

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



海通證券股份有限公司
HAITONG SECURITIES CO., LTD.*

(在中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

(股份代號：6837)

公告

- (1) 建議授予認可、分配或發行A股及／或H股股份的一般性授權
- (2) 2023年度日常關聯／連交易預計
- (3) 關於計提資產減值準備
- 及
- (4) 建議本公司2023年度自營投資業務配置規模預計

海通證券股份有限公司（「本公司」）董事（「董事」）會（「董事會」）謹此宣佈：

一、建議授予認可、分配或發行A股及／或H股股份的一般性授權

董事會經審議同意提請本公司股東大會審議和批准授予認可、分配或發行本公司A股（「A股」）及／或本公司H股（「H股」）股份的一般性授權。該一般性授權包括：

1. 在符合以下(1)、(2)、(3)項所列條件的前提下，根據《中華人民共和國公司法》（「公司法」）、《中華人民共和國證券法》（「證券法」）、香港聯合交易所有限公司證券上市規則（「香港上市規則」）及公司章程的規定，擬提請股東大會給予董事會一項無條件一般性授權，使董事會有權單獨或同時認可、分配或發行A股及／或H股（包括認股權證、可轉換公司債券及附有權利認購或轉換成股份之其他證券），並為完成該等事項簽署必要文件、辦理必要手續和採取其他必要的行動：

- (1) 該授權的有效期不得超過批准該項授權的股東大會決議通過之日起至下列最早日期止的期間：

(a) 該股東大會決議通過後公司下屆年度股東大會結束時；或

(b) 該股東大會決議通過後12個月屆滿之日；或

- (c) 公司股東於任何股東大會上通過決議撤銷或修訂本議案所賦予董事會的一般性授權之日。

如授權有效期內，董事會已簽署必要文件、辦理必要手續或採取相關行動，而該等文件、手續或行動可能需要在上述授權有效期結束時或之後履行、進行或持續至上述授權有效期結束後完成，則授權有效期將相應延長；

- (2) 董事會擬認可、分配或發行、或有條件或無條件地同意認可、分配或發行的A股及／或H股各自數量（包括認股權證、可轉換公司債券及附有權利認購或轉換成股份之其他證券，以其對應的潛在增加股份總數進行相應折算）不得超過批准上述授權的股東大會決議通過之日公司已發行的A股或H股各自數量的20%；
- (3) 董事會僅在符合公司法、證券法、香港上市規則或任何其他政府或監管機構的所有適用法律、法規及規定，並在獲得中國證券監督管理委員會及／或其他有關的中國政府機關批准的情況下方可行使上述授權。
2. 提請股東大會授權董事會在根據本項一般性授權發行股份的情況下，增加公司的註冊資本，以反映公司根據該項一般性授權而發行的股份數目，並對公司的章程作出其認為適當及必要的修訂，以反映公司註冊資本的增加，以及採取任何其他所需的行動和辦理任何所需手續。
3. 提請股東大會同意董事會在獲得上述授權的條件下，除非法律法規另有規定，將上述授權轉授予公司董事長、總經理共同或分別簽署、執行、修改、完成、遞交與認可、分配或發行一般性授權項下股份相關的一切協議、合同和文件。

一份載有（其中包括）以上議案詳情的通函，連同股東大會的通告，將適時地向本公司股東寄發。

二、2023年度日常關聯／連交易預計

本公司經中國證券監督管理委員會批准從事證券業務，開展證券及其他金融產品的交易和中介服務，交易對手和服務對象也包括公司的關聯方／關連人士。為做好關聯／連交易管理和信息披露工作，根據《中華人民共和國公司法》《上市公司治理準則》《上海證券交易所股票上市規則》（「《上交所上市規則》」）《上海證券交易所上市公司自律監管指引第5號－交易與關聯交易》《香港上市規則》及其他有關法律法規的規定，以及《公司章程》和本公司《關聯交易管理辦法》的要求，結合本公司日常經營和業務開展的需要，本公司對2023年日常關聯／連交易進行了預計。

