
上海证券有限责任公司

公司债券年度报告

(2022 年)

二〇二三年四月

重要提示

发行人承诺将及时、公平地履行信息披露义务。

本公司董事、高级管理人员已对年度报告签署书面确认意见。公司监事会（如有）已对年度报告提出书面审核意见，监事已对年度报告签署书面确认意见。

发行人及其全体董事、监事、高级管理人员保证年度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担相应的法律责任。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

重大风险提示

一、公司债券的投资风险

（一）利率风险

受国民经济总体运行状况、国家宏观经济、金融货币政策以及国际经济环境变化等因素的影响，市场利率存在波动的可能性。债券属于利率敏感型投资品种，市场利率变动将直接影响债券的投资价值。债券的投资价值在存续期内可能随着市场利率的波动而发生变动，从而使债券投资者持有的债券价值具有一定的不确定性。

（二）流动性风险

证券交易市场的交易活跃程度受到宏观经济环境、投资者分布、投资者交易意愿等因素的影响。因此，债券的投资者在购买债券后可能面临由于债券不能及时挂牌转让无法立即出售债券，或者由于债券挂牌转让后交易不活跃而不能以预期价格或及时出售债券所带来的流动性风险。

（三）偿付风险

发行人目前经营情况、财务状况和资产质量良好，但在债券存续期内，宏观经济环境、资本市场状况、国家相关政策等外部因素以及公司本身的生产经营存在着一定的不确定性，这些因素的变化会影响到公司的运营状况、盈利能力和现金流量，可能导致公司无法如期从预期的还款来源获得足够的资金按期支付本次债券本息，从而使投资者面临一定的偿付风险。

（四）公司债券安排所特有的风险

尽管在债券发行时，发行人已根据现实情况安排了偿债保障措施来控制和降低债券的还本付息风险，但是在债券存续期内，如果由于不可控的市场环境变化导致发行人的经营活动没有获得预期的合理回报，发行人未来的现金流可能会受到影响。如果发行人不能从预期还款来源中获得足额资金，同时又难以从其他渠道筹集偿债资金，则将直接影响债券按期付息或兑付。

（五）担保风险

公司所发行的债券均为无担保债券，在债券存续期内，若因发行人自身的相关风险或受市场环境变化等不可控因素影响，发行人不能从预期的还款来源获得足够资金，则可能影响本次债券本息的按期足额偿付。

（六）评级风险

本次债券无信用评级，由于证券行业外部环境和行业特性的影响，证券公司风险状况可能突然改变，投资者无法从信用评级了解发行人的资信状况，从而可能影响投资者的利益。

（七）资信风险

发行人目前资信状况良好，最近两年的债务偿还率和利息偿付率均为100%，能够按时偿付债务本息。但是，由于宏观经济的周期性波动，在债券存续期限内，如果发生不可控的市场环境变化，发行人可能不能从预期还款来源中获得足额资金，从而影响其偿付到期债务本息，导致发行人资信水平下降。

二、与发行人相关的风险

（一）证券经纪业务风险

证券经纪业务是发行人核心业务之一。市场交易量波动、交易佣金率变化、市场供给变化等因素可能导致发行人证券经纪业务增速放缓或下滑，从而给发行人带来经营风险。

（二）证券信用交易业务风险

信用风险，在信用交易业务开展过程中，由于维持担保比例或履约保障比例低于警戒线且未能追加担保物、不能按期支付利息、到期不偿还信用交易资金、市场交易出现极端情况等原因，信用交易客户未能履行合同义务，可能会导致发行人出现资金损失。此外，客户信用账户若被司法冻结，发行人也可能面临无法及时收回债权的风险。

（三）证券交易投资业务风险

证券市场的系统性风险，证券市场的走势受到国内外政治经济形势、国际证券市场波动及投资者心理预期变化等诸多因素的影响，容易产生较大幅度和较频繁波动。与此同时，当前我国证券市场的投资品种和金融工具较少、关联性高，对冲机制不够完善，金融避险工具品种不够丰富。因此，发行人证券交易投资业务面临证券市场系统性风险。未来，若证券市场行情剧烈波动，发行人证券交易投资业务收益可能随之出现较大波动。

（四）资产管理业务风险

产品投资风险，受证券市场景气程度、投资证券品种内含风险和投资决策等因素的影响，资产管理产品的收益率水平可能无法达到投资者或产品持有人的预期，使得发行人存在经营业绩下滑及声誉受损的风险。

（五）期货业务风险

发行人主要通过全资子公司海证期货从事商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理和风险管理等业务。海证期货在经营管理中不可避免地存在因期货市场周期性变化造成的经营风险、期货经纪和代理结算业务的市场竞争风险、资产管理和投资咨询业务的市场风险、保证金交易的结算风险、业务与产品创新导致的风险以及开展新业务不获批准的风险。

（六）合规风险

近年来，证券监管部门以及证券业自律管理组织着力调整与加强监管职能，按照“依法监管、从严监管，全面监管”的思路，对证券市场与证券业实施严格监管，日常监督管理和处罚力度不断加大。如果发行人及全资或控股子公司、公司从业人员未履行法定义务、出现违法违规行为或风险事件，将可能受到监管检查或立案调查，可能被监管机关采取监管措施。

（七）风险管理和内部控制风险

风险管理和内部控制制度的健全有效是证券公司经营发展的重要前提和保证，由于公司业务处于动态发展的环境中，发行人已建立的风险管理和内部控制体系中用以识别监控风险的模型和数据及管理风险的措施和程序存在无法预见所有风险的可能。同时任何内部控制措施都存在固有限制，可能因其自身的变化、内部治理结构以及外界环境的变化、风险管理当事者对某项事物的认识不足和对现有制度执行不严格等原因导致相应风险。

截至2022年末，公司面临的风险与公司所发行债券募集说明书中所提示的风险没有重大变化

目录

| | |
|----------------------------------|----|
| 重要提示..... | 2 |
| 重大风险提示..... | 3 |
| 释义..... | 6 |
| 第一节 发行人情况..... | 7 |
| 一、 公司基本信息..... | 7 |
| 二、 信息披露事务负责人..... | 7 |
| 三、 控股股东、实际控制人及其变更情况..... | 8 |
| 四、 报告期内董事、监事、高级管理人员的变更情况..... | 9 |
| 五、 公司业务和经营情况..... | 9 |
| 六、 公司治理情况..... | 18 |
| 七、 环境信息披露义务情况..... | 21 |
| 第二节 债券事项..... | 21 |
| 一、 公司信用类债券情况..... | 21 |
| 二、 公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况..... | 25 |
| 三、 公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况..... | 25 |
| 四、 公司债券募集资金使用情况..... | 27 |
| 五、 发行人或者公司信用类债券报告期内资信评级调整情况..... | 32 |
| 六、 公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施情况..... | 32 |
| 七、 中介机构情况..... | 35 |
| 第三节 报告期内重要事项..... | 36 |
| 一、 财务报告审计情况..... | 36 |
| 二、 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正..... | 36 |
| 三、 合并报表范围调整..... | 36 |
| 四、 资产情况..... | 37 |
| 五、 非经营性往来占款和资金拆借..... | 38 |
| 六、 负债情况..... | 38 |
| 七、 利润及其他损益来源情况..... | 40 |
| 八、 报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十..... | 41 |
| 九、 对外担保情况..... | 41 |
| 十、 重大诉讼情况..... | 41 |
| 十一、 报告期内信息披露事务管理制度变更情况..... | 41 |
| 十二、 向普通投资者披露的信息..... | 42 |
| 第四节 特定品种债券应当披露的其他事项..... | 42 |
| 一、 发行人为可交换债券发行人..... | 42 |
| 二、 发行人为非上市公司非公开发行可转换公司债券发行人..... | 42 |
| 三、 发行人为绿色债券发行人..... | 42 |
| 四、 发行人为永续期公司债券发行人..... | 42 |
| 五、 其他特定品种债券事项..... | 42 |
| 第五节 发行人认为应当披露的其他事项..... | 42 |
| 第六节 备查文件目录..... | 43 |
| 财务报表..... | 45 |
| 附件一： 发行人财务报表..... | 45 |

释义

| | | |
|-------------|---|---------------------------------|
| 公司/本公司/上海证券 | 指 | 上海证券有限责任公司 |
| 母公司 | 指 | 上海证券有限责任公司 |
| 股东会 | 指 | 上海证券有限责任公司股东会 |
| 董事会 | 指 | 公司股东会选举产生的公司董事会 |
| 高级管理人员 | 指 | 公司董事会聘任的高级管理人员 |
| 上海市国资委 | 指 | 上海市国有资产监督管理委员会 |
| 海证期货 | 指 | 海证期货有限公司 |
| 融资融券 | 指 | 证券公司向客户出借资金供其买入证券、出借证券供其卖出的经营活动 |
| 工作日 | 指 | 国内商业银行的对公营业日（不包括法定节假日和休息日） |
| 交易日 | 指 | 上海证券交易所的正常营业日 |
| 元 | 指 | 如无特别说明，指人民币元 |

本报告中部分合计数与各加数直接相加之和在尾数上有差异，这些差异是由四舍五入造成。

第一节 发行人情况

一、公司基本信息

| | |
|-----------|-------------------------------------|
| 中文名称 | 上海证券有限责任公司 |
| 中文简称 | 上海证券 |
| 外文名称（如有） | Shanghai Securities Company Limited |
| 外文缩写（如有） | - |
| 法定代表人 | 何伟 |
| 注册资本（万元） | 532,653.20 |
| 实缴资本（万元） | 532,653.20 |
| 注册地址 | 上海市 黄浦区四川中路 213 号 7 楼 |
| 办公地址 | 上海市 黄浦区四川中路 213 号 7 楼、8 楼、16 楼 |
| 办公地址的邮政编码 | 200002 |
| 公司网址（如有） | www.shzq.com |
| 电子信箱 | shzq@shzq.com |

二、信息披露事务负责人

| | |
|---------------|--|
| 姓名 | 吴佳 |
| 在公司所任职务类型 | <input type="checkbox"/> 董事 <input checked="" type="checkbox"/> 高级管理人员 |
| 信息披露事务负责人具体职务 | 总经理助理、董事会秘书 |
| 联系地址 | 上海市黄浦区四川中路 213 号 8 楼 |
| 电话 | 021-53686666 |
| 传真 | 021-53686100 |
| 电子信箱 | wujia@shzq.com |

三、控股股东、实际控制人及其变更情况

（一）报告期末控股股东、实际控制人信息

报告期末控股股东名称：百联集团有限公司

报告期末实际控制人名称：上海市国资委

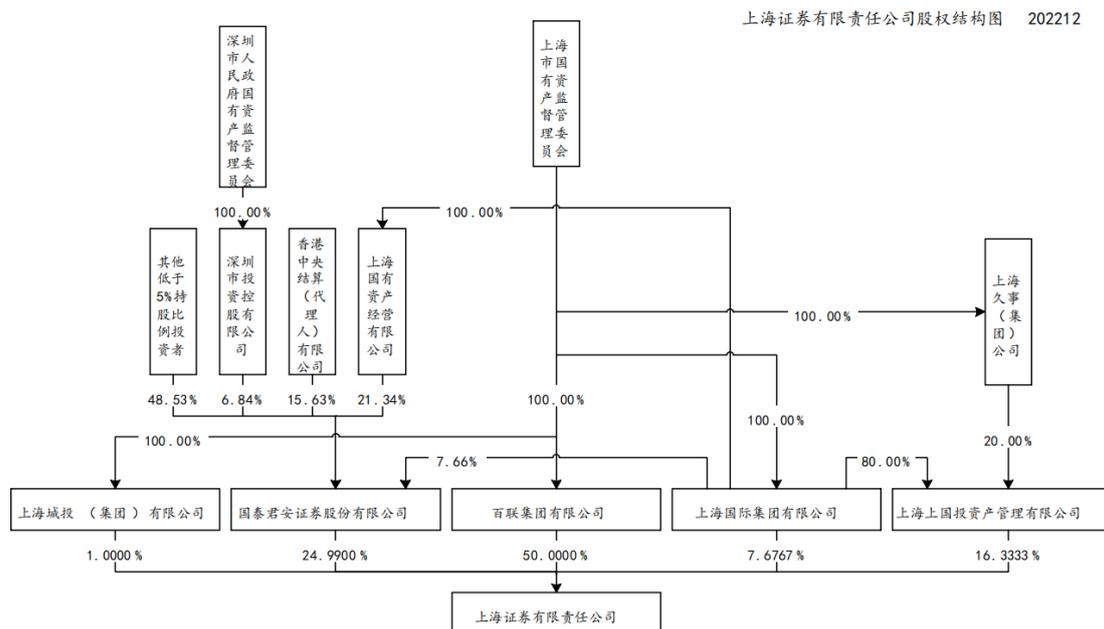
报告期末控股股东资信情况：良好

报告期末实际控制人资信情况：良好

报告期末控股股东对发行人的持股比例及股权¹受限情况：持股 50%，无受限情况

报告期末实际控制人对发行人的持股比例及股权受限情况：持股 0%，无受限情况

发行人与控股股东、实际控制人之间的产权及控制关系的方框图（有实际控制人的披露至实际控制人，无实际控制人的披露至最终自然人、法人或结构化主体）



注:上海国际集团有限公司、上海国有资产经营有限公司、深圳市投资控股有限公司持有国泰君安证券股份有限公司的持股权比例为其 A 股持股比例,其持有的国泰君安证券股份有限公司的 H 股,由香港中央结算(代理人)有限公司作为名义持有人持有。

