参见附注三、20）减去出售费用后净额的差额确认为资产减值损失，计入当期损益。

(2) 终止经营

本集团将满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已被本集团处置或划分为持有待售类别的界定为终止经营：

- 该组成部分代表一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区；
- 该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区进行处置的一项相关联计划的一部分；
- 该组成部分是专为转售而取得的子公司。

本集团对于当期列报的终止经营，在当期利润表中分别列示持续经营损益和终止经营损益，并在比较期间的利润表中将原来作为持续经营损益列报的信息重新作为可比会计期间的终止经营损益列报。

32 套期会计

套期会计方法，是指将套期工具和被套期项目产生的利得或损失在相同会计期间计入当期损益（或其他综合收益）以反映风险管理活动影响的方法。

被套期项目是使本集团面临公允价值或现金流量变动风险，且被指定为被套期对象的、能够可靠计量的项目。本集团指定为被套期项目有使本集团面临现金流量变动风险的浮动利率债券等。

套期工具是本集团为进行套期而指定的、其公允价值或现金流量变动预期可抵销被套期项目的公允价值或现金流量变动的金融工具。

本集团在套期开始日及以后期间持续地对套期关系是否符合套期有效性要求进行评估。套期同时满足下列条件时，本集团认定套期关系符合套期有效性要求：

- 被套期项目和套期工具之间存在经济关系；
- 被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影响不占主导地位；
- 套期关系的套期比率，应当等于企业实际套期的被套期项目数量与对其进行套期的套期工具实际数量之比。

套期关系由于套期比率的原因而不再符合套期有效性要求，但指定该套期关系的风险管理目标没有改变的，本集团进行套期关系再平衡，对已经存在的套期关系中被套期项目或套期工具的数量进行调整，以使套期比率重新符合套期有效性要求。

发生下列情形之一的，本集团终止运用套期会计：

- 因风险管理目标发生变化，导致套期关系不再满足风险管理目标；
- 套期工具已到期、被出售、合同终止或已行使；
- 被套期项目与套期工具之间不再存在经济关系，或者被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影响开始占主导地位；
- 套期关系不再满足运用套期会计方法的其他条件。

(1) 现金流量套期

现金流量套期是指对现金流量变动风险敞口进行的套期。套期工具产生的利得或损失中属于套期有效的部分，本集团将其作为现金流量套期储备，计入其他综合收益。现金流量套期储备的金额为下列两项的绝对额中较低者：

- 套期工具自套期开始的累计利得或损失；
- 被套期项目自套期开始的预计未来现金流量现值的累计变动额。

每期计入其他综合收益的现金流量套期储备的金额为当期现金流量套期储备的变动额。

套期工具产生的利得或损失中属于套期无效的部分，计入当期损益。

被套期项目为预期交易，且该预期交易使本集团随后确认一项非金融资产或非金融负债的，或者非金融资产或非金融负债的预期交易形成一项适用于公允价值套期会计的确定承诺时，本集团将原在其他综合收益中确认的现金流量套期储备金额转出，计入该资产或负债的初始确认金额。

对于不属于上述情况的现金流量套期，本集团在被套期的预期现金流量影响损益的相同期间，将原在其他综合收益中确认的现金流量套期储备金额转出，计入当期损益。

当本集团对现金流量套期终止运用套期会计时，在其他综合收益中确认的累计现金流量套期储备金额，按照下列会计政策进行处理：

- 被套期的未来现金流量预期仍然会发生的，累计现金流量套期储备的金额予以保留，并按照上述现金流量套期的会计政策进行处理；
- 被套期的未来现金流量预期不再发生的，累计现金流量套期储备的金额从其他综合收益中转出，计入当期损益。

(2) 公允价值套期

公允价值套期是指对已确认资产或负债、尚未确认的确定承诺，或上述项目组成部分的公允价值变动风险敞口进行的套期。

套期工具产生的利得或损失计入当期损益。被套期项目因被套期风险敞口形成的利得或损失计入当期损益，同时调整未以公允价值计量的已确认被套期项目的账面价值。

被套期项目为以摊余成本计量的金融工具（或其组成部分）的，本集团对被套期项目账面价值所作的调整按照开始摊销日重新计算的利率进行摊销，并计入当期损益。

(3) 境外经营净投资套期

境外经营净投资套期是指对境外经营净投资外汇风险敞口进行的套期。套期工具形成的利得或损失中属于套期有效的部分，计入其他综合收益，并于全部或部分处置境外经营时相应转出，计入当期损益。套期工具形成的利得或损失中属于套期无效的部分，计入当期损益。

33 股利分配

普通股的现金股利于股东大会批准的当期，确认为负债。永续债的股利分配政策参见附注三、9(8)。

资产负债表日后，经审议批准的利润分配方案中拟分配的股利或利润，不确认为资产负债表日的负债，在附注中单独披露。

34 关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可为个人或企业。仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成关联方。

此外，本公司同时根据证监会颁布的《上市公司信息披露管理办法》确定本集团或本公司的关联方。

35 风险准备计提

本公司根据《金融企业财务规则》（中华人民共和国财政部令 第 42 号）及其实施指南（财金 [2007] 23 号）的规定，以及证监会颁布的《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》（证监机构字 [2007] 320 号）的要求，按照当期净利润的 10% 提取一般风险准备；本公司根据《证券法》和证监机构字 [2007] 320 号的规定，按照当期净利润的 10% 提取交易风险准备。本公司根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》（证监会令 [第 94 号]）的规定，按照当期基金托管费收入的 2.5% 提取一般交易风险准备。本公司相关子公司亦根据相关监管规定的要求计提一般风险准备和交易风险准备。计提的一般风险准备和交易风险准备计入一般风险准备项目核算。

36 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部。如果两个或多个经营分部存在相似经济特征且同时在各单项产品或劳务的性质、生产过程的性质、产品或劳务的客户类型、销售产品或提供劳务的方式、生产产品及提供劳务受法律及行政法规的影响等方面具有相同或相似性的，可以合并为一个经营分部。本集团以经营分部为基础考虑重要性原则后确定报告分部。

本集团在编制分部报告时，分部间交易收入按实际交易价格为基础计量。编制分部报告所采用的会计政策与编制本集团财务报表所采用的会计政策一致。

37 主要会计估计及判断

编制财务报表时，本集团管理层需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本集团管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

(1) 金融工具的公允价值

对于缺乏活跃市场的金融工具，本集团运用估值方法确定其公允价值。估值方法在最大程度上利用可观察市场信息；当可观察市场信息无法获得时，将对估值方法中包括的重大不可观察信息做出估计。

(2) 预期信用损失的计量

计量预期信用损失，需要作出以下重大判断及估计：

信用风险的显著增加

预期信用损失模型中减值准备的确认为第一阶段资产按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其信用损失准备，第二阶段或第三阶段资产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信用损失准备。当初始确认后风险显著增加时，资产进入第二阶段。在评估资产的信用风险是否显著增加时，本集团会考虑定性和定量的合理且有依据的前瞻性信息。

根据信用风险特征划分资产组合

当以组合为基础计量预期信用损失时，金融工具根据共同风险特征分类。本集团持续评估信用风险是否相似的适当性，以确保如果信用风险特征发生变化，可以对资产进行合理的重新划分。这可能会导致设立新的组合或将资产重新划分至某个现存资产组合，以更好地反映该资产组合相似的风险特征。当信用风险显著增加时，资产从第一阶段转入第二阶段。但是在资产组合中，即使资产组合的信用风险计量基础未发生变化，仍旧以 12 个月的预期信用损失或整个存续期内预期信用损失为基础，由于资产组合的信用风险发生变化也会导致预期信用损失的变动。

使用的模型及假设

本集团使用多种模型及假设来估计预期信用损失。本集团通过判断来确定每一类型金融资产最合适的模型，以及模型中使用的假设，包括信用风险的关键驱动因素相关的假设。

前瞻性信息

本集团使用合理且有依据的前瞻性信息计量预期信用损失，这些信息基于对不同经济驱动因素未来走势的假设，以及这些经济驱动因素如何相互影响的假设。

违约概率

违约概率是计量预期信用损失的关键指标。违约概率指于给定时间范围内，采用历史数据、假设及预期未来状况计算出的违约可能性的估计。

违约损失率

违约损失率是对违约造成的损失程度的估计。它是到期合同现金流量与本集团预期收到的考虑了抵押物及整体信用增级后的现金流量之间的差异。

损失率

损失率是本集团基于相关履约担保比对可能产生的损失的预期。本集团基于公开可获取的信息采用历史损失率评估损失率的恰当性。

(3) 非金融资产减值

本集团对存在减值迹象的非金融资产进行减值测试，估计资产的可收回金额。此外，无论是否存在减值迹象，本集团于每年年度终了对商誉及使用寿命不确定的无形资产估计其可收回金额。

由于此类资产（或资产组）的市场价格无法可靠计量，因此相关资产的公允价值也无法得到可靠地估计。在评估资产（或资产组）的未来现金流量现值时，本集团需基于所有可收集的数据及合理充分假设，对资产在持续使用过程中和最终处置时所产生的预计未来现金流量及折现率作出重大判断和估计。

(4) 所得税

本集团需要对某些交易未来的税务处理作出判断以确认所得税。本集团根据有关税收法规，谨慎判断交易对应的所得税影响并相应地计提所得税。递延所得税资产只会在本集团很可能取得未来应纳税利润并可用作抵销有关暂时性差异时才可确认。对此，管理层需要就某些交易的税务处理作出重大判断，并需要就是否能取得足够的未来应纳税利润以抵销递延所得税资产的可能性作出重大的估计。

(5) 合并范围的确定

评估本集团是否作为管理人和/或投资者控制被投资单位时须考虑所有事实及情况。控制的定义包含以下三项要素：(i) 拥有对被投资者的权力；(ii) 通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；及(iii) 有能力运用对被投资者的权力影响其回报的金额。倘若有事实及情况显示上述一项或多项要素发生了变化，则本集团需要重新评估其是否对被投资单位构成控制。

对于本集团管理和/或投资的资产管理计划、投资基金及合伙企业等，综合考虑其自身直接或间接享有权利而拥有的权力，评估所持有结构化主体连同享有的管理人报酬所产生的可变回报的风险敞口是否足够重大以致表明其对结构化主体拥有控制。若本集团对管理和/或投资的结构化主体拥有控制，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

38 主要会计政策、会计估计的变更

(1) 本年新生效的企业会计准则相关规定

财政部于2022年11月30日发布了《企业会计准则解释第16号》（以下简称“解释16号”），规范了关于单项交易产生的资产和负债相关的递延所得税初始确认豁免的会计处理。

关于单项交易产生的资产和负债相关的递延所得税初始确认豁免的会计处理

解释16号对《企业会计准则第18号——所得税》中递延所得税初始确认豁免的范围进行了修订，明确对于不是企业合并、交易发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）、且初始确认的资产和负债导致产生等额应纳税暂时性差异和可抵扣暂时性差异的单项交易，不适用《企业会计准则第18号——所得税》关于豁免初始确认递延所得税负债和递延所得税资产的规定。该规定自2023年1月1日起施行，可以提前执行。本集团于本期执行了该规定，并对于财务报表列报最早期间的期初至2022年12月31日之间发生的单项交易采用追溯调整法进行会计处理，并重述了比较年度财务报表。具体影响列示如下：

合并财务报表

2022年1月1日			
项目	变更前	新准则影响金额	变更后
递延所得税资产	654,651,402.36	6,688,938.36	661,340,340.72
递延所得税负债	2,619,160,783.01	78,564.54	2,619,239,347.55
未分配利润	35,559,778,869.62	4,698,508.36	35,564,477,377.98
盈余公积	6,569,922,031.25	465,801.73	6,570,387,832.98
一般风险准备	18,106,043,631.71	1,446,063.73	18,107,489,695.44

2022年12月31日			
项目	变更前	新准则影响金额	变更后
递延所得税资产	596,499,230.16	3,973,774.67	600,473,004.83
递延所得税负债	2,203,855,426.39	(3,927,259.79)	2,199,928,166.60
未分配利润	37,923,299,960.91	5,785,750.37	37,929,085,711.28
盈余公积	7,790,909,135.02	419,488.89	7,791,328,623.91
一般风险准备	21,024,437,148.19	1,695,795.20	21,026,132,943.39

2022年1-6月			
项目	变更前	新准则影响金额	变更后
所得税费用	(1,221,856,699.85)	754,888.45	(1,221,101,811.40)
净利润	5,552,139,253.46	754,888.45	5,552,894,141.91

母公司财务报表

2022年1月1日			
项目	变更前	新准则影响金额	变更后
递延所得税资产	95,544,619.73	4,658,017.32	100,202,637.05
未分配利润	20,003,532,244.85	3,260,612.13	20,006,792,856.98
盈余公积	6,569,922,031.25	465,801.73	6,570,387,832.98
一般风险准备	13,352,459,851.82	931,603.46	13,353,391,455.28

2022年12月31日			
项目	变更前	新准则影响金额	变更后
递延所得税负债	142,515,563.92	(4,194,888.91)	138,320,675.01
未分配利润	24,000,453,156.70	2,936,422.24	24,003,389,578.94
盈余公积	7,790,909,135.02	419,488.89	7,791,328,623.91
一般风险准备	15,795,053,134.54	838,977.78	15,795,892,112.32

2022年1-6月			
项目	变更前	新准则影响金额	变更后
所得税费用	(942,998,019.24)	1,139,068.08	(941,858,951.16)
净利润	3,886,528,942.49	1,139,068.08	3,887,668,010.57

(2) 会计估计变更

报告期内，本集团主要会计估计未发生变更。

四、税项

1 主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	3% - 13%
城市维护建设税	按应交增值税计征	1% - 7%
教育费附加	按应交增值税计征	2% - 3%
地方教育费附加	按应交增值税计征	1% - 2%
企业所得税	按应纳税所得额计征	25% (注)

注：本公司及本公司的境内子公司适用的所得税率为 25% (2022 年：25%)。本公司的香港子公司适用的利得税率为 16.5% (2022 年：16.5%)。本公司的美国子公司适用 21% 的联邦所得税率 (2022 年：21%)。本公司的其他境外子公司适用于其所在地当地所规定的所得税税率。

五、合并财务报表项目注释

1 货币资金

(1) 按类别列示

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
库存现金	206,583.19	203,134.98
银行存款	164,061,739,644.09	155,612,284,845.19
其中：客户资金存款	116,550,537,451.23	110,431,006,423.76
公司存款	47,511,202,192.86	45,181,278,421.43
其他货币资金	150,388.99	96,113.06
减：减值准备	(412,285.70)	(832,617.78)
合计	164,061,684,330.57	155,611,751,475.45

(2) 按币种列示

	2023年6月30日			2022年12月31日		
	原币金额	折算率	人民币金额 人民币元	原币金额	折算率	人民币金额 人民币元
库存现金：						
人民币	196,441.41	1.0000	196,441.41	193,309.01	1.0000	193,309.01
港币	11,000.00	0.9220	10,141.78	10,999.63	0.8933	9,825.97
库存现金合计			206,583.19			203,134.98
银行存款：						
客户非信用资金存款						
人民币	100,401,873,499.10	1.0000	100,401,873,499.10	92,566,565,344.46	1.0000	92,566,565,344.46
美元	165,440,709.55	7.2258	1,195,441,479.03	123,349,080.23	6.9646	859,077,004.14
港币	1,415,289,475.12	0.9220	1,304,896,896.06	423,807,763.68	0.8933	378,587,475.29
其他			19,254,313.00			417,919.42
小计			102,921,466,187.19			93,804,647,743.31
客户信用资金存款						
人民币	12,737,698,503.81	1.0000	12,737,698,503.81	14,094,787,823.85	1.0000	14,094,787,823.85
美元	27,089,064.63	7.2258	195,740,163.21	77,819,766.16	6.9646	541,983,543.40
港币	752,482,704.15	0.9220	693,789,053.23	2,181,920,160.64	0.8933	1,949,109,279.50
其他			1,843,543.79			40,478,033.70
小计			13,629,071,264.04			16,626,358,680.45
客户存款小计			116,550,537,451.23			110,431,006,423.76
公司自有资金存款						
人民币	32,446,142,305.01	1.0000	32,446,142,305.01	32,825,101,053.80	1.0000	32,825,101,053.80
美元	1,910,046,941.64	7.2258	13,801,617,190.91	1,641,309,409.56	6.9646	11,431,063,513.83
港币	1,275,249,231.25	0.9220	1,175,779,791.21	982,556,520.67	0.8933	877,717,739.92
其他			87,662,905.73			47,396,113.88
小计			47,511,202,192.86			45,181,278,421.43
公司存款小计			47,511,202,192.86			45,181,278,421.43
银行存款合计			164,061,739,644.09			155,612,284,845.19
其他货币资金：						
人民币	150,388.99	1.0000	150,388.99	96,113.06	1.0000	96,113.06
其他货币资金合计			150,388.99			96,113.06
小计			164,062,096,616.27			155,612,584,093.23
减：减值准备			(412,285.70)			(832,617.78)
合计			164,061,684,330.57			155,611,751,475.45

(3) 使用受限制的货币资金

于2023年6月30日，本集团使用受限制的货币资金主要为最低流动资金限制、风险准备金及待缴纳结构化主体增值税等共计人民币1,112,327,732.11元(2022年12月31日：人民币1,205,332,921.99元)。

2 结算备付金

(1) 按类别列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
客户备付金	32,133,166,514.16	30,029,339,793.32
公司备付金	6,793,643,033.30	8,716,505,535.60
合计	<u>38,926,809,547.46</u>	<u>38,745,845,328.92</u>

(2) 按币种列示

	2023年6月30日			2022年12月31日		
	原币金额	折算率	人民币金额 人民币元	原币金额	折算率	人民币金额 人民币元
客户备付金：						
客户普通备付金						
人民币	28,405,873,349.86	1.0000	28,405,873,349.86	25,605,655,999.99	1.0000	25,605,655,999.99
美元	42,627,200.12	7.2258	308,015,622.63	40,326,516.39	6.9646	280,858,056.05
港币	61,478,505.93	0.9220	56,683,182.47	52,754,263.74	0.8933	47,125,383.80
小计			<u>28,770,572,154.96</u>			<u>25,933,639,439.84</u>
客户信用备付金						
人民币	3,362,594,359.20	1.0000	3,362,594,359.20	4,095,700,353.48	1.0000	4,095,700,353.48
小计			<u>3,362,594,359.20</u>			<u>4,095,700,353.48</u>
客户备付金合计			<u>32,133,166,514.16</u>			<u>30,029,339,793.32</u>
公司备付金：						
公司普通备付金						
人民币	5,928,365,272.30	1.0000	5,928,365,272.30	7,662,632,440.65	1.0000	7,662,632,440.65
美元	6,260,133.53	7.2258	45,234,472.86	669,760.22	6.9646	4,664,612.02
港币	423.18	0.9220	390.16	423.16	0.8933	378.01
其他			1,536,902.72			146,175.16
小计			<u>5,975,137,038.04</u>			<u>7,667,443,605.84</u>
公司信用备付金						
人民币	805,063,550.80	1.0000	805,063,550.80	993,535,018.66	1.0000	993,535,018.66
港币	14,579,971.00	0.9220	13,442,444.46	62,159,309.41	0.8933	55,526,911.10
小计			<u>818,505,995.26</u>			<u>1,049,061,929.76</u>
公司备付金合计			<u>6,793,643,033.30</u>			<u>8,716,505,535.60</u>
合计			<u>38,926,809,547.46</u>			<u>38,745,845,328.92</u>

3 融出资金

(1) 按类别列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
融资融券业务融出资金	103,614,815,413.24	99,846,681,526.69
孖展融资	3,303,986,434.75	2,328,049,396.34
减：减值准备	(1,506,634,467.14)	(1,526,356,209.30)
融出资金净值	<u>105,412,167,380.85</u>	<u>100,648,374,713.73</u>

(2) 按账龄分析

2023年6月30日					
	账面余额		坏账准备		
	金额 人民币元	比例 %	金额 人民币元	比例 %	
1 - 3个月	46,444,422,672.95	43.44	611,378,750.77	40.58	
3 - 6个月	11,541,079,050.29	10.79	150,546,414.04	9.99	
6个月以上	48,933,300,124.75	45.77	744,709,302.33	49.43	
合计	<u>106,918,801,847.99</u>	<u>100.00</u>	<u>1,506,634,467.14</u>	<u>100.00</u>	

2022年12月31日					
	账面余额		坏账准备		
	金额 人民币元	比例 %	金额 人民币元	比例 %	
1 - 3个月	37,773,777,247.19	36.97	532,302,252.86	34.87	
3 - 6个月	15,693,616,009.19	15.36	217,860,332.69	14.27	
6个月以上	48,707,337,666.65	47.67	776,193,623.75	50.86	
合计	<u>102,174,730,923.03</u>	<u>100.00</u>	<u>1,526,356,209.30</u>	<u>100.00</u>	

(3) 按客户类别列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
境内		
其中：个人	91,445,986,220.55	88,210,505,897.66
机构	12,168,829,192.69	11,636,175,629.03
减：减值准备	(1,457,996,682.56)	(1,486,115,063.16)
账面价值小计	<u>102,156,818,730.68</u>	<u>98,360,566,463.53</u>
境外		
其中：个人	1,157,182,033.69	963,070,218.04
机构	2,146,804,401.06	1,364,979,178.30
减：减值准备	(48,637,784.58)	(40,241,146.14)
账面价值小计	<u>3,255,348,650.17</u>	<u>2,287,808,250.20</u>
合计	<u><u>105,412,167,380.85</u></u>	<u><u>100,648,374,713.73</u></u>

(4) 担保物公允价值

融出资金的担保物公允价值详见附注十六、3(1)。

4 衍生金融工具

2023年6月30日

	用于套期的衍生金融工具			用于非套期的衍生金融工具		
	名义金额 人民币元	公允价值		名义金额 人民币元	公允价值	
		资产 人民币元	负债 人民币元		资产 人民币元	负债 人民币元
利率衍生工具	-	-	-	1,859,429,230,289.18	1,068,433,209.71	(186,742,178.87)
货币衍生工具	3,025,000,000.00	-	(60,040,131.43)	187,331,716,930.23	1,326,818,652.82	(1,102,940,442.34)
权益衍生工具	-	-	-	555,833,288,366.98	10,137,369,221.90	(9,425,104,033.06)
信用衍生工具	-	-	-	5,435,786,576.10	24,350,364.38	(5,807,642.85)
其他衍生工具	-	-	-	318,793,841,701.25	2,482,969,048.18	(3,143,215,593.08)
合计	<u>3,025,000,000.00</u>	<u>-</u>	<u>(60,040,131.43)</u>	<u>2,926,823,863,863.74</u>	<u>15,039,940,496.99</u>	<u>(13,863,809,890.20)</u>

2022年12月31日

	用于套期的衍生金融工具			用于非套期的衍生金融工具		
	名义金额 人民币元	公允价值		名义金额 人民币元	公允价值	
		资产 人民币元	负债 人民币元		资产 人民币元	负债 人民币元
利率衍生工具	1,392,920,000.00	11,522,977.34	-	2,048,022,312,327.38	1,187,554,673.14	(237,263,369.43)
货币衍生工具	3,025,000,000.00	31,120,602.31	-	127,664,441,359.57	337,447,486.66	(1,298,573,229.06)
权益衍生工具	-	-	-	573,466,284,116.46	13,178,785,166.23	(6,128,238,880.56)
信用衍生工具	-	-	-	3,485,135,472.47	20,451,814.80	(3,022,971.17)
其他衍生工具	-	-	-	549,318,616,319.19	1,021,418,073.60	(1,971,026,614.17)
合计	<u>4,417,920,000.00</u>	<u>42,643,579.65</u>	<u>-</u>	<u>3,301,956,789,595.07</u>	<u>15,745,657,214.43</u>	<u>(9,638,125,064.39)</u>

(1) 已抵销的衍生金融工具

项目	2023年6月30日			2022年12月31日		
	抵销前总额 人民币元	抵销金额 人民币元	抵销后净额 人民币元	抵销前总额 人民币元	抵销金额 人民币元	抵销后净额 人民币元
利率衍生工具	(504,375,830.04)	504,375,830.04	-	(765,239,572.20)	765,239,572.20	-
权益衍生工具	313,856,957.97	(313,856,957.97)	-	647,200,791.14	(647,200,791.14)	-
其他衍生工具	55,340,458.53	(55,340,458.53)	-	329,140,748.00	(329,140,748.00)	-

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本集团所持有的国债期货、利率互换、股指期货和商品期货产生的公允价值变动金额。因此，衍生金融资产和衍生金融负债项下的国债期货、利率互换、股指期货和商品期货投资按抵销相关暂收暂付款后的净额列示。

(2) 现金流量套期

本集团的现金流量套期工具包括利率掉期，主要用于对现金流波动进行套期。

上述衍生金融工具中，本集团认定为现金流量套期的套期工具如下：

2023年6月30日							
	名义金额					公允价值	
	3个月以内 人民币元	3个月至1年 人民币元	1至5年 人民币元	5年以上 人民币元	总计 人民币元	资产 人民币元	负债 人民币元
货币衍生工具	-	-	3,025,000,000.00	-	3,025,000,000.00	-	(60,040,131.43)

2022年12月31日							
	名义金额					公允价值	
	3个月以内 人民币元	3个月至1年 人民币元	1至5年 人民币元	5年以上 人民币元	总计 人民币元	资产 人民币元	负债 人民币元
利率衍生工具	1,392,920,000.00	-	-	-	1,392,920,000.00	11,522,977.34	-
货币衍生工具	-	-	3,025,000,000.00	-	3,025,000,000.00	31,120,602.31	-
合计	1,392,920,000.00	-	3,025,000,000.00	-	4,417,920,000.00	42,643,579.65	-

本集团在现金流量套期策略中被套期风险敞口及对权益的影响的具体资讯列示如下：

2023年6月30日					
	被套期项目账面价值		套期工具本期对 其他综合收益影响的金额 人民币元	套期工具累计计入 其他综合收益的金额 人民币元	资产负债表项目 人民币元
	资产 人民币元	负债 人民币元			
债券	-	(3,043,120,409.82)	41,749,661.01	84,393,240.66	应付债券

2022年12月31日					
	被套期项目账面价值		套期工具本年对 其他综合收益影响的金额 人民币元	套期工具累计计入 其他综合收益的金额 人民币元	资产负债表项目 人民币元
	资产 人民币元	负债 人民币元			
债券	-	(5,844,229,695.47)	56,827,162.56	42,643,579.65	应付债券

5 存出保证金

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
期货保证金	32,974,667,979.83	33,212,287,785.34
信用保证金	429,523,698.22	1,909,131,847.48
交易保证金	6,790,882,319.35	7,585,356,999.70
合计	40,195,073,997.40	42,706,776,632.52

	2023年6月30日			2022年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额 人民币元	外币金额	折算率	人民币金额 人民币元
期货保证金：						
人民币	30,070,950,013.03	1.0000	30,070,950,013.03	30,354,479,345.06	1.0000	30,354,479,345.06
美元	321,918,183.25	7.2258	2,326,116,408.53	340,179,137.06	6.9646	2,369,211,617.96
港币	526,105,528.66	0.9220	485,069,297.42	498,492,514.42	0.8933	445,303,363.13
其他			92,532,260.85			43,293,459.19
小计			32,974,667,979.83			33,212,287,785.34
信用保证金：						
人民币	429,523,698.22	1.0000	429,523,698.22	1,909,131,847.48	1.0000	1,909,131,847.48
小计			429,523,698.22			1,909,131,847.48
交易保证金：						
人民币	2,508,374,920.18	1.0000	2,508,374,920.18	2,273,628,060.63	1.0000	2,273,628,060.63
美元	568,812,605.90	7.2258	4,110,126,127.68	745,488,701.58	6.9646	5,192,030,611.02
港币	186,962,363.75	0.9220	172,379,195.38	52,773,582.45	0.8933	47,142,641.20
其他			2,076.11			72,555,686.85
小计			6,790,882,319.35			7,585,356,999.70
合计			40,195,073,997.40			42,706,776,632.52

6 应收款项

(1) 按类别分析如下

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
应收权益互换及场外期权	2,192,409,196.20	1,813,190,001.68
应收经纪、交易商及结算所	3,226,605,271.12	2,085,395,583.96
应收手续费及佣金	1,700,861,099.13	2,023,175,471.10
应收清算款	771,617,791.80	1,072,691,607.80
应收开放式基金赎回款	1,012,788,818.12	821,210,400.95
应收申购款	1,000,294,536.02	246,293.19
其他	133,013,808.77	56,961,853.39
小计	<u>10,037,590,521.16</u>	<u>7,872,871,212.07</u>
减：坏账准备	(75,743,672.22)	(68,530,562.66)
合计	<u><u>9,961,846,848.94</u></u>	<u><u>7,804,340,649.41</u></u>

(2) 按账龄分析如下

2023年6月30日					
	账面余额		坏账准备		
	金额 人民币元	比例 %	金额 人民币元	比例 %	
1年以内(含1年)	9,744,004,315.30	97.08	50,705,886.40	66.95	
1年至2年(含2年)	204,602,300.29	2.04	9,750,178.89	12.87	
2年至3年(含3年)	44,412,436.84	0.44	3,827,986.53	5.05	
3年以上	44,571,468.73	0.44	11,459,620.40	15.13	
合计	<u>10,037,590,521.16</u>	<u>100.00</u>	<u>75,743,672.22</u>	<u>100.00</u>	

2022年12月31日					
	账面余额		坏账准备		
	金额 人民币元	比例 %	金额 人民币元	比例 %	
1年以内(含1年)	7,620,381,304.67	96.79	53,768,250.36	78.46	
1年至2年(含2年)	197,671,009.44	2.51	6,221,791.60	9.08	
2年至3年(含3年)	39,778,804.79	0.51	3,296,304.20	4.81	
3年以上	15,040,093.17	0.19	5,244,216.50	7.65	
合计	<u>7,872,871,212.07</u>	<u>100.00</u>	<u>68,530,562.66</u>	<u>100.00</u>	

账龄自应收款项确认日起开始计算。

(3) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间应收款项坏账准备的变动情况参见附注五、21。

(4) 按欠款方归集的期末余额前五名的应收款项情况

单位名称	与本公司关系	金额 人民币元	账龄	占应收款项 总额的比例 %
交通银行股份有限公司	第三方	1,848,100,248.48	1 年以内 (含 1 年)	18.41
Clearstream	第三方	340,520,936.58	1 年以内 (含 1 年)	3.39
兴业证券股份有限公司	第三方	190,000,000.00	1 年以内 (含 1 年)	1.89
BNP PARIBAS	第三方	171,691,613.05	1 年以内 (含 1 年)	1.71
西部证券股份有限公司	第三方	160,000,000.00	1 年以内 (含 1 年)	1.59
合计		2,710,312,798.11		26.99