(I) 關聯／連交易履行的審議程序

1. 董事會的審議和表決情況

本公司於2023年3月30日召開的第七屆董事會第三十六次會議審議通過了《關於預計公司2023年度日常關聯／連交易的議案》。

2. 獨立董事的事前認可情況和獨立意見

公司獨立董事對該交易事項出具了事前認可意見，並發表了獨立意見：公司預計的2023年度各項關聯／連交易為公司在證券市場上提供的公開服務或交易，為公司日常經營業務，交易以公允價格執行，不存在損害公司及中小股東利益的情況；相關業務的開展有利於促進公司的業務增長，符合公司實際業務需要，有利於公司的長遠發展；有關的關聯交易情況應根據《上交所上市規則》在公司的相關定期報告中予以披露。

3. 審計委員會的審議情況

公司董事會審計委員會對公司2022年日常關聯／連交易執行情況進行了審核，並同意了公司對2023年度日常關聯交易的預計，同意將該事項提交公司董事會審議。

上述議案尚需提交股東大會審議通過後生效。一份載有（其中包括）以上議案詳情的通函，連同股東大會的通告，將適時地向本公司股東寄發。

(II) 2022年本公司日常關聯／連交易執行情況

1. 香港上市規則項下的持續性關連交易

茲提述本公司日期為2020年8月6日的持續關連交易公告，本公司於2020年8月6日與上海國盛(集團)有限公司(「**上海國盛集團**」)簽署《證券和金融產品交易及服務框架協議》(「**框架協議**」)。框架協議明確關連交易及相關服務的範圍、定價基準、管控流程等內容，並對截至2022年12月31日止三個年度的持續關連交易的年度上限進行預計。

上述框架協議經本公司第七屆董事會第十次會議(臨時會議)審議通過。關聯董事屠旋旋先生已根據有關法律法規及公司內部規定回避表決，本公司獨立非執行董事已針對框架協議的簽署發表事前認可意見和獨立意見。相關董事會審議結果及框架協議簽署公告均按照上海證券交易所及香港聯合交易所的相關要求進行披露。

截至2022年12月31日止年度(「**報告期內**」)，本集團與上海國盛集團及其聯繫人之間涉及證券和金融產品交易及證券和金融服務相關的持續關連交易執行情況如下：

單位：人民幣萬元

交易內容	截至2022年 12月31日止之 年度上限	截至2022年 12月31日止之 實際發生金額
證券和金融產品交易		
流入 ⁽¹⁾	290,000.00	14,041.75
流出 ⁽²⁾	540,000.00	2,943.45
證券和金融服務		
產生收入	7,000.00	671.46
支付費用	2,000.00	—

- (1) 「流入」是指本集團從證券和金融產品交易產生的現金流入總額，包括固定收益產品和權益類產品銷售、固定收益產品相關的衍生產品所得利息及通過融資交易的借入／購回所產生的現金流入總額。
- (2) 「流出」是指本集團從證券和金融產品交易產生的現金流出總額，包括固定收益產品及權益類產品購買、固定收益產品相關的衍生產品所付利息及通過融資交易的借出／買入返售所產生的現金流出總額。

本公司聘請的審計機構羅兵咸永道會計師事務所已就上述持續關連交易執行審核程序，並向公司董事會發出鑑證報告確認：(1)無注意到任何事項令其相信該等已披露的持續關連交易未獲公司董事會批准。(2)就集團提供貨品或服務所涉及的交易，並無注意到任何事項令其相信該等交易在各重大方面沒有按照集團的定價政策進行；(3)並無注意到任何事項令其相信該等交易在各重大方面沒有根據有關該等交易的協議進行；及(4)就上述列表所載持續關連交易的總金額而言，並無注意到任何事項令其相信該等持續關連交易的金額超逾公司訂立的全年上限。

