（上接B108版）

2. 衍生品投资情况

(1)衍生品投资情况

报告期衍生品持仓的风险分析及控制措施说明（包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等）	公司所属子公司具有开展相关业务的资格。衍生产品自营业务目前主要涉及股指期货及国债期货套利、套期保值、投机等自营业务和券商OTC柜台业务。报告期内公司所属子公司进行衍生产品投资业务时完全按照中国证监会、中国证券业协会及中金所的要求，规范运作，风险可控，不存在违法、违规操作。为保证衍生品自营业务规范运作，防范业务风险，公司以相关业务管理办法等规章制度为准则，依照业务方案，在分析及控制市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、法律风险等情况下开展此项业务。
已投资衍生品报告期内市场价格或产品公允价值变动的情况，对衍生品公允价值的分析应披露具体使用的方法及相关假设与参数的设定	截至报告期末，国债期货业务持仓合约的公允价值变动为59.65万元；利率互换公允价值变动损益为-17,673.13万元；股指期货公允价值变动损益为631.85万元；贵金属期货公允价值变动损益为1,622.71万元；商品期货公允价值变动损益为2,341.40万元。 衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行确认，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。衍生金融工具公允价值变动直接计入当期损益，普通的衍生金融工具主要基于市场普遍采用的估值模型计算公允价值。估值模型的数据尽可能采用可观察市场信息，复杂的结构性衍生金融工具的公允价值主要来源于交易商报价。
报告期公司衍生品的会计政策及会计核算具体原则与上一报告期相比是否发生重大变化的说明	无重大变化。
独立董事对公司衍生品投资及风险控制情况的专项意见	公司所属子公司已获得相关业务资格，可以开展相关业务。截至报告期末，利率衍生工具持仓合约金额6,112,202.60万元，占公司报告期末净资产的88.07%；权益衍生工具持仓合约金额2,101,114.71万元，占公司报告期末净资产30.28%；商品衍生工具持仓合约金额273,757.83万元，占公司报告期末净资产3.94%。风险可控。同时，符合监管部门相关监管指标要求。 此项业务不存在损害公司和全体股东权益的情况。

（2）报告期末衍生品投资的持仓情况

单位：万元

衍生品投资操作方名称	是否关联交易	是否关联交易	衍生品投资类型	衍生品投资初始投资金额	起始日期	终止日期	期初投资金额	报告期内购入金额	报告期内售出金额	期末投资金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例	报告期实际损益金额
公开市场		无	利率衍生工具	5,221,519.76	2017/7/4	2023/6/29	5,221,519.76	2,823,245.52	1,932,562.68	6,112,202.60	88.07%	-27,583.35
银行、私募基金、公开市场		无	权益衍生工具	385,780.00	2017/7/27	2019/11/21	385,780.00	2,077,161.51	361,826.80	2,101,114.71	30.28%	3,827.34
公开市场、银行、货币公司等		无	商品衍生工具	268,955.45	2017/10/12	2019/6/6	268,955.45	830,382.12	825,579.69	273,757.88	3.94%	-5,839.77
合计				5,876,255.21	-	-	5,876,255.21	5,730,789.15	3,119,969.17	8,487,075.19	122.29%	-29,595.78