应收款项余额中无应收持有本公司 5% (含 5%) 以上股份的股东之款项。

应收款项余额中未包含股票质押式回购业务。

7 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
债券	11,577,579,588.53	28,257,793,057.03
股票	6,484,639,934.67	7,704,841,035.00
减：减值准备	(672,584,106.67)	(1,138,412,700.39)
合计	<u>17,389,635,416.53</u>	<u>34,824,221,391.64</u>

(2) 按业务类别列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
债券质押式回购	11,577,579,588.53	28,257,793,057.03
股票质押式回购	6,484,639,934.67	7,704,841,035.00
减：减值准备	(672,584,106.67)	(1,138,412,700.39)
合计	<u>17,389,635,416.53</u>	<u>34,824,221,391.64</u>

(3) 担保物信息

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
担保物	26,619,672,023.81	36,336,682,495.19
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	-	-
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	-	-
合计	<u>26,619,672,023.81</u>	<u>36,336,682,495.19</u>

对于通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因此无法获知对手方质押库信息，故上述担保物公允价值未包括交易所国债逆回购所取得的担保物资产的公允价值。于2023年6月30日和2022年12月31日，上述交易所国债逆回购的金额分别为人民币2,751,649,561.02元和人民币13,325,496,044.57元。

(4) 股票质押式回购业务按剩余期限列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
1个月内	715,056,890.99	1,632,472,078.56
1个月至3个月	2,342,558,416.06	528,129,181.11
3个月至1年	3,427,024,627.62	5,544,239,775.33
减：减值准备	(541,552,616.11)	(1,014,020,369.91)
合计	<u>5,943,087,318.56</u>	<u>6,690,820,665.09</u>

(5) 股票质押式回购按减值阶段列示

	2023年6月30日			合计 人民币元
	未来12个月 预期信用损失 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值) 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值) 人民币元	
账面余额	5,913,466,623.42	-	571,173,311.25	6,484,639,934.67
减值准备	(22,048,606.62)	-	(519,504,009.49)	(541,552,616.11)
账面价值	<u>5,891,418,016.80</u>	-	<u>51,669,301.76</u>	<u>5,943,087,318.56</u>
担保物价值	<u>15,870,766,627.50</u>	-	<u>598,568,462.09</u>	<u>16,469,335,089.59</u>

	2022年12月31日			合计 人民币元
	未来12个月 预期信用损失 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值) 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值) 人民币元	
账面余额	6,696,552,426.36	-	1,008,288,608.64	7,704,841,035.00
减值准备	(28,128,119.43)	-	(985,892,250.48)	(1,014,020,369.91)
账面价值	<u>6,668,424,306.93</u>	-	<u>22,396,358.16</u>	<u>6,690,820,665.09</u>
担保物价值	<u>18,262,202,962.33</u>	-	<u>972,956,837.91</u>	<u>19,235,159,800.24</u>

8 交易性金融资产

(1) 按类别列示

	2023年6月30日		2022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
	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 人民币元	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 人民币元	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 人民币元	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 人民币元
债券	174,716,829,653.12	174,064,259,371.51	174,205,449,613.97	174,853,169,601.96
公募基金	69,023,139,638.14	69,586,842,467.82	45,543,363,174.05	45,537,809,183.20
股票	115,035,065,868.06	114,906,994,662.48	102,733,885,765.11	107,240,731,179.89
银行理财产品	1,127,404,969.14	1,119,872,634.80	841,667,657.05	841,673,228.43
券商资管产品	1,222,652,147.98	1,497,299,305.99	1,425,645,762.35	1,687,177,170.10
信托计划	33,588,942.55	182,407,489.84	884,143,754.54	1,008,408,489.84
私募基金	18,398,917,036.60	17,218,050,421.72	17,423,948,118.21	16,173,429,386.63
其他股权投资	6,937,219,998.11	6,571,676,279.52	5,384,349,316.02	4,921,274,194.60
其他债务工具	2,725,057,098.57	3,759,061,397.67	3,103,555,588.57	4,026,924,291.14
合计	<u>389,219,875,352.27</u>	<u>388,906,464,031.35</u>	<u>351,546,008,749.87</u>	<u>356,290,596,725.79</u>

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团无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（截至 2022 年 12 月 31 日：无）。

(2) 交易性金融资产中的融出证券情况

截至 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 31 日，本集团交易性金融资产余额中分别包含融出证券人民币 2,326,129,272.19 元和人民币 2,902,260,211.31 元。

(3) 变现有限制的交易性金融资产

	限制条件	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
债券	质押	113,957,858,481.85	106,726,924,199.90
股票	质押	19,029,108,007.03	19,328,437,231.64
股票	已融出证券	520,867,173.66	709,249,565.47
公募基金	已融出证券	1,805,262,098.53	2,193,010,645.84
股票	存在限售期限	8,188,570,491.17	10,529,043,020.04
公募基金	存在限售期限	649,520,651.13	735,250,874.30
券商资管产品	以管理人身份认购的集合资产管理计划	67,434,391.92	139,507,032.47
合计		<u>144,218,621,295.29</u>	<u>140,361,422,569.66</u>

9 债权投资

(1) 债权投资金融资产情况

2023年6月30日				
	初始成本 人民币元	利息 人民币元	减值准备 人民币元	账面价值 人民币元
国债	16,790,000,000.00	343,199,235.63	-	17,133,199,235.63
地方政府债	31,608,800,000.00	1,214,354,791.48	(4,172,341.49)	32,818,982,449.99
企业债	12,000,000.00	502,544.67	(1,209.38)	12,501,335.29
公司债	344,513,382.89	14,128,691.44	(965,042.00)	357,677,032.33
合计	<u>48,755,313,382.89</u>	<u>1,572,185,263.22</u>	<u>(5,138,592.87)</u>	<u>50,322,360,053.24</u>

2022年12月31日				
	初始成本 人民币元	利息 人民币元	减值准备 人民币元	账面价值 人民币元
国债	15,000,000,000.00	178,679,047.33	-	15,178,679,047.33
地方政府债	31,680,800,000.00	995,066,770.99	(4,440,989.55)	32,671,425,781.44
企业债	12,000,000.00	169,914.53	(472.04)	12,169,442.49
公司债	465,783,630.17	18,628,991.85	(635,976.66)	483,776,645.36
其他债	200,000,000.00	6,573,369.86	(54,069.54)	206,519,300.32
合计	<u>47,358,583,630.17</u>	<u>1,199,118,094.56</u>	<u>(5,131,507.79)</u>	<u>48,552,570,216.94</u>

有关本集团持有的债券投资的信用风险敞口，参见附注八、2(1)。

(2) 债权投资金融资产减值准备变动情况

2023年1月1日至2023年6月30日止期间债权投资金融资产减值准备变动情况参见附注五、21。

(3) 变现有限制的债权投资

于2023年6月30日和2022年12月31日，本集团债权投资中分别有人民币27,103,324,222.00元和人民币47,753,034,524.11元的债券投资为卖出回购业务设定质押。

10 其他债权投资

2023年6月30日					
	初始成本 人民币元	利息 人民币元	公允价值变动 人民币元	账面价值 人民币元	累计减值准备 人民币元
国债	6,090,000,000.00	158,968,859.33	40,536,647.16	6,289,505,506.49	-
地方政府债	5,320,000,000.00	189,544,281.11	30,544,151.06	5,540,088,432.17	747,868.95
公司债	3,158,400,920.91	27,780,028.66	(101,819,596.21)	3,084,361,353.36	73,584,990.29
其他债务工具	484,880,512.25	11,994,446.23	(16,605,423.83)	480,269,534.65	201,878.99
合计	<u>15,053,281,433.16</u>	<u>388,287,615.33</u>	<u>(47,344,221.82)</u>	<u>15,394,224,826.67</u>	<u>74,534,738.23</u>

2022年12月31日					
	初始成本 人民币元	利息 人民币元	公允价值变动 人民币元	账面价值 人民币元	累计减值准备 人民币元
国债	2,160,000,000.00	42,704,882.01	765,982.24	2,203,470,864.25	-
地方政府债	3,120,000,000.00	112,575,358.56	(293,445.30)	3,232,281,913.26	436,316.86
企业债	640,000,000.00	17,386,245.56	942,968.14	658,329,213.70	88,867.01
公司债	2,352,094,879.05	23,252,776.67	(91,341,918.92)	2,284,005,736.80	29,430,753.07
金融债	1,480,000,000.00	32,193,733.98	(1,251,848.91)	1,510,941,885.07	203,952.30
其他债务工具	611,298,088.58	9,587,047.42	(5,535,676.84)	615,349,459.16	294,969.29
合计	<u>10,363,392,967.63</u>	<u>237,700,044.20</u>	<u>(96,713,939.59)</u>	<u>10,504,379,072.24</u>	<u>30,454,858.53</u>

于2023年6月30日，存在限售期限或有承诺条件的其他债权投资的账面价值为人民币10,066,597,757.94元(2022年12月31日：人民币3,466,393,750.00元)。

有关本集团持有的债券投资的信用风险敞口，参见附注八、2(1)。

11 其他权益工具投资

	2023年6月30日		2022年12月31日	
	初始成本 人民币元	期末公允价值 人民币元	初始成本 人民币元	年末公允价值 人民币元
非交易性权益工具	291,219,521.77	270,778,287.24	281,963,443.25	241,586,793.58

于2023年1-6月及2022年1-6月，本集团无终止确认的其他权益工具投资。

于2023年1-6月及2022年1-6月上述投资无分红收益。

12 长期股权投资

(1) 按类别列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
对联营企业的投资	19,376,905,309.28	18,276,443,070.92
对合营企业的投资	772,137,718.63	964,719,658.34
小计	20,149,043,027.91	19,241,162,729.26
减：减值准备		
- 联营企业	-	-
- 合营企业	-	-
合计	20,149,043,027.91	19,241,162,729.26

于2023年6月30日，本集团将长期股权投资中账面价值为人民币4,985,961,196.68元的股权投资作为充抵保证金证券提交中国证券金融股份有限公司以进行转融通业务(2022年12月31日：人民币4,648,621,810.98元)。

(2) 长期股权投资本期变动情况分析如下：

被投资单位	期初余额 人民币元	本期增减变动										减值准备 期末余额 人民币元
		追加投资 人民币元	减少投资 人民币元	权益法下确认的 投资收益 人民币元	其他综合收益 人民币元	其他权益变动 人民币元	宣告发放现金 股利或利润 人民币元	计提减值准备 人民币元	其他 人民币元	期末余额 人民币元		
联营企业												
南方基金管理股份有限公司	3,553,181,895.13	-	-	381,404,284.79	2,984,051.10	-	(202,461,737.99)	-	-	-	3,735,108,493.03	-
华泰柏瑞基金管理有限公司	775,773,664.89	-	-	116,366,218.92	-	-	(109,760,000.00)	-	-	-	782,379,883.81	-
华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)	201,245,141.67	-	-	15,688,888.29	-	-	(23,015,384.63)	-	-	-	193,918,645.33	-
江苏工业和信息产业投资基金(有限合伙)	313,893,470.36	-	-	7,971,302.62	-	-	-	-	-	-	321,864,772.98	-
江苏银行股份有限公司	9,841,472,630.29	1,291,455.84	-	940,050,230.27	(8,648,696.06)	(216,483,822.72)	-	-	-	-	10,557,681,797.62	-
南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)	1,642,342,409.73	-	-	(69,572,315.32)	-	-	(272,917,327.25)	-	-	-	1,299,852,767.16	-
南京华泰大健康一号股权投资合伙企业(有限合伙)	840,128,575.40	-	(80,431,655.00)	(21,018,048.93)	-	-	-	-	-	-	738,678,871.47	-
其他	1,108,405,283.45	786,000,000.00	(5,258,442.44)	(103,225,542.66)	-	-	(38,501,220.47)	-	-	-	1,747,420,077.88	-
小计	18,276,443,070.92	787,291,455.84	(85,690,097.44)	1,287,665,017.98	(5,664,644.96)	(216,483,822.72)	(646,655,670.34)	-	-	-	19,376,905,309.28	-
合营企业												
华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙)	964,719,658.34	-	(151,000,000.00)	(19,752,465.15)	-	-	(21,829,474.56)	-	-	-	772,137,718.63	-
小计	964,719,658.34	-	(151,000,000.00)	(19,752,465.15)	-	-	(21,829,474.56)	-	-	-	772,137,718.63	-
合计	19,241,162,729.26	787,291,455.84	(236,690,097.44)	1,247,912,552.83	(5,664,644.96)	(216,483,822.72)	(668,485,144.90)	-	-	-	20,149,043,027.91	-

13 投资性房地产

(1) 采用成本法计量的投资性房地产

	房屋及建筑物 人民币元
原值	
期初余额	388,132,537.52
本期增加	
- 固定资产转入	-
本期减少	
- 处置	-
- 转至固定资产	(3,721,406.71)
期末余额	<u>384,411,130.81</u>
减：累计折旧	
期初余额	(165,999,752.37)
本期计提	
- 计提折旧	(5,247,628.33)
- 固定资产转入	-
本期减少	
- 处置	-
- 转至固定资产	1,910,232.49
期末余额	<u>(169,337,148.21)</u>
减值准备	
期初余额	(4,547,017.71)
本期计提	-
本期减少	-
期末余额	<u>(4,547,017.71)</u>
账面价值	
期末	<u>210,526,964.89</u>
期初	<u>217,585,767.44</u>

(2) 未办妥产权证书的情况

于 2023 年 6 月 30 日，本集团尚未办妥产权证书的投资性房地产账面价值为人民币 4,556,964.28 元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 4,742,322.82 元)。

14 固定资产

(1) 固定资产情况

	房屋及建筑物 人民币元	运输工具 人民币元	电子设备 人民币元	办公设备 及其他设备 人民币元	合计 人民币元
原值					
期初余额	4,689,613,729.40	161,582,112.88	1,917,815,711.79	424,007,537.39	7,193,019,091.46
本期增加					
- 购置	1,567,739.65	2,839,165.55	60,536,129.07	29,054,995.42	93,998,029.69
- 投资性房地产转入	3,721,406.71	-	-	-	3,721,406.71
- 在建工程转入	-	-	444,931.45	2,853,953.72	3,298,885.17
本期减少					
- 处置或报废	-	(8,463,125.62)	(14,723,143.52)	(1,799,497.13)	(24,985,766.27)
期末余额	<u>4,694,902,875.76</u>	<u>155,958,152.81</u>	<u>1,964,073,628.79</u>	<u>454,116,989.40</u>	<u>7,269,051,646.76</u>
减：累计折旧					
期初余额	(1,202,470,927.03)	(92,247,472.80)	(945,500,377.40)	(271,130,069.74)	(2,511,348,846.97)
本期计提	(67,176,429.51)	(6,068,584.49)	(158,052,231.34)	(30,315,560.73)	(261,612,806.07)
投资性房地产转入	(1,910,232.49)	-	-	-	(1,910,232.49)
本期减少					
- 处置或报废	-	6,552,878.77	12,062,290.57	1,578,509.50	20,193,678.84
期末余额	<u>(1,271,557,589.03)</u>	<u>(91,763,178.52)</u>	<u>(1,091,490,318.17)</u>	<u>(299,867,120.97)</u>	<u>(2,754,678,206.69)</u>
账面价值					
期末	<u>3,423,345,286.73</u>	<u>64,194,974.29</u>	<u>872,583,310.62</u>	<u>154,249,868.43</u>	<u>4,514,373,440.07</u>
期初	<u>3,487,142,802.37</u>	<u>69,334,640.08</u>	<u>972,315,334.39</u>	<u>152,877,467.65</u>	<u>4,681,670,244.49</u>

于 2023 年 6 月 30 日，本集团及本公司管理层认为无需对固定资产计提减值准备 (2022 年 12 月 31 日：无)。

(2) 未办妥产权证书的固定资产情况

于 2023 年 6 月 30 日，本集团尚未办妥产权证书的固定资产账面价值为人民币 39,211,412.86 元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 40,565,218.82 元)。

(3) 暂时闲置的固定资产情况

于 2023 年 6 月 30 日，本集团无暂时闲置的固定资产 (2022 年 12 月 31 日：无)。

15 在建工程

	2023年6月30日			2022年12月31日		
	账面余额 人民币元	减值准备 人民币元	账面价值 人民币元	账面余额 人民币元	减值准备 人民币元	账面价值 人民币元
建造工程	343,745,519.25	-	343,745,519.25	139,306,810.21	-	139,306,810.21
房屋装修工程	75,882,462.27	-	75,882,462.27	56,443,502.10	-	56,443,502.10
合计	<u>419,627,981.52</u>	<u>-</u>	<u>419,627,981.52</u>	<u>195,750,312.31</u>	<u>-</u>	<u>195,750,312.31</u>

16 使用权资产

	房屋、建筑物 人民币元	其他 人民币元	合计 人民币元
原值			
期初余额	2,491,571,792.09	23,832,821.91	2,515,404,614.00
本期增加	386,276,576.85	-	386,276,576.85
本期减少	(262,205,319.12)	-	(262,205,319.12)
期末余额	<u>2,615,643,049.82</u>	<u>23,832,821.91</u>	<u>2,639,475,871.73</u>
减：累计折旧			
期初余额	(1,086,222,450.84)	(19,220,017.71)	(1,105,442,468.55)
本期计提	(306,858,049.14)	(2,306,402.10)	(309,164,451.24)
本期减少	262,125,915.96	-	262,125,915.96
期末余额	<u>(1,130,954,584.02)</u>	<u>(21,526,419.81)</u>	<u>(1,152,481,003.83)</u>
账面价值			
期末	<u>1,484,688,465.80</u>	<u>2,306,402.10</u>	<u>1,486,994,867.90</u>
期初	<u>1,405,349,341.25</u>	<u>4,612,804.20</u>	<u>1,409,962,145.45</u>

于2023年6月30日，本集团认为无需对使用权资产计提减值准备(2022年12月31日：无)。

17 无形资产

(1) 无形资产情况

	土地使用权 人民币元	交易席位费 人民币元	与现有经纪商的关系 人民币元	与现有客户的关系 人民币元	商标 人民币元	软件及其他 人民币元	合计 人民币元
原值							
期初余额	1,768,329,191.21	125,497,526.81	3,931,667,362.47	242,225,282.71	348,719,844.68	3,961,641,091.90	10,378,080,299.78
本期增加	-	-	-	-	-	240,088,510.93	240,088,510.93
处置	-	-	-	-	-	(1,400,000.00)	(1,400,000.00)
外币报表折 算差额	-	-	124,712,721.32	8,300,714.56	10,756,258.79	70,146,244.17	213,915,938.84
期末余额	1,768,329,191.21	125,497,526.81	4,056,380,083.79	250,525,997.27	359,476,103.47	4,270,475,847.00	10,830,684,749.55
减：累计摊销							
期初余额	(158,885,913.78)	(124,900,374.45)	-	-	(178,508,806.34)	(2,475,968,901.24)	(2,938,263,995.81)
本期增加	(20,316,831.61)	(4,999.98)	-	-	(22,142,172.62)	(227,367,632.27)	(269,831,636.48)
处置	-	-	-	-	-	-	-
外币报表折 算差额	-	-	-	-	(6,250,856.92)	(35,180,285.12)	(41,431,142.04)
期末余额	(179,202,745.39)	(124,905,374.43)	-	-	(206,901,835.88)	(2,738,516,818.63)	(3,249,526,774.33)
账面价值							
期末	1,589,126,445.82	592,152.38	4,056,380,083.79	250,525,997.27	152,574,267.59	1,531,959,028.37	7,581,157,975.22
期初	1,609,443,277.43	597,152.36	3,931,667,362.47	242,225,282.71	170,211,038.34	1,485,672,190.66	7,439,816,303.97

(2) 无形资产抵押或担保情况

于 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本集团均无用于抵押或担保的无形资产。

(3) 使用寿命不确定的无形资产

本集团无法预见与现有经纪商及与现有客户的关系为企业带来的经济利益期限，将该项无形资产视为使用寿命不确定的无形资产。

于 2023 年 6 月 30 日，本集团及本公司管理层认为无需对无形资产计提减值准备（2022 年 12 月 31 日：无）。

18 商誉

被投资单位名称	注	期初余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期处置 人民币元	期末余额 人民币元
华泰联合证券有限责任公司	(a)	51,089,439.80	-	-	51,089,439.80
华泰期货有限公司	(b)	252,127.50	-	-	252,127.50
AssetMark Financial Holdings, Inc.	(c)	2,087,219,435.06	86,667,437.89	-	2,173,886,872.95
Global Financial Private Capital, Inc.	(d)	184,359,006.06	7,724,435.34	-	192,083,441.40
WBI OBS Financial, Inc.	(e)	78,458,166.33	3,287,309.07	-	81,745,475.40
Voyant, Inc.	(f)	679,466,489.07	28,468,882.93	-	707,935,372.00
Adhesion Wealth Advisor Solutions, Inc.	(g)	271,374,319.86	10,635,166.35	-	282,009,486.21
小计		3,352,218,983.68	136,783,231.58	-	3,489,002,215.26
减：减值准备	(h)	-	-	-	-
账面价值		3,352,218,983.68	136,783,231.58	-	3,489,002,215.26

(a) 本集团于 2006 年收购了华泰联合证券有限责任公司 70% 的权益。合并成本超过按比例获得的华泰联合证券有限责任公司可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与华泰联合证券有限责任公司相关的商誉。

(b) 本集团于 2006 年收购了华泰期货有限公司（原名为“长城伟业期货经纪公司”）60% 的权益。合并成本超过按比例获得的华泰期货有限公司可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与华泰期货有限公司相关的商誉。

(c) 本集团于 2016 年收购了 AssetMark Financial Holdings, Inc. 98.952% 的权益。合并成本超过按比例获得的 AssetMark Financial Holdings, Inc. 可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与 AssetMark Financial Holdings, Inc. 相关的商誉。本期增加主要为外币报表折算差额的影响。

(d) 本集团子公司 AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2019 年 4 月收购了 Global Financial Private Capital, Inc. 100% 的权益，合并成本超过按比例获得的 Global Financial Private Capital, Inc. 可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与 Global Financial Private Capital, Inc. 相关的商誉，本期增加主要为外币报表折算差额的影响。

(e) 本集团子公司 AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2020 年 2 月收购了 WBI OBS Financial, Inc. 100% 的权益，合并成本超过按比例获得的 WBI OBS Financial, Inc. 可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与 WBI OBS Financial, Inc. 相关的商誉。本集团于 2021 年度对组织架构进行调整，由 AssetMark Financial Holdings, Inc. 控股子公司 AssetMark, Inc 对 WBI OBS Financial, LLC 进行同一控制下的吸收合并，相关商誉金额未发生变化。本期增加主要为外币报表折算差额的影响。

(f) 本集团子公司 AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2021 年 7 月收购了 Voyant, Inc. 100% 的权益，合并成本超过按比例获得的 Voyant, Inc. 可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与 Voyant, Inc. 相关的商誉。本期增加主要为外币报表折算差额的影响。

(g) 本集团子公司 AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2022 年 12 月收购了 Adhesion Wealth Advisor Solutions, Inc. (以下简称“Adhesion Wealth”) 100% 的权益，合并成本超过按比例获得的 Adhesion Wealth 可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与 Adhesion Wealth 相关的商誉。本期增加主要为外币报表折算差额的影响。

(h) 于 2023 年 6 月 30 日，本集团及本公司管理层认为无需对商誉计提减值准备 (2022 年 12 月 31 日：无)。

19 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产和递延所得税负债

项目	2023年6月30日		2022年12月31日	
	可抵扣暂时性 差异 / (应纳税 暂时性差异) 人民币元	递延所得税 资产 / (负债) 人民币元	可抵扣暂时性 差异 / (应纳税 暂时性差异) 人民币元 (经重述)	递延所得税 资产 / (负债) 人民币元 (经重述)
递延所得税资产:				
资产减值准备	2,863,907,979.69	716,346,745.13	3,428,490,500.45	840,594,635.62
公允价值变动	538,231,072.64	89,641,893.65	264,694,374.47	52,662,550.07
应付职工薪酬	7,078,360,577.09	1,768,305,481.72	6,947,675,691.49	1,737,046,323.66
应付利息	1,017,835,760.79	254,458,940.20	682,385,694.66	170,596,423.67
租赁负债	1,258,417,273.58	301,173,931.32	1,350,813,242.45	325,676,259.49
其他	3,133,771,174.86	649,272,164.36	1,711,459,588.92	284,070,487.89
小计	15,890,523,838.65	3,779,199,156.38	14,385,519,092.44	3,410,646,680.40
互抵金额	(14,650,818,054.40)	(2,992,129,161.52)	(13,040,381,310.33)	(2,810,173,675.57)
互抵后的金额	1,239,705,784.25	787,069,994.86	1,345,137,782.11	600,473,004.83
递延所得税负债:				
公允价值变动	(4,176,568,540.70)	(1,044,151,135.24)	(2,605,510,419.42)	(651,377,604.86)
应收利息	(4,364,040,737.04)	(1,091,010,184.26)	(4,407,603,887.21)	(1,101,900,971.80)
于收购中确认的无形资产	(5,202,525,931.62)	(1,266,955,849.08)	(5,094,001,454.42)	(1,267,508,299.03)
私募投资基金享有的应纳税收益	(2,520,494,756.72)	(630,123,689.18)	(3,175,521,247.42)	(793,880,311.85)
使用权资产	(1,190,947,848.95)	(295,434,249.78)	(1,275,464,015.50)	(317,775,225.03)
其他	(4,420,000,749.52)	(1,122,814,958.96)	(3,517,634,270.33)	(877,659,429.60)
小计	(21,874,578,564.55)	(5,450,490,066.50)	(20,075,735,294.30)	(5,010,101,842.17)
互抵金额	14,650,818,054.40	2,992,129,161.52	13,040,381,310.33	2,810,173,675.57
互抵后的金额	(7,223,760,510.15)	(2,458,360,904.98)	(7,035,353,983.97)	(2,199,928,166.60)

(2) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

项目	2023年6月30日		2022年12月31日	
	递延所得税资产 和负债互抵金额 人民币元	抵销后递延所得税 资产或负债余额 人民币元	递延所得税资产 和负债互抵金额 人民币元 (经重述)	抵销后递延所得税 资产或负债余额 人民币元 (经重述)
递延所得税资产	(2,992,129,161.52)	787,069,994.86	(2,810,173,675.57)	600,473,004.83
递延所得税负债	2,992,129,161.52	(2,458,360,904.98)	2,810,173,675.57	(2,199,928,166.60)

(3) 未确认递延所得税资产明细

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
可抵扣亏损	975,713,135.85	978,151,364.61

(4) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的到期情况

年份	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
2023年	15,952,027.44	15,952,027.44
2024年	15,306,080.53	15,306,080.53
2025年	-	-
2026年	3,755,565.13	3,755,565.13
2027年及以后年度	940,699,462.75	943,137,691.51
合计	975,713,135.85	978,151,364.61

20 其他资产

(1) 其他资产按类别分析如下

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
预付款项	732,422,098.65	609,055,368.08
其他应收款	317,475,189.05	549,635,374.42
长期待摊费用	271,385,707.60	300,664,295.57
应收利息	82,502,479.37	82,063,087.53
待抵扣增值税	53,781,288.56	57,656,888.58
抵债资产	35,303,191.52	35,303,191.52
应收股利	19,209,763.30	11,326,108.80
待摊费用	12,044,800.63	31,150,417.98
其他	713,940,577.84	781,339,542.71
合计	2,238,065,096.52	2,458,194,275.19

(2) 其他应收款

(a) 其他应收款按类别分析如下

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
其他应收款余额	1,096,872,162.17	1,313,373,548.09
减：坏账准备	(779,396,973.12)	(763,738,173.67)
其他应收款净值	<u>317,475,189.05</u>	<u>549,635,374.42</u>

(b) 其他应收款按账龄分析如下

2023年6月30日				
	账面余额		坏账准备	
	金额 人民币元	比例 %	金额 人民币元	比例 %
1年以内	145,261,128.51	13.25	19,468,763.95	2.50
1至2年(含2年)	135,582,725.26	12.36	44,027,955.60	5.65
2至3年(含3年)	60,584,993.36	5.52	26,679,749.46	3.42
3年以上	755,443,315.04	68.87	689,220,504.11	88.43
合计	<u>1,096,872,162.17</u>	<u>100.00</u>	<u>779,396,973.12</u>	<u>100.00</u>

2022年12月31日				
	账面余额		坏账准备	
	金额 人民币元	比例 %	金额 人民币元	比例 %
1年以内	417,368,848.42	31.78	19,332,071.67	2.53
1至2年(含2年)	131,947,772.15	10.05	46,931,470.43	6.14
2至3年(含3年)	29,914,432.23	2.28	23,479,548.82	3.07
3年以上	734,142,495.29	55.89	673,995,082.75	88.26
合计	<u>1,313,373,548.09</u>	<u>100.00</u>	<u>763,738,173.67</u>	<u>100.00</u>

账龄自其他应收款确认日起开始计算。

(c) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况:

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间其他应收款坏账准备的变动情况参见附注五、21。

(d) 按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款项情况

单位名称	性质	金额 人民币元	账龄	占其他应收款 总额的比例 %
美橙二十八号证券型私募基金	应收债权	146,194,316.52	3 年以上	13.33
四通集团公司	占用原受托管理营业部资金	111,295,900.10	3 年以上	10.15
保定天威英利新能源有限公司	应收债权	62,365,027.00	3 年以上	5.69
刘伟	应收股票质押式逆回购解质押还款	58,489,729.15	3 年以上	5.32
四川圣达集团	应收债权	42,905,013.33	3 年以上	3.91
合计		421,249,986.10		38.40

(e) 截至 2023 年 6 月 30 日, 其他应收款项余额中无持本公司 5% 以上 (含 5%) 表决权股份的股东单位欠款。

(3) 长期待摊费用

	期初余额 人民币元	本期购入 人民币元	在建工程转入 人民币元	本期摊销 人民币元	其他减少 人民币元	期末余额 人民币元
租赁资产改良支出	249,451,856.67	8,563,780.70	31,474,898.15	(56,367,709.40)	(1,443,721.04)	231,679,105.08
其他	51,212,438.90	-	-	(11,505,836.38)	-	39,706,602.52
合计	300,664,295.57	8,563,780.70	31,474,898.15	(67,873,545.78)	(1,443,721.04)	271,385,707.60