本公司獨立非執行董事已審核上述持續關連交易，並確認：(1)於本集團之一般及日常業務中訂立；(2)按一般商業條款或更加條款進行；及(3)根據有關交易的協議進行，其條款公平合理，並符合股東的整體利益。

2. 《上交所上市規則》項下的日常關聯交易

(1) 與上海國盛集團及上海國盛集團資產有限公司的關聯交易

單位：人民幣萬元

交易內容	截至2022年 12月31日 止年度 發生金額	佔同類交易 金額的 比例	備註
手續費及 佣金淨收入	189.58	0.02%	向關聯人收取的資產管理手續費及佣金收入
手續費及 佣金淨收入	12.31	0.00%	向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入
利息淨收入	80.24	0.01%	關聯人保證金產生的利息淨收入
衍生金融工具 交易淨損益 (註)	625.28	N/A	報告期內，名義本金發生額人民幣1.71億元， 截至2022年12月31日，名義本金餘額人民幣0.57億元。

註：關聯人作為交易對手方與公司進行衍生品交易產生的已實現及未實現投資收益，虧損以負值列示。

單位：人民幣萬元

往來項目	於2022年 12月31日 餘額	佔同類交易 金額的 比例	備註
應收款項	68.43	0.01%	應向關聯人收取的各項服務手續費餘額
代理買賣 證券款	0.92	0.00%	關聯人存放公司的客戶保證金餘額
應付款項	5,698.00	0.50%	公司應付關聯人衍生金融工具保證金餘額
衍生金融資產	231.00	0.16%	與關聯人開展衍生品交易產生的衍生金融資產餘額

- (2) 與本公司董事、監事、高級管理人員擔任董事、高級管理人員的除本公司及其控股子公司以外的企業等其它關聯法人的關聯交易

單位：人民幣萬元

交易內容	截至2022年 12月31日 止年度 發生金額	佔同類交易 金額的 比例	備註
手續費及 佣金淨收入	28,404.88	2.45%	向關聯人收取的資產管理業務收入、銷售服務費收入、投資諮詢服務費收入等
手續費及 佣金淨收入	82.07	0.01%	向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入
利息淨收入	56.21	0.01%	關聯人保證金產生的利息淨收入

交易內容	截至2022年 12月31日 止年度 發生金額	佔同類交易 金額的 比例	備註
業務及管理費	1.10	0.00%	向關聯人支付的基金銷售服務費等支出
衍生金融 工具交易 淨損益(註)	10,133.61	N/A	報告期內，名義本金發生額人民幣423.16億元，於2022年12月31日，名義本金餘額人民幣41.86億元。

註：關聯人作為交易對手方與公司進行衍生品交易產生的已實現及未實現投資收益，虧損以負值列示。

單位：人民幣萬元

往來項目	於2022年 12月31日 餘額	佔同類交易 金額的 比例	備註
應收款項	2,066.80	0.20%	應收關聯人業務報酬及預付業務保證金餘額等
應付款項	3.04	0.00%	應付關聯人業務服務費及待付業務保證金餘額
代理買賣 證券款	5,484.72	0.05%	關聯人存放公司的客戶保證金餘額
衍生金融資產	1,543.32	1.04%	與關聯人開展衍生品交易產生的衍生金融資產餘額
衍生金融負債	228.53	0.25%	與關聯人開展衍生品交易產生的衍生金融負債餘額
交易性金融 負債	28.59	0.00%	與關聯人開展衍生品交易產生的交易性金融負債餘額

部分證券公司等關聯法人作為合格交易對手方與公司開展現券買賣交易，報告期內累計成交金額人民幣105.21億元。

(III)2023年日常關聯／連交易預計金額和類別

本公司對2023年度及至召開2023年度股東大會期間可能發生的日常關聯／連交易進行了預計。

1. 上海國盛集團及其聯繫人

茲提述本公司日期為2022年12月30日的公告，本公司與上海國盛集團於2022年12月30日重續持續關連交易框架協議，據此，本集團與上海國盛集團及其聯繫人將在日常業務過程中繼續進行證券和金融產品交易以及證券和金融服務，具體的交易類別和截至2025年12月31日止三個年度的該等交易的年度上限，請參見本公司日期為2022年12月30日的公告。

