

**申万宏源证券有限公司公司债券半年度报告
(2022 年)**

2022 年 08 月

重要提示

本公司董事、高级管理人员或履行同等职责的人员已对本报告签署书面确认意见。本公司监事会已对本报告提出书面审核意见，监事已签署书面确认意见。

公司承诺将及时、公平地履行信息披露义务，公司及其全体董事、监事、高级管理人员或履行同等职责的人员保证本报告信息披露的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司 2022 年半年度财务报告未经审计。

重大风险提示

投资者参与投资本公司发行的公司债券时，应认真考虑各项可能对公司债券的偿付、价值判断和投资者权益保护产生重大不利影响的风险因素。

截至本报告期末，公司面临的风险因素与上一期定期报告所披露的重大风险相比无重大变化，请投资者仔细阅读上一期定期报告的“重大风险提示”。

目录

重要提示	2
重大风险提示	3
释义	6
第一节 公司基本情况	8
一、公司基本信息	8
二、信息披露事务负责人基本信息	8
三、报告期内控股股东、实际控制人的变更情况	9
四、报告期内董事、监事、高级管理人员或履行同等职责人员的变更情况	9
五、公司独立性情况	9
六、公司合规性情况	10
七、公司业务及经营情况	10
第二节 公司信用类债券基本情况	31
一、公司信用类债券基本信息	31
二、公司债券募集资金使用情况	82
三、报告期内公司债券募集资金用途变更情况	97
四、报告期内公司信用类债券评级调整情况	98
五、增信措施情况	98
第三节 报告期内重要事项	99
一、审计情况	99
二、会计政策、会计估计变更和重大会计差错更正情况	99
三、合并报表范围变化情况	99
四、报告期内亏损情况	99
五、资产受限情况	99
六、可对抗第三人的优先偿付负债情况	99
七、资金占款情况	99
八、有息负债逾期和变动情况	99
九、对外担保情况	100
十、重大未决诉讼情况	100
十一、信息披露事务管理制度变更情况	107
第四节 创新债券特别事项	108
一、发行人为可交换债券发行人	108
二、发行人为绿色公司债券发行人	108
三、发行人为永续期公司债券发行人	108
四、发行人为扶贫公司债券发行人	111
五、发行人为一带一路公司债券发行人	112
第五节 向普通投资者披露的信息	113
第六节 财务报告	114
一、财务报表	114
(一) 合并资产负债表	114
(二) 母公司资产负债表	117
(三) 合并利润表	120

(四) 母公司利润表	122
(五) 合并现金流量表	125
(六) 母公司现金流量表	127
第七节 发行人认为应当披露的其他事项	130
第八节 备查文件	131

释义

释义项	指	释义内容
公司/本公司/发行人/申万宏源证券	指	申万宏源证券有限公司
本集团	指	申万宏源证券有限公司及其子公司
控股股东/申万宏源集团/集团公司	指	申万宏源集团股份有限公司
实际控制人/中央汇金	指	中央汇金投资有限责任公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
北交所	指	北京证券交易所
《公司章程》	指	《申万宏源证券有限公司章程》
申万研究所	指	上海申银万国证券研究所有限公司
申万菱信	指	申万菱信基金管理有限公司
申万期货	指	申银万国期货有限公司
申万宏源西部	指	申万宏源西部证券有限公司
申万宏源承销保荐	指	申万宏源证券承销保荐有限责任公司
申万宏源国际集团	指	申万宏源（国际）集团有限公司
申万投资	指	申银万国投资有限公司
申万创新投	指	申万创新证券投资有限公司
富国基金	指	富国基金管理有限公司
FICC	指	固定收益、外汇、货币及商品
PB 系统	指	主经纪商系统
PE	指	私募股权投资
VC	指	风险投资
Pre-IPO	指	对上市前或预期可上市企业进行直接股权投资

ABS	指	资产支持证券
REITs	指	房地产投资信托基金
QDLP	指	合格境内有限合伙人
报告期	指	2022 年 1 月 1 日—2022 年 6 月 30 日
元、万元、亿元	指	人民币“元、万元、亿元”

注：本报告中，部分合计数与各加数直接相加之和因四舍五入在尾数上略有差异，并非计算错误。

第一节 公司基本情况

一、公司基本信息

中文名称	申万宏源证券有限公司
中文简称	申万宏源证券
外文名称（如有）	Shenwan Hongyuan Securities Co.,Ltd.
外文名称缩写（如有）	Shenwan Hongyuan Securities
法定代表人	杨玉成
注册资本（万元）	5,350,000
实缴资本（万元）	5,350,000
注册地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
邮政编码	200031
公司网址（如有）	https://www.swhysc.com
电子信箱	swhysc@swhysc.com

二、信息披露事务负责人基本信息

姓名	陈秀清
职位	执行委员会成员、财务总监、董事会秘书
联系地址	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
电话	021-33389888
传真	021-54035333
电子信箱	swhysc@swhysc.com

三、报告期内控股股东、实际控制人的变更情况

(一) 报告期末控股股东、实际控制人

报告期末控股股东姓名/名称：申万宏源集团股份有限公司

报告期末实际控制人姓名/名称：中央汇金投资有限责任公司

(二) 控股股东、实际控制人的变更情况

1. 控股股东变更情况

报告期内，本公司控股股东未发生变更。

2. 实际控制人变更情况

报告期内，本公司实际控制人未发生变更。

四、报告期内董事、监事、高级管理人员或履行同等职责人员的变更情况

报告期内，本公司董事、监事、高级管理人员或履行同等职责人员发生如下变更：

变更时间	人员姓名	就任/离任	职务
2022年04月26日	房庆利	离任	执行委员会成员
2022年05月05日	毛宗平	就任	合规总监

毛宗平，男，硕士，生于 1964 年，历任南京航空航天大学人文社会科学学院副院长、申银万国证券股份有限公司江苏管理总部副总经理、总经理、南京分公司总经理、稽核审计总局常务副局长、合规与风险管理总部总经理、合规与风险管理中心总经理、联席主任、主任、申银万国投资有限公司董事长、申万宏源证券有限公司党委巡察办公室主任。现任申万宏源证券有限公司合规总监、法律合规总部总经理。

五、公司独立性情况

公司与控股股东、实际控制人、其他关联方之间在业务、人员、资产、机构、财务等方面完全分开，保持了机构完整、业务独立。公司具有独立完整的业务及自主经营能力，自主经营，独立核算，独立面对市场参与竞争，独立承担责任和风险。

公司《关联交易管理制度》规定了关联交易的审议程序，除部分事项免于按关联交易履行相关义务外，公司根据关联交易事项的交易金额大小和性质不同分别履行下列审议程序：（一）公司与关联自然人发生的交易金额在三十万元以上的关联交易，与关联法人发生的交易金额在三百万元以上且占公司（或申万宏源集团公司）最近一期经审计净资产（以公司或申万宏源集团公司合并报表净资产孰低为原

则计算，下同)绝对值 0.5%以上的关联交易，应当提交董事会审议；(二)公司与关联人发生的交易金额在三千万元以上且占公司(或申万宏源集团公司)最近一期经审计净资产 5%以上的交易，应当经董事会审议通过后提交股东审议；(三)其余的关联交易事项由公司总经理根据公司有关制度决定。公司为关联人提供担保的，不论数额大小，均应当在董事会审议通过后提交股东审议。

同时，该制度在关联交易审议要求上强调了定价公允性，并对相关关联交易提出了审计或评估要求，即公司审议关联交易事项时，应当对关联交易的必要性、公平性、真实意图、对公司的影响进行审查和判断，特别关注交易的定价政策及定价依据，包括评估值的公允性、交易标的的成交价格与账面值或评估值之间的关系等。

经公司董事会审议通过的关联交易事项，应在董事会审议通过的当日或次日将相关信息报法律部门。各部门在每季度结束之日起五个工作日内，汇总该季度所有关联交易事项报法律部门。法律部门收到上述信息后，汇总报送公司股东。

六、公司合规性情况

报告期内，本公司不存在违反法律法规、公司章程、信息披露事务管理制度等规定的情况以及债券募集说明书约定或承诺的情况。

七、公司业务及经营情况

(一) 公司业务情况

1、概述

公司经营范围：许可项目：证券业务；证券投资咨询；证券投资基金销售服务；证券投资基金托管。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准)一般项目：证券公司为期货公司提供中间介绍业务。(除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动)

本集团致力于为客户提供多元化的金融产品和服务，业务范围主要涵盖企业金融、个人金融、机构服务及交易、投资管理四个板块，具体如下：

企业金融		个人金融	机构服务及交易	投资管理
投资银行	本金投资			
· 股权融资	· 股权投资	· 证券经纪与	· 主经纪商服务	· 资产管理
· 债权融资	· 债权投资	期货经纪	· 研究咨询	· 公募基金管理
· 财务顾问	· 其他投资	· 融资融券	· 自营交易	· 私募基金管理
		· 股票质押式融资		
		· 金融产品销售		

(1) 企业金融

本集团的企业金融业务由投资银行业务和本金投资业务组成。投资银行业务为企业客户提供股票承销保荐、债券承销及财务顾问等服务；本金投资业务主要是使用自有资金对外进行股权投资、债权投资和其他投资。

(2) 个人金融

本集团的个人金融业务覆盖个人及非专业机构投资者全方位的需求，通过线上线下相结合的方式提供证券经纪、期货经纪、融资融券、股票质押式融资、金融产品销售和投资顾问等服务。

(3) 机构服务及交易

本集团的机构服务主要为专业机构客户提供主经纪商服务与研究咨询等服务；同时，公司亦从事 FICC、权益类及权益挂钩类证券交易，并基于此向机构客户提供销售、交易、对冲及场外衍生品服务。

(4) 投资管理

本集团的投资管理业务主要包括资产管理、公募基金管理 and 私募基金管理服务。

2、主营业务分析

(1) 总体情况

2022 年上半年，面对错综复杂的国际形势和不断加大的经济下行压力，公司坚持“稳中求进”工作总基调，立足主责主业，发挥金融优势，支持“专精特新”企业、战略性新兴产业、前沿科技企业发展，助力先进制造业、产业链重要环节和核心节点企业转型升级，丰富供应链金融服务供给，推动自身业务发展融入到我国经济、资本市场高质量发展的大局之中。同时积极践行国有金融企业责任担当，帮助受疫情影响、暂时困难的行业企业渡过难关、恢复发展，以发展促就业、以就业保民生。

报告期内，本集团稳步推进各项业务开展，上半年实现营业收入 96.44 亿元，净利润 36.20 亿元，营业收入和净利润稳居行业第一梯队。报告期末净资产 1,055.98 亿元，较年初增加 0.14%；基本每股收益 0.06 元/股；加权平均净资产收益率 3.47%，继续保持较强盈利能力。

单位：亿元 币种：人民币

业务板块	本期				上年同期			
	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	收入占比 (%)	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	收入占比 (%)
企业金融	12.01	6.01	49.97	12.45	12.14	4.99	58.90	10.97
个人金融	42.72	30.07	29.62	44.29	40.15	20.09	49.96	36.27
机构服务及交易	34.11	16.03	53.00	35.37	51.90	28.90	44.32	46.89
投资管理	7.61	3.52	53.71	7.89	6.50	4.47	31.23	5.88
合计	96.44	55.62	42.32	100.00	110.70	58.45	47.20	100.00

(2) 主营业务分析

申万宏源证券旗下包括申万宏源西部、申万宏源承销保荐、申万宏源国际集团、申万期货、申万菱信、申万投资、申万创新投、申万研究所等八家全资或控股子公司，业务范围涵盖企业金融、个人金融、机构服务及交易、投资管理等四大业务板块，致力于构建以资本市场为依托的投资与金融服务全产业链，为客户提供多元化的金融产品及服务。

1) 企业金融业务

企业金融业务以企业客户为对象，包括投资银行业务和本金投资业务。其中：投资银行业务包括股权融资、债权融资、财务顾问等；本金投资业务包括股权投资、债权投资、其他投资等。报告期内，公司企业金融业务板块实现营业收入 12.01 亿元，其中：投资银行业务板块 8.48 亿元，较上年同期增长 15.47%；本金投资业务板块 3.53 亿元。

① 投资银行业务

市场环境：

股权融资方面，受上半年新冠疫情反复影响，全市场股权业务整体呈下行趋势，股权项目家数和规模均较去年同期均有所下降。报告期内，A 股上市新股合计 176 家，同比下降 33.83%，首发募资金额达 2,600.64 亿元，同比增长 18.96%。2022 年上半年 A 股再融资规模达 4,291.31 亿元，同比下降 16.10%，其中定向增发募资规模达 2,382.38 亿元，同比下降 28.02%；可转债合计发行规模达 1,175.36 亿元，同比下降 22.17%（WIND,2022）。

债权融资方面，2022 年上半年债券市场主要品种发行规模同比均出现下滑，其中企业债发行 2,166.77 亿元，同比下降 1.00%；公司债发行 15,144.34 亿元，同比下降 9.13%；金融债发行 45,827.72 亿元，同比下降 2.96%（WIND,2022）。报告期内，为防范地方政府债务风险，各债券主管部门仍延续较为严格的直接债务融资审核政策，且维持收紧状态；债券一级市场不同地域分化明显，评级机构开展业务尤其是评级提升业务较为谨慎；产业类主体、民营企业发行债券受到政策支持。

财务顾问方面，在注册制改革稳步推进的背景下，IPO 成为优质资产的优选通道，优质资产供给端的日益匮乏导致并购市场相对冷清。证券监管部门审核通过的上市公司重组项目 15 项，较 2021 年同比

下降约 11.76% (WIND,2022)。

经营举措及业绩：

公司坚持以落实国家战略、服务实体经济为核心，切实发挥专业优势，深化业务转型创新，持续推动行业、区域、产品优化，持续提升对国家重大发展战略的金融服务能力。坚持履行经济责任与社会责任有机统一，做好“六稳”“六保”工作，践行服务国家战略的初心与使命。具体举措如下：

服务国家战略方面	具体举措
服务科技自立自强	股权融资方面：支持信科移动、中触媒、必易微等一批高新技术企业开展股权融资活动。科创板开板以来，已累计助力 10 家企业登陆科创板。债权融资方面：紧抓风口业务，发行 5 只“双创债”，发行规模 32 亿元，为贯彻落实创新驱动发展的国家战略贡献专业力量。报告期内成功发行全国首批、上海首单 10 亿元科创债券。
服务绿色金融	股权融资方面：助力绿色环保企业中触媒上市科创板，报告期末在审碳中和概念企业项目 5 家。 债权融资方面：报告期内先后完成中国建设银行绿色金融债、宝钢绿色债（全国首单低碳转型绿色公司债券）、嘉兴天然气绿色资产证券化等各类债券 12 只，累计发行规模 134.50 亿元。
服务“专精特新”中小企业	持续加大中小企业服持力度，累计服务 3,000 余家中小企业，制定并落实申万宏源“专精特新”、“投资+投行”战略。报告期内，北交所承销家数市场排名前 2；截至报告期末，北所在审家数市场排名第 1。
服务乡村振兴	报告期内公司共发行乡村振兴相关债券 2 只，承销规模和总发行额均为 6.2 亿元，以实际行动助力国家乡村振兴战略。
服务国家“一带一路”战略	股权融资方面：助力华新水泥香港上市，开创上交所 B 股转 H 股先河。 债权融资方面：报告期内实现首单“一带一路”债券项目“22 渝北 01”的发行，发行规模 10 亿元。
服务普惠金融政策	积极落实普惠金融政策，服务中小微企业，已连续多年为新三板企业减免持续督导费用；积极为中小微企业开展政策宣讲、专题讲座、业务培训及互动交流等活动十余次，帮助企业及时了解和掌握国家普惠金融相关政策、企业所属市场及行业动态、资本市场的发展态势等。报告期内公司新三板定向发行排名市场前 2，推荐挂牌储备项目市场前 2；发行北京银行、北部湾银行、江苏银行等债券项目 11 只，发行总规模达 464.06 亿元。

a. 股权融资

报告期内，公司股权融资业务取得跨越式发展，行业排名快速提升，IPO 业务表现亮眼，再融资业务奋楫争先，新三板业务厚积薄发。

境内股权融资业务方面，报告期内公司承销总规模 161.74 亿元，承销家数 14 家，承销规模行业排名第 10 (WIND,发行日口径)，行业排名快速上升。其中，再融资承销规模 125.78 亿元，承销家数 9 家，承销规模排名行业第 8，承销家数排名行业第 7；科创板 IPO 承销规模 27.98 亿元，承销家数 2 家，承销规模排名行业第 9；截至报告期末，公司 IPO 在审及已过会待发行数量共 36 家，储备数量位居行业第 9。

此外，公司积极推进“专精特新”战略，大力发展普惠金融业务，全力助推中小企业发展，截至报

告期末，新三板挂牌企业持续督导 578 家，市场排名第 2，其中创新层持续督导 158 家，市场排名第 2；累计推荐挂牌企业 812 家，累计为挂牌企业提供定向发行 862 次，累计为挂牌企业进行股权融资共计 355.51 亿元，均排名行业第 1（CHOICE，上市日口径）；北交所累计承销 8 家，排名行业第 3；北交所累计过会 9 家，排名行业第 3；北交所在审 13 家，排名行业第 1。

境外股权融资方面，公司持续推进国际化及境内外一体化战略，逐步扩大项目储备、加快项目周转速度。报告期内，公司作为独家保荐人和财务顾问助力华新水泥香港上市，完成上交所首单 B 股转 H 股项目。

b. 债权融资

2022 年上半年，在债券发行市场负增长以及新冠疫情持续反复背景下，公司债权融资业务保持良好发展态势，行业排名持续提升，市场影响力进一步增加。报告期内公司债券全口径（公司债+金融债+企业债）共计发行债券 150 只，承销家数行业排名第 8；承销规模人民币 978.75 亿元，承销规模行业排名第 7，较 2021 年末上升 1 位（WIND,2022）。

此外，公司积极落实服务国家战略要求，拓展布局服务国家战略类项目和特色业务品种，报告期内债券发行募集资金流向多为疫情防控、双碳发展和科技创新等关键领域，积极助力受疫情影响严重的交通运输、文化旅游和工程建筑等困难企业和中小微企业拓宽融资渠道，报告期内发行市场年度首单由央企发行的疫情防控债“22 上航 01”。

境外债权融资方面，公司持续开发大型央企、综合国企等优质企业境外债券项目，持续完善境内外团队协作能力。报告期内，共完成 60 单债券项目，融资规模共 99.57 亿美元，承销金额位列中资券商系第 7 名。此外，公司发行首单欧元债券——台州市黄岩交通旅游投资集团有限公司欧元债，为浙江省内首笔欧元备证增信债券，实现了债券承销种类的新突破，为公司实现债券品种全覆盖奠定良好的基础。

c. 财务顾问

报告期内，公司完成并购财务顾问项目 2 家，境外财务咨询项目 6 单，并连续 6 年荣获并购重组财务顾问执业能力评价 A 类券商。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司继续牢固树立“以客户为中心”的服务宗旨，秉持“简单金融、成就梦想”的经营理念，凭借丰富的资本市场经验，继续构筑资源整合力，全方位夯实资本、定价、销售、协同、风控、科技等综合能力，持续为客户提供全生命周期的综合金融服务，打造全产业链的大投行生态圈，积极响应国家政策、服务国家战略，助力实体经济发展，充分发挥国有金融企业担当作用。

② 本金投资业务

市场环境：

随着多层次资本市场不断建设完善，特别是设立科创板并试点注册制、创业板改革并试点注册制，建立上市公司创投基金股东减持股份“反向挂钩”机制，PE/VC 退出渠道进一步扩宽，有利于创业投资机构实现投资收益。与此同时注册制为中小企业打通直接融资渠道，并配套保荐跟投制度，推动券商投行业务转型升级，促进券商本金投资业务与投行承销保荐业务协同。

经营举措及业绩：

公司及全资子公司申万创新投开展本金投资业务。

2022 年上半年，公司立足“十四五”时期新的发展趋势，围绕证券业务核心，继续以协同业务为抓手，重点服务战略业务和战略客户，稳步开展投资业务布局，全面提升发展质量，积极构建以“投资+投行”为特色的综合金融服务体系，持续提升服务国家战略能力，全力支持稳定经济大盘，不断提升本金投资业务的市场竞争力。报告期内，申万创新投完成 2 单科创板跟投项目，择优投放 2 个 PRE-IPO 项目。

截至报告期末，公司本金投资（不含联营和合营企业）规模 20.40 亿元，较上年末下降 3.94%；联营和合营企业投资规模 19.88 亿元，较上年末下降 3.44%。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将持续以科创板、创业板跟投等业务为重点，积极探索与证券业务一体化的投资业务模式，实现投资业务与证券业务的协同并进，不断提升投资业务的盈利贡献及稳定性。

2) 个人金融业务

个人金融业务主要涵盖证券经纪、期货经纪、融资融券、股票质押式融资、金融产品销售等。报告期内，公司个人金融业务板块实现营业收入 42.72 亿元，较上年增长 6.41%。

① 证券经纪业务

市场环境：

2022 年上半年，资本市场整体呈震荡回调走势，截至报告期末，上证综指、深证成指、创业板指较年初分别下跌 6.63%、13.20%、15.41%（WIND,2022）；市场交投较 2021 年上半年略显活跃，沪深两市股票成交额 114.41 万亿元，同比增长 6.32%（中国人民银行,2022）。

经营举措及业绩：

报告期内，公司证券经纪业务以“稳中求进、进中求精”为目标，积极做强获客引资工作，做大客户和资产规模，完善标准化零售客户服务体系，扎实做好基础服务，提高综合服务能力，提升客户质量。报告期末公司证券客户托管资产达到 4.17 万亿元，市场占有率 5.93%，行业排名靠前。报告期内，实现代理买卖业务净收入 18.07 亿元，稳居行业前列。公司大赢家 APP 月活跃度均值 157.7 万，月活跃度峰值达 162.93 万。与此同时，公司证券经纪业务进一步加大金融科技赋能力度，现已启动新一代移动

终端-申财有道 APP 的建设工作，申财有道 APP 将充分利用金融科技力量，发力数字化、智能化，结合公司特色业务开展，为客户提供全方位的服务。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将持续推进财富管理业务转型，以资产配置与增值、投顾服务、金融科技为抓手，构建高质量客群服务核心竞争力，打造申万宏源财富管理特色品牌。夯实基础客户资产，转型买方投顾模式，强化金融科技赋能，加强财富管理业务协同，打造均衡、可持续发展的财富管理业务模式。

②期货经纪业务

市场环境：

2022 年，伴随着经济下行压力、国内外货币政策分化和大宗商品价格波动扩大等复杂的宏观环境，产业和金融机构风险管理需求上升，期货市场风险管理的功能持续发挥。上半年受内外部经济环境日趋复杂因素影响，国内期货市场整体活跃度有所下降，1 月至 6 月全国期货市场累计成交量为 30.46 亿手，累计成交额为 2,574,793.66 亿元，同比分别下降 18.04%和 10.08%（中国期货业协会）。

经营举措及业绩：

公司主要通过控股子公司申万期货开展期货经纪业务。

2022 年上半年，申万期货以“凝聚共识、夯实基础、深化转型、创先争优”为工作重点，加快建立完善以代理业务为基础，以风险管理业务和财富管理业务为两翼的“一主两翼”的业务体系，建立“机构+财富+资管”为协同的大机构业务模式，深化证券公司与期货公司协同，提高对重点区域产业、机构及高净值客户的服务能力，提升分支机构业务辐射能力，增强整体市场竞争力。上半年日均客户权益规模 312.97 亿元，同比增长 51.83%，6 月末客户权益规模达 345.2 亿元，较去年末增长 29.15%，均创历史新高。报告期内，申万期货“保险+期货”服务企业案例、党建优秀案例获评中国期货业协会优秀案例，行业地位和品牌形象不断提升。

2022 年下半年展望：

《中华人民共和国期货和衍生品法》已正式实施，进一步夯实市场法治建设基础，为期货市场的对外开放和高质量发展提供更广阔的发展空间。在期货行业快速发展同时，市场持续升温，竞争日益加剧。2022 年下半年，公司期货经纪业务将持续贯彻落实“大力发展轻资本业务，高质量发展重资本业务”发展理念，进一步夯实经纪业务基础，打造财富管理业务和风险管理业务核心能力，加快创新业务发展，推动客户、业务、收入结构转变。

③融资融券业务

市场环境：

2022 年上半年，A 股市场行情震荡回调，市场整体融资融券余额在 1 月-4 月加速下降后迎来阶段

性小幅反弹。截至 2022 年 6 月末，市场融资融券余额 16,033.31 亿元，较上年同期下降 10.14%(WIND,2022)。

经营举措及业绩：

报告期内，公司着力推进企业客户、机构客户、高净值客户综合服务，加快向机构化转型，同时从制度修订、流程优化、集中度管控、盯市管理等多方面，持续完善融资融券业务管控机制。截至报告期末，公司融资业务余额 641.54 亿元，融券业务余额 38.88 亿元（按证券公司监管报送口径统计）。公司整体融资融券业务的平均维持担保比例为 279.57%，较上年同期提升 3.62 个百分点。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将针对不同客户类别建立差异化营销服务体系，有效提高精准服务能力，切实提升客户服务体验；进一步构建完善券源产业链，加强机构客户券源合作，提升上下游客户融券体验，提高公司融券业务市场竞争力；进一步优化融资融券风险管控手段，持续加强信用业务风险管控及体系优化，积极布局全面注册制证券分类和集中度管控，分层分类进行管控、提升风险控制精准度，确保不发生重大风险事件。

④股票质押式融资业务

市场环境：

2022 年以来，股票质押业务全市场总体规模仍然保持下降态势，上市公司控股股东、大股东股票质押规模进一步减少。报告期内，面对“降规模、调结构”的市场环境，市场参与各方愈发重视股票质押风险防范，主动调整股票质押式融资业务定位。

经营举措及业绩：

报告期内，公司股票质押式融资业务继续保持“控风险、调结构”业务思路，加强项目风险管理，高质量发展股票质押业务，截至报告期末，公司以自有资金出资的股票质押业务融资余额 55.63 亿元，较年初下降 5.31%。

2022 年下半年展望：

公司作为大型券商，资本金充足、业务种类齐全、风险管理能力较强，将继续以高质量发展为方向，把股票质押业务作为服务客户的重要工具，致力于为客户提供全方位综合金融服务，切实服务国家战略、服务实体经济。