21 资产减值准备

(1) 各项减值准备的变动情况：

	期初余额 人民币元	本期计提/(转回) 人民币元	本期核销/转销 人民币元	其他变动 人民币元	期末余额 人民币元
货币资金减值准备	832,617.78	(420,332.08)	-	-	412,285.70
融出资金减值准备	1,526,356,209.30	(21,743,934.35)	-	2,022,192.19	1,506,634,467.14
买入返售金融资产减值准备	1,138,412,700.39	(468,975,952.44)	-	3,147,358.72	672,584,106.67
应收款项坏账准备	68,530,562.66	6,181,862.61	-	1,031,246.95	75,743,672.22
债权投资金融资产减值准备	5,131,507.79	7,085.08	-	-	5,138,592.87
其他债权投资金融资产减值准备	30,454,858.53	44,048,756.63	(211,867.86)	242,990.93	74,534,738.23
其他应收款坏账准备	763,738,173.67	15,658,799.45	-	-	779,396,973.12
应收利息坏账准备	38,175,368.60	7,232,118.15	-	-	45,407,486.75
金融工具信用减值准备小计	<u>3,571,631,998.72</u>	<u>(418,011,596.95)</u>	<u>(211,867.86)</u>	<u>6,443,788.79</u>	<u>3,159,852,322.70</u>
抵债资产减值准备	26,112,930.76	-	-	-	26,112,930.76
投资性房地产减值准备	4,547,017.71	-	-	-	4,547,017.71
其他资产减值准备小计	<u>30,659,948.47</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>30,659,948.47</u>
合计	<u>3,602,291,947.19</u>	<u>(418,011,596.95)</u>	<u>(211,867.86)</u>	<u>6,443,788.79</u>	<u>3,190,512,271.17</u>

(2) 按阶段划分的预期信用损失减值准备：

	2023年6月30日				合计 人民币元
	未来12个月 预期信用损失 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值) 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值) 人民币元		
货币资金减值准备	412,285.70	-	-		412,285.70
融出资金减值准备	507,341,153.90	862,732,172.47	136,561,140.77		1,506,634,467.14
买入返售金融资产减值准备	22,139,621.64	-	650,444,485.03		672,584,106.67
应收款项坏账准备	-	73,943,672.22	1,800,000.00		75,743,672.22
债权投资金融资产减值准备	5,138,592.87	-	-		5,138,592.87
其他债权投资金融资产减值准备	63,317,462.17	11,217,276.06	-		74,534,738.23
其他应收款坏账准备	1,603,354.16	43,505,367.96	734,288,251.00		779,396,973.12
应收利息坏账准备	-	-	45,407,486.75		45,407,486.75
合计	<u>599,952,470.44</u>	<u>991,398,488.71</u>	<u>1,568,501,363.55</u>		<u>3,159,852,322.70</u>

2022 年 12 月 31 日

	未来 12 个月 预期信用损失 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值) 人民币元	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值) 人民币元	合计 人民币元
货币资金减值准备	832,617.78	-	-	832,617.78
融出资金减值准备	653,659,616.04	745,959,954.66	126,736,638.60	1,526,356,209.30
买入返售金融资产减值准备	28,128,119.43	-	1,110,284,580.96	1,138,412,700.39
应收款项坏账准备	-	66,130,562.66	2,400,000.00	68,530,562.66
债权投资金融资产减值准备	5,131,507.79	-	-	5,131,507.79
其他债权投资金融资产减值准备	30,454,858.53	-	-	30,454,858.53
其他应收款坏账准备	1,223,630.77	25,062,024.73	737,452,518.17	763,738,173.67
应收利息坏账准备	-	-	38,175,368.60	38,175,368.60
合计	<u>719,430,350.34</u>	<u>837,152,542.05</u>	<u>2,015,049,106.33</u>	<u>3,571,631,998.72</u>

22 短期借款

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
信用借款	12,465,832,429.41	7,711,587,879.84
质押借款	1,198,574,247.00	285,846,489.60
合计	<u>13,664,406,676.41</u>	<u>7,997,434,369.44</u>

23 应付短期融资款

类型	项目	面值	起息日期	期限	发行金额	票面利率
		原币			原币	
公司债	22 华泰 F1	人民币 4,000,000,000.00	17/1/2022	365+365 天	人民币 4,000,000,000.00	2.75%
短期公司债	22 华泰 S2	人民币 5,000,000,000.00	19/8/2022	182 天	人民币 5,000,000,000.00	1.78%
短期公司债	23 华泰 S1	人民币 5,000,000,000.00	17/3/2023	182 天	人民币 5,000,000,000.00	2.65%
短期公司债	23 华泰 S2	人民币 5,000,000,000.00	23/3/2023	95 天	人民币 5,000,000,000.00	2.65%
境外债	HUATAI B2302b	港币 300,000,000.00	13/5/2022	276 天	港币 300,000,000.00	2.15%
境外债	HUATAI B2302d	美元 18,000,000.00	14/11/2022	92 天	美元 18,000,000.00	5.75%
境外债	HUATAI B2302e	港币 300,000,000.00	14/11/2022	92 天	港币 300,000,000.00	5.75%
境外债	HUATAI B2302f	美元 10,700,000.00	16/11/2022	92 天	美元 10,700,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302g	港币 496,000,000.00	16/11/2022	92 天	港币 496,000,000.00	5.50%
境外债	HUATAI B2302h	美元 5,499,000.00	18/11/2022	91 天	美元 5,499,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302i	港币 23,390,000.00	18/11/2022	91 天	港币 23,390,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302j	港币 150,000,000.00	22/11/2022	92 天	港币 150,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302k	美元 8,580,000.00	25/11/2022	91 天	美元 8,580,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302l	美元 100,000,000.00	29/11/2022	90 天	美元 100,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302m	美元 50,000,000.00	29/11/2022	90 天	美元 50,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2302a	美元 50,000,000.00	27/5/2022	277 天	美元 50,000,000.00	2.81%
境外债	HUATAI B2303a	美元 4,839,000.00	1/12/2022	90 天	美元 4,839,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2303b	港币 14,000,000.00	1/12/2022	90 天	港币 14,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2303c	美元 10,000,000.00	6/12/2022	87 天	美元 10,000,000.00	5.70%
境外债	HUATAI B2304a	美元 100,000,000.00	7/4/2022	364 天	美元 100,000,000.00	1.50%
境外债	HUATAI B2304b	美元 100,000,000.00	7/4/2022	364 天	美元 100,000,000.00	1.50%
境外债	HUATAI B2304c	美元 100,000,000.00	7/4/2022	364 天	美元 100,000,000.00	1.50%
境外债	HUATAI B2304d	美元 30,000,000.00	13/1/2023	90 天	美元 30,000,000.00	5.00%
境外债	HUATAI B2304e	港币 62,000,000.00	13/1/2023	90 天	港币 62,000,000.00	5.34%
境外债	HUATAI B2304f	美元 20,000,000.00	17/1/2023	90 天	美元 20,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2304g	美元 20,000,000.00	17/1/2023	91 天	美元 20,000,000.00	5.25%
境外债	HUATAI B2305b	美元 6,600,000.00	10/2/2023	89 天	美元 6,600,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2305c	美元 13,350,000.00	17/2/2023	89 天	美元 13,350,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2305d	美元 15,000,000.00	21/2/2023	91 天	美元 15,000,000.00	5.28%
境外债	HUATAI B2305e	港币 200,000,000.00	21/2/2023	91 天	港币 200,000,000.00	3.82%
境外债	HUATAI B2305a	美元 50,000,000.00	27/5/2022	363 天	美元 50,000,000.00	2.85%
境外债	HUATAI B2306	美元 100,000,000.00	10/6/2022	363 天	美元 100,000,000.00	2.86%
境外债	HUATAI B2306a	美元 11,820,000.00	8/3/2023	92 天	美元 11,820,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2306d	美元 20,000,000.00	10/3/2023	91 天	美元 20,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2306b	美元 62,000,000.00	15/12/2022	182 天	美元 62,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2306c	美元 32,300,000.00	29/12/2022	182 天	美元 32,300,000.00	5.60%
境外债	HUATAI B2307a	美元 10,000,000.00	8/5/2023	60 天	美元 10,000,000.00	5.55%
境外债	HUATAI B2307b	美元 40,000,000.00	10/5/2023	62 天	美元 40,000,000.00	5.55%
境外债	HUATAI B2307c	美元 12,500,000.00	16/5/2023	59 天	美元 12,500,000.00	5.55%
境外债	HUATAI B2307d	美元 20,000,000.00	17/1/2023	182 天	美元 20,000,000.00	5.00%
境外债	HUATAI B2307e	港币 200,000,000.00	17/1/2023	182 天	港币 200,000,000.00	5.14%
境外债	HUATAI B2307f	美元 17,000,000.00	19/4/2023	91 天	美元 17,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2307g	美元 6,300,000.00	20/4/2023	91 天	美元 6,300,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2307h	美元 18,000,000.00	20/4/2023	91 天	美元 18,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2307i	美元 20,000,000.00	24/4/2023	88 天	美元 20,000,000.00	5.55%
境外债	HUATAI B2307j	美元 25,427,000.00	19/5/2023	63 天	美元 25,427,000.00	5.00%

类型	项目	面值	起息日期	期限	发行金额	票面利率
		原币			原币	
境外债	HUATAI B2307k	港币 100,000,000.00	29/5/2023	60 天	港币 100,000,000.00	4.85%
境外债	HUATAI B2307l	美元 15,000,000.00	29/5/2023	60 天	美元 15,000,000.00	5.73%
境外债	HUATAI B2308a	美元 10,000,000.00	6/2/2023	179 天	美元 10,000,000.00	5.50%
境外债	HUATAI B2308b	美元 47,000,000.00	6/2/2023	182 天	美元 47,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2308c	美元 20,000,000.00	8/2/2023	181 天	美元 20,000,000.00	5.55%
境外债	HUATAI B2308	美元 15,000,000.00	10/8/2022	364 天	美元 15,000,000.00	3.00%
境外债	HUATAI B2308d	美元 100,000,000.00	9/2/2023	181 天	美元 100,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2308e	美元 15,000,000.00	10/2/2023	181 天	美元 15,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2308f	美元 50,000,000.00	22/2/2023	174 天	美元 50,000,000.00	5.00%
境外债	HUATAI B2308g	港币 250,000,000.00	14/6/2023	62 天	港币 250,000,000.00	4.65%
境外债	HUATAI B2308h	美元 30,000,000.00	17/2/2023	181 天	美元 30,000,000.00	5.46%
境外债	HUATAI B2308i	美元 100,000,000.00	21/2/2023	178 天	美元 100,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2309a	美元 15,000,000.00	6/6/2023	92 天	美元 15,000,000.00	5.88%
境外债	HUATAI B2309b	美元 100,000,000.00	10/3/2023	186 天	美元 100,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2309c	美元 26,300,000.00	15/6/2023	92 天	美元 26,300,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2309d	美元 10,000,000.00	27/6/2023	92 天	美元 10,000,000.00	5.50%
境外债	HUATAI B2310	美元 50,000,000.00	19/1/2023	273 天	美元 50,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2311a	港币 51,000,000.00	2/5/2023	184 天	港币 51,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2311b	美元 20,000,000.00	9/5/2023	184 天	美元 20,000,000.00	5.55%
境外债	HUATAI B2311c	美元 10,000,000.00	16/5/2023	184 天	美元 10,000,000.00	5.66%
境外债	HUATAI B2311d	美元 5,150,000.00	19/5/2023	182 天	美元 5,150,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2311	美元 40,000,000.00	23/11/2022	364 天	美元 40,000,000.00	6.05%
境外债	HUATAI B2311f	美元 39,000,000.00	23/6/2023	152 天	美元 39,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2311g	港币 200,000,000.00	23/5/2023	185 天	港币 200,000,000.00	4.70%
境外债	HUATAI B2311h	美元 10,500,000.00	26/6/2023	154 天	美元 10,500,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2311i	美元 25,500,000.00	30/6/2023	153 天	美元 25,500,000.00	5.50%
境外债	HUATAI B2312	人民币 440,000,000.00	13/12/2022	364 天	人民币 440,000,000.00	3.49%
境外债	HUATAI B2312a	美元 60,000,000.00	17/1/2023	339 天	美元 60,000,000.00	5.00%
境外债	HUATAI B2401a	美元 25,800,000.00	13/1/2023	364 天	美元 25,800,000.00	5.00%
境外债	HUATAI B2401b	美元 20,000,000.00	19/1/2023	365 天	美元 20,000,000.00	5.75%
境外债	HUATAI B2402a	美元 15,000,000.00	3/2/2023	364 天	美元 15,000,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2402b	美元 20,600,000.00	6/2/2023	364 天	美元 20,600,000.00	0.00%
境外债	HUATAI B2403a	美元 30,000,000.00	27/3/2023	366 天	美元 30,000,000.00	5.60%
境外债	HUATAI B2405b	港币 475,000,000.00	5/5/2023	364 天	港币 475,000,000.00	4.60%
境外债	HUATAI B2406c	美元 50,000,000.00	13/6/2023	366 天	美元 50,000,000.00	5.95%
收益凭证	收益凭证(注1)	人民币 9,236,198,748.00	注(1)	注(1)	人民币 9,236,198,748.00	注(1)

类型	项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
		等值人民币	等值人民币	等值人民币	等值人民币
公司债	22 华泰 F1	4,105,268,817.20	-	(4,105,268,817.20)	-
短期公司债	22 华泰 S2	5,032,776,881.76	7,416,666.63	(5,040,193,548.39)	-
短期公司债	23 华泰 S1	-	5,038,467,741.94	-	5,038,467,741.94
短期公司债	23 华泰 S2	-	5,036,330,645.16	-	5,036,330,645.16
境外债	HUATAI B2302b	271,620,854.01	175,572.62	(271,796,426.63)	-
境外债	HUATAI B2302d	126,320,992.86	556,607.64	(126,877,600.50)	-
境外债	HUATAI B2302e	269,950,000.68	1,433,325.39	(271,383,326.07)	-
境外债	HUATAI B2302f	74,030,180.64	-	(74,030,180.64)	-
境外债	HUATAI B2302g	445,901,704.69	2,541,468.36	(448,443,173.05)	-
境外债	HUATAI B2302h	38,131,918.50	-	(38,131,918.50)	-
境外债	HUATAI B2302i	20,748,911.39	-	(20,748,911.39)	-
境外债	HUATAI B2302j	132,877,699.29	-	(132,877,699.29)	-
境外债	HUATAI B2302k	59,279,353.26	-	(59,279,353.26)	-
境外债	HUATAI B2302l	690,163,104.43	-	(690,163,104.43)	-
境外债	HUATAI B2302m	345,081,552.22	-	(345,081,552.22)	-
境外债	HUATAI B2302a	354,203,472.29	2,356,479.52	(356,559,951.81)	-
境外债	HUATAI B2303a	33,398,213.09	-	(33,398,213.09)	-
境外债	HUATAI B2303b	12,390,307.97	-	(12,390,307.97)	-
境外债	HUATAI B2303c	69,931,149.33	641,142.47	(70,572,291.80)	-
境外债	HUATAI B2304a	697,584,513.33	3,953,840.86	(701,538,354.19)	-
境外债	HUATAI B2304b	697,584,513.33	3,953,840.86	(701,538,354.19)	-
境外债	HUATAI B2304c	697,584,513.33	3,953,840.86	(701,538,354.19)	-
境外债	HUATAI B2304d	-	216,488,610.23	(216,488,610.23)	-
境外债	HUATAI B2304e	-	57,162,771.92	(57,162,771.92)	-
境外债	HUATAI B2304f	-	142,527,104.04	(142,527,104.04)	-
境外债	HUATAI B2304g	-	144,468,764.23	(144,468,764.23)	-
境外债	HUATAI B2305b	-	47,062,874.78	(47,062,874.78)	-
境外债	HUATAI B2305c	-	95,228,262.29	(95,228,262.29)	-
境外债	HUATAI B2305d	-	108,351,573.17	(108,351,573.17)	-
境外债	HUATAI B2305e	-	184,396,038.44	(184,396,038.44)	-
境外债	HUATAI B2305a	354,024,685.05	3,523,369.39	(357,548,054.44)	-
境外债	HUATAI B2306	707,320,634.79	8,781,471.84	(716,102,106.63)	-
境外债	HUATAI B2306a	-	84,264,534.85	(84,264,534.85)	-
境外债	HUATAI B2306d	-	142,487,788.17	(142,487,788.17)	-
境外债	HUATAI B2306b	420,182,474.34	-	(420,182,474.34)	-
境外债	HUATAI B2306c	225,057,034.62	5,253,511.98	(230,310,546.60)	-
境外债	HUATAI B2307a	-	72,794,258.77	-	72,794,258.77
境外债	HUATAI B2307b	-	190,103,851.47	-	190,103,851.47
境外债	HUATAI B2307c	-	90,885,017.50	-	90,885,017.50
境外债	HUATAI B2307d	-	147,730,102.22	-	147,730,102.22
境外债	HUATAI B2307e	-	188,634,791.15	-	188,634,791.15
境外债	HUATAI B2307f	-	122,468,653.03	-	122,468,653.03
境外债	HUATAI B2307g	-	45,383,713.51	-	45,383,713.51
境外债	HUATAI B2307h	-	129,651,761.21	-	129,651,761.21
境外债	HUATAI B2307i	-	145,945,686.97	-	145,945,686.97
境外债	HUATAI B2307j	-	184,509,463.90	-	184,509,463.90
境外债	HUATAI B2307k	-	92,595,495.12	-	92,595,495.12

类型	项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
		等值人民币	等值人民币	等值人民币	等值人民币
境外债	HUATAI B2307I	-	108,903,443.85	-	108,903,443.85
境外债	HUATAI B2308a	-	73,820,644.14	-	73,820,644.14
境外债	HUATAI B2308b	-	337,826,989.68	-	337,826,989.68
境外债	HUATAI B2308c	-	147,631,426.26	-	147,631,426.26
境外债	HUATAI B2308	105,092,206.26	6,084,090.48	-	111,176,296.74
境外债	HUATAI B2308d	-	718,581,851.36	-	718,581,851.36
境外债	HUATAI B2308e	-	107,770,304.52	-	107,770,304.52
境外债	HUATAI B2308f	-	367,378,543.09	-	367,378,543.09
境外债	HUATAI B2308g	-	230,893,036.16	-	230,893,036.16
境外债	HUATAI B2308h	-	221,071,821.95	-	221,071,821.95
境外债	HUATAI B2308i	-	717,560,505.27	-	717,560,505.27
境外债	HUATAI B2309a	-	108,776,311.34	-	108,776,311.34
境外债	HUATAI B2309b	-	714,625,145.23	-	714,625,145.23
境外债	HUATAI B2309c	-	183,540,849.91	-	183,540,849.91
境外债	HUATAI B2309d	-	72,174,768.19	-	72,174,768.19
境外债	HUATAI B2310	-	355,420,623.61	-	355,420,623.61
境外债	HUATAI B2311a	-	46,061,991.54	-	46,061,991.54
境外债	HUATAI B2311b	-	145,437,668.08	-	145,437,668.08
境外债	HUATAI B2311c	-	72,745,440.37	-	72,745,440.37
境外债	HUATAI B2311d	-	36,222,811.45	-	36,222,811.45
境外债	HUATAI B2311	279,816,720.18	19,497,543.21	-	299,314,263.39
境外债	HUATAI B2311f	-	274,617,963.05	-	274,617,963.05
境外债	HUATAI B2311g	-	185,310,847.67	-	185,310,847.67
境外债	HUATAI B2311h	-	72,509,264.42	-	72,509,264.42
境外债	HUATAI B2311i	-	183,748,205.81	-	183,748,205.81
境外债	HUATAI B2312	440,603,987.35	7,785,362.14	-	448,389,349.49
境外债	HUATAI B2312a	-	441,527,773.44	-	441,527,773.44
境外债	HUATAI B2401a	-	189,907,468.42	-	189,907,468.42
境外债	HUATAI B2401b	-	148,206,893.51	-	148,206,893.51
境外债	HUATAI B2402a	-	104,944,972.05	-	104,944,972.05
境外债	HUATAI B2402b	-	144,056,498.73	-	144,056,498.73
境外债	HUATAI B2403a	-	219,746,952.75	-	219,746,952.75
境外债	HUATAI B2405b	-	438,568,668.75	-	438,568,668.75
境外债	HUATAI B2406c	-	362,013,662.28	-	362,013,662.28
收益凭证	收益凭证(注1)	9,065,677,407.64	920,476,766.74	(3,099,788,647.12)	6,886,365,527.26
		<u>25,772,603,803.83</u>	<u>21,237,927,751.94</u>	<u>(20,248,181,590.06)</u>	<u>26,762,349,965.71</u>

注 1: 本公司于本期共发行 91 期期限小于一年的收益凭证, 其中未到期收益凭证的固定收益率为 1.80%-6.58%。

24 拆入资金

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
银行拆入资金	34,017,697,210.38	25,877,713,063.31
转融通拆入资金	672,366,497.22	-
合计	<u>34,690,063,707.60</u>	<u>25,877,713,063.31</u>

截至2023年6月30日, 本集团向银行的拆入资金未设有担保, 年利率1.21% - 5.90% (2022年12月31日: 年利率1.96% - 5.51%)。

25 交易性金融负债

(1) 按项目列示

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
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	28,432,869,371.23	36,507,296,617.90
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	14,289,554,316.01	12,068,262,342.02
合计	<u>42,722,423,687.24</u>	<u>48,575,558,959.92</u>

(2) 按类别列示

	2023年6月30日		
	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 人民币元	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 人民币元	公允价值合计 人民币元
股票	774,131,162.56	-	774,131,162.56
债务工具(注1)	27,658,738,208.67	2,012,098,066.42	29,670,836,275.09
收益凭证(注2)		8,504,022,244.88	8,504,022,244.88
其他(注3)		3,773,434,004.71	3,773,434,004.71
合计	<u>28,432,869,371.23</u>	<u>14,289,554,316.01</u>	<u>42,722,423,687.24</u>

	2022年12月31日		
	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 人民币元	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 人民币元	公允价值合计 人民币元
股票	1,275,846,105.55	-	1,275,846,105.55
债务工具(注1)	35,231,450,512.35	1,996,183,485.61	37,227,633,997.96
收益凭证(注2)	-	6,217,290,082.59	6,217,290,082.59
其他(注3)	-	3,854,788,773.82	3,854,788,773.82
合计	<u>36,507,296,617.90</u>	<u>12,068,262,342.02</u>	<u>48,575,558,959.92</u>

注 1：本集团将一笔本集团发行的债券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以减少会计错配。

注 2：本集团将嵌入衍生工具与收益凭证主合同整体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 3：主要为资产管理计划其他份额持有人或私募基金其他有限合伙人在合并结构化主体中享有的权益。

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因企业自身信用风险变动而引起的公允价值变动金额不重大。

26 卖出回购金融资产款

(1) 按金融资产种类

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
债券	129,844,935,421.55	128,090,388,462.94
股票	16,119,947,696.90	11,960,615,825.31
贵金属	-	4,066,994,176.56
合计	<u>145,964,883,118.45</u>	<u>144,117,998,464.81</u>

(2) 按业务类别列示

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
质押式回购	128,495,033,085.21	125,350,763,511.58
质押式报价回购	13,774,926,641.54	10,525,993,781.21
买断式回购	3,694,923,391.70	4,174,246,995.46
贵金属	-	4,066,994,176.56
合计	<u>145,964,883,118.45</u>	<u>144,117,998,464.81</u>

(3) 担保物信息

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
债券	156,716,715,454.68	146,793,399,690.17
股票	19,029,108,007.03	13,810,218,296.00
贵金属	-	4,104,900,000.00
合计	<u>175,745,823,461.71</u>	<u>164,708,517,986.17</u>

(4) 交易所质押式报价回购剩余期限分析

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
1个月内	5,049,081,529.67	4,106,618,577.13
1个月至3个月	3,450,011,065.26	2,323,331,771.32
3个月至1年	5,275,834,046.61	4,096,043,432.76
合计	13,774,926,641.54	10,525,993,781.21

于2023年6月30日，交易所质押式报价回购利率区间为1.90%–8.18% (2022年12月31日：1.90%–8.18%)。

27 代理买卖证券款

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
普通经纪业务		
其中：个人	80,989,795,630.42	78,460,180,474.44
机构	61,120,139,428.89	54,712,899,066.97
小计	142,109,935,059.31	133,173,079,541.41
信用业务		
其中：个人	12,563,595,968.25	12,991,655,229.49
机构	4,680,783,268.65	6,386,988,463.55
小计	17,244,379,236.90	19,378,643,693.04
合计	159,354,314,296.21	152,551,723,234.45

28 代理承销证券款

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
股票	162,667,556.91	145,103,086.80
债券	10,783,649.58	5,357,400.00
其中：中期票据	10,783,649.58	5,357,400.00
合计	173,451,206.49	150,460,486.80

29 应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示：

	附注	期初余额 人民币元	本期增加额 人民币元	本期减少额 人民币元	期末余额 人民币元
短期薪酬及长期薪金	五、29(2)	11,405,262,076.94	4,275,079,177.84	(5,752,856,742.33)	9,927,484,512.45
离职后福利 - 设定提存计划	五、29(3)	487,362,945.67	556,296,905.12	(375,959,204.36)	667,700,646.43
合计		<u>11,892,625,022.61</u>	<u>4,831,376,082.96</u>	<u>(6,128,815,946.69)</u>	<u>10,595,185,158.88</u>

(2) 短期薪酬及长期薪金

		期初余额 人民币元	本期增加额 人民币元	本期减少额 人民币元	期末余额 人民币元
工资、奖金、津贴和补贴		11,343,869,314.77	3,821,186,052.72	(5,274,092,028.97)	9,890,963,338.52
职工福利费		13,639.42	81,415,484.37	(81,412,008.05)	17,115.74
社会保险费		3,802,902.17	157,375,827.59	(156,849,376.80)	4,329,352.96
其中：医疗保险费		3,749,704.29	149,324,484.37	(148,885,336.50)	4,188,852.16
工伤保险费		35,181.92	2,778,526.27	(2,782,095.13)	31,613.06
生育保险费		18,015.96	5,272,816.95	(5,181,945.17)	108,887.74
住房公积金		233,059.30	184,641,456.27	(184,638,507.21)	236,008.36
工会经费和职工教育经费		57,343,161.28	30,460,356.89	(55,864,821.30)	31,938,696.87
合计		<u>11,405,262,076.94</u>	<u>4,275,079,177.84</u>	<u>(5,752,856,742.33)</u>	<u>9,927,484,512.45</u>

于 2023 年 6 月 30 日，工资、奖金、津贴和补贴项目中包含的长期薪金余额为人民币 6,795,933,850.20 元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 6,588,447,675.83 元)。

(3) 离职后福利 - 设定提存计划

		期初余额 人民币元	本期增加额 人民币元	本期减少额 人民币元	期末余额 人民币元
基本养老保险费		4,250,734.86	351,321,854.57	(350,583,997.97)	4,988,591.46
失业保险费		111,449.00	7,092,511.95	(7,060,815.27)	143,145.68
企业年金缴费		483,000,761.81	197,882,538.60	(18,314,391.12)	662,568,909.29
合计		<u>487,362,945.67</u>	<u>556,296,905.12</u>	<u>(375,959,204.36)</u>	<u>667,700,646.43</u>

30 应交税费

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
企业所得税	667,726,859.56	524,996,864.86
个人所得税	317,515,862.34	333,462,236.73
增值税	82,808,432.71	117,612,021.10
教育费附加	4,044,639.07	5,151,833.54
房产税	5,987,939.85	6,810,486.48
城建税	5,769,532.02	6,655,217.12
其他	4,513,367.64	4,770,887.58
合计	<u>1,088,366,633.19</u>	<u>999,459,547.41</u>

31 应付款项

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
应付交易款项	99,432,885,030.02	92,616,100,636.78
应付清算款	5,907,237,444.36	6,765,938,094.32
开放式基金申、认购款	7,190,757,863.01	5,359,598,598.51
应付手续费及佣金	74,675,402.82	120,537,435.51
应付赎回款	16,585.94	142,217.32
其他	116,809,585.85	435,323,249.08
合计	<u>112,722,381,912.00</u>	<u>105,297,640,231.52</u>

32 合同负债

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
手续费及佣金预收款	259,110,279.73	210,393,885.44
销售货物预收款	17,566,818.44	8,548,697.98
合计	<u>276,677,098.17</u>	<u>218,942,583.42</u>

33 长期借款

(1) 长期借款分类

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
信用借款	657,557,638.84	804,902,959.53

(2) 长期借款明细

贷款单位	借款起始日	借款终止日	币种	利率	2023年6月30日 原币	2023年6月30日 等值人民币
Bank of Montreal	2022年1月13日	2027年1月12日	美元	SOFR+ 溢价	91,001,361.63	657,557,638.84

34 应付债券

(1) 应付债券

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
公司债	104,311,497,007.48	100,165,374,016.57
次级债	14,307,364,391.91	14,396,641,254.09
境外债	20,444,684,850.27	22,616,729,766.75
收益凭证	3,580,288,401.32	2,240,592,816.34
合计	142,643,834,650.98	139,419,337,853.75

