



华泰证券  
HUATAI SECURITIES



601688 · 6886 · HTSC · AMK HUATAI SECURITIES 601688 · 6886 · HTSC · AMK HUATAI SECURITIES

HUATAI SECURITIES

HUATAI SECURITIES

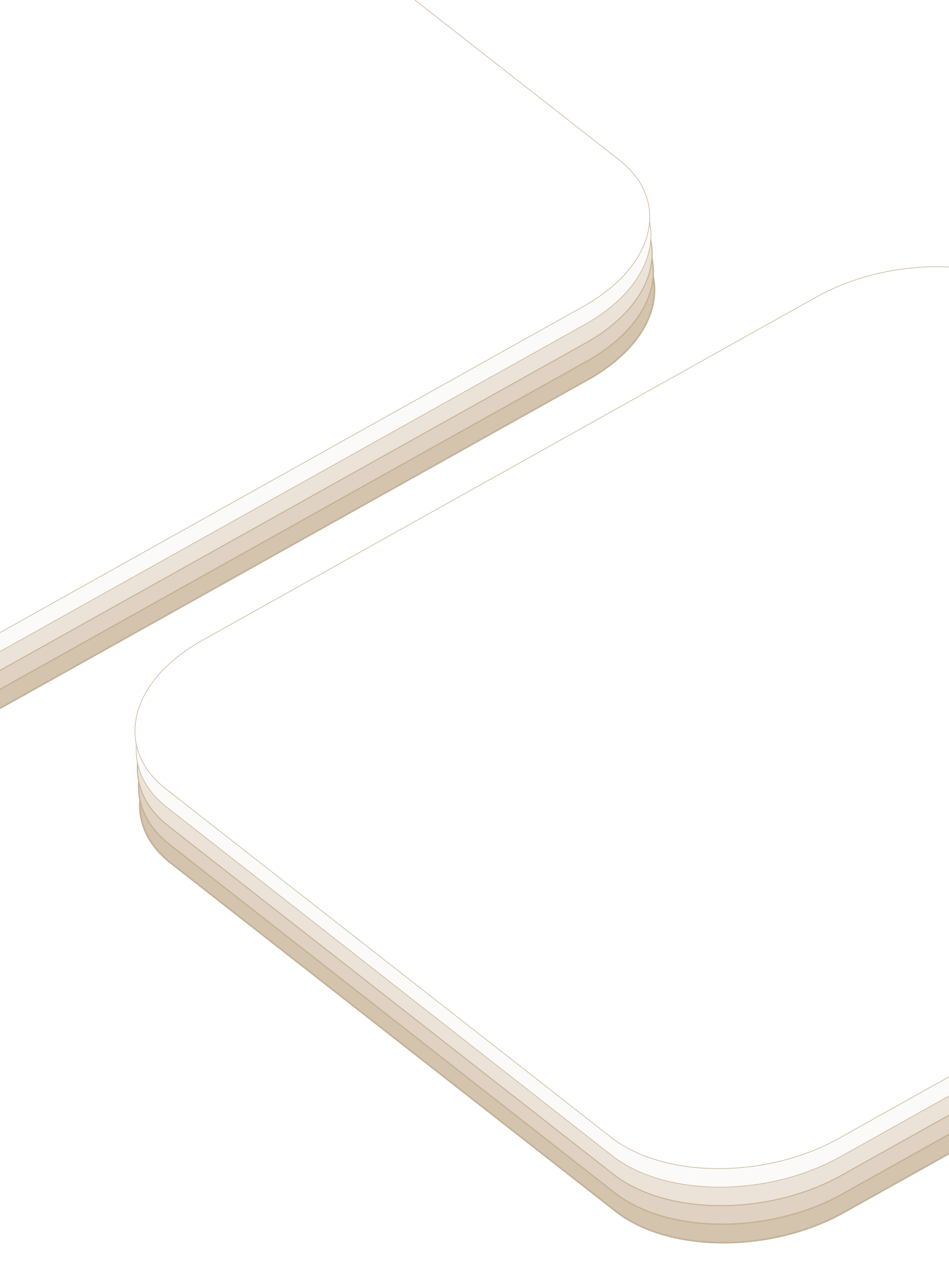
601688 · 6886 · HTSC · AMK

601688 · 6886 · HTSC · AMK HUATAI SECURITIES 601688 · 6886 · HTSC · AMK

601688 · 6886 · HTSC · AMK

2021 半年度报告  
INTERIM REPORT 2021  
股票代码 601688

H U A T A I   S E C U R I T I E S



# 目录 Contents

## 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

- 066 公司治理
- 074 环境与社会责任
- 078 重要事项
- 092 股份变动及股东情况
- 100 债券相关情况

## 4 财务报告及备查文件

- 108 半年度财务报告
- 257 备查文件目录
- 257 证券公司信息披露
- 258 附录



1

关于我们  
*ABOUT US*

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

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

## 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      | 丁锋      | 公务原因       | 张伟     |
| 董事      | 陈泳冰     | 公务原因       | 柯翔     |
| 董事      | 汪涛      | 公务原因       | 张伟     |

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

宏观经济及货币政策、影响金融及证券行业的法律法规、商业及金融行业的涨跌趋势、通胀、汇率波动、长短期市场资金来源的可用性、融资成本与利率水平及波动等整体经济及政治状况因素，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。公司无法保证有利的政治经济及市场状况会持续。

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；因经营管理或执业行为违反法律、法规或准则而使公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的合规风险；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；因市场价格（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；因产品或债券发行人违约、交易对手（客户）违约导致公司资产受损失的信用风险；无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的流动性风险；内外部原因造成公司信息系统发生各类技术故障或数据泄露，导致信息系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据加密等方面不能保障交易与业务管理稳定、高效、安全地进行，从而造成损失的信息技术风险；因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；公司经营、管理及其他行为或外部事件导致有关媒体对公司负面评价的声誉风险；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；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  |
| 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  |
| 上海清算所           | 指 | 银行间市场清算所股份有限公司   |
| 社保基金会           | 指 | 全国社会保障基金理事会  |
| 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  |
| 华泰期货            | 指 | 华泰证券控股子公司华泰期货有限公司  |
| 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  |
| 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.)                                     |
| 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  |
| 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   |
| AssetMark       | 指 | AssetMark Financial Holdings, Inc.   |
| 《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   |
| 上证 50 指数        | 指 | 上交所挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的 50 只股票组成指数样本股   |
| 沪深 300 指数       | 指 | 上交所与深交所联合以规模和流动性作为根本标准，挑选最具代表性的 300 只股票组成指数样本股   |
| 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  |
| 报告期             | 指 | 2021 年 1—6 月   |

2021 年半年度报告中，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 | 9,076,650,000.00  | 9,076,650,000.00  |
| 净资产  | 74,031,520,954.30 | 67,909,921,047.21 |

#### 公司的各单项业务资格情况

报告期内，根据公司收到的《关于华泰证券开展商品期货做市业务有关意见的复函》，中国证监会对公司开展商品期货做市业务无异议。

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：证券经纪业务，证券自营，证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具、金融债（含政策性金融债）），证券投资咨询，为期货公司提供中间介绍业务，融资融券业务，代销金融产品业务，证券投资基金代销，证券投资基金托管，黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务，股票期权做市业务，中国证监会批准的其他业务。（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）

## 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    | 025-83387793、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                           | 邝燕萍                        |
| 联系地址   | 中国江苏省南京市江东中路 228 号 1 号楼 11 楼 | 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      | 香港皇后大道中 99 号中环中心 42 楼 4201 室  |
| 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  |
| 指数纳入情况简要      | 上证 50 指数、沪深 300 指数、MSCI 中国股指数、恒生 A 股可持续发展企业基准指数                           |
| 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；上交所                    |
| 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；香港皇后大道中99号中环中心42楼4201室 |
| 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                        | <b>601688</b> |
| H股          | 香港联交所 | HTSC                        | <b>6886</b>   |
| GDR         | 伦交所   | Huatai Securities Co., Ltd. | <b>HTSC</b>   |

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<br>(境内) | 名称   | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)       |
|                     | 办公地址 | 中国北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8楼 |
| 公司聘请的会计师事务所<br>(香港) | 名称   | 毕马威会计师事务所                 |
|                     | 办公地址 | 香港中环遮打道10号太子大厦8楼          |
| 公司聘请的会计师事务所<br>(英国) | 名称   | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)       |
|                     | 办公地址 | 中国北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8楼 |

## (二) 法律顾问

|                   |      |                                   |
|-------------------|------|-----------------------------------|
| 公司聘请的法律顾问<br>(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<br>(境外) | 名称   | 高伟绅律师行                            |
|                   | 办公地址 | 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 | 香港湾仔皇后大道东 183 号合和中心 17M 楼 |

# 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<br>(1—6月)     | 上年同期               | 本报告期比<br>上年同期增减 (%)  |
|-----------------------|--------------------|--------------------|----------------------|
| 营业收入                  | 18,232,770,029.66  | 15,540,623,761.51  | 17.32                |
| 归属于母公司股东的净利润          | 7,770,308,425.05   | 6,404,994,430.49   | 21.32                |
| 归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 7,719,866,448.27   | 6,379,382,285.20   | 21.01                |
| 经营活动产生的现金流量净额         | -15,844,280,557.47 | 23,450,247,681.61  | -167.57              |
| 其他综合收益的税后净额           | -463,027,699.32    | -9,148,075.22      | 4,961.48             |
|                       | 本报告期末              | 上年度末               | 本报告期末比<br>上年度末增减 (%) |
| 资产总额                  | 790,110,728,651.02 | 716,751,234,978.88 | 10.24                |
| 负债总额                  | 653,919,179,558.70 | 584,439,201,008.08 | 11.89                |
| 归属于上市公司股东的净资产         | 132,827,186,031.32 | 129,071,499,419.26 | 2.91                 |
| 股东权益总额                | 136,191,549,092.32 | 132,312,033,970.80 | 2.93                 |

## (二) 主要财务指标

| 主要财务指标                   | 本报告期<br>(1—6月) | 上年同期 | 本报告期<br>比上年同期增减 (%) |
|--------------------------|----------------|------|---------------------|
| 基本每股收益 (元/股)             | 0.86           | 0.71 | 21.13               |
| 稀释每股收益 (元/股)             | 0.86           | 0.70 | 22.86               |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益 (元/股)   | 0.86           | 0.70 | 22.86               |
| 加权平均净资产收益率 (%)           | 5.73           | 4.98 | 增加 0.75 个百分点        |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率 (%) | 5.69           | 4.96 | 增加 0.73 个百分点        |

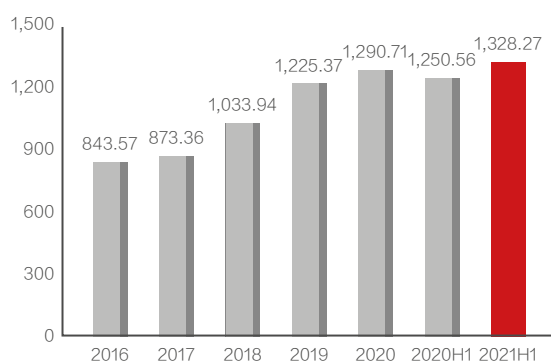
## (三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位: 元 币种: 人民币

| 项目                      | 本报告期末              | 上年度末               |
|-------------------------|--------------------|--------------------|
| 净资本                     | 74,031,520,954.30  | 67,909,921,047.21  |
| 净资产                     | 112,733,146,257.45 | 111,971,511,426.66 |
| 风险覆盖率 (%)               | 236.65             | 236.68             |
| 净资本 / 净资产 (%)           | 65.67              | 60.65              |
| 净资本 / 负债 (%)            | 20.93              | 21.86              |
| 净资产 / 负债 (%)            | 31.88              | 36.04              |
| 自营权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)  | 43.39              | 49.91              |
| 自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%) | 298.25             | 296.70             |
| 核心净资本                   | 60,031,520,954.30  | 62,909,921,047.21  |
| 附属净资本                   | 14,000,000,000.00  | 5,000,000,000.00   |
| 各项风险资本准备之和              | 31,283,738,065.23  | 28,693,100,276.16  |
| 表内外资产总额                 | 375,505,279,725.24 | 333,759,265,959.88 |
| 资本杠杆率 (%)               | 18.48              | 21.08              |
| 流动性覆盖率 (%)              | 184.06             | 230.31             |
| 净稳定资金率 (%)              | 131.50             | 130.22             |

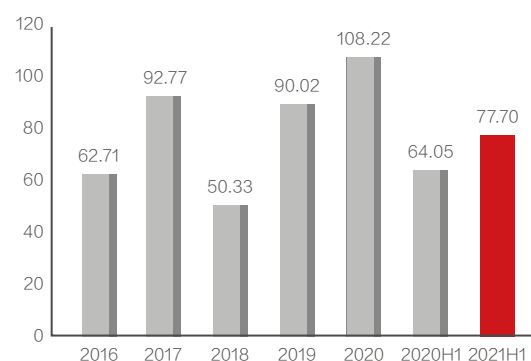
## (四) 主要业绩指标

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<br>人民币<br><b>18.04</b> 万亿元<br> 市场排名        | 股权承销数量<br><b>43</b> 单<br> 市场排名                 | 资产管理总规模<br>人民币<br><b>5,243.87</b> 亿元<br> 市场排名     | 港股 IPO 保荐项目数量<br><b>5</b> 单<br> 市场排名      |
| 涨乐财富通月活数<br><b>845.79</b> 万<br> 市场排名               | 股权承销金额<br>人民币<br><b>689.92</b> 亿元<br> 市场排名     | 私募子公司私募基金月均规模<br>人民币<br><b>410.74</b> 亿元<br> 市场排名 | AssetMark AoP<br><b>845.94</b> 亿美元   |
| 融资融券业务余额<br>人民币<br><b>1,380.78</b> 亿元<br> 市场排名    | 债券承销数量<br><b>843</b> 单<br> 市场排名               | 企业资产证券化发行数量<br><b>56</b> 单<br> 市场排名              | AssetMark 市场占有率<br><b>11.0%</b><br> 市场排名 |
| 非货币市场公募基金保有规模<br>人民币<br><b>1,126</b> 亿元<br> 市场排名 | 债券承销金额<br>人民币<br><b>4,043.59</b> 亿元<br> 市场排名 | 企业资产证券化发行规模<br>人民币<br><b>552.15</b> 亿元<br> 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 2021 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 2021 年第二季度的统计；股权承销数量及金额与排名、债券承销数量及金额与排名引自 Wind 资讯；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 2021 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 2021 年第二季度末以定价日为口径的中资券商情况统计，AssetMark AoP 引自公司内部截至 2021 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 2020 年年末的 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 2021 年 1—6 月及 2020 年 1—6 月的归属于上市公司股东的净利润、2021 年 6 月 30 日及 2020 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  | 319,213.69     |
| 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 | 74,335,646.38  |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出   | -6,096,961.09  |
| 所得税影响额   | -17,289,573.46 |
| 少数股东权益影响额  | -826,348.74    |
| 合计   | 50,441,976.78  |

## 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”。





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

1991



华泰证券（时名江苏省证券公司）成立

1993



公开发行江苏省第一支股票“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

金,经济缺乏活力,企业活力在电中  
国企改革”前,国企改革经验 要国家

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,募集资金超人民币 140 亿元



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

2019

# 更懂你的财富管理专家

华泰证券“涨乐财富通”升级 7.0 新版本

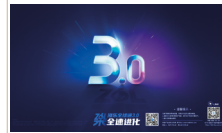


公司机构客户服务平台“行知”APP 上线

2021



“涨乐财富通”注册下载量逾 6,200 万



公司旗下全球财富管理平台“涨乐全球通 3.0”上线



公司完成 A 股限制性股票授予登记工作

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

2020



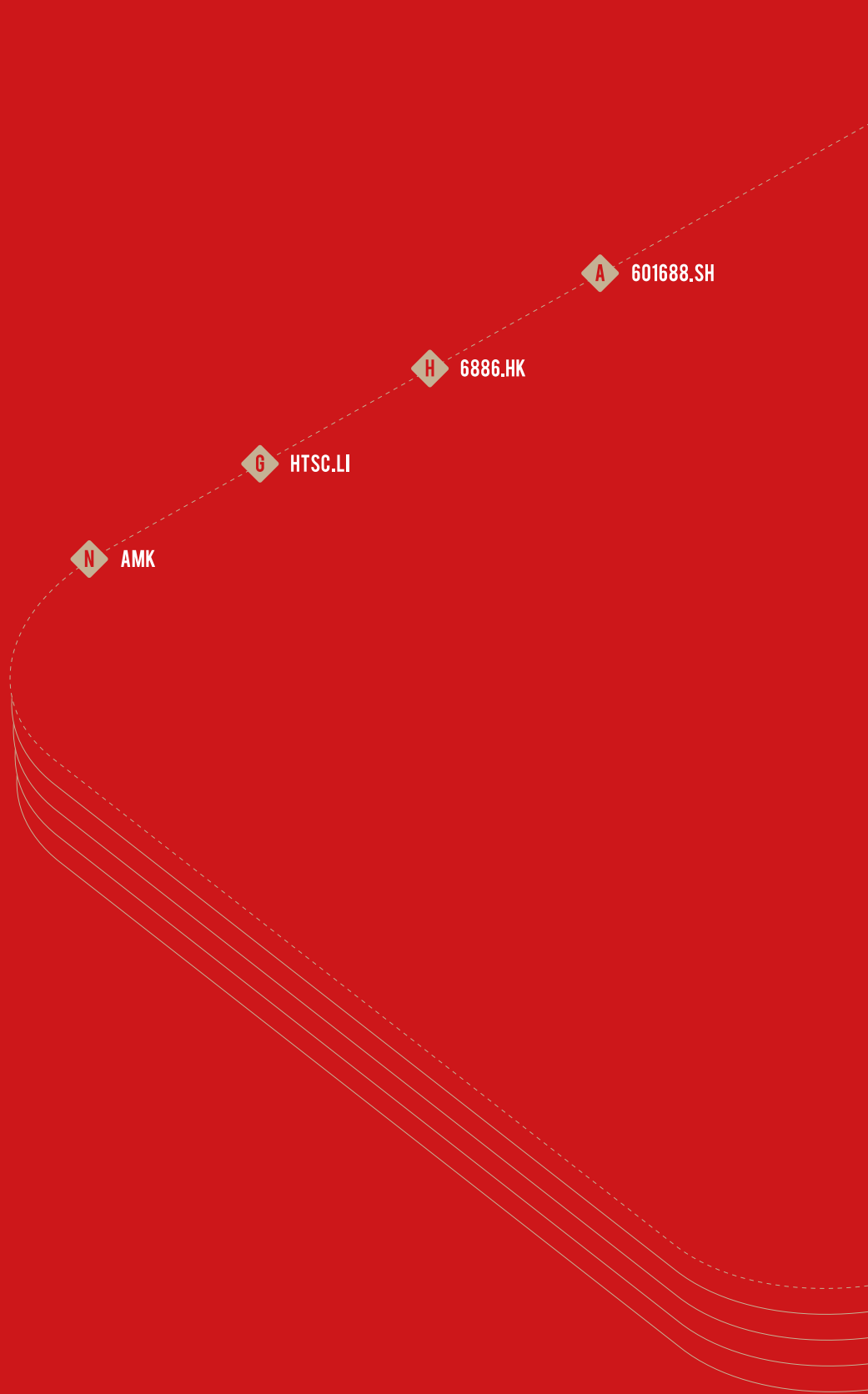
公司发布全市场首个开放式线上证券借贷交易平台“融资融券通”



公司基金投资顾问服务“涨乐星投”正式上线



公司获批正式实施并表监管试点



**N** AMK

**G** HTSC.LI

**H** 6886.HK

**A** 601688.SH

The background features a large, stylized number '2' on the left. To its right, the text '经营分析与战略' is written in a serif font, followed by 'OPERATING ANALYSIS AND STRATEGIES' in a bold, sans-serif font. The background is composed of several overlapping, wavy, ribbon-like shapes in shades of beige and light brown. A halftone pattern of small circles is visible in the lower right quadrant, fading out towards the bottom right corner.

# 2

经营分析与战略  
**OPERATING ANALYSIS  
AND STRATEGIES**

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

公司业务概要 020

经营层讨论与分析 030

# 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。

本集团是一家国内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、资本中介、基金投顾等业务。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。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。基金投顾业务方面，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。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。

## 机构服务业务

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、主经纪商业务、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股权承销、债券承销、财务顾问和场外业务等。股权承销业务方面，为客户提供首次公开发行及股权再融资服务。债券承销业务方面，为客户提供各类债券融资服务。财务顾问业务方面，从产业布局和策略角度为客户提供以并购为主的财务顾问服务。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、顾问费等。

(2) 主经纪商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。主经纪商业务主要业绩驱动因素包括基金托管费及服务业务费。

(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。

(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，并从事银行间债券市场、债券通做市服务等。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 产品和衍生品等各类投资收益等。

## 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

通过跨境联动协同，更好满足境内客户“走出去”和境外客户“走进来”的多元金融需求，打造跨境金融综合服务平台。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。

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，主要包括固收业务平台、股权业务平台、个人金融平台、基金平台和旗舰投行业务。固收业务平台方面，以适当的自有资金开展各类 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 解决方案。股权业务平台方面，通过股权衍生品团队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；通过股票销售及交易团队为全球机构客户提供境内外一体化、覆盖各行业的研究与销售服务。个人金融平台方面，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等。基金平台方面，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，覆盖医疗健康、半导体与硬科技、TMT 和优质消费等行业；资产管理团队向国际投资者提供投资组合和基金管理服务。旗舰投行业务方面，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，并完成上交所沪股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。

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。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，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。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

|               |  |  |
|---------------|--|--|
| <p>财富管理业务</p> | <p>上海证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 公司荣获“2020 年度十佳期权经纪商”</li> </ul> <p>《财资》杂志举办的“2020—2021 年度金融科技奖”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 “涨乐全球通”荣获“香港地区最佳手机券商 APP”</li> </ul> <p>专业财经资讯平台《经济通》举办的“2020 年金融科技大奖”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 “涨乐全球通”荣获“交易系统一杰出全方位股票交易流动应用程序”</li> </ul> | <p>易观智库统计数据：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 “涨乐财富通”2021 年上半年末月活数量保持业内第一</li> </ul> <p>新浪财经举办的“第六届券商 APP 风云榜”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 “涨乐财富通”荣获“年度十佳 APP”、“最佳财富管理 APP”、“最佳智能服务 APP”、“最受用户喜爱 APP”</li> </ul> |
|---------------|--|--|

|               |   |   |
|---------------|---|---|
| <p>机构服务业务</p> | <p>上海证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰联合证券荣获“2020 年度公司债券优秀承销商”、“2020 年度公司债券创新产品优秀承销商”、“2020 年度优秀受托管理人”等奖项</li> </ul> <p>《证券时报》举办的“第二届最受上市公司尊敬的投行”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰联合证券荣获“最受上市公司尊敬的十佳投行”、“最受上市公司尊敬的 IPO 投行”、“最受上市公司尊敬的并购投行”、“最受上市公司尊敬的债券投行”等奖项</li> </ul> | <p>深圳证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰联合证券荣获“2020 年度优秀债券存续期管理机构”等奖项</li> </ul> <p>《新财富》举办的“第十四届最佳投行”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰联合证券荣获“本土最佳投行”、“最佳股权承销投行”、“最佳债权承销投行”、“最佳 IPO 投行”、“最佳再融资投行”、“最佳并购投行”、“海外市场能力最佳投行”、“最具创新能力投行”等奖项</li> </ul> |
|---------------|---|---|

|        |  |  |
|--------|--|--|
| 投资管理业务 | <p>上海证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰资管公司荣获“2020 年度资产证券化业务优秀管理人”、“2020 年度资产证券化创新业务优秀管理人”、“2020 年度疫情防控专项奖”</li> </ul> <p>深圳证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰资管公司荣获“2020 年度优秀固定收益业务创新机构”</li> </ul> <p>东方财富网举办的“2020 东方财富风云榜”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰期货荣获“最佳期货资管”</li> </ul> | <p>投资中国举办的“投中 2020 年度榜”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰紫金投资荣获“中国最佳券商私募基金子公司 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 TOP50”、“最佳生物医药领域投资机构 TOP20”等奖项</li> </ul> <p>上海证券交易所：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰柏瑞荣获“十佳 ETF 管理人”</li> </ul> <p>《上海证券报》：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 南方基金荣获“2020 年度金基金·债券投资回报基金管理公司奖”</li> </ul> |
| 国际业务   | <p>国际知名私募债行业杂志《PDI(Private Debt Investor)》举办的“年度奖项”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰国际荣获“2020 年度亚太区最佳项目”、“2020 年度亚太区最佳地产私募债权投资基金管理人”</li> </ul> <p>《彭博商业周刊 / 中文版》举办的“2021 金融机构大奖”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰国际荣获“证券公司杰出大奖”、“风险管理杰出大奖”、“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）”</li> </ul>           | <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰金控（香港）实收资本达到 88 亿港元，资本规模位居香港行业前列</li> </ul> <p>香港交易所举办的“2020 年度沪深港通奖项”评选：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 华泰金控（香港）荣获“2020 沪深港通交投跃升经纪商大奖”</li> </ul> <p>Cerulli Associates 及其他公开信息：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 截至 2020 年年末，AssetMark 在美国 TAMP 行业中的市场占有率为 11.0%，排名第三</li> </ul>                          |

### 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

本集团多年来一直保持信息技术的高水位资源投入，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，致力于用数字化思维和平台彻底改造业务及管理模式，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，让科技的力量穿透前中后台，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。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、5G 等前沿领域。在财富管理领域，不断迭代升级移动金融战略，以移动化、数字化、智能化为目标，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”的研究、投资银行等服务，不断创新客户体验，通过更实时、更常态的交互，获得了越来越多机构客户的关注和认可，助力机构客户与业务资源高效互动。以“行知”为牵引，融券通、信用分析管理系统（CAMS 系统）、INCOS 赢客通云平台等正串联起机构服务的各个环节，服务效能持续提升，客户生态不断延展。依托于公司研发的各类先进的数字化中台体系，持续推进 FICC 交易台、分布式极速交易等平台建设，加速沉淀交易核心和定价能力。报告期内，升级涨乐全球通平台，推进商业模式与客户服务创新，为投资者提供更优质的全球投资体验；发布了境内外一体化交易平台革新传统技术，全面提升业务服务效能；启用全新的数字华泰运营中心，全面提升了 IT 数字化运营水平。集团多年通过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。

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业最具活力的财富管理平台之一，拥有超过 1,892 万客户。本集团充分借鉴国内外先进的财富管理服务体系和经验，从产品、服务、流程和技术平台等方面加快财富管理业务发展。本集团财富管理业务已经形成总部驱动的平台化发展模式，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“AORTA”在迭代升级中强化功能、深化贯通，高效、精准赋能一线投资顾问。截至报告期末，“涨乐财富通”累计下载量突破 6,230 万。根据易观智库统计数据，2021 年 6 月底，“涨乐财富通”月活数已突破 845 万，位居证券公司类 APP 第一名。报告期内，本集团作为首批获得基金投资顾问业务试点资格的证券公司之一，基金投顾业务获得快速发展，业务规模已居行业前列，产品研究、策略运营、陪伴服务体系日臻完善。本集团积极推进投资顾问专业队伍和财富管理服务能力建设，根据中国证券业协会统计数据，截至报告期末，母公司从业人员中投资顾问占比超过 32%。

体系化服务客户和高质量发展的—流投资银行业务

面对经济社会发展的新格局，本集团充分把握经济转型升级和以注册制为引领的资本市场改革机遇，继续加快行业布局、优化团队结构，深入贯彻“以客户为中心”的展业理念，积极打造以投行客户为中心的“生态圈”，依托全业务链大平台，持续加强投行业务与其他各项业务的联动协同，打造“买方 + 卖方 + 研究”三位一体的机构客户服务生态圈。本集团持续为新老客户提供境内外一体化的专业投行服务，同时坚持行业深耕，深度聚焦 TMT 行业、消费行业、大健康行业、能源与环保行业、金融行业、基础设施与地产行业、先进制造行业，依托对行业的深入理解和趋势研判，精准把握客户长短期需求，在重点行业领域成功开发并落地了一批优质客户。本集团股权承销、债券承销、财务顾问业务均在市场保持领先地位。报告期内，本集团境内股权承销规模人民币 689.92 亿元，居市场第三名。本集团持续保持在科创板的领先优势，截至报告期末科创板企业累计受理 55 家、累计上市 27 家，保荐企业受理及上市家数均居市场第二名。自 2012 年以来经中国证监会核准及注册的并购重组交易数量合计达 143 项，居市场第一名，本集团并购重组项目储备量处于市场领先水平，报告期内担任独立财务顾问的并购重组项目受理 12 单、截至 6 月末监管在审项目 12 单，均居市场第一名。报告期内，本集团境内全品种债券主承销金额人民币 4,043.59 亿元，行业排名第三，承销规模较去年同期增长约 75.84%。本集团持续推进创新驱动策略，完成交易所首批基础设施公募 REITs 首钢绿能 REITs 的发行。本集团境外业务取得较大突破，报告期内完成港股 IPO 保荐项目 5 单，位居中资券商第 2 名，并完成 2 单美股 IPO 项目。资本市场持续进行的改革开放，日益活跃的并购和融资活动，将为本集团带来宝贵机遇。

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，主动管理能力与规模持续提升，截至报告期末资产管理规模人民币 5,243.87 亿元，主动管理规模占比 80%，保持行业领先地位。管理产品覆盖主要资产大类，已形成规模可观、覆盖广泛的产品体系，打造了显著的运营优势和市场影响力。聚焦券商特色，系统化创设“基础产品 + 特色化产品”，强化与集团双向驱动，构建资产端产品输出模式，做大产品规模，满足集团及市场上零售客户和高净值客户对产品形式和风险收益的不同需求。同时，通过多资产、多策略定制化服务，为机构客户定制化提供—揽子的综合金融服务，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、流动性以及收益率的需求。本集团是业内 ABS 交易设计领导者，在基础资产、交易结构等层面的不断创新，为行业树立了标杆，在防疫抗疫、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。

## 全面提升国际业务综合竞争力和影响力

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。作为第一家在 A 股、港股以及伦敦三地上市的金融机构，集团继续坚持立足本土优势，贯彻服务境内客户“走出去”和境外客户“走进来”的国际化发展定位，强化团队、平台、客户资源的有效联动，着力打造跨市场的金融服务能力，持续深化跨境一体化联动。华泰国际持续强化集团海外业务桥头堡的角色，继续坚持券商本源业务，以跨境业务为抓手，打造全方位的销售交易业务平台，业务规模和盈利能力均进一步得到稳固。截至报告期末，华泰国际资产规模在突破千亿港元的基础上继续保持稳步增长，综合实力持续提升，跻身香港中资券商第一梯队前列。报告期内，华泰国际持续推进以固收业务平台、股权业务平台、个人金融平台、基金平台和旗舰投行业务构建的“4+1”业务平台体系的建设，通过境内外协同、股权债权结合、机构零售贯通、一二级联动，全方位满足客户需求。同时，华泰国际持续优化资产负债结构，并且不断做大资本市场中介业务规模，显著提升了整体收入水平、优化了整体收入结构。华泰国际继续聚焦头部客群，以平台化为基础推动机构业务体系升级，进一步做大跨境业务规模以及建立自动化交易平台，夯实了以主经纪商业务为核心的跨境销售交易业务体系；此外，华泰国际的财富管理业务在持续获客的基础上，全面向客户运营和资产配置转型，借助机构业务专长，发挥双轮驱动优势，提供差异化的产品服务，满足客户多层次的财富管理需求。AssetMark 继续保持运营独立性，通过领先的业务模式和先进的技术平台保持管理资产规模稳步增长，稳固行业领先地位，并持续提升本集团的国际业务收入。

## 兼具专业和平台优势的全面风险管理

本集团以全员、覆盖、穿透为核心理念，以集团化、专业化和平台化为主线建立健全全面风险管理体系。本集团具有良好的风险管理文化和清晰的风险管理目标，“稳健”始终是本集团企业核心价值观的重要组成部分。本集团积累建立了适应公司业务国际化发展的有效风险管理架构、流程和措施，持续推进对各子公司风险的体系化覆盖穿透和专业化集中统一管理。本集团重点打造专业化的风险前瞻评估和动态监测预警能力，深入业务提前发现风险，及时监测预警风险和快速应对处置风险。本集团高度重视以科技驱动风险管理能力及效率提升，运用数字化思维全力打造集中、时效、量化、穿透的风险管理技术平台，通过平台赋能风险管理，保障集团业务在风险可测、可控、可承受的前提下持续稳健开展。

## 一流的专业人才队伍和多元的股东基础

坚定打造市场化的体制机制是本集团持续转型超越的重要推动力。早在 2019 年，本集团职业经理人制度即已落地实施，构建了市场化、职业化的经营管理团队。新的经营管理团队视野开阔、经验丰富、业务能力强，正带领本集团打开新的发展局面。本集团深植“科技赋能、创新进取”的企业文化基因，不断丰富并深化“开放、包容、创新、奋斗、担当”的文化内涵，为“双轮驱动”战略的深入推进蓄积持久的动力与活力。本集团建立完善了以能力和贡献为导向的人才选拔任用机制，确立了市场化的用人机制和薪酬激励机制。报告期内，落地实施了面向核心骨干员工的股权激励计划；围绕经营发展需要，继续市场化多渠道引进海内外优秀年轻人才，尤其是金融科技人才，提升人才厚度，打造面向未来的国际化人才梯队。高端人才、创新型人才、跨界型人才和国际化人才陆续加盟，全职涯、立体化的动态培训体系持续满足员工发展需求。多元和均衡的股东和董事会架构有效提升了公司治理透明度，为本集团未来发展带来新的理念以及新的战略资源。



# 244

家营业部

# 28

家分公司

| 省市及地区    | 营业部数量 |
|----------|-------|
| 江苏省      | 95    |
| 北京市      | 6     |
| 上海市      | 15    |
| 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。

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。





# 经营层讨论与分析

## MANAGEMENT DISCUSSION AND ANALYSIS

### 一、经营情况的讨论与分析

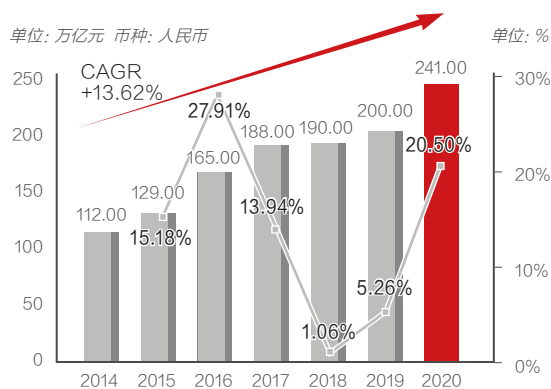
#### (一) 财富管理业务

##### 1、财富管理业务市场环境与行业趋势

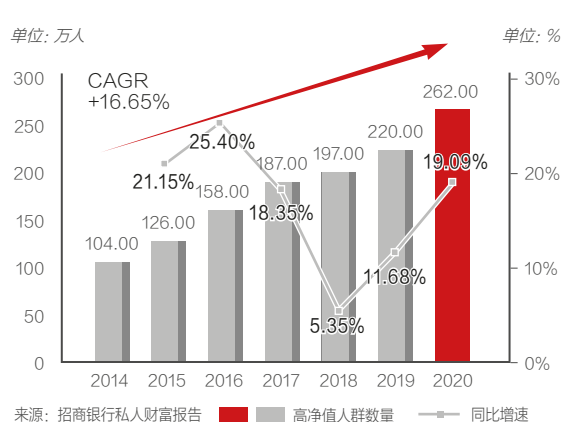
###### (1) 我国财富管理行业发展空间广阔，具备较强专业能力且服务体系成熟的机构将迎来发展机遇

随着我国实体经济潜能的不断释放、金融供给侧结构性改革的稳步推进、多层次资本市场的发展和完善、金融投资产品供给的日益丰富及社会总财富的持续增长，居民投资理财需求不断提升，资产配置结构日益优化，财富管理行业迎来发展的重要机遇期。基于品牌、内容营销与平台运营的服务模式获取客户心智将成为证券公司财富管理业务赢得未来的关键。根据招商银行私人财富报告统计数据，截至2020年年末，中国个人持有的可投资资产总体规模达人民币241万亿元，较2019年年末增长20.50%；个人可投资资产超过人民币1,000万元的高净值人群数量达262万人，较2019年年末增长19.09%。在双循环新发展格局构建、全市场注册制改革推进、财富管理行业渗透率提升、专业化业务需求增加等背景下，注重构建创新驱动的财富管理业务生态、打造专业化的资产配置服务能力、强化以客户为中心的服务理念、深度理解多元化的客户需求、聚焦客户全生命周期全品类产品服务的财富管理机构有望不断扩大竞争优势，为客户持续创造长久价值。

中国个人持有的可投资资产总体规模及同比增速情况



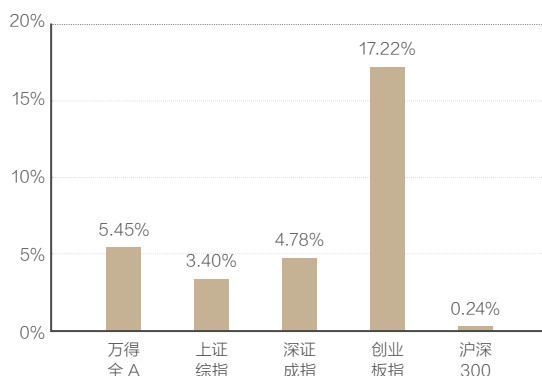
个人可投资资产超过人民币1,000万元的高净值人群数量及同比增速情况



## (2) 客户需求与市场竞争态势的变化持续推动证券公司财富管理业务转型升级

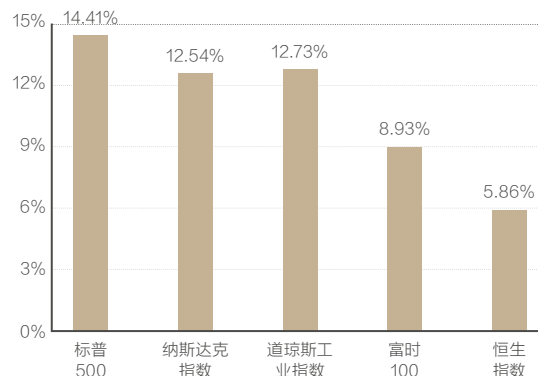
随着资本市场全面深化改革的持续推进、金融市场双向开放新格局的不断扩大、金融科技对证券行业的加速渗透、市场竞争的日趋激烈，证券行业股票基金交易平均佣金率水平持续保持低位，证券公司传统盈利模式及经营方式面临颠覆性挑战，构建新生态下的财富管理服务模式已成为证券公司战略转型的重要方向。报告期内，在经济加快复苏的宏观背景下，国内股票市场指数呈现震荡上行态势，上证综指上涨 3.40%、深证成指上涨 4.78%、创业板指上涨 17.22%；国际主要指数方面，标普 500 上涨 14.41%、纳斯达克指数上涨 12.54%、富时 100 上涨 8.93%。在境内外资本市场联动不断加强、监管政策和市场机制逐步完善、投资产品丰富度持续提升等背景下，资产配置服务的复杂性愈发增加，客户更加认可专业化财富管理机构的配置意见和服务价值。基金投资顾问业务试点机构的再扩容将为财富管理行业带来更大机遇，坚定向多元业务协同发展的综合型业务模式转型、持续提升专业能力并为客户提供全方位服务的金融机构更有机会在未来的竞争中取得优势。

2021 年上半年国内主要指数走势情况



来源：Wind

2021 年上半年国际主要指数走势情况



来源：Wind

## (3) 金融科技赋能与数字化转型重塑运营管理模式，引领财富管理行业迭代升级

近年来，证券公司积极把握金融科技应用场景不断拓宽及数字化浪潮加速渗透的新趋势，通过金融科技应用创新全方位赋能财富管理业务价值链各环节，构筑数字化、平台化、生态化的财富管理新模式，实现内外部资源协同、整合和共享，构建科技与业务全面融合联动的商业模式，不断优化客户体验、完善业务流程、提高运行效率、打造业务增长新动能，提升证券公司为客户提供专业化、智能化、一体化的综合金融服务能力。随着金融科技在财富管理行业应用的不断深化，金融科技正深刻改变着行业的服务边界、商业模式、资源配置及经营管理，已成为驱动金融生态演化的基本力量和构建证券行业竞争的战略制高点，特别是新冠肺炎疫情的防控催生金融服务线上化需求，为证券行业数字化和智能化转型发展提供了契机。充分运用金融科技手段深挖数据潜在价值，为客户提供全方位财富管理服务的必然选择，金融科技应用将助推证券公司向多元化的财富管理转型。

## 2、财富管理业务经营举措及业绩

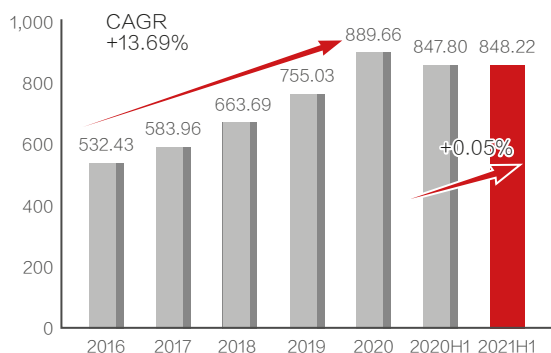
### (1) 证券期货期权经纪业务

报告期内，本集团坚守以客户需求为中心的价值观，依托数字化平台及全业务链体系优势，积极打造多维度、智能化的潜在客户挖掘、获客转化及资产配置等功能，全方位构建为客户创造价值的专业能力，加强客户品牌认知和专业依赖，持续深化财富管理业务体系化发展。基于客户分层分级体系和差异化需求，持续打造专业化的投资顾问队伍，全面提升以资产配置服务为核心的专业能力，推动规模化、专业化客户开发，促进渠道结构和客户结构优化，实现客户规模和客户资产的稳步增长。践行移动化、数字化、智能化导向，积极打造一站式、专业化、标杆型的财富管理平台，持续升级迭代投资顾问服务平台，不断优化业务运营模式，全面赋能专业队伍展业。

本集团持续优化升级“涨乐财富通”的业务功能及服务内容，陆续新增分时资讯、基金诊断、短视频/直播等功能，积极为用户打造全能投资工具箱，“涨乐财富通”客户数量及活跃度持续保持业内领先地位。报告期内，“涨乐财富通”下载量 422.96 万，自上线以来累计下载量 6,230.63 万；移动端客户开户数 183.10 万，占全部开户数的 99.72%；95.17% 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 848.22 万，截至报告期末月活数为 845.79 万，月活数位居证券公司类 APP 第一名，“涨乐财富通”继续发挥其作为本集团财富管理业务核心平台载体的重要作用。同时，本集团继续加强“涨乐全球通”平台建设，不断夯实平台基础交易服务能力，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 67.51 万，报告期内平均月活数为 10.17 万。

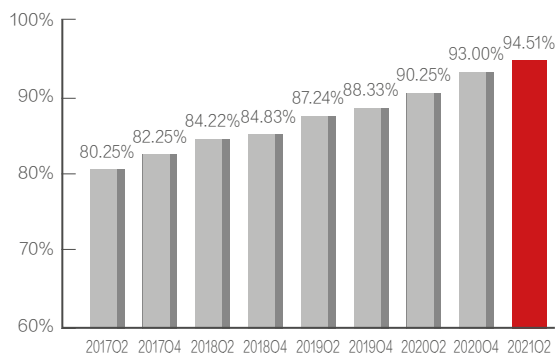
“涨乐财富通”平均月活数情况

单位：万



来源：易观智库统计数据

“涨乐财富通”交易人数占比情况



来源：公司内部统计

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 18.04 万亿元，排名行业第一。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 5.22 万亿元。

代理交易金额数据

币种：人民币

| 2021 年 1—6 月 |             | 2020 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           | 166,938.59  | 股票           | 135,315.97  |
| 基金           | 13,501.68   | 基金           | 10,870.20   |
| 债券           | 177,084.33  | 债券           | 148,775.51  |
| 合计           | 357,524.60  | 合计           | 294,961.68  |

注：鉴于 Wind 资讯不再统计公布会员交易量数据，2020 年 1—6 月、2021 年 1—6 月代理交易金额数据引自沪深交易所会员统计数据，其中，基金数据不含上交所场内货币基金交易量。

报告期内，港股通业务运行稳定，客户数量增长的同时服务不断深化，沪港通下港股通业务开通权限客户数 3.63 万户，深港通下港股通业务开通权限客户数 3.76 万户。股票期权经纪业务持续优化交易系统性能，强化线上线下联动服务，有效满足专业投资者高频量化交易需求，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，本集团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，华泰期货持续优化网点布局，截至报告期末，共有 9 家分公司、41 家期货营业部，遍及国内 4 个直辖市和 16 个省份，代理交易品种 94 个。报告期内，华泰期货（不含结算会员）实现代理成交量 40,852.01 万手，成交金额人民币 364,670.97 亿元。期货 IB 业务持续增长，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 229 家、期货 IB 业务总客户数 46,813 户。

## （2）金融产品销售与基金投资顾问业务

报告期内，本集团全面推进以客户需求为中心的金融产品业务开展，通过专业化与数字化的大类资产研究体系、策略研发体系、产品研究评价体系、产品和基金投顾服务体系，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。积极整合内外部资源，不断优化面向不同客群的产品线，提高产品和策略丰富度，强化分层分级的客户服务模式，提供多层次投资解决方案，持续强化业务品牌价值。根据内部统计数据，金融产品保有数量（除现金管理产品“天天发”外）6,173 只，金融产品销售规模（除现金管理产品“天天发”外）人民币 3,654.36 亿元，金融产品销售业务规模稳步增长。根据中国证券投资基金业协会截至 2021 年二季度的统计，本集团股票及混合公募基金保有规模人民币 1,079 亿元、非货币市场公募基金保有规模人民币 1,126 亿元，均排名行业第二。

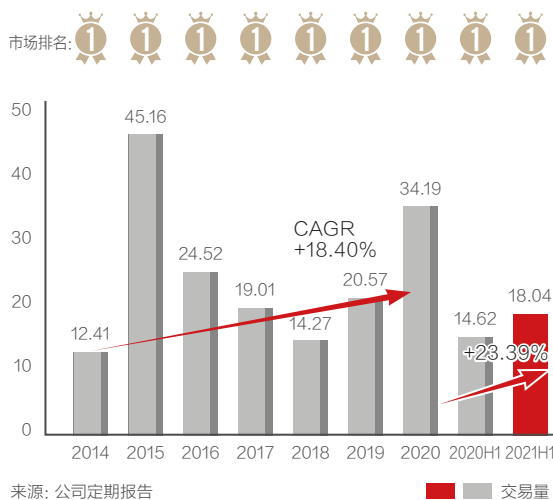
报告期内，基金投资顾问业务健全完善策略投研体系、运营推广体系、服务体系及相关系统平台，不断优化客户服务场景、客户服务方案和陪伴式服务，加强业务培训和宣导，通过持续客户运营，不断提升客户覆盖度。继续完善策略投研基础设施，打造资产研究、配置研究及基金研究为一体的基金投研体系，优化交易管理和风控管理功能，切实提升客户资产配置服务能力。本集团基金投资顾问业务涵盖打理闲钱、跑赢通胀及追求收益三大客户需求场景，合计 14 个策略组合，策略组合运行稳健，截至报告期末，根据内部统计数据，基金投资顾问业务授权资产人民币 62.29 亿元、客户数 18.35 万户。此外，本集团注重强化数字化赋能平台搭建，积极构建数字化平台架构，有效提升业务整体效率与能力。

## （3）资本中介业务

报告期内，本集团依托全业务链合作的业务优势，持续挖掘客户需求，构建矩阵式客户服务体系，积极创新业务运营模式，增强差异化与专业化服务能力，巩固业务竞争优势。快速响应市场变化和监管要求，完善营销服务体系，落实全过程风险管控理念，提升风险管理效能，通过平台建设引领数字化转型，推动资本中介业务高质量发展，持续扩大品牌影响力。以智能撮合和平台算法为抓手，以联通更多证券借贷市场参与者为目标，持续推进“融券通”平台迭代优化，致力于为平台参与者提供全方位的一站式服务。报告期内，受益于 A 股市场信用交易活跃度提升，本集团资本中介业务发展态势良好，融资融券业务规模增长明显，市场份额继续提升，融券业务快速发展，股票质押式回购业务结构改善，业务风险平稳可控。根据监管报表数据口径，截至报告期

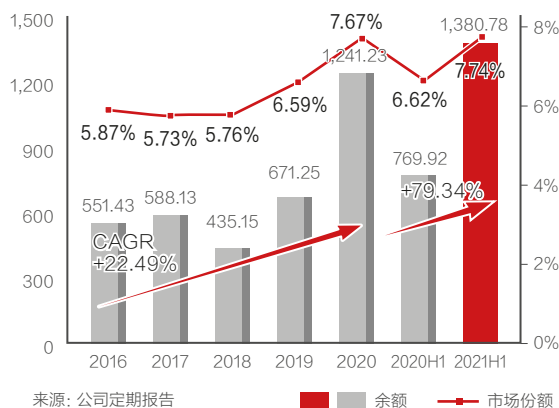
## 股票基金交易量情况

单位：万亿元 币种：人民币



## 融资融券业务规模情况

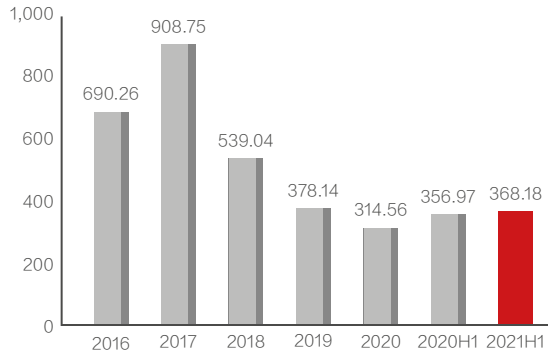
单位：亿元 币种：人民币



末，母公司融资融券业务余额为人民币 1,380.78 亿元，同比增长 79.34%，市场份额达 7.74%，整体维持担保比例为 306.42%，其中，融券业务余额为人民币 287.04 亿元，同比增长 694.66%，市场份额达 18.39%；股票质押式回购业务待购回余额为人民币 368.18 亿元、平均履约保障比例为 290.20%，其中，表内业务待购回余额为人民币 62.67 亿元、平均履约保障比例为 264.46%，表外业务待购回余额为人民币 305.51 亿元。

股票质押式回购业务规模情况

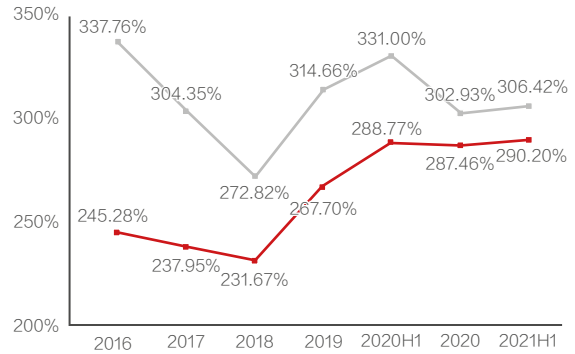
单位：亿元 币种：人民币



来源：公司定期报告

■ 待购回余额

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

— 融资融券业务整体维持担保比例  
— 股票质押式回购业务平均履约保障比例

### 3、财富管理业务 2021 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。2021 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，打造客户、投资顾问两端平台化运营模式，通过大规模获取客户、精准化激活客户、专业化转化客户价值，推动财富管理业务向客户全生命周期服务和资产配置服务模式转型，持续打造面向未来的全新竞争优势。

财富管理业务将不断适应市场发展变化，依托市场领先的客户规模和完备的全业务链条，坚守合规底线，以智能化、数字化、精准化和专业化的线上线下融合模式推动业务高质量发展；基于客户需求和资产配置策略的联动，打造多元化金融产品和策略产品体系，健全差异化服务模式，为客户创造可持续长期价值的同时提升金融产品服务变现能力；深化数字化发展战略，不断强化投资顾问队伍数智赋能，持续沉淀优秀投资顾问服务模式，同时继续优化投资顾问分层分级服务体系，加强精细化运营，全面提升投资顾问服务效能；继续贯彻科技赋能、平台驱动的理念，推进一体化的全业务链智能交互数字化平台建设，集中平台专业化资源和数字化能力，打造精细化、数据化、系统化运营体系，不断增强用户黏性和好感度。

金融产品销售业务将不断丰富优质产品资源储备、迭代优化策略模型、完善服务体系以及系统平台功能，加强客户需求响应和资源整合能力，持续扩大业务规模并强化业务优势。全面推进一体化的基金投资顾问业务，不断丰富需求场景和策略组合，开发有竞争力的产品策略，扩大客户覆盖，加强陪伴服务，提升业务整体竞争力和品牌影响力。加强数字化赋能，持续推进数字化运营系统能力建设，为业务开拓提供有效支撑。

资本中介业务将继续以客户需求为导向，创新产品设计与运营模式，全面强化风险管控能力，持续完善营销服务体系，不断加强资源型客户开发，进一步巩固行业领先优势。加大资源投入力度，持续推进“融券通”平台迭代更新，构建境内外、场内外一体化券池，积极打造开放、高效的证券借贷行业生态，不断增强融通品牌优势，构筑股票质押业务新生态，满足客户综合性融资服务业务需求。

## （二）机构服务业务

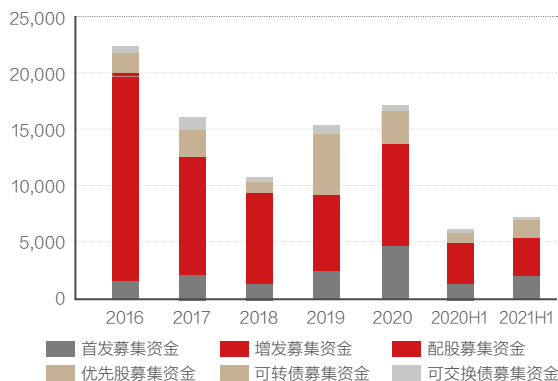
### 1、机构服务业务市场环境 with 行业趋势

#### （1）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提供战略性机遇

随着我国经济发展稳定恢复态势的巩固拓展、供给侧结构性改革与创新驱动发展战略的深入推进，资本市场服务经济高质量发展的战略地位持续提升，市场活力和动力进一步释放，机构服务业务迎来跨越式发展的良好契机，为机构客户提供全方位高品质的综合金融服务将成为证券公司核心竞争力的重要体现。近年来，在新《证券法》正式实施、常态化退市机制健全完善、注册制改革落地并分步骤向全市场推开的背景下，资本市场开启基础性制度全面优化、市场生态全面重构的改革发展新阶段，证券公司投资银行业务面临高阶转型战略机遇，业务能力突出、项目储备丰富的证券公司将迎来更多业务增量和收入。未来，随着我国资本市场改革的纵深推进，资本市场服务科技创新和实体经济的能力将显著提升，证券行业有望在拓展新经济和科技创新企业融资渠道、支持传统产业整合升级、吸引优质公司回归、丰富资本市场产品种类等方面拓宽业务边界，有能力更好把握宏观经济趋势、全方位提升全价值链综合服务能力并为客户创造长期价值的证券公司将面临更多业务机会。

股票发行统计情况

单位：亿元 币种：人民币

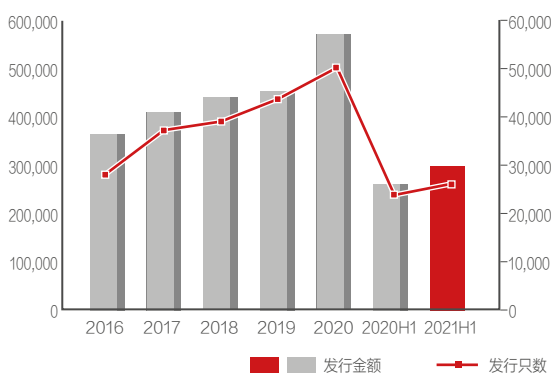


说明:

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

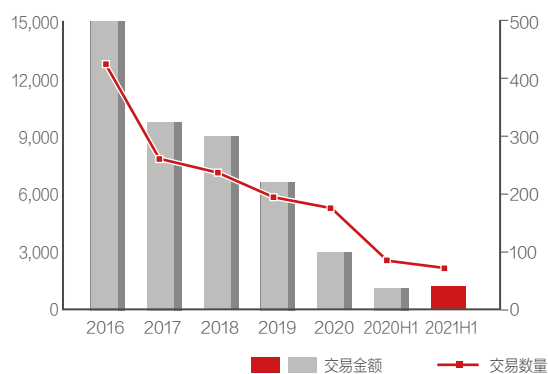


说明:

1. 数据来源: Wind;
2. 统计范围包括国债、地方政府债、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) 市场机构化、头部化、国际化趋势对证券公司机构服务能力提出更高要求

随着资本市场的加速扩容，境内外专业机构投资者的发展壮大，国内社保资金、保险资金和银行理财资金等的推动入市，外资准入门槛的降低，个人投资者借助金融产品间接参与证券市场投资的增加，以及新技术的发展与运用，机构市场影响力更趋明显，机构投资者正在成为资本市场主力军。特别是在推动基金发展的政策导向及资本市场改革红利的驱动下，居民财富配置加速向金融资产迁移的趋势持续强化，公募基金规模再创历史新高，资本市场机构化进程进一步加快，这对证券公司一体化、专业化金融服务能力提出更高要求。此外，在资本市场高水平双向开放新格局加快形成、证券公司分类监管与“白名单”制度实行、航母级证券公司打造等背景下，市场优势资源加速向优质机构集聚，行业实力分化更趋明显，基于平台赋能、高效整合境内外业务资源为客户提供综合金融服务将成为证券公司机构服务业务新一轮竞争的关键。未来，具备体系化机构服务优势和差异化、国际化机构服务能力，并在机构客户基础、专业人才队伍、品牌影响力等方面占据优势的大型证券公司将取得发展先机。

(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

近年来，随着金融风险表现形式及传导途径的日趋复杂、风险管理难度的持续增加，打造与自身发展战略及业务发展相匹配的风险管理能力，建立真正可测、可控、可承受的一体化风险管理体系，成为证券公司走得更稳、走得更远的关键。证券公司必须不断健全风险监管机制，保障全面风险管理体系有效覆盖，提高风险管理的专业性和渗透性，全面提升风险管理能力，有效预防、管理和化解金融风险，增强核心竞争优势。预防和管理金融风险需要证券公司不断优化风险管理组织架构和运作流程，持续健全专业化和平台化的全面风险管理机制，实现风险信息的集中监测分析和全流程管控。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。证券公司应基于估值、定价和交易等专业能力的不断提升，充分发挥独有的风险管理服务价值和差异化的金融产品创设能力，深化专业风险对业务全流程的覆盖穿透，提升风险管理策略和管控措施的专业性、前瞻性和主动性，切实把握机构服务业务高阶发展的新机遇。

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，本集团持续推进全业务链战略，秉持以客户为中心的经营理念，深度布局重点区域、聚焦重点行业、境内外一体化服务客户，市场排名与份额名列前茅，投资银行业务市场地位和品牌优势进一步巩固提升。