⑤金融产品销售业务

市场环境：

受 2022 年上半年市场行情影响，基金备案规模较 2021 年呈现下滑态势。券商报告期内金融产品销量出现明显下滑。与此同时，大型券商依托雄厚的资本金实力，充分发挥内部主动管理与风险定价能力、

资本、风控、销售、协同、科技等综合能力协同，财富管理领域“强者恒强”的趋势进一步显现。作为投资者资产配置服务手段之一，金融产品销售能力也逐渐成为衡量券商财富管理业务质量的重要标准之一。

经营举措及业绩：

公司金融产品销售包括销售公司自行开发的金融产品及代销第三方金融产品，金融产品类型涵盖公募证券投资基金、私募证券投资基金、信托计划、资产管理计划、收益凭证、质押式报价回购及其他金融产品等。

2022 年上半年，公司全面贯彻大财富管理的理念，持续推进自有产品能力提升、产品体系完善、产品销售强赋能、合规风险防范，通过完善科学化产品研究和评价体系、客户分级服务体系，持续为客户提供专业化、多层次的产品服务。报告期内，公司共销售金融产品 1,963.94 亿元，其中：自行开发金融产品 1,724.82 亿元，代理销售第三方金融产品 239.12 亿元。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将继续以客户为中心，致力于提升投资者长期收益及保有规模，着力加强优势业务资源产品化，提升自有产品竞争力，不断丰富产品储备与供给；加强产品研究能力建设，充分发挥分支区域资源禀赋，加码潜力管理人及优质产品的挖掘及筛选；加强资产配置能力建设，提升财富管理综合解决方案输出能力；全面优化客户服务体系，提升客户体验和获得感，为客户持续创造价值，进一步实现产品销售业务高质量可持续发展。

3) 机构服务及交易业务

机构服务及交易业务包括主经纪商服务、研究咨询、FICC 销售及交易、权益类销售及交易和衍生品业务等。报告期内，公司机构服务及交易业务板块实现营业收入 34.11 亿元。

①主经纪商业务

市场环境：

随着居民资产配置需求提升和资管新规的全面实施，各类资管机构同台竞技，呈现不同发展态势，公募、私募基金产品规模快速增长，机构化、产品化趋势日渐加强，专业化服务需求日益增长。

经营举措及业绩：

公司主经纪商服务涵盖交易席位租赁、PB 系统及基金行政服务。

2022 年上半年，在努力克服疫情带来的不利影响下，公司机构业务持续以产品为纽带，协同整合公司内外部资源，聚焦公募、保险、私募、银行和大型机构客户，为其提供研究、产品和交易等一站式综合金融服务，打造机构业务全业务链。同时，依托控股子公司申万研究所强大的研究实力和品牌影响力，机构客户资源不断积累，机构业务稳步发展。

席位租赁方面，报告期内公司实现收入 5.27 亿元，较上年同期增长了 30.09%，排名继续位于行业第一梯队。

PB 系统方面，公司持续加强对银行理财子等重点机构客户的个性化服务，报告期末客户 1,096 家，规模约 2,551.30 亿元。“SWHYMatrix”极速交易平台持续完善功能、优化性能，可为机构客户提供丰富的交易终端系统功能和算法，报告期末公司“SWHYMatrix”极速交易平台接入产品规模达 262.68 亿元。

基金托管和运营外包服务业务方面，公司依靠其广大的分支机构和业务总部赋能，加强属地化业务拓展，深度触达各区域各类资管产品管理人，为其提供产品托管和运营的全生命周期服务。常规化开展线上沙龙营销活动，活动内容涵盖了私募投资策略、合规和运营知识分享、服务功能升级等多个维度，疫情期间开辟了线上维度的新兴营销渠道。报告期内公司新增公募基金、私募基金、私募资管计划的托管及运营外包服务 215 只，新增托管及运营外包服务规模总规模 202.92 亿份。在券商托管机构中，公司报告期内新增公募托管数量排名第 11，新增私募托管数量排名第 10。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，全球疫情日益可控，经济发展逐渐重启，国内经济发展和各项财政、货币政策支持力度不减。在产品化、机构化的趋势下，公司将继续聚焦大机构、大销售、大交易、大平台的总体思路不动摇，做大做强机构金融“朋友圈”，加大布局投入，确保重点机构客户全覆盖，利用全牌照优势，增强客户黏性，发挥领先交易能力，满足各类客户需求，以资本引介服务，推动构建一站式服务体系。

②研究咨询业务

经营举措及业绩：

公司及控股子公司申万研究所开展研究及咨询业务。

报告期内，申万研究所不断践行“研究+投资+投行”战略，深入落实“六稳”“六保”任务，切实发挥品牌优势，着力布局深度研究，不断提升研究质量，市场影响力进一步提升。一是以金融力量服务国家战略。报告期内研究所成功当选中国绿色碳汇基金会副理事长单位，进一步提升在“碳中和”研究领域的影响力；受邀参与 ESG 行业标准编制《企业 ESG 信息披露通则》《企业 ESG 评价通则》，助力我国企业 ESG 信息披露走向标准化；与工信部中国中小企业发展促进中心合作，共同研究建立完善综合性、全链条产业金融服务体系，促进中小企业特别是专精特新企业高质量发展。二是发挥智库实效，为支持企业复工复产、修复经济动能贡献智库力量。联合《上海证券报》重磅推出“发挥资本要素在现代经济体系建设中的正向作用”5 篇研究系列报道，在新华社客户端和上证报整版连载发布，累计阅读量超过 320 万次，网络转载 51 篇，进一步彰显研究所“政策投研智库”的实力与底蕴。三是贯彻落实七大研究主题，巩固既有品牌优势。围绕“碳中和、专精特新、新基建、创新消费、数字经济、共同富

裕、十四五规划”专题系列，开展“回乡见闻”、多场大型策略会、数字经济高端交流活动、2022 年一季报前瞻系列电话会议、明星分析师十四五规划系列电话会议等，引起主流财经媒体全方位报道，受到市场及客户认可。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将继续以研究为本，对内积极协同支持公司各业务条线发展，对外保持卖方研究影响力，聚力抓好当前各项重点工作，持续提升决策影响力和行业影响力。

③ 自营交易

a.FICC 销售及交易业务

市场环境：

在海外地缘政治危机升级、货币政策集体转向、国内疫情超预期变化下，国家陆续出台“稳经济、扩投资、保就业”系列政策，通过实施积极的财政和稳健的货币政策，支持经济有序复苏，报告期内在货币政策整体宽松、宽信用预期、疫情反复以及资产荒背景下，债券利率整体呈现窄幅震荡走势，债券市场总体呈现波动格局。

经营举措及业绩：

公司 FICC 销售及交易业务以传统固收投资交易为依托，着力打造强大的投研平台，从宏观层面出发，通过统一的视角，自上而下分析各类资产的周期轮动，实现基于大类资产配置视角的多品种全覆盖，同时积极向客盘衍生品业务转型，力争打造完善的 FICC 业务链条。

报告期内，公司积极把握市场机遇，稳健开展固收投资，坚持控风险调结构，稳步推进投资风格转型，传统债券自营作为基本盘业务，策略交易表现成熟，在震荡行情里把握波段行情机会，利用利率衍生品灵活管理组合敞口风险，投资业绩在同行业中处于领先水平。在策略交易上，灵活把握组合交易机会，扩容量化交易。同时，公司积极推进战略转型，期权业务不断丰富产品结构，收益互换业务进一步提高了标的市场覆盖能力，收益凭证业务稳步增长，投资顾问业务规模不断提升，做市业务有序开展，信用衍生品业务实现业务模式及规模突破式发展，商品业务和公募 REITs 发挥投研优势，力争形成有效补充。

与此同时，公司积极推进各类业务创新，报告期内实现美国国债期货交易落地；与实体企业、私募基金分别开展了首笔场外利率期权交易，实现客群范围的拓展；新开辟公司零售柜台发行渠道，为上市公司、零售客户提供挂钩 FICC 类标的的财富管理工具；于交易所落地“不可质押交易所公募债+信用保护工具”的产品模式，实现公司在交易所信用保护工具业务上的突破，成功助力企业债券二级流通。

此外，公司围绕服务国家战略目标，切实履行央企社会责任，通过债券投资为国家科技自强战略、服务区域重大发展战略、绿色发展战略等项目提供支持，同时坚持“金融服务实体经济”，助力复工复

产、稳价保供，综合运用金融衍生工具为实体企业提供精准解决方案。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司 FICC 业务持续贯彻“三条盈利曲线”战略思想，打好“巩固传统领先业务+培育特色新生业务”组合拳，坚持以“债券多策略”提升固收自营能力，坚持以“多资产多策略”实现大类资产配置多品种全覆盖，坚持以“客盘交易、投资顾问”为聚焦点持续做大综合金融服务，形成固定收益、产品创设和投顾业务、商品交易齐头并进的“1+3”业务格局，争取实现优异的投资经营业绩。

b.权益类销售及交易业务

市场环境：

报告期内，权益市场在内外外部多重因素的共振下，经历了四个月的持续下跌，至 4 月 27 日沪深 300 指数最大跌幅近 22%，随后市场开启了两个月的修复性上涨。市场风格上方面，受益于政策刺激加码和疫后复苏的大消费板块以及内外需共振、高景气度的新能源车、光伏、风电和军工等板块表现较好。

经营举措及业绩：

报告期内，公司权益类销售及交易业务坚持以“非方向、低波动、绝对回报”为目标，逐步构建“多资产、多策略”的能力圈，在切实控制方向性资产投入的基础上，采取了一系列的精准改革措施，进一步夯实了以中性量化策略资产、含权债及公募 REITs 等“基石类”资产为主的组合配置结构，持续推动向“非方向”的中性多资产、多策略大类资产配置组合优化转型。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司权益类销售及交易业务将持续践行“低波、稳健”的核心理念，以量化对冲业务、资本市场业务及权益做市业务等“三大基石商业模式”为依托，通过买方投研体系赋能，优化合规风控运营管理机制，打造立体化证券投资交易体系。以“一体两翼”为资产配置抓手，加速资产结构优化，加大业务转型力度。

c.衍生品业务

市场环境：

2022 年上半年，全球资本市场和大宗商品市场波动加剧，机构投资者和实体企业出于资产配置和风险管理的考虑，对衍生品工具的需求进一步增长，从场外衍生品交易规模来看，上半年延续了近几年的上升趋势，存续规模再创新高，参考境外发达资本市场体量和衍生品规模，国内衍生品业务仍有巨大的发展潜力。伴随着衍生品业务的蓬勃发展，行业政策加速落地，《中华人民共和国期货和衍生品法》正式出台，立法明确了衍生品业务的法律地位，为衍生品业务长期健康发展和更好地服务实体经济提供法律保障。

经营举措及业绩：

2022 年上半年，公司场外衍生品业务保持竞争优势，新增、存续规模稳居行业前列。公司通过投研赋能和金融科技赋能不断提升定价和对冲交易能力，快速响应客户需求，持续向客户提供差异化的产品创设，进一步做大场外期权业务规模；同时加强境内外一体化系统建设，全面发力收益互换和跨境业务。场内做市方面，公司不断新增做市业务资格，持续对做市策略进行优化，形成稳定且可持续的做市交易模式，业务排名位于行业前列。量化业务方面，公司自主研发量化策略指数，在全球股票、债券、商品等不同大类资产上实现动态、分散化配置，挂钩相关指数的收益凭证等策略指数化产品已逐步落地，目前系列产品规模已达数十亿名义本金。公司坚持衍生品业务要服务于实体经济高质量发展，积极响应国家“六稳”“六保”政策要求，在服务产业客户规避风险、稳定生产经营方面不断进行探索与尝试。

报告期内，公司场内衍生品做市业务新增上海期货交易所铝期权做市业务资格、郑州商品交易所 PTA 期货做市业务资格、郑州商品交易所菜粕、棉花、白糖期权一般做市商资格，其中菜粕、棉花在一般做市商中连续三个月均排名第一，现已成为主做市商。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将继续提升产品、定价、交易等核心竞争力，着力打造场内外衍生品交易及产品创设的一体化平台，持续利用衍生品为市场提供有效的风险管理、财富管理及资产配置工具，为专业投资者提供差异化、一站式的综合金融服务方案。公司衍生品业务将结合市场环境，加强多样化的配置型和交易型产品开发力度，重点发力交易平台建设提高收益互换和跨境业务规模，场内做市实现新品种扩容，加大量化策略研发，完善人才梯队建设，同时进一步发挥衍生品业务引领优势，通过综合服务，带动公司经纪、信用、投行、托管等整体业务的协同发展。

4) 投资管理业务

投资管理业务包括资产管理、公募基金管理以及私募基金管理等。报告期内，公司投资管理业务板块实现营业收入 7.61 亿元，同比上升 16.95%。

①资产管理业务

市场环境：

报告期内，我国资产管理市场进入全面发展新阶段，证券、基金行业资产管理继续呈差异化发展，证券资管、基金及其子公司在度过资管新规的影响后，资产管理规模开始“触底反弹”。2022 年上半年发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定（征求意见稿）》等，为券商资管子公司设立后申请公募牌照放宽了条件，同时昭示公募产品将成为承接未来“万亿”个人养老资金的重要载体，凸显公募牌照对未来资管行业发展的重要作用。

经营举措及业绩：

公司及控股子公司申万菱信、申万期货开展资产管理业务。

2022 年上半年，公司资产管理业务继续围绕专业化改革和主动管理能力提升转型，不断完善产品图谱建设，持续推进投研体系建设，产品投资管理水平和投资业绩得到明显提升。一是持续深入推进主动管理业务转型，加速优化业务结构，资产管理规模企稳回升。截至报告期末，公司资产管理业务净收入行业排名第 9 位，较上年度上升 1 位；资产管理业务规模 2,839.63 亿元，较 2021 年末增长 4.80%；主动管理能力稳步提升，截至报告期末主动管理比重较去年同期增长 111.24%；专项 ABS 业务规模稳步增长，报告期末市场排名进入前十。投顾业务持续发力，规模较 2021 年末增长接近翻倍；报告期内公司新设立集合产品 51 只，在券商资管同业中排名第 4 位。二是完善产品图谱建设取得初步成效，不断丰富具有申万宏源“全资产配置商、数量化精品店”特色的基础产品图谱，现已形成 7 大产品类型、18 个产品小类、8 大品牌标签的完整产品体系，持续丰富配置策略与产品类型。三是投研体系建设已显成效，通过持续推进专业化分工，加强研究覆盖和深挖能力，构建重点深度覆盖的领域和标的跟踪机制。完善部门策略会机制，规范模拟组合推荐分享机制，丰富大类资产配置、多维度投资策略的资产管理业务思路。促进人才队伍专业化转型，达成研究资源共享、高效、专业、团队化合作模式，促进投资业绩和客户粘性提升。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将以推进设立资产管理子公司为契机，进一步巩固完善投研体系，提升主动管理能力，实现投资策略多元化；推动券商资管公募化，顺应行业转型发展趋势进入公募新赛道，解决客户准入和客户数量问题；大力发挥分支机构优势，拓展优化销售网络，协同销售以实现规模迅速增长；全面推动金融科技运用，统筹现有系统平台实现体系化，同时根据公募基金运营需求加快升级，提升专业运营能力。

②公募基金管理业务

市场环境：

2022 年上半年，A 股市场先抑后扬，公募基金行业也经历了从市场新发进入冰点到基金产品总数突破万只的里程碑时刻，随着二季度中国证监会发布《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，公募基金行业高质量发展有了清晰的“路线图”。截至 2022 年 6 月 30 日，全部 153 家公募基金管理机构在管的公募基金产品 10,010 只，净值总规模 26.79 万亿元（中国证券投资基金业协会，2022），公募基金已经成为居民财富保值增值的重要工具。金融机构在财富管理端加速从产品销售向资产配置转型，自试点以来，有超 60 家机构分三批获得公募基金投资顾问业务牌照，包括 26 家基金公司、29 家证券公司、3 家银行及 3 家第三方独立代销机构（毕马威，中国基金投顾蓝皮书 2022）。

经营举措及业绩：

公司及控股子公司申万菱信与参股公司富国基金开展公募基金管理业务。

报告期内，公司围绕着财富管理深化转型开展全方位工作，从商业模式、资产配置体系、人才队伍、金融科技、制度建设等方面全面升级，截至报告期末，公募基金投顾累计签约客户近 10 万人，存量客户人均委托资产达到 6.93 万元；共上线 5 大类 10 个组合策略，累计复投率达 66% 以上，部分中低风险组合盈利客户占比超过 90%。

申万菱信以持续建设完善的集研究、投资、风控于一体的关键假设平台为依托，有效发挥全面风险管理的“滑雪杖”作用，实现中长期投资业绩稳中向好。数字化战略推进方面，申万菱信正式上线第一期面向用户的“总量 EBS (Excellent Branding and Service) 小程序”，开启公司关键假设平台通过 EBS 对外赋能的新篇章。财务回报方面，申万菱信克服前 4 个月市场持续下行、机构及个人投资者悲观情绪持续发酵的不利影响，净利润较去年同期增长 7.52%。产品布局方面，报告期内申万菱信共计发行 7 只公募基金和 7 只专户产品，稳步推进“新理财”系列产品，完成包括宏量、智量、双禧、鑫享稳健、稳鑫 30 天滚动持有期短债等多只产品布局并开始积累业绩曲线，力求尽快为投资者提供较好的理财替代产品选择。创新业务方面，报告期内申万菱信正式完成基金投顾业务和 QDLP 业务落地，其中基金投顾业务正式上线 10 只策略，完成 2,800 户客户签约。

富国基金秉持高质量发展理念，保持了良好的业务发展态势。截至报告期末，富国基金管理资产总规模超 1.4 万亿元，再创历史新高，其中公募基金管理规模 9,329 亿元。养老金业务及专户业务均保持稳健增长，管理规模双双创下新高。

2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司战略层面积极布局基金投顾业务，以专业服务客户投资需求，以陪伴共享客户投资体验，推进财务管理由卖方模式向买方模式转型；同时结合新颁布的《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，持续通过研究、投资、风控一体化平台建设，构建公募基金业务发展的核心竞争力。

③ 私募基金管理业务

市场环境：

近年来，新兴产业高速发展推动私募股权行业兴起，叠加政策层面持续支持私募股权行业稳步发展，推动“募投管退”良性循环生态加速形成。报告期内，因受复杂的国际形势和频发的国内疫情影响，募资、投资以及退出均受影响，根据中国证券投资基金业协会数据，2022 年上半年新成立私募股权投资基金 1,659 只，备案规模 1,262.71 亿元，较去年同期分别下降 15.66% 和 46.87%。

经营举措及业绩：

公司主要通过全资子公司申万投资开展私募基金管理业务。

报告期内，申万投资充分发挥公司私募基金管理平台的作用，积极响应公司“五大科创基金”战略

布局，聚焦五大基金、聚焦重点区域、聚焦重点行业，分层扩张基金管理规模，进一步丰富基金产品线，持续推进产业基金、专精特新基金的落地与战略布局，加大对实体产业的扶持力度。报告期内公司设立的专精特新基金（1支）以及“碳中和”主题基金（1支）已开始投资运作。

2022年下半年展望：

2022年下半年，公司将继续积极响应国家战略，持续推进专精特新基金的设立，积极设立区域基金，丰富基金产品线，同时加强“研究+投资+投行”的协同工作，进一步梳理区域、行业投资核心逻辑，实现高质量基金投资。

3、收入与成本分析

报告期内，本集团稳步推进各项业务开展，上半年实现营业收入 96.44 亿元，净利润 36.20 亿元，营业收入和净利润稳居行业第一梯队。

单位：亿元

项目	本报告期	上年同期	增减值	变动幅度
营业收入	96.44	110.70	-14.25	-12.88%
营业支出	55.62	58.45	-2.83	-4.83%
其中：业务及管理费	40.43	42.96	-2.52	-5.88%
利润总额	40.33	51.90	-11.57	-22.29%
净利润	36.20	44.52	-8.32	-18.69%
加权平均净资产收益率	3.47%	5.29%	减少 1.82 个百分点	-34.37%

(1) 营业收入分析

2022年上半年，本集团实现营业收入 96.44 亿元，同比减少 14.25 亿元，降幅 12.88%，主要收入项目如下：

单位：亿元

项目	本报告期		上年同期		金额 同比增减
	金额	占营业收入 比重	金额	占营业收入 比重	
手续费及佣金净收入	41.72	43.26%	40.48	36.57%	3.06%
其中：经纪业务手续费净收入	26.63	27.61%	27.33	24.69%	-2.57%
投资银行业务手续费净收入	8.21	8.52%	7.14	6.45%	15.04%
资产管理及基金管理业务 手续费净收入	6.33	6.56%	5.84	5.27%	8.46%
投资咨询业务收入	0.55	0.58%	0.18	0.16%	205.97%
利息净收入	2.85	2.95%	12.38	11.18%	-76.99%
投资收益	0.75	0.78%	46.30	41.83%	-98.37%
公允价值变动收益（损失以“-”列示）	41.07	42.58%	-1.81	-1.64%	不适用
汇兑收益（损失以“-”列示）	-0.22	-0.22%	0.001	0.00%	-24509.59%
其他业务收入	7.88	8.17%	12.89	11.64%	-38.85%

资产处置收益	0.01	0.01%	0.02	0.02%	-59.77%
其他收益	2.38	2.46%	0.43	0.39%	446.44%
营业收入合计	96.44	100.00%	110.70	100.00%	-12.88%

1) 手续费及佣金收入

2022 年上半年，本集团手续费及佣金净收入 41.72 亿元，同比增加 1.24 亿元，增幅 3.06%。主要原因：一是公司经纪业务手续费净收入 26.63 亿元，同比减少 0.70 亿元，降幅 2.57%，主要是受 2022 年上半年资本市场整体呈震荡回调影响，导致经纪业务净收入同比减少；二是公司投资银行业务手续费净收入 8.21 亿元，同比增加 1.07 亿元，增幅 15.04%，主要是受股票和债券承销业务收入增加影响，投行业务净收入同比增加；三是公司资产管理及基金管理业务手续费净收入为 6.33 亿元，同比增加 0.49 亿元，增幅 8.46%，主要是受管理规模和业绩报酬增加的影响，资产管理及基金管理业务净收入同比增加；四是公司投资咨询业务收入 0.55 亿元，同比增长 0.37 亿元，增幅 205.97%，主要是公司着力推进财富管理转型，证券投资顾问业务收入和基金投资顾问业务收入增加。

2) 利息净收入

2022 年上半年，本集团利息净收入 2.85 亿元，同比减少 9.53 亿元，降幅 76.99%。从构成来看，利息收入 47.19 亿元，同比减少 6.20 亿元，降幅 11.62%，主要是融出资金利息收入同比减少 3.64 亿元、其他债权投资利息收入同比减少 3.26 亿元、买入返售金融资产利息收入同比减少 1.97 亿元；利息支出 44.34 亿元，同比增长 3.33 亿元，增幅 8.12%，主要是应付债券利息支出同比增加 3.42 亿元，卖出回购金融资产款利息支出同比增加 2.10 亿元，代理买卖证券款利息支出同比增加 0.43 亿元。

3) 投资收益与公允价值变动收益/损失

2022 年上半年，本集团投资收益与公允价值变动收益合计为 41.82 亿元，同比减少 2.67 亿元，降幅 5.99%，主要是金融资产处置取得收益减少。

4) 汇兑损益

2022 年上半年，本集团汇兑损失 0.22 亿元，同比增加 0.22 亿元，主要系汇率波动影响。

5) 其他业务收入

2022 年上半年，本集团其他业务收入 7.88 亿元，同比减少 5.01 亿元，降幅 38.85%，主要是大宗商品销售收入减少影响。

6) 资产处置收益

2022 年上半年，本集团资产处置收益 0.01 亿元，同比减少 0.01 亿元，降幅 59.77%，主要是因为固定资产处置损失收益减少。

7) 其他收益

2022 年上半年，本集团其他收益 2.38 亿元，同比增加 1.94 亿元，增幅 446.44%，主要因公司取得的政府补助增加。

(2) 营业支出分析

2022 年上半年公司营业支出 55.62 亿元，同比减少 2.83 亿元，降幅 4.83%，主要项目如下：

单位：亿元

项目	本报告期		上年同期		金额 同比增减
	金额	占营业支出 比重	金额	占营业支出 比重	
税金及附加	0.67	1.21%	0.75	1.29%	-10.83%
业务及管理费	40.43	72.69%	42.96	73.49%	-5.88%
信用减值损失	6.85	12.31%	2.25	3.86%	203.91%
其他资产减值损失	0.19	0.34%	-0.03	-0.05%	不适用
其他业务成本	7.49	13.46%	12.52	21.42%	-40.21%
营业支出合计	55.62	100.00%	58.45	100.00%	-4.83%

1) 税金及附加

2022 年上半年，本集团税金及附加 0.67 亿元，同比减少 0.08 亿元，降幅 10.83%，主要系城市维护建设税、教育费附加以及地方教育费附加减少。

2) 业务及管理费

2022 年上半年，本集团业务及管理费 40.43 亿元，同比减少 2.52 亿元，降幅 5.88%，主要系人力费用下降所致。

3) 信用减值损失

2022 年上半年，本集团信用减值损失 6.85 亿元，同比增加 4.60 亿元，增幅 203.91%，主要系买入返售金融资产计提减值准备增加。

4) 其他资产减值损失

2022 年上半年，本集团其他资产减值损失 0.19 亿元，同比增加 0.22 亿元，主要是因为公司所属期货子公司大宗商品计提的减值损失增加。

5) 其他业务成本

2022 年上半年，本集团其他业务成本 7.49 亿元，同比减少 5.03 亿元，降幅 40.21%，主要是因为所属期货子公司商品贸易成本减少。

4、现金流量分析

单位：亿元

项目	本报告期	上年同期	同比增减
经营活动现金流入小计	439.20	320.99	36.82%
经营活动现金流出小计	189.43	590.49	-67.92%

经营活动产生的现金流量净额	249.76	-269.50	不适用
投资活动现金流入小计	5.83	329.83	-98.23%
投资活动现金流出小计	64.42	1.31	4,836.05%
投资活动产生的现金流量净额	-58.59	328.52	-117.83%
筹资活动现金流入小计	625.18	715.48	-12.62%
筹资活动现金流出小计	621.75	686.27	-9.40%
筹资活动产生的现金流量净额	3.43	29.21	-88.25%
现金及现金等价物净增加额	194.39	88.24	120.30%