(2) 应付债券的明细

类型	项目	面值		起息日期	期限	发行金额		票面利率	期初余额		本期增加	本期减少		期末余额	
		原币	原币			原币	原币		等值人民币	等值人民币		等值人民币	等值人民币		
公司债	13 华泰 02	人民币 6,000,000,000.00	人民币 6,000,000,000.00	2013/6/5	10 年	人民币 6,000,000,000.00	人民币 6,000,000,000.00	5.10%	6,177,781,994.68	128,140,962.32	(6,305,922,957.00)	-	-	-	-
公司债	18 华泰 G2	人民币 1,000,000,000.00	人民币 1,000,000,000.00	2018/11/26	5 年	人民币 1,000,000,000.00	人民币 1,000,000,000.00	4.17%	1,003,868,599.88	20,951,218.22	(8,222,930,523.55)	-	-	1,024,819,818.10	-
公司债	20 华泰 G1	人民币 8,000,000,000.00	人民币 8,000,000,000.00	2020/3/26	3 年	人民币 8,000,000,000.00	人民币 8,000,000,000.00	2.99%	8,182,655,746.34	40,274,777.21	(101,500,000.00)	-	-	3,516,231,693.43	-
公司债	20 华泰 G3	人民币 3,500,000,000.00	人民币 3,500,000,000.00	2020/4/29	5 年	人民币 3,500,000,000.00	人民币 3,500,000,000.00	2.90%	3,566,651,895.85	51,079,797.58	(96,000,000.00)	-	-	3,009,728,363.90	-
公司债	20 华泰 G4	人民币 3,000,000,000.00	人民币 3,000,000,000.00	2020/5/21	5 年	人民币 3,000,000,000.00	人民币 3,000,000,000.00	3.20%	3,057,446,953.45	48,281,410.45	(3,293,092,630.61)	-	-	-	-
公司债	20 华泰 G6	人民币 3,200,000,000.00	人民币 3,200,000,000.00	2020/6/18	3 年	人民币 3,200,000,000.00	人民币 3,200,000,000.00	3.10%	3,251,652,768.48	41,439,862.13	-	-	-	3,582,128,654.79	-
公司债	20 华泰 G7	人民币 3,500,000,000.00	人民币 3,500,000,000.00	2020/11/24	3 年	人民币 3,500,000,000.00	人民币 3,500,000,000.00	3.90%	3,513,689,994.44	68,438,660.35	-	-	-	4,085,055,866.09	-
公司债	20 华泰 G9	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2020/12/9	3 年	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	3.79%	4,009,121,247.80	75,934,618.29	(143,200,000.00)	-	-	4,063,549,380.11	-
公司债	21 华泰 G1	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2021/1/20	3 年	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	3.58%	4,134,486,869.04	72,262,511.07	(171,000,000.00)	-	-	5,029,510,076.51	-
公司债	21 华泰 G3	人民币 5,000,000,000.00	人民币 5,000,000,000.00	2021/4/26	3 年	人民币 5,000,000,000.00	人民币 5,000,000,000.00	3.42%	5,114,196,876.75	86,313,199.76	(222,600,000.00)	-	-	6,024,065,540.25	-
公司债	21 华泰 G4	人民币 6,000,000,000.00	人民币 6,000,000,000.00	2021/5/17	5 年	人民币 6,000,000,000.00	人民币 6,000,000,000.00	3.71%	6,134,804,603.30	111,860,936.95	(131,200,000.00)	-	-	4,012,563,874.97	-
公司债	21 华泰 G5	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2021/5/24	3 年	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	3.28%	4,077,517,151.49	66,246,723.48	(72,600,000.00)	-	-	2,006,451,893.20	-
公司债	21 华泰 G6	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2021/5/24	5 年	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	3.63%	2,042,564,784.15	36,487,109.05	(68,000,000.00)	-	-	2,002,384,221.86	-
公司债	21 华泰 G7	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2021/6/15	3 年	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	3.40%	2,036,062,646.18	43,626,965.24	(86,250,000.00)	-	-	2,501,585,153.00	-
公司债	21 华泰 09	人民币 2,500,000,000.00	人民币 2,500,000,000.00	2021/6/21	3 年	人民币 2,500,000,000.00	人民币 2,500,000,000.00	3.45%	2,544,308,187.76	22,896,174.34	-	-	-	1,536,701,754.87	-
公司债	21 华泰 11	人民币 1,500,000,000.00	人民币 1,500,000,000.00	2021/9/7	3 年	人民币 1,500,000,000.00	人民币 1,500,000,000.00	3.03%	1,513,805,580.53	51,110,705.23	-	-	-	2,781,787,041.94	-
公司债	21 华泰 12	人民币 2,700,000,000.00	人民币 2,700,000,000.00	2021/9/7	10 年	人民币 2,700,000,000.00	人民币 2,700,000,000.00	3.78%	2,730,676,336.71	34,197,616.19	-	-	-	2,147,875,524.88	-
公司债	21 华泰 13	人民币 2,100,000,000.00	人民币 2,100,000,000.00	2021/10/18	3 年	人民币 2,100,000,000.00	人民币 2,100,000,000.00	3.25%	2,113,677,908.69	67,860,559.92	-	-	-	3,494,941,591.65	-
公司债	21 华泰 14	人民币 3,400,000,000.00	人民币 3,400,000,000.00	2021/10/18	10 年	人民币 3,400,000,000.00	人民币 3,400,000,000.00	3.99%	3,427,081,031.73	35,496,074.58	-	-	-	2,248,354,682.47	-
公司债	21 华泰 15	人民币 2,200,000,000.00	人民币 2,200,000,000.00	2021/10/25	3 年	人民币 2,200,000,000.00	人民币 2,200,000,000.00	3.22%	2,212,858,607.89	21,679,905.23	-	-	-	1,129,513,198.71	-
公司债	21 华泰 16	人民币 1,100,000,000.00	人民币 1,100,000,000.00	2021/10/25	10 年	人民币 1,100,000,000.00	人民币 1,100,000,000.00	3.94%	1,107,833,293.48	70,586,328.48	(139,500,000.00)	-	-	5,049,933,888.86	-
公司债	22 华泰 G1	人民币 5,000,000,000.00	人民币 5,000,000,000.00	2022/2/14	3 年	人民币 5,000,000,000.00	人民币 5,000,000,000.00	2.79%	5,118,847,560.38	24,710,002.46	-	-	-	2,041,779,873.24	-
公司债	22 华泰 G2	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2022/8/15	2 年	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2.43%	2,017,069,870.78	35,642,221.30	-	-	-	3,057,751,992.68	-
公司债	22 华泰 G3	人民币 3,000,000,000.00	人民币 3,000,000,000.00	2022/8/26	2 年	人民币 3,000,000,000.00	人民币 3,000,000,000.00	2.33%	3,022,109,771.38	25,469,774.35	-	-	-	2,040,222,717.77	-
公司债	22 华泰 G4	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2022/9/5	3 年	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2.52%	2,014,752,943.42	37,955,334.56	-	-	-	3,057,926,024.76	-
公司债	22 华泰 G5	人民币 3,000,000,000.00	人民币 3,000,000,000.00	2022/9/13	3 年	人民币 3,000,000,000.00	人民币 3,000,000,000.00	2.50%	3,019,970,690.20	51,844,100.74	-	-	-	3,662,617,702.10	-
公司债	22 华泰 G6	人民币 3,600,000,000.00	人民币 3,600,000,000.00	2022/11/21	2 年	人民币 3,600,000,000.00	人民币 3,600,000,000.00	2.87%	3,610,773,601.36	22,287,254.02	-	-	-	1,426,949,390.36	-
公司债	22 华泰 G7	人民币 1,400,000,000.00	人民币 1,400,000,000.00	2022/11/21	5 年	人民币 1,400,000,000.00	人民币 1,400,000,000.00	3.18%	1,404,662,136.34	-	-	-	-	-	-

类型	项目	面值		起息日期	期限	发行金额		票面利率	期初余额		本期增加		本期减少		期末余额	
		原币	人民币			原币	人民币		等值人民币	等值人民币	等值人民币	等值人民币	等值人民币	等值人民币		
公司债	22 华泰 G8	人民币 1,500,000,000.00	人民币 1,500,000,000.00	2022/12/15	2 年	人民币 1,500,000,000.00	人民币 1,500,000,000.00	2.87%	1,502,007,200.79	21,810,739.69	-	-	-	-	1,523,817,940.48	
公司债	22 华泰 10	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2022/12/12	3 年	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	3.35%	2,002,083,230.40	33,749,169.84	-	-	-	-	2,035,832,400.24	
公司债	22 华泰 11	人民币 500,000,000.00	人民币 500,000,000.00	2022/12/12	5 年	人民币 500,000,000.00	人民币 500,000,000.00	3.49%	500,555,564.31	8,761,033.44	-	-	-	-	509,316,597.75	
公司债	22 华泰 12	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2022/12/22	2 年	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	3.24%	3,999,798,368.59	65,718,827.04	-	-	-	-	4,065,517,195.63	
公司债	23 华泰 G1	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2023/1/10	2 年	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2.92%	-	4,052,398,622.13	-	-	-	-	4,052,398,622.13	
公司债	23 华泰 G2	人民币 800,000,000.00	人民币 800,000,000.00	2023/1/16	2 年	人民币 800,000,000.00	人民币 800,000,000.00	3.00%	-	810,390,346.03	-	-	-	-	810,390,346.03	
公司债	23 华泰 G3	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	2023/1/16	5 年	人民币 2,000,000,000.00	人民币 2,000,000,000.00	3.48%	-	2,030,096,297.39	-	-	-	-	2,030,096,297.39	
公司债	23 华泰 G4	人民币 4,500,000,000.00	人民币 4,500,000,000.00	2023/2/16	3 年	人民币 4,500,000,000.00	人民币 4,500,000,000.00	3.23%	-	4,554,326,974.25	-	-	-	-	4,554,326,974.25	
公司债	23 华泰 G5	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	2023/2/13	5 年	人民币 4,000,000,000.00	人民币 4,000,000,000.00	3.39%	-	4,047,798,664.57	-	-	-	-	4,047,798,664.57	
公司债	23 华泰 G6	人民币 1,500,000,000.00	人民币 1,500,000,000.00	2023/2/27	3 年	人民币 1,500,000,000.00	人民币 1,500,000,000.00	3.14%	-	1,514,594,084.07	-	-	-	-	1,514,594,084.07	
公司债	23 华泰 G7	人民币 2,200,000,000.00	人民币 2,200,000,000.00	2023/2/27	5 年	人民币 2,200,000,000.00	人民币 2,200,000,000.00	3.36%	-	2,222,941,565.46	-	-	-	-	2,222,941,565.46	
公司债	23 华泰 G8	人民币 1,700,000,000.00	人民币 1,700,000,000.00	2023/5/10	2 年	人民币 1,700,000,000.00	人民币 1,700,000,000.00	2.82%	-	1,706,965,039.19	-	-	-	-	1,706,965,039.19	
公司债	23 华泰 G9	人民币 700,000,000.00	人民币 700,000,000.00	2023/5/10	5 年	人民币 700,000,000.00	人民币 700,000,000.00	3.07%	-	703,081,359.79	-	-	-	-	703,081,359.79	
	小计								100,165,374,016.57	23,199,919,102.07	(19,053,796,111.16)	-	-	-	104,311,497,007.48	
次级债	20 华泰 C1	人民币 5,000,000,000.00	人民币 5,000,000,000.00	2020/11/13	5 年	人民币 5,000,000,000.00	人民币 5,000,000,000.00	4.48%	5,027,690,469.92	112,362,503.72	-	-	-	-	5,140,052,973.64	
次级债	21 华泰 C1	人民币 9,000,000,000.00	人民币 9,000,000,000.00	2021/01/29	5 年	人民币 9,000,000,000.00	人民币 9,000,000,000.00	4.50%	9,368,950,784.17	203,360,634.10	(405,000,000.00)	-	-	-	9,167,311,418.27	
	小计								14,396,641,254.09	315,723,137.82	(405,000,000.00)	-	-	-	14,307,364,391.91	
境外债	HUATAI B2302c	美元 400,000,000.00	美元 400,000,000.00	2020/2/12	3 年	美元 400,000,000.00	美元 400,000,000.00	LIBOR+0.95%	2,802,824,125.10	11,081,464.79	(2,813,905,589.89)	-	-	-	-	
境外债	HUATAI B2404	美元 900,000,000.00	美元 900,000,000.00	2021/4/9	3 年	美元 900,000,000.00	美元 900,000,000.00	1.30%	6,280,410,780.52	235,381,153.04	-	-	-	-	6,515,791,933.56	
境外债	HUATAI B2604	美元 500,000,000.00	美元 500,000,000.00	2021/4/9	5 年	美元 500,000,000.00	美元 500,000,000.00	2.00%	3,491,943,191.67	130,169,021.79	-	-	-	-	3,622,112,213.46	
境外债	HUATAI B2503	美元 1,000,000,000.00	美元 1,000,000,000.00	2022/3/3	3 年	美元 1,000,000,000.00	美元 1,000,000,000.00	2.38%	7,000,146,099.09	263,514,194.34	-	-	-	-	7,263,660,293.43	
境外债	HUATAI B2509	人民币 3,025,000,000.00	人民币 3,025,000,000.00	2022/9/14	3 年	人民币 3,025,000,000.00	人民币 3,025,000,000.00	2.85%	3,041,405,570.37	44,223,459.98	(42,508,620.53)	-	-	-	3,043,120,409.82	
	小计								22,616,729,766.75	684,369,293.94	(2,856,414,210.42)	-	-	-	20,444,684,850.27	
收益凭证	收益凭证 ⁽¹⁾	人民币 2,238,757,200.00	人民币 2,238,757,200.00	注(1)	注(1)	人民币 2,238,757,200.00	人民币 2,238,757,200.00	注(1)	2,240,592,816.34	1,460,852,784.98	(121,157,200.00)	-	-	-	3,580,288,401.32	
	合计								139,419,337,853.75	25,660,864,318.81	(22,436,367,521.58)	-	-	-	142,643,834,650.98	

(1) 本公司于本期共发行 2 期期限大于一年收益凭证。

35 租赁负债

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
1年以内	538,628,323.52	492,667,072.44
1-2年	379,405,418.96	537,830,144.27
2-5年	591,356,148.40	417,308,994.56
5年以上	74,130,249.39	70,779,407.82
合计	<u>1,583,520,140.27</u>	<u>1,518,585,619.09</u>

本集团租赁主要为房屋及建筑物。本集团租用房屋及建筑物作为其办公场所，办公场所租赁通常为期1-5年不等。

(a) 本集团对短期租赁和低价值资产租赁进行简化处理，未确认使用权资产和租赁负债。于2023年1月1日至2023年6月30日止期间，短期租赁和低价值资产为人民币18,511,785.27元(2022年1月1日至2022年6月30日止期间：人民币21,468,709.57元)。

(b) 于2023年6月30日及2022年12月31日，本集团已承诺但尚未开始的租赁预计未来年度现金流出并不重大。

36 预计负债

	期初余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元
租赁还原成本	101,047.62	-	-	101,047.62
未决诉讼(注1)	-	570,040,464.73	-	570,040,464.73
监管事项(注2)	-	141,733,000.00	-	141,733,000.00
合计	<u>101,047.62</u>	<u>711,773,464.73</u>	<u>-</u>	<u>711,874,512.35</u>

注1：本期增加系本集团子公司华泰联合证券有限责任公司的未决诉讼产生，详见附注十四、1。

注2：本期增加系美国证券交易委员会对于本集团子公司AssetMark, Inc.的监管事项产生。

37 其他负债

(1) 其他负债按类别分析如下

	注	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
应付普通股股息		4,077,129,854.00	13,096,676.00
其他应付款	(a)	1,179,091,390.72	944,696,032.43
应付永续债利息		705,430,000.00	94,230,000.00
限制性回购义务		236,008,416.60	366,522,972.75
期货风险准备金	(b)	224,778,893.05	209,833,391.50
递延收益	(c)	10,146,428.60	10,146,428.60
代理兑付证券款		9,701,353.12	9,699,229.12
其他		121,120,270.34	33,014,383.13
合计		<u>6,563,406,606.43</u>	<u>1,681,239,113.53</u>

(a) 其他应付款

其他应付款按款项性质列示如下：

项目	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
人力外包费用	199,200,621.35	187,422,887.72
应付证券投资者保护基金款项	68,494,820.40	63,090,496.43
办公楼工程款	24,676,689.64	27,794,146.99
其他	886,719,259.33	666,388,501.29
合计	1,179,091,390.72	944,696,032.43

(b) 期货风险准备金

本集团下设子公司华泰期货有限公司根据《商品期货交易财务管理暂行规定》按商品和金融期货经纪业务手续费收入的5%计提期货风险准备金并计入当期损益，动用风险准备金弥补因自身原因造成的损失或是按规定核销难以收回的垫付风险损失款时，冲减期货风险准备金余额。

(c) 递延收益

	期初余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元	形成原因
政府补助	10,146,428.60	-	-	10,146,428.60	
- 与资产相关	10,146,428.60	-	-	10,146,428.60	
其中：		-	-		
购置办公用房	10,146,428.60	-	-	10,146,428.60	补贴购置办公用房
合计	10,146,428.60	-	-	10,146,428.60	

注：本集团确认为递延收益的政府补助，参见附注五、49。

38 股本

	本期变动增减					小计 人民币元	期末余额 人民币元
	期初余额 人民币元	发行新股 人民币元	送股 人民币元	公积金转股 人民币元	其他 人民币元		
股份总数	9,075,589,027.00	-	-	-	-	-	9,075,589,027.00

本公司公告拟回购注销限制性股票 925,692 股，截至 2023 年 6 月 30 日尚未完成回购及注销。详见附注五、41。

39 其他权益工具

	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
永续债	19,200,000,000.00	-	-	19,200,000,000.00

经中国证监会批准，本公司于 2021 年 9 月 15 日、2021 年 10 月 26 日、2021 年 11 月 16 日、2022 年 1 月 26 日、2022 年 7 月 11 日及 2022 年 10 月 21 日发行了 6 期永续次级债券（以下简称“永续债”），即“21 华泰 Y1”、“21 华泰 Y2”、“21 华泰 Y3”及“22 华泰 Y1”、“22 华泰 Y2”、“22 华泰 Y3”，债券面值均为人民币 100 元，票面利率分别为 3.85%、4.00%、3.80%、3.49%、3.59% 及 3.20%。永续债均无到期日，但本公司有权于永续债第 5 个和其后每个付息日按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回该债券。

永续债票面利率在前 5 个计息年度内保持不变。如本公司未行使赎回权，自第 6 个计息年度起，永续债每 5 年重置一次票面利率，重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。当期基准利率为票面利率重置日前 5 个工作日中国债券信息网站公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债收益率算术平均值。

除非发生强制付息事件，债券的每个付息日，本公司可自行选择将当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息推迟到下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制。强制付息事件是指付息日前 12 个月，公司向普通股股东分红或减少注册资本。当发生强制付息事件时，本公司不得递延当期利息及已经递延的所有利息及其孳息。

本公司发行的永续次级债券属于权益性工具，在本集团及本公司资产负债表列示于股东权益中。

40 资本公积

	期初余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元
股本溢价（注 1）	69,334,231,536.29	115,774,756.02	-	69,450,006,292.31
其他资本公积（注 2）	1,147,828,531.00	95,053,145.82	(357,030,542.85)	885,851,133.97
合计	70,482,060,067.29	210,827,901.84	(357,030,542.85)	70,335,857,426.28

注 1：本期增加系本集团授予的以权益结算的股份支付第一批限制性股票于本期满足条件解除限售，详见附注十二。

注 2：本期增加主要系本集团授予的以权益结算的股份支付在等待期内确认的费用同时计入资本公积，详见附注十二。本期减少主要系本集团对联营企业江苏银行的持股比例因可转债转股被动稀释产生的权益变动计入资本公积，详见附注五、12。

41 库存股

	期初余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元
股份回购	835,801,429.10	-	-	835,801,429.10
A 股限制性股票激励计划	366,522,972.75	-	(130,514,556.15)	236,008,416.60
合计	1,202,324,401.85	-	(130,514,556.15)	1,071,809,845.70

2023年3月30日，公司董事会和监事会分别审议通过了《关于公司A股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件成就的议案》。根据公司层面业绩条件达成情况和激励对象个人绩效条件达成情况，本次可解除限售的限制性股票数量合计为14,222,943股，于2023年4月24日解除限售为无限售条件流通股上市流通，公司A股限制性股票剩余30,204,084股。根据A股计划限制性股票激励计划的规则，本次股票回购义务相应减少人民币117,339,279.75元。

2023年6月30日，根据2022年度股东大会决议，按9,029,384,840股（扣除存放于本公司回购专用证券账户的A股股份和拟回购注销的A股股份）为基数，向股东每10股派发现金红利人民币4.50元（含税）。根据A股计划限制性股票激励计划的规则，股票回购义务相应减少人民币13,175,276.40元。

4.2 其他综合收益

项目	2023年1-6月							
	归属于母公司 股东的其他综合 收益上期期末余额 人民币元	本期所得税前 发生额 人民币元	减：前期计入 其他综合收益 当期转入损益 人民币元	减：所得税费用 人民币元	合计 人民币元	税后归属于 母公司 人民币元	税后归属于 少数股东 人民币元	归属于母公司 股东的其他综合 收益期末余额 人民币元
不能重分类进损益的其他综合收益								
- 其他权益工具投资公允价值变动	(45,805,860.26)	19,511,192.72	-	(4,807,695.73)	14,703,496.99	14,703,496.99	-	(31,102,363.27)
以后将重分类进损益的其他综合收益								
其中：- 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的 其他综合收益中享有的份额	204,871,464.75	(5,664,644.96)	-	-	(5,664,644.96)	(5,664,644.96)	-	199,206,819.79
- 其他债权投资公允价值变动	(80,897,617.11)	79,183,656.39	(29,813,938.62)	(14,046,393.72)	35,323,324.05	35,323,324.05	-	(45,574,293.06)
- 其他债权投资信用减值准备	25,366,772.42	44,291,747.56	(211,867.86)	(7,273,714.57)	36,806,165.13	36,806,165.13	-	62,172,937.55
- 现金流量套期储备	42,643,579.65	41,749,661.01	-	-	41,749,661.01	41,749,661.01	-	84,393,240.66
- 外币财务报表折算差额	647,051,512.96	610,133,339.82	-	-	610,133,339.82	514,837,843.26	95,295,496.56	1,161,889,356.22
合计	793,229,852.41	789,204,952.54	(30,025,806.48)	(26,127,804.02)	733,051,342.04	637,755,845.48	95,295,496.56	1,430,985,697.89

43 盈余公积

	期初余额 人民币元 (经重述)	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元
法定盈余公积	7,791,328,623.91	-	-	7,791,328,623.91

根据《公司法》以及本公司章程的规定，本公司税后净利润在弥补以前年度未弥补亏损后，按 10% 的比例提取法定盈余公积金。法定盈余公积金累计额为注册资本 50% 以上的，可不再提取。

44 一般风险准备

	期初余额 人民币元 (经重述)	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元
一般风险准备	11,438,179,626.99	44,171,635.43	-	11,482,351,262.42
交易风险准备	9,587,953,316.40	-	-	9,587,953,316.40
合计	21,026,132,943.39	44,171,635.43	-	21,070,304,578.82

一般风险准备包括本公司及本公司下属子公司根据相关规定计提的一般风险准备和交易风险准备（参见附注三、35）。

45 未分配利润

		2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元 (经重述)
	注		
上年年末未分配利润		37,923,299,960.91	35,559,778,869.62
加：会计政策变更		5,785,750.37	4,698,508.36
本期 / 年初余额		37,929,085,711.28	35,564,477,377.98
加：本期 / 年归属于母公司股东的净利润		6,555,640,254.37	11,053,782,915.36
减：提取法定盈余公积	(1)	-	(1,220,987,103.77)
提取一般风险准备	(1)	(44,171,635.43)	(2,918,393,516.48)
应付普通股股利	(2)	(4,063,223,178.00)	(4,063,639,739.40)
应付永续债股利	(3)	(705,430,000.00)	(485,730,000.00)
其他综合收益结转留存收益		-	(424,222.41)
期 / 年末未分配利润	(4)	<u>39,671,901,152.22</u>	<u>37,929,085,711.28</u>

(1) 提取各项盈余公积和风险准备

本公司按证券法、公司章程及其他相关规定，提取以下各项盈余公积和风险准备：

(i)	提取法定盈余公积	10%
(ii)	提取一般风险准备	10%
(iii)	提取交易风险准备	10%

一般风险准备还包括本公司及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和交易风险准备。

(2) 本期内分配普通股股利

根据 2023 年 6 月 30 日股东大会的批准，本公司向普通股股东派发现金股利，扣除不参与利润分配的已回购的 A 股股份合计 45,278,495 股和拟回购注销的 925,692 股，即以 9,029,384,840 股为基数，每 10 股人民币 4.5 元，(2022 年：每 10 股人民币 4.50 元)，共计人民币 4,063,223,178.00 元 (2022 年：人民币 4,063,639,739.40 元)。

(3) 本期内分配永续债股利

截止 2023 年 6 月 30 日，已发生永续债强制付息事件(向普通股股东分红)，本公司确认应付永续债利息人民币 705,430,000.00 元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 485,730,000.00 元)。

(4) 期末未分配利润的说明

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团归属于母公司的未分配利润中包含了本公司子公司提取的盈余公积人民币 2,317,301,382.93 元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 2,317,477,373.73 元)。

46 手续费及佣金净收入

注	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
证券经纪业务净收入	2,849,402,513.31	3,252,721,539.74
其中：证券经纪业务收入	4,124,657,776.18	4,632,270,976.41
其中：代理买卖证券业务	3,381,719,821.28	3,790,996,846.25
交易单元席位租赁	398,544,372.12	377,892,920.17
代销金融产品业务	344,393,582.78	463,381,209.99
证券经纪业务支出	(1,275,255,262.87)	(1,379,549,436.67)
其中：代理买卖证券业务	(1,275,255,262.87)	(1,379,549,436.67)
期货经纪业务净收入	303,601,095.07	300,947,919.89
其中：期货经纪业务收入	540,051,394.87	751,102,576.39
期货经纪业务支出	(236,450,299.80)	(450,154,656.50)
投资银行业务净收入	1,610,043,779.94	1,690,578,024.73
其中：投资银行业务收入	1,637,703,713.21	1,723,393,623.96
其中：证券承销业务	1,464,904,033.92	1,523,628,771.45
证券保荐业务	79,846,403.46	56,785,762.47
财务顾问业务	(i) 92,953,275.83	142,979,090.04
投资银行业务支出	(27,659,933.27)	(32,815,599.23)
其中：证券承销业务	(27,514,312.52)	(31,399,679.17)
财务顾问业务	(i) (145,620.75)	(1,415,920.06)
资产管理业务净收入	2,085,349,230.46	1,669,276,065.41
其中：资产管理业务收入	2,723,174,663.93	2,208,039,460.04
资产管理业务支出	(637,825,433.47)	(538,763,394.63)
基金管理业务净收入	513,890,206.01	452,509,160.67
其中：基金管理业务收入	513,890,206.01	452,509,160.67
投资咨询服务净收入	76,885,051.60	67,211,335.37
其中：投资咨询服务收入	76,885,051.60	67,211,335.37
投资咨询服务支出	-	-
其他手续费及佣金净收入	108,627,111.68	95,654,328.69
其中：其他手续费及佣金收入	109,335,139.48	96,595,607.12
其他手续费及佣金支出	(708,027.80)	(941,278.43)
合计	<u>7,547,798,988.07</u>	<u>7,528,898,374.50</u>
其中：手续费及佣金收入合计	9,725,697,945.28	9,931,122,739.96
手续费及佣金支出合计	(2,177,898,957.21)	(2,402,224,365.46)

(i) 财务顾问业务净收入

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
并购重组财务顾问净收入	34,232,075.46	64,599,729.37
- 境内上市公司	31,779,245.28	49,980,778.05
- 其他	2,452,830.18	14,618,951.32
其他财务顾问业务净收入	58,575,579.62	76,963,440.61
合计	92,807,655.08	141,563,169.98

47 利息净收入

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
利息收入		
融资融券利息收入	3,953,584,992.21	3,930,960,096.06
货币资金及结算备付金利息收入	2,148,205,919.60	1,914,084,093.53
债权投资利息收入	704,012,138.11	486,456,197.96
买入返售金融资产利息收入	262,618,293.13	269,362,032.72
其中：股票质押回购利息收入	150,531,557.12	134,768,860.11
其他债权投资利息收入	189,236,504.75	149,275,672.63
其他	5,183,273.15	8,338,420.19
利息收入小计	7,262,841,120.95	6,758,476,513.09
利息支出		
应付债券利息支出	(2,640,701,232.80)	(2,322,530,725.06)
其中：次级债券利息支出	(315,962,379.27)	(315,900,010.96)
卖出回购金融资产利息支出	(2,094,971,629.16)	(1,265,259,294.41)
其中：报价回购利息支出	(193,507,943.37)	(109,686,069.08)
拆入资金利息支出	(980,129,747.95)	(944,405,345.82)
其中：转融通利息支出	(619,278,429.82)	(525,685,212.39)
应付短期融资款利息支出	(159,409,074.78)	(476,806,129.67)
代理买卖证券款利息支出	(424,807,028.76)	(222,246,154.93)
租赁负债利息支出	(34,713,237.56)	(39,455,248.27)
短期借款利息支出	(208,460,180.85)	(37,484,094.33)
长期借款利息支出	(9,837,228.33)	(9,235,662.30)
其他	(68,582,558.71)	(55,703,524.50)
利息支出小计	(6,621,611,918.90)	(5,373,126,179.29)
利息净收入	641,229,202.05	1,385,350,333.80

48 投资收益

(1) 投资收益按类别列示

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
权益法核算的长期股权投资收益	1,247,912,552.83	463,472,674.51
处置长期股权投资产生的投资损失	-	(504,035.52)
金融工具投资收益	8,104,528,816.68	277,826,023.29
其中：持有期间取得的收益/(损失)	3,800,489,357.56	4,330,578,067.18
- 交易性金融资产	3,834,459,256.26	4,385,778,067.18
- 交易性金融负债	(33,969,898.70)	(55,200,000.00)
处置金融工具取得的收益/(损失)	4,304,039,459.12	(4,052,752,043.89)
- 交易性金融资产	13,091,680,543.65	(10,297,267,190.24)
- 其他债权投资	29,813,938.62	(139,443,582.14)
- 衍生金融工具	(8,370,087,225.65)	7,139,550,590.19
- 交易性金融负债	(447,367,797.50)	(755,591,861.70)
合计	9,352,441,369.51	740,794,662.28

(2) 对联营及合营企业的投资收益

参见附注五、12(2)

(3) 本集团不存在投资收益汇回的重大限制。

(4) 交易性金融工具投资收益明细表

交易性金融工具		2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
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	持有期间收益	3,834,459,256.26	4,385,778,067.18
	处置取得收益/(损失)	13,091,680,543.65	(10,297,267,190.24)
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	处置取得损失	(527,464,395.95)	(755,591,861.70)
	持有期间损失	(33,969,898.70)	(55,200,000.00)
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	持有期间损失	(33,969,898.70)	(55,200,000.00)
	处置取得收益	80,096,598.45	-
合计		16,444,802,103.71	(6,722,280,984.76)

49 其他收益

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
与收益相关的政府补助	90,570,624.28	113,650,014.40
合计	<u>90,570,624.28</u>	<u>113,650,014.40</u>

(1) 与收益相关的政府补助

本集团 2023 上半年获得的与收益相关的政府补助主要系政府扶持资金及税收返还收入。

(2) 与资产相关的政府补助

本集团 2023 年上半年无与资产相关的政府补助。

50 公允价值变动收益

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
交易性金融资产	4,364,568,690.44	(5,293,450,119.00)
交易性金融负债	(33,942,054.51)	1,524,714,081.15
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	(33,277,439.75)	277,051,459.40
衍生金融工具	(6,616,689,943.93)	7,245,845,491.79
合计	<u>(2,286,063,308.00)</u>	<u>3,477,109,453.94</u>

51 其他业务收入

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
大宗商品销售收入	1,302,491,597.08	1,942,967,357.90
租赁收入	16,368,360.80	38,370,123.43
其他	94,943,159.25	57,335,450.71
合计	<u>1,413,803,117.13</u>	<u>2,038,672,932.04</u>