合并数据

币种：人民币

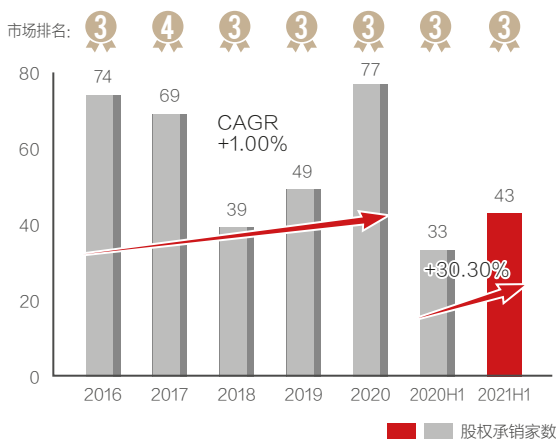
| 发行类别 | 主承销次数(次) |       | 主承销金额(万元)     |                | 主承销收入(万元)  |              |
|------|----------|-------|---------------|----------------|------------|--------------|
|      | 本期       | 历年累计  | 本期            | 历年累计           | 本期         | 历年累计         |
| 新股发行 | 16       | 211   | 1,164,696.76  | 16,035,276.96  | 70,250.59  | 761,727.98   |
| 增发新股 | 19       | 235   | 3,146,689.80  | 37,997,124.02  | 20,096.63  | 288,975.31   |
| 配股   | 1        | 33    | 396,189.30    | 2,063,047.02   | 1,495.05   | 22,627.93    |
| 债券发行 | 536      | 2,441 | 19,953,049.02 | 158,080,159.43 | 44,717.10  | 466,582.76   |
| 合计   | 572      | 2,920 | 24,660,624.88 | 214,175,607.43 | 136,559.37 | 1,539,913.98 |

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、企业债、公司债(含可交换债)、可转债、短期融资券、中期票据等。

## ① 股权承销业务

报告期内，股权承销业务充分发挥全业务链体系和大投行境内外一体化平台优势，为客户提供多样化、全周期、定制化的资本市场服务，业务继续保持稳健发展。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 689.92 亿元，行业排名第三。根据上交所统计数据，截至报告期末，本集团保荐科创板企业累计受理 55 家、累计上市 27 家，行业均排名第二。

### 股权承销数量及排名情况



说明:

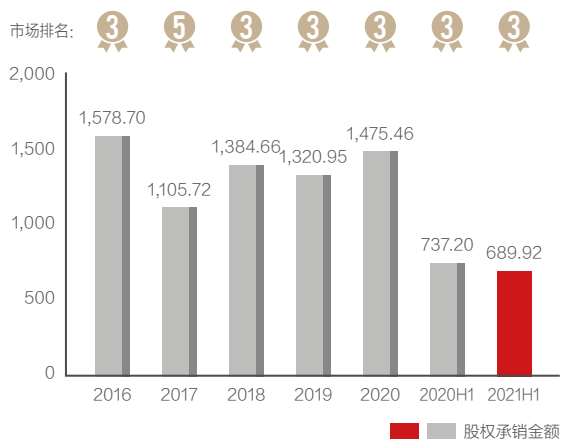
1、数据来源: Wind;

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。

### 股权承销金额及排名情况

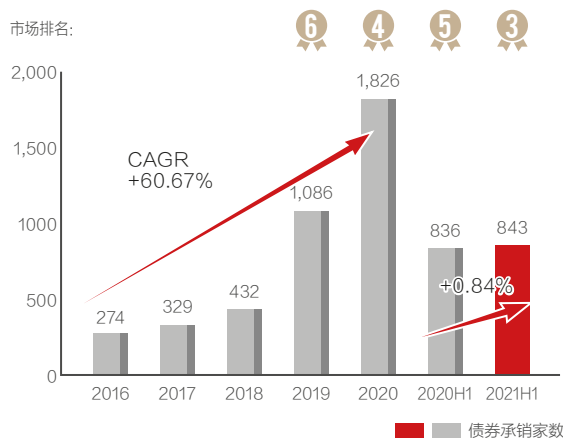
单位: 亿元 币种: 人民币



## ② 债券承销业务

报告期内，债券承销业务在严格控制风险的基础上，充分利用全牌照优势，发挥股债联动的全能型业务优势，重点发力地方政府债、公司债、资产支持证券和金融债产品，不断夯实展业渠道，客户群体数量进一步增加，客户结构不断优化，业务规模实现显著增长。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 4,043.59 亿元，行业排名第三。

### 债券承销数量及排名情况



说明:

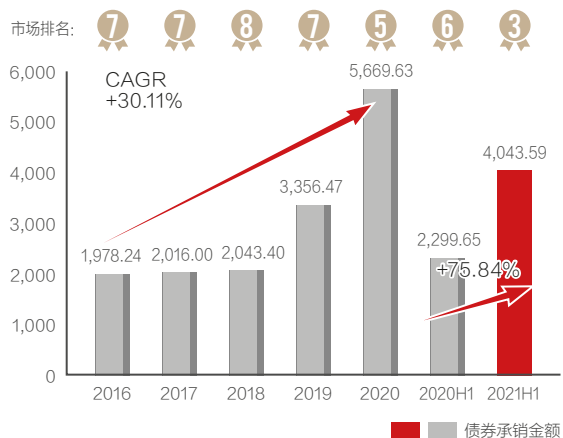
1、数据来源: Wind;

2、统计范围包括地方政府债、政策性金融债、非政策性金融债(含证券公司债)、企业债、公司债、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、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、可交换债及其他债券;

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, 另外 Wind 统计范围与监管报表不同, 因此 Wind 数据和公司统计数据有差异; 对于发行只数的计算方法, Wind 和监管报表统计口径不同。

### 债券承销金额及排名情况

单位: 亿元 币种: 人民币





### ③ 财务顾问业务

报告期内，并购重组财务顾问业务致力于打造市场标杆性项目，不断提升行业研究能力、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，并购重组储备项目市场领先。根据中国证监会及交易所公开数据整理，本集团报告期内担任独立财务顾问的并购重组项目受理 12 单、截至报告期末监管在审项目 12 单，行业均排名第一。报告期内，经中国证监会核准及注册的并购重组交易家数 2 家、交易金额人民币 91.06 亿元。

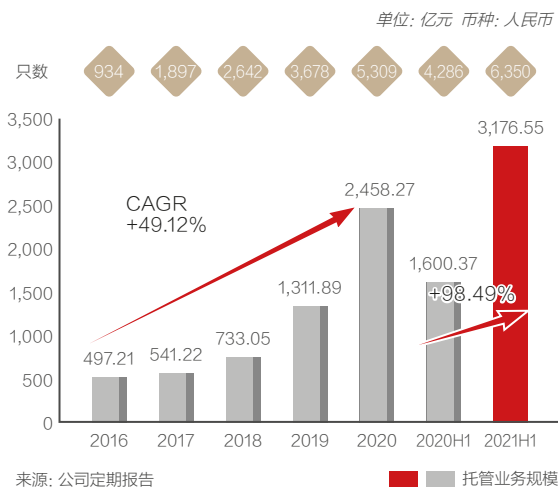
### ④ 场外业务

报告期内，新三板业务充分发挥大投行一体化优势，积极承接持续督导项目并为客户提供包括股票定向发行、公开发行并进入精选层等服务。报告期内，本集团为 23 家挂牌企业提供持续督导服务，完成股票公开发行并进入精选层主承销项目 1 单、保荐承销项目辅导阶段 1 单，并完成股票定向发行在审项目 1 单。控股子公司江苏股权交易中心继续加强合规风控体系建设，不断强化挂牌展示特色板块发展，积极探索新业务模式，持续拓展融资服务方式，坚持金融科技赋能，有序推进区块链试点建设，着力为中小微企业提供优质的综合性金融服务。截至报告期末，挂牌展示企业 9,702 家，托管企业 138 家，会员单位 252 家，各类投资者 76,978 户，报告期内为企业新增融资人民币 41.54 亿元。

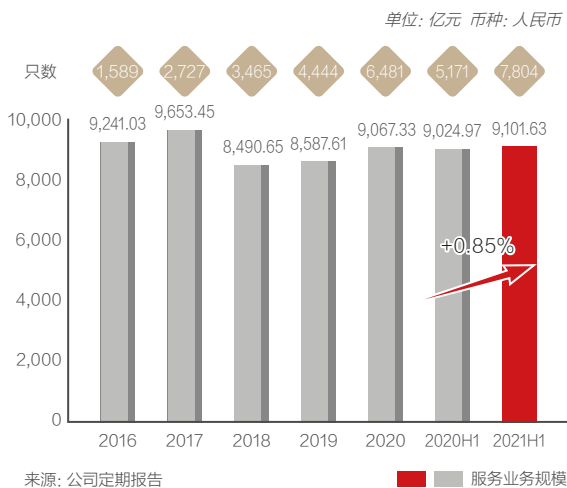
## (2) 主经纪商 (PB) 业务

报告期内，本集团践行以客户为导向的全业务链服务体系，围绕客户全生命周期的综合金融服务需求，体系化推动 PB 业务发展，积极拓展基础金融功能，持续丰富服务内涵，不断优化客户结构和业务结构，积极探索多元变现，同时持续推进面向内外部客户的一体化服务平台功能建设，不断完善系统功能，促进数字化转型和运营效率提升。截至报告期末，基金托管业务累计上线产品 6,350 只，托管业务规模人民币 3,176.55 亿元；基金服务业务累计上线产品 7,804 只（含资管子公司产品 740 只），服务业务规模人民币 9,101.63 亿元（含资管子公司业务规模人民币 5,041.22 亿元）。

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，研究业务不断深化全业务链，打造以产业链体系为中心的研究架构，持续完善专业人才队伍和人员培养体系，牵引深度行业、产业和趋势研究，坚定推进业务模式转型，不断提升业务协同效能，提高研究服务对接的有效性。持续推进数字化战略，以 RIS 和“行知”平台为支撑，加强智能研究平台体系化建设，积极构建机构客户服务生态圈，创新服务模式，强化研究质量管理，提升机构客户参与体验。积极打造跨境研究服务体系，完成研究产品互通体系搭建，推动实现研究报告一体化生产流程，有效满足海内外客户双向、多层次的专业化研究服务需求。机构销售业务依托全业务链优势，加大业务资源投入，充分发挥协同效应，做实机构投资者层级制管理，重塑机构客户服务体系，深入对接机构投资者多样化需求，持续优化升级机构客户服务平台“行知”APP 及机构客户 CRM 系统等数字化系统工作平台功能，

全力推动业务模式转型和能力进阶。本集团积极开展多种形式的研究服务活动，发布研究报告 4,114 篇，组织研究路演服务 10,598 场、专题电话会议 566 场，通过线上或线上线下相结合方式举办策略会及专题会议 4 场。报告期内，公募基金分仓交易量约人民币 6,301.02 亿元。

#### (4) 投资交易业务

##### ① 权益交易业务

报告期内，本集团继续坚定推进业务模式全面向交易导向转型，坚持去方向化，重点打造宏观对冲业务体系，优化完善大数据交易业务体系，大力拓展创新业务模式，不断提升投研一体化平台效能，全面升级投资交易能力。宏观对冲业务不断加强宏观策略研究队伍建设，强化投资策略运用，完善行业基本面研究体系，健全市场微观监控体系，动态监测市场特征，积极挖掘市场运行规律，有效识别市场机会和风险，支持交易业务开展。大数据交易业务不断加强事件型策略研发，夯实 Alpha 交易策略和套利策略，构建多场景、多品种、多周期、多策略的业务体系，同时借助大数据和人工智能等技术手段，积极打造一体化的大数据交易业务平台，推动交易规模和盈利水平的提升。

##### ② FICC 交易业务

报告期内，本集团充分发挥 FICC 业务体系的综合化及多元化运作优势，积极打造跨品种、跨市场的产品线，不断提升数字化运营水平，以科技赋能优化交易系统，推动业务快速发展。固定收益自营投资业务综合运用策略交易、多元化资产配置及杠杆操作等方式，稳健开展投资运作，积极把握定价偏差及估值修复机会，自营投资业绩良好。不断推进 HEADS 大交易平台建设和 CAMS 信用分析管理系统开发，体系化、平台化提升投资交易能力和风险管理能力。大宗商品业务和外汇业务持续推进策略交易研究，加快代客外汇交易系统开发，不断丰富交易品类，积极打造核心投资交易和定价能力，持续提升盈利能力。根据 Wind 资讯统计数据，报告期内，本集团债券交割量排名行业第四。

##### 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核心的场外衍生品业务体系，加速推进数字化转型，以科技重塑业务发展模式与管理范式，不断提升业务创新能力和交易定价能力，深度对接机构服务体系和客户需求，创设并推广跨市场、多样化、差异化的金融衍生产品，为客户提供全方位的衍生品交易服务。截至报告期末，收益互换交易业务存量为 3,833 笔，存量名义本金为人民币 694.72 亿元；场外期权交易业务存量为 1,016 笔，存量名义本金为人民币 444.59 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 1,822 只，合计规模人民币 352.81 亿元。

### 3、机构服务业务 2021 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。2021 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。

投资银行业务将深入贯彻“以客户为中心”的经营理念，依托全业务链大平台，加强境内境外、场内场外业务跨市场协同，重点聚焦新兴行业，广泛布局服务区域，全面提升全产品链的专业服务能力，并围绕行业头部客户积极打造大投行“生态圈”，推动对头部客户多元化和一体化全覆盖。股权承销业务将继续把握资本市场改革机遇，不断践行重点区域开发和行业深耕，加大优质客户布局，同时加强跨境联动，真正在境内外资本引入和境内外资源配置上为客户赋能；债券承销业务将在保持高速发展势头的基础上，加大专业布局，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；财务顾问业务将在保证储备项目高效执行的前提下，着力探索境内外基于产业逻辑的并购机会，以全面透彻的行业研究为基石，提升大规模交易机会的发现及撮合能力。

主经纪商业务将不断深化专业机构一体化服务平台建设，优化服务路径和服务流程，以平台化运营打造业务竞争优势，延伸业务服务内涵，强化业务协同及专业服务能力，持续为客户提供综合性服务，推动业务价值多元转化。

研究与机构销售业务将持续健全境内外一体化的业务体系，着力打造具备综合服务能力的专业队伍，不断完善协同联动的客户服务机制，深入贯彻数字化运营战略，全面拓展系统工作平台的服务内容维度和服务深度，有效提升客群专业化服务能力。

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能力，进一步推动盈利模式多元化。权益交易业务将持续升级宏观对冲交易能力，继续完善大数据策略体系，深入拓展创新业务模式，依托业务平台性能的提高与拓展，打造具备核心竞争力、可持续发展的权益投资与交易体系；FICC 交易业务将深入开发 CAMS 信用分析管理系统和一体化的 FICC 大交易平台，主动引导客户需求，不断加强产品和服务体系建设，持续完善投资交易决策体系，驱动业务高阶转型；场外衍生品交易业务将不断丰富产品结构、创新交易模式，积极打造高效的系统平台及数字化中后台，充分发挥系统化交易与金融科技优势，全面提升客户综合价值创造能力。

### （三）投资管理业务

#### 1、投资管理业务市场环境与行业趋势

##### （1）资产管理业务进入回归本源、规范发展的新时代

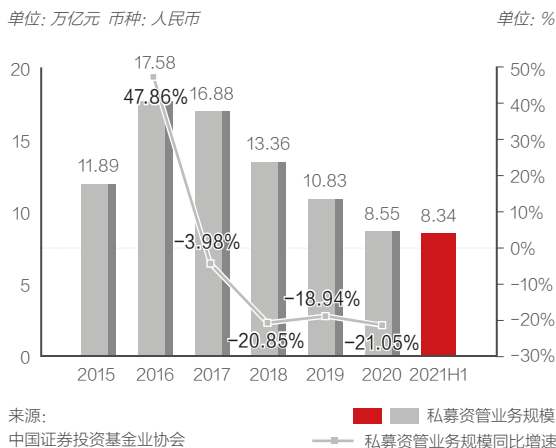
随着资产管理业务法律制度基础的不断健全完善，我国资产管理行业开启回归本源、规范发展、深度竞合的新征程，大集合公募化改造步伐加快，产品创新持续萌生活力，公募 REITs 启动发行，数字化变革加速业务升级与生态重塑，资产管理行业呈现分层次的竞争格局，各类资管机构正积极谋求新的业务发展方向及战略布局，持续打造全品类、丰富完善的产品体系以及全球视野的投资策略。在资产管理行业新发展格局下，资管机构亟

待向主动管理转型，打造差异化核心竞争力，具备优质增值服务及产品附加值能力的证券公司将在新一轮变革中取得优势。根据中国证券投资基金业协会统计数据，截至 2021 年二季度末，基金管理公司及其子公司、证券公司、期货公司、私募基金管理机构资产管理业务总规模约人民币 63.73 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 8.34 万亿元。对于大型综合性证券公司而言，资产管理业务应在深度把握客户需求和结构变化的基础上，依托全业务链协作及一体化专业优势，持续打造差异化的投资管理能力和精细化的资产定价能力、完善的风险管理能力，构建专业化资产管理平台，积极整合优质业务资源，致力于为客户提供多层次全方位高质量的投资产品、资产配置和整体金融解决方案。

##### （2）私募股权募资和投资规模保持低位，行业竞争加剧，头部效应日益凸显

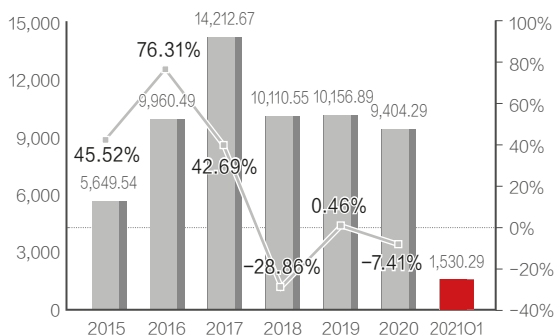
在全球疫情持续蔓延、宏观经济增速放缓、私募监管环境与行业自律体系日益趋严的背景下，私募股权市场依然面临严峻考验，市场募资难趋势延续，基金平均募资规模继续下滑。随着国内生产生活以及各类商业活动的迅速恢复，私募股权投资市场回暖，投资案例数量和规模明显回升。同时，优质项目竞争激烈，头部机构效应日益明显，市场资金向着具有强大专业能力、资源整合能力的头部机构聚集，行业生态格局进一步重塑。根据清科研究中心私募通统计数据，2021 年第一季度，私募股权募资市场新募资金 649 支，募资金额人民币 1,530.29 亿元，较 2020 年同期减少 14.3%；私募股权投资市场发生投资案例 1,005 起，投资金额人民币 1,925.03 亿元，较 2020 年同期增长 86.5%。长期来看，随着资本市场的全面深化改革，多层次市场体系逐步完善，市场基础性制度全面优化，特别是在未来注册制全面实施的市场背景下，资本市场在促进创新资本形成、孕育创新经济功能、为科技创新企业提供覆盖全生命周期金融支持等方面将发挥更重要作用，私募股权投资业务未来成长空间依然广阔。证券公司系私募股权投资业务将依托全业务链优势，凭借专业化、立体化的投资管理体系，持续增强全方位综合服务能力，积极打造业务核心竞争优势，切实提升服务实体经济的效率。

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



## 私募股权募资市场基金募资规模及同比增速情况

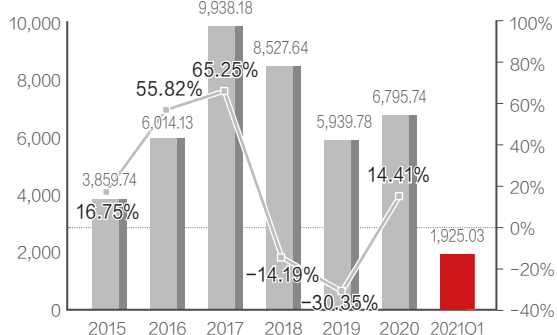
单位: 亿元 币种: 人民币



来源: 清科研究中心私募通统计数据  
■ 私募股权募资市场基金募资规模  
— 私募股权募资市场基金募资规模同比增速

## 私募股权投资市场投资规模及同比增速情况

单位: 亿元 币种: 人民币



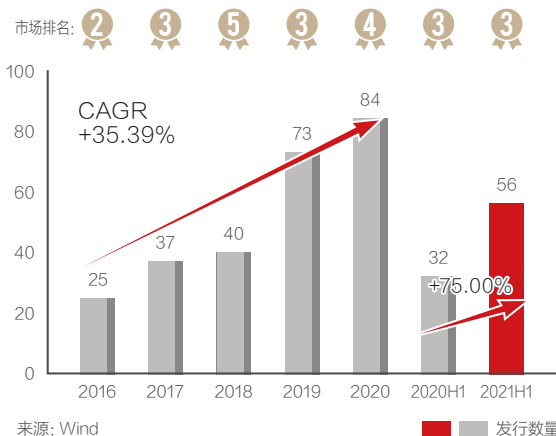
来源: 清科研究中心私募通统计数据  
■ 私募股权投资市场投资规模  
— 私募股权投资市场投资规模同比增速

## 2、投资管理业务经营举措及业绩

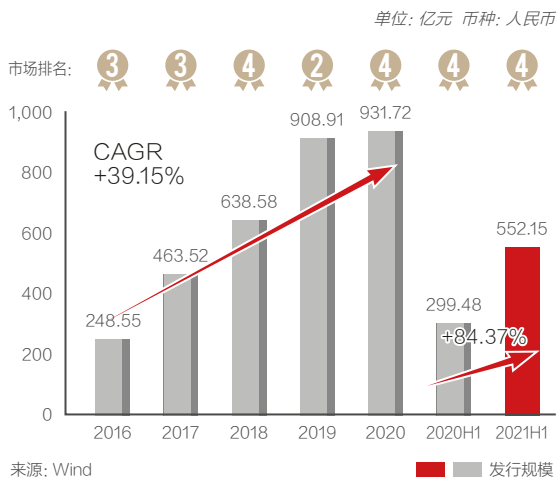
### (1) 证券公司资产管理业务

报告期内,在资管新规整改进入关键期的背景下,本集团全资子公司华泰资管公司依托全业务链资源优势,着力打造数字化、生态化运营模式,全面提升投研水平、定价能力及风控效能,积极培育可持续、高质量、高附加值的业务模式,不断加强主动投资管理能力,为客户提供全生命周期、全业务链条的综合金融服务解决方案。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 5,243.87 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) 发行规模人民币 552.15 亿元,行业排名第四。

### 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



报告期内,证券公司资产管理业务聚焦资产识别和风控能力,依托自身产品设计能力和定价能力优势,严格把控基础资产质量,巩固提升资产证券化业务领先优势,加大业务创新力度,积极培育发展公募 REITs 业务,加快向主动管理方向转型步伐,资产管理规模质量不断提升。集合资产管理业务综合实力稳定,净值型产品序列丰富,合计管理集合资管计划 195 只,合计管理规模人民币 1,187.35 亿元。单一资产管理业务加快探索净值型委外业务,持续推进业务转型,合计管理单一资管计划 408 只,合计管理规模人民币 2,485.92 亿元。专项资产管理业务继续保持特色优势,企业资产证券化项目发行数量及规模位居行业前列,合计管理专项资管计划 137 只,合计管理规模人民币 1,367.95 亿元。公募基金管理业务积极打造针对投资者不同流动性需求的净值化理财解决方案,发行成立 3 只公募基金,合计管理公募基金产品 20 只,合计管理规模人民币 202.65 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

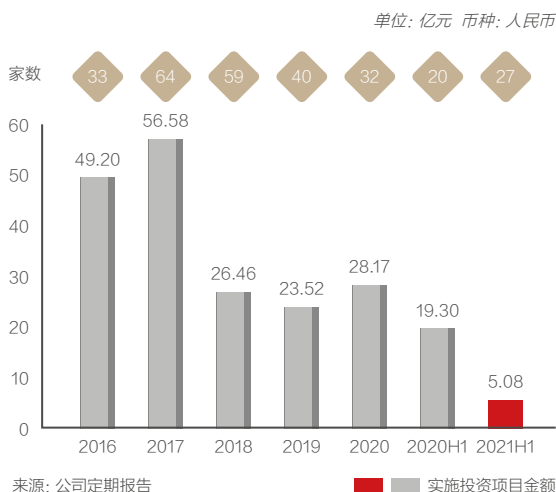
| 项目         | 2021年1—6月 |           | 2020年1—6月 |           |
|------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|            | 受托规模(亿元)  | 净收入(万元)   | 受托规模(亿元)  | 净收入(万元)   |
| 集合资产管理业务   | 1,187.35  | 49,901.04 | 1,496.69  | 81,583.04 |
| 单一资产管理业务   | 2,485.92  | 12,267.53 | 4,316.81  | 17,864.66 |
| 专项资产管理业务   | 1,367.95  | 6,006.74  | 1,005.31  | 4,786.31  |
| 公募基金资产管理业务 | 202.65    | 3,425.65  | 357.24    | 6,849.76  |

注：上表数据来源于监管报表。

### (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积极适应监管变化，不断优化业务架构体系，继续聚焦行业定位，强化重点领域的深度布局，把握科创板及创业板注册制改革等资本市场红利，充分发挥集团大平台优势，积极推进股权投资基金和母基金的募集，不断增强专业化投资管理能力。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 22 只，合计认缴规模人民币 477.65 亿元，合计实缴规模人民币 407.42 亿元。报告期内，上述私募股权投资基金实施投资项目合计 27 家，投资金额合计人民币 50,762.37 万元，均为股权投资类项目。根据中国证券投资基金业协会截至 2021 年二季度的统计，华泰紫金投资私募基金月均规模行业排名第二。

### 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积极顺应监管趋势和市场变化，坚持合规管理与业务发展并重，继续加强产品研究和业务创新，持续优化产品线布局，不断丰富销售和推广方式，着力完善智能化系统建设，资产管理规模显著增长，市场认知度和美誉度进一步提高。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 14,536.66 亿元，其中，公募业务管理基金数量合计 245 个，管理资产规模合计人民币 10,071.28 亿元；非公募业务管理资产规模合计人民币 4,465.38 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 2,317.13 亿元，其中，公募业务管理基金数量合计 90 个，管理资产规模合计人民币 2,174.24 亿元；非公募业务管理资产规模合计人民币 142.89 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，本集团控股子公司华泰期货顺应行业监管趋势，注重发挥合规风控管理效能，积极打造多元化业务体系，着力推动向主动管理业务转型，持续完善数字化运营体系，不断提升专业化服务水平、智能化管理水平及业务创新能力，业务规模实现明显增长。截至报告期末，存续期内资产管理计划合计 24 只，资产管理总规模人民币 183,789.49 万元，期货端权益规模人民币 44,908.39 万元。

### (5) 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，华泰创新投资持续健全完善内部管理制度和机制，根据监管要求及业务布局，着力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新三板战略配售业务。截至报告期末，存续投资项目 40 个，投资规模人民币 164,590.47 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 2021 年下半年展望

投资管理业务是本集团金融产品创新和客户资产管理的专业平台，承载着资产管理者和资产服务者的双重战略角色。2021 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继续依托全业务链资源，聚焦科技赋能，以数字化转型牵引业务体系的重塑和管理流程的再造，持续打造严密的风险管控能力，重塑硬核实力。深挖内部客户需求，积极开拓外部客户，创新产品形式与客户服务模式，构建完善以客户为中心的金融产品体系，加强投资研究体系建设，全方位提升主动投资管理能力和投资业绩，持续巩固市场地位和品牌价值。

私募股权基金管理业务将把握资本市场改革机遇，充分发挥集团全产业链业务优势，依托良好的管理能力和历史业绩，结合产业基金、并购基金和母基金等各类基金的资源配置及在重点行业的投资研究优势，持续加大投资力度，积极打造一流的行业影响力；不断完善数字化系统建设，加强对业务的全流程管理，持续提升全方位综合服务能力及专业化发展实力。

基金公司资产管理业务将继续加强风险防控和人才资源储备，不断巩固关键领域的优势地位，持续推动新业务探索与新产品开发，积极拓展市场和服务客户范围，加大金融科技引领业务发展和管理变革的力度，着力增强投资研究专业能力，有效提升整体资产管理规模，大力提升投资业绩。

期货公司资产管理业务将在强化内部管理和合规风控基础上，贯彻全业务链发展战略，持续推动全方位协同合作，大力推进系统平台建设，借助金融科技推动和引领业务模式、商业模式及管理模式创新，持续提升投资管理核心竞争能力。

另类投资业务将持续健全完善投资管理和业务发展模式，不断优化业务操作流程，审慎推进股权投资、科创板跟投及其他新业务的开展，有效防范和化解各项风险，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）资本市场双向开放新格局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

近年来，在我国资本市场高水平双向开放广度和深度不断增强的背景下，新渠道不断涌现，跨境投资愈加顺畅，境内外市场互联互通程度不断加深，跨境业务更趋多元化，资本市场开始具备链接境内外金融及产业资源、构建双循环体系枢纽平台的新价值定位，证券行业迎来历史性重大发展机遇，证券公司国际化发展进程也将深入推进。当前，客户跨境综合金融服务需求日益增加，资产全球配置趋势持续增强，国际业务已成为大型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。证券公司应抓住全面对外开放带来的资本市场发展新机遇，充分发挥专业和客户资源优势，依托境内外一体化平台与全业务链体系，建立长效的跨境联动机制与内部协同激励机制，持续打造客户跨境服务核心竞争力，在满足实体经济多品种、跨区域全球资源布局和资产配置需求的同时，提升国际化经营管理能力。

#### （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 PriceMetric 统计数据，2020 年投资顾问收入中 75% 来自管理费，相对佣金收入而言达到历史新高。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，2015 年至 2020 年间，TAMP 市场年复合增长率为 15.6%，显著高于同期整体投资顾问市场 5.2% 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，加强资源的跨境联动，深化推进跨境金融产品平台建设，为境内外客户提供全方位的跨境综合金融服务。截至报告期末，华泰国际资产规模在千亿港元的基础上稳步增长，综合实力持续提升，稳居香港中资券商第一梯队前列。

### (1) 香港业务

华泰金控（香港）坚持券商本源业务，以跨境业务为抓手，打造全方位的销售交易业务平台，为机构、个人和企业客户提供系统化金融服务，报告期内包括固收业务平台、股权业务平台、个人金融平台、基金平台和旗舰投行业务的业务平台体系能力持续增强。投资银行业务充分发挥境内外一体化和跨境联动优势，持续为客户拓宽融资渠道，积极提供境内外股权类和债券类服务；FICC 业务积极构建业务协同发展体系，全力推动业务平台化发展，持续提升科技实力，同时以去方向化为目标降低市场波动的影响，为境内外客户提供多元化交易服务；股权衍生品业务充分发挥集团平台优势，为客户提供境内境外多资产品种，以及全业务链条的综合性金融服务；股票销售交易业务持续拓展客户覆盖，为境内外机构投资者提供一站式跨境综合金融服务，报告期内以现金股票交易、Synthetic 交易和 QFII 交易为主的业务策略实现快速扩张，主经纪商核心功能助力打造机构客户生态圈；零售及网络金融业务积极推广线上科技平台“涨乐全球通”并不断更新迭代平台功能，以平台化模式实现规模获客，提升客户黏着度与价值变现，致力打造服务全球华人的财富管理平台；私人财富管理业务加大产品开发力度，推进销售广度，支持业务转型，深化境内外合作，充分利用集团客户体系优势和科技赋能，提供全生命周期综合金融服务；基金业务继续践行“投投联动”方针，获取优质项目资源的同时推进投资标的多元化，稳健管控投资风险，并积极探索引入第三方资金的渠道和推动已投项目的基金化；资产管理业务继续加强境内外跨境联动，积极开发资产管理产品，为客户提供投资组合及基金管理服务，不断优化客户资产配置。

报告期内，华泰金控（香港）各项业务保持健康均衡发展，截至报告期末，实收资本为港币 88 亿元，资本规模位居香港行业前列。证券交易方面，华泰金控（香港）托管资产总量港币 634.90 亿元、股票交易总量港币 1,713.97 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，参与完成上市及配售项目 13 个、债券发行项目 32 个，总交易发行规模约港币 96.43 亿元；提供证券保证金融资方面，累计授信金额港币 22.94 亿元；提供资产管理方面，受托资金规模合计港币 6,628.68 亿元（含 AssetMark 受托资金规模）。此外，报告期内，华泰金控（香港）共完成财务顾问项目 5 个。

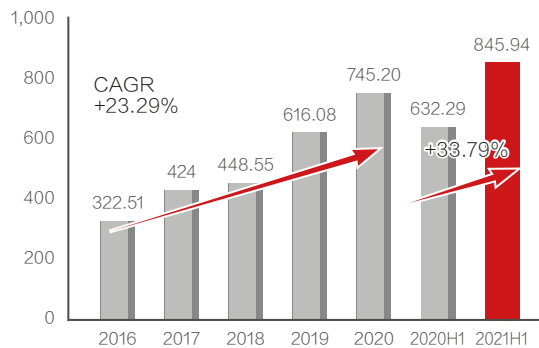
### (2) AssetMark

AssetMark 的愿景是致力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 2020 年年末，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 11.0%，排名第三。

截至报告期末，AssetMark 平台资产总规模达到 845.94 亿美元，较 2020 年年末增长约 13.52%；AssetMark 平台总计服务 8,496 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 2,691 名，较 2020 年年末增长约 6.11%；AssetMark 平台总计服务的终端账户覆盖了近 19.6 万个家庭，较 2020 年年末增长约 4.81%。报告期内，新增 397 名投资顾问与 AssetMark 签订合作协议。

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



### 投资解决方案

通过领先的第三方资产管理机构和策略顾问，以及自有投资管理团队提供全面可靠的解决方案，精简投资顾问工作任务，使投资顾问服务客户时间最大化

### 合规支持

AssetMark 通过提供投资组合监测和风险分析工具为投资顾问提供合规支持，有助于降低风险



### 技术平台

领先的集合式平台为投资顾问和投资者提供全周期支持的同时降低成本、简化流程

### 投顾服务

为投资顾问提供长期全方位的销售、运营支持和专家咨询服务

### 托管

开放化的托管架构平台提供灵活性

### (3) 华泰证券（美国）

经美国金融业监管局核准，华泰证券（美国）于 2019 年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，并于 2020 年获得自营牌照，业务资格进一步扩展。报告期内，华泰证券（美国）继续完善系统和平台建设，持续引进美国机构投资者，积极推进股权证券承销、全球股权分销和跨境股权交易业务建设，美国本土业务与境内及香港业务跨境联动协同机制不断优化，投资银行业务不断扩展，客户整体股票交易量有效提升。报告期内，华泰证券（美国）合计完成 2 单美股 IPO 项目，取得较大突破。

## 3、国际业务 2021 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。2021 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。

华泰国际将增强国际业务控股平台的资源整合功能，着力推进跨境管控一体化建设，持续完善风险内控体系，深入推进科技赋能，不断健全完善业务平台体系，深度拓展国际业务发展新空间。

华泰金控（香港）将持续以客户需求为中心，通过境内境外贯通、股权债权结合、机构零售互补、一级二级联动的业务策略，为客户提供一站式金融服务。投资银行业务将充分发挥境内外一体化以及 A+H+GDR 三地上市经验的优势，加强境内外团队联动，集中资源推进项目开发；FICC 业务将从系统平台、客户体系、资产及产品类别等多维度拓展创新，为客户提供一站式综合解决方案；股权衍生品业务将持续丰富产品结构，创新交易模式，满足客户跨境金融服务需求；股票销售交易业务将以主经纪商（PB）业务为发展方向，不断提升交易算法能力，做大跨境业务规模；零售及网络金融业务将持续完善“涨乐全球通”功能，分层营销客户，提高客户开发效率；私人财富管理业务将以客户需求为核心，深化境内外协同，加大产品开发和转型力度，持续提升综合服务能力；基金业务将继续提升投融资产品方面的专业设计及分销能力，拓展行业覆盖度，持续扩大管理规模，不断提升资本回报；资产管理业务将加强协同合作力度，充分挖掘业务资源优势，强化投资研究能力，有效落地资产管理业务需求。

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，以及加强先进的投资管理能力。不断深化与现有投资顾问客户的合作关系，同时通过专注客户需求、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。建立财务健康计划，积极探索前沿科技赋能投资顾问，通过提供深度服务满足客户不断



变化的需求。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）将继续完善人员团队和基础设施建设，维护与美国机构投资者的业务关系，加强与境内及香港业务团队的联动与合作，充分挖掘新业务机会，持续扩大客户群体及服务范围，同时有效平衡合规与风险管理要求，全方位服务客户资产配置需求。

### （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，公司持续促进业务创新活动，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。

公司强化新业务风险评估质控管理，加强对新业务流程执行情况的质量控制及新业务后续跟踪评估机制的落实，优化新业务风险评估流程，提升新业务评估机制运作有效性。

公司积极参与公募 REITs 新品种的投资与交易业务，并为产品提供流动性做市服务。公司根据具体业务风险特征，研究建立了公募 REITs 配售、做市及相关场外衍生品业务的风险管控机制，涵盖公募 REITs 集中度控制与风险敞口控制、标的的管理等措施，支持业务稳健开展。

### （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          | 182.33  | 155.41 | 17.32    |
| 营业成本          | 81.90   | 72.17  | 13.48    |
| 营业利润          | 100.43  | 83.24  | 20.65    |
| 归属于母公司股东的净利润  | 77.70   | 64.05  | 21.31    |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -158.44 | 234.50 | -167.57  |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 25.10   | -26.29 | 不适用      |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 329.33  | -64.62 | 不适用      |
| 现金及现金等价物净增加额  | 194.37  | 148.07 | 31.27    |

## 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 | 672,176.76 | 36.87      | 533,644.88 | 34.34          | 增加 2.53 个百分点  |
| 机构服务业务 | 492,630.93 | 27.02      | 323,512.54 | 20.82          | 增加 6.20 个百分点  |
| 投资管理业务 | 296,112.51 | 16.24      | 419,371.67 | 26.99          | 减少 10.75 个百分点 |
| 国际业务   | 278,372.85 | 15.27      | 188,661.05 | 12.14          | 增加 3.13 个百分点  |
| 其他     | 83,983.95  | 4.61       | 88,872.24  | 5.72           | 减少 1.11 个百分点  |

报告期内，本集团多业务条线实现高效增长，财富管理业务增长主要是上半年股市交投活跃，融资规模持续扩大，证券经纪业务佣金和融资融券利息收入增长；机构服务业务增长主要是来源于投资交易业务和投资银行业务的良好表现；投资管理业务主要是由于华泰资管公司受资管新规的影响收入有所下降，私募股权基金项目估值同比有所下降所致；国际业务业绩上涨则受益于华泰金控（香港）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 | 672,176.76   | 270,823.03 | 59.71   | 25.96           | 20.80           | 增加 1.72 个百分点  |
| 机构服务业务 | 492,630.93   | 185,717.90 | 62.30   | 52.28           | 65.29           | 减少 2.97 个百分点  |
| 投资管理业务 | 296,112.51   | 45,117.55  | 84.76   | -29.39          | -35.23          | 增加 1.37 个百分点  |
| 国际业务   | 278,372.85   | 172,409.78 | 38.07   | 47.55           | 10.74           | 增加 20.59 个百分点 |
| 其他     | 83,983.95    | 144,908.87 | -72.54  | -5.50           | -9.33           | 增加 7.29 个百分点  |
| 合计     | 1,823,277.00 | 818,977.13 | 55.08   | 17.32           | 13.48           | 增加 1.52 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  | 996,899.50   | 323,256.89 | 67.57   | 22.40           | 16.33           | 增加 1.69 个百分点  |
| 北京地区  | 76,111.26    | 18,629.03  | 75.52   | 27.02           | 13.92           | 增加 2.81 个百分点  |
| 上海地区  | 123,364.39   | 41,660.61  | 66.23   | -32.72          | -44.07          | 增加 6.86 个百分点  |
| 广东地区  | 290,800.58   | 220,246.55 | 24.26   | 34.46           | 42.39           | 减少 4.22 个百分点  |
| 湖北地区  | 10,977.33    | 7,916.66   | 27.88   | -40.72          | -4.45           | 减少 27.38 个百分点 |
| 其他地区  | 46,751.09    | 34,857.61  | 25.44   | -35.87          | 1.56            | 减少 27.48 个百分点 |
| 香港及海外 | 278,372.85   | 172,409.78 | 38.07   | 47.55           | 10.74           | 增加 20.59 个百分点 |
| 合计    | 1,823,277.00 | 818,977.13 | 55.08   | 17.32           | 13.48           | 增加 1.52 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 |        | 270,823.03 | 33.07        | 224,183.07 | 31.06          | 20.80             |
| 机构服务业务 |        | 185,717.90 | 22.68        | 112,360.37 | 15.57          | 65.29             |
| 投资管理业务 | 营业支出   | 45,117.55  | 5.51         | 69,656.54  | 9.65           | -35.23            |
| 国际业务   |        | 172,409.78 | 21.05        | 155,685.60 | 21.57          | 10.74             |
| 其他     |        | 144,908.87 | 17.69        | 159,815.69 | 22.14          | -9.33             |

### 4、费用总体情况对比

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 (%) |
|--------|-------|-------|-------|----------|
| 业务及管理费 | 78.16 | 64.65 | 13.51 | 20.90    |
| 所得税费用  | 21.50 | 18.63 | 2.87  | 15.41    |

报告期内，本集团业务及管理费的增加主要是因为收入上升，相应计提的人工费用增加所致。所得税费用的增加主要是因为应税所得上升所致。

### 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 | -158.44 | 234.50 | -392.94 | -167.57  |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 25.10   | -26.29 | 51.39   | 不适用      |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 329.33  | -64.62 | 393.95  | 不适用      |
| 现金及现金等价物净增加额  | 194.37  | 148.07 | 46.30   | 31.27    |

报告期内，本集团经营活动产生的现金流量净额为人民币 -158.44 亿元，同比减少 167.57%，主要是本期代理买卖证券收到的现金净额减少及融出资金导致的资金流出增加所致。投资活动产生的现金流量净额为人民币 25.10 亿元，主要是收回投资收到的现金增加所致。筹资活动产生的现金流量净额为人民币 329.33 亿元，主要是较上年同期偿还债务支付的现金减少；同时，本期发行债务收到的现金较上年同期有所增加所致。

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        | 182.33   | 155.41   | 17.32   | 手续费佣金收入及公允价值变动增加 |
| 营业支出        | 81.90    | 72.17    | 13.48   | 业务及管理费增加         |
| 营业利润        | 100.43   | 83.24    | 20.65   | 营业收入增加           |
| 利润总额        | 100.37   | 83.06    | 20.84   | 营业收入增加           |
| 净利润         | 78.87    | 64.43    | 22.41   | 营业收入增加           |
| 其中：归属母公司净利润 | 77.70    | 64.05    | 21.31   | 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          | 7,901.11 | 7,167.51 | 10.24   | 货币资金及融出资金增加所致    |
| 负债          | 6,539.19 | 5,844.39 | 11.89   | 债务融资规模增加所致       |
| 股东权益        | 1,361.92 | 1,323.12 | 2.93    | 当年利润实现及分红所致      |
| 归属母公司股东权益   | 1,328.27 | 1,290.71 | 2.91    | 当年利润实现及分红所致      |

## (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<br>占总资产的比例 (%) | 上年期末数    | 上年期末数<br>占总资产的比例 (%) | 本期期末金额<br>较上年期末变动比例 (%) | 情况说明           |
|----------|----------|----------------------|----------|----------------------|-------------------------|----------------|
| 货币资金     | 1,855.21 | 23.48                | 1,531.62 | 21.37                | 21.13                   | 客户资金增加所致       |
| 结算备付金    | 233.78   | 2.96                 | 281.13   | 3.92                 | -16.84                  | 客户结算资金减少所致     |
| 融出资金     | 1,281.78 | 16.22                | 1,025.74 | 14.31                | 24.96                   | 融出资金规模增加所致     |
| 交易性金融资产  | 3,109.93 | 39.36                | 2,926.95 | 40.84                | 6.25                    | -              |
| 衍生金融资产   | 123.77   | 1.57                 | 72.95    | 1.02                 | 69.66                   | 权益类衍生品规模增加     |
| 买入返售金融资产 | 180.71   | 2.29                 | 195.36   | 2.73                 | -7.50                   | -              |
| 应收款项     | 103.52   | 1.31                 | 90.96    | 1.27                 | 13.81                   | 应收开放式基金赎回款增加所致 |
| 存出保证金    | 263.37   | 3.33                 | 247.64   | 3.46                 | 6.35                    | -              |
| 其他权益工具投资 | 1.73     | 0.02                 | 106.78   | 1.49                 | -98.38                  | 投资交易规模下降所致     |
| 债权投资     | 334.99   | 4.24                 | 304.12   | 4.24                 | 10.15                   | -              |
| 其他债权投资   | 75.19    | 0.95                 | 52.68    | 0.73                 | 42.73                   | 投资交易规模增加所致     |
| 长期股权投资   | 189.07   | 2.39                 | 184.45   | 2.57                 | 2.50                    | -              |
| 投资性房地产   | 3.22     | 0.04                 | 4.08     | 0.06                 | -21.08                  | 投资性房地产转固定资产    |
| 固定资产     | 37.63    | 0.48                 | 37.79    | 0.53                 | -0.42                   | -              |
| 在建工程     | 0.72     | 0.01                 | 0.37     | 0.01                 | 94.59                   | 在建工程增加         |
| 商誉       | 22.41    | 0.28                 | 22.61    | 0.32                 | -0.88                   | -              |
| 无形资产     | 53.95    | 0.68                 | 52.76    | 0.74                 | 2.26                    | -              |
| 使用权资产    | 12.12    | 0.15                 | 11.99    | 0.17                 | 1.08                    | -              |
| 递延所得税资产  | 4.19     | 0.05                 | 3.40     | 0.05                 | 23.24                   | 可抵扣暂时性差异增加     |
| 其他资产     | 13.84    | 0.18                 | 14.15    | 0.20                 | -2.19                   | -              |

单位：亿元 币种：人民币

| 项目名称      | 本期期末数    | 本期期末数<br>占总负债的<br>比例 (%) | 上年期末数    | 上年期末数<br>占总负债的<br>比例 (%) | 本期期末金额<br>较上年期末变<br>动比例 (%) | 情况说明         |
|-----------|----------|--------------------------|----------|--------------------------|-----------------------------|--------------|
| 短期借款      | 142.82   | 2.18                     | 113.00   | 1.93                     | 26.39                       | 子公司质押借款规模增加  |
| 应付短期融资款   | 348.68   | 5.33                     | 439.51   | 7.52                     | -20.67                      | 收益凭证规模下降     |
| 拆入资金      | 61.17    | 0.94                     | 48.15    | 0.82                     | 27.04                       | 银行拆入资金规模增加   |
| 交易性金融负债   | 230.51   | 3.53                     | 153.82   | 2.63                     | 49.86                       | 子公司结构性融资规模增加 |
| 衍生金融负债    | 132.04   | 2.02                     | 133.99   | 2.29                     | -1.46                       | -            |
| 卖出回购金融资产款 | 1,366.10 | 20.89                    | 1,399.00 | 23.94                    | -2.35                       | -            |
| 代理买卖证券款   | 1,492.71 | 22.83                    | 1,363.88 | 23.34                    | 9.45                        | -            |
| 代理承销证券款   | 0.03     | -                        | 0.71     | 0.01                     | -95.77                      | 承销结算款减少      |
| 应付职工薪酬    | 105.94   | 1.62                     | 111.32   | 1.90                     | -4.83                       | -            |
| 应交税费      | 8.46     | 0.13                     | 19.50    | 0.33                     | -56.62                      | 应交所得税减少所致    |
| 应付款项      | 606.40   | 9.27                     | 437.06   | 7.48                     | 38.75                       | 应付交易款项增加所致   |
| 合同负债      | 1.06     | 0.02                     | 0.92     | 0.02                     | 15.22                       | -            |
| 租赁负债      | 13.03    | 0.20                     | 12.49    | 0.21                     | 4.32                        | -            |
| 长期借款      | 9.57     | 0.15                     | 4.75     | 0.08                     | 101.47                      | 子公司长期信用借款增加  |
| 应付债券      | 1,380.71 | 21.11                    | 970.53   | 16.61                    | 42.26                       | 公司债发行规模增加    |
| 递延所得税负债   | 33.80    | 0.52                     | 25.46    | 0.44                     | 32.76                       | 应纳税暂时性差异增加   |
| 其他负债      | 606.16   | 9.27                     | 610.31   | 10.44                    | -0.68                       | -            |

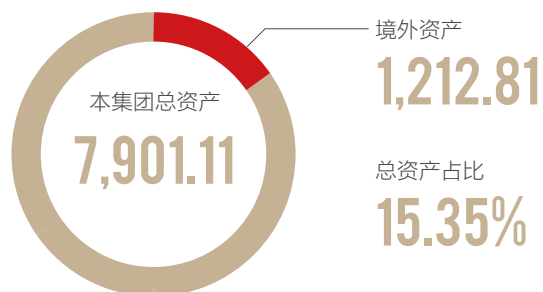
单位: 亿元 币种: 人民币

| 利润表项目       | 2021年<br>1—6月 | 2020年<br>1—6月 | 本期金额<br>较上期金额<br>变动比例 (%) | 变动原因                  |
|-------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------------|
| 手续费及佣金净收入   | 71.06         | 58.00         | 22.52                     | 主要系证券经纪及投资银行业务手续费增加所致 |
| 利息净收入       | 19.11         | 10.22         | 86.99                     | 融资融券利息收入增加所致          |
| 投资收益        | 64.33         | 86.06         | -25.25                    | 投资交易业务以及联营企业投资收益减少所致  |
| 公允价值变动收益    | 23.42         | -7.63         | 不适用                       | 衍生金融工具浮盈增加            |
| 其他收益        | 0.74          | 0.52          | 42.31                     | 政府补助增加所致              |
| 汇兑收益        | -1.41         | 3.20          | -144.06                   | 汇率变动所致                |
| 其他业务收入      | 5.07          | 5.03          | 0.80                      | -                     |
| 税金及附加       | 1.10          | 1.02          | 7.84                      | -                     |
| 业务及管理费      | 78.16         | 64.65         | 20.90                     | 人工成本增加                |
| 其他资产减值损失    | -             | 0.06          | -                         | -                     |
| 信用减值损失      | -1.93         | 2.07          | -193.24                   | 融资类减值转回所致             |
| 其他业务成本      | 4.57          | 4.37          | 4.58                      | -                     |
| 所得税费用       | 21.50         | 18.63         | 15.41                     | -                     |
| 其他综合收益的税后净额 | -4.63         | -0.09         | 5,044.44                  | 其他权益工具投资公允价值变动        |

## 2、境外资产情况

单位: 亿元 币种: 人民币

报告期内, 本集团总资产为人民币 7,901.11 亿元, 其中: 境外资产人民币 1,212.81 亿元, 占总资产的比例为 15.35%。



## 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 2021 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 1,328.27 亿元，较 2020 年年末增加人民币 37.56 亿元，提升 2.91%。

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团总资产人民币 7,901.11 亿元，较年初增加人民币 733.60 亿元，增幅为 10.24%，主要是货币资金、融出资金和交易性金融资产增加所致。其中，本集团货币资金及结算备付金为人民币 2,088.99 亿元，占总资产的比率为 26.44%；融出资金为人民币 1,281.78 亿元，占总资产的比率为 16.22%；交易性金融资产为人民币 3,109.93 亿元，占总资产的比率为 39.36%；债权投资和其他债权投资为人民币 410.19 亿元，占总资产的比率为 5.19%；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 1.36%，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，本集团资产负债率水平有所上升。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团负债为人民币 6,539.19 亿元，较年初增加人民币 694.80 亿元，增幅为 11.89%，主要是本报告期内应付债券、应付款项、代理买卖证券款等增加所致。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团扣除代理买卖证券款、代理承销证券款及合并结构化主体形成的其他负债后的资产负债率为 76.79%，同比增加 2.18 个百分点。

#### 5、盈利能力情况分析

2021 年上半年，本集团坚定践行财富管理和机构服务“双轮驱动”的核心战略，在科技赋能下提升数字化运营能力，主要业务稳步增长，综合实力稳居行业前列。股票基金交易量、融资余额等主要业务指标市场排名处于行业领先地位，国际业务发展迅猛，总体盈利能力稳定。

#### 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

|                  |   |
|------------------|---|
| 融资渠道             | <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。从融资期限来看，公司在境内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，发行短期融资券、短期公司债，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、银行等金融机构进行转融资、两融收益权融资以及资产证券化等；中长期融资渠道包括发行公司债、次级债、永续次级债以及股权再融资等融资方式。此外，公司还可以通过发行境外债、中期票据等方式，融入外币资金。通过多年来卓有成效的努力，公司探索并建立了包含新型融资工具在内的多融资渠道于一体的，短、中、长相结合的融资平台，在公司业务的快速发展过程中发挥关键作用。</p>  |
| 负债结构             | <p>截至 2021 年 6 月 30 日，本集团总负债为人民币 6,539.19 亿元，扣除代理买卖证券款、代理承销证债券款及合并结构化主体形成的其他负债后，本集团自有负债为人民币 4,506.43 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（短期融资券、短期公司债、短期收益凭证等）为人民币 552.67 亿元，占比 12.26%；卖出回购金融资产款为人民币 1,366.10 亿元，占比 30.31%；长期借款及应付债券（公司债、次级债、金融债、长期收益凭证等）为人民币 1,390.28 亿元，占比 30.85%；交易性金融负债及衍生金融负债为人民币 362.55 亿元，占比 8.05%。针对负债规模日益增大的趋势，公司加强了流动性管理，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>   |
| 流动性管理政策和措施       | <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：一是不断完善资金计划体系，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，提高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> |
| 融资能力及融资策略分析      | <p>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，授信额度稳步增长，具备较强的短期和中长期融资能力。作为上市券商，公司也可以通过股权再融资等方式，解决长期发展的资金需求。</p> <p>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。</p> <p>为保持公司资产的流动性并兼顾收益率，公司自有资金由资金运营部统一管理，并配以健全的管理制度和相应的业务流程。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。</p>  |
| 或有事项及其对公司财务状况的影响 | -   |

## （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为人民币 189.07 亿元，较期初人民币 184.45 亿元增加人民币 4.62 亿元，增幅为 2.50%。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）本公司无重大的股权投资

（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

| 项目名称     | 期初余额               | 期末余额               | 报告期投资收益            | 单位：元 币种：人民币       |
|----------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
|          |                    |                    |                    | 报告期公允价值变动金额       |
| 交易性金融资产  | 292,695,306,675.55 | 310,993,352,712.12 | 15,476,500,252.84  | -1,669,934,770.05 |
| 交易性金融负债  | 15,381,530,029.60  | 23,050,529,481.43  | -48,744,806.30     | -416,582,858.72   |
| 其他债权投资   | 5,267,955,106.65   | 7,519,277,729.12   | 1,779,231.14       | -24,064,802.35    |
| 其他权益工具投资 | 10,678,417,333.15  | 173,280,904.08     | 618,870,144.41     | -483,824,444.38   |
| 衍生金融工具   | -6,103,472,812.43  | -827,426,399.75    | -11,249,575,482.27 | 4,437,644,888.10  |

### 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（含募集资金产生的活期利息收入），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。

截至本报告期末，本公司 GDR 募集资金使用情况如下：人民币 3,547,720,085.15 元（按照结汇当日实际汇率计算）用于持续投入现有主营业务，深耕财富管理、机构服务、投资管理等业务板块，进一步推动业务转型升级，人民币 1,000,000,000.00 元（按照结汇当日实际汇率计算）用于补充营运资本及满足一般企业用途，美元 994,212,858.59 元用于支持国际业务内生及外延式增长，扩展海外战略布局。除以上资金使用外，本公司所得款项剩余资金为人民币 127,358,491.15 元（含募集资金利息、汇兑损益及尚未支付的发行费用，按照报告期末汇率折算）尚未使用，此部分资金存放于本公司在银行开设的专用账户中。截至 2021 年 6 月 30 日，本公司 GDR 募集资金计划投向与 GDR 募集说明书约定的资金投向一致，没有发生变更。公司计划于 2021 年年底前安排剩余 GDR 募集资金的使用。

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 | -             | 1,145,595.39 | 7,993.29   | 补充营运资本及满足一般企业用途 |
| 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 | -             | 7,198,724.65 | 7,993.29   | -               |
| 募集资金总体使用情况说明 |             | -            |               |              |            |                 |

(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

|  |       |   |      |        |        |
|--|-------|---|------|--------|--------|
| <br><b>华泰证券</b><br>HUATAI SECURITIES | 控股子公司 |  <b>华泰联合证券</b><br>HUATAI UNITED SECURITIES   |      | 99.92% |        |
|  |       |  <b>华泰期货</b><br>HUATAI FUTURES   | 持股比例 | 60%    |        |
|  |       |  <b>江苏股权交易中心</b><br>JIANGSU EQUITY EXCHANGE  |      | 52%    |        |
|  | 全资子公司 |  <b>华泰证券(上海)资产管理有限公司</b><br>HUATAI SECURITIES (SHANGHAI) ASSET MANAGEMENT COMPANY LTD. |      |        |        |
|  |       |  <b>华泰国际金融控股有限公司</b><br>HUATAI INTERNATIONAL FINANCIAL CONTROL CO., LTD.               | 持股比例 | 100%   |        |
|  |       |  <b>华泰紫金投资有限责任公司</b><br>HUATAI ZIJIN INVESTMENT CO., LTD.                              |      |        |        |
|  | 参股公司  |  <b>南方基金</b><br>NANFANG FUNDS  | 基金   |        | 41.16% |
|  |       |  <b>华泰柏瑞基金</b><br>Huatai-PineBridge Investments  | 基金   | 持股比例   | 49%    |
|  |       |  <b>江苏银行</b><br>BANK OF JIANGSU  | 银行   |        | 5.63%  |

6、主要控股参股公司分析

| 名称                       | 公司持<br>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          |
|--------------------------|------------|---|------------|------------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| 华泰联合证券有<br>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<br>路 128 号前海深港基金小镇 B7 栋 401 | 1997/9/5   | 99,748.00              | 763,791.07     | 441,894.47    | 158,491.48   | 44,193.16    | 32,910.10    |
| 华泰证券(上海)<br>资产管理有限公<br>司 | 100%       | 中国(上海)自由贸易试验区基隆路 6 号<br>1222 室                  | 2014/10/16 | 260,000.00             | 1,015,090.67   | 878,966.17    | 96,536.13    | 69,117.11    | 52,180.04    |
| 华泰紫金投资有<br>限责任公司         | 100%       | 中国江苏省南京市汉中门 180 号                               | 2008/8/12  | 600,000.00             | 1,665,203.48   | 1,171,154.02  | 119,145.40   | 111,497.71   | 84,366.53    |
| 华泰国际金融控<br>股有限公司         | 100%       | 香港皇后大道中 99 号中环中心 58 楼<br>5808-12 室              | 2017/1/4/5 | 8,800,000,002.00<br>港元 | 12,075,527.62  | 1,183,841.51  | 278,091.83   | 106,865.05   | 92,580.42    |
| 华泰创新投资有<br>限公司           | 100%       | 中国北京市西城区丰盛胡同 28 号楼 15 层<br>1501                 | 2013/11/21 | 350,000.00             | 360,415.50     | 301,656.99    | 60,544.11    | 53,754.70    | 40,696.63    |
| 华泰期货有限公<br>司             | 60%        | 中国广州市越秀区东风东路 761 号丽华大厦<br>20 层                  | 1995/7/10  | 160,900.00             | 4,690,487.25   | 315,605.93    | 111,133.28   | 24,731.77    | 18,152.03    |
| 江苏股权交易中<br>心有限责任公司       | 52%        | 中国江苏省南京市庐山路 188 号 11 层                          | 2013/7/14  | 20,000.00              | 48,414.59      | 37,176.82     | 4,254.63     | 1,797.19     | 1,349.72     |
| 南方基金管理股<br>份有限公司         | 41.16%     | 中国深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号<br>基金大厦 32-42 楼          | 1998/3/6   | 36,172.00              | 1,229,631.65   | 794,768.59    | 346,059.44   | 116,995.67   | 87,640.31    |
| 华泰柏瑞基金管<br>理有限公司         | 49%        | 中国(上海)自由贸易试验区民生路 1199<br>弄上海证大五道口广场 1 号 17 层    | 2004/11/18 | 20,000.00              | 197,280.45     | 130,811.00    | 70,820.17    | 26,869.14    | 20,278.32    |
| 江苏银行股份有限公司               | 5.63%      | 中国江苏省南京市中华路 26 号                                | 2007/1/22  | 1,154,445.00           | 255,329,474.80 | 18,331,675.80 | 3,073,682.20 | 1,330,719.50 | 1,019,857.20 |