控股股东为机关法人、国务院组成部门或相关机构直接监管的企业以外主体或者实际控制人为自然人

适用 不适用

（二）报告期内控股股东的变更情况

适用 不适用

（三）报告期内实际控制人的变更情况

适用 不适用

¹均包含股份,下同。

四、报告期内董事、监事、高级管理人员的变更情况

（一）报告期内董事、监事、高级管理人员是否发生变更

√发生变更 □未发生变更

| 变更人员类型 | 变更人员名称 | 变更人员职务 | 变更类型 | 决定（议）时间或辞任生效时间 | 工商登记完成时间 |
|--------|--------|--------|------|----------------|------------|
| 董事 | 罗国华 | 董事 | 聘任 | 2022.02.14 | 2022.02.22 |
| 高级管理人员 | 罗国华 | 总经理 | 聘任 | 2022.02.14 | 2022.02.22 |
| 高级管理人员 | 张艳红 | 副总经理 | 聘任 | 2022.02.14 | - |
| 高级管理人员 | 谢华 | 总经理助理 | 辞任 | 2022.04.22 | - |
| 高级管理人员 | 欧阳琛 | 合规总监 | 聘任 | 2022.07.18 | - |

（二）报告期内董事、监事、高级管理人员离任人数

报告期内董事、监事、高级管理人员的离任（含变更）人数：1人，离任人数占报告期初全体董事、监事、高级管理人员总人数4.76%。

（三）定期报告批准报出日董事、监事、高级管理人员名单

定期报告批准报出日发行人的全体董事、监事、高级管理人员名单如下：

发行人的法定代表人：何伟

发行人的董事长或执行董事：何伟

发行人的其他董事：罗国华、赵斌、李峰、肖敏、喻健、李俊杰、陈志刚、吕劲新、李志强、梁国勇、佟爱琴

发行人的监事：谷峰、张悦、贾亚南

发行人的总经理：罗国华

发行人的财务负责人：罗国华

发行人的其他非董事高级管理人员：吴君年、张艳红、褚卫忠、欧阳琛、李国柱、吴佳

五、公司业务和经营情况

（一）公司业务情况

1.报告期内公司业务范围、主要产品（或服务）及其经营模式、主营业务开展情况

业务范围：许可项目：证券业务（证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券（不含股票、上市公司发行的公司债券）承销；证券自营；证券资产管理；融资融券业务；代销金融产品业务）；证券投资基金销售服务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，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】。

主要业务情况：

（一）财富管理业务

报告期内，公司财富管理业务转型加快。主要表现为：新增客户总量、客户资产显著

提升，金融产品代销工作延续前一年较好的发展态势。其中，手续费及佣金净收入 5.39 亿元，股基交易市场份额 0.4132%，同比下降 3.17%。

报告期内，新增合格客户数 15.42 万户，同比增加 13.52%，累计合格客户总量 135.51 万户，同比增加 10.65%。其中，50 万以上中高端客户 5.27 万户，同比减少 9.80%。新增客户引入资产 267.67 亿元，同比增加 129.42%。报告期末，经纪业务客户总资产 2,965 亿元，同比减少 6.05%。

报告期内，公司搭建种类丰富、体系完整的产品中心，初步实现全流程管理，践行以客户为中心的产品销售理念。年内，代销外部产品 126.98 亿元，同比增加 60.82%，外部金融产品日均保有量达到 81.56 亿元，同比增长 17.62%。其中，公募非货币产品日均保有量达到 39.53 亿元，较上年增幅为 7.48%。

报告期内，新增私募机构 155 家，私募机构总数 695 家，新增私募资产净规模 11.93 亿元，期末私募资产 164.17 亿元。

公司代理买卖证券业务交易量情况表

单位：（人民币）元

| 项目 | 2022 年交易额 | 2022 年佣金收入 |
|------------------|-----------------------------|-----------------------|
| A 股 ² | 1,900,398,348,390.77 | 626,668,272.48 |
| B 股（折人民币） | 2,701,536,169.85 | 1,566,481.47 |
| 全国股转系统挂牌股票 | 730,242,561.15 | 591,062.96 |
| 公募基金 | 88,711,498,825.11 | 11,593,145.48 |
| 债券 | 65,183,318,884.63 | 12,015,463.11 |
| 沪港通 | 9,795,334,751.42 | 4,464,233.55 |
| 深港通 | 8,412,658,150.26 | 3,805,556.83 |
| 存托凭证 | 268,674,657.15 | 88,823.34 |
| 场内期权 | 2,529,518.00 | 3,931,405.30 |
| 债券融券回购交易 | 1,196,185,096,000.00 | 12,275,850.06 |
| 北交所股票 | 2,852,793,418.19 | 2,103,154.98 |
| 总计 | 3,275,242,031,326.53 | 679,103,449.56 |

销售金融产品情况表

单位：（人民币）元

| 项目 | 2022 年产品销售增加 | | 2022 年产品销售减少 | |
|-------------------|--------------|-------------------|--------------|-------------------|
| | 数量 | 金额 | 数量 | 金额 |
| 收益凭证 | 11 | 122,750,000.00 | 2 | 25,100,000.00 |
| 公募基金 ³ | 3,868 | 6,272,918,663.41 | 3,193 | 6,401,273,336.30 |
| 基金公司及其子公司资产管理计划 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 私募基金 | 55 | 349,206,391.50 | 104 | 681,848,326.84 |
| 证券公司资产管理计划 | 48 | 36,937,819,728.20 | 53 | 32,449,023,945.69 |

² 项目 A 股包括 A 股主板、A 股创业板、A 股科创板

³ 不包含 ETF 股票申购

| | | | | |
|-----------------|--------------|--------------------------|--------------|--------------------------|
| 其中：本公司资产管理计划 | 47 | 36,934,129,728.20 | 52 | 32,435,884,325.35 |
| 其它公司资产管理计划 | 1 | 3,690,000.00 | 1 | 13,139,620.34 |
| 期货公司及其子公司资管产品 | 3 | 57,050,000.00 | 22 | 52,594,954.61 |
| 商业银行及其理财子公司理财产品 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 信托产品 | 9 | 40,110,000.00 | 25 | 149,334,138.39 |
| 保险产品 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 其他金融产品 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| 总计 | 3,994 | 43,779,854,783.11 | 3,399 | 39,759,174,701.83 |

（二）机构业务

报告期内，公司机构业务完成了服务体系搭建工作，推动场外衍生品业务稳健发展，机构业务实现收入 0.26 亿元，场外衍生品规模达 15.95 亿元。报告期内，公司打造具有竞争力的基金投研数据平台和 2B 基金代销平台，基金评价中心荣获“2022 年度百联集团创新优秀奖证券期货科学技术奖”。同时，机构业务协同业务成绩突出，引入战略客户华策影视，累计投资公司资管产品 0.6 亿元，引入上海北外滩集团，新增债券承销业务规模 12 亿元，引入公募基金（恒越基金），落地公司首单券结模式业务。

（三）资产管理业务

报告期内，公司资产管理业务固本开源，根据各业务板块现状全面布局，重点出击，加快新产品落地，实现业务量质齐升。报告期内，新设产品 21 只，期末资产管理总规模约 331 亿元，较上个报告期末增幅 89%；其中集合资管规模 48.22 亿元，单一资管规模 253.45 亿元，专项资管规模 29.29 亿元。

公司资产管理规模情况表

单位：（人民币）元

| 产品分类 | 截至 2021 年末 | 截至 2022 年末 |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 大集合资产管理计划 | 1,610,707,179.04 | 1,405,509,361.51 |
| 集合资产管理计划 | 2,084,507,782.22 | 3,416,986,500.65 |
| 单一资产管理计划 | 12,699,290,006.65 | 25,345,436,361.00 |
| 专项资产管理计划 | 1,149,253,341.25 | 2,928,881,067.08 |
| 合计 | 17,543,758,309.16 | 33,096,813,290.24 |

（四）证券投资业务

报告期内，公司证券投资业务实现投资收益收入 6.04 亿元。权益类投资从基本面出发，在整体保持均衡配置的基础上，更加注重仓位管理及结构调整，积极把握长期投资价值和结构性投资机会，直接投资部分收益率大幅跑赢沪深 300 指数。固定收益类投资以配置流动性较好的央企债券为主，并积极进行长久期利率债的波段交易，同时加强利率衍生品的交易和挖掘其他类固收产品的投资价值，加强组合收益率。报告期内固定收益类投资实现收益率 7.3%，大幅超越同期指数表现及市场平均水平。

公司证券投资业务情况表

单位：（人民币）元

| 项目 | 2022 年 | 2021 年 | 增减百分比(%) |
|----------------|-----------------|----------------|----------|
| 其他债权投资持有期间收益 | 694,509,141.50 | 638,404,105.97 | 8.79% |
| 证券投资收益 | 320,000,198.98 | 429,895,408.05 | -25.56% |
| 其中：处置交易性金融工具收益 | -119,698,270.18 | 96,541,954.74 | -223.99% |

| | | | |
|------------|-----------------------|-------------------------|----------------|
| 处置其他债权投资收益 | 214,423,708.25 | 143,832,346.76 | 49.08% |
| 处置衍生金融工具收益 | 14,469,830.66 | 696,659.57 | 1977.03% |
| 处置其他金融工具收益 | | | |
| 金融资产持有期间收益 | 210,804,930.25 | 188,824,446.98 | 11.64% |
| 公允价值变动损益 | -410,010,904.71 | -31,117,944.97 | -1217.60% |
| 其中：交易性金融工具 | -408,870,115.61 | -33,639,694.70 | -1115.44% |
| 衍生金融工具 | -1,140,789.10 | 2,521,749.73 | -145.24% |
| 合计 | 604,498,435.77 | 1,037,181,569.05 | -41.72% |

（五）信用业务

报告期内，公司积极发展融资融券业务。通过优化营销策略，持续引入自然人高净值客户、机构和产品户，全年信用开户净增 918 户。报告期末，公司融资融券客户数达 27542 户，融资融券余额 73.56 亿元，融资融券市场份额 0.48%。同时，公司审慎开展股票质押业务，继续压缩股票质押业务规模。报告期末，公司股票质押业务规模 8.31 亿元。

公司信用业务情况表

| 项目 | 2022 年末 | 2021 年末 | 增减百分比(%) |
|---------------------|---------|---------|----------|
| 融出资金余额(人民币亿元) | 70.43 | 85.87 | -17.98% |
| 融出证券市值(人民币亿元) | 3.13 | 5.76 | -45.66% |
| 股票质押待回购余额(人民币亿元) | 8.31 | 8.61 | -3.48% |
| 约定购回式交易待回购余额(人民币亿元) | 0 | 0 | 0.00% |

（六）投行业务

报告期内，公司投行业务债券承销亮点较多，多个项目创下单笔发行的区域记录。其中“22 沧港 01”发行规模 20 亿元，为近一年以来同评级、同品种债券最大单笔发行规模，也为公司历年承销的公司债中最大单笔发行规模。“22 沧港 01/02”合计发行规模 38 亿元，为河北省 2022 年同一发行主体累计发行同品种债券规模第一。“22 北外滩”是北外滩集团首次发行公司债券，也是虹口区属国有企业首次尝试的直接融资，发行利率 2.90%，创造了上海市同评级同品种信用债票面利率历史最低记录。报告期内，完成债券主承销项目 16 期，发行规模 101.97 亿元。债券主承销项目发行规模行业排名第 64 位，与去年持平，新签债券承销项目 28 个，期末承做项目 29 个。2022 年，公司参与地方政府债券承销团包括安徽省、大连市、贵州省等 10 个。全年累计承销地方债 44 只，承销规模 18.60 亿元，实现收入 463.20 万元，同比逆势增长 131.60%。