2. 與本公司董事、監事、高級管理人員擔任董事、高級管理人員的除本公司及其控股子公司以外的企業等其它關聯法人的關聯交易

交易類別	交易內容	預計交易 上限及說明
證券和金融 產品服務	為關聯方提供證券、期貨經紀服務；向關聯方出租交易席位；向關聯方提供定向資產管理服務；為關聯方提供資產託管與運營外包服務；在關聯方銀行存款及存款利息；關聯方提供第三方資金存管服務；代銷關聯方金融產品；為關聯方提供承銷、保薦及財務顧問服務；為關聯方提供股票質押及融資融券服務；向關聯方提供投資諮詢服務；關聯方為公司提供銀行授信、借款等服務；向關聯方提供融資租賃業務；向關聯方支付股利；與關聯人共同投資。	因業務的發生及規模的不確定性，以實際發生數計算。

交易類別	交易內容	預計交易 上限及說明
證券和金融 產品交易	與關聯方在銀行間市場進行買入返售或賣出回購交易；與關聯方在銀行間市場進行債券自營交易；與關聯方進行收益權轉讓交易；認購關聯方發行的債券、基金、理財產品或信託計劃；關聯方認購本公司發行的基金、資產管理計劃、理財產品、場外衍生品及非公開發行債券；與關聯方在全國股份轉讓系統進行掛牌股票的轉讓交易；與關聯人共同投資。	因業務的發生及規模的不確定性，以實際發生數計算。

(IV) 預計2023年度確定發生關聯／連交易的關聯方及其關聯關係介紹

1. 上海國盛(集團)有限公司及其聯繫人

上海國盛(集團)有限公司為國有獨資的大型投資控股和資本運營公司，成立於2007年4月。截至2022年12月31日上海國盛(集團)有限公司及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司合計持有公司10.38%的股份。根據《上交所上市規則》第6.3.3條第二款第(四)項，上海國盛(集團)有限公司及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司為公司關聯人；根據《香港上市規則》第14A.07條第(1)/(4)款、第14A.13條第(1)款，上海國盛(集團)有限公司及其聯繫人為公司關連人。

2. 其他關聯企業

根據《上交所上市規則》第6.3.3條第二款第(三)項，本公司董事、監事和高級管理人員擔任董事(不含同為雙方的獨立董事)、高級管理人員的除本公司、控股子公司及控制的其他主體以外的企業為公司關聯方，但不構成《香港上市規則》項下的關連方。

(V) 定價原則

1. 證券和金融服務

主要包括但不限於因相關業務產生的：代理買賣證券手續費、證券金融產品銷售服務費、受託資產管理費與業績報酬、投資諮詢服務費、投行承銷費、財務顧問費、應收賬款、應付賬款等，定價參照市場化價格水平、行業慣例、第三方定價確定。

2. 證券和金融產品交易

主要包括但不限於因相關業務產生的：保證金利息收入、投資收益、交易性金融資產等，定價參照市場化價格水平、行業慣例、第三方定價確定。

上述日常關聯／連交易不存在損害公司及股東特別是中、小股東利益的情形。

(VI) 交易目的及對公司產生的影響

1. 上述關聯／連交易系日常關聯／連交易，均因公司日常業務經營產生，能為公司產生一定的收益，有助於公司業務的發展，但不對公司正常經營產生重大影響；
2. 上述關聯／連交易是公允的，交易的定價參考了市場價格，不存在損害公司利益的情況；
3. 上述關聯／連交易不影響公司的獨立性，公司主要業務沒有因上述關聯／連交易而對關聯／連方形成依賴。