52 资产处置收益

项目	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元	2023年1-6月计入 非经常性损益的金额 人民币元
固定资产处置利得	9,990.17	184,416.62	9,990.17
使用权资产处置利得	-	4,170.76	-
合计	<u>9,990.17</u>	<u>188,587.38</u>	<u>9,990.17</u>

53 税金及附加

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
城建税	41,499,414.67	45,402,962.92
教育费附加	29,924,874.81	32,499,226.81
其他	26,015,431.94	27,225,846.63
合计	<u>97,439,721.42</u>	<u>105,128,036.36</u>

54 业务及管理费

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
员工成本	4,940,925,418.06	4,619,709,654.99
研究开发费	1,118,741,615.37	949,387,899.06
使用权资产折旧	309,164,451.24	245,316,381.78
无形资产摊销	266,985,839.54	199,475,042.96
固定资产折旧	261,612,806.07	221,455,597.31
交易所费用	256,621,960.53	231,526,814.32
咨询费	213,362,222.59	169,860,201.76
业务宣传费	205,997,105.26	184,146,470.05
邮电通讯费	144,281,835.43	117,484,014.00
长期待摊费用摊销	67,873,545.78	55,002,987.27
证券投资者保护基金	64,013,990.89	52,537,744.82
产品代销手续费	21,528,836.34	33,901,556.17
租赁费	18,511,785.27	21,468,709.57
其他	740,842,475.96	510,610,873.84
合计	<u>8,630,463,888.33</u>	<u>7,611,883,947.90</u>

55 信用减值损失

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
货币资金减值损失转回	(420,332.08)	(592,699.18)
融出资金减值损失转回	(21,743,934.35)	(341,255,781.77)
应收及其他应收坏账准备计提	21,840,662.06	3,259,884.79
债权投资减值损失计提	7,085.08	567,734.15
其他债权投资减值损失计提/(转回)	44,048,756.63	(57,344,770.65)
买入返售金融资产减值损失(转回)/计提	(468,975,952.44)	56,015,467.71
应收利息减值损失计提	7,232,118.15	1,725,699.78
合计	(418,011,596.95)	(337,624,465.17)

56 其他业务成本

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
大宗商品销售成本	1,330,493,986.99	1,957,805,086.72
员工成本	6,632,639.95	8,312,169.74
投资性房地产折旧	5,247,628.33	6,559,156.66
其他	30,046,016.94	17,543,687.70
合计	1,372,420,272.21	1,990,220,100.82

57 营业外收支

(1) 营业外收入分项目情况如下：

项目	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元	2023年1-6月计入 非经常性损益的金额 人民币元
拆迁补偿款	30,233,307.20	-	30,233,307.20
非流动资产处置收益	244,687.04	283,390.59	244,687.04
违约补偿金	343,601.76	518,003.55	343,601.76
其他	840,895.57	245,165.60	840,895.57
合计	31,662,491.57	1,046,559.74	31,662,491.57

(2) 营业外支出

项目	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元	2023 年 1-6 月计入 非经常性损益的金额 人民币元
未决诉讼	570,040,464.73	-	570,040,464.73
捐赠支出	2,226,380.00	19,674,405.89	2,226,380.00
罚款、违约和赔偿损失	147,205,772.69	67,574.85	147,205,772.69
其他	1,743,378.66	3,800,097.96	1,743,378.66
合计	<u>721,215,996.08</u>	<u>23,542,078.70</u>	<u>721,215,996.08</u>

58 所得税费用

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元 (经重述)
按税法及相关规定计算的当年所得税	1,319,920,520.40	1,455,081,131.20
汇算清缴差异调整	(30,677,050.20)	26,076,632.88
递延所得税的变动	45,707,944.33	(260,055,952.68)
合计	<u>1,334,951,414.53</u>	<u>1,221,101,811.40</u>

(1) 递延所得税调整分析如下：

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元 (经重述)
暂时性差异的产生和转回	<u>45,707,944.33</u>	<u>(260,055,952.68)</u>

(2) 所得税费用与会计利润的关系如下：

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元 (经重述)
税前利润	7,997,428,532.25	6,773,995,953.31
按税率 25% 计算的预期所得税	1,999,357,133.07	1,693,498,988.33
子公司适用不同税率的影响	(74,786,233.21)	(210,724,845.15)
调整以前年度所得税的影响	(30,677,050.20)	26,076,632.88
非应税收入的影响	(686,557,422.31)	(388,480,062.22)
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	127,591,493.18	132,160,661.73
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	(609,557.19)	(30,904,736.38)
其他	633,051.19	(524,827.79)
本期所得税费用	<u>1,334,951,414.53</u>	<u>1,221,101,811.40</u>

59 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

(1) 基本每股收益

基本每股收益以归属于本公司普通股股东的合并净利润除以本公司发行在外普通股的加权平均数计算：

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元 (经重述)
归属于本公司普通股股东的合并净利润	6,280,102,998.52	5,180,353,450.33
本公司发行在外普通股的加权平均数	8,992,562,787.62	8,985,883,505.00
基本每股收益(元/股)	0.70	0.58

(a) 归属于本公司普通股股东的合并净利润计算过程如下：

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元 (经重述)
归属于母公司股东的合并净利润	6,555,640,254.37	5,375,963,043.99
限制性股票红利	(13,175,276.40)	(19,992,162.15)
其他权益工具股息影响(注)	(262,361,979.45)	(175,617,431.51)
归属于本公司普通股股东的合并净利润	6,280,102,998.52	5,180,353,450.33

(b) 普通股的加权平均数计算过程如下：

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
期初已发行普通股股数	9,075,589,027.00	9,076,650,000.00
股票回购股份加权平均	(83,026,239.38)	(90,766,495.00)
本期新增普通股加权平均数	-	-
本期减少普通股加权平均数	-	-
期末普通股的加权平均数	8,992,562,787.62	8,985,883,505.00

注：本公司在计算2023年上半年基本每股收益时，将归属于2023年上半年度的永续债股息共计人民币262,361,979.45元从归属于母公司的合并净利润中予以扣除(2022年上半年：人民币175,617,431.51元)。

(2) 稀释每股收益

稀释每股收益以归属于本公司普通股股东的合并净利润（稀释）除以本公司发行在外普通股的加权平均数（稀释）计算：

		2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元 (经重述)
归属于本公司普通股股东的合并净利润（稀释）	(a)	6,132,829,115.29	5,069,157,939.54
本公司发行在外普通股的加权平均数（稀释）	(b)	8,992,562,787.62	8,985,883,505.00
稀释每股收益（元 / 股）		0.68	0.56

(a) 归属于本公司普通股股东的合并净利润（稀释）计算过程如下：

		2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元 (经重述)
归属于本公司普通股股东的合并净利润		6,280,102,998.52	5,180,353,450.33
稀释调整：			
限制性股票红利的影响（注 1）		-	-
联营企业可转换公司债券的影响（注 2）		(146,052,071.89)	(111,053,907.54)
子公司稀释性潜在普通股转换时影响（注 3）		(1,221,811.34)	(141,603.25)
归属于本公司普通股股东的合并净利润（稀释）		6,132,829,115.29	5,069,157,939.54

(b) 普通股的加权平均数（稀释）计算过程如下：

		2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
期初已发行普通股股数		8,992,562,787.62	8,985,883,505.00
稀释调整：			
股份激励稀释作用下增加的股份数（注 1）		-	-
期末普通股的加权平均数		8,992,562,787.62	8,985,883,505.00

注 1：于 2021 年，本公司授予了部分员工 A 股限制性股票激励计划。稀释每股收益应考虑到相关员工行权后摊薄每股收益的影响，但在综合考虑当年分配给预计未来可解锁限制性股票持有者的现金股利及预计行权时转换的普通股股数时，授予的 A 股限制性股票激励计划于本期具有反稀释性（2022 年 1-6 月：具有反稀释性）。

注 2：于 2019 年 3 月，本公司的联营公司江苏银行发行了可转换公司债券。稀释每股收益考虑该可转换债券全部转换为普通股对归属于本公司合并净利润的潜在影响。

注 3：为 AssetMark Financial Holdings, Inc. 股权激励计划产生的稀释效应。

60 现金流量表项目注释

(1) 收到其他与经营活动有关的现金

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
收到的往来款项	9,233,428,492.78	7,049,287,904.42
存出保证金本期净流入	2,511,702,635.12	-
收到的大宗商品交易收入	1,302,491,597.08	1,942,967,357.90
使用受限制货币资金的变动	166,458,358.40	1,226,352,235.35
合并结构化主体收到的现金	-	770,570,571.42
收到的政府补助及营业外收入	121,336,895.59	114,696,574.14
其他业务收入	111,311,520.05	95,705,574.14
合计	<u>13,446,729,499.02</u>	<u>11,199,580,217.37</u>

(2) 支付其他与经营活动有关的现金

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
支付的往来款项及其他费用	6,893,730,305.84	11,436,540,886.65
存出保证金本期净支付	-	4,763,430,297.58
支付大宗商品交易成本	1,330,493,986.99	1,957,805,086.72
合并结构化主体减少的现金	81,354,769.11	-
合计	<u>8,305,579,061.94</u>	<u>18,157,776,270.95</u>

(3) 收到其他与投资活动有关的现金

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
处置固定资产、无形资产和其他长期资产所收到的现金	7,890,485.67	17,573,303.94
收购子公司产生的现金净额	-	16,309,431.57
合计	<u>7,890,485.67</u>	<u>33,882,735.51</u>

(4) 将净利润调节为经营活动现金流量

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元 (经重述)
净利润	6,662,477,117.72	5,552,894,141.91
加：信用减值损失	(418,011,596.95)	(337,624,465.17)
固定资产及投资性房地产折旧	266,860,434.40	228,014,753.97
无形资产摊销	266,985,839.54	199,475,042.96
长期待摊费用摊销	67,873,545.78	55,002,987.27
使用权资产折旧	309,164,451.24	245,316,381.78
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的收益	(254,677.21)	(188,587.38)
公允价值变动收益	1,939,782,927.52	(2,284,163,860.70)
利息支出	2,159,872,311.46	2,249,779,989.04
汇兑收益	(396,149,113.24)	(881,434,733.84)
投资收益	(1,277,726,491.45)	(323,525,056.85)
递延所得税资产增加	(186,596,990.03)	(49,812,224.15)
递延所得税负债增加 / (减少)	232,304,934.36	(210,243,728.53)
交易性金融工具的增加	(38,637,828,030.28)	(26,175,713,175.70)
经营性应收项目的(增加) / 减少	(1,218,737,572.16)	12,723,064,925.45
经营性应付项目的增加	24,983,115,690.05	39,232,144,073.01
经营活动(使用) / 产生的现金流量净额	<u>(5,246,867,219.25)</u>	<u>30,222,986,463.07</u>

(5) 现金及现金等价物净变动情况

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
现金及现金等价物的期末余额	211,415,037,052.89	200,564,075,459.14
减：现金及现金等价物的期初余额	(215,921,297,118.14)	(189,399,437,061.37)
现金及现金等价物净(减少) / 增加额	<u>(4,506,260,065.25)</u>	<u>11,164,638,397.77</u>

(6) 现金及现金等价物构成

	2023年6月30日 人民币元	2022年6月30日 人民币元
现金	198,159,317,805.00	191,800,816,180.03
其中：库存现金	206,583.19	385,616.24
可随时用于支付的银行存款	159,242,652,671.36	167,194,025,034.93
可随时用于支付的其他货币资金	150,388.99	1,489,532.41
结算备付金	38,916,308,161.46	24,604,915,996.45
现金等价物	13,255,719,247.89	8,763,259,279.11
其中：原到期日在三个月内的买入返售金融资产	11,423,205,334.05	8,683,590,379.07
原到期日在三个月内的债券投资	1,832,513,913.84	79,668,900.04
现金及现金等价物余额	<u>211,415,037,052.89</u>	<u>200,564,075,459.14</u>

(7) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动

于2023年1-6月，本集团无不涉及现金收支的重大投资和筹资活动。

61 外币货币性项目

(1) 外币货币性项目

中国大陆以外地区经营实体主要报表项目的折算汇率：

	2023年6月30日	2022年12月31日
美元	7.2258	6.9646
港币	0.9220	0.8933

(2) 境外经营实体说明

本公司主要境外经营实体为本公司子公司华泰金融控股（香港）有限公司及 AssetMark Financial Holdings, Inc.，其经营地分别在香港和美国，记账本位币分别为港币和美元。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定，本期未发生变化。

六、合并范围的变更

1 纳入合并范围结构化主体的变动而导致的合并范围变更

本集团对作为结构化主体的管理人和 / 或作为投资人，且综合评估本集团因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本集团面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并（主要是资产管理计划）。本集团本期结构化主体纳入合并报表范围较上年新增 7 个，减少 7 个，详见附注七、3。

七、在其他主体中的权益

1 在子公司中的权益

(1) 企业集团的构成

子公司名称	注册	主要经营地	注册地	业务性质	币种	注册 / 认缴资本		持股比例 (%) (或类似权益比例)		取得方式
						原币	人民币	直接	间接	
华泰联合证券有限责任公司		深圳	深圳	投资银行	人民币	997,480,000.00		99.92	-	购买
华泰期货有限公司		广州	广州	期货经纪	人民币	3,939,000,000.00		100.00	-	购买
华泰紫金投资有限责任公司		南京	南京	股权投资	人民币	6,000,000,000.00		100.00	-	设立
江苏股权交易中心有限责任公司		南京	南京	股权交易服务	人民币	200,000,000.00		52.00	-	设立
华泰创新投资有限公司		上海	上海	创新投资	人民币	3,500,000,000.00		100.00	-	设立
华泰证券(上海)资产管理有限公司		上海	上海	资产管理	人民币	2,600,000,000.00		100.00	-	设立
华泰国际金融控股有限公司		香港	香港	控股投资	港币	10,200,000,002.00		100.00	-	设立
上海盛钜资产管理(上海)有限公司		上海	上海	资产管理	人民币	121,000,000.00		100.00	-	购买
华泰金融控股(香港)有限公司		香港	香港	证券经纪	港币	8,800,000,000.00		-	100.00	设立
南京华泰瑞通投资管理有限公司		南京	南京	投资管理	人民币	5,000,000.00		-	54.00	设立
华泰金控投资咨询(深圳)有限公司		深圳	深圳	管理咨询	港币	10,000,000.00		-	100.00	设立
深圳市华泰君信基金投资管理有限公司		深圳	深圳	投资管理	人民币	5,000,000.00		-	51.00	设立
北京市华泰同信投资基金管理有限公司		北京	北京	投资管理	人民币	3,000,000.00		-	51.00	设立
华泰长城资本管理有限公司		深圳	深圳	场外衍生品和做市业务	人民币	1,000,000,000.00		-	100.00	设立
华泰长城国际贸易有限公司		上海	上海	仓单服务和基差贸易	人民币	150,000,000.00		-	100.00	设立
深圳市华泰瑞麟基金投资管理合伙企业(有限合伙)		深圳	深圳	投资管理	人民币	30,000,000.00		-	52.00	设立
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业(有限合伙)		深圳	深圳	股权投资	人民币	1,000,000,000.00		-	31.00	设立
北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)		北京	北京	股权投资	人民币	1,000,000,000.00		-	45.00	设立
北京华泰瑞合投资管理合伙企业(有限合伙)		北京	北京	投资管理	人民币	30,000,000.00		-	52.00	设立
盛道(南京)股权投资管理有限公司		南京	南京	投资管理	人民币	1,000,000.00	1	-	51.00	设立
南京致远股权投资合伙企业(有限合伙)		南京	南京	投资管理	人民币	1,000,000.00	1	-	52.00	设立
HTSC LIMITED		香港	香港	不活动	港币	1.00		-	100.00	设立
Huatat HK SPC		开曼群岛	开曼群岛	基金管理	美元	100.00		-	100.00	设立
Huatat International Private Equity Investment Management Limited	注 2	开曼群岛	开曼群岛	投资管理	美元	50,000.00		-	100.00	设立

子公司名称	注释	主要经营地	注册地	业务性质	币种	注册/认缴资本	持股比例 (%)		取得方式
							直接	间接	
Huatai International Finance Limited (华泰国际财务有限公司)		英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Value Investment Partners Limited		英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	融资业务	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Capital Investment Management Limited (华泰资本投资管理有限公司)		香港	香港	财务业务	港币	2.00	-	100.00	设立
Huatai Capital Investment Limited (华泰资本投资有限公司)		香港	香港	自营投资	港币	2.00	-	100.00	设立
Huatai International Corporate Finance Limited (华泰国际融资有限公司)		香港	香港	融资业务	港币	30,000,000.00	-	100.00	设立
Principle Solution Group Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Pioneer Reward Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai International Financial Products Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Capital Investment Partners Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Capital Management Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Value Management Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Principal Investment I Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
Huatai Principal Investment Group Limited		香港	英属维尔京群岛	控股投资	美元	1.00	-	100.00	设立
华泰资本管理(香港)有限公司		香港	香港	资产管理	港币	222,986,411.15	-	100.00	设立
伊犁华泰瑞达股权投资管理有限公司		伊宁	伊宁	投资管理	人民币	2,000,000.00	-	51.00	设立
伊犁华泰瑞达股权投资管理合伙企业(有限合伙)		伊宁	伊宁	股权投资	人民币	2,000,000.00	-	52.00	设立
伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)		伊宁	伊宁	股权投资	人民币	1,900,000,000.00	-	24.73	设立
南京华泰瑞兴投资管理有限公司		南京	南京	投资管理	人民币	1,000,000.00	-	51.00	设立
南京华泰瑞兴投资基金管理合伙企业(有限合伙)		南京	南京	股权投资	人民币	1,000,000.00	-	52.00	设立
Huatai Financial USA Inc.		美国	美国	期货经纪	美元	8,685,500.00	-	100.00	设立
华泰(香港)期货有限公司		香港	香港	期货经纪	港币	143,529,936.09	-	100.00	设立
华泰长城投资管理有限公司		上海	上海	仓单服务和基差贸易	人民币	550,000,000.00	-	100.00	设立
Huatai International Investment Holdings Limited		香港	开曼群岛	股权投资	美元	100.00	-	100.00	设立
AssetMark Financial Holdings, Inc.		美国	美国	资产管理	美元	675,000.00	-	88.59	购买

子公司名称	注释	主要经营地	注册地	业务性质	币种	注册 / 认缴资本	持股比例 (%) (或类似权益比例)		取得方式
							直接	间接	
AssetMark Trust Company		美国	美国	资产托管	美元	60,000.00	-	68.59	购买
AssetMark Retirement Services, Inc.		美国	美国	投资咨询	美元	100.00	-	68.59	购买
AssetMark, Inc.		美国	美国	投资咨询	美元	1,000.00	-	68.59	购买
AssetMark Brokerage, LLC		美国	美国	基金经纪	美元	-	-	68.59	购买
Huatai Securities USA Holding, Inc.		美国	美国	投资管理	美元	100.00	-	100.00	设立
Huatai Securities (USA), Inc.		美国	美国	投资银行	美元	100.00	-	100.00	设立
Global Financial Private Capital, Inc.		美国	美国	投资咨询	美元	100,000.00	-	68.59	购买
Global Financial Advisory, LLC		美国	美国	保险中介服务	美元	-	-	68.59	购买
Voyant, Inc.		美国	美国	投资咨询	美元	1,000.00	-	68.59	购买
Voyant UK Limited		英国	英国	投资咨询	英镑	1.00	-	68.59	购买
Voyant Financial Technologies, Inc.		加拿大	加拿大	投资咨询	加元	1.00	-	68.59	购买
Voyant Australia Pty Ltd		澳大利亚	澳大利亚	投资咨询	澳元	10.00	-	68.59	购买
泰保资本管理有限公司		香港	香港	境外股权投资和资产管理业务	港币	2.00	-	100.00	设立
Atria Investments, Inc.		美国	美国	投资咨询	美元	100.00	-	68.59	购买
Huatai Securities (Singapore) Pte., Limited		新加坡	新加坡	投资咨询	新加坡元	5,000,000.00	-	100.00	设立
HS Carbon Neutrality & Energy Transition Investment Limited	注3	香港	香港	股权投资	港币	2.00	-	100.00	设立

注 1：于 2023 年 1 月，Adhesion Wealth Advisor Solutions, Inc. 合并至 Atria Investment, Inc. 后被注销。

注 2：原 Huatai HK Investment (Cayman) Limited 更名为 Huatai International Private Equity Investment Management Limited。

注 3：于 2023 年 3 月，华泰国际金融控股有限公司于香港设立全资子公司 HS Carbon Neutrality & Energy Transition Investment Limited。

(2) 重要的非全资子公司

于 2023 年 1-6 月，本公司在重要的非全资子公司中权益列示如下：

子公司名称	少数股东的 持股比例 %	本期归属于 少数股东的损益 人民币元	本期向少数股东 宣告分派的股利 人民币元	期末少数股东 权益余额 人民币元
AssetMark Financial Holdings, Inc.	31.41	102,638,385.19	-	2,680,205,675.94

下表列示了上述子公司的主要财务信息，该财务信息是集团内部交易抵销前的金额：

AssetMark Financial Holdings, Inc.			
	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元	
资产合计	11,299,973,394.60	10,528,077,373.53	
负债合计	(2,767,004,034.71)	(2,699,029,843.82)	
2023 年 1-6 月 人民币元			
	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元	
营业收入	1,860,158,688.01	1,403,758,478.77	
净利润	326,769,771.38	351,013,228.60	
其他综合收益	-	-	
综合收益总额	326,769,771.38	351,013,228.60	
经营活动现金流量	730,874,538.90	358,331,164.46	

2 在联营企业和合营企业中的权益

项目	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
联营企业		
- 重要的联营企业	15,592,643,057.81	15,036,996,935.15
- 不重要的联营企业	3,784,262,251.47	3,239,446,135.77
合营企业		
- 不重要的合营企业	772,137,718.63	964,719,658.34
小计	20,149,043,027.91	19,241,162,729.26
减：减值准备	-	-
合计	20,149,043,027.91	19,241,162,729.26

(1) 重要联营企业：

企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	直接		间接		对联营企业投资的会计处理方法		注册/认缴资本(人民币万元)		对集团活动是否具有战略性
				30/6/2023	31/12/2022	30/6/2023	31/12/2022	30/6/2023	31/12/2022			
江苏银行股份有限公司(注1)	南京	南京	商业银行	5.59%	5.88%	-	-	权益法	1,551,909.35	1,476,965.67	是	
南方基金管理股份有限公司	深圳	深圳	基金管理	41.16%	41.16%	-	-	权益法	36,172.00	36,172.00	是	
南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)(注2)	南京	南京	股权投资	-	-	48.27%	48.27%	权益法	544,200.00	544,200.00	是	

注1：本公司在江苏银行董事会中派有一名董事，且本公司通过派出的董事参与江苏银行的财务和经营政策的制定，从而继续实施对江苏银行的重大影响，因此本公司对江苏银行的投资确认为长期股权投资并按权益法核算。截至2023年6月30日，江苏银行发行的苏银转债累计转股股数为749,559,864股，占苏银转债转股前江苏银行已发行普通股股份总额的6.4928%，本期江苏银行发行的苏银转债转股导致本公司对江苏银行的持股比例从5.88%减少至5.59%。

注2：截至2023年6月30日，本集团持有南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)48.27%的股权。根据该有限合伙基金的合伙协议，本集团为该有限合伙基金的共同管理人，对该有限合伙基金具有重大影响，故将其作为本集团的联营企业核算，对其采用长期股权投资按权益法核算。

(2) 重要联营企业的主要财务信息：

下表列示了本集团重要联营企业的主要财务信息，这些联营企业的重要会计政策与本集团会计政策无重大差异。此外，下表还列示了这些财务信息按照权益法调整至本集团对联营企业投资账面价值的调节过程：

	江苏银行股份有限公司		南方基金管理有限公司		南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)	
	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
资产	3,294,582,710,000.00	2,980,403,000,000.00	13,686,055,285.42	14,133,326,066.76	2,791,598,691.98	3,517,570,614.68
负债	(3,056,280,475,000.00)	(2,764,867,948,666.67)	(4,370,104,242.76)	(5,247,732,572.21)	(2,416,789.63)	(10,412,909.65)
净资产	238,302,235,000.00	215,535,051,333.33	9,315,951,042.66	8,885,593,494.55	2,789,181,902.35	3,507,157,705.03
少数股东权益	7,437,337,000.00	6,794,051,333.33	241,343,430.83	252,984,419.90	-	-
归属于母公司普通股股东权益	190,890,140,000.00	168,766,000,000.00	9,074,607,611.83	8,632,609,074.65	2,789,181,902.35	3,507,157,705.03
按持股比例计算的净资产份额	10,557,681,797.62	9,841,472,630.29	3,735,108,493.03	3,553,181,895.13	1,346,338,104.26	1,692,905,024.22
其他调整	-	-	-	-	(46,485,337.10)	(50,562,614.49)
对联营企业投资的账面价值	10,557,681,797.62	9,841,472,630.29	3,735,108,493.03	3,553,181,895.13	1,299,852,767.16	1,642,342,409.73
营业收入	38,842,871,000.00	35,107,352,000.00	3,521,313,938.95	3,273,448,504.24	(147,597,176.78)	(821,042,348.98)
净利润	17,625,964,000.00	13,849,233,000.00	984,808,531.75	886,412,150.94	(147,918,699.31)	(845,029,853.60)
其他综合收益	1,375,220,000.00	576,745,000.00	12,857,051.82	16,666,417.21	-	-
综合收益总额	19,001,184,000.00	14,425,978,000.00	997,665,583.57	903,078,568.15	(147,918,699.31)	(845,029,853.60)
本期收到的来自联营企业的股利	-	332,800,000.00	202,461,737.99	345,394,016.87	272,917,327.25	134,681,297.42

(3) 不重要联营企业和合营企业的汇总财务信息如下：

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
联营企业：		
投资账面价值合计	3,784,262,251.47	3,239,446,135.77
	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
下列各项按持股比例计算的合计数		
- 净利润	15,782,818.24	(245,283,233.43)
- 其他综合收益	-	-
- 综合收益总额	15,782,818.24	(245,283,233.43)
	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
合营企业：		
投资账面价值合计	772,137,718.63	964,719,658.34
	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
下列各项按持股比例计算的合计数		
- 净利润	(19,752,465.15)	51,528,581.86
- 其他综合收益	-	-
- 综合收益总额	(19,752,465.15)	51,528,581.86

3 本集团在合并的结构化主体中的权益

本集团合并的结构化主体主要是指本集团作为管理人和 / 或投资者的资产管理计划。本集团综合评估本集团因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的报酬是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。

于2023年6月30日，本集团共合并61个结构化主体（2022年12月31日：61个结构化主体），合并结构化主体的总资产为人民币83,093,634,934.18元（2022年12月31日：人民币71,869,706,994.01元）。本集团在上述合并结构化主体中的持有的权益体现在资产负债表中交易性金融资产的金额为人民币76,808,656,261.05元（2022年12月31日上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产的金额为人民币69,504,863,433.19元）。

4 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本集团作为结构化主体的普通合伙人或管理者，在报告期间对资产管理计划拥有管理权。除已于附注七、3所述本集团已合并的结构化主体外，本集团因在结构化主体中拥有的权益而享有可变回报并不重大，因此，本集团并未合并该等结构化主体。

于2023年6月30日，上述由本集团管理的未合并结构化主体的资产总额为人民币524,732,649,090.82元（2022年12月31日：人民币528,130,258,765.68元）。于2023年6月30日，本集团于上述未合并结构化主体中所持权益账面价值为人民币6,904,960,266.15元（2022年12月31日：人民币9,032,168,591.30元）。

于2023年1-6月，本集团在上述结构化主体中获得的收益包括管理费收入、业绩报酬及投资收益共计人民币458,824,004.39元（2022年1-6月：人民币47,446,485.33元）。

5 本集团在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益，这些结构化主体未纳入本集团的合并财务报表范围，主要包括基金、银行理财产品、信托计划与其他产品。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

于2023年6月30日与2022年12月31日，合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本集团因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情载列如下：

2023年6月30日		
	交易性金融资产 人民币元	合计 人民币元
基金	67,967,838,558.79	67,967,838,558.79
银行理财产品	1,127,404,969.14	1,127,404,969.14
信托计划	33,588,942.55	33,588,942.55
其他	19,000,087,113.34	19,000,087,113.34
合计	<u>88,128,919,583.82</u>	<u>88,128,919,583.82</u>

2022年12月31日		
	交易性金融资产 人民币元	合计 人民币元
基金	43,326,657,239.89	43,326,657,239.89
银行理财产品	841,667,657.05	841,667,657.05
信托计划	884,143,754.54	884,143,754.54
其他	17,907,434,650.19	17,907,434,650.19
合计	<u>62,959,903,301.67</u>	<u>62,959,903,301.67</u>

于2023年6月30日和2022年12月31日，本集团因投资上述基金、银行理财产品、信托计划与其他产品而可能遭受损失的最大风险敞口为其在报告日的公允价值。

八、与金融工具相关的风险

1 风险管理政策及组织架构

(1) 风险管理政策

为了提高集团管理和运营的科学性、规范性和有效性，增强对金融风险的防范能力，保障集团各项业务持续、稳定、快速发展，根据《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司全面风险管理规范》等有关规定并结合业务和管理实际情况，本集团制定了《风险管理基本制度》并经董事会审议通过，明确了风险管理目标、原则、公司总体及各风险类型的风险偏好及容忍度、风险管理流程、相关资源保障及考核机制。经营管理方面，制定并发布了各类专业风险管理指引，明确了各类风险的管理流程及措施、风险指标及限额；此外，经营层面还制定了《风险控制指标管理办法》、《子公司风险管理办法》、《压力测试机制实施方案》、《压力测试实施细则》等政策。具体业务层面，集团根据各业务和管理条线自身的风险点，建立了业务风险管理制度或风险管理手册。

本集团在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险、声誉风险、信息技术风险、合规风险和模型风险等。本集团制定了相应的政策和程序来识别和分析这些风险，并结合实际设定适当的风险指标、风险限额、风险内部控制流程，通过信息系统支持和有效的机制持续管理上述各类风险。

风险管理是本集团所有员工的共同责任，集团通过培训和考核的方式，促进全体员工不断增强风险管理意识和风险敏感度以培养良好的风险管理文化。

(2) 风险治理组织架构

本公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及合规与风险管理委员会，监事会，经营管理层及风险控制委员会，风险管理部及各类专业风险管理部门，其他各部门、分支机构及子公司。

董事会承担公司全面风险管理的最终责任。董事会设合规与风险管理委员会，对风险管理的总体目标、基本政策、风险评估报告进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见。监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。经营管理层根据董事会的授权和批准，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，并下设风险控制委员会。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作。风险管理部履行全面风险管理职责，对经营管理层和公司整体风险负责，牵头管理市场风险、信用风险和操作风险。公司相关职能部门根据职责定位分别负责牵头管理其他类型风险；公司其他各部门、分支机构及子公司对各自条线的风险管理工作负责，落实公司及各类风险牵头管理部门制定的各项政策、流程和措施，接受各类风险牵头管理部门的指导以及风险牵头管理部门对各类风险管理、执行责任的分解。稽查部负责对公同风险管理流程的有效性 & 执行情况进行稽核检查，并牵头对公司全面风险管理体系进行评估。