公司承销业务情况表

单位：万元

| 承销方式 | 项目类型 | 承销家数 | | 承销金额 | | 承销佣金收入 | |
|---------|-----------|-----------|-----------|---------------------|---------------------|-----------------|------------------|
| | | 2022 年 | 2021 年 | 2022 年 | 2021 年 | 2022 年 | 2021 年 |
| 主承销 | 企业债 | 1 | 2 | 80,000.00 | 153,000.00 | 756.00 | 560.00 |
| | 公司债 | 15 | 22 | 939,700.00 | 1,265,000.00 | 7,118.74 | 9,847.25 |
| | 其他 | 0 | 1 | 0 | 65,000.00 | 0 | 150.00 |
| | 合计 | 16 | 25 | 1,019,700.00 | 1,483,000.00 | 7,874.74 | 10,557.25 |
| 副主承销及分销 | 企业债 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 公司债 | 11 | 4 | 167,600.00 | 111,500.00 | 212.26 | 697.50 |
| | 其他 | 44 | 29 | 186,000.00 | 236,647.00 | 463.20 | 200.02 |

| | | | | | | |
|----|----|----|------------|------------|--------|--------|
| 合计 | 55 | 33 | 353,600.00 | 348,147.00 | 675.46 | 897.52 |
|----|----|----|------------|------------|--------|--------|

（七）研究业务

报告期内，研究业务秉承“内外并举，双轮驱动”的发展战略，积极推进卖方研究服务和对内服务，研究质量、合规风控、人才引进等方面皆有显著进展，逐步建立符合市场需求的多层次研究服务体系。研究业务对外打造研究所品牌特色，提供差异化服务和专项定制服务，不断提高公司声誉、扩大公司影响力，研究报告产出、电话会议及路演数量大幅增加；对内赋能经纪业务、财富管理等业务线发展，加强业务协同能力，助力公司打造综合金融服务平台。

（八）期货业务

报告期内，子公司海证期货完成对其风险管理子公司的增资工作，加快推动了集团内产融结合、期现结合的发展方向。期货客户总量增长 23.48%，千万以上客户数增长 18.69%，期末客户权益同比增加 17.49%，代理交易份额减少 21.4%。优势交易品种的交易量和持仓量市场排名总体保持稳定，部分指标进入行业前 20 位。期货子公司分类评级保持 B 类 BBB 级，连续四年获得“中国最具成长性期货公司”殊荣。

2.报告期内公司所处行业情况，包括所处行业基本情况、发展阶段、周期性特点等，以及公司所处的行业地位、面临的主要竞争状况，可结合行业特点，针对性披露能够反映公司核心竞争力的行业经营性信息

目前，资本市场改革政策持续不断颁布，新型产品不断推出，国家致力于推动金融供给侧改革，一系列重磅政策的落地，直接融资比重将进一步提升。证券公司作为资本市场的核心中介机构，未来十年证券行业发展将享受资本市场改革红利。2022 年，我国资本市场体量和活跃度持续提升，以北交所快速落地为代表，权益市场扩容与多层次资本市场建设将成为未来几年重要的长期趋势性变化，预计我国证券化率将提升。2022 全年 A 股三大指数集体走强，全年上证综指、深圳成指、创业板指分别上涨 4.80%、2.67%、12.02%。沪深两市全年股票成交额 257 万亿元，创下 A 股全年成交额新纪录。

根据证券业协会发布的证券公司 2022 年度经营数据，全行业 140 家证券公司实现营业收入 3949.73 亿元，实现净利润 1423.01 亿元。截至 2022 年末，行业总资产为 11.06 万亿元，净资产为 2.79 万亿元，净资本 2.09 万亿元，分别较上年末增长 4.41%、8.52%、4.69%。

我国证券行业发展特征：

（1）资本市场深改加速推进，服务实体经济发展作用更为突出

伴随着中国经济转型发展，中国逐步建立起结构合理、功能完善的多层次资本市场体系，资本市场在国民经济发展中的地位和重要性日益提高，2020-2022 年资本市场深改政策频出，监管层围绕全面深化资本市场改革工作 12 项重点任务出台多项措施。其中，以注册制为突破口，涵盖发行、上市、信披以及退市等基础制度改革持续推进，北交所设立，再融资松绑超预期，公司债、企业债注册制落地，科创板发行常态化，创业板注册制落地，新三板精选层推出，直接融资大发展，“十四五规划”定调注册制全面推行，多项基础制度改革不断优化 A 股市场存量结构，标志我国多层次资本市场全面启动质效改革，规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场正在形成。随着多层次资本市场体系不断完善，以信息披露为核心的基础制度持续构建的基础上，券商深度参与培育发行主体、询价定价、维护交易、风险管理、投资者适当性管理等多个环节，进一步推进资本市场稳健运行，持续增强服务实体经济功能。

（2）政策与经济双重顺周期，市场面叠加政策面推动业绩向好

面临着资本市场深化改革持续推进和市场交投活跃度同比大幅提升双重利好的背景下，2020-2022 年证券行业抓住机遇加快业务转型，加强能力建设，积极服务实体经济和居民财富管理，经营情况整体向好，券商各业务板块保持高态势增长，活跃度提升和注册制红

利下手续费型业务占比持续提升，金融资产投资和两融业务等资金型业务稳步扩张，财务管理、大投行及机构客需型业务等创新型业务成长性不断凸显。根据证券业协会发布的证券公司2022年度经营数据，全行业140家证券公司实现营业收入3949.73亿元，实现净利润1423.01亿元。

（3）券商迈入头部效应时代，强者恒强市场竞争格局日益明显

受益于中国迅速发展的多层次资本市场所带来的重大机遇，中国证券行业获得了长足的发展，并呈现出行业集中度提高、重资产与轻资产业务并重等发展特征。从业务发展角度来看，发行制度变革、财富管理转型、资产管理去通道和衍生品业务的“马太效应”，加速行业集中度提升。从行业监管角度来看，分类监管的强化，风控指标的修订，航母级券商的打造，监管层“扶优限劣”的导向也在日益强化行业集中度加速提高，前十大证券公司头部效应显著，核心业务市占率进一步提升，“马太效应”愈加明显。

展望未来，全面推进注册制改革、畅通多元化退市渠道、引入长线资金入市、完善基础制度安排，深化金融“对外开放”等改革政策发布有望进一步激发市场活力和发展潜能，为证券公司带来新的利润增长点，但仍存在国际形势错综复杂，国内经济筑底企稳有待确认，市场行情波动较大等因素，证券公司如何把握多层次资本市场建设带来的关键发展机遇，有效防范化解风险，在合规前提下拥抱创新，将是立足未来，行稳致远的的关键。

我国证券行业发展趋势：

（1）资本市场改革有序推进，券商升级进入加速时期

多层次资本市场深化改革持续推进，证券行业迎来战略机遇期。政策引导释放改革信号，2019年资本市场多项改革部署铺开，2020年再融资新规、新证券法、新三板精选层、创业板注册制等渐次落地，2021年匹配中小企业融资、鼓励创新发展的北交所设立，标志我国多层次资本市场全面启动质效改革。2020年11月3日“十四五”规划定调全面推行注册制，完善基础制度安排、进一步深化“对外开放”、吸引长期资金入市、多层次资本市场重塑并承接相应产业的融资需求等政策有望落地开花。注册制全面推进过程中IPO加速为大投行带来极大业务空间，居民大类资产配置和中长线资金流入为财富管理打开业务“天花板”，证券公司将向以客户需求为出发点，协同打造以创业投资、投资银行与高端财务管理为核心的综合金融服务体系转型升级，实现全业务链协同和价值延伸。

（2）资本市场持续深化扩容，券商业绩出现利好消息

随着资本市场地位的空前提高，各项政策措施进入一砖一瓦的实施阶段，资本市场不仅会在稳经济、稳金融、稳预期等方面发挥更积极的作用，也将给市场各参与主体带来重大战略机遇。未来三到五年我国资本市场将进入持续扩容阶段，注册制的全面实施将使更加多元化的资产嫁接资本市场，融资规模将保持在高位，各类中长期资金入市比例和范围逐步放宽，社保基金、保险资金、企业年金等入市规模将逐步提升，带动市场交投活跃度持续提高，利好证券行业经纪业务、两融业务。

（3）金融科技推动行业发展，构建全新商业竞争模式

金融科技是推动金融转型升级的新引擎、金融服务实体经济的新途径、促进普惠金融发展的新机遇、防范化解金融风险的新利器。互联网时代背景下，“金融+科技”融合发展模式正逐步改变证券行业服务客户模式，券商通过加强金融科技平台的建设，提升企业线上获客能力，促进财富管理转型，进行智能投顾、智能交易、智能运营等多方面运用，以金融科技赋能助力服务升级与业务创新，实现动力变革、效率变革、质量变革，进一步推动证券行业高质量发展。

（4）证券行业分化发展，券商竞争格局发生变革

大财富管理、大资管、大投行时代已然来临，2020年以来市场股基交投活跃、注册制下企业上市加速、市场产品化、机构化特征愈发显著，市场全面加速扩容，资产配置趋向资本市场集中。混业趋势下银行业的参与竞争、金融科技变革下科技公司的参与竞争、开

放新格局下外资投行的参与竞争、行业马太效应下的内部竞争，同业兼并、混业融合的行业生态已初步显现，市场竞争日益激烈。随着资本市场改革的不断深化，大型券商不断对现有业务进行改造和优化，呈现头部券商集中化的趋势；中小券商则在寻求差异化发展的道路上不断探索，未来头部券商航母化和精品券商差异化共存的格局或有望形成。新证券法实施、注册制改革推进，对外开放节奏加速，金融科技赋能等，均为证券业重塑新格局、迈向高质量发展创造了契机与条件。

公司行业地位及竞争情况：

（1）明显的区域优势和广阔的发展空间

上海作为我国最大的经济中心城市，在国家发展大局中占有重要位置。目前，上海已经初步建成由证券市场、货币市场、外汇市场、保险市场、期货市场和金融衍生品市场等构成的比较健全的全国性金融市场体系，成为中国最大的证券、保险、期货、外汇和黄金交易市场。在上海启动国际金融中心建设的大环境下，公司将迎来更大的发展空间。

（2）有效的公司治理和丰富透明的管理团队

公司按照现代企业制度的要求建立了规范的治理结构并有效运行。公司董事会、监事会、监事会及经理层各司其职，相互制衡，有利于保障股东的合法利益，保证了公司持续、独立和稳定的经营。

公司现任高级管理层均长期从事证券行业相关管理工作，拥有丰富的战略实施、业务运营和财务管理经验。公司管理层及各业务团队的情况均在公司网站予以公开，所有人的工作业绩和诚信情况将直接接受市场的检验。公司管理团队形成了稳健、诚信、务实的经营风格，强调以长期盈利为目标，注重增强公司核心竞争力。

（3）稳健进取的经营模式

公司自成立以来即以“诚信、专业”的核心价值理念指导公司的业务经营，以诚信经营为根本，以专业服务为中心；规范运作、稳健务实，在市场上树立了良好的企业形象。

多年来，公司坚持可持续发展的经营原则，不以谋求高风险状态下的短期高额利润为目标。在此原则下，公司凭借卓有成效的集约化管理，打造了风险可控、结构均衡、盈利稳定的业务体系。稳健进取的经营模式不仅能够使公司降低资本市场低迷和大幅波动时的系统性风险影响，而且能够使公司抓住机遇，分享市场繁荣时的各种盈利机会，实现快速增长。

（4）强大的股东背景

本公司的主要股东为百联集团有限公司（持股 50.00%）和国泰君安证券股份有限公司（持股 24.99%）。

本公司是百联集团的控股子公司。百联集团是中国上海市属大型国有重点企业，由原上海一百集团、华联集团、上海友谊集团、上海物资集团合并重组的大型国有商贸流通产业集团，挂牌成立于 2003 年 4 月。截至 2022 年末，百联集团注册资本 10 亿元。主要业务涵盖主题百货、购物中心、奥特莱斯、大型卖场、标准超市、便利店、专业专卖等零售业态，经营有色金属、黑色金属、汽车、化轻、机电、木材、燃料等大宗物资贸易，涉及电子商务、仓储物流、消费服务、电子信息等领域。本次拟以增资扩股的方式控股上海证券是对集团旗下金融板块的一个补充。目前百联集团控股百联股份（A、B 股）、联华超市（H 股）、上海物贸（A、B 股）、第一医药（A 股）4 家境内外上市公司。