单位: 万元 币种: 人民币

净利率

净利润

利润总额

营业收入

净资产

总资产

注册资本

设立时间

地址

公司持  
股比例

名称

华泰联合证券有  
限责任公司

华泰证券(上海)  
资产管理有限公  
司

华泰紫金投资有  
限责任公司

华泰国际金融控  
股有限公司

华泰创新投资有  
限公司

华泰期货有限公  
司

江苏股权交易中  
心有限责任公司

南方基金管理股  
份有限公司

华泰柏瑞基金管  
理有限公司

江苏银行股份有限公司

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。

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)。

主营业务: 100% 中国江苏省南京市汉中门 180 号

主营业务: 股权投资、股权投资相关的其他投资基金;股权投资、股权投资相关的其他投资基金;股权投资、股权投资相关的其他投资基金。(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)。

主营业务: 100% 香港皇后大道中 99 号中环中心 58 楼

主营业务: 控股公司。

主营业务: 100% 中国北京市西城区丰盛胡同 28 号楼 15 层

主营业务: 60% 中国广州市越秀区东风东路 761 号丽华大厦

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)。

主营业务: 52% 中国江苏省南京市庐山路 188 号 11 层

主营业务: 41.16% 中国深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号

主营业务: 49% 中国(上海)自由贸易试验区民生路 1199

主营业务: 5.63% 中国江苏省南京市中华路 26 号

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、承销政府债券、承销短期融资券;买卖政府债券、企业债  
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、代理销售基金、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;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: 江苏银行的财务数据取自其 2021 年半年度报告,净资产数据为归属于上市公司股东的所有者权益,净利润数据为归属于上市公司股东的净利润。

## 7、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或投资顾问及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或投资顾问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 2021 年 6 月 30 日，本集团共合并 44 个结构化主体，合并结构化主体的总资产为人民币 89,932,113,921.19 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 31,943,662,630.04 元。

## 》 三、其他披露事项

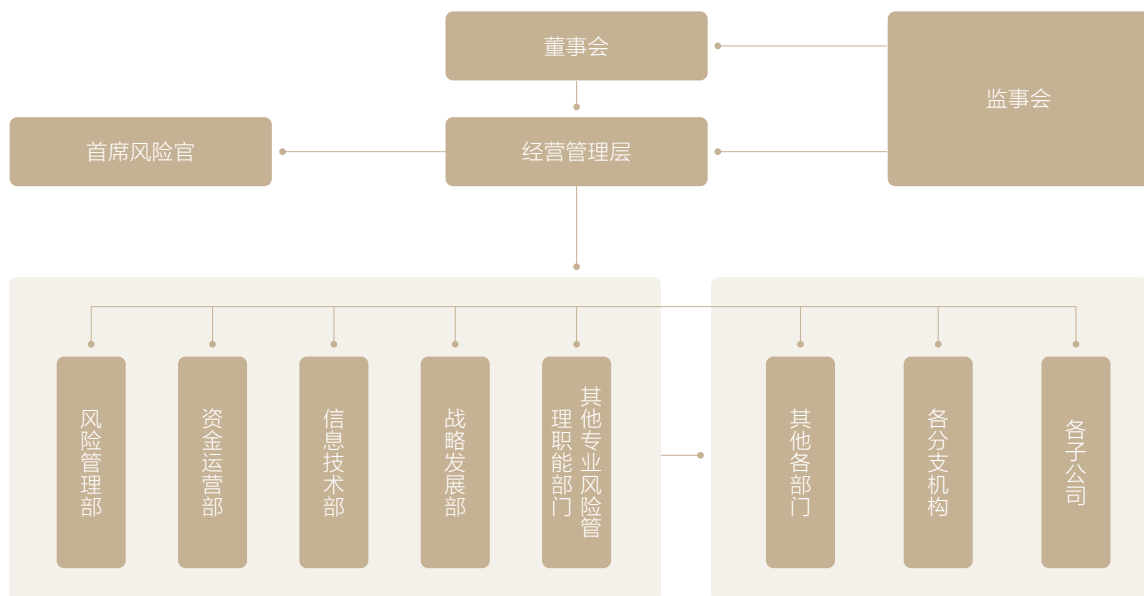
### （一）可能面对的风险及风险防范措施

#### 1、风险管理概况

公司高度重视风险管理工作，根据监管要求及公司业务发展实际情况，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，与发展战略有机结合，多层次风险管理制度体系覆盖全公司；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，同时大力深化专业风险条线集中统一的管理思路，构建满足集团业务发展要求的专业风险管控体系。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，公司以深入穿透业务风险管控、做实做精风险管理体系、搭建体系化风险管理平台为工作重心，全面推进各项风险管理工作。公司强化重点业务和领域的风险管控，深入排查业务风险来源，强化业务前瞻性分析和底线管控。公司持续健全全面风险管理体系建设，深化风险管控体系化落地，提升重要风险及领域风险管控效能。公司坚持科技赋能，大力推进数字化的风险管理平台建设，打造覆盖境内外一体化的风险管理平台，不断提升公司风险识别、预警发现、计量监测及风险管控能力。

## 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线条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，以美国为首的各国央行大规模“放水”，加剧了全球的通胀压力，多个金融市场呈现出“过热”的趋势且波动加大，后续市场出现大幅调整的风险正在逐步增大。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。公司建立统一的风险限额体系，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。公司建立压力测试体系，定期计量各类极端风险。权益类证券投资方面，公司持续推进去方向化投资的转型，同时根据市场变化灵活调整对冲头寸，控制投资组合下行风险的前提下，积极发掘交易机会。固定收益类证券投资方面，公司严格控制信用债组合的久期，通过利率互换及国债期货等利率衍生品有效对冲整体债券组合的利率风险。衍生品业务方面，公司的场外衍生品业务和场内期权做市业务均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；针对场外衍生品业务，公司建立了标的入池、交易对手履约担保比例、标的流动性及集中度等管理标准，有效防范市场风险及交易对手违约风险。

#### 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       |           |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|           | 2021 年中期末 | 2020 年中期末 | 2021 年中期末 | 2020 年中期末 |
| 权益敏感性金融工具 | 7,325     | 3,607     | 15,949    | 7,504     |
| 利率敏感性金融工具 | 3,518     | 4,073     | 4,749     | 4,272     |
| 商品敏感性金融工具 | 42        | 128       | 179       | 335       |
| 整体组合风险价值  | 7,743     | 5,642     | 16,465    | 8,820     |

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 | 17,656 | 16,465 | 24,851 | 11,303 |
| 本公司 | 8,170  | 7,743  | 17,996 | 5,964  |

数据来源：公司内部统计。



#### 4、信用风险

信用风险是指由于融资客户、产品或债券发行人违约、交易对手违约导致公司资产受损失的风险。

融资类业务方面，公司执行严格的客户及标的管理、持续动态监控、及时风险化解等全流程管控措施，把控业务信用风险。报告期内市场活跃，公司融资融券业务规模持续增长，公司执行严格的风控流程和措施，对两融业务进行专项风险检查，加强业务逆周期管理机制，完善差异化客户管控标准，两融业务待追索金额保持在较低水平；此外，公司审慎开展股票质押业务，持续探索优化股票质押业务风险管控标准，增强实质风险审核，严控业务风险敞口。债券投资类业务方面，公司建立发行人统一管理体系。报告期内，公司修订并重构重点行业和区域信用债底线管控方案，推进集团信用债监控及管理方案，持续推进发行人信用风险管理模块系统化建设，增强风险管控针对性。同时稳步推进信用分析管理系统（CAMS系统）等，健全统一内评体系，持续推进挂钩CAMS评级结果的业务准入和限额规则落地执行，提升集团整体风险的识别和管控能力。交易对手管理方面，公司推进交易对手统一管理体系建设，拓展集团层面交易对手授信额度统一管理的覆盖范围，形成集团全量范围交易对手名单制管理方案，严控业务风险敞口。同时，公司增强对资产管理受托资金交易对手管理体系的覆盖管控。此外，公司持续推进交易对手信用风险管理模块系统化建设，实现业务综合管理及相关流程的平台化。对于担保交收类业务，公司将其纳入交易对手体系进行统一管理。同时探索增强客户资质管理体系及准入标准，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的管控能力。同时，公司推进集团统一的客户穿透管理体系系统化建设，全面梳理发布《业务信用风险管控重点参考指引》，强化管控底线措施，落地客户ESG风险管理机制，巩固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支撑。

#### 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。在掌控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。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应急融资能力。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的辅导力度，尤其是加大对香港子公司的流动性管理力度，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。

公司持续强化操作风险识别梳理精细度及发现精准度，深化推动操作风险识别、评估、监测、应对及报告全流程的有效运作。报告期内，公司聚焦重点业务前中后流程及操作风险重点关注领域进行梳理并推动管控措施的优化；强化集团新业务风险评估质控管理，优化新业务风险评估流程，完善新业务风险评估机制；针对疫情管控常态化后国内个别地区疫情风险反弹的情形，开展疫情下保障业务连续性关键资源梳理，组织完善疫情突发事件应急预案和关键资源优化配置。

#### 7、模型风险

模型风险是指错误或不当的模型设计、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、评估和监测等方法与措施，推进模型风险管理。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，改进模型信息数据库功能。报告期内，公司开展各业务条线全方位模型使用情况的梳理和更新，模型承载敞口的统计，根据模型所承载的模型风险大小等多方面信息对模型进行分级，切实落实模型风险管理工作。

## 8、合规风险

合规风险是指因证券公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规和准则而使证券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，加快推动合规风险管理从被动应对向主动管控转型；持续完善业务合规管理机制，通过合规评估、流程梳理、提示督导、会议列席等方式加大对重点业务的管控和支持力度；在锻造全员合规理念方面深化落实机制，健全合规培训体系、丰富培训形式，力求将监管要求和合规理念渗透到业务人员思想中，促使业务部门及早做好自我规范；审慎开展合规审查，及时指出合规问题或瑕疵、提出规范建议，促进相关业务或产品合规运作。

## 9、信息技术风险

信息技术风险主要是指各种内、外部原因造成公司信息系统运行异常或者数据毁损、泄露，导致系统在业务实现、响应速度、处理能力、数据加密等方面不能持续保障交易与业务管理稳定、高效、安全地进行，从而造成损失的风险。

公司各项业务以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，公司持续加大信息技术投入，不断完善信息技术风险管理制度与流程，不断加强信息技术质量控制，加强信息技术风险排查与治理，完善监控体系，风险管理成效进一步提升。公司不断完善信息技术风险应急预案，定期进行应急演练。报告期内，公司信息系统安全平稳运行，未发生重大信息技术风险事件。

## 10、声誉风险

声誉风险主要是指公司经营、管理及其他行为或外部事件导致有关媒体对公司负面评价的风险。

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，强化与境内外媒体的沟通，加强声誉风险的监测和处理，为公司发展营造良好的媒体环境。同时，持续完善相关工作流程，加强事前管理和内部宣导，进一步提升声誉风险应对水平。

**(二) 报告期内，本公司无其他应披露而未披露的事项**

The background features abstract, wavy, layered shapes in a light beige color. A halftone pattern of small circles is visible in the lower right quadrant, fading out towards the center.

# 3

公司治理  
*CORPORATE GOVERNANCE*

|           |     |
|-----------|-----|
| 公司治理      | 066 |
| 环境与社会责任   | 074 |
| 重要事项      | 078 |
| 股份变动及股东情况 | 092 |
| 债券相关情况    | 100 |

# 公司治理

## CORPORATE GOVERNANCE

### 一、股东大会、董事会、监事会会议情况简介

| 会议届次           | 召开日期       | 决议刊登的指定网站的查询索引   | 决议刊登的披露日期  | 会议决议  |
|----------------|------------|--|------------|---|
| 2021年第一次临时股东大会 | 2021年2月8日  | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a><br><a href="http://www.londonstockexchange.com">http://www.londonstockexchange.com</a><br><a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a> | 2021年2月9日  | 审议通过了《关于选举柯翔先生为公司第五届董事会非执行董事的议案》《关于公司境内外债务融资工具一般性授权的议案》《关于修订〈华泰证券股份有限公司股东大会议事规则〉的议案》《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（草案）及其摘要〉的议案》《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管理办法〉的议案》《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实施考核管理办法〉的议案》《关于提请股东大会授权董事会办理公司A股限制性股票股权激励计划相关事宜的议案》 |
| 2020年年度股东大会    | 2021年6月22日 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a><br><a href="http://www.londonstockexchange.com">http://www.londonstockexchange.com</a><br><a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a> | 2021年6月23日 | 审议通过了《公司2020年度董事会工作报告》《公司2020年度监事会工作报告》《公司2020年度财务决算报告》《关于公司2020年度报告的议案》《关于公司2020年度利润分配的议案》《关于预计公司2021年日常关联交易的议案》《关于预计公司2021年自营投资额度的议案》《关于公司续聘会计师事务所的议案》《关于选举公司第五届董事会独立非执行董事的议案》  |

| 会议届次         | 召开日期       | 会议形式  | 会议议案                                |
|--------------|------------|-------|-------------------------------------|
| 第五届董事会第十二次会议 | 2021年1月29日 | 通讯方式。 | 审议关于公司全资子公司华泰紫金投资有限责任公司投资设立产业基金的议案。 |
| 第五届董事会第十三次会议 | 2021年2月8日  | 通讯方式。 | 审议关于调整公司第五届董事会部分专门委员会组成方案的议案。       |

| 会议届次         | 召开日期           | 会议形式  | 会议议案  |
|--------------|----------------|---|---|
| 第五届董事会第十四次会议 | 2021年<br>3月23日 | 现场及视频会议方式。<br>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层华泰证券北京分公司中会议室、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、深圳市益田路5999号基金大厦42楼华泰证券深圳分公司仿真会议室、香港皇后大道中99号中环中心62楼华泰金融控股（香港）有限公司仿真视频伦敦会议室。   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 审议公司2020年度经营管理层工作报告；</li> <li>2. 审议公司2020年度财务决算报告；</li> <li>3. 审议公司2021年度财务预算报告；</li> <li>4. 审议关于公司2020年度利润分配的预案；</li> <li>5. 审议关于计提资产减值准备的议案；</li> <li>6. 审议公司2020年度董事会工作报告；</li> <li>7. 审议关于公司2020年度报告的议案；</li> <li>8. 审议关于公司2020年度合规报告的议案；</li> <li>9. 审议关于公司2020年度风险管理报告的议案；</li> <li>10. 审议关于公司2020年度内部控制评价报告的议案；</li> <li>11. 审议关于公司2020年度信息技术管理专项报告的议案；</li> <li>12. 审议关于公司2020年度社会责任报告的议案；</li> <li>13. 审议关于预计公司2021年日常关联交易的预案；</li> <li>14. 审议关于预计公司2021年自营投资额度的预案；</li> <li>15. 审议公司2021年度内部审计工作计划；</li> <li>16. 审议关于公司续聘会计师事务所的议案；</li> <li>17. 审议关于调整公司A股限制性股票股权激励计划相关事项的议案；</li> <li>18. 审议关于向激励对象授予A股限制性股票的议案；</li> <li>19. 审议关于公司董事2020年度绩效考核和薪酬情况的报告；</li> <li>20. 审议关于公司高级管理人员2020年度履行职责、绩效考核和薪酬情况的报告；</li> <li>21. 审议关于召开公司2020年度股东大会的议案；</li> <li>22. 听取公司2020年度独立董事工作报告；</li> <li>23. 听取公司董事会审计委员会2020年度履职情况报告；</li> <li>24. 听取公司2020年度合规总监工作报告；</li> <li>25. 听取公司2020年度反洗钱工作报告；</li> <li>26. 听取关于公司2020年度内部审计工作情况的报告；</li> <li>27. 审查关于公司2020年度净资产等风险控制指标具体情况的报告。</li> </ol> |
| 第五届董事会第十五次会议 | 2021年<br>4月29日 | 现场及视频会议方式。<br>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9层华泰证券北京分公司研究所第三会议室、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、深圳市益田路5999号基金大厦42楼华泰证券深圳分公司仿真会议室、香港皇后大道中99号中环中心62楼华泰金融控股（香港）有限公司仿真视频伦敦会议室 | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 审议关于公司2021年第一季度报告的议案；</li> <li>2. 审议关于动用部分江苏银行股份有限公司股票充抵转融通保证金的议案。</li> </ol>   |
| 第五届董事会第十六次会议 | 2021年<br>5月20日 | 通讯方式。   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 审议关于选举公司第五届董事会独立非执行董事的预案；</li> <li>2. 审议关于增加公司2020年度股东大会议程的议案。</li> </ol>   |
| 第五届董事会第十七次会议 | 2021年6<br>月29日 | 通讯方式。   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 审议关于《公司“十四五”发展战略规划》的议案；</li> <li>2. 审议关于调整公司第五届董事会部分专门委员会组成方案的议案。</li> </ol>  |

| 会议届次        | 召开日期       | 会议形式                                    | 会议议案   |
|-------------|------------|---|--|
| 第五届监事会第七次会议 | 2021年2月2日  | 现场方式。<br>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 | 审议关于公司A股限制性股票股权激励计划激励对象名单公示情况及核查意见的议案。   |
| 第五届监事会第八次会议 | 2021年3月23日 | 现场方式。<br>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2020年度监事会工作报告；<br>2. 审议关于公司2020年度利润分配的预案；<br>3. 审议关于计提资产减值准备的议案；<br>4. 审议关于公司2020年度报告的议案；<br>5. 审议关于公司2020年度内部控制评价报告的议案；<br>6. 审议关于调整公司A股限制性股票股权激励计划相关事项的议案；<br>7. 审议关于向激励对象授予A股限制性股票的议案；<br>8. 审议关于公司监事2020年度绩效考核和薪酬情况的报告；<br>9. 听取关于公司2020年度内部审计工作情况的报告；<br>10. 听取公司2021年度内部审计工作计划。 |
| 第五届监事会第九次会议 | 2021年4月29日 | 现场方式。<br>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 | 审议关于公司2021年第一季度报告的议案。  |

## 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《证券上市规则》的规定。公司第五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，成员包括陈志斌先生、丁锋先生、区璟智女士，其中陈志斌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、公司第五届董事会审计委员会2021年第一次会议于2021年1月19日以现场及视频会议方式召开，会议听取了毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）相关人员关于2020年审计工作进度安排、年审审计重点、预审工作情况的汇报等。
- 2、公司第五届董事会审计委员会2021年第二次会议于2021年2月26日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于公司2020年度审计计划的议案》。
- 3、公司第五届董事会审计委员会2021年第三次会议于2021年3月19日以现场及视频会议方式召开，会议审议通过了《公司2020年度财务决算报告》《公司2021年度财务预算报告》《关于公司2020年度利润分配的预案》《关于计提资产减值准备的议案》《关于公司2020年度财务报表的议案》《关于公司2020年度报告的预案》《关于公司2020年度内部控制评价报告的议案》《关于预计公司2021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2020年度履职情况报告》《公司2020年度关联交易专项审计报告》《公司2021年度内部审计工作计划》，审阅了公司2020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2020年度内部审计工作情况的报告》。
- 4、公司第五届董事会审计委员会2021年第四次会议于2021年4月28日以通讯方式召开，会议审议通过了《关于公司2021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

| 姓名  | 担任的职务 | 变动情形              |
|-----|-------|-------------------|
| 柯翔  | 董事    | 2021 年第一次临时股东大会选举 |
| 区璟智 | 独立董事  | 2020 年年度股东大会选举    |
| 徐清  | 董事    | 因工作安排，不再担任公司董事    |
| 李志明 | 独立董事  | 因任职期满，不再担任公司独立董事  |

#### 公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

2021 年 2 月 8 日，公司 2021 年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举柯翔先生为公司第五届董事会非执行董事的议案》，选举柯翔先生为公司第五届董事会非执行董事。柯翔先生自 2021 年 2 月 8 日起接替徐清先生履行公司第五届董事会非执行董事职责，任期至本届董事会任期结束。

2021 年 6 月 22 日，公司 2020 年年度股东大会审议通过了《关于选举公司第五届董事会独立非执行董事的议案》，选举区璟智女士为公司第五届董事会独立非执行董事。区璟智女士自 2021 年 6 月 22 日起接替李志明先生履行公司第五届董事会独立非执行董事职责，任期至本届董事会任期结束。

除以上披露外，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) 条须予披露的有关董事、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。 |  |   |



## 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>2020年12月31日，公司第五届董事会第十一次会议及第五届监事会第六次会议分别审议通过了公司A股限制性股票股权激励计划（以下简称“本激励计划”）的相关议案，并同意提交公司股东大会审议。2021年2月2日，本激励计划获江苏省国资监管机构原则同意。2021年2月8日，公司2021年第一次临时股东大会审议通过了本激励计划相关议案。</p>                  | <p>公告编号：临2021-001、2021-015、2021-016</p> |
| <p>2021年3月23日，公司第五届董事会第十四次会议及第五届监事会第八次会议分别审议通过了《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》《关于向激励对象授予A股限制性股票的议案》。公司认为本激励计划的授予条件已经满足，确定2021年3月29日为授予日。</p>  | <p>公告编号：临2021-029、2021-030</p>          |
| <p>2021年4月7日，公司收到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司出具的《证券变更登记证明》，股权登记日为2021年4月6日，向符合条件的810名激励对象授予4,548.80万股A股限制性股票，授予价格为人民币9.10元/股，授予对象包括公司董事、高级管理人员及其他核心骨干人员，但不包括公司非执行董事（含独立董事）、监事，公司完成A股限制性股票的授予登记工作。</p> | <p>公告编号：临2021-032</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表附注十二、股份支付。

## 六、员工及薪酬政策

### （一）薪酬政策

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的薪酬分配体系。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，公司培训工作继续围绕业务创新、入职教育、通用能力、管理素质和内部讲师等方面，采取集中培训与外部培训相结合、现场培训与华泰云端学院培训相结合的方式推进，年度培训计划有序实施。公司基于双轮驱动的业务战略和赋能于人的人才发展战略，打造了 HTalent 人才发展体系。2021 年上半年，公司组织实施了 BAL 星战营新任营业部负责人培训 1 期，新任团队负责人培训 1 期，现任团队负责人培训 3 期；华泰星培训 7 期；机构 RM 培训 4 期；线上培训，组织投资顾问线上训练营 3 期，共推出 185 场直播培训，直播参训人员超过 102,000 人次；云端学院累计学习超 575,000 人次，完成 136,000 学时在线学习。

公司 HTalent 人才发展体系致力于满足员工动态发展需求，推出贯穿员工全职业生涯的新员工 HTSC STAR 项目、高潜 / 骨干 HIPO 项目、管理者 BAL 项目，覆盖全业务链的投资顾问、机构业务、科技赋能等专业培训项目，关注员工职业生涯成长和专业赋能；基于员工画像进行定制化设计，每个项目以员工需求为中心，针对性匹配学习内容，满足员工个性化发展需求；秉承遇见 & 预见的未来成长理念，预见公司未来业务发展的方向，预见员工未来能力发展的需要；探索建立线上线下有机结合的学习平台，开展了多个线上线下相结合的培训项目，加速培训发展工作数字化转型，升级云端学院功能；打造聚焦金融行业的发展智库，共创优质知识内容；打造人才生态共生的全向赋能，协同公司内外资源，赋能内部员工和生态伙伴。

### （三）员工人数

截至 2021 年 6 月底，集团员工人数为 11,610 人（含劳务派遣及经纪人），其中母公司 8,280 人（含劳务派遣及经纪人）。

## 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》及《企业管治报告》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》及《企业管治报告》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 2 次，董事会 6 次，监事会 3 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 1 次，薪酬与考核委员会 1 次，提名委员会 1 次，共计 19 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 A.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。2019 年 12 月 16 日，公司第五届董事会第一次会议选举张伟先生为公司第五届董事会董事长，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。

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》及《企业管治报告》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。《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》的规定委任足够数目、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，分别为陈传明先生、刘艳女士、陈志斌先生、王建文先生、区璟智女士。

### （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的公司

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

1. 报告期内，公司无因环境问题受到行政处罚的情况

2. 参照重点排污单位披露其他环境信息

公司为金融企业，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

1、公司积极响应《南京市生活垃圾管理条例》，在华泰证券广场每个楼层设置生活垃圾分类投放点，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。

2、公司《机动车辆管理办法》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。华泰证券广场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。

3、公司营业用房装修改造中，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。

4、2021年7月6日，华泰证券（上海）资产管理有限公司已正式签署协议加入联合国责任投资原则组织（United Nations Principles for Responsible Investment，以下简称“UNPRI”）。

UNPRI旨在帮助投资者理解环境、社会和公司治理等要素对投资价值的影响，并支持各签署机构将这些要素融入投资战略与决策中。此次正式加入UNPRI后，华泰资管公司成为中国加入该组织资管规模最大的券商资管子公司，标志着华泰资管公司将承诺遵循UNPRI的六大原则，继续践行责任投资的理念，为广大投资者提供更优质的服务。

5、2021年8月，全球最大指数公司明晟（Morgan Stanley Capital International，以下简称“MSCI”）上调华泰证券ESG评级至A级，实现连续三年提升，达到全球同行业领先水平。

MSCI指数作为全球投资组合经理采用最多的基准指数，其ESG评级结果为全球各大投资机构决策的重要依据。该评价体系基于市场公开信息，从ESG角度评估公司的可持续发展绩效，衡量企业面对的ESG风险、核心业务的潜在机遇以及行业普遍关注的ESG议题。此次评级提升是对华泰证券体系化构建ESG治理架构、积极履行社会责任的认可，也是对公司长期可持续发展能力的肯定。作为上海、香港和伦敦三地上市的大型证券集团，华泰证券将积极把握市场变革的历史性机遇，持续加大在社会责任和ESG领域的投入，共同助力绿色高质量发展和“碳中和”目标的实现。

#### （四）在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

##### 1、绿色园区

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，通过构建中央绿化以及多层次的景观打造，不断扩大绿植种植面积，着力降低碳排放量。

2021年上半年公司光伏发电系统节电量达37,452千瓦时，每月功率因数均达到供电局奖励标准，获总奖励金额约为人民币13万元。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措施，为低碳经济带来良好的社会效益。

##### 2、绿色运营

华泰证券广场数据中心使用面积约3,600平方米，自2015年投产使用，从前期的建设到后期的运维都以打造绿色数据中心为目标，并采取多种方式提升能源使用效率。

建设阶段，机房区域就采用冷通道封闭这种高效节能的新技术，提高设备散热效率，加强冷气流利用效果。投产以后近六年来，数据中心持续通过技术和管理的不断减少能量损耗，如增加盲板提升冷热通道隔离效果；对空调间回风百叶进行改造更新，减少回风阻力；对机房照明系统进行精细化管理等。

2021年为进一步提升能源使用效率，运维人员对数据中心的整体温度情况进行了全面分析，发现约20%的冷通道温度长期偏低，这些冷通道直对空调送风通道。经过多次的试验和调整，将对应区域的空调回风温度调高1℃，调整的空调占空调总数的20%。调整后，数据中心的空调能耗整体降低1.6%，全年可节约用电约14万度。

##### 3、绿色行动倡议

“地球一小时”是由世界自然基金会（WWF）为应对全球气候变化发起的一项环保行动，公司已连续五年加入“地球一小时”环保接力。在2021年3月27日“地球一小时”活动中，公司以“推广合作伙伴”的身份参与，在线举办“一个小时一个长江”星空对话，邀请“一个长江·野生动植物保护小额基金”项目的一线保护专家与观众探讨如何在科学研究、生态保护、社区发展以及公众推动下，协力守护长江流域生物多样性，助力绿色发展。此外，公司总部大楼熄灯一小时，并号召公众关上不必要的灯与电子设备，引导关注环境变化，推动可持续发展。

##### 4、发展绿色金融，推动资本向善

2021年2月，公司子公司华泰联合证券助力国华能源集团在上海证券交易所成功发行“国家能源投资集团有限责任公司2021年度第一期绿色公司债券（专项用于碳中和）”。本期债券为交易所首批碳中和绿色公司债，其募集资金将主要用于经认证具有碳减排效益的绿色产业项目建设、运营、收购或偿还碳中和项目的贷款等，通过节能减排、充分使用

可再生能源等方式，减少碳排放，持续致力于推进绿色发展。

2021年3月，龙源电力可再生能源电价附加补助2期绿色资产支持专项计划（专项用于碳中和）在深圳证券交易所成功发行，由华泰联合证券担任财务顾问，本期专项计划系交易所市场首单“碳中和”资产支持专项计划，募集资金将投向新能源产业，助力“碳中和”目标实现，促进低碳节能生态体系建设。

公司子公司华泰联合证券始终致力于以金融力量响应国家碳减排的重大决策，推动绿色产业发展，积极参与绿色金融市场的建设与绿色金融产品的创新。截至报告期末，华泰联合证券已成功承销市场多单“碳中和”债券，包括国家能源集团“碳中和”公司债券、中国华电集团“碳中和”公司债券和深圳地铁集团“碳中和”公司债券等。

## 》 二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

公司坚定践行ESG理念，认真履行社会责任，持续为巩固脱贫攻坚成果、推动乡村振兴贡献积极力量。

1、开展党建共建，公司党委与驻地社区党组织开展共驻共建，基层党组织与10个共建村党组织开展共建互联，报告期内落地1家党员实践基地、1家爱国主义教育基地，组织党员志愿者走访慰问百余名老红军、老党员和贫困户，努力实现以党建共建引领乡村振兴。

2、开展产业支持，安排专项资金，加大力度推动“万企联万村 共走振兴路”行动确定的14个共建项目落地见效，目前丰县高效设施农业项目已建成投产，阜宁县生猪产业“期货+保险”项目、沛县标准钢架厂房项目已落实帮扶资金，兴化县美丽乡村建设、扬州富硒米线上渠道建设等项目正在有序推进中。

3、开展消费支持，将消费支持作为服务乡村振兴的重要手段，报告期内，公司累计采购青海扶贫产品人民币45.3万元。

4、开展公益支持，报告期内，公司携手爱德基金会在腾讯公益平台发起“困境儿童资助计划”，筹集善款人民币52.8万元，为安徽金寨、岳西、湖北恩施、江苏宿迁、青海玉树的5所“益心华泰 一个明天”项目设点学校的200名困境儿童，按照每人每年人民币2,640元的标准补贴一年的生活费用，改善他们的学习和生活条件。向新疆克州阿图什市哈拉峻乡捐赠人民币50万元，专项用于克孜勒陶村庄环境整治试点项目。

### 三、合规道德培训情况

2021年4月，为强化全体员工国家安全观，提升全员反洗钱信息保密意识、明确反洗钱保密工作职责，公司以国家安全教育日为契机，聚焦金融信息安全与反洗钱信息保密，举行了“2021年国家安全教育日普法宣传暨反洗钱信息保密工作培训”，并组织公司全体员工学习。

《中华人民共和国刑法修正案(十一)》于2021年3月1日正式施行。此次刑法修改坚持问题导向,以防范化解金融风险、保障金融改革、维护金融秩序为目标,与以信息披露为核心的注册制改革相适应,大幅提高了欺诈发行、信息披露造假、中介机构提供虚假证明文件和操纵市场等四类证券期货犯罪的刑事惩戒力度,对于切实提高证券违法成本、保护投资者合法权益、维护市场秩序、推进注册制改革、保障资本市场平稳健康发展具有重要意义。为帮助员工充分认识刑法修正案(十一)的重要意义,公司制作了“刑法修正案(十一)证券犯罪专题解读课程”和宣传培训视频,覆盖全体员工(包括兼职、实习生及外包人员),以强化其守法及道德意识。

同时,公司高度重视廉洁教育,通过道德、反腐败培训等方式加强员工廉洁从业意识,规范员工廉洁从业行为。公司不定期通过“纪检工作组”和“华泰清风”工作群发布反腐败相关培训材料及典型案例,培训覆盖公司全体员工。



## 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 2020 年年报中查询         |
| 华泰资管公司关于华泰集合资产管理计划项下房产抵押纠纷案件和债券违约合同纠纷案件     | 可在 2020 年年报中查询         |
| 华泰资管公司关于华泰资管资本创新招商 3 号定向资产管理计划股票质押式回购合同纠纷案件 | 可在 2020 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 2020 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 2020 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、华诚投资管理有限责任公司债权债务纠纷案   | 可在 2011 年至 2020 年年报中查询 |
| 华泰联合证券与邮储银行关于美吉特项目纠纷案                       | 可在 2020 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 年至 2020 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）或已披露且有新进展的诉讼、仲裁事项：

#### 1、质押式证券回购纠纷

| 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 | 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、唐付君提出上诉，目前案件处于二审阶段。 |

| 事项                         | 详情  |
|----------------------------|---|
| 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 | 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，森源集团提出上诉，目前案件处于二审阶段。 |
| 公司与韩华、杨立军质押式证券回购纠纷         | 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。   |
| 公司与杨立军、韩华质押式证券回购纠纷         | 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。   |

## 2、光大证券股份有限公司与公司《上海证券交易所债券质押式协议回购交易主协议》争议仲裁案

报告期内，公司收到上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）仲裁文件，光大证券股份有限公司因上海证券交易所债券质押式协议回购交易，向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，请求公司偿还相关协议回购交易项下四笔融资款共计人民币18,430万元以及相应的利息、违约金等。本案中，公司并非案涉协议回购交易的正回购方，仅为正回购方交易商，公司已聘请律师代理应诉，目前本案尚未开庭审理。

## 3、华泰联合证券与16亿阳债投资者纠纷

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。

### （1）已披露且有新进展的案件

2020年10月26日，华泰联合证券收到北京市第一中级人民法院寄来的应诉通知书。原告中国对外经济贸易信托有限公司认为债券已违约且《募集说明书》存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，主承销商及联席主承销商未尽勤勉尽责义务，起诉发行人、主承销商及联席主承销商，要求发行人向其赔付债券本金人民币4,500万元及利息人民币16,481,126元，并要求主承销商及联席主承销商承担连带责任。

2020年10月31日，华泰联合证券收到北京市第一中级人民法院寄来的应诉通知书。原告深圳市融通资本管理股份有限公司起诉发行人、主承销商及联席主承销商，要求发行人向其赔付债券本金人民币5亿元及利息、实现债权费用，合计人民币6.024亿元，并要求主承销商及联席主承销商承担连带责任。

2020年11月5日，华泰联合证券收到北京市第一中级人民法院寄来的应诉通知书。原告中信信托有限责任公司起诉发行人、主承销商及联席主承销商，要求发行人向其赔付债券本金人民币2,000万元及利息，合计人民币2,353.65万元，并要求主承销商及联席主承销商承担连带责任。

就上述案件，北京市第一中级人民法院做出裁定三起案件并案审理，移交哈尔滨市中级人民法院处理，2021年8月3日，哈尔滨市中级人民法院向公司律师送达民事判决书，认为三个原告的债权已通过破产重整程序得到有效清偿，原被告各方债权债务关系已经全部消灭，因此判决驳回原告的诉讼请求。

## （2）新增案件

2021年3月8日，华泰联合证券收到北京市第一中级人民法院寄来的应诉通知书。原告中信建投基金管理有限公司起诉发行人要求赔付债券本金及利息合计人民币85,684,579元，并起诉主承销商及联席主承销商、发行人负责人、会计师事务所、律师事务所承担连带赔偿责任。

北京市第一中级人民法院于2021年4月25日作出裁定，该案移交哈尔滨市中级人民法院处理。截至报告期末尚未收到哈尔滨市中级人民法院的应诉相关司法文书。

## （三）报告期内，本公司不存在被处罚和公开谴责的情况

## 八、报告期内，本公司及董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人不存在涉嫌违法违规、受到处罚及整改的情况

报告期内，公司及其董事、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。

## 九、报告期内，本公司及其控股股东、实际控制人诚信情况的说明

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2020年度股东大会审议通过的《关于预计公司2021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、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        | 2021年1-6月     | 2020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 | 39,696,647.54 | 43,341,587.00 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司           | 席位费分仓佣金及销售服务费 | 22,639,391.54 | 9,613,477.42  |
| 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 | 190,302.71    | -             |
| 江苏省国信集团有限公司            | 证券代理买卖佣金      | -             | 63,806.62     |
| 江苏省国际信托有限责任公司          | 证券代理买卖佣金      | -             | 22,998.81     |
| 江苏舜天行健贸易有限公司           | 证券代理买卖佣金      | -             | 4.92          |
| 江苏锦盈资本管理有限公司           | 证券代理买卖佣金      | 3,439,561.05  | 400,048.69    |
| 江苏舜天国际集团经济协作有限公司       | 证券代理买卖佣金      | -             | 429.66        |
| 江苏冶金进出口有限公司            | 证券代理买卖佣金      | 10.17         | -             |
| 江苏高科技投资集团有限公司          | 证券代理买卖佣金      | -             | 23,897.84     |
| 江苏宁沪高速公路股份有限公司         | 证券代理买卖佣金      | 237.70        | 9.45          |
| 江苏高投鑫海创业投资有限公司         | 证券代理买卖佣金      | -             | 5,567.48      |
| 关联自然人                  | 证券代理买卖佣金      | 35,712.73     | 29,677.29     |
| 南方基金管理股份有限公司           | 证券代理买卖佣金      | 130,793.36    | 550.36        |
| 江苏紫金文化产业二期创业投资基金(有限合伙) | 证券代理买卖佣金      | 6,819.67      | -             |
| 江苏紫金文化产业发展基金(有限合伙)     | 证券代理买卖佣金      | 21.21         | -             |
| 南京钢铁股份有限公司             | 证券代理买卖佣金      | 46,504.25     | -             |
| 江苏省国信集团有限公司            | 债券承销收入        | 4,575,471.70  | 698,113.21    |
| 江苏交通控股有限公司             | 债券承销收入        | 1,904,971.70  | -             |
| 南京银行股份有限公司             | 债券承销收入        | 113,207.55    | -             |
| 江苏银行股份有限公司             | 债券承销及保荐收入     | 71,981.13     | 193,867.92    |
| 江苏省新能源开发股份有限公司         | 财务顾问费         | 566,037.74    | -             |

## (2) 利息净收入

单位：元 币种：人民币

| 关联方         | 关联交易内容     | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
|-------------|------------|---------------|---------------|
| 江苏银行股份有限公司  | 银行存款利息收入   | 3,562,276.48  | 2,774,652.34  |
| 江苏银行股份有限公司  | 质押式正回购利息支出 | -2,364,777.23 | -3,813,103.74 |
| 江苏银行股份有限公司  | 拆入资金利息支出   | -5,629,750.01 | -5,213,888.93 |
| 江苏省国信集团有限公司 | 债权投资利息收入   | 779,968.63    | 3,644,453.47  |
| 南京银行股份有限公司  | 质押式正回购利息支出 | -7,262,906.61 | -             |
| 南京银行股份有限公司  | 质押式逆回购利息收入 | 58,548.12     | -             |

## (3) 投资收益

单位：元 币种：人民币

| 关联方         | 关联交易内容         | 2021年1-6月     | 2020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 | 172,634.81    | -            |
| 江苏交通控股有限公司  | 持有及处置交易性金融资产收益 | 14,111,763.80 | 9,058,113.20 |
| 江苏银行股份有限公司  | 持有及处置交易性金融资产收益 | 197,921.14    | 4,057,973.09 |
| 兴业证券股份有限公司  | 持有及处置衍生金融资产损失  | -2,042,406.88 | -            |

## (4) 关联方投资本集团发行的短期收益凭证情况

单位：元 币种：人民币

| 关联方               | 关联交易内容         | 2021年1-6月      | 2020年1-6月     |
|-------------------|----------------|----------------|---------------|
| 江苏丰海新能源淡化海水发展有限公司 | 净赎回 / 投资短期收益凭证 | -30,000,000.00 | 70,000,000.00 |
| 江苏丰海新能源淡化海水发展有限公司 | 支付短期收益凭证投资收益   | 475,931.51     | -             |
| 江苏银行股份有限公司        | 支付短期收益凭证投资收益   | -              | 191,780.82    |
| 莱绅通灵珠宝股份有限公司      | 净赎回 / 投资短期收益凭证 | -40,000,000.00 | 50,000,000.00 |
| 莱绅通灵珠宝股份有限公司      | 支付短期收益凭证投资收益   | 284,438.36     | 447,945.21    |

## (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 | 2021年1-6月       | 2020年1-6月       |
|----------------|--------|-----------------|-----------------|
| 江苏省国信集团有限公司    | 净赎回债券  | -160,000,000.00 | -231,000,000.00 |
| 江苏交通控股有限公司     | 净认购债券  | 200,000,000.00  |                 |
| 江苏银行股份有限公司     | 净赎回债券  | -               | -52,717,346.44  |
| 江苏宁沪高速公路股份有限公司 | 净赎回债券  | -10,000,000.00  | -               |

## (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 | 2021年1-6月         | 2020年1-6月         |
|------------|--------|-------------------|-------------------|
| 江苏银行股份有限公司 | 质押式正回购 | 31,077,618,000.00 | 74,325,970,000.00 |
| 南京银行股份有限公司 | 质押式正回购 | 72,154,599,000.00 | -                 |
| 南京银行股份有限公司 | 质押式逆回购 | 220,020,000.00    | -                 |
| 江苏银行股份有限公司 | 拆入资金   | 56,000,000,000.00 | 77,800,000,000.00 |

## (7) 关联租赁

单位:元 币种:人民币

| 承租方            | 租赁资产种类   | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
|----------------|----------|---------------|---------------|
| 南方基金管理股份有限公司   | 房屋建筑物    | 1,619,067.02  | 2,288,075.53  |
| 江苏银行股份有限公司     | 房屋建筑物    | -             | 3,169,526.16  |
| 江苏沿海创新资本管理有限公司 | 房屋建筑物及车位 | -             | 521,950.00    |
| 江苏沿海创新资本管理有限公司 | 其他       | -             | 45,714.29     |
| 出租方            | 租赁资产种类   | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
| 南方基金管理股份有限公司   | 房屋建筑物    | 16,916,228.51 | 16,480,943.46 |
| 南方基金管理股份有限公司   | 其他       | 1,524,600.00  | 3,049,200.00  |

## 2、报告期内，本公司无临时公告未披露的事项

## (二) 报告期内，本公司无资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

## (三) 共同对外投资的重大关联交易

2021年1月29日，公司董事会审议通过了《关于公司全资子公司华泰紫金投资有限责任公司投资设立产业基金的议案》，批准华泰紫金投资与国信集团的全资子公司江苏省投资管理有限责任公司等三家公司成立合伙企业以创立基金，其中华泰紫金投资认缴出资人民币6亿元（详见公司日期为2021年1月30日的公告）。截至报告期末，华泰紫金投资实缴出资人民币6,000万元。

根据《香港上市规则》第 14A 章，成立合伙企业项下拟进行之交易构成本公司之关连交易。根据《香港上市规则》第 14.07 条计算之有关成立合伙企业之出资额之最高可适用百分比率高于 0.1% 但低于 5%，成立合伙企业仅须遵守《香港上市规则》第 14A 章项下申报及公告之规定。

#### (四) 关联债权债务往来

1、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      | 2021年6月30日    |            | 2020年12月31日   |             |
|--------------|--------------|---------------|------------|---------------|-------------|
|              |              | 账面余额          | 坏账准备       | 账面余额          | 坏账准备        |
| 南方基金管理股份有限公司 | 基金分仓佣金及销售服务费 | 9,805,787.64  | -49,028.94 | 21,193,970.72 | -105,969.85 |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 基金分仓佣金及销售服务费 | 14,821,749.64 | -74,108.75 | 13,893,089.69 | -69,465.45  |
| 江苏银行股份有限公司   | 承销保荐费        | -             | -          | 11,585,106.08 | -           |
| 南方基金管理股份有限公司 | 代垫费用         | 1,719,582.25  | -8,597.91  | 367,889.71    | -27,194.60  |

##### (2) 预收关联方款项

单位：元 币种：人民币

| 关联方        | 关联方交易内容 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 |
|------------|---------|------------|-------------|
| 江苏银行股份有限公司 | 保荐业务预收款 | -          | 642,902.67  |

##### (3) 关联方资金拆借

单位：元 币种：人民币

| 关联方        | 关联方交易内容 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日    |
|------------|---------|------------|----------------|
| 江苏银行股份有限公司 | 拆入资金    | -          | 500,210,972.22 |

##### (4) 与关联方开展质押式回购

单位：元 币种：人民币

| 关联方        | 关联方交易内容 | 2021年6月30日     | 2020年12月31日 |
|------------|---------|----------------|-------------|
| 江苏银行股份有限公司 | 质押式正回购  | 199,524,937.50 | -           |
| 南京银行股份有限公司 | 质押式正回购  | 287,070,670.03 | -           |

##### (5) 存放关联方款项

单位：元 币种：人民币

| 关联方        | 关联方交易内容 | 2021年6月30日     | 2020年12月31日    |
|------------|---------|----------------|----------------|
| 江苏银行股份有限公司 | 银行存款    | 603,840,340.12 | 277,360,918.92 |



(6) 承租关联方租赁

单位:元 币种:人民币

| 关联方          | 关联交易内容 | 2021年6月30日     | 2020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  | 102,436,725.68 | 115,570,892.20 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 其他     | 12,117,409.50  | 14,540,891.46  |

| 关联方          | 关联交易内容 | 2021年6月30日     | 2020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  | 105,057,432.48 | 123,800,455.38 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 其他     | 12,117,409.50  | 14,050,033.85  |

(7) 应付关联方款项

单位:元 币种:人民币

| 关联方                | 关联方交易内容 | 2021年6月30日    | 2020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  |
| 江苏省国信集团有限公司        | 代理买卖证券款 | 5,518,681.25  | 4,859,366.34  |
| 江苏交通控股有限公司         | 代理买卖证券款 | 1,022.49      | 1,935.11      |
| 江苏高科技投资集团有限公司      | 代理买卖证券款 | 2,389,541.18  | 2,390,852.82  |
| 江苏舜天国际集团有限公司       | 代理买卖证券款 | 100.00        | 100.00        |
| 江苏锦盈资本管理有限公司       | 代理买卖证券款 | 28,116,069.01 | 36,822,000.03 |
| 江苏舜天行健贸易有限公司       | 代理买卖证券款 | 49,928.75     | 8,893.58      |
| 江苏省国际信托有限责任公司      | 代理买卖证券款 | 1,033,514.38  | 129,197.51    |
| 江苏省投资管理有限责任公司      | 代理买卖证券款 | -             | 373,339.80    |
| 江苏冶金进出口有限公司        | 代理买卖证券款 | 100.00        | 0.24          |
| 江苏省软件产业股份有限公司      | 代理买卖证券款 | 1,435.55      | 1,433.01      |
| 江苏舜天股份有限公司         | 代理买卖证券款 | 2.16          | 2.16          |
| 江苏舜天国际集团苏迈克斯工具有限公司 | 代理买卖证券款 | 31,657.97     | 25,272.79     |
| 江苏舜天国际集团经济协作有限公司   | 代理买卖证券款 | 9.49          | 9.47          |
| 江苏舜天国际集团机械进出口有限公司  | 代理买卖证券款 | 1,188,646.58  | 1,185,048.31  |
| 江苏宁沪高速公路股份有限公司     | 代理买卖证券款 | 61,069.24     | 713,863.87    |
| 江苏丰海新能源淡化海水发展有限公司  | 代理买卖证券款 | -             | 96,256.88     |
| 江苏高新创业投资管理有限公司     | 代理买卖证券款 | 0.17          | 0.17          |
| 高投名力成长创业投资有限公司     | 代理买卖证券款 | 12,417.36     | 12,395.41     |
| 江苏高投鑫海创业投资有限公司     | 代理买卖证券款 | 590,058.07    | 7,570.43      |

| 关联方                    | 关联方交易内容 | 2021年6月30日     | 2020年12月31日   |
|------------------------|---------|----------------|---------------|
| 江苏高投发展创业投资有限公司         | 代理买卖证券款 | 473.63         | 472.79        |
| 江苏高投中小企业创业投资有限公司       | 代理买卖证券款 | 198,270.76     | 262.60        |
| 江苏省铁路集团有限公司            | 代理买卖证券款 | 10,825,624.26  | 633.14        |
| 华新水泥股份有限公司             | 代理买卖证券款 | -              | 5,064.73      |
| 江苏紫金文化产业二期创业投资基金（有限合伙） | 代理买卖证券款 | -              | 5,845,324.00  |
| 江苏紫金文化产业发展基金（有限合伙）     | 代理买卖证券款 | 197,684.30     | 7,832.31      |
| 南方基金管理股份有限公司           | 代理买卖证券款 | -              | 1,049,824.39  |
| 关联自然人                  | 代理买卖证券款 | 20,388,668.63  | 2,816,605.58  |
| 江苏银行股份有限公司             | 代理买卖证券款 | 5,581,958.40   | 1,949.75      |
| 南京钢铁股份有限公司             | 代理买卖证券款 | 15,028,641.33  | 36,688,232.63 |
| 兴业证券股份有限公司             | 代理买卖证券款 | 110,680,676.09 | 13,550,000.00 |

## 2、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

## 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                    | 123.02            |
| 报告期末对子公司担保余额合计（B）                  | 270.83            |
| 公司担保总额情况（包括对子公司的担保）                |                   |
| 担保总额（A+B）                          | 270.83            |
| 担保总额占公司净资产的比例（%）                   | 20.39             |
| 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） | 208.83            |
| 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）                  | 208.83            |
| 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、本公司的担保事项

(1) 2015年1月，华泰资管公司正式营业。随着公司资管业务的稳步发展和资产管理规模的快速扩大，为确保华泰资管公司各项风控指标符合监管要求，公司股东大会于2015年3月30日和2016年9月13日，分别审议通过了相关议案，批准公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币12亿元和人民币50亿元的净资本担保，并承诺当华泰资管公司开展业务需要现金支持时，将无条件在上述额度内提供现金。

2020年12月31日，上海证监局批准公司终止对华泰资管公司提供的人民币20亿元净资本担保承诺。报告期末，公司合计为华泰资管公司提供最高额度为人民币42亿元的净资本担保。

(2) 于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。

(3) 于2018年，经公司第四届董事会第十六次会议审议通过，本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。

(4) 于2019年，经公司第四届董事会第二十次会议审议通过，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5亿美元债券提供无条件及不可撤销的保证担保。于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。

(5) 于2020年，经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。

(6) 2021年4月，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1亿美元债券分别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53.14亿元。

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208.83亿元，包括1)公司为华泰国际下属公司 Pioneer Reward Limited 发行的23亿美元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3号—半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无进展。

## 十二、其他重大事项的说明

### 1、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，公司新设证券营业部情况

| 序号 | 名称                     | 所在地区   | 成立日期       | 经营范围   |
|----|------------------------|--------|------------|--|
| 1  | 华泰证券股份有限公司赣州并购基金园证券营业部 | 江西省赣州市 | 2021年5月25日 | 证券经纪；证券投资咨询；证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具、金融债（含政策性金融债）承销）；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。 |

#### (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  | 四川分公司 | 四川分公司 | 中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区交子大道33号中国华商金融中心1-1-25楼2503、2504、2505、2506、2507、2508 | 2020年11月16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  | 镇江丹阳东方路证券营业部   | 镇江丹阳凤凰路证券营业部      | 丹阳市开发区凤凰路16-1号至16-3号                       | 2021年1月12日 |
| 2  | 南通人民中路证券营业部    | 南通人民中路证券营业部       | 南通市崇川区人民中路79号金信大厦东半层                       | 2021年1月12日 |
| 3  | 成都人民南路证券营业部    | 成都人民南路证券营业部       | 成都市武侯区人民南路四段45号新希望大厦1栋1单元7楼703室            | 2021年1月25日 |
| 4  | 深圳海德三道证券营业部    | 深圳科苑南路华润大厦证券营业部   | 深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L1805、L1806   | 2021年1月25日 |
| 5  | 上海奉贤区望园南路证券营业部 | 上海奉贤区望园南路证券营业部    | 上海市奉贤区庙泾新村46、47、48、49号                     | 2021年1月27日 |
| 6  | 深圳高新南一道证券营业部   | 深圳深南大道华润置地大厦证券营业部 | 深圳市南山区粤海街道大冲社区科发路19号华润置地大厦D座2904、2905、2906 | 2021年1月27日 |
| 7  | 徐州青年路证券营业部     | 徐州淮海东路证券营业部       | 徐州市鼓楼区淮海东路29号苏宁广场第1F层第165号；A单元2102-2105室   | 2021年3月8日  |
| 8  | 南通上海东方路证券营业部   | 南通上海东方路证券营业部      | 南通市开发区金海苑2幢101室                            | 2021年3月5日  |

| 序号 | 迁址前名称          | 迁址后名称           | 迁址后地址   | 获得许可证日期    |
|----|----------------|-----------------|---|------------|
| 9  | 德阳中江县凯丰北路证券营业部 | 德阳长江西路钻石广场证券营业部 | 四川省德阳市区长江西路二段29号钻石广场1栋5楼A2A3A4A5A6            | 2021年3月31日 |
| 10 | 南京广州路证券营业部     | 南京文澜路证券营业部      | 南京市栖霞区仙林大学城文澜路6号                              | 2021年4月7日  |
| 11 | 南京中山北路证券营业部    | 南京郑和中路证券营业部     | 南京市鼓楼区郑和中路118号南京长江国际航运服务中心D座9层902室、永宁街3-15号-2 | 2021年4月19日 |
| 12 | 南宁中泰路证券营业部     | 南宁民族大道证券营业部     | 南宁市青秀区民族大道136-5号南宁华润中心南写字楼7层702-704号          | 2021年4月29日 |
| 13 | 南京解放路证券营业部     | 南京大光路证券营业部      | 南京市秦淮区大光路39号光华大厦202A室                         | 2021年5月25日 |
| 14 | 广州天河东路证券营业部    | 广州兴民路证券营业部      | 广州市天河区兴民路222号之三906-911房                       | 2021年5月28日 |
| 15 | 淮安涟水红日大道证券营业部  | 淮安涟水红日大道证券营业部   | 淮安市涟水县中联壹城新莲壹品Z02幢104室                        | 2021年6月17日 |
| 16 | 兰州甘南路证券营业部     | 兰州东岗西路证券营业部     | 甘肃省兰州市城关区东岗西路621号长业金座4层                       | 2021年6月24日 |

## 2、子公司重大事项说明

### (1) 华泰紫金投资

报告期内，公司董事会批准华泰紫金投资参与投资设立南京华泰国信医疗投资合伙企业（有限合伙），基金总认缴规模人民币300,000万元。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60,000万元。截至报告期末，华泰紫金投资实缴出资人民币6,000万元。

报告期内，华泰紫金投资对其出资设立的江苏紫金弘云健康产业投资合伙企业（有限合伙）增加实缴出资人民币8,700万元。截至报告期末，华泰紫金投资实缴出资人民币23,200万元。

### (2) 华泰国际

报告期内，华泰国际的子公司AssetMark Financial, Inc.于美国特拉华州注册设立全资子公司Gossamer Merger Sub, Inc.，并注销了注册于美国特拉华州的子公司OBS Financial Services, Inc.。

### (3) 华泰期货

报告期内，华泰期货境外子公司华泰资本管理（香港）有限公司向其全资子公司华泰香港期货有限公司和华泰金融美国公司增资600万港币和300万港币。

2021年8月，华泰期货聘任赵昌涛先生为总经理。

### (4) 江苏股权交易中心

报告期内，江苏股权交易中心召开董事会，选举孙含林先生为公司第三届董事会董事长，任期至本届董事会任期结束。

3、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

#### 4、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；上半年共接待境内外多家券商和基金公司等机构共 14 批次约 47 名研究员和投资人员的到访调研或电话访谈；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。上半年共参加 2 场策略报告会与投资论坛，就行业发展趋势、公司经营业绩及业务发展战略等问题与投资者和研究员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。

2021 年上半年公司接待调研、沟通、采访等工作开展情况：

| 序号 | 接待时间            | 接待地点  | 接待方式 | 接待对象                              | 谈论的主要内容及提供的资料               |
|----|-----------------|-------|------|-----------------------------------|-----------------------------|
| 1  | 2021 年 1 月 20 日 | 香港办公室 | 电话访谈 | 富达基金（1 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 |
| 2  | 2021 年 1 月 20 日 | 香港办公室 | 电话访谈 | M&G 资管（1 人次）                      |                             |
| 3  | 2021 年 1 月 27 日 | 香港办公室 | 电话访谈 | 中信里昂证券（1 人次）                      |                             |
| 4  | 2021 年 3 月 30 日 | 公司总部  | 电话访谈 | 施罗德集团（4 人次）                       |                             |
| 5  | 2021 年 3 月 30 日 | 公司总部  | 现场访谈 | 朱雀基金、国泰基金、嘉实基金等（13 人次）            |                             |
| 6  | 2021 年 4 月 8 日  | 上海办公室 | 现场访谈 | 朱雀基金（2 人次）                        |                             |
| 7  | 2021 年 4 月 12 日 | 上海办公室 | 现场访谈 | APS 资管（2 人次）                      |                             |
| 8  | 2021 年 4 月 12 日 | 上海办公室 | 现场访谈 | 太保资管（1 人次）                        |                             |
| 9  | 2021 年 5 月 12 日 | 深圳办公室 | 电话访谈 | 富达基金（1 人次）                        |                             |
| 10 | 2021 年 5 月 13 日 | 深圳办公室 | 现场访谈 | 大成基金（1 人次）                        |                             |
| 11 | 2021 年 5 月 21 日 | 公司总部  | 现场访谈 | 招商基金（1 人次）                        |                             |
| 12 | 2021 年 5 月 27 日 | 香港办公室 | 电话访谈 | 汇丰银行（3 人次）                        |                             |
| 13 | 2021 年 6 月 3 日  | 香港办公室 | 电话访谈 | 平安证券、东吴证券（2 人次）                   |                             |
| 14 | 2021 年 6 月 23 日 | 香港办公室 | 电话访谈 | Prime Capital、WT Capital 等（14 人次） |                             |

2021 年上半年公司参加境内外证券经营机构举办的策略报告会与投资论坛等工作开展情况：

| 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  | 2021 年 1 月 21 日 | 瑞银 2021 年大中华研讨会   | 电话访谈 | 瑞银财富管理、APS 资管、野村资管等（18 人次） | 公司业务亮点、经营和财务情况及公司长期战略规划等 |
| 2  | 2021 年 6 月 1 日  | 中信证券 2021 年资本市场论坛 | 现场访谈 | 大成基金、嘉实基金、淡水泉投资等（28 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(%)         |
| <b>一、有限售条件股份</b>   | -                    | -             | -            | -        | -        | 45,488,000  | 45,488,000  | 45,488,000           | 0.50          |
| 1、国家持股             | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| 2、国有法人持股           | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| 3、其他内资持股           | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| 其中：境内非国有法人持股       | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| 境内自然人持股            | -                    | -             | -            | -        | -        | 45,488,000  | 45,488,000  | 45,488,000           | 0.50          |
| 4、外资持股             | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| 其中：境外法人持股          | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| 境外自然人持股            | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| <b>二、无限售条件流通股份</b> | 9,076,650,000        | 100.00        | -            | -        | -        | -45,488,000 | -45,488,000 | 9,031,162,000        | 99.50         |
| 1、人民币普通股           | 7,357,604,320        | 81.06         | -            | -        | -        | -45,488,000 | -45,488,000 | 7,312,116,320        | 80.56         |
| 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               | -                    | -             | -            | -        | -        | -           | -           | -                    | -             |
| <b>三、股份总数</b>      | <b>9,076,650,000</b> | <b>100.00</b> | <b>-</b>     | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>-</b>    | <b>-</b>    | <b>9,076,650,000</b> | <b>100.00</b> |

## 2、股份变动情况说明

报告期内，公司完成 A 股限制性股票的授予登记，授予激励对象的 4,548.80 万股 A 股限制性股票由无限售条件流通股变更为有限售条件股份，股份来源为公司从二级市场回购的本公司 A 股普通股股票。

## 3、报告期后到半年报披露日期间未发生股份变动

## 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

2021 年 7 月 6 日，公司接到国信集团通知，国信集团通过港股通增持公司 H 股股份 2,363,600 股，约占公司总股数的 0.0260%。增持后，国信集团持有公司股份 1,351,597,036 股，约占公司总股数的 14.8909%。国信集团计划自本次增持之日起未来 6 个月内继续通过港股通增持公司 H 股股份，累计增持股份比例为不低于公司总股数的 0.1102%（1000 万股）、不高于公司总股数的 0.5%，以上比例均含本次已增持股份。（详见上交所公告 2021-045）

