证券简称:华泰证券　　证券代码:601688　　编号:临 2023-078

华泰证券股份有限公司 第六届董事会第四次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

华泰证券股份有限公司(以下简称"公司")第六届董事会第四次会议通知及议案于 2023 年 8 月 16 日以专人送达或电子邮件方式发出。会议于 2023 年 8 月 30 日以现场及视频会议方式召开,现场会议地点为南京。会议应到董事 13 人,实到董事 11 人,胡晓非执行董事和彭冰独立非执行董事未亲自出席会议,其中:胡晓书面委托张伟董事长代为行使表决权,彭冰书面委托王建文独立非执行董事代为行使表决权。会议由公司董事长张伟主持。公司部分监事及高级管理人员列席会议。本次会议有效表决数占董事总数的 100%,符合《公司法》、公司《章程》和《董事会议事规则》的规定。经与会董事审议,表决通过了各项议案,并作出如下决议:

一、同意关于公司 2023 年半年度报告的议案。

同意公司按中国会计准则和国际财务报告准则分别编制的 2023 年半年度报告。

表决结果:13 票赞成,0 票反对,0 票弃权

二、同意关于修订《华泰证券股份有限公司风险管理基本制度》的议案。

表决结果:13 票赞成,0 票反对,0 票弃权

本次会议还审查了关于公司 2023 年上半年净资本等风险控制指标具体情况的报告。

公司 2023 年半年度报告及摘要、修订后的《华泰证券股份有限公司风险管理基本制度》于同日在上海证券交易所网站披露。

特此公告。

华泰证券股份有限公司董事会

2023 年 8 月 31 日

公司代码:601688　　公司简称:华泰证券

华泰证券股份有限公司 2023 年半年度报告摘要

第一节 重要提示

1.1 本半年度报告摘要来自半年度报告全文,为全面了解本公司的经营成果、财务状况及未来发展规划,投资者应当到 http://www.sse.com.cn 网站仔细阅读半年度报告全文。

1.2 本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证半年度报告内容的真实性、准确性、完整性,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并承担个别和连带的法律责任。

1.3 未出席董事情况

未出席董事职务	未出席董事姓名	未出席董事的原因说明	被委托人姓名
董事	胡晓	公务原因	张伟
独立董事	彭冰	公务原因	王建文

1.3 本半年度报告未经审计。

1.4 董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司董事会在审议半年度报告时,未拟定利润分配预案、资本公积金转增股本预案。

第二节 公司基本情况

2.1 公司简介

公司股票简况				
股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称
A 股	上海证券交易所	华泰证券	601688	-
H 股	香港联合交易所	HTSC	6886	-
GDR	伦敦证券交易所	Huatai Securities Co., Ltd.	HTSC	-

联系人和联系方式	董事会秘书	证券事务代表
姓名	张辉	-
电话	025-83387272、83387780、83389157	-
办公地址	中国江苏省南京市江东中路 228 号 1 号楼 11 楼	-
电子信箱	zhanghui@htsc.com	-

2.2 主要财务数据

单位:元　币种:人民币

	本报告期末	上年度末		本报告期末比上年度末增减(%)
		调整后	调整前	
总资产	887,070,258,102.31	846,570,989,585.00	846,567,015,810.33	4.78
归属于上市公司股东的净资产	167,504,156,660.42	165,095,101,823.43	165,087,200,788.97	1.46

	本报告期	上年同期		本报告期比上年同期增减(%)
		调整后	调整前	
营业收入	18,369,294,321.77	16,166,099,092.18	16,166,099,092.18	13.63
归属于上市公司股东的净利润	6,555,640,254.37	5,375,963,043.99	5,375,208,155.54	21.94
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	7,016,616,781.88	5,307,510,769.45	5,306,755,881.00	32.20
经营活动产生的现金流量净额	-5,246,867,219.25	30,222,986,463.07	30,222,986,463.07	不适用
加权平均净资产收益率(%)	4.23	3.69	3.69	增加 0.54 个百分点
基本每股收益(元/股)	0.70	0.58	0.58	20.69
稀释每股收益(元/股)	0.68	0.56	0.56	21.43