注 1：经营活动产生的现金流量净额同比增加主要是报告期内公司为交易目的而持有的金融工具净流出和代理买卖证券现金净流出同比减少所致。

注 2：投资活动产生的现金流量净额同比减少主要是因为收回投资收到的现金流减少，投资支付的现金增加。

注 3：筹资活动产生的现金流量净额同比减少主要是因为吸收投资收到的现金减少。

（1）经营活动现金流量

2022 年上半年，本集团经营活动产生的现金流量净流入 249.76 亿元，其中经纪客户保证金净流入 93.42 亿元，剔除此因素后的经营活动现金流量净流入 156.35 亿元。从构成来看，现金流入主要为卖出交易性金融资产产生的现金流入 121.26 亿元、收取利息、手续费及佣金的现金流入 116.66 亿元、融出资金净减少额 91.58 亿元、其他现金流入 16.28 亿元；现金流出主要为回购业务资金净流出 71.48 亿元、其他现金流出 34.32 亿元、支付给职工以及为职工支出的现金 27.90 亿元、支付利息、手续费及佣金的现金流出 25.03 亿元、支付的各项税费 20.44 亿元、拆入资金流出 10.27 亿元。

（2）投资活动现金流量

2022 年上半年，本集团投资活动产生的现金流量净流出 58.59 亿元。从构成来看，现金流入主要为取得投资收益收到的现金 5.81 亿元、处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额 0.02 亿元；现金流出主要为投资支付的现金 63.39 亿元、购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 1.03 亿元。

（3）筹资活动现金流量

2022 年上半年，本集团筹资活动产生的现金流量净流入 3.43 亿元。从构成来看，现金流入主要为发行债券收到的现金 601.73 亿元、取得借款收到的现金 23.45 亿元；现金流出主要为偿还债务支付的现金 592.03 亿元、分配股利、利润或偿付利息支付的现金 27.65 亿元、支付租赁负债的现金 2.07 亿元。

（二）公司业务发展目标

1、公司所处行业基本情况和竞争状况

2022 年上半年，全球疫情依然严峻、地缘政治冲突升级、全球化与区域化不断博弈，多重不利因素影响对我国国民经济发展带来了前所未有的挑战，资本市场行情呈现较大波动。为维护资本市场稳定，

提振市场信心，中国证监会坚决贯彻国务院金融稳定发展委员会专题会议精神，陆续出台系列政策，全力维护资本市场平稳运行。在高效统筹疫情防控和经济社会发展各项政策措施的支持下，国内经济逐步企稳回升，呈现稳中加固、稳中向好、稳中提质运行态势，证券行业整体经营环境有所改善，各项业务重回良性发展的正轨。报告期内，我国证券行业主要呈三大发展特征：

1) 资本市场波动加剧，券商行情及经营业绩整体承压

2022 年上半年，面对国内经济运行下行和疫情防控形势趋紧的双重压力，证券市场主要指数出现一定幅度的震荡下调，截至 6 月 30 日，上证综指、深证成指、创业板指分别下跌 6.63%、13.20%、15.41%，受市场剧烈波动影响，一季度证券市场震荡下跌，伴随着二季度市场回暖，以及机构自身策略调整，券商行情回暖，但整体表现较去年同期相比仍有一定程度下滑。

2) 改革夯实资本市场韧性，流动性宽松叠加政策面持续向好

报告期内资本市场围绕“稳字当头、稳中求进”推进各项改革举措，制度建设逐步完善，推动资本市场长期向好，个人养老金制度落地带来资管行业增量；加快推进公募基金行业高质量发展推动中长期资金入市；股票交易过户费下调利于促进成交额上升；北交所转板制度正式落地，标志着我国多层次资本市场实现了真正意义上的互联互通；科创板做市商制度试点落地，填补 A 股做市制度空白；《中华人民共和国期货和衍生品法》发布，为期货市场的对外开放和高质量发展提供更广阔的发展空间。此外，中央政治局会议明确提出全面稳增长，国常会部署稳经济一揽子政策加速落地生效，坚决稳住宏观经济大盘，市场生态逐步改善，市场活力持续增强，推动证券行业健康可持续发展。

3) 全面贯彻“零容忍”监管方针，持续完善市场发展生态

资本市场“零容忍”监管执法持续升级，报告期内证监系统密集发布各类监管文件，涵盖从业人员执业规范、业务操作指引、合规文化建设、声誉管理等，稳步推进各项法规条例建设。与此同时，监管机构对证券公司各类违规行为依然保持严监管态势，行政处罚力度显著加强，对中介机构执业过程尽职尽责提出更高要求。2022 年上半年，各监管主体向券商及个人共发出 163 张罚单，涉及 60 家证券公司，137 名相关从业人员，数量较同期明显增加，并呈现一案“多罚”、后督追责时间拉长等特点。通过加强制度建设，加大监管力度，进一步构建“合规、诚信、专业、稳健”为核心的证券行业文化理念，持续推动证券行业高质量发展。

2、公司所处的行业地位

作为一家以资本市场为依托的综合金融服务商，公司见证了中国证券业的发展历程，经历了多个市场周期变化，确立了在中国证券行业内历史悠久、多方位、高质量的领先地位。公司充分利用“投资控股集团+证券公司”的双层架构优势，坚持稳健经营，严控风险，围绕企业金融、个人金融、机构服务及交易、投资管理等客户需求，不断丰富投资业务领域、优化资产配置结构、加快各类业务协同、持

续完善可持续发展投资模式，全力打造综合金融服务闭环。报告期内，公司积极应对新冠肺炎疫情和经济发展压力的双重挑战，认真贯彻落实党中央、国务院各项决策部署，统筹疫情防控和经营管理，全力做好“六稳”工作、落实“六保”任务，不断增强客户综合服务能力，积极优化业务布局、加快改革转型、强化风险防控，多措并举服务国家战略，支持各类市场主体纾困解难，助力稳住经济大盘。

现阶段，公司资产质量优良、财务状况良好，在营业收入、净利润、总资产、净资产、净资产收益率、行业排名等方面均保持较好水平，综合实力稳居行业第一梯队。

3、公司业务发展目标

2022 年，公司将坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，继续以全面贯彻落实党的十九大和十九届六中全会精神、迎接和学习宣传贯彻党的二十大为统领，以落实中央延伸巡视整改为契机，以全面落实创新、协调、绿色、开放、共享的新发展理念为根本，深入贯彻党中央、中投公司和董事会各项决策部署，坚持稳中求进工作总基调，正确认识和把握公司发展新形势新任务，加强战略引领、科学辩证施策，乘势而上、不断丰富与改善盈利模式，深化专业化、市场化改革，全面构建核心竞争力，不断强化完善合规风控体系建设，实现公司新发展格局迈出新步伐、高质量发展取得新成效。

（三）报告期内利润来源情况

报告期内，公司利润主要来源于机构服务及交易、个人金融、企业金融业务板块，占比 44.82%、31.05%、14.00%，为本公司主要经营业务。

第二节 公司信用类债券基本情况

一、公司信用类债券基本信息

债券简称	17 申证 02
债券代码	136981
债券名称	申万宏源证券有限公司公开发行 2017 年公司债券（第一期）（品种二）
发行日	2017 年 02 月 17 日
起息日	2017 年 02 月 17 日
最近回售日	
到期日	2024 年 02 月 17 日
债券余额（亿元）	5
票面利率（%）	4.50
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	上海证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司
受托管理人/债权代理人	华泰联合证券有限责任公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用

报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	18 申证 03
债券代码	112812
债券名称	申万宏源证券有限公司 2018 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）
发行日	2018 年 12 月 10 日
起息日	2018 年 12 月 10 日
最近回售日	
到期日	2023 年 12 月 10 日
债券余额（亿元）	15
票面利率（%）	4.08
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司

受托管理人/债权代理人	华泰联合证券有限责任公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 06
债券代码	149173
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）
发行日	2020 年 07 月 27 日
起息日	2020 年 07 月 27 日
最近回售日	
到期日	2023 年 07 月 27 日
债券余额（亿元）	41
票面利率（%）	3.49
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA

最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 08
债券代码	149230
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）
发行日	2020 年 09 月 10 日
起息日	2020 年 09 月 10 日
最近回售日	
到期日	2023 年 09 月 10 日
债券余额（亿元）	32

票面利率（%）	3.76
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 10
债券代码	149274
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）（品种二）
发行日	2020 年 10 月 26 日

起息日	2020 年 10 月 26 日
最近回售日	
到期日	2023 年 10 月 26 日
债券余额（亿元）	57
票面利率（%）	3.68
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 12
债券代码	149299
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种二）
发行日	2020 年 11 月 16 日
起息日	2020 年 11 月 16 日
最近回售日	
到期日	2022 年 11 月 16 日
债券余额（亿元）	17
票面利率（%）	3.55
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发	不适用

及执行情况	
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 01
债券代码	149425
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期）（品种一）
发行日	2021 年 04 月 29 日
起息日	2021 年 04 月 29 日
最近回售日	
到期日	2024 年 04 月 29 日
债券余额（亿元）	25
票面利率（%）	3.45
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者

报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 02
债券代码	149431
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期）（品种二）
发行日	2021 年 04 月 29 日
起息日	2021 年 04 月 29 日
最近回售日	
到期日	2031 年 04 月 29 日
债券余额（亿元）	20
票面利率（%）	4.05
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否

交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 03
债券代码	149479
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第二期）
发行日	2021 年 05 月 24 日
起息日	2021 年 05 月 24 日
最近回售日	
到期日	2026 年 05 月 24 日
债券余额（亿元）	26
票面利率（%）	3.63
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次

	还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 04
债券代码	149490
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第三期）（品种一）
发行日	2021 年 05 月 28 日
起息日	2021 年 05 月 28 日

最近回售日	
到期日	2024 年 05 月 28 日
债券余额（亿元）	20
票面利率（%）	3.27
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 05
------	----------

债券代码	149491
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第三期）（品种二）
发行日	2021 年 05 月 28 日
起息日	2021 年 05 月 28 日
最近回售日	
到期日	2031 年 05 月 28 日
债券余额（亿元）	25
票面利率（%）	4.00
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用

报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 06
债券代码	149559
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第四期）（品种一）
发行日	2021 年 07 月 21 日
起息日	2021 年 07 月 21 日
最近回售日	
到期日	2024 年 07 月 21 日
债券余额（亿元）	20
票面利率（%）	3.13
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用

报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 07
债券代码	149560
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第四期）（品种二）
发行日	2021 年 07 月 21 日
起息日	2021 年 07 月 21 日
最近回售日	
到期日	2031 年 07 月 21 日
债券余额（亿元）	30
票面利率（%）	3.77
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所

主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 08
债券代码	149574
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第五期）（品种一）
发行日	2021 年 07 月 28 日
起息日	2021 年 07 月 28 日
最近回售日	
到期日	2024 年 07 月 28 日
债券余额（亿元）	28
票面利率（%）	3.04
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付

最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 09
债券代码	149575
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第五期）（品种二）
发行日	2021 年 07 月 28 日
起息日	2021 年 07 月 28 日
最近回售日	

到期日	2026 年 07 月 28 日
债券余额（亿元）	42
票面利率（%）	3.38
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 10
债券代码	149614

债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第六期）（品种一）
发行日	2021 年 08 月 26 日
起息日	2021 年 08 月 26 日
最近回售日	
到期日	2024 年 08 月 26 日
债券余额（亿元）	30
票面利率（%）	3.02
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用

适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 11
债券代码	149615
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第六期）（品种二）
发行日	2021 年 08 月 26 日
起息日	2021 年 08 月 26 日
最近回售日	
到期日	2031 年 08 月 26 日
债券余额（亿元）	30
票面利率（%）	3.75
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行	不适用

情况	
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 12
债券代码	149626
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第七期）（品种一）
发行日	2021 年 09 月 09 日
起息日	2021 年 09 月 09 日
最近回售日	
到期日	2024 年 09 月 09 日
债券余额（亿元）	48
票面利率（%）	3.05
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公

	司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 13
债券代码	149627
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第七期）（品种二）
发行日	2021 年 09 月 09 日
起息日	2021 年 09 月 09 日
最近回售日	
到期日	2026 年 09 月 09 日
债券余额（亿元）	10
票面利率（%）	3.40
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA

最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 14
债券代码	149595
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第八期）（品种一）
发行日	2021 年 09 月 22 日
起息日	2021 年 09 月 22 日
最近回售日	
到期日	2023 年 09 月 22 日

债券余额（亿元）	23
票面利率（%）	2.95
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 15
债券代码	149640
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专

	业投资者) (第八期) (品种二)
发行日	2021 年 09 月 22 日
起息日	2021 年 09 月 22 日
最近回售日	
到期日	2024 年 09 月 22 日
债券余额 (亿元)	23
票面利率 (%)	3.10
还本付息方式	采用单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本, 最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用

适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 01
债券代码	149789
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）
发行日	2022 年 01 月 21 日
起息日	2022 年 01 月 21 日
最近回售日	
到期日	2025 年 01 月 21 日
债券余额（亿元）	50
票面利率（%）	2.80
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行	不适用

情况	
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 02
债券代码	149790
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）
发行日	2022 年 01 月 21 日
起息日	2022 年 01 月 21 日
最近回售日	
到期日	2032 年 01 月 21 日
债券余额（亿元）	24
票面利率（%）	3.60
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公

	司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 03
债券代码	149809
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）
发行日	2022 年 02 月 23 日
起息日	2022 年 02 月 23 日
最近回售日	
到期日	2025 年 02 月 23 日
债券余额（亿元）	22
票面利率（%）	2.95
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA

最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 05
债券代码	149852
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）（品种一）
发行日	2022 年 03 月 24 日
起息日	2022 年 03 月 24 日
最近回售日	
到期日	2025 年 03 月 24 日

债券余额（亿元）	35
票面利率（%）	3.18
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 06
债券代码	149853
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公

	司债券（第三期）（品种二）
发行日	2022 年 03 月 24 日
起息日	2022 年 03 月 24 日
最近回售日	
到期日	2027 年 03 月 24 日
债券余额（亿元）	21
票面利率（%）	3.53
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用

适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 07
债券代码	112904
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种一）
发行日	2022 年 05 月 23 日
起息日	2022 年 05 月 23 日
最近回售日	
到期日	2025 年 05 月 23 日
债券余额（亿元）	18
票面利率（%）	2.78
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行	不适用

情况	
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 08
债券代码	149252
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种二）
发行日	2022 年 05 月 23 日
起息日	2022 年 05 月 23 日
最近回售日	
到期日	2027 年 05 月 23 日
债券余额（亿元）	22
票面利率（%）	3.20
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公

	司、海通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 C1
债券代码	149360
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）
发行日	2021 年 01 月 21 日
起息日	2021 年 01 月 21 日
最近回售日	
到期日	2024 年 01 月 21 日
债券余额（亿元）	30
票面利率（%）	3.93
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA

最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 C2
债券代码	149405
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第二期）
发行日	2021 年 03 月 11 日
起息日	2021 年 03 月 11 日
最近回售日	
到期日	2024 年 03 月 11 日

债券余额（亿元）	38
票面利率（%）	3.94
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 C3
债券代码	149761
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第三期）（品种一）

发行日	2021 年 12 月 27 日
起息日	2021 年 12 月 27 日
最近回售日	
到期日	2023 年 12 月 27 日
债券余额（亿元）	18
票面利率（%）	3.08
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 C4
债券代码	149762
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第三期）（品种二）
发行日	2021 年 12 月 27 日
起息日	2021 年 12 月 27 日
最近回售日	
到期日	2024 年 12 月 27 日
债券余额（亿元）	12
票面利率（%）	3.20
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用

报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 C1
债券代码	149904
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）
发行日	2022 年 04 月 27 日
起息日	2022 年 04 月 27 日
最近回售日	
到期日	2025 年 04 月 27 日
债券余额（亿元）	30
票面利率（%）	3.19
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者

报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 D5
债券代码	149736
债券名称	申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第三期）（品种二）
发行日	2021 年 12 月 08 日
起息日	2021 年 12 月 08 日
最近回售日	
到期日	2022 年 12 月 08 日
债券余额（亿元）	47
票面利率（%）	2.68
还本付息方式	采用单利计息，不计复利。到期一次性还本付息，利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	A-1
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否

交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 Y1
债券代码	149529
债券名称	申万宏源证券有限公司公开发行 2021 年永续次级债券（第一期）
发行日	2021 年 06 月 24 日
起息日	2021 年 06 月 24 日
最近回售日	
到期日	2026 年 06 月 24 日
债券余额（亿元）	20
票面利率（%）	4.10
还本付息方式	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次

最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	海通证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司
受托管理人/债权代理人	海通证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	附赎回权及满足特定条件时发行人赎回选择权，报告期内均未触发相关选择权
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 Y2
债券代码	149605
债券名称	申万宏源证券有限公司公开发行 2021 年永续次级债券（第二期）
发行日	2021 年 08 月 19 日
起息日	2021 年 08 月 19 日
最近回售日	

到期日	2026 年 08 月 19 日
债券余额（亿元）	33
票面利率（%）	3.70
还本付息方式	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	海通证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司
受托管理人/债权代理人	海通证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	附赎回权及满足特定条件时发行人赎回选择权，报告期内均未触发相关选择权
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	21 申证 Y3
债券代码	149700

债券名称	申万宏源证券有限公司公开发行 2021 年永续次级债券（第三期）
发行日	2021 年 11 月 15 日
起息日	2021 年 11 月 15 日
最近回售日	
到期日	2026 年 11 月 15 日
债券余额（亿元）	47
票面利率（%）	3.88
还本付息方式	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	海通证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司
受托管理人/债权代理人	海通证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	附赎回权及满足特定条件时发行人赎回选择权，报告期内均未触发相关选择权

适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 Y1
债券代码	148005
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第一期）
发行日	2022 年 07 月 27 日
起息日	2022 年 07 月 27 日
最近回售日	
到期日	2027 年 07 月 27 日
债券余额（亿元）	50
票面利率（%）	3.45
还本付息方式	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行	不适用

情况	
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	22 申证 Y2
债券代码	148040
债券名称	申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第二期）
发行日	2022 年 08 月 25 日
起息日	2022 年 08 月 25 日
最近回售日	
到期日	2027 年 08 月 25 日
债券余额（亿元）	48
票面利率（%）	3.28
还本付息方式	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次
最新主体评级	AAA
最新债项评级	AAA
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	国泰君安证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财

	通证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 02
债券代码	114653
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第一期）（品种二）
发行日	2020 年 01 月 16 日
起息日	2020 年 01 月 16 日
最近回售日	
到期日	2023 年 01 月 16 日
债券余额（亿元）	20
票面利率（%）	3.55
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA

最新债项评级	无评级
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司、兴业证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	兴业证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 04
债券代码	114666
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第二期）（品种二）
发行日	2020 年 02 月 21 日
起息日	2020 年 02 月 21 日
最近回售日	
到期日	2023 年 02 月 21 日

债券余额（亿元）	30
票面利率（%）	3.20
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	无评级
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司、兴业证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	兴业证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 C2
债券代码	115112
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年证券公司次级债券（第一

	期) (品种二)
发行日	2020 年 04 月 23 日
起息日	2020 年 04 月 23 日
最近回售日	
到期日	2023 年 04 月 23 日
债券余额 (亿元)	60
票面利率 (%)	3.18
还本付息方式	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 到期一次还本, 最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	无评级
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用

适用的交易机制	点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

债券简称	20 申证 C3
债券代码	115114
债券名称	申万宏源证券有限公司 2020 年证券公司次级债券（第二期）
发行日	2020 年 05 月 25 日
起息日	2020 年 05 月 25 日
最近回售日	
到期日	2023 年 05 月 25 日
债券余额（亿元）	60
票面利率（%）	3.25
还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付
最新主体评级	AAA
最新债项评级	无评级
最新评级展望	稳定
是否列入信用观察名单	否
交易场所	深圳证券交易所
主承销商	申万宏源证券承销保荐有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司
受托管理人/债权代理人	国泰君安证券股份有限公司
投资者适当性安排	专业机构投资者
报告期内发行人调整票面利率选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内投资者回售选择权的触发及执行	不适用

情况	
报告期内发行人赎回选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内可交换债中的交换选择权的触发及执行情况	不适用
报告期内其他特殊条款的触发及执行情况	不适用
适用的交易机制	点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市风险和应对措施	否

二、公司债券募集资金使用情况

债券简称	17 申证 02
债券代码	136981
募集资金总额（亿元）	5
募集资金计划用途	补充公司营运资金
已使用金额（亿元）	5
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国农业银行股份有限公司上海卢湾支行，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	18 申证 03
债券代码	112812
募集资金总额（亿元）	15
募集资金计划用途	用于补充公司营运资金
已使用金额（亿元）	15

未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国民生银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 06
债券代码	149173
募集资金总额（亿元）	41
募集资金计划用途	补充公司营运资金及偿还到期债务
已使用金额（亿元）	41
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 08
债券代码	149230
募集资金总额（亿元）	32
募集资金计划用途	补充公司营运资金，及偿还到期债务。
已使用金额（亿元）	32
未使用金额（亿元）	0

募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 10
债券代码	149274
募集资金总额（亿元）	57
募集资金计划用途	补充公司营运资金,及偿还到期债务
已使用金额（亿元）	57
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在上海浦东发展银行股份有限公司三林支行，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 12
债券代码	149299
募集资金总额（亿元）	17
募集资金计划用途	补充公司营运资金，及偿还到期债务
已使用金额（亿元）	17
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国工商银行股份有限公司上海

	市分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 01、21 申证 02
债券代码	149425、149431
募集资金总额（亿元）	45
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	45
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司福州分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 03
债券代码	149479
募集资金总额（亿元）	26
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	26
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息

项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 04、21 申证 05
债券代码	149490、149491
募集资金总额（亿元）	45
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	45
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立兴业银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 06、21 申证 07
债券代码	149559、149560
募集资金总额（亿元）	50
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	50
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立兴业银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用

是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 08、21 申证 09
债券代码	149574、149575
募集资金总额（亿元）	70
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	70
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司上海外滩支行，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 10、21 申证 11
债券代码	149614、149615
募集资金总额（亿元）	60
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	60
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于兴业银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是

及其他约定一致	
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 12、21 申证 13
债券代码	149626、149627
募集资金总额（亿元）	58
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	58
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司上海外滩支行，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 14、21 申证 15
债券代码	149595、149640
募集资金总额（亿元）	46
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	46
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司福州分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是

募集资金违规使用的整改情况	不适用
---------------	-----

债券简称	22 申证 01、22 申证 02
债券代码	149789、149790
募集资金总额（亿元）	74
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	74
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司上海外滩支行，报告期内通过该账户完成募集资金的收款和使用
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	22 申证 03
债券代码	149809
募集资金总额（亿元）	22
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	22
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内通过该账户完成募集资金的收款和使用
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是

募集资金违规使用的整改情况	不适用
---------------	-----

债券简称	22 申证 05、22 申证 06
债券代码	149852、149853
募集资金总额（亿元）	56
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	56
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司上海外滩支行，报告期内通过该账户完成募集资金的收款和使用
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	22 申证 07、22 申证 08
债券代码	112904、149252
募集资金总额（亿元）	40
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	40
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于兴业银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内通过该账户完成募集资金的收款和使用
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 C1
债券代码	149360
募集资金总额（亿元）	30
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	30
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国农业银行股份有限公司上海卢湾支行，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 C2
债券代码	149405
募集资金总额（亿元）	38
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	38
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 C3、21 申证 C4
债券代码	149761、149762
募集资金总额（亿元）	30
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	30
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立於兴业银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内按要 求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	22 申证 C1
债券代码	149904
募集资金总额（亿元）	30
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	30
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立於中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内通过该账户完成募集资金的收款和使用
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 D5
债券代码	149736
募集资金总额（亿元）	47
募集资金计划用途	补充流动资金，偿还一年内到期的债务
已使用金额（亿元）	47
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司福州分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 Y1
债券代码	149529
募集资金总额（亿元）	20
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	20
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司上海外滩支行，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 Y2
------	----------

债券代码	149605
募集资金总额（亿元）	33
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	33
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	21 申证 Y3
债券代码	149700
募集资金总额（亿元）	47
募集资金计划用途	补充公司营运资金，偿还到期债务
已使用金额（亿元）	47
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国招商银行股份有限公司上海外滩支行，报告期内按要求规范运作
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	22 申证 Y1
债券代码	148005

募集资金总额（亿元）	50
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	50
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司上海分行营业部，报告期后通过该账户完成募集资金的收款和使用。截至报告出具日，募集资金已使用完毕
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	22 申证 Y2
债券代码	148040
募集资金总额（亿元）	48
募集资金计划用途	偿还到期公司债券
已使用金额（亿元）	48
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立于招商银行股份有限公司福州分行营业部，报告期后通过该账户完成募集资金的收款和使用。截至报告出具日，募集资金已使用完毕
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 02
------	----------

债券代码	114653
募集资金总额（亿元）	20
募集资金计划用途	全部用于偿还到期债务
已使用金额（亿元）	20
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国工商银行股份有限公司上海市分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 04
债券代码	114666
募集资金总额（亿元）	30
募集资金计划用途	偿还到期债务
已使用金额（亿元）	30
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立在中国招商银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 C2
债券代码	115112

募集资金总额（亿元）	60
募集资金计划用途	偿还到期债务
已使用金额（亿元）	60
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立兴业银行股份有限公司上海分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

债券简称	20 申证 C3
债券代码	115114
募集资金总额（亿元）	60
募集资金计划用途	偿还到期债务
已使用金额（亿元）	60
未使用金额（亿元）	0
募集资金专项账户运作情况	募集资金专项账户开立招商银行股份有限公司福州分行营业部，报告期内通过该账户完成债券付息
项目的进展情况及运营效益	不适用
是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	是
募集资金违规使用的整改情况	不适用

三、报告期内公司债券募集资金用途变更情况

适用 不适用

四、报告期内公司信用类债券评级调整情况

（一）主体评级变更情况

报告期内，发行人主体评级变更情况

适用 不适用

（二）债券评级变更情况

报告期内，公司信用类债券评级调整情况

适用 不适用

五、增信措施情况

适用 不适用

第三节 报告期内重要事项

一、审计情况

本公司 2022 年半年度财务报告未经审计。

二、会计政策、会计估计变更和重大会计差错更正情况

报告期内，公司未发生会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正事项。

三、合并报表范围变化情况

报告期内，公司合并报表范围未发生重大变化。

四、报告期内亏损情况

报告期内，公司合并报表范围内未发生亏损。

五、资产受限情况

截至报告期末，公司合并报表范围内受限资产账面价值为 13,987,221.05 万元，占报告期末净资产比例为 132.46%，具体如下：

受限资产类型	受限金额（万元）	占报告期末净资产百分比（%）
货币资金	71,681.08	0.68
交易性金融资产	11,524,073.83	109.13
其他债权投资	2,307,459.09	21.85
其他权益工具投资	82,956.38	0.79
固定资产	1,050.67	0.01