6.6重大资产和股权出售

报告期，公司无重大资产和股权出售情况。

6.7主要控股参股公司分析

（一）主要子公司

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	总资产	净资产	营业收入	营业利润	净利润
申万宏源证券有限公司	全资子公司	证券经纪、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、证券资产管理业务、证券承销与保荐业务和证券自营业务	43,000,000,000	322,918,909,317.30	68,424,504,752.63	12,170,416,104.25	4,927,213,270.92	4,052,706,127.98
申万宏源产业投资管理有限责任公司	全资子公司	投资与资产管理，投资咨询服务。（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）	200,000,000	161,783,119.39	156,269,031.55	9,832,429.58	85,279.69	1,182,312.23
宏源汇智投资有限公司	全资子公司	投资；资产管理；投资管理；企业管理咨询；投资咨询	2,000,000,000	4,682,947,832.67	2,195,191,276.62	256,988,247.45	171,493,169.82	127,901,998.84
宏源期货有限公司	全资子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询	1,000,000,000	6,968,623,893.05	1,187,436,526.33	2,720,134,038.83	129,112,972.70	97,009,519.86
宏源汇富创业投资有限公司	全资子公司	创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构	500,000,000	589,606,745.51	570,267,538.84	10,323,196.45	-17,612,568.91	-14,192,075.51
申银万国投资有限公司	全资子公司	使用自有资金对境内企业进行股权投资；为客户提供股权投资的财务顾问服务；设立直投基金，募集并管理客户资金进行股权投资等	500,000,000	816,565,505.32	593,555,826.23	73,612,360.10	38,374,054.93	34,600,144.09
申银万国创新证券投资有限公司	全资子公司	投资管理、咨询服务、顾问服务	1,000,000,000	1,330,663,710.71	1,316,883,954.07	74,951,588.72	45,042,560.74	33,697,410.23
申万菱信基金管理有限公司	控股子公司	基金管理	150,000,000	946,390,683.00	816,735,329.00	355,434,539.00	108,219,700.00	79,112,563.00
上海申银万国证券研究所有限公司	控股子公司	投资咨询业务	20,000,000	124,277,423.17	79,101,977.06	310,971,105.08	2,615,434.59	2,190,735.02
申万宏源（国际）集团有限公司	全资子公司	投资控股	2,253,398,812.18港币	9,630,867,957.00港币	4,219,579,462.28港币	434,569,388.10港币	109,498,745.05港币	104,190,007.05港币
申银万国期货有限公司	控股子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售	1,119,371,400	12,828,568,230.70	2,379,276,855.64	600,192,142.03	264,914,759.90	216,822,940.22
申万宏源西部证券有限公司	全资子公司	证券经纪、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、证券投资基金代销、为期货公司提供中间介绍业务，证券自营等	4,700,000,000	11,573,707,060.99	6,852,320,454.32	845,691,883.17	420,231,521.46	315,713,437.35
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	全资子公司	证券承销与保荐，与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问等	1,000,000,000	1,600,320,766.63	1,397,707,744.55	270,702,995.27	38,722,201.39	31,853,029.56

（二）参股公司

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	总资产	净资产	营业收入	营业利润	净利润
富国基金管理有限公司	有限责任公司（中外合资）	公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理	520,000,000	4,701,752,997.71	3,392,979,155.51	2,381,397,478.97	927,456,726.52	703,982,561.82
霍尔果斯天山一号产业投资基金有限合伙企业	有限合伙企业	股权投资、实业投资及相关的投资咨询和管理服务（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）	1,510,000,000	2,550,397,171.28	1,154,183,469.70	25,966,476.88	-26,447,878.04	-26,447,878.04

6.8报告期内取得和处置子公司、分公司、营业部情况

1.报告期，公司无取得和处置子公司、分公司情况。

2.公司所属申万宏源证券分公司、营业部设立和撤销情况

（1）报告期内，申万宏源证券未增设证券分公司。

（2）报告期内，申万宏源证券新设完成6证券营业部，分别是：淄博华光路证券营业部、乐清伯乐东路证券营业部、淮南洞山中路证券营业部、新乡平原路证券营业部、曲靖麒麟西路证券营业部、深圳前海自贸区梦海大道证券营业部。

（3）报告期内，申万宏源证券撤销完成2家证券营业部，分别是：大连星河路证券营业部、本溪花旗证券营业部。另有盐城盐都西环中路证券营业部正在撤销。

（有关分公司、证券营业部详细情况请见公司2018年年度报告“第五节 重要事项”“二十三 、公司组织机构情况”）

3.公司控制的结构化主体情况

公司管理或投资多个结构化主体，主要包括基金、银行理财产品、资产管理计划与信托计划。为判断是否控制该类结构化主体，公司主要评估其通过参与设立相关结构化主体时的决策和参与度及相关合同安排等所享有的对该类结构化主体的整体经济利益(包括直接持有产生的收益以及预期管理费）以及对该类结构化主体的决策权范围。若本集团通过投资合同等安排同时对该类结构化主体拥有权力、通过参与该结构化主体的相关活动而享有可变回报以及有能力运用本集团对该类结构化主体的权力影响可变回报，则本集团认为能够控制该类结构化主体，并将此类结构化主体纳入合并财务报表范围。

