

2021 中信证券 半年度报告

CITIC SECURITIES 2021 INTERIM REPORT



重要提示

- 一、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、准确、完整，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
- 二、本报告经本公司第七届董事会第二十七次会议审议通过。公司全体董事出席董事会会议，未有董事对本报告提出异议
- 三、本半年度报告未经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和罗兵咸永道会计师事务所分别根据中国和国际审阅准则出具了审阅意见
- 四、公司负责人张佑君先生、主管会计工作负责人李闯先生及会计机构负责人史本良先生声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整
- 五、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：本公司 2021 年上半年度无利润分配或公积金转增股本方案
- 六、前瞻性陈述的风险声明

本报告所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描述不构成本公司对投资者的实质承诺，敬请投资者注意投资风险。

- 七、是否存在被控股股东及其关联 / 连方非经营性占用资金情况：否
- 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况：否
- 九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告的真实性和完整性：否
- 十、重大风险提示

本集团的业务高度依赖于中国及其它业务所处地区的整体经济及市场状况，中国及国际资本市场的波动，都将对本集团经营业绩产生重大影响。

本集团面临的风险主要包括：因国家法律法规和监管机构条例调整，如业务管理和规范未能及时跟进，而造成的法律以及合规风险；面对国内外资本市场的深刻变化，而确定战略规划的战略风险；因业务模式转型、新业务产生、新技术出现等方面的变化，而带来的内部运营及管理风险；持仓金融头寸的市场价格变动可能导致的市场风险；因借款人、交易对手或持仓金融头寸的发行人无法履约或信用资质恶化而导致的信用风险；在履行偿付义务时遇到资金短缺而产生的流动性风险；因内部流程管理疏漏、信息系统故障或人员行为不当等可能引起的操作风险；因公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价而引起的声誉风险；因开展国际化业务及金融创新业务等带来的汇率风险等。其中，信用风险和流动性风险是当前面临的主要风险。

针对上述风险，本集团从组织架构、管理机制、信息技术等方面进行防范，同时优化业务流程，重点加强信用风险和流动性风险的管理。



目录

1	第一节	释义
4	第二节	公司简介和主要财务指标
11	第三节	管理层讨论与分析
44	第四节	公司治理
47	第五节	环境与社会责任
54	第六节	重要事项
72	第七节	股份变动及股东情况
76	第八节	优先股相关情况
77	第九节	债券相关情况
85	第十节	财务报告
280	第十一节	证券公司信息披露
282	附录：	信息披露索引

备查文件目录

载有公司负责人、主管会计工作负责人和会计机构负责人签名并盖章的财务报表
载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审阅报告原件
报告期内公司在中国证监会指定信息披露载体上公开披露过的所有文件的正本及公告原稿
在其它证券市场公布的半年度报告
公司《章程》

第一节 释义



第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
公司、本公司、中信证券	指	中信证券股份有限公司
本集团	指	本公司及其子公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
财政部	指	中华人民共和国财政部
深圳证监局	指	中国证券监督管理委员会深圳监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
中国结算	指	中国证券登记结算有限责任公司
上海清算所	指	银行间市场清算所股份有限公司
香港交易所	指	香港交易及结算所有限公司
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
中信集团	指	中国中信集团有限公司
中信有限	指	中国中信有限公司
全国社保基金	指	全国社会保障基金
中信证券（山东）	指	中信证券（山东）有限责任公司
中信里昂	指	本公司境外业务的品牌名称
中信证券国际	指	中信证券国际有限公司
CLSA B.V.	指	Crédit Agricole Securities Asia B.V.，一家根据荷兰法律成立的私人有限公司，于 2013 年 7 月 31 日成为中信证券国际的全资子公司
中信里昂证券	指	CLSA Limited
金石投资	指	金石投资有限公司
中信证券投资	指	中信证券投资有限公司
中信期货	指	中信期货有限公司
中信证券华南、广州证券	指	中信证券华南股份有限公司（前称“广州证券股份有限公司”）
华夏基金	指	华夏基金管理有限公司
金通证券	指	金通证券有限责任公司，公司全资证券子公司

常用词语释义		
中信产业基金	指	中信产业投资基金管理有限公司
广证领秀	指	广证领秀投资有限公司
CITIC Securities Finance MTN	指	CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.
金石灏纳	指	青岛金石灏纳投资有限公司
金石泽信	指	金石泽信投资管理有限公司
中信寰球商贸	指	中信寰球商贸（上海）有限公司
越秀金控	指	广州越秀金融控股集团股份有限公司
金控有限	指	广州越秀金融控股集团有限公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《上交所上市规则》	指	《上海证券交易所股票上市规则》
《香港上市规则》	指	《香港联合交易所有限公司证券上市规则》
关联交易	指	与现行有效且不时修订的《上交所上市规则》中“关联交易”的定义相同
关连交易	指	与现行有效且不时修订的《香港上市规则》中“关连交易”的定义相同
普华永道中天	指	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
罗兵咸永道	指	罗兵咸永道会计师事务所
万得资讯	指	万得信息技术股份有限公司
股份	指	A 股及 H 股
股东	指	本公司普通股股本中每股面值人民币 1.00 元的内资股或境外上市外资股并分别于上交所及香港联交所上市的持有人
A 股	指	本公司普通股股本中每股面值为人民币 1.00 元的内资股，于上海证券交易所上市（股份代码：600030）
H 股	指	本公司普通股股本中每股面值为人民币 1.00 元的境外上市外资股，于香港联合交易所有限公司上市（股份代码：6030）
A 股股东	指	A 股持有人
H 股股东	指	H 股持有人
中国	指	中华人民共和国
香港	指	中国香港特别行政区
报告期	指	截至 2021 年 6 月 30 日止六个月期间

第二节 公司简介和主要财务指标



第二节 公司简介和主要财务指标

一、公司信息

公司的中文名称	中信证券股份有限公司
公司的中文简称	中信证券
公司的外文名称	CITIC Securities Company Limited
公司的外文名称缩写	CITIC Securities Co., Ltd.
公司的法定代表人	张佑君
公司总经理	杨明辉
授权代表	杨明辉、刘小萌

注册资本和净资产

	单位：元 币种：人民币	
	本报告期末	上年度末
注册资本	12,926,776,029.00	12,926,776,029.00
净资产	89,339,795,174.39	85,906,426,786.60

注：截至本报告披露日，公司总股数为 12,926,776,029 股，A 股 10,648,448,329 股，H 股 2,278,327,700 股

公司的各单项业务资格情况

公司经营范围包括：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

此外，公司还具有以下业务资格：

1. 经中国证监会核准或认可的业务资格：受托投资管理业务资格、网上证券委托业务资格、受托理财、合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务（QDII）、直接投资业务、银行间市场利率互换业务、自营业务及资产管理业务开展股指期货

交易资格、股票收益互换业务试点资格、场外期权一级交易商资质、自营业务及证券资产管理业务开展国债期货交易业务资格、黄金等贵金属现货合约代理及黄金现货合约自营业务试点资格、证券投资基金托管资格、信用风险缓释工具卖出业务资格、国债期货做市业务资格、商品衍生品交易及境外交易所金融产品交易资格、试点开展跨境业务资格。

2. 交易所核准的业务资格：交易所固定收益平台做市商、权证交易、约定购回式证券交易业务资格、股票质押式回购业务资格、转融资、转融券、港股通业务、债券质押式报价回购业务、上市公司股权激励行权融资业务、股票期权经纪业务、股票期权自营业务、上交所上证 50ETF 期权主做

市商、上交所及深交所沪深 300ETF 期权主做市商、上交所上市基金主做市商、深交所上市基金做市商资格。

3. 中国证券业协会核准的业务资格：报价转让业务、柜台市场业务、柜台交易业务、互联网证券业务试点、跨境收益互换交易业务。

4. 中国人民银行核准的业务资格：全国银行间同业拆借中心组织的拆借交易和债券交易、短期融资券承销、银行间债券市场做市商、公开市场一级交易商。

5. 其它资格：记账式国债承销团成员、中国结算甲类结算参与者、证券业务外汇经营许可证（外币有价证券经纪业务、外币有价证券承销业务、受托外汇资产管理业务）、企业年金、职业年金投资管理人、政策性银行承销团成员、全国社保基

金转持股份管理人、全国社保基金境内投资管理、受托管理保险资金、全国基本养老保险基金证券投资管理、转融通业务试点、保险兼业代理业务、保险机构特殊机构客户业务、全国中小企业股份转让系统从事推荐业务和经纪业务、全国中小企业股份转让系统从事做市业务、军工涉密业务咨询服务、上海黄金交易所会员、上海清算所利率互换集中清算业务综合清算会员、结售汇业务经营、上海清算所大宗商品及航运金融衍生品集中清算业务综合清算会员、上海清算所标准债券远期集中清算业务综合清算会员、上海清算所债券净额集中清算业务综合清算会员、中国证券投资基金业协会会员、银行间外汇市场会员、银行间外币对市场会员、上海票据交易所会员、非金融企业债务融资工具受托管理人。

二、联系人和联系方式

	董事会秘书、证券事务代表、公司秘书
姓名	董事会秘书：王俊锋 证券事务代表：杨宝林 联席公司秘书：刘小萌、余晓君
联系地址	广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦（注：此为邮寄地址，与公司注册地址为同一楼宇，公司注册地址系该楼宇于深圳市房地产权登记中心登记的名称） 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
电话	0086-755-2383 5383、0086-10-6083 6030
传真	0086-755-2383 5525、0086-10-6083 6031
电子信箱	ir@citics.com

三、基本情况变更简介

公司注册地址	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
公司注册地址的历史变更情况	2000 年 4 月 6 日，经中国证监会和国家工商总局批准，公司注册地由北京市变更至深圳市。
公司办公地址	广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
公司办公地址的邮政编码	518048、100026
香港营业地址	香港中环添美道 1 号中信大厦 26 层
公司网址	http://www.citics.com
电子信箱	ir@citics.com
联系电话	0086-755-2383 5888、0086-10-6083 8888
传真	0086-755-2383 5861、0086-10-6083 6029
经纪业务、资产管理业务 客户服务热线	95548、4008895548
股东联络热线	0086-755-2383 5383、0086-10-6083 6030
统一社会信用代码	914403001017814402
报告期内变更情况 查询索引	报告期内无变更情况

四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露 报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载半年度报告的 网站地址	中国证监会指定网站： http://www.sse.com.cn （上交所网站） 香港联交所指定网站： http://www.hkexnews.hk （香港交易所披露易网站） 公司网站： http://www.citics.com
公司半年度报告备置地点	广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦 16 层 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 10 层 香港中环添美道 1 号中信大厦 26 层
报告期内变更情况 查询索引	报告期内无变更情况

五、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	上交所	中信证券	600030	不适用
H 股	香港联交所	中信证券	6030	不适用

六、其他有关资料：不适用

七、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期（1—6 月）	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
营业收入	37,720,623,459.15	26,743,555,665.56	41.05
归属于母公司股东的净利润	12,197,983,849.06	8,925,877,416.81	36.66
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	12,140,291,863.85	8,855,166,210.57	37.10
经营活动产生的现金流量净额	2,230,043,927.49	30,899,120,695.09	-92.78
其他综合收益的税后净额	-1,354,715,200.20	-206,670,452.20	不适用
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减 (%)
资产总额	1,169,139,293,301.20	1,052,962,294,032.21	11.03
负债总额	977,560,388,118.85	867,079,558,284.09	12.74
归属于母公司股东的权益	187,405,971,779.65	181,712,068,580.73	3.13
所有者权益总额	191,578,905,182.35	185,882,735,748.12	3.06
期末总股本	12,926,776,029.00	12,926,776,029.00	-
归属于母公司股东的每股净资产 (元 / 股)	14.50	14.06	3.13

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1—6 月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
基本每股收益 (元 / 股)	0.94	0.70	34.29
稀释每股收益 (元 / 股)	0.94	0.70	34.29
扣除非经常性损益后的基本每股收益 (元 / 股)	0.94	0.69	36.23
加权平均净资产收益率 (%)	6.52	5.07	增加 1.45 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率 (%)	6.49	5.03	增加 1.46 个百分点

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	89,339,795,174.39	85,906,426,786.60
净资产	153,947,246,176.77	151,704,855,612.78
各项风险资本准备之和	62,333,486,067.61	55,438,286,749.69
风险覆盖率 (%)	143.33	154.96
资本杠杆率 (%)	14.22	14.95
流动性覆盖率 (%)	125.60	141.83
净稳定资金率 (%)	121.73	124.15
净资本 / 净资产 (%)	58.03	56.63
净资本 / 负债 (%)	15.41	16.51
净资产 / 负债 (%)	26.55	29.15
自营权益类证券及证券衍生品 / 净资本 (%)	44.05	78.54
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	336.50	293.17

注：母公司各项业务风险控制指标均符合中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》的有关规定

八、境内外会计准则下会计数据差异：不适用

九、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币		
非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	790,470.44	主要是固定资产处置收益
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	138,222,464.56	主要是政府补助
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益	-458,839.81	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-51,786,636.67	-
少数股东权益影响额	-7,056,429.73	-
所得税影响额	-22,019,043.58	-
合计	57,691,985.21	-

十、采用公允价值计量的项目

单位：元 币种：人民币				
项目名称	期初余额	期末余额	本期变动	对本期利润的影响金额
交易性金融资产	419,980,859,823.90	469,208,958,162.87	49,228,098,338.97	14,669,101,766.02
其他债权投资	49,400,900,096.32	58,019,065,775.32	8,618,165,679.00	1,028,678,921.33
其他权益工具投资	16,635,500,511.08	166,328,755.33	-16,469,171,755.75	970,070,287.17
交易性金融负债	58,408,743,795.91	66,261,731,125.47	7,852,987,329.56	-3,470,168,407.72
衍生金融工具	-26,718,215,106.63	-14,250,781,694.09	12,467,433,412.54	-764,503,392.45
合计	-	-	-	12,433,179,174.35

第三节 管理层讨论与分析



第三节 管理层讨论与分析

一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

本集团所属行业为证券行业，主要业务为投资银行、财富管理、资产管理、金融市场等相关金融服务，具体情况请参阅本节“经营情况的讨论与分析”。

二、报告期内核心竞争力分析

公司在二十多年的发展过程中，凭借强大的股东背景，形成和积累了完善的公司治理体系、前瞻性的战略布局和完整的业务体系、雄厚的资本实力和领先行业的经营业绩、深厚的客户资源、优秀的企业文化和核心价值观，这些构成了公司的核心竞争力。

1. 恪守“七个坚持”的发展原则

公司总结出“七个坚持”的原则，它是公司的核心价值观，也是公司发展的不竭动力：坚持党的领导，为公司发展提供坚强政治保障；坚持践行国家战略、服务实体经济的经营宗旨；坚持以客户为中心、与客户共成长的经营方针；坚持合规经营、严控风险的经营理念；坚持创新创业、永不懈怠的进取精神；坚持以人为本、市场化的人才强企战略；坚持和发扬公司优秀的企业文化和传统。

2. 强大的股东背景和完善的公司治理体系

中信证券第一大股东为中信有限。公司是在整合中信集团旗下的证券业务基础上成立的，在中信集团的全力支持下，从一家中小证券公司发展成为大型综合化的证券集团，2003年在上交所挂牌上市交易，2011年在香港联交所挂牌上市交易，是中国第一家A股、H股、A+H股IPO上市的证

券公司。公司形成了以董事会、监事会、股东大会为核心的、完善的公司治理结构，确保公司长期保持市场化的运行机制，实现持续健康发展。

3. 前瞻性的战略布局和完整的业务体系

多年来，公司不断探索与实践新的业务模式，在行业内率先提出并践行资本中介业务，布局直接投资、债券做市、大宗交易等业务；通过收购与持续培育，确立期货、基金、商品等业务的领先优势；加大投入固定收益、融资融券、股权衍生品、另类投资等业务，建立起金融市场业务体系。公司已获得多项境内监管部门许可的业务资格，实现了全品种、全市场、全业务覆盖，投资、融资、交易、支付和托管等金融基础功能日益完善。

4. 雄厚的资本实力和领先行业的经营业绩

自成立以来，公司净资本、净资产和总资产等规模优势显著，盈利能力突出。投资银行、财富管理、资产管理、金融市场、固定收益等各项业务均保持市场领先地位，在国内市场积累了广泛的声誉和品牌优势。多年来获得亚洲货币、英国金融时报、福布斯、沪深证券交易所等境内外机构颁发的各类奖项。

5. 深厚的客户资源和广泛的网点布局

二十多年来，公司积累了三峡集团、长江电力、工商银行等一大批值得信赖的战略客户。目前，公司零售客户超过 1,000 万户，境内企业与机构客户 7.5 万家，分布在国民经济主要领域，对主要央企、重要地方国企、有影响力上市公司做到了深度覆盖。以客户为中心、与客户共成长，一直是促进公司发展的不竭动力。

6. “一带一路”地区布局最广的中国投资银行

公司旗下的海外业务平台中信里昂，分支机构遍及英、美、澳、东南亚等多个国家和地区，研究覆盖超过 1,000 家“一带一路”区域上市公司，是在“一带一路”区域拥有最多当地分支机构、研究覆盖、销售网络和清算交收基础设施的中资证券公司，也是全球范围内与“一带一路”倡议契合度最高的投资银行。凭借独特的行业地位和累积的优势，中信里昂证券为参与“一带一路”项目的企业在亚洲跨国收购、建立合资企业、深入了解当地市场等业务领域，提供最优质、最有效的服务和建议。

7. 市场化机制下的人才优势

公司不断完善市场化机制，探索运用中长期激励政策，健全人才激励和保障机制，深入实施人才强企战略。实行更开放的人才政策，培养具有竞争力的青年人才后备军，加大国际化人才储备，加强分业务、分层次的专业化培训和系统性培养，打造了一批具有国际化视野、精通国际运营、富有创造性思维的国际化人才队伍。

8. 优秀的企业文化和核心价值理念

公司继承了中信集团的优秀文化基因，秉承“遵纪守法，作风正派；实事求是，开拓创新；谦虚谨慎，团结互助；勤勉奋发，雷厉风行”的中信风格，弘扬“诚信、创新、凝聚、融合、奉献、卓越”的中信核心价值理念，恪守“做强做优做大，践行国家战略，助力民族复兴”的中信发展使命，逐渐形成了中信证券遵纪守法、规范经营、严控风险的经营理念；铸就了追求卓越、勇于创新、允许试错的进取精神；养成了直面问题、敬畏市场、主动求变的危机意识；培养了低调做人、低头做事、谦虚谨慎的处事风格；形成了勤俭节约、崇尚简明、摒弃缛节的优良传统。



三、经营情况的讨论与分析

本集团的投资银行业务包括股权融资、债务融资和财务顾问业务。本集团在中国及全球为各类企业及其它机构客户提供融资及财务顾问服务。

本集团的财富管理业务主要从事证券及期货经纪业务、代销金融产品、投资顾问服务。

本集团的机构股票经纪业务服务于境内外的专业机构投资者客户群，为其投资交易中国股票市场以及亚太、美国等海外股票市场，提供包括研究销售、交易执行、股票融资和交易项目推介等各类专业增值服务。

本集团的金融市场业务主要从事权益产品、固定收益产品及衍生品的交易及做市、外汇交易业务、融资融券业务、另类投资和大宗商品业务。

本集团在中国及全球范围内为客户提供资产管理服务及产品。本集团已经开展的资产管理业务包括：集合资产管理、单一资产管理、专项资产管理、基金管理及其他投资账户管理。

本集团的投资业务主要包括另类投资、私募股权投资。

本集团提供托管及研究等服务。

(一) 投资银行



1. 股权融资业务

市场环境

2021 年上半年，随着注册制改革推进，A 股 IPO 发行规模显著提升，沪深两市共计 245 家企业完成 IPO 发行上市，同比增长 105.88%，合计发行规模人民币 2,109.50 亿元，同比增长 51.46%。IPO 项目累计过会率 89.82%，发行审核通过率维持较高水平，IPO 维持常态化发行。随着 2020

年推出的再融资新政逐步落地，再融资发行持续快速增长，现金类定向增发项目合计发行人民币 3,372.63 亿元，同比增长 165.54%；可转债合计发行人民币 1,652.25 亿元，同比增长 74.17%。

2021 年上半年，A 股承销金额（现金类）人民币 7,567.66 亿元，同比增长 80.70%；A 股承销金额（现金类及资产类）人民币 7,874.69 亿元，同比增长 21.40%。A 股承销金额（现金类）前十位证券公司的市场份额合计为 72.46%，集中度较高。

2021 年上半年，港股 IPO 承销金额 300.12 亿美元，同比增长 136.86%；港股再融资市场承销金额 619.93 亿美元，同比增长 176.98%；按承销金额在所有承销商中平均分配的口径计算，港股股权融资前十大投行的市场份额合计 70.39%。

经营举措及业绩

2021 年上半年，境内股权融资方面，公司完成 A 股主承销项目 92 单，主承销金额人民币 1,422.99 亿元（现金类及资产类），同比增长 8.01%，市场份额 18.07%，排名市场第一。随着注册制改革推进，公司继续加大科创板、创业板等 IPO 客户覆

盖力度，完成 IPO 项目 27 单，合计发行人民币 377.14 亿元，市场份额 17.88%，排名市场第一。公司完成再融资主承销项目 65 单，主承销金额人民币 1,045.85 亿元，市场份额 18.14%，排名市场第一。随着现金类定向增发市场供需显著提升，公司重点布局现金类定向增发业务，完成 41 单现金类定向增发项目，合计承销金额人民币 845.44 亿元，市场份额 25.07%，排名市场第一。同时，公司积极拓展可转债、资产类定增、配股等业务机会，不断加强股权融资项目全流程质量管理和风险控制，巩固提升综合竞争优势。

项目	2021 年 1—6 月		2020 年 1—6 月	
	主承销金额 (人民币百万元)	发行数量	主承销金额 (人民币百万元)	发行数量
首次公开发行	37,714	27	9,981	6
再融资发行	104,585	65	121,768	46
合计	142,299	92	131,749	52

资料来源：万得资讯、公司内部统计

注 1：上表统计中，首次公开发行、公开增发股票、可转债 / 可交换债、定向增发、配股、优先股完成时点均为上市日

注 2：如无明确承销商份额，联席主承销项目的承销金额为项目总规模除以主承销商家数

2021 年上半年，境外股权融资方面，公司进一步加强境内外一体化管理，继续重点布局信息传媒、消费、医疗健康等新经济行业。按照账簿管理口径，公司完成 32 单境外股权项目，承销金额合计 60.05 亿美元。其中，香港市场 IPO 项目 14 单，承销金额 16.32 亿美元；再融资项目 11 单，承销金额 34.61 亿美元，香港市场股权融资业务排名中资证券公司第二。同时，公司完成美国、澳大利亚和东南亚等海外市场股权融资项目 7 单，承销金额 9.12 亿美元。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司将进一步扩大境内外客户覆盖，增加项目储备；加强新兴行业、重要客户及

创新产品研究，根据市场发展与客户需求主动优化业务结构，获取重要客户关键交易，进一步提升全球市场影响力；紧密跟进政策变化，就注册制全面稳步推进、沪 / 深伦通、A、H 股两地上市及境外公司回归 A 股上市等业务持续进行布局；加强股权承销业务能力，严格项目质量管理，发挥公司平台优势，为客户提供综合投行服务。

2. 债务融资业务

市场环境

境内市场方面，2021 年上半年国内经济增长和货币政策操作向疫情前常态化回归，货币政策整体处于稳增长和防风险的动态均衡，债券供给低

于预期，市场收益率稳中有降。2021 年上半年债券发行总规模人民币 29.51 万亿元，同比增长 13.92%；净融资额人民币 6.74 万亿元，同比减少人民币 1.78 万亿元；信用债券（不含同业存单）发行总规模人民币 9.37 万亿元，同比增长 1.55%。财政政策回归疫情前常态化，国债增幅稳健，地方债略有下降；非金融企业债券受地产和城投信用收缩影响，总体发行量较去年同期基本持平；资产证券化市场持续活跃，交易所证券化产品发行继续提速，银行间信贷资产证券化市场规模较去年同期增幅明显。

境外市场方面，2021 年上半年海外经济逐步修复，宽松基调尚未完结，美债利率明显上行。根据

Bloomberg 数据统计，2021 年上半年中资企业发行的中资美元债券共 228 只，总融资规模 955.82 亿美元。

经营举措及业绩

2021 年上半年，公司债务融资业务继续保持行业领先地位，承销金额合计人民币 6,638.03 亿元，同比增长 17.89%。承销金额占证券公司承销总金额的 13.18%，排名同业第一；占包含商业银行等承销机构在内的全市场承销总金额的 5.35%，排名全市场第三，共承销债券 1,287 只，排名同业第一。

项目	2021 年上半年		2020 年上半年	
	主承销金额 (人民币百万元)	发行只数	主承销金额 (人民币百万元)	发行只数
企业债	20,110	26	21,354	27
公司债	141,652	288	131,147	231
金融债	167,987	109	108,314	63
中期票据	22,541	38	34,855	49
短期融资券	7,150	19	7,898	18
定向工具	6,390	19	15,150	27
资产支持证券	135,922	399	109,705	323
可转债 / 可交换债	18,045	14	21,319	21
地方政府债	144,004	375	113,328	621
合计	663,803	1,287	563,069	1,380

资料来源：万得资讯、公司内部统计

境外中资美元债券业务方面，公司共完成项目 57 单，总承销规模 19.39 亿美元，市场份额 2.22%，排名中资证券公司第四；同时，在债券承销的基础上，公司为客户提供结构化及杠杆融资、风险解决方案、流动性管理等多元化服务。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，债务融资业务机遇与挑战并存。

债券市场继续推动改革、开放、创新，将进一步带来业务机会；企业违约风险进一步暴露、压实中介机构责任等也对债券承销业务提出了更高要求和挑战。公司将积极把握市场机遇，整合资源，继续做大客户市场，提高公司市场份额，并大力加强尽职调查、风险管理和质量管控，降低项目风险。业务策略方面，巩固公司在债务融资业务领域的领先优势，继续加大对非金融企业债券的

投入，为客户提供综合化服务和一揽子融资解决方案；加大力度开拓地方企业与区域客户的债务融资机会，形成区域优势和竞争力；继续加强推进基础设施公募 REITs 业务投入，加大市场影响力项目落单，有效提升在该业务领域领先优势；全面落实公司境内外一体化战略，加强境内外客户与业务协同，大力拓展中资美元债券市场，提高公司境外债券业务承销能力及市场份额。

3. 财务顾问业务

市场环境

根据 Dealogic 统计，2021 年上半年全球已公告的并购交易金额 2.99 万亿美元，交易数量 16,185 单。行业方面，以电子与计算机行业最为活跃，2021 年上半年公告的并购交易金额 8,265 亿美元，占已公告并购交易金额的 27.67%；其次是医疗健康行业，2021 年上半年公告的并购交易金额 3,274 亿美元，占已公告并购交易金额的 10.96%。

2021 年上半年，市场已公告涉及中国企业的并购交易 2,667 单，交易规模 2,982 亿美元。其中跨境交易 331 单，交易规模 498 亿美元。

经营举措及业绩

2021 年上半年，公司完成 A 股重大资产重组交易金额人民币 182 亿元，市场份额 22.80%，排名行业第一。公司坚持以客户为中心，围绕国家提高上市公司质量及核心竞争力的发展要求，深度服务央企集团、国有企业及民营企业，完成了多单并购重组交易，包括大连港和营口港换股合并、华东科技收购冠捷科技、维业股份重大资产重组、天顺风能收购苏州天顺等，不断巩固提升公司在并购领域的市场地位与竞争力。

2021 年上半年，公司完成涉及中国企业全球并购交易金额 134 亿美元，排名行业第二。公司积极协助客户整合全球优质资源，加强境内外并购业

务覆盖。公司协助伊利股份私有化中地乳业，助力其完成大型牧业资源整合；协助格兰仕完成对惠而浦（中国）的控制权收购，推动双方合作关系全面升级；协助金杯汽车收购安道拓 50% 股权，增强其核心竞争力及持续盈利能力。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司将继续坚持以客户为中心，围绕国家发展战略及要求，持续巩固市场份额，在大型企业并购重组、上市公司控制权转让、企业债务重组及破产重整等方面积极布局，不断提升公司并购综合服务能力。公司还将继续深化境内外协同合作，发挥全球化布局优势，加强跨境并购、并购融资、境外上市公司私有化等业务的开拓力度，增强公司全球业务覆盖能力及市场竞争力。

4. 新三板业务

市场环境

2021 年上半年，新三板改革稳步推进，新三板公开发行并在精选层挂牌业务有序开展，市场各项功能指标回升，积极效应逐渐显现。截至报告期末，新三板市场挂牌企业共 7,472 家，总股本 4,923.58 亿股，总市值人民币 23,884.37 亿元，其中精选层挂牌企业共 55 家，总股本 94.10 亿股，总市值人民币 1,407.62 亿元。2021 年上半年，新三板市场总成交金额人民币 610.67 亿元，完成股票发行募集资金总额人民币 129.98 亿元。截至报告期末，新三板成指收于 996.65 点，较 2020 年末下降 1.40%，新三板做市指数收于 1,139.63 点，较 2020 年末上升 6.19%。

经营举措及业绩

2021 年上半年，公司新三板业务继续坚持以客户拓展覆盖为基础，以价值发现和价值实现为核心。在积极开展新三板精选层公开发行业务，坚持优

化做市持仓结构，加大对优质企业覆盖力度的同时，高度重视质量控制工作，有效控制业务风险。

截至报告期末，公司作为新三板主办券商，持续督导的挂牌公司共 21 家，其中 15 家进入了创新层及精选层。2021 年上半年，公司作为保荐券商申报新三板公开发行挂牌公司 1 家，公司为 29 家挂牌公司提供了做市服务，其中 23 家公司进入了创新层及精选层。

(二) 财富管理



市场环境

2021 年上半年，国内证券市场整体活跃度较 2020 年明显提升，上证综指涨幅 3.40%，中小板综指涨幅 5.19%，创业板综指涨幅 14.13%。

经营举措及业绩

2021 年上半年，公司坚持经纪业务本源，深化财富管理发展，贯彻全球一体化发展要求，完善多层次、立体式、个性化、全资产的财富客户产品与服务体系，以企业家办公室为载体打造超高净值客户服务生态，强化核心财富配置能力与买方服务能力，在市场波动下财富配置的风险控制优

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司将根据新三板深化改革进程不断完善业务管理体系和市场开发体系，继续以价值发现和价值实现为核心，带动其他相关业务发展，为客户提供高质量的新三板综合服务，选择优质企业，深度挖掘企业价值，力争创造良好效益。

势凸显，帮助客户实现财富管理目标的能力持续提升。

截至报告期末，客户数量累计超 1,140 万户，托管客户资产规模合计人民币 9.7 万亿元。人民币 200 万元以上资产财富客户数量 14.0 万户，资产规模人民币 1.7 万亿元，较 2020 年末分别增长 11%、15%；人民币 600 万元以上资产高净值客户数量 3.1 万户，资产规模人民币 1.4 万亿元，较 2020 年末均增长 15%；财富管理账户签约客户 1.7 万户，签约客户资产超人民币 2,100 亿元。2021 年上半年，公司及中信证券（山东）、中信证券华南代理股票基金交易总额人民币 15.8 万亿元，代销金融

产品人民币 4,356 亿元，公募及私募基金保有规模超人民币 3,600 亿元。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司将继续全面贯彻以客户为中心的经营理念和帮助客户实现资产保值增值的经营宗旨，深化财富管理转型发展，提升资产配置服务能力，推动财富客户及其资产规模稳定增长，优化业务收入结构，进一步提升财富管理收入占比，扩大财富管理品牌影响力；逐步建立为境内外高净值客户提供全球资产配置和交易服务的全方位财富管理平台，更好地满足客户财富的保值、增值、传承需求。坚持经纪业务本源，保持并扩大经纪业务收入领先优势。探索搭建数字化运营服务体系，推动传统营销模式向内容营销新模式、数字化智能营销新模式转变，提升获客留客效率，做大客户市场规模。搭建专业队伍，提升专业能力，更好地支持公司综合金融服务在各区域全面落地，充分发挥公司综合金融服务优势，促进财富管理大力发展，实现专业价值。

(三) 机构股票经纪业务

市场环境

(请参见财富管理部分)

经营举措及业绩

公司机构股票经纪业务 2021 年上半年实现了较好的业绩增长，进一步加强了跨境一体化管理和协

同展业，在跨境联合覆盖服务客户以及产品交叉销售方面取得持续进展，境外研究也由传统的单一业务模式转型为支持全公司业务发展的多产品模式。

境内机构股票经纪业务主要覆盖服务公募基金、保险公司、私募基金、银行理财子公司、QFI、WFOE 等境内外专业机构投资者。2021 年上半年，公司保持了在境内机构经纪业务中的整体领先地位。