2021 年 7 月 8 日，公司收到国信集团通知，国信集团在 2021 年 7 月 6 日至 7 月 8 日期间，通过港股通已累计增持公司 H 股 7,824,600 股，已超过股票增持计划数量下限的 50%。增持后国信集团持有公司股份 1,357,058,036 股，占公司总股数的 14.9511%。（详见上交所公告 2021-046）

## （二）限售股份变动情况

单位：股

| 股东名称         | 期初<br>限售股数 | 报告期解除<br>限售股数 | 报告期增加<br>限售股数 | 报告期末<br>限售股数 | 限售<br>原因         | 解除<br>限售日期 |
|--------------|------------|---------------|---------------|--------------|------------------|------------|
| A 股限制性股票激励对象 | -          | -             | 45,488,000    | 45,488,000   | A 股限制性股票<br>激励计划 | 详见附注       |
| 合计           | -          | -             | 45,488,000    | 45,488,000   | /                | /          |

注：本激励计划授予限制性股票的解除限售期及各期解除限售时间安排如下表所示：

| 解除限售安排   | 解除限售的时限  | 解除限售比例 |
|----------|--|--------|
| 第一个解除限售期 | 自相应部分限制性股票授予登记完成之日起 24 个月后的首个交易日起至限制性股票登记完成之日起 36 个月内的最后一个交易日当日止 | 33%    |
| 第二个解除限售期 | 自相应部分限制性股票授予登记完成之日起 36 个月后的首个交易日起至限制性股票登记完成之日起 48 个月内的最后一个交易日当日止 | 33%    |
| 第三个解除限售期 | 自相应部分限制性股票授予登记完成之日起 48 个月后的首个交易日起至限制性股票登记完成之日起 60 个月内的最后一个交易日当日止 | 34%    |



## 二、股东情况

### (一) 股东总数：

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 截止报告期末普通股股东总数（户）       | 346,778 |
| 截止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 339,243 户，H 股登记股东 7,535 户。

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

单位：股

| 前十名股东持股情况                     |             |               |       |             |            |             |         |
|-------------------------------|-------------|---------------|-------|-------------|------------|-------------|---------|
| 股东名称（全称）                      | 报告期内增减      | 期末持股数量        | 比例（%） | 持有有限售条件股份数量 | 质押、标记或冻结情况 |             | 股东性质    |
|                               |             |               |       |             | 股份状态       | 数量          |         |
| 香港中央结算（代理人）有限公司               | -87,937,200 | 1,483,151,327 | 16.34 | -           | 无          | -           | 境外法人    |
| 江苏省国信集团有限公司                   | -           | 1,349,233,436 | 14.86 | -           | 无          | -           | 国有法人    |
| 江苏交通控股有限公司                    | 5,000,000   | 489,065,418   | 5.39  | -           | 无          | -           | 国有法人    |
| 江苏高科技投资集团有限公司                 | -           | 356,233,206   | 3.92  | -           | 无          | -           | 国有法人    |
| 阿里巴巴（中国）网络技术有限公司              | -           | 268,199,233   | 2.95  | -           | 无          | -           | 境内非国有法人 |
| 香港中央结算有限公司                    | -48,020,163 | 227,399,485   | 2.51  | -           | 无          | -           | 境外法人    |
| 江苏省苏豪控股集团有限公司                 | 6,614,245   | 160,019,699   | 1.76  | -           | 无          | -           | 国有法人    |
| 中国证券金融股份有限公司                  | -93,814,073 | 152,906,738   | 1.68  | -           | 无          | -           | 未知      |
| 江苏宏图高科技股份有限公司                 | -           | 123,169,146   | 1.36  | -           | 未知         | 123,169,146 | 境内非国有法人 |
| 安信证券-招商银行-安信证券定增宝 1 号集合资产管理计划 | -79,931,176 | 118,743,891   | 1.31  | -           | 无          | -           | 未知      |

| 前十名无限售条件股东持股情况                    |   |         |               |
|-----------------------------------|---|---------|---------------|
| 股东名称                              | 持有无限售条件流通股的数量   | 股份种类及数量 |               |
|                                   |   | 种类      | 数量            |
| 香港中央结算（代理人）有限公司                   | 1,483,151,327   | 境外上市外资股 | 1,483,151,327 |
| 江苏省国信集团有限公司                       | 1,349,233,436   | 人民币普通股  | 1,271,072,836 |
|                                   |   | 境外上市外资股 | 78,160,600    |
| 江苏交通控股有限公司                        | 489,065,418   | 人民币普通股  | 452,065,418   |
|                                   |   | 境外上市外资股 | 37,000,000    |
| 江苏高科技投资集团有限公司                     | 356,233,206   | 人民币普通股  | 342,028,006   |
|                                   |   | 境外上市外资股 | 14,205,200    |
| 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   |
| 香港中央结算有限公司                        | 227,399,485   | 人民币普通股  | 227,399,485   |
| 江苏省苏豪控股集团有限公司                     | 160,019,699   | 人民币普通股  | 56,997,299    |
|                                   |   | 境外上市外资股 | 103,022,400   |
| 中国证券金融股份有限公司                      | 152,906,738   | 人民币普通股  | 152,906,738   |
| 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   |
| 安信证券 - 招商银行 - 安信证券定增宝 1 号集合资产管理计划 | 118,743,891   | 人民币普通股  | 118,743,891   |
| 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。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、江苏高投和江苏省苏豪控股集团有限公司通过港股通分别购入了本公司 H 股股份 78,160,600 股、37,000,000 股、14,205,200 股和 103,022,400 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 1,715,539,527 股，占公司总股本的 18.90%。

3、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。

4、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 1,032,393 份，占中国证监会核准发行数量的 1.25%。

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        | 720,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 2                | 韩臻聪       | 600,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 3                | 李世谦       | 600,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 4                | 孙含林       | 600,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 5                | 姜健        | 600,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 6                | 张辉        | 600,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 7                | 陈天翔       | 600,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 8                | 焦晓宁       | 500,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 9                | 焦凯        | 500,000      | 详见附注             | -           | 详见附注 |
| 10               | 王翀        | 500,000      | 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 日在上海证券交易所网站披露的《A 股限制性股票股权激励计划》相关内容。

(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变动情况

单位：股

| 姓名  | 职务（注） | 期初持股数 | 期末持股数   | 报告期内股份增减变动量 | 增减变动原因 |
|-----|-------|-------|---------|-------------|--------|
| 周易  | 董事、高管 | -     | 720,000 | 720,000     | 股权激励   |
| 李世谦 | 高管    | -     | 600,000 | 600,000     | 股权激励   |
| 孙含林 | 高管    | -     | 600,000 | 600,000     | 股权激励   |
| 姜健  | 高管    | -     | 600,000 | 600,000     | 股权激励   |
| 张辉  | 高管    | -     | 600,000 | 600,000     | 股权激励   |
| 陈天翔 | 高管    | -     | 600,000 | 600,000     | 股权激励   |
| 焦晓宁 | 高管    | -     | 500,000 | 500,000     | 股权激励   |
| 焦凯  | 高管    | -     | 500,000 | 500,000     | 股权激励   |
| 王翀  | 高管    | -     | 500,000 | 500,000     | 股权激励   |

#### (二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

单位：股

| 姓名  | 职务（注） | 期初持有限制性股票数量 | 报告期新授予限制性股票数量 | 已解锁股份 | 未解锁股份     | 期末持有限制性股票数量 |
|-----|-------|-------------|---------------|-------|-----------|-------------|
| 周易  | 董事、高管 | -           | 720,000       | -     | 720,000   | 720,000     |
| 李世谦 | 高管    | -           | 600,000       | -     | 600,000   | 600,000     |
| 孙含林 | 高管    | -           | 600,000       | -     | 600,000   | 600,000     |
| 姜健  | 高管    | -           | 600,000       | -     | 600,000   | 600,000     |
| 张辉  | 高管    | -           | 600,000       | -     | 600,000   | 600,000     |
| 陈天翔 | 高管    | -           | 600,000       | -     | 600,000   | 600,000     |
| 焦晓宁 | 高管    | -           | 500,000       | -     | 500,000   | 500,000     |
| 焦凯  | 高管    | -           | 500,000       | -     | 500,000   | 500,000     |
| 王翀  | 高管    | -           | 500,000       | -     | 500,000   | 500,000     |
| 合计  | /     | -           | 5,220,000     | -     | 5,220,000 | 5,220,000   |

### 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 2021 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(注 2) / 淡仓(注 3) / 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(注 1)                            | 1,271,072,836 | 14.00             | 17.28                     | 好仓                          |
|    |                | H 股(港股通) | 实益拥有人(注 1)                            | 78,160,600    | 0.86              | 4.55                      | 好仓                          |
| 2  | 江苏交通控股有限公司     | A 股      | 实益拥有人(注 1)                            | 452,065,418   | 4.98              | 6.14                      | 好仓                          |
|    |                | H 股(港股通) | 实益拥有人(注 1)                            | 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(注 1)                            | 56,997,299    | 0.63              | 0.77                      | 好仓                          |
|    |                | H 股(港股通) | 实益拥有人(注 1)                            | 103,022,400   | 1.14              | 5.99                      | 好仓                          |
|    |                |          | 受控法团权益(注 1)                           | 26,938,200    | 0.30              | 1.57                      | 好仓                          |
| 4  | 朱雀基金管理有限公司     | H 股(港股通) | 属第 317(1)(a) 条所述的买入股份协议一方的一致行动人士(注 1) | 114,309,400   | 1.26              | 6.65                      | 好仓                          |
| 5  | Citigroup Inc. | H 股      | 受控法团权益、核准借出代理人(注 1)                   | 87,884,862    | 0.97              | 5.11                      | 好仓                          |
|    |                | H 股      | 受控法团权益(注 1)                           | 452,600       | 0.005             | 0.02                      | 淡仓                          |
|    |                | H 股      | 核准借出代理人(注 1)                          | 86,210,689    | 0.95              | 5.01                      | 可供借出的股份                     |

注 1：按香港交易所网站(www.hkex.com.hk)及中国证券登记结算有限公司(www.chinaclear.cn)所提供的信息。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 103,022,400 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 26,938,200 股 H 股好仓。

Citigroup Inc. 通过受其控制的一系列法团间接持有本公司 87,884,862 股 H 股好仓(其中 86,210,689 股为以核准借出代理人身份持有)以及 452,600 股 H 股淡仓。

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；及

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 2021 年 6 月 30 日，本公司并不知悉任何其他人士(本公司董事、监事及最高行政人员除外)于本公司股份或相关股份中拥有根据《证券及期货条例》第 336 条规定须记录于登记册内之权益或淡仓。

## 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 2021 年 6 月 30 日，就本公司所获得的资料及据董事所知，本公司董事、监事及最高行政人员在本公司或其相联法团（定义见《证券及期货条例》第 XV 部分）的股份、相关股份或债权证中根据《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 条须通知本公司及香港联交所的权益及淡仓。

截至报告期末，因公司实施 A 股限制性股票激励计划授予本公司部分董事限制性股票的情况如下：

| 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，于 2021 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

2021 年 1 月 8 日，公司通过集中竞价交易方式回购 A 股股份 2,675,500 股，至此公司完成回购，已实际回购 A 股股份 90,766,495 股，占公司总股本的 0.9999999%，回购最高价为人民币 23.08 元 / 股，回购最低价为人民币 17.19 元 / 股，回购均价为人民币 18.46 元 / 股，使用资金总额为人民币 1,675,361,296.88 元（不含交易费用）。本次回购 A 股股份方案实际执行情况与原披露的回购股份方案不存在差异，公司已按披露的方案完成回购。（详见上交所公告 2021-007）

除上述情形外，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、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<br>2013年公司债券(10年期)                    | 13华泰<br>02 | 122262.SH | 2013-06-05 | 2013-06-05 | 2023-06-05 | 60   | 5.10   | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2016年公司债券(第一期)(品种二)                | 16华泰<br>G2 | 136852.SH | 2016-12-02 | 2016-12-06 | 2021-12-06 | 25   | 3.78   | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2016年公司债券(第二期)(品种二)                | 16华泰<br>G4 | 136874.SH | 2016-12-12 | 2016-12-14 | 2021-12-14 | 30   | 3.97   | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2018年面向合格投资者<br>公开发行公司债券(第一期)(品种一) | 18华泰<br>G1 | 155047.SH | 2018-11-22 | 2018-11-26 | 2021-11-26 | 30   | 3.88   | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2018年面向合格投资者<br>公开发行公司债券(第一期)(品种二) | 18华泰<br>G2 | 155048.SH | 2018-11-22 | 2018-11-26 | 2023-11-26 | 10   | 4.17   | 到期还本,<br>按年付息 |

| 债券名称   | 简称          | 代码        | 发行日        | 起息日        | 到期日        | 债券<br>余额 | 利率<br>(%) | 还本付息<br>方式    |
|--|-------------|-----------|------------|------------|------------|----------|-----------|---------------|
| 华泰证券股份有限公司<br>2019年面向合格投资者<br>公开发行公司债券(第<br>一期)(品种一)   | 19 华泰<br>G1 | 155240.SH | 2019-03-15 | 2019-03-19 | 2022-03-19 | 70       | 3.68      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2019年面向合格投资者<br>公开发行公司债券(第<br>二期)(品种一)   | 19 华泰<br>G3 | 155358.SH | 2019-04-18 | 2019-04-22 | 2022-04-22 | 50       | 3.80      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向合格投<br>资者公开发行公司债券<br>(第一期)        | 20 华泰<br>G1 | 163353.SH | 2020-03-24 | 2020-03-26 | 2023-03-26 | 80       | 2.99      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向合格投<br>资者公开发行公司债券<br>(第二期)        | 20 华泰<br>G3 | 163482.SH | 2020-04-27 | 2020-04-29 | 2025-04-29 | 35       | 2.90      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向合格投<br>资者公开发行公司债券<br>(第三期)        | 20 华泰<br>G4 | 163558.SH | 2020-05-19 | 2020-05-21 | 2025-05-21 | 30       | 3.20      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向合格投<br>资者公开发行公司债券<br>(第四期)(品种二)   | 20 华泰<br>G6 | 163670.SH | 2020-06-16 | 2020-06-18 | 2023-06-18 | 32       | 3.10      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2020年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第一期)(品种一) | 20 华泰<br>S1 | 163823.SH | 2020-08-27 | 2020-08-31 | 2021-08-31 | 55       | 3.10      | 到期一次还<br>本付息  |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向专业投<br>资者公开发行次级债券<br>(第一期)        | 20 华泰<br>C1 | 175409.SH | 2020-11-11 | 2020-11-13 | 2025-11-13 | 50       | 4.48      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向专业投<br>资者公开发行公司债券<br>(第五期)        | 20 华泰<br>G7 | 175473.SH | 2020-11-20 | 2020-11-24 | 2023-11-24 | 35       | 3.90      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公<br>司2020年面向专业投<br>资者公开发行公司债券<br>(第六期)(品种一)   | 20 华泰<br>G8 | 175534.SH | 2020-12-07 | 2020-12-09 | 2022-12-09 | 40       | 3.67      | 到期还本,<br>按年付息 |



| 债券名称   | 简称         | 代码        | 发行日        | 起息日        | 到期日        | 债券<br>余额 | 利率<br>(%) | 还本付息<br>方式    |
|--|------------|-----------|------------|------------|------------|----------|-----------|---------------|
| 华泰证券股份有限公司<br>2020年面向专业投资者<br>公开发行公司债券<br>(第六期)(品种二)   | 20华泰<br>G9 | 175535.SH | 2020-12-07 | 2020-12-09 | 2023-12-09 | 40       | 3.79      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>一期)(品种一)   | 21华泰<br>G1 | 175648.SH | 2021-01-18 | 2021-01-20 | 2024-01-20 | 40       | 3.58      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行次级债券(第<br>一期)        | 21华泰<br>C1 | 175721.SH | 2021-01-27 | 2021-01-29 | 2026-01-29 | 90       | 4.50      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>二期)        | 21华泰<br>G3 | 188047.SH | 2021-04-22 | 2021-04-26 | 2024-04-26 | 50       | 3.42      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>三期)        | 21华泰<br>G4 | 188106.SH | 2021-05-13 | 2021-05-17 | 2026-05-17 | 60       | 3.71      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>四期)(品种一)   | 21华泰<br>G5 | 188134.SH | 2021-05-20 | 2021-05-24 | 2024-05-24 | 40       | 3.28      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>四期)(品种二)   | 21华泰<br>G6 | 188140.SH | 2021-05-20 | 2021-05-24 | 2026-05-24 | 20       | 3.63      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>五期)(品种一)   | 21华泰<br>G7 | 188239.SH | 2021-06-10 | 2021-06-15 | 2024-06-15 | 20       | 3.40      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行公司债券(第<br>六期)(品种一)   | 21华泰<br>09 | 188282.SH | 2021-06-17 | 2021-06-21 | 2024-06-21 | 25       | 3.45      | 到期还本,<br>按年付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资者<br>公开发行短期公司债券<br>(第一期)(品种二) | 21华泰<br>S2 | 163883.SH | 2021-06-24 | 2021-06-28 | 2022-06-28 | 40       | 2.95      | 到期一次还<br>本付息  |

| 债券名称   | 简称          | 代码        | 发行日        | 起息日        | 到期日        | 债券<br>余额 | 利率<br>(%) | 还本付息<br>方式   |
|--|-------------|-----------|------------|------------|------------|----------|-----------|--------------|
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第二期)(品种一) | 21 华泰<br>S3 | 163888.SH | 2021-07-07 | 2021-07-09 | 2022-02-22 | 20       | 2.75      | 到期一次还<br>本付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第二期)(品种二) | 21 华泰<br>S4 | 163889.SH | 2021-07-07 | 2021-07-09 | 2022-07-09 | 40       | 2.87      | 到期一次还<br>本付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第三期)      | 21 华泰<br>S5 | 163892.SH | 2021-07-15 | 2021-07-19 | 2022-07-19 | 30       | 2.75      | 到期一次还<br>本付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第四期)      | 21 华泰<br>S6 | 188548.SH | 2021-08-05 | 2021-08-09 | 2022-02-11 | 40       | 2.55      | 到期一次还<br>本付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第五期)      | 21 华泰<br>S7 | 188591.SH | 2021-08-12 | 2021-08-16 | 2022-01-20 | 40       | 2.51      | 到期一次还<br>本付息 |
| 华泰证券股份有限公司<br>2021年面向专业投资<br>者公开发行短期公司债<br>券(第六期)      | 21 华泰<br>S8 | 188658.SH | 2021-08-24 | 2021-08-26 | 2021-11-09 | 30       | 2.40      | 到期一次还<br>本付息 |

注：1、投资者适当性安排：发行对象为持有中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 A 股证券账户且符合《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》及相关法律法规规定的专业投资者（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。投资者认购本期债券应遵守相关法律法规和中国证券监督管理委员会的有关规定，并自行承担相应的法律责任。

2、上述公司债券均在上海证券交易所上市，可采取竞价、报价、询价和协议交易方式，不存在终止上市交易的风险。

3、报告期内，公司无逾期未偿还债券。

2. 报告期内，公司无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

3. 报告期内，公司无信用评级结果调整情况

#### 4. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及其影响

报告期内，公司按计划完成了 7 只人民币公司债券付息和 3 只人民币公司债兑付工作。具体情况如下：

| 债券简称     | 起息日        | 到期日        | 发行金额<br>(人民币亿元) | 兑付兑息情况  |
|----------|------------|------------|-----------------|---------|
| 13 华泰 02 | 2013-06-05 | 2023-06-05 | 60              |         |
| 19 华泰 G1 | 2019-03-19 | 2022-03-19 | 70              |         |
| 19 华泰 G3 | 2019-04-22 | 2022-04-22 | 50              |         |
| 20 华泰 G1 | 2020-03-26 | 2023-03-26 | 80              | 已足额按时付息 |
| 20 华泰 G3 | 2020-04-29 | 2025-04-29 | 35              |         |
| 20 华泰 G4 | 2020-05-21 | 2025-05-21 | 30              |         |
| 20 华泰 G6 | 2020-06-18 | 2023-06-18 | 32              |         |
| 20 华泰 G5 | 2020-06-18 | 2021-06-18 | 23              |         |
| 20 华泰 S2 | 2020-08-31 | 2021-05-28 | 15              | 已足额按时兑付 |
| 20 华泰 S4 | 2020-09-17 | 2021-04-17 | 40              |         |

公司存续的二十六只公司债券均采用无担保的发行方式，其中 13 华泰 02、16 华泰 G2、16 华泰 G4、18 华泰 G1、18 华泰 G2、19 华泰 G1、19 华泰 G3、20 华泰 G1、20 华泰 G3、20 华泰 G4、20 华泰 G6、20 华泰 C1、20 华泰 G7、20 华泰 G8、20 华泰 G9、21 华泰 G1、21 华泰 C1、21 华泰 G3、21 华泰 G4、21 华泰 G5、21 华泰 G6、21 华泰 G7、21 华泰 09 的偿债计划为在债券存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付；20 华泰 S1、20 华泰 S3、21 华泰 S2 的偿债计划为在债券到期时一次支付本息。报告期内，公司债券担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更，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，及时披露公司相关信息，以保障投资者的合法权益。

(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: 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             | 1.42             | 1.38             | 2.90                | -                 |
| 速动比率             | 1.42             | 1.38             | 2.90                | -                 |
| 资产负债率 (%)        | 78.75            | 77.20            | 增加 1.55 个百分点        | -                 |
|                  | 本报告期<br>(1-6月)   | 上年同期             | 本报告期比上年同期<br>增减 (%) | 变动原因              |
| 扣除非经常性损益后净利润     | 7,835,516,164.03 | 6,417,178,332.19 | 22.10               | -                 |
| EBITDA 全部债务比 (%) | 4.44             | 5.54             | 减少 1.10 个百分点        | -                 |
| 利息保障倍数           | 3.02             | 3.39             | -10.91              | -                 |
| 现金利息保障倍数         | -2.08            | 7.37             | -128.22             | 主要系经营活动现金流量净额减少所致 |
| EBITDA 利息保障倍数    | 3.17             | 3.59             | -11.70              | -                 |
| 贷款偿还率 (%)        | 100              | 100              | -                   | -                 |
| 利息偿付率 (%)        | 100              | 100              | -                   | -                 |

## 二、报告期内, 公司无可转换公司债券

The background features a large, stylized number '4' on the left. To its right, the title is presented in both Chinese and English. The design is composed of several overlapping, wavy, ribbon-like shapes in a light beige color. The bottom right corner is filled with a halftone dot pattern that fades out towards the center.

# 4

财务报告及备查文件  
*FINANCIAL REPORT AND  
DOCUMENTS FOR INSPECTION*

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

|          |     |
|----------|-----|
| 半年度财务报告  | 108 |
| 备查文件目录   | 257 |
| 证券公司信息披露 | 257 |
| 附录       | 258 |

# 半年度财务报告

自 2021 年 1 月 1 日  
至 2021 年 6 月 30 日止半年度财务报表  
(按中国企业会计准则编制)

华泰证券股份有限公司  
合并资产负债表和母公司资产负债表  
2021 年 6 月 30 日  
未经审计

(金额单位: 人民币元)

|            | 附注五 | 本集团                       |                           | 本公司                       |                           |
|------------|-----|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|            |     | 2021 年 6 月 30 日           | 2020 年 12 月 31 日          | 2021 年 6 月 30 日           | 2020 年 12 月 31 日          |
| <b>资产</b>  |     |                           |                           |                           |                           |
| 货币资金       | 1   | 185,520,581,184.12        | 153,161,845,002.57        | 110,417,474,770.87        | 92,121,664,130.70         |
| 其中: 客户资金存款 |     | 120,334,425,277.03        | 103,510,805,878.23        | 94,234,924,382.01         | 80,291,078,166.32         |
| 结算备付金      | 2   | 23,378,263,681.85         | 28,112,597,360.67         | 26,894,753,250.55         | 30,659,764,628.47         |
| 其中: 客户备付金  |     | 17,330,923,630.45         | 21,124,201,115.99         | 17,330,923,630.45         | 21,124,201,115.99         |
| 融出资金       | 3   | 128,177,514,441.21        | 102,574,007,019.08        | 112,169,681,168.64        | 100,819,185,468.12        |
| 衍生金融资产     | 4   | 12,376,626,971.30         | 7,295,357,324.28          | 11,732,357,750.34         | 7,583,195,471.07          |
| 存出保证金      | 5   | 26,336,577,261.54         | 24,763,790,295.82         | 8,291,217,074.08          | 9,876,631,872.16          |
| 应收款项       | 6   | 10,351,526,872.28         | 9,095,560,247.32          | 12,584,287,679.38         | 6,872,139,056.00          |
| 买入返售金融资产   | 7   | 18,071,368,069.34         | 19,536,412,405.52         | 8,213,819,599.50          | 9,983,826,655.81          |
| 金融投资:      |     | 352,185,149,455.71        | 339,053,186,837.40        | 243,627,188,114.56        | 224,340,803,011.99        |
| 交易性金融资产    | 8   | 310,993,352,712.12        | 292,695,306,675.55        | 206,833,732,305.26        | 183,679,814,079.01        |
| 债权投资       | 9   | 33,499,238,110.39         | 30,411,507,722.05         | 33,225,457,843.48         | 30,120,020,705.50         |
| 其他债权投资     | 10  | 7,519,277,729.12          | 5,267,955,106.65          | 3,515,304,105.79          | -                         |
| 其他权益工具投资   | 11  | 173,280,904.08            | 10,678,417,333.15         | 52,693,860.03             | 10,540,968,227.48         |
| 长期股权投资     | 12  | 18,907,076,651.23         | 18,444,811,734.41         | 31,459,908,311.14         | 30,692,145,826.95         |
| 投资性房地产     | 13  | 321,687,525.89            | 408,337,803.10            | 1,116,673,181.12          | 1,216,252,357.85          |
| 固定资产       | 14  | 3,763,253,083.98          | 3,778,555,127.47          | 2,722,383,139.46          | 2,726,008,509.80          |
| 在建工程       | 15  | 71,602,641.85             | 36,551,735.94             | 70,592,850.47             | 36,537,871.42             |
| 使用权资产      | 16  | 1,211,694,182.07          | 1,198,977,583.07          | 655,192,125.25            | 664,917,807.58            |
| 无形资产       | 17  | 5,394,883,472.10          | 5,276,069,156.38          | 692,141,774.60            | 490,002,927.30            |
| 商誉         | 18  | 2,240,812,066.34          | 2,260,945,283.90          | -                         | -                         |
| 递延所得税资产    | 19  | 418,605,021.25            | 339,501,946.73            | -                         | -                         |
| 其他资产       | 20  | 1,383,506,068.96          | 1,414,728,115.22          | 7,828,038,351.51          | 6,255,245,786.64          |
| 资产总计       |     | <u>790,110,728,651.02</u> | <u>716,751,234,978.88</u> | <u>578,475,709,141.47</u> | <u>524,338,321,381.86</u> |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并资产负债表和母公司资产负债表 (续)  
2021 年 6 月 30 日  
未经审计

(金额单位: 人民币元)

|           | 附注五 | 本集团                |                    | 本公司                |                    |
|-----------|-----|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|           |     | 2021 年 6 月 30 日    | 2020 年 12 月 31 日   | 2021 年 6 月 30 日    | 2020 年 12 月 31 日   |
| 负债和股东权益   |     |                    |                    |                    |                    |
| 负债:       |     |                    |                    |                    |                    |
| 短期借款      | 22  | 14,282,125,385.47  | 11,299,858,788.62  | -                  | -                  |
| 应付短期融资款   | 23  | 34,867,899,417.35  | 43,951,387,602.74  | 31,864,733,834.93  | 43,720,162,895.82  |
| 拆入资金      | 24  | 6,117,116,248.62   | 4,815,235,806.67   | 6,117,116,248.62   | 4,815,235,806.67   |
| 交易性金融负债   | 25  | 23,050,529,481.43  | 15,381,530,029.60  | 2,645,873,832.49   | -                  |
| 衍生金融负债    | 4   | 13,204,053,371.05  | 13,398,830,136.71  | 9,687,591,631.14   | 6,906,378,862.98   |
| 卖出回购金融资产款 | 26  | 136,610,383,475.90 | 139,899,968,467.21 | 118,466,809,793.75 | 120,402,890,577.79 |
| 代理买卖证券款   | 27  | 149,271,327,128.03 | 136,387,634,132.26 | 112,198,682,021.76 | 100,723,551,439.06 |
| 代理承销证券款   | 28  | 2,902,000.00       | 70,930,338.63      | 2,902,000.00       | 15,066,500.00      |
| 应付职工薪酬    | 29  | 10,593,669,165.38  | 11,131,509,940.50  | 7,421,200,098.71   | 7,452,013,331.36   |
| 应交税费      | 30  | 846,160,397.44     | 1,949,983,376.01   | 389,998,186.55     | 1,233,871,906.88   |
| 应付款项      | 31  | 60,640,038,120.56  | 43,706,056,087.16  | 46,503,523,063.49  | 33,834,595,851.67  |
| 合同负债      | 32  | 106,245,421.16     | 92,365,911.23      | -                  | -                  |
| 长期借款      | 33  | 956,938,159.14     | 475,413,821.66     | -                  | -                  |
| 应付债券      | 34  | 138,071,335,432.94 | 97,053,187,662.55  | 123,169,839,827.29 | 91,153,583,480.76  |
| 租赁负债      | 35  | 1,302,533,893.48   | 1,248,799,878.85   | 683,297,680.91     | 670,580,046.64     |
| 预计负债      | 36  | 101,047.62         | 101,047.62         | 101,047.62         | 101,047.62         |
| 递延所得税负债   | 19  | 3,379,692,182.04   | 2,545,646,807.33   | 725,643,023.02     | 150,743,037.14     |
| 其他负债      | 37  | 60,616,129,231.09  | 61,030,761,172.73  | 5,865,250,593.74   | 1,288,035,170.81   |
| 负债合计      |     | 653,919,179,558.70 | 584,439,201,008.08 | 465,742,562,884.02 | 412,366,809,955.20 |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。



华泰证券股份有限公司  
合并资产负债表和母公司资产负债表（续）  
2021年6月30日  
未经审计

（金额单位：人民币元）

|              | 附注五 | 本集团                       |                           | 本公司                       |                           |
|--------------|-----|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|              |     | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
| 负债和股东权益（续）   |     |                           |                           |                           |                           |
| 股东权益：        |     |                           |                           |                           |                           |
| 股本           | 38  | 9,076,650,000.00          | 9,076,650,000.00          | 9,076,650,000.00          | 9,076,650,000.00          |
| 资本公积         | 39  | 70,400,945,370.77         | 70,750,052,647.82         | 68,837,280,595.52         | 69,229,342,337.75         |
| 减：库存股        | 40  | (1,231,547,029.10)        | (1,626,546,421.80)        | (1,231,547,029.10)        | (1,626,546,421.80)        |
| 其他综合收益       | 41  | (79,252,044.41)           | 368,713,282.23            | (11,038,349.57)           | 342,154,791.49            |
| 盈余公积         | 42  | 5,711,066,830.18          | 5,711,066,830.18          | 5,711,066,830.18          | 5,711,066,830.18          |
| 一般风险准备       | 43  | 15,846,133,106.73         | 15,792,944,866.70         | 11,634,551,412.45         | 11,634,395,442.05         |
| 未分配利润        | 44  | 33,103,189,797.15         | 28,998,618,214.13         | 18,716,182,797.97         | 17,604,448,446.99         |
| 归属于母公司股东权益合计 |     | 132,827,186,031.32        | 129,071,499,419.26        | 112,733,146,257.45        | 111,971,511,426.66        |
| 少数股东权益       |     | 3,364,363,061.00          | 3,240,534,551.54          | -                         | -                         |
| 股东权益合计       |     | <u>136,191,549,092.32</u> | <u>132,312,033,970.80</u> | <u>112,733,146,257.45</u> | <u>111,971,511,426.66</u> |
| 负债和股东权益总计    |     | <u>790,110,728,651.02</u> | <u>716,751,234,978.88</u> | <u>578,475,709,141.47</u> | <u>524,338,321,381.86</u> |

此财务报表已获董事会批准。

|       |               |         |
|-------|---------------|---------|
| 张伟    | 焦晓宁           | 费雷      |
| 法定代表人 | 主管会计工作<br>负责人 | 会计机构负责人 |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并利润表和母公司利润表  
2021 年半年度  
未经审计

(金额单位: 人民币元)

|                              | 附注五 | 本集团                |                    | 本公司                |                    |
|------------------------------|-----|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|                              |     | 2021 年 1-6 月       | 2020 年 1-6 月       | 2021 年 1-6 月       | 2020 年 1-6 月       |
| 一、营业总收入                      |     | 18,232,770,029.66  | 15,540,623,761.51  | 10,100,719,791.30  | 7,996,994,804.57   |
| 手续费及佣金净收入                    | 45  | 7,106,439,327.63   | 5,799,812,937.29   | 3,415,664,974.96   | 2,948,817,066.64   |
| 其中:                          |     |                    |                    |                    |                    |
| 经纪业务手续费净收入                   |     | 3,506,391,714.81   | 2,791,555,223.43   | 3,153,605,689.11   | 2,675,143,781.43   |
| 投资银行业务手续费净收入                 |     | 1,817,896,911.02   | 1,261,487,107.85   | 158,352,731.95     | 228,801,651.91     |
| 资产管理业务手续费净收入                 |     | 1,470,614,466.72   | 1,576,086,804.45   | -                  | -                  |
| 利息净收入                        | 46  | 1,910,953,431.25   | 1,022,132,880.41   | 1,323,293,988.87   | 722,351,897.07     |
| 其中: 利息收入                     |     | 7,148,805,777.41   | 4,706,531,349.95   | 6,218,554,650.21   | 4,021,873,973.37   |
| 利息支出                         |     | (5,237,852,346.16) | (3,684,398,469.54) | (4,895,260,661.34) | (3,299,522,076.30) |
| 投资收益                         | 47  | 6,432,941,370.37   | 8,605,944,335.26   | 4,290,747,731.96   | 5,685,143,902.35   |
| 其中:                          |     |                    |                    |                    |                    |
| 对联营及合营企业的投资收益                |     | 1,583,856,265.25   | 2,448,181,827.86   | 982,035,054.97     | 768,993,003.12     |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 / (损失) |     | 50,255,765.30      | (222,104.79)       | 36,087,521.48      | -                  |
| 其他收益                         | 48  | 74,335,646.38      | 52,269,099.01      | 51,945,794.56      | 28,228,726.04      |
| 公允价值变动收益 / (损失)              | 49  | 2,342,355,469.65   | (762,954,716.36)   | 1,063,456,138.70   | (1,559,459,367.97) |
| 汇兑 (损失) / 收益                 |     | (141,239,487.88)   | 320,191,851.67     | (95,503,923.57)    | 119,033,101.87     |
| 其他业务收入                       | 50  | 506,665,058.57     | 503,232,906.65     | 51,117,902.40      | 52,808,164.97      |
| 资产处置收益 / (损失)                | 51  | 319,213.69         | (5,532.42)         | (2,816.58)         | 71,313.60          |
| 二、营业总支出                      |     | (8,189,771,349.81) | (7,217,012,701.26) | (4,120,180,017.90) | (3,769,545,873.62) |
| 税金及附加                        | 52  | (109,880,037.43)   | (101,653,349.80)   | (89,638,246.88)    | (85,911,839.10)    |
| 业务及管理费                       | 53  | (7,816,219,163.90) | (6,464,700,296.81) | (4,189,274,875.52) | (3,452,997,303.75) |
| 信用减值转回 / (损失)                | 54  | 193,027,153.42     | (206,982,358.54)   | 179,431,725.90     | (207,074,883.70)   |
| 其他资产减值损失                     | 55  | -                  | (6,380,973.07)     | -                  | -                  |
| 其他业务成本                       | 56  | (456,699,301.90)   | (437,295,723.04)   | (20,698,621.40)    | (23,561,847.07)    |
| 三、营业利润                       |     | 10,042,998,679.85  | 8,323,611,060.25   | 5,980,539,773.40   | 4,227,448,930.95   |
| 加: 营业外收入                     | 57  | 1,021,814.59       | 13,730,965.89      | 659,925.65         | 1,752,027.99       |
| 减: 营业外支出                     | 57  | (7,118,775.68)     | (31,280,487.92)    | (3,897,845.93)     | (21,292,011.26)    |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并利润表和母公司利润表(续)  
2021年半年度  
未经审计

(金额单位:人民币元)

|              | 附注五 | 本集团                |                    | 本公司                |                  |
|--------------|-----|--------------------|--------------------|--------------------|------------------|
|              |     | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          | 2021年1-6月          | 2020年1-6月        |
| 四、利润总额       |     | 10,036,901,718.76  | 8,306,061,538.22   | 5,977,301,853.12   | 4,207,908,947.68 |
| 减: 所得税费用     | 58  | (2,150,117,229.21) | (1,862,851,963.97) | (1,252,862,929.74) | (853,368,397.46) |
| 五、净利润        |     | 7,886,784,489.55   | 6,443,209,574.25   | 4,724,438,923.38   | 3,354,540,550.22 |
| (一) 按所有权归属分类 |     |                    |                    |                    |                  |
| 归属于母公司股东的净利润 |     | 7,770,308,425.05   | 6,404,994,430.49   | 4,724,438,923.38   | 3,354,540,550.22 |
| 少数股东损益       |     | 116,476,064.50     | 38,215,143.76      | -                  | -                |
| (二) 按持续经营分类  |     |                    |                    |                    |                  |
| 持续经营净利润      |     | 7,886,784,489.55   | 6,443,209,574.25   | 4,724,438,923.38   | 3,354,540,550.22 |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并利润表和母公司利润表（续）  
2021 年半年度  
未经审计

（金额单位：人民币元）

|                      | 附注五 | 本集团                     |                         | 本公司                     |                         |
|----------------------|-----|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                      |     | 2021 年 1-6 月            | 2020 年 1-6 月            | 2021 年 1-6 月            | 2020 年 1-6 月            |
| 六、其他综合收益的税后净额        | 41  | (463,027,699.32)        | (9,148,075.22)          | (353,193,141.06)        | (205,657,411.86)        |
| 归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额 |     | (447,965,326.64)        | (34,600,109.37)         | (353,193,141.06)        | (205,657,411.86)        |
| (一) 不能重分类进损益的其他综合收益  |     | (362,868,333.29)        | (226,209,861.15)        | (366,205,775.59)        | (227,322,295.47)        |
| 1 其他权益工具投资公允价值变动     |     | (362,868,333.29)        | (226,209,861.15)        | (366,205,775.59)        | (227,322,295.47)        |
| (二) 将重分类进损益的其他综合收益   |     | (85,096,993.35)         | 191,609,751.78          | 13,012,634.53           | 21,664,883.61           |
| 1 权益法下可转损益的其他综合收益    |     | 10,331,166.36           | 21,664,883.61           | 10,331,166.36           | 21,664,883.61           |
| 2 其他债权投资公允价值变动       |     | (24,064,802.35)         | 31,032,755.31           | 2,206,949.70            | -                       |
| 3 其他债权投资信用减值准备       |     | (1,095,403.87)          | 21,971,124.54           | 474,518.47              | -                       |
| 4 现金流量套期储备           |     | 8,771,789.69            | (44,394,085.31)         | -                       | -                       |
| 5 外币财务报表折算差额         |     | (79,039,743.18)         | 161,335,073.63          | -                       | -                       |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额  |     | (15,062,372.68)         | 25,452,034.15           | -                       | -                       |
| 七、综合收益总额             |     | <u>7,423,756,790.23</u> | <u>6,434,061,499.03</u> | <u>4,371,245,782.32</u> | <u>3,148,883,138.36</u> |
| 归属于母公司股东的综合收益总额      |     | 7,322,343,098.41        | 6,370,394,321.12        | 4,371,245,782.32        | 3,148,883,138.36        |
| 归属于少数股东的综合收益总额       |     | 101,413,691.82          | 63,667,177.91           | -                       | -                       |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并利润表和母公司利润表（续）  
2021 年半年度  
未经审计

（金额单位：人民币元）

|           | 附注五 | 本集团          |              | 本公司          |              |
|-----------|-----|--------------|--------------|--------------|--------------|
|           |     | 2021 年 1-6 月 | 2020 年 1-6 月 | 2021 年 1-6 月 | 2020 年 1-6 月 |
| 八、每股收益    |     |              |              |              |              |
| （一）基本每股收益 | 59  | 0.86         | 0.71         | -            | -            |
| （二）稀释每股收益 | 59  | 0.86         | 0.70         | -            | -            |

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

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并现金流量表和母公司现金流量表  
2021 年半年度  
未经审计

(金额单位：人民币元)

|                    | 附注五   | 本集团                        |                            | 本公司                        |                            |
|--------------------|-------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
|                    |       | 2021 年 1-6 月               | 2020 年 1-6 月               | 2021 年 1-6 月               | 2020 年 1-6 月               |
| 一、经营活动产生的现金流量：     |       |                            |                            |                            |                            |
| 为交易目的而持有的金融工具净减少额  |       | -                          | 3,136,438,539.62           | -                          | 16,015,012,365.54          |
| 收取利息、手续费及佣金的现金     |       | 21,592,041,189.25          | 17,461,410,470.71          | 11,247,998,658.00          | 8,585,784,056.39           |
| 拆入资金净增加额           |       | 1,301,130,389.53           | -                          | 1,312,874,090.80           | -                          |
| 代理买卖证券收到的现金净额      |       | 12,883,692,995.77          | 28,292,021,137.92          | 11,475,130,582.70          | 18,280,987,381.39          |
| 收到其他与经营活动有关的现金     | 60(1) | 17,679,310,188.55          | 21,974,287,195.93          | 16,727,202,255.84          | 9,809,168,131.00           |
| 经营活动现金流入小计         |       | <u>53,456,174,763.10</u>   | <u>70,864,157,344.18</u>   | <u>40,763,205,587.34</u>   | <u>52,690,951,934.32</u>   |
| 拆入资金净减少额           |       | -                          | (8,324,177,540.36)         | -                          | (8,334,417,207.81)         |
| 融出资金净增加额           |       | (25,519,180,767.77)        | (9,305,768,510.00)         | (11,262,399,013.66)        | (8,340,827,018.12)         |
| 回购业务资金净减少额         |       | (4,063,654,491.32)         | (13,642,309,063.57)        | (1,690,068,291.40)         | (21,722,471,695.60)        |
| 为交易目的而持有的金融工具净增加额  |       | (12,162,671,398.00)        | -                          | (14,452,367,439.88)        | -                          |
| 支付利息、手续费及佣金的现金     |       | (5,628,414,294.35)         | (5,701,330,175.58)         | (4,061,487,319.64)         | (2,600,328,458.91)         |
| 支付给职工及为职工支付的现金     |       | (6,190,813,598.57)         | (4,597,972,372.58)         | (3,064,568,238.77)         | (2,227,480,560.23)         |
| 支付的各项税费            |       | (3,410,485,192.15)         | (2,040,912,283.93)         | (2,110,983,546.36)         | (1,314,389,951.28)         |
| 支付其他与经营活动有关的现金     | 60(2) | (12,325,235,578.41)        | (3,801,439,716.55)         | (9,973,401,509.54)         | (6,515,789,439.68)         |
| 经营活动现金流出小计         |       | <u>(69,300,455,320.57)</u> | <u>(47,413,909,662.57)</u> | <u>(46,615,275,359.25)</u> | <u>(51,055,704,331.63)</u> |
| 经营活动(使用)/产生的现金流量净额 | 60(7) | <u>(15,844,280,557.47)</u> | <u>23,450,247,681.61</u>   | <u>(5,852,069,771.91)</u>  | <u>1,635,247,602.69</u>    |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并现金流量表和母公司现金流量表（续）  
2021 年半年度  
未经审计

（金额单位：人民币元）

|                          | 附注五   | 本集团                       |                           | 本公司                       |                         |
|--------------------------|-------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|-------------------------|
|                          |       | 2021 年 1-6 月              | 2020 年 1-6 月              | 2021 年 1-6 月              | 2020 年 1-6 月            |
| 二、投资活动产生的现金流量：           |       |                           |                           |                           |                         |
| 收回投资所收到的现金               |       | 6,406,537,734.21          | 1,153,837,378.25          | 5,863,526,765.52          | 94,180,138.38           |
| 取得投资收益收到的现金              |       | 2,036,128,511.69          | 849,307,466.26            | 1,750,311,097.90          | 631,046,870.04          |
| 收到其他与投资活动有关的现金           | 60(3) | 3,939,040.89              | 2,078,202.17              | 3,281,657.85              | 4,158,103.26            |
| 投资活动现金流入小计               |       | <u>8,446,605,286.79</u>   | <u>2,005,223,046.68</u>   | <u>7,617,119,521.27</u>   | <u>729,385,111.68</u>   |
| 投资所支付的现金                 |       | (5,519,646,028.61)        | (3,882,423,218.93)        | (7,027,185,189.83)        | -                       |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 |       | (417,113,973.82)          | (224,009,929.00)          | (366,014,911.69)          | (136,987,157.98)        |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金        |       | -                         | (130,049,502.60)          | -                         | -                       |
| 支付其他与投资活动有关的现金           | 60(4) | -                         | (397,861,288.15)          | -                         | -                       |
| 投资活动现金流出小计               |       | <u>(5,936,760,002.43)</u> | <u>(4,634,343,938.68)</u> | <u>(7,393,200,101.52)</u> | <u>(136,987,157.98)</u> |
| 投资活动产生/(使用)的现金流量净额       |       | <u>2,509,845,284.36</u>   | <u>(2,629,120,892.00)</u> | <u>223,919,419.75</u>     | <u>592,397,953.70</u>   |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并现金流量表和母公司现金流量表 (续)  
2021 年半年度  
未经审计

(金额单位: 人民币元)

|                      | 附注五   | 本集团                 |                     | 本公司                 |                     |
|----------------------|-------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
|                      |       | 2021 年 1-6 月        | 2020 年 1-6 月        | 2021 年 1-6 月        | 2020 年 1-6 月        |
| 三、筹资活动产生的现金流量:       |       |                     |                     |                     |                     |
| 发行债券收到的现金            |       | 99,691,106,294.67   | 85,008,449,721.58   | 87,907,052,326.00   | 82,176,677,000.00   |
| 取得借款收到的现金            |       | 3,478,126,905.56    | 2,686,693,811.36    | -                   | -                   |
| 收到其他与筹资活动有关的现金       | 60(5) | 413,940,800.00      | -                   | 413,940,800.00      | -                   |
|                      |       |                     |                     |                     |                     |
| 筹资活动现金流入小计           |       | 103,583,174,000.23  | 87,695,143,532.94   | 88,320,993,126.00   | 82,176,677,000.00   |
| 偿还债务支付的现金            |       | (68,097,918,182.00) | (90,120,121,175.13) | (68,097,918,182.00) | (90,355,647,209.63) |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金    |       | (2,189,616,083.65)  | (2,563,389,102.48)  | (2,001,259,216.72)  | (2,059,857,679.44)  |
| 其中: 子公司支付给少数股东的股利、利润 |       | -                   | -                   | -                   | -                   |
| 偿还租赁负债支付的现金          |       | (313,984,493.22)    | (172,502,265.34)    | (115,018,428.45)    | (108,331,857.04)    |
| 支付其他与筹资活动有关的现金       | 60(6) | (48,963,487.30)     | (1,301,129,805.87)  | (52,171,036.12)     | (1,284,837,353.04)  |
|                      |       |                     |                     |                     |                     |
| 筹资活动现金流出小计           |       | (70,650,482,246.17) | (94,157,142,348.82) | (70,266,366,863.29) | (93,808,674,099.15) |
| 筹资活动产生/(使用)的现金流量净额   |       | 32,932,691,754.06   | (6,461,998,815.88)  | 18,054,626,262.71   | (11,631,997,099.15) |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响   |       |                     |                     |                     |                     |
|                      |       | (161,410,106.33)    | 447,624,274.86      | (95,503,923.57)     | 115,913,916.88      |
|                      |       |                     |                     |                     |                     |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。



华泰证券股份有限公司  
合并现金流量表和母公司现金流量表（续）  
2021 年半年度  
未经审计

（金额单位：人民币元）

|                          | 附注五   | 本集团                              |                                  | 本公司                              |                                  |
|--------------------------|-------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                          |       | 2021 年 1-6 月                     | 2020 年 1-6 月                     | 2021 年 1-6 月                     | 2020 年 1-6 月                     |
| 五、现金及现金等价物净增加 /<br>（减少）额 | 60(8) | 19,436,846,374.62                | 14,806,752,248.59                | 12,330,971,986.98                | (9,288,437,625.88)               |
| 加：期初现金及现金等价物余额           |       | <u>190,449,812,345.46</u>        | <u>152,070,456,856.52</u>        | <u>128,124,401,656.13</u>        | <u>114,825,117,329.66</u>        |
| 六、期末现金及现金等价物余额           | 60(9) | <u><u>209,886,658,720.08</u></u> | <u><u>166,877,209,105.11</u></u> | <u><u>140,455,373,643.11</u></u> | <u><u>105,536,679,703.78</u></u> |

此财务报表已获董事会批准。

|       |               |         |
|-------|---------------|---------|
| 张伟    | 焦晓宁           | 费雷      |
| 法定代表人 | 主管会计工作<br>负责人 | 会计机构负责人 |

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并股东权益变动表  
2021年半年度  
未经审计

(金额单位:人民币元)

| 附注               | 2021年1-6月        |                   |                    |                  |                  |                   | 少数股东权益             | 股东权益合计             |
|------------------|------------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
|                  | 股本               | 资本公积              | 减:库存股              | 其他综合收益           | 盈余公积             | 一般风险准备            |                    |                    |
| 一、2021年1月1日      | 9,076,650,000.00 | 70,750,052,647.82 | (1,626,546,421.80) | 368,713,282.23   | 5,711,066,830.18 | 15,792,944,866.70 | 28,998,618,214.13  | 132,312,033,970.80 |
| 二、本期增减变动金额       |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| (一) 综合收益总额       | -                | -                 | -                  | (447,965,326.64) | -                | -                 | 7,770,308,425.05   | 7,423,756,790.23   |
| (二) 股东投入和减少资本    |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| 1. 股份支付计入股东权益的金额 | -                | (349,107,727.72)  | 443,962,880.00     | -                | -                | -                 | -                  | 117,269,969.92     |
| 2. 回购股份          | -                | -                 | (48,963,487.30)    | -                | -                | -                 | -                  | (48,963,487.30)    |
| 3. 其他            | -                | 450.67            | -                  | -                | -                | -                 | -                  | 450.67             |
| (三) 利润分配         |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| 五、44             |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| 1. 提取盈余公积        | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | -                  | -                  |
| 2. 提取一般风险准备      | -                | -                 | -                  | -                | -                | 53,188,240.03     | (53,188,240.03)    | -                  |
| 3. 对股东的分配        | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | (3,612,548,602.00) | (3,612,548,602.00) |
| 三、2021年6月30日     | 9,076,650,000.00 | 70,400,945,370.77 | (1,231,547,029.10) | (79,252,044.41)  | 5,711,066,830.18 | 15,846,133,106.73 | 33,103,189,797.15  | 136,191,549,092.32 |

此财务报表已获董事会批准。

张伟 法定代表人  
焦砾宁 主管会计工作负责人  
费雷 会计机构负责人

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
合并股东权益变动表  
2020 年半年度  
未经审计

(金额单位: 人民币元)

2020 年 1-6 月

| 附注                | 归属于母公司股东权益       |                   |                    |                 |                  |                   |                    | 少数股东权益           | 股东权益合计             |
|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------|------------------|--------------------|
|                   | 股本               | 资本公积              | 减: 库存股             | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润              |                  |                    |
| 一、2020 年 1 月 1 日  | 9,076,650,000.00 | 70,290,533,440.50 | -                  | 788,767,977.40  | 5,118,690,487.75 | 14,084,426,255.63 | 23,178,411,266.43  | 3,117,228,744.63 | 125,654,708,172.34 |
| 二、本期增减变动金额        |                  |                   |                    |                 |                  |                   |                    |                  |                    |
| (一) 综合收益总额        | -                | -                 | -                  | (34,600,109.37) | -                | -                 | 6,404,994,430.49   | 63,667,177.91    | 6,434,061,499.03   |
| (二) 股东投入和减少资本     |                  |                   |                    |                 |                  |                   |                    |                  |                    |
| 1. 股份支付计入股东权益的金额  | -                | 134,010,825.89    | -                  | -               | -                | -                 | -                  | 56,703,863.64    | 190,714,689.53     |
| 2. 其他             | -                | 2,162.07          | (1,284,837,353.04) | -               | -                | -                 | -                  | -                | (1,284,835,190.97) |
| (三) 利润分配          |                  |                   |                    |                 |                  |                   |                    |                  |                    |
| 五、44              |                  |                   |                    |                 |                  |                   |                    |                  |                    |
| 1. 提取盈余公积         | -                | -                 | -                  | -               | -                | -                 | -                  | -                | -                  |
| 2. 提取一般风险准备       | -                | -                 | -                  | -               | -                | 74,321,477.84     | (74,321,477.84)    | -                | -                  |
| 3. 对股东的分配         | -                | -                 | -                  | -               | -                | -                 | (2,701,394,989.80) | -                | (2,701,394,989.80) |
| 三、2020 年 6 月 30 日 | 9,076,650,000.00 | 70,424,546,428.46 | (1,284,837,353.04) | 754,167,868.03  | 5,118,690,487.75 | 14,158,747,733.47 | 26,807,689,229.28  | 3,237,599,786.18 | 128,293,254,180.13 |

此财务报表已获董事会批准。

张伟 焦晓宁 费雷  
法定代表人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
母公司股东权益变动表  
2021年半年度  
未经审计

(金额单位:人民币元)

|                  | 2021年1-6月        |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
|------------------|------------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
|                  | 股本               | 资本公积              | 减:库存股              | 其他综合收益           | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润              | 股东权益合计             |
| 一、2021年1月1日      | 9,076,650,000.00 | 69,229,342,337.75 | (1,626,546,421.80) | 342,154,791.49   | 5,711,066,830.18 | 11,634,395,442.05 | 17,604,448,446.99  | 111,971,511,426.66 |
| 二、本期增减变动金额       | -                | -                 | -                  | (353,193,141.06) | -                | -                 | 4,724,438,923.38   | 4,371,245,782.32   |
| (一)综合收益总额        | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | -                  | -                  |
| (二)股东投入和减少资本     | -                | (392,062,192.90)  | 443,962,880.00     | -                | -                | -                 | -                  | 51,900,687.10      |
| 1.股份支付计入所有者权益的金额 | -                | -                 | (48,963,487.30)    | -                | -                | -                 | -                  | (48,963,487.30)    |
| 2.回购股份           | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | -                  | -                  |
| 3.其他             | -                | 450.67            | -                  | -                | -                | -                 | -                  | 450.67             |
| (三)利润分配          | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | -                  | -                  |
| 1.提取盈余公积         | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | -                  | -                  |
| 2.提取一般风险准备       | -                | -                 | -                  | -                | -                | 155,970.40        | (155,970.40)       | -                  |
| 3.对股东的分配         | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | (3,612,548,602.00) | (3,612,548,602.00) |
| 三、2021年6月30日     | 9,076,650,000.00 | 68,837,280,595.52 | (1,231,547,029.10) | (11,038,349.57)  | 5,711,066,830.18 | 11,634,551,412.45 | 18,716,182,797.97  | 112,733,146,257.45 |

此财务报表已获董事会批准。

张伟

焦晓宁

费雷

法定代表人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

华泰证券股份有限公司  
母公司股东权益变动表  
2020 年半年度  
未经审计

(金额单位:人民币元)

|                   | 2020 年 1-6 月     |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
|                   | 股本               | 资本公积              | 减:库存股              | 其他综合收益           | 盈余公积             | 一般风险准备            | 未分配利润              | 股东权益合计             |
| 一、2020 年 1 月 1 日  | 9,076,650,000.00 | 69,229,337,237.49 | -                  | 222,536,430.00   | 5,118,690,487.75 | 10,449,289,789.99 | 16,159,562,007.01  | 110,256,065,952.24 |
| 二、本期增减变动金额        |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| (一) 综合收益总额        | -                | -                 | -                  | (205,657,411.86) | -                | -                 | 3,354,540,550.22   | 3,148,883,138.36   |
| (二) 股东投入和减少资本     |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| 1. 其他             | -                | 2,162.07          | (1,284,837,353.04) | -                | -                | -                 | -                  | (1,284,835,190.97) |
| (三) 利润分配          |                  |                   |                    |                  |                  |                   |                    |                    |
| 1. 提取盈余公积         | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | -                  | -                  |
| 2. 提取一般风险准备       | -                | -                 | -                  | -                | -                | 253,900.43        | (253,900.43)       | -                  |
| 3. 对股东的分配         | -                | -                 | -                  | -                | -                | -                 | (2,701,394,989.80) | (2,701,394,989.80) |
| 三、2020 年 6 月 30 日 | 9,076,650,000.00 | 69,229,339,399.56 | (1,284,837,353.04) | 16,879,018.14    | 5,118,690,487.75 | 10,449,543,690.42 | 16,812,453,667.00  | 109,418,718,909.83 |

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

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

# 华泰证券股份有限公司

## 财务报表附注

(金额单位：人民币元)

### 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 320000000000192 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 2021 年 6 月 30 日，本公司累计发行股本总额为人民币 9,076,650,000.00 元，注册资本为人民币 9,076,650,000.00 元。

本公司及子公司（以下简称“本集团”）经营范围：证券经纪业务，证券自营，证券资产管理业务，证券承销保荐业务，证券投资咨询，为期货公司提供中间介绍业务，融资融券业务，代销金融产品业务，证券投资基金代销，证券投资基金托管，公开募集证券投资基金管理业务，黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务，股票期权做市业务，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 2021 年 6 月 30 日，本公司经批准设立分公司 28 家，证券营业部 244 家，本公司下设子公司情况参见附注七、1。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司拥有员工 8,280 人（含劳务派遣及经纪人），其中高级管理人员 9 人。

### 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、完整地反映了本公司 2021 年 6 月 30 日的合并财务状况和财务状况、2021 年 1-6 月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》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。

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，包括本公司、本公司控制的子公司及受本公司控制的结构化主体。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公司合并范围，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。

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。

## (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。

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，本公司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

本公司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。

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。处置境外经营时，相关的外币财务报表折算差额自其他综合收益转入处置当期损益。

## 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。

## 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。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。

本集团在判断对被投资单位是否存在共同控制时，通常考虑下述事项：

- 是否任何一个参与方均不能单独控制被投资单位的相关活动；
- 涉及被投资单位相关活动的决策是否需要分享控制权参与方一致同意。

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% |

## 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。

报废或处置固定资产项目所产生的损益为处置所得款项净额与项目账面金额之间的差额，并于报废或处置日在损益中确认。

## 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     | 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 |
| 商标        | 20年     |
| 软件及其他     | 2-5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     |
|----------|----------|
| 固定资产改良支出 | 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，选择恰当的税前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。

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)。

其他买入返售金融资产的减值准备计提参见附注三、9(6)。

## 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 2021 年 6 月 30 日，本集团的股份支付为以权益结算的股份支付。

### (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，包括直接人工、直接材料、制造费用（或类似费用）、明确由客户承担的成本以及仅因该合同而发生的其他成本；
- 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。

## 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是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。基本养老保险的缴费金额按国家规定的基准和比例计算。本集团在职工提供服务的会计期间，将应缴存的金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

### (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。

## 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。

租赁变更，是指原合同条款之外的租赁范围、租赁对价、租赁期限的变更。对由新冠肺炎疫情直接引发、于 2020 年 1 月 1 日或以后就现有租赁合同达成的租金减免、延期支付等租金减让，同时满足下列条件的，本集团选择简化方法（“疫情租金减让简化方法”）进行会计处理，不再评估是否发生租赁变更，也不再重新评估租赁分类：