于2018 年12 月31 日和2017 年12 月31 日，公司纳入合并范围的资产管理计划的净资产总额分别为人民币13,641,595,556.36 元和人民币15,857,776,650.93 元。于2018年12月31日和2017年12月31日，公司认为上述结构化主体受本集团控制，故将其纳入合并财务报表范围。

七、涉及财务报告的相关事项

7.1会计政策变更情况说明：

1.实施新金融工具会计准则

2017年3月31日，财政部修订发布了《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》和《企业会计准则第24号—套期会计》；2017年5月2日，财政部修订发布《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下统称“新金融工具会计准则”），要求境内外同时上市的企业以及在境外上市并采用国际财务报告准则或企业会计准则编制财务报告的企业自2018年1月1日起施行，同时，鼓励企业提前执行。公司根据整体发展战略、规范金融工具会计处理、加强金融资产风险管理等多方面因素，经董事会同意，于2018年1月1日起实施新金融工具会计准则。 详见2018年1月31日刊登在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn的公司公告。

2.实施新收入准则

2017年7月5日，财政部修订发布了《企业会计准则第14号—收入》，要求境内外同时上市的企业自2018年1月1日起施行。同时，允许企业提前执行。经董事会同意，公司于2018年1月1日起执行。修订后的收入准则，将现行收入和建造合同两项准则纳入统一的收入确认模型；以控制权转移替代风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准；对于包含多重交易安排的合同的会计处理提供更明确的指引；对于某些特定交易（或事项）的收入确认和计量给出了明确规定。实施新收入准则对公司合并财务报表不产生重大影响。详见2018年1月31日刊登在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn的公司公告。

3.执行新金融企业财务报表格式

财政部2018 年12 月27 日修订发布了《关于修订印发2018年度金融企业财务报表格式的通知》，要求已执行新金融工具会计准则的金融企业应当按照通知要求编制财务报表。公司按照通知规定，采用了新的金融企业财务报表格式编制公司2018年度财务报表。

实施新金融工具会计准则、新收入准则和新金融企业财务报表格式具体影响情况详见公司2018年年度财务报告“附注五”。

7.2报告期，会计估计和核算方法未发生变化

7.3 报告期内未发生重大会计差错更正需追溯重述情况。

7.4 与上年度财务报告相比，财务报表合并范围未发生变化。

董事长：储晓明

申万宏源集团股份有限公司董事会

二〇一九年二月二十六日

证券代码：000166　　证券简称：申万宏源　　公告编号：临2019-19

申万宏源集团股份有限公司 第四届董事会第三十八次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

申万宏源集团股份有限公司第四届董事会第三十八次会议于2019年2月26日在北京市西城区太平桥大街19号公司会议室以现场、视频和通讯相结合方式召开。2019年2月16日，公司以书面形式向全体董事发出了召开董事会会议的通知。会议由储晓明董事长主持。会议应参加会议董事11人，实际参加会议董事11人，其中王凤朝董事、叶相、黄丹涵、杨秋梅独立董事以通讯方式参加表决，符合《公司法》和公司章程的有关规定。公司部分监事和高级管理人员列席了本次会议。会议经认真审议并以记名投票方式表决，形成决议如下：

一、同意《申万宏源集团股份有限公司2018年度董事会工作报告》，并提请公司股东大会审议批准（详见巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn）。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

二、通过《申万宏源集团股份有限公司2018年度总经理工作报告》。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

三、同意《申万宏源集团股份有限公司2018年度财务决算报告》，并提请公司股东大会审议批准。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

具体详见公司在巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn披露的审计报告。

四、同意《申万宏源集团股份有限公司2018年度利润分配预案》。

经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计确认，截至2018年12月31日，申万宏源集团股份有限公司实现合并归属于母公司股东的净利润人民币4,160,188,689.17元。母公司2018年期初经审计的未分配利润余额为人民币2,116,705,930.96元，加上2018年度实现归属于母公司的净利润人民币1,670,040,361.69元；扣除2018年实施现金分红人民币1,126,797,228.00元；按2018年度实现净利润的10%提取法定盈余公积金人民币167,004,036.16元，母公司2018年末可供分配利润余额为人民币2,492,945,028.49元。公司2018年度利润分配预案为：以公司截止2018年12月31日总股本22,535,944,560股为基数，向全体股东每10股派发现金股利0.50元（含税），共分配利润人民币1,126,797,228.00元。剩余未分配利润1,366,147,800.49元转入下一年度。