境外机构股票经纪业务表现卓越，业务收入和净利润均同比大幅提升，现金股票业务市场份额在亚太地区继续保持领先，业绩增长主要驱动因素是全球市场的交易活动增加，以及境外投资机构对中国股票市场的关注持续增加。全球一体化交易平台为全球客户提供综合性交易服务，MSCI 指数调整交易市场份额排名第一，单日执行交易最高达 86 亿美元，创历史新高。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司将结合境内外业务优势和客户资源，持续推进全球机构股票经纪业务一体化整合和业务拓展。境内机构股票经纪业务将继续深耕传统客户市场，提升客户有效覆盖率，开拓新的客户市场，探索新的业务模式。加强境内外一体化覆盖服务，以客户为中心，积极协调对接公司各类业务产品和资源，为客户提供综合金融服务，提升客户业务合作的广度和深度。



(四) 金融市场

市场环境

2021 年上半年，国内宏观基本面平稳，股票市场呈现震荡和分化的主基调，指数波幅有限。各行业龙头公司受制于估值较高和流动性预期波动的影响，股价波动较大，回报有限；中小型公司则由于业绩改善和资金流入表现较佳。2021 年上半年沪深 300 指数微涨 0.2%，中证 1000 指数则上涨 6.6%，股票基金指数上涨 7.8%。两市 2021 年上半年成交额同比增长近 20%，市场结构分化加剧，板块轮动较快，高景气高增长主题方向相对强势。

2021 年上半年，发达国家疫情控制较好，财政货币环境宽松，海外主要市场波澜不惊，主要股票指数延续升势。标普 500 指数上涨 14%，纳斯达克 100 指数上涨 13%。欧洲和香港市场较 2020 年弱势有所改善，欧洲 STOXX600 指数上涨 13%，恒生指数上涨 6%。而 2020 年领涨的恒生科技指数在 2021 年上半年下跌了 3%。

2021 年上半年，中国债券市场稳中有升，整体表现平稳。中债综合财富指数上涨 2.1%。国债中长期关键期限利率小幅下行，短端利率保持稳定，银行间流动性整体仍然较为宽松。

经营举措及业绩

公司场外衍生品业务和柜台产品持续发展，产品结构、应用场景进一步丰富；做市交易业务持续排名市场前列。股权衍生品业务保持客户群体广泛、产品供给丰富、收益相对稳定的业务形态。境外股权衍生品交易持续发展创新，交易覆盖国际主流市场，为客户提供跨时区的全球市场衍生品交易服务。

公司固定收益业务充分发挥客户资源优势，提升产品设计及服务客户的综合能力，不断丰富盈利模式，各项业务稳步发展。2021 年上半年，公司利率产品销售规模保持同业第一。

公司股票自营业务在坚持投资优质行业龙头的基础上，加强内部协同及多元化策略的开发，同时

继续注重对尾部风险的控制，整体保持了稳健的业绩。在量化分析和多元策略的探索和实践上取得成效，为未来进一步降低业绩对市场单一方向变动的依赖打下坚实基础。

公司证券融资及借贷业务持续优化业务风险管理和基础设施建设，深化金融科技运用；在对业务结构进行调整，保障公司资产安全和高质量发展的同时，加强各类型客群精细化管理，深化产品创新服务，加大区域市场下沉力度。业务规模持续增长，市场份额保持同业领先。

公司另类投资业务在数据、模型、标的、优化方式等多方面持续研发多元化策略，在有效分散风险的同时获取更多的超额收益。此外，公司还积极布局海外业务，完善投研、交易、风控平台基础设施建设，推进跨部门业务协同。

公司大宗商品业务践行金融服务实体经济的理念，加强综合服务能力，在大宗商品市场大幅上涨的过程中，增加产业客户拓展和服务力度，及时满足产业客户套期保值的需求，持续为各类产业和机构客户提供大宗商品领域个性化、专业化的金融服务。

2021 年下半年展望

股权衍生品业务方面，公司将继续完善产品供给和交易服务，以满足客户需求为中心，提高综合解决方案服务能力，打造股票衍生品国际综合业务平台，为境内外客户提供多市场、全天候的一站式投资交易服务和综合解决方案。

固定收益业务方面，公司将进一步深耕客户市场，把握新兴业务机会及客户需求，为客户提供多样的产品和交易服务。继续发展跨境业务，促进境内外业务的共同发展。

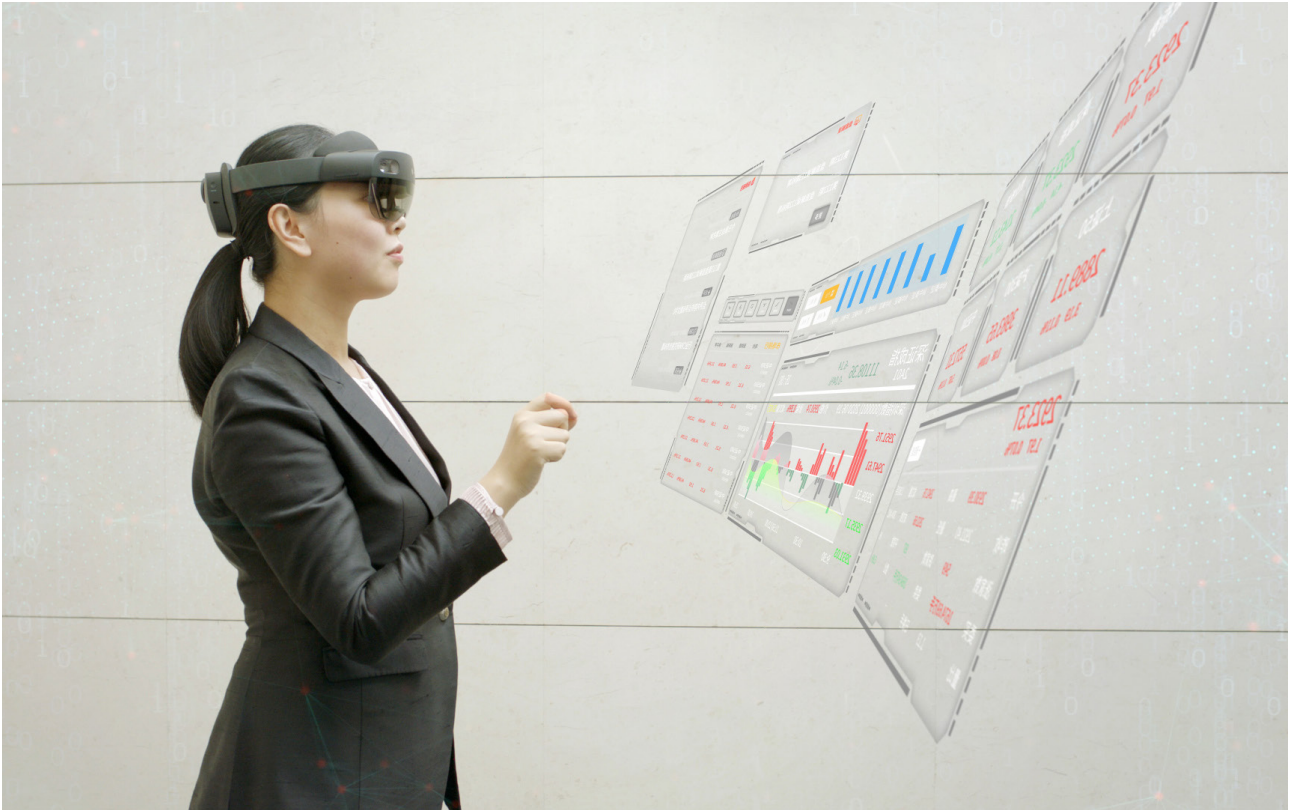
股票自营业务方面，公司将继续优化投研体系，继续探索开发多策略投资系统，提升资本运用能力。

证券融资及借贷业务方面，公司将继续完善“以客户为中心”的产品供给和客户服务生态，紧跟资本市场改革创新步伐，优化风险管理，提升复杂产品创设、专业化精细化服务及科技创新能力，为境内外专业机构、上市公司及企业客户、高净值个人及财富客户等提供融资、交易及 PB 服务等一站式金融产品和综合解决方案。

另类投资业务方面，公司的重点工作依然是策略研发，持续加快新策略的研发上线，逐步实现对境内外各市场、各类型交易策略的全覆盖。

大宗商品业务方面，公司将继续拓宽客户市场覆盖面，丰富客群层次，优化客户结构，提高产业客户占比，继续加强实体产业客户的服务力度。同时，不断提升服务深度，丰富产品设计，覆盖全球主流商品品种，提供多样的衍生工具，为境内外客户提供风险对冲和转移的渠道，使大宗商品成为公司提供 FICC 综合性金融服务链条中的重要一环。

(五) 资产管理



市场环境

2021 年，资管新规过渡期结束在即，资产管理行业净值化转型进入最后阶段，在此过程中逐渐衍生出新模式、新产品、新格局，资产管理行业价值链正在重塑。未来，资产管理机构应深刻认识当前经济发展规律和行业竞合关系，继续坚持主动管理的发展方向，持续寻找差异化定位，不断强化综合管理能力，发挥服务实体经济发展和推动居民资产保值增值的重要作用。

1. 本公司资产管理业务

经营举措及业绩

2021 年上半年，面临资管新规整改期限临近所带来的持续性行业转型发展环境，公司资产管理业务持续秉持“为人民谋幸福、服务实体经济、防范金融风险”的初心使命，加强产品创新、持续

完善产品布局，提升投研专业化、完善买方投研体系。大力发展社保及基本养老、企业年金、职业年金等养老业务，积极推动银行主动管理业务转型，与银行理财子公司、银行私行合作取得新进展，持续推进大集合公募化改造，以 FOF 产品为载体迅速做大高净值个人业务。

截至报告期末，公司资产管理规模合计人民币 13,909.62 亿元，包括集合资产管理计划、单一资产管理计划及专项资产管理计划，规模分别为人民币 3,614.15 亿元、10,294.42 亿元和 1.05 亿元，其中主动管理规模人民币 11,663.68 亿元，资管新规下公司私募资产管理业务（不包括养老业务、公募大集合产品以及资产证券化产品）市场份额约 13.84%，排名行业第一。

类别	资产管理规模 (人民币百万元)		管理费收入 (人民币百万元)	
	2021 年 6 月末	2020 年末	2021 年 1—6 月	2020 年 1—6 月
集合资管计划	361,415	260,124	988.19	353.53
单一资管计划	1,029,442	1,106,168	771.22	522.43
专项资管计划	105	109	23.03	10.46
合计	1,390,962	1,366,401	1,782.44	866.42

资料来源：公司内部统计

注：集合资管计划规模包括大集合产品，不包括养老金产品；单一资管计划规模包括养老业务；专项资管计划规模不包括资产证券化产品

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司资产管理业务将持续围绕“立足机构、做大零售”的客户开发战略，提升客户开发能力和综合金融服务水平。不断丰富产品种类，注重主动管理、长期净值型、“固收+”及权益等多资产模式，持续布局和发展跨境产品。努力打造专业化投研团队，做大做强养老业务，不断夯实机构业务领先地位，围绕客户需求创新业务模式，持续推进大集合公募化改造和营销。做好资管子公司设立筹备工作。持续推进资产管理业务数字化建设，全面建设新一代业务平台。

2. 华夏基金

经营举措及业绩

2021 年上半年，华夏基金强化战略性方向投资，加强长期赛道布局，投资业绩显著提升；基金发行数量再创新高，持续营销成效显著；把握港股

市场机会，持续完善指数产品线布局；稳步推进养老战略业务，改善主动管理专户结构；加大创新业务投入，打造金融科技生态圈，不断提高风险防范能力，整体资产管理规模进一步提升。截至报告期末，华夏基金本部管理资产规模人民币 16,066.14 亿元。其中，公募基金管理规模人民币 9,762.43 亿元；机构及国际业务资产管理规模人民币 6,303.71 亿元。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，华夏基金将加强战略性资产配置，持续提升投资业绩，科学布局新发基金，提升客户和渠道运营能力，加强优势指数产品营销，全面提升机构业务服务质量，拓展国际业务规模，持续完善金融科技生态圈，保持行业综合竞争力。

(六) 托管

市场环境

2021 年上半年，随着疫情防控常态化，宏观经济持续复苏。银行理财、信托等资管产品加速转型，公募基金发行规模再创新高，创新产品多点开花，基础设施公募 REITs 项目正式诞生。中国证监会发布加强私募投资基金监管若干规定，进一步强化私募行业监管，规范私募基金良性发展。私募基金管理人数量有所下滑，但存续私募基金数量和管理规模依然保持上涨趋势，6 月末再创新高。

经营举措及业绩

2021 年上半年，公司继续增加业务系统建设投入，优化业务运营质量控制机制，细化重点客户服务流程，提升运营效率，增强客户粘性。公司恪守谨慎勤勉的原则，忠实履行托管人职责，保护基金投资者的利益。基金运营外包服务方面继续拓展服务客群，构建境内外一体化的基金运营服务体系。通过协同公司境内外资源，为资产管理机构提供全方位综合运营服务。

截至报告期末，公司资产托管和基金运营外包服务业务继续实现增长，由公司提供资产托管服务的存续产品数量为 9,381 只，提供基金运营外包服务的存续产品数量为 9,617 只。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，公司将继续拓展财富管理市场机构客户，满足各类资产管理机构的综合化需求，强化基金运营服务能力，通过发挥业务协同优势持续扩大托管业务市场规模。

(七) 股权投资

市场环境

随着国内疫情防控常态化，募资环境整体呈现向

好趋势。根据清科研究中心数据，2021 年一季度新募集规模 2,238.24 亿元，同比上升 6.3%；新募集基金 873 只，基金募集数量同比增长 66.6%。整体而言，私募募资数量已逐步恢复到疫情之前的状态，但长期资金缺失等结构性募资困难仍然存在。投资方面，一季度私募投资市场逐步回升，共有 1,005 笔投资，同比上升 47.14%，其中披露金额的共有 813 笔投资，涉及披露金额人民币 1,925.01 亿元，同比上升 86.52%。投资案例数量达到近三年的较高水平，整体发展较 2020 年相比已大幅回暖。退出方面，一季度私募市场共完成 383 笔退出，同比上升 16.41%；IPO 退出仍是市场主流，共完成 313 笔 IPO 退出，占比 81.7%，同比上升 67.38%；其中 120 笔 IPO 退出事件涉及的企业在科创板挂牌。

1. 中信证券投资

经营举措和业绩

作为公司另类投资子公司，2021 年上半年，中信证券投资紧密围绕资本市场和国内外宏观形势的发展，继续在先进智造、信息技术、现代服务、医疗健康、新材料及工业品等行业深入挖掘投资机会，积极探索投资阶段适当前移，继续发挥中信证券的综合优势，加大投资力度，在消费、半导体、医疗健康、新材料、信息技术等领域投资了一批具有核心竞争力的企业。

2021 年下半年展望

2021 年下半年，中信证券投资将以国家政策为导向，服务实体经济、践行国家战略，提升投研能力，系统化进行产业布局，加大前瞻性投资性布局，开展多样化投资方式，加大投资力度，加强投后管理和风险控制，继续巩固在券商另类投资子公司股权投资领域的领先地位。



2. 金石投资

经营举措和业绩

作为公司募集并管理私募股权投资基金的平台，2021 年上半年，金石投资发起设立朔州市华朔金石能源产业转型母基金、深石（深圳）智慧物流基础设施私募基金，规模约为人民币 18 亿元，金石投资担任基金管理人，通过股权投资方式，支持具有核心竞争优势的能源产业、仓储物流等企业的发展。在投资方面，金石投资 2021 年上半年对外投资金额约为人民币 18 亿元，涉及新材料、物流、生物科技、软件、通信及信息技术等多个领域。截至报告期末，金石投资在管私募股权投资基金 20 只。

2021 年下半年展望

金石投资的发展策略是管理规模与投资效益并重；战略目标是发展成为国内领先的私募投资基金管理机构；投资目标是为基金投资人创造优异的回报，为公司实现管理费收入和业绩报酬。金石投资将通过自上而下的研究，以产业升级与整合为核心，挖掘有价值的公司，对其进行投资，并在投后管理中提升公司价值。此外，金石投资也将拓展境外投资，抓住新区域的经济机会，作为境内投资的有益补充。

(八) 研究

2021 年上半年，公司继续推进研究业务的全面战略转型。研究覆盖和服务覆盖进一步拓宽，在 A 股及海外上市公司覆盖持续增加、机构客户数量再创新高的同时，有效服务了企业与股权投资机构。公司境内外研究力量加速融合，中英文研究报告数量增长，海外市场影响力提升，研究报告的国际化 and 全球发送工作取得进一步进展。研究影响力进一步提升，中央媒体、专业财经媒体的报道和引用大幅增加，研究会议活动也广受关注。研究综合服务与业务协同相结合，为政府机构提供多类课题服务，提升了公司声誉。

2021 年下半年，公司研究业务将以价值量为导向，做客户驱动型和业务驱动型的研究服务，持续提升公司声誉和价值。研究领域方面，推进从二级市场到产业趋势、产业整合、并购重组、未上市企业的拓展。服务对象方面，在保持重点机构客户市场现有优势地位的同时，加大对各类增量领域的客户服务力度。境内外协同方面，打造全球视野、扎根本土研究品牌。



报告期内公司经营情况无重大变化，以及报告期内未发生对公司经营情况有重大影响和预计未来会有重大影响的事项。



四、报告期内主要经营情况

(一) 主营业务分析

1. 财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)	主要变动原因
手续费及佣金净收入	16,010,064,223.00	10,826,568,650.75	47.88	经纪业务、投资银行业务、资产管理业务手续费及佣金净收入均增加
利息净收入	2,323,538,084.53	810,370,609.51	186.73	融出资金利息收入增加
公允价值变动收益	1,836,523,107.53	3,756,765,438.35	-51.11	证券市场波动导致金融工具公允价值变动
汇兑收益	45,594,075.48	288,585,305.58	-84.20	汇率变动
资产处置收益	754,467.68	-1,359,605.28	不适用	非流动资产处置收益增加
其他收益	137,366,437.86	96,080,488.98	42.97	与公司日常活动相关的政府补助收益增加
其他业务收入	7,346,955,982.31	2,836,257,662.77	159.04	下属子公司大宗商品贸易销售收入增加
业务及管理费	13,345,700,573.82	9,777,495,813.06	36.49	职工费用、基金销售及管理费用增加
其他资产减值损失	47,979,747.79	266,413,884.19	-81.99	下属子公司计提存货跌价准备减少
信用减值损失	691,677,252.79	2,034,691,254.09	-66.01	买入返售金融资产计提信用减值损失减少
其他业务成本	7,082,339,334.93	2,602,302,052.19	172.16	下属子公司大宗商品贸易销售成本增加
营业外收入	18,077,484.80	43,631,639.82	-58.57	与公司日常活动无关的政府补助收益减少
营业外支出	69,430,931.82	46,567,912.63	49.10	下属子公司计提预计负债
所得税费用	3,696,873,257.00	2,653,479,640.43	39.32	当期所得税费用增加
其他综合收益的税后净额	-1,354,715,200.20	-206,670,452.20	不适用	其他权益工具投资减少所致
经营活动产生的现金流量净额	2,230,043,927.49	30,899,120,695.09	-92.78	回购业务及代理买卖证券业务净流入同比下降
投资活动产生的现金流量净额	2,311,641,373.99	4,955,986,600.46	-53.36	去年同期新增并表子公司导致投资活动现金净流入增加

营业收入变动原因说明：2021 年上半年，本集团实现归属于母公司股东的净利润人民币 121.98 亿元，同比增长 36.66%；实现基本每股收益人民币 0.94 元，同比增长 34.29%；加权平均净资产收益率 6.52%，同比增长 1.45 个百分点。2021 年上半年，本集团实现营业收入 377.21 亿元，同比增加 41.05%，其中，经纪业务实现收入人民币 92.48 亿元，同比增长 40.67%；资产管理业务实现收入人民币 63.60 亿元，同比增长 55.88%；证券投资业务实现收入人民币 97.68 亿元，同比增长 9.49%；证券承销业务实现收入人民币 26.16 亿元，同比增长 23.05%；其他业务实现收入人民币 97.29 亿元，同比增长 92.94%。

营业成本变动原因说明：2021 年上半年，本集团营业支出人民币 213.78 亿元，同比增加 43.80%，主要是业务及管理费、其他业务成本增加所致。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：2021 年上半年，本集团经营活动产生的现金流量净额为人民币 22.30 亿元，净流入同比减少人民币 286.69 亿元，主要是由于回购业务及代理买卖证券业务净流入同比下降。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：2021 年上半年，本集团投资活动产生的现金流量净额为人民币 23.12 亿元，净流入同比减少人民币 26.44 亿元，主要是由于去年同期新增并表子公司导致投资活动现金净流入增加。

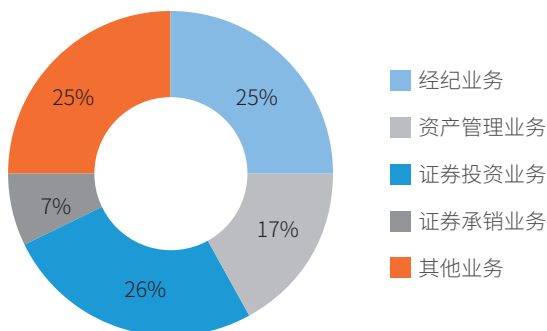
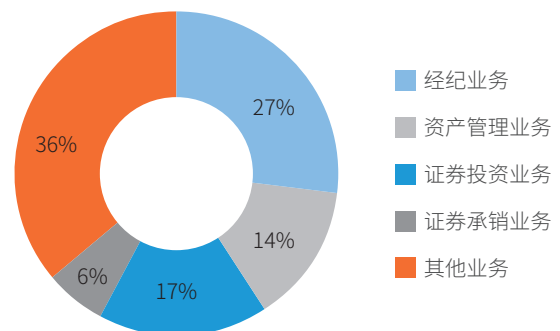
筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：2021 年上半年，本集团筹资活动产生的现金流量净额为人民币 106.23 亿元，净流入同比增加人民币 20.36 亿元，主要是由于报告期内公司取得借款收到的现金同比增加。

2. 本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明：不适用

3. 主营业务分行业情况

单位：元 币种：人民币

业务单元	营业收入	营业支出	营业利润率 (%)	营业收入比上年同期增减 (%)	营业支出比上年同期增减 (%)	营业利润率比上年同期增减 (%)
经纪业务	9,248,385,841.01	5,705,087,493.18	38.31	40.67	46.52	减少 2.46 个百分点
资产管理业务	6,360,417,964.15	3,007,356,812.46	52.72	55.88	54.14	增加 0.54 个百分点
证券投资业务	9,768,061,716.23	3,606,926,022.98	63.07	9.49	-22.20	增加 15.04 个百分点
证券承销业务	2,615,798,111.45	1,356,661,751.99	48.14	23.05	36.33	减少 5.05 个百分点
其他业务	9,727,959,826.31	7,702,014,970.87	20.83	92.94	127.14	减少 11.92 个百分点
合计	37,720,623,459.15	21,378,047,051.48	43.33	41.05	43.80	减少 1.08 个百分点

营业收入构成情况

营业支出构成情况


4. 主营业务分地区情况

单位：元 币种：人民币

地区	营业收入	营业支出	营业利润率 (%)	营业收入比上年同期增减 (%)	营业支出比上年同期增减 (%)	营业利润率比上年同期增减 (%)
北京	446,992,064.98	374,597,752.68	16.20	17.17	77.67	减少 28.54 个百分点
天津	41,010,793.78	43,753,374.93	-6.69	0.66	40.38	减少 30.19 个百分点
河北	31,695,401.68	40,565,608.40	-27.99	19.77	34.78	减少 14.26 个百分点
山西	10,334,753.62	20,186,483.05	-95.33	16.83	20.58	减少 6.09 个百分点
辽宁	96,589,841.51	80,257,564.13	16.91	64.35	37.00	增加 16.59 个百分点
吉林	6,249,153.10	9,094,375.42	-45.53	51.05	28.32	增加 25.78 个百分点
上海	455,699,598.77	555,210,350.90	-21.84	44.18	163.93	减少 55.28 个百分点
江苏	130,597,987.78	149,628,537.93	-14.57	14.48	39.61	减少 20.62 个百分点
浙江	859,949,765.01	630,585,581.97	26.67	19.04	37.84	减少 10.01 个百分点
安徽	14,940,466.32	20,797,031.27	-39.20	26.18	34.40	减少 8.52 个百分点
福建	25,564,581.44	39,388,594.03	-54.07	17.98	33.33	减少 17.73 个百分点
江西	27,456,266.12	34,220,931.84	-24.64	-1.57	21.60	减少 23.74 个百分点
山东	480,811,597.35	394,961,823.69	17.86	14.55	49.42	减少 19.16 个百分点
河南	28,994,020.90	31,025,436.39	-7.01	19.37	49.32	减少 21.46 个百分点
湖北	54,246,815.96	68,238,613.69	-25.79	15.11	44.76	减少 25.76 个百分点
湖南	26,139,555.45	35,757,729.66	-36.80	15.09	56.71	减少 36.34 个百分点
广东	393,525,551.72	335,645,186.62	14.71	23.20	45.55	减少 13.10 个百分点
广西	5,785,231.41	8,067,740.69	-39.45	23.98	24.61	减少 0.70 个百分点
海南	4,708,868.13	5,819,264.23	-23.58	26.91	52.67	减少 20.85 个百分点
四川	34,307,231.60	41,915,011.79	-22.18	19.08	46.57	减少 22.92 个百分点
云南	8,794,413.20	11,758,968.21	-33.71	18.97	58.51	减少 33.36 个百分点
陕西	23,445,155.51	35,987,248.64	-53.50	27.41	36.47	减少 10.19 个百分点
宁夏	6,123,259.14	5,727,070.72	6.47	141.17	39.83	增加 67.78 个百分点
黑龙江	4,117,459.05	7,201,654.36	-74.91	53.34	26.32	增加 37.39 个百分点
内蒙古	7,725,843.45	9,323,191.82	-20.68	38.29	14.77	增加 24.73 个百分点
重庆	5,966,678.11	9,724,145.09	-62.97	36.14	21.96	增加 18.95 个百分点
甘肃	2,443,190.09	4,013,815.08	-64.29	62.28	22.07	增加 54.12 个百分点
贵州	1,348,756.28	2,583,965.82	-91.58	192.75	78.48	增加 122.66 个百分点
青海	3,746,631.73	2,705,797.74	27.78	29.96	70.26	减少 17.10 个百分点
西藏	-	16,664.40	-	不适用	-95.58	-
新疆	709,947.17	3,522,640.79	-396.18	31.90	34.19	减少 8.46 个百分点
小计	3,240,020,880.36	3,012,282,155.98	7.03	22.21	58.86	减少 21.45 个百分点
公司本部	29,935,102,126.81	15,752,343,701.65	47.38	37.46	44.26	减少 2.48 个百分点
境内小计	33,175,123,007.17	18,764,625,857.63	43.44	35.81	46.42	减少 4.10 个百分点
境外小计	4,545,500,451.98	2,613,421,193.85	42.51	96.31	27.41	增加 31.09 个百分点
合计	37,720,623,459.15	21,378,047,051.48	43.33	41.05	43.80	减少 1.08 个百分点

注：上表境内地区的营业收入和支出为公司及境内证券、期货子公司的营业分支机构的经营情况

(二) 非主营业务导致利润重大变化的说明：不适用

(三) 资产、负债情况分析

1. 资产及负债状况

单位：元 币种：人民币

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上年期末数	上年期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上年期末变动比例 (%)	情况说明
结算备付金	37,739,297,424.71	3.23	56,934,000,392.55	5.41	-33.71	客户备付金存款规模变动
应收款项	66,919,086,798.64	5.72	39,352,598,397.78	3.74	70.05	应收经纪客户款项增加
存出保证金	38,510,507,446.64	3.29	3,877,774,046.76	0.37	893.11	下属子公司已被合约占用的保证金规模变动
其他权益工具投资	166,328,755.33	0.01	16,635,500,511.08	1.58	-99.00	出售其他权益工具投资所致
其他资产	7,438,712,595.73	0.64	14,434,530,119.63	1.37	-48.47	国债充抵保证金变动所致
短期借款	10,594,212,662.74	0.91	5,010,371,216.16	0.48	111.45	短期借款规模增加
应交税费	4,892,815,008.95	0.42	7,381,981,338.20	0.70	-33.72	应交企业所得税减少
应付款项	158,833,689,486.15	13.59	118,947,545,790.80	11.30	33.53	应付客户保证金增加
其他负债	13,203,876,392.84	1.13	7,680,036,499.54	0.73	71.92	应付股利增加
合同负债	1,085,579,257.75	0.09	2,194,220,628.36	0.21	-50.53	大宗商品贸易货款减少
其他综合收益	-1,026,231,250.18	-0.09	316,814,211.81	0.03	不适用	其他权益工具投资减少所致

其他说明：

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团资产总额为人民币 11,691.39 亿元，同比上年度末增加人民币 1,161.77 亿元、增长 11.03%；扣除代理买卖证券款及代理承销证券款后，本集团资产总额为人民币 9,231.94 亿元，同比上年度末增加人民币 744.14 亿元、增长 8.77%。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团负债总额为人民币 9,775.60 亿元，同比上年度末增加人民币 1,104.80 亿元、增长 12.74%；扣除代理买卖证券款及代理承销证券款后，本集团负债总额为人民币 7,316.15 亿元，同比上年度末增加人民币 687.17 亿元、增长 10.37%。

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团归属于母公司股东的权益为人民币 1,874.06 亿元，同比上年度末增加人民币 56.94 亿元、增长 3.13%。

资产负债结构稳定。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团扣除代理买卖证券款及代理承销证券款的总资产为人民币 9,231.94 亿元，其中，投资类的资产主要包括对联营、合营公司的投资及对金融资产的投资，占比 60.36%；融出资金及买入返售金融资产占比 17.44%；现金及银行结余占比 10.48%；固定资产、在建工程、无形资产、投资性房地产及使用权资产合计占比 1.41%。

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团扣除代理买卖证券款及代理承销证券款的负债总额为人民币 7,316.15 亿元。

其中，卖出回购金融资产款为人民币 2,143.36 亿元，占比 29.30%；应付债券及长期借款为人民币 1,833.19 亿元，占比 25.06%；短期借款、拆入资金及应付短期融资款为人民币 318.53 亿元，占比 4.35%；交易性金融负债及衍生金融负债为人民币 1,009.41 亿元，占比 13.80%；其他类负债合计金额为人民币 2,011.66 亿元，占比 27.49%。

资产负债水平略有增长。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团扣除代理买卖证券款及代理承销证券款的资产负债率为 79.25%，较上年末增加 1.15 个百分点。

2. 境外资产情况

(1) 资产规模

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团境外子公司资产总值为人民币 2,307.42 亿元，占本集团总资产的比例为 19.74%。

(2) 境外资产相关说明：不适用

3. 截至报告期末主要资产受限情况

报告期内主要资产受限情况请参阅财务报告附注六，1. 货币资金、8. 金融投资：交易性金融资产、9. 金融投资：其他债权投资。

(四) 投资状况分析

1. 对外股权投资总体分析

报告期内，公司减少股权类投资约人民币 29.10 亿元。其中，主要包括公司对中信期货增资人民币 20 亿元；对中信证券华南减资人民币 50 亿元。

(1) 重大的股权投资：不适用

(2) 重大的非股权投资：不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产

报告期内公司以公允价值计量的金融资产请参阅财务报告附注四、38。

(五) 重大资产和股权出售：不适用

(六) 主要控股参股公司分析

公司现有主要子公司 7 家，主要参股公司 1 家，简要情况如下：

名称	公司持股比例 (%)	设立日期	注册资本	办公地址	注册地址	负责人	联系电话
中信证券(山东)	100	1988.6.2	人民币 249,380 万元	山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场 1 号楼东 5 层 山东省济南市市中区经七路 156 号国际财富中心 15 层	山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001	冯恩新	0532-85022309
中信证券国际	100	1998.4.9	实收资本 651,605 万港元	香港中环添美道 1 号中信大厦 26 楼	香港中环添美道 1 号中信大厦 26 楼	张佑君	00852-26008188
金石投资	100	2007.10.11	人民币 300,000 万元	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 17 层	北京市朝阳区亮马桥路 48 号	金剑华	010-60837800
中信证券投资	100	2012.4.1	人民币 1,400,000 万元	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 17 层	山东省青岛市崂山区深圳路 222 号国际金融广场 1 号楼 2001 户	张佑君	010-60833811
中信期货	100	1993.3.30	人民币 560,000 万元	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层	张 皓	0755-83217780
中信证券华南	100	1988.3.26	人民币 5,091,137,318 元	广东省广州市天河区临江大道 395 号 901 室、1001 室	广东省广州市天河区临江大道 395 号 901 室、1001 室。	胡伏云	020-88836999
华夏基金	62.20	1998.4.9	人民币 23,800 万元	北京市西城区月坛南街 1 号院 7 号楼	北京市顺义区安庆大街甲 3 号院	杨明辉	010-88066688
中信产业基金	35	2008.6.6	人民币 180,000 万元	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 17 层	绵阳科技城科教创业园区孵化大楼 C 区	金剑华	010-60837869