- 减让后的租赁对价较减让前减少或基本不变，其中，租赁对价未折现或按减让前折现率折现均可；
- 减让仅针对 2022 年 6 月 30 日前的应付租赁付款额，2022 年 6 月 30 日后应付租赁付款额增加不影响满足该条件，2022 年 6 月 30 日后应付租赁付款额减少不满足该条件；
- 综合考虑定性和定量因素后认定租赁的其他条款和条件无重大变化。

本集团所有属于疫情租金减让简化方法适用范围的租金减让选择应用简化方法进行会计处理。

#### (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；
- 本集团对购买选择权、续租选择权或终止租赁选择权的评估结果发生变化，或续租选择权或终止租赁选择权的实际行使情况与原评估结果不一致。

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。

除了短期租赁及选择应用疫情租金减让简化方法的情形外，对于其他租赁变更，当租赁变更增加了一项或多项租赁资产的使用权，且增

加的对价与增加的使用权的单独价格按该合同情况调整后的金额相当，则本集团将该变更作为一项单独租赁核算；当租赁变更未作为一项单独租赁的，本集团在租赁变更生效日，对变更后合同的对价进行分摊，重新确定变更后的租赁期，并按照变更后的租赁付款额和修订后的折现率重新计量租赁负债。

选择应用疫情租金减让简化方法的，本集团继续按照与减让前一致的折现率计算租赁负债的利息费用并计入当期损益，继续按照与减让前一致的方法对使用权资产进行计提折旧等后续计量。发生租金减免的，本集团将减免的租金作为可变租赁付款额，在达成减让协议等解除原租金支付义务时，按未折现或减让前折现率折现金额冲减相关资产成本或费用，同时相应调整负债；延期支付租金的，本集团在实际支付时冲减前期确认的租赁负债。

本集团已选择对短期租赁（租赁期不超过 12 个月的租赁）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。

除了选择应用疫情租金减让简化方法的情形外，当短期租赁发生租赁变更或者因租赁变更之外的原因导致租赁期发生变化的，本集团将其视为一项新租赁进行会计处理。

选择应用疫情租金减让简化方法的短期租赁和低价值资产租赁，本集团继续按照与减让前一致的方法将原合同租金计入相关资产成本或费用。发生租金减免的，本集团将减免的租金作为可变租赁付款额，在减免期间冲减相关资产成本或费用；延期支付租金的，本集团在原支付期间将应支付的租金确认为应付款项，在实际支付时冲减前期确认的应付款项。

## (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，对转租赁进行分类。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，本集团将该转租赁分类为经营租赁。

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，同时将相应利息收入计入当期损益。

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会计处理；
- 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

现金股利于股东大会批准的当期，确认为负债。

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) 主要会计估计

除投资性房地产、固定资产及无形资产等资产的折旧及摊销(参见附注三、11、12 和 15)和各类资产减值(参见附注五、3、6、7、9、10、12、13、14、15、16、17、18 和 20 以及附注十七、1)涉及的会计估计外,其他主要的会计估计如下:

- (i) 附注五、19 - 递延所得税资产的确认;及
- (ii) 附注九 - 金融工具公允价值估值。

#### (2) 主要会计判断

本集团在运用会计政策过程中做出的重要判断如下:

- (i) 附注六 - 本集团是否控制结构化主体的判断。

### 38 主要会计政策、会计估计的变更

#### (1) 会计政策变更

报告期内,本集团主要会计政策未发生变更。

#### (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 1) |

注 1: 本公司及本公司的境内子公司适用的所得税率为 25% (2020 年 1-6 月: 25%)。本公司的香港子公司适用的利得税率为 16.5% (2020 年 1-6 月: 16.5%)。本公司的美国子公司适用 21% 的单一税制 (2020 年 1-6 月: 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

|            | 2021 年 6 月 30 日    | 2020 年 12 月 31 日   |
|------------|--------------------|--------------------|
| 库存现金       | 206,399.89         | 200,488.05         |
| 银行存款       | 185,518,360,702.56 | 153,153,040,151.34 |
| 其中: 客户资金存款 | 120,334,425,277.03 | 103,510,805,878.23 |
| 公司存款       | 65,183,935,425.53  | 49,642,234,273.11  |
| 其他货币资金     | 8,060,757.34       | 10,034,026.86      |
| 减: 减值准备    | (6,046,675.67)     | (1,429,663.68)     |
| 合计         | 185,520,581,184.12 | 153,161,845,002.57 |

## (2) 按币种列示

|                | 2021年6月30日         |        |                    | 2020年12月31日       |        |                    |
|----------------|--------------------|--------|--------------------|-------------------|--------|--------------------|
|                | 原币金额               | 折算率    | 人民币金额              | 原币金额              | 折算率    | 人民币金额              |
| <b>库存现金：</b>   |                    |        |                    |                   |        |                    |
| 人民币            | 197,247.01         | 1.0000 | 197,247.01         | 191,230.01        | 1.0000 | 191,230.01         |
| 港币             | 10,999.74          | 0.8321 | 9,152.88           | 11,000.52         | 0.8416 | 9,258.04           |
| 库存现金合计         |                    |        | 206,399.89         |                   |        | 200,488.05         |
| <b>银行存款：</b>   |                    |        |                    |                   |        |                    |
| 客户非信用资金存款      |                    |        |                    |                   |        |                    |
| 人民币            | 103,488,865,408.36 | 1.0000 | 103,488,865,408.36 | 84,662,828,427.33 | 1.0000 | 84,662,828,427.33  |
| 美元             | 97,816,093.93      | 6.4601 | 631,901,748.40     | 122,705,974.34    | 6.5249 | 800,644,211.99     |
| 港币             | 393,708,004.92     | 0.8321 | 327,604,430.89     | 333,616,628.83    | 0.8416 | 280,771,754.82     |
| 小计             |                    |        | 104,448,371,587.65 |                   |        | 85,744,244,394.14  |
| 客户信用资金存款       |                    |        |                    |                   |        |                    |
| 人民币            | 12,206,407,815.83  | 1.0000 | 12,206,407,815.83  | 13,284,612,498.67 | 1.0000 | 13,284,612,498.67  |
| 美元             | 156,746,866.04     | 6.4601 | 1,012,600,429.30   | 158,899,202.35    | 6.5249 | 1,036,801,405.39   |
| 港币             | 3,202,270,412.85   | 0.8321 | 2,664,609,210.53   | 4,090,853,130.58  | 0.8416 | 3,442,861,994.70   |
| 其他             |                    |        | 2,436,233.72       |                   |        | 2,285,585.33       |
| 小计             |                    |        | 15,886,053,689.38  |                   |        | 17,766,561,484.09  |
| 客户存款小计         |                    |        | 120,334,425,277.03 |                   |        | 103,510,805,878.23 |
| 公司自有资金存款       |                    |        |                    |                   |        |                    |
| 人民币            | 49,489,107,290.05  | 1.0000 | 49,489,107,290.05  | 38,758,500,966.70 | 1.0000 | 38,758,500,966.70  |
| 美元             | 2,167,609,218.43   | 6.4601 | 14,002,972,312.00  | 1,290,741,201.85  | 6.5249 | 8,421,957,267.93   |
| 港币             | 1,999,406,997.54   | 0.8321 | 1,663,706,562.65   | 2,890,365,003.17  | 0.8416 | 2,432,531,186.67   |
| 其他             |                    |        | 28,149,260.83      |                   |        | 29,244,851.81      |
| 小计             |                    |        | 65,183,935,425.53  |                   |        | 49,642,234,273.11  |
| 公司存款小计         |                    |        | 65,183,935,425.53  |                   |        | 49,642,234,273.11  |
| 银行存款合计         |                    |        | 185,518,360,702.56 |                   |        | 153,153,040,151.34 |
| <b>其他货币资金：</b> |                    |        |                    |                   |        |                    |
| 人民币            | 8,060,757.34       | 1.0000 | 8,060,757.34       | 10,034,026.86     | 1.0000 | 10,034,026.86      |
| 其他货币资金合计       |                    |        | 8,060,757.34       |                   |        | 10,034,026.86      |
| 小计             |                    |        | 185,526,627,859.79 |                   |        | 153,163,274,666.25 |
| 减：减值准备         |                    |        | (6,046,675.67)     |                   |        | (1,429,663.68)     |
| 合计             |                    |        | 185,520,581,184.12 |                   |        | 153,161,845,002.57 |

(3) 使用受限制的货币资金

于 2021 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本限制、风险准备金及待缴纳结构化主体增值税等共计人民币 876,550,724.34 元 (2020 年 12 月 31 日：人民币 1,513,585,701.55 元)。

2 结算备付金

(1) 按类别列示

|       | 2021 年 6 月 30 日   | 2020 年 12 月 31 日  |
|-------|-------------------|-------------------|
| 客户备付金 | 17,330,923,630.45 | 21,124,201,115.99 |
| 公司备付金 | 6,047,340,051.40  | 6,988,396,244.68  |
| 合计    | 23,378,263,681.85 | 28,112,597,360.67 |

## (2) 按币种列示

|         | 2021年6月30日        |        |                          | 2020年12月31日       |        |                          |
|---------|-------------------|--------|--------------------------|-------------------|--------|--------------------------|
|         | 原币金额              | 折算率    | 人民币金额                    | 原币金额              | 折算率    | 人民币金额                    |
| 客户备付金：  |                   |        |                          |                   |        |                          |
| 客户普通备付金 |                   |        |                          |                   |        |                          |
| 人民币     | 12,750,220,333.59 | 1.0000 | 12,750,220,333.59        | 18,459,417,211.16 | 1.0000 | 18,459,417,211.16        |
| 美元      | 33,610,962.30     | 6.4601 | 217,130,177.57           | 29,267,355.11     | 6.5249 | 190,966,565.36           |
| 港币      | 79,526,836.39     | 0.8321 | 66,174,280.56            | 41,384,786.99     | 0.8416 | 34,829,436.73            |
| 小计      |                   |        | <u>13,033,524,791.72</u> |                   |        | <u>18,685,213,213.25</u> |
| 客户信用备付金 |                   |        |                          |                   |        |                          |
| 人民币     | 4,297,398,838.73  | 1.0000 | 4,297,398,838.73         | 2,438,987,902.74  | 1.0000 | 2,438,987,902.74         |
| 小计      |                   |        | <u>4,297,398,838.73</u>  |                   |        | <u>2,438,987,902.74</u>  |
| 客户备付金合计 |                   |        | <u>17,330,923,630.45</u> |                   |        | <u>21,124,201,115.99</u> |
| 公司备付金：  |                   |        |                          |                   |        |                          |
| 公司普通备付金 |                   |        |                          |                   |        |                          |
| 人民币     | 5,978,659,170.67  | 1.0000 | 5,978,659,170.67         | 6,388,195,398.61  | 1.0000 | 6,388,195,398.61         |
| 港币      | 82,539,214.91     | 0.8321 | 68,680,880.73            | 713,166,404.55    | 0.8416 | 600,200,846.07           |
| 小计      |                   |        | <u>6,047,340,051.40</u>  |                   |        | <u>6,988,396,244.68</u>  |
| 公司备付金合计 |                   |        | <u>6,047,340,051.40</u>  |                   |        | <u>6,988,396,244.68</u>  |
| 合计      |                   |        | <u>23,378,263,681.85</u> |                   |        | <u>28,112,597,360.67</u> |

### 3 融出资金

#### (1) 按类别列示

|            | 2021年6月30日         | 2020年12月31日        |
|------------|--------------------|--------------------|
| 融资融券业务融出资金 | 113,524,858,984.05 | 102,262,459,970.38 |
| 孖展融资       | 16,013,290,680.30  | 1,779,798,002.49   |
| 减：减值准备     | (1,360,635,223.14) | (1,468,250,953.79) |
| 融出资金净值     | 128,177,514,441.21 | 102,574,007,019.08 |

于2021年6月30日，本公司未将上述融资融券业务中的债权收益权进行质押式回购（参见附注五、26(3)）（2020年12月31日：人民币311,411,219.72元）。

#### (2) 按账龄分析

|         | 2021年6月30日         |        |                  |        |
|---------|--------------------|--------|------------------|--------|
|         | 账面余额               |        | 坏账准备             |        |
|         | 金额                 | 比例 (%) | 金额               | 比例 (%) |
| 1 - 3个月 | 74,670,826,439.73  | 57.65  | 700,252,856.29   | 51.46  |
| 3 - 6个月 | 19,215,826,643.85  | 14.83  | 229,376,933.68   | 16.86  |
| 6个月以上   | 35,651,496,580.77  | 27.52  | 431,005,433.17   | 31.68  |
| 合计      | 129,538,149,664.35 | 100.00 | 1,360,635,223.14 | 100.00 |

|         | 2020年12月31日        |        |                  |        |
|---------|--------------------|--------|------------------|--------|
|         | 账面余额               |        | 坏账准备             |        |
|         | 金额                 | 比例 (%) | 金额               | 比例 (%) |
| 1 - 3个月 | 57,167,977,244.90  | 54.95  | 782,030,513.79   | 53.26  |
| 3 - 6个月 | 25,540,803,465.58  | 24.55  | 360,495,945.94   | 24.55  |
| 6个月以上   | 21,333,477,262.39  | 20.50  | 325,724,494.06   | 22.19  |
| 合计      | 104,042,257,972.87 | 100.00 | 1,468,250,953.79 | 100.00 |

## (3) 按客户类别列示

|        | 2021年6月30日         | 2020年12月31日        |
|--------|--------------------|--------------------|
| 境内     |                    |                    |
| 其中：个人  | 100,587,141,038.36 | 91,366,760,325.37  |
| 机构     | 12,937,717,945.69  | 10,895,699,645.01  |
| 减：减值准备 | (1,355,177,815.41) | (1,443,274,502.26) |
| 账面价值小计 | 112,169,681,168.64 | 100,819,185,468.12 |
| 境外     |                    |                    |
| 其中：个人  | 15,179,258,206.55  | 1,032,070,222.97   |
| 机构     | 834,032,473.75     | 747,727,779.52     |
| 减：减值准备 | (5,457,407.73)     | (24,976,451.53)    |
| 账面价值小计 | 16,007,833,272.57  | 1,754,821,550.96   |
| 合计     | 128,177,514,441.21 | 102,574,007,019.08 |

## (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

|        | 2021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             | 公允价值 |                 | 名义金额               | 公允价值              |                     |
| 资产     |                  | 负债   | 资产              |                    | 负债                |                     |
| 利率衍生工具 | 1,304,980,000.00 | -    | (25,575,798.99) | 513,279,105,505.55 | 23,951,964.75     | (6,916,955.44)      |
| 货币衍生工具 | -                | -    | -               | 45,051,502,091.17  | 740,225,577.90    | (730,830,822.27)    |
| 权益衍生工具 | -                | -    | -               | 325,970,510,999.47 | 10,826,259,407.03 | (11,735,398,142.79) |
| 信用衍生工具 | -                | -    | -               | 1,780,301,382.58   | 58,734,636.04     | (6,753,437.39)      |
| 其他衍生工具 | -                | -    | -               | 91,225,753,995.22  | 727,455,385.58    | (698,578,214.17)    |
| 合计     | 1,304,980,000.00 | -    | (25,575,798.99) | 977,307,173,973.99 | 12,376,626,971.30 | (13,178,477,572.06) |



2020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             | 公允价值 |                 | 名义金额               | 公允价值             |                     |
|        |                  | 资产   | 负债              |                    | 资产               | 负债                  |
| 利率衍生工具 | 1,304,980,000.00 | -    | (34,347,588.68) | 481,978,704,239.33 | 9,700,902.12     | (20,360,178.24)     |
| 货币衍生工具 | -                | -    | -               | 69,388,949,262.64  | 173,507,235.31   | (227,346,714.52)    |
| 权益衍生工具 | -                | -    | -               | 238,259,560,500.66 | 6,724,105,818.96 | (12,529,494,927.62) |
| 信用衍生工具 | -                | -    | -               | 436,626,077.72     | 202,284.00       | (10,744,831.21)     |
| 其他衍生工具 | -                | -    | -               | 110,314,867,865.75 | 387,841,083.89   | (576,535,896.44)    |
| 合计     | 1,304,980,000.00 | -    | (34,347,588.68) | 900,378,707,946.10 | 7,295,357,324.28 | (13,364,482,548.03) |

(1) 已抵销的衍生金融工具

| 项目     | 2021年6月30日         |                  |       | 2020年12月31日        |                  |       |
|--------|--------------------|------------------|-------|--------------------|------------------|-------|
|        | 抵销前总额              | 抵销金额             | 抵销后净额 | 抵销前总额              | 抵销金额             | 抵销后净额 |
| 利率衍生工具 | (858,194,128.04)   | 858,194,128.04   | -     | (1,079,095,182.13) | 1,079,095,182.13 | -     |
| 权益衍生工具 | (1,411,258,304.67) | 1,411,258,304.67 | -     | (714,413,635.50)   | 714,413,635.50   | -     |
| 其他衍生工具 | (72,378,245.25)    | 72,378,245.25    | -     | 7,806,073.14       | (7,806,073.14)   | -     |

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互换，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：

|        | 2021年6月30日 |        |                  |      |                  |    | 公允价值            |    |
|--------|------------|--------|------------------|------|------------------|----|-----------------|----|
|        | 名义金额       |        |                  |      |                  | 总计 | 资产              | 负债 |
|        | 3个月以内      | 3个月至1年 | 1至5年             | 5年以上 |                  |    |                 |    |
| 利率衍生工具 | -          | -      | 1,304,980,000.00 | -    | 1,304,980,000.00 | -  | (25,575,798.99) |    |

|        | 2020年12月31日 |        |                  |      |                  |    | 公允价值            |    |
|--------|-------------|--------|------------------|------|------------------|----|-----------------|----|
|        | 名义金额        |        |                  |      |                  | 总计 | 资产              | 负债 |
|        | 3个月以内       | 3个月至1年 | 1至5年             | 5年以上 |                  |    |                 |    |
| 利率衍生工具 | -           | -      | 1,304,980,000.00 | -    | 1,304,980,000.00 | -  | (34,347,588.68) |    |

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：

2021年6月30日

|    | 被套期项目账面价值 |                    | 套期工具本期对其<br>其他综合收益影响的金额 | 套期工具累计计入<br>其他综合收益的金额 | 资产负债表项目 |
|----|-----------|--------------------|-------------------------|-----------------------|---------|
|    | 资产        | 负债                 |                         |                       |         |
| 债券 | -         | (2,585,664,722.45) | 8,771,789.69            | (25,575,798.99)       | 应付债券    |

2020年12月31日

|    | 被套期项目账面价值 |                    | 套期工具本期对其<br>其他综合收益影响的金额 | 套期工具累计计入<br>其他综合收益的金额 | 资产负债表项目 |
|----|-----------|--------------------|-------------------------|-----------------------|---------|
|    | 资产        | 负债                 |                         |                       |         |
| 债券 | -         | (2,611,554,530.08) | (34,347,588.68)         | (34,347,588.68)       | 应付债券    |

## 5 存出保证金

|       | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
|-------|-------------------|-------------------|
| 期货保证金 | 20,917,431,963.70 | 17,397,564,034.70 |
| 信用保证金 | 1,936,409,198.02  | 4,961,706,927.62  |
| 交易保证金 | 3,482,736,099.82  | 2,404,519,333.50  |
| 合计    | 26,336,577,261.54 | 24,763,790,295.82 |

2021年6月30日

2020年12月31日

|        | 2021年6月30日        |        |                   | 2020年12月31日       |        |                   |
|--------|-------------------|--------|-------------------|-------------------|--------|-------------------|
|        | 外币金额              | 折算率    | 人民币金额             | 外币金额              | 折算率    | 人民币金额             |
| 期货保证金: |                   |        |                   |                   |        |                   |
| 人民币    | 20,794,690,002.33 | 1.0000 | 20,794,690,002.33 | 17,296,653,516.95 | 1.0000 | 17,296,653,516.95 |
| 美元     | 19,000,009.50     | 6.4601 | 122,741,961.37    | 14,790,292.48     | 6.5249 | 96,505,179.38     |
| 港币     | -                 | 0.8321 | -                 | 3,031,363.29      | 0.8416 | 2,551,195.34      |
| 其他     |                   |        | -                 |                   |        | 1,854,143.03      |
| 小计     |                   |        | 20,917,431,963.70 |                   |        | 17,397,564,034.70 |
| 信用保证金: |                   |        |                   |                   |        |                   |
| 人民币    | 1,936,409,198.02  | 1.0000 | 1,936,409,198.02  | 4,961,706,927.62  | 1.0000 | 4,961,706,927.62  |
| 小计     |                   |        | 1,936,409,198.02  |                   |        | 4,961,706,927.62  |
| 交易保证金: |                   |        |                   |                   |        |                   |
| 人民币    | 1,461,955,034.70  | 1.0000 | 1,461,955,034.70  | 1,394,006,397.44  | 1.0000 | 1,394,006,397.44  |
| 美元     | 301,575,268.87    | 6.4601 | 1,948,206,394.44  | 148,870,386.18    | 6.5249 | 971,364,382.79    |
| 港币     | 54,949,586.18     | 0.8321 | 45,723,550.66     | 46,204,553.49     | 0.8416 | 38,885,752.22     |
| 其他     |                   |        | 26,851,120.02     |                   |        | 262,801.05        |
| 小计     |                   |        | 3,482,736,099.82  |                   |        | 2,404,519,333.50  |
| 合计     |                   |        | 26,336,577,261.54 |                   |        | 24,763,790,295.82 |

## 6 应收款项

(1) 按类别分析如下

|                 | 2021年6月30日        | 2020年12月31日      |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 应收权益互换及场外期权     | 4,972,874,082.28  | 4,385,953,032.49 |
| 应收开放式基金赎回款      | 2,205,990,794.86  | 940,016,478.03   |
| 应收手续费及佣金        | 1,233,215,792.10  | 910,562,950.21   |
| 应收经纪、交易商及结算所    | 1,068,233,613.80  | 2,564,670,429.78 |
| 应收清算款           | 896,498,875.45    | 168,810,186.66   |
| 应收申购款           | 3,655,489.21      | 112,017,997.02   |
| 其他              | 17,884,471.85     | 76,829,942.19    |
| 小计              | 10,398,353,119.55 | 9,158,861,016.38 |
| 减：坏账准备（按简化模型计提） | (46,826,247.27)   | (63,300,769.06)  |
| 合计              | 10,351,526,872.28 | 9,095,560,247.32 |

(2) 按账龄分析如下

|            | 2021年6月30日        |        |               |        |
|------------|-------------------|--------|---------------|--------|
|            | 账面余额              |        | 坏账准备          |        |
|            | 金额                | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 1年以内(含1年)  | 10,234,735,290.10 | 98.43  | 34,374,299.89 | 73.41  |
| 1年至2年(含2年) | 134,537,240.16    | 1.29   | 5,531,825.93  | 11.81  |
| 2年至3年(含3年) | 18,067,545.29     | 0.17   | 1,413,599.45  | 3.02   |
| 3年以上       | 11,013,044.00     | 0.11   | 5,506,522.00  | 11.76  |
| 合计         | 10,398,353,119.55 | 100.00 | 46,826,247.27 | 100.00 |

|            | 2020年12月31日      |        |               |        |
|------------|------------------|--------|---------------|--------|
|            | 账面余额             |        | 坏账准备          |        |
|            | 金额               | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 1年以内(含1年)  | 9,121,524,497.48 | 99.59  | 59,033,335.50 | 93.26  |
| 1年至2年(含2年) | 27,100,862.90    | 0.30   | 291,505.56    | 0.46   |
| 2年至3年(含3年) | 2,854,750.00     | 0.03   | 285,475.00    | 0.45   |
| 3年以上       | 7,380,906.00     | 0.08   | 3,690,453.00  | 5.83   |
| 合计         | 9,158,861,016.38 | 100.00 | 63,300,769.06 | 100.00 |

账龄自应收款项确认日起开始计算。

## (3) 按评估方式分析如下

| 2021年6月30日 |                   |        |               |        |
|------------|-------------------|--------|---------------|--------|
|            | 账面余额              |        | 坏账准备          |        |
|            | 金额                | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 单独计提减值准备   | -                 | -      | -             | -      |
| 组合计提减值准备   | 10,398,353,119.55 | 100.00 | 46,826,247.27 | 100.00 |
| 合计         | 10,398,353,119.55 | 100.00 | 46,826,247.27 | 100.00 |

| 2020年12月31日 |                  |        |               |        |
|-------------|------------------|--------|---------------|--------|
|             | 账面余额             |        | 坏账准备          |        |
|             | 金额               | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) |
| 单独计提减值准备    | -                | -      | -             | -      |
| 组合计提减值准备    | 9,158,861,016.38 | 100.00 | 63,300,769.06 | 100.00 |
| 合计          | 9,158,861,016.38 | 100.00 | 63,300,769.06 | 100.00 |

## (4) 单项计提坏账准备的应收款项

本集团并无单项金额重大并单独计提坏账准备的应收款项。

## (5) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况

2021年1-6月应收款项坏账准备的变动情况参见附注五、21。

## (6) 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               | 账龄   | 占应收款项<br>总额的比例 (%) |
|--------------|--------|------------------|------|--------------------|
| 渣打银行         | 第三方    | 862,999,155.75   | 一年以内 | 8.34               |
| 中国银河证券股份有限公司 | 第三方    | 624,170,464.74   | 一年以内 | 6.03               |
| 兴业银行         | 第三方    | 446,913,141.78   | 一年以内 | 4.32               |
| 国泰君安风险管理有限公司 | 第三方    | 394,853,174.52   | 一年以内 | 3.81               |
| 深圳诚奇资产管理有限公司 | 第三方    | 314,377,344.02   | 一年以内 | 3.04               |
| 合计           |        | 2,643,313,280.81 |      | 25.54              |

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

|        | 2021年6月30日               | 2020年12月31日              |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 债券     | 12,137,384,578.80        | 13,883,006,450.19        |
| 股票     | 6,798,707,772.67         | 6,692,818,392.27         |
| 减：减值准备 | (864,724,282.13)         | (1,039,412,436.94)       |
| 合计     | <u>18,071,368,069.34</u> | <u>19,536,412,405.52</u> |

### (2) 按业务类别列示

|         | 2021年6月30日               | 2020年12月31日              |
|---------|--------------------------|--------------------------|
| 债券质押式回购 | 12,137,384,578.80        | 13,883,006,450.19        |
| 股票质押式回购 | 6,798,707,772.67         | 6,692,818,392.27         |
| 减：减值准备  | (864,724,282.13)         | (1,039,412,436.94)       |
| 合计      | <u>18,071,368,069.34</u> | <u>19,536,412,405.52</u> |

### (3) 担保物信息

|                    | 2021年6月30日               | 2020年12月31日              |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|
| 担保物                | 22,069,082,465.48        | 19,852,936,356.84        |
| 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>22,069,082,465.48</u> | <u>19,852,936,356.84</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2021年6月30日和2020年12月31日，上述交易所国债逆回购的金额分别为人民币8,238,477,784.80元和人民币12,610,865,930.90元。

## (4) 股票质押式回购业务按剩余期限列示

|         | 2021年6月30日       | 2020年12月31日        |
|---------|------------------|--------------------|
| 1个月内    | 2,128,137,079.60 | 1,631,621,951.83   |
| 1个月至3个月 | 2,077,911,441.68 | 688,996,824.91     |
| 3个月至1年  | 2,592,659,251.39 | 4,372,199,615.53   |
| 减：减值准备  | (864,724,282.13) | (1,039,412,436.94) |
| 合计      | 5,933,983,490.54 | 5,653,405,955.33   |

## (5) 股票质押式回购按减值阶段列示

| 2021年6月30日 |                   |                              |                              |                   |
|------------|-------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------|
|            | 未来12个月<br>预期信用损失  | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(未发生信用减值) | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(已发生信用减值) | 合计                |
| 账面余额       | 5,348,622,874.53  | 146,501,603.85               | 1,303,583,294.29             | 6,798,707,772.67  |
| 减值准备       | (12,458,136.19)   | (1,465,016.04)               | (850,801,129.90)             | (864,724,282.13)  |
| 账面价值       | 5,336,164,738.34  | 145,036,587.81               | 452,782,164.39               | 5,933,983,490.54  |
| 担保物价值      | 16,081,244,451.95 | 259,671,913.82               | 1,134,254,729.35             | 17,475,171,095.12 |

| 2020年12月31日 |                   |                              |                              |                    |
|-------------|-------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------|
|             | 未来12个月<br>预期信用损失  | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(未发生信用减值) | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(已发生信用减值) | 合计                 |
| 账面余额        | 5,047,694,452.71  | 13,510,000.00                | 1,631,613,939.56             | 6,692,818,392.27   |
| 减值准备        | (11,995,971.64)   | (135,100.00)                 | (1,027,281,365.30)           | (1,039,412,436.94) |
| 账面价值        | 5,035,698,481.07  | 13,374,900.00                | 604,332,574.26               | 5,653,405,955.33   |
| 担保物价值       | 16,323,423,925.19 | 17,413,876.40                | 2,039,803,686.20             | 18,380,641,487.79  |

## 8 交易性金融资产

## (1) 按类别列示

| 2021年6月30日 |                           |                           |                           |                           |                           |                           |
|------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|            | 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 | 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 | 公允价值合计                    | 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 | 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 | 初始投资成本合计                  |
| 债券         | 173,002,181,603.14        | -                         | 173,002,181,603.14        | 172,260,701,978.15        | -                         | 172,260,701,978.15        |
| 公募基金       | 35,932,741,147.01         | -                         | 35,932,741,147.01         | 35,174,086,857.30         | -                         | 35,174,086,857.30         |
| 股票         | 79,728,914,893.32         | -                         | 79,728,914,893.32         | 74,442,994,099.13         | -                         | 74,442,994,099.13         |
| 银行理财产品     | 874,546,603.76            | -                         | 874,546,603.76            | 870,827,433.34            | -                         | 870,827,433.34            |
| 券商资管产品     | 2,601,600,821.69          | -                         | 2,601,600,821.69          | 2,608,763,525.86          | -                         | 2,608,763,525.86          |
| 信托计划       | 2,258,767,310.01          | -                         | 2,258,767,310.01          | 2,314,839,006.05          | -                         | 2,314,839,006.05          |
| 其他股权投资     | 4,977,097,869.62          | -                         | 4,977,097,869.62          | 3,079,831,107.57          | -                         | 3,079,831,107.57          |
| 应收款项类投资    | 4,835,200,636.74          | -                         | 4,835,200,636.74          | 4,874,820,609.82          | -                         | 4,874,820,609.82          |
| 其他         | 6,782,301,826.83          | -                         | 6,782,301,826.83          | 6,679,949,665.56          | -                         | 6,679,949,665.56          |
| 合计         | <u>310,993,352,712.12</u> | <u>-</u>                  | <u>310,993,352,712.12</u> | <u>302,306,814,282.78</u> | <u>-</u>                  | <u>302,306,814,282.78</u> |

| 2020年12月31日 |                           |                           |                           |                           |                           |                           |
|-------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
|             | 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 | 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 | 公允价值合计                    | 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 | 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 | 初始投资成本合计                  |
| 债券          | 188,336,801,746.52        | -                         | 188,336,801,746.52        | 187,571,144,151.74        | -                         | 187,571,144,151.74        |
| 公募基金        | 24,409,874,437.18         | -                         | 24,409,874,437.18         | 23,913,388,128.08         | -                         | 23,913,388,128.08         |
| 股票          | 58,988,300,512.18         | -                         | 58,988,300,512.18         | 51,825,020,765.17         | -                         | 51,825,020,765.17         |
| 银行理财产品      | 1,335,346,136.28          | -                         | 1,335,346,136.28          | 1,335,595,385.14          | -                         | 1,335,595,385.14          |
| 券商资管产品      | 2,790,751,363.01          | -                         | 2,790,751,363.01          | 2,701,264,781.88          | -                         | 2,701,264,781.88          |
| 信托计划        | 4,880,104,147.61          | -                         | 4,880,104,147.61          | 4,954,042,875.09          | -                         | 4,954,042,875.09          |
| 其他股权投资      | 5,608,484,897.46          | -                         | 5,608,484,897.46          | 3,417,120,611.13          | -                         | 3,417,120,611.13          |
| 应收款项类投资     | 4,049,841,121.07          | -                         | 4,049,841,121.07          | 4,167,489,874.03          | -                         | 4,167,489,874.03          |
| 其他          | 2,295,802,314.24          | -                         | 2,295,802,314.24          | 2,289,018,284.79          | -                         | 2,289,018,284.79          |
| 合计          | <u>292,695,306,675.55</u> | <u>-</u>                  | <u>292,695,306,675.55</u> | <u>282,174,084,857.05</u> | <u>-</u>                  | <u>282,174,084,857.05</u> |

## (2) 交易性金融资产中的融出证券情况

截至2021年6月30日和2020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4,978,933,074.10元和人民币5,426,439,381.32元。

## (3) 变现有限制的交易性金融资产

|        | 限制条件              | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
|--------|-------------------|---------------------------|---------------------------|
| 债券     | 质押                | 106,427,520,007.97        | 98,239,851,872.79         |
| 股票     | 质押                | 8,481,472,713.59          | 16,653,143,097.21         |
| 股票     | 已融出证券             | 1,297,562,896.35          | 974,537,436.12            |
| 公募基金   | 已融出证券             | 3,681,370,177.75          | 4,451,901,945.20          |
| 股票     | 存在限售期限            | 5,555,401,367.17          | 2,446,592,706.27          |
| 公募基金   | 存在限售期限            | 162,503,516.46            | 54,681,839.03             |
| 券商资管产品 | 以管理人身份认购的集合资产管理计划 | 172,464,677.18            | 233,029,480.89            |
| 合计     |                   | <u>125,778,295,356.47</u> | <u>123,053,738,377.51</u> |

## 9 债权投资

## (1) 债权投资金融资产情况

|       | 2021年6月30日               |                       |                        |                          |
|-------|--------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|
|       | 初始成本                     | 利息                    | 减值准备                   | 账面价值                     |
| 国债    | 14,150,000,000.00        | 144,071,422.82        | -                      | 14,294,071,422.82        |
| 地方政府债 | 16,494,000,000.00        | 378,906,593.66        | (10,662,626.45)        | 16,862,243,967.21        |
| 企业债   | 154,000,000.00           | 5,160,631.53          | (20,174.25)            | 159,140,457.28           |
| 公司债   | 1,120,351,275.80         | 18,867,034.87         | (26,687,475.11)        | 1,112,530,835.56         |
| 金融债   | 800,000,000.00           | (2,124,945.23)        | (107,731.59)           | 797,767,323.18           |
| 其他债   | 270,000,000.00           | 3,601,775.33          | (117,670.99)           | 273,484,104.34           |
| 合计    | <u>32,988,351,275.80</u> | <u>548,482,512.98</u> | <u>(37,595,678.39)</u> | <u>33,499,238,110.39</u> |

|       | 2020年12月31日              |                       |                        |                          |
|-------|--------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|
|       | 初始成本                     | 利息                    | 减值准备                   | 账面价值                     |
| 国债    | 14,240,000,000.00        | 159,641,882.55        | -                      | 14,399,641,882.55        |
| 地方政府债 | 8,160,000,000.00         | 157,446,881.45        | (1,122,582.06)         | 8,316,324,299.39         |
| 企业债   | 1,080,702,903.71         | 12,449,797.11         | (669,438.16)           | 1,092,483,262.66         |
| 公司债   | 3,667,998,000.00         | 64,949,851.89         | (26,120,040.83)        | 3,706,827,811.06         |
| 金融债   | 1,500,000,000.00         | (4,504,195.31)        | (146,576.23)           | 1,495,349,228.46         |
| 其他债   | 1,360,000,000.00         | 41,389,925.63         | (508,687.70)           | 1,400,881,237.93         |
| 合计    | <u>30,008,700,903.71</u> | <u>431,374,143.32</u> | <u>(28,567,324.98)</u> | <u>30,411,507,722.05</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

2021年1-6月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2021年6月30日和2020年12月31日，本集团债权投资中分别有人民币29,133,373,769.83元和人民币25,167,103,012.69元的债券投资为卖出回购业务设定质押。

10 其他债权投资

| 2021年6月30日 |                  |                |               |                  |               |
|------------|------------------|----------------|---------------|------------------|---------------|
|            | 初始成本             | 利息             | 公允价值变动        | 账面价值             | 累计减值准备        |
| 应收款项类投资    | 437,913,001.70   | 15,363,107.04  | 1,700,137.78  | 454,976,246.52   | 11,611,835.78 |
| 债券         | 6,937,064,274.56 | 115,543,266.95 | 11,693,941.09 | 7,064,301,482.60 | 55,311,346.49 |
| 合计         | 7,374,977,276.26 | 130,906,373.99 | 13,394,078.87 | 7,519,277,729.12 | 66,923,182.27 |

| 2020年12月31日 |                  |               |               |                  |               |
|-------------|------------------|---------------|---------------|------------------|---------------|
|             | 初始成本             | 利息            | 公允价值变动        | 账面价值             | 累计减值准备        |
| 应收款项类投资     | 856,484,794.30   | 19,887,421.83 | 870,444.21    | 877,242,660.34   | 22,381,792.47 |
| 债券          | 4,293,213,912.66 | 60,910,096.64 | 36,588,437.01 | 4,390,712,446.31 | 45,636,793.67 |
| 合计          | 5,149,698,706.96 | 80,797,518.47 | 37,458,881.22 | 5,267,955,106.65 | 68,018,586.14 |

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

|          | 2021年6月30日     |                | 2020年12月31日       |                   |
|----------|----------------|----------------|-------------------|-------------------|
|          | 初始成本           | 期末公允价值         | 初始成本              | 期末公允价值            |
| 非交易性权益工具 | 133,416,057.40 | 173,280,904.08 | 10,154,728,042.09 | 10,678,417,333.15 |

## 12 长期股权投资

## (1) 按类别列示

|          | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
|----------|-------------------|-------------------|
| 对联营企业的投资 | 17,993,447,948.29 | 17,691,160,951.07 |
| 对合营企业的投资 | 913,628,702.94    | 753,650,783.34    |
| 小计       | 18,907,076,651.23 | 18,444,811,734.41 |
| 减：减值准备   |                   |                   |
| - 联营企业   | -                 | -                 |
| - 合营企业   | -                 | -                 |
| 合计       | 18,907,076,651.23 | 18,444,811,734.41 |

## (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              | 本期增减变动         |                  |                  |                |        |                  |        | 减值准备<br>期末余额 |                   |
|-------------------------|-------------------|----------------|------------------|------------------|----------------|--------|------------------|--------|--------------|-------------------|
|                         |                   | 追加投资           | 减少投资             | 权益法下确认的<br>投资收益  | 其他综合收益         | 其他权益变动 | 宣告发放现金<br>股利或利润  | 计提减值准备 |              | 其他                |
| <b>联营企业</b>             |                   |                |                  |                  |                |        |                  |        |              |                   |
| 南方基金管理股份有限公司            | 3,138,586,592.44  | -              | -                | 344,586,386.26   | (1,246,447.44) | -      | (295,956,611.06) | -      | -            | 3,185,969,920.20  |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司            | 590,457,198.59    | -              | -                | 99,432,603.69    | -              | -      | (75,950,000.00)  | -      | -            | 613,939,802.28    |
| 华泰紫金(江苏)股权投资基金(有限合伙)    | 516,392,390.55    | -              | -                | 1,447,111.19     | -              | -      | (24,159,486.41)  | -      | -            | 493,680,015.33    |
| 江苏工业和信息产业投资基金(有限合伙)     | 281,745,258.37    | -              | -                | 7,971,744.28     | -              | -      | -                | -      | -            | 289,717,002.65    |
| 江苏银行股份有限公司              | 7,588,139,898.35  | -              | -                | 538,016,065.02   | 11,577,613.80  | 450.67 | (262,912,000.00) | -      | -            | 7,874,822,027.84  |
| 南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)      | 4,031,951,384.30  | -              | (506,846,461.88) | 332,750,552.46   | -              | -      | (73,320,897.41)  | -      | -            | 3,784,534,577.47  |
| 南京华泰大健康一号股权投资合伙企业(有限合伙) | 750,163,696.12    | -              | (9,575,199.00)   | (14,143,288.89)  | -              | -      | -                | -      | -            | 726,445,208.23    |
| 其他                      | 793,724,532.35    | 147,000,000.00 | (5,277,323.12)   | 113,817,171.64   | -              | -      | (24,924,986.58)  | -      | -            | 1,024,339,394.29  |
| 小计                      | 17,691,160,951.07 | 147,000,000.00 | (521,698,984.00) | 1,423,878,345.65 | 10,331,166.36  | 450.67 | (757,223,981.46) | -      | -            | 17,993,447,948.29 |
| <b>合营企业</b>             |                   |                |                  |                  |                |        |                  |        |              |                   |
| 华泰招商(江苏)资本市场投资母基金(有限合伙) | 753,650,783.34    | -              | -                | 159,977,919.60   | -              | -      | -                | -      | -            | 913,628,702.94    |
| 小计                      | 753,650,783.34    | -              | -                | 159,977,919.60   | -              | -      | -                | -      | -            | 913,628,702.94    |
| 合计                      | 18,444,811,734.41 | 147,000,000.00 | (521,698,984.00) | 1,583,856,265.25 | 10,331,166.36  | 450.67 | (757,223,981.46) | -      | -            | 18,907,076,651.23 |

## 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           |
|----------|------------------|
| 原值       |                  |
| 期初余额     | 644,786,623.23   |
| 本期增加     |                  |
| - 外购     | -                |
| - 固定资产转入 | -                |
| - 在建工程转入 | -                |
| 本期减少     |                  |
| - 处置     | -                |
| - 其他转出   | (93,817,605.21)  |
| 期末余额     | 550,969,018.02   |
| 减：累计折旧   |                  |
| 期初余额     | (231,901,802.42) |
| 本期计提     |                  |
| - 计提折旧   | (7,744,555.57)   |
| - 固定资产转入 | -                |
| 本期减少     |                  |
| - 处置     | -                |
| - 其他转出   | 14,911,883.57    |
| 期末余额     | (224,734,474.42) |
| 减值准备     |                  |
| 期初余额     | (4,547,017.71)   |
| 本期计提     | -                |
| 本期减少     | -                |
| 期末余额     | (4,547,017.71)   |
| 账面价值     |                  |
| 期末       | 321,687,525.89   |
| 期初       | 408,337,803.10   |

(2) 未办妥产权证书的投资性房地产情况

于 2021 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 44,725,357.48 元 (2020 年 12 月 31 日：人民币 46,055,808.30 元)。

14 固定资产

(1) 固定资产情况

|            | 房屋及建筑物                  | 运输工具                    | 电子设备                    | 办公设备<br>及其他设备           | 合计                        |
|------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 原值         |                         |                         |                         |                         |                           |
| 期初余额       | 3,778,316,937.26        | 153,955,711.26          | 1,393,318,820.54        | 288,253,719.02          | 5,613,845,188.08          |
| 本期增加       |                         |                         |                         |                         |                           |
| - 购置       | -                       | 1,467,856.48            | 77,186,846.71           | 13,242,157.15           | 91,896,860.34             |
| - 投资性房地产转入 | 93,817,605.21           | -                       | -                       | -                       | 93,817,605.21             |
| - 在建工程转入   | -                       | -                       | 221,502.47              | 1,194,837.30            | 1,416,339.77              |
| 本期减少       |                         |                         |                         |                         |                           |
| - 处置或报废    | -                       | (3,167,857.02)          | (63,017,476.59)         | (4,584,760.14)          | (70,770,093.75)           |
| 期末余额       | <u>3,872,134,542.47</u> | <u>152,255,710.72</u>   | <u>1,407,709,693.13</u> | <u>298,105,953.33</u>   | <u>5,730,205,899.65</u>   |
| 减：累计折旧     |                         |                         |                         |                         |                           |
| 期初余额       | (871,680,000.13)        | (106,560,973.97)        | (663,129,771.70)        | (193,919,314.81)        | (1,835,290,060.61)        |
| 本期计提       | (54,707,657.65)         | (4,086,664.47)          | (106,806,358.33)        | (18,300,457.59)         | (183,901,138.04)          |
| 投资性房地产转入   | (14,911,883.57)         | -                       | -                       | -                       | (14,911,883.57)           |
| 本期减少       |                         |                         |                         |                         |                           |
| - 处置或报废    | -                       | 3,073,341.01            | 60,457,958.92           | 3,618,966.62            | 67,150,266.55             |
| 期末余额       | <u>(941,299,541.35)</u> | <u>(107,574,297.43)</u> | <u>(709,478,171.11)</u> | <u>(208,600,805.78)</u> | <u>(1,966,952,815.67)</u> |
| 账面价值       |                         |                         |                         |                         |                           |
| 期末         | <u>2,930,835,001.12</u> | <u>44,681,413.29</u>    | <u>698,231,522.02</u>   | <u>89,505,147.55</u>    | <u>3,763,253,083.98</u>   |
| 期初         | <u>2,906,636,937.13</u> | <u>47,394,737.29</u>    | <u>730,189,048.84</u>   | <u>94,334,404.21</u>    | <u>3,778,555,127.47</u>   |

于 2021 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 (2020 年 12 月 31 日：无)。

(2) 未办妥产权证书的固定资产情况

于 2021 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 6,338,212.41 元 (2020 年 12 月 31 日：人民币 6,561,749.79 元)。

(3) 暂时闲置的固定资产情况

于 2021 年 6 月 30 日，本集团无暂时闲置的固定资产 (2020 年 12 月 31 日：无)。

## 15 在建工程

|        | 2021年6月30日    |      |               | 2020年12月31日   |      |               |
|--------|---------------|------|---------------|---------------|------|---------------|
|        | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          | 账面余额          | 减值准备 | 账面价值          |
| 房屋装修工程 | 71,602,641.85 | -    | 71,602,641.85 | 36,551,735.94 | -    | 36,551,735.94 |

## 16 使用权资产

|        | 房屋、建筑物           | 其他              | 合计               |
|--------|------------------|-----------------|------------------|
| 原值     |                  |                 |                  |
| 期初余额   | 1,772,454,107.52 | 25,042,646.62   | 1,797,496,754.14 |
| 本期增加   | 253,701,993.78   | -               | 253,701,993.78   |
| 本期减少   | (112,387,949.15) | -               | (112,387,949.15) |
| 期末余额   | 1,913,768,152.15 | 25,042,646.62   | 1,938,810,798.77 |
| 减：累计折旧 |                  |                 |                  |
| 期初余额   | (587,613,502.25) | (10,905,668.82) | (598,519,171.07) |
| 本期计提   | (213,522,932.37) | (2,019,568.30)  | (215,542,500.67) |
| 本期减少   | 86,945,055.04    | -               | 86,945,055.04    |
| 期末余额   | (714,191,379.58) | (12,925,237.12) | (727,116,616.70) |
| 账面价值   |                  |                 |                  |
| 期末     | 1,199,576,772.57 | 12,117,409.50   | 1,211,694,182.07 |
| 期初     | 1,184,840,605.27 | 14,136,977.80   | 1,198,977,583.07 |

于2021年6月30日，本集团认为无需对使用权资产计提减值准备（2020年12月31日：无）。

## 17 无形资产

### (1) 无形资产情况

|          | 土地使用权           | 交易席位费            | 与现有经纪商的关系        | 商标               | 软件及其他              | 合计                 |
|----------|-----------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|--------------------|
| 原值       |                 |                  |                  |                  |                    |                    |
| 期初余额     | 362,280,665.44  | 125,497,526.81   | 3,738,929,579.92 | 300,370,114.02   | 2,721,125,086.43   | 7,248,202,972.62   |
| 本期增加     | 298,775,840.57  | -                | -                | -                | 121,910,356.12     | 420,686,196.69     |
| 外币报表折算差额 | -               | -                | (42,410,231.16)  | (3,407,062.29)   | (16,115,699.07)    | (61,932,992.52)    |
| 期末余额     | 661,056,506.01  | 125,497,526.81   | 3,696,519,348.76 | 296,963,051.73   | 2,826,919,743.48   | 7,606,956,176.79   |
| 减：累计摊销   |                 |                  |                  |                  |                    |                    |
| 期初余额     | (92,621,957.09) | (124,880,374.53) | -                | (87,012,112.48)  | (1,667,619,372.14) | (1,972,133,816.24) |
| 本期增加     | (5,906,838.38)  | (4,999.98)       | -                | (18,963,351.94)  | (223,198,410.82)   | (248,073,601.12)   |
| 外币报表折算差额 | -               | -                | -                | 976,952.47       | 7,157,760.20       | 8,134,712.67       |
| 期末余额     | (98,528,795.47) | (124,885,374.51) | -                | (104,998,511.95) | (1,883,660,022.76) | (2,212,072,704.69) |
| 账面价值     |                 |                  |                  |                  |                    |                    |
| 期末       | 562,527,710.54  | 612,152.30       | 3,696,519,348.76 | 191,964,539.78   | 943,259,720.72     | 5,394,883,472.10   |
| 期初       | 269,658,708.35  | 617,152.28       | 3,738,929,579.92 | 213,358,001.54   | 1,053,505,714.29   | 5,276,069,156.38   |

### (2) 无形资产抵押或担保情况

于 2021 年 6 月 30 日及 2020 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 2021 年 6 月 30 日，本集团基于上述单项无形资产的可回收金额能否可靠估计的判断，对上述单项无形资产进行减值测试。可收回金额以预计未来现金流量现值的方法确定，本集团根据管理层批准的 9 年期的财务预算和税前折现率 15.6% 预计该资产组的未来现金流量现值，该折现率已反映相关资产的特定风险。超过财务预算之后年份的现金流量以 3.5% 的长期平均增长率推断。

于 2021 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（2020 年 12 月 31 日：无）。

## 18 商誉

## (1) 商誉变动情况

| 被投资单位名称                                | 注   | 期初余额             | 本期减少            | 本期处置 | 期末余额             |
|--|-----|------------------|-----------------|------|------------------|
| 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) | 1,962,336,106.20 | (17,677,556.76) | -    | 1,944,658,549.44 |
| Global Financial Private Capital, Inc. | (d) | 173,451,416.70   | (1,722,578.40)  | -    | 171,728,838.30   |
| WBI OBS Financial, Inc.                | (e) | 73,816,193.70    | (733,082.40)    | -    | 73,083,111.30    |
| 小计                                     |     | 2,260,945,283.90 | (20,133,217.56) | -    | 2,240,812,066.34 |
| 减：减值准备                                 |     | -                | -               | -    | -                |
| 账面价值                                   |     | 2,260,945,283.90 | (20,133,217.56) | -    | 2,240,812,066.34 |

(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。本期减少数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。本期减少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。本期减少主要为外币报表折算差额的影响。



## (2) 商誉减值准备

本集团将商誉分摊至各资产组的具体情况如下：

|          | 注   | 2021年6月30日       | 2020年12月31日      |
|----------|-----|------------------|------------------|
| 投行业务     | (a) | 51,089,439.80    | 51,089,439.80    |
| 期货经纪业务   | (a) | 252,127.50       | 252,127.50       |
| 境外资产管理业务 | (b) | 2,189,470,499.04 | 2,209,603,716.60 |
| 合计       |     | 2,240,812,066.34 | 2,260,945,283.90 |

对于投行业务和期货经纪业务资产组，收购的每个子公司产生的现金流皆是独立的，故每一个被收购的子公司都是一个独立的资产组。对于境外资产管理业务资产组，本集团认为2019年收购的Global Financial Private Capital, Inc.与2020年收购的WBI OBS Financial, Inc.的主营业务与AssetMark Financial Holdings, Inc.一致，三者能够产生协同效应，故将三者认定为同一个资产组。本集团对每个资产组单独进行了商誉减值测试。

## (a) 投行业务、期货经纪业务资产组

各资产组的可收回金额以预计未来现金流量现值的方法确定。本集团根据相关子公司管理层批准的最近未来若干年财务预算和适用的折现率预计该资产组的未来现金流量现值。超过财务预算之后年份的现金流量以适当的预测加权平均增长率推断。该增长率并不超出资产组所涉及业务的长期平均增长率。于2021年6月30日，投行业务和期货经纪业务资产组所使用的现金流量税前折现率分别为20%和18%（2020年12月31日：20%和18%），加权平均增长率分别为5%和6.6%（2020年12月31日：5%和6.6%），该税前折现率和加权平均增长率反映了相关资产组的特定风险和长期增长预期。其他预测现金流入或流出有关的可收回金额估计值的主要假设包括预测收入及收入利润率，该估计值是根据该资产组过往的表现及管理层对市场变化的预期而确定。

## (b) 境外资产管理业务资产组

资产组的可收回金额按照资产组公允价值减去处置费用后的净额确定，其公允价值减去处置费用后的净额按照AssetMark Financial Holdings, Inc.于2021年6月30日的在纽约证券交易所的股票市值确定。

于2021年6月30日，对投行业务、期货经纪业务资产组及境外资产管理业务的可收回金额的预计结果并没有导致确认减值损失。本集团认为已根据可以获得的信息做出适当假设。但预计该等资产组未来现金流量现值所依据的关键假设可能会发生改变，管理层认为如果关键假设发生负面变动，则可能会导致该等资产组的账面价值超过其可收回金额。

## 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             | 2021年6月30日            |                    | 2020年12月31日           |                    |
|----------------|-----------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|
|                | 可抵扣暂时性差异 / (应纳税暂时性差异) | 递延所得税资产 / (负债)     | 可抵扣暂时性差异 / (应纳税暂时性差异) | 递延所得税资产 / (负债)     |
| 递延所得税资产：       |                       |                    |                       |                    |
| 资产减值准备         | 3,227,638,543.30      | 806,914,310.72     | 3,431,009,932.43      | 857,752,483.11     |
| 公允价值变动         | 12,092,008.37         | 3,023,002.08       | 246,449,894.97        | 61,612,473.75      |
| 应付职工薪酬         | 6,559,000,520.91      | 1,641,838,949.04   | 7,095,053,232.22      | 1,782,676,915.90   |
| 应付利息           | 36,298,690.79         | 9,074,672.70       | 806,644,432.55        | 201,661,108.14     |
| 其他             | 2,991,380,510.61      | 602,162,624.06     | 2,083,148,775.37      | 315,411,169.95     |
| 小计             | 12,826,410,273.98     | 3,063,013,558.60   | 13,662,306,267.54     | 3,219,114,150.85   |
| 互抵金额           | (11,151,990,187.50)   | (2,644,408,537.35) | (12,304,298,480.62)   | (2,879,612,204.12) |
| 互抵后的金额         | 1,674,420,086.48      | 418,605,021.25     | 1,358,007,786.92      | 339,501,946.73     |
| 递延所得税负债：       |                       |                    |                       |                    |
| 公允价值变动         | (6,535,867,444.82)    | (1,633,966,861.23) | (5,267,400,995.80)    | (1,316,850,248.96) |
| 应收利息           | (4,093,645,009.87)    | (1,023,411,252.47) | (3,470,260,475.55)    | (867,565,118.89)   |
| 于收购中确认的无形资产    | (4,549,672,986.12)    | (1,220,728,609.67) | (4,591,202,723.16)    | (1,174,737,537.97) |
| 私募投资基金享有的应纳税收益 | (4,779,482,260.20)    | (1,194,870,565.05) | (4,294,941,483.92)    | (1,073,735,370.98) |
| 其他             | (3,804,493,724.02)    | (951,123,430.97)   | (3,969,482,938.55)    | (992,370,734.65)   |
| 小计             | (23,763,161,425.03)   | (6,024,100,719.39) | (21,593,288,616.98)   | (5,425,259,011.45) |
| 互抵金额           | 11,151,990,187.50     | 2,644,408,537.35   | 12,304,298,480.62     | 2,879,612,204.12   |
| 互抵后的金额         | (12,611,171,237.53)   | (3,379,692,182.04) | (9,288,990,136.36)    | (2,545,646,807.33) |

## (2) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

| 项目      | 2021年6月30日         |                    | 2020年12月31日        |                    |
|---------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|         | 递延所得税资产和负债互抵金额     | 抵销后递延所得税资产或负债余额    | 递延所得税资产和负债互抵金额     | 抵销后递延所得税资产或负债余额    |
| 递延所得税资产 | (2,644,408,537.35) | 418,605,021.25     | (2,879,612,204.12) | 339,501,946.73     |
| 递延所得税负债 | 2,644,408,537.35   | (3,379,692,182.04) | 2,879,612,204.12   | (2,545,646,807.33) |

(3) 未确认递延所得税资产明细

|       | 2021年6月30日     | 2020年12月31日    |
|-------|----------------|----------------|
| 可抵扣亏损 | 755,141,190.34 | 877,560,629.54 |

(4) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的到期情况

| 年份         | 2021年6月30日     | 2020年12月31日    |
|------------|----------------|----------------|
| 2021年      | -              | -              |
| 2022年      | -              | -              |
| 2023年      | -              | -              |
| 2024年      | -              | -              |
| 2025年及以后年度 | 755,141,190.34 | 877,560,629.54 |
| 合计         | 755,141,190.34 | 877,560,629.54 |

20 其他资产

(1) 其他资产按类别分析如下

|        | 2021年6月30日       | 2020年12月31日      |
|--------|------------------|------------------|
| 其他应收款  | 419,581,248.07   | 310,992,759.97   |
| 长期待摊费用 | 254,248,391.79   | 283,319,947.64   |
| 应收利息   | 200,549,325.62   | 161,662,333.45   |
| 预付款项   | 123,324,612.31   | 206,754,419.12   |
| 待抵扣增值税 | 71,076,090.00    | 56,164,504.52    |
| 抵债资产   | 29,912,930.75    | 29,912,930.75    |
| 待摊费用   | 21,463,539.01    | 19,424,913.02    |
| 应收股利   | 17,096,825.02    | 15,469,330.54    |
| 预缴所得税  | 30,639.91        | 63,074,122.34    |
| 其他     | 246,222,466.48   | 267,952,853.87   |
| 合计     | 1,383,506,068.96 | 1,414,728,115.22 |

## (2) 其他应收款

## (a) 其他应收款按类别分析如下

|         | 2021年6月30日       | 2020年12月31日      |
|---------|------------------|------------------|
| 其他应收款余额 | 1,286,887,812.15 | 1,109,045,767.92 |
| 减：坏账准备  | (867,306,564.08) | (798,053,007.95) |
| 其他应收款净值 | 419,581,248.07   | 310,992,759.97   |

## (b) 其他应收款按账龄分析如下

|           | 2021年6月30日       |        |                |        |
|-----------|------------------|--------|----------------|--------|
|           | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|           | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) |
| 1年以内      | 318,527,761.94   | 24.75  | 1,687,000.17   | 0.19   |
| 1至2年(含2年) | 371,747,902.56   | 28.89  | 330,269,801.11 | 38.08  |
| 2至3年(含3年) | 155,435,061.49   | 12.08  | 142,133,639.44 | 16.39  |
| 3年以上      | 441,177,086.16   | 34.28  | 393,216,123.36 | 45.34  |
| 合计        | 1,286,887,812.15 | 100.00 | 867,306,564.08 | 100.00 |

|           | 2020年12月31日      |        |                |        |
|-----------|------------------|--------|----------------|--------|
|           | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|           | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) |
| 1年以内      | 182,118,817.97   | 16.42  | 15,835,731.85  | 1.98   |
| 1至2年(含2年) | 377,247,034.39   | 34.02  | 293,213,258.06 | 36.74  |
| 2至3年(含3年) | 178,463,465.54   | 16.09  | 160,947,749.13 | 20.17  |
| 3年以上      | 371,216,450.02   | 33.47  | 328,056,268.91 | 41.11  |
| 合计        | 1,109,045,767.92 | 100.00 | 798,053,007.95 | 100.00 |

账龄自其他应收款确认日起开始计算。

(c) 其他应收款按减值准备评估方式分析如下

|          | 2021年6月30日       |        |                |        |
|----------|------------------|--------|----------------|--------|
|          | 账面余额             |        | 坏账准备           |        |
|          | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 比例 (%) |
| 单独计提减值准备 | 804,017,255.91   | 62.48  | 795,478,547.77 | 91.72  |
| 组合计提减值准备 | 482,870,556.24   | 37.52  | 71,828,016.31  | 8.28   |
| 合计       | 1,286,887,812.15 | 100.00 | 867,306,564.08 | 100.00 |

|          | 2020年12月31日      |        |                |          |
|----------|------------------|--------|----------------|----------|
|          | 账面余额             |        | 坏账准备           |          |
|          | 金额               | 比例 (%) | 金额             | 计提比例 (%) |
| 单独计提减值准备 | 772,081,270.96   | 69.62  | 772,081,270.96 | 96.75    |
| 组合计提减值准备 | 336,964,496.96   | 30.38  | 25,971,736.99  | 3.25     |
| 合计       | 1,109,045,767.92 | 100.00 | 798,053,007.95 | 100.00   |