六、可对抗第三人的优先偿付负债情况

截至报告期末，公司不存在可对抗第三人的优先偿付负债。

七、资金占款情况

报告期内，公司是否发生非经营性往来占款或资金拆借

是 否

报告期内，公司是否存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况

是 否

报告期内，公司未发生非经营性往来占款或资金拆借，亦不存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况。

八、有息负债逾期和变动情况

截至报告期末，公司合并报表范围内不存在公司信用类债券逾期和其他有息债务重大逾期情况。

截至报告期末，公司有息负债总额为 30,553,741.02 万元，同比变动 15.40%，未超过 30%。

九、对外担保情况

截至报告期末，公司不存在对外担保。

十、重大未决诉讼情况

适用 不适用

1、报告期公司及其子公司有关诉讼、仲裁事项

(1) 公司诉张留洋融资融券交易纠纷案

2020年6月，公司与张留洋签订《融资融券合同》。张留洋开展融资购买股票业务期间，信用账户维持担保比例低于平仓线，且未采取有效措施提高维持担保比例，后经公司强制平仓，尚欠公司融资本金人民币8,540.08万元未还。经催讨未果，为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求张留洋履行还款义务。2021年1月，上海金融法院受理公司起诉。2021年9月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求，后张留洋提出上诉。2021年11月，因张留洋未缴纳上诉费，法院裁定一审判决生效。截至目前，公司已向法院申请执行。

(2) 公司诉 RAAS CHINA LIMITED、深圳莱士凯吉投资咨询有限公司、科瑞天诚投资控股有限公司质押式证券回购合同纠纷案

2017年10月，公司与 RAAS CHINA LIMITED 签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，RAAS CHINA LIMITED 向公司融入资金，科瑞天诚承担连带保证责任。2018年3月，公司、RAAS CHINA LIMITED、深圳莱士、科瑞天诚签订了《补充协议》。2018年9月，深圳莱士未按照合同约定履行义务。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求 RAAS CHINA LIMITED 向公司支付未偿还本金人民币20,000万元及相关利息、违约金，深圳莱士向公司支付相关利息，科瑞天诚承担连带清偿责任等。2021年4月，上海金融法院受理本案。2021年11月，上海金融法院作出一审判决，支持公司主要诉讼请求。截至目前，本案判决已生效，公司已向法院申请执行。

(3) 申万创新投与上海世联行股权投资管理有限公司合同争议仲裁案

2015年11月，申万创新投与上海世联行股权投资管理有限公司（以下简称“上海世联行”）等签署了《上海祺浩投资合伙企业（有限合伙）合伙协议》。2016年11月，申万创新投与上海世联行签署了《关于上海祺浩投资合伙企业（有限合伙）的补充协议》。后上海世联行未按照协议约定履行相关义务。为维护公司的合法权益，申万创新投向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，要求上海世联行履行收购义务，支付投资款及协议约定的回购利息合计人民币6,178.54万元。2021年4月，上海国际经济贸易仲裁委员会已受理本案。2022年7月，上海国际经济贸易仲裁委员会根据双方签署的《和解协议》做出裁决，裁决上海世联行依照双方《和解协议》约定的付款方式，分期向申万创新投支付履行回

购义务的款项。截至目前，《和解协议》正在履行中。

(4) 公司诉邹勇、李亚丽质押式证券回购合同纠纷案

2017 年 3 月，公司与邹勇签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，邹勇向公司融入人民币 13,600 万元，其配偶李亚丽承担连带责任。期间，邹勇未按照协议约定支付利息，未在履约比例低于平仓线时采取措施使履约保障比例恢复至约定的预警值以上。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求邹勇归还本金人民币 7,368 万元并支付相关利息、违约金，李亚丽承担共同还款责任等。2021 年 6 月，上海金融法院已受理本案。截至目前，本案尚未判决。

(5) 公司诉翁武游、林永飞、翁雅云质押式证券回购纠纷案

2016 年 6 月及 2018 年 2 月，公司与翁武游分别签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，翁武游向公司融入合计人民币 9,900 万元的资金，林永飞承担连带保证责任，并以其持有的“摩登大道”作为质押标的股票，林永飞配偶翁雅云予以确认。2018 年 12 月，翁武游未按照合同的约定支付相应的利息等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼。2021 年 3 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，本案判决已生效，公司已向法院申请执行。

(6) 公司诉沈培今、朱礼静质押式证券回购纠纷案

2017 年 4 月，公司与沈培今签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，沈培今向公司融入人民币 70,000 万元的资金，其配偶朱礼静承担连带责任。2018 年 10 月，沈培今履约保障比例跌至约定的最低履约保障比例以下，且未依约提升履约保障比例至预警值以上或采取其他履约保障措施，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求沈培今、朱礼静支付本金未偿还人民币 69,500 万元及相应利息、违约金等。2021 年 1 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，本案判决已生效，公司已向法院申请执行。

(7) 公司诉柯宗贵、陈色琴等质押式证券回购系列纠纷案

①2017 年 3 月，公司与柯宗贵签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗贵向公司融入人民币 8,300 万元，其配偶陈色琴承担连带责任，中经汇通有限责任公司、马美容提供质押担保。柯宗贵自 2020 年 3 月起未按照协议约定支付利息，亦未完成回购交易等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼。2020 年 8 月，上海金融法院受理本案。2021 年 10 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。后柯宗贵一方向上海高级人民法院提起上诉。截至目前，本案尚未判决。

②2017 年 3 月，公司与柯宗贵签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗贵向公司融入人民币 10,000 万元，其配偶陈色琴承担连带责任，中经汇通有限责任公司、

马美容提供质押担保，期间柯宗贵向公司归还了 4,000 万本金。柯宗贵自 2020 年 3 月起未按照协议约定支付利息，亦未完成回购交易等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼。2020 年 8 月，上海金融法院受理本案。2021 年 10 月，公司收到上海金融法院一审判决书，支持公司诉讼请求。后柯宗贵一方向上海高级人民法院提起上诉。截至目前，本案尚未判决。

③2017 年 7 月，公司与柯宗贵签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗贵向公司融入人民币 9,000 万元，其配偶陈色琴承担连带责任，马美容提供质押担保，期间柯宗贵归还了部分本金，后柯宗贵后续未按照协议约定支付利息，亦未完成回购交易等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海市徐汇区人民法院提起诉讼，要求支付本金人民币 2,173 万元及相应利息、违约金等。2020 年 8 月，上海市徐汇区人民法院受理本案。2021 年 8 月，上海市徐汇区人民法院作出一审判决，支持公司诉讼请求，后柯宗贵提起上诉。2022 年 6 月，上海金融法院作出二审判决，驳回上诉，维持原判。截至目前，公司已向法院申请执行。

（8）公司诉柯宗庆、谭爱武质押式证券回购系列纠纷案

①2017 年 7 月，公司与柯宗庆签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗庆向公司融入人民币 6,500 万元，其配偶谭爱武承担连带责任，期间柯宗庆归还了部分本金。后柯宗庆未能按照约定完成回购等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海市徐汇区人民法院提起诉讼，双方在法院组织下达成调解，根据民事调解书，柯宗庆需于 2020 年 10 月 28 日前向公司支付人民币 3,696.42 万元及相关利息、违约金等，谭爱武承担连带责任。截至目前，柯宗庆未按照调解书履行还款义务，公司已向法院申请强制执行。

②2018 年 4 月，公司与柯宗庆签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗庆向公司融入人民币 6,990 万元，其配偶谭爱武承担连带责任。期间，柯宗庆归还了部分本金，后由于柯宗庆未能按照约定完成回购等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海市徐汇区人民法院提起诉讼，双方在法院组织下达成调解，根据民事调解书，柯宗庆需于 2020 年 10 月 28 日前向公司支付人民币 4,323 万元及相关利息、违约金等，谭爱武承担连带责任。截至目前，柯宗庆未按照调解书履行还款义务，公司已向法院申请强制执行。

③2018 年 4 月，公司与柯宗庆签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗庆向公司融入人民币 2,510 万元，其配偶谭爱武承担连带责任。期间，柯宗庆归还了部分本金，后履约保障比例跌破平仓线，柯宗庆未依约回购本息等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海市徐汇区人民法院提起诉讼，双方在法院组织下达成调解，根据民事调解书，柯宗庆需于 2020 年 10 月 28 日前向公司支付人民币 1,499 万元及相关利息、违约金，谭爱武承担连带责任。截至目前，柯宗庆未按照调解书履行还款义务，公司已向法院申请强制执行。

(9) 公司诉创金合信基金管理有限公司债券质押式回购协议违约纠纷案

2018 年 10 月，公司所管理的申银万国天天增 1 号集合资产管理计划与创金合信基金管理有限公司（以下简称“被申请人、创金合信”）管理的创金合信邻水融富 2 号资产管理计划（下称“邻水融富 2 号”）开展债券质押式回购业务，成交金额为 7,000 万元，质押债券为“17 国购 01”100,000 手。2019 年 1 月，创金合信及其管理的邻水融富 2 号在约定的到期日未履行资金融入方的还款义务，构成违约，经多次催讨，被申请人仍未履行还款义务。为维护公司及委托人合法权益，公司向深圳国际仲裁院提起仲裁。2021 年 7 月，公司收到裁决书，裁决邻水融富 2 号履行还款义务，偿还本息合计人民币 7,109.39 万元及相关利息、罚息等。截至目前，邻水融富 2 号未能按照裁决书履行义务，公司已向法院申请执行。

(10) 公司诉中信国安集团有限公司质押式证券回购纠纷案

2018 年，公司与中信国安集团有限公司（以下简称“中信国安”）签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，中信国安向公司融入资金，2018 年 10 月，履约保障比例低于约定，中信国安未依约履行相关义务，构成违约。2019 年 12 月，公司向上海金融法院起诉并获得受理，要求支付本金人民币 45,000 万元及相应利息、违约金等。后本案移送北京市三中院处理。2021 年 12 月，北京市三中院做出一审判决，支持公司主要诉讼请求。2022 年 1 月，北京市一中院裁定受理中信国安重整申请。截至目前，本案判决已生效，公司正向管理人申报债权。

(11) 公司诉中信国安投资有限公司、中信国安集团有限公司质押式证券回购纠纷案

2018 年 3 月，公司与中信国安投资有限公司（以下简称“国安投资”）签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，国安投资向公司融入资金，中信国安承担连带保证责任。2018 年 10 月，履约保障比例低于约定，国安投资未依约履行相关义务，中信国安亦未承担相应担保责任，构成违约。2019 年 12 月，公司向上海金融法院起诉并获得受理，要求支付本金人民币 32,896 万元及相应利息、违约金等。后本案移送至北京市第三中级人民法院处理。2021 年 12 月，北京市三中院做出一审判决，支持公司主要诉讼请求。2022 年 1 月，北京市一中院裁定受理中信国安重整申请。2022 年 6 月，中信国安投资被法院裁定与中信国安合并重整。截至目前，本案判决已生效，公司正向管理人申报债权。

(12) 申万创新投诉中科建设开发总公司等信托贷款违约案

2016 年，申万创新投与光大兴陇信托有限责任公司（以下简称“光大信托公司”）签订信托合同，申万创新投交付信托资金合计人民币 3 亿元，由光大信托公司向中科建设开发总公司（简称“中科建设”）发放信托贷款，中科龙轩工程项目管理海安有限公司提供质押担保。后中科建设到期未支付相应利息，经多次催告仍未支付，构成违约。后光大信托公司与申万创新投合意终止信托，并将其基于相关债权及担保权利等全部权利转让于申万创新投。2018 年 9 月，申万创新投向甘肃省高级人民法院提交

《民事起诉状》，请求判决中科建设向申万创新投偿还借款本金人民币 3 亿元及利息、支付罚息、律师费，中科龙轩对前述请求承担连带责任。2020 年 11 月，申万创新投收到该案件一审裁定书，法院裁定驳回其起诉，后申万创新投就该裁定上诉。2021 年 8 月，申万创新投收到最高法院裁定，撤销一审裁定，指令一审法院重新审理。截至目前，本案尚未判决。

(13) 公司代表资产管理计划诉柳永詮等质押式证券回购合同纠纷系列案

①公司（代表证券行业支持民企发展系列之申万宏源聚龙 1 号集合资产管理计划）诉安吉聚龙企业管理咨询合伙企业（有限合伙）等质押式证券回购合同纠纷案

2019 年 12 月，公司代表申万宏源聚龙 1 号集合资产管理计划与安吉聚龙企业管理咨询合伙企业（有限合伙）（以下简称“安吉聚龙”）签订《股票质押式回购交易业务协议》及《公司股票质押式回购交易协议书》，安吉聚龙向资管计划融入资金合计人民币 12,260 万元。柳永铨及其配偶张奈提供连带保证，柳长庆提供质押担保。期间，安吉聚龙偿还了部分本金。因安吉聚龙未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求安吉聚龙支付待偿还本金人民币 10,682.50 万元及利息、违约金，柳永铨、张奈、柳长庆承担相应担保责任等。

②公司（代表证券行业支持民企发展系列之申万宏源聚龙 1 号集合资产管理计划）诉柳永詮等质押式证券回购合同纠纷案

2019 年 12 月，公司代表申万宏源聚龙 1 号集合资产管理计划与柳永詮签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柳永詮向资管计划融入资金合计人民币 37,540 万元，其配偶张奈承担连带责任，安吉聚龙提供连带保证，柳长庆提供质押担保。期间，柳永詮未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求柳永铨、张奈共同支付待偿还本金人民币 37,540 万元及相关利息、违约金，安吉聚龙和柳长庆承担相应担保责任等。

③公司（代表证券行业支持民企发展之申万宏源 15 号单一资产管理计划）诉柳永詮等质押式证券回购合同纠纷案

2020 年 4 月 17 日，公司代表申万宏源 15 号单一资产管理计划与柳永詮签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柳永詮向资管计划融入资金合计人民币 15,820.76 万元，其配偶张奈承担连带责任并提供质押担保，柳长庆提供质押担保。期间，柳永詮未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，在合约到期时也未履行购回义务。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求柳永铨、张奈共同支付待偿还本金人民币 15,820.76 万元及相关利息、违约金，柳长庆承担相应担保责任等。

④公司（代表证券行业支持民企发展之申万宏源 15 号单一资产管理计划）诉周素芹等质押式证券回购合同纠纷案

2020 年 4 月 17 日，公司代表申万宏源 15 号单一资产管理计划与周素芹签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，周素芹向资管计划融入资金合计人民币 16,076.52 万元，其配偶柳长庆承担连带责任并提供质押担保，张奈提供质押担保。期间，周素芹未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，在合约到期时也未履行购回义务。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求周素芹、柳长庆共同支付待偿还本金人民币 16,076.52 万元及相关利息、违约金，张奈承担相应担保责任等。

2021 年 7 月，上海金融法院受理上述案件。2022 年 6 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，上述判决尚未生效。

（14）公司与开源证券股份有限公司债券质押式回购协议纠纷案

2018 年 10 月，公司所管理的申银万国天天增 1 号集合资产管理计划与开源证券股份有限公司（以下简称“被申请人、开源证券”）管理的臻意 7 号定向资产管理计划（下称“臻意 7 号”）开展债券质押式回购业务，开展了五笔债券质押式协议回购业务，合计本金 10,596 万元。2019 年 9 月 9 日，被申请人开源证券管理的臻意 7 号在约定的到期日未履行正回购方的还款义务，构成实质性违约。为维护公司及委托人合法权益，公司代表资产管理计划向上海国际仲裁中心提起仲裁，并于 2021 年 8 月 23 日得知获得受理。2021 年 11 月 22 日，公司收到仲裁裁决，支持公司的诉讼请求。截至目前，公司已向北京市金融法院申请执行。

（15）湖北襄阳农村商业银行股份有限公司诉公司等委托理财合同纠纷案

湖北襄阳农村商业银行股份有限公司（以下简称“申请人”）因委托理财合同纠纷在武汉仲裁委员会对公司及资产管理计划托管人提起仲裁。申请人为公司管理的资产管理计划委托人，因对资产管理计划的运作存在争议，要求公司赔偿本金、预期利息损失及管理费合计 7,600 余万元，并要求托管人承担补充责任。2022 年 3 月 4 日，公司收到武汉仲裁委员会仲裁通知书。截至目前，本案尚未裁决。

（16）山东莱州农村商业银行股份有限公司与公司资产管理合同纠纷案

山东莱州农村商业银行股份有限公司（以下简称“申请人”）因资产管理合同纠纷在上海国际经济贸易仲裁委员会对我公司提起仲裁。申请人为公司管理的资产管理计划委托人，因对资产管理计划的运作存在争议，要求公司退还委托资金、赔偿投资损失、管理费托管费损失合计人民币 7,600 余万元。2022 年 3 月 15 日，公司收到仲裁通知书。截至目前，本案尚未裁决。

（17）公司诉科瑞天诚投资控股有限公司、宁波科瑞金鼎投资合伙企业（有限合伙）质押式证券回购合同纠纷案

2017 年 3 月，公司与科瑞天诚投资控股有限公司（以下简称“科瑞天诚”）签订《股票质押式回购交易业务协议》，其后又签订七份《股票质押式回购交易协议书》，科瑞天诚向公司融入资金。后双方对上述交易合约进行了延期。宁波科瑞金鼎投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“宁波金鼎”）承担连带保证责任。2020 年 8 月，公司与科瑞天诚签订《补充协议》，并由双方与宁波金鼎等签订《应收账款质押三方协议》。2022 年 1 月，科瑞天诚未按照公司要求提高履约保障比例或提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，请求科瑞天诚向公司支付未偿还本金人民币 180,000 万元及相关利息、违约金、利息滞纳金，宁波金鼎对上述债务承担连带清偿责任等。2022 年 3 月，上海金融法院受理本案。截至目前，本案尚未判决。

（18）公司（代表证券行业支持民企发展之申万宏源 15 号单一资产管理计划）诉明泰汇金资本投资有限公司质押式证券回购合同纠纷系列案

①2019 年 12 月，公司代表证券行业支持民企发展之申万宏源 15 号单一资产管理计划与明泰汇金资本投资有限公司（以下简称“明泰汇金”）签订《股票质押式回购交易业务协议》，其后又签订两份《股票质押式回购交易协议书》，明泰汇金向资产管理计划融入资金。2021 年 3 月，因质押股票被司法冻结，明泰汇金未按公司通知要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司代表资产管理计划向上海金融法院提起诉讼，请求明泰汇金支付未偿还本金人民币 43,000 万元及相关利息、违约金等。

②2017 年 3 月，公司与明泰汇金签订《股票质押式回购交易业务协议》，其后又签订一份《股票质押式回购交易协议书》，明泰汇金向公司融入资金。2021 年 3 月，因质押股票被司法冻结，明泰汇金未按公司通知要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，我司向上海金融法院提起诉讼，请求明泰汇金向公司支付未偿还本金人民币 12,500 万元及相关利息、违约金等。

2022 年 5 月，上海金融法院受理上述案件。截至目前，上述案件尚未判决。

（19）公司诉彭朋、韦越萍质押式证券回购纠纷案

2016 年 8-9 月，公司与彭朋签订了质押式证券回购协议，约定由公司作为融出方，彭朋作为融入方，双方进行股票质押式回购交易。韦越萍作为彭朋的配偶，明确愿意与彭朋共同承担相关融资负债。2018 年 4 月，彭朋未依约履行提升履约保障比例至最低值以上的义务，且未能如期足额支付到期利息，构成违约。2018 年 8 月，公司向上海金融法院起诉彭朋、韦越萍，要求被告支付本金 9,146 万元及相应的利息和违约金。2019 年 7 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉请。后彭朋、韦越萍未履行支付义务，公司向法院申请强制执行。2020 年 7 月，因被告除质押股票外无其他可执行财产，法院裁定终结本次执行程序。截至目前，公司已向法院申请恢复执行。

十一、信息披露事务管理制度变更情况

报告期内，本公司信息披露事务管理制度未发生变更。

第四节 创新债券特别事项

一、发行人为可交换债券发行人

适用 不适用

二、发行人为绿色公司债券发行人

适用 不适用

三、发行人为可续期公司债券发行人

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

债券代码	149529
债券简称	21 申证 Y1
债券余额	20
续期情况	债券于发行人依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在发行人依据发行条款的约定赎回时到期。
利率跳升情况	债券采用浮动利率形式，单利按年计息。债券存续的前 5 个计息年度的票面利率将根据发行时的市场情况及相关规定依法确定，在前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起每 5 年重置一次票面利率。前 5 个计息年度的票面利率为初始基准利率加上初始利差。其中初始基准利率为发行日前 5 个交易日中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值（四舍五入计算到 0.01%），初始利差为票面利率与初始基准利率之间的差值。如果发行人不行使赎回权，此后每 5 年重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。 报告期内无利率跳升情况。
利息递延情况	递延支付利息条款：债券附设发行人延期支付利息权，除非发生债券条款约定的强制付息事件，债券的每个付息日，公司可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于发行人未能按照约定足额支付利息的行为。 报告期内无递延情况。
强制付息情况	强制付息事件：付息日前 12 个月内，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红；（2）减少注册资本。如发生强制付息事件发行人应在 2 个交易日内披露。 2022 年 4 月 13 日公司披露《申万宏源证券有限公司分配现金股利的公告》，本期债券已根据募集说明书有关约定支付利息。
是否仍计入权益及相关会计处理	根据条款，在符合《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会[2017]7 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会[2017]14 号）、《永续债相关会计处理的规定》（财会[2019]2 号）相关要求的前提下，发行人本期债券将分类为权益工具，同时根据债券剩余期限按比例计入公司净资产。若发生导致不再计入权益的事项，发行人应在 2 个交易日内披露。截至报告期末，本期债券仍分类为权益工具。

单位：亿元 币种：人民币

债券代码	149605
债券简称	21 申证 Y2
债券余额	33
续期情况	债券于发行人依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在发行人依据发行条款的约定赎回时到期。
利率跳升情况	债券采用浮动利率形式，单利按年计息。债券存续的前 5 个计息年度的票面利率将根据发行时的市场情况及相关规定依法确定，在前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起每 5 年重置一次票面利率。前 5 个计息年度的票面利率为初始基准利率加上初始利差。其中初始基准利率为发行日前 5 个交易日中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值（四舍五入计算到 0.01%），初始利差为票面利率与初始基准利率之间的差值。如果发行人不行使赎回权，此后每 5 年重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。 报告期内无利率跳升情况。
利息递延情况	递延支付利息条款：债券附设发行人延期支付利息权，除非发生债券条款约定的强制付息事件，债券的每个付息日，公司可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于发行人未能按照约定足额支付利息的行为。 报告期内无递延情况。
强制付息情况	强制付息事件：付息日前 12 个月内，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红；（2）减少注册资本。如发生强制付息事件发行人应在 2 个工作日内披露。 2022 年 4 月 13 日公司披露《申万宏源证券有限公司分配现金股利的公告》，本期债券已根据募集说明书有关约定支付利息。
是否仍计入权益及相关会计处理	根据条款，在符合《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会[2017]7 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会[2017]14 号）、《永续债相关会计处理的规定》（财会[2019]2 号）相关要求的前提下，发行人本期债券将分类为权益工具，同时根据债券剩余期限按比例计入公司净资本。若发生导致不再计入权益的事项，发行人应在 2 个工作日内披露。 截至报告期末，本期债券仍分类为权益工具。

单位：亿元 币种：人民币

债券代码	149700
债券简称	21 申证 Y3
债券余额	47
续期情况	债券于发行人依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在发行人依据发行条款的约定赎回时到期。
利率跳升情况	债券采用浮动利率形式，单利按年计息。债券存续的前 5 个计息年度的票面利率将根据发行时的市场情况及相关规定依法确定，在前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起每 5 年重置一次票面利率。前 5 个计息年度的票面利率为初始基准利率加上初始利差。其中初始基准利率为发行日前 5 个交易日中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值（四舍五入计算到 0.01%），初始利差为票面利率与初始基准利率之间的差值。如果发行人不行使赎回权，此后每 5 年重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。 报告期内无利率跳升情况。

利息递延情况	递延支付利息条款：债券附设发行人延期支付利息权，除非发生债券条款约定的强制付息事件，债券的每个付息日，公司可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于发行人未能按照约定足额支付利息的行为。 报告期内无递延情况。
强制付息情况	强制付息事件：付息日前 12 个月内，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红；（2）减少注册资本。如发生强制付息事件发行人应在 2 个交易日内披露。 2022 年 4 月 13 日公司披露《申万宏源证券有限公司分配现金股利的公告》，本期债券将根据募集说明书有关约定支付利息。
是否仍计入权益及相关会计处理	根据条款，在符合《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会[2017]7 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会[2017]14 号）、《永续债相关会计处理的规定》（财会[2019]2 号）相关要求的前提下，发行人本期债券将分类为权益工具，同时根据债券剩余期限按比例计入公司净资产。若发生导致不再计入权益的事项，发行人应在 2 个交易日内披露。 截至报告期末，本期债券仍分类为权益工具。

单位：亿元 币种：人民币

债券代码	148005
债券简称	22 申证 Y1
债券余额	50
续期情况	本期债券以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期，在每个重定价周期末，公司有权选择将本期债券期限延长 1 个重定价周期（即延长 5 年），或选择在该周期末到期全额兑付本期债券。公司应至少于续期选择权行权年度付息日前 30 个交易日，在相关媒体上刊登续期选择权行使公告。
利率跳升情况	债券采用浮动利率形式，单利按年计息。 在债券存续的前 5 个计息年度的票面利率将根据发行时的市场情况及相关规定依法确定，在前 5 个计息年度内保持不变。自第 6 个计息年度起，每 5 年重置一次票面利率。 前 5 个计息年度的票面利率为初始基准利率加上初始利差。其中初始基准利率为发行日前 5 个工作日中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值(四舍五入计算到 0.01%)，初始利差为票面利率与初始基准利率之间的差值，由公司根据发行时的市场情况确定。 如果公司选择将本期债券延长 1 个重定价周期，则从第 6 个计息年度开始票面利率调整为当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点，在第 6 个计息年度至第 10 个计息年度内保持不变。当期基准利率为每个票面利率重置日前 5 个工作日中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值(四舍五入计算到 0.01%)。此后每 5 年重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。 票面利率公式为：当期票面利率=当期基准利率+初始利差+300BPs 如果未来因宏观经济及政策变化等因素影响导致当期基准利率在利率重置日不可得，票面利率将采用票面利率重置日之前一期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。
利息递延情况	递延支付利息条款：本期债券附设发行人延期支付利息权，除非发生强制付息事件，本期债券的每个付息日，公司可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于公司未能按照约定足