2.3 前 10 名股东持股情况表

单位: 股

截至报告期末股东总数(户)	256,953
截至报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	-

前 10 名股东持股情况

股东名称	股东性质	持股比例(%)	持股数量	持有有限售条件的股份数量	质押、标记或冻结的股份数量	
江苏省国信集团有限公司	国有法人	15.13	1,373,481,636	-	无	-
香港中央结算(代理人)有限公司	境外法人	13.95	1,266,027,718	-	无	-
江苏交通控股有限公司	国有法人	5.39	489,065,418	-	无	-
江苏高科技投资集团有限公司	国有法人	3.92	356,183,206	-	无	-
江苏省苏豪控股集团有限公司	国有法人	3.12	283,264,288	-	无	-
香港中央结算有限公司	境外法人	2.97	269,638,900	-	无	-
阿里巴巴(中国)网络技术有限公司	境内非国有法人	2.96	268,199,233	-	无	-
中国证券金融股份有限公司	未知	1.68	152,906,738	-	无	-
江苏苏豪国际集团股份有限公司	国有法人	1.52	137,838,367	-	无	-
江苏宏图高科技股份有限公司	境内非国有法人	1.36	123,169,146	-	未知	123,169,146
上述股东关联关系或一致行动的说明	江苏省国信集团有限公司、江苏交通控股有限公司、江苏高科技投资集团有限公司和江苏省苏豪控股集团有限公司均为江苏省国资委所属独资企业。江苏省苏豪控股集团有限公司是江苏苏豪国际集团股份有限公司的控股股东。此外,公司未知其他股东之间是否存在关联关系,也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。					
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	公司无优先股股东。					