本公司实际控制人为上海市国资委，主要股东及其所投资企业均为行业内影响巨大的标杆企业，本公司将依托该优势，凭借与上海市政府的良好关系，以“上海力量”为客户创造价值，提供全面、专业、个性化的金融类服务。

（5）网点和营销渠道优势

截至 2022 年末，公司下设 6 家分公司和 75 家证券营业部，已形成以上海为中心，北

京、深圳、重庆、温州、南京、杭州等发达城市为主体的经营网络。公司健全而高效的营销渠道有利于充分满足各类客户的需求，为客户提供良好的服务，建立稳固的客户关系。因此，营业网点优势使公司具有强大的渠道和客户优势，也为公司的业务拓展和创新提供了强大的支持。

（6）审慎的风险管理和内部控制

公司一贯秉持“诚信、专业”的核心价值观，以诚信经营为根本，以专业服务为中心；规范运作、稳健务实、开拓进取、和谐创新。在组织架构方面，公司建立了包括董事会（下设战略与投资决策委员会、提名、薪酬与考核委员会、审计委员会、风险控制委员会）、各业务部门和管理部门、各营业部的顺序递进、权责统一、严密有效的三级风险控制体系，对各项风险进行控制和管理。在业务开展方面，公司建立了以净资本为核心的风险控制体系，并实时进行净资本监控，确保公司各项业务在合规开展的同时，公司净资本各项指标仍然符合监管机构规定的标准，从而将风险控制在公司可测、可控、可承受的范围，确保公司持续、稳定、健康发展。

3. 报告期内公司业务、经营情况及公司所在行业情况是否发生重大变化，以及变化对公司生产经营和偿债能力产生的影响

未发生重大变化

（二） 新增业务板块

报告期内发行人合并报表范围新增收入或者利润占发行人合并报表相应数据 10%以上业务板块

是 否

（三） 主营业务情况

1. 分板块、分产品情况

（1）业务板块情况

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 (%) |
| 手续费及佣金净收入 | 8.40 | | | 29.38 | 9.80 | | | 42.97 |
| 利息净收入 | 7.95 | | | 27.78 | 8.69 | | | 38.11 |
| 投资收益 | 3.49 | | | 12.19 | 4.31 | | | 18.88 |
| 公允价值变动损益 | -4.32 | | | -15.09 | -0.68 | | | -2.98 |
| 汇兑收益 | 0.04 | | | 0.12 | -0.01 | | | -0.04 |
| 资产处置损益 | 0.00 | | | 0 | 0.28 | | | 1.22 |
| 其他收益 | 0.40 | | | 1.41 | 0.20 | | | 0.89 |
| 其他业务 | 12.65 | | | 44.21 | 0.21 | | | 0.94 |

| 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 (%) |
| 收入 | | | | | | | | |
| 税金及附加 | | 0.15 | | | | 0.19 | | |
| 业务及管理费 | | 11.16 | | | | 13.31 | | |
| 信用减值损失 | | 1.37 | | | | -0.49 | | |
| 其他资产减值损失 | | 0.01 | | | | 0.00 | | |
| 其他业务成本 | | 12.60 | | | | 0.00 | | |
| 合计 | 28.61 | 25.29 | 11.59 | | 22.80 | 13.01 | 42.92 | |

(2) 各产品（或服务）情况

适用 不适用

见“五、公司业务和经营情况”-“(一)公司业务情况”。

2. 收入和成本分析

各业务板块、各产品（或服务）营业收入、营业成本、毛利率等指标同比变动在 30%以上的，发行人应当结合所属行业整体情况、经营模式、业务开展实际情况等，进一步说明相关变动背后的经营原因及其合理性。

报告期内，公司公允价值变动损益较上年减少 536.04%，主要原因是今年证券市场下跌，公司交易性金融资产公允价值变动收益下降所致。

报告期内，汇总收益较上年增加 486.69%，主要原因是今年美元兑人民币汇率上升，公司美元资产折本币汇兑收益增加所致。

报告期内，资产处置收益较上年减少 100.05%，主要原因是去年公司处置使用权资产产生收益所致。

报告期内，其他收益较上年增加 97.99%，主要原因是今年公司获取政府补助较去年增加所致。

报告期内，其他业务收入较上年增加 5825.87%，主要原因是今年公司子公司开展基差业务规模增加，收入增长所致。

报告期内，信用减值损失较上年增加 376.34%，主要原因是今年公司股票质押式回购业务计提信用减值损失较去年增加所致。

报告期内，其他业务成本较上年增加 528307.9%，主要原因是今年公司子公司开展基差业务规模增加，成本增长所致。

(四) 公司关于业务发展目标的讨论与分析

1. 结合公司面临的特定环境、所处行业及所从事业务的特征，说明报告期末的业务发展目标

上海证券始终坚持高质量发展，以客户需求为导向，通过“科技引领、财富驱动”，矢志成为“特色鲜明、区域领先、品牌知名”的优质财富管理型券商。

公司秉承“开放、包容、规范、协同”的核心理念，坚持效益、质量、规模、结构协调发展，积极探索金融创新，努力打造“上海证券”经营品牌，资产规模持续扩大，经营实力

不断增强，取得了显著的社会效益和经济效益。

展望未来，公司将按照“综合化经营、差异化竞争”的战略，立足普惠金融，以最佳产品和服务为指引，加大互联网金融实践，提升客户体验，竭力为广大投资者提供更新更好的金融服务。

2.公司未来可能面对的风险，对公司的影响以及已经采取或拟采取的措施

证券经纪业务是公司核心业务之一。2020-2022年，公司证券经纪业务手续费净收入分别为7.19亿元、8.24亿元和7.24亿元，对营业总收入的贡献度分别达到42.00%、36.14%和25.31%。市场交易量波动、交易佣金率变化、市场供给变化等因素可能导致公司证券经纪业务增速放缓或下滑，从而给公司带来经营风险。

随着证券经纪业务通道服务竞争日益激烈以及券商新设网点大量增加，行业交易佣金率平均水平呈下滑趋势。未来，随着行业竞争日益激烈以及互联网证券等新业务模式的冲击，公司证券经纪业务面临交易佣金率较大幅度下滑的风险。

公司积极推进经纪业务转型发展，修订《上海证券有限责任公司员工市场化管理办法》和《上海证券有限责任公司营业部三定方案》等制度，确保分支机构员工市场化改革全面落地。制定《公司经纪业务轻型营业网点发展指导意见》，推动分支机构差异化发展，明确新型网点发展的指导思想、基本原则和工作目标，推动轻型营业部有序发展。

公司为完善经纪业务精细化管理机制，提高中台统筹协调效率，三管齐下制定《上海证券财富管理业务委员会工作规则》、完成经纪业务综合管理平台（原CRM）建设和《上海证券有限责任公司营业部负责人工作手册》。

同时，公司完善代销金融产品制度建设、加强投顾团队建设和投资者教育与客户投诉管理工作、分层面开展员工培训、全面实施营销服务一体化，深耕细作，全力打造强有力的经纪业务后台业务支持。

公司的经纪业务持续保持稳健经营，行业地位稳中有升。获得市场广泛认可，多次获得行业协会及知名媒体组织开展的“投顾精英赛—机构综合能力全国十强”、连续两届获得“新财富最佳投资顾问”奖项，2019年5月获得深交所《投知微课堂》优秀奖，“上海金融职工立功竞赛建功奖”等殊荣，2019年荣获上交所投资者教育与保护系列活动最佳图文奖、投资者保护基金公司投资者调查优秀调查工作负责人奖、深交所《投知微课堂》视频作品优秀奖、深交所“2019年度会员投教菁英提名奖”；2020年荣获上海证券同业公会颁发的2020年新《证券法》知识竞赛优秀组织奖和“学习新《证券法》投资者调查问卷活动”优秀组织奖、深交所颁发的“创业板改革优秀投教作品”优秀奖（视频作品和海报作品）、深交所、人民日报社和证券时报颁发的2020全国投教动漫大赛最佳组织奖和最佳书法奖、投保基金公司颁发的“投资者调查优秀证券公司”奖，2019年5月29日衍生品业务部荣获2018年度上海金融职工立功竞赛“建功奖”。

六、公司治理情况

（一） 发行人报告期内是否存在与控股股东、实际控制人以及其他关联方之间不能保证独立性的情况：

是 否

（二） 发行人报告期内是否存在与控股股东、实际控制人以及其他关联方之间在资产、人员、机构、财务、业务经营等方面的相互独立情况：

发行人具有独立的企业法人资格，自主经营、独立核算、自负盈亏。公司与控股股东百联集团有限公司及实际控制人上海市国有资产监督管理委员会之间在业务、人员、资产、财务、机构上完全分开，做到了业务及资产独立、机构完整、财务独立，在经营管理各个环节保持应有的独立性。

（三） 发行人关联交易的决策权限、决策程序、定价机制及信息披露安排

关联交易的决策权限和决策程序

1、公司与关联人拟发生的交易金额在人民币 1000 万元以上的关联交易（公司提供担保除外），应当经公司董事会审议批准。

2、公司与关联人拟发生的关联交易达到以下标准之一的，除经公司董事会审议外，还应当提交公司股东会审议：

（1）公司与关联人拟发生的交易（公司提供担保、受赠现金资产、单纯减免公司义务的债务除外）金额在人民币 2000 万元以上，且占公司最近一期经审计净资产绝对值 5% 以上的重大关联交易，应经公司股东会审议批准；

（2）公司为关联人提供担保。公司拟发生前款第（1）项所述重大关联交易的，可以提供具有执行证券、期货相关业务资格的证券服务机构对交易标的出具的审计或者评估报告。

3、公司除上述第 1 条和第 2 条所涉的重大关联交易事项外，其他关联交易事项无需经公司董事会或者股东会审议，但需按照公司内部管理制度、授权体系和决策体系审批和执行，并及时向公司董事会办公室报备。

4、公司与关联人共同出资设立公司，应当以公司的出资额作为交易额，适用第 1 条和第 2 条（1）的规定。

5、公司拟放弃向与关联人共同投资的公司同比例增资或优先受让权的，应当以公司放弃增资权或优先受让权所涉及的金额为交易金额，适用第 1 条和第 2 条（1）的规定。公司因放弃增资权或优先受让权将导致公司合并报表范围发生变更的，应当以公司拟放弃增资权或优先受让权所对应的公司的最近一期末全部净资产为交易金额，适用第 1 条和第 2 条（1）的规定。

6、公司进行“提供财务资助”、“委托理财”等关联交易的，应当以发生额作为交易金额，适用第 1 条和第 2 条（1）的规定。

7、公司进行下列关联交易的，应当按照连续十二个月内累计计算的原则，计算关联交易金额，分别适用第 1 条和第 2 条（1）的规定：

（1）与同一关联人进行的交易；

（2）与不同关联人进行的交易标的类别相关的交易。

上述同一关联人，包括与该关联人受同一法人或其他组织或者自然人直接或间接控制的，或相互存在股权控制关系；根据法律、法规和其他规范性文件的规定应当视为同一关联人的其他情形。已经按照累计计算原则履行董事会或者股东会决策程序的，不再纳入相关的累计计算范围。

8、公司拟与关联人发生第 1 条和第 2 条（1）所述的重大关联交易的，董事会审计委员会应当对该关联交易事项进行审核，形成书面意见，提交公司董事会审议，并报告公司监事会。董事会审计委员会可以聘请独立财务顾问出具报告，作为其判断的依据。

9、公司董事会审议重大关联交易事项，关联董事应当回避表决，也不得代理其他董事行使表决权。

该董事会会议由过半数的非关联董事出席即可举行，董事会会议所作决议须经非关联董事过半数通过。出席董事会会议的非关联董事人数不足三人的，公司应当将重大关联交易事项提交公司股东会审议。