公司主要子公司、参股公司基本情况如下（均未经审计）：

(1) 中信证券（山东），注册资本人民币 249,380 万元，为公司的全资子公司。截至报告期末，中信证券（山东）总资产人民币 3,162,327 万元，净资产人民币 726,950 万元；2021 年上半年，实现营业收入人民币 108,154 万元，利润总额人民币 45,836 万元，净利润人民币 34,389 万元；拥有证券分支机构 70 家，员工 2,489 人，其中经纪人 3 人、派遣员工 7 人。

中信证券（山东）的主营业务：中国保监会批准的人身险和财产险（航意险及替代产品除外）；外币有价证券经纪业务；证券经纪（限山东省、河南省）；证券投资咨询（限山东省、河南省的证券投资顾问业务）；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品（限山东省、河南省）。

(2) 中信证券国际，实收资本 651,605 万港元，为公司的全资子公司。截至报告期末，中信证券国际总资产约合人民币 20,833,894 万元，净资产约合人民币 967,723 万元；2021 年上半年，实现营业收入约合人民币 413,029 万元，利润总额约合人民币 165,047 万元，净利润约合人民币 141,953 万元。在香港拥有 4 家分行，员工 1,847 人，其中经纪人 86 人。

中信证券国际的主营业务：控股、投资，其下设的子公司从事企业融资及资本市场、证券经纪、期货经纪、资产管理、自营业务、直接投资等业务。

(3) 金石投资，注册资本人民币 30 亿元，为公司的全资子公司。截至报告期末，金石投资总资产人民币 3,555,831 万元，净资产人民币 916,852 万元；2021 年上半年，实现营业收入人民币 89,717 万元，利润总额人民币 60,889 万元，净利润人民币 45,262 万元；员工 116 人（含派遣员工 7 人）。

金石投资的主营业务：实业投资；投资咨询、管理。

(4) 中信证券投资，注册资本人民币 140 亿元，为公司的全资子公司。截至报告期末，中信证券投资总资产人民币 2,039,337 万元，净资产人民币 1,751,484 万元；2021 年上半年，实现营业收入人民币 165,365 万元，利润总额人民币 122,095 万元，净利润人民币 92,625 万元；员工 29 人。

中信证券投资的主营业务：金融产品投资、证券投资、股权投资。

(5) 中信期货，注册资本人民币 56 亿元，为公司的全资子公司。截至报告期末，中信期货总资产人民币 12,058,329 万元，净资产人民币 862,205 万元；2021 年上半年，实现营业收入人民币 840,929 万元，利润总额人民币 63,457 万元，净利润人民币 47,946 万元；拥有期货分支机构 48 家，员工 1,478 人。

中信期货的主营业务：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。

(6) 中信证券华南，注册资本人民币 5,091,137,318 元，为公司的全资子公司。截至报告期末，中信证券华南总资产人民币 1,877,507 万元，净资产人民币 650,514 万元；2021 年上半年，实现营业收入人民币 43,172 万元，利润总额人民币 9,788 万元，净利润人民币 9,275 万元；拥有证券分支机构 62 家，员工 1,002 人，经纪人 1 人。

中信证券华南的主营业务：证券经纪；证券投资咨询（仅限于证券投资顾问业务）；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。

(7) 华夏基金，注册资本人民币 2.38 亿元，公司持有 62.20% 的股权。截至报告期末，华夏基金总资产人民币 1,410,587 万元，净资产人民币

1,003,986 万元；2021 年上半年，实现营业收入人民币 365,195 万元，利润总额人民币 136,619 万元，净利润人民币 104,871 万元；员工 1,095 人。

华夏基金的主营业务：基金募集；基金销售；资产管理；从事特定客户资产管理业务；中国证监会核准的其他业务。

(8) 中信产业基金，注册资本人民币 18 亿元，公司持有 35% 的股权。截至报告期末，中信产业

基金总资产人民币 507,354 万元，净资产人民币 479,543 万元；2021 年上半年，实现净利润人民币 -15,669 万元。

中信产业基金的主营业务：发起设立产业（股权）投资基金；产业（股权）投资基金管理；财务顾问、投资及投资管理咨询；股权投资及对外投资；企业管理。

(七) 证券分公司介绍

截至报告期末，本公司在国内共设立了 36 家证券分公司，基本情况如下：

序号	所属分公司	负责人	营业地址	联系方式
1	北京分公司	田兵	北京市东城区建国门北大街 5 号金成建国 5 号 4 层	010-65128320
2	上海分公司	汪丽华	上海市世纪大道 1568 号 8 层（实际楼层 7 层）06、07 单元，10 层（实际楼层 9 层）01-03、06A、07 单元	021-61768697
3	湖北分公司	孙洪涛	湖北省武汉市江汉区建设大道 737 号广发银行大厦 51 层	027-85355366
4	江苏分公司	解思源	江苏省南京市建邺区庐山路 168 号新地中心二期十层、B 区一层	025-83261298
5	上海自贸试验区分公司	田兴农	上海市自由贸易试验区世纪大道 1568 号 19、20 层	021-20262006
6	深圳分公司	梁琪	广东省深圳市福田区福田街道中心三路 8 号中信证券大厦 12 楼、20 楼	0755-23911668
7	东北分公司	李喆	辽宁省沈阳市和平区青年大街 286 号华润大厦 A 座 30 层	024-23972693
8	浙江分公司	陈钢	浙江省杭州市江干区迪凯银座 1703、1704、1901、1902、2201、2202、2203、2204、2301、2303、2304 室	0571-85783714
9	江西分公司	张新青	江西省南昌市红谷滩新区绿茵路 129 号联发广场写字楼 2801、2802、2806、2807、2808、2809、2810（第 28 层）	0791-83970561
10	福建分公司	睦艳萍	福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 1901、1902、1907、2005B、2006、2007 单元	0591-87905705
11	宁波分公司	姚锋	浙江省宁波市江东区济和街 235 号 2 幢（15-1）	0574-87033718
12	温州分公司	潘晔	浙江省温州市车站大道 577 号财富中心 7 楼 702.703 室	0577-88107230
13	四川分公司	洪蔚	四川省中国（四川）自由贸易试验区成都市高新区天府大道北段 1480 号拉·德方斯大厦西楼 1 层	028-63278899
14	陕西分公司	史磊	陕西省西安市高新区唐延路 11 号禾盛京广中心 1 幢 1 单元 19 层 02-03-04 号房	029-88601239
15	天津分公司	张新宇	天津市河西区友谊路 23 号天津科技大厦 7 层	022-58816668
16	内蒙古分公司	樊雅琼	内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区四纬路金泰丽湾 10 号综合体	0471-5982233
17	安徽分公司	韩睿	安徽省合肥市庐阳区濉溪路 287 号金鼎国际广场 A 座 1- 商 101、1-701-708 室	0551-65662889

序号	所属分公司	负责人	营业地址	联系方式
18	山西分公司	郑文慧	山西省太原市晋源区集阜路 1 号鸿昇时代金融广场东北角 1 号商铺	0351-6191968
19	云南分公司	张蕊	云南省昆明市盘龙区东风东路 23 号昆明恒隆广场办公楼 26 层 2601-2603、2612 单元	0871-68583323
20	湖南分公司	罗花	湖南省长沙市天心区芙蓉中路二段 198 号新世纪大厦二楼	0731-85175379
21	河北分公司	邱振缨	河北省石家庄市长安区中山东路 39 号勒泰中心 B 座 35 层 3501-3504 室	0311-66188908
22	重庆分公司	韩函	重庆市江北区江北城西大街 5 号中信银行大厦负 5-1、12-1-2	023-67518668
23	海南分公司	朱玉梅	海南省海口市美兰区国兴大道 65 号盛达景都东区 B 栋 1-2 层	0898-65361268
24	广西分公司	刘渝扬	广西南宁市青秀区民族大道 136-5 号华润大厦 C 座 18 楼 1805 室	0771-2539031
25	甘肃分公司	徐莹	甘肃省兰州市城关区民主西路 9 号兰州 SOHO 大厦 4 层	0931-8631255
26	宁夏分公司	吴立刚	宁夏银川市金凤区尹家渠东侧、枕水路南侧悦海新天地 16 号 (原 B4 号) 综合商业楼 301 室	0951-5102568
27	吉林分公司	刘明旭	吉林省长春市南关区人民大街 8988 号明珠广场 C 座一至二层 C101 三层 C301、C302 室	0431-81970899
28	黑龙江分公司	赵勇	黑龙江省哈尔滨市道里区金江路 1150 号	0451-51176699
29	嘉兴分公司	吴静兰	浙江省嘉兴市经济技术开发区财富广场商办楼 D110 室 1、3、4 层, D111 室, D113 室 3、4 层	0573-82069341
30	金华分公司	厉强	浙江省金华市中山路 331 号海洋大厦 1-4 层	0579-82337102
31	绍兴分公司	童维佳	浙江省绍兴市越城区偏门直街 117 号	0575-88096598
32	台州分公司	林斌仙	浙江省台州市椒江区府中路 188 号开投商务大厦 2001 室、103 室	0576-88896598
33	新疆分公司	贾昊昊	新疆乌鲁木齐高新区 (新市区) 高新街 217 号盈科广场 A 座 1 层 1-01、7 层 7017 室	0991-5870063
34	苏州分公司	王晓猛	江苏省苏州工业园区苏雅路 308 号 8 楼	0512-67615858
35	佛山分公司	陈恒富	广东省佛山市南海区桂城中路 23 号南海万科广场写字楼 15 楼	0757-82067623
36	东莞分公司	曹鸿	广东省东莞市东城街道岗贝东城路御景大厦首层部分 17 层 1705、1706、1707、1708	0769-89907858

(八) 公司控制的结构化主体情况

公司控制的结构化主体情况请参阅财务报告附注六、1。

(九) 财务报表合并范围变更的说明

报告期内, 纳入公司财务报表合并范围的结构化主体变更为 12 支, 纳入公司财务报表合并范围的一级单位变更为 29 家。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险

当前世界经济在疫情后恢复的态势有所强化，但各国之间仍有较为明显的分化，各国央行陆续释放结束宽松、逐步收紧的货币政策预期，市场可能因此产生的波动不容忽视。国内经济稳中加固，但平衡好稳增长和防范金融风险之间的关系仍面临挑战。随着外部环境的变化，信用衍生品、大宗商品、外汇等新业务规模增长将带来相应的市场风险增加，融资类业务、固定收益类产品投资等面临着信用风险与交易对手风险的变化。公司在稳健经营的过程中，要保证在业务规模增长的趋势下风险水平仍保持可查可控。



(二) 风险管理

概述

公司始终认为，有效的风险管理和内部控制对公司的成功运作至关重要。通过实施全面的风险管理机制和内部控制流程，公司对业务活动中的金融、操作、合规、法律风险进行监测、评估与管理，对子公司通过业务指导、运营支持、决策管理等不同模式进行垂直的风险管理。根据各类法律法规及监管要求，公司建立了完整有效的治理结构

体系。公司股东大会、董事会和监事会根据《公司法》《证券法》、公司《章程》履行职权，对公司的经营运作进行监督管理。董事会通过加强对内部控制有关工作的安排、完善公司的内部控制环境和内部控制结构，使内部控制与风险管理成为公司决策的必要环节。

公司建立了由首席风险官领导，风险管理部牵头，公司各部门/业务线、分支机构、子公司及全体员工共同参与的全面风险管理体系以及风险管理三道防线机制。公司在“十四五”规划中，明确了风险战略目标：持续优化全面风险管理体系和全球一体化风险管理体系，建成与业务发展相匹配的、面向全球业务的 24 小时、全覆盖、无死角的风险管控体系，保持国内领先、并基本达到国际先进投行的风险管理水平，将风险管理能力打造成公司的核心竞争力之一；构建科学的风险偏好管理体系，发挥风险偏好与容忍度的引导作用，达到资本、风险与收益的均衡匹配，助力公司经营战略目标的实现，推动公司持续高质量发展。

2021 年上半年，公司重点优化风险偏好管理体系建设，发布了经董事会审议批准的《中信证券股份有限公司风险偏好管理办法》以及《中信证券股份有限公司 2021 年度风险偏好陈述书》，充分发挥风险偏好对业务发展的引导作用；进一步完善风险管理手段和应对措施，保障公司全面风险管理体系稳健运行，各类风险得到有效管理和控制；持续满足并表监管试点要求，深化境内外一体化风险管理机制，提升集团化风险管理水平。

公司深知，要实现“成为全球客户最为信赖的国内领先、国际一流的中国投资银行”的发展愿景，离不开完善的全面风险管理体系和先进的信息技术平台。因此，公司近年来持续增加在合规风控、

信息技术方面的研究及投入，加大相关专业人才的招聘力度，运用金融科技手段推进合规风控系统的建设与优化，不断完善计量方法和计量工具，提升精细化风险管理水平，确保风险管理对境内外业务的全覆盖。

风险管理架构

公司董事会下设的风险管理委员会，经营管理层下设的专业委员会，相关内部控制部门与业务部门/业务线共同构成公司风险管理的主要组织架构，形成由委员会进行集体决策、内部控制部门与业务部门/业务线密切配合，较为完善的三层次风险管理体系，从审议、决策、执行和监督等方面管理风险。在部门和业务线层面，确立了由业务部门/业务线承担风险管理的首要责任、风险管理部及合规部等内部控制部门对各类风险进行专业化管理、稽核审计部负责事后监督与评价的风险管理三道防线。

第一层：董事会

董事会风险管理委员会对公司的总体风险管理进行监督，并将之控制在合理的范围内，以确保公司能够对与经营活动相关联的各种风险实施有效的风险管理计划；制定总体风险管理政策供董事会审议；规定用于公司风险管理的战略结构和资源，并使之与公司的内部风险管理政策相兼容；制定重要风险的界限；对相关的风险管理政策进行监督、审查和向董事会提出建议。

第二层：经营管理层

公司设立资产负债管理委员会。该委员会在公司董事会和经营管理层的授权范围内，对涉及公司自有资金运用的重要事项及相关制度进行决策审批，利用科学、规范的管理手段，坚持稳健的原则，严格控制和管理风险，在保证公司资金安全的基础上，优化资产配置，提高资金使用效率。

公司设立资本承诺委员会。该委员会在公司董事会和经营管理层的授权范围内，对承销业务的资本承诺进行最终的风险审查和审批，所有可能动用公司资本的企业融资业务均需要经过资本承诺委员会批准，确保企业融资业务风险的可承受性和公司资本的安全。

公司设立风险管理委员会。该委员会向公司董事会风险管理委员会、公司经营管理层汇报，并在授权范围内，负责公司日常的风险监控和管理工作，对涉及风险管理的重要事项及相关制度进行决策审批，制定风险限额。风险管理委员会下设风险管理工作小组和声誉风险管理工作小组，其中，风险管理工作小组是负责对公司买方业务的金融风险实行日常监控管理的协调决策机构，推进落实公司风险管理委员会的决策。风险管理工作小组在定期工作会议的机制上，针对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险分别设置由专岗风险管理专家牵头、主要涉及业务部门/业务线参与的专项工作组，通过建立执行层面的协调机制，及时响应日常监控所发现的待处理事项或上级机构制订的决策事项。声誉风险管理工作小组是声誉风险的日常管理机构，负责建立相关制度和管理机制，防范和识别声誉风险，主动、有效地应对和处置声誉事件，最大程度地减少负面影响。

公司任命首席风险官负责协调全面风险管理工作。

公司设立产品委员会。产品委员会在公司董事会和经营管理层的授权范围内，对公司产品与服务业务进行统一规划、部署及决策，对公司发行或销售产品、提供相关服务进行审批，是公司金融产品准入与适当性管理的决策机构。产品委员会下设风险评估小组、适当性管理小组和指数专业委员会。风险评估小组负责公司代销产品的委托人资格审查，负责组织产品评估的具体工作，制定公司产品或服务风险分级的标准和方法，对产品或服务进行风险评估与风险评级，督促存续期

管理等工作。适当性管理小组负责制定投资者分类的标准、对投资者进行适当性匹配的原则和流程，督促各部门落实投资者适当性管理工作，组织开展适当性培训和公司级别的适当性自查及整改，督促建立并完善投资者适当性评估数据库等适当性管理相关的工作。指数专业委员会负责对公司自创指数业务的规划和运维进行统一的管理，具体包括制定公司指数业务开展和运维的制度与标准，明确风险事件的处理预案和责任机制，规划公司指数业务布局，对公司自创指数进行上线审核等工作。

第三层：部门 / 业务线

在部门和业务线层面，公司对前、中、后台进行了分离，分别行使不同的职责，建立了相应的制约机制，形成由业务部门 / 业务线、风险管理部及合规部等内部控制部门、稽核审计部共同构筑的风险管理三道防线。

公司的前台业务部门 / 业务线作为公司风险管理的第一道防线，承担风险管理的第一线责任，负责建立各项业务的业务管理制度与风险管理制度，对业务风险进行监控、评估、报告，并将业务风险控制授权范围内。

公司风险管理部、合规部等内部控制部门是公司风险管理的第二道防线，其中：

公司风险管理部对公司面临的风险进行识别、测量、分析、监控、报告和管理，分析、评价公司总体及业务线风险，对优化公司的风险资源配置提出建议；协助公司风险管理委员会制订公司的风险限额等风险管理指标，监控、报告风险限额等指标的执行情况；建立和完善业务风险在前台、风险管理部门、经营管理层间的快速报告、反馈

机制，定期向经营管理层全面揭示公司的整体风险状况，为公司风险管理提供建议；建立健全压力测试机制，为公司重大决策和日常经营调整提供依据，并满足监管要求；对新产品、新业务进行事前的风险评估和控制设计。

公司合规部组织拟订并实施公司合规管理的基本制度；为公司经营管理层及各部门 / 业务线和分支机构提供合规建议及咨询，并对其经营管理活动的合法合规性进行监督；督导公司各部门 / 业务线和分支机构根据法律法规和准则的变化，评估、制定、修订、完善内部管理制度和业务流程；对公司内部管理制度、重大决策、新产品、新业务及重要业务活动等进行事前合规审查；履行向监管部门定期、临时报告义务；依据公司反洗钱有关制度，组织开展洗钱风险防控工作等。

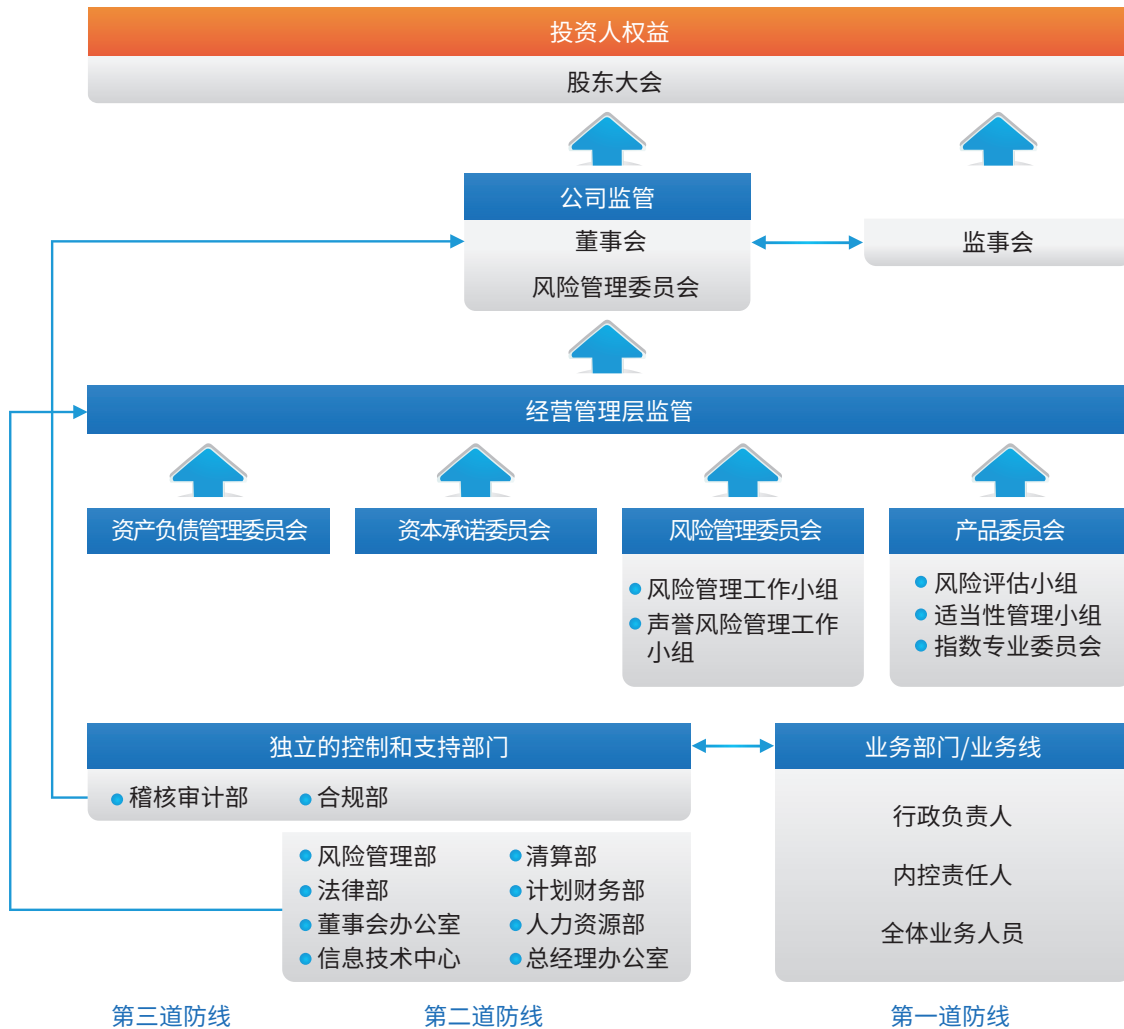
公司法律部负责控制公司及相关法律风险等。

公司董事会办公室会同总经理办公室、风险管理部、合规部、人力资源部、法律部、信息技术中心、稽核审计部及相关部门，共同推进管理公司的声誉风险。

公司信息技术中心负责管理公司的信息技术风险。

公司稽核审计部是公司风险管理的第三道防线，全面负责内部稽核审计，计划并实施对公司各部门 / 业务线、子公司及分支机构的内部审计工作，监督内部控制制度的执行情况，防范各种道德风险和政策风险，协助公司对突发事件进行核查。

其他内部控制部门分别在各部门职责范围内行使相应的风险管理职能。



图：风险管理架构

市场风险

市场风险是由于持仓金融头寸的市场价格变动而导致的损失风险。持仓金融头寸来自于自营投资、做市业务以及其他投资活动。持仓金融头寸的变动主要来自客户的要求或自营投资的相关策略。

市场风险的类别主要包括权益价格风险、利率风险、商品价格风险和汇率风险。其中，权益价格风险是由于股票、股票组合、股指期货等权益品种价格或波动率的变化而导致的；利率风险主要

由固定收益投资收益率曲线结构、利率波动性和信用利差等变动引起；商品价格风险由各类商品价格发生不利变动引起；汇率风险由非本国货币汇率波动引起。

公司建立了自上而下的风险限额管理体系，通过将公司整体的风险限额分配至各业务部门/业务线、内部控制部门监督执行、重大风险事项及时评估与报告等方式，将公司整体市场风险水平管理在恰当的范围内。

公司通过独立于业务部门 / 业务线的风险管理部对公司整体的市场风险进行全面的评估、监测和管理，并将评估、监测结果向各业务部门 / 业务线、公司经营管理层和风险管理委员会进行汇报。在具体实施市场风险管理的过程中，前台业务部门 / 业务线作为市场风险的直接承担者和一线管理人员，动态管理其持仓部分所暴露出的市场风险，并在风险暴露较高时主动采取降低风险敞口或风险对冲等操作；而风险管理部的相关监控人员则会持续地直接与业务部门 / 业务线的团队沟通风险信息，讨论风险状态和极端损失情景等。

风险管理部通过一系列计量方式估计可能的市场风险损失，既包括在市场正常波动状况下的可能损失，也包括市场极端变动状况下的可能损失。风险管理部主要通过 VaR 和敏感性分析的方式对正常波动情况下的短期可能损失进行衡量，同时，对于极端情况下的可能损失，采用压力测试的方法进行评估。风险报告包括各业务部门 / 业务线的市场风险状况以及变化情况，会以每日、周、月、季度等不同频率发送给业务部门 / 业务线的主要负责人和公司经营管理层。

VaR 是在一定的时间段内、一定置信度下持仓投资组合由于市场价格变动导致的可能损失。公司使用 VaR 作为衡量市场风险状况的主要指标。在具体参数设置上采用 1 天持有期、95% 置信度。VaR 的计算模型覆盖了利率风险、权益价格风险、汇率风险等风险类型，能够衡量由于利率曲线变动、证券价格变动、汇率变动等因素导致的市场风险变动。风险管理部通过回溯测试等方法对 VaR 计算模型的准确性进行持续检测，并随公司业务不断拓展，积极改善 VaR 风险计算模型。公司还通过压力测试的方式对持仓面临极端情况的冲击下的可能损失状况进行评估。风险管理部设置了一系列宏观及市场场景，来计算公司全部持仓在单一情景或多情景同时发生的不同状况下的可能损失。这些场景包括：宏观经济状况的大幅下滑、

主要市场大幅不利变动、特殊风险事件的发生等。压力测试是公司市场风险管理中的重要组成部分。通过压力测试，可以更为突出的显示公司的可能损失，进行风险收益分析，并对比风险承受能力，衡量公司整体的市场风险状态是否在预期范围内。

公司对业务部门 / 业务线设置了风险限额以控制盈亏波动水平和市场风险暴露程度，风险管理部对风险限额进行每日监控。当接近或突破风险限额时，风险管理部会向相关管理人员进行预警提示，并和相关业务管理人员进行讨论，按照讨论形成的意见，业务部门 / 业务线会降低风险暴露程度使之符合风险限额，或者业务部门 / 业务线申请临时或永久提高风险限额，经相应授权人员或组织批准后实施。

公司对风险限额体系进行持续的完善，明确了统一的限额管理办法和分级授权机制，并根据授权机制调整公司整体、各业务部门 / 业务线、投资账户等不同层面的风险限额指标体系管理办法。

对于境外资产及子公司资产，公司实行境内外一体化管理，以逐日盯市方式对账户资产价格进行跟踪，并从资产限额、VaR、敏感性分析、压力测试等多个角度进行管理，针对外币资产，公司对汇率风险进行整体监控和管理，并通过调整外汇头寸、用外汇远期 / 期权对冲、进行货币互换等多种手段管理汇率风险敞口。

2021 年上半年，公司依据新的业务规划，更新了新一年的市场风险限额，并持续丰富指标限额体系，持续推动风险计量方法研究与完善。从而更有针对性地评估各业务的市场风险和进行管控，以防止可能发生的重大损失。

本集团紧密跟踪市场和业务变化，及时掌握最新市场风险状况，与监管机构和股东保持良好的沟通，及时管理市场风险敞口。

信用风险

信用风险是指因借款人、交易对手或持仓金融头寸的发行人无法履约或信用资质恶化而带来损失的风险。

本集团的信用风险主要来自四个方面：一是经纪业务代理客户买卖证券及进行期货交易，若没有提前要求客户依法缴足交易保证金，在结算当日客户的资金不足以支付交易所需的情况下，或客户资金由于其他原因出现缺口，本集团有责任代客户进行结算而造成损失的风险。二是融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购等证券融资类业务的信用风险，指由于客户未能履行合同约定而带来损失的风险。三是信用类产品投资的违约风险，即所投资信用类产品之融资人或发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致资产损失和收益变化的风险。四是利率互换、股票收益互换、场外期权、远期交易等场外衍生品交易对手方违约风险，即交易对手方到期未能按照合同约定履行相应支付义务的风险。

公司通过内部信用评级体系对交易对手或发行人的信用级别进行评估，采用压力测试、敏感性分析等手段进行计量，并基于这些结果通过授信制度来管理信用风险。同时，公司通过信息管理系统对信用风险进行实时监控，跟踪业务品种及交易对手的信用风险状况、出具分析及预警报告并及时调整授信额度。

在中国境内代理客户进行的证券交易均以全额保证金结算，很大程度上控制了交易业务相关的结算风险。

证券融资类业务的信用风险主要涉及客户提供虚假资料、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、交易行为违反监管规定、提供的担保物资产涉及法律纠纷等。公司主要通过对客户风险教育、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式，控制此类业务的信用风险。

信用类产品投资方面，对于私募类投资，公司制定了产品准入标准和投资限额，通过风险评估、风险提示和司法追索等方式对其信用风险进行管理；对于公募类投资，公司通过交易对手授信制度针对信用评级制定相应的投资限制。

场外衍生品交易的交易对手主要为金融机构或其他专业机构，主要涉及交易对手未能按时付款、在投资发生亏损时未能及时补足保证金、交易双方计算金额不匹配等风险。公司对交易对手设定保证金比例和交易规模限制，通过每日盯市、追保、强制平仓等手段来控制交易对手的信用风险敞口，并在出现强制平仓且发生损失后通过司法程序进行追索。

因境内外评级机构对于债券的评级结果没有较强的可比性，因此分别表述如下：

债券类投资信用风险敞口（中国境内）

单位：万元 币种：人民币

投资评级	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
中国主权信用	5,381,844	4,645,709
AAA	5,722,423	6,951,854
AA	1,985,634	1,886,740
A	23,137	25,349
A-1	72,035	64,532
其他	1,856,161	1,559,341
敞口合计	15,041,234	15,133,525

注：AAA ~ A 指一年期以上债务的评级，其中 AAA 为最高评级；A-1 指一年期以内债务的最高评级；AA 包含实际评级为 AA+、AA 和 AA- 的产品；A 包含实际评级为 A+、A 和 A- 的产品；其他为 A- 以下（不含 A-）评级及没有外部债项评级的资产

债券类投资信用风险敞口（境外）

单位：万元 币种：人民币

投资评级	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
A	4,791	990
B	708,924	621,323
C	667,193	705,817
D	2,130	13,627
NR	134,934	-69,095
敞口合计	1,517,972	1,272,662

注：境外债券评级取自穆迪、标普、惠誉三者评级（若有）中的最低者；若三者均无评级，则记为 NR。其中，A 评级包含穆迪评级 Aaa ~ Aa3、标普评级 AAA ~ AA-、惠誉评级 AAA ~ AA- 的产品；B 评级包含穆迪评级 A1 ~ Baa3、标普评级 A+ ~ BBB-、惠誉评级 A+ ~ BBB- 的产品；C 评级包含穆迪评级 Ba1 ~ B3、标普评级 BB+ ~ B-、惠誉评级 BB+ ~ B- 的产品；D 评级包含穆迪评级 Caa1 ~ D、标普评级 CCC+ ~ D、惠誉评级 CCC+ ~ D 的产品

本集团对证券融资类业务从质押率、质押物、保障金比例、集中度、流动性、期限等多个角度继续保持严格的风险管理标准，并通过及时的盯市管理来管理信用风险敞口。

报告期末，本集团融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 295%；本集团约定购回式证券交易客户无负债；本集团自有资金出资的股票质押式回购业务规模为人民币 282.82 亿元，平均维持担保比例 291%，本集团管理的资管产品股票质押式回购业务规模为人民币 209.53 亿元。

流动性风险

流动性风险，是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。公司一贯坚持资金的整体运作，并由库务部统一管理公司的资金调配。在境内交易所和银行间市场，公司具有较好的资信水平，维持着比较稳定的拆借、回购等短期融资通道；同时也通过公募或私募的方式发行公司债、次级债、收益凭证等补充公司长期运营资金，从而使公司的整体流动性状态保持在较为安全的水平。

此外，风险管理部会独立地对公司未来一段时间内的资金负债情况进行每日监测与评估，通过对特定时间点和时间段的资产负债匹配情况的分析以及对资金缺口等指标的计算，来评估公司的资金支付能力。公司建立了流动性储备池制度，持有充足的高流动性资产以满足公司应急流动性需求，并由风险管理部每日对储备池规模及流动性情况进行监控。风险管理部每日发布公司流动性风险报告，对公司的资产负债状况、流动性风险限额执行情况、储备池情况进行报告。同时，公司对流动性风险指标设置了预警阈值，当超过阈值时，风险管理部将依照相关制度向公司风险管理委员会和公司管理层以及相关部门进行风险警示，并由相关的管理部门进行适当操作以将公司的流动性风险调整到公司允许的范围。

2021 年上半年，市场流动性环境基本保持稳定，公司保持了对流动性风险的密切关注和日常管理，确保公司流动性维持良好状态。同时加强了对流动性监管指标的前瞻性管理，以确保流动性监管指标持续符合监管标准。上半年，风险管理部牵头开展了集团层面的流动性风险压力测试，评估极端情况下的流动性压力，并梳理了母子公司流动性风险管理机制，以确保公司流动性的安全。