	额支付利息的行为。如公司决定递延支付利息的，应在付息日前 10 个交易日披露《递延支付利息公告》。递延支付的金额将按照当期执行的利率计算复息。在下个利息支付日，若公司继续选择延后支付，则上述递延支付的金额产生的复息将加入已经递延的所有利息及其孳息中继续计算利息。
强制付息情况	强制付息事件：付息日前 12 个月内，若发生以下事件的，公司不得递延支付当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红；（2）减少注册资本。
是否仍计入权益及相关会计处理	根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会[2017]7 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会[2017]14 号）和《关于印发〈永续债相关会计处理的规定〉的通知》（财会〔2019〕2 号），公司将本期债券分类为权益工具。 截至报告期末，本期债券仍分类为权益工具。

单位：亿元 币种：人民币

债券代码	148040
债券简称	22 申证 Y2
债券余额	48
续期情况	本期债券以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期，在每个重定价周期末，公司有权选择将本期债券期限延长 1 个重定价周期（即延长 5 年），或选择在该周期末到期全额兑付本期债券。公司应至少于续期选择权行权年度付息日前 30 个交易日，在相关媒体上刊登续期选择权行使公告。
利率跳升情况	<p>债券采用浮动利率形式，单利按年计息。</p> <p>在债券存续的前 5 个计息年度的票面利率将根据发行时的市场情况及相关规定依法确定，在前 5 个计息年度内保持不变。自第 6 个计息年度起，每 5 年重置一次票面利率。</p> <p>前 5 个计息年度的票面利率为初始基准利率加上初始利差。其中初始基准利率为发行日前 5 个工作日中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值(四舍五入计算到 0.01%)，初始利差为票面利率与初始基准利率之间的差值，由公司根据发行时的市场情况确定。</p> <p>如果公司选择将本期债券延长 1 个重定价周期，则从第 6 个计息年度开始票面利率调整为当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点，在第 6 个计息年度至第 10 个计息年度内保持不变。当期基准利率为每个票面利率重置日前 5 个工作日中国债券信息网(www.chinabond.com.cn)公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债到期收益率算术平均值(四舍五入计算到 0.01%)。此后每 5 年重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。</p> <p>票面利率公式为：当期票面利率=当期基准利率+初始利差+300BPs</p> <p>如果未来因宏观经济及政策变化等因素影响导致当期基准利率在利率重置日不可得，票面利率将采用票面利率重置日之前一期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。</p>
利息递延情况	递延支付利息条款：本期债券附设发行人延期支付利息权，除非发生强制付息事件，本期债券的每个付息日，公司可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于公司未能按照约定足额支付利息的行为。如公司决定递延支付利息的，应在付息日前 10 个交易日披露《递延支付利息公告》。递延支付的金额将按照当期执行的利率计算复息。在下个利息支付日，若公司继续选择延后支付，则上述递延支付的金额产生的复息将加入已经递延的所有利息及其孳息中继续计算利息。
强制付息情况	强制付息事件：付息日前 12 个月内，若发生以下事件的，公司不得递延支

	付当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红； （2）减少注册资本。
是否仍计入权益及相关会计处理	根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会[2017]7 号）、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（财会[2017]14 号）和《关于印发〈永续债相关会计处理的规定〉的通知》（财会〔2019〕2 号），公司将本期债券分类为权益工具。 截至报告期末，本期债券仍分类为权益工具。

四、发行人为扶贫公司债券发行人

适用 不适用

五、发行人为一带一路公司债券发行人

适用 不适用

第五节 向普通投资者披露的信息

适用 不适用

第六节 财务报告

是否模拟报表	否	模拟期	
是否已对外披露	否	已披露报告期	
是否经审计	否	已审计报告期	
是否经审计	标准的无保留意见		

一、财务报表

(一) 合并资产负债表

单位：元

项目	2022年06月30日	2021年12月31日
资产：		
货币资金	116,830,052,059.87	100,625,513,937.42
其中：客户资金存款	85,232,777,896.65	71,750,522,259.05
结算备付金	24,923,200,368.87	25,451,667,252.47
其中：客户备付金	9,349,881,411.84	10,225,584,200.45
贵金属		
拆出资金		
融出资金	67,378,075,125.46	76,296,755,210.91
衍生金融资产	6,035,433,575.39	2,763,446,439.08
存出保证金	25,002,070,978.21	24,134,283,840.87
应收款项	7,882,659,534.76	4,049,604,729.85
应收款项融资		
合同资产		

买入返售金融资产	29,433,728,826.82	25,088,525,075.36
持有待售资产		
金融投资：	294,138,056,349.97	296,040,226,320.28
交易性金融资产	249,914,409,089.34	255,452,340,190.95
债权投资	612,015,860.2	849,679,228.25
其他债权投资	40,604,245,017.5	37,125,399,149.14
其他权益工具投资	3,007,386,382.93	2,612,807,751.94
长期股权投资	1,988,077,303.4	2,058,914,114.89
投资性房地产	34,813,765.32	36,653,406.93
固定资产	654,037,608.1	653,370,375.02
在建工程	203,660,829.17	227,067,332.24
使用权资产	1,018,742,889.58	930,557,913.13
无形资产	227,621,729.56	246,562,967.65
商誉		
递延所得税资产	1,915,389,814.85	1,814,804,012.05
其他资产	1,640,133,804.99	1,316,378,852.22
资产总计	579,305,754,564.32	561,734,331,780.37
负债：		
短期借款	2,758,858,719.39	2,889,474,355.38
应付短期融资款	36,032,626,484.09	29,594,133,198.81
拆入资金	3,337,755,264.73	4,366,724,506.15
交易性金融负债	4,904,911,356.77	6,101,505,942.56
衍生金融负债	7,931,301,953.71	7,251,334,740.25
卖出回购金融资产款	127,520,696,846.28	136,100,964,254.94

代理买卖证券款	106,118,482,191.01	95,195,335,799.11
代理承销证券款	19,909,120	
应付职工薪酬	6,188,016,514.77	5,777,407,347.9
应交税费	858,219,650.9	2,608,437,688.99
应付款项	26,516,383,702.05	16,387,392,592.3
合同负债	17,026,974.48	17,177,196.61
持有待售负债		
预计负债		
长期借款		1,500,719,178.08
应付债券	133,839,773,811.65	135,481,490,239.37
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	1,049,086,770.4	945,270,945.96
递延收益		
递延所得税负债	1,084,560.23	22,718,065.13
其他负债	16,614,050,373.21	12,041,407,767.84
负债合计	473,708,184,293.67	456,281,493,819.38
所有者权益：		
实收资本（或股本）	53,500,000,000	53,500,000,000
其他权益工具	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
其中：优先股		
永续债	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
资本公积	3,273,875,823.46	3,273,875,823.46
减：库存股		

其他综合收益	-758,265,766.13	-637,963,143.61
盈余公积	4,757,269,783.54	4,757,269,783.54
一般风险准备	11,199,498,941.34	11,165,585,974.39
未分配利润	22,069,017,096.15	21,847,352,361.82
归属于母公司所有者权益合计	104,029,211,916.1	103,893,936,837.34
少数股东权益	1,568,358,354.55	1,558,901,123.65
所有者权益合计	105,597,570,270.65	105,452,837,960.99
负债和所有者权益总计	579,305,754,564.32	561,734,331,780.37

法定代表人：杨玉成 主管会计工作负责人：陈秀清 会计机构负责人：吴惠明

（二）母公司资产负债表

单位：元

项目	2022年06月30日	2021年12月31日
资产：		
货币资金	82,126,157,090.62	72,874,967,244.38
其中：客户资金存款	60,399,185,464.26	52,999,300,456.84
结算备付金	26,494,741,287.84	23,066,028,652.07
其中：客户备付金	7,233,134,584.89	9,171,354,919
贵金属		
拆出资金		
融出资金	60,548,950,830.81	68,698,562,789.8
衍生金融资产	5,454,568,820.23	2,273,985,839.19
存出保证金	9,861,933,240.78	9,625,061,277.4
应收款项	2,891,017,344.02	2,199,974,348.57
应收款项融资		

合同资产		
买入返售金融资产	25,918,616,714.37	20,404,098,277.76
持有待售资产		
金融投资：	260,206,185,631.59	263,199,989,065.58
交易性金融资产	221,073,841,540.53	227,732,621,914.44
债权投资	291,649,531.51	312,481,640.9
其他债权投资	36,495,393,903.81	32,542,077,758.3
其他权益工具投资	2,345,300,655.74	2,612,807,751.94
长期股权投资	17,948,371,809.64	18,019,789,081.68
投资性房地产	34,813,765.32	36,653,406.93
固定资产	591,714,829.15	584,309,039.31
在建工程	179,930,061.47	207,826,521.26
使用权资产	760,096,218.19	735,497,011.81
无形资产	206,450,648.88	222,506,417.62
商誉		
递延所得税资产	1,500,300,186.43	1,666,333,159.63
其他资产	2,988,745,663.87	1,827,316,081.48
资产总计	497,712,594,143.21	485,642,898,214.47
负债：		
短期借款		
应付短期融资款	34,684,311,074.93	29,594,133,198.81
拆入资金	3,337,755,264.73	4,366,724,506.15
交易性金融负债	2,899,878,110	1,471,747,260
衍生金融负债	7,589,534,054.94	6,752,040,547.08

卖出回购金融资产款	119,022,060,110.93	127,277,108,159.2
代理买卖证券款	67,858,168,461.37	62,373,081,647.16
代理承销证券款		
应付职工薪酬	5,138,013,526.96	4,808,183,789.75
应交税费	141,930,726.57	1,255,055,219.08
应付款项	25,551,796,000.93	14,287,705,122.1
合同负债		
持有待售负债		
预计负债		
长期借款		1,500,719,178.08
应付债券	128,451,617,378.73	132,276,202,955.93
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	772,981,583.54	736,279,702.11
递延收益		
递延所得税负债		
其他负债	4,386,115,801.08	723,896,596.12
负债合计	399,834,162,094.71	387,422,877,881.57
所有者权益：		
实收资本（或股本）	53,500,000,000	53,500,000,000
其他权益工具	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
其中：优先股		
永续债	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
资本公积	3,023,312,985.09	3,023,312,985.09

减：库存股		
其他综合收益	-653,749,190.96	-448,342,505.98
盈余公积	4,757,269,783.54	4,757,269,783.54
一般风险准备	9,440,008,491.15	9,427,870,443.63
未分配利润	17,823,773,941.94	17,972,093,588.88
所有者权益合计	97,878,432,048.5	98,220,020,332.9
负债和所有者权益总计	497,712,594,143.21	485,642,898,214.47

（三）合并利润表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入	9,644,141,550.53	11,069,588,288.31
利息净收入	284,929,927.19	1,238,052,062.65
利息收入	4,718,554,499.95	5,338,892,383.72
利息支出	-4,433,624,572.76	-4,100,840,321.07
手续费及佣金净收入	4,172,227,023.38	4,048,311,058.66
其中：经纪业务手续费净收入	2,662,546,391.63	2,732,697,150.70
投资银行业务手续费净收入	821,336,375.86	713,974,378.01
资产管理及基金管理业务手续费净收入	632,848,137.85	583,501,574.81
投资收益（损失以“-”列示）	75,354,466.73	4,629,930,813.57
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	313,336,533.04	345,092,554.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）	-19,341,172.21	
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）		
其他收益	237,525,333.88	43,468,047.09
公允价值变动收益（损失以“-”列示）	4,106,808,088.57	-181,169,852.57

汇兑收益（损失以“-”列示）	-21,640,768.48	88,656.83
其他业务收入	788,120,469.1	1,288,876,880.59
资产处置收益（损失以“-”号填列）	817,010.16	2,030,621.49
二、营业总支出	5,562,461,074.69	5,845,060,946.01
税金及附加	67,039,796.15	75,182,569.88
业务及管理费	4,043,225,289.67	4,295,612,820.3
资产减值损失		
信用减值损失	684,905,511.14	225,362,215.55
其他资产减值损失	18,744,167.68	-3,054,832.57
其他业务成本	748,546,310.05	1,251,958,172.85
三、营业利润（亏损以“-”列示）	4,081,680,475.84	5,224,527,342.3
加：营业外收入	3,195,470.16	6,265,731.91
减：营业外支出	51,469,411.48	40,534,275.46
四、利润总额（亏损总额以“-”列示）	4,033,406,534.52	5,190,258,798.75
减：所得税费用	413,599,794.73	738,424,741.76
五、净利润（净亏损以“-”列示）	3,619,806,739.79	4,451,834,056.99
（一）按经营持续性分类		
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	3,619,806,739.79	4,451,834,056.99
2.终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）		
（二）按所有权归属分类		
1.归属于母公司所有者（或股东）的净利润	3,625,533,718.05	4,406,331,421.28
2.少数股东损益	-5,726,978.26	45,502,635.71
六、其他综合收益的税后净额	-131,524,019.17	-226,372,911.61
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	-146,708,228.33	-212,253,397.2

（一）不能重分类进损益的其他综合收益	-214,775,589.37	-342,653,196.77
1.重新计量设定受益计划变动额		
2.权益法下不能转损益的其他综合收益		
3.其他权益工具投资公允价值变动	-214,775,589.37	-342,653,196.77
4.企业自身信用风险公允价值变动		
5.其他		
（二）将重分类进损益的其他综合收益	68,067,361.04	130,399,799.57
1.权益法下可转损益的其他综合收益	4,365,114.58	-696,896.41
2.其他债权投资公允价值变动	-139,652,557.46	1,514,590.07
3.金融资产重分类计入其他综合收益的金 额		
4.其他债权投资信用损失准备	30,385,774.48	147,281,377.8
5.现金流量套期储备		
6.外币财务报表折算差额	172,969,029.44	-17,699,271.89
7.其他		
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	15,184,209.16	-14,119,514.41
七、综合收益总额	3,488,282,720.62	4,225,461,145.38
其中：归属于母公司所有者（或股东）的综合收 益总额	3,478,825,489.72	4,194,078,024.08
归属于少数股东的综合收益总额	9,457,230.9	31,383,121.3
八、每股收益：	--	--
（一）基本每股收益	0.06	0.08
（二）稀释每股收益	0.06	0.08

法定代表人：杨玉成

主管会计工作负责人：陈秀清

会计机构负责人：吴惠明

(四) 母公司利润表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入	6,691,060,096.34	7,775,123,592.25
利息净收入	-180,219,928.89	649,529,487.76
利息收入	3,962,738,759.69	4,514,085,556.88
利息支出	-4,142,958,688.58	-3,864,556,069.12
手续费及佣金净收入	2,907,054,816.71	3,046,314,973.42
其中：经纪业务手续费净收入	2,098,340,595.57	2,147,494,407.21
投资银行业务手续费净收入	355,512,485.05	358,511,648.32
资产管理业务手续费净收入	425,394,726.32	525,628,235.4
投资收益（损失以“-”列示）	161,520,902.17	3,987,359,147.79
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	313,067,613.38	344,534,427.58
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）		
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）		
其他收益	187,036,212.4	23,398,637.25
公允价值变动收益（损失以“-”列示）	3,589,309,078.18	42,733,525.08
汇兑收益（损失以“-”列示）	9,530,056.01	-1,834,781.3
其他业务收入	16,294,258.32	25,591,980.76
资产处置收益（损失以“-”号填列）	534,701.44	2,030,621.49
二、营业总支出	3,163,542,850.15	3,562,369,902.1
税金及附加	53,432,691.17	63,217,395.19
业务及管理费	2,945,504,015.94	3,274,322,587.02
资产减值损失		

信用减值损失	162,609,399.84	222,575,317.46
其他资产减值损失		
其他业务成本	1,996,743.2	2,254,602.43
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	3,527,517,246.19	4,212,753,690.15
加：营业外收入	2,855,657.34	6,147,120.01
减：营业外支出	50,969,614.48	38,865,415.36
四、利润总额（亏损以“-”号填列）	3,479,403,289.05	4,180,035,394.8
减：所得税费用	245,628,871.7	527,631,894.17
五、净利润（亏损以“-”号填列）	3,233,774,417.35	3,652,403,500.63
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	3,233,774,417.35	3,652,403,500.63
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）		
六、其他综合收益的税后净额	-231,812,290.79	-193,517,215.96
（一）不能重分类进损益的其他综合收益	-200,488,394.29	-342,653,196.77
1.重新计量设定受益计划变动额		
2.权益法下不能转损益的其他综合收益		
3.其他权益工具投资公允价值变动	-200,488,394.29	-342,653,196.77
4.企业自身信用风险公允价值变动		
5.其他		
（二）将重分类进损益的其他综合收益	-31,323,896.5	149,135,980.81
1.权益法下可转损益的其他综合收益	4,365,114.58	-696,896.41
2.其他债权投资公允价值变动	-48,343,166.47	6,042,778.18
3.金融资产重分类计入其他综合收益的金 额		
4.其他债权投资信用损失准备	12,654,155.39	143,790,099.04

5.现金流量套期储备		
6.外币财务报表折算差额		
7.其他		
七、综合收益总额	3,001,962,126.56	3,458,886,284.67
八、每股收益：		
（一）基本每股收益	0.05	0.07
（二）稀释每股收益	0.05	0.07

（五）合并现金流量表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、经营活动产生的现金流量：		
销售商品、提供劳务收到的现金		
为交易目的而持有的金融工具净减少额	12,126,326,860.01	
向其他金融机构拆入资金净增加额		
收取利息、手续费及佣金的现金	11,665,749,846.12	11,832,885,404.55
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额		18,670,292,311.04
代理买卖证券收到的现金净额	9,341,626,834.96	
融出资金净减少额	9,157,546,929.35	
收到其他与经营活动有关的现金	1,628,287,608.54	1,596,158,363.58
经营活动现金流入小计	43,919,538,078.98	32,099,336,079.17
为交易目的而持有的金融资产净增加额		38,145,811,040.06
拆出资金净增加额		
代理买卖证券支出的现金净额		1,252,275,487.98

回购业务资金净减少额	7,147,934,387.15	
拆入资金净减少额	1,026,775,020.00	550,409,940.00
融出资金净增加额		5,473,169,207.93
返售业务资金净增加额		
支付利息、手续费及佣金的现金	2,502,720,414.15	2,440,031,648.22
支付给职工及为职工支付的现金	2,789,744,803.12	2,174,533,038.26
支付的各项税费	2,044,278,881.23	2,506,847,687.34
支付其他与经营活动有关的现金	3,431,954,186.69	6,505,893,537.50
经营活动现金流出小计	18,943,407,692.34	59,048,971,587.29
经营活动产生的现金流量净额	24,976,130,386.64	-26,949,635,508.12
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资所收到的现金		30,612,214,135.98
取得投资收益收到的现金	580,777,681.47	2,367,613,961.19
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	2,100,424.54	2,821,391.07
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		
收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计	582,878,106.01	32,982,649,488.24
投资支付的现金	6,339,043,925.10	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	102,963,864.76	130,509,300.55
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计	6,442,007,789.86	130,509,300.55
投资活动产生的现金流量净额	-5,859,129,683.85	32,852,140,187.69
三、筹资活动产生的现金流量：		

吸收投资收到的现金		8,500,000,000
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		
取得借款收到的现金	2,345,201,489.52	8,753,105,741.44
发行债券收到的现金	60,173,103,938.46	54,294,808,048
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计	62,518,305,427.98	71,547,913,789.44
偿还债务支付的现金	59,202,518,563.57	62,809,559,675.28
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,765,369,202.58	5,617,242,352.44
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		12,848,262.36
支付其他与筹资活动有关的现金		
支付租赁负债的现金	207,135,180.39	200,074,934.28
筹资活动现金流出小计	62,175,022,946.54	68,626,876,962.00
筹资活动产生的现金流量净额	343,282,481.44	2,921,036,827.44
四、汇率变动对现金的影响	-21,640,768.48	88,656.83
五、现金及现金等价物净增加额	19,438,642,415.75	8,823,630,163.84
加：期初现金及现金等价物余额	141,498,572,603.76	118,596,534,563.88
六、期末现金及现金等价物余额	160,937,215,019.51	127,420,164,727.72

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、经营活动产生的现金流量：		
销售商品、提供劳务收到的现金		
为交易目的而持有的金融工具净减少额	16,954,350,771.59	
融出资金净减少额	8,388,589,423.50	

向其他金融机构拆入资金净增加额		
收取利息、手续费及佣金的现金	9,279,205,092.59	8,999,031,069.62
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额		17,602,529,180.46
代理买卖证券收到的现金净额	5,424,983,619.16	
收到其他与经营活动有关的现金	203,388,526.82	706,938,263.17
经营活动现金流入小计	40,250,517,433.66	27,308,498,513.25
为交易目的而持有的金融资产净增加额		37,999,599,485.86
代理买卖证券支出的现金净额		4,992,807,888.39
回购业务资金净减少额	7,689,295,925.91	
拆入资金净减少额	1,026,775,020.00	550,409,940
融出资金净增加额		1,556,300,500.26
拆出资金净增加额		
返售业务资金净增加额		
支付利息、手续费及佣金的现金	2,222,906,955.35	2,140,734,533.24
支付给职工及为职工支付的现金	1,854,878,113.77	1,376,016,716.95
支付的各项税费	1,573,023,148.97	1,896,886,120.3
支付其他与经营活动有关的现金	939,081,619.09	2,419,467,903.82
经营活动现金流出小计	15,305,960,783.09	52,932,223,088.82
经营活动产生的现金流量净额	24,944,556,650.57	-25,623,724,575.57
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资所收到的现金		30,375,795,995.16
取得投资收益收到的现金	753,501,147.97	2,308,251,136.41
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	1,720,023.42	2,229,841.97

收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计	755,221,171.39	32,686,276,973.54
投资支付的现金	4,006,943,720.00	2,500,000,000
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金	89,551,900.61	93,871,921.92
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计	4,096,495,620.61	2,593,871,921.92
投资活动产生的现金流量净额	-3,341,274,449.22	30,092,405,051.62
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金		8,500,000,000.00
取得借款收到的现金		1,500,000,000.00
发行债券收到的现金	56,634,865,403.75	54,294,808,048.00
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计	56,634,865,403.75	64,294,808,048.00
偿还债务支付的现金	56,693,633,056.20	59,214,138,338.33
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,730,183,794.52	5,579,704,751.16
支付租赁负债的现金	150,065,162.29	152,954,798.48
支付其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流出小计	59,573,882,013.01	64,946,797,887.97
筹资活动产生的现金流量净额	-2,939,016,609.26	-651,989,839.97
四、汇率变动对现金的影响	9,530,056.01	-1,834,781.3
五、现金及现金等价物净增加额	18,673,795,648.1	3,814,855,854.78
加：期初现金及现金等价物余额	110,312,479,510.03	92,316,550,287.47
六、期末现金及现金等价物余额	128,986,275,158.13	96,131,406,142.25

第七节 发行人认为应当披露的其他事项

适用 不适用

第八节 备查文件

备查文件目录

序号	文件名称
1	载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表
2	载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件（如有）
3	报告期内在中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿
4	按照境内外其他监管机构、交易场所等的要求公开披露的半年度报告、半年度财务信息

备查文件查阅

备查文件置备地点	上海市
具体地址	上海市徐汇区常熟路 171 号
查阅网站	http://www.szse.cn/ 及 http://www.sse.com.cn/

(本页无正文，为《申万宏源证券有限公司公司债券半年度报告（2022 年）》盖章页)



合并资产负债表

2022年6月30日

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
资产：		
货币资金	116,830,052,059.87	100,625,513,937.42
其中：客户资金	85,232,777,896.65	71,750,522,259.05
结算备付金	24,923,200,368.87	25,451,667,252.47
其中：客户备付金	9,349,881,411.84	10,225,584,200.45
融出资金	67,378,075,125.46	76,296,755,210.91
衍生金融资产	6,035,433,575.39	2,763,446,439.08
存出保证金	25,002,070,978.21	24,134,283,840.87
应收款项	7,882,659,534.76	4,049,604,729.85
买入返售金融资产	29,433,728,826.82	25,088,525,075.36
金融投资		
交易性金融资产	249,914,409,089.34	255,452,340,190.95
债权投资	612,015,860.20	849,679,228.25
其他债权投资	40,604,245,017.50	37,125,399,149.14
其他权益工具投资	3,007,386,382.93	2,612,807,751.94
长期股权投资	1,988,077,303.40	2,058,914,114.89
投资性房地产	34,813,765.32	36,653,406.93
固定资产	654,037,608.10	653,370,375.02
在建工程	203,660,829.17	227,067,332.24
使用权资产	1,018,742,889.58	930,557,913.13
无形资产	227,621,729.56	246,562,967.65
递延所得税资产	1,915,389,814.85	1,814,804,012.05
其他资产	1,640,133,804.99	1,316,378,852.22
资产合计	579,305,754,564.32	561,734,331,780.37
负债：		
短期借款	2,758,858,719.39	2,889,474,355.38
应付短期融资款	36,032,626,484.09	29,594,133,198.81
拆入资金	3,337,755,264.73	4,366,724,506.15
交易性金融负债	4,904,911,356.77	6,101,505,942.56
衍生金融负债	7,931,301,953.71	7,251,334,740.25
卖出回购金融资产款	127,520,696,846.28	136,100,964,254.94
代理买卖证券款	106,118,482,191.01	95,195,335,799.11
代理承销证券款	19,909,120.00	-
应付职工薪酬	6,188,016,514.77	5,777,407,347.90
应交税费	858,219,650.90	2,608,437,688.99
应付款项	26,516,383,702.05	16,387,392,592.30

长期借款	-	1,500,719,178.08
应付债券	133,839,773,811.65	135,481,490,239.37
递延所得税负债	1,084,560.23	22,718,065.13
合同负债	17,026,974.48	17,177,196.61
租赁负债	1,049,086,770.40	945,270,945.96
其他负债	16,614,050,373.21	12,041,407,767.84
负债合计	473,708,184,293.67	456,281,493,819.38
所有者权益：		
实收资本	53,500,000,000.00	53,500,000,000.00
其他权益工具	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
其中：永续债	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
资本公积	3,273,875,823.46	3,273,875,823.46
其他综合收益	(758,265,766.13)	(637,963,143.61)
盈余公积	4,757,269,783.54	4,757,269,783.54
一般风险准备	11,199,498,941.34	11,165,585,974.39
未分配利润	22,069,017,096.15	21,847,352,361.82
归属于母公司股东权益合计	104,029,211,916.10	103,893,936,837.34
少数股东权益	1,568,358,354.55	1,558,901,123.65
所有者权益合计	105,597,570,270.65	105,452,837,960.99
负债和所有者权益总计	579,305,754,564.32	561,734,331,780.37