此预案需提请公司股东大会审议批准。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

独立董事对该事项出具了独立意见。

五、同意《申万宏源集团股份有限公司2018年年度报告》及年报摘要，并提请公司股东大会审议批准（详见巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn）。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

六、通过《申万宏源集团股份有限公司2018年度内部控制评价报告》（详见巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn）。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

独立董事对该事项出具了独立意见。

七、通过《申万宏源集团股份有限公司2018年度社会责任报告》（详见巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn）。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

八、通过《申万宏源集团股份有限公司2018年度募集资金存放与使用情况专项报告》（详见巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn）。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

九、同意《申万宏源集团股份有限公司股东大会对董事会授权方案（2019年）》，并提请公司股东大会审议批准（详见巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn）。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

十、通过《申万宏源集团股份有限公司董事会对总经理授权方案（2019年）》。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

十一、同意《关于预计2019年度日常关联交易的议案》，并提请公司股东大会审议批准。

在审议与中国建银投资有限责任公司及其所属公司发生的日常关联交易事项时，关联董事屈艳萍董事、陈建民董事回避表决。

表决结果：9 票同意，0票反对，0票弃权。

在审议与上海久事（集团）有限公司发生的日常关联交易事项时，关联董事王洪刚董事回避表决。

表决结果：10票同意，0票反对，0票弃权。

在审议与其他关联方发生的日常关联交易事项时，关联董事王凤朝董事、叶梅独立董事、谢荣独立董事、黄丹涵独立董事、杨秋梅独立董事回避表决。

表决结果：6票同意，0票反对，0票弃权。

独立董事对该事项出具了事前认可意见和独立意见。

《关于预计2019年度日常关联交易的公告》详见2019年2月28日巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn。

十二、同意《关于与中国建银投资有限责任公司签订证券与金融类产品、交易及服务框架协议的议案》。

1. 同意与中国建银投资有限责任公司签订证券与金融类产品、交易及服务框架协议，该协议于公司在香港联合交易所有限公司主板上市之日起生效；

2. 提请股东大会授权董事会或董事会授权的人士根据境内外法律、法规的规定、境内外有关政府部门和监管机构的要求与建议以及本次发行并上市的实际情况，对经公司股东大会审议通过的《证券与金融类产品、交易及服务框架协议》进行必要的调整、补充、修改（包括但不限于协议的预计金额）以及正式签署。

上述事项尚需提请公司股东大会审议批准。

关联董事屈艳萍董事、陈建民董事对上述事项回避表决。

表决结果：9票同意，0票反对，0票弃权。

独立董事对该事项出具了独立意见。

《关于与中国建银投资有限责任公司签订证券与金融类产品、交易及服务框架协议的公告》详见2019年2月28日巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn。

十三、同意《关于为宏源恒利（上海）实业有限公司提供担保的议案》。

1.同意公司在不超过人民币100,000万元的额度内，为宏源恒利（上海）实业有限公司对外融资提供担保，有效期为自股东大会审议通过之日起两年。

2.授权公司经理层根据宏源恒利（上海）实业有限公司申请及其主营业务发展情况，确定实施担保的具体事项，同时办理与担保相关的法律文本签署等事宜。

上述事项尚需提请公司股东大会审议批准。

《关于为全资子公司提供担保的公告》详见2019年2月28日巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn。

十四、同意《关于提名非独立董事候选人的议案》。

1.同意提名葛蓉蓉女士为公司非独立董事候选人。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

2.同意提名任晓涛先生为公司非独立董事候选人。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

3.同意提名杨文清先生为公司非独立董事候选人。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

上述事项尚需提请公司股东大会审议选举。

独立董事对该事项出具了独立意见。

非独立董事候选人简历如下：

葛蓉蓉，女，汉族，1968年1月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国共产党党员。历任北京工业大学经管学院讲师、大鹏证券公司（北京）研究部副研究员，中国证监会发行监管部主任科员，中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部高级经理、副主任，银行机构管理一部建行股权管理处副主任、主任，汇金公司监事会职工监事，银行机构管理一部研究支持处主任，汇金公司派往工商银行董事，银行机构管理一部副主任、董事总经理，工银瑞信基金管理有限公司董事。