2.4 截至报告期末的优先股股东总数、前 10 名优先股股东情况表

□适用　√不适用

2.5 控股股东或实际控制人变更情况

□适用　√不适用

2.6 在半年度报告批准报出日存续的债券情况

√适用　□不适用

单位:亿元　币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率(%)
华泰证券股份有限公司 2018 年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	18 华泰 G2	155048	2018-11-22	2023-11-26	10	4.17
华泰证券股份有限公司 2020 年面向合格投资者公开发行公司债券(第二期)	20 华泰 G3	163482	2020-04-27	2025-04-29	35	2.90
华泰证券股份有限公司 2020 年面向合格投资者公开发行公司债券(第三期)	20 华泰 G4	163558	2020-05-19	2025-05-21	30	3.20
华泰证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)	20 华泰 C1	175409	2020-11-11	2025-11-13	50	4.48
华泰证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)	20 华泰 G7	175473	2020-11-20	2023-11-24	35	3.90
华泰证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	20 华泰 G9	175535	2020-12-07	2023-12-09	40	3.79
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	21 华泰 G1	175648	2021-01-18	2024-01-20	40	3.58
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)	21 华泰 C1	175721	2021-01-27	2026-01-29	90	4.50
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	21 华泰 G3	188047	2021-04-22	2024-04-26	50	3.42
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	21 华泰 G4	188106	2021-05-13	2026-05-17	60	3.71
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	21 华泰 G5	188134	2021-05-20	2024-05-24	40	3.28
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种二)	21 华泰 G6	188140	2021-05-20	2026-05-24	20	3.63
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种一)	21 华泰 G7	188239	2021-06-10	2024-06-15	20	3.40
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	21 华泰 09	188282	2021-06-17	2024-06-21	25	3.45
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第七期)(品种一)	21 华泰 11	188324	2021-09-03	2024-09-07	15	3.03
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第七期)(品种二)	21 华泰 12	188325	2021-09-03	2031-09-07	27	3.78
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第一期)	21 华泰 Y1	188785	2021-09-15	-	30	3.85
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第八期)(品种一)	21 华泰 13	188874	2021-10-14	2024-10-18	21	3.25
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第八期)(品种二)	21 华泰 14	188875	2021-10-14	2031-10-18	34	3.99
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第九期)(品种一)	21 华泰 15	188926	2021-10-21	2024-10-25	22	3.22
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第九期)(品种二)	21 华泰 16	188927	2021-10-21	2031-10-25	11	3.94
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第二期)	21 华泰 Y2	188942	2021-10-26	-	50	4.00
华泰证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第三期)	21 华泰 Y3	185019	2021-11-16	-	20	3.80
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第一期)	22 华泰 Y1	185337	2022-01-24	-	27	3.49
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	22 华泰 G1	185364	2022-02-10	2025-02-14	50	2.79
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第二期)	22 华泰 Y2	185388	2022-07-07	-	30	3.59
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	22 华泰 G2	137666	2022-08-11	2024-08-15	20	2.43
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	22 华泰 G3	137732	2022-08-24	2024-08-26	30	2.33
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)	22 华泰 G4	137780	2022-09-01	2025-09-05	20	2.52
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)	22 华泰 G5	137814	2022-09-08	2025-09-13	30	2.50
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券(第三期)	22 华泰 Y3	137604	2022-10-19	-	35	3.20
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	22 华泰 G6	138597	2022-11-17	2024-11-21	36	2.87
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	22 华泰 G7	138598	2022-11-17	2027-11-21	14	3.18
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第七期)(品种一)	22 华泰 G8	138679	2022-12-01	2024-12-05	15	2.87
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第八期)(品种一)	22 华泰 10	138709	2022-12-08	2025-12-12	20	3.35
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第八期)(品种二)	22 华泰 11	138710	2022-12-08	2027-12-12	5	3.49
华泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第九期)(品种一)	22 华泰 12	138737	2022-12-20	2024-12-22	40	3.24
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	23 华泰 G1	138816	2023-01-06	2025-01-10	40	2.92
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	23 华泰 G2	138844	2023-01-12	2025-01-16	8	3.00
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	23 华泰 G3	138845	2023-01-12	2028-01-16	20	3.48
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	23 华泰 G4	138857	2023-02-02	2026-02-06	45	3.23
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)	23 华泰 G5	138886	2023-02-09	2028-02-13	40	3.39
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种一)	23 华泰 G6	138915	2023-02-23	2026-02-27	15	3.14
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种二)	23 华泰 G7	138916	2023-02-23	2028-02-27	22	3.36
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第一期)	23 华泰 S1	115083	2023-03-15	2023-09-15	50	2.65
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第二期)	23 华泰 S2	115117	2023-03-21	2023-10-25	50	2.65
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	23 华泰 G8	115346	2023-05-08	2025-07-10	17	2.82
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	23 华泰 G9	115347	2023-05-08	2028-05-10	7	3.07
华泰证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券(第七期)	23 华泰 10	115367	2023-08-22	2023-08-24	20	2.64

反映发行人偿债能力的指标:

√适用　□不适用

主要指标	报告期末	上年末
资产负债率(%)	76.58	75.81
	本报告期	上年同期
EBITDA 利息保障倍数	2.44	2.46

2.7 经营情况讨论与分析

本集团所属行业是证券行业。证券行业的营业收入和利润水平对证券市场变化趋势的依赖程度较高,具有较强的周期性与波动性特点。本集团的证券业务也依赖并受益于我国的经济增长及我国资本市场的发展及表现,受经济环境、监管环境、投资者情绪以及国际市场等多方面因素影响。

本集团是一家行业领先的科技驱动型证券集团,拥有高度协同的业务模式、先进的数字化平台以及广泛且紧密的客户资源。本集团从事的主要业务包括财富管理业务、机构服务业务、投资管理业务和国际业务。本集团搭建了客户导向的组织架构及机制,通过线上线下有机结合的方式,为个人和机构客户提供全方位的证券及金融服务,并致力于成为兼具本土优势和全球影响力的一流投资银行。

2.7.1 财富管理业务

(1)证券期货期权经纪业务

报告期内,本集团以客户为中心完善一体化经营体系,围绕数字化、平台化、生态化理念,搭建全生命周期财富客户交易体系与成长体系,坚持精细化运营与精准化营销,以优质的平台和服务不断优化用户体验,打造具有差异化竞争优势的财富管理平台,持续提升财富管理服务的覆盖率和满意度。构建完善总部驱动、总分联动、一体运营的财富管理运营体系,打造专业化、开放化的平台发展生态,持续迭代升级"涨乐财富通"平台与"聊 TA"平台功能,不断打磨优化双平台闭环运营模式,切实提升运营效率。积极推动客户服务模式升级和用户运营模式创新,以智能化、平台化方式不断提升服务承载能力、服务效率与服务体验,深度挖掘客户服务场景与业务机会,不断增强客户服务粘性。持续深化财富管理队伍运营的赋能支持,积极打造专业化分工、体系化培育的分层分级财富管理队伍体系,全面提升业务能力与服务效能,满足客户多元化财富管理需求。

本集团持续推进"涨乐财富通"平台产品与服务创新,不断优化内容运营模式,增强特色交易工具和策略服务的运营效能及场景化渗透力,持续升级理财及交易服务体系,有效提升客户粘性。报告期内,"涨乐财富通"下载量 217.68 万,自上线以来累计下载量 7,223.69 万;96.24%的交易客户通过"涨乐财富通"进行交易。根据易观智库统计数据,报告期内,"涨乐财富通"平均月活数为 885.23 万,截至报告期末月活数为 890.64 万,月活数位居证券公司类 APP 第一名。同时,本集团不断夯实"涨乐全球通"平台基础交易服务能力,以专业的平台服务持续提升用户粘性,致力于为客户提供全球资产一站式投资管理服务,"涨乐全球通"自上线以来累计下载量 205.14 万。

本集团进一步强化基于先进平台的交易服务优势。根据沪深交易所会员统计数据,本集团股票基金交易量合计人民币 19.59 万亿元,行业排名第一。截至报告期末,根据内部统计数据,客户账户总资产规模达人民币 5.19 万亿元。

代理交易金额数据

币种:人民币

2023 年 1-6 月		2022 年 1-6 月	
证券品种	代理交易金额(亿元)	证券品种	代理交易金额(亿元)
股票	160,298.23	股票	166,698.49
基金	35,590.70	基金	30,478.02
债券	245,681.69	债券	204,382.31
合计	441,570.62	合计	401,558.82

注:代理交易金额数据引自沪深交易所会员统计数据,其中,基金数据包含上海证券交易所 ETF、货币 ETF、LOF、公募 REITs 交易量。

报告期内,股票期权经纪业务不断提升交易技术支持能力,持续培育合格投资者,深化专业投资者服务,业务继续保持市场领先优势。根据上海证券交易所统计数据,报告期内,本公司沪市股票期权经纪业务成交量市场份额行业排名第一。

期货经纪业务方面,截至报告期末,华泰期货有限公司(以下简称"华泰期货")共有 9 家期货分公司、42 家期货营业部,遍及国内 4 个直辖市和 17 个省份,代理交易品种 116 个。报告期内,华泰期货实现代理成交量 34,646.91 万手,成交金额人民币 263,675.36 亿元。证期业务进一步深度融合,截至报告期末,本集团获准从事期货 IB 业务的证券营业部共 237 家、期货 IB 业务总客户数 5.79 万户。