账龄自其他应收款确认日起开始计算。

(d) 本期计提、收回或转回的坏账准备情况：

2021年1-6月其他应收款坏账准备的变动情况参见附注五、21。

(e) 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             | 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         | 146,196,972.87 | 1至2年 | 11.35           |
| 四通集团公司        | 占用原受托管理营业部资金 | 106,795,900.10 | 3年以上 | 8.30            |
| 张庆文           | 应收债权         | 84,912,289.89  | 1年以内 | 6.60            |
| 招商期货有限公司      | 应收债权         | 71,813,001.04  | 2至3年 | 5.58            |
| 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 | 4.85            |
| 合计            |              | 472,083,190.90 |      | 36.68           |

(f) 截至2021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           | 本期购入         | 在建工程转入        | 本期摊销            | 期末余额           |
|----------|----------------|--------------|---------------|-----------------|----------------|
| 固定资产改良支出 | 162,545,393.42 | 5,922,408.09 | 15,570,417.87 | (35,220,338.78) | 148,817,880.60 |
| 其他       | 120,774,554.22 | -            | -             | (15,344,043.03) | 105,430,511.19 |
| 合计       | 283,319,947.64 | 5,922,408.09 | 15,570,417.87 | (50,564,381.81) | 254,248,391.79 |

## 21 资产减值准备

## (1) 各项减值准备的变动情况：

|                | 期初余额             | 计提             | 本期减少             |                 | 期末余额             |
|----------------|------------------|----------------|------------------|-----------------|------------------|
|                |                  |                | 转回               | 核销 / 转销         |                  |
| 货币资金减值准备       | 1,429,663.68     | 5,977,282.62   | (1,360,270.63)   | -               | 6,046,675.67     |
| 融出资金减值准备       | 1,468,250,953.79 | 261,657,316.63 | (345,983,970.98) | (23,289,076.30) | 1,360,635,223.14 |
| 买入返售金融资产减值准备   | 1,039,412,436.94 | 36,494,025.63  | (211,182,180.44) | -               | 864,724,282.13   |
| 应收款项坏账准备       | 63,300,769.06    | 4,776,115.18   | (21,250,636.97)  | -               | 46,826,247.27    |
| 债权投资金融资产减值准备   | 28,567,324.98    | 11,478,058.92  | (1,949,843.47)   | (499,862.04)    | 37,595,678.39    |
| 其他债权投资金融资产减值准备 | 68,018,586.14    | 475,641.52     | (1,571,045.39)   | -               | 66,923,182.27    |
| 其他应收款坏账准备      | 798,053,007.95   | 88,514,890.71  | (19,261,334.58)  | -               | 867,306,564.08   |
| 应收利息坏账准备       | 34,284,000.09    | 1,579,499.84   | (1,420,702.01)   | -               | 34,442,797.92    |
| 金融工具信用减值准备小计   | 3,501,316,742.63 | 410,952,831.05 | (603,979,984.47) | (23,788,938.34) | 3,284,500,650.87 |
| 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       | -                | -              | -                | -               | -                |
| 其他资产减值准备小计     | 30,659,948.47    | -              | -                | -               | 30,659,948.47    |
| 合计             | 3,531,976,691.10 | 410,952,831.05 | (603,979,984.47) | (23,788,938.34) | 3,315,160,599.34 |

(2) 按阶段划分的预期信用损失减值准备：

| 2021年6月30日     |                       |                              |                              |                         |
|----------------|-----------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------|
|                | 未来12个月<br>预期信用损失      | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(未发生信用减值) | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(已发生信用减值) | 合计                      |
| 货币资金减值准备       | 6,046,675.67          | -                            | -                            | 6,046,675.67            |
| 融出资金减值准备       | 385,060,213.76        | 878,307,744.53               | 97,267,264.85                | 1,360,635,223.14        |
| 买入返售金融资产减值准备   | 12,458,136.19         | 1,465,016.04                 | 850,801,129.90               | 864,724,282.13          |
| 应收款项坏账准备       | -                     | 46,826,247.27                | -                            | 46,826,247.27           |
| 债权投资金融资产减值准备   | 11,938,678.39         | 25,657,000.00                | -                            | 37,595,678.39           |
| 其他债权投资金融资产减值准备 | 66,923,182.27         | -                            | -                            | 66,923,182.27           |
| 其他应收款坏账准备      | -                     | 71,828,016.30                | 795,478,547.78               | 867,306,564.08          |
| 应收利息坏账准备       | -                     | -                            | 34,442,797.92                | 34,442,797.92           |
| 合计             | <u>482,426,886.28</u> | <u>1,024,084,024.14</u>      | <u>1,777,989,740.45</u>      | <u>3,284,500,650.87</u> |

| 2020年12月31日    |                       |                              |                              |                         |
|----------------|-----------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------------|
|                | 未来12个月<br>预期信用损失      | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(未发生信用减值) | 整个存续期<br>预期信用损失<br>(已发生信用减值) | 合计                      |
| 货币资金减值准备       | 1,429,663.68          | -                            | -                            | 1,429,663.68            |
| 融出资金减值准备       | 355,422,223.65        | 996,449,335.22               | 116,379,394.92               | 1,468,250,953.79        |
| 买入返售金融资产减值准备   | 11,995,971.64         | 135,100.00                   | 1,027,281,365.30             | 1,039,412,436.94        |
| 应收款项坏账准备       | -                     | 63,300,769.06                | -                            | 63,300,769.06           |
| 债权投资金融资产减值准备   | 2,910,324.98          | 25,657,000.00                | -                            | 28,567,324.98           |
| 其他债权投资金融资产减值准备 | 68,018,586.14         | -                            | -                            | 68,018,586.14           |
| 其他应收款坏账准备      | -                     | 25,971,736.99                | 772,081,270.96               | 798,053,007.95          |
| 应收利息坏账准备       | -                     | -                            | 34,284,000.09                | 34,284,000.09           |
| 合计             | <u>439,776,770.09</u> | <u>1,111,513,941.27</u>      | <u>1,950,026,031.27</u>      | <u>3,501,316,742.63</u> |

## 22 短期借款

|      | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
|------|-------------------|-------------------|
| 信用借款 | 7,474,239,604.44  | 11,194,653,748.20 |
| 质押借款 | 6,807,885,781.03  | 105,205,040.42    |
| 合计   | 14,282,125,385.47 | 11,299,858,788.62 |

## 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                 |       |
| 短期融资券 | 20 华泰 CP010 | 人民币 5,000,000,000  | 15/12/2020 | 3 个月  | 人民币 5,000,000,000  | 2.94% |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP001 | 人民币 3,000,000,000  | 25/01/2021 | 3 个月  | 人民币 3,000,000,000  | 2.48% |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP002 | 人民币 3,000,000,000  | 27/01/2021 | 3 个月  | 人民币 3,000,000,000  | 2.42% |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP003 | 人民币 3,000,000,000  | 09/03/2021 | 3 个月  | 人民币 3,000,000,000  | 2.68% |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP004 | 人民币 4,000,000,000  | 25/06/2021 | 3 个月  | 人民币 4,000,000,000  | 2.40% |
| 公司债   | 20 华泰 G5    | 人民币 2,300,000,000  | 18/06/2020 | 1 年   | 人民币 2,300,000,000  | 2.58% |
| 短期公司债 | 20 华泰 S1    | 人民币 5,500,000,000  | 31/08/2020 | 1 年   | 人民币 5,500,000,000  | 3.10% |
| 短期公司债 | 20 华泰 S2    | 人民币 1,500,000,000  | 31/08/2020 | 270 天 | 人民币 1,500,000,000  | 3.05% |
| 短期公司债 | 20 华泰 S3    | 人民币 5,000,000,000  | 11/09/2020 | 334 天 | 人民币 5,000,000,000  | 3.20% |
| 短期公司债 | 20 华泰 S4    | 人民币 4,000,000,000  | 17/09/2020 | 212 天 | 人民币 4,000,000,000  | 3.15% |
| 短期公司债 | 21 华泰 S2    | 人民币 4,000,000,000  | 28/06/2021 | 3 个月  | 人民币 4,000,000,000  | 2.95% |
| 境外债   | 华泰 B2111    | 美元 50,000,000      | 27/11/2020 | 1 年   | 美元 50,000,000      | 0.50% |
| 境外债   | 华泰 B2112    | 美元 60,000,000      | 03/02/2021 | 328 天 | 美元 60,000,000      | 1.35% |
| 境外债   | 华泰 B2108a   | 美元 20,000,000      | 10/02/2021 | 6 个月  | 美元 20,000,000      | 1.23% |
| 境外债   | 华泰 B2203    | 美元 100,000,000     | 23/03/2021 | 1 年   | 美元 100,000,000     | 0.35% |
| 境外债   | 华泰 B2108b   | 美元 35,000,000      | 12/05/2021 | 3 个月  | 美元 35,000,000      | 0.50% |
| 境外债   | 华泰 B2112    | 美元 100,000,000     | 03/02/2021 | 328 天 | 美元 100,000,000     | 1.35% |
| 境外债   | 华泰 B2206    | 美元 100,000,000     | 11/06/2021 | 1 年   | 美元 100,000,000     | 0.70% |
| 收益凭证  | 收益凭证 (1)    | 人民币 13,072,068,000 | 注 (1)      | 注 (1) | 人民币 13,072,068,000 | 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             |
| 短期融资券 | 20 华泰 CP010 | 5,006,846,575.34  | 29,400,000.00     | (5,036,246,575.34)  | -                 |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP001 | -                 | 3,018,345,205.48  | (3,018,345,205.48)  | -                 |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP002 | -                 | 3,017,901,369.86  | (3,017,901,369.86)  | -                 |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP003 | -                 | 3,019,824,657.53  | (3,019,824,657.53)  | -                 |
| 短期融资券 | 21 华泰 CP004 | -                 | 4,001,578,082.21  | -                   | 4,001,578,082.21  |
| 公司债   | 20 华泰 G5    | 2,331,812,833.34  | 27,527,166.67     | (2,359,340,000.01)  | -                 |
| 短期公司债 | 20 华泰 S1    | 5,557,300,456.62  | 85,250,000.00     | -                   | 5,642,550,456.62  |
| 短期公司债 | 20 华泰 S2    | 1,515,375,342.47  | 18,937,157.53     | (1,534,312,500.00)  | -                 |
| 短期公司债 | 20 华泰 S3    | 5,053,333,333.33  | 80,000,000.00     | -                   | 5,133,333,333.33  |
| 短期公司债 | 20 华泰 S4    | 4,042,000,000.00  | 37,100,000.00     | (4,079,100,000.00)  | -                 |
| 短期公司债 | 21 华泰 S2    | -                 | 4,000,983,333.33  | -                   | 4,000,983,333.33  |
| 境外债   | 华泰 B2111    | 323,744,706.92    | 2,037,705.22      | (1,969,359.39)      | 323,813,052.75    |
| 境外债   | 华泰 B2112    | -                 | 389,823,046.14    | -                   | 389,823,046.14    |
| 境外债   | 华泰 B2108a   | -                 | 129,847,355.87    | -                   | 129,847,355.87    |
| 境外债   | 华泰 B2203    | -                 | 642,258,368.40    | -                   | 642,258,368.40    |
| 境外债   | 华泰 B2108b   | -                 | 226,308,546.14    | -                   | 226,308,546.14    |
| 境外债   | 华泰 B2112    | -                 | 646,013,864.80    | -                   | 646,013,864.80    |
| 境外债   | 华泰 B2206    | -                 | 645,101,348.32    | -                   | 645,101,348.32    |
| 收益凭证  | 收益凭证 (1)    | 20,120,974,354.72 | 36,570,767,955.52 | (43,605,453,680.80) | 13,086,288,629.44 |
| 合计    |             | 43,951,387,602.74 | 56,589,005,163.02 | (65,672,493,348.41) | 34,867,899,417.35 |

(1) 本公司于本期共发行 1,823 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 2.20%-6.58%。

## 24 拆入资金

|         | 2021 年 6 月 30 日  | 2020 年 12 月 31 日 |
|---------|------------------|------------------|
| 银行拆入资金  | 6,117,116,248.62 | 4,815,235,806.67 |
| 转融通融入资金 | -                | -                |
| 合计      | 6,117,116,248.62 | 4,815,235,806.67 |

## 25 交易性金融负债

## (1) 按项目列示

|                           | 2021年6月30日        | 2020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 | 19,075,208,304.76 | 11,469,173,777.28 |
| 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 | 3,975,321,176.67  | 3,912,356,252.32  |
| 合计                        | 23,050,529,481.43 | 15,381,530,029.60 |

## (2) 按类别列示

|      | 2021年6月30日                        |                                   |                   |
|------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------|
|      | 分类为以公允价值<br>计量且其变动计入<br>当期损益的金融负债 | 指定为以公允价值<br>计量且其变动计入<br>当期损益的金融负债 | 公允价值合计            |
| 股票   | 863,937,871.46                    | -                                 | 863,937,871.46    |
| 债务工具 | 18,211,270,433.30                 | -                                 | 18,211,270,433.30 |
| 其他   | -                                 | 3,975,321,176.67                  | 3,975,321,176.67  |
| 合计   | 19,075,208,304.76                 | 3,975,321,176.67                  | 23,050,529,481.43 |

|      | 2020年12月31日                       |                                   |                   |
|------|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------|
|      | 分类为以公允价值<br>计量且其变动计入<br>当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值<br>计量且其变动计入<br>当期损益的金融资产 | 公允价值合计            |
| 股票   | 240,150,844.10                    | -                                 | 240,150,844.10    |
| 债务工具 | 11,229,022,933.18                 | -                                 | 11,229,022,933.18 |
| 其他   | -                                 | 3,912,356,252.32                  | 3,912,356,252.32  |
| 合计   | 11,469,173,777.28                 | 3,912,356,252.32                  | 15,381,530,029.60 |

于2021年6月30日及2020年12月31日，指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债主要为资产管理计划其他份额持有者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

|           | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 债券        | 112,459,389,593.47        | 111,403,580,154.90        |
| 贵金属       | 16,452,311,910.89         | 18,564,573,335.31         |
| 股票        | 7,698,681,971.54          | 9,631,494,143.66          |
| 信用业务债权收益权 | -                         | 300,320,833.34            |
| 合计        | <u>136,610,383,475.90</u> | <u>139,899,968,467.21</u> |

### (2) 按业务类别列示

|           | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 质押式回购     | 108,196,348,068.45        | 110,469,748,693.46        |
| 贵金属       | 16,452,311,910.89         | 18,564,573,335.31         |
| 质押式报价回购   | 6,452,776,014.54          | 7,786,425,374.91          |
| 买断式回购     | 5,508,947,482.02          | 2,778,900,230.19          |
| 信用业务债权收益权 | -                         | 300,320,833.34            |
| 合计        | <u>136,610,383,475.90</u> | <u>139,899,968,467.21</u> |

### (3) 担保物信息

|           | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 债券        | 121,677,727,661.79        | 122,560,717,191.68        |
| 贵金属       | 15,401,022,000.00         | 18,759,000,000.00         |
| 股票        | 8,481,472,713.59          | 16,653,143,097.21         |
| 信用业务债权收益权 | -                         | 311,411,219.72            |
| 合计        | <u>145,560,222,375.38</u> | <u>158,284,271,508.61</u> |

## (4) 交易所质押式报价回购剩余期限分析

|         | 2021年6月30日              | 2020年12月31日             |
|---------|-------------------------|-------------------------|
| 1个月内    | 3,565,863,607.94        | 3,883,110,408.89        |
| 1个月至3个月 | 1,669,805,576.01        | 2,516,665,611.67        |
| 3个月至1年  | 1,217,106,830.59        | 1,386,649,354.35        |
| 合计      | <u>6,452,776,014.54</u> | <u>7,786,425,374.91</u> |

于2021年6月30日，交易所质押式报价回购利率区间为1.40%–6.88%（2020年12月31日：1.40%–8.00%）。

## 27 代理买卖证券款

|        | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
|--------|---------------------------|---------------------------|
| 普通经纪业务 |                           |                           |
| 其中：个人  | 90,977,276,207.23         | 77,243,611,944.33         |
| 机构     | <u>40,082,083,198.33</u>  | <u>41,189,006,724.73</u>  |
| 小计     | <u>131,059,359,405.56</u> | <u>118,432,618,669.06</u> |
| 信用业务   |                           |                           |
| 其中：个人  | 14,205,401,207.04         | 12,450,914,127.10         |
| 机构     | <u>4,006,566,515.43</u>   | <u>5,504,101,336.10</u>   |
| 小计     | <u>18,211,967,722.47</u>  | <u>17,955,015,463.20</u>  |
| 合计     | <u>149,271,327,128.03</u> | <u>136,387,634,132.26</u> |

## 28 代理承销证券款

|         | 2021年6月30日          | 2020年12月31日          |
|---------|---------------------|----------------------|
| 股票      | -                   | 55,863,838.63        |
| 债券      | 2,902,000.00        | 15,066,500.00        |
| 其中：中期票据 | <u>2,902,000.00</u> | <u>15,066,500.00</u> |
| 合计      | <u>2,902,000.00</u> | <u>70,930,338.63</u> |

## 29 应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示：

|                | 附注      | 期初余额                     | 本期增加额                   | 本期减少额                     | 期末余额                     |
|----------------|---------|--------------------------|-------------------------|---------------------------|--------------------------|
| 短期薪酬及长期薪金      | 五、29(2) | 10,871,175,080.16        | 5,227,804,098.43        | (5,887,637,899.40)        | 10,211,341,279.19        |
| 离职后福利 - 设定提存计划 | 五、29(3) | 260,334,860.34           | 357,667,460.44          | (235,674,434.59)          | 382,327,886.19           |
| 合计             |         | <u>11,131,509,940.50</u> | <u>5,585,471,558.87</u> | <u>(6,123,312,333.99)</u> | <u>10,593,669,165.38</u> |

2021年上半年，本公司向关键管理人员支付的薪酬总额为人民币 4,295 万元 (2020 年上半年：人民币 2,686 万元)。

(2) 短期薪酬及长期薪金

|             | 期初余额                     | 本期增加额                   | 本期减少额                     | 期末余额                     |
|-------------|--------------------------|-------------------------|---------------------------|--------------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 10,813,253,442.95        | 4,854,612,187.83        | (5,495,646,178.04)        | 10,172,219,452.74        |
| 职工福利费       | -                        | 84,320,549.74           | (84,302,978.52)           | 17,571.22                |
| 社会保险费       | 2,010,120.03             | 115,170,090.89          | (114,276,578.88)          | 2,903,632.04             |
| 其中：医疗保险费    | 1,967,999.46             | 109,206,825.16          | (108,392,256.76)          | 2,782,567.86             |
| 工伤保险费       | 17,524.14                | 1,719,800.59            | (1,688,421.54)            | 48,903.19                |
| 生育保险费       | 24,596.43                | 4,243,465.14            | (4,195,900.58)            | 72,160.99                |
| 住房公积金       | 8,307.58                 | 133,935,984.90          | (133,829,062.61)          | 115,229.87               |
| 工会经费和职工教育经费 | 55,903,209.60            | 39,765,285.07           | (59,583,101.35)           | 36,085,393.32            |
| 合计          | <u>10,871,175,080.16</u> | <u>5,227,804,098.43</u> | <u>(5,887,637,899.40)</u> | <u>10,211,341,279.19</u> |

于 2021 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 5,627,796,347.95 元 (2020 年 12 月 31 日：人民币 6,974,615,214.85 元)。

(3) 离职后福利 - 设定提存计划

|         | 期初余额                  | 本期增加额                 | 本期减少额                   | 期末余额                  |
|---------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
| 基本养老保险费 | 2,444,840.33          | 232,832,718.66        | (230,883,003.31)        | 4,394,555.68          |
| 失业保险费   | 66,787.23             | 4,834,741.78          | (4,791,431.28)          | 110,097.73            |
| 企业年金缴费  | 257,823,232.78        | 120,000,000.00        | -                       | 377,823,232.78        |
| 合计      | <u>260,334,860.34</u> | <u>357,667,460.44</u> | <u>(235,674,434.59)</u> | <u>382,327,886.19</u> |

## 30 应交税费

|       | 2021年6月30日     | 2020年12月31日      |
|-------|----------------|------------------|
| 企业所得税 | 413,505,616.48 | 1,275,589,196.74 |
| 个人所得税 | 258,578,719.10 | 340,789,354.77   |
| 增值税   | 128,280,830.46 | 297,947,650.95   |
| 教育费附加 | 6,435,871.44   | 13,868,534.18    |
| 房产税   | 5,467,870.68   | 6,920,241.63     |
| 城建税   | 8,055,076.76   | 6,908,219.78     |
| 其他    | 25,836,412.52  | 7,960,177.96     |
| 合计    | 846,160,397.44 | 1,949,983,376.01 |

## 31 应付款项

|            | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
|------------|-------------------|-------------------|
| 应付交易款项     | 53,818,031,319.84 | 36,314,243,980.24 |
| 应付清算款      | 5,072,131,306.01  | 5,131,182,668.82  |
| 开放式基金申、认购款 | 1,254,232,497.20  | 1,810,719,262.08  |
| 应付手续费及佣金   | 310,154,179.21    | 260,482,987.19    |
| 应付赎回款      | -                 | 27,215,370.86     |
| 其他         | 185,488,818.30    | 162,211,817.97    |
| 合计         | 60,640,038,120.56 | 43,706,056,087.16 |

### 32 合同负债

|           | 2021年6月30日     | 2020年12月31日   |
|-----------|----------------|---------------|
| 手续费及佣金预收款 | 106,245,421.16 | 90,314,229.81 |
| 销售货物预收款   | -              | 2,051,681.42  |
| 合计        | 106,245,421.16 | 92,365,911.23 |

合同负债主要涉及本集团保荐业务合同的预收款、管理费预收款。预收款在合同签订时收取，合同的相关收入在本集团履行履约义务后确认。

### 33 长期借款

#### (1) 长期借款分类

|      | 2021年6月30日     | 2020年12月31日    |
|------|----------------|----------------|
| 信用借款 | 956,938,159.14 | 475,413,821.66 |

#### (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          | 2021年6月30日<br>原币 | 2021年6月30日<br>等值人民币 |
|------------------|-------------|-------------|----|-------------|------------------|---------------------|
| Bank of Montreal | 2020年12月30日 | 2024年12月30日 | 美元 | LIBOR+2.00% | 148,130,548.93   | 956,938,159.14      |

| 贷款单位             | 借款起始日       | 借款终止日       | 币种 | 利率          | 2020年12月31日<br>原币 | 2020年12月31日<br>等值人民币 |
|------------------|-------------|-------------|----|-------------|-------------------|----------------------|
| Bank of Montreal | 2020年12月30日 | 2024年12月30日 | 美元 | LIBOR+2.00% | 72,861,472.46     | 475,413,821.66       |

## 34 应付债券

## (1) 应付债券

|      | 2021年6月30日         | 2020年12月31日       |
|------|--------------------|-------------------|
| 公司债  | 102,407,851,891.32 | 76,880,939,853.23 |
| 次级债  | 14,301,644,619.29  | 7,918,800,650.49  |
| 金融债  | 6,174,877,037.01   | 6,072,452,668.40  |
| 境外债  | 14,891,775,645.61  | 5,885,978,093.17  |
| 收益凭证 | 295,186,239.71     | 295,016,397.26    |
| 合计   | 138,071,335,432.94 | 97,053,187,662.55 |



(2) 应付债券的明细

| 类型       | 项目                   | 面值<br>原币              | 起息日期       | 期限                   | 发行金额<br>原币            | 票面利率  | 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             | 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  | 2013/06/05 | 10 年                 | 人民币 6,000,000,000.00  | 5.10% | 6,171,489,628.35  | 153,731,639.64   | (306,000,000.00) | 6,019,221,267.99  |       |       |      |  |
|          | 16 华泰 G2             | 人民币 2,500,000,000.00  | 2016/12/06 | 5 年                  | 人民币 2,500,000,000.00  | 3.78% | 2,508,601,254.39  | 47,250,000.00    | -                | 2,555,851,254.39  |       |       |      |  |
|          | 16 华泰 G4             | 人民币 3,000,000,000.00  | 2016/12/14 | 5 年                  | 人民币 3,000,000,000.00  | 3.97% | 3,006,353,787.34  | 59,550,000.00    | -                | 3,065,903,787.34  |       |       |      |  |
|          | 18 华泰 G1             | 人民币 3,000,000,000.00  | 2018/11/26 | 3 年                  | 人民币 3,000,000,000.00  | 3.88% | 3,010,178,788.23  | 58,636,516.75    | -                | 3,068,815,304.98  |       |       |      |  |
|          | 18 华泰 G2             | 人民币 1,000,000,000.00  | 2018/11/26 | 5 年                  | 人民币 1,000,000,000.00  | 4.17% | 1,003,413,001.87  | 20,933,915.08    | -                | 1,024,346,916.95  |       |       |      |  |
|          | 19 华泰 G1             | 人民币 7,000,000,000.00  | 2019/03/19 | 3 年                  | 人民币 7,000,000,000.00  | 3.68% | 7,199,047,904.16  | 130,585,991.52   | (257,600,000.00) | 7,072,033,895.68  |       |       |      |  |
|          | 19 华泰 G3             | 人民币 5,000,000,000.00  | 2019/04/22 | 3 年                  | 人民币 5,000,000,000.00  | 3.80% | 5,129,536,688.78  | 95,787,884.66    | (190,000,000.00) | 5,035,324,573.44  |       |       |      |  |
|          | 19 华泰 02             | 人民币 5,000,000,000.00  | 2019/05/27 | 3 年                  | 人民币 5,000,000,000.00  | 3.94% | 5,115,538,772.89  | 99,283,064.09    | (197,000,000.00) | 5,017,821,836.98  |       |       |      |  |
|          | 19 华泰 03             | 人民币 4,000,000,000.00  | 2019/10/24 | 3 年                  | 人民币 4,000,000,000.00  | 3.68% | 4,025,006,457.04  | 74,222,365.13    | -                | 4,099,228,822.17  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G1             | 人民币 8,000,000,000.00  | 2020/03/26 | 3 年                  | 人民币 8,000,000,000.00  | 2.99% | 8,177,637,856.80  | 120,826,627.58   | (239,200,000.00) | 8,059,264,484.38  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G3             | 人民币 3,500,000,000.00  | 2020/04/29 | 5 年                  | 人民币 3,500,000,000.00  | 2.90% | 3,565,376,172.99  | 51,061,333.54    | (101,500,000.00) | 3,514,937,506.53  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G4             | 人民币 3,000,000,000.00  | 2020/05/21 | 5 年                  | 人民币 3,000,000,000.00  | 3.20% | 3,056,359,141.93  | 48,340,102.81    | (96,075,990.34)  | 3,008,623,254.40  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G6             | 人民币 3,200,000,000.00  | 2020/06/18 | 3 年                  | 人民币 3,200,000,000.00  | 3.10% | 3,250,724,999.92  | 49,880,775.92    | (99,200,000.00)  | 3,201,405,775.84  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G7             | 人民币 3,500,000,000.00  | 2020/11/24 | 3 年                  | 人民币 3,500,000,000.00  | 3.90% | 3,512,736,501.40  | 68,496,273.16    | -                | 3,581,232,774.56  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G8             | 人民币 4,000,000,000.00  | 2020/12/09 | 2 年                  | 人民币 4,000,000,000.00  | 3.67% | 4,008,065,206.57  | 70,597,105.11    | -                | 4,078,662,311.68  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 G9             | 人民币 4,000,000,000.00  | 2020/12/09 | 3 年                  | 人民币 4,000,000,000.00  | 3.79% | 4,008,442,571.63  | 75,956,363.98    | -                | 4,084,398,935.61  |       |       |      |  |
|          | 20 华泰 02             | 人民币 10,000,000,000.00 | 2020/07/24 | 2 年                  | 人民币 10,000,000,000.00 | 3.20% | 10,132,431,118.94 | 162,297,520.04   | -                | 10,294,728,638.98 |       |       |      |  |
|          | 21 华泰 G1             | 人民币 4,000,000,000.00  | 2021/01/20 | 3 年                  | 人民币 4,000,000,000.00  | 3.58% | -                 | 4,064,844,062.15 | (3,860,377.36)   | 4,060,983,684.79  |       |       |      |  |
|          | 21 华泰 G3             | 人民币 5,000,000,000.00  | 2021/04/26 | 3 年                  | 人民币 5,000,000,000.00  | 3.42% | -                 | 5,031,155,313.72 | (4,825,471.70)   | 5,026,329,842.02  |       |       |      |  |
|          | 21 华泰 G4             | 人民币 6,000,000,000.00  | 2021/05/17 | 5 年                  | 人民币 6,000,000,000.00  | 3.71% | -                 | 6,027,659,544.55 | (5,790,566.03)   | 6,021,868,978.52  |       |       |      |  |
| 21 华泰 G5 | 人民币 4,000,000,000.00 | 2021/05/24            | 3 年        | 人民币 4,000,000,000.00 | 3.28%                 | -     | 4,013,885,880.49  | (3,860,377.36)   | 4,010,025,503.13 |                   |       |       |      |  |
| 21 华泰 G6 | 人民币 2,000,000,000.00 | 2021/05/24            | 5 年        | 人民币 2,000,000,000.00 | 3.63%                 | -     | 2,007,649,059.13  | (1,930,188.68)   | 2,005,718,870.45 |                   |       |       |      |  |
| 21 华泰 G7 | 人民币 2,000,000,000.00 | 2021/06/15            | 3 年        | 人民币 2,000,000,000.00 | 3.40%                 | -     | 2,003,049,478.37  | (1,930,188.68)   | 2,001,119,289.69 |                   |       |       |      |  |
| 21 华泰 09 | 人民币 2,500,000,000.00 | 2021/06/21            | 3 年        | 人民币 2,500,000,000.00 | 3.45%                 | -     | 2,502,417,116.67  | (2,412,735.85)   | 2,500,004,380.82 |                   |       |       |      |  |

小计 76,880,939,853.23 27,038,097,934.09 (1,511,185,896.00) 102,407,851,891.32

| 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 |                  | 原币                | 人民币              | 原币                | 人民币                | 原币                | 人民币                | 原币   | 人民币 |
| 次级债  | 18 华泰 C2            | 人民币 2,800,000,000.00 |     | 2018/05/10 | 3 年  | 人民币 2,800,000,000.00 |     | 5.20%            | 2,893,742,306.79  |                  | 48,335,112.56     | (2,942,077,419.35) |                   | -                  |      |     |
|      | 20 华泰 C1            | 人民币 5,000,000,000.00 |     | 2020/11/13 | 5 年  | 人民币 5,000,000,000.00 |     | 4.48%            | 5,025,058,343.70  |                  | 113,088,843.10    | (395,530.85)       |                   | 5,137,751,655.95   |      |     |
|      | 21 华泰 C1            | 人民币 9,000,000,000.00 |     | 2021/01/29 | 5 年  | 人民币 9,000,000,000.00 |     | 4.50%            | -                 |                  | 9,173,274,759.91  | (9,381,796.57)     |                   | 9,163,892,963.34   |      |     |
|      | 小计                  |                      |     |            |      |                      |     |                  | 7,918,800,650.49  |                  | 9,334,698,715.57  | (2,951,854,746.77) |                   | 14,301,644,619.29  |      |     |
| 金融债  | 19 华泰金融债 01         | 人民币 6,000,000,000.00 |     | 2019/08/21 | 3 年  | 人民币 6,000,000,000.00 |     | 3.40%            | 6,072,452,668.40  |                  | 102,424,368.61    |                    |                   | 6,174,877,037.01   |      |     |
|      | 小计                  |                      |     |            |      |                      |     |                  |                   |                  |                   |                    |                   |                    |      |     |
| 境外债  | HUATAI B2205        | 美元 500,000,000.00    |     | 2019/05/16 | 3 年  | 美元 500,000,000.00    |     | 3.38%            | 3,274,423,563.09  |                  | 15,433,855.01     | (43,466,151.47)    |                   | 3,246,391,266.63   |      |     |
|      | HUATAI B2302        | 美元 400,000,000.00    |     | 2020/02/12 | 3 年  | 美元 400,000,000.00    |     | LIBOR+0.95%      | 2,611,554,530.08  |                  | 5,090,235.50      | (30,980,043.13)    |                   | 2,585,664,722.45   |      |     |
|      | HUATAI B2404        | 美元 900,000,000.00    |     | 2021/04/09 | 3 年  | 美元 900,000,000.00    |     | 1.30%            | -                 |                  | 5,823,142,410.92  |                    |                   | 5,823,142,410.92   |      |     |
|      | HUATAI B2604        | 美元 500,000,000.00    |     | 2021/04/09 | 5 年  | 美元 500,000,000.00    |     | 2.000%           | -                 |                  | 3,236,577,245.61  |                    |                   | 3,236,577,245.61   |      |     |
| 小计   |                     |                      |     |            |      |                      |     | 5,885,978,093.17 |                   | 9,080,243,747.04 | (74,446,194.60)   |                    | 14,891,775,645.61 |                    |      |     |
| 收益凭证 | 收益凭证 <sup>(1)</sup> | 人民币 322,000,000.00   |     | 注(1)       | 注(1) | 人民币 322,000,000.00   |     | 注(1)             | 295,016,397.26    |                  | 169,842.45        |                    |                   | 295,186,239.71     |      |     |
|      | 合计                  |                      |     |            |      |                      |     |                  | 97,053,187,662.55 |                  | 45,555,634,607.76 | (4,537,486,837.37) |                   | 138,071,335,432.94 |      |     |

(1) 本公司本期未发行期限大于一年收益凭证。

### 35 租赁负债

|            | 2021年6月30日       | 2020年12月31日      |
|------------|------------------|------------------|
| 一年内到期的流动负债 | 406,007,267.66   | 398,069,317.91   |
| 一年以上的非流动负债 | 896,526,625.82   | 850,730,560.94   |
| 合计         | 1,302,533,893.48 | 1,248,799,878.85 |

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。于2021年1-6月未确认使用权资产和租赁负债，短期租赁、低价值资产和未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额为人民币28,834,135.05元(2020年1-6月：人民币37,042,596.89元)。

(b) 于2021年6月30日及2020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       | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额       |
|--------|------------|------|------|------------|
| 租赁还原成本 | 101,047.62 | -    | -    | 101,047.62 |

### 37 其他负债

(1) 其他负债按类别分析如下

|                  | 注   | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
|------------------|-----|-------------------|-------------------|
| 合并结构化主体形成的其他金融负债 | (a) | 54,002,147,216.03 | 59,032,382,565.10 |
| 应付股利             |     | 3,625,645,278.00  | -                 |
| 其他应付款            | (b) | 2,734,873,059.86  | 1,740,837,698.23  |
| 期货风险准备金          | (c) | 160,412,427.21    | 144,621,504.60    |
| 代理兑付证券款          |     | 50,976,683.63     | 31,312,132.73     |
| 递延收益             | (d) | 10,958,142.88     | 10,958,142.88     |
| 其他               |     | 31,116,423.48     | 70,649,129.19     |
| 合计               |     | 60,616,129,231.09 | 61,030,761,172.73 |

## (a) 合并结构化主体形成的其他金融负债

合并结构化主体形成的其他金融负债为本集团纳入合并范围内结构化主体产生的应付其他权益持有人享有的权益。纳入合并范围的结构化主体信息详见附注七、3。

## (b) 其他应付款

其他应付款按款项性质列示如下：

| 项目             | 2021年6月30日              | 2020年12月31日             |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
| 发行可交换债券担保抵押分红款 | 1,380,776,740.09        | 1,178,430,450.70        |
| 限制性股票回购义务      | 395,745,600.00          | -                       |
| 信息技术服务费        | 147,237,263.97          | 87,654,698.04           |
| 应付转融券权益补偿款     | 73,486,620.20           | -                       |
| 应付证券投资者保护基金款项  | 64,110,025.48           | 57,172,531.19           |
| 办公楼工程款         | 54,970,903.51           | 56,571,473.14           |
| 其他             | 618,545,906.61          | 361,008,545.16          |
| 合计             | <u>2,734,873,059.86</u> | <u>1,740,837,698.23</u> |

## (c) 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。

## (d) 递延收益

|         | 期初余额                 | 本期增加     | 本期减少     | 期末余额                 | 形成原因     |
|---------|----------------------|----------|----------|----------------------|----------|
| 政府补助（注） | 10,958,142.88        | -        | -        | 10,958,142.88        |          |
| - 与资产相关 | 10,958,142.88        | -        | -        | 10,958,142.88        |          |
| 其中：     |                      |          |          |                      |          |
| 购置办公用房  | 10,958,142.88        | -        | -        | 10,958,142.88        | 补贴购置办公用房 |
| - 与收益相关 | -                    | -        | -        | -                    |          |
| 合计      | <u>10,958,142.88</u> | <u>-</u> | <u>-</u> | <u>10,958,142.88</u> |          |

注：本集团确认为递延收益的政府补助，参见附注五、48。

### 38 股本

|      | 本期变动增减           |      |    |       |    |    | 期末余额             |
|------|------------------|------|----|-------|----|----|------------------|
|      | 期初余额             | 发行新股 | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 |                  |
| 股份总数 | 9,076,650,000.00 | -    | -  | -     | -  | -  | 9,076,650,000.00 |

### 39 资本公积

|        | 期初余额              | 本期增加          | 本期减少             | 期末余额              |
|--------|-------------------|---------------|------------------|-------------------|
| 股本溢价   | 69,903,564,158.05 | -             | (425,850,615.66) | 69,477,713,542.39 |
| 其他资本公积 | 846,488,489.77    | 76,743,338.61 | -                | 923,231,828.38    |
| 合计     | 70,750,052,647.82 | 76,743,338.61 | (425,850,615.66) | 70,400,945,370.77 |

### 40 库存股

|     | 期初余额             | 本期增加          | 本期减少             | 期末余额             |
|-----|------------------|---------------|------------------|------------------|
| 库存股 | 1,626,546,421.80 | 48,963,487.30 | (443,962,880.00) | 1,231,547,029.10 |
| 合计  | 1,626,546,421.80 | 48,963,487.30 | (443,962,880.00) | 1,231,547,029.10 |

2020年3月30日，本公司第五届董事会第五次会议审议通过了《关于以集中竞价交易方式回购公司A股股份方案的议案》。截至2021年6月30日，本公司累计通过上海证券交易所集中竞价方式累计回购本公司90,766,495股A股股票，购买的最高价为人民币23.08元/股，最低价为人民币17.19元/股，购股成本为人民币1,675,361,296.88元，交易费用人民币148,612.22元，合计增加库存股人民币1,675,509,909.10元。

2021年3月23日，本公司召开第五届董事会第十四次会议，审议通过了《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。截至2021年6月30日止，公司共收到810名激励对象缴纳的认购资金人民币413,940,800.00元，按照授予限制性股票的库存股数量减少库存股人民币839,708,480.00元，库存股面额高于认购资金总额的差额人民币425,767,680.00元冲减股本溢价。限售期满后，公司为满足解除限售条件的激励对象办理解除限售事宜，因公司层面业绩考核或个人层面绩效考核导致当期可解除限售的股份未全额解除限售的，对应的限制性股票不得解除限售且不得递延至下期解除限售，由公司按照授予价格和回购时股票市场价格（董事会审议回购事项前1个交易日公司标的股票交易均价）孰低值回购。因此，本公司确认股票回购义务人民币413,940,800.00元。

2021年6月22日，经2020年度股东大会审议通过，以公司总股本9,076,650,000股扣除存放于公司回购专用证券账户且暂不用于股权激励计划的A股股份为基数，每10股派发现金红利人民币4.00元（含税）。公司限制性股票股权激励计划810名激励对象共计分配现金红利人民币18,195,200.00元。根据《A股限制性股票股权激励计划》，在解除限售前，公司进行现金分红时，激励对象就其获授的限制性股票应取得的现金分红在代扣代缴个人所得税后由激励对象享有；若该部分限制性股票未能解除限售，公司回购该部分限制性股票时应扣除激励对象已享有的该部分现金分红。因此，公司确认减少股票回购义务人民币18,195,200.00元。

#### 4.1 其他综合收益

| 项目  | 2021年1-6月                   |                  |                            |                |                  |                  |                 |                             |
|---|-----------------------------|------------------|----------------------------|----------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------------------|
|   | 归属于母公司<br>股东的其他综合<br>收益期初余额 | 本期所得税前<br>发生额    | 减：前期计入<br>其他综合收益<br>当期转入损益 | 减：所得税费用        | 合计               | 税后归属于<br>母公司     | 税后归属于<br>少数股东   | 归属于母公司<br>股东的其他综<br>合收益期末余额 |
| 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                          | 384,749,337.92              | (483,824,444.38) | -                          | 120,956,111.09 | (362,868,333.29) | (362,868,333.29) | -               | 21,881,004.63               |
| 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<br>收益中享有的份额 | 134,670,131.14              | 10,331,166.36    | -                          | -              | 10,331,166.36    | 10,331,166.36    | -               | 145,001,297.50              |
| - 其他债权投资公允价值变动                            | 37,458,881.22               | (25,844,033.49)  | 1,779,231.14               | -              | (24,064,802.35)  | (24,064,802.35)  | -               | 13,394,078.87               |
| - 其他债权投资信用减值准备                            | 68,018,586.14               | (1,095,403.87)   | -                          | -              | (1,095,403.87)   | (1,095,403.87)   | -               | 66,923,182.27               |
| - 现金流量套期储备                                | (34,347,588.68)             | 8,771,789.69     | -                          | -              | 8,771,789.69     | 8,771,789.69     | -               | (25,575,798.99)             |
| - 外币财务报表折算差额                              | (221,836,065.51)            | (94,102,115.86)  | -                          | -              | (94,102,115.86)  | (79,039,743.18)  | (15,062,372.68) | (300,875,808.69)            |
| 合计  | 368,713,282.23              | (585,763,041.55) | 1,779,231.14               | 120,956,111.09 | (463,027,699.32) | (447,965,326.64) | (15,062,372.68) | (79,252,044.41)             |

#### 42 盈余公积

|        | 期初余额             | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额             |
|--------|------------------|------|------|------------------|
| 法定盈余公积 | 5,711,066,830.18 | -    | -    | 5,711,066,830.18 |

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。

#### 43 一般风险准备

|        | 期初余额              | 本期增加          | 本期减少 | 期末余额              |
|--------|-------------------|---------------|------|-------------------|
| 一般风险准备 | 8,540,708,217.66  | 53,188,240.03 | -    | 8,593,896,457.69  |
| 交易风险准备 | 7,252,236,649.04  | -             | -    | 7,252,236,649.04  |
| 合计     | 15,792,944,866.70 | 53,188,240.03 | -    | 15,846,133,106.73 |

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）。

## 44 未分配利润

|                      | 注   | 2021年6月30日               | 2020年12月31日              |
|----------------------|-----|--------------------------|--------------------------|
| 上年年末未分配利润            |     | 28,998,618,214.13        | 23,178,411,266.43        |
| 加：本期 / 年归属于母公司股东的净利润 |     | 7,770,308,425.05         | 10,822,496,891.00        |
| 减：提取法定盈余公积           | (1) | -                        | (592,376,342.43)         |
| 提取一般风险准备             | (1) | (53,188,240.03)          | (1,708,518,611.07)       |
| 应付普通股股利              | (2) | (3,612,548,602.00)       | (2,701,394,989.80)       |
| 期末 / 年末未分配利润         | (3) | <u>33,103,189,797.15</u> | <u>28,998,618,214.13</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) 本期分配普通股股利

根据 2021 年 6 月 22 日股东大会的批准，本公司将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，即以 9,031,371,505 股为基数，每 10 股人民币 4.00 元，(2020 年 1-6 月：每 10 股人民币 3.00 元)，共人民币 3,612,548,602 元 (2020 年 1-6 月：人民币 2,701,394,989.80 元)。

## (3) 期末未分配利润的说明

截至 2021 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 1,787,605,707.37 元 (2020 年 12 月 31 日：人民币 1,787,605,707.37 元)



## 45 手续费及佣金净收入

|               | 注   | 2021年1-6月               | 2020年1-6月               |
|---------------|-----|-------------------------|-------------------------|
| 证券经纪业务净收入     |     | 3,195,756,942.74        | 2,637,479,799.43        |
| 其中：证券经纪业务收入   |     | 4,701,723,387.58        | 3,898,592,332.53        |
| 其中：代理买卖证券业务   |     | 3,885,366,340.16        | 3,409,372,243.91        |
| 交易单元席位租赁      |     | 410,147,278.23          | 303,732,579.02          |
| 代销金融产品业务      |     | 406,209,769.19          | 185,487,509.60          |
| 证券经纪业务支出      |     | (1,505,966,444.84)      | (1,261,112,533.10)      |
| 其中：代理买卖证券业务   |     | (1,505,966,444.84)      | (1,261,112,533.10)      |
| 期货经纪业务净收入     |     | 310,634,772.07          | 154,075,424.00          |
| 其中：期货经纪业务收入   |     | 939,960,201.04          | 569,245,538.61          |
| 期货经纪业务支出      |     | (629,325,428.97)        | (415,170,114.61)        |
| 投资银行业务净收入     |     | 1,817,896,911.02        | 1,261,487,107.85        |
| 其中：投资银行业务收入   |     | 1,941,006,839.75        | 1,273,767,998.61        |
| 其中：证券承销业务     |     | 1,689,972,095.57        | 1,021,332,572.56        |
| 证券保荐业务        |     | 76,732,976.46           | 16,784,695.65           |
| 财务顾问业务        | (i) | 174,301,767.72          | 235,650,730.40          |
| 投资银行业务支出      |     | (123,109,928.73)        | (12,280,890.76)         |
| 其中：证券承销业务     |     | (122,749,680.14)        | (11,573,640.76)         |
| 证券保荐业务        |     | -                       | -                       |
| 财务顾问业务        | (i) | (360,248.59)            | (707,250.00)            |
| 资产管理业务净收入     |     | 1,470,614,466.72        | 1,576,086,804.45        |
| 其中：资产管理业务收入   |     | 1,938,594,861.23        | 2,046,721,517.24        |
| 资产管理业务支出      |     | (467,980,394.51)        | (470,634,712.79)        |
| 基金管理业务净收入     |     | 130,703,313.24          | 120,909,567.66          |
| 其中：基金管理业务收入   |     | 130,703,313.24          | 120,909,567.66          |
| 投资咨询服务净收入     |     | 100,872,098.20          | 20,423,243.56           |
| 其中：投资咨询服务收入   |     | 101,245,683.10          | 20,423,243.56           |
| 投资咨询服务支出      |     | (373,584.90)            | -                       |
| 其他手续费及佣金净收入   |     | 79,960,823.64           | 29,350,990.34           |
| 其中：其他手续费及佣金收入 |     | 80,947,176.28           | 51,741,575.19           |
| 其他手续费及佣金支出    |     | (986,352.64)            | (22,390,584.85)         |
| 合计            |     | <u>7,106,439,327.63</u> | <u>5,799,812,937.29</u> |
| 其中：手续费及佣金收入合计 |     | 9,834,181,462.22        | 7,981,401,773.40        |
| 手续费及佣金支出合计    |     | (2,727,742,134.59)      | (2,181,588,836.11)      |

## (i) 财务顾问业务净收入

|             | 2021年1-6月      | 2020年1-6月      |
|-------------|----------------|----------------|
| 并购重组财务顾问净收入 | 40,950,506.13  | 81,795,660.37  |
| - 境内上市公司    | 30,939,185.38  | 81,795,660.37  |
| - 其他        | 10,011,320.75  | -              |
| 其他财务顾问业务净收入 | 132,991,013.00 | 153,147,820.03 |
| 合计          | 173,941,519.13 | 234,943,480.40 |

## 46 利息净收入

|                | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 利息收入           |                    |                    |
| 融资融券利息收入       | 4,355,753,221.99   | 2,458,695,041.03   |
| 货币资金及结算备付金利息收入 | 1,926,522,739.29   | 1,586,346,806.60   |
| 买入返售金融资产利息收入   | 257,465,521.20     | 173,051,053.62     |
| 其中：股票质押回购利息收入  | 188,776,660.05     | 103,629,029.81     |
| 债权投资利息收入       | 482,890,774.68     | 384,713,010.44     |
| 其他债权投资利息收入     | 125,108,614.70     | 95,280,387.35      |
| 其他             | 1,064,905.55       | 8,445,050.91       |
| 利息收入小计         | 7,148,805,777.41   | 4,706,531,349.95   |
| 利息支出           |                    |                    |
| 应付债券利息支出       | (2,295,895,171.07) | (1,372,843,909.41) |
| 其中：次级债券利息支出    | (337,832,286.62)   | (208,612,268.06)   |
| 卖出回购金融资产利息支出   | (1,454,026,867.12) | (1,211,083,750.31) |
| 应付短期融资款利息支出    | (202,558,265.49)   | (421,433,119.33)   |
| 代理买卖证券款利息支出    | (276,180,684.59)   | (211,524,158.79)   |
| 拆入资金利息支出       | (832,610,207.69)   | (297,025,448.45)   |
| 其中：转融通利息支出     | (631,410,771.51)   | (157,073,054.91)   |
| 长期借款利息支出       | (9,995,419.95)     | (21,948,444.00)    |
| 短期借款利息支出       | (87,609,957.77)    | (90,333,417.46)    |
| 租赁负债利息支出       | (28,285,396.36)    | (18,115,021.49)    |
| 其他             | (50,690,376.12)    | (40,091,200.30)    |
| 利息支出小计         | (5,237,852,346.16) | (3,684,398,469.54) |
| 利息净收入          | 1,910,953,431.25   | 1,022,132,880.41   |

## 47 投资收益

### (1) 投资收益按类别列示

|                   | 2021年1-6月           | 2020年1-6月          |
|-------------------|---------------------|--------------------|
| 权益法核算的长期股权投资收益    | 1,583,856,265.25    | 2,448,181,827.86   |
| 处置长期股权投资产生的投资收益   | -                   | -                  |
| 金融工具投资收益          | 4,849,085,105.12    | 6,157,762,507.40   |
| 其中：持有期间取得的收益      | 4,949,399,697.78    | 3,663,211,926.60   |
| - 交易性金融资产         | 4,385,729,553.37    | 3,661,891,926.60   |
| - 其他权益工具投资        | 618,870,144.41      | 1,320,000.00       |
| - 交易性金融负债         | (55,200,000.00)     | -                  |
| 处置金融工具取得的（损失）/ 收益 | (100,314,592.66)    | 2,494,550,580.80   |
| - 交易性金融资产         | 11,090,770,699.47   | 6,851,025,967.50   |
| - 债权投资            | 50,255,765.30       | (222,104.79)       |
| - 其他债权投资          | 1,779,231.14        | 35,612,445.90      |
| - 衍生金融工具          | (11,249,575,482.27) | (4,224,149,433.23) |
| - 交易性金融负债         | 6,455,193.70        | (167,716,294.58)   |
| 合计                | 6,432,941,370.37    | 8,605,944,335.26   |

### (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                   |               | 2021年1-6月         | 2020年1-6月         |
|---------------------------|---------------|-------------------|-------------------|
| 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        | 4,385,729,553.37  | 3,661,891,926.60  |
|                           | 处置取得收益        | 11,090,770,699.47 | 6,851,025,967.50  |
| 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 | 持有期间收益        | -                 | -                 |
|                           | 处置取得收益        | -                 | -                 |
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 持有期间收益        | -                 | -                 |
|                           | 处置取得收益 / （损失） | 6,455,193.70      | (167,716,294.58)  |
| 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        | (55,200,000.00)   | -                 |
|                           | 处置取得收益        | -                 | -                 |
| 合计                        |               | 15,427,755,446.54 | 10,345,201,599.52 |

## 48 政府补助

### 其他收益

|            | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
|------------|---------------|---------------|
| 与收益相关的政府补助 | 74,335,646.38 | 52,269,099.01 |

### 营业外收入

本集团 2021 上半年无计入营业外收入的政府补助项目（2020 年上半年：无）

#### (1) 与收益相关的政府补助

本集团 2021 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 2021 年上半年无与资产相关的政府补助。

## 49 公允价值变动收益 / ( 损失 )

|                              | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          |
|------------------------------|--------------------|--------------------|
| 交易性金融资产                      | (1,669,934,770.05) | 2,491,229,334.87   |
| 交易性金融负债                      | (416,582,858.72)   | (695,855,245.00)   |
| 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 | (680,391,869.21)   | (634,813,053.32)   |
| 衍生金融工具                       | 4,428,873,098.42   | (2,558,328,806.23) |
| 合计                           | 2,342,355,469.65   | (762,954,716.36)   |

## 50 其他业务收入

|          | 2021年1-6月      | 2020年1-6月      |
|----------|----------------|----------------|
| 大宗商品销售收入 | 416,260,730.20 | 406,670,268.47 |
| 租赁收入     | 25,607,605.79  | 49,270,910.54  |
| 其他       | 64,796,722.58  | 47,291,727.64  |
| 合计       | 506,665,058.57 | 503,232,906.65 |

51 资产处置收益 / ( 损失 )

| 项目                | 2021 年 1-6 月 | 2020 年 1-6 月 | 2021 年 1-6 月计入非经常性损益的金额 |
|-------------------|--------------|--------------|-------------------------|
| 固定资产处置利得 / ( 损失 ) | 319,213.69   | ( 5,532.42 ) | 319,213.69              |

52 税金及附加

|       | 2021 年 1-6 月   | 2020 年 1-6 月   |
|-------|----------------|----------------|
| 城建税   | 49,963,038.58  | 47,686,086.41  |
| 教育费附加 | 35,408,304.48  | 33,257,056.82  |
| 其他    | 24,508,694.37  | 20,710,206.57  |
| 合计    | 109,880,037.43 | 101,653,349.80 |

53 业务及管理费

|         | 2021 年 1-6 月     | 2020 年 1-6 月     |
|---------|------------------|------------------|
| 员工成本    | 5,674,258,831.83 | 4,499,207,038.54 |
| 研究开发费   | 296,067,892.30   | 284,755,490.86   |
| 无形资产摊销  | 248,073,601.12   | 262,881,113.09   |
| 使用权资产折旧 | 215,542,500.67   | 199,214,413.63   |
| 固定资产折旧  | 183,901,138.04   | 166,588,221.59   |
| 业务宣传费   | 142,368,739.16   | 114,380,217.93   |
| 交易所费用   | 136,364,491.30   | 90,997,747.93    |
| 咨询费     | 132,639,209.89   | 94,574,111.30    |
| 邮电通讯费   | 79,035,734.99    | 66,508,805.32    |
| 产品代销手续费 | 66,284,182.42    | 79,810,527.18    |
| 其他      | 641,682,842.18   | 605,782,609.44   |
| 合计      | 7,816,219,163.90 | 6,464,700,296.81 |

## 54 信用减值 (转回) / 损失

|                        | 2021年1-6月        | 2020年1-6月       |
|------------------------|------------------|-----------------|
| 货币资金减值损失计提 / (转回)      | 4,617,011.99     | (10,961,992.26) |
| 融出资金减值损失 (转回) / 计提     | (84,326,654.35)  | 380,453.15      |
| 应收及其他应收账款准备计提          | 52,779,034.34    | 132,029,527.30  |
| 债权投资减值损失计提 / (转回)      | 9,528,215.45     | (2,765,763.83)  |
| 其他债权投资减值损失 (转回) / 计提   | (1,095,403.87)   | 21,971,124.54   |
| 买入返售金融资产减值损失 (转回) / 计提 | (174,688,154.81) | 102,372,852.69  |
| 应收利息减值损失计提 / (转回)      | 158,797.83       | (36,043,843.05) |
| 合计                     | (193,027,153.42) | 206,982,358.54  |

## 55 其他资产减值损失

|          | 2021年1-6月 | 2020年1-6月    |
|----------|-----------|--------------|
| 其他资产减值损失 | -         | 6,380,973.07 |

## 56 其他业务成本

|          | 2021年1-6月      | 2020年1-6月      |
|----------|----------------|----------------|
| 大宗商品销售成本 | 413,313,780.61 | 408,660,440.59 |
| 投资性房地产折旧 | 7,744,555.57   | 10,614,357.47  |
| 员工成本     | 10,300,301.01  | 7,229,556.05   |
| 其他       | 25,340,664.71  | 10,791,368.93  |
| 合计       | 456,699,301.90 | 437,295,723.04 |

## 57 营业外收支

(1) 营业外收入分项目情况如下：

| 项目        | 2021年1-6月           | 2020年1-6月            | 2021年1-6月计入非经常性损益的金额 |
|-----------|---------------------|----------------------|----------------------|
| 非流动资产处置收益 | 578,101.46          | -                    | 578,101.46           |
| 违约补偿金     | 2,672.88            | 11,309,178.08        | 2,672.88             |
| 其他        | 441,040.25          | 2,421,787.81         | 441,040.25           |
| 合计        | <u>1,021,814.59</u> | <u>13,730,965.89</u> | <u>1,021,814.59</u>  |

(2) 营业外支出

| 项目         | 2021年1-6月           | 2020年1-6月            | 2021年1-6月计入非经常性损益的金额 |
|------------|---------------------|----------------------|----------------------|
| 捐赠支出       | 4,224,628.17        | 17,871,903.31        | 4,224,628.17         |
| 罚款、违约和赔偿损失 | 71,008.40           | 12,667,428.85        | 71,008.40            |
| 其他         | 2,823,139.11        | 741,155.76           | 2,823,139.11         |
| 合计         | <u>7,118,775.68</u> | <u>31,280,487.92</u> | <u>7,118,775.68</u>  |

## 58 所得税费用

|                  | 2021年1-6月        | 2020年1-6月        |
|------------------|------------------|------------------|
| 按税法及相关规定计算的当年所得税 | 1,258,692,961.12 | 1,815,981,356.35 |
| 汇算清缴差异调整         | 15,525,856.81    | (818,958.94)     |
| 递延所得税的变动         | 875,898,411.28   | 47,689,566.56    |
| 合计               | 2,150,117,229.21 | 1,862,851,963.97 |

(1) 递延所得税调整分析如下：

|             | 2021年1-6月      | 2020年1-6月     |
|-------------|----------------|---------------|
| 暂时性差异的产生和转回 | 875,898,411.28 | 47,689,566.56 |

(2) 所得税费用与会计利润的关系如下：

|                                | 2021年1-6月         | 2020年1-6月        |
|--------------------------------|-------------------|------------------|
| 税前利润                           | 10,036,901,718.76 | 8,306,061,538.22 |
| 按税率 25% 计算的预期所得税               | 2,509,225,429.69  | 2,076,515,384.57 |
| 子公司适用不同税率的影响                   | (29,832,703.99)   | 23,681,179.36    |
| 调整以前年度所得税的影响                   | 15,525,856.81     | (818,958.94)     |
| 非应税收入的影响                       | (368,639,557.95)  | (211,444,506.72) |
| 不可抵扣的成本、费用和损失的影响               | 56,745,498.76     | 51,883,303.41    |
| 使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响        | (30,604,859.80)   | (99,041,632.06)  |
| 本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响 | -                 | 19,442,826.21    |
| 其他                             | (2,302,434.31)    | 2,634,368.14     |
| 本期所得税费用                        | 2,150,117,229.21  | 1,862,851,963.97 |



## 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：

|                        |     | 2021年1-6月        | 2020年1-6月        |
|------------------------|-----|------------------|------------------|
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润（调整后） | (a) | 7,752,113,225.05 | 6,404,994,430.49 |
| 本公司发行在外普通股的加权平均数       | (b) | 8,986,001,759.14 | 9,063,474,914.64 |
| 基本每股收益（元 / 股）          |     | 0.86             | 0.71             |