2 公司面临的主要风险及应对措施

(1) 信用风险管理

信用风险是指因融资方、发行人或交易对手等违约导致损失的风险。公司建立了覆盖自有资金出资及受托资金业务的信用风险管理体系，将境内外子公司纳入统一管理范围，实现信用风险管理全覆盖。

报告期内，本集团面临的信用风险主要包括三类：一是在融资类业务中，融资方违约致使借出资金及息费遭受损失的风险；二是在债券投资业务中，发行人违约造成的风险；三是在交易类业务（含担保交收类业务）中，交易对手方出现违约，导致资产遭受损失的风险。

融资类业务信用风险管理方面，公司执行严格的风险客户与风险资产持续监控、及时化解的管控措施，强化动态的逆周期调节机制，建立市场系统性风险监测及应对机制，加强相关业务贷后管理，以控制业务常规风险、防范底线风险、灵活调节业务结构。

发行人信用风险管理方面，公司建立信用债发行人统一监控平台，实现集团各业务信用债标的的统一监控，同时公司深化信用债全流程风险管控，建立常态化的风险券筛查处置机制，持续强化持仓债券监控预警机制，提升集团发行人信用风险防控成效。

有关债券投资的具体信息，请参见附注五、8、9及10的相关披露。

交易对手信用风险管理方面，公司持续推进交易对手统一管理体系及管理系统优化建设，并根据内外部舆情进一步加强交易对手授信管理，严控尾部风险，对于担保交收类业务，持续完善风险指标设计的前端管控并推进系统化建设，强化风险事件处理和风险传导管控能力。

公司持续优化完善信用风险统一管理体系，提升应对外部复杂信用环境的能力，为各类信用业务发展提供强有力的风控保障。报告期内，公司未发生重大信用风险事件，各项业务平稳运行。

针对买入返售金融资产中的股票质押式回购业务，本集团综合债务人持续还款情况、还款能力及履约保障比例，分析交易面临的违约风险程度，划分三个阶段，确定减值准备，具体方案如下：

描述	预期信用损失阶段	
履约比高于平仓线且未发生逾期	未来 12 个月预期信用损失	第一阶段
履约比高于平仓线、逾期天数不超过 90 天	整个存续期预期信用损失 未发生信用减值	第二阶段
履约比处于平仓区但未逾期		
履约比处于平仓区、逾期天数不超过 90 天	整个存续期预期信用损失 已发生信用减值	第三阶段
履约比低于 100%		
履约比不低于 100%、逾期天数超过 90 天 已进入场内违约处置或场外司法诉讼环节 跟踪到债务人出现重大财务困难、很可能破产或重组等情形		

本集团为不同融资主体及合约设置不同的平仓线，平仓线一般不低于 130%。

针对第一阶段、第二阶段风险合约，本集团根据履约保障比例及逾期天数，按照相应的损失率计提减值准备。于 2023 年 6 月 30 日，第一阶段风险合约减值损失率为 0.37%，无纳入第二阶段的风险合约（于 2022 年 12 月 31 日，第一阶段风险合约减值损失率为 0.42%，无纳入第二阶段的风险合约）。

针对第三阶段风险合约，本集团从每笔合约的标的券及融资人两个维度进行综合评估，评估时考虑的因素包括但不限于标的券的版块、市值、日均成交额、商誉占比、重大风险指标等，以及融资人是否控股股东、是否受减持新规限制、是否黑名单或违约客户、质押比例、担保情况、增信措施等，并结合履约保障比例及逾期天数等指标，对合约进行减值测算，计提相应的减值准备，减值损失率为 10%–100% 不等。

(a) 最大信用风险敞口

在不考虑担保物或其他信用增级措施的情况下，于资产负债表日最大信用风险敞口是指金融资产扣除减值准备后的账面价值。本集团最大信用风险敞口金额列示如下：

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
货币资金	164,061,477,747.38	155,611,548,340.47
结算备付金	38,926,809,547.46	38,745,845,328.92
融出资金	105,412,167,380.85	100,648,374,713.73
交易性金融资产	179,768,016,023.88	180,211,265,413.85
衍生金融资产	15,039,940,496.99	15,788,300,794.08
买入返售金融资产	17,389,635,416.53	34,824,221,391.64
应收款项	9,961,846,848.94	7,804,340,649.41
存出保证金	40,195,073,997.40	42,706,776,632.52
债权投资	50,322,360,053.24	48,552,570,216.94
其他债权投资	15,394,224,826.67	10,504,379,072.24
其他资产（金融资产）	399,977,668.42	631,698,461.95
合计	636,871,530,007.76	636,029,321,015.75

(2) 流动性风险管理

流动性风险，是指本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。本公司已建立了一套完整的流动性风险管理体系，对本公司整体的流动性风险实施识别、计量、监测、控制和报告，并不断提高流动性风险管理的信息化水平，提高流动性风险识别、计量和监测的能力，强化本公司应对流动性风险的能力。此外，本公司根据风险偏好建立规模适当的流动性资产储备，持有充足的优质流动性资产，确保在压力情景下能够及时满足流动性需求。

(3) 市场风险管理

市场风险指市场价格变动，如外汇汇率、利率和证券价格的变动等，影响本集团收入或持有的金融工具的价值而形成的风险。市场风险管理的目标是在可接受范围内管理和控制市场风险，并使风险报酬率最大化。

(a) 汇率风险

汇率风险是指本集团进行的外币业务因外汇汇率变动所产生的风险。本集团除了境外子公司持有以港币或美元为记账本位币的资产及负债外，其他外币资产及负债主要为境内公司持有的外币货币资金、跨境业务中产生的外币金融资产及负债以及子公司所购买的外币金融资产。对于不是以记账本位币计价的货币资金、结算备付金、存出保证金、应收款项、代理买卖证券款、应付款项、应付债券等外币资产和负债，如果出现短期的失衡情况，本集团会在必要时按市场汇率买卖外币，以确保将净风险敞口维持在可接受的水平。本集团的外币资产及外币负债详见附注五、61(1)。

假定除汇率以外的其他风险变量不变，于 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 31 日人民币对美元和港币的汇率变动使人民币升值 10% 将导致本集团股东权益和净利润的变动情况如下。此影响按资产负债表日即期汇率折算为人民币列示，负数表示减少净利润或股东权益，正数表示增加净利润或股东权益。

	股东权益 人民币元	净利润 人民币元
2023 年 6 月 30 日		
美元	(212,182,069.61)	(212,182,069.61)
港币	(3,028,493,681.56)	(1,267,168,136.28)
合计	<u>(3,240,675,751.17)</u>	<u>(1,479,350,205.89)</u>
2022 年 12 月 31 日		
美元	(835,159,428.27)	(835,159,428.27)
港币	(2,964,476,328.32)	(1,483,611,480.57)
合计	<u>(3,799,635,756.59)</u>	<u>(2,318,770,908.84)</u>

于 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 31 日，在假定其他变量保持不变的前提下，人民币对美元和港币的汇率变动使人民币贬值 10% 将导致本集团股东权益和净利润的变化和上表列示的金额相同但方向相反。

上述敏感性分析是假设资产负债表日汇率发生变动，以变动后的汇率对资产负债表日本集团持有的、面临汇率风险的金融工具进行重新计量得出的。

(b) 利率风险

利率风险是指公司的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本公司的生息资产主要为银行存款、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金及债券投资等，付息负债主要为短期借款、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、长期借款、应付债券等。

对于资产负债表日持有的使本集团面临公允价值利率风险的金融工具，本集团利用敏感性分析作为监控利率风险的主要方法。采用敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，将对净利润和股东权益产生的影响。

市场利率的波动主要影响本集团持有的以公允价值计量的生息资产的估值。假设收益率曲线平行移动 100 个基点，且不考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动，对本集团各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

	2023 年 6 月 30 日		2022 年 12 月 31 日	
	股东权益 人民币元	净利润 人民币元	股东权益 人民币元	净利润 人民币元
收益率曲线上平移 100 个基点	(3,267,976,749.14)	(3,072,198,889.72)	(2,732,824,866.00)	(2,606,204,377.00)
收益率曲线下平移 100 个基点	3,730,133,616.03	3,527,580,437.77	3,123,949,951.73	2,991,993,602.91

(c) 其他价格风险

其他价格风险是指本集团所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集团主要投资于证券交易所上市的股票及基金等，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。对于此类风险，本集团采取分散化投资并选取适当的金融工具进行有效风险对冲。

敏感度分析反映本集团的净利润及权益可能发生的即时变动，假设股市指数或其他有关风险变量于报告期末发生变动，且已用于重新计量该等由本集团所持令本集团于报告期末面临权益价格风险的金融工具。在所有其他变量不变的情况下，权益类证券价格变动 10% 对本集团净利润及权益的影响分析如下：

	2023 年 6 月 30 日		2022 年 12 月 31 日	
	净利润敏感度 人民币元	净权益敏感度 人民币元	净利润敏感度 人民币元	净权益敏感度 人民币元
上升 10%	7,629,713,683.86	7,651,413,683.63	6,004,806,187.59	6,024,232,432.86
下降 10%	(7,629,713,683.86)	(7,651,413,683.63)	(6,004,806,187.59)	(6,024,232,432.86)

(4) 操作风险管理

操作风险是指由不完善或有问题的内部程序、人员、系统或外部事件所造成公司损失的风险。风险管理部是本公司操作风险的牵头管理部门，各部门、分支机构、子公司对各自条线的操作风险进行主动管理并对管理效果负责，承担本单位操作风险管理的第一责任。公司利用技术手段防范各项业务及管理流程、关键环节的操作风险，并加强流程管控，以保证操作风险管理的政策、制度能够有效落实。公司运用风险与控制自我评估、关键风险指标监测、损失数据收集作为辅助工具加强对操作风险的管理。

本公司根据财政部、证监会、审计署、原银保监会联合发布的《企业内部控制基本规范》及其配套指引以及监管部门和公司相关工作要求，开展了以风险为导向的内部控制规范建设工作，并开展持续优化，将操作风险自我评估与内控自评相结合，对各业务流程中的固有风险、控制活动等进行了全面梳理、评估，对控制设计及执行的有效性进行了测试，对内控缺陷落实整改，全面梳理优化了公司各业务环节和制度流程，同时补充完善了风险控制矩阵及内控手册，记录了风险点、关键控制活动及业务主要流程图，以保障公司内控措施的到位以及风险管理的有效性。此外，公司在日常工作中将操作风险管理及内部控制工作前移，全程参与新业务的制度流程及方案设计，充分识别和全面评估操作风险，通过设置前端控制、规范业务流程、建立发现型指标、开展培训与检查等前中后管理机制，以落实关键风险点的内部控制措施。

(5) 金融资产转移

在日常业务中，本集团通过卖出回购协议及融出证券将已确认的金融资产转让给对手方。本集团尚保留该部分已转让金融资产的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本集团与客户订立卖出回购协议，借出分类为交易性金融资产的债务证券及债权投资。卖出回购协议是指如下交易，将证券出售并同时达成回购协议，在未来某时间以约定价格购回。即使回购价格是约定的，本集团仍面临着显著的信用风险、市场风险和出售这些证券获取回报的风险。本集团尚保留该部分已转让金融资产的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本集团与客户订立融出证券协议，借出分类为交易性金融资产的股票及交易所交易基金。根据融出证券协议规定，股票及交易所交易基金的法定所有权转让给客户。尽管客户可于协议期间出售相关证券，但有责任于未来指定日期向本集团归还该等证券。由于本集团尚保留该部分已转让证券的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

于 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 31 日，本集团已转移但未终止确认的金融资产及相关负债如下：

2023 年 6 月 30 日	交易性金融资产		债权投资		合计 人民币元
	卖出回购协议 人民币元	融出证券 人民币元	卖出回购协议 人民币元		
转让资产的账面金额	4,038,535,676.00	2,326,129,272.19	-		6,364,664,948.19
相关负债的账面金额	(3,694,923,391.70)	-	-		(3,694,923,391.70)
净头寸	<u>343,612,284.30</u>	<u>2,326,129,272.19</u>	<u>-</u>		<u>2,669,741,556.49</u>

2022 年 12 月 31 日	交易性金融资产		债权投资		合计 人民币元
	卖出回购协议 人民币元	融出证券 人民币元	卖出回购协议 人民币元		
转让资产的账面金额	4,514,082,102.00	2,902,260,211.31	50,458,400.00		7,466,800,713.31
相关负债的账面金额	(4,125,761,264.49)	-	(48,485,730.97)		(4,174,246,995.46)
净头寸	<u>388,320,837.51</u>	<u>2,902,260,211.31</u>	<u>1,972,669.03</u>		<u>3,292,553,717.85</u>

(6) 金融资产和金融负债的抵销

当本集团具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本集团计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额列示。

本集团已就衍生金融工具应用了可执行的总抵销协议进行了抵销列示。

根据本集团与客户签订的权益类收益互换协议，与同一客户间的应收及应付款项于同一结算日以净额结算。

在本集团与香港中央结算有限公司进行持续净额结算的情况下，与该公司间同一结算日内应收及应付款项以净额结算。

九、金融工具的公允价值

下表列示了本集团在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值

1 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

2023年6月30日					
	附注	第一层次 人民币元	第二层次 人民币元	第三层次 人民币元	合计 人民币元
持续的公允价值计量					
资产					
交易性金融资产	五、8	175,861,417,677.25	195,078,781,593.27	18,279,676,081.75	389,219,875,352.27
- 交易性债券投资		1,320,475,013.30	173,199,827,158.25	196,527,481.57	174,716,829,653.12
- 交易性其他债务工具投资		-	-	2,725,057,098.57	2,725,057,098.57
- 交易性权益工具		174,540,942,663.95	21,878,954,435.02	15,358,091,501.61	211,777,988,600.58
衍生金融资产	五、4	145,089,260.14	11,014,963,771.18	3,879,887,465.67	15,039,940,496.99
其他债权投资	五、10	-	14,805,185,465.31	589,039,361.36	15,394,224,826.67
其他权益工具投资	五、11	-	163,720,967.46	107,057,319.78	270,778,287.24
持续以公允价值计量的资产总额		<u>176,006,506,937.39</u>	<u>221,062,651,797.22</u>	<u>22,855,660,228.56</u>	<u>419,924,818,963.17</u>
负债					
交易性金融负债	五、25	(973,413,120.69)	(29,803,904,055.47)	(11,945,106,511.08)	(42,722,423,687.24)
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		(199,925,198.52)	(2,144,522,606.41)	(11,945,106,511.08)	(14,289,554,316.01)
衍生金融负债	五、4	(126,687,278.28)	(10,364,040,355.18)	(3,433,122,388.17)	(13,923,850,021.63)
持续以公允价值计量的负债总额		<u>(1,100,100,398.97)</u>	<u>(40,167,944,410.65)</u>	<u>(15,378,228,899.25)</u>	<u>(56,646,273,708.87)</u>

2022年12月31日

	附注	第一层次 人民币元	第二层次 人民币元	第三层次 人民币元	合计 人民币元
持续的公允价值计量					
资产					
交易性金融资产	五、8	136,749,041,029.33	193,652,471,116.68	21,144,496,603.86	351,546,008,749.87
- 交易性债券投资		1,731,296,851.90	172,159,441,743.75	314,711,018.32	174,205,449,613.97
- 交易性其他债务工具投资		-	-	3,103,555,588.57	3,103,555,588.57
- 交易性权益工具		135,017,744,177.43	21,493,029,372.93	17,726,229,996.97	174,237,003,547.33
衍生金融资产	五、4	109,080,306.21	12,443,938,714.20	3,235,281,773.67	15,788,300,794.08
其他债权投资	五、10	-	9,826,506,114.69	677,872,957.55	10,504,379,072.24
其他权益工具投资	五、11	-	153,792,441.26	87,794,352.32	241,586,793.58
持续以公允价值计量的资产总额		<u>136,858,121,335.54</u>	<u>216,076,708,386.83</u>	<u>25,145,445,687.40</u>	<u>378,080,275,409.77</u>
负债					
交易性金融负债	五、25	(1,591,148,777.66)	(37,324,263,427.50)	(9,660,146,754.76)	(48,575,558,959.92)
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		(315,302,672.11)	(2,092,812,915.15)	(9,660,146,754.76)	(12,068,262,342.02)
衍生金融负债	五、4	(130,351,491.10)	(8,226,124,815.55)	(1,281,648,757.74)	(9,638,125,064.39)
持续以公允价值计量的负债总额		<u>(1,721,500,268.76)</u>	<u>(45,550,388,243.05)</u>	<u>(10,941,795,512.50)</u>	<u>(58,213,684,024.31)</u>

2 持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

对于存在活跃市场的交易性金融资产及负债、衍生金融资产及负债，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。此市场报价取自活跃市场中与成交价，经销商及交易对手以及公平切磋商为基础的市场交易。

3 持续和非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

对于交易性金融资产中的债券投资及交易性金融负债中的债务工具的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

对于交易性金融资产中不存在公开市场的权益工具投资，其公允价值以投资账户管理人提供的账户净值确定。

衍生金融资产和负债的公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日，采用类似衍生金融工具的市场利率将未来现金流折现，以验证报价的合理性。权益互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用相关证券交易所报价计算的相关权益证券回报来确定的。

2023年1-6月，本集团上述持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

4 持续和非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

本集团制定了相关流程来确定持续的第三层次公允价值计量中合适的估值技术和输入值。本集团定期复核相关流程以及公允价值确定的合适性。

第三层次公允价值计量的量化信息如下：

	2023年6月30日的公允价值 人民币元	估值技术	不可观察输入值	对公允价值影响
其他债务工具及私募配售债券	3,510,623,941.50	贴现现金流量模型	经风险调整的贴现率和 预计现金流	经风险调整的贴现率越高，公允价值越低； 预计现金流越高，公允价值越高
未上市股权投资	15,465,148,821.39	市场法	缺乏市场流动性贴现率和 市场乘数	贴现率越高，公允价值越低； 市场乘数越高，公允价值越高
场外衍生合约 - 资产	3,879,887,465.67	布莱克 - 斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
		蒙特卡罗 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
场外衍生合约 - 负债	(3,433,122,388.17)	布莱克 - 斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
		蒙特卡罗 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
私募基金其他合伙人于合并结构 化主体享有的权益	(3,441,084,266.20)	市场法	缺乏市场流动性贴现率和 市场乘数	贴现率越高，公允价值越低； 市场乘数越高，公允价值越高
收益凭证	(8,504,022,244.88)	布莱克 - 斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
		蒙特卡罗 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大

	2022年12月31日的公允价值 人民币元	估值技术	不可观察输入值	对公允价值影响
其他债务工具及私募配售债券	4,096,139,564.44	贴现现金流量模型	经风险调整的贴现率和 预计现金流	经风险调整的贴现率越高，公允价值越低； 预计现金流越高，公允价值越高
未上市股权投资	17,814,024,349.29	市场法	缺乏市场流动性贴现率和 市场乘数	贴现率越高，公允价值越低； 市场乘数越高，公允价值越高
场外衍生合约 - 资产	3,235,281,773.67	布莱克 - 斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
		蒙特卡罗 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
场外衍生合约 - 负债	(1,281,648,757.74)	布莱克 - 斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
		蒙特卡罗 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
私募基金其他合伙人于合并结构 化主体享有的权益	(3,442,856,672.17)	市场法	缺乏市场流动性贴现率和 市场乘数	贴现率越高，公允价值越低； 市场乘数越高，公允价值越高
收益凭证	(6,217,290,082.59)	布莱克 - 斯科尔斯 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大
		蒙特卡罗 期权定价模型	标的资产的价格波动率	价格波动率越大，对公允价值的影响越大

	本期利得或损失总额					增加、发行、出售和结算					对于期末持有的资产和承担的负债，计入损益的当期未实现利得或损失 人民币元
	2022年 1月1日余额 人民币元	转入第三层次 人民币元	转出第三层次 人民币元	计入损益 人民币元	计入其他 综合收益 人民币元	增加 人民币元	发行 人民币元	出售 人民币元	结算 人民币元	2022年 6月30日余额 人民币元	
资产											
交易性金融资产	9,056,536,355.74	141,164,317.81	-	(446,916,480.04)	-	7,703,249,643.99	-	(278,105,809.28)	(888,382,292.31)	15,287,545,735.91	(536,917,770.17)
- 交易性债券投资	499,953,620.97	-	-	1,231,044.69	-	51,537,105.78	-	(219,792,712.53)	(117,987,840.76)	214,941,218.15	4,693,188.19
- 交易性其他债务 工具投资	3,611,228,987.79	-	-	(683,180,467.13)	-	861,832,128.79	-	-	(770,344,451.55)	3,019,536,197.90	(678,635,563.14)
- 交易性权益工具	4,945,353,746.98	141,164,317.81	-	235,032,942.40	-	6,789,880,409.42	-	(58,313,096.75)	(50,000.00)	12,053,068,319.86	137,024,604.78
其他债权投资	909,525,340.69	-	-	65,873,960.32	(18,756,722.61)	268,456,000.00	-	-	(498,378,391.44)	726,720,186.96	-
其他权益工具投资	88,606,603.26	-	-	-	(812,250.94)	-	-	-	-	87,794,352.32	-
衍生金融资产	2,679,712,524.59	-	-	2,171,546,168.69	-	100,273.97	-	(11,967.12)	(100,983,399.24)	4,750,363,600.89	1,699,639,894.65
负债											
衍生金融负债	(2,151,622,141.84)	-	-	(516,979,862.75)	24,820,236.49	(40,364,457.61)	-	50,199,856.05	38,443,575.31	(2,595,502,794.35)	(774,819,925.11)
交易性金融负债	(3,606,853,563.36)	-	-	(130,878,445.22)	-	-	-	-	116,830,101.96	(3,620,901,906.62)	(120,319,706.19)
合计	6,975,905,119.08	141,164,317.81	-	1,142,645,341.00	5,251,262.94	7,931,441,460.35	-	(227,917,920.35)	(1,332,470,405.72)	14,636,019,175.11	267,582,493.18

6 持续的公允价值计量项目，本期内发生各层次之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

对于持续的以公允价值计量的资产和负债，本集团在每个报告期末通过重新评估层次分类（基于对整体公允价值计量有重大影响的最低层次输入值），判断各层次之间是否存在转换。

于财务报告期间，本集团无由第二层次转入第一层次的以公允价值计量的金融资产。转入或转出第三层次是由于部分金融工具的公允价值计量估值技术及输入值发生改变。

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

本集团不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：货币资金、结算备付金、债权投资、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金、应收款项、短期借款、长期借款、应付短期融资款、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付款项、应付债券和其他金融负债等。于 2023 年 6 月 30 日，除债权投资、应付短期融资款以及应付债券外，其他金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。截至 2023 年 6 月 30 日，本集团所持有债权投资账面价值为人民币 50,322,360,053.24 元，公允价值为人民币 51,123,655,473.95 元，本集团所持有应付短期融资款账面价值为人民币 26,762,349,965.71 元，公允价值为人民币 26,772,856,578.61 元，本集团所持有应付债券账面价值为人民币 142,643,834,650.98 元，公允价值为人民币 144,264,079,684.53 元。

十、资本管理

本集团资本管理的主要目标是保障本集团的持续经营，能够通过制定与风险水平相当的产品和服务价格并确保以合理融资成本获得融资的方式，持续为股东提供回报。

本集团定期复核和管理自身的资本结构，力求达到最理想的资本结构和股东回报。本集团考虑的因素包括：本集团未来的资金需求、资本效率、现实的及预期的盈利能力、预期的现金流、预期资本支出等。如果经济状况发生改变并影响本集团，本集团将会调整资本结构。

证监会分别于2020年1月23日和2020年3月20日颁布了经修订的《证券公司风险控制指标计算标准规定》及《证券公司风险控制指标管理办法》，对证券公司必须持续符合的风险控制指标体系及标准进行了修改，并要求于2020年6月1日起施行，本公司须就风险控制指标持续达到下列标准：

1. 净资本与各项风险资本准备之和的比率不得低于100%（“风险覆盖率”）；
2. 净资本与净资产的比率不得低于20%（“净资本/净资产”）；
3. 净资本与负债的比率不得低于8%（“净资本/负债”）；
4. 净资产与负债的比率不得低于10%（“净资产/负债”）；
5. 自营权益类证券及证券衍生品与净资本的比率不得超过100%（“自营权益类证券及其衍生品/净资本”）；
6. 自营非权益类证券及证券衍生品与净资本的比率不得超过500%（“自营非权益类证券及其衍生品/净资本”）；
7. 核心净资本与表内外资产总额的比率不得少于8%（“资本杠杆率”）；
8. 优质流动性资产与未来30天现金净流出量的比率不得少于100%（“流动性覆盖率”）；
9. 可用稳定资金与所需稳定资金的比率不得少于100%（“净稳定资金率”）；及
10. 融资（含融券）的金额与净资本的比率不得超过400%（“融资（含融券）的金额/净资本”）。

净资本指资产净值扣除管理办法所指若干类别资产的风险调整。

于2023年6月30日及2022年12月31日，本公司的净资本及上述比率如下：

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元 (重述后)
净资本（人民币元）	93,158,894,331.82	92,975,958,998.68
风险覆盖率	246.50%	240.14%
净资本/净资产	64.23%	64.73%
净资本/负债	22.80%	23.14%
净资产/负债	35.49%	35.76%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	31.92%	45.73%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	357.77%	316.80%
资本杠杆率	14.24%	14.10%
流动性覆盖率	196.93%	166.57%
净稳定资金率	131.64%	129.33%
融资（含融券）的金额/净资本	133.78%	131.02%

本集团若干子公司与本公司须分别遵守中国大陆、香港和美国监管要求的资本规定。截至2023年6月30日及2022年12月31日，该等子公司均遵守资本规定。

十一、关联方及关联交易

1 主要股东：

持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东单位情况如下

股东名称	注册地	业务性质	注册资本	对本公司的持股比例 (%)	对本公司的表决权比例 (%)	本公司最终控制方
江苏省国信集团有限公司 (注)	南京	国有资产管理等	人民币 300 亿元	15.13	15.13	否
江苏交通控股有限公司	南京	国有资产管理等	人民币 168 亿元	5.39	5.39	否

注：本公司的实际控制人为江苏省政府国有资产管理委员会。

2 本公司的子公司情况

本公司的子公司信息详见附注七、1。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 本集团的联营和合营企业情况

本集团的联营和合营企业详见附注七、2。

4 其他关联方

本期与本集团发生关联方交易，或上年与本集团发生关联交易形成余额的其他关联方情况如下：

名称	关联关系
江苏高科技投资集团有限公司	其他关联法人
高投名力成长创业投资有限公司	其他关联法人
江苏高投鑫海创业投资有限公司	其他关联法人
江苏高投发展创业投资有限公司	其他关联法人
江苏省信用再担保集团有限公司	其他关联法人
江苏高投中小企业创业投资有限公司	其他关联法人
江苏高新创业投资管理有限公司	其他关联法人
江苏省港口集团有限公司	其他关联法人
徐州高新创业投资有限公司	其他关联法人
招银理财有限责任公司	其他关联法人
南京银行股份有限公司	其他关联法人
东部机场集团有限公司	其他关联法人
江苏苏美达资本控股有限公司	其他关联法人
南京白鹭高速客运股份有限公司	其他关联法人
苏州金陵南林饭店有限责任公司	其他关联法人
江苏云杉资本管理有限公司	其他关联法人
南通天生港发电有限公司	其他关联法人
江苏省广播电视信息网络投资有限公司	其他关联法人
金陵饭店股份有限公司	其他关联法人
江苏省苏豪控股集团有限公司	其他关联法人
苏州中方财团控股股份有限公司	其他关联法人
富安达基金管理有限公司	其他关联法人
紫金财产保险股份有限公司	其他关联法人
红星美凯龙家居集团股份有限公司	其他关联法人
伊犁苏新投资基金合伙企业（有限合伙）	其他关联法人
江苏高投毅达中小贰号创业投资合伙企业（有限合伙）	其他关联法人

注：其他关联法人包括其他关联自然人担任董事、高级管理人员的公司和主要股东施加重大影响的公司。其他关联自然人包括本公司董事、监事、高级管理人员及与其关系密切的家庭成员。

5 关联交易情况

(1) 手续费及佣金净收入

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
主要股东及其子公司	债券承销收入	2,884,905.66	1,415,094.34
主要股东及其子公司	代理买卖交易佣金收入	4,856,453.81	5,389,028.73
本集团的联营和合营企业	基金管理费收入	84,007,419.61	76,684,248.60
本集团的联营和合营企业	席位费分仓佣金及销售服务费	74,774,340.09	119,086,647.28
本集团的联营和合营企业	债券承销收入	137,200.00	195,903.14
本集团的联营和合营企业	代理买卖交易佣金收入	141,013.33	1,421.62
本集团的联营和合营企业	银行存管费支出	(197,295.74)	(200,530.03)
其他关联法人	债券承销收入	2,396,132.47	4,522,771.93
其他关联法人	财务顾问收入	-	1,080,000.00
其他关联法人	代理买卖交易佣金收入	226,261.01	131,840.26
其他关联法人	基金管理费收入	3,866,384.83	-
其他关联法人	席位费分仓佣金及销售服务费	79,548.98	-
其他关联法人	银行存管费支出	(684,935.79)	(362,949.39)
其他关联自然人	代理买卖交易佣金收入	27,236.90	62,099.05
合计		172,514,665.16	208,005,575.53

(2) 利息净收入

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	银行存款利息收入	12,790,405.33	3,820,175.05
本集团的联营和合营企业	质押式回购利息支出	(4,447,257.35)	(4,548,732.08)
本集团的联营和合营企业	拆入资金利息支出	(3,286,433.30)	(5,448,555.56)
其他关联法人	质押式正回购利息支出	(12,520,938.95)	(10,116,503.20)
其他关联法人	拆入资金利息支出	-	(607,777.78)
其他关联法人	质押式逆回购利息收入	660,328.79	3,725,875.87
其他关联法人	银行存款利息收入	6,846,757.62	6,953,808.02
其他关联法人	持有债权投资利息收入	-	123,504.93
合计		42,862.14	(6,098,204.75)

(3) 投资收益

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
主要股东及其子公司	持有及处置交易性金融资产收益	1,784,529.90	2,376,786.49
本集团的联营和合营企业	持有及处置交易性金融资产收益	262,568.68	136,696.13
其他关联法人	持有及处置交易性金融资产收益	519,719.79	196,089.13
其他关联法人	持有及处置衍生金融资产损失	(2,786,960.53)	-
合计		<u>(220,142.16)</u>	<u>2,709,571.75</u>