10、公司股东会审议重大关联交易事项，不得损害公司及客户的合法权益。

11、公司监事会应当对关联交易的审议、表决、披露、履行等情况进行监督并在监事会年度报告中发表意见。

12、公司董事会办公室应当及时收集公司的关联交易情况并定期向董事会审计委员会报告。董事会审计委员会应当将确认后的公司关联交易情况定期向公司董事会和监事会报告。

关联交易定价机制

1、公司关联交易应当有明确的定价政策。

2、公司关联交易定价应当公允，参照下列原则执行：

（1）交易事项实行政府定价的，可以直接适用该价格；

- (2) 交易事项实行政府指导价的，可以在政府指导价范围内合理确定交易价格；
- (3) 除实行政府定价或政府指导价外，交易事项有可比的独立第三方的市场价格或收费标准的，可以优先参考该价格或标准确定交易价格；
- (4) 关联事项无可比的独立第三方市场价格的，交易定价可以参考关联方与独立于关联方的第三方发生非关联交易价格确定；
- (5) 既无独立第三方的市场价格，也无独立的非关联交易价格可供参考的，可以合理的构成价格作为定价的依据，构成价格为合理成本费用加合理利润。

3、公司按照第2条（3）-（5）项确定关联交易价格时，可以视不同的关联交易情形采用下列定价方法：

- (1) 成本加成法，以关联交易发生的合理成本加上可比非关联交易的毛利定价。适用于采购、销售、有形资产的转让和使用、劳务提供、资金融通等关联交易；
- (2) 再销售价格法，以关联方购进商品再销售给非关联方的价格减去可比非关联交易毛利后的金额作为关联方购进商品的公平成交价格。适用于再销售者未对商品进行改变外形、性能、结构或更换商标等实质性增值加工的简单加工或单纯的购销业务；
- (3) 可比非受控价格法，以非关联方之间进行的与关联交易相同或类似业务活动所收取的价格定价。适用于所有类型的关联交易；
- (4) 交易净利润法，以可比非关联交易的利润水平指标确定关联交易的净利润。适用于采购、销售、有形资产的转让和使用、劳务提供等关联交易；
- (5) 利润分割法，根据公司与其关联方对关联交易合并利润的贡献计算各自应该分配的利润额。适用于各参与方关联交易高度整合且难以单独评估各方交易结果的情况。

4、公司关联交易无法按上述原则和方法定价的，应当向公司董事会说明该关联交易价格的确定原则、方法及其定价的公允性。

信息披露安排

公司年度报告关联人及关联交易的披露应当遵守《证券公司年度报告内容与格式准则》和《企业会计准则第36号—关联方披露》的规定。

（四） 发行人关联交易情况

1. 日常关联交易

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 关联交易类型 | 该类关联交易的金额 |
|--------------|-----------|
| 保安服务费支出 | 0.01 |
| 场外期权交易 | 0.07 |
| 大宗采购费 | 0.03 |
| 代理买卖证券业务收入 | 0 |
| 房租 | 0 |
| 合并结构化产品托管运营费 | 0 |
| 抗疫物资费 | 0 |
| 客户存款利息支出 | 0.01 |
| 使用权资产折旧 | 0.25 |
| 收益互换交易 | 0.03 |
| 物业费支出 | 0.04 |
| 信息网络管理费 | 0 |
| 证券承销业务收入 | 0.01 |
| 租赁负债利息支出 | 0.05 |

2. 其他关联交易

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 关联交易类型 | 该类关联交易的金额 |
|----------|-----------|
| 关键管理人员报酬 | 0.18 |

3. 担保情况

适用 不适用

4. 报告期内与同一关联方发生的关联交易情况

报告期内与同一关联方发生关联交易累计金额超过发行人上年末净资产的

适用 不适用**（五） 发行人报告期内是否存在违反法律法规、自律规则、公司章程、公司信息披露事务管理制度等规定的情况**是 否**（六） 发行人报告期内是否存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况**是 否**七、环境信息披露义务情况**

发行人是否属于应当履行环境信息披露义务的主体

是 否**第二节 债券事项****一、公司信用类债券情况**

公司债券基本信息列表（以未来行权（含到期及回售）时间顺序排列）

单位：亿元 币种：人民币

| | |
|--------------------------|---|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第一期) |
| 2、债券简称 | 22 上证 S1 |
| 3、债券代码 | 185762.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 5 月 11 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 5 月 13 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 8、债券余额 | 20.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 2.40 |
| 10、还本付息方式 | 本期债券到期一次还本付息。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |

| | |
|----------------------------|--------------|
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|----------------------------|---|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第二期) |
| 2、债券简称 | 22 上证 S2 |
| 3、债券代码 | 137543.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 7 月 14 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 7 月 18 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2023 年 7 月 18 日 |
| 8、债券余额 | 10.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 2.30 |
| 10、还本付息方式 | 本期债券到期一次还本付息。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|--------------------------|--|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司非公开发行 2020 年次级债券(第一期) |
| 2、债券简称 | 20 沪券 C1 |
| 3、债券代码 | 167473.SH |
| 4、发行日 | 2020 年 8 月 13 日 |
| 5、起息日 | 2020 年 8 月 17 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2023 年 8 月 17 日 |
| 8、债券余额 | 26.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 4.55 |
| 10、还本付息方式 | 本次债券采用单利按年计息，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。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 国泰君安证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 恒泰长财证券有限责任公司 |

| | |
|----------------------------|--------------|
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|----------------------------|--|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期) |
| 2、债券简称 | 22 上证 01 |
| 3、债券代码 | 185316.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 1 月 20 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2025 年 1 月 24 日 |
| 8、债券余额 | 32.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 2.99 |
| 10、还本付息方式 | 本次债券采用单利按年计息，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。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|--------------------------|--|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一) |
| 2、债券简称 | 22 上证 02 |
| 3、债券代码 | 137744.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 8 月 26 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 8 月 30 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2025 年 8 月 30 日 |
| 8、债券余额 | 12.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 2.75 |
| 10、还本付息方式 | 本次债券采用单利按年计息，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。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |

| | |
|----------------------------|--------------|
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|----------------------------|--|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期) |
| 2、债券简称 | 22 上证 05 |
| 3、债券代码 | 138572.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 11 月 9 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 11 月 11 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2025 年 11 月 11 日 |
| 8、债券余额 | 10.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 2.70 |
| 10、还本付息方式 | 本次债券采用单利按年计息，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。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|--------------------------|--|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二) |
| 2、债券简称 | 22 上证 03 |
| 3、债券代码 | 137745.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 8 月 26 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 8 月 30 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2027 年 8 月 30 日 |
| 8、债券余额 | 18.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 3.19 |
| 10、还本付息方式 | 本次债券采用单利按年计息，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。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |

| | |
|----------------------------|--------------|
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

| | |
|----------------------------|--|
| 1、债券名称 | 上海证券有限责任公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期) |
| 2、债券简称 | 22 上证 04 |
| 3、债券代码 | 137835.SH |
| 4、发行日 | 2022 年 9 月 16 日 |
| 5、起息日 | 2022 年 9 月 20 日 |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | - |
| 7、到期日 | 2027 年 9 月 20 日 |
| 8、债券余额 | 14.00 |
| 9、截止报告期末的利率(%) | 3.16 |
| 10、还本付息方式 | 本次债券采用单利按年计息，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。本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。 |
| 11、交易场所 | 上交所 |
| 12、主承销商 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 13、受托管理人 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 14、投资者适当性安排 | 面向专业投资者交易的债券 |
| 15、适用的交易机制 | 协议 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 否 |

二、公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况

√ 本公司所有公司债券均不含选择权条款 □ 本公司的公司债券有选择权条款

三、公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况

□ 本公司所有公司债券均不含投资者保护条款 √ 本公司的公司债券有投资者保护条款

债券代码：185762.SH

债券简称：22 上证 S1

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

债券代码：137543.SH

债券简称：22 上证 S2

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

债券代码：185316.SH

债券简称：22 上证 01

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

债券代码：137744.SH

债券简称：22 上证 02

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

债券代码：138572.SH

债券简称：22 上证 05

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

债券代码：137745.SH

债券简称：22 上证 03

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起

的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

债券代码：137835.SH

债券简称：22 上证 04

债券约定的投资者保护条款名称：

约定了偿债保障措施，即制定债券持有人会议规则、充分发挥债券受托管理人的作用、设立专门的偿付工作小组、加强资产负债管理和严格履行信息披露义务。

发行人在募集说明书中承诺保证按照募集说明书约定的还本付息安排，按时向债券持有人还本付息，若公司未按时还本付息，或发生其他违约情况时，投资者可以向公司追索或者采取相应的法律措施收回债券本金、利息和逾期利息。对违约及赔偿产生的任何争议，由债券持有人和发行人平等协商解决，双方协商无法达成一致的，则任何因募集说明书引起的或与募集说明书有关的法律诉讼应在发行人所在地有管辖权的人民法院提起。

投资者保护条款的触发和执行情况：

是 否

四、公司债券募集资金使用情况

本公司所有公司债券在报告期内和报告期后批准报出日前均不涉及募集资金使用或者整改
公司债券在报告期内和报告期后批准报出日前涉及募集资金使用或者整改

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：185762.SH

| | |
|--------------------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 S1 |
| 募集资金总额 | 20.00 |
| 使用金额 | 20.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 20 亿元（含 20 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 20.00 亿元，用于补充运营资金 |

| | |
|------------------------------|-----|
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |
|------------------------------|-----|

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：137543.SH

| | |
|--------------------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 S2 |
| 募集资金总额 | 10.00 |
| 使用金额 | 10.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 10 亿元（含 10 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 10.00 亿元，用于补充运营资金 |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：167473.SH

| | |
|--------------------|---|
| 债券简称 | 20 沪券 C1 |
| 募集资金总额 | 26.00 |
| 使用金额 | 0.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 本期债券发行总额不超过人民币 35 亿元（含 35 亿元），募集资金扣除发行费用后，拟全部用于补充流动资金。本期债券募集资金不用于新股配售、申购，或用于股票及其衍生品种、可转换公司债券等的交易及其他非生产性支出。根据公司财务状况和资金使用需求，公司未 |

| | |
|--------------------------------|---|
| | 来可能调整部分募集资金用于补充流动资金。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 26.00 亿元，用于补充流动资金。 |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：185316.SH

| | |
|--------------------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 01 |
| 募集资金总额 | 32.00 |
| 使用金额 | 32.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 32 亿元（含 32 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资 | 已使用募集资金 32.00 亿元，用于补充运营资金 |

| | |
|------------------------------|-----|
| 金使用用途 | |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：137744.SH

| | |
|--------------------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 02 |
| 募集资金总额 | 12.00 |
| 使用金额 | 12.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 30 亿元（含 30 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 12.00 亿元，用于补充运营资金 |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：138572.SH

| | |
|--------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 05 |
| 募集资金总额 | 10.00 |
| 使用金额 | 10.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 10 亿元（含 10 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调 |

| | |
|--------------------------------|---|
| | 整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 10.00 亿元，用于补充运营资金 |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：137745.SH

| | |
|-----------------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 03 |
| 募集资金总额 | 18.00 |
| 使用金额 | 18.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 30 亿元（含 30 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债 | 不适用 |

| | |
|------------------------------|---------------------------|
| 务管理规定的情形及整改情况（如有） | |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 18.00 亿元，用于补充运营资金 |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：137835.SH

| | |
|--------------------------------|---|
| 债券简称 | 22 上证 04 |
| 募集资金总额 | 14.00 |
| 使用金额 | 14.00 |
| 批准报出日前余额 | 0.00 |
| 专项账户运作情况 | 正常 |
| 约定的募集资金使用用途（请全文列示） | 公司拟公开发行不超过人民币 14 亿元（含 14 亿元）的公司债券。本期债券募集资金扣除发行费用后，将用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，或用于调整公司负债结构和改善财务结构。发行人将根据本期债券募集资金的实际到位情况及资金使用需要，进一步安排具体的补充营运资金明细及调整公司负债结构的金额，可能对拟定的金额进行适当调整。 |
| 是否变更募集资金用途 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 变更募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生变更） | 不适用 |
| 报告期内及批准报出日前募集资金是否存在违规使用情况 | <input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否 |
| 违规使用的具体情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有） | 不适用 |
| 募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用 |
| 募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有） | 不适用 |
| 截至批准报出日实际的募集资金使用用途 | 已使用募集资金 14.00 亿元，用于补充运营资金 |
| 募集资金用于项目建设的，项目的进展情况及运营效益（如有） | 不适用 |

五、发行人或者公司信用类债券报告期内资信评级调整情况适用 不适用**六、公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施情况****（一）报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施变更情况**适用 不适用

（二）截至报告期末增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施情况

√适用 □不适用

债券代码：185762.SH

| | |
|---|---|
| 债券简称 | 22 上证 S1 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：债券采用单利计息，不计复利，到期一次性还本付息。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |

债券代码：137543.SH

| | |
|---|---|
| 债券简称 | 22 上证 S2 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：债券采用单利计息，不计复利，到期一次性还本付息。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |

债券代码：167473.SH

| | |
|---|--|
| 债券简称 | 20 沪券 C1 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：在存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切 |

| | |
|-----------------|--|
| 划及其他偿债保障措施的执行情况 | 实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |
|-----------------|--|

债券代码：185316.SH

| | |
|---|--|
| 债券简称 | 22 上证 01 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：在存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |

债券代码：137744.SH

| | |
|---|--|
| 债券简称 | 22 上证 02 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：在存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |

债券代码：138572.SH

| | |
|---|--|
| 债券简称 | 22 上证 05 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：在存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |

| | |
|-----------------------------|---|
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |
|-----------------------------|---|

债券代码：137745.SH

| | |
|---|--|
| 债券简称 | 22 上证 03 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：在存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |

债券代码：137835.SH

| | |
|---|--|
| 债券简称 | 22 上证 04 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 增信机制：各期债券均无担保。 偿债计划：在存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。 其他偿债保障措施：制定《债券持有人会议规则》、聘请债券受托管理人、募集资金与偿债资金专项账户、严格执行资金管理计划、严格的信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况 | 公司能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。公司为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。 |

七、中介机构情况

（一）出具审计报告的会计师事务所

√适用 □不适用

| | |
|---------|-----------------------|
| 名称 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 办公地址 | 中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层 |
| 签字会计师姓名 | 张楠、钱茹雯 |

（二）受托管理人/债权代理人

| | |
|------|-----------|
| 债券代码 | 167473.SH |
|------|-----------|

| | |
|------|-------------------------------|
| 债券简称 | 20 沪券 C1 |
| 名称 | 恒泰长财证券有限责任公司 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 904 室 |
| 联系人 | 黄昊 |
| 联系电话 | 021-68906568 |

| | |
|------|---|
| 债券代码 | 185762.SH、137543.SH、185316.SH、137744.SH、138572.SH、137745.SH、137835.SH |
| 债券简称 | 22 上证 S1、22 上证 S2、22 上证 01、22 上证 02、22 上证 05、22 上证 03、22 上证 04 |
| 名称 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2207 |
| 联系人 | 黄凯丽 |
| 联系电话 | 021-50701171 |

（三）资信评级机构

适用 不适用

| | |
|------|---|
| 债券代码 | 185762.SH、137543.SH、185316.SH、137744.SH、138572.SH、137745.SH、137835.SH |
| 债券简称 | 22 上证 S1、22 上证 S2、22 上证 01、22 上证 02、22 上证 05、22 上证 03、22 上证 04 |
| 名称 | 中证鹏元资信评估股份有限公司 |
| 办公地址 | 深圳市深南大道 7008 号阳光高尔夫大厦三楼 |

（四）报告期内中介机构变更情况

适用 不适用

第三节 报告期内重要事项

一、财务报告审计情况

标准无保留意见 其他审计意见

二、会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

适用 不适用

三、合并报表范围调整

报告期内新增合并财务报表范围内子公司，且新增的子公司报告期内营业收入、净利润或报告期末总资产任一占合并报表 10%以上

适用 不适用

报告期内减少合并财务报表范围内子公司，且减少的子公司上个报告期内营业收入、净利润或上个报告期末总资产占上个报告期合并报表 10%以上

适用 不适用

四、资产情况

（一）资产及变动情况

1. 占发行人合并报表范围总资产 10%以上的资产类报表项目的资产

| 项目名称 | 主要构成 |
|---------|--------------------------------|
| 货币资金 | 库存现金、银行存款和其他货币资金 |
| 融出资金 | 融资融券业务融出资金 |
| 交易性金融资产 | 债券、基金、券商资管产品、银行理财产品、股票/股权和其他投资 |
| 其他债权投资 | 国债、金融债、企业债和中期票据等 |

2. 公司存在期末余额变动比例超过 30%的资产项目

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 资产项目 | 本期末余额 | 占本期末资产总额的比例（%） | 上期末余额 | 变动比例（%） |
|----------|-------|----------------|-------|-----------|
| 衍生金融资产 | 0.05 | 0.01 | 0 | 10,967.01 |
| 买入返售金融资产 | 18.93 | 2.81 | 8.37 | 126.19 |
| 应收款项 | 2.42 | 0.36 | 5.31 | -54.49 |
| 在建工程 | 0.16 | 0.02 | 0.08 | 107.85 |
| 投资性房地产 | 0.48 | 0.07 | - | - |
| 使用权资产 | 2.77 | 0.41 | 1.59 | 74.59 |
| 无形资产 | 0.26 | 0.04 | 0.43 | -39.73 |
| 递延所得税资产 | 2.62 | 0.39 | 1.11 | 136.26 |
| 其他资产 | 2.56 | 0.38 | 1.74 | 47.20 |

发生变动的的原因：

2022 年末衍生金融资产余额较 2021 年末增加了 10967.01%，主要系今年公司开展期权期货衍生品业务规模增加所致。

2022 年末买入返售金融资产余额较 2021 年末增加了 126.19%，主要系今年公司债券质押式逆回购业务规模增加所致。

2022 年末应收款项余额较 2021 年末减少了 54.49%，主要系今年公司应收交易待清算款较年初减少所致。

2022 年末在建工程余额较 2021 年末增加了 107.85%，主要系今年公司装修工程较去年增加所致。

2022 年末投资性房地产余额较 2021 年末增加，主要系今年公司将出租的自有房产计入投资性房地产所致。

2022 年末使用权资产余额较 2021 年末增加了 74.59%，主要系今年公司租赁的办公场所较去年增加所致。

2022 年末无形资产余额较 2021 年末减少了 39.73%，主要系今年无形资产摊销所致。

2022 年末递延所得税资产余额较 2021 年末增加了 136.26%，主要系今年公允价值变动形成的递延所得税资产较去年增加所致。

2022 年末其他资产余额较 2021 年末增加了 47.20%，主要系今年采购资产等预付款增加所致。

（二）资产受限情况

1. 资产受限情况概述

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 受限资产类别 | 受限资产账面价值 | 资产受限金额 | 受限资产评估价值（如有） | 资产受限金额占该类别资产账面价值的比例（%） |
|---------|----------|--------|--------------|------------------------|
| 货币资金 | 176.42 | 7.08 | — | 4.01 |
| 交易性金融资产 | 113.47 | 5.32 | — | 4.69 |
| 其他债权投资 | 189.85 | 72.22 | — | 38.04 |
| 合计 | 479.74 | 84.62 | — | — |

2. 单项资产受限情况

单项资产受限金额超过报告期末合并口径净资产 10%

□适用 √不适用

3. 发行人所持重要子公司股权的受限情况

截至报告期末，直接或间接持有的重要子公司股权存在权利受限情况

□适用 √不适用

五、非经营性往来占款和资金拆借

（一）非经营性往来占款和资金拆借余额

1. 报告期初，发行人合并口径应收的非因生产经营直接产生的对其他方的往来占款和资金拆借（以下简称非经营性往来占款和资金拆借）余额：0.00 亿元；

2. 报告期内，非经营性往来占款和资金拆借新增：0.00 亿元，收回：0.00 亿元；

3. 报告期内，非经营性往来占款或资金拆借情形是否存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况

否

4. 报告期末，未收回的非经营性往来占款和资金拆借合计：0.00 亿元，其中控股股东、实际控制人及其他关联方占款或资金拆借合计：0.00 亿元。

（二）非经营性往来占款和资金拆借明细

报告期末，发行人合并口径未收回的非经营性往来占款和资金拆借占合并口径净资产的比例：0.00%，是否超过合并口径净资产的 10%：

□是 √否

（三）以前报告期内披露的回款安排的执行情况

√完全执行 □未完全执行

六、负债情况

（一）有息债务及其变动情况

1. 发行人债务结构情况

报告期初和报告期末，发行人口径（非发行人合并范围口径）有息债务余额分别为 293.21 亿元和 263.13 亿元，报告期内有息债务余额同比变动-10.26%。

单位：亿元 币种：人民币

| 有息债务 | 到期时间 | 金额合计 | 金额占有 |
|------|------|------|------|
|------|------|------|------|

| 类别 | 已逾期 | 6个月以内 (含) | 6个月(不 含)至1 年(含) | 超过1年 (不含) | | 息债务的 占比 |
|-------------------|-----|--------------|-----------------------|--------------|--------|------------|
| 公司信用 类债券 | - | 35.46 | 36.53 | 87.33 | 159.32 | 60.55% |
| 银行贷款 | - | - | - | - | - | - |
| 非银行金 融机构贷 款 | - | - | - | - | - | - |
| 其他有息 债务 | - | 103.81 | - | - | 103.81 | 39.45% |

报告期末发行人口径存续的公司信用类债券中，公司债券余额 142.00 亿元，企业债券余额 142.00 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0.00 亿元，且共有 56.00 亿元公司信用类债券在 2023 年 12 月 31 日到期或回售偿付。

2. 发行人合并口径有息债务结构情况

报告期初和报告期末，发行人合并报表范围内公司有息债务余额分别为 293.48 亿元和 263.13 亿元，报告期内有息债务余额同比变动-10.34%。

单位：亿元 币种：人民币

| 有息债务 类别 | 到期时间 | | | | 金额合计 | 金额占有 息债务的 占比 |
|-------------------|------|--------------|-----------------------|--------------|--------|--------------------|
| | 已逾期 | 6个月以内 (含) | 6个月(不 含)至1 年(含) | 超过1年 (不含) | | |
| 公司信用 类债券 | - | 35.46 | 36.53 | 87.33 | 159.32 | 60.55% |
| 银行贷款 | - | - | - | - | - | - |
| 非银行金 融机构贷 款 | - | - | - | - | - | - |
| 其他有息 债务 | - | 103.81 | - | - | 103.81 | 39.45% |

报告期末，发行人合并口径存续的公司信用类债券中，公司债券余额 142.00 亿元，企业债券余额 142.00 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0.00 亿元，且共有 56.00 亿元公司信用类债券在 2023 年 12 月 31 日到期或回售偿付。

3. 境外债券情况

截止报告期末，发行人合并报表范围内发行的境外债券余额 0.00 亿元人民币，且在 2023 年末内到期的境外债券余额为 0.00 亿元人民币。

(二) 报告期末存在逾期金额超过 1000 万元的有息债务或者公司信用类债券逾期情况

适用 不适用

(三) 负债变动情况

公司存在期末余额变动比例超过 30%的负债项目

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 负债项目 | 本期末余额 | 占本期末负债总额的比例（%） | 上年末余额 | 变动比例（%） |
|-----------|--------|----------------|-------|----------|
| 拆入资金 | 35.01 | 6.95 | 2 | 1,649.93 |
| 交易性金融负债 | 0.98 | 0.2 | 0.27 | 262.58 |
| 卖出回购金融资产款 | 67.81 | 13.46 | 201.1 | -66.28 |
| 应付职工薪酬 | 2.56 | 0.51 | 4.71 | -45.75 |
| 应付债券 | 113.76 | 22.57 | 26.42 | 330.65 |
| 租赁负债 | 3.02 | 0.6 | 1.74 | 73.33 |
| 合同负债 | 0.01 | 0 | 0.01 | -42.33 |
| 其他负债 | 7.47 | 1.48 | 0.36 | 1,960.79 |