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



母公司资产负债表

2022年6月30日

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
资产：		
货币资金	82,126,157,090.62	72,874,967,244.38
其中：客户资金	60,399,185,464.26	52,999,300,456.84
结算备付金	26,494,741,287.84	23,066,028,652.07
其中：客户备付金	7,233,134,584.89	9,171,354,919.00
融出资金	60,548,950,830.81	68,698,562,789.80
衍生金融资产	5,454,568,820.23	2,273,985,839.19
存出保证金	9,861,933,240.78	9,625,061,277.40
应收款项	2,891,017,344.02	2,199,974,348.57
买入返售金融资产	25,918,616,714.37	20,404,098,277.76
金融投资		
交易性金融资产	221,073,841,540.53	227,732,621,914.44
债权投资	291,649,531.51	312,481,640.90
其他债权投资	36,495,393,903.81	32,542,077,758.30
其他权益工具投资	2,345,300,655.74	2,612,807,751.94
长期股权投资	17,948,371,809.64	18,019,789,081.68
投资性房地产	34,813,765.32	36,653,406.93
固定资产	591,714,829.15	584,309,039.31
在建工程	179,930,061.47	207,826,521.26
使用权资产	760,096,218.19	735,497,011.81
无形资产	206,450,648.88	222,506,417.62
递延所得税资产	1,500,300,186.43	1,666,333,159.63
其他资产	2,988,745,663.87	1,827,316,081.48
资产合计	497,712,594,143.21	485,642,898,214.47
负债：		
应付短期融资款	34,684,311,074.93	29,594,133,198.81
拆入资金	3,337,755,264.73	4,366,724,506.15
交易性交融负债	2,899,878,110.00	1,471,747,260.00
衍生金融负债	7,589,534,054.94	6,752,040,547.08
卖出回购金融资产款	119,022,060,110.93	127,277,108,159.20
代理买卖证券款	67,858,168,461.37	62,373,081,647.16
应付职工薪酬	5,138,013,526.96	4,808,183,789.75
应交税费	141,930,726.57	1,255,055,219.08
应付款项	25,551,796,000.93	14,287,705,122.10
长期借款	-	1,500,719,178.08
应付债券	128,451,617,378.73	132,276,202,955.93

租赁负债	772,981,583.54	736,279,702.11
其他负债	4,386,115,801.08	723,896,596.12
负债合计	399,834,162,094.71	387,422,877,881.57
所有者权益：		
实收资本	53,500,000,000.00	53,500,000,000.00
其他权益工具	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
其中：永续债	9,987,816,037.74	9,987,816,037.74
资本公积	3,023,312,985.09	3,023,312,985.09
其他综合收益	(653,749,190.96)	(448,342,505.98)
盈余公积	4,757,269,783.54	4,757,269,783.54
一般风险准备	9,440,008,491.15	9,427,870,443.63
未分配利润	17,823,773,941.94	17,972,093,588.88
所有者权益合计	97,878,432,048.50	98,220,020,332.90
负债和所有者权益总计	497,712,594,143.21	485,642,898,214.47

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



合并利润表

2022年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2022年1-6月	2021年1-6月
一、营业收入	9,644,141,550.53	11,069,588,288.31
手续费及佣金净收入	4,172,227,023.38	4,048,311,058.66
其中：经纪业务手续费净收入	2,662,546,391.63	2,732,697,150.70
投资银行业务手续费净收入	821,336,375.86	713,974,378.01
资产管理业务及基金管理业务 手续费净收入	632,848,137.85	583,501,574.81
利息净收入	284,929,927.19	1,238,052,062.65
其中：利息收入	4,718,554,499.95	5,338,892,383.72
利息支出	(4,433,624,572.76)	(4,100,840,321.07)
投资收益	75,354,466.73	4,629,930,813.57
其中：对联营企业和合营企业的投资 收益	313,336,533.04	345,092,554.89
以摊余成本计量的金融资产终 止确认收益	(19,341,172.21)	-
其他收益	237,525,333.88	43,468,047.09
公允价值变动收益/(损失)	4,106,808,088.57	(181,169,852.57)
汇兑收益(损失)/收益	(21,640,768.48)	88,656.83
其他业务收入	788,120,469.10	1,288,876,880.59
资产处置收益	817,010.16	2,030,621.49
二、营业支出	5,562,461,074.69	5,845,060,946.01
税金及附加	67,039,796.15	75,182,569.88
业务及管理费	4,043,225,289.67	4,295,612,820.30
信用减值损失	684,905,511.14	225,362,215.55
其他减值损失	18,744,167.68	(3,054,832.57)
其他业务成本	748,546,310.05	1,251,958,172.85
三、营业利润	4,081,680,475.84	5,224,527,342.30
加：营业外收入	3,195,470.16	6,265,731.91
减：营业外支出	51,469,411.48	40,534,275.46
四、利润总额	4,033,406,534.52	5,190,258,798.75
减：所得税费用	413,599,794.73	738,424,741.76
五、净利润	3,619,806,739.79	4,451,834,056.99
(一) 按经营持续性分类：		
1. 持续经营净利润	3,619,806,739.79	4,451,834,056.99
2. 终止经营净利润		
(二) 按所有权归属分类：		
1. 归属于母公司股东的净利润	3,625,533,718.05	4,406,331,421.28

2. 少数股东损益	(5,726,978.26)	45,502,635.71
六、其他综合收益的税后净额	(131,524,019.17)	(226,372,911.61)
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额	(146,708,228.33)	(212,253,397.20)
(一)不能重分类进损益的其他综合收益		
1. 其他权益工具投资公允价值变动	(214,775,589.37)	(342,653,196.77)
(二)将重分类进损益的其他综合收益		
1. 权益法下可转损益的其他综合收益	4,365,114.58	(696,896.41)
2. 其他债权投资公允价值变动	(139,652,557.46)	1,514,590.07
3. 其他债权投资信用减值准备	30,385,774.48	147,281,377.80
4. 外币财务报表折算差额	172,969,029.44	(17,699,271.89)
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	15,184,209.16	(14,119,514.41)
七、综合收益总额	3,488,282,720.62	4,225,461,145.38
归属于母公司股东的综合收益总额	3,478,825,489.72	4,194,078,024.08
归属于少数股东的综合收益总额	9,457,230.90	31,383,121.30

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



母公司利润表

2022年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2022年1-6月	2021年1-6月
一、营业收入	6,691,060,096.34	7,775,123,592.25
手续费及佣金净收入	2,907,054,816.71	3,046,314,973.42
其中：经纪业务手续费净收入	2,098,340,595.57	2,147,494,407.21
投资银行业务手续费净收入	355,512,485.05	358,511,648.32
资产管理业务及基金管理业务 手续费净收入	425,394,726.32	525,628,235.40
利息净(支出)/收入	(180,219,928.89)	649,529,487.76
其中：利息收入	3,962,738,759.69	4,514,085,556.88
利息支出	(4,142,958,688.58)	(3,864,556,069.12)
投资收益	161,520,902.17	3,987,359,147.79
其中：对联营企业和合营企业的投资 收益	313,067,613.38	344,534,427.58
其他收益	187,036,212.40	23,398,637.25
公允价值变动收益	3,589,309,078.18	42,733,525.08
汇兑收益/(损失)	9,530,056.01	(1,834,781.30)
其他业务收入	16,294,258.32	25,591,980.76
资产处置收益	534,701.44	2,030,621.49
二、营业支出	3,163,542,850.15	3,562,369,902.10
税金及附加	53,432,691.17	63,217,395.19
业务及管理费	2,945,504,015.94	3,274,322,587.02
信用减值损失	162,609,399.84	222,575,317.46
其他业务成本	1,996,743.20	2,254,602.43
三、营业利润	3,527,517,246.19	4,212,753,690.15
加：营业外收入	2,855,657.34	6,147,120.01
减：营业外支出	50,969,614.48	38,865,415.36
四、利润总额	3,479,403,289.05	4,180,035,394.80
减：所得税费用	245,628,871.70	527,631,894.17
五、净利润	3,233,774,417.35	3,652,403,500.63
(一)持续经营净利润	3,233,774,417.35	3,652,403,500.63
(二)终止经营净利润		
六、其他综合收益的税后净额	(231,812,290.79)	(193,517,215.96)
(一)不能重分类进损益的其他综合收 益		
1. 其他权益工具投资公允价值变动	(200,488,394.29)	(342,653,196.77)
(二)将重分类进损益的其他综合收益		
1. 权益法下可转损益的其他综合收	4,365,114.58	(696,896.41)

益		
2. 其他债权投资公允价值变动	(48,343,166.47)	6,042,778.18
3. 其他债权投资信用减值准备	12,654,155.39	143,790,099.04
七、综合收益总额	3,001,962,126.56	3,458,886,284.67

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



合并现金流量表

2022年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2022年1-6月	2021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	12,126,326,860.01	
收取利息、手续费及佣金的现金	11,665,749,846.12	11,832,885,404.55
回购业务资金净增加额	-	18,670,292,311.04
代理买卖证券收到的现金净额	9,341,626,834.96	-
融出资金净减少额	9,157,546,929.35	-
收到其他与经营活动有关的现金	1,628,287,608.54	1,596,158,363.58
经营活动现金流入小计	43,919,538,078.98	32,099,336,079.17
为交易目的而持有的金融工具净增加额	-	38,145,811,040.06
融出资金净增加额	-	5,473,169,207.93
代理买卖证券支出的现金净额	-	1,252,275,487.98
回购业务资金净减少额	7,147,934,387.15	-
拆入资金净减少额	1,026,775,020.00	550,409,940.00
支付利息、手续费及佣金的现金	2,502,720,414.15	2,440,031,648.22
支付给职工以及为职工支付的现金	2,789,744,803.12	2,174,533,038.26
支付的各项税费	2,044,278,881.23	2,506,847,687.34
支付其他与经营活动有关的现金	3,431,954,186.69	6,505,893,537.50
经营活动现金流出小计	18,943,407,692.34	59,048,971,587.29
经营活动产生的现金流量净额	24,976,130,386.64	(26,949,635,508.12)
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资收到的现金	-	30,612,214,135.98
取得投资收益收到的现金	580,777,681.47	2,367,613,961.19
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额	2,100,424.54	2,821,391.07
投资活动现金流入小计	582,878,106.01	32,982,649,488.24
投资支付的现金	6,339,043,925.10	-
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	102,963,864.76	130,509,300.55
投资活动现金流出小计	6,442,007,789.86	130,509,300.55
投资活动产生的现金流量净额	(5,859,129,683.85)	32,852,140,187.69
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金	-	8,500,000,000.00
取得借款收到的现金	2,345,201,489.52	8,753,105,741.44
发行债券收到的现金	60,173,103,938.46	54,294,808,048.00
筹资活动现金流入小计	62,518,305,427.98	71,547,913,789.44
偿还债务支付的现金	59,202,518,563.57	62,809,559,675.28

分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,765,369,202.58	5,617,242,352.44
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润	-	12,848,262.36
支付租赁负债的现金	207,135,180.39	200,074,934.28
筹资活动现金流出小计	62,175,022,946.54	68,626,876,962.00
筹资活动产生的现金流量净额	343,282,481.44	2,921,036,827.44
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	(21,640,768.48)	88,656.83
五、现金及现金等价物净增加额	19,438,642,415.75	8,823,630,163.84
加：期初现金及现金等价物余额	141,498,572,603.76	118,596,534,563.88
六、期末现金及现金等价物余额	160,937,215,019.51	127,420,164,727.72

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：





母公司现金流量表

2022年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2022年1-6月	2021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	16,954,350,771.59	-
收取利息、手续费及佣金的现金	9,279,205,092.59	8,999,031,069.62
回购业务资金净增加额	-	17,602,529,180.46
代理买卖证券收到的现金净额	5,424,983,619.16	-
融出资金净减少额	8,388,589,423.50	-
收到其他与经营活动有关的现金	203,388,526.82	706,938,263.17
经营活动现金流入小计	40,250,517,433.66	27,308,498,513.25
为交易目的而持有的金融工具净增加额	-	37,999,599,485.86
融出资金净增加额	-	1,556,300,500.26
代理买卖证券支出的现金净额	-	4,992,807,888.39
回购业务资金净减少额	7,689,295,925.91	-
拆入资金净减少额	1,026,775,020.00	550,409,940.00
支付利息、手续费及佣金的现金	2,222,906,955.35	2,140,734,533.24
支付给职工以及为职工支付的现金	1,854,878,113.77	1,376,016,716.95
支付的各项税费	1,573,023,148.97	1,896,886,120.30
支付其他与经营活动有关的现金	939,081,619.09	2,419,467,903.82
经营活动现金流出小计	15,305,960,783.09	52,932,223,088.82
经营活动产生的现金流量净额	24,944,556,650.57	(25,623,724,575.57)
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资收到的现金	-	30,375,795,995.16
取得投资收益收到的现金	753,501,147.97	2,308,251,136.41
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额	1,720,023.42	2,229,841.97
投资活动现金流入小计	755,221,171.39	32,686,276,973.54
投资支付的现金	4,006,943,720.00	2,500,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	89,551,900.61	93,871,921.92
投资活动现金流出小计	4,096,495,620.61	2,593,871,921.92
投资活动产生的现金流量净额	(3,341,274,449.22)	30,092,405,051.62
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金	-	8,500,000,000.00
取得借款收到的现金	-	1,500,000,000.00
发行债券收到的现金	56,634,865,403.75	54,294,808,048.00
筹资活动现金流入小计	56,634,865,403.75	64,294,808,048.00
偿还债务支付的现金	56,693,633,056.20	59,214,138,338.33

分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,730,183,794.52	5,579,704,751.16
支付租赁负债的现金	150,065,162.29	152,954,798.48
筹资活动现金流出小计	59,573,882,013.01	64,946,797,887.97
筹资活动产生的现金流量净额	(2,939,016,609.26)	(651,989,839.97)
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	9,530,056.01	(1,834,781.30)
五、现金及现金等价物净增加额	18,673,795,648.10	3,814,855,854.78
加：期初现金及现金等价物余额	110,312,479,510.03	92,316,550,287.47
六、期末现金及现金等价物余额	128,986,275,158.13	96,131,406,142.25

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



申万宏源证券有限公司 2022 年半年度

合并财务报表重要项目的说明

以下注释项目除特别注明外，金额单位为人民币元。

1 货币资金

(1) 按币种列示

	2022 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
现金			
人民币	4,521.96	1.00000	4,521.96
美元	71.45	6.71140	479.53
港币	77,898.80	0.85519	66,618.28
小计			<u>71,619.77</u>
银行存款			
自有资金			
人民币	29,809,867,378.85	1.00000	29,809,867,378.85
美元	69,966,943.65	6.71140	469,576,145.63
港币	1,221,160,547.76	0.85519	1,044,324,288.84
其他币种			108,586,487.54
小计			<u>31,432,354,300.86</u>
客户资金			
人民币	78,645,292,767.96	1.00000	78,645,292,767.96
美元	440,250,690.83	6.71140	2,954,698,486.47
港币	4,215,725,187.47	0.85519	3,605,246,023.08
其他币种			27,540,619.14
小计			<u>85,232,777,896.65</u>
银行存款合计			<u>116,665,132,197.51</u>
其他货币资金			
人民币	166,240,954.15	1.00000	<u>166,240,954.15</u>
小计			116,831,444,771.43
减：减值准备			<u>(1,392,711.56)</u>
合计			<u>116,830,052,059.87</u>

申万宏源证券
骑缝章

其中，融资融券业务

	2022年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
客户信用资金			
人民币	9,462,169,599.76	1.00000	9,462,169,599.76
美元	117,933,211.62	6.71140	791,496,956.50
港币	4,019,699,572.02	0.85519	3,437,606,877.00
其他币种			27,540,619.14
小计			13,718,814,052.40
合计			13,718,814,052.40

(2) 受限制的货币资金

2022年6月30日	
一般风险准备	703,298,705.16
在途投资款	13,512,100.00
合计	716,810,805.16

2 结算备付金

	2022年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
公司备付金			
公司自有备付金			
人民币	15,511,179,069.16	1.00000	15,511,179,069.16
美元	6,539,225.28	6.71140	43,887,356.54
港币	14,366,494.90	0.85519	12,286,082.77
小计			15,567,352,508.47
公司信用备付金			
人民币	5,966,448.56	1.00000	5,966,448.56
公司备付金合计			15,573,318,957.03
客户备付金			
客户普通备付金			
人民币	6,154,734,061.36	1.00000	6,154,734,061.36
美元	48,656,676.13	6.71140	326,554,416.19
港币	237,614,206.01	0.85519	203,205,292.83
小计			6,684,493,770.38
客户信用备付金			
人民币	2,665,387,641.46	1.00000	2,665,387,641.46

小计	2,665,387,641.46
客户备付金合计	9,349,881,411.84
合计	24,923,200,368.87

3 融出资金

(1) 按客户类别列示

2022年6月30日

境内	
其中：个人	58,492,560,358.77
机构	7,721,523,380.93
小计	66,214,083,739.70
减：减值准备	(365,972,236.47)
账面价值小计	65,848,111,503.23
境外	
其中：个人	908,888,458.81
机构	621,075,163.42
小计	1,529,963,622.23
减：减值准备	-
账面价值小计	1,529,963,622.23
账面价值合计	67,378,075,125.46

(2) 融资融券业务担保物公允价值

2022年6月30日

股票	199,004,627,954.22
资金	9,652,707,729.15
基金	7,907,565,441.52
债券	358,225,317.84
合计	216,923,126,442.73

4 衍生金融资产和衍生金融负债

	2022年6月30日		
	名义金额	非套期工具	
		资产	负债
权益衍生工具	227,773,445,598.57	5,219,461,674.21	(7,039,795,410.12)
利率衍生工具	300,018,086,372.30	623,872,539.09	(693,695,428.16)
商品衍生工具	67,826,755,064.54	177,940,191.45	(195,916,024.17)
信用衍生工具	4,291,000,000.00	14,159,170.64	(1,895,091.26)
合计	<u>599,909,287,035.41</u>	<u>6,035,433,575.39</u>	<u>(7,931,301,953.71)</u>

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、股指期货、贵金属期货、黄金延期和其他商品期货产生的公允价值变动金额，而并未反映在上述衍生金融工具科目中。于2022年6月30日，本集团未到期的上述衍生金融工具合约的公允价值为人民币804,781,256.00元。

5 存出保证金

	2022年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
交易保证金			
人民币	20,276,188,942.15	1.00000	20,276,188,942.15
美元	540,000.00	6.71140	3,624,156.00
港币	23,694,505.47	0.85519	20,263,304.13
小计			<u>20,300,076,402.28</u>
信用保证金			
人民币	78,123,418.02	1.00000	<u>78,123,418.02</u>
履约保证金			
人民币	3,585,505,443.51	1.00000	3,585,505,443.51
美元	8,966,870.68	6.71140	60,180,255.88
港币	124,867,448.34	0.85519	106,785,393.15
小计			<u>3,752,471,092.54</u>
转融通保证金			
人民币	871,400,065.37	1.00000	<u>871,400,065.37</u>
合计			<u>25,002,070,978.21</u>

6 应收款项

(1) 按类别列示

2022年6月30日

应收清算款项	6,127,115,835.42
应收资管业务款	1,488,759,447.58
应收手续费及佣金	730,466,850.92
其他	151,111,314.92
小计	8,497,453,448.84
减：坏账准备	(614,793,914.08)
合计	7,882,659,534.76

(2) 按账龄分析

2022年6月30日

	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1年以内	6,999,553,054.22	82.38	(64,381,444.40)	0.92
1-2年	100,580,941.80	1.18	(18,669,383.85)	18.56
2-3年	1,181,226,018.66	13.90	(486,395,877.09)	41.18
3年以上	216,093,434.16	2.54	(45,347,208.74)	20.99
合计	8,497,453,448.84	100.00	(614,793,914.08)	7.24

适用于《企业会计准则第14号—收入》产生的应收款项，本集团运用预期信用损失简化模型计量其减值准备，本集团采用预期信用损失一般模型计量其余应收款项减值准备。于2022年6月30日，除部分应收资管业务款处于信用减值第三阶段外，其余适用预期信用损失一般模型计量减值准备的应收款项均处于信用减值第一阶段。

7 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

2022年6月30日

债券	23,908,753,378.74
股票	7,266,067,398.46

小计	31,174,820,777.20
减：减值准备	(1,741,091,950.38)
合计	29,433,728,826.82

(2) 按业务类别列示

2022年6月30日

债券质押式回购	23,908,753,378.74
股票质押式回购	7,266,067,398.46
小计	31,174,820,777.20
减：减值准备	(1,741,091,950.38)
合计	29,433,728,826.82

于2022年6月30日，股票质押式回购中剩余到期日一年以上的账面余额为人民币4,658,160,448.08元。

(3) 担保物金额

2022年6月30日

担保物	17,874,910,399.97
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	-

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2022年6月30日上述交易所国债逆回购的金额为人民币19,139,592,392.78元。

8 金融投资：交易性金融资产

(1) 按类别列示

2022年6月30日

	初始成本		公允价值			
	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	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
债券	121,495,835,934.56	-	121,495,835,934.56	122,801,576,672.87	-	122,801,576,672.87
公募基金	43,209,007,274.47	-	43,209,007,274.47	43,242,896,052.66	-	43,242,896,052.66
股票	32,529,761,695.43	-	32,529,761,695.43	32,816,521,111.49	-	32,816,521,111.49
券商资管产品	13,221,194,064.91	-	13,221,194,064.91	14,801,097,177.26	-	14,801,097,177.26
银行理财产品	325,000,000.00	-	325,000,000.00	325,938,279.45	-	325,938,279.45
其他	35,328,639,714.43	-	35,328,639,714.43	35,926,379,795.61	-	35,926,379,795.61
合计	246,109,438,683.80	-	246,109,438,683.80	249,914,409,089.34	-	249,914,409,089.34

(2) 交易性金融资产中已融出证券情况

于2022年6月30日，本集团交易性金融资产余额中包含的融出证券余额于12(1)融出证券中披露。本集团融出证券收到的担保物于3(2)中披露。

(3) 存在限售期及承诺条件的交易性金融资产

于2022年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币5,373,066,392.17元的股票投资存在限售期限。

于2022年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币105,865,669,473.36元的金融资产为卖出回购金融资产款设定质押。

于2022年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币3,166,559,985.00元的金融资产为债券借贷业务设定质押。

9 金融投资：债权投资

	2022年6月30日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
资产管理计划	520,802,734.82	-	(229,153,203.31)	291,649,531.51
债券	275,582,179.32	12,567,051.26	(40,099,597.40)	248,049,633.18
信托计划	300,000,000.00	-	(227,683,304.49)	72,316,695.51
合计	1,096,384,914.14	12,567,051.26	(496,936,105.20)	612,015,860.20

10 金融投资：其他债权投资

(1) 按类别列式

	2022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
企业债	12,395,391,771.94	269,867,820.18	(227,599,412.32)	12,437,660,179.80	197,470,426.43
公司债	9,595,276,192.16	164,982,764.35	(420,448,432.16)	9,339,810,524.35	323,886,572.57
中期票据	6,182,241,064.94	111,532,150.74	44,156,500.06	6,337,929,715.74	6,233,934.98
地方债	1,914,336,642.42	19,077,634.22	(44,608.42)	1,933,369,668.22	2,618,787.02
金融债	803,955,753.65	17,687,769.85	4,336,761.35	825,980,284.85	621,432.46
国债	109,635,636.43	249,775.34	(232,166.43)	109,653,245.34	-
其他	9,326,224,523.81	268,772,780.80	24,844,094.59	9,619,841,399.20	24,875,436.24
合计	40,327,061,585.35	852,170,695.48	(574,987,263.33)	40,604,245,017.50	555,706,589.70

(2) 存在承诺条件的其他债权投资

于2022年6月30日，本集团其他债权投资中有人民币16,382,819,947.81元的金融资产为卖出回购金融资产款设定质押。

于 2022 年 6 月 30 日，本集团其他债权投资中人民币 6,691,770,993.00 元的金融资产为债券借贷业务设定质押。

11 金融投资：其他权益工具投资

	2022 年 6 月 30 日		
	初始成本	公允价值	本期确认的股利收入
非交易性权益工具	3,950,902,625.94	3,007,386,382.93	32,190,256.27

于 2022 年 6 月 30 日，本集团其他权益工具投资中无非交易性权益工具投资为转融通业务设定质押。

于 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本集团终止确认的其他权益工具投资累计损失从其他综合收益转入留存收益为人民币 26,405,605.81 元。

12 融出证券

(1) 按项目分析

	2022 年 6 月 30 日
转融通融入证券	2,141,184,033.56
交易性金融资产	835,442,456.66
其他权益工具投资	829,563,791.40
融出证券总额	3,806,190,281.62
转融通融入证券总额	2,675,614,022.15

(2) 融券业务违约情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团融券业务无重大合约逾期。

13 长期股权投资

(1) 按类别列示

	2022 年 6 月 30 日
合营企业	
—不重要的合营企业	49,076,127.70

联营企业	
—重要的联营企业	1,885,080,590.91
—不重要的联营企业	53,920,584.79
小计	1,939,001,175.70
合计	1,988,077,303.40

于 2022 年 6 月 30 日，本集团的长期股权投资未计提减值准备。

(2) 长期股权投资明细情况

被投资单位名称	2022年 1月1日	本期增减变动							2022年 6月30日	减值准备 期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认 的投资收益	其他综 合收益	其他权 益变动	宣告发放现金 股利或利润	计提减 值准备		
合营企业										
上海申万宏源嘉实 股权投资合伙企业 (有限合伙)	990,347.98	51,615.53	-	(435,470.89)	-	-	-	-	-	606,492.62
厦门市象屿泓鼎现 代物流投资合伙企 业(有限合伙)	155,184.60	-	-	(12,568.97)	-	-	(142,499.60)	-	-	116.03
珠海申宏格金医疗 健康产业投资基金 合伙企业(有限合伙)	47,980,628.11	-	(98,828.69)	587,719.63	-	-	-	-	-	48,469,519.05
小计	49,126,160.69	51,615.53	(98,828.69)	139,679.77	-	-	(142,499.60)	-	-	49,076,127.70
联营企业										
富国基金管理有限 公司	1,956,497,862.95	-	-	313,067,613.38	4,365,114.58	-	(388,850,000.00)	-	-	1,885,080,590.91
桐乡申万泓鼎成长 二号股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	52,778,746.70	-	-	129,516.49	-	-	-	-	-	52,908,263.19

重庆市富荣股权投资
基金合伙企业(有
限合伙)

小计	511,344.55	501,253.65	-	(276.60)	-	-	-	-	1,012,321.60	-
	2,009,787,954.20	501,253.65	-	313,196,853.27	4,365,114.58	-	(388,850,000.00)	-	1,939,001,175.70	-
合计	2,058,914,114.89	552,869.18	(98,828.69)	313,336,533.04	4,365,114.58	-	(388,992,499.60)	-	1,988,077,303.40	-

(3) 合营企业基本情况

合营企业	注册地及主要经营地	业务性质	设立时实收资本人民币元	持有权益比例	
				直接	间接
上海申万宏源嘉实股权投资合伙企业(有限合伙)	上海	股权投资	1.00 亿元	-	31.00%
厦门市象屿泓鼎现代物流合伙企业(有限合伙)	福建厦门	股权投资	0.40 亿元	-	50.00%
珠海申宏格金医疗健康产业投资基金合伙企业(有限合伙)	广东珠海	股权投资	2.51 亿元	-	20.00%

(4) 联营企业基本情况

联营企业	注册地及主要经营地	业务性质	设立时实收资本人民币元	持有权益比例	
				直接	间接
富国基金管理有限公司	上海	基金管理	5.20 亿元	-	27.775%
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金合伙企业(有限合伙)(i)	浙江嘉兴	股权投资	3.80 亿元	-	13.16%
重庆市富荣股权投资基金合伙企业(有限合伙)(i)	重庆	股权投资	0.50 亿元	-	1.00%

- (i) 本集团于该被投资企业的股权低于 20%，但由于公司章程细则、有限合伙协议及其他公司治理文件载明的相关安排，本集团对该被投资企业拥有重大影响或共同控制。

所有上述联营企业及合营企业均使用权益法进行核算。

(5) 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。该联营企业的重要会计政策、会计估计与本集团的会计政策、会计估计无重大差异，该联营企业的主要财务信息是在按投资时公允价值为基础调整后的金额。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：

	富国基金管理有限公司 2022 年 6 月 30 日
资产总额	12,243,844,069.95
负债总额	(5,456,875,245.78)
净资产	6,786,968,824.17
持股比例	27.775%
按持股比例计算的净资产份额	1,885,080,590.91
调整事项	-
对联营企业投资的账面价值	1,885,080,590.91

	1月1日至6月30日止期间
	2022年
营业收入	3,772,562,283.29
净利润	1,122,213,277.60
其他综合收益	15,715,984.10
其他调整	-
综合收益总额	1,137,929,261.70
本集团本期间收到的来自联营企业的股利	-

于2022年6月30日，本集团重要联营企业为非上市公司，不存在公开市场报价。

(6) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

	2022年6月30日
合营企业：	
投资账面价值合计	49,076,127.70
下列各项按持股比例计算的合计数	
-净利润	139,679.77
-综合收益总额	139,679.77
联营企业：	
投资账面价值合计	53,920,584.79
下列各项按持股比例计算的合计数	
-净利润	129,239.89
-综合收益总额	129,239.89

14 投资性房地产

	房屋及建筑物
成本	
2021年12月31日余额	91,019,200.94
2022年6月30日余额	91,019,200.94
减：累计折旧	
2021年12月31日余额	(54,365,794.01)
本期增加	(1,839,641.61)
2022年6月30日余额	(56,205,435.62)

账面价值	
2022年6月30日余额	<u>34,813,765.32</u>

于2022年6月30日，本集团的投资性房地产未计提减值准备。

于2022年6月30日，本集团投资性房地产无尚未办妥产权证的情况。

15 固定资产

(1) 账面价值

	2022年6月30日
固定资产原值	2,254,715,360.38
减：累计折旧	(1,600,393,781.31)
固定资产减值准备	(283,970.97)
	<hr/>
合计	<u>654,037,608.10</u>

(2) 固定资产增减变动表

	房屋及建筑物	运输工具	机械动力设备	电子设备	其他设备	自有		合计
						固定资产	资产装修	
原值								
2021年12月31日余额	934,001,240.36	47,799,868.72	17,850,121.09	1,087,054,090.13	78,861,114.16	72,190,384.93	2,237,756,819.39	
本期增加	1,228,800.00	1,135,982.31	-	22,403,361.92	764,816.20	30,554.67	25,563,515.10	
— 在建工程转入	-	-	-	51,046,541.99	24,982.30	22,624.92	51,094,149.21	
本期减少	-	-	(480,525.00)	(3,317,422.40)	(286,065.19)	-	(4,084,012.59)	
— 转让和出售	-	-	(538,409.05)	(52,182,901.51)	(1,054,704.17)	-	(55,615,110.73)	
— 清理报废	-	(1,839,096.00)						
2022年6月30日余额	935,230,040.36	47,096,755.03	16,831,187.04	1,105,003,670.13	78,310,143.30	72,243,564.52	2,254,715,360.38	
减：累计折旧								
2021年12月31日余额	(560,065,950.42)	(40,783,034.23)	(15,544,854.40)	(835,433,243.41)	(66,224,483.86)	(66,050,907.08)	(1,584,102,473.40)	
本期计提	(15,184,821.93)	(856,798.21)	(107,497.05)	(54,108,074.81)	(855,255.81)	(1,167,841.11)	(72,280,288.92)	
本期减少	-	1,739,110.17	961,106.64	52,028,672.78	1,260,091.42	-	55,988,981.01	
2022年6月30日余额	(575,250,772.35)	(39,900,722.27)	(14,691,244.81)	(837,512,645.44)	(65,819,648.25)	(67,218,748.19)	(1,600,393,781.31)	
减：减值准备								
2021年12月31日余额	(283,970.97)	-	-	-	-	-	(283,970.97)	
2022年6月30日余额	(283,970.97)	-	-	-	-	-	(283,970.97)	
账面价值								
2022年6月30日	359,695,297.04	7,196,032.76	2,139,942.23	267,491,024.69	12,490,495.05	5,024,816.33	654,037,608.10	

(3) 暂时闲置的固定资产

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无闲置的重大固定资产。

(4) 通过融资租赁租入的固定资产情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无通过融资租赁租入的重大固定资产。

(5) 通过经营租赁租出的固定资产的情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无通过经营租赁租出的重大固定资产。

(6) 未办妥产权证书的固定资产情况

于 2022 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 10,506,670.62 元。

16 在建工程

(1) 在建工程账面价值

	2022 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
无形资产开发支出	108,951,288.94	-	108,951,288.94
自有房产装修工程	44,728,045.14	-	44,728,045.14
租入房产装修工程	41,742,189.60	-	41,742,189.60
其他	8,239,305.49	-	8,239,305.49
合计	<u>203,660,829.17</u>	<u>-</u>	<u>203,660,829.17</u>

(2) 在建工程项目变动

工程名称	资金来源	2022年1月1日	本期增加	本期减少		2022年6月30日
				本期转入固定资产	其他减少	
自有房产装修工程	自有	42,358,182.95	2,392,487.11	(22,624.92)	-	44,728,045.14
无形资产开发支出	自有	109,462,754.74	35,812,670.51	-	(36,324,136.31)	108,951,288.94
租入房产装修工程	自有	28,883,399.92	16,915,042.75	-	(4,056,253.07)	41,742,189.60
其他	自有	46,362,994.63	12,947,835.15	(51,071,524.29)	-	8,239,305.49
合计		227,067,332.24	68,068,035.52	(51,094,149.21)	(40,380,389.38)	203,660,829.17

17 使用权资产

	房屋及建筑物
原值	
2021年12月31日余额	1,568,857,673.80
本期增加	291,505,640.98
本期减少	(105,841,951.04)
2022年6月30日余额	<u>1,754,521,363.74</u>
减：累计折旧	
2021年12月31日余额	(638,299,760.67)
本期计提	(201,621,331.78)
本期减少	104,142,618.29
2022年6月30日余额	<u>(735,778,474.16)</u>
账面价值	
2022年6月30日余额	<u>1,018,742,889.58</u>

于2022年6月30日，本集团的使用权资产未计提减值准备。

18 无形资产

	计算机软件	其他	合计
原值			
2021年12月31日余额	803,691,527.89	321,026,640.94	1,124,718,168.83
本期增加	42,654,368.95	13,622.00	42,667,990.95
本期减少	-	(1,872.50)	(1,872.50)
2022年6月30日余额	<u>846,345,896.84</u>	<u>321,038,390.44</u>	<u>1,167,384,287.28</u>
减：累计摊销			
2021年12月31日余额	(573,812,246.88)	(303,667,374.38)	(877,479,621.26)
本期增加	(61,222,889.58)	(386,339.46)	(61,609,229.04)
本期减少	-	1,872.50	1,872.50
2022年6月30日余额	<u>(635,035,136.46)</u>	<u>(304,051,841.34)</u>	<u>(939,086,977.80)</u>
减：减值准备			
2021年12月31日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
2022年6月30日余额	-	<u>(675,579.92)</u>	<u>(675,579.92)</u>
账面价值			

2022年6月30日 211,310,760.38 16,310,969.18 227,621,729.56

于2022年6月30日，本集团无用于抵押或担保的重大无形资产。

19 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 递延所得税资产

项目	2022年6月30日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	4,254,997,634.07	1,063,749,408.52
可抵扣亏损	3,473,053,541.36	783,639,752.08
资产减值准备	2,564,284,247.11	640,470,188.17
其他权益工具投资	943,516,243.02	235,444,358.80
其他债权投资	574,987,263.32	120,395,254.11
交易性金融资产	24,495,244.77	4,041,715.39
其他	189,249,670.36	47,291,862.52
合计	<u>12,024,583,844.01</u>	<u>2,895,032,539.59</u>

(2) 递延所得税负债

项目	2022年6月30日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	(2,710,662,640.98)	(677,665,660.26)
衍生金融工具	(1,195,126,744.25)	(298,781,686.06)
交易性金融负债	(3,978,921.95)	(994,730.49)
其他	(14,384,401.22)	(3,285,208.16)
合计	<u>(3,924,152,708.40)</u>	<u>(980,727,284.97)</u>

(3) 抵销后的递延所得税资产和递延所得税负债净额列示如下：

2022年6月30日	
递延所得税资产	1,915,389,814.85
递延所得税负债	<u>(1,084,560.23)</u>

(4) 未确认递延所得税资产额可抵扣亏损金额

项目	2022年6月30日
可抵扣亏损	77,468,878.08

20 其他资产

2022年6月30日

应收股利	388,850,000.00
其他应收款(1)	375,128,348.23
大宗商品存货	341,362,870.81
待抵扣税项	226,585,949.12
预付款项	176,984,333.12
长期待摊费用(2)	74,210,537.72
应收利息	38,051,786.25
待摊费用	4,276,926.36
抵债资产	1,000,000.00
其他(3)	13,683,053.38
合计	1,640,133,804.99

(1) 其他应收款

(a) 按明细列式

2022年6月30日

其他应收款余额	659,474,755.31
减：坏账准备	(284,346,407.08)
合计	375,128,348.23

(b) 按账龄分析

2022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	322,363,055.15	48.88	(10,222,926.93)	3.17
1-2年	42,536,700.69	6.45	(11,579,943.01)	27.22
2-3年	26,951,408.06	4.09	(20,100,755.75)	74.58
3年以上	267,623,591.41	40.58	(242,442,781.39)	90.59
合计	659,474,755.31	100.00	(284,346,407.08)	43.12

(2) 长期待摊费用

	2022年 1月1日	本期购入	在建工程转入	本期摊销	本期转出	2022年 6月30日
租入资产改良	70,828,993.16	2,988,459.50	3,534,396.74	(14,993,046.15)	-	62,358,803.25
支出其他	11,329,878.14	-	521,856.33	-	-	11,851,734.47
合计	82,158,871.30	2,988,459.50	4,056,253.07	(14,993,046.15)	-	74,210,537.72

- (3) 截至 2022 年 6 月 30 日，其他包括本公司因收购子公司形成的商誉。商誉减值评估每年执行一次。可收回金额根据资产的公允价值减去处置费用后的净额与使用现值两者之间较高者确定。

21 资产减值准备

	2022年1月1日	本期计提	本期转回	本期核销	其他变动	2022年6月30日
货币资金	1,267,282.18	171,160.73	(58,324.00)	-	12,592.65	1,392,711.56
融出资金(1)	378,786,450.60	49,914,126.62	(61,444,398.10)	-	(1,283,942.65)	365,972,236.47
应收款项	602,906,761.82	10,442,116.37	-	-	1,445,035.89	614,793,914.08
买入返售金融资产(2)	1,132,232,686.05	648,329,935.98	(39,470,671.65)	-	-	1,741,091,950.38
债权投资(3)	470,451,793.15	26,331,580.20	(1,559,025.28)	-	1,711,757.13	496,936,105.20
其他债权投资(4)	499,213,998.97	115,632,196.07	(66,886,149.31)	-	7,746,543.97	555,706,589.70
其他金融资产	285,679,022.27	3,502,963.51	-	-	-	289,181,985.78
金融工具信用减值准备						
小计	3,370,537,995.04	854,324,079.48	(169,418,568.34)	-	9,631,986.99	4,065,075,493.17
固定资产	283,970.97	-	-	-	-	283,970.97
无形资产	675,579.92	-	-	-	-	675,579.92
存货跌价准备	24,507,696.57	18,744,167.68	-	-	-	43,251,864.25
其他资产减值准备						
小计	25,467,247.46	18,744,167.68	-	-	-	44,211,415.14
合计	3,396,005,242.50	873,068,247.16	(169,418,568.34)	-	9,631,986.99	4,109,286,908.31

(1) 融出资金

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
未来 12 个月预期信用损失		整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	114,598,650.34	8,721,031.30	255,466,768.96	378,786,450.60
本期计提	49,689,882.86	-	224,243.76	49,914,126.62
本期转回	(58,114,723.20)	(1,978,078.16)	(1,351,596.74)	(61,444,398.10)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(4,222,386.67)	4,222,386.67	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(356,092.26)	-	356,092.26	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(127,867.20)	127,867.20	-
第二阶段转移至第一阶段	4,581,143.70	(4,581,143.70)	-	-
外汇及其他变动	-	-	(1,283,942.65)	(1,283,942.65)
2022 年 6 月 30 日	106,176,474.77	6,256,328.91	253,539,432.79	365,972,236.47

(2) 买入返售金融资产

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
未来 12 个月预期信用损失		整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	5,632,855.92	2,264,850.00	1,124,334,980.13	1,132,232,686.05
本期计提	-	-	648,329,935.98	648,329,935.98
本期转回	(2,604,304.12)	(614,850.00)	(36,251,517.53)	(39,470,671.65)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(420,294.81)	420,294.81	-	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(1,650,000.00)	1,650,000.00	-
2022 年 6 月 30 日	2,608,256.99	420,294.81	1,738,063,398.58	1,741,091,950.38

(3) 债权投资

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
未来 12 个月预期信用损失		整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	4,488,208.76	-	465,963,584.39	470,451,793.15
本期计提	204,553.76	-	26,127,026.44	26,331,580.20
本期转回	(1,559,025.28)	-	-	(1,559,025.28)

外汇及其他变动	162,854.12	-	1,548,903.01	1,711,757.13
2022年6月30日	3,296,591.36	-	493,639,513.84	496,936,105.20

(4) 其他债权投资

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022年1月1日	71,727,224.21	84,862,942.40	342,623,832.36	499,213,998.97
本期计提	22,716,087.89	4,654,192.34	88,261,915.84	115,632,196.07
本期转回	(36,202,385.90)	(30,621,475.98)	(62,287.43)	(66,886,149.31)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(778,055.95)	778,055.95	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(13,077,899.54)	-	13,077,899.54	-
第二阶段转移至第一阶段	6,037,243.68	(6,037,243.68)	-	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(45,027,993.69)	45,027,993.69	-
外汇及其他变动	822,314.41	317,720.76	6,606,508.80	7,746,543.97
2022年6月30日	51,244,528.80	8,926,198.10	495,535,862.80	555,706,589.70

22 短期借款

2022年6月30日

银行借款

2,758,858,719.39

于2022年6月30日，短期借款的利率区间为1.44% - 3.45%。

23 应付短期融资款

债券名称	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面利率 %	2022年1月1日 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022年6月30日 人民币元
21 申万宏源 CP007	20.00	2021/10/18	12个月	20.00	2.82	2,011,589,041.10	27,968,219.19	-	2,039,557,260.29
21 申证 D2	52.00	2021/10/27	6个月	52.00	2.74	5,220,838,978.56	40,056,583.09	(5,260,895,561.65)	-
21 申证 D3	28.00	2021/10/27	9个月	28.00	2.78	2,810,920,606.24	41,358,455.01	-	2,852,279,061.25
21 申万宏源 CP008	30.00	2021/10/29	12个月	30.00	2.85	3,014,991,780.83	42,398,630.15	-	3,057,390,410.98
21 申证 D4	33.00	2021/12/08	8个月	33.00	2.64	3,300,376,507.89	47,625,257.62	-	3,348,001,765.51
21 申证 D5	47.00	2021/12/08	12个月	47.00	2.68	4,700,380,646.54	66,656,489.66	-	4,767,037,136.20
22 申万宏源 CP001	20.00	2022/01/26	5个月	20.00	2.37	-	2,016,362,739.71	(2,016,362,739.71)	-
22 申万宏源 CP002	20.00	2022/02/17	12个月	20.00	2.49	-	2,018,282,739.71	-	2,018,282,739.71
22 申万宏源 CP003	20.00	2022/03/28	12个月	20.00	2.66	-	2,013,846,575.34	-	2,013,846,575.34
22 申万宏源 CP004	30.00	2022/04/22	7个月	30.00	2.34	-	3,013,463,013.69	-	3,013,463,013.69
22 申万宏源香港美元债(1)						-	1,348,315,409.16	-	1,348,315,409.16
收益凭证(2)						8,535,035,637.65	18,602,336,793.28	(15,562,919,318.97)	11,574,453,111.96

合计	29,594,133,198.81	29,278,670,905.61	(22,840,177,620.33)	36,032,626,484.09
----	-------------------	-------------------	---------------------	-------------------

于 2022 年 6 月 30 日，以上应付短期融资款没有出现拖欠本金、利息或赎回款项的违约情况。

- (1) 本公司间接附属公司申万宏源(香港)有限公司于 2022 年 1 月 27 日发行 2 亿美元的债券，期限 1 年，采用固定利率形式，票面利率 1.50%，单利按年计息，每半年付息一次，本期债券为无抵押及无担保债券。
- (2) 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团共发行 855 期期限一年以内的收益凭证。于 2022 年 6 月 30 日，本集团发行的收益凭证采用固定年利率或与若干股挂钩的浮动利率两种方式计息，其中固定利率区间为 2.05% - 6.80%。

24 拆入资金

2022年6月30日

银行拆入资金	2,645,000,000.00
其他拆入资金	692,755,264.73
转融通拆入资金	-
合计	<u>3,337,755,264.73</u>

25 交易性金融负债

2022年6月30日

债券	3,404,402,522.62
结构化票据	1,441,587,334.15
黄金	58,921,500.00
股票	-
合计	<u>4,904,911,356.77</u>

26 卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别列示

2022年6月30日

质押式卖出回购	100,085,844,542.57
质押式报价回购	17,063,903,423.88
黄金掉期业务	10,370,948,879.83
买断式卖出回购	-
合计	<u>127,520,696,846.28</u>

(2) 按金融资产总类列示

2022年6月30日

债券	100,085,844,542.57
基金	17,063,903,423.88
贵金属	10,370,948,879.83
合计	<u>127,520,696,846.28</u>

(3) 担保物金额

2022年6月30日

债券	112,581,930,776.48
基金	10,458,390,000.00
贵金属	22,813,175,336.37
合计	145,853,496,112.85

27 代理买卖证券款

2022年6月30日

普通经纪业务	
—个人	54,298,423,391.66
—机构	39,621,212,421.01
小计	93,919,635,812.67
信用业务	
—个人	10,351,948,815.50
—机构	1,846,897,562.84
小计	12,198,846,378.34
加：应付利息	-
合计	106,118,482,191.01

28 应付职工薪酬

	2022年 1月1日	本期增加	本期减少	2022年 6月30日
短期薪酬(1)	1,898,474,598.40	2,511,194,960.52	(2,283,127,116.49)	2,126,542,442.43
离职后福利				
—设定提存计划(2)	191,116,390.11	273,597,482.49	(444,548,878.13)	20,164,994.47
辞退福利	8,297,074.35	1,524,561.99	(1,524,561.99)	8,297,074.35
其他长期职工福利				
—递延奖金	3,679,519,285.04	353,492,718.48	-	4,033,012,003.52
合计	5,777,407,347.90	3,139,809,723.48	(2,729,200,556.61)	6,188,016,514.77

(1) 短期薪酬

	2022年1月1日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
工资、奖金、津贴和补贴	1,728,941,356.45	2,130,190,073.78	(1,902,288,664.06)	1,956,842,766.17
职工福利费	175,000.00	44,614,474.72	(44,639,474.72)	150,000.00
社会保险费	977,261.88	117,545,544.40	(117,286,071.23)	1,236,735.05
其中：医疗保险费	793,956.77	113,295,368.64	(113,038,360.37)	1,050,965.04
工伤保险费	13,977.27	2,326,899.40	(2,325,431.76)	15,444.91
生育保险费	169,327.84	1,923,276.36	(1,922,279.10)	170,325.10
住房公积金	3,305,081.91	146,141,354.61	(145,768,193.77)	3,678,242.75
工会经费和职工教育经费	164,022,550.71	50,796,277.04	(51,800,043.95)	163,018,783.80

其他	1,053,347.45	21,907,235.97	(21,344,668.76)	1,615,914.66
合计	1,898,474,598.40	2,511,194,960.52	(2,283,127,116.49)	2,126,542,442.43

(2) 离职后福利 - 设定提存计划

	2022年1月1日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
基本养老保险	2,655,963.76	183,509,862.30	(182,775,699.23)	3,390,126.83
失业保险费	192,251.59	5,684,108.72	(5,649,926.99)	226,433.32
企业年金缴费	188,268,174.76	84,403,511.47	(256,123,251.91)	16,548,434.32
合计	191,116,390.11	273,597,482.49	(444,548,878.13)	20,164,994.47

本集团以当地劳动和社会保障部门规定的缴纳基数和比例，按月向相关经办机构缴纳养老保险费及失业保险费，且缴纳后不可用于抵减本集团未来期间应为员工交存的款项。

(3) 基本养老保险、失业保险及企业年金的缴费情况

按照中国有关法规，本集团境内公司的职工参加了由当地劳动和社会保障部门组织实施的社会基本养老保险和失业保险，本集团境内公司以当地规定的社会基本养老保险和失业保险的缴纳基数和比例，向当地社会基本养老保险和失业保险经办机构缴纳保险费。

除了以上基本养老保险和失业保险计划外，本集团境内公司为符合条件的职工设立了企业年金计划，按上年职工工资总额的一定比例提取年金计划供款。

本集团境外公司符合资格的职工参加当地的福利供款计划。境外公司按照当地政府机构的规定为职工供款。

本集团应付职工薪酬中并无属于拖欠性质的余额。

29 应交税费

2022年6月30日

代扣代缴个人所得税	523,147,183.50
企业所得税	217,597,249.20
增值税	103,666,834.40
城市维护建设税	7,714,904.94
教育费附加及地方教育附加	5,516,588.29
其他	576,890.57
	<hr/>
合计	858,219,650.90

30 应付款项

2022年6月30日

应付履约保证金	25,580,314,587.88
应付清算款项	469,824,172.36
应付手续费及佣金	312,092,202.90
应付销售服务费	107,297,427.43
应付投资者保护基金	39,021,081.33
应付经纪人佣金	7,834,230.15
	<hr/>
合计	26,516,383,702.05