(4) 业务及管理费

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
主要股东及其子公司	广告服务费	(199,000.00)	-
本集团的联营和合营企业	客户维护费支出	(1,496.63)	-
其他关联法人	客户维护费支出	(395,875.17)	-
合计		<u>(596,371.80)</u>	<u>-</u>

(5) 汇兑损失

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
其他关联法人	处置外汇衍生金融工具损失	<u>(76,096.17)</u>	<u>(274,626.32)</u>

(6) 关联租赁出租

出租

承租方名称	租赁资产种类	2023年1-6月确认 的租赁收入 人民币元	2022年1-6月确认 的租赁收入 人民币元
本集团的联营和合营企业	房屋建筑物	<u>1,094,507.26</u>	<u>1,619,067.02</u>

承租

出租方名称	租赁资产种类	2023年1-6月支出 的租赁费用 人民币元	2022年1-6月支出 的租赁费用 人民币元
本集团的联营和合营企业	房屋建筑物	20,911,309.58	23,084,282.80
本集团的联营和合营企业	其他	2,110,619.46	2,698,407.36
合计		<u>23,021,929.04</u>	<u>25,782,690.16</u>

(7) 关联方认购本集团非公开发行债券情况

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	认购债券	1,642,822,600.00	-

(8) 本集团净认购/(赎回)关联方发行债券情况

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
主要股东及其子公司	净认购债券	99,211,294.47	-
主要股东及其子公司	净赎回债券	-	(70,109,842.85)
其他关联法人	净认购债券	10,774,892.74	60,225,224.11
合计		109,986,187.21	(9,884,618.74)

(9) 与关联方相关取得的股利收益

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	收到股利分红	668,485,144.90	1,004,551,629.81

(10) 对关联方投资减少

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	投资净减少	550,601,358.40	(16,449,100.33)

(11) 与关联方开展质押式回购业务及资金拆借情况

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	质押式正回购	53,167,260,000.00	67,979,258,000.00
本集团的联营和合营企业	拆入资金	39,970,000,000.00	49,350,000,000.00
其他关联法人	质押式逆回购	(800,000,000.00)	(13,188,191,000.00)
其他关联法人	质押式正回购	148,258,560,000.00	130,652,685,000.00
其他关联法人	拆入资金	-	2,800,000,000.00
合计		240,595,820,000.00	237,593,752,000.00

(12) 关联方投资本集团发行的结构化票据情况

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	净赎回结构化票据	-	(102,729,346.39)

关联方	关联交易内容	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
本集团的联营和合营企业	支付结构化票据投资收益	-	9,074,810.78

(13) 关键管理人员报酬

2023年1-6月，本公司董事、监事和高级管理人员从本公司领取的本期税前薪酬总额为人民币2,165.91万元，本公司向董事、监事及高级管理人员支付以往年度税前延期薪酬总额为人民币1,441.12万元（含任期激励）。

6 关联方款项余额

(1) 应收关联方款项

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日		2022年12月31日	
		账面余额 人民币元	坏账准备 人民币元	账面余额 人民币元	坏账准备 人民币元
主要股东及其子公司	代垫费用	41,000.00	(200.00)	41,000.00	(200.00)
本集团的联营和合营企业	席位费分仓佣金及销售服务费	40,347,201.54	(201,736.01)	77,311,394.03	(386,556.97)
本集团的联营和合营企业	应收承销保荐费	209,488.89	(1,047.44)	119,600.00	(1,176.00)
本集团的联营和合营企业	应收管理费	103,643,693.31	-	151,529,409.71	-
本集团的联营和合营企业	代垫费用	2,445,152.79	(6,909.46)	3,238,963.56	(273,292.44)
其他关联法人	席位费分仓佣金及销售服务费	14,088.18	(70.44)	26,651.09	(133.26)
其他关联法人	应收承销保荐费	43,621.95	(218.11)	1,237,650.00	(7,088.25)
其他关联法人	代垫费用	20,000.00	-	20,000.00	-
合计		146,764,246.66	(210,181.46)	233,524,668.39	(668,446.92)

(2) 存放关联方款项

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
本集团的联营和合营企业	银行存款	1,118,007,296.29	1,855,132,248.19
其他关联法人	银行存款	148,681,846.34	1,381,159,592.66
合计		1,266,689,142.63	3,236,291,840.85

(3) 应付关联方款项

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
主要股东及其子公司	应付款项	3,211,190.78	3,211,190.78
主要股东及其子公司	代理买卖证券款	109,457,309.57	52,450,431.97
本集团的联营和合营企业	代理买卖证券款	48,782,959.05	34,060,111.79
本集团的联营和合营企业	应付款项	687,947.70	4,055,657.89
其他关联法人	代理买卖证券款	21,513,873.78	3,881,731.02
其他关联法人	应付款项	809,250.30	1,894,353.67
其他关联自然人	代理买卖证券款	9,898,557.46	7,725,103.38
合计		<u>194,361,088.64</u>	<u>107,278,580.50</u>

(4) 关联方资金拆借

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
本集团的联营和合营企业	拆入资金	<u>1,100,179,666.67</u>	<u>500,143,055.56</u>

(5) 关联方逆回购

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
其他关联法人	质押式逆回购	<u>700,149,315.09</u>	<u>280,323,890.42</u>

(6) 关联方正回购

关联方	关联方交易内容	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
其他关联法人	质押式正回购	-	298,810,963.36

(7) 关联租赁

出租方名称	租赁资产种类	2023年6月30日 使用权资产 人民币元	2022年12月31日 使用权资产 人民币元
主要股东及其子公司	房屋建筑物	397,299.76	482,435.44
本集团的联营和合营企业	房屋建筑物	49,662,228.27	49,802,749.74
本集团的联营和合营企业	其他	2,306,402.31	4,612,804.20
合计		<u>52,365,930.34</u>	<u>54,897,989.38</u>

出租方名称	租赁资产种类	2023年6月30日 租赁负债 人民币元	2022年12月31日 租赁负债 人民币元
主要股东及其子公司	房屋建筑物	354,981.04	348,470.76
本集团的联营和合营企业	房屋建筑物	58,874,674.80	59,994,280.69
本集团的联营和合营企业	其他	2,092,207.63	4,141,322.95
合计		<u>61,321,863.47</u>	<u>64,484,074.40</u>

十二、股份支付

	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
以权益结算的股份支付：				
- A 股限制性股票股份支付	223,981,176.43	47,434,340.16	(115,774,756.02)	155,640,760.57
- 美国子公司股份支付	1,273,641,192.90	69,240,732.24	-	1,342,881,925.14
以现金结算的股份支付	-	585,089.50	-	585,089.50
合计	1,497,622,369.33	117,260,161.90	(115,774,756.02)	1,499,107,775.21

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团资本公积中确认以权益结算的股份支付的累计金额为人民币 1,614,297,441.73 元。本期以权益结算的股份支付确认的费用总额为人民币 116,675,072.40 元。截至 2023 年 6 月 30 日，本集团应付职工薪酬中确认以现金结算的股份支付的累计金额为人民币 585,089.50 元。本期以现金结算的股份支付确认的费用总额为人民币 585,089.50 元。

1 A 股限制性股票股份支付总体情况

2021 年 3 月 23 日，本公司召开第五届董事会第十四次会议及第五届监事会第八次会议，审议通过了《关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项的议案》和《关于向激励对象授予 A 股限制性股票的议案》，确定以 2021 年 3 月 29 日为授予日，向符合条件的 813 名激励对象授予 45,640,000 股 A 股限制性股票，授予价格为人民币 9.10 元/股。在本激励计划授予日确定后的实际认购过程中，激励对象因个人原因由 813 人减少为 810 人，实际完成认购 45,488,000 股。

限制性股票激励计划授予的限制性股票限售期分别为自授予登记完成之日起分三批解禁。解除限售后，本公司为满足解除限售条件的激励对象统一办理解除限售事宜，对于未满足解除限售条件的激励对象，本公司将回购其持有的该次解除限售对应的限制性股票。

2023 年 3 月 30 日，本公司第六届董事会第二次会议及第六届监事会第二次会议分别审议通过了《关于公司 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件成就的议案》和《关于公司回购注销部分 A 股限制性股票的议案》。公司独立董事发表了独立意见，公司监事会出具了核查意见。本次可解除限售的限制性股票数量合计为 14,222,943 股，约占目前公司总股本的 0.16%。

本期发生的股份支付如下：

股数	2023 年 1-6 月	2022 年 1-6 月
公司期初的 A 股限制性股票股权	43,788,054	44,463,027
公司本期授予的 A 股限制性股票股权	-	-
公司本期行权的 A 股限制性股票股权	-	-
公司本期失效的 A 股限制性股票股权	(286,719)	(36,000)
公司本期到期的 A 股限制性股票股权	(14,222,943)	-
公司期末的 A 股限制性股票股权	29,278,392	44,427,027
公司期末可行权的 A 股限制性股票股权	29,278,392	44,427,027

本期发生的股份支付费用如下：

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
以权益结算的股份支付	47,434,340.16	63,909,907.57

于2023年1-6月，上述股份支付费用中，对应本公司董事、监事和高级管理人员部分为人民币6,121,052.23元。

(1) 授予日权益工具公允价值的确定方法如下：

本公司授予的限制性股票公允价值为授予日当天的收盘价。

(2) 对可行权权益工具数量的确定依据：

在等待期内每个资产负债表日，根据最新取得的可行权职工人数变动等后续信息做出最佳估计，修正预计可行权的权益工具数量。在可行权日，最终预计可行权权益工具的数量与实际可行权工具的数量一致。

2 美国子公司股份支付总体情况

2019年7月3日，AssetMark Financial Holdings, Inc. 通过了2019年股权激励计划，该计划于2019年7月17日生效，即AssetMark Financial Holdings, Inc. 首次公开发售登记表S-1的生效日期。

(1) 限制性股票激励 (RSAs)

于2019年7月17日，AssetMark Financial Holdings, Inc. 将总数等同于6,309,049股AssetMark Financial Holdings, Inc. 股份的限制性股票激励 (RSAs) 授予普通股持有人。

(2) 股票期权

AssetMark Financial Holdings, Inc. 于首次公开发售时授予部分管理人员股票期权，该等股票期权可获得总数为918,981股普通股，行权价格为每股22美元。自2019年7月18日起三年内，上述股票期权计划以大致相等的分期方式于每一年间行权。AssetMark Financial Holdings, Inc. 使用布莱克-斯科尔斯 (Black-Scholes) 期权定价模型估算股票期权的公允价值。

(3) 限制性股票单位 (RSUs)

AssetMark Financial Holdings, Inc. 同样于首次公开发售时授予部分管理人员限制性股票单位 (RSUs)，总数为 85,737 股普通股。自 2019 年 7 月 18 日起三年内，上述限制性股票单位计划以大致相等的分期方式于每一年间行权。AssetMark Financial Holdings, Inc. 后续分别于 2020 年及 2021 年授予高级管理人员、特定员工及独立董事限制性股票单位 (RSUs)，上述限制性股票单位在授予日起的四年内大致相等的分期方式于每一年间行权。AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2023 年上半年授予管理人员、特定员工及独立董事共计 579,758 份限制性股票单位 (RSUs)。上述 RSUs 大部分在将在授予日起的四年内大致相等的分期方式于每一年间行权。

(4) 股票增值权 (SARs)

2020 年 6 月 9 日，AssetMark Financial Holdings, Inc. 就 2019 年股权激励计划项下的 831,902 股公司普通股向部分高管发行了股票增值权 (SARs)。股票增值权的执行价等于授予日公司普通股的公平市价，并计划在 2020 年 6 月 9 日起四年内大致相等的分期方式于每一年间行权。行权后，每一个 SARs 将以公司普通股股份结算，其价值等于行权日公司普通股的公平市价超过执行价的部分（如有）。于 2021 年 7 月，AssetMark Financial Holdings, Inc. 再次向部分高管授予股票增值权 (SARs)，并计划在 2021 年 7 月起四年内大致相等的分期方式于每一年间行权。行权后，每一个 SARs 将以公司普通股股份结算，其价值等于行权日公司普通股的公允价值超过执行价的部分（如有）。AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2023 年上半年向部分高管授予共计 109,889 份股票增值权 (SARs)，并计划在授予日起四年内大致相等的分期方式于每一年间行权。

AssetMark Financial Holdings, Inc. 于 2023 年上半年向部分高管授予共计 338,907 份以现金结算的股票增值权 (Cash-settled SARs)。以现金结算的股票增值权的执行价等于授予日公司普通股的公平市价，并计划在授予日起四年内大致相等的分期方式于每一年间行权，前提是被授予者继续受雇且签有 10 年的合约。行权后，每一个 SARs 将以现金结算，其价值等于行权日公司普通股的公平市价超过执行价的部分（如有）。

十三、分部报告

1 业务分部

(1) 报告分部的确定依据与会计政策

本集团根据内部组织结构、管理要求及内部报告制度确定了财富管理分部，机构服务分部，投资管理分部，国际业务分部和其他分部共五个报告分部。每个报告分部为单独的业务分部，提供不同的劳务，由于每个分部需要不同的技术及市场策略而需要进行单独的管理。本集团管理层将会定期审阅不同分部的财务信息以决定向其配置资源、评价业绩，业绩评价的主要指标为利润总额。

财富管理分部代理客户买卖股票、基金、债券及期货，向客户提供各种金融产品销售服务和资产配置服务，此外，本分部亦提供融资融券、股票质押式回购及销售金融产品服务。

机构服务分部主要包括投资银行业务，研究业务与机构销售业务，权益证券投资及交易、固定收益投资及交易、OTC 金融产品与交易等业务。

投资管理分部主要包括资产管理业务，私募股权投资，另类投资及商品交易与套利。

国际业务分部主要包括境外子公司的海外业务。

其他分部业务主要包括总部的其他运营，主要包括利息收入，母公司参股联营公司所享有的权益，运营资金利息支出以及中后台的成本和费用。

(2) 报告分部的财务信息

	2023年1-6月						合计 人民币元
	财富管理 人民币元	机构服务 人民币元	投资管理 人民币元	国际业务 人民币元	其他 人民币元	分部间抵消 人民币元	
营业收入							
手续费及佣金净收入	2,849,314,525.53	1,925,648,786.51	775,351,888.28	2,058,015,023.79	(10,955,176.26)	(49,576,059.78)	7,547,798,988.07
利息净收入/(支出)	3,028,709,659.69	(1,191,335,079.66)	(172,005,624.47)	(1,019,157,765.37)	(15,624,026.50)	10,642,038.36	641,229,202.05
投资收益/(亏损)	69,488,398.65	2,508,258,131.64	840,628,846.34	4,041,495,661.07	2,885,009,944.74	(992,439,612.93)	9,352,441,369.51
公允价值变动(损失)/收益	(20,847,191.39)	989,291,759.86	25,438,514.78	(3,371,237,797.15)	91,291,405.90	-	(2,286,063,308.00)
其他	874,969,601.20	(153,187,043.92)	70,721,121.69	2,166,202,464.43	187,947,644.93	(32,765,718.19)	3,113,888,070.14
营业收入合计	6,801,634,993.68	4,078,676,554.43	1,540,134,746.62	3,875,317,586.77	3,137,669,792.81	(1,064,139,352.54)	18,369,294,321.77
营业支出	(2,775,463,013.44)	(1,918,313,112.01)	(538,101,645.13)	(2,927,573,338.50)	(1,587,845,030.85)	64,983,854.92	(9,682,312,285.01)
营业利润/(亏损)	4,026,171,980.24	2,160,363,442.42	1,002,033,101.49	947,744,248.27	1,549,824,761.96	(999,155,497.62)	8,686,982,036.76
利润/(亏损)总额	4,023,785,123.50	1,589,956,248.03	1,002,036,176.82	806,011,248.27	1,574,795,233.25	(999,155,497.62)	7,997,428,532.25
分部资产	288,829,008,009.98	343,458,581,183.60	40,517,996,257.34	179,241,398,482.08	193,449,110,508.28	(158,425,836,338.97)	887,070,258,102.31
分部负债	(279,194,018,912.26)	(336,218,296,532.20)	(18,477,031,816.47)	(161,536,522,669.96)	(79,556,874,343.91)	158,425,836,338.97	(716,556,907,935.83)
补充信息							
利息收入	5,315,389,116.26	651,237,337.44	71,863,245.12	549,343,158.58	833,190,842.17	(158,182,578.62)	7,262,841,120.95
利息支出	(2,286,679,456.57)	(1,842,572,417.10)	(243,868,869.59)	(1,568,500,923.95)	(848,814,868.67)	168,824,616.98	(6,621,611,918.90)
折旧与摊销费用	(284,971,106.07)	(101,165,292.76)	(44,184,037.54)	(214,248,409.72)	(281,675,224.06)	15,359,799.19	(910,884,270.96)
资本性支出	63,716,388.64	31,060,942.31	14,131,011.26	103,300,404.51	184,654,318.06	-	396,863,064.78
信用减值转回/(损失)	487,273,755.79	10,691,754.94	(141,541.99)	(56,754,055.28)	(23,058,316.51)	-	418,011,596.95

2022年1-6月

	财富管理 人民币元	机构服务 人民币元	投资管理 人民币元	国际业务 人民币元	其他 人民币元	分部间抵消 人民币元	合计 人民币元
营业收入							
手续费及佣金净收入	3,233,970,813.75	2,053,111,029.02	722,280,811.87	1,572,826,471.07	(12,244,515.87)	(41,046,235.34)	7,528,898,374.50
利息净收入/(支出)	3,119,969,314.15	(931,258,011.61)	(61,649,636.09)	(262,837,682.53)	(489,255,649.69)	10,381,999.57	1,385,350,333.80
投资收益/(亏损)	58,602,663.35	(592,831,896.92)	350,528,171.18	(1,021,217,569.55)	1,937,920,120.67	7,793,173.55	740,794,662.28
公允价值变动收益/(损失)	(19,385,953.77)	1,871,158,826.67	(990,585,440.85)	2,550,371,839.13	65,550,182.76	-	3,477,109,453.94
其他	2,003,053,920.19	117,162,030.59	43,587,095.40	323,365,943.62	569,018,280.23	(22,241,002.37)	3,033,946,267.66
营业收入合计	8,396,210,757.67	2,517,341,977.75	64,161,001.51	3,162,509,001.74	2,070,988,418.10	(45,112,064.59)	16,166,099,092.18
营业支出							
营业支出	(4,006,216,789.49)	(1,708,103,821.97)	(407,537,183.36)	(1,903,737,346.88)	(1,404,483,558.78)	60,471,080.57	(9,369,607,619.91)
营业利润/(亏损)	4,389,993,968.18	809,238,155.78	(343,376,181.85)	1,258,771,654.86	666,504,859.32	15,359,015.98	6,796,491,472.27
利润/(亏损)总额	4,388,132,515.53	809,005,026.32	(343,373,612.40)	1,258,083,843.36	646,789,164.52	15,359,015.98	6,773,995,953.31
截止2022年12月31日							
分部资产(经重述)	282,826,739,933.94	338,717,045,515.03	39,880,992,609.57	160,618,093,582.14	189,193,383,709.33	(164,665,265,765.01)	846,570,989,585.00
分部负债(经重述)	(278,153,206,146.15)	(333,267,313,226.24)	(18,205,051,100.99)	(144,243,708,411.67)	(69,510,366,471.99)	164,665,265,765.01	(678,714,379,592.03)
补充信息							
利息收入	5,292,863,613.83	305,475,795.14	80,340,043.09	214,687,620.73	909,186,040.57	(44,076,600.27)	6,758,476,513.09
利息支出	(2,172,894,299.68)	(1,236,733,806.75)	(141,989,679.18)	(477,525,303.26)	(1,398,441,690.26)	54,458,599.84	(5,373,126,179.29)
折旧与摊销费用	(270,150,635.55)	(85,066,150.09)	(36,809,397.19)	(172,388,724.97)	(181,473,966.31)	18,079,708.13	(727,809,165.98)
资本性支出	66,800,059.85	10,988,957.94	1,468,394.49	176,425,189.62	190,067,789.28	-	445,750,391.18
信用减值转回/(损失)	283,914,678.53	(488,400.00)	1,257,421.92	48,433,129.23	4,507,635.49	-	337,624,465.17

2 地区信息

本集团按不同地区列示的有关 (i) 取得的对外交易收入及 (ii) 固定资产、在建工程、投资性房地产、商誉、无形资产、长期待摊费用及长期股权投资等非流动资产（简称“非流动资产”）的信息如下。对外交易收入的地区分布是按接受服务的客户所在地进行划分。非流动资产是按资产实物所在地（对于固定资产、在建工程、投资性房地产和长期待摊费用而言）或被分配到相关业务的所在地（对商誉和无形资产而言）或联营企业的所在地进行划分。

国家或地区	对外交易收入总额		非流动资产总额	
	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
中国大陆	14,493,976,735.00	13,003,590,090.44	28,429,188,062.66	27,561,898,295.95
境外（注）	3,875,317,586.77	3,162,509,001.74	9,692,924,117.71	9,273,730,346.41
合计	<u>18,369,294,321.77</u>	<u>16,166,099,092.18</u>	<u>38,122,112,180.37</u>	<u>36,835,628,642.36</u>

注：境外主要是中国香港及美国。

3 主要客户

于2023年1-6月及2022年1-6月，本集团来自各单一客户的收入均低于本集团总收入的10%。

十四、或有事项

1 未决诉讼仲裁形成的或有负债及其财务影响

本集团在日常经营中会涉及索赔、法律诉讼或监管机构调查。截至2023年6月30日及2022年12月31日，根据法庭裁决及管理层的判断，已对本集团作为被告方的法律或仲裁案件产生的索赔金额计提预计负债。本集团认为法院的最终裁决对本集团的财务状况或经营不会造成重大影响。截至2023年6月30日，本集团作为被告方的重大法律诉讼列示如下：

集团子公司华泰联合证券有限责任公司，于2020年9月25日收到上海金融法院发送的《应诉通知书》等相关诉讼材料，原告中国邮政储蓄银行股份有限公司因投资美吉特ABS未得到全额兑付，诉至法院要求该专项计划管理人（被告一）、法律顾问（被告二）、评级机构（被告三）、原始权益人（被告四）及财务顾问华泰联合证券股份有限公司（被告五）承担连带赔偿责任，赔偿原告投资损失人民币5.27亿元及相关利息。上海金融法院分别于2023年4月14日一审判决华泰联合证券有限责任公司承担连带赔偿责任，4月26日华泰联合证券有限责任公司提交上诉申请，一审判决尚未生效。截至2023年6月30日，二审案件已正式立案，尚未开庭。结合一审判决结果以及企业会计准则的相关要求，本集团认为该案件已达到预计负债的确认条件，对该索赔金额计提预计负债人民币5.70亿元。

2 提供债务担保形成的或有负债及其财务影响

于2021年4月，本公司作为担保人与花旗国际有限公司（作为受托人）签署担保协议，为本集团子公司Pioneer Reward Limited发行的含三年期品种9亿美元和五年期品种5亿美元债券提供无条件及不可撤销的保证担保。担保金额不超过上述债券本金、利息及其他相关费用。

于2022年3月，本公司作为担保人与花旗国际有限公司（作为受托人）签署担保协议，为本集团子公司Pioneer Reward Limited发行的10亿美元债券提供无条件及不可撤销的保证担保。担保金额不超过上述债券本金、利息及其他相关费用。

于2022年9月，本公司作为担保人与花旗国际有限公司（作为受托人）签署担保协议，为本集团子公司Pioneer Reward Limited发行的50亿元人民币债券提供无条件及不可撤销的保证担保。担保金额不超过上述债券本金、利息及其他相关费用。

3 其他或有负债及其财务影响

截至2023年6月30日，本集团不存在其他或有负债。

4 或有资产

截至2023年6月30日，本集团不存在或有资产。

十五、承诺事项

1 重大承诺事项

(1) 资本承担

项目	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
已签约但未拨付	3,472,951,177.36	3,130,050,617.80

上述资本承担主要为本集团证券包销承诺。

十六、其他重要事项

1 资产负债表日后事项

(1) 发行公司债券

于2023年6月30日后至本报告日期，本公司发行公司债1期，规模为人民币20亿元，年利率为2.64%。

于2023年6月30日后至本报告日期，本集团境外全资子公司华泰国际金融控股有限公司旗下附属公司华泰国际财务有限公司发行中期票据23笔，累计规模为美元3.87亿元，港币4.29亿元，年利率范围为0.00%至6.17%。

于2023年6月30日后至本报告日期，本集团境外间接全资子公司Pioneer Reward Limited发行中期票据1笔，规模为美元8.00亿元，年利率为5.25%。

(2) 于会计期间后的提供债务担保形成的或有负债及其财务影响

于2023年8月，本公司作为担保人与香港上海汇丰银行有限公司（作为受托人）签署担保协议，为本集团子公司Pioneer Reward Limited发行的8亿美元债券提供无条件及不可撤销的保证担保。担保金额不超过上述债券本金、利息及其他相关费用。

(3) 利润分配

根据公司2023年6月30日的2022年年度股东大会决议，公司2022年度利润分配采用现金分红的方式，以公司总股本9,075,589,027股扣除存放于公司回购专用证券账户的45,278,495股和拟回购注销的925,692股A股股份，即以9,029,384,840股为基数，每10股派发现金红利人民币4.50元（含税），分配现金红利总额为人民币4,063,223,178.00元，已于2023年8月11日发放完毕。

(4) 收购子公司

2023年8月，本公司通过北京产权交易所摘牌方式受让了华泰联合证券有限责任公司（以下简称“华泰联合”）另一股东中国东方航空集团有限公司所持有的华泰联合0.0812%股权。截至本报告出具日，华泰联合的股权变更涉及的工商变更登记等手续尚在办理。

2 新设证券营业部

截至2023年6月30日，本公司无新获准设立营业部。

3 其他需要披露的重要事项

(1) 融资融券业

(i) 融资融券业务明细情况

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
融出资金	105,412,167,380.85	100,648,374,713.73
融出证券	2,326,129,272.19	2,902,260,211.31
合计	<u>107,738,296,653.04</u>	<u>103,550,634,925.04</u>

融出资金详见附注五、3。

(ii) 融券业务明细情况

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
融出证券		
- 交易性金融资产	2,326,129,272.19	2,902,260,211.31
- 转融通融入证券	14,936,319,003.87	15,407,921,802.73
融出证券总额	<u>17,262,448,276.06</u>	<u>18,310,182,014.04</u>
转融通融入证券总额	<u>32,763,118,878.08</u>	<u>32,918,667,089.21</u>

(iii) 融出资金及融出证券担保物公允价值

	2023年6月30日 人民币元	2022年12月31日 人民币元
股票	298,079,423,868.61	283,187,259,855.79
基金	30,934,306,385.40	28,829,001,204.11
货币资金	9,882,004,266.35	11,097,378,377.30
债券	1,399,506,668.74	942,065,789.17
合计	<u>340,295,241,189.10</u>	<u>324,055,705,226.37</u>

(iv) 本期融券业务无违约情况

(2) 本集团 2023 年 1-6 月为履行社会责任，在公益项目、慈善捐赠、乡村振兴等方面的支出为人民币 2,226,380.00 元 (2022 年 1-6 月：19,674,405.89 元)

(3) 以公允价值计量的资产和负债

2023 年 6 月 30 日

	期初余额 人民币元	本期公允 价值变动损益 人民币元	计入权益的累计 公允价值变动 人民币元	本期计提的减值 人民币元	期末余额 人民币元
金融资产					
交易性金融资产	351,546,008,749.87	4,364,568,690.44	-	-	389,219,875,352.27
衍生金融资产	15,788,300,794.08	(3,138,818,498.68)	(42,643,579.65)	-	15,039,940,496.99
其他权益工具投资	241,586,793.58	-	19,511,192.72	-	270,778,287.24
其他债权投资	10,504,379,072.24	-	49,369,717.77	44,079,879.70	15,394,224,826.67
金融资产小计	<u>378,080,275,409.77</u>	<u>1,225,750,191.76</u>	<u>26,237,330.84</u>	<u>44,079,879.70</u>	<u>419,924,818,963.17</u>
金融负债					
交易性金融负债	(48,575,558,959.92)	(33,942,054.51)	-	-	(42,722,423,687.24)
衍生金融负债	(9,638,125,064.39)	(3,477,871,445.25)	84,393,240.66	-	(13,923,850,021.63)
金融负债小计	<u>(58,213,684,024.31)</u>	<u>(3,511,813,499.76)</u>	<u>84,393,240.66</u>	<u>-</u>	<u>(56,646,273,708.87)</u>

注：本表不存在必然的勾稽关系。

(4) 外币金融资产和金融负债

2023 年 6 月 30 日

	期初余额 人民币元	本期公允 价值变动损益 人民币元	计入权益的累计 公允价值变动 人民币元	本期计提的减值 人民币元	期末余额 人民币元
金融资产					
交易性金融资产	70,126,750,328.58	2,832,754,673.17	-	-	68,992,760,342.53
衍生金融资产	8,209,434,471.93	(2,857,075,531.14)	(42,643,579.65)	-	16,031,575,438.09
债权投资	248,496,154.60	-	-	332,833.11	256,173,609.45
其他权益工具投资	153,792,441.26	-	1,648,225.26	-	163,720,967.46
其他债权投资	2,807,158,992.53	-	(21,413,003.14)	44,073,592.44	3,564,630,888.01
金融资产小计	<u>81,545,632,388.90</u>	<u>(24,320,857.97)</u>	<u>(62,408,357.53)</u>	<u>44,406,425.55</u>	<u>89,008,861,245.54</u>
金融负债					
交易性金融负债	(33,285,171,072.99)	30,865,835.37	-	-	(27,078,791,742.27)
衍生金融负债	(6,003,925,686.95)	2,713,746,472.03	84,393,240.66	-	(15,227,329,768.48)
金融负债小计	<u>(39,289,096,759.94)</u>	<u>2,744,612,307.40</u>	<u>84,393,240.66</u>	<u>-</u>	<u>(42,306,121,510.75)</u>

注：本表不存在必然的勾稽关系。

(5) 所有权或使用权受到限制的资产

	2023 年 6 月 30 日 人民币元	2022 年 12 月 31 日 人民币元
货币资金	1,112,327,732.11	1,205,332,921.99
交易性金融资产	144,218,621,295.29	140,361,422,569.66
债权投资	27,103,324,222.00	47,753,034,524.11
其他债权投资	10,066,597,757.94	3,466,393,750.00
长期股权投资	4,985,961,196.68	4,648,621,810.98
合计	<u>187,486,832,204.02</u>	<u>197,434,805,576.74</u>