发生变动的原因：

2022年末拆入资金余额较2021年末增加了1649.93%，主要系今年公司增加同业拆借规模所致。

2022年末交易性金融负债余额较2021年末增加262.58%，主要系今年公司发行浮动收益凭证所致。

2022年末卖出回购金融资产款余额较2021年末减少了66.28%，主要系今年公司减少债券质押式回购业务规模所致。

2022年末应付职工薪酬余额较2021年末减少了45.75%，主要系今年公司计提职工薪酬较去年下降所致。

2022年末应付债券余额较2021年末增加了330.65%，主要系今年公司发行长期公司债所致。

2022年末租赁负债余额较2021年末增加了73.33%，主要系今年公司增加办公场所租赁所致。

2022年末合同负债余额较2021年末减少了42.33%，主要系今年末公司需履行的合同义务较年初减少所致。

2022年末其他负债余额较2021年末增加了1960.79%，主要系今年公司应付票据规模增加所致。

（四）可对抗第三人的优先偿付负债情况

截至报告期末，发行人合并报表范围内存在可对抗第三人的优先偿付负债：

适用 不适用

七、利润及其他损益来源情况

（一）基本情况

报告期利润总额：3.30亿元

报告期非经常性损益总额：0.39亿元

报告期内合并报表范围利润主要源自非主要经营业务的：

适用 不适用

（二）投资状况分析

如来源于单个子公司的净利润或单个参股公司的投资收益对发行人合并口径净利润影响达到20%以上

适用 不适用

（三）净利润与经营性净现金流差异

报告期公司经营活动产生的现金净流量与报告期净利润存在重大差异

适用 不适用

八、报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十

是 否

九、对外担保情况

报告期初对外担保的余额：0.00 亿元

报告期末对外担保的余额：0.00 亿元

报告期对外担保的增减变动情况：0.00 亿元

对外担保中为控股股东、实际控制人和其他关联方提供担保的金额：0.00 亿元

报告期末尚未履行及未履行完毕的对外单笔担保金额或者对同一对象的担保金额是否超过报告期末净资产 10%：是 否

十、重大诉讼情况

截至报告期末是否存在重大未决诉讼、证券特别代表人诉讼

是 否

| 原告姓名 (名称) | 被告姓名 (名称) | 案由 | 一审受理 时间 | 一审受理 法院 | 标的金额 (如有) | 目前所处 的诉讼程 序 |
|--------------------|--|--|----------------|------------------------|--------------|--|
| 上海证券 有限责任 公司 | 重庆市福 星门业 (集团) 有限公 司、重 庆欧枫 投资有 限公司 | 公司诉私 募债发 行人及 保证人 私募债 违约 | 2016 年 9 月 | 重庆第 五中级 人民法 院 | 8800 万 元 | 发行人 及担保 人制定 财产分 配方案 中。 |
| 上海证券 有限责任 公司 | 上海市奉 贤区土 地储备 中心 | 房屋置 换协议 纠纷 | 2016 年 11 月 | 上海仲 裁委员 会 | 1.07 亿 元 | 尚待裁 决。 |
| 上海证券 有限责任 公司 | 张亦斌、 马玲芝 | 质押式 证券回 购纠纷 | 2021 年 9 月 | 上海金 融法院 | 3.49 亿 元 | 正在审 理中。 |
| 上海证券 有限责任 公司 | 柯宗贵 | 质押式 证券回 购纠纷 | 2021 年 11 月 | 上海金 融法院 | 1.035 亿 元 | 被告已 提起上 诉，案 件将进 入二审 程序。 |
| 上海证券 有限责任 公司 | 中融新 大集团 有限公 司 | 公司债 券交易 纠纷 | 2022 年 3 月 | 上海金 融法院 | 1 亿元 | 被告提 起上诉 ，目前 案件正 在二审 审理中 |

十一、报告期内信息披露事务管理制度变更情况

发生变更 未发生变更

十二、向普通投资者披露的信息

在定期报告批准报出日，发行人是否存续有面向普通投资者交易的债券

是 否

第四节 特定品种债券应当披露的其他事项

一、发行人为可交换债券发行人

适用 不适用

二、发行人为非上市公司非公开发行可转换公司债券发行人

适用 不适用

三、发行人为绿色债券发行人

适用 不适用

四、发行人为永续期公司债券发行人

适用 不适用

五、其他特定品种债券事项

无

第五节 发行人认为应当披露的其他事项

无

第六节 备查文件目录

一、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；

二、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）；

三、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；

四、按照境内外其他监管机构、交易场所等的要求公开披露的年度报告、年度财务信息。

发行人披露的公司债券信息披露文件可在交易所网站上进行查询，
<http://www.sse.com.cn>。

（以下无正文）

(以下无正文，为《上海证券有限责任公司公司债券年度报告（2022年）》盖章页)



财务报表

附件一： 发行人财务报表

合并资产负债表

2022年12月31日

编制单位：上海证券有限责任公司

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2022年12月31日 | 2021年12月31日 |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 资产： | | |
| 货币资金 | 17,641,988,814.30 | 17,737,592,694.23 |
| 其中：客户资金存款 | 15,514,490,210.05 | 16,147,987,130.15 |
| 结算备付金 | 3,393,148,785.76 | 2,679,679,463.98 |
| 其中：客户备付金 | 1,911,661,976.50 | 1,710,937,105.35 |
| 贵金属 | | |
| 拆出资金 | | |
| 融出资金 | 7,494,161,181.91 | 9,048,653,130.10 |
| 衍生金融资产 | 4,526,376.25 | 40,899.73 |
| 存出保证金 | 5,013,265,622.29 | 4,334,051,538.04 |
| 应收款项 | 241,862,080.08 | 531,458,405.85 |
| 应收款项融资 | | |
| 合同资产 | | |
| 买入返售金融资产 | 1,892,713,535.59 | 836,774,786.40 |
| 持有待售资产 | | |
| 金融投资： | | |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | | |
| 交易性金融资产 | 11,347,316,634.34 | 9,112,558,989.37 |
| 债权投资 | | |
| 可供出售金融资产 | | |
| 其他债权投资 | 18,984,748,246.40 | 24,415,849,196.12 |
| 其他权益工具投资 | 342,439,371.11 | 334,970,611.32 |
| 持有至到期投资 | | |
| 长期股权投资 | | |
| 投资性房地产 | 48,012,526.97 | |
| 固定资产 | 192,057,431.50 | 262,618,339.21 |
| 在建工程 | 16,299,297.32 | 7,841,970.33 |
| 使用权资产 | 277,021,563.28 | 158,673,055.79 |
| 无形资产 | 25,686,847.53 | 42,616,590.92 |
| 商誉 | 14,716,094.21 | 14,716,094.21 |
| 递延所得税资产 | 262,166,080.31 | 110,963,872.39 |
| 其他资产 | 255,873,349.48 | 173,831,723.67 |

| | | |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 资产总计 | 67,448,003,838.63 | 69,802,891,361.66 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | |
| 应付短期融资款 | 4,556,400,961.72 | 6,369,364,980.49 |
| 拆入资金 | 3,500,849,944.44 | 200,056,222.22 |
| 交易性金融负债 | 98,363,221.33 | 27,128,387.73 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | | |
| 衍生金融负债 | | |
| 卖出回购金融资产款 | 6,781,421,217.30 | 20,110,022,484.81 |
| 代理买卖证券款 | 11,862,495,005.01 | 12,379,777,334.58 |
| 代理承销证券款 | | |
| 应付职工薪酬 | 255,781,178.70 | 471,461,674.09 |
| 应交税费 | 87,034,789.35 | 95,169,573.64 |
| 应付款项 | 10,823,063,167.55 | 10,367,871,077.12 |
| 合同负债 | 820,205.54 | 1,422,200.00 |
| 持有待售负债 | | |
| 预计负债 | | |
| 长期借款 | | |
| 应付债券 | 11,375,592,254.98 | 2,641,523,463.78 |
| 其中：优先股 | | |
| 永续债 | | |
| 租赁负债 | 302,430,157.07 | 174,481,144.22 |
| 递延收益 | | |
| 递延所得税负债 | 75,723.75 | 86,606.03 |
| 其他负债 | 747,012,977.77 | 36,248,869.24 |
| 负债合计 | 50,391,340,804.51 | 52,874,614,017.95 |
| 所有者权益（或股东权益）： | | |
| 实收资本（或股本） | 5,326,532,000.00 | 5,326,532,000.00 |
| 其他权益工具 | | |
| 其中：优先股 | | |
| 永续债 | | |
| 资本公积 | 7,776,642,356.71 | 7,776,642,356.71 |
| 减：库存股 | | |
| 其他综合收益 | (6,724,970.37) | 156,535,023.51 |
| 盈余公积 | 963,610,622.05 | 940,756,828.47 |
| 一般风险准备 | 1,946,538,270.44 | 1,892,598,882.60 |
| 未分配利润 | 1,050,064,755.29 | 835,212,252.42 |
| 归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计 | 17,056,663,034.12 | 16,928,277,343.71 |
| 少数股东权益 | | |
| 所有者权益（或股东权益）合 | 17,056,663,034.12 | 16,928,277,343.71 |

| | | |
|-------------------|-------------------|-------------------|
| 计 | | |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | 67,448,003,838.63 | 69,802,891,361.66 |

法定代表人：何伟 主管会计工作负责人：罗国华 会计机构负责人：帅隽

母公司资产负债表

2022年12月31日

编制单位：上海证券有限责任公司

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2022年12月31日 | 2021年12月31日 |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 资产： | | |
| 货币资金 | 10,911,077,247.74 | 11,671,238,691.75 |
| 其中：客户资金存款 | 10,101,904,567.03 | 11,011,495,079.43 |
| 结算备付金 | 2,731,697,929.17 | 2,333,505,402.97 |
| 其中：客户备付金 | 1,250,211,119.91 | 1,364,763,044.34 |
| 贵金属 | | |
| 拆出资金 | | |
| 融出资金 | 7,494,161,181.91 | 9,048,653,130.10 |
| 衍生金融资产 | 4,526,376.25 | 40,899.73 |
| 存出保证金 | 263,605,363.97 | 527,827,835.60 |
| 应收款项 | 221,312,992.15 | 499,635,753.53 |
| 应收款项融资 | | |
| 合同资产 | | |
| 买入返售金融资产 | 1,892,713,535.59 | 836,774,786.40 |
| 持有待售资产 | | |
| 金融投资： | | |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | | |
| 交易性金融资产 | 11,057,077,556.17 | 8,970,599,983.05 |
| 债权投资 | | |
| 可供出售金融资产 | | |
| 其他债权投资 | 18,984,748,246.40 | 24,415,849,196.12 |
| 其他权益工具投资 | 342,439,371.11 | 334,970,611.32 |
| 持有至到期投资 | | |
| 长期股权投资 | 1,026,861,000.00 | 1,026,861,000.00 |
| 投资性房地产 | 48,012,526.97 | |
| 固定资产 | 178,340,243.72 | 248,817,305.11 |
| 在建工程 | 12,923,324.77 | 4,875,498.79 |
| 使用权资产 | 273,325,741.83 | 154,862,257.98 |
| 无形资产 | 15,140,195.46 | 32,242,811.29 |
| 商誉 | | |
| 递延所得税资产 | 245,785,602.09 | 99,682,546.53 |

| | | |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 其他资产 | 194,263,202.68 | 133,148,794.17 |
| 资产总计 | 55,898,011,637.98 | 60,339,586,504.44 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | |
| 应付短期融资款 | 4,556,400,961.72 | 6,369,364,980.49 |
| 拆入资金 | 3,500,849,944.44 | 200,056,222.22 |
| 交易性金融负债 | 98,363,221.33 | |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | | |
| 衍生金融负债 | | |
| 卖出回购金融资产款 | 6,781,421,217.30 | 20,110,022,484.81 |
| 代理买卖证券款 | 11,147,833,647.92 | 12,118,665,879.48 |
| 代理承销证券款 | | |
| 应付职工薪酬 | 211,490,897.02 | 395,745,389.58 |
| 应交税费 | 77,554,470.43 | 78,542,018.64 |
| 应付款项 | 863,914,665.78 | 1,348,110,419.41 |
| 合同负债 | 95,405.54 | |
| 持有待售负债 | | |
| 预计负债 | | |
| 长期借款 | | |
| 应付债券 | 11,375,592,254.98 | 2,641,523,463.78 |
| 其中：优先股 | | |
| 永续债 | | |
| 租赁负债 | 298,653,290.99 | 170,789,362.70 |
| 递延收益 | | |
| 递延所得税负债 | | |
| 其他负债 | 14,981,191.28 | 1,183,756.00 |
| 负债合计 | 38,927,151,168.73 | 43,434,003,977.11 |
| 所有者权益（或股东权益）： | | |
| 实收资本（或股本） | 5,326,532,000.00 | 5,326,532,000.00 |
| 其他权益工具 | | |
| 其中：优先股 | | |
| 永续债 | | |
| 资本公积 | 7,763,925,816.68 | 7,763,925,816.68 |
| 减：库存股 | | |
| 其他综合收益 | (6,724,970.37) | 156,535,023.51 |
| 盈余公积 | 963,610,622.05 | 940,756,828.47 |
| 一般风险准备 | 1,937,627,241.66 | 1,889,960,273.96 |
| 未分配利润 | 985,889,759.23 | 827,872,584.71 |
| 所有者权益（或股东权益）合计 | 16,970,860,469.25 | 16,905,582,527.33 |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | 55,898,011,637.98 | 60,339,586,504.44 |