于2022年6月30日，本集团无账龄超过1年的大额应付款项。

31 应付债券

债券名称	面值 人民币 亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿 元	票面利率 %	2022年1月1日		本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022年6月30日	
						人民币元	人民币元			人民币元	人民币元
17 申证 01	75.00	2017/02/17	60 个月	75.00	4.40	7,787,506,849.32	28,027,397.26	(7,815,534,246.58)	-	-	-
17 申证 02	5.00	2017/02/17	84 个月	5.00	4.50	519,602,739.71	10,039,246.10	(21,513,698.61)	508,128,287.20	508,128,287.20	508,128,287.20
18 申证 03	15.00	2018/12/10	60 个月	15.00	4.08	1,503,688,767.12	30,144,288.70	-	1,533,833,055.82	1,533,833,055.82	1,533,833,055.82
19 申证 01	22.00	2019/01/16	36 个月	22.00	3.55	2,274,890,410.92	-	(2,274,890,410.92)	-	-	-
19 申证 03	62.00	2019/03/11	36 个月	62.00	3.68	6,385,028,383.54	36,880,657.53	(6,421,909,041.07)	-	-	-
19 申证 05	81.00	2019/05/09	36 个月	81.00	3.88	8,304,066,739.73	103,324,931.50	(8,407,391,671.23)	-	-	-
19 申万宏源金融债 01	60.00	2019/09/18	36 个月	60.00	3.43	6,058,194,304.27	102,756,272.81	-	6,160,950,577.08	6,160,950,577.08	6,160,950,577.08
20 申证 01	40.00	2020/01/16	24 个月	40.00	3.40	4,130,372,434.67	38,524.22	(4,130,410,958.89)	-	-	-
20 申证 02	20.00	2020/01/16	36 个月	20.00	3.55	2,067,755,202.33	32,275,017.68	(68,082,191.80)	2,031,948,028.21	2,031,948,028.21	2,031,948,028.21
20 申证 03	10.00	2020/02/21	24 个月	10.00	3.03	1,026,066,301.39	2,573,424.66	(1,028,639,726.05)	-	-	-
20 申证 04	30.00	2020/02/21	36 个月	30.00	3.20	3,082,586,301.39	42,041,786.53	(90,739,726.05)	3,033,888,361.87	3,033,888,361.87	3,033,888,361.87
20 申证 06	41.00	2020/07/27	36 个月	41.00	3.49	4,161,940,328.79	70,266,384.25	-	4,232,206,713.04	4,232,206,713.04	4,232,206,713.04
20 申证 08	32.00	2020/09/10	36 个月	32.00	3.76	3,229,595,062.28	61,911,075.72	-	3,291,506,138.00	3,291,506,138.00	3,291,506,138.00
20 申证 10	57.00	2020/10/26	36 个月	57.00	3.68	5,723,852,430.12	108,017,843.40	-	5,831,870,273.52	5,831,870,273.52	5,831,870,273.52
20 申证 12	17.00	2020/11/16	24 个月	17.00	3.55	1,704,452,031.54	31,716,402.17	-	1,736,168,433.71	1,736,168,433.71	1,736,168,433.71
20 申证 C2	60.00	2020/04/23	36 个月	60.00	3.18	6,128,554,520.52	83,754,024.28	(179,299,726.05)	6,033,008,818.75	6,033,008,818.75	6,033,008,818.75
20 申证 C3	60.00	2020/05/25	36 个月	60.00	3.25	6,116,095,115.04	83,730,679.78	(182,178,082.22)	6,017,647,712.60	6,017,647,712.60	6,017,647,712.60
21 申证 01	25.00	2021/04/29	36 个月	25.00	3.45	2,553,695,077.73	37,140,830.93	(79,633,561.69)	2,511,202,346.97	2,511,202,346.97	2,511,202,346.97
21 申证 02	20.00	2021/04/29	120 个月	20.00	4.05	2,050,346,774.32	34,190,324.22	(74,786,301.35)	2,009,750,797.19	2,009,750,797.19	2,009,750,797.19
21 申证 03	26.00	2021/05/24	60 个月	26.00	3.63	2,652,080,429.38	41,452,452.08	(88,432,767.13)	2,605,100,114.33	2,605,100,114.33	2,605,100,114.33
21 申证 04	20.00	2021/05/28	36 个月	20.00	3.27	2,035,197,258.60	28,382,801.69	(60,562,191.81)	2,003,017,868.48	2,003,017,868.48	2,003,017,868.48
21 申证 05	25.00	2021/05/28	120 个月	25.00	4.00	2,554,094,926.63	42,487,905.27	(92,602,739.69)	2,503,980,092.21	2,503,980,092.21	2,503,980,092.21
21 申证 06	20.00	2021/07/21	36 个月	20.00	3.13	2,023,634,629.13	31,915,209.08	-	2,055,549,838.21	2,055,549,838.21	2,055,549,838.21
21 申证 07	30.00	2021/07/21	120 个月	30.00	3.77	3,043,248,871.92	56,477,960.00	-	3,099,726,831.92	3,099,726,831.92	3,099,726,831.92
21 申证 08	28.00	2021/07/28	36 个月	28.00	3.04	2,833,266,846.21	42,844,290.04	-	2,876,111,136.25	2,876,111,136.25	2,876,111,136.25
21 申证 09	42.00	2021/07/28	60 个月	42.00	3.38	4,248,283,216.22	71,782,465.23	-	4,320,065,681.45	4,320,065,681.45	4,320,065,681.45
21 申证 10	30.00	2021/08/26	36 个月	30.00	3.02	3,021,940,075.74	46,766,088.82	-	3,068,706,164.56	3,068,706,164.56	3,068,706,164.56
21 申证 11	30.00	2021/08/26	120 个月	30.00	3.75	3,028,710,150.64	56,339,397.87	-	3,085,049,548.51	3,085,049,548.51	3,085,049,548.51

21 申证 12	48.00	2021/09/09	36 个月	48.00	3.05	4,834,126,671.56	74,736,120.98	-	4,908,862,792.54
21 申证 13	10.00	2021/09/09	60 个月	10.00	3.40	1,008,090,732.24	17,127,592.13	-	1,025,218,324.37
21 申证 14	23.00	2021/09/22	24 个月	23.00	2.95	2,310,361,711.05	36,067,138.82	-	2,346,428,849.87
21 申证 15	23.00	2021/09/22	36 个月	23.00	3.10	2,310,865,236.68	36,969,496.63	-	2,347,834,733.31
21 申证 C1	30.00	2021/01/21	36 个月	30.00	3.93	3,102,716,541.73	54,110,400.61	(111,439,726.04)	3,045,387,216.30
21 申证 C2	38.00	2021/03/11	36 个月	38.00	3.94	3,909,641,529.59	72,806,942.03	(145,618,082.20)	3,836,830,389.42
21 申证 C3	18.00	2021/12/27	24 个月	18.00	3.08	1,793,170,281.73	29,386,840.02	-	1,822,557,121.75
21 申证 C4	12.00	2021/12/27	36 个月	12.00	3.20	1,195,454,928.38	19,883,501.48	-	1,215,338,429.86
22 申证 01	50.00	2022/01/21	36 个月	50.00	2.80	-	5,051,530,119.49	-	5,051,530,119.49
22 申证 02	24.00	2022/01/21	120 个月	24.00	3.60	-	2,432,612,104.47	-	2,432,612,104.47
22 申证 03	22.00	2022/02/23	36 个月	22.00	2.95	-	2,216,980,594.62	-	2,216,980,594.62
22 申证 05	35.00	2022/03/24	36 个月	35.00	3.18	-	3,521,063,314.46	-	3,521,063,314.46
22 申证 06	21.00	2022/03/24	60 个月	21.00	3.53	-	2,114,411,858.01	-	2,114,411,858.01
22 申证 07	18.00	2022/05/23	36 个月	18.00	2.78	-	1,800,692,962.44	-	1,800,692,962.44
22 申证 08	22.00	2022/05/23	60 个月	22.00	3.20	-	2,201,749,160.70	-	2,201,749,160.70
22 申证 C1	30.00	2022/04/27	36 个月	30.00	3.19	-	3,005,027,634.35	-	3,005,027,634.35
21 申万宏源国际金融 美元债(1)						3,198,233,307.37	168,760,572.68	-	3,366,993,880.05
22 申万宏源国际金融 美元债(2)						-	2,021,162,552.87	-	2,021,162,552.87
收益凭证(3)						11,570,083,119.84	4,702,076,444.24	(1,262,484,611.19)	15,009,674,952.89
合计						135,481,490,239.37	30,894,433,032.85	(32,536,149,460.57)	133,839,773,811.65

(1) Shenwan Hongyuan International Finance Limited 于 2021 年 7 月 14 日发行 5 亿美元的债券，期限 5 年，采用固定利率形式，票面利率 1.80%，单利按年计息，每半年付息一次，本公司提供连带责任担保。

(2) Shenwan Hongyuan International Finance Limited 于 2022 年 3 月 16 日发行 3 亿美元的债券，期限 3 年，采用固定利率形式，票面利率 2.63%，单利按年计息，每半年付息一次，本公司提供连带责任担保。

- (3) 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团共发行 113 期期限超过一年的收益凭证。于 2022 年 6 月 30 日，本集团发行的收益凭证采用固定年利率或与若干股指挂钩的浮动利率两种方式计息，其中固定利率区间为 2.60% - 3.60%。

32 合同负债

	2022 年 6 月 30 日
保荐及财务顾问合同	15,952,662.29
资产管理合同	1,074,312.19
	<hr/>
合计	17,026,974.48
	<hr/>

33 租赁负债

	2022 年 6 月 30 日
一年以上的非流动租赁负债	667,741,639.70
一年以内到期的租赁负债	381,345,130.70
	<hr/>
合计	1,049,086,770.40
	<hr/>

本集团未纳入租赁负债计量的未来潜在现金流出主要来源于已承诺但尚未开始的租赁等风险敞口。本集团已承诺但尚未开始的租赁预计未来年度现金流出不重大。

34 其他负债

	2022 年 6 月 30 日
合并结构化主体形成的其他金融负 债(1)	11,321,457,219.09
应付股利(3)	3,438,847,715.75
其他应付款(2)	1,438,838,586.51
期货风险准备(4)	176,223,415.64
预提费用	166,710,538.36
递延收益	71,972,897.86
	<hr/>
合计	16,614,050,373.21
	<hr/>

(1) 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持有的权益。

(2) 应付股利

2022年6月30日

一年以上应付股利	<u>134,387,715.75</u>
----------	-----------------------

本集团应付股利为应付普通股股利，主要是相应股权质押冻结或股权转让等历史原因导致的。

(3) 其他应付款

2022年6月30日

应付保证金及押金	826,407,923.98
资管产品增值税合并纳税结余	153,594,114.89
长期应付款	177,311,399.98
代理兑付债券款	6,579,569.27
其他	<u>274,945,578.39</u>
合计	<u>1,438,838,586.51</u>

于2022年6月30日，除长期应付款和资管产品增值税合并纳税结余外，本集团无账龄超过1年的重要其他应付款。

(4) 期货风险准备

本集团子公司申银万国期货有限公司根据《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。

35 实收资本

本公司注册资本及实收资本结构如下：

	2022年6月30日余额	
	人民币	%
申万宏源集团	<u>53,500,000,000.00</u>	<u>100.00</u>

36 其他权益工具

	2022年1月1日		本期增加		2022年6月30日	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
永续债	100,000,000.00	9,987,816,037.74	-	-	100,000,000.00	9,987,816,037.74

经证监会证券基金机构监管部机构部函[2020]3544号文核准，本集团于2021年6月24日、2021年8月19日、2021年11月15日分别发行了三期永续次级债券(以下统称“永续债”)，即“21申证Y1”、“21申证Y2”及“21申证Y3”，债券面值均为人民币100元，票面利率分别为4.10%、3.70%及3.88%。面值总额为人民币10,000,000,000.00元；永续债的其他主要条款如下：

- 利率在债券存续的前五个计息年度内分别按票面利率保持不变，自第六个计息年度起每五年重置一次，每次重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上300个基点确定。
- 除非发生强制付息事件，每个付息日，本公司可自行选择将当期利息以及按照合同条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制，前述利息递延不构成本公司未能按照约定足额支付利息。每笔递延利息在递延期间应按当期票面利率累计计息。于2022年6月30日，本公司已在应付股利中确认应付永续债利息人民币304,460,000.00元。
- 当存在递延支付利息的情形时，本公司在已递延利息及其孳息全部清偿完毕前不得向普通股股东分红和减少注册资本。
- 清偿顺序在本公司的普通债务和次级债务之后，除非公司清算，投资者不能要求公司加速偿还本次债券的本金。

由于该永续债未构成本公司无法避免的支付现金或其他金融资产的合同义务，因此分类为权益工具，列示为其他权益工具。

37 资本公积

	2022年1月1日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
资本溢价	3,273,875,823.46	-	-	3,273,875,823.46

38 其他综合收益

(1) 资产负债表中归属于母公司的其他综合收益情况表

	2022年1月1日	税后归属于 母公司	其他综合收益 转留存收益	2022年6月30日
其他债权投资公允价值变动	(265,749,049.14)	(139,652,557.46)	-	(405,401,606.60)
其他债权投资信用减值准备	357,083,590.27	30,385,774.48	-	387,469,364.75
其他权益工具投资公允价值变动	(529,718,788.21)	(214,775,589.37)	26,405,605.81	(718,088,771.77)
权益法下可转损益的其他综合收益	(4,416,624.33)	4,365,114.58	-	(51,509.75)
外币财务报表折算差额	(195,162,272.20)	172,969,029.44	-	(22,193,242.76)
合计	(637,963,143.61)	(146,708,228.33)	26,405,605.81	(758,265,766.13)

(2) 利润表中归属于母公司的其他综合收益情况表

2022年1月1日至6月30日止期间

	本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益本期转出	减：所得税费用	减：税后归属于少数股东	税后归属于母公司
将重分类进损益的其他综合收益					
其他债权投资公允价值变动	(246,112,899.99)	49,956,184.22	37,844,750.30	18,659,408.01	(139,652,557.46)
其他债权投资信用减值准备	48,746,046.76	-	(9,477,235.32)	(8,883,036.96)	30,385,774.48
权益法下可转损益的其他综合收益	4,365,114.58	-	-	-	4,365,114.58
外币财务报表折算差额	197,929,609.65	-	-	(24,960,580.21)	172,969,029.44
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	(281,605,054.13)	-	66,829,464.76	-	(214,775,589.37)
合计	(276,677,183.13)	49,956,184.22	95,196,979.74	(15,184,209.16)	(146,708,228.33)

39 盈余公积

	2022年1月1日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
法定盈余公积金	4,521,398,336.20	-	-	4,521,398,336.20
任意盈余公积金	235,871,447.34	-	-	235,871,447.34
	<u>4,757,269,783.54</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>4,757,269,783.54</u>

40 一般风险准备

	2022年1月1日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
一般风险准备	5,954,618,839.18	26,151,741.30	-	5,980,770,580.48
交易风险准备	5,210,967,135.21	7,761,225.65	-	5,218,728,360.86
	<u>11,165,585,974.39</u>	<u>33,912,966.95</u>	<u>-</u>	<u>11,199,498,941.34</u>

41 未分配利润

1月1日至6月30日止期间
2022年

期初未分配利润	21,847,352,361.82
加：本期归属于母公司所有者的净利润	3,625,533,718.05
其他综合收益转入	-
减：提取法定盈余公积	-
提取任意盈余公积	-
提取一般风险准备	(26,151,741.30)
提取交易风险准备	(7,761,225.65)
对所有者的分配	(3,000,000,000.00)
其他综合收益结转	(26,405,605.81)
对其他权益工具投资者的分配	(343,550,410.96)
期末未分配利润	<u>22,069,017,096.15</u>

(1) 提取各项盈余公积和风险准备

本集团按照相关法律法规及公司章程规定提取2022年1月1日至2022年6月30日止期间财务报表的法定盈余公积、任意盈余公积、一般风险准备及交易风险准备。

(2) 向所有者分配现金股利

经本公司单一股东申万宏源集团2022年4月11日分配股利的决议，本公

公司向申万宏源集团分配现金股利人民币 3,000,000,000.00 元。

(3) 向其他权益工具投资者分配现金股利

于 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本公司已确认永续债相关的应付股利人民币 343,550,410.96 元。

(4) 期/年末未分配利润的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本集团的未分配利润余额中包括子公司提取的盈余公积归属于母公司部分人民币 934,204,223.56 元。

42 手续费及佣金净收入

(1) 按收入类别列示

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2022年
证券经纪业务净收入	2,465,888,246.86
证券经纪业务收入	3,046,905,481.81
其中：代理买卖证券业务	2,387,616,890.34
交易单元席位租赁	526,527,283.36
代销金融产品业务	132,761,308.11
证券经纪业务支出	(581,017,234.95)
其中：代理买卖证券业务	(581,017,234.95)
期货经纪业务净收入	196,658,144.77
期货经纪业务收入	542,740,143.48
期货经纪业务支出	(346,081,998.71)
投资咨询业务净收入	55,496,118.04
投资咨询业务收入	60,816,498.64
投资咨询业务支出	(5,320,380.60)
投资银行业务净收入	821,336,375.86
投资银行业务收入	829,148,930.85
其中：证券承销业务	700,162,004.32
证券保荐业务	52,147,576.69
财务顾问业务(a)	76,839,349.84
投资银行业务支出	(7,812,554.99)
其中：证券承销业务	(7,750,541.23)
财务顾问业务(a)	(62,013.76)
资产管理业务净收入	345,263,147.14
资产管理业务收入	345,793,952.80
资产管理业务支出	(530,805.66)
基金管理业务净收入	287,584,990.71

基金管理业务收入	287,584,990.71
基金管理业务支出	-
合计	<u>4,172,227,023.38</u>
其中：手续费及佣金收入合计	5,112,989,998.29
手续费及佣金支出合计	<u>(940,762,974.91)</u>

(a) 财务顾问业务

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>	
	2022年	
并购重组财务顾问业务净收入		
—境内上市公司		6,900,943.41
其他财务顾问业务净收入		<u>69,876,392.67</u>
合计		<u>76,777,336.08</u>

(2) 手续费及佣金收入的分解

	<u>2022年1月1日至6月30日止期间</u>	
	在某一时点 确认收入	在一段时间内 确认收入
证券经纪及期货经纪业务收入	3,589,645,625.29	-
投资银行业务收入	542,740,143.48	52,147,576.69
资产管理及基金管理业务收入	-	633,378,943.51
投资咨询业务收入	<u>60,816,498.64</u>	-
合计	<u>4,427,463,478.09</u>	<u>685,526,520.20</u>

43 利息净收入

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>	
	2022年	
利息收入		
货币资金及结算备付金利息收入		1,367,693,672.96
融出资金利息收入		2,365,590,474.46
买入返售金融资产利息收入		159,549,344.12
其中：股票质押回购利息收入		<u>52,593,746.39</u>
债权投资利息收入		13,132,507.11
其他债权投资利息收入		<u>812,588,501.30</u>
利息收入小计		<u>4,718,554,499.95</u>
利息支出		
短期借款利息支出		(12,341,880.55)

应付短期融资款利息支出	(401,279,404.51)
拆入资金利息支出	(144,426,622.15)
其中：转融通利息支出	(76,110,850.87)
卖出回购金融资产款利息支出	(1,457,155,598.76)
其中：报价回购利息支出	(238,270,188.09)
代理买卖证券款利息支出	(213,039,136.36)
长期借款利息支出	(7,910,958.91)
应付债券利息支出	(2,110,149,110.56)
其中：次级债券利息支出	(398,868,717.25)
合并结构化主体形成的其他金融负债 利息支出	(33,665,720.15)
租赁负债利息支出	(21,144,696.60)
其他	(32,511,444.21)
利息支出小计	(4,433,624,572.76)
利息净收入	284,929,927.19

44 投资收益

	1月1日至6月30日止期间 2022年
权益法核算的长期股权投资收益	313,336,533.04
金融工具投资收益	(237,982,066.31)
其中：持有期间取得的收益	3,046,029,127.52
—交易性金融工具(1)	3,013,838,871.25
—其他权益工具投资	32,190,256.27
处置金融工具取得的损益	(3,284,011,193.83)
—交易性金融工具(1)	(4,280,582,705.78)
—衍生金融工具	1,009,591,278.98
—债券投资	(19,341,172.21)
—其他债权投资	6,321,405.18
合计	75,354,466.73

(1) 交易性金融工具投资收益明细如下：

	1月1日至6月30日止期间 2022年
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	
其中：持有期间损益	3,033,777,999.70
处置取得损益	(4,294,109,141.76)

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

其中：持有期间损益	(19,939,128.45)
处置取得损益	13,526,435.98

(2) 对联营企业和合营企业的投资收益

参见 13(2)。

(3) 投资收益汇回有无重大限制

于 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本集团投资收益汇回均无重大限制。

45 其他收益

	1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	
	2022 年	与资产相关/与收益相关
政府补助	237,525,333.88	与收益相关

46 公允价值变动损益

	1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	
	2022 年	
衍生金融工具	2,016,714,327.31	
交易性金融资产	1,365,206,239.15	
交易性金融负债	724,887,522.11	
合计	4,106,808,088.57	

47 其他业务收入

	1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	
	2022 年	
大宗商品销售收入	744,243,492.20	
资产出租和保管收入	6,656,098.06	
其他	37,220,878.84	
合计	788,120,469.10	

48 税金及附加

	1月1日至6月30日止期间
	2022年
城市维护建设税	34,439,265.10
教育费附加及地方教育附加	24,639,257.82
其他	7,961,273.23
	<hr/>
合计	67,039,796.15
	<hr/>

49 业务及管理费

	1月1日至6月30日止期间
	2022年
职工费用	3,139,809,723.48
使用权资产折旧费	201,621,331.78
电子设备运转费	87,473,071.97
交易单元费	72,791,806.64
固定资产折旧	72,280,288.92
办公运营费	71,614,553.94
租赁费及物业费	64,641,667.38
无形资产摊销	61,609,229.04
专业服务及咨询费	45,505,171.91
投资者保护基金	37,022,042.61
其他	188,856,402.00
	<hr/>
合计	4,043,225,289.67
	<hr/>

50 信用减值损失

	1月1日至6月30日止期间
	2022年
买入返售金融资产	608,859,264.33
其他债权投资	48,746,046.76
债权投资	24,772,554.92
应收款项	10,442,116.37
其他资产	3,502,963.51
货币资金	112,836.73
融出资金	(11,530,271.48)
	<hr/>
合计	684,905,511.14
	<hr/>

51 其他业务成本

	1月1日至6月30日止期
	2022年
大宗商品销售成本	746,549,566.85
资产出租和保管支出	1,839,641.61
其他	157,101.59
合计	748,546,310.05

52 营业外支出

	1月1日至6月30日止期
	2022年
对外捐赠及赞助支出	35,406,000.00
违约金及赔偿毁损	13,416,676.39
报废非流动资产损失	2,505,627.80
其他	141,107.29
合计	51,469,411.48

53 所得税费用

(1) 本期所得税费用组成

	1月1日至6月30日止期
	2022年
当期所得税费用	367,843,412.57
递延所得税费用	42,671,112.58
汇算清缴差异	3,085,269.58
合计	413,599,794.73

(2) 所得税费用与会计利润的关系

	1月1日至6月30日止期间
	2022年
税前利润	4,033,406,534.52
按中国法定税率 25%计算的所得税	1,008,351,633.63

费用	
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	9,706,839.96
非应纳税收入的影响	(617,713,199.56)
子公司适用不同税率的影响	7,622,657.71
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂	
时性差异的影响	14,532,980.98
汇算清缴差异调整	3,085,269.58
其他	(11,986,387.57)
	<hr/>
所得税费用	413,599,794.73
	<hr/>

54 现金流量表附注

(1) 现金流量表补充资料

(a) 将净利润调节为经营活动现金流量

	1月1日至6月30日止期间
	2022年
净利润	3,619,806,739.79
加： 信用/其他资产减值损失	703,649,678.82
使用权资产折旧	201,621,331.78
固定资产折旧	72,280,288.92
无形资产摊销	61,609,229.04
长期待摊费用摊销	14,993,046.15
投资性房地产折旧	1,839,641.61
处置或报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损益	1,609,717.77
公允价值变动损益	(4,106,808,088.57)
利息净支出	1,727,105,042.72
汇兑损益	21,640,768.48
投资收益	(332,507,022.28)
递延所得税资产增加	(100,585,802.80)
递延所得税负债增加	(21,633,504.90)
交易性金融工具的减少/(增加)	6,251,192,640.48
经营性应收项目的减少/(增加)	5,249,638,299.90
经营性应付项目的增加	11,610,678,379.73
	<hr/>
经营活动产生的现金流量净额	24,976,130,386.64
	<hr/>

(b) 不涉及现金收支的重大经营、投资和筹资活动

于2022年1月1日至6月30日止期间，本集团无不涉及现金收支的重大投资和筹资活动。

(2) 收到的其他与经营活动有关的现金

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2022年
大宗商品贸易收到的现金	845,731,241.14
合并结构化主体净增加的现金	502,062,943.13
收到的政府补助	237,525,333.88
房屋租赁收入	7,043,490.01
其他	35,924,600.38
	<hr/>
合计	1,628,287,608.54

(3) 支付的其他与经营活动有关的现金

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2022年
支付的存出保证金	867,971,171.96
大宗商品贸易支付的现金	912,613,229.63
支付运营和管理费用	405,742,788.40
往来款项支付的现金	1,035,768,582.40
支付专业服务及咨询费	45,505,171.91
资管业务款支付的现金	-
支付租赁费及物业费用	64,641,667.38
支付证券投资者保护基金	21,614,703.72
其他	78,096,871.29
	<hr/>
合计	3,431,954,186.69

(4) 现金及现金等价物净变动情况

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2022年
现金的期末余额	137,033,651,789.25
减：现金的期初余额	(123,766,530,938.06)
加：现金等价物的期末余额	23,903,563,230.26
减：现金等价物的期初余额	(17,732,041,665.70)
	<hr/>
现金及现金等价物净增加额	19,438,642,415.75

(5) 现金及现金等价物的构成

2022年6月30日

货币资金	116,692,503,225.54
其中：库存现金	71,619.77
可随时用于支付的银行存款	111,957,650,946.46
可随时用于支付的其他货币资金	152,728,854.15
三个月以上定期存款	3,865,241,000.00
受限制的货币资金	716,810,805.16
结算备付金	24,923,200,368.87
现金等价物	23,903,563,230.26
期末货币资金、结算备付金及现金等价物	165,519,266,824.67
减：三个月以上定期存款	(3,865,241,000.00)
受限制的货币资金	(716,810,805.16)
期末现金及现金等价物余额	<u>160,937,215,019.51</u>

55 货币性项目

(1) 外币货币性项目

	2022年6月30日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
货币资金			
美元	510,217,705.94	6.71140	3,424,275,111.63
港币	5,436,963,634.03	0.85519	4,649,636,930.20
其他币种			<u>136,127,106.68</u>
合计			<u>8,210,039,148.51</u>
结算备付金			
美元	55,195,901.41	6.71140	370,441,772.73
港币	251,980,700.90	0.85519	<u>215,491,375.60</u>
合计			<u>585,933,148.33</u>
融出资金			
港币	1,789,033,574.10	0.85519	<u>1,529,963,622.23</u>
应收款项			
港币	5,970,823,381.08	0.85519	<u>5,106,188,447.27</u>
存出保证金			

美元	9,506,870.68	6.71140	63,804,411.88
港币	148,561,953.81	0.85519	<u>127,048,697.28</u>
合计			<u>190,853,109.16</u>
其他资产			
· 美元	2,365,156.36	6.71140	15,873,510.39
港币	273,849,877.70	0.85519	<u>234,193,676.91</u>
合计			<u>250,067,187.30</u>
短期借款			
港币	3,002,910,136.21	0.85519	<u>2,568,058,719.39</u>
代理买卖证券款			
美元	652,665,827.78	6.71140	4,380,301,436.56
港币	7,233,740,141.90	0.85519	6,186,222,231.95
其他币种			<u>160,887,806.04</u>
合计			<u>10,727,411,474.55</u>
应付款项			
港币	538,558,679.46	0.85519	<u>460,569,997.09</u>
应付债券			
美元	802,836,432.48	6.71140	<u>5,388,156,432.92</u>
应付短期融资款			
美元	200,899,277.22	6.71140	<u>1,348,315,409.16</u>
其他负债			
港币	352,172,664.45	0.85519	<u>301,174,540.91</u>

(2) 境外经营实体说明

本集团主要境外经营实体为本公司子公司申万宏源(香港)有限公司，其经营地在香港，记账本位币为港币。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定，报告期内未发生变化。