葛蓉蓉女士没有持有本公司股份，没有与公司其他董事、监事和高级管理人员存在关联关系，没有受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒，不存在证券交易所认定不适合担任公司董事的其他情形，不是失信被执行人，符合《公司法》等相关法律、法规和规定要求的任职条件。

任晓涛，男，汉族，1971年2月出生，硕士研究生学历，民革党员。历任上海市建平中学高中数学教师，中国太平洋保险（集团）股份有限公司财务部精算经理、精算部精算高级经理，中央汇金投资有限责任公司非银行部高级副经理，证券机构管理部/保险机构管理部高级副经理，证券机构管理部/保险机构管理部保险机构股权管理二处处主任、高级经理（其间挂职中国大地财产保险股份有限公司发展企划部副总经理，资产管理部副总经理兼上海自贸区分公司副总经理），现任中央汇金投资有限公司证券机构管理部/保险机构管理部保险机构股权管理二处处长、高级经理。

任晓涛先生没有持有本公司股份，没有与公司其他董事、监事和高级管理人员存在关联关系，没有受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒，不存在证券交易所认定不适合担任公司董事的其他情形，不是失信被执行人，符合《公司法》等相关法律、法规和规定要求的任职条件。

杨文清，男，汉族，1963年10月出生，大学本科学历，高级经济师，中国共产党党员。历任国家开发银行办公厅正处级干部，国家开发银行营业部办公室主任，国家开发银行海南分行党委委员、副行长兼纪委书记，国家开发银行党委办公室副主任、办公厅副主任，国家开发银行甘肃分行党委书记、行长，国家开发银行党委组织部部长、人事局局长，中国投资有限责任公司纪委书记、党委委员。

杨文清先生没有持有本公司股份，没有与公司其他董事、监事和高级管理人员存在关联关系，没有受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒，不存在证券交易所认定不适合担任公司董事的其他情形，不是失信被执行人，符合《公司法》等相关法律、法规和规定要求的任职条件。

十五、同意召开公司2018年度股东大会。

表决结果：11票同意，0票反对，0票弃权。

《关于召开2018年度股东大会的通知》详见2019年2月28日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn。

特此公告。

申万宏源集团股份有限公司董事会

二〇一九年二月二十六日

证券代码：000166　　证券简称：申万宏源　　公告编号：临2019-20

申万宏源集团股份有限公司 关于预计2019年度日常关联交易的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、日常关联交易基本情况

（一）日常关联交易概述

根据《深圳证券交易所股票上市规则》（以下简称“《上市规则》”）的相关规定，结合公司实际情况，申万宏源集团股份有限公司（以下简称“公司”）对2019年度的日常经营性关联交易进行了预计，主要是公司与关联方之间因证券和金融产品交易及服务、房屋租赁、综合服务等发生的交易。

公司于2019年2月26日召开第四届董事会第三十八会议，审议同意《关于预计2019年度日常关联交易的议案》，有关关联董事对涉及的相关关联交易事项回避表决。本议案将提交公司股东大会审议批准，有关股东中国建银投资有限责任公司、中央汇金投资有限责任公司、上海久事（集团）有限公司、中国光大集团股份公司等将分别对本议案中关联事项回避表决。

（会议情况详见公司2019年2月28日刊登于《证券时报》《中国证券报》《上海证券报》和巨潮资讯网http://www.cninfo.com.cn的公司第四届董事会第三十八次会议决议公告。）