操作风险

操作风险是指由内部流程缺陷、信息系统故障、人员失误或不当行为，以及外部因素等原因给公司造成损失的风险。

报告期内，已建立的各项管理工具持续有效运行，公司通过新产品新业务评估与回顾、业务流程梳理与规章制度审核等手段不断完善内控流程、控制风险暴露；通过关键风险指标（KRI）监控及时对运营中的风险进行预警与分析，关键风险指标的数量稳步增加，针对性不断增强；通过风险事件调查与报告、整改措施追踪及时缓释风险。通过开展形式多样的培训，培育员工操作风险理念，提升操作风险意识。通过不断完善操作风险管理系统功能及配套 OA 办公流程，辅以自动化手段支持操作风险日常管理，助力操作风险管理效率与效果的持续提升。

第四节 公司治理



中信证券
CITIC SECURITIES

第四节 公司治理

一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2020 年度股东大会	2021.6.29	www.sse.com.cn www.hkexnews.hk www.citics.com	2021.6.30	会议审议通过以下议案： 《2020 年度董事会工作报告》《2020 年度监事会工作报告》《2020 年年度报告》《2020 年度利润分配方案》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于预计公司 2021 年自营投资额度的议案》《关于审议公司董事、监事 2020 年度报酬总额的议案》《关于预计公司 2021 年日常关联 / 持续性关联交易的议案》《关于修订公司 < 章程 > 的议案》《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》《关于公司发行境内外公司债务融资工具可能涉及的关联 / 连交易的议案》《关于选举公司独立非执行董事的议案》《关于公司符合配股条件的议案》《配股公开发行证券方案》《配股公开发行证券预案》《公司配股募集资金使用的可行性分析报告》《关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施的议案》《关于授权董事会全权办理本次配股相关事宜的议案》《公司 2021—2023 年股东回报规划》《关于前次募集资金使用情况的议案》
2021 年第一次 A 股类别股东会	2021.6.29	www.sse.com.cn www.hkexnews.hk www.citics.com	2021.6.30	会议审议通过以下议案： 《关于公司符合配股条件的议案》《配股公开发行证券方案》《配股公开发行证券预案》《公司配股募集资金使用的可行性分析报告》《关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施的议案》《关于授权董事会全权办理本次配股相关事宜的议案》
2021 年第一次 H 股类别股东会	2021.6.29	www.sse.com.cn www.hkexnews.hk www.citics.com	2021.6.30	会议审议通过以下议案： 《关于公司符合配股条件的议案》《配股公开发行证券方案》《配股公开发行证券预案》《公司配股募集资金使用的可行性分析报告》《关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施的议案》《关于授权董事会全权办理本次配股相关事宜的议案》

注：上述会议决议公告请参阅会议当日的香港交易所披露易网站，次日的上交所网站、《中国证券报》《上海证券报》和《证券时报》及本公司网站

表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会：不适用

股东大会情况说明

公司 2020 年度股东大会及 2021 年第一次 A 股类别股东会、2021 年第一次 H 股类别股东会于 2021 年 6 月 29 日采取现场投票与网络投票相结合的表决方式召开，会议现场设在北京瑞城四季酒店。2020 年度股东大会审议通过了十项普通决议案、十项特别决议案；2021 年第一次 A 股类别股东会及 2021 年第一次 H 股类别股东分别审议了六项特别决议案。上述股东会由公司董事长张佑君先生主持，公司董事、监事及部分高级管理人员出席了会议。

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

姓名	担任的职务	变动情形
李青	独立非执行董事	选举
何佳	原独立非执行董事	离任

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

公司原独立非执行董事何佳先生因希望投入更多时间于个人事务，向公司董事会辞去公司第七届董事会独立非执行董事职务及董事会下设专门委员会相应职务，自 2021 年 4 月 28 日起正式生效。

经公司第七届董事会第二十二次会议提名，经公司 2020 年度股东大会选举，李青先生于 2021 年 6 月 29 日起正式出任公司独立非执行董事，接任何佳先生原在董事会下设专门委员会的委员职务，任期与第七届董事会一致。

三、利润分配或资本公积金转增预案

半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	否
每 10 股送红股数（股）	-
每 10 股派息数（元）（含税）	-
每 10 股转增数（股）	-
利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明	无

四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

公司曾于 2006 年实施了股权激励，请参见 2006 年 9 月 7 日的《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及上交所网站。

第五节 环境与社会责任



第五节 环境与社会责任

一、环境信息情况

(一) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其主要子公司的环保情况说明：不适用

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明：不适用

(三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明：不适用

(四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

公司以践行国家战略、服务实体经济、为社会创造更大价值为己任，以成为全球客户最为信赖的国内领先、国际一流的中国投资银行为愿景，从稳健运营、可持续金融、员工发展、环境友好、回馈社会等方面，积极履行企业社会责任，努力为客户、股东、员工、社会等利益相关方创造价值。



1. 环境责任理念及管理架构

公司认真学习新发展理念，积极响应国家环境保护和可持续发展战略，从自身运营及绿色金融等方面，自觉履行企业环境责任；积极推行绿色运营理念，在办公楼、数据中心采取一系列节能减排的环保措施，倡导绿色办公、绿色出行，尽可能减低自身运营对环境的影响；践行绿色采购，优先选用环保产品，倡导鼓励员工树立环保意识，

以实际行动助力生态文明建设；以 ESG 理念服务国家“碳中和”目标，提供“碳达峰”承诺的资本市场解决方案，致力于在金融领域实践可持续发展，主动践行负责任投资、发展绿色金融，大力支持绿色产业相关项目，持续推动发行绿色债券及 ESG 主题基金，推动传统产业向高端化、智能化、绿色化转型。

公司建立并不断完善环境管理架构，将环境责任理念融入日常经营管理各个方面，确保环境责任落到实处。公司的环境管理策略由董事会决策、管理层统筹实施，各部门及各子公司相互协作配合，共同开展和推进环境保护工作。

2. 环境管理工作开展情况

(1) 绿色运营

公司积极推行绿色办公理念，实施多类环保措施，包括节约照明用电、公共区域空调温度节能设置、洗手间节水、禁止公务车私用、推行无纸化办公等。

减少废弃物。公司持续坚持“低碳环保”原则，采取多种措施减少废弃物产生。2021年上半年，公司积极响应《有关加快推进生活垃圾分类工作的意见》政策要求，持续开展垃圾分类回收专项活动。通过继续做好“垃圾分类”内部宣传、组织专项培训、策划公益活动等措施，提升员工环保意识，促进废弃物回收利用。疫情期间，增设废弃口罩回收箱，消毒后处理，按照政府要求做好疫情物资回收工作。公司通过安装饮水机、配置热水壶和可重复使用的茶杯以及提倡员工自带水杯、及减少提供瓶装水及一次性纸杯使用等方式，减少一次性用品产生量。

珍惜水资源。公司积极响应国家节约用水相关号召，根据实际运营情况制定节水计划并贯彻落实。为达成节水目标，公司对北京总部大楼净水主机进行废水回收改造，将主机过滤后的废水通过新增管道统一回收到地下中水水箱后重复利用。

合规排放。为改善餐厅污水排放指标，公司加装了新的污水净化设备，经检测，污水中的悬浮物、油脂、化学需氧量等指标均符合北京市地方排放标准。

节约能耗。公司继续落实节能计划，管理好能耗数据台账，定期对比分析。通过开展“厉行节约、

反对浪费”的主题宣传活动，积极推行节能降耗的绿色办公理念。联合物业方形成节约水电的常态化巡查机制，在工作中采取多种措施有效的促进能耗节约。通过实施LED灯具替换传统灯具工作，既降低灯具耗电量及发热量，也减少了荧光灯管等有害废弃物产生；LED灯具无可视频闪、远离蓝光危害，护眼效果更好。供冷季合理设置公共区域温度，供暖季根据室内外温度合理调节供暖水温，进一步节约能源。

低碳办公。减少现场会，提倡电话、视频会；采取封闭打印方式，减少人员流动、保障安全的同时节约纸张。

低碳数据中心。公司北京数据中心总使用面积约3,000平方米，建设标准采用Tier 4级标准，达到国内一流、同行业领先水平，曾获得多个国内数据中心设计和建设的最高奖项。同时，数据中心采取多种节能措施，以达成节约能耗，减少温室气体排放的目标。

(2) 绿色采购

公司供应商和承包商选择过程中积极落实环保要求，实行绿色采购理念。公司针对采购的产品及施工环境提出具体环保要求，主要体现在：

材料选用方面，选择符合国家环保标准的合格材料，提供环境检测相关报告，严格管理进场核验及验收检测手续等。

家具选用方面，选择符合国家环保标准的合格产品，尤其在板材、包布等主要材料上遵循行业内较高的环保标准。

(3) 绿色出行

公司通过加强公务车管理、为新能源汽车提供充电设备等措施，继续贯彻绿色出行理念。

公司严格按照相关规定，加强公务用车管理，明

确公务用车使用申请及审批流程、费用核算及限额规定。根据公司业务发展和战略需求，对各地公务用车进行适当调配，规范各地公务用车的运行管理模式，充分提高公务用车使用率，进一步节能减排。

公司管理部门针对车辆油耗进行月度统计，并形成季度报告，分析车辆油耗趋势，对于高出正常标准的情况及时分析原因并采取解决措施，避免资源浪费现象的发生。为达到车辆排放标准要求，公司及时淘汰老旧车辆，并保证运行车辆的尾气排放标准符合国家相关规定。通过落实公务用车管理办法，公司已明显减少使用公务用车的情况，有效降低了运营过程中产生的汽车尾气排放。

为鼓励低碳绿色出行，公司为员工使用新能源汽车提供便利，在北京总部大楼设置充电桩，可供多辆电动汽车同时充电。

(4) 绿色金融

公司致力于走在金融领域可持续发展前列，大力支持绿色金融，主动践行负责任投资，支持环境的可持续发展。根据中国证券业协会数据，2021年上半年，公司绿色公司债券（含资产证券化产品）主承销（或管理人）家数 3.97 家^注，主承销绿色公司债券（含资产证券化产品）已发行金额人民币 78.34 亿元，主承销家数及金额均排名行业第一。其中，公司助力国家能源集团、深圳地铁、天成租赁发行成功全市场首批碳中和绿色债券，作为计划管理人助力中海地产成功发行全国首单碳中

和 CMBS，助力顺丰泰森成功发行全国首单民营企业碳中和公司债券，公司以引领市场的创新能力、高效的执行效率、过硬的执行能力受到监管机构及发行人信赖和高度认可。

除绿色公司债券及资产证券化产品之外，公司在绿色金融债券、绿色债务融资工具及绿色企业债券承销方面亦卓有成效。2021 年上半年，公司助力重庆银行、长城国兴金融租赁、广东能源集团、济南轨道交通集团、知识城集团、瀚蓝环境等发行人成功发行各类型绿色债券。在产品交易方面，公司完成了市场首笔以“上海清算所碳中和债券指数”为标的的场外衍生品交易业务。

境外方面，2021 年公司已承销 ESG 国际债券共计 22 只，其中包括建设银行香港分行双年期 11.5 亿美元可持续发展挂钩债券（SLB）、小米集团 30 年期 4 亿美元绿色债券等国际标杆性债券。同时，公司已建立由国际评级顾问领衔的 ESG 顾问服务团队，为境内外企业设计国际 ESG 融资产品和方案，持续协助中国企业熟悉国际规则，助力参与国际 ESG 债务资本市场发展和建设。

2021 年 6 月 18 日，公司举办 ESG 境外债策略研讨会，会议吸引了近三百位来自中国内地、东南亚、中国香港和欧美的跨行业嘉宾参会，就境外 ESG 债券的发展历程、投资逻辑、战略机遇和挑战等主题进行讨论，获得国际 ESG 债券市场的广泛关注。

注：同一项目分期发行的，仅于发行首期计入当年度主承销家数。若一个债券发行项目由 N 家证券公司联合主承销，则每家证券公司的主承销家数均按 1/N 家计。



(五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

公司碳排放主要来自于日常运营过程中电力、汽油、柴油等相关能源消耗。报告期内，公司通过绿色办公、低碳数据中心运营、低碳出行等方式持续开展节能工作，促进可再生能源使用和可再生资源利用，以减少运营过程中的碳排放。

作为国内领先的证券公司，2021 年上半年，公司针对国家“2030 年碳达峰，2060 年碳中和”的战

略部署，持续从金融领域开展相关研究，为资本市场参与者提供研究成果，为中国金融业可持续发展、服务“碳达峰、碳中和”目标提供支持和建议。报告期内，公司共发布《碳中和系列报告之一——碳达峰全景图：新目标、新结构、新机遇》《FICC 碳中和系列》和《社会责任（ESG）主题政策》等 41 篇“碳达峰、碳中和”相关研究报告。



二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

公司以习近平总书记关于扶贫工作的重要论述为根本遵循，以高度的政治责任感积极践行国家脱贫攻坚、乡村振兴战略。通过结合自身业务与地方实际情况，聚焦机制扶贫、教育扶贫和产业扶贫，有的放矢地创新扶贫手段，形成具有公司特色的扶贫理念与实践范式，为帮扶区域持续培育内生发展新动能。十余年间，公司的扶贫举措覆盖西藏自治区申扎县、江西省会昌县、甘肃省积石山县、河北省涿源县等多个区域。

2021 年上半年，公司积极发挥金融机构专业优势，在产业金融、消费帮扶、教育帮扶、金融帮扶等方面，持续巩固结对帮扶县的帮扶成果，主要工作如下：

1. 发挥专业优势，积极通过资本市场助力企业融资。2021 年上半年，公司通过承销扶贫专项公司债券项目发行、农业产业化国家重点龙头企业在

创业板上市、资产支持专项计划发行等，助力企业融资共计人民币 16.53 亿元。

2. 继续做好江西会昌县光伏扶贫项目的后续维护工作。2021 年上半年，光伏扶贫一、二期项目合计发电量 49.41 万度，发电收益人民币 20.47 万元。

3. 积极开展消费帮扶工作，有效促进了帮扶地区的农产品销售。2021 年上半年，公司分别采购了江西会昌县、甘肃积石山县、山西隰县、西藏申扎县、云南元阳县等 8 个帮扶地区的农副产品，共计金额人民币 984.7 万元。

4. 积极开展教育帮扶工作。2021 年 5 月，中信证券（山东）向青岛证券期货业协会“助力乡村振兴项目”——山东莱西市望城街道后堤新村幼儿园建设工程，捐赠人民币 30 万元。2021 年 6 月，幼儿园建设工程顺利竣工，公司向幼儿园赠送了学习用品。

2021 年下半年，公司将持续推进乡村振兴工作，计划如下：

1. 继续开展对口帮扶的西藏申扎县后续帮扶工作。
2. 积极参与证券期货行业资本市场公益联盟的乡村振兴工作，拟出资参与基金设立，所设基金用于经济落后地区的经济建设、教育、公益等事业。
3. 继续利用金融专业优势，开展“保险+期货”

形式的金融帮扶，通过农产品价格保险锁定农户收益。

4. 继续开展与河北沽源一中的助学活动，资助贫困高中生完成学业。
5. 继续向甘肃积石山对口中学开展捐赠助学活动，改善教职工生活环境。

三、积极履行社会责任的其他工作

今年 7 月，河南发生汛情后，公司党委认真学习贯彻习近平总书记对防汛救灾工作的重要指示精神，快速、科学部署分支机构积极做好防汛救灾工作、筑牢安全防线，并捐赠人民币 1,300 万元支持河南防汛抗灾和灾后重建。此次援助河南防汛救灾工作的主要举措包括：

中信证券河南分公司快速应对汛情影响，保证各方的生命、资产安全。在保证员工安全的前提下，中信证券河南分公司克服停水停电困难，为受灾严重的客户提供及时协助与安置。同时，在服务社会民众方面，河南地区各营业部紧锣密鼓安排设置便民服务站，为附近居民提供应急充电、饮用水以及食品。

公司子公司华夏基金第一时间驰援河南受灾地区，

全力支持抗汛救灾工作。面对暴雨的严峻形势，华夏基金紧急采购了纸巾、消毒液、毛巾、饼干、矿泉水、方便面等消毒和日常生活物资。第一批物资于 7 月 22 日装点连夜送往郑州，7 月 25 日第二批物资送达新乡，7 月 26 日第三批物资送达鹤壁。

公司子公司中信期货快速反应，组织当地干部员工开展援助行动，为灾区捐款捐物。中信期货河南分公司员工在汛情发生后，主动外出采购食物帮助公司内滞留人员解决饮食、住宿等难题，为附近客户提供补给、休整场所，争当志愿者为周边受灾小区分发救援物资。7 月 24 日连夜采购物资装车，7 月 25 日清晨奔赴受灾严重的巩义地区，为灾区群众现场发放生活必需品。



第六节 重要事项



第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

(一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与股改相关的承诺	股份限售	中信集团。因中信集团已将其所持本公司全部股份转让至中信有限，此承诺由中信有限承继。	所持股份自获得上市流通权之日起 12 个月内不上市交易或转让的承诺期期满后，通过交易所挂牌交易出售的股份数量达到中信证券股份总数的 1% 的，自该事实发生之日起两个工作日内作出公告，且出售数量占公司股份总数的比例在 12 个月内不超过 5%，在 24 个月内不超过 10%。	2005 年公司实施股权分置改革时起，长期有效。	否	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	解决同业竞争	中信集团。因中信集团已将其所持本公司全部股份转让至中信有限，此承诺由中信有限承继。	保证现时不存在并且将来也不再设立新的证券公司；针对银行和信托投资公司所从事的与证券公司相同或类似的业务，由中信证券股份有限公司进行充分的信息披露；保证不利用控股股东地位，损害中信证券股份有限公司及其他股东的利益。	2002 年 12 月公司首次公开发行 A 股时起，长期有效。	否	是	不适用	不适用
与再融资相关的承诺	其他	中信有限	1. 中信有限将根据本次配股股权登记日收市后的持股数量，按照公司与保荐机构（或承销商）协商确定的配股价格和配股比例，以现金方式全额认购根据本次配股方案确定的可获得的配售股份； 2. 中信有限用于认购配售股份的资金来源合法合规，为中信有限的自有资金或自筹资金。中信有限认购本次配股项下可配售股份，不存在接受他人委托投资或股份代持的情形； 3. 中信有限承诺本次配股方案如根据中国证监会的规定和要求进行调整，将按照中国证监会最终核准的配股比例以现金方式全额认购可配股份； 4. 中信有限将在本次配股获得公司股东大会审议通过，并经中国证监会核准后实际履行上述承诺。	公司配股期间	是	是	不适用	不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与发行股份收购广州证券相关的承诺	其他	中信有限	<p>1. 保持中信证券业务的独立性 中信有限不会对中信证券的正常经营活动进行非法干预。中信有限将尽量减少中信有限及中信有限控制的其他企业与中信证券的关联交易；如有不可避免的关联交易，将依法签订协议，并将按照有关法律、法规的规定，履行必要的程序。</p> <p>2. 保持中信证券资产的独立性 中信有限将不通过中信有限自身及控制的关联企业违规占用中信证券或其控制企业的资产、资金及其他资源。</p> <p>3. 保持中信证券人员的独立性 中信有限保证中信证券的总经理、财务负责人、董事会秘书等高级管理人员不在中信有限及 / 或中信有限控制的其他企业担任除董事、监事以外的其他职务或者领取报酬。中信有限将确保及维持中信证券劳动、人事和工资及社会保障管理体系的完整性。</p> <p>4. 保持中信证券财务的独立性 中信有限将保证中信证券财务会计核算部门的独立性，建立独立的会计核算体系和财务管理制度，并设置独立的财务部负责相关业务的具体运作。中信证券开设独立的银行账户，不与中信有限及其控制的其他企业共用银行账户。中信证券的财务人员不在中信有限及其控制的其他企业兼职。中信证券依法独立纳税。中信证券将独立作出财务决策，不存在中信有限以违法、违规的方式干预中信证券的资金使用调度的情况。</p> <p>5. 保持中信证券机构的独立性 中信有限将确保中信证券与中信有限及其控制的其他企业的机构保持独立运作。中信有限保证中信证券保持健全的股份公司法人治理结构。中信证券的股东大会、董事会、监事会以及公司各职能部门等均依照法律、法规和公司章程独立行使职权，与中信有限控制的其他企业的职能部门之间不存在机构混同的情形。</p>	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
其他		越秀金控、金控有限	<p>1. 保持中信证券业务的独立性 越秀金控、金控有限不会对中信证券的正常经营活动进行非法干预。越秀金控、金控有限将尽量减少越秀金控、金控有限及其控制的其他企业与中信证券的关联交易；如有不可避免的关联交易，将依法签订协议，并将按照有关法律、法规的规定，履行必要的程序。</p> <p>2. 保持中信证券资产的独立性 越秀金控、金控有限将不通过越秀金控、金控有限自身及控制的关联企业违规占用中信证券或其控制企业的资产、资金及其他资源；亦不会要求中信证券或其控制的企业为越秀金控、金控有限及其控制的其他企业提供担保。</p> <p>3. 保持中信证券人员的独立性 越秀金控、金控有限保证中信证券的总经理、副总经理、财务负责人、董事会秘书等高级管理人员不在越秀金控、金控有限及/或控制的其他关联企业担任除董事、监事以外的其他职务或者领取报酬。越秀金控、金控有限将确保及维持中信证券劳动、人事和工资及社会保障管理体系的完整性。</p> <p>4. 保持中信证券财务的独立性 越秀金控、金控有限将保证不干预中信证券财务会计核算部门的独立性，不干预其建立独立的会计核算体系和财务管理制度，并设置独立的财务部负责相关业务的具体运作。中信证券开设独立的银行账户，不与越秀金控、金控有限及控制的其他关联企业共用银行账户。中信证券的财务人员不在越秀金控、金控有限及其控制的其他企业兼职。中信证券依法独立纳税。中信证券将独立作出财务决策，不存在越秀金控、金控有限以违法、违规的方式干预中信证券的资金使用调度的情况。</p> <p>5. 保持中信证券机构的独立性 越秀金控、金控有限将确保中信证券与越秀金控、金控有限及其控制的其他企业的机构保持独立运作。越秀金控、金控有限将督促和支持中信证券保持健全的股份公司法人治理结构。中信证券的股东大会、董事会、监事会以及公司各职能部门等均依照法律、法规和公司章程独立行使职权，与越秀金控、金控有限控制的其他关联企业的职能部门之间不存在从属关系。</p>	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
	解决关联交易	中信有限	1. 中信有限及其控制的企业将继续依照相关法律法规及《中信证券股份有限公司关联交易管理办法》的规定规范与中信证券及其下属企业的关联交易。若发生必要且不可避免的关联交易，中信有限及其控制的企业将与中信证券及其下属企业按照公平、公正、公开的原则依法签订协议，履行合法程序，保证关联交易价格的公允性。 2. 中信有限保证将依照相关法律法规及《中信证券股份有限公司章程》等内控制度的规定行使相关股东权利，承担相应义务。不利用股东地位谋取不正当利益，不利用关联交易非法转移中信证券及其下属企业的资金、利润，不利用关联交易恶意损害中信证券其他股东的合法权益。	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用
	解决关联交易	越秀金控、金控有限	1. 本次交易完成后，越秀金控、金控有限及控制的企业将尽可能减少与中信证券及其下属企业的关联交易。若发生必要且不可避免的关联交易，越秀金控、金控有限及控制的企业将与中信证券及其下属企业按照公平、公正、公开的原则依法签订协议，履行合法程序，确保关联交易价格的公允性。 2. 越秀金控、金控有限保证将依照相关法律法规及《中信证券股份有限公司章程》等内控制度的规定行使相关股东权利，承担相应义务。不利用股东地位谋取不正当利益，不利用关联交易非法转移中信证券及其下属企业的资金、利润，不利用关联交易恶意损害中信证券其他股东的合法权益。	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用
	股份限售	越秀金控、金控有限	1. 越秀金控、金控有限在本次交易中所获得的对价股份自发行结束之日（注：“对价股份发行结束之日”指：对价股份登记在越秀金控/金控有限名下之日，下同）起 48 个月内不进行转让，除非中国证监会等监管机构提出更长锁定期要求。 2. 本次交易完成后，如越秀金控、金控有限由于中信证券派息、送股、配股、资本公积金转增股本等原因增持的中信证券股份，亦应遵守上述约定。	自 2019 年公司发行股份购买资产起至限售期满。	是	是	不适用	不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
	其他	越秀金控、金控有限	为保障中信证券、广州证券的合法权益，越秀金控、金控有限在此不可撤销地承诺，不会占用中信证券、广州证券或其控制企业的资金或要求其为越秀金控、金控有限及其控制的企业提供担保，否则，应对中信证券因此遭受的任何损失及时进行补偿。	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用
	解决同业竞争	本公司	本次交易完成后，广州证券股份有限公司将成为本公司直接或间接持股的全资子公司，其现有业务与本公司及控股子公司可能存在利益冲突及同业竞争。本公司承诺将在本次交易完成后 5 年之内进行资产和业务整合，以解决母子公司可能存在的利益冲突及同业竞争问题，符合相关法律法规规定及监管要求。	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用
	其他	中信有限	1. 不越权干预中信证券经营管理活动，不侵占中信证券利益； 2. 如违反上述承诺给中信证券造成损失的，本承诺人将依法承担补偿责任。	自 2019 年公司发行股份购买资产起长期有效。	否	是	不适用	不适用

公司未有其他股东及关联 / 连方尚未履行完毕的公开承诺事项。

二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况：不适用

三、违规担保情况：不适用

四、半年报审计情况：不适用

五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况：不适用

六、破产重整相关事项：不适用

七、重大诉讼、仲裁事项

报告期内，本集团不存在《上交所上市规则》中要求披露的涉案金额超过人民币 1,000 万元并且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的重大诉讼、仲裁事项。

自报告期初至本报告披露日，本集团已披露且有新进展的诉讼、仲裁事项如下：

公司与康得集团保证合同纠纷案

因深圳前海丰实云兰资本管理有限公司（以下简称“丰实云兰”）与公司开展股票质押式回购交易时违约，康得投资集团有限公司（以下简称“康得集团”）也未能及时履行保证责任，代丰实云兰向公司偿还相关债务。2019 年 1 月 22 日，公司向北京市高级人民法院（以下简称“北京高院”）提起诉讼，要求康得集团承担连带保证责任，偿还欠付公司的资金人民币 1,418,245,278.08 元。2019 年 12 月 9 日，北京高院开庭审理本案。2020 年 4 月 30 日、5 月 6 日，北京高院作出一审判决及补正裁定，支持了公司的全部诉讼请求。2020 年 7 月 2 日，公司已向北京高院申请强制执行。后北京高院将本案指定由北京市第一中级人民法院（以下简称“北京一中院”）负责执行，案件于 2020 年 8 月 4 日受理，目前本案正在强制执行过程中。2020 年 12 月 28 日，公司向执行法院提起执行异议之诉，请求康得集团股东韩于在未实缴本息范围内承担赔偿责任，法院于 2021 年 1 月 4 日受理（相关案件信息请参见公司 2020 年年度报告），2021 年 6 月 16 日，法院作出一审判决，判定康得集团股东韩于在未实缴本金范围内承担赔偿责任。2021 年 7 月 19 日，公司收到北京一中院通知，韩于等不服一审判决，已提起上诉。

公司与何巧女、唐凯股票质押式回购交易纠纷案

因何巧女、唐凯股票质押式回购交易违约，公司于 2018 年 10 月 26 日向北京市方圆公证处提出申请签发执行证书。2018 年 11 月 22 日，北京市方圆公证处依法出具《执行证书》。2019 年 5 月 15 日，公司向北京市第三中级人民法院（以下简称“北

京三中院”）递交强制执行申请，当日完成立案。2019 年 8 月 27 日，公司与何巧女、唐凯达成执行和解。2019 年 9 月 26 日，公司已收到何巧女支付的第一笔和解款项。后因何巧女、唐凯未履行和解协议项下的全部承诺，公司向法院申请恢复执行，2020 年 7 月 3 日法院裁定受理。2020 年 12 月 11 日，公司与何巧女、唐凯再次达成执行和解（相关案件信息请参见公司 2020 年年度报告）。因何巧女、唐凯再次违反和解协议，2021 年 4 月 28 日，公司向法院申请恢复执行，目前本案正在强制执行过程中。

公司与中绒集团纠纷案

因中银绒业国际集团有限公司（以下简称“中绒集团”）违反承诺义务，公司于 2019 年 6 月 26 日向深圳市中级人民法院（以下简称“深圳中院”）提起诉讼，请求判决确认中绒集团名下持有的合伙份额及相关权益归属公司所有并过户至公司名下，如无法过户，则赔偿公司相关损失共计人民币 110,962,689.95 元。深圳中院于 2019 年 6 月 26 日立案受理。2019 年 12 月 20 日，深圳中院裁定本案移送宁夏回族自治区银川市中级人民法院管辖（以下简称“银川中院”）。2020 年 9 月 15 日，本案在银川中院开庭审理（相关案件信息请参见公司 2020 年第三季度报告）。2021 年 4 月 28 日，银川中院作出判决，判定中绒集团赔偿公司基金份额对应的市值人民币 1.042 亿元，驳回其他诉讼请求。后公司向银川中院申请强制执行，法院于 2021 年 7 月 6 日受理，目前本案正在强制执行过程中。

公司与中民投定向发行协议纠纷案

因中国民生投资股份有限公司（以下简称“中民投”）定向发行协议违约，公司代表所管理的资产管理计划向中国国际经济贸易仲裁委员会（以下简称“贸仲委”）提起仲裁，要求中民投偿还债券本金人民币 495,497,382.20 元及相应利息、违约金等。本案于 2019 年 8 月 27 日获得受理，于 2020 年 10 月 9 日开庭审理（相关案件信息请参见公司 2020 年第三季度报告）。2021 年 7 月 1 日，贸仲委作出仲裁裁决，基本支持了公司的仲裁请求，目前仲裁裁决已生效。

公司与新华联控股公司债券交易纠纷案

因新华联控股有限公司（以下简称“新华联控股”）未能按约定履行中期票据兑付义务，公司向北京三中院依法提起诉讼，请求判令新华联控股偿付债券本金人民币 2 亿元及至付清之日止的利息等。2020 年 4 月 2 日，法院正式受理本案，并于 2020 年 7 月 21 日、8 月 13 日两次开庭。2020 年 12 月 30 日，北京三中院作出一审判决，支持了公司的主要诉讼请求。后公司与新华联控股均提出上诉，案件于 2021 年 5 月 10 日二审开庭（相关案件信息请参见公司 2021 年第一季度报告）。2021 年 7 月 7 日，公司收到北京高院作出的二审判决，法院支持了公司提出的上诉请求，驳回了新华联控股提出的上诉请求。公司向北京三中院申请强制执行，法院于 2021 年 7 月 20 日受理，目前本案正在强制执行过程中。

公司、金石泽信与信业公司委托合同纠纷案

2020 年 9 月 22 日，公司收到北京三中院寄来的信业股权投资管理有限公司（以下简称“信业公司”）诉公司及间接子公司金石泽信委托合同纠纷一案的诉讼材料。信业公司要求公司和金石泽信

支付项目管理费及违约金等共计人民币 13,958 万元。北京三中院已正式受理本案，并于 2021 年 1 月 15 日、4 月 15 日开庭审理（相关案件信息请参见公司 2020 年年度报告）。北京三中院于 2021 年 5 月 17 日作出一审判决，判决公司和金石泽信共计向信业公司支付项目管理费约人民币 601 万元。公司和金石泽信已就一审判决向北京高院提起上诉。目前正在等待二审开庭通知。

金石灏沔、三峡金石基金与张勇刚、李建琼股权合同纠纷案

因张勇刚、李建琼增资合同违约，公司间接子公司金石灏沔、三峡金石（武汉）股权投资基金合伙企业（有限合伙）（以下简称“三峡金石基金”）分别向贸仲委申请仲裁，要求张勇刚、李建琼分别受让金石灏沔所持有的四川刚毅科技集团有限公司（以下简称“刚毅集团”）3.8961% 股权（截至 2019 年 3 月 4 日应支付款项共计人民币 37,684,932 元）、三峡金石基金所持有的刚毅集团 3.8961% 股权（截至 2019 年 3 月 4 日应支付款项共计人民币 37,684,932 元），并支付律师费、仲裁费等。贸仲委于 2019 年 4 月 12 日已分别受理该两起案件，并于 2019 年 10 月 10 日开庭审理。2019 年 12 月 1 日，贸仲委分别作出两案仲裁裁决，公司均胜诉。后公司向成都市中级人民法院申请强制执行，已于 2020 年 1 月 8 日及 1 月 9 日分别立案（相关案件信息请参见公司 2019 年年度报告），目前案件处于强制执行过程中。

上述案件中涉及的潜在损失已根据相关规定进行了充分计提。

以下中信证券华南案件涉及的潜在损失已在交割之前予以充分考虑，未来对本公司及中信证券华南的潜在损失风险较小。

中信证券华南与瑞丰集团股票质押回购交易纠纷案

因广州瑞丰集团股份有限公司（以下简称“瑞丰集团”）与原广州证券（于 2020 年 1 月更名为中信证券华南，下同）开展股票质押业务发生违约，2019 年 8 月 5 日，原广州证券向广州市中级人民法院（以下简称“广州中院”）申请强制执行公证文书并获得立案，执行标的为本金人民币 32,999 万元及相应的利息、违约金、债权实现费用等。因被执行人提起执行异议，2020 年 1 月 13 日，广州中院裁定驳回中信证券华南的强制执行申请。后中信证券华南向广东省高级人民法院（以下简称“广东高院”）提起复议。2020 年 4 月 30 日，广东高院作出执行裁定，撤销广州中院的执行裁定，发回广州中院重新审查执行异议。2021 年 1 月 7 日，广州中院裁定驳回被执行人的执行异议（相关案件信息请参见公司 2020 年年度报告）。目前正在强制执行过程中。

中信证券华南与安徽盛运环保、西部证券债券交易纠纷案

因安徽盛运环保（集团）股份有限公司（以下简称“安徽盛运环保”）债券交易违约，该债券的主承销商、受托管理人西部证券股份有限公司（以下简称“西部证券”）受托管理工作未能勤勉尽责，募集说明书存在虚假记载及重大遗漏，应对广州证券的损失承担连带赔偿责任。2019 年 9 月 27 日，原广州证券向安庆市中级人民法院（以下简称“安

庆中院”）递交材料，起诉安徽盛运环保与西部证券，诉讼标的为本金人民币 1 亿元及相应的利息、违约金、债权实现费用等，2019 年 10 月案件得到受理。2019 年 11 月 12 日，西部证券提出管辖权异议。2019 年 12 月 16 日，安庆中院裁定案件移送安徽省合肥市中级人民法院（以下简称“合肥中院”）管辖。2020 年 10 月 26 日，本案开庭审理（相关案件信息请参见公司 2021 年第一季度报告），2021 年 6 月 10 日，中信证券华南收到合肥中院作出的驳回起诉裁定，2021 年 6 月 17 日向安徽省高级人民法院提起上诉，目前法院尚未作出二审判决。

中信证券华南与灏轩公司、丁孔贤股票质押回购交易纠纷案

因阿拉山口市灏轩股权投资有限公司（以下简称“灏轩公司”）开展股票质押式回购交易发生违约，中信证券华南于 2020 年 7 月 31 日向广州中院起诉灏轩公司及保证人丁孔贤，起诉标的为本金人民币 1.49 亿元，以及相应的利息、违约金、债权实现费用等。广州中院于当日受理本案。2021 年 3 月 1 日，本案开庭审理（相关案件信息请参见公司 2020 年年度报告），2021 年 3 月 31 日，中信证券华南收到广州中院作出的一审判决，法院基本支持了中信证券华南的诉讼请求。2021 年 4 月 25 日中信证券华南收到灏轩公司和丁孔贤的上诉状，2021 年 6 月 21 日收到广东高院应诉通知书，目前尚待二审开庭。

八、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人涉嫌违法违规、受到处罚及整改情况

1. 报告期内，公司被监管部门采取行政监管措施情况：

2021年2月4日，深圳证监局对公司出具《深圳证监局关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》。上述监管函认定：一、私募基金托管业务内部控制不够完善，个别项目履职不谨慎。二、个别首次公开发行保荐项目执业质量不高，存在对发行人现金交易等情况关注和披露不充分、不准确，对发行人收入确认依据、补贴可回收性等情况核查不充分等问题。三、公司个别资管产品未按《证券公司定向资产管理业务实施细则》规定，根据合同约定的时间和方式向客户提供对账单，说明报告期内客户委托资产的配置情况、净值变动、交易记录等情况。以上情形违反了《证券投资基金托管业务管理办法》《私募投资基金监督管理暂行办法》《证券发行上市保荐业务管理办法》等规定。公司收到监管函件后立即组织对私

募基金托管业务、投资银行业务和资产管理业务进行深入整改，目前已整改完毕，已向深圳证监局报送了整改报告。

2. 报告期内，公司未涉嫌犯罪被依法立案调查，公司的第一大股东、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施的情形；公司或公司的第一大股东、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或受到中国证监会行政处罚，或受到其他有权机关重大行政处罚的情形；公司的第一大股东、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责的情形；公司董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责的情形。

九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

报告期内，公司及其第一大股东不存在未履行法院法律文书确定的义务、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易 / 非豁免关联交易

1. 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项：不适用

2. 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

(1) 本集团与中信集团及其下属公司、联系人发生的关联 / 连交易

经公司 2019 年第二次临时股东大会批准，公司与中信集团于 2019 年 12 月 31 日再次续签了《证券和金融产品交易及服务框架协议》，经董事会批准与中信集团于同日再次续签了《综合服务框架协议》、签署了《〈房屋租赁框架协议〉之补充协议（三）》，就前述续签之框架协议下 2020—2022 年的日常关联 / 持续性关连交易的内容进行了约定，并分别设定了年度交易金额上限。再次续签之《证券和金融产品交易及服务框架协议》及《综合服务框架协议》的期限为 2020 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日。《〈房屋租赁框架协议〉之补充协议（三）》的期限为 2020 年 1 月 1 日至 2021 年 9 月 22 日。

报告期内，公司严格按照 2020 年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2021 年日常关联 / 持续性关连交易的议案》及上述与中信集团签署 / 续签的框架 / 补充协议开展关联 / 连交易，相关执行情况如下表：

单位：万元 币种：人民币

关联 / 连方	关联 / 连交易类别	2021 年度交易金额上限	2021 年 1—6 月发生交易金额 / 单日最高余额	占同类交易额的比例 (%)	对公司利润的影响
	证券和金融产品交易净现金流入 (扣除同业拆入、正回购及收益凭证金额)	8,000,000	2,201,798	-	-
	证券和金融产品交易净现金流出 (扣除同业拆出及逆回购金额)	18,000,000	2,864,703	-	-
	金融机构间拆入及收益凭证售出金额	未设定上限 ^注	7,249,000	-	-
	正回购交易涉及的每日最高余额 (含利息)	2,000,000	197,787	-	-
	金融机构间拆出及逆回购交易涉及的每日最高余额 (含利息)	800,000	-	-	-
中信集团及其联系人	关联 / 连交易类别	2021 年度交易金额上限	2021 年 1—6 月发生交易金额	占公司营业收入 / 营业支出的比例 (%)	对公司利润的影响
	证券和金融服务收入	260,000	63,760	1.69	63,760
	证券和金融服务支出	88,000	2,868	0.13	-2,868
	综合服务收入	4,500	27	0.00	27
	综合服务支出	112,000	10,517	0.49	-10,517
	关联 / 连交易类别	2021 年 1 月 1 日至 9 月 22 日交易金额上限	2021 年 1—6 月发生交易金额	占公司营业收入 / 营业支出的比例 (%)	对公司利润的影响
	房屋租赁收入	50,000	1,612	0.04	1,612
	房屋租赁支出 / 使用权资产总值增加	80,000	8,117	-	-

注：中信集团及其联系人向本集团提供同业拆入及认购本集团发行的收益凭证，系基于其利益考虑并按正常商业条款提供；且本集团无须就该等同业拆入及收益凭证提供任何担保；同时，该等同业拆入及收益凭证属联交所上市规则第 14A.90 条下的获豁免持续关连交易，因此公司未对中信集团及其联系人向本集团提供同业拆入及认购本集团发行的收益凭证设定上限

(2) 本集团与其它关联 / 连方发生的关联 / 连交易

报告期内，公司严格按照 2020 年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2021 年日常关联 / 持续性关连交易的议案》开展关联 / 连交易，相关执行情况如下：

1) 本集团与公司董事、监事、高级管理人员担任董事、高级管理人员职务的公司（公司控股子公司除外）于报告期内发生的关联交易

单位：万元 币种：人民币

关联方	关联交易类别	2021 年预计交易金额	2021 年 1—6 月发生交易金额	占公司营业收入 / 营业支出的比例 (%)	对公司利润的影响
广州越秀产业投资基金管理股份有限公司	收入	100	47.17	不足 0.01	47.17
证通股份有限公司	支出	1,500	13.21	不足 0.01	-13.21

2) 本集团与持有公司重要下属子公司 10% 以上股权的公司于报告期内发生的关联 / 连交易

单位：万元 币种：人民币

关联 / 连方	关联 / 连交易类别	2021 年预计交易金额	2021 年 1—6 月发生交易金额	占公司营业收入 / 营业支出的比例 (%)	对公司利润的影响
POWER CORPORATION OF CANADA	收入	1,000	274.99	不足 0.01	274.99
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	收入	500	262.51	不足 0.01	262.51
	支出	500	80.81	不足 0.01	-80.81

3) 本集团与持有公司股份比例超过 5% 的公司于报告期内发生的关联交易

单位：万元 币种：人民币

关联方	关联交易类别	2021 年预计交易金额	2021 年 1—6 月发生交易金额	占公司营业收入 / 营业支出的比例 (%)	对公司利润的影响
越秀金控	收入	1,000	179.53	不足 0.01	179.53
金控有限	收入	1,500	73.58	不足 0.01	73.58

(3) 其他关联 / 连交易

中信寰球商贸与上海中信轮船有限公司签署的《光船租赁合同》

按照中信期货下属公司中信寰球商贸与上海中信轮船有限公司 [现已更名为“中信轮船(宁波)有限公司”] 签署的《光船租赁合同》，2021 年上半年发生租金收入人民币 637.17 万元。该关联 / 连交易审批情况请详见公司 2014 年年度报告。

3. 临时公告未披露的事项：不适用

(二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易：不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易：不适用

(四) 关联债权债务往来

1. 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项：不适用

2. 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项：不适用

3. 临时公告未披露的事项

单位：元 币种：人民币

关联方	关联关系	向关联方提供资金			关联方向上市公司提供资金		
		期初余额	发生额	期末余额	期初余额	发生额	期末余额
中信集团下属子公司	股东的子公司	27,118,261.79	37,191,777.27	64,310,039.06	22,789,995.53	-9,758,417.72	13,031,577.81
金控有限	参股股东	209,682.00	-209,682.00	-	2,290,319,023.41	-563,467,215.77	1,726,851,807.64
合计		27,327,943.79	36,982,095.27	64,310,039.06	2,313,109,018.94	-573,225,633.49	1,739,883,385.45
关联债权债务形成原因		主要是与上述关联方发生的应付代销基金费用、应收 / 应付押金、保证金及次级债务等					
关联债权债务对公司经营成果及财务状况的影响		无不良影响					

(五) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务：不适用

(六) 其他重大关联交易：不适用

十一、重大合同及其履行情况

1. 托管、承包、租赁事项：不适用

2. 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

单位：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	-
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	-
公司对子公司的担保情况	
报告期内对子公司担保发生额合计	329.70
报告期末对子公司担保余额合计（B）	836.33
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	836.33
担保总额占公司净资产的比例（%）	44.63
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	-
直接或间接为资产负债率超过 70% 的被担保对象提供的债务担保金额（D）	827.61
担保总额超过净资产 50% 部分的金额（E）	-
上述三项担保金额合计（C+D+E）	827.61
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	承担债券的本金、利息及其他相关费用
担保情况说明	<p>(1) 本公司的担保事项</p> <p>公司根据股东大会决议，经获授权小组审议，为间接全资附属公司 CITIC Securities Finance MTN 设立的境外中期票据计划内拟发行的每批票据项下的清偿义务提供无条件及不可撤销的连带责任保证担保，担保金额为 30 亿美元，担保范围包括境外票据本金、利息及其他或有应付款。截至报告期末，上述中期票据计划内存续的票据余额合计 25 亿美元，包括：2017 年，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行提取，发行五年期品种 5 亿美元；2018 年，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行提取，发行三年期品种 3 亿美元；2019 年，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行提取，发行规模 7 亿美元，其中三年期品种 5 亿美元，五年期品种 2 亿美元；2020 年，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行提取，发行规模 10 亿美元，其中三年期品种 5 亿美元，五年期品种 5 亿美元。</p> <p>公司根据股东大会决议，经公司经营管理层审议，为 CITIC Securities Finance MTN 设立的欧洲商业票据项目进行无条件及不可撤销的担保，担保起止期为 2018 年 5 月 4 日至 2023 年 5 月 4 日，担保金额为 30 亿美元，担保范围包括境外票据本金、利息及其他或有应付款。报告期内，CITIC Securities Finance MTN 共发行 6 期欧洲商业票据，合计发行规模 3.345 亿美元；截至报告期末，存续票据余额 5.95 亿美元。</p>

(2) 控股子公司的担保事项

报告期内，公司控股子公司中，中信证券国际存在担保事项，相关担保均是对其下属子公司提供，且为满足下属子公司业务开展而进行的，主要为：贷款担保、中期票据担保、与交易对手方签署国际衍生品框架协议（ISDA）、全球证券借贷主协议（GMSLA）涉及的交易担保等。截至 2021 年 6 月 30 日，上述担保金额约合人民币 636.42 亿元。

此外，中信证券国际和 CLSA B.V. 为多项国际衍生品框架协议（ISDA）、全球总回购协议（GMRA）、全球证券借贷主协议（GMSLA）及经纪交易商协议提供无限额担保。上述无限额担保乃依据国际银行业及资本市场常规作出，使得与中信证券国际、CLSA B.V. 及其子公司交易的银行和其他金融机构可以支持较大的市场交易量及波动之需求量，保证中信证券国际、CLSA B.V. 及其子公司的正常业务不受影响。量化这些无限额担保的最高数额并不实际，但由于中信证券国际和 CLSA B.V. 都属有限责任公司，因此该等担保之绝对最高总金额亦将分别以中信证券国际及 CLSA B.V. 各自的净资产为限。

前述直接或间接为资产负债率超过 70% 的被担保对象提供的债务担保金额人民币 827.61 亿元，全部为公司及境外子公司为满足业务开展需要对其下属子公司提供的担保金额。

3. 其他重大合同：不适用

十二、其他重大事项

(一) 分支机构变更情况

1. 本公司

报告期内，本公司新设新疆分公司，撤销平湖东湖大道证券营业部，完成 8 家分支机构同城迁址及 3 家分支机构名称变更。

具体迁址情况如下：

序号	分支机构原名称	分支机构现名称	搬迁后地址
1	南通工农路证券营业部	南通工农南路证券营业部	江苏省南通市崇川区中南世纪城 43 幢 102 室、1903-1905 室
2	湖州环城西路证券营业部	湖州劳动路证券营业部	浙江省湖州市吴兴区劳动路 84、86 号一层、新天地商场二层二 F9、F10、F14、F15、F16 号
3	云南分公司	云南分公司	云南省昆明市盘龙区东风东路 23 号昆明恒隆广场办公楼 26 层 2601-2603、2612 单元
4	深圳科技园科苑路证券营业部	深圳科技园证券营业部	广东省深圳市南山区粤海街道科技园社区科苑路 11 号金融科技大厦 1 楼 A 座大堂、2 楼 A03 单元
5	成都金阳路证券营业部	成都日月大道证券营业部	四川省成都市青羊区日月大道 1501 号 3 栋 1 层附 109 号

序号	分支机构原名称	分支机构现名称	搬迁后地址
6	嘉兴分公司	嘉兴分公司	浙江省嘉兴市经济技术开发区财富广场商办楼 D110 室 1、3、4 层, D111 室, D113 室 3、4 层
7	乐清伯乐东路证券营业部	乐清金溪路证券营业部	浙江省乐清市城南街道金溪路 99 号置信城市花苑 8 幢 101 室、201 室
8	武汉南太子湖证券营业部	武汉天地证券营业部	湖北省武汉市江岸区永清街永清片综合发展项目 A3 (企业天地 3 号) 22 层 1 号房 [中信泰富大厦 25 层 (系名义楼层) 01、02 单元写字间]

具体更名情况如下：

序号	分支机构原名称	分支机构现名称
1	苏州苏雅路证券营业部	苏州分公司
2	佛山桂澜中路证券营业部	佛山分公司
3	东莞东城路证券营业部	东莞分公司

截至报告期末，本公司拥有 36 家分公司、198 家证券营业部。

2. 中信证券（山东）

报告期内，中信证券（山东）分支机构未发生变动。截至报告期末，中信证券（山东）拥有 6 家分公司、64 家证券营业部。

3. 中信期货

报告期内，中信期货完成 4 家分公司同城迁址及 1 家分公司名称变更。

具体迁址情况如下：

序号	分公司名称	搬迁后地址
1	上海浦东分公司	中国（上海）自由贸易试验区南泉北路 429 号 28 层（实际楼层 25 层）02A 单元
2	上海世纪大道分公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1568 号 9 层 04 单元、05B 单元
3	华南分公司	广东省深圳市福田区福田街道福安社区中心三路 8 号卓越时代广场二期 1303、1304、1305B 室
4	广东分公司	广东省广州市越秀区东风东路 761 号 3601B、3602 房

具体更名情况如下：

序号	分公司原名称	分公司现名称
1	青岛分公司	山东分公司

截至报告期末，中信期货拥有 44 家分公司、4 家期货营业部。

4. 中信证券华南

报告期内，中信证券华南撤销了 5 家证券营业部——拉萨东环路证券营业部、常德柳叶大道证券营业部、无锡中山路证券营业部、乐都古城大街证券营业部、乐山春华路证券营业部，完成 2 家分支机构同城迁址。具体迁址情况如下：

序号	分支机构原名称	分支机构现名称	搬迁后地址
1	新疆分公司	新疆分公司	新疆乌鲁木齐高新区（新市区）高新街 217 号盈科广场 A 座 7 层 7015、7016 室
2	西宁文景街证券营业部	青海分公司	青海省西宁市城西区冷湖路 27 号 2 号楼 1 单元 1141 室

截至报告期末，中信证券华南拥有 3 家分公司、59 家证券营业部。

5. 中信证券国际

报告期内，中信证券国际分支机构未发生变动。截至报告期末，中信证券国际拥有 4 家分行。

6. 金通证券

报告期内，金通证券分支机构未发生变动。截至报告期末，金通证券拥有 2 家证券营业部。

(二) 已公告事项的后续进展情况

规范公司大集合产品的进展情况

根据公司第六届董事会第三十五次会议一致审议通过的《关于规范公司大集合产品的议案》，公司大集合产品的整改规范工作有序推进，目前公司已有十四只大集合产品合同变更申请获中国证监会批准，其中十一只已参考公募基金正常运作，其他大集合产品的整改规范工作正在积极有序推进。

关于收购广证领秀 100% 股权

2020 年 4 月 28 日，公司第七届董事会第五次会议审议通过了《关于收购广证领秀投资有限公司 100% 股权的议案》，同意公司以广证领秀 2020 年 1 月 31 日经审计的净资产值为交易作价向中信证券华南购买广证领秀 100% 的股权；授权中信证券投资协助公司办理上述股权收购的具体事宜。2020 年内已完成股权转让协议的签署、股权变更

登记及备案手续。2021 年 5 月，公司完成转让价款人民币 1,390,232,558.49 元的支付。

对中信证券华南减资

2020 年 11 月 20 日，公司第七届董事会第十六次会议审议通过了《关于对中信证券华南股份有限公司减资的议案》，同意对中信证券华南减资，减资金额不超过人民币 70 亿元（含 70 亿元），将根据中信证券华南业务运营情况分批实施；同意公司经营管理层在中信证券华南各项风险控制指标符合监管要求的前提下，办理涉及减资事项的备案及审批手续。中信证券华南已于 2021 年 5 月完成首批减资的变更备案手续，注册资本由人民币 100.91 亿元变更为人民币 50.91 亿元。

综合管理部设置调整

2021 年 1 月 6 日，公司第七届董事会第十七次会议一致审议通过了《关于综合管理部设置调整的议案》，同意综合管理部不再作为公司一级部门设

置，隶属于总经理办公室。前述调整已于 2021 年 1 月完成。

收购中信证券华南部分证券营业部

2021 年 2 月 19 日，公司第七届董事会第十八次会议一致审议通过了《关于收购华南公司“五省外”31 家证券营业部的议案》，同意公司收购中信证券华南在广东省（不含深圳市）、广西壮族自治区、云南省、海南省、贵州省以外区域的 31 家证券营业部。公司已于 2021 年 5 月完成 31 家证券营业部变更备案手续。

设立资管子公司

2021 年 2 月 22 日，公司第七届董事会第十九次会议审议通过了《关于设立资产管理子公司并相应变更公司经营范围的预案》。同意公司出资不超过人民币 30 亿元（含）设立全资子公司中信证券资产管理有限公司（暂定名），从事证券资产管理业务、公开募集证券投资基金管理业务以及监管机构核准的其他业务。该事项已经公司 2021 年第一次临时股东大会审议通过。资产管理子公司需经中国证监会批准后方可设立。

拟配股公开发行证券

经公司第七届董事会第二十次会议预审，经公司 2020 年度股东大会及 2021 年第一次 A 股类别股东会、2021 年第一次 H 股类别股东会审议通过了公司配股发行证券（以下简称“本次配股”）的预案等相关议案。截至目前，中国证监会已对本次配股的行政许可申请予以受理，公司在收到中国证监会出具的一次反馈意见后及时进行了回复。公司本次配股尚需获得中国证监会核准。

对中信期货增资

2021 年 4 月 28 日，公司第七届董事会第二十二次会议审议通过了《关于中信期货有限公司增资的议案》，同意对中信期货进行现金增资，增资金额人民币 20 亿元。授权公司经营管理层在公司各项风险控制指标符合监管要求的前提下，全权办理涉及增资事项的相关手续。中信期货已于 2021 年 4 月 30 日收到增资款人民币 20 亿元并于 2021 年 5 月 17 日完成注册资本的变更备案手续，注册资本由人民币 36 亿元变更为人民币 56 亿元。

修订公司《章程》

公司《章程》（2021 年第一次修订）经第七届董事会第二十一次会议预审，经 2020 年度股东大会审议通过，修订后的公司《章程》已于 2021 年 6 月 29 日起正式实施，公司已完成相关备案手续。

调整公司非执行董事、独立非执行董事及监事补助

公司 2021 年第一次临时股东大会审议通过了《关于调整公司非执行董事、独立非执行董事及监事补助的议案》，调整后的补助自股东大会审议通过当月起执行。

（三）回购、出售或购回本公司之证券

报告期内，公司及附属公司没有回购、出售或购回本公司任何证券。

第七节 股份变动及股东情况



第七节 股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1. 股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

2. 股份变动情况说明：不适用

3. 报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）：不适用

4. 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容：不适用

(二) 限售股份变动情况：不适用

二、股东情况

(一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数（户） ^{注1}	742,647
截至报告期末表决权恢复的优先股股东总数（户）	-

(二) 截至报告期末前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内增减	期末持股数量	比例 (%)	持有有限售条 件股份数量	质押、标记或冻结情况		股东性质
					股份状态	数量	
香港中央结算（代理人）有限公司 ^{注2}	-14,107	2,277,338,662	17.62	-	未知	-	境外法人
中国中信有限公司 ^{注3}	-	1,999,695,746	15.47	-	无	-	国有法人
广州越秀金融控股集团有限公司 ^{注4}	-	544,514,633	4.21	544,514,633	无	-	国有法人
香港中央结算有限公司 ^{注5}	38,575,648	346,826,847	2.68	-	无	-	境外法人
广州越秀金融控股集团股份有限公司	-	265,352,996	2.05	265,352,996	无	-	国有法人
中央汇金资产管理有限责任公司	-	198,709,100	1.54	-	无	-	国有法人
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司 交易型开放式指数证券投资基金	-24,402,774	158,862,355	1.23	-	无	-	未知
大成基金—农业银行—大成中证金融资产管理计划	-	153,726,217	1.19	-	无	-	未知
华夏基金—农业银行—华夏中证金融资产管理计划	-	144,472,197	1.12	-	无	-	未知
中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划	-	140,178,900	1.08	-	无	-	未知

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
香港中央结算（代理人）有限公司	2,277,338,662	境外上市外资股	2,277,338,662
中国中信有限公司	1,999,695,746	人民币普通股	1,999,695,746
香港中央结算有限公司	346,826,847	人民币普通股	346,826,847
中央汇金资产管理有限责任公司	198,709,100	人民币普通股	198,709,100
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司 交易型开放式指数证券投资基金	158,862,355	人民币普通股	158,862,355

大成基金—农业银行—大成中证金融资产管理计划	153,726,217	人民币普通股	153,726,217
华夏基金—农业银行—华夏中证金融资产管理计划	144,472,197	人民币普通股	144,472,197
中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划	140,178,900	人民币普通股	140,178,900
广发基金—农业银行—广发中证金融资产管理计划	140,049,999	人民币普通股	140,049,999
南方基金—农业银行—南方中证金融资产管理计划	139,589,061	人民币普通股	139,589,061
前十名股东中回购专户情况说明			-
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明			-
上述股东关联关系或一致行动的说明	广州越秀金融控股集团有限公司系广州越秀金融控股集团股份有限公司全资子公司，两者构成一致行动关系。除上述情况外，本公司未知上述其他股东之间是否存在关联关系或一致行动关系。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明			-

注 1：截至 2021 年 6 月 30 日，公司股东共 742,647 户，其中，A 股股东 742,478 户，H 股登记股东 169 户

注 2：香港中央结算（代理人）有限公司为公司 H 股非登记股东所持股份的名义持有人

注 3：截至 2021 年 6 月 30 日，中国中信有限公司的一致行动人中国中信股份有限公司持有公司 376,000,000 股 H 股，中国中信有限公司及其一致行动人合计持有公司股份 2,375,695,746 股，占比 18.38%

注 4：截至 2021 年 6 月 30 日，广州越秀金融控股集团有限公司除直接持有公司 544,514,633 股 A 股外，通过沪股通持有公司 106,494,000 股 H 股，合计持有公司股份 651,008,633 股，占比 5.04%

注 5：香港中央结算有限公司名下股票为沪股通的非登记股东所持股份

注 6：A 股股东性质为股东在中国结算上海分公司登记的账户性质

注 7：因公司股票为融资融券标的证券，股东持股数量按照其通过普通证券账户、信用证券账户持有的股票及权益数量合并计算

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	广州越秀金融控股集团有限公司	544,514,633	2024-03-11	-	股东承诺限售 48 个月
2	广州越秀金融控股集团股份有限公司	265,352,996	2024-03-11	-	股东承诺限售 48 个月
3	股权激励暂存股及其它	23,919,000	股权激励计划实施后确定	-	股权激励计划实施后确定
上述股东关联关系或一致行动的说明		广州越秀金融控股集团有限公司系广州越秀金融控股集团股份有限公司全资子公司，两者构成一致行动关系。			

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前十名股东：不适用

三、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况：不适用

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况：不适用

(三) 其他说明：不适用

四、控股股东或实际控制人变更情况：不适用

第八节 优先股相关情况：不适用

第九节 债券相关情况



第九节 债券相关情况

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

(一) 企业债券：不适用

(二) 公司债券

1. 公开发行公司债券基本情况

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
2006 年中信证券股份有限公司债券	06 中信证 券债	065001.IB	2006-05-29	2006-05-31	2021-05-31	0	4.25	每年付息一次，到期一次还本	银行间	面向机构投资者发行	报价、询价	否
中信证券股份有限公司 2013 年公司债券 (第一期) (10 年期)	13 中信 02	122260.SH	2013-06-07	2013-06-07	2023-06-07	120	5.05	每年付息一次，到期一次还本	上交所	面向机构投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2015 年公司债券 (品种二)	15 中信 02	122385.SH	2015-06-24	2015-06-25	2025-06-25	25	5.10	每年付息一次，到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2016 年公司债券 (第一期) (品种二)	16 中信 G2	136831.SH	2016-11-16	2016-11-17	2021-11-17	25	3.38	每年付息一次，到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2017 年公司债券 (第一期) (品种二)	17 中信 G2	136896.SH	2017-02-16	2017-02-17	2022-02-17	20	4.40	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2018 年公司债券 (第一期)	18 中信 G1	143512.SH	2018-03-16	2018-03-20	2021-03-20	0	5.14	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2018 年公司债券 (第二期) (品种一)	18 中证 G1	143685.SH	2018-06-13	2018-06-15	2021-06-15	0	4.80	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2018 年公司债券 (第二期) (品种二)	18 中证 G2	143686.SH	2018-06-13	2018-06-15	2023-06-15	6	4.90	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2019 年公司债券 (第一期) (品种一)	19 中证 G1	155524.SH	2019-09-06	2019-09-10	2022-09-10	20	3.39	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2019 年公司债券 (第一期) (品种二)	19 中证 G2	155525.SH	2019-09-06	2019-09-10	2024-09-10	10	3.78	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第一期) (品种一)	20 中证 G1	163156.SH	2020-02-20	2020-02-21	2023-02-21	30	3.02	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第一期) (品种二)	20 中证 G2	163157.SH	2020-02-20	2020-02-21	2025-02-21	20	3.31	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第二期) (品种一)	20 中证 G3	163244.SH	2020-03-09	2020-03-10	2023-03-10	22	2.95	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第二期) (品种二)	20 中证 G4	163245.SH	2020-03-09	2020-03-10	2025-03-10	20	3.20	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第三期) (品种一)	20 中证 G5	163339.SH	2020-04-10	2020-04-14	2021-04-16	0	1.88	到期一次还本付息	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第三期) (品种二)	20 中证 G6	163340.SH	2020-04-10	2020-04-14	2023-04-14	33	2.54	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2020 年公司债券 (第三期) (品种三)	20 中证 G7	163341.SH	2020-04-10	2020-04-14	2025-04-14	10	3.10	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第一期) (品种一)	20 中证 08	163583.SH	2020-05-29	2020-06-02	2021-06-02	0	2.08	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第一期) (品种二)	20 中证 09	163584.SH	2020-05-29	2020-06-02	2023-06-02	45	2.70	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第二期) (品种一)	20 中证 11	163629.SH	2020-06-17	2020-06-19	2023-06-19	20	3.10	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第三期) (品种一)	20 中证 13	163707.SH	2020-07-10	2020-07-14	2023-07-14	30	3.58	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第四期) (品种二)	20 中证 15	163774.SH	2020-07-24	2020-07-28	2023-07-28	75	3.49	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第四期) (品种一)	20 中证 S1	163815.SH	2020-07-24	2020-07-28	2021-04-28	0	2.84	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第五期) (品种一)	20 中证 S2	163816.SH	2020-08-05	2020-08-07	2021-08-07	28	2.95	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第五期) (品种二)	20 中证 16	163910.SH	2020-08-05	2020-08-07	2023-08-07	52	3.55	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第六期) (品种一)	20 中证 17	175037.SH	2020-08-20	2020-08-24	2021-08-29	42	2.95	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第六期) (品种二)	20 中证 18	175038.SH	2020-08-20	2020-08-24	2023-08-24	28	3.48	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第七期) (品种一)	20 中证 19	175124.SH	2020-09-09	2020-09-11	2021-09-16	22	3.23	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第七期) (品种二)	20 中证 20	175125.SH	2020-09-09	2020-09-11	2030-09-11	8	4.20	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第八期) (品种二)	20 中证 21	175250.SH	2020-10-19	2020-10-21	2022-10-21	75	3.48	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第九期) (品种一)	20 中证 22	175315.SH	2020-10-26	2020-10-28	2021-11-02	8	3.16	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第九期) (品种二)	20 中证 23	175316.SH	2020-10-26	2020-10-28	2022-10-28	43	3.45	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券 (第九期) (品种三)	20 中证 24	175317.SH	2020-10-26	2020-10-28	2030-10-28	9	4.27	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第一期) (品种一)	21 中证 01	175667.SH	2021-01-21	2021-01-25	2022-01-30	22	2.90	到期一次还本付息	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第一期) (品种二)	21 中证 02	175668.SH	2021-01-21	2021-01-25	2024-01-25	46	3.56	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第一期) (品种三)	21 中证 03	175669.SH	2021-01-21	2021-01-25	2031-01-25	32	4.10	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
中信证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年次级债券 (第一期) (品种一)	21 中证 C1	175747.SH	2021-02-04	2021-02-08	2024-02-08	30	3.97	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第二期) (品种一)	21 中证 04	175765.SH	2021-02-25	2021-03-01	2024-03-01	15	3.60	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第二期) (品种二)	21 中证 05	175766.SH	2021-02-25	2021-03-01	2031-03-01	30	4.10	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第三期)	21 中证 06	175871.SH	2021-03-17	2021-03-19	2031-03-19	25	4.10	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第四期)	21 中证 07	175972.SH	2021-04-09	2021-04-13	2031-04-13	14	4.04	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第五期) (品种一)	21 中证 08	188205.SH	2021-06-09	2021-06-11	2026-06-11	10	3.70	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
中信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券 (第五期) (品种二)	21 中证 09	188206.SH	2021-06-09	2021-06-11	2031-06-11	25	4.03	每年付息一次, 到期一次还本	上交所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

公司对债券终止上市交易风险的应对措施：不适用

逾期未偿还债券：不适用

关于逾期债项的说明：不适用

2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况：不适用

3. 信用评级结果调整情况：不适用

4. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响

公司债券的偿债资金主要来源于本公司日常经营所产生的利润及经营性现金流。2018 年、2019 年、2020 年和 2021 年上半年，公司合并财务报表营业收入分别为人民币 372.21 亿元、人民币 431.40 亿元、人民币 543.83 亿元和人民币 377.21 亿元，实现归属于母公司的净利润分别为人民币 93.90 亿元、人民币 122.29 亿元、人民币 149.02 亿元和人民币 121.98 亿元。良好的收入规模和盈利积累，是公司按期偿本付息的有力保障。

公司经营稳健，信用记录良好，各项风险监管指标均满足相关要求，外部融资渠道畅通。良好的

融资渠道为发行人债务的偿还提供较为有力的保障。

同时，为了充分、有效地维护债券持有人的利益，公司为公司债券的按时、足额偿付做出一系列安排，包括制定《债券持有人会议规则》、设立专门的偿付工作小组、制定并严格执行资金管理计划、充分发挥债券受托管理人的作用和严格履行信息披露义务等，形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施。

“06 中信证券债”由中信集团提供担保，根据中信集团重组协议，此担保由中信有限承继。截至 2021 年 5 月 31 日，该公司债券到期兑付，相关担保已履行完毕。除此以外，报告期内，债券担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施均未发生变更，对债券投资者权益没有影响。

5. 公司债券其他情况的说明：不适用

(三) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具：不适用

(四) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%：不适用

(五) 主要会计数据和财务指标

单位：元 币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减 (%)
流动比率	1.47	1.52	-3.29
速动比率	1.47	1.52	-3.29
资产负债率 (%)	79.25	78.10	增加 1.15 个百分点
	本报告期 (1—6 月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
EBITDA 利息保障倍数	3.43	3.16	8.54
利息偿付率 (%)	332.89	302.53	增加 30.36 个百分点

二、可转换公司债券情况：不适用

第十节 财务报告



中信证券股份有限公司

中期财务报表(未经审计)及审阅报告
2021年1月1日至6月30日止期间

审阅报告

普华永道中天阅字(2021)第 0035 号

中信证券股份有限公司全体股东：

我们审阅了后附的中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)的中期财务报表，包括 2021 年 6 月 30 日的合并及公司资产负债表，截至 2021 年 6 月 30 日止六个月期间的中期合并及公司利润表、合并及公司股东权益变动表和合并及公司现金流量表以及中期财务报表附注。按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制中期财务报表是中信证券管理层的责任，我们的责任是在实施审阅工作的基础上对中期财务报表出具审阅报告。

我们按照《中国注册会计师审阅准则第 2101 号—财务报表审阅》的规定执行了审阅业务。该准则要求我们计划和实施审阅工作，以对中期财务报表是否不存在重大错报获取有限保证。审阅主要限于询问公司有关人员和对财务数据实施分析程序，提供的保证程度低于审计。我们没有实施审计，因而不发表审计意见。

根据我们的审阅，我们没有注意到任何事项使我们相信上述中期财务报表没有在所有重大方面按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

姜 昆

中国·上海市
2021年8月19日

注册会计师

逯 一 斌

中信证券股份有限公司

合并资产负债表

2021年6月30日

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	附注四	本集团	
		2021年 6月30日 (未经审计)	2020年 12月31日 (经审计)
资产			
货币资金	1	266,284,494,640.72	233,693,264,600.98
其中：客户资金存款		182,752,847,196.02	158,250,995,008.88
结算备付金	2	37,739,297,424.71	56,934,000,392.55
其中：客户备付金		24,510,765,476.10	41,266,582,125.23
融出资金	3	124,786,429,551.65	116,741,431,729.57
衍生金融资产	4	20,428,111,123.29	20,157,990,448.68
买入返售金融资产	5	36,264,339,190.14	39,226,613,451.99
应收款项	6	66,919,086,798.64	39,352,598,397.78
存出保证金	7	38,510,507,446.64	3,877,774,046.76
金融投资：			
交易性金融资产	8	469,208,958,162.87	419,980,859,823.90
其他债权投资	9	58,019,065,775.32	49,400,900,096.32
其他权益工具投资	10	166,328,755.33	16,635,500,511.08
长期股权投资	12	9,425,910,287.20	8,876,581,406.90
投资性房地产	13	1,013,174,559.68	1,060,211,371.39
固定资产	14	6,872,256,703.43	7,048,297,138.27
在建工程	15	492,972,180.23	482,344,110.41
无形资产	16	2,740,798,768.15	2,855,003,356.28
商誉	17	10,757,488,374.83	10,776,698,306.15
递延所得税资产	18	10,164,863,291.26	9,661,920,246.87
使用权资产	19	1,906,497,671.38	1,765,774,476.70
其他资产	20	7,438,712,595.73	14,434,530,119.63
资产总计		<u>1,169,139,293,301.20</u>	<u>1,052,962,294,032.21</u>

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李同	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并资产负债表(续)

2021年6月30日

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

	附注四	本集团	
		2021年 6月30日 (未经审计)	2020年 12月31日 (经审计)
负债			
短期借款	22	10,594,212,662.74	5,010,371,216.16
应付短期融资款	23	9,147,965,802.12	11,941,871,221.60
拆入资金	24	12,110,934,850.37	10,504,114,828.52
交易性金融负债	25	66,261,731,125.47	58,408,743,795.91
衍生金融负债	4	34,678,892,817.38	46,876,205,555.31
卖出回购金融资产款	26	214,336,488,317.42	198,299,400,036.70
代理买卖证券款	27	245,178,494,655.96	203,110,587,613.79
代理承销证券款	28	766,719,059.89	1,071,235,143.49
应付职工薪酬	29	18,066,242,683.94	17,583,983,484.40
应交税费	30	4,892,815,008.95	7,381,981,338.20
应付款项	31	158,833,689,486.15	118,947,545,790.80
预计负债	32	302,556,926.32	305,979,812.67
长期借款	33	802,590,230.69	893,535,664.41
应付债券	34	182,516,293,619.31	171,987,819,424.94
递延所得税负债	18	2,905,109,381.17	3,176,191,664.55
合同负债	35	1,085,579,257.75	2,194,220,628.36
租赁负债	36	1,876,195,840.38	1,705,734,564.74
其他负债	37	13,203,876,392.84	7,680,036,499.54
负债合计		977,560,388,118.85	867,079,558,284.09
股东权益			
股本	39	12,926,776,029.00	12,926,776,029.00
资本公积	40	65,626,903,193.91	65,628,293,570.20
其他综合收益	41	(1,026,231,250.18)	316,814,211.81
盈余公积		9,438,480,129.79	9,438,480,129.79
一般风险准备		28,879,367,700.93	28,634,720,699.32
未分配利润		71,560,675,976.20	64,766,983,940.61
归属于母公司股东权益合计		187,405,971,779.65	181,712,068,580.73
少数股东权益	42	4,172,933,402.70	4,170,667,167.39
股东权益合计		191,578,905,182.35	185,882,735,748.12
负债和股东权益总计		1,169,139,293,301.20	1,052,962,294,032.21

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署:

张佑君	李冏	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

公司资产负债表

2021年6月30日

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	附注五	本公司	
		2021年 6月30日 (未经审计)	2020年 12月31日 (经审计)
资产			
货币资金		147,488,118,904.63	151,261,039,831.54
其中：客户资金存款		96,595,457,172.36	89,431,459,030.03
结算备付金		27,427,957,862.47	20,726,530,638.24
其中：客户备付金		21,447,617,522.11	18,710,816,936.26
融出资金		102,911,430,158.30	96,834,509,753.63
衍生金融资产		19,101,711,171.55	26,428,901,521.03
买入返售金融资产		33,848,119,556.45	34,778,736,015.77
应收款项		42,188,705,785.38	23,807,245,628.95
存出保证金		8,557,197,839.02	8,603,714,321.31
金融投资：			
交易性金融资产		314,195,941,616.31	258,978,814,422.72
其他债权投资		64,517,214,401.94	56,477,261,960.15
其他权益工具投资		-	16,440,223,235.14
长期股权投资	1	47,066,644,020.67	49,976,849,258.79
投资性房地产		87,107,198.93	89,098,092.59
固定资产		388,242,419.81	388,888,830.07
在建工程		491,433,567.80	478,902,225.31
无形资产		2,040,178,944.76	2,090,537,194.46
商誉		43,500,226.67	43,500,226.67
递延所得税资产		7,884,636,733.12	7,692,036,751.71
使用权资产		1,886,332,306.09	2,040,786,773.41
其他资产		30,224,991,467.95	21,210,121,862.86
资产总计		850,349,464,181.85	778,347,698,544.35

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李同	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

公司资产负债表(续)

2021年6月30日

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

附注五	本公司	
	2021年 6月30日 (未经审计)	2020年 12月31日 (经审计)
负债		
应付短期融资款	5,627,704,159.17	9,570,094,097.42
拆入资金	12,110,934,850.37	10,504,114,828.52
交易性金融负债	28,330,001,056.52	19,780,660,805.29
衍生金融负债	28,990,945,019.28	37,346,163,994.32
卖出回购金融资产款	184,978,752,350.96	163,112,170,331.60
代理买卖证券款	115,732,258,825.73	104,957,910,421.19
代理承销证券款	806,719,059.89	1,320,885,071.49
应付职工薪酬	10,701,095,263.38	11,221,664,212.36
应交税费	3,287,967,247.18	5,427,524,246.10
应付款项	122,485,982,072.18	92,892,670,637.64
预计负债	203,013,621.52	186,523,422.02
应付债券	169,867,381,866.70	158,486,981,965.38
递延所得税负债	1,529,549,629.60	2,091,247,507.23
租赁负债	1,845,052,173.64	1,986,209,817.66
其他负债	9,904,860,808.96	7,758,021,573.35
负债合计	696,402,218,005.08	626,642,842,931.57
股东权益		
股本	12,926,776,029.00	12,926,776,029.00
资本公积	65,799,696,719.82	65,799,696,719.82
其他综合收益	15,343,462.50	1,128,624,278.52
盈余公积	6,669,818,337.95	6,669,818,337.95
一般风险准备	25,467,250,592.60	25,401,918,612.56
未分配利润	43,068,361,034.90	39,778,021,634.93
股东权益合计	153,947,246,176.77	151,704,855,612.78
负债和股东权益总计	850,349,464,181.85	778,347,698,544.35

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李闯	史本良
公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并利润表

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	附注四	本集团	
		截至6月30日止6个月	
		2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
一、营业收入		37,720,623,459.15	26,743,555,665.56
手续费及佣金净收入	43	16,010,064,223.00	10,826,568,650.75
其中：经纪业务手续费净收入		6,741,864,066.04	5,008,405,370.28
投资银行业务手续费净收入		3,306,766,633.47	2,220,929,171.01
资产管理业务手续费净收入		5,571,844,419.11	3,290,032,689.15
利息净收入(支出以负号列示)	44	2,323,538,084.53	810,370,609.51
其中：利息收入		9,855,886,502.89	6,957,480,416.38
利息支出		(7,532,348,418.36)	(6,147,109,806.87)
投资收益(损失以负号列示)	45	10,019,827,080.76	8,130,287,114.90
其中：对联营公司和合营公司的投资收益		427,533,871.28	91,804,295.60
公允价值变动收益(损失以负号列示)	46	1,836,523,107.53	3,756,765,438.35
资产处置收益(损失以负号列示)		754,467.68	(1,359,605.28)
汇兑收益(损失以负号列示)		45,594,075.48	288,585,305.58
其他收益		137,366,437.86	96,080,488.98
其他业务收入	47	7,346,955,982.31	2,836,257,662.77
二、营业支出		21,378,047,051.48	14,866,875,586.68
税金及附加	48	210,350,142.15	185,972,583.15
业务及管理费	49	13,345,700,573.82	9,777,495,813.06
信用减值损失	50	691,677,252.79	2,034,691,254.09
其他资产减值损失		47,979,747.79	266,413,884.19
其他业务成本	51	7,082,339,334.93	2,602,302,052.19
三、营业利润		16,342,576,407.67	11,876,680,078.88
加：营业外收入		18,077,484.80	43,631,639.82
减：营业外支出		69,430,931.82	46,567,912.63
四、利润总额		16,291,222,960.65	11,873,743,806.07
减：所得税费用	52	3,696,873,257.00	2,653,479,640.43
五、净利润		12,594,349,703.65	9,220,264,165.64
(一)按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润		12,594,349,703.65	9,220,264,165.64
2. 终止经营净利润		-	-
(二)按所有权归属分类			
1. 归属于母公司股东的净利润		12,197,983,849.06	8,925,877,416.81
2. 少数股东损益		396,365,854.59	294,386,748.83

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李问	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并利润表(续)

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

		本集团	
		截至6月30日止6个月	
	附注四	2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
六、其他综合收益的税后净额		<u>(1,354,715,200.20)</u>	<u>(206,670,452.20)</u>
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额	41	(1,343,045,461.99)	(211,982,759.84)
(一)不能重分类进损益的其他综合收益		(596,690,491.92)	(393,279,169.51)
1. 权益法下不能转损益的其他综合收益		-	(2,879,067.12)
2. 其他权益工具投资公允价值变动		(599,871,399.41)	(387,985,652.37)
3. 其他		3,180,907.49	(2,414,450.02)
(二)将重分类进损益的其他综合收益		(746,354,970.07)	181,296,409.67
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		698,627.92	(810,209.25)
2. 其他债权投资公允价值变动		(382,736,723.99)	(58,715,112.21)
3. 其他债权投资信用损失准备		(155,094,088.46)	76,540,675.72
4. 外币财务报表折算差额		(229,410,873.71)	179,012,079.56
5. 其他		20,188,088.17	(14,731,024.15)
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		<u>(11,669,738.21)</u>	<u>5,312,307.64</u>
七、综合收益总额		<u>11,239,634,503.45</u>	<u>9,013,593,713.44</u>
其中: 归属于母公司股东的综合收益总额		10,854,938,387.07	8,713,894,656.97
归属于少数股东的综合收益总额		384,696,116.38	299,699,056.47
八、每股收益	53		
(一)基本每股收益(元/股)		0.94	0.70
(二)稀释每股收益(元/股)		<u>0.94</u>	<u>0.70</u>

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署:

<p>张佑君</p> <hr style="border: 0.5px solid black;"/> <p>公司负责人</p>	<p>李同</p> <hr style="border: 0.5px solid black;"/> <p>主管会计工作负责人</p>	<p>史本良</p> <hr style="border: 0.5px solid black;"/> <p>会计机构负责人</p>
<p>二〇二一年八月十九日</p>		

中信证券股份有限公司

公司利润表

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	附注五	本公司	
		截至6月30日止6个月	
		2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
一、营业收入		18,174,100,730.59	14,640,247,551.38
手续费及佣金净收入	2	9,121,166,993.68	6,051,937,374.70
其中：经纪业务手续费净收入		4,483,259,782.74	3,106,039,791.59
投资银行业务手续费净收入		2,609,097,669.61	1,799,637,977.34
资产管理业务手续费净收入		1,782,439,824.45	886,417,776.83
利息净收入(支出以负号列示)	3	1,423,976,318.83	447,272,794.87
其中：利息收入		8,101,129,120.12	5,739,713,074.09
利息支出		(6,677,152,801.29)	(5,292,440,279.22)
投资收益	4	9,254,791,415.01	8,235,055,406.80
其中：对联营公司和合营公司的投资收益 (损失以负号列示)		168,556,108.82	316,768,858.08
公允价值变动收益(损失以负号列示)	5	(1,675,178,985.51)	(303,379,611.88)
资产处置收益(损失以负号列示)		(256,865.26)	(578,863.73)
汇兑收益(损失以负号列示)		(75,382,260.58)	88,351,976.25
其他收益		77,454,424.71	77,761,322.08
其他业务收入		47,529,689.71	43,827,152.29
二、营业支出		7,235,832,144.55	6,698,510,278.43
税金及附加		115,925,645.00	110,320,732.55
业务及管理费	6	6,448,448,475.82	4,763,126,058.88
信用减值损失		669,467,130.07	1,823,072,593.34
其他业务成本		1,990,893.66	1,990,893.66
三、营业利润		10,938,268,586.04	7,941,737,272.95
加：营业外收入		7,614,743.83	12,425,899.57
减：营业外支出		2,180,472.09	18,745,419.30
四、利润总额		10,943,702,857.78	7,935,417,753.22
减：所得税费用		2,417,321,066.17	1,755,368,833.11
五、净利润		<u>8,526,381,791.61</u>	<u>6,180,048,920.11</u>
按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润		8,526,381,791.61	6,180,048,920.11
2. 终止经营净利润		-	-

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第88页至第103页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李冏	史本良
公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

二〇二一年八月十九日

中信证券股份有限公司

公司利润表(续)

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

附注五	本公司	
	截至6月30日止6个月	
	2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
六、其他综合收益的税后净额	(1,113,280,816.02)	(239,755,993.69)
(一)不能重分类进损益的其他综合收益	(574,022,426.35)	(359,203,582.76)
1. 权益法下不能转损益的其他综合收益	-	(2,879,067.12)
2. 其他权益工具投资公允价值变动	(574,022,426.35)	(356,324,515.64)
(二)将重分类进损益的其他综合收益	(539,258,389.67)	119,447,589.07
1. 权益法下可转损益的其他综合收益	698,627.92	(810,209.25)
2. 其他债权投资公允价值变动	(387,325,916.44)	50,377,417.09
3. 其他债权投资信用损失准备	(152,631,101.15)	69,880,381.23
七、综合收益总额	7,413,100,975.59	5,940,292,926.42

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第88页至第103页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李闯	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并股东权益变动表

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

	归属于母公司股东权益							少数股东权益	合计
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
一、2020年12月31日余额(经审计)	12,926,776,029.00	65,628,293,570.20	316,814,211.81	9,438,480,129.79	28,634,720,699.32	64,766,983,940.61	4,170,667,167.39	185,882,735,748.12	
二、本期增减变动金额	-	(1,390,376.29)	(1,343,045,461.99)	-	244,647,001.61	6,793,692,035.59	2,266,235.31	5,696,169,434.23	
(一)净利润	-	-	-	-	-	12,197,983,849.06	396,365,854.59	12,594,349,703.65	
(二)其他综合收益	-	-	(1,343,045,461.99)	-	-	-	(11,669,738.21)	(1,354,715,200.20)	
综合收益总额	-	-	(1,343,045,461.99)	-	-	12,197,983,849.06	384,696,116.38	11,239,634,503.45	
(三)股东投入和减少资本	-	(1,390,376.29)	-	-	-	11,065,599.74	(3,602.98)	9,671,620.47	
1.股东投入资本	-	-	-	-	-	-	(3,602.98)	(3,602.98)	
2.其他	-	(1,390,376.29)	-	-	-	11,065,599.74	-	9,675,223.45	
(四)利润分配	-	-	-	-	244,647,001.61	(5,415,357,413.21)	(382,426,278.09)	(5,553,136,689.69)	
1.提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	
2.提取一般风险准备	-	-	-	-	244,647,001.61	(244,647,001.61)	-	-	
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	(5,170,710,411.60)	(382,426,278.09)	(5,553,136,689.69)	
三、2021年6月30日余额(未经审计)	12,926,776,029.00	65,626,903,193.91	(1,026,231,250.18)	9,438,480,129.79	28,879,367,700.93	71,560,675,976.20	4,172,933,402.70	191,578,905,182.35	

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第88页至第103页的中期财务报表由下列负责人签署:

张佑君	李冏	史本良
公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并股东权益变动表(续)

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

	归属于母公司股东权益							少数股东权益	合计
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
一、2019年12月31日余额(经审计)	12,116,908,400.00	54,152,030,508.04	954,348,112.50	8,682,886,571.37	25,614,987,937.31	60,104,047,192.75	3,824,583,551.35	165,449,792,273.32	
二、本期增减变动金额	809,867,629.00	11,356,071,208.87	(211,982,759.84)	-	130,492,069.42	2,333,865,996.19	131,056,051.59	14,549,370,195.23	
(一)净利润	-	-	-	-	-	8,925,877,416.81	294,386,748.83	9,220,264,165.64	
(二)其他综合收益	-	-	(211,982,759.84)	-	-	-	5,312,307.64	(206,670,452.20)	
综合收益总额	-	-	(211,982,759.84)	-	-	8,925,877,416.81	299,699,056.47	9,013,593,713.44	
(三)股东投入和减少资本	809,867,629.00	11,356,071,208.87	-	-	-	1,868,663.30	18,851,863.44	12,186,659,364.61	
1.股东投入资本	809,867,629.00	11,357,362,100.09	-	-	-	-	(4,800,000.00)	12,162,429,729.09	
2.其他	-	(1,290,891.22)	-	-	-	1,868,663.30	23,651,863.44	24,229,635.52	
(四)利润分配	-	-	-	-	130,492,069.42	(6,593,880,083.92)	(187,494,868.32)	(6,650,882,882.82)	
1.提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-	
2.提取一般风险准备	-	-	-	-	130,492,069.42	(130,492,069.42)	-	-	
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	(6,463,388,014.50)	(187,494,868.32)	(6,650,882,882.82)	
三、2020年6月30日余额(未经审计)	12,926,776,029.00	65,508,101,716.91	742,365,352.66	8,682,886,571.37	25,745,480,006.73	62,437,913,188.94	3,955,639,602.94	179,999,162,468.55	

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署:

张佑君	李冏	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

公司股东权益变动表

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、2020年12月31日余额(经审计)	12,926,776,029.00	65,799,696,719.82	1,128,624,278.52	6,669,818,337.95	25,401,918,612.56	39,778,021,634.93	151,704,855,612.78
二、本期增减变动金额	-	-	(1,113,280,816.02)	-	65,331,980.04	3,290,339,399.97	2,242,390,563.99
(一)净利润	-	-	-	-	-	8,526,381,791.61	8,526,381,791.61
(二)其他综合收益	-	-	(1,113,280,816.02)	-	-	-	(1,113,280,816.02)
综合收益总额	-	-	(1,113,280,816.02)	-	-	8,526,381,791.61	7,413,100,975.59
(三)股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-
1.股东投入资本	-	-	-	-	-	-	-
2.其他	-	-	-	-	-	-	-
(四)利润分配	-	-	-	-	65,331,980.04	(5,236,042,391.64)	(5,170,710,411.60)
1.提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-
2.提取一般风险准备	-	-	-	-	65,331,980.04	(65,331,980.04)	-
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	(5,170,710,411.60)	(5,170,710,411.60)
三、2021年6月30日余额(未经审计)	12,926,776,029.00	65,799,696,719.82	15,343,462.50	6,669,818,337.95	25,467,250,592.60	43,068,361,034.90	153,947,246,176.77

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第88页至第103页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李问	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

公司股东权益变动表(续)

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、2019年12月31日余额(经审计)	12,116,908,400.00	54,362,218,074.34	1,107,476,099.24	6,263,770,251.95	22,862,847,082.33	36,844,385,889.87	133,557,605,797.73
二、本期增减变动金额	809,867,629.00	11,357,362,100.09	(239,755,993.69)	-	14,609,861.88	(297,948,956.27)	11,644,134,641.01
(一)净利润	-	-	-	-	-	6,180,048,920.11	6,180,048,920.11
(二)其他综合收益	-	-	(239,755,993.69)	-	-	-	(239,755,993.69)
综合收益总额	-	-	(239,755,993.69)	-	-	6,180,048,920.11	5,940,292,926.42
(三)股东投入和减少资本	809,867,629.00	11,357,362,100.09	-	-	-	-	12,167,229,729.09
1.股东投入资本	809,867,629.00	11,357,362,100.09	-	-	-	-	12,167,229,729.09
2.其他	-	-	-	-	-	-	-
(四)利润分配	-	-	-	-	14,609,861.88	(6,477,997,876.38)	(6,463,388,014.50)
1.提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-
2.提取一般风险准备	-	-	-	-	14,609,861.88	(14,609,861.88)	-
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	(6,463,388,014.50)	(6,463,388,014.50)
三、2020年6月30日余额(未经审计)	12,926,776,029.00	65,719,580,174.43	867,720,105.55	6,263,770,251.95	22,877,456,944.21	36,546,436,933.60	145,201,740,438.74

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署:

张佑君	李问	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并现金流量表

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	附注四	本集团	
		截至6月30日止6个月	
		2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
一、经营活动产生的现金流量			
代理买卖证券收到的现金净额		42,047,453,665.18	56,208,056,298.58
回购业务资金净增加额		18,813,628,743.26	33,973,051,926.96
拆入资金净增加额		1,630,147,948.37	(25,949,380,416.89)
收取利息、手续费及佣金的现金		27,983,993,850.45	20,354,272,488.76
收到其他与经营活动有关的现金	54	42,450,582,419.03	47,241,339,447.62
经营活动现金流入小计		132,925,806,626.29	131,827,339,745.03
为交易目的而持有的金融资产净增加额		39,465,746,408.08	56,816,849,242.30
融出资金净增加额		7,679,546,738.77	11,774,665,062.35
拆出资金净增加额		-	(3,503,033,333.33)
支付利息、手续费及佣金的现金		7,573,380,194.06	5,357,472,013.40
支付给职工以及为职工支付的现金		9,862,938,157.63	7,788,597,762.99
支付的各项税费		8,036,312,301.70	3,640,757,971.05
支付其他与经营活动有关的现金	55	58,077,838,898.56	19,052,910,331.18
经营活动现金流出小计		130,695,762,698.80	100,928,219,049.94
经营活动产生的现金流量净额	56	2,230,043,927.49	30,899,120,695.09
二、投资活动产生的现金流量			
收回投资收到的现金		57,282,886.92	663,592,938.67
取得子公司及其他营业单位收到的 现金净额	57	-	13,726,710,610.12
取得投资收益收到的现金		986,646,136.31	141,910,751.66
收到其他与投资活动有关的现金		29,797,920.02	1,396,663,496.14
投资活动现金流入小计		1,073,726,943.25	15,928,877,796.59
投资支付的现金		(1,401,828,253.62)	10,832,018,158.15
购建固定资产、无形资产和其他长期 资产所支付的现金		163,913,822.88	137,659,925.46
支付其他与投资活动有关的现金		-	3,213,112.52
投资活动现金流出小计		(1,237,914,430.74)	10,972,891,196.13
投资活动产生的现金流量净额		2,311,641,373.99	4,955,986,600.46

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李同	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

合并现金流量表(续)

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	本集团		
	截至6月30日止6个月		
	附注四	2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
三、筹资活动产生的现金流量			
取得借款收到的现金		16,463,325,147.14	13,676,753,226.87
发行债券收到的现金		41,355,352,210.93	123,398,904,242.06
收到其他与筹资活动有关的现金		2,003,752,551.14	609,463,390.29
筹资活动现金流入小计		<u>59,822,429,909.21</u>	<u>137,685,120,859.22</u>
偿还债务支付的现金		44,612,067,599.03	122,232,652,293.15
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		3,791,179,089.22	4,611,217,176.23
其中：子公司支付给少数股东的股利、 利润		380,080,078.28	188,885,625.62
支付其他与筹资活动有关的现金		795,930,143.46	2,254,099,543.02
筹资活动现金流出小计		<u>49,199,176,831.71</u>	<u>129,097,969,012.40</u>
筹资活动产生的现金流量净额		<u>10,623,253,077.50</u>	<u>8,587,151,846.82</u>
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		<u>(931,673,032.37)</u>	<u>319,971,648.60</u>
五、现金及现金等价物的净增加额		14,233,265,346.61	44,762,230,790.97
加：期初现金及现金等价物余额		<u>282,856,754,711.52</u>	<u>177,822,867,101.68</u>
六、期末现金及现金等价物余额	58	<u>297,090,020,058.13</u>	<u>222,585,097,892.65</u>

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第88页至第103页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李冏	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

公司现金流量表

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	附注四	本公司	
		截至6月30日止6个月	
		2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
一、经营活动产生的现金流量			
收取利息、手续费及佣金的现金		17,715,602,228.08	13,324,688,536.93
拆入资金净增加额		1,630,147,948.37	(18,596,700,747.44)
回购业务资金净增加额		22,475,101,714.20	33,313,251,685.15
代理买卖证券收到的现金净额		10,774,348,404.54	29,300,481,313.80
收到的其他与经营活动有关的现金		22,772,229,241.60	33,818,934,420.23
经营活动现金流入小计		75,367,429,536.79	91,160,655,208.67
为交易目的而持有的金融资产净增加额		35,645,400,620.56	52,423,335,439.65
融出资金净增加额		5,820,148,566.42	9,681,211,910.50
支付利息、手续费及佣金的现金		4,809,349,398.96	3,713,791,212.46
支付给职工以及为职工支付的现金		6,003,498,212.62	4,638,881,667.77
支付的各项税费		6,013,466,076.35	2,713,353,706.20
支付其他与经营活动有关的现金		22,718,271,772.59	6,919,711,119.68
经营活动现金流出小计		81,010,134,647.50	80,090,285,056.26
经营活动产生的现金流量净额	56	(5,642,705,110.71)	11,070,370,152.41
二、投资活动产生的现金流量			
收回投资收到的现金		5,079,527,040.00	37,343,481.61
取得投资收益收到的现金		1,615,493,061.47	389,695,921.95
收到其他与投资活动有关的现金		1,642,916.74	657,151.00
投资活动现金流入小计		6,696,663,018.21	427,696,554.56
投资支付的现金		(44,563,092.32)	8,503,344,570.12
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		96,522,991.23	76,686,136.23
支付其他与投资活动有关的现金		-	3,213,112.52
投资活动现金流出小计		51,959,898.91	8,583,243,818.87
投资活动产生的现金流量净额		6,644,703,119.30	(8,155,547,264.31)

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第 88 页至第 103 页的中期财务报表由下列负责人签署：

张佑君	李问	史本良
_____ 公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人

二〇二一年八月十九日

中信证券股份有限公司

公司现金流量表(续)

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

	本公司		
	截至6月30日止6个月		
	附注四	2021年 (未经审计)	2020年 (未经审计)
三、筹资活动产生的现金流量			
发行债券收到的现金		39,879,490,556.47	115,751,650,840.66
筹资活动现金流入小计		<u>39,879,490,556.47</u>	<u>115,751,650,840.66</u>
偿还债务支付的现金		32,887,400,000.00	100,962,550,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,855,148,320.40	3,563,965,760.47
支付其他与筹资活动有关的现金		321,918,962.52	2,041,096,225.27
筹资活动现金流出小计		<u>36,064,467,282.92</u>	<u>106,567,611,985.74</u>
筹资活动产生的现金流量净额		<u>3,815,023,273.55</u>	<u>9,184,038,854.92</u>
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		<u>(277,903,950.83)</u>	<u>(102,695,765.70)</u>
五、现金及现金等价物的净增加额		4,539,117,331.31	11,996,165,977.32
加：期初现金及现金等价物余额		<u>169,674,443,679.08</u>	<u>107,321,586,680.16</u>
六、期末现金及现金等价物余额		<u>174,213,561,010.39</u>	<u>119,317,752,657.48</u>

后附财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第88页至第103页的中期财务报表由下列负责人签署：

<u>张佑君</u>	<u>李阔</u>	<u>史本良</u>
公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人
二〇二一年八月十九日		

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

一、 公司基本情况

中信证券股份有限公司(以下简称“本公司”或“公司”)于 1995 年 10 月 25 日正式成立，原为有限责任公司，注册资本为人民币 300,000,000.00 元，由中国中信集团有限公司(原中国国际信托投资公司)、中信宁波信托投资公司、中信兴业信托投资公司和中信上海信托投资公司共同出资组建。

1999 年，经中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)批准(证监机构字[1999]121 号)，本公司增资改制为股份有限公司，营业执照统一社会信用代码 914403001017814402。本公司于 2003 年 1 月 6 日在上海证券交易所上市，注册地为广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司拥有 198 家批准设立并已开业的证券营业部及 36 家分公司；拥有一级全资子公司 15 家，即中信证券(山东)有限责任公司(以下简称“中信证券(山东)”)、金石投资有限公司(以下简称“金石投资”)、中信证券国际有限公司(以下简称“中信证券国际”)、中信证券投资有限公司(以下简称“中信证券投资”)、中信期货有限公司(以下简称“中信期货”)、中信证券华南股份有限公司(以下简称“中信证券华南”)、广证领秀投资有限公司、青岛中信证券培训中心、中信证券信息与量化服务(深圳)有限责任公司、金通证券有限责任公司(以下简称“金通证券”)、CITICS Global Absolute Return Fund、中信证券海外投资有限公司、中信中证投资服务有限责任公司、天津京证物业服务有限公司和天津深证物业服务有限公司；拥有主要一级控股子公司 2 家，即华夏基金管理有限公司(以下简称“华夏基金”)和新疆股权交易中心有限公司(以下简称“新疆交易中心”)。本集团纳入合并范围内的结构化主体参见附注六。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共有员工 11,380 人，其中高级管理人员共计 17 人。