(2)金融产品销售与基金投资顾问业务

报告期内,本集团多角度推动以客户需求为中心的金融产品销售与基金投资顾问业务开展,以资产配置和金融产品投研为核心业务驱动,以平台化与专业化为牵引,积极构建基于买方视角的一体化资产配置服务体系,为客户提供符合其风险与收益需求的策略组合和金融产品,满足客户多层次的财富管理需求,持续优化客户体验。根据内部统计数据,报告期内,金融产品保有数量(除现金管理产品"天天发"外)10,342 只,金融产品销售规模(除现金管理产品"天天发"外)人民币 2,082.84 亿元。根据中国证券投资基金业协会 2023 年二季度的统计,本公司股票及混合公募基金保有规模人民币 1,297 亿元、非货币市场公募基金保有规模人民币 1,517 亿元,均排名证券行业第二。

报告期内,本集团围绕分层分级客户的差异化需求,以买方投资顾问业务为核心,持续丰富和完善金融产品供给体系,基于多重维度构建供给矩阵,积极打造覆盖资产、策略、产品的一体化投研模式,加强各类资产和策略趋势的研究判断,不断完善"省心家族"配置服务体系,提供从单产品优选到策略配置的多维度解决方案,满足客户多层次、差异化的资产配置需求。持续加强财富管理顾问服务体系建设,不断优化客户服务场景和客户服务方案,通过客户需求深度挖掘和持续客户运营,为客户提供全生命周期的立体式陪伴服务。强化数字化平台能力建设,持续升级迭代投研平台,不断优化因子研究体系,积极构建投研联动模式,提升投资研究效能,有效支持基金投资顾问策略投资生产和运营,增强业务整体效率与能力。

(3)资本中介业务

报告期内,本集团围绕以客户需求为中心的经营理念,深化全业务链合作与联动,深入挖掘客户需求,及时响应客户反馈,积极构建多层次、差异化的客户服务体系,依托业务生态化建设和开放式融券通平台持续迭代的系统优势,不断增强差异化与专业化服务能力,业务发展态势良好。持续完善融券业务运营管理体系,不断丰富与持牌金融机构的合作模式,积极挖掘机构客户券源出借潜力,夯实券源开发基础,拓展券池规模,增强策略和服务供给效率,切实满足客户多层次的业务需求。加强数字化与平台化建设,不断迭代更新融券通平台,构建完善覆盖出借与融券业务全链路的证券借贷业务模式,提供智能、实时的交易体验及数字化、人性化的运营服务,为打造开放生态、创新业务场景、服务客户需求持续赋能。根据监管报表数据口径,截至报告期末,母公司融资融券业务余额为人民币 1,155.61 亿元,市场份额达 7.27%,整体维持担保比例为 270.72%,其中,融券业务余额为人民币 164.79 亿元,市场份额达 17.72%;股票质押式回购业务待购回余额为人民币 274.47 亿元、平均履约保障比例为 228.81%,其中,表内业务待购回余额为人民币 68.23 亿元、平均履约保障比例为 226.26%,表外业务待购回余额为人民币 206.24 亿元。

2.7.2 机构服务业务

(1)投资银行业务

报告期内,本集团将服务实体经济作为自身的使命担当,秉持以优质客户为中心的经营理念,以行业聚焦、区域布局和客户深耕为方向,加强境内境外、场内场外跨市场协同,全面提升全产品服务能力和综合服务快速响应能力,投资银行业务持续保持市场头部地位,业务实力进一步提升。

合并数据

币种:人民币

发行类别	主承销次数(次)		主承销金额(万元)		主承销收入(万元)	
	本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
新股发行	10	262	990,084.34	22,654,748.50	66,329.46	1,132,408.00
增发新股	16	300	2,167,061.38	47,992,218.84	19,134.98	360,113.75
配股	1	37	-	2,280,547.65	-	23,109.07
债券发行	1,165	6,860	22,883,607.87	270,513,302.35	47,723.89	683,816.53
合计	1,192	7,459	26,040,753.59	343,440,817.34	133,188.33	2,199,447.35

注:上表数据来源于监管报表,统计口径为项目发行完成日;增发新股内含优先股;债券发行含国债、金融债、企业债、公司债(含可交换债)、可转债、短期融资券、中期票据等,不含资产证券化项目。

