申万宏源集团股份有限公司独立董事专项意见

根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等有关规定，作为申万宏源集团股份有限公司董事会现任的独立董事，我们认真审阅了公司提供的有关公司衍生品自营业务的有关资料，现发表如下独立意见：

公司所属子公司已获得相关业务资格，可以开展相关业务。报告期内公司所属子公司进行衍生产品投资业务时能够按照中国证券监督管理委员会、中国证券业协会及中国金融期货交易所的要求，规范运作。截至报告期末，利率衍生工具持仓合约金额人民币 11,662,917.26 万元，占公司报告期末净资产的 131.17%；权益衍生工具持仓合约金额人民币 6,371,064.25 万元，占公司报告期末净资产 71.66%；商品衍生工具持仓合约金额人民币 11,299,327.18 万元，占公司报告期末净资产 127.08%。公司所属子公司衍生品投资业务的开展符合相关监管要求，风险可控。

此项业务不存在损害公司和全体股东权益的情况。

二〇二〇年十月三十日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（此页无正文，为《申万宏源集团股份有限公司独立董事关于衍生品投资情况的独立意见》的签署页）

独立董事：

叶　梅	谢　荣	黄丹涵	杨秋梅

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn