

---

上海海通证券资产管理有限公司

公司债券中期报告

(2022 年)

二〇二二年八月

## 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、高级管理人员已对中期报告签署书面确认意见。公司监事会（如有）已对中期报告提出书面审核意见，监事已对中期报告签署书面确认意见。

发行人及全体董事、监事、高级管理人员保证中期报告内容的真实、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。

本公司中期报告中的财务报告未经审计。

## 重大风险提示

投资者在评价和购买本公司发行的公司债券前，应认真考虑各项可能对本次债券的偿付、债券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，并仔细阅读各期募集说明书中“风险因素”等有关章节的内容。

截至本半年度报告出具日，公司面临的风险因素与上一报告期以及募集说明书中“风险因素”章节没有重大变化。

## 目录

重要提示.....	2
重大风险提示.....	3
释义.....	5
<b>第一节 发行人情况.....</b>	<b>7</b>
一、 公司基本信息.....	7
二、 信息披露事务负责人.....	7
三、 报告期内控股股东、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.....	8
五、 公司业务和经营情况.....	9
六、 公司治理情况.....	10
<b>第二节 债券事项.....</b>	<b>11</b>
一、 公司信用类债券情况.....	11
二、 公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况.....	12
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.....	13
四、 公司债券报告期内募集资金使用情况.....	13
五、 公司信用类债券报告期内资信评级调整情况.....	13
六、 公司债券担保、偿债计划及其他偿债保障措施情况.....	13
<b>第三节 报告期内重要事项.....</b>	<b>14</b>
一、 财务报告审计情况.....	14
二、 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正.....	14
三、 合并报表范围调整.....	14
四、 资产情况.....	14
五、 负债情况.....	15
六、 利润及其他损益来源情况.....	16
七、 报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十.....	16
八、 非经营性往来占款和资金拆借.....	16
九、 对外担保情况.....	17
十、 关于重大未决诉讼情况.....	17
十一、 报告期内信息披露事务管理制度变更情况.....	17
十二、 向普通投资者披露的信息.....	17
<b>第四节 特定品种债券应当披露的其他事项.....</b>	<b>17</b>
一、 发行人为可交换债券发行人.....	17
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.....	17
三、 发行人为永续期公司债券发行人.....	17
四、 发行人为其他特殊品种债券发行人.....	17
五、 其他特定品种债券事项.....	17
<b>第五节 发行人认为应当披露的其他事项.....</b>	<b>18</b>
<b>第六节 备查文件目录.....</b>	<b>19</b>
<b>财务报表.....</b>	<b>21</b>
附件一： 发行人财务报表.....	21

## 释义

发行人	指	上海海通证券资产管理有限公司
上交所	指	上海证券交易所
登记机构	指	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
18海资01	指	上海海通证券资产管理有限公司 2018 年次级债券（第一期）
20海资G1	指	上海海通证券资产管理有限公司 2020 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期）
本公司债券	指	18海资01、20海资G1
债券持有人	指	通过认购、交易、受让、继承、承继或其他合法方式取得并持有本公司债券的合格投资者
《债券受托管理协议》	指	债券受托管理协议
《账户及资金监管协议》	指	债券账户及资金监管协议
公司章程	指	《上海海通证券资产管理有限公司章程》
报告期、本报告期、本期	指	2022年1月1日至2022年6月30日
交易日	指	上海证券交易所的营业日
半年度报告/本报告	指	上海海通证券资产管理有限公司公司债券中期报告（2022年）
法定节假日或休息日	指	中华人民共和国法定节假日或休息日（不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法定节假日和/或休息日）
受限资产	指	被设立了抵押/质押等限制物权，或被查封/冻结，或被设立了可对抗第三人的优先受偿权的资产，其将无法变现，或必须满足一定条件才能够变现用于清偿债务
其他债券和债务工具	指	除公司债以外的债券和债务工具，包括企业债、可转换债券、可交换债券、项目收益债券、专项债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、银行借款等
连带责任担保	指	当事人在保证合同中约定保证人与债务人对债务承担连带责任的一种担保方式，如果在保证期间内，债权人依法向连带责任保证人请求承担保证责任，保证人不得拒绝
银行授信	指	商业银行向非金融机构客户提供的资金，或者对客户在有关经济活动中可能产生的赔偿、支付责任做出的保证，包括贷款、贸易融资、票据融资、融资租赁、透支、各项垫款等表内业务，以及票据承兑、开出信用证、保函、备用信用证、信用证保兑、债券发行担保、借款担保、有追索权的资产销售、未使用的不可撤销的贷款承诺等表外业务
独立性	指	公司与其控股股东或实际控制人之间，在业务、资产、人员、财务、机构五大方面保持独立性，能够自主决定其经营方针和战略决策
非经营性往来占款	指	与主营业务和其他业务无关的大额长账龄往来款项，尤其是关联方之间的此类款项
资金拆借	指	银行或其他金融机构之间在经营过程中相互调剂头

		寸资金的信用活动
存续期	指	债券起息日起至债券到期日（或赎回日）止的时间区间
元	指	如无特别说明，指人民币元

## 第一节 发行人情况

### 一、公司基本信息

中文名称	上海海通证券资产管理有限公司
中文简称	海通资管
外文名称（如有）	Shanghai Haitong Securities Asset Management Co., Ltd
外文缩写（如有）	Haitong Securities Asset Management
法定代表人	裴长江
注册资本（万元）	220,000
实缴资本（万元）	220,000
注册地址	上海市广东路 689 号第 32 层
办公地址	上海市广东路 689 号第 32 层、31 层 7-12 单元及 30 层第 10 单元
办公地址的邮政编码	200001
公司网址（如有）	<a href="http://www.htsamc.com">http://www.htsamc.com</a>
电子信箱	htam@htsec.com

### 二、信息披露事务负责人

姓名	吴文然
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	上海海通证券资产管理有限公司合规总监、合规与法务部总监
联系地址	上海市广东路 689 号第 32 层、31 层 7-12 单元及 30 层第 10 单元
电话	021-23212075
传真	021-63410460
电子信箱	wwr9133@htsec.com

**三、报告期内控股股东、实际控制人及其变更情况****（一）报告期内控股股东的变更情况**

□适用√不适用

**（二）报告期内实际控制人的变更情况**

□适用√不适用

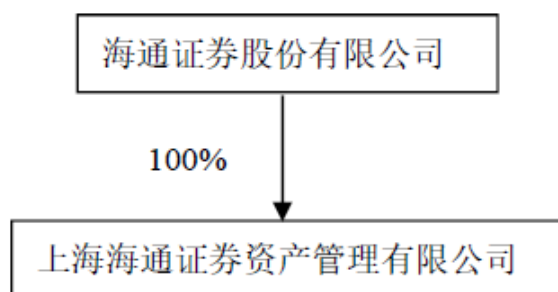
**（三）报告期末控股股东、实际控制人信息**

报告期末控股股东名称：海通证券股份有限公司

报告期末控股股东对发行人的股权（股份）质押占控股股东持股的百分比（%）：0.00

报告期末实际控制人名称：无实际控制人

公司与控股股东、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）



控股股东为机关法人、国务院各组织机构直接监管的企业以外主体的

√适用□不适用

控股股东的资信情况

截至报告期末，公司控股股东海通证券股份有限公司资信良好。

控股股东所持有的除发行人股权（股份）外的其他主要资产及其受限情况

截至报告期末，公司控股股东海通证券股份有限公司除持有海通资管股权外，主要还拥有海通国际控股有限公司、海通开元投资有限公司、海通创新证券投资有限公司、海通期货股份有限公司等全资或控股子公司。截至2021年末，海通证券股份有限公司总资产为7,449.25亿元，受限资产为1,205.41亿元，主要为有承诺条件的交易性金融资产和其他债权投资。

实际控制人为自然人的

□适用√不适用

**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	决定/决议变更时间或辞任时间	工商登记完成时间
高级管理人员	周陶	合规总监 (离任)	2022-3-10	无需工商登记
高级管理人员	吴文然	合规总监	2022-3-10	无需工商登记

		(新任)		
--	--	------	--	--

## （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、高级管理人员人数8.33%。

## （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：

发行人董事长：裴长江

发行人的其他董事：李井伟、吴淑琨、张少华、吴国华

发行人的监事：宋世浩

发行人的总经理：李井伟

发行人的财务负责人：李井伟

发行人的其他高级管理人员：胡倩、陈颖、邓航、曾丽琼、张承启、吴文然

## 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

2022年上半年，公司一方面积极谋划资管业务转型并布局公募市场，另一方面持续提升主动管理能力。上半年，公司继续冲刺大集合公募改造工作，截至目前，全部17只大集合产品中已有15只产品完成整改规范、对标公募基金运作中，1只已获中国证监会审批通过，剩余1只在会审批中；获监管批准，公司已恢复新增私募产品备案资格。截至2022年6月30日，公司管理的集合资产管理计划规模352.60亿元，单一资产管理计划规模260.99亿元，专项资产管理计划规模349.28亿元，QDII业务占用额度为3.4609亿美元。此外，公司2022年1-6月新增1只集合资产管理计划，6只专项资产管理计划（为资产证券化业务）。

#### 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

伴随着中国资产管理行业新规过渡期的结束，中国资产管理行业于2022年全面开启净值化时代。整体来看，2022年上半年由于海外资本市场受俄乌局势冲突与美联储加息影响震荡显著、叠加国内疫情等多重影响，国内资本市场也出现了波动，资管行业发展形势更加严峻、复杂。具体而言，2022年上半年，国内权益市场呈震荡下行态势，固收市场进一步承压，资管行业整体业绩表现不佳，公募基金增速也随之放缓。

据中国证券投资基金业协会统计，截至2022年第一季度末，公募基金业务规模25.08万亿元，证券公司及其子公司私募资产管理业务规模7.85万亿元，基金管理公司及其子公司私募资产管理业务规模7.19万亿元，期货公司及其子公司私募资产管理业务规模0.35万亿元，基金公司管理的养老金规模3.83万亿元。

#### 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

后资管新规时代，资管机构已逐步完成了去通道、净值化管理等要求，也促使券商资管步入向公募基金业务转型的新阶段。2022年5月20日，证监会对《证券投资基金管理公司管理办法》进行了修订，并更名为《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》，本次修订在继续坚持基金管理公司“一参一控”政策前提下，适度放宽了公募持牌数量限制，

允许同一集团下证券资管子公司、保险资管公司、银行理财子公司等专业资管机构申请公募牌照。据此，公司可依法申请公募基金管理业务资格。

目前，公司已完成十余只大集合产品的公募化改造，形成了产品风险等级由低到高、持有期限由短到长的公募产品矩阵线，在充分控制投资风险的前提下，力求实现产品资产的增值。为适应公募化转型的变化，公司也积极完善内部治理结构及各项制度、建立高标准的合规风控体系及运营服务体系、提升投研能力和财富服务能力，为投资者创造更优质的投资服务体验。接下来，公司也将积极申请公募业务牌照，立足所长，不断拓展资管业务。根据政策导向，公司将重点构建领先的投资能力、构建持续精进风格化、专业化的投资能力，促进产品风格的多元稳定；加强人才队伍建设，打造公司平台与优秀人才相互促进的良性循环；坚持中长期业绩导向，力争为投资者创造长期、稳定、可持续的回报。

## （二） 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

未来，公司在回归本源的同时，充分利用自身优势和政策利好，实现资管业务高质量的发展，拓宽投资渠道，搭建不同风险偏好的产品体系，开发跨市场的产品或产品组合，实现差异化经营，满足个性化的综合金融服务需求。具体而言，公司将以公募产品作为财富管理的基石产品、以特色私募产品为机构客户和高净值客户提供多元化的产品与服务方案，在发展过程中寻求特色化、差异化发展的路径和规划。

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

公司未来可能面临的风险：

2022年以来，政策持续助力公募基金行业高质量发展，积极培育专业资产管理机构、壮大公募基金经理人队伍、调整优化公募基金牌照制度、适度放宽公募持牌数量限制，“一参一控一牌”正式落地。各家券商正加速转型并布局公募市场，除了不断提升主动管理能力外，还积极申请设立资管子公司、拿下公募基金牌照、增持公募基金公司股权。公司当前正面临自身转型及多方竞争的压力。

公司采取的措施：

公司正完善投研体系建设，加大投研队伍的培养，引进优秀的投研人才；同时，致力于“核心化、精品化、定制化”的产品布局，挖掘优秀产品、丰富产品体系、做精产品布局、提升产品业绩、做大产品规模、扩大产品宣传，有效提升产品获客能力。

公司力争在今年第三季度前完成剩余1只大集合产品的参公改造工作，形成17只产品风险等级由低到高、持有期限差异化的公募产品矩阵；同时继续加快公募化转型，积极申请公募业务牌照；私募板块则依托良好的投资历史业绩及市场口碑，充分发挥集团资源和自身专业优势，加快净值产品的布局。

## 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、不能保持自主经营能力的情况：

是 否

（二） 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

根据公司章程第八十二条：公司与关联方之间进行的、标的额达到或超过公司最近一期经审计净资产值5%的关联交易，属于公司的重大关联交易，应事先经董事会批准。

关联方与公司之间进行的、达到公司最近一期经审计的净资产10%以上的关联交易，须经董事会审议后，经股东同意且做出书面决定。

对关联方、关联交易的认定，按照财政部《企业会计准则——关联方关系及其交易的

披露》中关于关联方关系、关联交易的有关规定执行。

根据公司章程第八十三条：公司与股东、受股东控制的其他子公司之间应当建立合理必要的隔离墙，防止可能出现的风险传递和利益冲突。

根据公司章程第八十四条：公司与股东之间进行的业务合作，不得违反法律法规的规定及监管机构的要求。

对于无法避免或者有合理原因而发生的关联交易，海通资管承诺将遵循市场公正、公平、公开的原则，并依法签订协议，履行合法程序，按照公司章程、有关法律法规履行信息披露义务和办理有关报批程序，确保不通过关联交易损害公司及债权人的合法权益。

**（三） 发行人报告期内是否存在违反法律法规、公司章程、公司信息披露事务管理制度等规定的情况**

是 否

**（四） 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

## 第二节 债券事项

### 一、公司信用类债券情况

#### （一） 结构情况

截至报告期末，发行人口径有息债务余额 11 亿元，其中公司信用类债券余额 11 亿元，占有息债务余额的 100%；银行贷款余额 0 亿元，占有息债务余额的 0%；非银行金融机构贷款 0 亿元，占有息债务余额的 0%；其他有息债务余额 0 亿元，占有息债务余额的 0%。

单位：亿元币种：人民币

有息债务类别	到期时间				合计
	已逾期	6 个月以内（含）；	6 个月（不含）至 1 年（含）	超过 1 年以上（不含）	
公司信用类债券	-	-	1	10	11
合计	-	-	1	10	11

截至报告期末，发行人发行的公司信用类债券中，公司债券余额 11 亿元，企业债券余额 0 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0 亿元，且共有 0 亿元公司信用类债券在 2022 年下半年到期或回售偿付。

#### （二） 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	上海海通证券资产管理有限公司 2018 年次级债券（第一期）
2、债券简称	18 海资 01
3、债券代码	150254.SH
4、发行日	2018 年 4 月 4 日
5、起息日	2018 年 4 月 4 日
6、2022 年 8 月 31 日后的最近回售日	-
7、到期日	2023 年 4 月 4 日

8、债券余额	1.00
9、截止报告期末的利率(%)	5.00
10、还本付息方式	本期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
11、交易场所	上交所
12、主承销商	海通证券股份有限公司
13、受托管理人（如有）	上海市锦天城律师事务所
14、投资者适当性安排（如适用）	面向合格机构投资者交易的债券
15、适用的交易机制	点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	上海海通证券资产管理有限公司 2020 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期）
2、债券简称	20 海资 G1
3、债券代码	175365.SH
4、发行日	2020 年 11 月 4 日
5、起息日	2020 年 11 月 4 日
6、2022 年 8 月 31 日后的最近回售日	2023 年 11 月 4 日
7、到期日	2025 年 11 月 4 日
8、债券余额	10.00
9、截止报告期末的利率(%)	3.85
10、还本付息方式	本期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
11、交易场所	上交所
12、主承销商	海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司
13、受托管理人（如有）	申万宏源证券有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向专业投资者公开发行
15、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
16、是否存在终止上市的风险（如适用）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  本公司的债券有选择权条款

债券代码：150254.SH

债券简称：18 海资 01

债券包括的条款类型：

调整票面利率选择权  回售选择权  发行人赎回选择权  可交换债券选择权  其他选择权

选择权条款的触发和执行情况：

调整票面利率选择权：公司决定将 18 海资 01 在 2021 年 4 月 4 日至 2023 年 4 月 3 日期间的票面利率调整为 5.00%。

回售选择权：18 海资 01 回售价格为债券面值（100 元/张），回售有效期登记数量为 900,000 手，回售金额为 900,000,000.00 元，回售资金兑付日为 2021 年 4 月 6 日。

债券代码：175365.SH

债券简称：20 海资 G1

债券包括的条款类型：

调整票面利率选择权 回售选择权 发行人赎回选择权 可交换债券选择权 其他选择权

选择权条款的触发和执行情况：

本期债券相应选择权在报告期内均未触发执行。

### 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 本公司的债券有投资者保护条款

### 四、公司债券报告期内募集资金使用情况

本公司所有公司债券在报告期内均未使用募集资金

本公司的债券在报告期内使用了募集资金

### 五、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、公司债券担保、偿债计划及其他偿债保障措施情况

#### （一）报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施变更情况

适用 不适用

#### （二）截至报告期末担保、偿债计划及其他偿债保障措施情况

适用 不适用

债券代码：150254.SH

债券简称	18海资01
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	1) 增信措施：无。2) 偿债计划：本期债券付息日为2019年至2023年每年的4月4日，本金兑付日为2023年4月4日。3) 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、设立专门的偿付工作小组、严格的信息披露、设立募集资金专项账户、严格执行资金管理计划及发行人承诺。
担保、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）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，偿债计划及其他偿债保障措施均按照《募集说明书》的约定执行

债券代码：175365.SH

债券简称	20海资G1
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	1) 增信措施：无。2) 偿债计划：本期债券付息日为2021年至2025年每年的11月4日，本金兑付日为2025年11月4日。若投资人行使回售选择权，则回售部分债券的付息日为2021年至2023年每年11月4日，兑付日为2023年11月4日。3) 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、设立专门的偿付工作小组、严格的信息披露、设立募集资金专项账户、严格执行资金管理计划及发行人承诺。
担保、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）	无

报告期担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，偿债计划及其他偿债保障措施均按照《募集说明书》的约定执行
--------------------------	-----------------------------------

### 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 未经审计

#### 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）资产变动情况

公司存在期末余额变动比例超过 30% 的主要资产项目

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 (%)	上年末余额	变动比例 (%)
货币资金	16.25	22.58	11.20	45.05
结算备付金	0.11	0.15	0.36	-71.04
交易性金融资产	17.18	23.87	33.22	-48.24
递延所得税资产	1.96	2.73	1.49	32.09
使用权资产	-	-	0.01	-100.00
其他资产	1.55	2.15	0.24	557.98

发生变动的的原因：

货币资金变动主要系收到自有资金投资款。

结算备付金变动主要系合并结构化主体的自由结算备付金减少。

交易性金融资产变动主要系自有资金投资减少。

递延所得税资产变动主要系可抵扣暂时性差异增加。

使用权资产变动主要系长期租赁合同到期。

其他资产变动主要系暂付款增加。

##### （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	16.25	2.43	不适用	14.94
合计	16.25	2.43	—	—

## 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百分之十

适用 不适用

## 3. 发行人所持重要子公司股权的受限情况

直接或间接持有的重要子公司股权截止报告期末存在的权利受限情况：

适用 不适用

## 五、负债情况

## （一） 负债变动情况

公司存在期末余额变动比例超过 30%的主要负债项目

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（%）
交易性金融负债	1.11	5.84	4.78	-76.86
卖出回购金融资产款	-	-	0.20	-100.00
应交税费	0.76	4.01	3.25	-76.65
应付款项	-	-	0.05	-100.00
租赁负债	-	-	0.01	-100.00
其他负债	1.78	9.42	6.96	-74.40

发生变动的的原因：

交易性金融负债变动主要系合并结构化产品规模减少。

卖出回购金融资产款变动主要系合并结构化产品中卖出回购金融资产减少。

应交税费变动主要系缴纳税费。

应付款项变动主要系合并结构化产品中应付款项减少。

租赁负债变动主要系长期租赁合同到期。

其他负债变动主要系其他应付款减少。

## （二） 报告期末存在逾期金额超过 1000 万元的有息债务

适用 不适用

## （三） 合并报表范围内公司报告期末存在公司信用类债券逾期的

适用 不适用

## （四） 有息债务及其变动情况

1. 报告期初合并报表范围内公司有息债务总额：11 亿元，报告期末合并报表范围内公司有息债务总额 11 亿元，有息债务同比变动 0%。

2. 报告期末合并报表范围内有息债务中，公司信用类债券余额 11 亿元，占有息债务余额的 100%，其中 2022 年下半年到期或回售的公司信用类债券 0 亿元；银行贷款余额 0 亿元，占有息债务余额的 0%；非银行金融机构贷款 0 亿元，占有息债务余额的 0%；其他有息债务余额 0 亿元，占有息债务余额的 0%。

单位：亿元币种：人民币

有息债务类别	到期时间				合计
	已逾期	6 个月以内（含）	6 个月（不含）至 1 年（含）	超过 1 年以上（不含）	
公司信用类债券	-	-	1	10	11
合计	-	-	1	10	11

3. 截至报告期末，发行人合并口径内发行的境外债券余额 0 亿元人民币，且在 2022 年下半年内到期的境外债券余额为 0 亿元人民币。

#### （五） 可对抗第三人的优先偿付负债情况

截至报告期末，可对抗第三人的优先偿付负债情况：

适用 不适用

### 六、利润及其他损益来源情况

#### （一） 基本情况

报告期利润总额：3.36 亿元

报告期非经常性损益总额：2.49 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 10%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的，请说明原因

适用 不适用

### 七、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

### 八、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 亿元；

2. 报告期内，非经营性往来占款和资金拆借新增：0 亿元，收回：0 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

不适用。

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 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 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%，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

**九、对外担保情况**

报告期初对外担保的余额：0 亿元

报告期末对外担保的余额：0 亿元

报告期对外担保的增减变动情况：0 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 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、关于重大未决诉讼情况**

适用 不适用

**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、发行人为永续期公司债券发行人**

适用 不适用

**四、发行人为其他特殊品种债券发行人**

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中期报告、半年度财务信息。

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，亦可在发行人办公场所查阅（上海市黄浦区广东路689号32层）。

（以下无正文）

（本页无正文，为《上海海通证券资产管理有限公司公司债券中期报告（2022年）》之盖章页）

上海海通证券资产管理有限公司



2022年08月31日

## 财务报表

### 附件一： 发行人财务报表

#### 合并资产负债表

2022年6月30日

编制单位：上海海通证券资产管理有限公司

单位:元币种:人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	1,625,101,339.93	1,120,403,612.66
其中：客户资金存款		
结算备付金	10,509,470.60	36,288,133.98
其中：客户备付金		
贵金属		
拆出资金		
融出资金		
衍生金融资产		
存出保证金	10,500,000.00	10,529,327.97
应收款项	272,795,558.95	301,747,771.78
应收款项融资		
合同资产		
买入返售金融资产	3,197,138,053.59	3,107,088,277.25
持有待售资产		
<b>金融投资：</b>		
交易性金融资产	1,718,289,745.88	3,321,943,677.29
债权投资		
其他债权投资		
其他权益工具投资		
长期股权投资		
投资性房地产		
固定资产	2,575,270.90	3,231,420.97
在建工程		
使用权资产		853,873.66
无形资产	9,104,408.92	12,513,678.57
商誉		
递延所得税资产	196,350,155.22	148,649,045.05
其他资产	154,721,364.64	23,514,577.73
资产总计	7,197,085,368.63	8,086,763,396.91
<b>负债：</b>		
短期借款		
应付短期融资款		
拆入资金		
交易性金融负债	110,560,348.28	477,721,311.86
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		20,052,602.72
代理买卖证券款		
代理承销证券款		

应付职工薪酬	401,625,588.20	400,958,962.61
应交税费	75,822,107.66	324,750,925.79
应付款项		4,667,376.96
合同负债		
持有待售负债		
预计负债		
长期借款		
应付债券	1,126,309,588.94	1,109,738,356.10
其中：优先股		
永续债		
租赁负债		618,096.18
递延收益		
递延所得税负债		
其他负债	178,198,774.60	695,980,552.70
负债合计	1,892,516,407.68	3,034,488,184.92
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>		
实收资本（或股本）	2,200,000,000.00	2,200,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积		
减：库存股		
其他综合收益		
盈余公积	441,412,304.75	441,412,304.75
一般风险准备	1,137,377,680.87	1,133,616,744.24
未分配利润	1,525,778,975.33	1,277,246,163.00
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	5,304,568,960.95	5,052,275,211.99
少数股东权益		
所有者权益（或股东权益）合计	5,304,568,960.95	5,052,275,211.99
负债和所有者权益（或股东权益）总计	7,197,085,368.63	8,086,763,396.91

公司负责人：裴长江主管会计工作负责人：李井伟会计机构负责人：孙琪旻

### 母公司资产负债表

2022年6月30日

编制单位：上海海通证券资产管理有限公司

单位：元币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	1,579,259,540.88	1,096,429,022.25
其中：客户资金存款		
结算备付金	10,509,470.60	11,386,498.43
其中：客户备付金		
贵金属		
拆出资金		
融出资金		

衍生金融资产		
存出保证金	10,500,000.00	10,500,000.00
应收款项	518,634,890.73	608,195,711.48
应收款项融资		
合同资产		
买入返售金融资产	2,667,972,679.36	2,338,623,386.00
持有待售资产		
<b>金融投资：</b>		
交易性金融资产	1,930,512,434.23	2,763,168,954.42
债权投资		
其他债权投资		
其他权益工具投资		
长期股权投资		
投资性房地产		
固定资产	2,575,270.90	3,231,420.97
在建工程		
使用权资产		853,873.66
无形资产	9,104,408.92	12,513,678.57
商誉		
递延所得税资产	196,350,155.22	148,649,045.05
其他资产	153,177,110.18	20,836,811.15
资产总计	7,078,595,961.02	7,014,388,401.98
<b>负债：</b>		
短期借款		
应付短期融资款		
拆入资金		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		
代理买卖证券款		
代理承销证券款		
应付职工薪酬	401,625,588.20	400,958,962.61
应交税费	69,031,270.93	323,100,233.62
应付款项		
合同负债		
持有待售负债		
预计负债	13,487,558.98	17,553,717.48
长期借款		
应付债券	1,126,309,588.94	1,109,738,356.10
其中：优先股		
永续债		
租赁负债		618,096.18
递延收益		
递延所得税负债		
其他负债	163,572,993.02	110,143,824.00
负债合计	1,774,027,000.07	1,962,113,189.99
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>		
实收资本（或股本）	2,200,000,000.00	2,200,000,000.00

其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积		
减：库存股		
其他综合收益		
盈余公积	441,412,304.75	441,412,304.75
一般风险准备	1,137,377,680.87	1,133,616,744.24
未分配利润	1,525,778,975.33	1,277,246,163.00
所有者权益（或股东权益）合计	5,304,568,960.95	5,052,275,211.99
负债和所有者权益（或股东权益）总计	7,078,595,961.02	7,014,388,401.98

公司负责人：裴长江主管会计工作负责人：李井伟会计机构负责人：孙琪旻

**合并利润表**  
2022年1—6月

单位：元币种：人民币

项目	2022年半年度	2021年半年度
一、营业总收入	380,672,069.01	999,934,060.55
利息净收入	17,724,274.41	-2,683,976.77
其中：利息收入	38,700,374.26	59,571,131.68
利息支出	20,976,099.85	62,255,108.45
手续费及佣金净收入	183,705,294.32	892,645,285.27
其中：经纪业务手续费净收入		
投资银行业务手续费净收入		
资产管理业务手续费净收入	182,786,521.75	864,005,990.33
投资收益（损失以“-”号填列）	-17,082,128.09	165,630,306.47
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	86,903,514.75	85,864,392.90
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	109,421,113.62	-141,521,947.32
汇兑收益（损失以“-”号填列）		
其他业务收入		
资产处置收益（损失以“-”号填列）		
二、营业总支出	44,355,660.27	261,140,463.58
税金及附加	2,694,458.11	5,692,928.84
业务及管理费	95,029,580.61	222,047,936.96
资产减值损失	-53,368,378.45	33,399,597.78
信用减值损失		
其他资产减值损失		
其他业务成本		
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	336,316,408.74	738,793,596.97
加：营业外收入		
减：营业外支出		1,200.00
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	336,316,408.74	738,792,396.97
减：所得税费用	84,022,659.78	183,325,924.58

五、净利润（净亏损以“-”号填列）	252,293,748.96	555,466,472.39
（一）按经营持续性分类		
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		
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）	252,293,748.96	555,466,472.39
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		
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		
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		
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		
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		
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		
5.现金流量套期储备		
6.外币财务报表折算差额		
7.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	252,293,748.96	555,466,472.39
归属于母公司所有者的综合收益总额		
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 元,上期被合并方实现的净利润为：0 元。

公司负责人：裴长江主管会计工作负责人：李井伟会计机构负责人：孙琪旻

**母公司利润表**  
2022 年 1—6 月

单位:元币种:人民币

项目	2022 年半年度	2021 年半年度
一、营业总收入	432,438,602.99	1,000,295,745.04
利息净收入	17,061,415.55	-21,791,396.47
其中：利息收入	38,637,633.49	40,463,711.98
利息支出	21,576,217.94	62,255,108.45
手续费及佣金净收入	183,705,294.32	894,759,378.65