（二）预计2019年度日常关联交易类别和金额

1.与中国建银投资有限责任公司及其所属公司发生的日常关联交易

单位：万元

关联交易类别	交易内容	定价原则	预计交易上限及说明	截至披露日已发生金额	2018年实际发生金额
证券和金融服务	向关联方提供证券经纪、投资银行、资产管理、代销、出租交易单元等证券和金融服务产生的收入	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	38.53	1219.45
	接受关联方提供的基金管理等证券和金融服务产生的支出	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定		1.28	608.71
证券和金融产品交易	与关联方进行回购交易、债券交易、关联方认购公司及下属公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	0	1755.44
	回购交易利息、与关联方进行债券交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定		10000	--
租赁	租赁房屋	参照市场租金，经双方公平协商确定	280	0	253.29
综合服务	接受关联方提供的机房维护等服务产生的支出	参照市场价格，经双方公平协商确定	960	0	874.4

2.与上海久事（集团）有限公司发生的日常关联交易

单位：万元

关联交易类别	交易内容	定价原则	预计交易上限及说明	截至披露日已发生金额	2018年实际发生金额
证券和金融服务	向关联方提供证券经纪等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	19.85	145.03

3.与其他关联方发生的日常关联交易

单位：万元

关联交易类别	关联人	关联交易内容	定价原则	合同签订金额或预计金额	截至披露日已发生金额	上年发生金额
证券和金融服务	中国光大银行股份有限公司	向关联方提供资金存款、资产管理、代销等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率，行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	93.14	4,199.66
		接受关联方提供的资产托管、财务顾问等证券和金融服务产生的支出			388.41	2,528.58
	上海国际信托有限公司	向关联方提供咨询等证券和金融产品服务产生的收入	参照市场费率，行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	59.6	20
	上海汽车集团财务有限责任公司	向关联方提供证券经纪、资产管理等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率，行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	8.19	208.36
	上海汽车集团股份有限公司	向关联方提供证券经纪等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率，行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0	55
	上汽通用汽车金融有限责任公司	向关联方提供投资银行等证券和金融产品服务收入	参照市场费率，行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0	540
	除前述列明之外的公司其他关联方	与关联方相互提供证券和金融服务产生的收入或支出	参照市场费率，行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0	0
	小计				549.34	7,551.60
证券和金融产品交易	中国光大银行股份有限公司	回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	3,162,581.02	17,450,747.87
		回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			34,257.52	774,405.45
	上海国际信托有限公司	回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	112,523.70	1,066,486.72
		回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			15.23	16,310.87
	星展银行（中国）有限公司	回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	16,427.78	284,305.29
		回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易和同业拆借利息、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			0	5,036.88
	除前述列明之外的公司其他关联方	回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	0	0
		回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			0	0
	小计				3,325,805.25	19,645,142.66

（三）2018年度日常关联交易实际发生情况

单位：万元

关联交易类别	关联人	关联交易内容	实际发生金额（万元）	实际发生额占同类业务比例（%）
证券和金融服务	中国建银投资有限责任公司及其下属公司	向关联方提供证券经纪、投资银行、资产管理、代销、出租交易单元等证券和金融服务产生的收入	1,219.45	0.25
		接受关联方提供的基金管理等证券和金融服务产生的支出	508.71	0.04
	中国光大银行股份有限公司	向关联方提供资金存款、资产管理、代销等证券和金融服务产生的收入	4199.66	1.21
		接受关联方提供的资产托管、财务顾问等证券和金融服务产生的支出	2528.58	-
	上海国际信托有限公司	向关联方提供咨询等证券和金融产品服务产生的收入	20	0.12
	上海久事（集团）有限公司	向关联方提供证券经纪等证券和金融服务产生的收入	145.03	0.04
	上海汽车集团财务有限责任公司	向关联方提供证券经纪、资产管理等证券和金融服务产生的收入	208.36	0.04
	上海汽车集团股份有限公司	向关联方提供证券经纪等证券和金融服务产生的收入	55	0.01
	上汽通用汽车金融有限责任公司	向关联方提供投资银行等证券和金融产品服务收入	540	0.88
	除前述列明的公司其他关联方	向关联方提供证券经纪、投资银行、财务顾问、投资咨询、代销等证券和金融产品服务产生的收入	-	-
	小计		9424.79	
证券和金融产品交易	中国建银投资有限责任公司及其下属公司	与关联方进行回购交易、债券交易、关联方认购公司及下属公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	1755.44	0.005
		与关联方进行回购交易利息、债券交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额	0	0.005
	中国光大银行股份有限公司	与关联方进行回购交易、债券交易、资金拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	17,450,747.87	0.08
		与关联方进行回购交易和资金拆借利息、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额	774,405.45	0.60
	上海国际信托有限公司	与关联方进行回购交易、债券交易、资金拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	1,066,486.72	0.12
		与关联方进行回购交易和资金拆借利息、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额	16,310.87	0.01
	星展银行（中国）有限公司	与关联方进行回购交易、债券交易、资金拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	284,305.29	0.22
		与关联方进行回购交易和资金拆借利息、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额	5,036.88	0.005
	除前述列明之外的关联方	与关联方进行回购交易、债券交易、资金拆借、衍生品交易、关联方认购公司发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	0	-
		与关联方进行回购交易和资金拆借利息、债券交易、衍生品交易、认购关联方发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额	0	-
	小计		19,599,048.92	
房屋租赁	中国建银投资有限责任公司及下属公司	租赁关联方的房屋产生的支出	253.29	0.56
综合服务	中国建银投资有限责任公司及下属公司	接受关联方提供的机房维护等服务产生的支出	874.4	7.67
公司董事会对日常关联交易实际发生情况与预计存在较大差异的说明（如适用）			不适用	
公司独立董事对日常关联交易实际发生情况与预计存在较大差异的说明（如适用）			不适用	