法定代表人：何伟 主管会计工作负责人：罗国华 会计机构负责人：帅隽

合并利润表
2022年1—12月

单位:元 币种:人民币

| 项目 | 2022年度 | 2021年度 |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| 一、营业总收入 | 2,860,536,495.46 | 2,280,053,811.99 |
| 利息净收入 | 794,789,489.98 | 868,919,492.48 |
| 其中：利息收入 | 1,700,221,065.27 | 1,633,327,655.86 |
| 利息支出 | 905,431,575.29 | 764,408,163.38 |
| 手续费及佣金净收入 | 840,392,353.37 | 979,769,610.99 |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | 723,934,531.00 | 824,062,676.49 |
| 投资银行业务手续费净收入 | 76,184,383.29 | 105,768,166.01 |
| 资产管理业务手续费净收入 | 41,480,022.12 | 45,915,145.18 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 348,672,108.19 | 430,561,895.67 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | |
| 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 | 40,349,327.85 | 20,379,047.67 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -431,734,616.16 | -67,878,653.83 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | 3,545,590.74 | -916,897.89 |
| 其他业务收入 | 1,264,535,382.46 | 21,339,247.99 |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列） | -13,140.97 | 27,880,068.91 |
| 二、营业总支出 | 2,528,998,451.48 | 1,301,490,086.70 |
| 税金及附加 | 15,410,094.08 | 19,450,176.57 |
| 业务及管理费 | 1,115,973,170.57 | 1,331,223,961.39 |
| 资产减值损失 | | |
| 信用减值损失 | 136,575,829.98 | -49,422,583.36 |
| 其他资产减值损失 | 616,964.08 | |
| 其他业务成本 | 1,260,422,392.77 | 238,532.10 |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列） | 331,538,043.98 | 978,563,725.29 |
| 加：营业外收入 | 6,282.93 | 285,016.05 |
| 减：营业外支出 | 1,562,500.55 | 1,345,909.20 |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 329,981,826.36 | 977,502,832.14 |
| 减：所得税费用 | 32,767,634.24 | 211,397,125.30 |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | 297,214,192.12 | 766,105,706.84 |
| （一）按经营持续性分类 | | |
| 1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列） | 297,214,192.12 | 766,105,706.84 |
| 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. 归属于母公司股东的净利润 (净亏损以“-”号填列) | 297,214,192.12 | 766,105,706.84 |
| 2. 少数股东损益 (净亏损以“-”号填列) | | |
| 六、其他综合收益的税后净额 | -168,828,501.71 | 274,550,459.77 |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额 | -168,828,501.71 | 274,550,459.77 |
| (一) 不能重分类进损益的其他综合收益 | 15,188,791.77 | 10,680,660.60 |
| 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 | 15,188,791.77 | 10,680,660.60 |
| 4. 企业自身信用风险公允价值变动 | | |
| (二) 将重分类进损益的其他综合收益 | -184,017,293.48 | 263,869,799.17 |
| 1. 权益法下可转损益的其他综合收益 | | |
| 2. 其他债权投资公允价值变动 | -175,908,781.01 | 243,410,666.66 |
| 3. 可供出售金融资产公允价值变动损益 | | |
| 4. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额 | | |
| 5. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益 | | |
| 6. 其他债权投资信用损失准备 | -8,108,512.47 | 20,459,132.51 |
| 7. 现金流量套期储备 (现金流量套期损益的有效部分) | | |
| 8. 外币财务报表折算差额 | | |
| 9. 其他 | | |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额 | | |
| 七、综合收益总额 | 128,385,690.41 | 1,040,656,166.61 |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额 | 128,385,690.41 | 1,040,656,166.61 |
| 归属于少数股东的综合收益总额 | | |
| 八、每股收益: | | |
| (一) 基本每股收益(元/股) | | |
| (二) 稀释每股收益(元/股) | | |

本期发生同一控制下企业合并的，被合并方在合并前实现的净利润为：0.00 元，上期被合并方实现的净利润为：0.00 元。

法定代表人：何伟 主管会计工作负责人：罗国华 会计机构负责人：帅隽

母公司利润表
2022 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

| 项目 | 2022 年度 | 2021 年度 |
|----|---------|---------|
|----|---------|---------|

| | | |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| 一、营业总收入 | 1,318,726,760.04 | 1,991,226,416.21 |
| 利息净收入 | 703,181,355.14 | 742,138,877.84 |
| 其中：利息收入 | 1,537,328,445.32 | 1,458,788,257.73 |
| 利息支出 | 834,147,090.18 | 716,649,379.89 |
| 手续费及佣金净收入 | 653,514,400.76 | 784,093,888.90 |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | 538,921,853.37 | 627,339,975.54 |
| 投资银行业务手续费净收入 | 76,184,383.29 | 105,768,166.01 |
| 资产管理业务手续费净收入 | 39,614,747.14 | 46,969,609.46 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 320,000,198.98 | 429,895,408.05 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | |
| 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 | 38,421,602.50 | 19,962,133.67 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -410,010,904.71 | -31,117,944.97 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | 3,545,590.74 | -916,897.89 |
| 其他业务收入 | 10,087,657.60 | 19,290,881.70 |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列） | -13,140.97 | 27,880,068.91 |
| 二、营业总支出 | 1,062,603,110.55 | 1,058,540,265.83 |
| 税金及附加 | 13,654,518.56 | 18,357,490.04 |
| 业务及管理费 | 910,117,692.25 | 1,040,871,600.90 |
| 资产减值损失 | | |
| 信用减值损失 | 136,575,829.98 | -688,825.11 |
| 其他资产减值损失 | | |
| 其他业务成本 | 2,255,069.76 | |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列） | 256,123,649.49 | 932,686,150.38 |
| 加：营业外收入 | 6,282.93 | 281,440.00 |
| 减：营业外支出 | 1,200,235.29 | 546,416.90 |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 254,929,697.13 | 932,421,173.48 |
| 减：所得税费用 | 20,823,253.50 | 198,766,478.69 |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | 234,106,443.63 | 733,654,694.79 |
| （一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列） | 234,106,443.63 | 733,654,694.79 |
| （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 | -168,828,501.71 | 274,550,459.77 |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益 | 15,188,791.77 | 10,680,660.60 |
| 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 | 15,188,791.77 | 10,680,660.60 |
| 4.企业自身信用风险公允价值变动 | | |

| | | |
|---------------------------|-----------------|------------------|
| (二) 将重分类进损益的其他综合收益 | -184,017,293.48 | 263,869,799.17 |
| 1.权益法下可转损益的其他综合收益 | | |
| 2.其他债权投资公允价值变动 | -175,908,781.01 | 243,410,666.66 |
| 3.可供出售金融资产公允价值变动损益 | | |
| 4.金融资产重分类计入其他综合收益的金额 | | |
| 5.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益 | | |
| 6.其他债权投资信用损失准备 | -8,108,512.47 | 20,459,132.51 |
| 7.现金流量套期储备(现金流量套期损益的有效部分) | | |
| 8.外币财务报表折算差额 | | |
| 9.其他 | | |
| 七、综合收益总额 | 65,277,941.92 | 1,008,205,154.56 |
| 八、每股收益: | | |
| (一) 基本每股收益(元/股) | | |
| (二) 稀释每股收益(元/股) | | |

法定代表人：何伟 主管会计工作负责人：罗国华 会计机构负责人：帅隽

合并现金流量表

2022年1—12月

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2022年度 | 2021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 | | |
| 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 | 1,993,442,574.04 | 2,171,825,047.47 |
| 拆入资金净增加额 | 3,300,000,000.00 | 200,000,000.00 |
| 回购业务资金净增加额 | | 10,514,949,740.32 |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | 2,359,022,707.13 |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | 4,700,192,155.05 | 4,629,690,506.06 |
| 经营活动现金流入小计 | 9,993,634,729.09 | 19,875,488,000.98 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | 2,561,682,838.74 | 3,700,007,006.19 |
| 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 | 680,898,627.45 | 754,860,443.93 |
| 支付给职工及为职工支付的现金 | 857,686,921.31 | 717,864,171.43 |
| 支付的各项税费 | 155,561,399.48 | 257,824,512.82 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | 16,412,180,547.96 | 3,918,291,939.95 |
| 经营活动现金流出小计 | 20,668,010,334.94 | 9,348,848,074.32 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -10,674,375,605.85 | 10,526,639,926.66 |

| | | |
|---------------------------|-------------------|--------------------|
| 二、投资活动产生的现金流量： | | |
| 收回投资收到的现金 | 15,108,638,127.98 | 14,479,433,517.12 |
| 取得投资收益收到的现金 | 1,034,035,685.15 | 601,387,506.38 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | |
| 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 | 16,142,673,813.13 | 15,080,821,023.50 |
| 投资支付的现金 | 9,552,315,733.50 | 29,920,132,038.73 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | 107,503,592.52 | 107,743,577.50 |
| 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 | 9,659,819,326.02 | 30,027,875,616.23 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 6,482,854,487.11 | -14,947,054,592.73 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | |
| 吸收投资收到的现金 | | 10,468,020,000.00 |
| 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 | | |
| 发行债券收到的现金 | 14,197,650,000.00 | 10,230,000,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | |
| 筹资活动现金流入小计 | 14,197,650,000.00 | 20,698,020,000.00 |
| 偿还债务支付的现金 | 7,320,000,000.00 | 9,989,600,000.00 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | 290,944,379.77 | 365,487,304.56 |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润 | | |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | 109,573,373.73 | 2,724,927,703.41 |
| 筹资活动现金流出小计 | 7,720,517,753.50 | 13,080,015,007.97 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 6,477,132,246.50 | 7,618,004,992.03 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | 3,545,590.74 | -916,897.89 |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | 2,289,156,718.50 | 3,196,673,428.07 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | 15,196,086,516.49 | 11,999,413,088.42 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | 17,485,243,234.99 | 15,196,086,516.49 |

法定代表人：何伟 主管会计工作负责人：罗国华 会计机构负责人：帅隽

母公司现金流量表

2022年1—12月

单位:元 币种:人民币

| 项目 | 2022年度 | 2021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 | | |
| 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 | 1,636,528,036.83 | 1,810,553,363.12 |
| 拆入资金净增加额 | 3,300,000,000.00 | 200,000,000.00 |
| 回购业务资金净增加额 | | 10,495,949,740.32 |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | 2,121,710,296.45 |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | 2,233,360,408.33 | 1,386,861,414.04 |
| 经营活动现金流入小计 | 7,169,888,445.16 | 16,015,074,813.93 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | 2,408,019,997.73 | 4,269,709,110.35 |
| 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 | 590,431,628.13 | 710,908,508.60 |
| 支付给职工及为职工支付的现金 | 737,865,533.19 | 631,603,281.27 |
| 支付的各项税费 | 131,630,908.46 | 244,816,074.61 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | 14,998,392,174.59 | 2,492,119,261.44 |
| 经营活动现金流出小计 | 18,866,340,242.10 | 8,349,156,236.27 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -11,696,451,796.94 | 7,665,918,577.66 |
| 二、投资活动产生的现金流量: | | |
| 收回投资收到的现金 | 14,676,404,827.98 | 14,455,497,923.01 |
| 取得投资收益收到的现金 | 1,021,705,517.83 | 601,387,506.38 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | |
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | |
| 投资活动现金流入小计 | 15,698,110,345.81 | 15,056,885,429.39 |
| 投资支付的现金 | 9,554,082,433.50 | 27,570,132,038.73 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | 90,423,687.76 | 96,977,335.96 |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | | |
| 投资活动现金流出小计 | 9,644,506,121.26 | 27,667,109,374.69 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 6,053,604,224.55 | -12,610,223,945.30 |
| 三、筹资活动产生的现金流量: | | |
| 吸收投资收到的现金 | | 10,468,020,000.00 |
| 取得借款收到的现金 | | |
| 发行债券收到的现金 | 14,197,650,000.00 | 10,230,000,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | |
| 筹资活动现金流入小计 | 14,197,650,000.00 | 20,698,020,000.00 |
| 偿还债务支付的现金 | 7,320,000,000.00 | 9,989,600,000.00 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | 290,944,379.77 | 365,487,304.56 |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | 81,052,631.20 | 2,055,999,038.43 |

| | | |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| 筹资活动现金流出小计 | 7,691,997,010.97 | 12,411,086,342.99 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 6,505,652,989.03 | 8,286,933,657.01 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | 3,545,590.74 | -916,897.89 |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | 866,351,007.38 | 3,341,711,391.48 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | 14,225,788,461.68 | 10,884,077,070.20 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | 15,092,139,469.06 | 14,225,788,461.68 |

法定代表人：何伟 主管会计工作负责人：罗国华 会计机构负责人：帅隽