其中：经纪业务手续费净收入		
投资银行业务手续费净收入		
资产管理业务手续费净收入	182,786,521.75	866,120,083.71
投资收益（损失以“-”号填列）	335,621,730.90	109,648,952.12
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	86,903,514.75	85,864,392.90
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-190,853,352.53	-68,185,582.16
汇兑收益（损失以“-”号填列）		
其他业务收入		
资产处置收益（损失以“-”号填列）		
二、营业总支出	96,122,194.25	226,807,677.10
税金及附加	1,360,769.21	5,422,865.19
业务及管理费	94,761,425.04	221,384,811.91
资产减值损失		
信用减值损失		
其他资产减值损失		
其他业务成本		
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	336,316,408.74	773,488,067.94
加：营业外收入		
减：营业外支出		34,695,670.97
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	336,316,408.74	738,792,396.97
减：所得税费用	84,022,659.78	183,325,924.58
五、净利润（净亏损以“-”号填列）	252,293,748.96	555,466,472.39
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		
（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		
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		
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		
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		
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		
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		
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	252,293,748.96	555,466,472.39
八、每股收益：		
（一）基本每股收益(元/股)		

(二) 稀释每股收益(元/股)

公司负责人：裴长江主管会计工作负责人：李井伟会计机构负责人：孙琪旻

## 合并现金流量表

2022年1—6月

单位：元币种：人民币

项目	2022年半年度	2021年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>		
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	223,149,504.31	887,955,157.46
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额	-46,590,061.48	882,269,688.53
代理买卖证券收到的现金净额		
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额	1,519,032,552.16	1,007,247,609.10
收到其他与经营活动有关的现金	172,024,570.33	250,398,750.56
经营活动现金流入小计	1,867,616,565.32	3,027,871,205.65
为交易目的而持有的金融资产净增加额		
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		19,706.04
支付给职工及为职工支付的现金	35,818,919.78	23,577,501.79
支付的各项税费	474,666,351.09	500,795,371.39
支付其他与经营活动有关的现金	888,928,876.46	214,857,487.51
经营活动现金流出小计	1,399,414,147.33	739,250,066.73
经营活动产生的现金流量净额	468,202,417.99	2,288,621,138.92
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金		
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		
投资支付的现金		
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		2,509,407.74
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		2,509,407.74
投资活动产生的现金流量净额		-2,509,407.74
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>		
吸收投资收到的现金		
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		
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计		
偿还债务支付的现金	5,000,000.00	900,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	623,081.28	60,500,000.00
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		
筹资活动现金流出小计	5,623,081.28	960,500,000.00
筹资活动产生的现金流量净额	-5,623,081.28	-960,500,000.00
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	462,579,336.71	1,325,611,731.18
加：期初现金及现金等价物余额	930,167,966.08	264,419,742.66
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	1,392,747,302.79	1,590,031,473.84

公司负责人：裴长江主管会计工作负责人：李井伟会计机构负责人：孙琪旻

#### 母公司现金流量表

2022年1—6月

单位：元币种：人民币

项目	2022年半年度	2021年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>		
销售商品、提供劳务收到的现金		
处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额	988,554,531.99	1,052,222,952.21
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	293,839,310.59	890,041,857.97
拆入资金净增加额		
回购业务资金净增加额	-329,349,293.36	799,307,993.00
代理买卖证券收到的现金净额		
收到其他与经营活动有关的现金	171,995,242.36	250,376,547.98
经营活动现金流入小计	1,125,039,791.58	2,991,949,351.16
为交易目的而持有的金融资产净增加额		
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		
支付给职工及为职工支付的现金	35,818,919.78	23,577,501.79
支付的各项税费	478,472,806.75	500,795,371.39
支付其他与经营活动有关的现金	139,511,220.15	214,857,487.51
经营活动现金流出小计	653,802,946.68	739,230,360.69
经营活动产生的现金流量净额	471,236,844.90	2,252,718,990.47
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金		
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		
投资支付的现金		
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		2,509,407.74
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计		2,509,407.74
投资活动产生的现金流量净额		-2,509,407.74
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>		
吸收投资收到的现金		
取得借款收到的现金		
发行债券收到的现金		
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计		
偿还债务支付的现金		900,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	5,000,000.00	60,500,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金	623,081.28	
筹资活动现金流出小计	5,623,081.28	960,500,000.00
筹资活动产生的现金流量净额	-5,623,081.28	-960,500,000.00
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	465,613,763.62	1,289,709,582.73
加：期初现金及现金等价物余额	881,291,740.12	260,521,680.10
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	1,346,905,503.74	1,550,231,262.83

公司负责人：裴长江主管会计工作负责人：李井伟会计机构负责人：孙琪旻