(a) 归属于本公司普通股股东的合并净利润（调整后）计算过程如下：

|                        |  | 2021年1-6月        | 2020年1-6月        |
|------------------------|--|------------------|------------------|
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润      |  | 7,770,308,425.05 | 6,404,994,430.49 |
| 限制性股票红利                |  | (18,195,200.00)  | -                |
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润（调整后） |  | 7,752,113,225.05 | 6,404,994,430.49 |

(b) 普通股的加权平均数计算过程如下：

|             |  | 2021年1-6月        | 2020年1-6月        |
|-------------|--|------------------|------------------|
| 期初已发行普通股股数  |  | 9,076,650,000.00 | 9,076,650,000.00 |
| 股票回购股份加权平均数 |  | (90,648,240.86)  | (13,175,085.36)  |
| 期末普通股的加权平均数 |  | 8,986,001,759.14 | 9,063,474,914.64 |

## (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：

|                       |     | 2021年1-6月               | 2020年1-6月               |
|-----------------------|-----|-------------------------|-------------------------|
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润（稀释） | (a) | <u>7,694,513,581.78</u> | <u>6,347,622,763.09</u> |
| 本公司发行在外普通股的加权平均数（稀释）  | (b) | <u>8,987,068,783.04</u> | <u>9,063,474,914.64</u> |
| 稀释每股收益（元/股）           |     | <u>0.86</u>             | <u>0.70</u>             |

(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：

|                       |  | 2021年1-6月               | 2020年1-6月               |
|-----------------------|--|-------------------------|-------------------------|
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润     |  | 7,770,308,425.05        | 6,404,994,430.49        |
| 稀释调整：                 |  |                         |                         |
| 联营企业可转换公司债券的影响（注1）    |  | (75,721,683.35)         | (57,371,667.40)         |
| 子公司稀释性潜在普通股转换时影响（注2）  |  | <u>(73,159.92)</u>      | <u>-</u>                |
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润（稀释） |  | <u>7,694,513,581.78</u> | <u>6,347,622,763.09</u> |

(b) 普通股的加权平均数（稀释）计算过程如下：

|                 |  | 2021年1-6月               | 2020年1-6月               |
|-----------------|--|-------------------------|-------------------------|
| 期末普通股的加权平均数     |  | 8,986,001,759.14        | 9,063,474,914.64        |
| 稀释调整：           |  |                         |                         |
| 股份激励稀释作用下增加的股份数 |  | <u>1,067,023.90</u>     | <u>-</u>                |
| 期末普通股的加权平均数（稀释） |  | <u>8,987,068,783.04</u> | <u>9,063,474,914.64</u> |

注1：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2：为AssetMark Financial Holdings, Inc. 股票期权计划和限制性股票激励计划权产生的稀释效应。

## 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

|               | 2021年1-6月                | 2020年1-6月                |
|---------------|--------------------------|--------------------------|
| 收到的往来款项       | 17,097,287,669.01        | 12,710,052,724.41        |
| 收到的大宗商品交易收入   | 416,260,730.20           | 406,670,268.47           |
| 收到的政府补助及营业外收入 | 75,357,460.97            | 52,269,099.01            |
| 使用受限制货币资金的变动  | -                        | 8,708,732,465.86         |
| 其他业务收入        | 90,404,328.37            | 96,562,638.18            |
| 合计            | <u>17,679,310,188.55</u> | <u>21,974,287,195.93</u> |

### (2) 支付其他与经营活动有关的现金

|              | 2021年1-6月                | 2020年1-6月               |
|--------------|--------------------------|-------------------------|
| 合并结构化主体减少的现金 | 5,030,235,349.07         | 367,304,641.46          |
| 存出保证金本期净支付   | 1,572,786,965.72         | 1,914,062,456.56        |
| 支付的其他费用      | 2,402,108,664.17         | 1,111,412,177.94        |
| 支付大宗商品交易成本   | 413,313,780.61           | 408,660,440.59          |
| 使用受限制货币资金的变动 | 2,906,790,818.84         | -                       |
| 合计           | <u>12,325,235,578.41</u> | <u>3,801,439,716.55</u> |

### (3) 收到其他与投资活动有关的现金

|                          | 2021年1-6月           | 2020年1-6月           |
|--------------------------|---------------------|---------------------|
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产所收到的现金 | <u>3,939,040.89</u> | <u>2,078,202.17</u> |

### (4) 支付其他与投资活动有关的现金

|                         | 2021年1-6月 | 2020年1-6月             |
|-------------------------|-----------|-----------------------|
| 应付私募基金份额持有人及有限合伙人净资产减少额 | <u>-</u>  | <u>397,861,288.15</u> |

## (5) 收到其他与筹资活动有关的现金

|                 | 2021年1-6月      | 2020年1-6月 |
|-----------------|----------------|-----------|
| 收到的限制性股票激励计划认购款 | 413,940,800.00 | -         |

## (6) 支付其他与筹资活动有关的现金

|              | 2021年1-6月     | 2020年1-6月        |
|--------------|---------------|------------------|
| 回购股份支付的现金    | 48,963,487.30 | 1,284,837,353.04 |
| 发行普通股支付的发行费用 | -             | 16,292,452.83    |
| 现金及现金等价物净增加额 | 48,963,487.30 | 1,301,129,805.87 |

## (7) 将净利润调节为经营活动现金流量

|                             | 2021年1-6月           | 2020年1-6月          |
|-----------------------------|---------------------|--------------------|
| 净利润                         | 7,886,784,489.55    | 6,443,209,574.25   |
| 加：资产减值（转回）/ 损失              | (193,027,153.42)    | 213,363,331.61     |
| 固定资产及投资性房地产折旧               | 191,645,693.61      | 177,202,579.06     |
| 无形资产摊销                      | 248,073,601.12      | 262,881,113.09     |
| 长期待摊费用摊销                    | 50,564,381.81       | 41,259,764.11      |
| 使用权资产折旧                     | 215,542,500.67      | 199,214,413.63     |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的（收益）/ 损失 | (319,213.69)        | 5,532.42           |
| 公允价值变动收益                    | (1,786,227,536.17)  | (572,777,643.88)   |
| 利息支出                        | 2,048,961,691.97    | 1,721,026,122.42   |
| 汇兑损失 /（收益）                  | 141,239,487.88      | (320,191,851.67)   |
| 投资收益                        | (2,254,761,406.10)  | (2,484,892,168.97) |
| 递延所得税资产（增加）/ 减少             | (79,103,074.52)     | 9,969,764.42       |
| 递延所得税负债增加                   | 955,001,485.80      | 37,719,802.14      |
| 交易性金融工具的增加                  | (12,718,799,331.48) | (1,427,028,193.81) |
| 经营性应收项目的增加                  | (32,361,714,156.37) | (3,943,792,487.96) |
| 经营性应付项目的增加                  | 21,811,857,981.87   | 23,093,078,030.75  |
| 经营活动（使用）/ 产生的现金流量净额         | (15,844,280,557.47) | 23,450,247,681.61  |

(8) 现金及现金等价物净变动情况

|                 | 2021年1-6月            | 2020年1-6月            |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 现金及现金等价物的期末余额   | 209,886,658,720.08   | 166,877,209,105.11   |
| 减：现金及现金等价物的期初余额 | (190,449,812,345.46) | (152,070,456,856.52) |
| 现金及现金等价物净增加额    | 19,436,846,374.62    | 14,806,752,248.59    |

(9) 现金及现金等价物构成

|                | 2021年6月30日         | 2020年6月30日         |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 现金             | 194,509,127,197.28 | 151,333,186,358.42 |
| 其中：库存现金        | 206,399.89         | 413,449.91         |
| 可随时用于支付的银行存款   | 171,140,190,096.81 | 134,410,495,275.06 |
| 可随时用于支付的其他货币资金 | 72,406.79          | 1,751,732.19       |
| 结算备付金          | 23,368,658,293.79  | 16,920,525,901.26  |
| 现金等价物          | 15,377,531,522.80  | 15,544,022,746.69  |
| 现金及现金等价物余额     | 209,886,658,720.08 | 166,877,209,105.11 |

(10) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动

于2021年上半年，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

|         | 2021年6月30日          |        |                     | 2020年12月31日        |        |                    |
|---------|---------------------|--------|---------------------|--------------------|--------|--------------------|
|         | 期末外币余额              | 折算汇率   | 期末折算人民币余额           | 期末外币余额             | 折算汇率   | 期末折算人民币余额          |
| 货币资金    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | 2,422,172,178.40    | 6.4601 | 15,647,474,489.70   | 1,572,346,378.54   | 6.5249 | 10,259,402,885.31  |
| 港币      | 5,595,396,415.05    | 0.8321 | 4,655,929,356.95    | 7,314,845,763.10   | 0.8416 | 6,156,174,194.23   |
| 其他      |                     |        | 30,585,494.55       |                    |        | 31,530,437.14      |
| 结算备付金   |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | 33,610,962.30       | 6.4601 | 217,130,177.57      | 29,267,355.11      | 6.5249 | 190,966,565.36     |
| 港币      | 162,066,051.30      | 0.8321 | 134,855,161.29      | 754,551,191.54     | 0.8416 | 635,030,282.80     |
| 应收款项    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | 46,189,137.71       | 6.4601 | 298,386,448.51      | 541,799,078.62     | 6.5249 | 3,535,184,808.08   |
| 港币      | 286,209,913.60      | 0.8321 | 238,155,269.11      | 339,263,579.13     | 0.8416 | 285,524,228.20     |
| 存出保证金   |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | 320,575,278.37      | 6.4601 | 2,070,948,355.81    | 163,660,678.66     | 6.5249 | 1,067,869,562.17   |
| 港币      | 54,949,586.18       | 0.8321 | 45,723,550.66       | 49,235,916.78      | 0.8416 | 41,436,947.56      |
| 其他      |                     |        | 26,851,120.02       |                    |        | 2,116,944.08       |
| 其他应收款   |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | 10,951,065.82       | 6.4601 | 70,744,980.31       | 10,296,134.15      | 6.5249 | 67,181,245.72      |
| 港币      | 34,494,808.08       | 0.8321 | 28,703,129.80       | 60,707,044.27      | 0.8416 | 51,091,048.46      |
| 代理买卖证券款 |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (301,587,152.02)    | 6.4601 | (1,948,283,160.77)  | (309,468,763.76)   | 6.5249 | (2,019,252,736.65) |
| 港币      | (3,998,677,658.57)  | 0.8321 | (3,327,299,679.70)  | (4,250,037,684.68) | 0.8416 | (3,576,831,715.43) |
| 其他      |                     |        | (2,537,745.12)      |                    |        | (4,484,141.16)     |
| 应付款项    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (1,465,139,767.16)  | 6.4601 | (9,464,949,409.80)  | (441,774,496.17)   | 6.5249 | (2,882,534,410.05) |
| 港币      | (1,561,378,980.98)  | 0.8321 | (1,299,223,450.07)  | (7,793,646,012.14) | 0.8416 | (6,559,132,483.81) |
| 拆入资金    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (219,123,303.59)    | 6.4601 | (1,415,558,453.50)  | (186,101,404.87)   | 6.5249 | (1,214,293,056.63) |
| 应付短期融资款 |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (464,879,116.80)    | 6.4601 | (3,003,165,582.42)  | (49,616,807.45)    | 6.5249 | (323,744,706.92)   |
| 应付债券    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (2,305,192,744.02)  | 6.4601 | (14,891,775,645.61) | (902,079,433.12)   | 6.5249 | (5,885,978,093.17) |
| 短期借款    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (183,075,117.30)    | 6.4601 | (1,182,683,565.29)  | (1,532,517,661.43) | 6.5249 | (9,999,524,489.08) |
| 港币      | (15,742,629,275.54) | 0.8321 | (13,099,441,820.18) | (1,545,074,025.12) | 0.8416 | (1,300,334,299.54) |
| 长期借款    |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (148,130,548.93)    | 6.4601 | (956,938,159.14)    | (72,861,472.46)    | 6.5249 | (475,413,821.66)   |
| 其他应付款   |                     |        |                     |                    |        |                    |
| 其中：美元   | (468,191.37)        | 6.4601 | (3,024,563.09)      | (769,652.37)       | 6.5249 | (5,021,904.75)     |
| 港币      | (7,249,286.83)      | 0.8321 | (6,032,131.57)      | (2,929,288.43)     | 0.8416 | (2,465,289.14)     |

## (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减少而导致的合并范围变更

本集团对同时作为结构化主体的管理人或投资顾问和投资人，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 4 个，减少 7 个，详见附注七、3。

### 2 其他原因的合并范围变动

#### 新设子公司导致的合并范围变动

于 2021 年 2 月，本集团新设立全资子公司 Gossamer Merger Sub, Inc.。本集团管理层认为本集团对新设立的子公司具有实际控制，采用长期股权投资成本法对其进行核算，自设立之日起，纳入集团合并范围。

#### 子公司注销导致的合并范围变动

于 2021 年 3 月，本集团子公司 OBS Financial Services, Inc. 依法注销。

## 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(%)<br>(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 | 1,609,000,000.00 |     | 60.00                | -      | 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                              |      | 北京    | 北京   | 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  | 8,800,000,002.00 |     | 100.00               | -      | 设立   |
| 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                            |      | 上海    | 上海   | 基金及仓单交易 | 人民币 | 650,000,000.00   |     | -                    | 100.00 | 设立   |
| 华泰长城国际贸易有限公司                            |      | 上海    | 上海   | 风险管理    | 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)                 | 注(1) | 深圳    | 深圳   | 股权投资    | 人民币 | 1,000,000,000.00 |     | -                    | 31.00  | 设立   |
| 北京华泰瑞麟合医疗产业投资中心(有限合伙)                   | 注(1) | 北京    | 北京   | 股权投资    | 人民币 | 1,000,000,000.00 |     | -                    | 45.00  | 设立   |
| 深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业(有限合伙)               | 注(1) | 深圳    | 深圳   | 股权投资    | 人民币 | 220,010,000.00   |     | -                    | 25.00  | 设立   |
| 北京华泰瑞麟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     |     | -                    | 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     |     | -                    | 52.00  | 设立   |
| HTSC LIMITED                            |      | 香港    | 香港   | 不活动     | 港币  | 1.00             |     | -                    | 100.00 | 设立   |
| Huat tai HK SPC                         | 注(2) | 开曼群岛  | 开曼群岛 | 基金管理    | 美元  | 100.00           |     | -                    | 100.00 | 设立   |
| Huat tai HK Investment (Cayman) Limited |      | 开曼群岛  | 开曼群岛 | 投资管理    | 美元  | 0.01             |     | -                    | 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(%)<br>(或类似权益比例) |    | 取得方式 |
|---|------|---------|---------|--------|-----|------------------|-----|----------------------|----|------|
|   |      |         |         |        |     | 原币               | 人民币 | 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   |
| Principal 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      | 期货经纪管理 | 港币  | 153,300,000.00   | -   | 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)  | 注(1) | 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  | 10.00            | -   | 100.00               | -  | 设立   |
| 华泰(香港)期货有限公司  | 注(3) | 香港      | 香港      | 期货经纪   | 港币  | 138,456,000.00   | -   | 100.00               | -  | 设立   |
| 华泰长城投资管理有限公司  |      | 上海      | 上海      | 投资管理   | 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  | 1.00             | -   | 100.00               | -  | 设立   |
| AssetMark Financial Holdings, Inc.                          |      | 美国      | 美国      | 资产管理   | 美元  | 675,000.00       | -   | 70.27                | -  | 购买   |
| AssetMark Financial, Inc.                                   |      | 美国      | 美国      | 投资管理   | 美元  | 1,087,718.00     | -   | 70.27                | -  | 购买   |
| AssetMark Trust Company                                     |      | 美国      | 美国      | 资产托管   | 美元  | 60,000.00        | -   | 70.27                | -  | 购买   |
| AssetMark Retirement Services, Inc.                         |      | 美国      | 美国      | 投资咨询   | 美元  | 100.00           | -   | 70.27                | -  | 购买   |
| AssetMark, Inc.   |      | 美国      | 美国      | 投资咨询   | 美元  | 1,000.00         | -   | 70.27                | -  | 购买   |
| AssetMark Brokerage, LLC                                    |      | 美国      | 美国      | 基金经纪   | 美元  | -                | -   | 70.27                | -  | 购买   |
| Huatai Securities USA Holding, Inc.                         |      | 美国      | 美国      | 投资管理   | 美元  | 100.00           | -   | 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 (%)<br>(或类似权益比例) |        | 取得方式 |
|--|----|-------|-----|--------|----|----------|-----|-----------------------|--------|------|
|  |    |       |     |        |    | 原币       | 人民币 | 直接                    | 间接     |      |
| 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 | 100.00   |     | -                     | 70.27  | 购买   |
| Global Financial Advisory, LLC         |    | 美国    | 美国  | 保险中介服务 | 美元 | 100.00   |     | -                     | 70.27  | 购买   |
| WBI OBS Financial, Inc.                |    | 美国    | 美国  | 投资咨询   | 美元 | 1,000.00 |     | -                     | 70.27  | 购买   |
| OBS Holdings, Inc.                     |    | 美国    | 美国  | 投资咨询   | 美元 | 850.00   |     | -                     | 70.27  | 购买   |
| Gossamer Merger Sub, Inc.              |    | 美国    | 美国  | 投资咨询   | 美元 | 1,000.00 |     | -                     | 70.27  | 设立   |

注 1: 截至 2021 年 6 月 30 日, 本公司间接持有深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业(有限合伙)、北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)、深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业(有限合伙)、伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)的股权比例均小于 50%。根据上述有限合伙基金的合伙协议, 本公司拥有控制这些基金的权力, 并且有能力运用该权力影响本公司的可变回报金额。因此, 本公司管理层认为本公司对这些企业具有实际控制, 故纳入合并财务报表范围。

注 2: 于 2021 年 5 月, 本公司子公司 Huatai HK SPC 注册资本变更为 100 美元。

注 3: 于 2021 年 1 月, 本公司子公司华泰(香港)期货有限公司注册资本变更为港币 138,456,000.00 元。

(2) 重要的非全资子公司

| 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  | 本期向少数股东宣告分派的股利 | 期末少数股东权益余额       |
|------------------------------------|-----------|---------------|----------------|------------------|
| 华泰期货有限公司                           | 40.00%    | 72,608,100.76 | -              | 1,262,423,714.96 |
| AssetMark Financial Holdings, Inc. | 29.73%    | 35,424,852.64 | -              | 1,798,627,044.67 |

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：

单位：人民币元

|            | 华泰期货有限公司            |                     | AssetMark Financial Holdings, Inc. |                    |
|------------|---------------------|---------------------|------------------------------------|--------------------|
|            | 2021年6月30日          | 2020年12月31日         | 2021年6月30日                         | 2020年12月31日        |
| 资产合计       | 46,904,872,499.43   | 42,842,626,904.09   | 8,447,250,588.01                   | 7,983,789,341.20   |
| 负债合计       | (43,748,813,212.04) | (39,867,604,488.79) | (2,397,835,402.01)                 | (2,078,278,523.50) |
|            | 2021年1-6月           | 2020年1-6月           | 2021年1-6月                          | 2020年1-6月          |
| 营业收入       | 1,111,332,824.40    | 835,769,290.46      | 1,112,536,647.57                   | 1,014,296,166.50   |
| 净利润 / (亏损) | 181,520,251.90      | 93,406,026.87       | 124,594,273.79                     | (75,012,873.39)    |
| 其他综合收益     | (542,657.84)        | -                   | (50,487,257.11)                    | 94,562,485.99      |
| 综合收益总额     | 180,977,594.06      | 93,406,026.87       | 74,107,016.68                      | 19,549,612.60      |
| 经营活动现金流量   | (46,415,717.31)     | 7,310,850,789.81    | 94,974,428.60                      | 207,745,040.00     |

2 在联营企业和合营企业中的权益

| 项目         | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
|------------|-------------------|-------------------|
| 联营企业       |                   |                   |
| - 重要的联营企业  | 14,845,326,525.51 | 14,758,677,875.09 |
| - 不重要的联营企业 | 3,148,121,422.78  | 2,932,483,075.98  |
| 合营企业       |                   |                   |
| - 重要的合营企业  | 913,628,702.94    | 753,650,783.34    |
| - 不重要的合营企业 | -                 | -                 |
| 小计         | 18,907,076,651.23 | 18,444,811,734.41 |
| 减：减值准备     | -                 | -                 |
| 合计         | 18,907,076,651.23 | 18,444,811,734.41 |

## (1) 重要联营企业或合营企业：

| 企业名称                             | 主要经营地 | 注册地 | 业务性质 | 持股比例 (%) |        | 对联营 / 合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 |
|----------------------------------|-------|-----|------|----------|--------|---------------------|-------------------|--------------|
|                                  |       |     |      | 直接       | 间接     |                     |                   |              |
| 联营企业                             |       |     |      |          |        |                     |                   |              |
| 江苏银行股份有限公司 (注 1)                 | 南京    | 南京  | 商业银行 | 5.63%    | -      | 权益法                 | 1,476,962.42      | 是            |
| 南方基金管理股份有限公司                     | 深圳    | 深圳  | 基金管理 | 41.16%   | -      | 权益法                 | 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% | 权益法                 | 544,200.00        | 是            |
| 合营企业                             |       |     |      |          |        |                     |                   |              |
| 华泰招商 (江苏) 资本市场投资母基金 (有限合伙) (注 3) | 南京    | 南京  | 股权投资 | -        | 10.00% | 权益法                 | 1,000,100.00      | 是            |

注 1：于 2021 年 1-6 月，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 2021 年 6 月 30 日，江苏银行发行的苏银转债累计转股股数为 90,570 股，占苏银转债转股前江苏银行已发行普通股股份总额的 0.0008%，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 5.63319% 减少至 5.63318%。

注 2：截至 2021 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。

注 3：截至 2021 年 6 月 30 日，本集团持有华泰招商 (江苏) 资本市场投资母基金 (有限合伙) 10.00% 的股权。根据该有限合伙基金的合伙协议，本集团与第三方约定分享该基金的控制权，并有权拥有该基金的净资产。本集团认为本集团与第三方共同对该基金具有实际控制，故将其作为本集团的合营企业核算，对其确认为长期股权投资并按权益法核算。

(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） |                  |
|----------------|------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|------------------|
|                | 2021年6月30日             | 2020年12月31日            | 2021年6月30日         | 2020年12月31日        | 2021年6月30日         | 2020年12月31日      |
| 资产             | 2,553,294,748,000.00   | 2,337,893,000,000.00   | 12,296,316,499.69  | 12,009,246,254.06  | 8,152,092,204.07   | 8,561,101,638.22 |
| 负债             | (2,365,326,728,000.00) | (2,155,755,442,666.67) | (4,348,630,603.09) | (4,168,197,785.00) | -                  | -                |
| 净资产            | 187,968,020,000.00     | 182,137,557,333.33     | 7,947,685,896.60   | 7,841,048,469.06   | 8,152,092,204.07   | 8,561,101,638.22 |
| 少数股东权益         | 4,651,262,000.00       | 4,099,557,333.33       | 207,234,195.43     | 215,716,611.82     | -                  | -                |
| 归属于母公司普通股股东权益  | 139,844,021,509.00     | 135,275,105,000.00     | 7,740,451,701.17   | 7,625,331,857.24   | 8,152,092,204.07   | 8,561,101,638.22 |
| 按持股比例计算的净资产份额  | 7,877,670,006.30       | 7,588,139,898.35       | 3,185,969,920.20   | 3,138,586,592.44   | 3,935,014,906.90   | 4,132,151,940.78 |
| 其他调整           | (2,847,978.46)         | -                      | -                  | -                  | (150,480,329.43)   | (100,200,556.48) |
| 对联营企业投资的账面价值   | 7,874,822,027.84       | 7,588,139,898.35       | 3,185,969,920.20   | 3,138,586,592.44   | 3,784,534,577.47   | 4,031,951,384.30 |
| 营业收入           | 30,736,822,000.00      | 25,056,803,000.00      | 3,460,694,372.52   | 2,140,314,986.21   | 746,132,247.47     | 2,047,671,254.19 |
| 净利润            | 10,508,900,000.00      | 8,429,752,000.00       | 876,403,076.46     | 592,139,209.82     | 707,430,540.84     | 1,996,451,414.08 |
| 其他综合收益         | 507,538,000.00         | 78,128,000.00          | (2,912,829.59)     | 12,466,414.52      | -                  | -                |
| 综合收益总额         | 11,016,438,000.00      | 8,507,880,000.00       | 873,490,246.87     | 604,605,624.34     | 707,430,540.84     | 1,996,451,414.08 |
| 本期收到的来自联营企业的股利 | 262,912,000.00         | 177,920,000.00         | 295,956,611.06     | 71,638,064.54      | 73,320,897.41      | -                |

## (3) 重要合营企业的主要财务信息：

下表列示了本集团重要合营企业的主要财务信息，这些合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合营企业投资账面价值的调节过程：

| 华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙） |                  |                  |
|-------------------------|------------------|------------------|
|                         | 2021年6月30日       | 2020年12月31日      |
| 资产                      | 8,147,619,353.17 | 7,537,023,356.80 |
| 负债                      | (10,784,698.62)  | (515,523.40)     |
| 净资产                     | 8,136,834,654.55 | 7,536,507,833.40 |
| 少数股东权益                  | -                | -                |
| 归属于母公司股东权益              | 8,136,834,654.55 | 7,536,507,833.40 |
| 按持股比例计算的净资产份额           | 813,683,465.45   | 753,650,783.34   |
| 其他调整                    | 99,945,237.49    | -                |
| 对合营企业投资的账面价值            | 913,628,702.94   | 753,650,783.34   |

|                | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
|----------------|---------------|---------------|
| 营业收入           | 21,417,097.30 | 36,049,140.66 |
| 净利润            | 11,589,986.72 | 26,117,527.27 |
| 其他综合收益         | -             | -             |
| 综合收益总额         | 11,589,986.72 | 26,117,527.27 |
| 本期收到的来自合营企业的股利 | -             | -             |

## (4) 不重要联营企业和合营企业的汇总财务信息如下：

|          | 2021年6月30日       | 2020年12月31日      |
|----------|------------------|------------------|
| 联营企业：    |                  |                  |
| 投资账面价值合计 | 3,148,121,422.78 | 2,932,483,075.98 |

|                 | 2021年1-6月      | 2020年1-6月      |
|-----------------|----------------|----------------|
| 下列各项按持股比例计算的合计数 |                |                |
| - 净利润           | 208,525,341.91 | 799,697,764.83 |
| - 其他综合收益        | -              | (501,938.20)   |
| - 综合收益总额        | 208,525,341.91 | 799,195,826.63 |

### 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同时作为管理人或投资顾问及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或投资顾问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2021年6月30日，本集团共合并44个结构化主体（2020年12月31日：47个结构化主体），合并结构化主体的总资产为人民币89,932,113,921.19元（2020年12月31日：人民币96,479,001,599.21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31,943,662,630.04元（2020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34,831,430,075.35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2021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476,992,927,621.85元（2020年12月31日：人民币542,764,075,169.90元）。于2021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2,085,067,425.43元（2020年12月31日：人民币1,809,127,505.21元）。

于2021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及业绩报酬共计人民币376,273,758.32元（2020年1-6月：人民币544,527,345.53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、信托计划与其他理财产品。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 2021 年 6 月 30 日与 2020 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：

| 2021 年 6 月 30 日 |                   |          |                   |
|-----------------|-------------------|----------|-------------------|
|                 | 交易性金融资产           | 其他权益工具投资 | 合计                |
| 基金              | 35,591,331,838.50 | -        | 35,591,331,838.50 |
| 银行理财产品          | 874,546,603.76    | -        | 874,546,603.76    |
| 信托计划            | 2,258,767,310.01  | -        | 2,258,767,310.01  |
| 其他              | 7,638,769,609.90  | -        | 7,638,769,609.90  |
| 合计              | 46,363,415,362.17 | -        | 46,363,415,362.17 |

| 2020 年 12 月 31 日 |                   |                   |                   |
|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                  | 交易性金融资产           | 其他权益工具投资          | 合计                |
| 基金               | 23,800,198,471.83 | -                 | 23,800,198,471.83 |
| 银行理财产品           | 1,335,346,136.28  | -                 | 1,335,346,136.28  |
| 信托计划             | 4,880,104,147.61  | -                 | 4,880,104,147.61  |
| 其他               | 3,887,102,137.39  | 10,586,865,078.69 | 14,473,967,216.08 |
| 合计               | 33,902,750,893.11 | 10,586,865,078.69 | 44,489,615,971.80 |

于 2021 年 6 月 30 日和 2020 年 12 月 31 日，本集团因投资上述基金、银行理财产品、信托计划与其他理财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（试行）》、《压力测试实施方案及实施细则》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、信息技术风险和合规风险等。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。

董事会是风险管理的最高决策机构，并对公司全面风险管理体系的有效性承担最终责任。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总裁室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。稽查部负责对公司风险管理流程的有效性及其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

信用风险是指由于产品或债券发行人违约、交易对手（客户）违约导致公司资产受损失的风险。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，将境内外所有子公司，以及比照子公司管理的各类孙公司纳入进行统一管理，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四类：一是在融资类业务中，客户违约致使借出资券及利息遭受损失的风险；二是在债券投资业务中，发债主体违约造成的风险；三是交易对手方出现违约，导致资产遭受损失的风险；四是在担保交收类业务中，客户资金出现缺口，集团代客户垫资从而可能给本集团造成损失的风险。

对于融资类业务，本集团执行严格的客户及目标管理、持续动态监控、及时风险化解等全流程管控措施，把控业务信用风险。报告期内市场活跃，公司融资融券业务规模持续增长，公司亦执行严格的风控流程和措施，对两融业务进行专项风险检查，加强业务逆周期管理机制，完善差异化客户管控标准，两融业务待追索金额保持在较低水平。

对于债券投资类业务，公司建立发行人统一管理体系，报告期内，公司修订并重构重点行业和区域信用债底线管控方案，持续推进发行人信用风险管理模块化建设，增强风险管控的效率和针对性。同时持续推进挂钩 CAMS 评级结果的业务准入和限额规则落地执行，健全统一内评体系，提升集团整体风险的识别和管控能力。

交易对手管理方面，公司推进交易对手统一管理体系建设，拓展集团层面交易对手授信额度统一管理的覆盖范围，形成集团全量范围交易对手名单制管理方案，严控业务风险敞口。同时，公司持续推进交易对手信用风险管理模块系统化建设，逐步实现交易对手管理及相关流程的平台化。

对于担保交收类业务，本集团将其纳入交易对手体系进行统一管理，同时探索增强客户资质管理体系及准入标准，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的管控能力。

同时，公司推进集团统一的客户穿透管理体系系统化建设，全面梳理发布《业务信用风险管控重点参考指引》，强化重点信用业务管控底线措施，并根据外部环境变化持续细化提升客户 ESG 尽职调查风险管理机制，巩固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及为各类信用业务发展提供强有力风控保障支撑的水平。

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，分析交易面临的减持风险因素，划分三个阶段，确定减值准备，具体如下：

| 描述                         | 风险阶段                       |
|----------------------------|----------------------------|
| 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<br>第一阶段     |
| 履约比高于平仓线、逾期天数不超过 90 天      |                            |
| 履约比处于平仓区但未逾期               | 整个存续期预期信用损失未发生信用减值<br>第二阶段 |
| 履约比处于平仓区、逾期天数不超过 90 天      |                            |
| 履约比低于 100%                 |                            |
| 履约比不低于 100%、逾期天数超过 90 天    | 整个存续期预期信用损失已发生信用减值<br>第三阶段 |
| 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，第一阶段风险合约减值损失率一般为 0.25%，第二阶段风险合约减值损失率一般为 1%-4%。

针对第三阶段风险合约，本集团从每笔合约的目标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目标券的版块、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：

|            | 2021年6月30日         | 2020年12月31日        |
|------------|--------------------|--------------------|
| 货币资金       | 185,520,374,784.23 | 153,161,644,514.52 |
| 结算备付金      | 23,378,263,681.85  | 28,112,597,360.67  |
| 融出资金       | 128,177,514,441.21 | 102,574,007,019.08 |
| 交易性金融资产    | 177,981,114,677.24 | 197,813,082,248.91 |
| 衍生金融资产     | 12,376,626,971.30  | 7,295,357,324.28   |
| 买入返售金融资产   | 18,071,368,069.34  | 19,536,412,405.52  |
| 应收款项       | 10,351,526,872.28  | 9,095,560,247.32   |
| 存出保证金      | 26,336,577,261.54  | 24,763,790,295.82  |
| 债权投资       | 33,499,238,110.39  | 30,411,507,722.05  |
| 其他债权投资     | 7,519,277,729.12   | 5,267,955,106.65   |
| 其他资产（金融资产） | 620,130,573.68     | 472,655,093.42     |
| 合计         | 623,832,013,172.18 | 578,504,569,338.24 |

## (b) 债券投资

对于债券投资类业务，公司建立发行人统一管理体系，通过系统实现集团各业务单位同一发行人投资总额的汇总监测，并对重点行业的信用债投资实行底线管控。同时持续推进挂钩 CAMS 评级结果的业务准入和限额规则的落地执行，健全统一内评体系，提升集团整体风险的识别和管控能力。

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。

## (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，以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外币金融资产。对于不是以记账本位币计价的现金及银行结余、结算备付金、存出保证金、应收款项、应付经纪账款、应付款项、长期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)。

## 敏感性分析

假定除汇率以外的其他风险变量不变，于 2021 年 6 月 30 日和 2020 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 1% 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             | 净利润             |
|------------|------------------|-----------------|
| 2021年6月30日 |                  |                 |
| 美元         | (58,880,074.83)  | (15,803,260.91) |
| 港币         | (84,894,890.39)  | (62,996,105.55) |
| 合计         | (143,774,965.22) | (78,799,366.46) |

|             | 股东权益             | 净利润             |
|-------------|------------------|-----------------|
| 2020年12月31日 |                  |                 |
| 美元          | (85,335,069.13)  | 9,816,348.78    |
| 港币          | (61,149,033.75)  | (50,080,758.60) |
| 合计          | (146,484,102.88) | (40,264,409.82) |

于2021年6月30日和2020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1%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结余、结算备付金、应收融出资金、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银行借款、已发行的短期债务工具、拆入资金、卖出回购金融资产款、应付经纪客户账款、长期银行借款、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：

|                 | 2021年6月30日       |                  | 2020年12月31日        |                    |
|-----------------|------------------|------------------|--------------------|--------------------|
|                 | 股东权益             | 净利润              | 股东权益               | 净利润                |
| 收益率曲线向上平移100个基点 | (888,605,222.11) | (831,529,958.30) | (1,678,899,541.97) | (1,611,464,412.30) |
| 收益率曲线向下平移100个基点 | 1,106,945,161.28 | 1,047,272,355.35 | 1,753,170,750.01   | 1,685,735,620.34   |

#### (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、债券及基金等，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。

截至2021年6月30日，若本集团持有的上述投资的公允价值上升5%且其他市场变量保持不变，本集团净资产将相应增加7%(2020年12月31日：7%)；反之，若本集团持有金融工具的公允价值下降5%且其他市场变量保持不变，本集团净资产则将相应下降7%(2020年12月31日：7%)。

#### (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，各专业风险管理部门、各业务部门、支持部门等按照职能分工，分别执行本业务及管理领域的操作风险管控。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、银监会、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、债权投资及融出资金债权收益权。卖出回购协议是指如下交易，将证券及融出资金债权收益权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及融出资金债权收益权获取回报的风险。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 2021 年 6 月 30 日和 2020 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：

| 2021 年 6 月 30 日 | 交易性金融资产            |                  | 债权投资               | 融出资金    | 合计                 |
|-----------------|--------------------|------------------|--------------------|---------|--------------------|
|                 | 卖出回购协议             | 融出证券             | 卖出回购协议             | 债权收益权回购 |                    |
| 转让资产的账面金额       | 3,345,401,736.42   | 4,978,933,074.10 | 2,487,451,568.00   | -       | 10,811,786,378.52  |
| 相关负债的账面金额       | (3,104,032,676.60) | -                | (2,404,914,805.42) | -       | (5,508,947,482.02) |
| 净头寸             | 241,369,059.82     | 4,978,933,074.10 | 82,536,762.58      | -       | 5,302,838,896.50   |

| 2020 年 12 月 31 日 | 交易性金融资产            |                  | 债权投资             | 融出资金             | 合计                 |
|------------------|--------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|
|                  | 卖出回购协议             | 融出证券             | 卖出回购协议           | 债权收益权回购          |                    |
| 转让资产的账面金额        | 2,649,170,295.35   | 5,426,439,381.32 | 317,881,679.39   | 311,411,219.72   | 8,704,902,575.78   |
| 相关负债的账面金额        | (2,484,314,242.38) | -                | (294,585,987.81) | (300,320,833.34) | (3,079,221,063.53) |
| 净头寸              | 164,856,052.97     | 5,426,439,381.32 | 23,295,691.58    | 11,090,386.38    | 5,625,681,512.25   |

## (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

| 2021年6月30日                   |      |                           |                            |                           |                            |
|------------------------------|------|---------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|
|                              | 附注   | 第一层次                      | 第二层次                       | 第三层次                      | 合计                         |
| 持续的公允价值计量                    |      |                           |                            |                           |                            |
| 资产                           |      |                           |                            |                           |                            |
| 交易性金融资产                      | 五、8  | 164,344,008,739.00        | 135,649,709,307.06         | 10,999,634,666.06         | 310,993,352,712.12         |
| - 交易性债券投资                    |      | 54,800,246,113.97         | 117,576,003,781.35         | 625,931,707.82            | 173,002,181,603.14         |
| - 交易性其他债务工具投资                |      | -                         | -                          | 4,835,200,636.74          | 4,835,200,636.74           |
| - 交易性权益工具                    |      | 109,543,762,625.03        | 18,073,705,525.71          | 5,538,502,321.50          | 133,155,970,472.24         |
| 衍生金融资产                       | 五、4  | 118,584,030.33            | 10,967,837,793.67          | 1,290,205,147.30          | 12,376,626,971.30          |
| 其他债权投资                       | 五、10 | 3,515,304,105.79          | 3,548,997,376.81           | 454,976,246.52            | 7,519,277,729.12           |
| 其他权益工具投资                     | 五、11 | -                         | 77,278,726.55              | 96,002,177.53             | 173,280,904.08             |
| 持续以公允价值计量的资产总额               |      | <u>167,977,896,875.12</u> | <u>150,243,823,204.09</u>  | <u>12,840,818,237.41</u>  | <u>331,062,538,316.62</u>  |
| 负债                           |      |                           |                            |                           |                            |
| 交易性金融负债                      | 五、25 | (863,937,871.46)          | (18,598,006,169.22)        | (3,588,585,440.75)        | (23,050,529,481.43)        |
| 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 |      | -                         | (386,735,735.92)           | (3,588,585,440.75)        | (3,975,321,176.67)         |
| 衍生金融负债                       | 五、4  | (188,626,556.85)          | (10,667,354,256.24)        | (2,348,072,557.96)        | (13,204,053,371.05)        |
| 持续以公允价值计量的负债总额               |      | <u>(1,052,564,428.31)</u> | <u>(29,265,360,425.46)</u> | <u>(5,936,657,998.71)</u> | <u>(36,254,582,852.48)</u> |

2020年12月31日

|                              | 附注   | 第一层次                      | 第二层次                       | 第三层次                      | 合计                         |
|------------------------------|------|---------------------------|----------------------------|---------------------------|----------------------------|
| 持续的公允价值计量                    |      |                           |                            |                           |                            |
| 资产                           |      |                           |                            |                           |                            |
| 交易性金融资产                      | 五、8  | 107,181,751,967.38        | 172,281,767,767.10         | 13,231,786,941.07         | 292,695,306,675.55         |
| - 交易性债券投资                    |      | 27,242,315,778.28         | 160,410,226,483.42         | 684,259,484.82            | 188,336,801,746.52         |
| - 交易性其他债务工具投资                |      | -                         | -                          | 4,049,841,121.07          | 4,049,841,121.07           |
| - 交易性权益工具                    |      | 79,939,436,189.10         | 11,871,541,283.68          | 8,497,686,335.18          | 100,308,663,807.96         |
| 衍生金融资产                       | 五、4  | 117,320,242.64            | 6,775,881,640.79           | 402,155,440.85            | 7,295,357,324.28           |
| 其他债权投资                       | 五、10 | -                         | 4,390,712,446.31           | 877,242,660.34            | 5,267,955,106.65           |
| 其他权益工具投资                     | 五、11 | -                         | 10,586,865,078.69          | 91,552,254.46             | 10,678,417,333.15          |
| 持续以公允价值计量的资产总额               |      | <u>107,299,072,210.02</u> | <u>194,035,226,932.89</u>  | <u>14,602,737,296.72</u>  | <u>315,937,036,439.63</u>  |
| 负债                           |      |                           |                            |                           |                            |
| 交易性金融负债                      | 五、25 | (811,336,627.64)          | (11,386,175,746.48)        | (3,184,017,655.48)        | (15,381,530,029.60)        |
| 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 |      | (571,185,783.54)          | (157,152,813.30)           | (3,184,017,655.48)        | (3,912,356,252.32)         |
| 衍生金融负债                       | 五、4  | (253,514,923.96)          | (11,636,722,699.61)        | (1,508,592,513.14)        | (13,398,830,136.71)        |
| 持续以公允价值计量的负债总额               |      | <u>(1,064,851,551.60)</u> | <u>(23,022,898,446.09)</u> | <u>(4,692,610,168.62)</u> | <u>(28,780,360,166.31)</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交易价，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和其他权益工具投资中不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。

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。股指期权的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

2021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：

|                        | 2021年6月30日的公允价值    | 估值技术           | 不可观察输入值    | 对公允价值影响            |
|------------------------|--------------------|----------------|------------|--------------------|
| 理财产品、应收款项类投资及私募配售债券    | 8,223,548,039.87   | 贴现现金流量模型       | 经风险调整的贴现率  | 经风险调整的贴现率越高，公允价值越低 |
| 未上市股权投资                | 3,327,065,050.24   | 市场法            | 缺乏市场流通性贴现率 | 贴现率越高，公允价值越低       |
| 场外衍生品                  | (1,057,867,410.66) | 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 |
|                        |                    | 蒙特卡洛期权定价模型     | 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 | (3,588,585,440.75) | 市场法            | 缺乏市场流通性贴现率 | 贴现率越高，公允价值越低       |

|                        | 2020年12月31日的公允价值   | 估值技术           | 不可观察输入值    | 对公允价值影响            |
|------------------------|--------------------|----------------|------------|--------------------|
| 理财产品、应收款项类投资及私募配售债券    | 9,414,294,012.29   | 贴现现金流量模型       | 经风险调整的贴现率  | 经风险调整的贴现率越高，公允价值越低 |
| 未上市股权投资                | 4,786,287,843.58   | 市场法            | 缺乏市场流通性贴现率 | 贴现率越高，公允价值越低       |
| 场外衍生品                  | (1,106,437,072.29) | 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 |
|                        |                    | 蒙特卡洛期权定价模型     | 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 | (3,184,017,655.48) | 市场法            | 缺乏市场流通性贴现率 | 贴现率越高，公允价值越低       |

第三层次金融资产公允价值对不可观察输入数据的合理性变动不具有重大敏感性。



5 持续以第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息

|               | 2021年1月1日余额             |                      | 本期利得或损失总额               |                           |                     |                         |          | 2021年6月30日余额            |                           |                         | 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 |    |  |
|---------------|-------------------------|----------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------|-------------------------|----------|-------------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------------------|----|--|
|               | 转入第三层次                  | 转出第三层次               | 计入损益 (I)                | 计入其他综合收益 (I)              | 购买                  | 发行                      | 出售       | 购买                      | 发行                        | 出售                      |                                 | 结算 |  |
| <b>资产</b>     |                         |                      |                         |                           |                     |                         |          |                         |                           |                         |                                 |    |  |
| 交易性金融资产       | 13,231,786,941.07       | 40,000,000.00        | (783,857,442.56)        | (79,862,167.35)           | -                   | 3,167,626,939.46        | -        | (68,080,684.94)         | (4,507,978,919.62)        | 10,999,634,666.06       | (249,499,905.63)                |    |  |
| - 交易性债券投资     | 684,259,484.82          | -                    | -                       | (49,190,905.59)           | -                   | 120,613,485.76          | -        | (68,080,684.94)         | (61,669,672.23)           | 625,931,707.82          | (35,626,617.92)                 |    |  |
| - 交易性其他债务工具投资 | 4,049,841,121.07        | -                    | -                       | 78,028,779.88             | -                   | 2,973,149,998.97        | -        | -                       | (2,265,819,263.18)        | 4,835,200,636.74        | (28,596,159.90)                 |    |  |
| - 交易性权益工具     | 8,497,686,335.18        | 40,000,000.00        | (783,857,442.56)        | (108,700,041.64)          | -                   | 73,863,454.73           | -        | (2,180,489,984.21)      | 5,538,502,321.50          | 454,976,246.52          | (185,277,127.81)                |    |  |
| 其他股权投资        | 877,242,660.34          | -                    | -                       | 80,330,628.94             | (5,264,543.57)      | -                       | -        | (497,332,499.19)        | -                         | 96,002,177.53           | -                               |    |  |
| 其他权益工具投资      | 91,552,254.46           | -                    | -                       | -                         | 4,449,923.07        | -                       | -        | -                       | -                         | -                       | -                               |    |  |
| 衍生金融资产        | 402,155,440.85          | -                    | -                       | 877,542,416.15            | -                   | 127,955,096.71          | -        | (86,438,091.24)         | (31,009,715.17)           | 1,290,205,147.30        | 877,542,416.15                  |    |  |
| <b>负债</b>     |                         |                      |                         |                           |                     |                         |          |                         |                           |                         |                                 |    |  |
| 衍生金融负债        | (1,508,592,513.14)      | -                    | -                       | (3,464,113,938.73)        | 8,771,789.69        | 288,716,988.11          | -        | (232,107,335.67)        | 2,559,252,451.78          | (2,348,072,557.96)      | (1,766,128,817.77)              |    |  |
| 交易性金融负债       | (3,184,017,655.48)      | -                    | -                       | (404,567,785.27)          | -                   | -                       | -        | -                       | -                         | (3,588,585,440.75)      | (405,849,986.98)                |    |  |
| <b>合计</b>     | <b>9,910,127,128.10</b> | <b>40,000,000.00</b> | <b>(783,857,442.56)</b> | <b>(2,990,670,846.26)</b> | <b>7,957,169.19</b> | <b>3,584,299,024.28</b> | <b>-</b> | <b>(386,626,111.85)</b> | <b>(2,477,068,682.20)</b> | <b>6,904,160,238.70</b> | <b>(1,543,936,294.23)</b>       |    |  |

|                   | 2020年1月                 |                      | 2020年6月                 |                         |                     |                         |          | 对于期末持有的<br>资产和承担的<br>负债，计入损<br>益的当期未实<br>现利得或损失 |                         |                         |                         |
|-------------------|-------------------------|----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------|-------------------------|----------|---|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                   | 1日余额                    | 转入第三层次               | 转出第三层次                  | 计入损益(i)                 | 计入其他<br>综合收益(i)     | 购买                      | 发行       |   | 出售                      | 购买、发行、出售和结算<br>30日余额    | 结算                      |
| <b>资产</b>         |                         |                      |                         |                         |                     |                         |          |   |                         |                         |                         |
| 交易性金融资产           | 7,799,346,438.13        | 63,472,500.00        | (164,969,071.00)        | 377,457,113.07          | -                   | 2,008,699,290.26        | -        | (298,801,132.34)                                | (432,186,059.85)        | 9,353,019,078.27        | 245,049,107.52          |
| - 交易性债券投资         | 1,603,833,803.26        | -                    | -                       | 37,855,381.65           | -                   | 155,751,549.38          | -        | (287,820,588.61)                                | (115,452,700.14)        | 1,394,167,445.54        | 22,847,820.05           |
| - 交易性其他债务<br>工具投资 | 623,350,603.41          | -                    | -                       | (2,895,999.77)          | -                   | 39,128,032.17           | -        | -   | -                       | 659,582,635.81          | (2,895,999.77)          |
| - 交易性权益工具         | 5,572,162,031.46        | 63,472,500.00        | (164,969,071.00)        | 342,497,731.19          | -                   | 1,813,819,708.71        | -        | (10,980,543.73)                                 | (316,733,359.71)        | 7,299,288,996.92        | 225,097,287.24          |
| 其他债权投资            | 997,992,212.17          | -                    | -                       | 45,976,909.55           | 8,420,370.44        | 962,802,725.34          | -        | -   | (204,958,977.70)        | 1,810,233,239.80        | -                       |
| 其他权益工具投资          | 90,069,008.70           | -                    | -                       | 1,320,000.00            | 1,483,245.76        | -                       | -        | -   | (1,320,000.00)          | 91,552,254.46           | -                       |
| 衍生金融资产            | 775,442,046.64          | -                    | -                       | 160,495,395.71          | -                   | 97,428,330.82           | -        | (116,709,433.34)                                | (637,401,455.07)        | 279,254,884.76          | 263,567,556.62          |
| <b>负债</b>         |                         |                      |                         |                         |                     |                         |          |   |                         |                         |                         |
| 衍生金融负债            | (542,972,006.20)        | -                    | -                       | (857,906,816.52)        | -                   | (166,190,304.95)        | -        | 154,146,154.27                                  | 770,780,081.73          | (642,142,891.67)        | (620,893,754.01)        |
| 交易性金融负债           | (2,690,563,221.98)      | -                    | -                       | (634,870,002.48)        | -                   | -                       | -        | -   | 307,861,288.15          | (3,017,571,936.31)      | (634,870,002.48)        |
| <b>合计</b>         | <b>6,429,314,477.46</b> | <b>63,472,500.00</b> | <b>(164,969,071.00)</b> | <b>(907,527,400.67)</b> | <b>9,903,616.20</b> | <b>2,902,740,041.47</b> | <b>-</b> | <b>(261,364,411.41)</b>                         | <b>(197,225,122.74)</b> | <b>7,874,344,629.31</b> | <b>(747,147,092.35)</b> |

(i) 上述本集团于本期确认的利得或损失计入损益或其他综合收益的具体项目情况如下：

| 2021年1-6月       |                  |                    |
|-----------------|------------------|--------------------|
|                 | 项目               | 金额                 |
| 本期计入损益的已实现利得或损失 | 投资收益             | (1,448,304,474.37) |
| 本期计入损益的未实现利得或损失 | 公允价值变动收益         | (1,543,936,294.23) |
| 本期计入损益的已实现利得或损失 | 信用减值损失           | 1,569,922.34       |
| 合计              |                  | (2,990,670,846.26) |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 其他权益工具投资公允价值变动收益 | 4,449,923.07       |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 其他债权投资公允价值变动收益   | (3,694,621.23)     |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 其他债权投资信用减值准备     | (1,569,922.34)     |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 衍生金融负债           | 8,771,789.69       |
| 合计              |                  | 7,957,169.19       |

| 2020年1-6月       |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
|                 | 项目               | 金额               |
| 本期计入损益的已实现利得或损失 | 投资收益             | (155,382,336.67) |
| 本期计入损益的未实现利得或损失 | 公允价值变动收益         | (747,147,092.35) |
| 本期计入损益的已实现利得或损失 | 信用减值损失           | (4,997,971.65)   |
| 合计              |                  | (907,527,400.67) |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 其他权益工具投资公允价值变动收益 | 1,483,245.76     |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 其他债权投资公允价值变动收益   | 3,422,398.79     |
| 计入其他综合收益的利得或损失  | 其他债权投资信用减值准备     | 4,997,971.65     |
| 合计              |                  | 9,903,616.20     |

## 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，本集团持有由第二层次转入第一层次的以公允价值计量的金融资产共计人民币 247,087,665.44 元，主要系限售股解禁。转入和转出第三层次是由于部分金融工具的公允价值计量输入值发生改变。

## 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 2021 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 2021 年 6 月 30 日，本集团所持有债权投资账面价值为人民币 33,499,238,110.39 元，公允价值为人民币 33,471,942,085.81 元，本集团所持有应付短期融资款账面价值为人民币 34,867,899,417.35 元，公允价值为人民币 34,863,590,211.85 元，本集团所持有应付债券账面价值为人民币 138,071,335,432.94 元，公允价值为人民币 138,740,385,385.33 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%（“比率 1”）；
2. 净资本与净资产的比率不得低于 20%（“比率 2”）；
3. 净资本与负债的比率不得低于 8%（“比率 3”）；
4. 净资产与负债的比率不得低于 10%（“比率 4”）；
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%（“比率 5”）；
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%（“比率 6”）；
7. 核心净资本与表内外资产总额的比率不得少于 8%（“比率 7”）；
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%（“比率 8”）；
9. 可用稳定资金与所需稳定资金的比率不得少于 100%（“比率 9”）；及
10. 融资（含融券）的金额与净资本的比率不得超过 400%（“比率 10”）。

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 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本公司的净资本及上述比率如下：

|            | 2021 年 6 月 30 日   | 2020 年 12 月 31 日  |
|------------|-------------------|-------------------|
| 净资本 (人民币元) | 74,031,520,954.30 | 67,909,921,047.21 |
| 比率 1       | 236.65%           | 236.68%           |
| 比率 2       | 65.67%            | 60.65%            |
| 比率 3       | 20.93%            | 21.86%            |
| 比率 4       | 31.88%            | 36.04%            |
| 比率 5       | 43.39%            | 49.91%            |
| 比率 6       | 298.25%           | 296.70%           |
| 比率 7       | 18.48%            | 21.08%            |
| 比率 8       | 184.06%           | 230.31%           |
| 比率 9       | 131.50%           | 130.22%           |
| 比率 10      | 196.53%           | 194.19%           |

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 2021 年 6 月 30 日及 2020 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 | 14.86         | 14.86          | 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                    |
|------------------------|-------------------------|
| 江苏省苏豪控股集团有限公司          | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏高科技投资集团有限公司          | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏沿海创新资本管理有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏金融租赁股份有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏高投发展创业投资有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏苏豪投资集团有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏高投鑫海创业投资有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 弘业期货股份有限公司             | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏苏豪资本管理有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏宁沪高速公路股份有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏丰海新能源淡化海水发展有限公司      | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏省文化投资管理集团有限公司        | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏高新创业投资管理有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 高投名力成长创业投资有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 徐州矿务集团有限公司             | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏高投中小企业创业投资有限公司       | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 南京紫金投资集团有限责任公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏鑫惠创业投资有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏信新资产管理股份公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏省铁路集团有限公司            | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 莱绅通灵珠宝股份有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 晨壹投资（北京）有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 华新水泥股份有限公司             | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 南京钢铁股份有限公司             | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏紫金文化产业二期创业投资基金（有限合伙） | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏紫金文化产业发展基金（有限合伙）     | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 兴业证券股份有限公司             | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 南方东英资产管理有限公司           | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 南京银行股份有限公司             | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |
| 江苏省新能源开发股份有限公司         | 其他（其他关联人担任董事、高级管理人员的公司） |

注：其他关联人包括本公司董事、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        | 2021年1-6月             | 2020年1-6月             |
|---------------------|---------------|-----------------------|-----------------------|
| 主要股东及其子公司           | 债券承销收入        | 6,480,443.40          | 698,113.21            |
| 主要股东及其子公司           | 代理买卖交易佣金收入    | 3,439,571.22          | 487,288.70            |
| 本集团的联营和合营企业         | 基金管理费收入       | 99,135,009.38         | 52,608,520.21         |
| 本集团的联营和合营企业         | 席位费分仓佣金及销售服务费 | 62,336,039.08         | 52,955,064.42         |
| 本集团的联营和合营企业         | 债券承销收入        | -                     | 193,867.92            |
| 本集团的联营和合营企业         | 代理买卖交易佣金收入    | 245,917.45            | 52,020.01             |
| 本集团的联营和合营企业         | 承销保荐收入        | 71,981.13             | -                     |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 债券承销收入        | 113,207.55            | -                     |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 财务顾问收入        | 566,037.74            | -                     |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 代理买卖交易佣金收入    | 53,582.83             | 62,647.09             |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 席位费分仓佣金及销售服务费 | 190,302.71            | -                     |
| 其他关联人               | 代理买卖交易佣金收入    | 35,712.73             | 29,677.29             |
| 合计                  |               | <u>172,667,805.22</u> | <u>107,087,198.85</u> |

### (2) 利息净支出

| 关联方                 | 关联交易内容     | 2021年1-6月              | 2020年1-6月             |
|---------------------|------------|------------------------|-----------------------|
| 本集团的联营和合营企业         | 银行存款利息收入   | 3,562,276.48           | 2,774,652.34          |
| 本集团的联营和合营企业         | 质押式回购利息支出  | (2,364,777.23)         | (3,813,103.74)        |
| 本集团的联营和合营企业         | 拆入资金利息支出   | (5,629,750.01)         | (5,213,888.93)        |
| 主要股东及其子公司           | 拆入资金利息支出   | -                      | (1,181,250.00)        |
| 主要股东及其子公司           | 持有债权投资利息收入 | 779,968.63             | 3,644,453.47          |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 质押式回购利息支出  | (7,262,906.61)         | -                     |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 质押式回购利息收入  | 58,548.12              | -                     |
| 合计                  |            | <u>(10,856,640.62)</u> | <u>(3,789,136.86)</u> |

### (3) 投资收益

| 关联方                 | 关联交易内容         | 2021年1-6月            | 2020年1-6月            |
|---------------------|----------------|----------------------|----------------------|
| 主要股东及其子公司           | 持有及处置交易性金融资产收益 | 14,284,398.61        | 9,058,113.20         |
| 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 | 197,921.14           | 4,057,973.09         |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 持有及处置衍生金融资产损失  | (2,042,406.88)       | -                    |
| 合计                  |                | <u>12,439,912.87</u> | <u>13,116,086.29</u> |

## (4) 关联租赁

## 出租

| 承租方名称               | 租赁资产种类 | 2021年1-6月确认的租赁收入    | 2020年1-6月确认的租赁收入    |
|---------------------|--------|---------------------|---------------------|
| 本集团的联营和合营企业         | 房屋建筑物  | 1,619,067.02        | 5,457,601.69        |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 房屋建筑物  | -                   | 567,664.29          |
| 合计                  |        | <u>1,619,067.02</u> | <u>6,025,265.98</u> |

## 承租

| 出租方名称       | 租赁资产种类 | 2021年1-6月支出的租赁费用     | 2020年1-6月支出的租赁费用     |
|-------------|--------|----------------------|----------------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 房屋建筑物  | 16,916,228.51        | 16,480,943.46        |
| 本集团的联营和合营企业 | 其他     | 1,524,600.00         | 3,049,200.00         |
| 合计          |        | <u>18,440,828.51</u> | <u>19,530,143.46</u> |

## (5) 关联方净认购本集团发行债券情况

| 关联方         | 关联交易内容 | 2021年1-6月             | 2020年1-6月            |
|-------------|--------|-----------------------|----------------------|
| 主要股东及其子公司   | 认购债券   | -                     | 20,000,000.00        |
| 本集团的联营和合营企业 | 认购债券   | 519,144,000.00        | 20,000,000.00        |
| 合计          |        | <u>519,144,000.00</u> | <u>40,000,000.00</u> |

## (6) 本集团净认购 / ( 赎回 ) 关联方发行证券情况

| 关联方                 | 关联交易内容          | 2021年1-6月            | 2020年1-6月               |
|---------------------|-----------------|----------------------|-------------------------|
| 主要股东及其子公司           | 净认购 / ( 赎回 ) 债券 | 40,000,000.00        | (231,000,000.00)        |
| 本集团的联营和合营企业         | 净赎回债券           | -                    | (52,717,346.44)         |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 净赎回债券           | (10,000,000.00)      | -                       |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 净购买股票           | 3,316,770.08         | -                       |
| 合计                  |                 | <u>33,316,770.08</u> | <u>(283,717,346.44)</u> |



## (7) 与关联方相关取得的股利收益

| 关联方         | 关联交易内容 | 2021年1-6月      | 2020年1-6月      |
|-------------|--------|----------------|----------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 收到股利分红 | 757,223,981.46 | 332,603,727.36 |