①股权融资业务

报告期内,股权融资业务以优质客户为中心,充分发挥全业务链体系和大投行境内外一体化平台优势,深耕区域,聚焦行业,为客户提供多产品、全周期、定制化的资本市场服务。根据 Wind 资讯统计数据,本集团股权主承销金额(含首次公开发行、增发、配股、优先股、可转债、可交换债)人民币 724.28 亿元,行业排名第三。

②债券融资业务

报告期内,债券融资业务在严格控制风险的基础上,充分发挥全业务链优势,不断完善客户分层管理,积极培养核心客户群体,行业地位进一步巩固。根据 Wind 资讯统计数据,本集团全品种债券主承销金额人民币 5,649.02 亿元,行业排名第三。根据中国证券业协会统计数据,本集团主承销科技创新公司债券金额人民币 101.77 亿元,行业排名第四。

③财务顾问业务

报告期内,并购重组财务顾问业务充分发挥业务创新优势,聚焦高价值交易机会发现能力及交易撮合能力,积极拓展客户持续服务,并购重组业务品牌优势持续稳固。本集团担任独立财务顾问的经监管审核通过的并购重组交易家数 2 家,行业排名第二;交易金额人民币 103.20 亿元,行业排名第三。

④场外业务

报告期内,本集团积极开拓以北京证券交易所上市为目标的新三板挂牌项目,充分发挥大投行一体化优势,持续为科技创新型成长性企业提供完善的资本市场服务。报告期内,本集团完成新三板挂牌项目 3 单、挂牌在审项目 1 单,完成挂牌企业股票定向发行项目 2 单,股票定向发行获准项目 1 单及在审项目 2 单。控股子公司江苏股权交易中心有限责任公司不断完善存续产品管理并持续探索业务模式创新,积极推动制度与业务创新试点方案申报,深化数字化转型,有效推进区块链平台功能的扩充和完善,不断提升中小微企业综合金融服务能力。截至报告期末,挂牌展示企业 15,395 家,纯托管企业 146 家,会员单位 230 家,各类投资者 79,975 户,报告期内为企业新增融资人民币 45.10 亿元。

(2)主经纪商(PB)业务

报告期内,本集团认真贯彻以客户运营为核心的服务理念,围绕客户全生命周期的综合金融服务需求,充分发挥数字化赋能与全业务链服务体系优势,打造具有核心竞争力的一体化服务平台,为专业机构投资者提供跨场内外、境内外的一站式综合主经纪商交易及服务。截至报告期末,基金托管业务累计上线产品 11,627 只,托管业务规模人民币 4,609.40 亿元;基金服务业务累计上线产品 15,482 只(含资管子公司产品 827 只),服务业务规模人民币 10,077.28 亿元(含资管子公司业务规模人民币 3,630.74 亿元)。根据中国证券投资基金业协会截至 2023 年二季度的统计,本集团私募基金托管业务备案存续产品数量行业排名第四。

(3)研究与机构销售业务

报告期内,研究业务坚定推进业务模式转型,积极践行全业务链战略,不断深化业务协同效能,持续完善跨境研究服务体系,打造研究业务竞争优势。持续升级迭代数字服务平台"行知"和智能研究平台"RIS",不断夯实投研底座,沉淀投研数据资产,优化完善产品生产和管理流程,不断提升平台生产效率和服务质量,有效拓展研究成果触达范围和深度。聚焦头部机构客户,通过加强多行业研究联动、深入研究价值挖掘,着力发挥研究业务支撑和牵引作用,多渠道、多平台、多方式开展研究服务活动,满足客户专业化的研究业务需求。机构销售业务以客户为中心,依托全业务链优势,推进"行知"服务平台及机构投资者工作平台建设和功能迭代,做实全面覆盖、分层分级的机构客户池,构建以交易和产品为中心的机构服务生态圈,重塑机构业务一体化服务体系,深入对接机构投资者多样化需求,提供一站式交易及服务解决方案。报告期内,本集团积极开展多种形式的研究服务活动,发布研究报告 4,650 篇,组织研究路演服务 16,890 场、专题电话会议 392 场,通过线上或线上线下相结合方式举办投资峰会、研讨会等专题会议 13 场。报告期内,公募基金分仓交易量人民币 6,478.09 亿元。