(6) 金融资产计量基础分类表

金融资产项目	2023年6月30日账面金额					
	以摊余成本计量的金融资产 人民币元	以公允价值计量 且其变动计入其他综合 收益的金融资产 人民币元	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益 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 人民币元	按照《套期会计》准则指定为 以公允价值计量且其变动计入 其他综合收益的金融资产 人民币元	以公允价值计量且其变动计入当期损益 按照《金融工具确认和计量》准 则指定为以公允价值计量且其变 动计入当期损益的金融资产 人民币元	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 人民币元
货币资金	164,061,684,330.57	-	-	-	-	-
结算备付金	38,926,809,547.46	-	-	-	-	-
融出资金	105,412,167,380.85	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	389,219,875,352.27	-
衍生金融资产	-	-	-	-	15,039,940,496.99	-
买入返售金融资产	17,389,635,416.53	-	-	-	-	-
应收款项	9,961,846,848.94	-	-	-	-	-
存出保证金	40,195,073,997.40	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	270,778,287.24	-	-	-
其他债权投资	-	15,394,224,826.67	-	-	-	-
债权投资	50,322,360,053.24	-	-	-	-	-
其他资产	399,977,668.42	-	-	-	-	-

2023年6月30日账面金额

金融负债项目	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		按照《会计准则》准则指定为以公允价值计量的金融负债 人民币元
	以摊余成本计量的金融负债 人民币元	按照《会计准则》准则指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融负债 人民币元	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 人民币元	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 人民币元	
短期借款	13,664,406,676.41	-	-	-	-
应付短期融资款	26,762,349,965.71	-	-	-	-
拆入资金	34,690,063,707.60	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	28,432,869,371.23	14,289,554,316.01	-
衍生金融负债	-	60,040,131.43	13,863,809,890.20	-	-
卖出回购金融资产款	145,964,883,118.45	-	-	-	-
代理买卖证券款	159,354,314,296.21	-	-	-	-
代理承销证券款	173,451,206.49	-	-	-	-
应付款项	112,722,381,912.00	-	-	-	-
长期借款	657,557,638.84	-	-	-	-
应付债券	142,643,834,650.98	-	-	-	-
其他负债	6,328,481,284.78	-	-	-	-

2022年12月31日账面金额

金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产 人民币元	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 人民币元	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 人民币元	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量的金融资产 人民币元	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量的金融资产 人民币元	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量的金融资产 人民币元
货币资金	155,611,751,475.45	-	-	-	-	-
结算备付金	38,745,845,328.92	-	-	-	-	-
融出资金	100,648,374,713.73	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	351,546,008,749.87	-	-
衍生金融资产	-	-	-	42,643,579.65	-	-
买入返售金融资产	34,824,221,391.64	-	-	-	-	-
应收款项	7,804,340,649.41	-	-	-	-	-
存出保证金	42,706,776,632.52	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	241,586,793.58	-	-	-
其他债权投资	-	10,504,379,072.24	-	-	-	-
债权投资	48,552,570,216.94	-	-	-	-	-
其他资产	631,698,461.95	-	-	-	-	-

2022年12月31日账面金额

金融负债项目	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	
	以摊余成本计量的金融负债 人民币元	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计 量且其变动计入其他综合收益的金融负债 人民币元	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 人民币元	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 人民币元
短期借款	7,997,434,369.44	-	-	-
应付短期融资款	25,772,603,803.83	-	-	-
拆入资金	25,877,713,063.31	-	-	-
交易性金融负债	-	-	36,507,296,617.90	-
衍生金融负债	-	-	9,638,125,064.39	-
卖出回购金融资产款	144,117,998,464.81	-	-	-
代理买卖证券款	152,551,723,234.45	-	-	-
代理承销证券款	150,460,486.80	-	-	-
应付款项	105,297,640,231.52	-	-	-
长期借款	804,902,959.53	-	-	-
应付债券	139,419,337,853.75	-	-	-
其他负债	1,461,259,293.43	-	-	-

十七、母公司财务报表主要项目注释

1 长期股权投资

(1) 按类别列示

2023年6月30日			
	账面余额 人民币元	减值准备 人民币元	账面价值 人民币元
对子公司投资	24,760,872,963.77	-	24,760,872,963.77
对联营企业投资	15,075,170,174.46	-	15,075,170,174.46
合计	<u>39,836,043,138.23</u>	<u>-</u>	<u>39,836,043,138.23</u>

2022年12月31日			
	账面余额 人民币元	减值准备 人民币元	账面价值 人民币元
对子公司投资	24,746,871,106.91	-	24,746,871,106.91
对联营企业投资	14,170,428,190.31	-	14,170,428,190.31
合计	<u>38,917,299,297.22</u>	<u>-</u>	<u>38,917,299,297.22</u>

(2) 对子公司的投资

单位名称	期初余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	期末余额 人民币元	减值准备 期末余额 人民币元
华泰联合证券有限责任公司	1,317,806,088.36	6,086,428.36	-	1,323,892,516.72	-
华泰期货有限公司	3,562,816,504.95	340,942.71	-	3,563,157,447.66	-
华泰紫金投资有限责任公司	5,205,369,129.09	1,205,662.90	-	5,206,574,791.99	-
华泰国际金融控股有限公司	8,669,101,513.15	3,537,511.88	-	8,672,639,025.03	-
江苏股权交易中心有限责任公司	104,306,907.23	67,963.64	-	104,374,870.87	-
华泰创新投资有限公司	2,601,207,168.46	267,323.63	-	2,601,474,492.09	-
华泰证券(上海)资产管理有限公司	2,612,740,636.97	2,496,023.74	-	2,615,236,660.71	-
上海盛钜资产经营管理有限公司	673,523,158.70	-	-	673,523,158.70	-
合计	<u>24,746,871,106.91</u>	<u>14,001,856.86</u>	<u>-</u>	<u>24,760,872,963.77</u>	<u>-</u>

本公司子公司的相关信息参见附注七。

(3) 对联营企业的投资

联营企业	期初余额 人民币元	追加投资 人民币元	减少投资 人民币元	权益法下 确认的投资收益 人民币元	其他综合收益 人民币元	其他权益变动 人民币元	宣告发放 现金股利或利润 人民币元	计提减值准备 人民币元	其他 人民币元	期末余额 人民币元	减值准备 期末余额 人民币元
南方基金管理股份有限公司	3,553,181,895.13	-	-	381,404,284.79	2,984,051.10	-	(202,461,737.99)	-	-	3,735,108,493.03	-
华泰柏瑞基金管理有限公司	775,773,664.89	-	-	116,366,218.92	-	-	(109,760,000.00)	-	-	782,379,883.81	-
江苏银行股份有限公司	9,841,472,630.29	1,291,455.84	-	940,050,230.27	(8,648,696.06)	(216,483,822.72)	-	-	-	10,557,681,797.62	-
合计	14,170,428,190.31	1,291,455.84	-	1,437,820,733.98	(5,664,644.96)	(216,483,822.72)	(312,221,737.99)	-	-	15,075,170,174.46	-

2 应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示：

	附注	期初余额 人民币元	本期增加额 人民币元	本期减少额 人民币元	期末余额 人民币元
短期薪酬及长期薪金	十七、2(2)	6,345,116,805.64	2,036,550,746.54	(2,417,970,014.84)	5,963,697,537.34
离职后福利					
- 设定提存计划	十七、2(3)	480,000,000.00	362,340,615.04	(182,340,615.04)	660,000,000.00
合计		<u>6,825,116,805.64</u>	<u>2,398,891,361.58</u>	<u>(2,600,310,629.88)</u>	<u>6,623,697,537.34</u>

(2) 短期薪酬及长期薪金

		期初余额 人民币元	本期增加额 人民币元	本期减少额 人民币元	期末余额 人民币元
工资、奖金、津贴和补贴	6,338,527,545.76	1,728,388,359.04	(2,105,937,115.32)	5,960,978,789.48	
职工福利费	11,550.90	63,529,430.92	(63,529,430.92)	11,550.90	
社会保险费	-	107,823,657.84	(107,755,905.47)	67,752.37	
其中：医疗保险费	-	101,517,104.49	(101,517,104.49)	-	
工伤保险费	-	2,007,909.41	(2,007,909.41)	-	
生育保险费	-	4,298,643.94	(4,230,891.57)	67,752.37	
住房公积金	-	127,785,953.07	(127,785,953.07)	-	
工会经费和职工教育经费	6,577,708.98	9,023,345.67	(12,961,610.06)	2,639,444.59	
合计	<u>6,345,116,805.64</u>	<u>2,036,550,746.54</u>	<u>(2,417,970,014.84)</u>	<u>5,963,697,537.34</u>	

2023年6月30日工资、奖金、津贴和补贴项目中包含的长期薪金余额为人民币4,668,576,303.87元(2022年12月31日：人民币5,023,272,463.60元)

(3) 离职后福利 - 设定提存计划

		期初余额 人民币元	本期增加额 人民币元	本期减少额 人民币元	期末余额 人民币元
基本养老保险费	-	176,960,298.93	(176,960,298.93)	-	
失业保险费	-	5,380,316.11	(5,380,316.11)	-	
企业年金缴费	480,000,000.00	180,000,000.00	-	660,000,000.00	
合计	<u>480,000,000.00</u>	<u>362,340,615.04</u>	<u>(182,340,615.04)</u>	<u>660,000,000.00</u>	

3 手续费及佣金净收入

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
证券经纪业务净收入	2,793,617,532.79	3,185,572,283.07
其中：证券经纪业务收入	4,058,378,645.54	4,560,147,255.90
其中：代理买卖证券业务	3,291,490,681.33	3,691,590,013.56
交易单元席位租赁	398,596,849.79	377,892,920.17
代销金融产品业务	368,291,114.42	490,664,322.17
证券经纪业务支出	(1,264,761,112.75)	(1,374,574,972.83)
其中：代理买卖证券业务	(1,264,761,112.75)	(1,374,574,972.83)
期货经纪业务净收入	16,657,549.12	12,389,055.55
其中：期货经纪业务收入	16,657,549.12	12,389,055.55
投资银行业务净收入	173,042,670.22	174,281,551.13
其中：投资银行业务收入	173,042,670.22	174,281,551.13
其中：证券承销业务	173,042,670.22	174,281,551.13
投资银行业务支出	-	-
其中：证券承销业务	-	-
投资咨询服务净收入	22,112,777.20	15,558,212.51
其中：投资咨询服务收入	22,112,777.20	15,558,212.51
投资咨询服务支出	-	-
其他手续费及佣金净收入	108,629,449.62	95,654,353.69
其中：其他手续费及佣金收入	109,335,139.48	96,595,607.12
其他手续费及佣金支出	(705,689.86)	(941,253.43)
合计	<u>3,114,059,978.95</u>	<u>3,483,455,455.95</u>
其中：手续费及佣金收入合计	4,379,526,781.56	4,858,971,682.21
手续费及佣金支出合计	(1,265,466,802.61)	(1,375,516,226.26)

4 利息净收入

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
利息收入		
融资融券利息收入	3,768,138,918.14	3,862,185,001.51
货币资金及结算备付金利息收入	1,309,132,266.58	1,382,139,366.37
买入返售金融资产利息收入	220,516,908.73	225,979,003.57
其中：股票质押回购利息收入	150,531,557.12	134,768,860.11
债权投资利息收入	700,730,301.35	483,364,094.69
其他债权投资利息收入	127,779,555.12	66,914,415.52
其他	158,182,578.62	44,122,296.89
利息收入小计	<u>6,284,480,528.54</u>	<u>6,064,704,178.55</u>
利息支出		
应付债券利息支出	(2,181,256,051.27)	(2,092,351,773.49)
其中：次级债券利息支出	(315,962,379.27)	(315,900,010.96)
卖出回购金融资产利息支出	(1,407,515,995.44)	(1,123,389,761.44)
其中：报价回购利息支出	(193,507,943.37)	(109,686,069.08)
拆入资金利息支出	(913,418,876.51)	(944,405,345.82)
其中：转融通利息支出	(619,278,429.82)	(525,685,212.39)
应付短期融资款利息支出	(159,409,074.78)	(476,806,129.67)
代理买卖证券款利息支出	(205,199,652.02)	(130,774,354.05)
租赁负债利息支出	(16,280,681.33)	(13,821,922.82)
其他	(66,880,757.95)	(49,355,454.98)
利息支出小计	<u>(4,949,961,089.30)</u>	<u>(4,830,904,742.27)</u>
利息净收入	<u><u>1,334,519,439.24</u></u>	<u><u>1,233,799,436.28</u></u>

5 投资收益

(1) 投资收益按类别列示

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
成本法核算的长期股权投资收益	996,670,000.00	-
权益法核算的长期股权投资收益	1,437,820,733.98	1,150,635,784.52
金融工具投资收益	2,995,280,857.12	192,302,485.06
持有期间取得的分红和利息	2,779,327,950.99	2,996,399,221.21
其中：交易性金融资产	2,779,327,950.99	2,996,399,221.21
处置金融工具取得的收益	215,952,906.13	(2,804,096,736.15)
其中：交易性金融资产	5,176,615,902.79	(4,003,785,274.14)
其他债权投资	2,031,678.54	5,479,696.65
衍生金融工具	(4,700,171,330.64)	1,243,822,258.22
交易性金融负债	(262,523,344.56)	(49,613,416.88)
合计	5,429,771,591.10	1,342,938,269.58

(2) 对联营企业的投资收益

参见附注十七、1(3)

(3) 本公司不存在投资收益汇回的重大限制。

(4) 交易性金融工具投资收益明细表

交易性金融工具	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
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	持有期间收益	2,779,327,950.99
	处置取得收益 / (亏损)	5,176,615,902.79
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	处置取得 亏损	(342,619,943.01)
	处置取得收益	80,096,598.45
合计	7,693,420,509.22	(1,056,999,469.81)

6 公允价值变动收益

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
交易性金融资产	2,350,472,899.85	(781,044,951.22)
交易性金融负债	8,463,816.01	27,808,882.21
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	25,229,393.03	-
衍生金融工具	(1,141,889,330.89)	2,440,624,854.76
合计	1,217,047,384.97	1,687,388,785.75

7 业务及管理费

	2023年1-6月 人民币元	2022年1-6月 人民币元
员工成本	2,432,323,844.88	1,902,158,692.85
研究开发费	940,773,731.01	857,868,172.49
交易所费用	245,163,681.52	221,464,339.63
固定资产折旧	189,284,586.17	162,359,665.17
使用权资产折旧	157,855,359.05	131,723,630.21
无形资产摊销	118,840,907.89	80,382,081.00
邮电通讯费	89,503,282.68	81,742,366.78
长期待摊费用摊销	57,608,483.63	45,876,970.87
证券投资者保护基金	50,902,707.09	39,165,680.29
业务宣传费	48,359,659.24	29,875,530.51
租赁费	14,081,834.22	10,256,842.16
咨询费	14,062,593.32	19,059,336.57
其他	230,316,500.39	180,775,828.95
合计	4,589,077,171.09	3,762,709,137.48

8 现金流量表补充资料

(1) 将净利润调节为经营活动现金流量

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元 (经重述)
净利润	6,164,748,660.59	3,887,668,010.57
加：信用减值损失	(472,441,045.31)	(284,512,183.82)
固定资产及投资性房地产折旧	207,483,644.10	181,855,721.33
无形资产摊销	118,840,907.89	80,382,081.00
长期待摊费用摊销	57,608,483.63	45,876,970.87
使用权资产的摊销	157,855,359.05	131,723,630.21
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的收益	(5,616.31)	(130,933.84)
公允价值变动收益	(1,388,721,025.37)	(67,926,104.70)
利息支出	1,528,435,950.91	2,019,211,448.30
汇兑损失 / (收益)	368,806,773.16	(562,184,868.43)
投资收益	(1,439,852,412.52)	(1,156,115,481.17)
递延所得税负债增加	348,400,947.73	271,624,191.15
交易性金融工具的增加	(19,499,154,738.08)	(30,242,482,738.54)
经营性应收项目的减少	53,565,162.64	17,984,568,733.72
经营性应付项目的增加	6,830,685,607.60	42,303,171,423.33
经营活动(使用)/产生的现金流量净额	<u>(6,963,743,340.29)</u>	<u>34,592,729,899.98</u>

(2) 现金及现金等价物净变动情况

	2023 年 1-6 月 人民币元	2022 年 1-6 月 人民币元
现金及现金等价物的期末余额	148,713,639,128.04	147,294,681,538.32
减：现金及现金等价物的期初余额	<u>(159,509,159,372.69)</u>	<u>(142,329,317,203.81)</u>
现金及现金等价物净增加额	<u>(10,795,520,244.65)</u>	<u>4,965,364,334.51</u>

十八、财务报告的批准报出

本财务报表经公司董事会于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

补充资料

一、2023年1-6月非经常性损益明细表

	金额 人民币元
非流动资产处置损益	(423,999.10)
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）	90,570,624.28
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	(689,119,515.24)
所得税影响额	137,695,917.52
少数股东权益影响额（税后）	300,445.03
合计	(460,976,527.51)

本集团持有交易性金融资产、交易性金融负债及衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有交易性金融资产、其他权益工具投资、交易性金融负债投资期间取得的投资收益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具、债权投资、其他债权投资取得的投资收益不作为非经常性损益项目，而界定为经常性损益项目，原因为本集团作为证券公司，上述业务均属于本集团的正常经营业务。

二、境内外会计准则下会计数据差异

本公司按照中国企业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2023年1-6月及2022年1-6月的净利润、2023年6月30日及2022年12月31日的净资产无差异。

三、净资产收益率及每股收益

本集团按照证监会颁布的《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）以及会计准则相关规定计算的净资产收益率和每股收益如下：

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	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	4.23	0.70	0.68
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	4.54	0.75	0.73

备查文件目录

备查文件目录	载有公司法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报表
	报告期内公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿
	公司章程

董事长：张伟

董事会批准报送日期：2023 年 8 月 30 日

证券公司信息披露

公司重大行政许可事项的相关情况

2023 年 1 月 30 日，《关于华泰证券股份有限公司自营参与碳排放权交易的无异议函》（机构部函[2023]102 号）。

附录：信息披露索引

1 报告期内，公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》以及上交所网站（www.sse.com.cn）上披露的信息如下：

序号	日期	公告事项
1	2023-01-07	华泰证券 H 股公告（截至 2022 年 12 月 31 日股份发行人的证券变动月报表）
2	2023-01-16	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
3	2023-01-19	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
4	2023-01-20	华泰证券股份有限公司关于完成经营范围工商变更登记的公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
5	2023-02-06	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于自营参与碳排放权交易收到中国证监会无异议函的公告
6	2023-02-07	华泰证券股份有限公司关于 2023 年第一次临时股东大会、2023 年第一次 A 股类别股东会的延期公告，华泰证券 H 股公告（截至 2023 年 1 月 31 日股份发行人的证券变动月报表）
7	2023-02-08	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
8	2023-02-09	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
9	2023-02-11	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
10	2023-02-13	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
11	2023-02-18	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
12	2023-02-23	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于全资子公司华泰创新投资有限公司注册地址变更的公告
13	2023-02-24	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
14	2023-03-04	华泰证券 H 股公告（截至 2023 年 2 月 28 日股份发行人的证券变动月报表）
15	2023-03-07	华泰证券股份有限公司关于向专业投资者公开发行短期公司债券获得中国证监会注册批复的公告
16	2023-03-10	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
17	2023-03-13	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
18	2023-03-21	华泰证券 H 股公告（董事会召开日期）
19	2023-03-23	华泰证券股份有限公司关于召开 2022 年度业绩说明会的公告
20	2023-03-29	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
21	2023-03-31	华泰证券股份有限公司 2022 年年度报告、华泰证券股份有限公司 2022 年年度报告摘要、华泰证券股份有限公司 2022 年度财务报表及审计报告、华泰证券股份有限公司 2022 年度非经营性资金占用及其他关联资金往来情况的专项说明、华泰证券股份有限公司 2022 年度内部控制评价报告、华泰证券股份有限公司 2022 年度内部控制审计报告、华泰证券股份有限公司 2022 年度社会责任报告、华泰证券股份有限公司董事会审计委员会 2022 年度履职情况报告、华泰证券股份有限公司独立董事 2022 年度履职报告、华泰证券股份有限公司独立董事关于第六届董事会第二次会议相关事项的事前认可意见、华泰证券股份有限公司独立董事关于第六届董事会第二次会议相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司第六届董事会第二次会议决议公告、华泰证券股份有限公司第六届监事会第二次会议决议公告、华泰证券股份有限公司关于续聘会计师事务所的公告、华泰证券股份有限公司关于 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件成就的公告、北京市金杜（南京）律师事务所关于华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划第一个解除限售期解除限售条件成就及回购注销部分限制性股票事宜的法律意见书、华泰证券股份有限公司关于回购注销部分 A 股限制性股票的公告、华泰证券股份有限公司 2022 年年度利润分配方案公告、华泰证券股份有限公司关于预计 2023 年度日常关联交易的公告
22	2023-04-07	华泰证券 H 股公告（截至 2023 年 3 月 31 日股份发行人的证券变动月报表）
23	2023-04-18	华泰证券股份有限公司关于 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售暨上市公告
24	2023-04-19	华泰证券 H 股公告（董事会召开日期）
25	2023-04-21	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
26	2023-04-22	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
27	2023-04-26	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
28	2023-04-29	华泰证券股份有限公司 2023 年第一季度报告、华泰证券股份有限公司第六届董事会第三次会议决议公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于第六届董事会第三次会议相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司第六届监事会第三次会议决议公告、华泰证券股份有限公司关于会计政策变更的公告
29	2023-05-06	华泰证券 H 股公告（截至 2023 年 4 月 30 日股份发行人的证券变动月报表）、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
30	2023-05-08	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
31	2023-05-09	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告

序号	日期	公告事项
32	2023-05-10	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
33	2023-05-12	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
34	2023-05-17	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
35	2023-05-23	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
36	2023-05-24	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
37	2023-05-31	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于召开 2022 年年度股东大会、2023 年第二次 A 股类别股东会的通知，华泰证券股份有限公司 2022 年度股东大会、2023 年第二次 A 股类别股东会、2023 年第二次 H 股类别股东会会议文件
38	2023-06-06	华泰证券 H 股公告（截至 2023 年 5 月 31 日股份发行人的证券变动月报表）
39	2023-06-07	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
40	2023-06-15	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
41	2023-06-16	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
42	2023-06-17	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
43	2023-06-26	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
44	2023-06-28	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
45	2023-06-29	华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告

2 报告期内，公司在香港交易所披露易网站（www.hkexnews.hk）上披露的信息如下：

序号	日期	公告事项
1	2023-01-02	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于公司符合配股条件的说明、华泰证券股份有限公司配股公开发行证券预案、华泰证券股份有限公司配股募集资金使用可行性分析报告、华泰证券股份有限公司前次募集资金使用情况报告、华泰证券股份有限公司前次募集资金使用情况报告及鉴证报告、华泰证券股份有限公司中期股东回报规划（2023-2025年）、华泰证券股份有限公司关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的公告、华泰证券股份有限公司关于召开2023年第一次临时股东大会、2023年第一次A股类别股东大会的通知
2	2023-01-06	截至二零二二年十二月三十一日止股份发行人的证券变动月报表
3	2023-01-09	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）票面利率公告
4	2023-01-11	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）发行结果公告
5	2023-01-13	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）票面利率公告
6	2023-01-15	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
7	2023-01-16	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第一期）2023年付息公告、华泰证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）2023年付息公告、华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）发行结果公告
8	2023-01-18	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
9	2023-01-19	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于完成经营范围工商变更登记的公告
10	2023-02-02	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）票面利率公告
11	2023-02-05	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于自营参与碳排放权交易收到中国证监会无异议函的公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
12	2023-02-06	截至二零二三年一月三十一日止股份发行人的证券变动月报表、关于2023年第一次临时股东大会、2023年第一次H股类别股东大会的延期公告、海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）发行结果公告
13	2023-02-07	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
14	2023-02-08	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第九期）（品种一）2023年付息公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
15	2023-02-10	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）票面利率公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
16	2023-02-12	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
17	2023-02-17	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
18	2023-02-22	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于全资子公司华泰创新投资有限公司注册地址变更的公告
19	2023-02-23	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
20	2023-02-24	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）票面利率公告
21	2023-02-28	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）发行结果公告
22	2023-03-03	截至二零二三年二月二十八日止股份发行人的证券变动月报表
23	2023-03-06	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于向专业投资者公开发行短期公司债券获得中国证监会注册批复的公告
24	2023-03-09	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
25	2023-03-12	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
26	2023-03-16	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）票面利率公告
27	2023-03-17	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）发行结果公告
28	2023-03-20	董事会召开日期
29	2023-03-22	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第二期）票面利率公告、华泰证券股份有限公司关于召开2022年度业绩说明会的公告
30	2023-03-23	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第二期）发行结果公告
31	2023-03-28	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
32	2023-03-30	关于回购注销部分A股限制性股票的公告、2022社会责任报告、截至2022年12月31日止年度之业绩公告、截至2022年12月31日止年度之末期股息、海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司2022年年度报告、华泰证券股份有限公司2022年年度报告摘要、华泰证券股份有限公司2022年度财务报表及审计报告、华泰证券股份有限公司2022年度非经营性资金占用及其他关联资金往来情况的专项说明、华泰证券股份有限公司2022年度内部控制评价报告、华泰证券股份有限公司2022年度内部控制审计报告、华泰证券股份有限公司董事会审计委员会2022年度履职情况报告、华泰证券股份有限公司独立董事2022年度履职报告、华泰证券股份有限公司独立董事关于第六届董事会第二次会议相关事项的事前认可意见、华泰证券股份有限公司独立董事关于第六届董事会第二次会议相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司第六届董事会第二次会议决议公告、华泰证券股份有限公司第六届监事会第二次会议决议公告、华泰证券股份有限公司关于续聘会计师事务所的公告、华泰证券股份有限公司关于A股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售条件成就的公告、北京市金杜（南京）律师事务所关于华泰证券股份有限公司A股限制性股票股权激励计划第一个解除限售期解除限售条件成就及回购注销部分限制性股票事宜的法律意见书、华泰证券股份有限公司2022年年度利润分配方案公告、华泰证券股份有限公司关于预计2023年度日常关联交易的公告

序号	日期	公告事项
33	2023-04-06	截至二零二三年三月三十一日止股份发行人的证券变动月报表
34	2023-04-17	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于 A 股限制性股票股权激励计划第一个限售期解除限售暨上市公告
35	2023-04-18	董事会召开日期
36	2023-04-19	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）2023 年付息公告
37	2023-04-20	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
38	2023-04-21	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
39	2023-04-24	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2020 年面向合格投资者公开发行公司债券（第二期）2023 年付息公告
40	2023-04-25	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
41	2023-04-26	2022 年年度报告、致登记股东的通知信函及申请表、致非登记持有人的通知信函及申请表
42	2023-04-28	2023 年第一季度报告、海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于会计政策变更的公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于第六届董事会第三次会议相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司第六届监事会第三次会议决议公告、华泰证券股份有限公司第六届董事会第三次会议决议公告
43	2023-05-05	截至二零二三年四月三十日止股份发行人的证券变动月报表，海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
44	2023-05-08	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
45	2023-05-09	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第六期）票面利率公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
46	2023-05-10	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第六期）发行结果公告
47	2023-05-11	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）2023 年付息公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
48	2023-05-15	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2020 年面向合格投资者公开发行公司债券（第三期）2023 年付息公告
49	2023-05-16	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
50	2023-05-17	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种一）2023 年付息公告、华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种二）2023 年付息公告
51	2023-05-22	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
52	2023-05-23	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
53	2023-05-30	2022 年度股东大会通函、2022 年度股东大会通告、2023 年第二次 H 股类别股东会通告、2023 年 6 月 30 日举行的年度股东大会 H 股股东代表委任表格、2023 年 6 月 30 日举行的 2023 年第二次 H 股类别股东会 H 股股东代表委任表格、致登记股东的通知信函及申请表、致非登记持有人的通知信函及申请表、截至 2022 年 12 月 31 日止年度之末期股息（更新），海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2013 年公司债券（10 年期）2023 年本息兑付及摘牌公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
54	2023-06-05	截至二零二三年五月三十一日止股份发行人的证券变动月报表
55	2023-06-06	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
56	2023-06-08	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种一）2023 年付息公告
57	2023-06-12	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2020 年面向合格投资者公开发行公司债券（第四期）（品种二）2023 年本息兑付及摘牌公告
58	2023-06-14	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第六期）（品种一）2023 年付息公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
59	2023-06-15	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
60	2023-06-16	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
61	2023-06-25	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
62	2023-06-27	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
63	2023-06-28	海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告
64	2023-06-30	2022 年度股东大会、2023 年第二次 A 股类别股东会及 2023 年第二次 H 股类别股东会之投票表决结果；及派付末期股息，海外监管公告 - 华泰证券股份有限公司关于回购注销部分 A 股限制性股票减少注册资本通知债权人的公告、华泰证券股份有限公司关于间接全资子公司根据中期票据计划进行发行并由全资子公司提供担保的公告、北京市金杜律师事务所关于华泰证券股份有限公司 2022 年年度股东大会、2023 年第二次 A 股类别股东会、2023 年第二次 H 股类别股东会之法律意见书

3 报告期内，公司在伦交所网站（www.londonstockexchange.com）上披露的信息如下：

序号	日期	公告事项
1	2023-01-03	POLL RESULTS OF THE EGM (临时股东大会之投票表决结果)、ARTICLES OF ASSOCIATION (公司章程)
2	2023-02-06	EXTENSION ANNOUNCEMENT ON THE GENERAL MEETINGS (股东大会延期公告)
3	2023-03-30	2022 CORPORATE SOCIAL RESPONSIBILITY REPORT (2022 年度社会责任报告)、REPURCHASE AND CANCELLATION OF PART OF SHARES (回购注销部分股票)、2022 ANNUAL FINANCIAL REPORT (2022 年度财务报告)
4	2023-04-26	2022 ANNUAL REPORT (2022 年度报告)
5	2023-04-28	FIRST QUARTERLY REPORT OF 2023 (2023 年第一季度报告)
6	2023-05-30	NOTICE OF AGM AND A SHARE CLASS MEETING (年度股东大会及 A 股类别股东会通知)
7	2023-06-30	RESULTS OF AGM AND A SHARE & H SHARE CLASS MEETING (年度股东大会及 A 股、H 股类别股东会之投票表决结果)



 华泰在线: www.htsc.com

 客服热线: **95597**

 地址: 中国江苏省南京市江东中路228号 华泰证券

Huatai Online: www.htsc.com

Customer Services Hotline: 95597

Company Address: No. 228 Middle Jiangdong Road, Nanjing, Jiangsu Province, PRC

© HUATAI SECURITIES All Rights Reserved. 
RECYCLABLE