二、关联人介绍和关联关系

（一）中国建银及其控制的企业

1.中国建银投资有限责任公司基本情况

该公司的法定代表人为仲建安，注册资本为人民币2,069,225万元，注册地址为北京市西城区闹市口大街1号院2号楼7-14层，经营范围为投资与投资管理；资产管理与处置；企业管理；房地产租赁；咨询。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

截至2017年12月31日，中国建银投资有限责任公司的财务数据如下：总资产15,343,223万元，净资产7,811,551万元，主营业务收入1,054,596万元，净利润554,427万元。

2.与上市公司的关联关系

中国建银投资有限责任公司为公司的控股股东，持有公司29.27%的股权，该关联人符合《上市规则》10.1.3条第（一）、（二）项规定的关联关系情形。

3.履约能力分析

中国建银投资有限责任公司依法存续且正常经营，具备履约能力。

（二）上海久事（集团）有限公司

1.基本情况

该公司的法定代表人为龚德庆，注册资本为人民币6,000,000万元，注册地址为上海市黄浦区中山南路28号，经营范围为利用国内外资金，城市交通运营、基础设施投资管理及资源开发利用，土地及房产开发、经营，物业管理，体育与旅游经营，股权投资、管理及运作，信息技术服务，汽车租赁，咨询业务。（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）

截至2017年12月31日，上海久事（集团）有限公司的财务数据如下：总资产46,890,312万元，净资产29,267,780万元，主营业务收入2,110,617万元，净利润-614,013万元 。

2.与上市公司的关联关系

上海久事（集团）有限公司持有公司5.38%的股份，该关联人符合《上市规则》10.1.3条第（四）项规定的关联关系情形。

3.履约能力分析

上海久事（集团）有限公司依法存续且正常经营，具备履约能力。

（三）其他关联方情况

其他关联方为公司董事、监事和高级管理人员担任董事、高级管理人员职务的法人或其他组织（公司及控股公司除外）。

根据《上市规则》10.1.3，本公司董事、监事、高级管理人员担任董事或高级管理人员的法人或者其他组织（本公司及控股公司除外）为公司关联方。除董事、监事、高级管理人员兼职的原因外，公司与该等关联方无其他关联关系。

三、关联交易主要内容

（一）关联交易定价政策

1.证券及金融服务

证券及金融服务交易包括本公司及下属公司与关联方之间互相提供的监管部门允许的各类证券及金融服务，包括但不限于：证券经纪业务、期货经纪业务、基金外包、出租交易单元、代销金融产品、投资银行业务、资产管理服务、咨询及顾问服务、期货保证金存款等。上述各项证券及金融服务的定价，参照市场化价格水平、行业惯例、中国人民银行批准及发布的存贷款利率等，经公平协商确定。

2.证券和金融产品交易

证券和金融产品交易包括监管部门允