(4)投资交易业务

①权益交易业务

报告期内,本集团不断完善策略交易体系,持续提升宏观策略交易能力,深度挖掘重点投资交易品种,积极把握市场投资交易机会,优化加强以大数据交易业务、宏观基本面业务和创新投资业务为核心的绝对收益一体化投资体系,持续拓展权益基础研究的广度、深度和力度,扩充交易模式,丰富业务场景,控制回撤风险,持续完善联动发展的多市场、多层次、立体式的多元业务模式,积极打造投资交易核心能力。全面落实数字化和平台化建设,持续推进平台的迭代升级,不断提升关键节点性能,强化业务运营监控能力,全面提升系统平台业务效能。科创板股票做市交易业务方面,本集团持续加强人才体系建设,不断完善交易系统,迭代做市策略、完备风控体系、业务运营稳健,业务规模有序扩张,截至报告期末累计报备做市股票 45 只。

②FICC 交易业务

报告期内,本集团继续坚定推进 FICC 量化交易战略转型,持续构建以客户需求为导向、以交易为核心的 FICC 业务模式。固定收益自营投资业务积极开展模型、策略和产品等多层次的量化创新实践,不断提升量化策略丰富度,充分发挥市场前瞻和风险控制优势,打磨稳健盈利能力。FICC 代客业务以客户需求引领业务创新,持续扩充产品类型,业务布局不断完善,产品规模不断提升。做市业务实现跨市场、跨品种延展,量化做市报价战略转型成效显著,做市交易量、品种覆盖等维度实现突破。大宗商品和外汇业务持续推进业务创新,落地首单碳排放权交易,业务多元化发展基础不断夯实,客户服务能力稳步提升。积极推进业务数字化转型,不断扩充 HEADS 大象平台应用场景,持续优化 CAMS 信用分析管理系统标准化产品服务形态,体系化、平台化提升投资交易能力和风险管理能力。根据中国证券业协会统计数据,本集团创设信用保护工具规模人民币 11.87 亿元,行业排名第三。

③场外衍生品交易业务

报告期内,本集团着力构建以客户为导向的场外衍生品业务体系,不断提升业务创新能力和交易定价能力,积极扩展客户覆盖的深度和广度,以更加多元化的投资与风险管理工具为客户提供全方位的衍生品交易服务。凭借交易驱动、平台赋能的核心竞争力,持续完善业务模式并不断开拓创新,充分发挥金融科技优势,推动实现核心业务能力的沉淀、升级与转化,积极打造持续驱动业务高质量发展的强力引擎,全面提升客户综合价值创造能力。根据监管报表 SAC 协议数据口径,截至报告期末,收益互换业务存续合约笔数 7,536 笔,存续规模人民币 1,120.74 亿元;场外期权业务存续合约笔数 1,861 笔,存续规模人民币 1,185.66 亿元。报告期内,本集团通过中证机构间报价系统和柜台市场发行私募产品 1,899 只,合计规模人民币 144.29 亿元。

2.7.3 投资管理业务

(1)证券公司资产管理业务

报告期内,本集团全资子公司华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称"华泰资管公司")主动适应市场及监管环境变化,坚持以客户为中心,以投资资管和投行资管服务为抓手,一站式提供一流的投资产品、资产配置及整体金融服务解决方案,赋能客户的资产管理服务旅程,培育差异化的核心竞争力。依托集团全业务链资源,强化与集团双向驱动,立足投行基因优势,充分发挥数字化应用能力,不断夯实主动管理能力,持续完善合规化、便利化、一体化、多样化、高效化的综合资产管理服务体系。根据监管报表数据口径,截至报告期末,华泰资管公司资产管理总规模人民币 4,570.01 亿元。根据 Wind 资讯统计数据,报告期内,华泰资管公司企业 ABS(资产证券化)发行数量 58 单、发行规模人民币 530.75 亿元,均排名行业第三。