(VII) 香港上市規則之影響

上海國盛集團為香港上市規則第十四A章項下本公司的關連人士。因此，本集團與上海國盛集團及其聯繫人訂立的該等交易構成香港上市規則第十四A章項下本公司之持續關連交易。本公司已於2020年8月6日與上海國盛集團訂立持續關連交易框架協議，於2022年12月30日重續持續關連交易框架協議，並履行香港上市規則項下的申報、公告及年度審核等要求。詳見本公司日期為2020年8月6日及2022年12月30日的公告及本公司日期為2023年3月30日的年度業績公告。

根據適用的中國法律及法規，上述關聯交易須在本公司股東大會上提呈議案以供股東投票表決。一份載有（其中包括）該議案詳情的通函，連同股東大會的通告，將適時地向本公司股東寄發。

如果將來上述任何關聯交易將構成香港上市規則第十四A章項下規定的「關連交易」或不再受相關豁免，則本公司將嚴格按照香港上市規則第十四A章的規定履行相應合規義務（包括但不限於申報、公告、年度審查或獨立股東批准）。

三、關於計提資產減值準備

1. 計提資產減值準備情況概述

根據《企業會計準則》和本公司會計政策的相關規定，為真實、公允地反映本公司截至2022年12月31日的財務狀況及2022年經營成果，本公司及下屬子公司對截至2022年12月31日的各項需要計提減值的資產進行了預期信用損失評估和減值測試，2022年共計提信用減值損失人民幣166,564.89萬元，計提其他資產減值損失人民幣6,512.10萬元，合計計提資產減值損失人民幣173,076.99萬元，對淨利潤的影響超過公司2021年經審計的淨利潤的10%，具體如下：

單位：人民幣萬元

項目	2022年計提金額
一、信用減值損失	166,564.89
其中：應收融資租賃款	119,523.26
長期應收款	50,301.24
融出資金	43,904.44
其他貸款和應收款項	34,290.56
應收款項	13,988.28
買入返售金融資產	-95,383.58
其他	-59.31
二、其他資產減值損失	6,512.10
合計	173,076.99

2. 計提資產減值準備對公司的影響

2022年，本公司合併報表共計提資產減值準備人民幣173,076.99萬元，減少利潤總額人民幣173,076.99萬元，減少淨利潤人民幣140,605.92萬元。

3. 計提資產減值準備的具體說明

(1). 應收融資租賃款

2022年計提應收融資租賃款減值準備人民幣11.95億元。

對於融資租賃業務，根據應收融資租賃款的信用風險變化評估預期信用損失並確定相應的信用損失準備，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算預期信用損失，計提減值準備。

(2). 長期應收款

2022年計提長期應收款減值準備人民幣5.03億元。

對於售後回租業務，根據長期應收款的信用風險變化評估預期信用損失並確定相應的信用損失準備，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算預期信用損失，計提減值準備。

(3). 融出資金

2022年計提融出資金減值準備人民幣4.39億元。

對於融出資金業務，根據融資主體特徵和擔保證券預期處置變現狀況，綜合評估融資主體的預期可回收現金流量，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算其預期信用損失，計提減值準備。

(4). 其他貸款和應收款項

2022年計提其他貸款和應收款項減值準備人民幣3.43億元。

對於其他貸款及應收款項，根據其他貸款及應收款項的最新狀態、公開的或可獲取的有關借款人的信息、抵質押物的價值、借款人及擔保人的最新財務狀況等因素綜合評估可收回情況，期末依據可收回金額與未償還貸款金額差額計提減值準備。

(5). 應收款項

2022年計提應收款項減值準備人民幣1.40億元。

對於應收款項，根據應收款項對象的財務狀況、從第三方獲取擔保的可能性、信用記錄及其他因素諸如目前市場狀況等評估其信用資質，綜合評估應收款項對象的預期可回收現金流量，採用違約概率／違約損失率法或企業會計準則允許的簡化方法計提減值準備。

(6). 買入返售金融資產

2022年計提買入返售金融資產減值準備人民幣-9.54億元。

對於股票質押和約定購回業務，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算其預期信用損失，依據擔保證券的預期處置變現價值，綜合評估融資主體的預期可回收現金流量，折現後預期仍不足以覆蓋其風險敞口的部分，計提減值準備。