## (8) 对关联方投资减少

| 关联方         | 关联交易内容 | 2021年1-6月        | 2020年1-6月          |
|-------------|--------|------------------|--------------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 投资净减少  | (374,698,984.00) | (1,155,351,604.93) |

## (9) 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 | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          |
|---------------------|--------|--------------------|--------------------|
| 主要股东及其子公司           | 拆入资金   | -                  | 2,500,000,000.00   |
| 本集团的联营和合营企业         | 质押式回购  | 31,077,618,000.00  | 74,325,970,000.00  |
| 本集团的联营和合营企业         | 拆入资金   | 56,000,000,000.00  | 77,800,000,000.00  |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 质押式回购  | 71,934,579,000.00  | -                  |
| 合计                  |        | 159,012,197,000.00 | 154,625,970,000.00 |

## (10) 关联方投资本集团发行的短期收益凭证情况

| 关联方                 | 关联交易内容         | 2021年1-6月          | 2020年1-6月      |
|---------------------|----------------|--------------------|----------------|
| 本集团的联营和合营企业         | 净(赎回)/投资短期收益凭证 | (1,150,520,000.00) | 357,870,000.00 |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 净(赎回)/投资短期收益凭证 | (70,000,000.00)    | 90,000,000.00  |
| 合计                  |                | (1,220,520,000.00) | 447,870,000.00 |

| 关联方                 | 关联交易内容       | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
|---------------------|--------------|---------------|---------------|
| 本集团的联营和合营企业         | 支付短期收益凭证投资收益 | 12,624,993.35 | 20,189,726.82 |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 支付短期收益凭证投资收益 | 760,369.87    | 715,873.97    |
| 合计                  |              | 13,385,363.22 | 20,905,600.79 |

## (11) 关键管理人员报酬

| 关联交易内容   | 2021年1-6月     | 2020年1-6月     |
|----------|---------------|---------------|
| 关键管理人员报酬 | 42,950,606.72 | 26,860,321.47 |

## 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      | 2021年6月30日     |                | 2020年12月31日    |              |
|-------------|--------------|----------------|----------------|----------------|--------------|
|             |              | 账面余额           | 坏账准备           | 账面余额           | 坏账准备         |
| 本集团的联营和合营企业 | 基金分仓佣金及销售服务费 | 24,627,537.28  | (123,137.69)   | 35,087,060.41  | (175,435.30) |
| 本集团的联营和合营企业 | 应收承销保存费      | -              | -              | 11,585,106.08  | -            |
| 本集团的联营和合营企业 | 应收管理费        | 165,356,231.60 | (1,125,451.13) | 91,889,404.28  | -            |
| 本集团的联营和合营企业 | 代垫费用         | 3,233,808.93   | (8,597.91)     | 1,882,116.39   | (27,194.60)  |
| 合计          |              | 193,217,577.81 | (1,257,186.73) | 140,443,687.16 | (202,629.90) |

## (2) 存放关联方款项

| 关联方         | 关联方交易内容 | 2021年6月30日     | 2020年12月31日    |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 银行存款    | 603,840,340.12 | 277,360,918.92 |

## (3) 应付关联方款项

| 关联方                 | 关联方交易内容 | 2021年6月30日     | 2020年12月31日    |
|---------------------|---------|----------------|----------------|
| 主要股东及其子公司           | 其他应付款   | 3,211,190.78   | 3,211,190.78   |
| 主要股东及其子公司           | 代理买卖证券款 | 35,941,167.63  | 43,406,598.35  |
| 本集团的联营和合营企业         | 代理买卖证券款 | 43,763,493.10  | 12,553,295.62  |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 应付款项    | 110,680,676.09 | 13,550,000.00  |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 代理买卖证券款 | 29,303,780.30  | 45,768,761.78  |
| 其他关联人               | 代理买卖证券款 | 20,388,668.63  | 2,816,605.58   |
| 合计                  |         | 243,288,976.53 | 121,306,452.11 |

## (4) 合同负债

| 关联方         | 关联方交易内容    | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 |
|-------------|------------|------------|-------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 保荐业务合同的预收款 | -          | 642,902.67  |

(5) 关联方资金拆借

| 关联方         | 关联方交易内容 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日    |
|-------------|---------|------------|----------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 拆入资金    | -          | 500,210,972.22 |

(6) 关联租赁

| 出租方名称       | 租赁资产种类 | 2021年6月30日<br>使用权资产 | 2020年12月31日<br>使用权资产 |
|-------------|--------|---------------------|----------------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 房屋建筑物  | 102,436,725.68      | 115,570,892.20       |
| 本集团的联营和合营企业 | 其他     | 12,117,409.50       | 14,540,891.46        |
| 合计          |        | 114,554,135.18      | 130,111,783.66       |

| 出租方名称       | 租赁资产种类 | 2021年6月30日<br>租赁负债 | 2020年12月31日<br>租赁负债 |
|-------------|--------|--------------------|---------------------|
| 本集团的联营和合营企业 | 房屋建筑物  | 105,057,432.48     | 123,800,455.38      |
| 本集团的联营和合营企业 | 其他     | 12,117,409.50      | 14,050,033.85       |
| 合计          |        | 117,174,841.98     | 137,850,489.23      |

(7) 关联方质押式正回购

| 关联方                 | 关联方交易内容 | 2021年6月30日     | 2020年12月31日 |
|---------------------|---------|----------------|-------------|
| 本集团的联营和合营企业         | 质押式正回购  | 199,524,937.50 | -           |
| 其他关联人担任董事、高级管理人员的公司 | 质押式正回购  | 287,070,670.03 | -           |
| 合计                  |         | 486,595,607.53 | -           |

## 十二、股份支付

### 1 本公司股份支付总体情况

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。

截至2021年6月30日，本公司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33,705,487.11元。本期以权益结算的股份支付确认的费用总额为人民币33,705,487.11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。

### 2 子公司股份支付总体情况

2021年1-6月

|            | 期初账面余额           | 本期增加额         | 本期转换额 | 期末账面余额           |
|------------|------------------|---------------|-------|------------------|
| 以权益结算的股份支付 |                  |               |       |                  |
| - 美元等值人民币  | 1,004,838,562.68 | 65,382,086.86 | -     | 1,070,220,649.54 |

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) 授予原AssetMark Holdings, LLC的C级普通股持有人。

#### (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期间行权。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 日起三年间，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。

(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）。

## 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。

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

|               | 2021年1-6月            |                      |                     |                      |                     | 合计                   |
|---------------|----------------------|----------------------|---------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
|               | 财富管理                 | 机构服务                 | 投资管理                | 国际业务                 | 其他                  |                      |
| 营业收入          |                      |                      |                     |                      |                     |                      |
| 手续费及佣金净收入     | 3,162,640,848.80     | 1,987,518,020.80     | 479,748,258.45      | 1,543,693,680.88     | -                   | 7,106,439,327.63     |
| 利息净收入/(支出)    | 3,053,034,517.05     | (1,188,378,545.74)   | 95,573,818.01       | 26,858,441.32        | (86,993,965.82)     | 1,910,953,431.25     |
| 投资收益/(亏损)     | 93,398,048.18        | 2,950,232,827.25     | 1,586,689,753.71    | 594,892,697.11       | 1,214,417,055.98    | 6,432,941,370.37     |
| 公允价值变动(损失)/收益 | (64,179,153.81)      | 1,150,489,773.22     | 741,731,064.04      | 661,095,654.55       | (146,781,868.35)    | 2,342,355,469.65     |
| 其他            | 476,873,380.70       | 26,447,190.77        | 57,382,193.93       | (42,811,997.52)      | (47,688,350.39)     | 440,080,430.76       |
| 营业收入合计        | 6,721,767,640.92     | 4,926,309,266.30     | 2,961,125,088.14    | 2,783,728,476.34     | 932,952,871.42      | 18,232,770,029.66    |
| 营业支出          | (2,708,230,318.55)   | (1,857,179,006.08)   | (451,175,542.72)    | (1,724,097,763.96)   | (1,550,906,816.93)  | (8,189,771,349.81)   |
| 营业利润/(亏损)     | 4,013,537,322.37     | 3,069,130,260.22     | 2,509,949,545.42    | 1,059,630,712.38     | (617,953,945.51)    | 10,042,998,679.85    |
| 利润/(亏损)总额     | 4,011,079,008.49     | 3,069,235,529.66     | 2,510,181,637.54    | 1,057,864,845.14     | (620,164,087.04)    | 10,036,901,718.76    |
| 截至2021年6月30日  |                      |                      |                     |                      |                     |                      |
| 分部资产          | 281,534,866,150.26   | 238,105,686,350.19   | 74,818,601,565.95   | 121,281,434,518.59   | 150,153,154,917.85  | 790,110,728,651.02   |
| 分部负债          | (272,929,311,740.50) | (233,873,427,658.35) | (68,490,873,464.26) | (109,402,001,165.12) | (45,006,580,382.29) | (653,919,179,558.70) |
| 补充信息          |                      |                      |                     |                      |                     |                      |
| 利息收入          | 5,612,802,901.68     | 270,418,072.50       | 239,389,608.42      | 296,649,515.48       | 744,503,676.49      | 7,148,805,777.41     |
| 利息支出          | (2,559,768,384.62)   | (1,458,796,618.24)   | (143,815,790.41)    | (269,791,074.16)     | (831,497,642.32)    | (5,237,852,346.16)   |
| 折旧与摊销费用       | (205,764,881.77)     | (58,766,745.29)      | (35,424,004.18)     | (185,042,870.41)     | (225,737,957.86)    | (705,826,177.21)     |
| 资本性支出         | 82,774,337.43        | 20,582,944.64        | 2,191,975.10        | 122,535,340.91       | 358,028,948.47      | 586,113,546.55       |
| 其他资产减值转回      | -                    | -                    | -                   | -                    | -                   | -                    |
| 信用减值转回/(损失)   | 194,933,993.80       | (491,435.20)         | (2,531,745.59)      | (16,127,173.11)      | 17,243,513.52       | 193,027,153.42       |

## 2020年1-6月

|               | 财富管理                 | 机构服务                 | 投资管理                | 国际业务                | 其他                  | 分部间抵销               | 合计                   |
|---------------|----------------------|----------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------|
| 营业收入          |                      |                      |                     |                     |                     |                     |                      |
| 手续费及佣金净收入     | 2,549,491,846.99     | 1,361,363,335.58     | 669,455,423.93      | 1,351,158,803.91    | -                   | (131,656,473.12)    | 5,799,812,937.29     |
| 利息净收入/(支出)    | 2,285,518,513.10     | (1,061,656,958.29)   | (14,530,930.75)     | (53,464,606.97)     | (141,872,093.12)    | 8,138,956.44        | 1,022,132,880.41     |
| 投资收益          | 12,235,124.34        | 4,532,746,606.93     | 2,806,353,096.19    | 105,677,432.78      | 1,148,932,075.02    | -                   | 8,605,944,335.26     |
| 公允价值变动收益/(损失) | 44,442,618.69        | (1,640,466,968.85)   | 696,662,271.70      | 279,301,424.93      | (142,894,062.83)    | -                   | (762,954,716.36)     |
| 其他            | 444,760,689.92       | 43,139,352.14        | 35,776,856.40       | 203,937,438.27      | 163,373,289.48      | (15,299,301.30)     | 875,688,324.91       |
| 营业收入合计        | 5,336,448,793.04     | 3,235,125,367.51     | 4,193,716,717.47    | 1,886,610,492.92    | 1,027,539,208.55    | (138,816,817.98)    | 15,540,623,761.51    |
| 营业支出          | (2,241,830,673.69)   | (1,123,603,698.83)   | (696,565,439.09)    | (1,556,855,962.59)  | (1,752,255,778.98)  | 154,098,851.92      | (7,217,012,701.26)   |
| 营业利润/(亏损)     | 3,094,618,119.35     | 2,111,521,668.68     | 3,497,151,278.38    | 329,754,530.33      | (724,716,570.43)    | 15,282,033.94       | 8,323,611,060.25     |
| 利润/(亏损)总额     | 3,095,530,937.58     | 2,108,845,792.48     | 3,501,755,650.27    | 329,704,043.79      | (745,056,919.84)    | 15,282,033.94       | 8,306,061,538.22     |
| 截至2020年12月31日 |                      |                      |                     |                     |                     |                     |                      |
| 分部资产          | 256,640,781,301.48   | 216,306,067,628.42   | 103,238,485,923.42  | 94,398,197,023.72   | 113,821,675,618.69  | (67,653,972,516.85) | 716,751,234,978.88   |
| 分部负债          | (254,171,512,855.74) | (214,585,003,207.10) | (67,898,373,599.37) | (83,388,407,013.80) | (32,049,876,848.92) | 67,653,972,516.85   | (584,439,201,008.08) |
| 补充信息          |                      |                      |                     |                     |                     |                     |                      |
| 利息收入          | 3,512,953,743.54     | 210,068,384.72       | 180,184,620.38      | 252,292,568.67      | 575,486,317.75      | (24,454,285.11)     | 4,706,531,349.95     |
| 利息支出          | (1,227,435,230.44)   | (1,271,725,343.01)   | (194,715,551.13)    | (305,757,175.64)    | (717,358,410.87)    | 32,593,241.55       | (3,684,398,469.54)   |
| 折旧与摊销费用       | (84,074,820.94)      | (53,720,601.46)      | (31,471,559.72)     | (180,374,955.69)    | (330,915,932.08)    | -                   | (680,557,869.89)     |
| 资本性支出         | 98,490,906.88        | 21,297,933.96        | 7,648,976.57        | 135,560,569.03      | 29,935,440.31       | -                   | 292,933,826.75       |
| 其他资产减值损失      | (6,380,973.07)       | -                    | -                   | -                   | -                   | -                   | (6,380,973.07)       |
| 信用减值(损失)/转回   | (165,244,914.03)     | 3,431,076.76         | 18,012,279.99       | (20,348,038.88)     | (42,832,762.38)     | -                   | (206,982,358.54)     |



## 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           |                   |
|-------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|       | 2021年1-6月         | 2020年1-6月         | 2021年6月30日        | 2020年12月31日       |
| 中国大陆  | 15,449,041,553.32 | 13,654,013,268.59 | 24,867,719,295.33 | 24,545,028,573.51 |
| 境外（注） | 2,783,728,476.34  | 1,886,610,492.92  | 7,297,538,719.92  | 7,349,294,217.52  |
| 合计    | 18,232,770,029.66 | 15,540,623,761.51 | 32,165,258,015.25 | 31,894,322,791.03 |

注：境外主要是中国香港及美国。

## 3 主要客户

于2021年1-6月及2020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。于 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，根据法庭裁决、法定代理律师意见及管理层的判断，未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任何预计负债。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 2021 年 6 月 30 日，本集团作为被告方的重大法律诉讼列示如下：

(1) 本集团子公司华泰联合证券有限责任公司（以下简称“华泰联合”）于 2020 年收到法院发送的《应诉通知书》等相关诉讼材料，中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市融通资本管理股份有限公司、中信信托有限责任公司因投资“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”未得到全额兑付，诉至法院要求该债券主承销商（被告一）及联席主承销商华泰联合（被告二）承担连带赔偿责任，案件目标合计人民币 6.87 亿元。于 2021 年 8 月 3 日，哈尔滨市中级人民法院向公司律师送达民事判决书，认为三个原告的债权已通过破产重整程序得到有效清偿，原被告各方债权债务关系已经全部消灭，因此判决驳回原告的诉讼请求。本集团未对该索赔金额计提任何预计负债。

此外，2021 年 3 月，华泰联合收到法院发送的《应诉通知书》等相关诉讼材料，中信建投基金管理有限公司起诉该债券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人民币 0.86 亿元，并起诉该债券主承销商及联席主承销商华泰联合、亿阳集团股份有限公司负责人、会计师事务所、律师事务所承担连带赔偿责任。截至本报告日，该案件仍在移交哈尔滨市中级人民法院处理过程中且尚未开庭审理，根据诉讼代理律师意见及管理层的判断，本集团未对该索赔金额计提任何预计负债。

(2) 本集团子公司华泰联合于 2020 年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“华泰美吉特灯都资产支持专项计划”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（被告五）承担连带赔偿责任，案件目标人民币 5.98 亿元。截至本报告日，本案尚在审理过程中，根据诉讼代理律师意见及管理层的判断，本集团未对该索赔金额计提任何预计负债。

### 2 提供债务担保形成的或有负债及其财务影响

于 2019 年 5 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 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 2020 年 2 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 4 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 其他或有负债及其财务影响

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团不存在其他或有负债。

### 4 或有资产

截至 2021 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      | 2021年6月30日        | 2020年12月31日      |
|---------|-------------------|------------------|
| 已签约但未拨付 | 11,668,000,000.00 | 1,888,359,161.32 |

上述资本承担主要为本集团工程建设、证券包销承诺的资本承担。

## 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2021年7月9日，本公司已完成2021年度第二期短期公司债的公开发行工作，该债券面向专业投资者发行，其中品种一规模为人民币20亿元，年利率为2.75%，期限为228天，品种二规模为人民币40亿元，年利率为2.87%，期限为365天。

于2021年7月15日，本公司已完成2021年度第五期短期融资券的公开发行工作，该债券面向机构投资者发行，规模为人民币40亿元。该短期融资券年利率为2.15%，期限为90天。

于2021年7月19日，本公司已完成2021年度第三期短期公司债的公开发行工作，该债券面向专业投资者发行，规模为人民币30亿元。该短期债券年利率为2.75%，期限为365天。

于2021年7月22日，本公司已完成2021年度第六期短期融资券的公开发行工作，该债券面向机构投资者发行，规模为人民币30亿元。该短期融资券年利率为2.15%，期限为90天。

于2021年8月9日，本公司已完成2021年度第四期短期公司债的公开发行工作，该债券面向专业投资者发行，规模为人民币40亿元。该短期债券年利率为2.55%，期限为186天。

于2021年8月16日，本公司已完成2021年度第五期短期公司债的公开发行工作，该债券面向专业投资者发行，规模为人民币40亿元。该短期债券年利率为2.51%，期限为157天。

于2021年8月26日，本公司已完成2021年度第六期短期公司债的公开发行工作，该债券面向专业投资者发行，规模为人民币30亿元。该短期债券年利率为2.40%，期限为75天。

#### (2) 收购子公司

于2021年7月1日，在收到所有必要的监管批准和第三方同意后，本公司的子公司AssetMark Financial Holdings, Inc. 以约1.455亿美元完成了对Voyant, Inc. 的收购。

#### (3) 购买土地使用权

于2021年8月24日，本公司的子公司华泰联合签订土地使用权出让合同书，购买位于深圳市前海深港现代服务业合作区前海片区九开发单元04街坊地块土地使用权，并于2021年8月25日支付对价人民币10.75亿元。

#### (4) 于会计期间后的利润分配方案

根据公司 2021 年 6 月 22 日的 2020 年年度股东大会决议，公司 2020 年度利润分配采用现金分红的方式，以公司总股本 9,076,650,000 股扣除存放于公司回购专用证券账户且暂不用于股权激励计划的 A 股股份为基数，每 10 股派发现金红利人民币 4.00 元（含税），分配现金红利总额为人民币 3,612,548,602.00 元，已于 2021 年 8 月 6 日发放完毕。

## 2 新设证券营业部

于 2021 年 5 月 25 日，本公司设立赣州并购基金园证券营业部，截至 2021 年 6 月 30 日本公司拥有共计 244 家营业部。

## 3 其他需要披露的重要事项

### (1) 融资融券业务

#### (i) 融资融券业务明细情况

| 核算科目 | 2021 年 6 月 30 日    | 2020 年 12 月 31 日   |
|------|--------------------|--------------------|
| 融出资金 | 128,177,514,441.21 | 102,574,007,019.08 |
| 融出证券 | 4,978,933,074.10   | 5,426,439,381.32   |
| 合计   | 133,156,447,515.31 | 108,000,446,400.40 |

融出资金详见附注五、3。

#### (ii) 融券业务明细情况

|           | 2021 年 6 月 30 日   | 2020 年 12 月 31 日  |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 融出证券      |                   |                   |
| - 交易性金融资产 | 4,978,933,074.10  | 5,426,439,381.32  |
| - 转融通融入证券 | 24,621,383,317.33 | 20,505,952,752.78 |
| 融出证券总额    | 29,600,316,391.43 | 25,932,392,134.10 |
| 转融通融入证券总额 | 36,791,481,612.75 | 28,889,509,895.00 |

## (iii) 融出资金及融出证券担保物公允价值

|    | 2021年6月30日         | 2020年12月31日        |
|----|--------------------|--------------------|
| 股票 | 393,482,837,818.55 | 345,971,251,569.26 |
| 基金 | 24,772,182,385.65  | 30,090,346,371.95  |
| 资金 | 15,755,511,700.16  | 15,637,131,332.00  |
| 债券 | 1,194,268,432.23   | 1,578,120,705.57   |
| 合计 | 435,204,800,336.59 | 393,276,849,978.78 |

## (iv) 本期融券业务无违约情况。

(2) 本公司为履行社会责任，在公益项目、慈善捐赠、扶贫捐赠等方面的支出为人民币 4,224,628.17 元（2020 年 1-6 月：17,871,903.31 元）

## (3) 以公允价值计量的资产和负债

2021 年 6 月 30 日

|             | 期初余额                | 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      | 期末余额               |
|-------------|---------------------|--------------------|------------------|--------------|--------------------|
| <b>金融资产</b> |                     |                    |                  |              |                    |
| 交易性金融资产     | 292,695,306,675.55  | (1,669,934,770.05) | -                | -            | 310,993,352,712.12 |
| 衍生金融资产      | 7,295,357,324.28    | 5,663,314,111.61   | -                | -            | 12,376,626,971.30  |
| 其他权益工具投资    | 10,678,417,333.15   | -                  | (483,824,444.38) | -            | 173,280,904.08     |
| 其他债权投资      | 5,267,955,106.65    | -                  | (24,064,802.35)  | 1,095,403.87 | 7,519,277,729.12   |
| 金融资产小计      | 315,937,036,439.63  | 3,993,379,341.56   | (507,889,246.73) | 1,095,403.87 | 331,062,538,316.62 |
| <b>金融负债</b> |                     |                    |                  |              |                    |
| 交易性金融负债     | (15,381,530,029.60) | (416,582,858.72)   | -                | -            | 23,050,529,481.43  |
| 衍生金融负债      | (13,398,830,136.71) | (1,234,441,013.20) | 8,771,789.69     | -            | 13,204,053,371.05  |
| 金融负债小计      | (28,780,360,166.31) | (1,651,023,871.92) | 8,771,789.69     | -            | 36,254,582,852.48  |

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

2021年6月30日

|               | 期初余额                       | 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               | 期末余额                       |
|---------------|----------------------------|---------------------------|------------------------|-----------------------|----------------------------|
| <b>金融资产</b>   |                            |                           |                        |                       |                            |
| 交易性金融资产       | 45,087,608,094.13          | (2,838,893,150.96)        | -                      | -                     | 50,124,301,603.18          |
| 衍生金融资产        | 2,789,106,458.90           | 1,470,187,357.06          | -                      | -                     | 7,680,486,268.12           |
| 其他权益工具投资      | 5,267,955,106.65           | -                         | (37,936,102.85)        | (1,569,922.34)        | 3,990,079,196.72           |
| 债权投资          | 291,487,016.54             | -                         | (573,006.80)           | -                     | 273,780,269.00             |
| 其他债权投资        | 98,590,711.24              | -                         | 13,639,721.85          | -                     | 77,278,725.93              |
| <b>金融资产小计</b> | <b>53,534,747,387.46</b>   | <b>(1,368,705,793.90)</b> | <b>(24,869,387.80)</b> | <b>(1,569,922.34)</b> | <b>62,145,926,062.95</b>   |
| <b>金融负债</b>   |                            |                           |                        |                       |                            |
| 交易性金融负债       | (11,670,703,864.81)        | 3,881,792.88              | -                      | -                     | (16,615,862,105.07)        |
| 衍生金融负债        | (9,611,695,759.90)         | 2,025,919,655.56          | 8,771,789.69           | -                     | (10,583,717,796.35)        |
| <b>金融负债小计</b> | <b>(21,282,399,624.71)</b> | <b>2,029,801,448.44</b>   | <b>8,771,789.69</b>    | <b>-</b>              | <b>(27,199,579,901.42)</b> |

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

|           | 2021年6月30日                | 2020年12月31日               |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| 货币资金      | 876,550,724.34            | 1,513,585,701.55          |
| 融出资金      | -                         | 311,411,219.72            |
| 交易性金融资产   | 125,778,295,356.47        | 123,053,738,377.51        |
| 债权投资      | 29,133,373,769.83         | 25,167,103,012.69         |
| 其他债权投资    | 2,991,284,863.88          | -                         |
| 其他权益工具投资  | -                         | 10,488,274,367.45         |
| <b>合计</b> | <b>158,779,504,714.52</b> | <b>160,534,112,678.92</b> |

## (6) 金融资产计量基础分类表

| 金融资产项目   | 以摊余成本计量的金融资产       | 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益               |                        | 以公允价值计量且其变动计入当期损益         |  | 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 |
|----------|--------------------|-----------------------------------|------------------------|---------------------------|--|-------------------------------------|
|          |                    | 分类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 | 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益 | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 按照《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 |                                     |
| 货币资金     | 185,520,581,184.12 | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 结算备付金    | 23,378,263,681.85  | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 融出资金     | 128,177,514,441.21 | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 交易性金融资产  | -                  | -                                 | -                      | 310,993,352,712.12        | -  | -                                   |
| 衍生金融资产   | -                  | -                                 | -                      | 12,376,626,971.30         | -  | -                                   |
| 买入返售金融资产 | 18,071,368,069.34  | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 应收款项     | 10,351,526,872.28  | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 存出保证金    | 26,336,577,261.54  | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 其他权益工具投资 | -                  | -                                 | 173,280,904.08         | -                         | -  | -                                   |
| 其他债权投资   | -                  | 7,519,277,729.12                  | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 债权投资     | 33,499,238,110.39  | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |
| 其他资产     | 620,130,573.68     | -                                 | -                      | -                         | -  | -                                   |

2021年6月30日账面金额

| 金融资产项目    | 以摊余成本计量的金融资产       | 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益                 |                                     | 以公允价值计量且其变动计入当期损益                        |                                     | 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 |
|-----------|--------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|
|           |                    | 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 | 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 | 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 | 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 |                                     |
| 短期借款      | 14,282,125,385.47  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 应付短期融资款   | 34,867,899,417.35  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 拆入资金      | 6,117,116,248.62   | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 交易性金融负债   | -                  | -                                   | 19,075,208,304.76                   | 3,975,321,176.67                         | -                                   | -                                   |
| 衍生金融负债    | -                  | 25,575,798.99                       | 13,178,477,572.06                   | -  | -                                   | -                                   |
| 卖出回购金融资产款 | 136,610,383,475.90 | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 代理买卖证券款   | 149,271,327,128.03 | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 代理承销证券款   | 2,902,000.00       | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 应付款项      | 60,640,038,120.56  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 长期借款      | 956,938,159.14     | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 应付债券      | 138,071,335,432.94 | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 其他负债      | 60,338,366,549.97  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |



2020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       | 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《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 |
|----------|--------------------|-----------------------------------|-----------------------------|--|--|-------------------------------------|
|          |                    | 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 | 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 | 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 | 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 |                                     |
| 货币资金     | 153,161,845,002.57 | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 结算备付金    | 28,112,597,360.67  | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 融出资金     | 102,574,007,019.08 | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 交易性金融资产  | -                  | -                                 | 292,695,306,675.55          | -  | -  | -                                   |
| 衍生金融资产   | -                  | -                                 | 7,295,357,324.28            | -  | -  | -                                   |
| 买入返售金融资产 | 19,536,412,405.52  | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 应收款项     | 9,095,560,247.32   | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 存出保证金    | 24,763,790,295.82  | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 其他权益工具投资 | -                  | -                                 | 10,678,417,333.15           | -  | -  | -                                   |
| 其他债权投资   | -                  | 5,267,955,106.65                  | -                           | -  | -  | -                                   |
| 债权投资     | 30,411,507,722.05  | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |
| 其他资产     | 472,655,093.42     | -                                 | -                           | -  | -  | -                                   |

2020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       | 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《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 |
|-----------|--------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--|-------------------------------------|-------------------------------------|
|           |                    | 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 | 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 | 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 | 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 |                                     |
| 短期借款      | 11,299,858,788.62  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 应付短期融资款   | 43,951,387,602.74  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 拆入资金      | 4,815,235,806.67   | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 交易性金融负债   | -                  | -                                   | 11,469,173,777.28                   | 3,912,356,252.32                         | -                                   | -                                   |
| 衍生金融负债    | -                  | 34,347,588.68                       | 13,364,482,548.03                   | -  | -                                   | -                                   |
| 卖出回购金融资产款 | 139,899,968,467.21 | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 代理买卖证券款   | 136,387,634,132.26 | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 代理承销证券款   | 70,930,338.63      | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 应付款项      | 43,706,056,087.16  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 长期借款      | 475,413,821.66     | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 应付债券      | 97,053,187,662.55  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |
| 其他负债      | 60,875,181,525.25  | -                                   | -                                   | -  | -                                   | -                                   |

## 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

| 2021年6月30日 |                   |      |                   |
|------------|-------------------|------|-------------------|
|            | 账面余额              | 减值准备 | 账面价值              |
| 对子公司投资     | 19,785,176,560.82 | -    | 19,785,176,560.82 |
| 对联营企业投资    | 11,674,731,750.32 | -    | 11,674,731,750.32 |
| 合计         | 31,459,908,311.14 | -    | 31,459,908,311.14 |

| 2020年12月31日 |                   |      |                   |
|-------------|-------------------|------|-------------------|
|             | 账面余额              | 减值准备 | 账面价值              |
| 对子公司投资      | 19,374,962,137.57 | -    | 19,374,962,137.57 |
| 对联营企业投资     | 11,317,183,689.38 | -    | 11,317,183,689.38 |
| 合计          | 30,692,145,826.95 | -    | 30,692,145,826.95 |

#### (2) 对子公司的投资

| 单位名称             | 期初余额              | 本期增加           | 本期减少 | 期末余额              | 减值准备<br>期末余额 |
|------------------|-------------------|----------------|------|-------------------|--------------|
| 华泰联合证券有限责任公司     | 1,288,386,241.52  | 4,511,880.48   | -    | 1,292,898,122.00  | -            |
| 华泰期货有限公司         | 971,998,085.65    | 59,278.03      | -    | 972,057,363.68    | -            |
| 华泰紫金投资有限责任公司     | 5,200,000,000.00  | 789,118.76     | -    | 5,200,789,118.76  | -            |
| 华泰国际金融控股有限公司     | 7,510,577,810.40  | 2,414,758.75   | -    | 7,512,992,569.15  | -            |
| 江苏股权交易中心有限责任公司   | 104,000,000.00    | 88,917.04      | -    | 104,088,917.04    | -            |
| 华泰创新投资有限公司       | 1,700,000,000.00  | 400,174,870.19 | -    | 2,100,174,870.19  | -            |
| 华泰证券(上海)资产管理有限公司 | 2,600,000,000.00  | 2,175,600.00   | -    | 2,602,175,600.00  | -            |
| 合计               | 19,374,962,137.57 | 410,214,423.25 | -    | 19,785,176,560.82 | -            |

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              | 本期增减变动 |      |                 |                |        |                  |        |    |      |                   | 减值准备期末余额 |
|--------------|-------------------|--------|------|-----------------|----------------|--------|------------------|--------|----|------|-------------------|----------|
|              |                   | 追加投资   | 减少投资 | 权益法下<br>确认的投资收益 | 其他综合收益         | 其他权益变动 | 宣告发放<br>现金股利或利润  | 计提减值准备 | 其他 | 期末余额 |                   |          |
| 南方基金管理股份有限公司 | 3,138,586,592.44  | -      | -    | 344,586,386.26  | (1,246,447.44) | -      | (295,956,611.06) | -      | -  | -    | 3,185,969,920.20  | -        |
| 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 590,457,198.59    | -      | -    | 99,432,603.69   | -              | -      | (75,950,000.00)  | -      | -  | -    | 613,939,802.28    | -        |
| 江苏银行股份有限公司   | 7,588,139,898.35  | -      | -    | 538,016,065.02  | 11,577,613.80  | 450.67 | (262,912,000.00) | -      | -  | -    | 7,874,822,027.84  | -        |
| 合计           | 11,317,183,689.38 | -      | -    | 982,035,054.97  | 10,331,166.36  | 450.67 | (634,818,611.06) | -      | -  | -    | 11,674,731,750.32 | -        |

## 2 应付职工薪酬

### (1) 应付职工薪酬列示：

|           | 附注      | 期初余额             | 本期增加额            | 本期减少额              | 期末余额             |
|-----------|---------|------------------|------------------|--------------------|------------------|
| 短期薪酬及长期薪金 | 十七、2(2) | 7,194,187,731.36 | 2,757,981,424.46 | (2,909,271,981.96) | 7,042,897,173.86 |
| 离职后福利     |         |                  |                  |                    |                  |
| - 设定提存计划  | 十七、2(3) | 257,825,600.00   | 246,602,193.00   | (126,124,868.15)   | 378,302,924.85   |
| 合计        |         | 7,452,013,331.36 | 3,004,583,617.46 | (3,035,396,850.11) | 7,421,200,098.71 |

2021年上半年，本公司向关键管理人员支付的薪酬总额为人民币 4,295 万元（2020 年上半年：人民币 2,686 万元）。

### (2) 短期薪酬及长期薪金

|             | 期初余额             | 本期增加额            | 本期减少额              | 期末余额             |
|-------------|------------------|------------------|--------------------|------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 7,188,972,896.38 | 2,506,657,103.66 | (2,655,677,866.80) | 7,039,952,133.24 |
| 职工福利费       | -                | 57,394,513.14    | (57,382,962.24)    | 11,550.90        |
| 社会保险费       | 137,152.40       | 80,320,902.01    | (80,196,551.72)    | 261,502.69       |
| 其中：医疗保险费    | 123,437.16       | 75,860,185.54    | (75,753,862.62)    | 229,760.08       |
| 工伤保险费       | -                | 1,273,705.08     | (1,266,147.75)     | 7,557.33         |
| 生育保险费       | 13,715.24        | 3,187,011.39     | (3,176,541.35)     | 24,185.28        |
| 住房公积金       | -                | 98,650,188.49    | (98,644,223.54)    | 5,964.95         |
| 工会经费和职工教育经费 | 5,077,682.58     | 14,958,717.16    | (17,370,377.66)    | 2,666,022.08     |
| 合计          | 7,194,187,731.36 | 2,757,981,424.46 | (2,909,271,981.96) | 7,042,897,173.86 |

2021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 4,344,384,700 元（2020年12月31日：人民币 5,619,040,100 元）

### (3) 离职后福利 - 设定提存计划

|         | 期初余额           | 本期增加额          | 本期减少额            | 期末余额           |
|---------|----------------|----------------|------------------|----------------|
| 基本养老保险费 | -              | 122,941,286.24 | (122,479,108.92) | 462,177.32     |
| 失业保险费   | -              | 3,660,906.76   | (3,645,759.23)   | 15,147.53      |
| 企业年金缴费  | 257,825,600.00 | 120,000,000.00 | -                | 377,825,600.00 |
| 合计      | 257,825,600.00 | 246,602,193.00 | (126,124,868.15) | 378,302,924.85 |

## 3 手续费及佣金净收入

|               | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 证券经纪业务净收入     | 3,142,344,698.72   | 2,665,557,029.61   |
| 其中：证券经纪业务收入   | 4,630,749,067.66   | 3,923,792,900.90   |
| 其中：代理买卖证券业务   | 3,750,517,684.84   | 3,315,933,184.95   |
| 交易单元席位租赁      | 410,147,278.23     | 304,560,065.10     |
| 代销金融产品业务      | 470,084,104.59     | 303,299,650.85     |
| 证券经纪业务支出      | (1,488,404,368.94) | (1,258,235,871.29) |
| 其中：代理买卖证券业务   | (1,488,404,368.94) | (1,258,235,871.29) |
| 期货经纪业务净收入     | 11,260,990.39      | 9,586,751.82       |
| 其中：期货经纪业务收入   | 11,260,990.39      | 9,586,751.82       |
| 投资银行业务净收入     | 158,352,731.95     | 228,801,651.91     |
| 其中：投资银行业务收入   | 160,508,005.13     | 229,356,130.70     |
| 其中：证券承销业务     | 160,508,005.13     | 229,356,130.70     |
| 投资银行业务支出      | (2,155,273.18)     | (554,478.79)       |
| 其中：证券承销业务     | (2,155,273.18)     | (554,478.79)       |
| 投资咨询服务净收入     | 23,745,730.26      | 15,520,642.96      |
| 其中：投资咨询服务收入   | 24,119,315.16      | 15,520,642.96      |
| 投资咨询服务支出      | (373,584.90)       | -                  |
| 其他手续费及佣金净收入   | 79,960,823.64      | 29,350,990.34      |
| 其中：其他手续费及佣金收入 | 80,947,176.28      | 51,741,575.19      |
| 其他手续费及佣金支出    | (986,352.64)       | (22,390,584.85)    |
| 合计            | 3,415,664,974.96   | 2,948,817,066.64   |
| 其中：手续费及佣金收入合计 | 4,907,584,554.62   | 4,229,998,001.57   |
| 手续费及佣金支出合计    | (1,491,919,579.66) | (1,281,180,934.93) |

#### 4 利息净收入

|                | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 利息收入           |                    |                    |
| 融资融券利息收入       | 4,183,041,566.26   | 2,411,301,871.23   |
| 货币资金及结算备付金利息收入 | 1,327,165,549.90   | 1,154,437,491.69   |
| 买入返售金融资产利息收入   | 196,267,332.41     | 113,891,519.84     |
| 其中：股票质押回购利息收入  | 188,776,660.05     | 91,583,723.30      |
| 债权投资利息收入       | 497,122,204.48     | 317,788,805.50     |
| 其他             | 14,957,997.16      | 24,454,285.11      |
| 利息收入小计         | 6,218,554,650.21   | 4,021,873,973.37   |
| 利息支出           |                    |                    |
| 应付债券利息支出       | (2,228,186,048.43) | (1,280,923,610.94) |
| 其中：次级债券利息支出    | (337,832,286.62)   | (208,612,268.06)   |
| 卖出回购金融资产利息支出   | (1,370,558,974.92) | (1,089,725,734.00) |
| 应付短期融资款利息支出    | (202,558,265.49)   | (421,433,119.33)   |
| 拆入资金利息支出       | (832,610,207.69)   | (297,025,448.45)   |
| 其中：转融通利息支出     | (631,410,771.51)   | (157,073,054.91)   |
| 代理买卖证券款利息支出    | (198,351,262.58)   | (159,581,330.60)   |
| 租赁负债利息支出       | (14,336,428.97)    | (10,741,632.68)    |
| 其他             | (48,659,473.26)    | (40,091,200.30)    |
| 利息支出小计         | (4,895,260,661.34) | (3,299,522,076.30) |
| 利息净收入          | 1,323,293,988.87   | 722,351,897.07     |

## 5 投资收益

### (1) 投资收益按类别列示

|                  | 2021年1-6月          | 2020年1-6月          |
|------------------|--------------------|--------------------|
| 成本法核算的长期股权投资收益   | -                  | -                  |
| 权益法核算的长期股权投资收益   | 982,035,054.97     | 768,993,003.12     |
| 金融工具投资收益         | 3,308,712,676.99   | 4,916,150,899.23   |
| 持有期间取得的分红和利息     | 3,379,384,135.38   | 2,743,858,774.67   |
| 其中：交易性金融资产       | 2,760,513,990.97   | 2,743,858,774.67   |
| 其他权益工具投资         | 618,870,144.41     | -                  |
| 处置金融工具取得的（损失）/收益 | (70,671,458.39)    | 2,172,292,124.56   |
| 其中：交易性金融资产       | 5,678,943,765.30   | 4,494,772,960.59   |
| 债权投资             | 36,087,521.48      | -                  |
| 衍生金融工具           | (5,750,306,431.94) | (2,254,454,256.53) |
| 交易性金融负债          | (35,396,313.23)    | (68,026,579.50)    |
| 合计               | 4,290,747,731.96   | 5,685,143,902.35   |

### (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                   |        | 2021年1-6月        | 2020年1-6月        |
|---------------------------|--------|------------------|------------------|
| 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 | 2,760,513,990.97 | 2,743,858,774.67 |
|                           | 处置取得收益 | 5,678,943,765.30 | 4,494,772,960.59 |
| 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 | 持有期间收益 | -                | -                |
|                           | 处置取得收益 | -                | -                |
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 持有期间收益 | -                | -                |
|                           | 处置取得亏损 | (35,396,313.23)  | (68,026,579.50)  |
| 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 | 持有期间收益 | -                | -                |
|                           | 处置取得收益 | -                | -                |
| 合计                        |        | 8,404,061,443.04 | 7,170,605,155.76 |



## 6 公允价值变动收益 / ( 损失 )

|                              | 2021 年 1-6 月     | 2020 年 1-6 月       |
|------------------------------|------------------|--------------------|
| 交易性金融资产                      | 118,236,390.63   | (4,232,580.38)     |
| 交易性金融负债                      | (922,140.26)     | (4,632,258.64)     |
| 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 | -                | -                  |
| 衍生金融工具                       | 946,141,888.33   | (1,550,594,528.95) |
| 合计                           | 1,063,456,138.70 | (1,559,459,367.97) |

## 7 业务及管理费

|           | 2021 年 1-6 月     | 2020 年 1-6 月     |
|-----------|------------------|------------------|
| 员工成本      | 3,028,074,681.32 | 2,458,334,212.16 |
| 研究开发费     | 211,486,816.69   | 221,232,696.16   |
| 固定资产折旧    | 137,519,955.02   | 124,023,996.13   |
| 使用权资产折旧   | 123,666,768.95   | 103,477,379.00   |
| 交易所费用     | 121,948,204.37   | 80,517,458.52    |
| 无形资产摊销    | 116,902,208.77   | 141,855,931.05   |
| 业务宣传费     | 70,195,802.85    | 50,182,184.40    |
| 邮电通讯费     | 51,036,252.61    | 39,327,697.29    |
| 证券投资者保护基金 | 48,248,452.14    | 38,632,134.52    |
| 长期待摊费用摊销  | 44,087,256.73    | 35,945,075.97    |
| 其他        | 236,108,476.07   | 159,468,538.55   |
| 合计        | 4,189,274,875.52 | 3,452,997,303.75 |

## 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

|                              | 2021年1-6月           | 2020年1-6月           |
|------------------------------|---------------------|---------------------|
| 净利润                          | 4,724,438,923.38    | 3,354,540,550.22    |
| 加：资产减值损失                     | (179,431,725.90)    | 207,074,883.70      |
| 固定资产及投资性房地产折旧                | 158,193,410.11      | 147,572,911.85      |
| 无形资产摊销                       | 116,902,208.77      | 141,855,931.05      |
| 长期待摊费用摊销                     | 44,087,256.73       | 35,945,075.97       |
| 使用权资产的摊销                     | 123,666,768.95      | 103,477,379.00      |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失 / (收益) | 2,816.58            | (71,313.60)         |
| 公允价值变动收益                     | (1,704,316,183.66)  | (1,245,249.88)      |
| 利息支出                         | 1,868,255,443.40    | 1,396,952,031.23    |
| 汇兑收益                         | 95,503,923.57       | (115,913,916.88)    |
| 投资收益                         | (1,600,905,199.38)  | (768,993,003.12)    |
| 递延所得税负债增加 / (减少)             | 696,968,577.74      | (574,190,016.10)    |
| 交易性金融工具的(增加) / 减少            | (16,743,545,352.88) | 12,622,614,758.63   |
| 经营性应收项目增加                    | (16,887,613,854.71) | (16,395,405,058.48) |
| 经营性应付项目的增加                   | 23,435,723,214.89   | 1,481,032,639.10    |
| 经营活动产生的现金流量净额                | (5,852,069,771.91)  | 1,635,247,602.69    |

## (2) 现金及现金等价物净变动情况

|                 | 2021年1-6月            | 2020年1-6月            |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 现金及现金等价物的期末余额   | 140,455,373,643.11   | 105,536,679,703.78   |
| 减：现金及现金等价物的期初余额 | (128,124,401,656.13) | (114,825,117,329.66) |
| 现金及现金等价物净增加额    | 12,330,971,986.98    | (9,288,437,625.88)   |

## 十八、补充资料

### 1 2021年1-6月非经常性损益明细表

|   | 金额              |
|---|-----------------|
| 非流动资产处置损失                                     | 319,213.69      |
| 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） | 74,335,646.38   |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出                            | (6,096,961.09)  |
| 所得税影响额  | (17,289,573.46) |
| 少数股东权益影响额（税后）                                 | (826,348.74)    |
| 合计  | 50,441,976.78   |

本集团持有金融资产、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、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。

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

### 3 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          | 5.73          | 0.86   | 0.86   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 5.69          | 0.86   | 0.85   |

## 十九、财务报表的批准报出

本财务报表经公司董事会于2021年8月27日批准报出。

## 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                                  |

## 证券公司信息披露

### 一、公司重大行政许可事项的相关情况

2021年1月18日,《关于华泰证券开展商品期货做市业务有关意见的复函》(机构部函【2021】177号)。

### 二、监管部门对公司的分类结果

- 1、2019年度,在证券公司分类评价中,公司被评为A类AA级。
- 2、2020年度,在证券公司分类评价中,公司被评为A类AA级。
- 3、2021年度,在证券公司分类评价中,公司被评为A类AA级。

# 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  | 2021-01-04 | 华泰证券股份有限公司第五届董事会第十一次会议决议公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于提名公司非执行董事候选人的独立意见、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划（草案）摘要公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于《华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划（草案）》及相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司监事会关于《华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划（草案）》及相关事项的核查意见、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划实施考核管理办法、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划管理办法、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划（草案）、华泰证券股份有限公司第五届监事会第六次会议决议公告  |
| 2  | 2021-01-06 | 华泰证券股份有限公司关于以集中竞价交易方式回购公司 A 股股份的回购进展公告   |
| 3  | 2021-01-07 | 华泰证券 H 股公告 -- 截至 2020 年 12 月 31 日股份发行人的证券变动月报表   |
| 4  | 2021-01-08 | 华泰证券股份有限公司关于独立董事公开征集投票权的公告、华泰证券股份有限公司关于召开 2021 年第一次临时股东大会的通知、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（草案）的法律意见书、华泰证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会大会文件  |
| 5  | 2021-01-09 | 华泰证券 H 股公告 -- 翌日披露报表   |
| 6  | 2021-01-12 | 华泰证券股份有限公司关于 A 股股份回购实施结果暨股份变动的公告   |
| 7  | 2021-01-21 | 华泰证券股份有限公司关于开展商品期货做市业务收到中国证监会复函的公告   |
| 8  | 2021-01-27 | 华泰证券股份有限公司 2021 年度第一期短期融资券发行结果公告   |
| 9  | 2021-01-29 | 华泰证券股份有限公司 2021 年度第二期短期融资券发行结果公告   |
| 10 | 2021-01-30 | 华泰证券股份有限公司第五届董事会第十二次会议决议公告、华泰证券股份有限公司关于疫情防控期间参加 2021 年第一次临时股东大会相关注意事项的提示性公告、华泰证券 H 股公告 -- 关连交易成立合伙企业   |
| 11 | 2021-02-03 | 华泰证券 H 股公告 -- 截至 2021 年 1 月 31 日股份发行人的证券变动月报表、华泰证券股份有限公司第五届监事会第七次会议决议公告、华泰证券股份有限公司监事会关于 A 股限制性股票股权激励计划激励对象名单的公示情况说明及核查意见、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划激励对象名单、关于 A 股限制性股票股权激励计划获批的公告  |
| 12 | 2021-02-09 | 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内幕信息知情人买卖公司股票情况的自查报告、华泰证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会决议公告、北京市金杜律师事务所关于华泰证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会之法律意见书、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划管理办法、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划实施考核管理办法、华泰证券股份有限公司股东大会议事规则（2021 年修订）、华泰证券股份有限公司关于董事任职的公告、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十三次会议决议公告  |
| 13 | 2021-02-10 | 华泰证券股份有限公司当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告  |
| 14 | 2021-03-04 | 华泰证券 H 股公告 -- 截至 2021 年 2 月 28 日股份发行人的证券变动月报表  |
| 15 | 2021-03-12 | 华泰证券股份有限公司 2021 年度第三期短期融资券发行结果公告、华泰证券 H 股公告 -- 董事会召开日期   |
| 16 | 2021-03-18 | 华泰证券股份有限公司关于召开 2020 年度业绩说明会的公告   |
| 17 | 2021-03-24 | 华泰证券股份有限公司 2020 年年度报告摘要、华泰证券股份有限公司 2020 年度内部控制评价报告、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预计 2021 年度日常关联交易的公告、华泰证券股份有限公司关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项的公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项及授予事项的独立意见、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十四次会议决议公告、华泰证券股份有限公司第五届监事会第八次会议决议公告、华泰证券股份有限公司 2020 年年度利润分配方案公告、华泰证券股份有限公司关于计提资产减值准备的公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于计提资产减值准备的独立意见、华泰证券股份有限公司 2020 年年度报告、华泰证券股份有限公司关于向 A 股限制性股票股权激励计划激励对象授予 A 股限制性股票的公告、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调整及授予相关事项的法律意见书、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划激励对象名单、华泰证券股份有限公司监事会关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项及授予事项的核查意见、华泰证券股份有限公司独立董事关于公司 2020 年年度报告相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司 2020 年度审计报告、华泰证券股份有限公司 2020 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独立董事 2020 年度履职报告、华泰证券股份有限公司 2020 年度社会责任报告、华泰证券股份有限公司 2020 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 2020 年度履职情况报告 |
| 18 | 2021-04-01 | 华安证券、华泰联合证券关于华泰证券所属 AssetMark 境外上市之持续上市总结报告书   |
| 19 | 2021-04-06 | 华泰证券股份有限公司关于完成股份性质变更暨 A 股限制性股票股权激励计划授予的进展公告  |
| 20 | 2021-04-08 | 华泰证券 H 股公告 -- 截至 2021 年 3 月 31 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 A 股限制性股票股权激励计划授予结果公告  |


| 序号 | 日期         | 公告事项   |
|----|------------|--|
| 21 | 2021-04-13 | 华泰证券股份有限公司关于境外债券于香港联合交易所有限公司上市的公告、华泰证券股份有限公司为境外全资附属公司发行美元债券提供担保的公告   |
| 22 | 2021-04-20 | 华泰证券 H 股公告 -- 董事会召开日期  |
| 23 | 2021-04-22 | 华泰证券股份有限公司为境外全资附属公司发行美元债券提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于境外债券于香港联合交易所有限公司上市的公告   |
| 24 | 2021-04-30 | 华泰证券股份有限公司 2021 年第一季度报告正文、华泰证券股份有限公司 2021 年第一季度报告、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十五次会议决议公告   |
| 25 | 2021-05-07 | 华泰证券 H 股公告 -- 截至 2021 年 4 月 30 日股份发行人的证券变动月报表  |
| 26 | 2021-05-21 | 华泰证券股份有限公司关于召开 2020 年年度股东大会的通知、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十六次会议决议公告、华泰证券股份有限公司独立董事关于提名公司独立非执行董事候选人的独立意见、华泰证券股份有限公司独立董事提名人名声、华泰证券股份有限公司独立董事候选人声明、华泰证券股份有限公司 2020 年度股东大会文件 |
| 27 | 2021-06-04 | 华泰证券 H 股公告 -- 截至 2021 年 5 月 31 日股份发行人的证券变动月报表  |
| 28 | 2021-06-11 | 华泰证券股份有限公司关于疫情防控期间参加 2020 年年度股东大会相关注意事项的提示性公告  |
| 29 | 2021-06-23 | 华泰证券股份有限公司关于独立非执行董事任职的公告、华泰证券股份有限公司 2020 年年度股东大会决议公告、北京市金杜律师事务所关于华泰证券股份有限公司 2020 年年度股东大会之法律意见书   |
| 30 | 2021-06-29 | 华泰证券股份有限公司 2021 年度第四期短期融资券发行结果公告   |
| 31 | 2021-06-30 | 华泰证券股份有限公司第五届董事会第十七次会议决议公告   |

## 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  | 2021-01-06 | 截至二零二零年十二月三十一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以集中竞价交易方式回购公司 A 股股份的回购进展公告   |
| 2  | 2021-01-07 | 选举非执行董事、本公司境内外债务融资工具一般性授权、修订《股东大会议事规则》、建议采纳 A 股限制性股票股权激励计划及 2021 年第一次临时股东大会通告、临时股东大会通告、2021 年 2 月 8 日举行的 2021 年第一次临时股东大会 H 股股东代表委任表格、2021 年 2 月 8 日举行的 2021 年第一次临时股东大会独立非执行董事征集投票权授权委托书、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、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于召开 2021 年第一次临时股东大会的通知、华泰证券股份有限公司关于独立董事公开征集投票权的公告、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（草案）的法律意见书、华泰证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会文件 |
| 3  | 2021-01-08 | 翌日披露报表  |
| 4  | 2021-01-11 | 回购 A 股结果、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于 A 股股份回购实施结果暨股份变动的公告   |
| 5  | 2021-01-19 | 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（第一期）票面利率公告   |
| 6  | 2021-01-20 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于开展商品期货做市业务收到中国证监会复函的公告  |
| 7  | 2021-01-21 | 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（第一期）发行结果公告   |
| 8  | 2021-01-26 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司 2021 年度第一期短期融资券发行结果公告  |
| 9  | 2021-01-28 | 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次级债券（第一期）票面利率公告、华泰证券股份有限公司 2021 年度第二期短期融资券发行结果公告  |
| 10 | 2021-01-29 | 关连交易 - 成立合伙企业、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司第五届董事会第十二次会议决议公告、华泰证券股份有限公司关于疫情防控期间参加 2021 年第一次临时股东大会相关注意事项的提示性公告   |
| 11 | 2021-02-01 | 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次级债券（第一期）发行结果公告   |
| 12 | 2021-02-02 | 截至 2021 年 1 月 31 日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第五届监事会第七次会议决议公告、华泰证券股份有限公司监事会关于 A 股限制性股票股权激励计划激励对象名单的公示情况说明及核查意见、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划激励对象名单、关于 A 股限制性股票股权激励计划获批的公告   |
| 13 | 2021-02-08 | 2021 年第一次临时股东大会之投票表决结果 非执行董事变更及调整董事会专门委员会组成方案、董事名单与其角色和职能、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划实施考核管理办法、北京市金杜律师事务所关于华泰证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会之法律意见书、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十三次会议决议公告、华泰证券股份有限公司股东大会会议事规则（2021 年修订）、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划管理办法、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内幕信息知情人买卖公司股票情况的自查报告、  |
| 14 | 2021-02-09 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告   |
| 15 | 2021-03-03 | 截至二零二一年二月二十八日止股份发行人的证券变动月报表   |

| 序号 | 日期         | 公告事项  |
|----|------------|---|
| 16 | 2021-03-11 | 董事会召开日期、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司 2021 年度第三期短期融资券发行结果公告  |
| 17 | 2021-03-17 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于召开 2020 年度业绩说明会的公告  |
| 18 | 2021-03-19 | 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（第一期）（品种一）<br>关于向 A 股限制性股票股权激励计划激励对象授予 A 股限制性股票的公告、关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项的公告、关于计提资产减值准备的公告、截至 2020 年 12 月 31 日止年度之业绩公告、2020 社会责任报告、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司 2020 年年度报告、华泰证券股份有限公司 2020 年年度报告摘要、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十四次会议决议公告、华泰证券股份有限公司第五届监事会第八次会议决议公告、华泰证券股份有限公司 2020 年年度利润分配方案公告、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预计 2021 年度日常关联交易的公告、华泰证券股份有限公司监事会关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项 |
| 19 | 2021-03-23 | 及授予事项的核查意见、华泰证券股份有限公司 A 股限制性股票股权激励计划激励对象名单、华泰证券股份有限公司独立董事关于调整公司 A 股限制性股票股权激励计划相关事项及授予事项的独立意见、华泰证券股份有限公司独立董事关于计提资产减值准备的独立意见、华泰证券股份有限公司独立董事关于公司 2020 年度报告相关事项的独立意见、华泰证券股份有限公司 2020 年度内部控制评价报告、华泰证券股份有限公司 2020 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 2020 年度内部控制审计报告、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调整及授予相关事项的法律意见书  |
| 20 | 2021-03-31 | 海外监管公告 -- 华安证券、华泰联合证券关于华泰证券所属 AssetMark 境外上市之持续上市总结报告书  |
| 21 | 2021-04-07 | 截至二零二一年三月三十一日止股份发行人的证券变动月报表、关于 A 股限制性股票股权激励计划授予结果的公告、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于完成股份性质变更暨 A 股限制性股票股权激励计划授予的进展公告  |
| 22 | 2021-04-12 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于境外债券于香港联合交易所有限公司上市的公告、华泰证券股份有限公司为境外全资附属公司发行美元债券提供担保的公告  |
| 23 | 2021-04-19 | 董事会召开日期   |
| 24 | 2021-04-21 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司为境外全资附属公司发行美元债券提供担保的公告、华泰证券股份有限公司关于境外债券于香港联合交易所有限公司上市的公告  |
| 25 | 2021-04-22 | 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）2021 年付息公告   |
| 26 | 2021-04-23 | 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）票面利率公告   |
| 27 | 2021-04-27 | 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）发行结果公告、华泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年次级债券（第二期）（品种一）2021 年本息兑付及摘牌公告   |
| 28 | 2021-04-29 | 2021 年第一季度报告、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司第五届董事会第十五次会议决议公告   |
| 29 | 2021-05-06 | 截至二零二一年四月三十日止股份发行人的证券变动月报表  |
| 30 | 2021-05-14 | 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（第三期）票面利率公告   |
| 31 | 2021-05-18 | 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）发行结果公告   |
| 32 | 2021-05-20 | 建议变更独立非执行董事、年度股东大会通告、2020 年度股东大会通函、2021 年 6 月 22 日举行的年度股东大会 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、海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司独立董事关于提名公司独立非执行董事候选人的独立意见、华泰证券股份有限公司关于召开 2020 年年度股东大会的通知、华泰证券股份有限公司 2020 年度股东大会文件、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十六次会议决议公告、华泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年公司债券（第一期）（品种二）2021 年付息公告   |
| 33 | 2021-05-21 | 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）票面利率公告   |
| 34 | 2021-05-25 | 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）发行结果公告   |
| 35 | 2021-05-28 | 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）2021 年付息公告  |
| 36 | 2021-06-03 | 截至二零二一年五月三十一日止股份发行人的证券变动月报表   |
| 37 | 2021-06-10 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司关于疫情防控期间参加 2020 年年度股东大会相关注意事项的提示性公告、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）（品种一）2021 年兑付及摘牌公告、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）2021 年付息公告  |
| 38 | 2021-06-15 | 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）票面利率公告   |
| 39 | 2021-06-16 | 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）发行结果公告   |
| 40 | 2021-06-18 | 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）票面利率公告   |
| 41 | 2021-06-22 | 2020 年度股东大会之投票表决结果；派付末期股息；及独立非执行董事变更、董事名单与其角色和职能、海外监管公告 -- 北京市金杜律师事务所关于华泰证券股份有限公司 2020 年年度股东大会之法律意见书  |
| 42 | 2021-06-23 | 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）发行结果公告   |
| 43 | 2021-06-25 | 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短期公司债券（第一期）票面利率公告   |
| 44 | 2021-06-28 | 海外监管公告 -- 华泰证券股份有限公司 2021 年度第四期短期融资券发行结果公告  |
| 45 | 2021-06-29 | 海外监管公告 -- 董事名单与其角色和职能、调整审计委员会组成、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短期公司债券（第一期）发行结果公告、华泰证券股份有限公司第五届董事会第十七次会议决议公告  |



 华泰在线: [www.htsc.com](http://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](http://www.htsc.com)

Customer Services Hotline: 95597

Company Address: No. 228 Middle Jiangdong Road, Nanjing, Jiangsu Province, PRC

© HUATAI SECURITIES All Rights Reserved.   
RECYCLABLE