报告期内,证券公司资产管理业务继续向主动管理方向转型,持续打磨平台运营、一体联动的核心竞争力,充分发挥资产发现、风险定价与产品设计能力,积极构建规模化、差异化且覆盖不同风险收益特征的产品体系。集合资产管理业务合计管理集合资管计划 184 只,合计管理规模人民币 566.47 亿元。单一资产管理业务加快探索净值型委外业务,合计管理单一资管计划 429 只,合计管理规模人民币 1,134.69 亿元。专项资产管理业务持续推进产品创新,不断提升全链条服务能力,合计管理专项资管计划 214 只,合计管理规模人民币 1,929.57 亿元。公募基金管理业务积极打造针对投资者不同需求的净值化理财解决方案,合计管理公募基金产品 38 只,合计管理规模人民币 939.28 亿元。

证券公司资产管理业务规模和收入情况如下表所示:

币种:人民币

项目	2023 年 1—6 月		2022 年 1—6 月	
	受托规模(亿元)	净收入(万元)	受托规模(亿元)	净收入(万元)
集合资产管理业务	566.47	5,689.56	701.96	9,595.17
单一资产管理业务	1,134.69	14,200.17	1,480.75	11,161.15
专项资产管理业务	1,929.57	6,623.30	1,861.06	6,478.05
公募基金管理业务	939.28	43,080.13	972.36	37,900.88

注:上表数据来源于监管报表。

(2)私募股权基金管理业务

报告期内,私募股权基金管理业务围绕自身优势赛道,专注行业研究,深入布局重点行业,巩固行业影响力,积极推动已投企业借助全面注册制改革契机实现上市退出,同时加强与大型国有企业、行业龙头企业、上市公司等开展合作,推进专注于母基金、医疗健康基金、TMT 基金等各类基金的募集设立,扩大基金管理规模,持续做好投资业务项目储备。截至报告期末,华泰紫金投资有限责任公司(以下简称"华泰紫金投资")及其二级子公司作为管理人在中国证券投资基金业协会备案存续的私募股权投资基金合计 27 只,合计认缴规模人民币 606.29 亿元,合计实缴规模人民币 454.27 亿元。报告期内,上述私募股权投资基金实施投资项目合计 22 个,投资金额合计人民币 6.73 亿元,均为股权投资类项目。根据中国证券投资基金业协会截至 2023 年二季度的统计,华泰紫金投资私募基金月均规模行业排名第三。

(3)基金公司资产管理业务

报告期内,本集团旗下基金公司坚持合规管理与业务发展并重,积极推动产品创新,不断拓宽业务领域与产品线布局,着力完善智能化系统建设,不断研发多元投资模型,多类别、跨周期的综合资产管理能力进一步提升,资产管理总规模继续保持增长。南方基金管理股份有限公司(以下简称"南方基金")资产管理业务方面,截至报告期末,南方基金管理资产规模合计人民币 18,832.37 亿元,其中,公募业务管理基金数量合计 337 个,管理资产规模合计人民币 11,389.00 亿元;非公募业务管理资产规模合计人民币 7,443.37 亿元。华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称"华泰柏瑞")资产管理业务方面,截至报告期末,华泰柏瑞管理资产规模合计人民币 3,559.02 亿元,其中,公募业务管理基金数量合计 136 个,管理资产规模合计人民币 3,348.66 亿元;非公募业务管理资产规模合计人民币 210.36 亿元。(南方基金以及华泰柏瑞的股权投资损益计入在分部报告中的其