(7). 其他

除上述應收融資租賃款、長期應收款、融出資金、其他貸款和應收款項、應收款項、買入返售金融資產等資產減值損失外，依據其他各類業務的性質，對面臨的其他各類信用風險進行識別、評估，對其他資產進行減值測試，根據《企業會計準則》和公司相關會計政策及管理辦法，2022年計提其他減值準備合計人民幣0.65億元。

4. 獨立董事關於公司資產減值準備的意見

本公司獨立非執行董事認為：本公司本次計提資產減值準備符合《企業會計準則》和公司會計政策的相關規定，真實、公允地反映公司2022年12月31日的財務狀況及2022年經營成果，有助於向投資者提供更加真實、可靠、準確的會計信息，符合公司及中小股東的利益。同意公司本次計提資產減值準備。

5. 董事會審計委員會關於公司資產減值準備的意見

本公司第七屆董事會審計委員會2022年度報告會議審議通過了《關於計提資產減值準備的議案》，審計委員會認為：公司本次計提資產減值準備符合《企業會計準則》和公司會計政策的相關規定，真實、公允地反映本公司2022年12月31日的財務狀況及2022年經營成果，能更加公允地反映本公司實際資產及財務狀況。同意本公司本次計提資產減值準備。

6. 董事會關於公司資產減值準備的意見

本公司第七屆董事會第三十六次會議審議通過了《關於計提資產減值準備的議案》，董事會認為：本公司本次計提資產減值準備符合《企業會計準則》和本公司會計政策的相關規定，真實、公允地反映本公司2022年12月31日的財務狀況及2022年經營成果，目前本公司經營狀況正常，各項業務穩定，資產結構良好，流動性較強，各項風險控制指標均符合監管要求。董事會同意本公司本次計提資產減值準備。

7. 監事會關於公司資產減值準備的意見

本公司第七屆監事會第二十二次會議審議通過了《關於計提資產減值準備的議案》，監事會認為：本公司本次計提資產減值準備符合《企業會計準則》和本公司會計政策的相關規定，真實、公允地反映本公司2022年12月31日的財務狀況及2022年經營成果，有助於向投資者提供更加真實、可靠、準確的會計信息，符合本公司及中小股東的利益。監事會同意本公司本次計提資產減值準備。

四、建議本公司2023年度自營投資業務配置規模預計

自營投資業務是公司重要主營業務之一，為便於自營投資業務可根據市場環境波動、自營投資策略靈活調整自營投資規模，經綜合考慮宏觀經濟及證券市場情況，同意以下事宜：

1. 2023年度公司自營投資業務額度如下：

- (1) 自營權益類證券及其衍生品投資業務規模不超過上年度淨資本的80%；
- (2) 自營非權益類證券及其衍生品投資業務規模不超過上年度淨資本的400%。

2. 授權公司經營管理層在符合中國證監會有關自營管理、風險管理的相關規定下，根據市場機會和公司實際情況，在以上額度內確定、調整公司年度資產負債配置方案。

上述額度不包括公司長期股權投資，以及因承銷業務、融資融券業務所發生的被動型持倉。本公司自營投資業務規模按照中國證監會發布的《證券公司風險控制指標管理辦法(2020年修正)》《證券公司風險控制指標計算標準規定(2020)》中的相關公式計算。

上述議案尚需提交股東大會審議通過後生效。一份載有(其中包括)以上議案詳情的通函，連同股東大會的通告，將適時地向本公司股東寄發。

承董事會命
海通證券股份有限公司
董事長
周杰

中國上海
2023年3月30日

於本公告日期，本公司執行董事為周杰先生及李軍先生；本公司非執行董事為屠旋旋先生、周東輝先生、余莉萍女士及許建國先生；本公司獨立非執行董事為張鳴先生、林家禮先生、朱洪超先生及周宇先生。

* 僅供識別