截至本中期财务报表批准报出日，本公司经营范围为：证券经纪(限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域)；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，本期间变化情况参见附注六。

二、 中期财务报表的编制基础

本中期财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制。

本中期财务报表根据财政部颁布的《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》和中国证券监督管理委员会颁布的《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式》(2017 年修订)的要求列示和披露有关财务信息。本中期财务报表应与本集团经审计的 2020 年度财务报表一并阅读。

本中期财务报表以持续经营为基础编制。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

三、 遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》的要求，真实、完整地反映了本集团及本公司于 2021 年 6 月 30 日的合并及公司财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的合并及公司经营成果和现金流量。

四、 合并财务报表主要项目附注

1. 货币资金

(1) 按类别列示

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
库存现金	298,026.78	317,467.36
银行存款	259,892,402,274.67	227,747,676,572.89
其中：客户资金存款	182,752,847,196.02	158,250,995,008.88
公司存款	77,139,555,078.65	69,496,681,564.01
其他货币资金	6,391,794,339.27	5,945,270,560.73
	<hr/>	<hr/>
合计	266,284,494,640.72	233,693,264,600.98
	<hr/>	<hr/>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

1. 货币资金(续)

(2) 按币种列示

类别	2021年6月30日		
	原币	汇率	折人民币
库存现金			
人民币	106,055.15	1.00000	106,055.15
港币	144,674.65	0.83208	120,380.88
其他货币			71,590.75
小计			<u>298,026.78</u>
客户资金存款			
人民币	157,280,995,652.77	1.00000	157,280,995,652.77
美元	649,239,965.16	6.46010	4,194,155,098.93
港币	6,569,709,356.01	0.83208	5,466,523,760.95
其他货币			114,339,013.01
小计			<u>167,056,013,525.66</u>
客户信用资金存款			
人民币	15,696,833,670.36	1.00000	15,696,833,670.36
客户存款合计			<u>182,752,847,196.02</u>
公司自有资金存款			
人民币	54,562,815,886.07	1.00000	54,562,815,886.07
美元	1,446,962,041.25	6.46010	9,347,519,482.68
港币	4,315,126,422.74	0.83208	3,590,530,393.83
其他货币			5,632,537,682.77
小计			<u>73,133,403,445.35</u>
公司信用资金存款			
人民币	4,006,151,633.30	1.00000	4,006,151,633.30
公司存款合计			<u>77,139,555,078.65</u>
其他货币资金			
人民币	6,017,034,918.68	1.00000	6,017,034,918.68
美元	58,011,396.20	6.46010	374,759,420.59
小计			<u>6,391,794,339.27</u>
合计			<u>266,284,494,640.72</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

1. 货币资金(续)

(2) 按币种列示(续)

类别	2020年12月31日		
	原币	汇率	折人民币
库存现金			
人民币	140,588.91	1.00000	140,588.91
港币	108,098.13	0.84164	90,979.71
其他货币			85,898.74
小计			<u>317,467.36</u>
客户资金存款			
人民币	131,441,295,310.32	1.00000	131,441,295,310.32
美元	640,364,525.42	6.52490	4,178,314,491.91
港币	8,450,863,637.78	0.84164	7,112,584,872.10
其他货币			261,051,079.88
小计			<u>142,993,245,754.21</u>
客户信用资金存款			
人民币	15,257,749,254.67	1.00000	<u>15,257,749,254.67</u>
客户资金存款合计			<u>158,250,995,008.88</u>
公司自有资金存款			
人民币	55,666,350,256.58	1.00000	55,666,350,256.58
美元	609,300,879.97	6.52490	3,975,627,311.72
港币	4,648,363,922.82	0.84164	3,912,249,012.00
其他货币			5,870,185,577.28
小计			<u>69,424,412,157.58</u>
公司信用资金存款			
人民币	72,269,406.43	1.00000	<u>72,269,406.43</u>
公司存款合计			<u>69,496,681,564.01</u>
其他货币资金			
人民币	5,760,035,657.87	1.00000	5,760,035,657.87
美元	28,222,308.49	6.52490	184,147,740.68
港币	1,291,718.76	0.84164	1,087,162.18
小计			<u>5,945,270,560.73</u>
合计			<u>233,693,264,600.98</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

1. 货币资金(续)

(2) 按币种列示(续)

于 2021 年 6 月 30 日，本集团使用受到限制的货币资金为人民币 6,513,792,003.14 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 7,529,161,050.19 元)。

于 2021 年 6 月 30 日，本集团存放在境外的货币资金共计人民币 26,455,045,569.48 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 24,829,477,870.06 元)，主要为中信证券及其境外子公司使用。

2. 结算备付金

(1) 按类别列示

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
客户备付金	24,510,765,476.10	41,266,582,125.23
公司备付金	13,228,531,948.61	15,667,418,267.32
合计	<u>37,739,297,424.71</u>	<u>56,934,000,392.55</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

2. 结算备付金(续)

(2) 按币种列示

类别	2021年6月30日		
	原币	汇率	折人民币
客户普通备付金			
人民币	18,848,114,516.14	1.00000	18,848,114,516.14
美元	202,662,245.37	6.46010	1,309,218,371.31
港币	699,475,077.75	0.83208	582,019,222.69
其他货币			44,298,017.37
小计			<u>20,783,650,127.51</u>
客户信用备付金			
人民币	3,727,115,348.59	1.00000	3,727,115,348.59
客户备付金合计			<u>24,510,765,476.10</u>
公司自有备付金			
人民币	12,849,881,727.21	1.00000	12,849,881,727.21
美元	2,912,908.66	6.46010	18,817,681.23
港币	324,557,603.74	0.83208	270,057,890.92
其他货币			89,774,649.25
小计			<u>13,228,531,948.61</u>
公司信用备付金			
人民币	-	1.00000	-
公司备付金合计			<u>13,228,531,948.61</u>
合计			<u>37,739,297,424.71</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

2. 结算备付金(续)

(2) 按币种列示(续)

类别	2020年12月31日		
	原币	汇率	折人民币
客户普通备付金			
人民币	36,991,450,805.52	1.00000	36,991,450,805.52
美元	56,172,572.76	6.52490	366,520,420.00
港币	239,801,585.45	0.84164	201,826,606.38
其他货币			80,332,421.60
小计			<u>37,640,130,253.50</u>
客户信用备付金			
人民币	3,626,451,871.73	1.00000	<u>3,626,451,871.73</u>
客户备付金合计			<u>41,266,582,125.23</u>
公司自有备付金			
人民币	15,091,629,767.22	1.00000	15,091,629,767.22
美元	4,022,471.29	6.52490	26,246,222.92
港币	285,885,925.86	0.84164	240,613,030.64
其他货币			221,559,749.89
小计			<u>15,580,048,770.67</u>
公司信用备付金			
人民币	87,369,496.65	1.00000	<u>87,369,496.65</u>
公司备付金合计			<u>15,667,418,267.32</u>
合计			<u><u>56,934,000,392.55</u></u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

3. 融出资金

(1) 按交易对手

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
中国大陆：		
个人	79,337,384,504.05	72,009,945,228.70
机构	41,608,356,456.93	40,611,766,344.76
减：减值准备	1,915,054,262.80	1,482,853,946.50
小计	<u>119,030,686,698.18</u>	<u>111,138,857,626.96</u>
中国大陆以外地区：	5,806,751,576.42	5,653,252,955.25
减：减值准备	51,008,722.95	50,678,852.64
小计	<u>5,755,742,853.47</u>	<u>5,602,574,102.61</u>
合计	<u>124,786,429,551.65</u>	<u>116,741,431,729.57</u>

(2) 按类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
融资融券业务融出资金	120,945,740,960.98	112,621,711,573.46
孖展融资	5,806,751,576.42	5,653,252,955.25
减：减值准备	1,966,062,985.75	1,533,532,799.14
融出资金净值	<u>124,786,429,551.65</u>	<u>116,741,431,729.57</u>

(3) 按账龄分析

账龄	2021年6月30日			
	账面余额		减值准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1个月以内	73,127,739,428.69	57.69%	224,190,251.19	11.40%
1-3个月	8,074,391,768.42	6.37%	24,787,779.46	1.26%
3-6个月	18,458,671,962.71	14.56%	56,637,024.81	2.88%
6个月以上	21,337,577,630.54	16.83%	1,660,314,342.98	84.45%
无固定期限	5,754,111,747.04	4.55%	133,587.31	0.01%
合计	<u>126,752,492,537.40</u>	<u>100.00%</u>	<u>1,966,062,985.75</u>	<u>100.00%</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

3. 融出资金(续)

(3) 按账龄分析(续)

账龄	2020年12月31日			
	账面余额		减值准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1个月以内	36,744,839,843.17	31.07%	120,170,916.31	7.84%
1-3个月	20,239,221,546.45	17.11%	174,334,255.06	11.37%
3-6个月	25,158,946,237.06	21.27%	82,110,661.09	5.35%
6个月以上	30,531,916,137.00	25.81%	1,156,779,260.17	75.43%
无固定期限	5,600,040,765.03	4.74%	137,706.51	0.01%
合计	118,274,964,528.71	100.00%	1,533,532,799.14	100.00%

(4) 融资融券担保物信息

	2021年 6月30日	2020年 12月31日
资金	19,373,687,022.94	20,263,016,379.68
债券	1,407,531,859.39	709,702,748.65
股票	485,368,491,719.10	459,400,180,979.00
基金	41,465,736,616.95	31,531,139,094.28
担保物合计	547,615,447,218.38	511,904,039,201.61

于2021年6月30日，本集团融出资金业务强制平仓合约终止后客户尚未归还款项金额为人民币264,216,156.66元(2020年12月31日：人民币270,373,980.59元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

4. 衍生金融工具

项目	2021年6月30日			2020年12月31日		
	名义金额	非套期工具		名义金额	非套期工具	
		资产	公允价值 负债		资产	公允价值 负债
利率衍生工具	1,661,228,091,392.64	4,725,009,382.83	5,130,064,646.76	1,499,934,029,274.67	5,934,465,816.11	6,525,382,741.15
货币衍生工具	164,871,183,240.24	1,246,992,419.23	814,153,783.22	115,613,610,331.97	1,580,362,128.39	1,287,917,799.30
权益衍生工具	335,105,410,734.69	12,754,203,693.14	26,916,156,150.67	330,660,257,691.33	10,984,621,512.89	37,062,854,883.51
信用衍生工具	8,330,495,424.93	100,385,535.46	74,196,405.97	7,573,988,870.11	32,819,679.16	19,707,467.41
其他衍生工具	348,001,115,922.14	1,601,520,092.63	1,744,321,830.76	197,947,212,477.44	1,625,721,312.13	1,980,342,663.94
合计	<u>2,517,536,296,714.64</u>	<u>20,428,111,123.29</u>	<u>34,678,892,817.38</u>	<u>2,151,729,098,645.52</u>	<u>20,157,990,448.68</u>	<u>46,876,205,555.31</u>

在当日无负债结算制度下，本集团的期货合约每日结算，其产生的持仓损益金额已在本集团其他货币资金以及利润表中体现，而并未反映在上述衍生金融工具科目中。于2021年6月30日，本集团未到期的期货合约的公允价值为人民币-45,725,395.91元(2020年12月31日：人民币201,736,978.09元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

5. 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
股票	28,464,013,315.95	31,723,843,161.92
债券	13,099,772,382.51	15,541,709,156.48
其中：国债	863,733,801.72	347,147,690.52
金融债	330,996,911.46	1,585,999,481.95
企业债	10,893,049,786.54	13,608,561,984.01
其他	3,052,487,801.91	-
减：减值准备	8,351,934,310.23	8,038,938,866.41
合计	<u>36,264,339,190.14</u>	<u>39,226,613,451.99</u>

(2) 按业务类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
股票质押式回购	28,464,013,315.95	31,723,843,161.92
债券质押式回购	10,018,962,991.37	8,771,006,080.79
买断式回购	3,080,809,391.14	6,770,703,075.69
其他	3,052,487,801.91	-
减：减值准备	8,351,934,310.23	8,038,938,866.41
合计	<u>36,264,339,190.14</u>	<u>39,226,613,451.99</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

5. 买入返售金融资产(续)

(3) 股票质押式回购按剩余期限分类

期限	2021年 6月30日	2020年 12月31日
1个月以内	11,341,995,972.61	9,381,514,189.80
1个月以上至3个月内	2,733,724,663.62	3,553,473,196.85
3个月以上至1年以内	12,987,790,140.83	16,779,035,323.55
1年以上	1,400,502,538.89	2,009,820,451.72
合计	<u>28,464,013,315.95</u>	<u>31,723,843,161.92</u>

(4) 担保物

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
担保物	101,075,999,716.26	125,402,073,257.15
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	4,204,925,955.06	8,422,000,787.20
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	1,574,124,638.81	3,010,425,862.48

本集团买断式回购持有的担保物，在担保物所有人无任何违约的情况下可以再次用于担保。如果持有的担保物价值下跌，本集团在特定情况下可以要求增加担保物。本集团并负有在合同到期时将担保物返还至交易对手的义务。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

6. 应收款项

(1) 按明细列示

项目	2021年 6月30日		2020年 12月31日	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
应收经纪客户	31,241,408,131.72		13,835,207,062.63	
应收代理商	10,680,680,940.41		12,657,085,482.18	
应收清算款	7,400,520,067.93		7,735,319,173.69	
应收手续费及佣金	2,349,765,014.48		2,205,781,045.38	
应收贷款	130,878,898.76		40,715,330.12	
预付股权投资款	340,462,935.50		566,300,689.83	
其他	16,758,546,315.11		4,257,731,644.39	
减：减值准备(按简化模型计提)	171,650,112.97		129,807,084.52	
减值准备(按一般模型计提)	1,811,525,392.30		1,815,734,945.92	
合计	<u>66,919,086,798.64</u>		<u>39,352,598,397.78</u>	

(2) 按简化模型计提账龄分析

账龄	2021年6月30日			
	账面余额		减值准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	14,826,184,932.26	99.51%	166,696,138.12	97.11%
1-2年	40,733,707.98	0.28%	1,843,371.32	1.07%
2-3年	19,962,488.37	0.13%	1,438,446.75	0.84%
3年以上	12,362,241.35	0.08%	1,672,156.78	0.98%
合计	<u>14,899,243,369.96</u>	<u>100.00%</u>	<u>171,650,112.97</u>	<u>100.00%</u>

账龄	2020年12月31日			
	账面余额		减值准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	7,724,684,083.58	98.45%	123,720,818.19	95.31%
1-2年	74,386,656.39	0.95%	2,975,662.80	2.29%
2-3年	29,854,710.73	0.38%	1,438,446.75	1.11%
3年以上	17,161,196.64	0.22%	1,672,156.78	1.29%
合计	<u>7,846,086,647.34</u>	<u>100.00%</u>	<u>129,807,084.52</u>	<u>100.00%</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

7. 存出保证金

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
交易保证金	36,564,192,959.13	2,116,013,007.22
信用保证金	1,405,151,952.36	1,404,749,172.46
履约保证金	541,162,535.15	357,011,867.08
合计	<u>38,510,507,446.64</u>	<u>3,877,774,046.76</u>

项目	2021年6月30日		
	原币	汇率	折人民币
交易保证金			
人民币	34,819,570,587.63	1.00000	34,819,570,587.63
美元	218,754,462.25	6.46010	1,413,175,701.58
港币	340,825,117.34	0.83208	283,593,763.64
其他货币			47,852,906.28
小计			<u>36,564,192,959.13</u>
信用保证金			
人民币	1,405,151,952.36	1.00000	1,405,151,952.36
小计			<u>1,405,151,952.36</u>
履约保证金			
人民币	133,172,199.08	1.00000	133,172,199.08
美元	56,649,478.00	6.46010	365,961,292.83
其他货币			42,029,043.24
小计			<u>541,162,535.15</u>
合计			<u>38,510,507,446.64</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

7. 存出保证金(续)

项目	2020年12月31日		
	原币	汇率	折人民币
交易保证金			
人民币	1,804,678,718.14	1.00000	1,804,678,718.14
美元	7,809,230.65	6.52490	50,954,449.07
港币	248,658,881.94	0.84164	209,281,261.40
其他货币			51,098,578.61
小计			<u>2,116,013,007.22</u>
信用保证金			
人民币	1,404,749,172.46	1.00000	1,404,749,172.46
小计			<u>1,404,749,172.46</u>
履约保证金			
人民币	169,926,970.67	1.00000	169,926,970.67
美元	28,672,454.20	6.52490	187,084,896.41
小计			<u>357,011,867.08</u>
合计			<u>3,877,774,046.76</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

8. 金融投资：交易性金融资产

按类别列示

2021年6月30日

项目	公允价值			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	181,977,887,490.16	96,928,308.72	182,074,815,798.88	183,837,035,811.16	96,929,575.27	183,933,965,386.43
公募基金	23,787,193,156.43	283,135,344.52	24,070,328,500.95	23,045,135,267.14	229,218,005.64	23,274,353,272.78
股票	138,648,043,642.98	10,244,929,030.50	148,892,972,673.48	129,449,392,501.46	1,303,244,931.92	130,752,637,433.38
银行理财	1,948,735,600.50	-	1,948,735,600.50	1,939,871,224.51	-	1,939,871,224.51
券商资管	33,213,693,559.68	-	33,213,693,559.68	28,682,245,921.40	-	28,682,245,921.40
信托计划	1,781,057,827.60	-	1,781,057,827.60	2,178,889,078.63	-	2,178,889,078.63
其他	75,874,028,969.70	1,353,325,232.08	77,227,354,201.78	78,271,805,324.65	1,670,600,752.70	79,942,406,077.35
合计	457,230,640,247.05	11,978,317,915.82	469,208,958,162.87	447,404,375,128.95	3,299,993,265.53	450,704,368,394.48

于2021年6月30日，交易性金融资产中有承诺条件的金融资产，包括含在卖出回购金融资产款、转融通业务和债券借贷业务中作为担保物的金融资产，其公允价值为人民币186,331,520,868.53元(2020年12月31日：人民币136,219,389,458.95元)。

截至2021年6月30日，存在限售期限的交易性金融资产其公允价值为人民币18,032,608,063.17元，限售解禁日范围为2021年7月1日至2026年5月17日。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

8. 金融投资：交易性金融资产(续)

按类别列示(续)

2020年12月31日

项目	公允价值			初始投资成本		
	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	为交易目的而持有的金融资产	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	初始投资成本合计
债券	140,966,859,178.01	97,861,764.42	141,064,720,942.43	141,165,789,185.82	97,857,341.35	141,263,646,527.17
公募基金	22,118,281,323.85	209,034,610.13	22,327,315,933.98	21,390,327,208.72	167,941,181.11	21,558,268,389.83
股票	135,942,626,494.30	12,894,385,060.41	148,837,011,554.71	114,860,204,842.15	4,403,290,669.02	119,263,495,511.17
银行理财	1,709,651,356.61	-	1,709,651,356.61	1,667,204,481.39	-	1,667,204,481.39
券商资管	37,196,411,038.98	-	37,196,411,038.98	33,531,670,643.98	-	33,531,670,643.98
信托计划	2,344,887,300.95	-	2,344,887,300.95	2,724,287,903.18	-	2,724,287,903.18
其他	65,098,815,225.39	1,402,046,470.85	66,500,861,696.24	69,678,529,197.68	1,691,586,777.01	71,370,115,974.69
合计	<u>405,377,531,918.09</u>	<u>14,603,327,905.81</u>	<u>419,980,859,823.90</u>	<u>385,018,013,462.92</u>	<u>6,360,675,968.49</u>	<u>391,378,689,431.41</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

9. 金融投资：其他债权投资

以公允价值计量

项目	2021年6月30日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	5,540,208,810.00	69,937,629.48	15,867,338.61	5,626,013,778.09	-
金融债	2,032,346,672.80	59,910,121.10	(157,696,631.07)	1,934,560,162.83	29,667,882.39
企业债	4,731,612,600.00	170,268,219.25	(67,827,801.37)	4,834,053,017.88	126,186,052.06
同业存单	26,112,948,640.00	357,873,427.96	25,837,504.02	26,496,659,571.98	12,478,922.57
超短期融资券	3,470,000,000.00	25,285,596.88	731,061.66	3,496,016,658.54	899,377.76
其他	15,732,011,811.38	476,820,326.54	(577,069,551.92)	15,631,762,586.00	202,230,521.94
合计	57,619,128,534.18	1,160,095,321.21	(760,158,080.07)	58,019,065,775.32	371,462,756.72

于 2021 年 6 月 30 日，其他债权投资中有承诺条件的金融资产，包括含在卖出回购金融资产款、转融通业务和债券借贷业务中作为担保物的金融资产，其公允价值为人民币 37,276,534,225.71 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 39,717,926,790.30 元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

9. 金融投资：其他债权投资(续)

以公允价值计量

项目	2020年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	6,281,564,000.00	147,296,172.22	(5,756,074.96)	6,423,104,097.26	-
金融债	5,236,500,000.00	107,046,364.06	(17,231,777.74)	5,326,314,586.32	52,906,785.60
企业债	5,715,085,000.00	192,250,887.52	(36,692,548.14)	5,870,643,339.38	206,900,543.26
同业存单	12,134,046,340.00	98,125,285.55	20,550,900.68	12,252,722,526.23	11,475,001.76
超短期融资券	1,630,000,000.00	7,249,156.15	901,409.20	1,638,150,565.35	462,499.41
其他	17,560,120,780.25	570,101,411.80	(240,257,210.27)	17,889,964,981.78	305,748,213.03
合计	48,557,316,120.25	1,122,069,277.30	(278,485,301.23)	49,400,900,096.32	577,493,043.06

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

10. 金融投资：其他权益工具投资

(1) 按投资品种类别列示

	<u>2021年6月30日</u>	<u>2020年12月31日</u>
	账面价值	账面价值
证金1号	-	16,440,223,235.14
非交易性权益工具	<u>166,328,755.33</u>	<u>195,277,275.94</u>
合计	<u><u>166,328,755.33</u></u>	<u><u>16,635,500,511.08</u></u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

11. 融券业务

	2021年 6月30日	2020年 12月31日
融出证券		
交易性金融资产	4,609,696,988.08	5,419,333,272.19
转融通融入证券	35,064,975,326.78	27,421,356,343.02
合计	<u>39,674,672,314.86</u>	<u>32,840,689,615.21</u>
转融通融入证券总额	<u>48,995,567,562.50</u>	<u>36,832,894,368.00</u>

于2021年6月30日，本集团融券业务无违约情况(2020年12月31日：无)。

12. 长期股权投资

(1) 按类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
联营企业	9,333,636,600.91	8,818,598,813.84
合营企业	92,273,686.29	57,982,593.06
小计	<u>9,425,910,287.20</u>	<u>8,876,581,406.90</u>
减：减值准备	-	-
合计	<u>9,425,910,287.20</u>	<u>8,876,581,406.90</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

12. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细

2021年1月1日至6月30日止期间

被投资单位名称	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日	减值准备
权益法：					
联营企业：					
中信产业投资基金管理有限公司	1,758,697,563.90	-	55,448,775.06	1,703,248,788.84	-
中信建投证券股份有限公司	3,116,538,763.08	224,475,548.49	-	3,341,014,311.57	-
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	58,577,221.07	768,065.48	-	59,345,286.55	-
北京金石农业投资基金管理中心(有限合伙)	14,667,288.97	151,935.43	3,019,500.00	11,799,724.40	-
北京农业产业投资基金(有限合伙)	105,943,182.11	-	85,625,759.37	20,317,422.74	-
深圳市信融客户服务俱乐部有限公司	112,457.54	-	-	112,457.54	-
泰富金石(天津)基金管理有限公司	20,628,817.32	-	231,190.84	20,397,626.48	-
苏宁金石(天津)基金管理有限公司	22,616,408.32	-	1,252,744.75	21,363,663.57	-
西安明日宇航工业有限责任公司	9,571,692.49	-	-	9,571,692.49	-
中证基金管理有限公司	14,965,691.15	-	-	14,965,691.15	-
深圳前海基础设施投资基金管理有限公司	39,909,390.57	-	2,450,533.92	37,458,856.65	-
赛领国际投资基金(上海)有限公司	701,715,943.16	36,775,243.35	-	738,491,186.51	-
赛领资本管理有限公司	47,200,280.02	-	3,573,665.22	43,626,614.80	-
信保(天津)股权投资基金管理有限公司	820,140,003.49	193,791,038.36	-	1,013,931,041.85	-
西藏信昇股权投资合伙企业(有限合伙)	312,526,517.61	183,333,333.33	7,728,819.08	488,131,031.86	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

12. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

被投资单位名称	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日	减值准备
权益法:					
联营企业:					
CITIC PE Holdings Limited	408,962,787.51	-	7,319,290.08	401,643,497.43	-
Aria Investment Partners III, L.P.	(552,912.36)	2,544,845.10	-	1,991,932.74	-
Aria Investment Partners IV, L.P.	219,698,941.71	13,269,451.38	-	232,968,393.09	-
Aria Investment Partners V, L.P.	52,825,510.53	10,260,875.09	-	63,086,385.62	-
Clean Resources Asia Growth Fund L.P.	19,624,584.45	41,433.36	-	19,666,017.81	-
Fudo Capital L.P. II	3,190,559.77	-	39,008.22	3,151,551.55	-
Fudo Capital L.P. III	26,420,686.39	381,187.22	-	26,801,873.61	-
Fudo Capital L.P. IV	1,854,011.17	1,598,155.13	-	3,452,166.30	-
Sunrise Capital L.P. II	294,135,649.52	7,345,401.92	-	301,481,051.44	-
Sunrise Capital L.P. III	180,800,290.02	-	1,752,075.96	179,048,214.06	-
Sunrise Capital IV, L.P.	-	45,322,400.84	-	45,322,400.84	-
CLSA Aviation Private Equity Fund I	18,122,940.48	-	1,548,701.74	16,574,238.74	-
CLSA Aviation Private Equity Fund II	306,747.51	572,119.11	-	878,866.62	-
CLSA Aviation II Investments (Cayman) Limited	66,343,665.33	-	632,162.79	65,711,502.54	-
CT CLSA Holdings Limited	10,804,344.60	-	537,032.58	10,267,312.02	-
Pan Asia Realty Ltd	21,018,877.88	928,367.39	-	21,947,245.27	-
Holisol Logistics Private Ltd	46,740,957.17	-	1,942,098.56	44,798,858.61	-
CLSA Infrastructure Private Equity Fund I	815,021.95	1,743.83	-	816,765.78	-
CSOBOR Fund, L.P.	89,266,633.22	-	26,439,685.14	62,826,948.08	-
Alfalah Securities (Private) Limited	4,188,785.85	632,493.50	-	4,821,279.35	-
Pine Tree Special Opportunity FMC LLC	-	-	-	-	-
CLSA Real Estate Limited	-	-	-	-	-
Lending Ark Asia Secured Private Debt Fund I (Non-US), LP	310,219,510.34	-	7,614,807.93	302,604,702.41	-
Lending Ark Asia Secured Private Debt Holdings Limited	-	-	-	-	-
小计	8,818,598,813.84	722,193,638.31	207,155,851.24	9,333,636,600.91	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

12. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

被投资单位名称	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日	减值准备
权益法:					
合营企业:					
Double Nitrogen Fund GP, Limited	313.16	-	2.98	310.18	-
CSOBOR Fund GP Limited	319.68	-	3.04	316.64	-
Sino-Ocean Land Logistics Investment Management Limited	6.52	-	0.06	6.46	-
Merchant Property Limited	19,708,831.78	32,169,544.28	-	51,878,376.06	-
中信标普指数信息服务(北京)有限公司	-	-	-	-	-
Bright Lee Capital Limited	(54,624.30)	-	9,250.54	(63,874.84)	-
Kingvest Limited	38,327,420.01	-	2,151,718.34	36,175,701.67	-
Sunrise Capital Holdings IV Limited	326.21	4,282,523.91	-	4,282,850.12	-
小计	57,982,593.06	36,452,068.19	2,160,974.96	92,273,686.29	-
合计	8,876,581,406.90	758,645,706.50	209,316,826.20	9,425,910,287.20	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

12. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

2020年度

被投资单位名称	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日	减值准备
权益法：					
联营企业：					
中信产业投资基金管理有限公司	1,555,593,397.11	203,104,166.79	-	1,758,697,563.90	-
中信建投证券股份有限公司	2,618,699,234.73	587,809,106.33	89,969,577.98	3,116,538,763.08	-
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	54,410,590.82	5,366,630.25	1,200,000.00	58,577,221.07	-
北京金石农业投资基金管理中心(有限合伙)	13,689,034.69	978,254.28	-	14,667,288.97	-
北京农业产业投资基金(有限合伙)	90,876,205.17	15,066,976.94	-	105,943,182.11	-
深圳市前海中证城市发展管理有限公司	13,106,879.93	-	13,106,879.93	-	-
深圳市信融客户服务俱乐部有限公司	112,457.54	-	-	112,457.54	-
泰富金石(天津)基金管理有限公司	20,924,427.17	-	295,609.85	20,628,817.32	-
苏宁金石(天津)基金管理有限公司	25,728,382.18	-	3,111,973.86	22,616,408.32	-
西安明日宇航工业有限责任公司	14,701,350.55	-	5,129,658.06	9,571,692.49	-
中证基金管理有限公司	17,526,172.24	-	2,560,481.09	14,965,691.15	-
深圳前海基础设施投资基金管理有限公司	41,083,350.13	1,798,589.88	2,972,549.44	39,909,390.57	-
赛领国际投资基金(上海)有限公司	1,051,146,559.86	17,554,806.72	366,985,423.42	701,715,943.16	-
赛领资本管理有限公司	46,544,150.20	4,347,696.53	3,691,566.71	47,200,280.02	-
信保(天津)股权投资基金管理有限公司	918,044,174.92	19,766,416.30	117,670,587.73	820,140,003.49	-
西藏信昇股权投资合伙企业(有限合伙)	264,129,554.91	52,119,683.22	3,722,720.52	312,526,517.61	-
CITIC PE Holdings Limited	394,339,617.21	14,623,170.30	-	408,962,787.51	-
Aria Investment Partners III, L.P.	(374,995.11)	-	177,917.25	(552,912.36)	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

12. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

被投资单位名称	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日	减值准备
权益法：					
联营企业：					
Aria Investment Partners IV, L.P.	342,848,621.04	-	123,149,679.33	219,698,941.71	-
Aria Investment Partners V, L.P.	51,652,378.56	1,173,131.97	-	52,825,510.53	-
Clean Resources Asia Growth Fund L.P.	62,153,573.28	-	42,528,988.83	19,624,584.45	-
Fudo Capital L.P. II	3,490,352.30	-	299,792.53	3,190,559.77	-
Fudo Capital L.P. III	24,917,643.56	1,503,042.83	-	26,420,686.39	-
Fudo Capital L.P. IV	-	1,854,011.17	-	1,854,011.17	-
Sunrise Capital L.P. II	455,647,954.67	-	161,512,305.15	294,135,649.52	-
Sunrise Capital L.P. III	122,093,857.22	58,706,432.80	-	180,800,290.02	-
CLSA Aviation Private Equity Fund I	27,459,482.88	-	9,336,542.40	18,122,940.48	-
CLSA Aviation Private Equity Fund II	342,533.65	-	35,786.14	306,747.51	-
CLSA Aviation II Investments (Cayman) Limited	61,986,668.03	4,356,997.30	-	66,343,665.33	-
CT CLSA Holdings Limited	11,528,517.22	-	724,172.62	10,804,344.60	-
Pan Asia Realty Ltd.	4,162,511.54	16,856,366.34	-	21,018,877.88	-
Holisol Logistics Private Ltd.	60,853,240.78	-	14,112,283.61	46,740,957.17	-
CLSA Infrastructure Private Equity Fund I	874,734.87	-	59,712.92	815,021.95	-
CSOBOR Fund, L.P.	198,386,592.33	-	109,119,959.11	89,266,633.22	-
CSI Partners Limited	8,923,584.01	-	8,923,584.01	-	-
Alfalah Securities (Private) Limited	3,891,000.11	297,785.74	-	4,188,785.85	-
Pine Tree Special Opportunity FMC LLC	256,321.36	-	256,321.36	-	-
CLSA Real Estate Limited	-	-	-	-	-
Lending Ark Asia Secured Private Debt Fund I (Non-US), LP	344,203,968.30	-	33,984,457.96	310,219,510.34	-
Lending Ark Asia Secured Private Debt Holdings Limited	-	-	-	-	-
小计	8,925,954,079.96	1,007,283,265.69	1,114,638,531.81	8,818,598,813.84	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

12. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

被投资单位名称	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日	减值准备
权益法：					
合营企业：					
Double Nitrogen Fund GP, Limited	334.80	-	21.64	313.16	-
Platinum Property Management Limited	458.75	-	458.75	-	-
CSOBOR Fund GP Limited	341.77	-	22.09	319.68	-
Sino-Ocean Land Logistics Investment Management Limited	6.97	-	0.45	6.52	-
Merchant Property Limited	40,233,726.93	-	20,524,895.15	19,708,831.78	-
Bright Lee Capital Limited	-	-	54,624.30	(54,624.30)	-
Kingvest Limited	34,893,634.37	3,433,785.64	-	38,327,420.01	-
Sunrise Capital Holdings IV Limited	-	326.21	-	326.21	-
中信标普指数信息服务(北京)有限公司	-	-	-	-	-
Lending Ark Asia Secured Private Debt Holdings Limited	-	-	-	-	-
小计	75,128,503.59	3,434,111.85	20,580,022.38	57,982,593.06	-
合计	9,001,082,583.55	1,010,717,377.54	1,135,218,554.19	8,876,581,406.90	-

(3) 截至2021年6月30日本集团无向投资企业转移资金的能力受到限制的有关情况。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

13. 投资性房地产

房屋及建筑物

原值：

2020年12月31日	1,470,704,956.81
本期增加	-
本期减少	41,176,244.14
汇率变动的影响	1,457,304.65
2021年6月30日	<u>1,430,986,017.32</u>

累计折旧和摊销：

2020年12月31日	260,528,046.12
本期增加	16,887,151.09
本期减少	2,169,228.04
汇率变动的影响	68,081.43
2021年6月30日	<u>275,314,050.60</u>

减值准备：

2020年12月31日	149,965,539.30
本期增加	-
本期减少	7,996,418.38
汇率变动的影响	528,286.12
2021年6月30日	<u>142,497,407.04</u>

账面价值：

2021年6月30日	<u>1,013,174,559.68</u>
2020年12月31日	<u>1,060,211,371.39</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

13. 投资性房地产(续)

	房屋及建筑物
原值：	
2019年12月31日	1,550,288,217.32
本年增加	-
本年减少	69,966,006.35
汇率变动影响	(9,617,254.16)
2020年12月31日	<u>1,470,704,956.81</u>
累计折旧和摊销：	
2019年12月31日	225,531,616.99
本年增加	38,517,596.59
本年减少	2,768,359.22
汇率变动影响	(752,808.24)
2020年12月31日	<u>260,528,046.12</u>
减值准备：	
2019年12月31日	70,023,185.80
本年增加	102,416,496.31
本年减少	10,446,926.42
汇率变动影响	(12,027,216.39)
2020年12月31日	<u>149,965,539.30</u>
账面价值：	
2020年12月31日	<u>1,060,211,371.39</u>
2019年12月31日	<u>1,254,733,414.53</u>

于2021年6月30日，本集团投资性房地产采用成本模式计量，无按公允价值计量的投资性房地产(2020年12月31日：无)。

于2021年6月30日，本集团未办妥产权证书的投资性房地产原值为人民币0.24亿元(2020年12月31日：人民币0.24亿元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

14. 固定资产

(1) 账面价值

	2021年 6月30日	2020年 12月31日
固定资产原价	11,499,630,021.43	11,523,220,710.70
减：累计折旧	4,625,845,014.84	4,473,042,182.17
固定资产减值准备	1,528,303.16	1,881,390.26
合计	<u>6,872,256,703.43</u>	<u>7,048,297,138.27</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

14. 固定资产(续)

(2) 固定资产增减变动表

	房屋及建筑物	通讯设备	办公设备	运输设备	安全防卫设备	电子设备	其他	合计
原值:								
2020年12月31日	6,109,896,008.17	76,366,935.10	296,127,054.13	2,389,388,748.79	10,483,113.16	2,604,283,113.42	36,675,737.93	11,523,220,710.70
本期增加	1,818,826.21	466,657.98	4,316,516.23	706,008.85	185,576.15	92,760,037.67	454,049.91	100,707,673.00
本期减少	821,146.33	2,106,965.61	7,373,359.48	2,916,498.52	200,143.80	61,508,475.43	6,513,167.56	81,439,756.73
外币报表折算差额	(3,141,855.31)	(1,110,500.05)	(1,073,433.38)	(22,230,824.52)	-	(14,982,697.80)	(319,294.48)	(42,858,605.54)
2021年6月30日	<u>6,107,751,832.74</u>	<u>73,616,127.42</u>	<u>291,996,777.50</u>	<u>2,364,947,434.60</u>	<u>10,468,545.51</u>	<u>2,620,551,977.86</u>	<u>30,297,325.80</u>	<u>11,499,630,021.43</u>
累计折旧:								
2020年12月31日	1,279,286,224.28	69,016,096.20	269,243,526.46	558,652,273.34	8,199,818.58	2,253,938,599.98	34,705,643.33	4,473,042,182.17
本期增加	90,684,056.96	1,416,468.40	6,682,613.32	62,009,159.04	682,029.07	91,146,579.79	1,281,721.29	253,902,627.87
其中: 本期计提	90,684,056.96	1,416,468.40	6,682,613.32	62,009,159.04	682,029.07	91,146,579.79	1,281,721.29	253,902,627.87
本期减少	821,976.25	1,941,241.40	7,172,216.33	2,541,579.14	176,606.93	58,855,620.66	6,512,951.55	78,022,192.26
外币报表折算差额	(2,482,734.75)	(1,063,171.42)	(865,784.71)	(5,009,186.04)	-	(13,332,608.59)	(324,117.43)	(23,077,602.94)
2021年6月30日	<u>1,366,665,570.24</u>	<u>67,428,151.78</u>	<u>267,888,138.74</u>	<u>613,110,667.20</u>	<u>8,705,240.72</u>	<u>2,272,896,950.52</u>	<u>29,150,295.64</u>	<u>4,625,845,014.84</u>
固定资产减值准备:								
2020年12月31日	1,524,600.00	-	105,857.12	-	-	250,933.14	-	1,881,390.26
本期增加	-	-	-	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	105,845.14	-	-	247,060.74	-	352,905.88
外币报表折算差额	-	-	(11.98)	-	-	(169.24)	-	(181.22)
2021年6月30日	<u>1,524,600.00</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>3,703.16</u>	<u>-</u>	<u>1,528,303.16</u>
净值:								
2021年6月30日	<u>4,739,561,662.50</u>	<u>6,187,975.64</u>	<u>24,108,638.76</u>	<u>1,751,836,767.40</u>	<u>1,763,304.79</u>	<u>347,651,324.18</u>	<u>1,147,030.16</u>	<u>6,872,256,703.43</u>
2020年12月31日	<u>4,829,085,183.89</u>	<u>7,350,838.90</u>	<u>26,777,670.55</u>	<u>1,830,736,475.45</u>	<u>2,283,294.58</u>	<u>350,093,580.30</u>	<u>1,970,094.60</u>	<u>7,048,297,138.27</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

14. 固定资产(续)

(2) 固定资产增减变动表(续)

	房屋及建筑物	通讯设备	办公设备	运输设备	安全防卫设备	电子设备	其他	合计
原值:								
2019年12月31日	6,119,346,685.89	79,515,560.90	296,998,319.72	2,539,496,217.50	7,253,872.15	2,519,159,139.48	37,975,368.88	11,599,745,164.52
本年增加	10,467,190.30	2,336,368.54	17,651,953.93	5,663,520.07	6,175,009.89	294,411,236.10	33,148.67	336,738,427.50
本年减少	9,565,295.40	1,284,919.49	14,636,721.38	1,878,996.95	2,945,768.88	135,259,771.64	1,207,277.27	166,778,751.01
外币报表折算差额	(10,352,572.62)	(4,200,074.85)	(3,886,498.14)	(153,891,991.83)	-	(74,027,490.52)	(125,502.35)	(246,484,130.31)
2020年12月31日	6,109,896,008.17	76,366,935.10	296,127,054.13	2,389,388,748.79	10,483,113.16	2,604,283,113.42	36,675,737.93	11,523,220,710.70
累计折旧:								
2019年12月31日	1,110,234,332.20	69,553,375.25	264,353,149.93	457,181,175.28	4,807,143.75	2,194,245,041.14	31,571,491.43	4,131,945,708.98
本年增加	185,890,662.70	4,577,172.02	22,104,240.86	135,639,477.31	6,211,003.22	258,010,620.07	3,977,016.53	616,410,192.71
其中: 本年新增	1,270,449.59	1,549,465.54	7,187,819.31	3,631,224.55	5,116,764.38	96,647,675.94	-	115,403,399.31
本年计提	184,620,213.11	3,027,706.48	14,916,421.55	132,008,252.76	1,094,238.84	161,362,944.13	3,977,016.53	501,006,793.40
本年减少	9,679,306.31	1,244,891.89	14,372,985.80	1,884,561.04	2,818,328.39	131,649,675.70	800,239.92	162,449,989.05
外币报表折算差额	(7,159,464.31)	(3,869,559.18)	(2,840,878.53)	(32,283,818.21)	-	(66,667,385.53)	(42,624.71)	(112,863,730.47)
2020年12月31日	1,279,286,224.28	69,016,096.20	269,243,526.46	558,652,273.34	8,199,818.58	2,253,938,599.98	34,705,643.33	4,473,042,182.17
固定资产减值准备:								
2019年12月31日	-	-	106,101.84	-	-	247,659.73	-	353,761.57
本年增加	1,524,600.00	-	-	-	-	-	-	1,524,600.00
本年减少	-	-	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	(244.72)	-	-	3,273.41	-	3,028.69
2020年12月31日	1,524,600.00	-	105,857.12	-	-	250,933.14	-	1,881,390.26
净值:								
2020年12月31日	4,829,085,183.89	7,350,838.90	26,777,670.55	1,830,736,475.45	2,283,294.58	350,093,580.30	1,970,094.60	7,048,297,138.27
2019年12月31日	5,009,112,353.69	9,962,185.65	32,539,067.95	2,082,315,042.22	2,446,728.40	324,666,438.61	6,403,877.45	7,467,445,693.97

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

14. 固定资产(续)

于2021年6月30日，本集团尚有部分房屋及建筑物仍未取得有关房产证，其原值金额为人民币0.36亿元(2020年12月31日：人民币0.36亿元)。

于2021年6月30日，本集团无所有权存在限制和用于担保的固定资产(2020年12月31日：无)。

于2021年6月30日，用于经营租出的运输设备的账面价值为人民币1,748,170,906.75元，原值为人民币2,322,411,175.75元(2020年12月31日：账面价值为人民币1,826,673,687.12元，原值为人民币2,344,465,408.95元)。

15. 在建工程

项目名称	2021年6月30日		
	账面余额	减值准备	账面价值
中信金融中心	439,363,284.41	-	439,363,284.41
其他	53,608,895.82	-	53,608,895.82
合计	492,972,180.23	-	492,972,180.23

项目名称	2020年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值
中信金融中心	433,797,156.29	-	433,797,156.29
其他	48,546,954.12	-	48,546,954.12
合计	482,344,110.41	-	482,344,110.41

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

16. 无形资产

项目	交易席位费	软件购置及开发	客户关系	商标权	土地使用权	合计
原值:						
2020年12月31日	131,593,711.36	1,690,769,884.94	1,336,613,727.75	277,662,771.96	2,272,436,620.05	5,709,076,716.06
本期增加	-	24,667,190.63	4,200,310.72	-	-	28,867,501.35
本期减少	1,499,391.52	69,201,600.61	-	-	-	70,700,992.13
外币报表折算差额	(519,943.12)	(7,453,315.68)	(11,526,797.10)	(2,642,071.23)	-	(22,142,127.13)
2021年6月30日	129,574,376.72	1,638,782,159.28	1,329,287,241.37	275,020,700.73	2,272,436,620.05	5,645,101,098.15
累计摊销:						
2020年12月31日	102,198,594.26	1,406,146,729.27	983,909,984.09	-	324,918,463.93	2,817,173,771.55
本期增加	170,769.24	43,074,493.36	64,196,450.53	-	29,490,511.32	136,932,224.45
本期减少	-	34,623,072.63	-	-	-	34,623,072.63
外币报表折算差额	(269,256.58)	(6,418,598.50)	(8,708,144.22)	-	-	(15,395,999.30)
2021年6月30日	102,100,106.92	1,408,179,551.50	1,039,398,290.40	-	354,408,975.25	2,904,086,924.07
减值准备:						
2020年12月31日	1,499,562.61	35,400,025.62	-	-	-	36,899,588.23
本期增加	-	-	-	-	-	-
本期减少	1,499,391.52	34,180,297.89	-	-	-	35,679,689.41
外币报表折算差额	(171.09)	(1,004,321.80)	-	-	-	(1,004,492.89)
2021年6月30日	-	215,405.93	-	-	-	215,405.93
账面价值:						
2021年6月30日	27,474,269.80	230,387,201.85	289,888,950.97	275,020,700.73	1,918,027,644.80	2,740,798,768.15
2020年12月31日	27,895,554.49	249,223,130.05	352,703,743.66	277,662,771.96	1,947,518,156.12	2,855,003,356.28

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

16. 无形资产(续)

项目	交易席位费	软件购置及开发	客户关系	商标权	土地使用权	合计
原值:						
2019年12月31日	130,669,466.45	1,512,048,786.91	1,415,668,143.82	296,822,116.22	2,273,423,259.01	5,628,631,772.41
本年增加	4,998,810.00	336,758,737.92	4,240,718.86	-	6,199,996.88	352,198,263.66
本年减少	1,200,000.00	118,105,285.80	-	-	7,186,635.84	126,491,921.64
外币报表折算差额	(2,874,565.09)	(39,932,354.09)	(83,295,134.93)	(19,159,344.26)	-	(145,261,398.37)
2020年12月31日	131,593,711.36	1,690,769,884.94	1,336,613,727.75	277,662,771.96	2,272,436,620.05	5,709,076,716.06
累计摊销:						
2019年12月31日	100,504,845.73	1,248,931,120.07	902,062,804.72	-	266,923,918.25	2,518,422,688.77
本年增加	4,140,348.48	254,187,322.62	143,029,066.65	-	58,981,184.64	460,337,922.39
本年减少	1,200,000.00	57,808,376.82	-	-	986,638.96	59,995,015.78
外币报表折算差额	(1,246,599.95)	(39,163,336.60)	(61,181,887.28)	-	-	(101,591,823.83)
2020年12月31日	102,198,594.26	1,406,146,729.27	983,909,984.09	-	324,918,463.93	2,817,173,771.55
减值准备:						
2019年12月31日	1,503,029.26	36,077,996.59	-	-	-	37,581,025.85
本年增加	-	5,671.05	-	-	-	5,671.05
本年减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	(3,466.65)	(683,642.02)	-	-	-	(687,108.67)
2020年12月31日	1,499,562.61	35,400,025.62	-	-	-	36,899,588.23
账面价值						
2020年12月31日	27,895,554.49	249,223,130.05	352,703,743.66	277,662,771.96	1,947,518,156.12	2,855,003,356.28
2019年12月31日	28,661,591.46	227,039,670.25	513,605,339.10	296,822,116.22	2,006,499,340.76	3,072,628,057.79

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

17. 商誉

被投资单位名称	2020年12月31日	本期增加额	本期减少额	2021年6月30日	期末减值准备
华夏基金管理有限公司	7,418,586,708.87	-	-	7,418,586,708.87	-
中信证券国际有限公司	2,059,837,204.85	-	19,209,931.32	2,040,627,273.53	480,468,137.21
中信证券华南股份有限公司	967,730,660.00	-	-	967,730,660.00	-
中信期货有限公司	193,826,413.07	-	-	193,826,413.07	-
中信证券(山东)有限责任公司	88,675,272.02	-	-	88,675,272.02	-
中信证券股份有限公司	43,500,226.67	-	-	43,500,226.67	-
新疆股权交易中心有限公司	4,541,820.67	-	-	4,541,820.67	-
中信证券海外投资有限公司	-	-	-	-	458,271,144.70
合计	10,776,698,306.15	-	19,209,931.32	10,757,488,374.83	938,739,281.91

被投资单位名称	2019年12月31日	本年增加额	本年减少额	2020年12月31日	年末减值准备
华夏基金管理有限公司	7,418,586,708.87	-	-	7,418,586,708.87	-
中信证券国际有限公司	2,273,058,670.86	4,794,646.13	218,016,112.14	2,059,837,204.85	485,090,373.26
中信证券华南股份有限公司	-	967,730,660.00	-	967,730,660.00	-
中信证券海外投资有限公司	634,675.83	-	634,675.83	-	463,536,350.14
中信期货有限公司	193,826,413.07	-	-	193,826,413.07	-
中信证券(山东)有限责任公司	88,675,272.02	-	-	88,675,272.02	-
中信证券股份有限公司	43,500,226.67	-	-	43,500,226.67	-
新疆股权交易中心有限公司	4,541,820.67	-	-	4,541,820.67	-
合计	10,022,823,787.99	972,525,306.13	218,650,787.97	10,776,698,306.15	948,626,723.40

于2021年6月30日，因汇率变动引起减值准备余额变动合计人民币-9,887,441.49元(2020年12月31日：人民币-62,345,771.55元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

18. 递延所得税资产/递延所得税负债

(1) 递延所得税资产

项目	2021年6月30日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	16,396,340,114.30	4,068,171,897.19
衍生金融工具	7,717,380,175.14	1,929,345,044.06
交易性金融资产	834,753,518.43	208,407,415.47
其他债权投资	355,912,265.06	88,978,066.27
固定资产	14,500,727.75	2,742,637.39
资产减值准备	12,376,122,803.37	3,094,030,700.79
其他	3,113,639,692.94	773,187,530.09
合计	<u>40,808,649,296.99</u>	<u>10,164,863,291.26</u>

项目	2020年12月31日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	16,313,415,844.56	4,067,554,722.85
衍生金融工具	7,570,243,874.58	1,892,560,968.63
交易性金融资产	867,599,016.15	216,657,635.73
固定资产	30,245,772.51	5,238,277.04
资产减值准备	11,732,029,716.86	2,933,007,429.19
其他	2,206,253,174.47	546,901,213.43
合计	<u>38,719,787,399.13</u>	<u>9,661,920,246.87</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

18. 递延所得税资产/递延所得税负债(续)

(2) 递延所得税负债

项目	2021年6月30日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	8,136,572,873.09	1,769,999,343.42
无形资产	499,105,071.99	184,668,876.64
固定资产	171,445,057.65	36,385,621.48
衍生金融工具	3,614,213.28	903,553.32
其他	3,654,249,018.18	913,151,986.31
合计	<u>12,464,986,234.19</u>	<u>2,905,109,381.17</u>

项目	2020年12月31日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	8,012,636,204.43	1,851,000,227.76
其他债权投资	298,199,985.07	74,549,996.27
其他权益工具投资	765,363,235.14	191,340,808.79
无形资产	532,698,109.95	197,098,300.68
固定资产	197,460,307.20	42,743,066.26
其他	3,297,612,368.58	819,459,264.79
合计	<u>13,103,970,210.37</u>	<u>3,176,191,664.55</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

19. 使用权资产

	房屋及建筑物	运输设备	电子设备	其他	合计
原值:					
2020年12月31日	2,819,342,232.53	1,795,817.12	768,289.57	1,608,221.34	2,823,514,560.56
本期增加	507,604,656.74	129,253.88	-	144,309.69	507,878,220.31
本期减少	356,328,392.95	441,383.28	-	-	356,769,776.23
外币报表折算差额	(12,321,911.51)	(95,952.87)	(34,793.73)	-	(12,452,658.11)
2021年6月30日	2,958,296,584.81	1,387,734.85	733,495.84	1,752,531.03	2,962,170,346.53
累计折旧:					
2020年12月31日	1,055,726,821.86	1,059,343.64	412,435.78	541,482.58	1,057,740,083.86
本期增加	340,163,668.64	155,875.63	98,483.48	184,118.15	340,602,145.90
本期减少	337,210,431.03	407,430.72	-	-	337,617,861.75
外币报表折算差额	(4,967,840.42)	(63,758.93)	(20,093.51)	-	(5,051,692.86)
2021年6月30日	1,053,712,219.05	744,029.62	490,825.75	725,600.73	1,055,672,675.15
减值准备:					
2020年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
汇率变动的影响	-	-	-	-	-
2021年6月30日	-	-	-	-	-
账面价值:					
2021年6月30日	1,904,584,365.76	643,705.23	242,670.09	1,026,930.30	1,906,497,671.38
2020年12月31日	1,763,615,410.67	736,473.48	355,853.79	1,066,738.76	1,765,774,476.70

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

19. 使用权资产(续)

	房屋及建筑物	运输设备	电子设备	其他	合计
原值:					
2019年12月31日	2,190,369,055.67	1,762,957.50	754,848.03	1,349,021.47	2,194,235,882.67
本年增加	874,125,889.00	-	-	727,928.54	874,853,817.54
本年减少	197,342,214.73	-	-	468,728.67	197,810,943.40
外币报表折算差额	(47,810,497.41)	32,859.62	13,441.54	-	(47,764,196.25)
2020年12月31日	2,819,342,232.53	1,795,817.12	768,289.57	1,608,221.34	2,823,514,560.56
累计折旧:					
2019年12月31日	592,417,648.90	517,368.42	191,092.85	225,254.40	593,351,364.57
本年增加	615,006,462.32	493,763.73	197,306.41	459,450.83	616,156,983.29
本年减少	147,008,876.51	-	-	143,222.65	147,152,099.16
外币报表折算差额	(4,688,412.85)	48,211.49	24,036.52	-	(4,616,164.84)
2020年12月31日	1,055,726,821.86	1,059,343.64	412,435.78	541,482.58	1,057,740,083.86
减值准备:					
2019年12月31日					
本年增加	-	-	-	-	-
本年减少	-	-	-	-	-
汇率变动的影响	-	-	-	-	-
2020年12月31日	-	-	-	-	-
账面价值:					
2020年12月31日	1,763,615,410.67	736,473.48	355,853.79	1,066,738.76	1,765,774,476.70
2019年12月31日	1,597,951,406.77	1,245,589.08	563,755.18	1,123,767.07	1,600,884,518.10

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

20. 其他资产

(1) 按类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
其他应收款(2)	1,962,955,512.85	2,405,041,586.58
长期待摊费用(3)	188,495,677.46	209,283,292.42
待摊费用	98,826,393.89	64,984,437.11
应收股利	452,007.83	10,725,920.95
工程项目	1,903,724,477.00	1,888,180,777.19
大宗商品存货	2,502,997,286.90	4,784,609,137.95
应收利息	394,075,009.19	386,071,133.59
其他项目	603,109,620.31	4,874,958,746.62
减: 减值准备(2)	215,923,389.70	189,324,912.78
合计	<u>7,438,712,595.73</u>	<u>14,434,530,119.63</u>

(2) 其他应收款

I. 按明细列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
其他应收款项余额	1,962,955,512.85	2,405,041,586.58
减: 减值准备	196,731,024.92	185,905,317.91
其他应收款净值	<u>1,766,224,487.93</u>	<u>2,219,136,268.67</u>

II. 按简易模型计提账龄分析

账龄	2021年6月30日			
	账面余额		减值准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
单项计提减值准备				
单项金额重大	119,287,414.08	6.08%	103,794,110.30	52.76%
单项金额不重大	17,089,360.52	0.87%	6,777,017.44	3.44%
单项小计	<u>136,376,774.60</u>	<u>6.95%</u>	<u>110,571,127.74</u>	<u>56.20%</u>
组合计提减值准备				
1年以内	1,616,909,420.02	82.37%	24,424,050.75	12.41%
1-2年	61,311,659.01	3.12%	9,330,680.14	4.74%
2-3年	77,930,971.64	3.97%	16,652,028.58	8.47%
3年以上	70,426,687.58	3.59%	35,753,137.71	18.18%
组合小计	<u>1,826,578,738.25</u>	<u>93.05%</u>	<u>86,159,897.18</u>	<u>43.80%</u>
合计	<u>1,962,955,512.85</u>	<u>100.00%</u>	<u>196,731,024.92</u>	<u>100.00%</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

20. 其他资产(续)

(2) 其他应收款(续)

II. 按简易模型计提账龄分析(续)

账龄	2020年12月31日			
	账面余额		减值准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
单项计提减值准备				
单项金额重大	106,790,719.39	4.45%	103,073,453.15	55.44%
单项金额不重大	20,139,864.06	0.83%	7,580,928.09	4.08%
单项小计	<u>126,930,583.45</u>	<u>5.28%</u>	<u>110,654,381.24</u>	<u>59.52%</u>
组合计提减值准备				
1年以内	1,990,635,693.13	82.77%	13,648,828.42	7.34%
1-2年	107,596,126.09	4.47%	363,846.42	0.20%
2-3年	105,014,937.81	4.37%	10,840,963.66	5.83%
3年以上	74,864,246.10	3.11%	50,397,298.17	27.11%
组合小计	<u>2,278,111,003.13</u>	<u>94.72%</u>	<u>75,250,936.67</u>	<u>40.48%</u>
合计	<u>2,405,041,586.58</u>	<u>100.00%</u>	<u>185,905,317.91</u>	<u>100.00%</u>

(i) 于2021年6月30日及2020年12月31日，其他应收款中无持本公司5%(含)以上股份的股东单位欠款。

(ii) 应收关联方款项参见“十、关联方关系及其重大交易”。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

20. 其他资产(续)

(3) 长期待摊费用

项目	2020年12月31日	本期增加	本期摊销	其他变动	2021年6月30日
使用权资产改良	177,886,356.48	23,434,863.38	40,231,007.27	(1,127,446.48)	159,962,766.11
网络工程	14,217,025.45	1,205,436.99	1,594,775.63	-	13,827,686.81
其他	17,179,910.49	1,407,906.31	3,878,363.81	(4,228.45)	14,705,224.54
合计	<u>209,283,292.42</u>	<u>26,048,206.68</u>	<u>45,704,146.71</u>	<u>(1,131,674.93)</u>	<u>188,495,677.46</u>
项目	2019年12月31日	本年增加	本年摊销	其他变动	2020年12月31日
使用权资产改良	183,311,041.94	91,715,383.46	91,428,091.73	(5,711,977.19)	177,886,356.48
网络工程	14,417,181.39	2,882,056.09	3,082,212.03	-	14,217,025.45
其他	23,104,660.35	6,875,846.45	7,140,694.21	(5,659,902.10)	17,179,910.49
合计	<u>220,832,883.68</u>	<u>101,473,286.00</u>	<u>101,650,997.97</u>	<u>(11,371,879.29)</u>	<u>209,283,292.42</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

21. 资产减值及损失准备

项目	2020年12月31日	本期增加		本期减少			2021年6月30日
		本期计提	其他增加	转回	转销	其他减少	
买入返售金融资产减值准备	8,038,938,866.41	490,313,695.93	-	177,318,252.11	-	-	8,351,934,310.23
应收款项和其他应收款减值准备	2,131,447,348.35	71,966,833.14	-	10,641,431.72	92,286.00	12,773,933.58	2,179,906,530.19
融出资金减值准备	1,533,532,799.14	474,529,767.40	-	42,329,451.10	-	(329,870.31)	1,966,062,985.75
其他债权投资信用损失准备	577,493,043.06	19,981.34	-	134,573,870.72	71,419,724.24	56,672.72	371,462,756.72
其他	2,878,470.19	-	2,512,857.62	-	-	66,428.34	5,324,899.47
金融工具及其他项目信用减值准备小计	12,284,290,527.15	1,036,830,277.81	2,512,857.62	364,863,005.65	71,512,010.24	12,567,164.33	12,874,691,482.36
投资性房地产减值准备	149,965,539.30	-	-	-	7,996,418.38	(528,286.12)	142,497,407.04
商誉减值准备	948,626,723.40	-	-	-	-	9,887,441.49	938,739,281.91
固定资产减值准备	1,881,390.26	-	-	-	352,905.88	181.22	1,528,303.16
无形资产减值准备	36,899,588.23	-	-	-	35,679,689.41	1,004,492.89	215,405.93
存货跌价准备	3,419,594.87	48,064,859.66	-	-	32,292,089.75	-	19,192,364.78
其他资产减值准备小计	1,140,792,836.06	48,064,859.66	-	-	76,321,103.42	10,363,829.48	1,102,172,762.82
合计	13,425,083,363.21	1,084,895,137.47	2,512,857.62	364,863,005.65	147,833,113.66	22,930,993.81	13,976,864,245.18

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

21. 资产减值及损失准备(续)

项目	2019年12月31日	本年增加		本年减少			2020年12月31日
		计提	其他增加	转回	转销	其他减少	
买入返售金融资产减值准备	3,045,908,691.57	5,318,441,930.48	857,372,810.47	439,169,588.49	553,391,936.06	190,223,041.56	8,038,938,866.41
应收款项和其他应收款减值准备	1,771,514,380.03	455,032,401.80	278,707,787.46	120,691,819.97	81,284,060.08	171,831,340.89	2,131,447,348.35
融出资金减值准备	772,485,264.41	777,226,560.14	54,297,435.18	66,357,260.05	-	4,119,200.54	1,533,532,799.14
其他债权投资信用损失准备	262,919,870.35	581,750,792.71	-	26,526,999.05	240,299,246.70	351,374.25	577,493,043.06
其他	381,648.86	2,688,047.46	-	187,039.68	-	4,186.45	2,878,470.19
金融工具及其他项目信用减值准备小计	<u>5,853,209,855.22</u>	<u>7,135,139,732.59</u>	<u>1,190,378,033.11</u>	<u>652,932,707.24</u>	<u>874,975,242.84</u>	<u>366,529,143.69</u>	<u>12,284,290,527.15</u>
投资性房地产减值准备	70,023,185.80	102,416,496.31	-	10,446,926.42	-	12,027,216.39	149,965,539.30
固定资产减值准备	353,761.57	-	1,524,600.00	-	-	(3,028.69)	1,881,390.26
商誉减值准备	929,486,492.38	81,486,002.57	-	-	-	62,345,771.55	948,626,723.40
无形资产减值准备	37,581,025.85	5,671.05	-	-	-	687,108.67	36,899,588.23
存货跌价准备	236,185.67	321,619,662.00	-	-	318,436,252.80	-	3,419,594.87
其他资产减值准备小计	<u>1,037,680,651.27</u>	<u>505,527,831.93</u>	<u>1,524,600.00</u>	<u>10,446,926.42</u>	<u>318,436,252.80</u>	<u>75,057,067.92</u>	<u>1,140,792,836.06</u>
合计	<u>6,890,890,506.49</u>	<u>7,640,667,564.52</u>	<u>1,191,902,633.11</u>	<u>663,379,633.66</u>	<u>1,193,411,495.64</u>	<u>441,586,211.61</u>	<u>13,425,083,363.21</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四 合并财务报表主要项目附注(续)

21. 资产减值及损失准备(续)

	2021年6月30日			合计
	阶段一 12个月预期信用损失	阶段二 整个存续期预期信用损失	阶段三	
买入返售金融资产				
账面余额	33,012,414,258.48	4,107,512,671.17	7,496,346,570.72	44,616,273,500.37
减值损失准备	55,596,303.92	1,679,859,222.31	6,616,478,784.00	8,351,934,310.23
账面价值	32,956,817,954.56	2,427,653,448.86	879,867,786.72	36,264,339,190.14
融出资金				
账面余额	122,052,352,726.88	405,648,718.84	4,294,491,091.68	126,752,492,537.40
减值损失准备	359,693,294.92	42,415,329.06	1,563,954,361.77	1,966,062,985.75
账面价值	121,692,659,431.96	363,233,389.78	2,730,536,729.91	124,786,429,551.65
应收款项及其他应收款				
账面余额	68,440,401,097.46	368,178,083.01	2,056,638,636.29	70,865,217,816.76
减值损失准备	213,574,756.38	13,567,739.75	1,952,764,034.06	2,179,906,530.19
账面价值	68,226,826,341.08	354,610,343.26	103,874,602.23	68,685,311,286.57
其他债权投资				
账面价值	58,019,065,775.32	-	-	58,019,065,775.32
减值损失准备	327,462,756.72	-	44,000,000.00	371,462,756.72

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四 合并财务报表主要项目附注(续)

21. 资产减值及损失准备(续)

	2020年12月31日			合计
	第1阶段 12个月预期信用损失	第2阶段 整个存续期预期信用损失	第3阶段	
买入返售金融资产				
账面余额	33,506,322,238.86	5,369,838,132.87	8,389,391,946.67	47,265,552,318.40
减值损失准备	58,758,443.12	1,331,266,622.37	6,648,913,800.92	8,038,938,866.41
账面价值	33,447,563,795.74	4,038,571,510.50	1,740,478,145.75	39,226,613,451.99
融出资金				
账面余额	114,595,281,677.26	120,175,782.88	3,559,507,068.57	118,274,964,528.71
减值损失准备	344,215,075.17	12,546,351.73	1,176,771,372.24	1,533,532,799.14
账面价值	114,251,066,602.09	107,629,431.15	2,382,735,696.33	116,741,431,729.57
应收款项及其他应收款				
账面余额	41,612,420,588.57	37,506,473.31	2,053,254,952.92	43,703,182,014.80
减值损失准备	173,932,070.44	8,130,712.44	1,949,384,565.47	2,131,447,348.35
账面价值	41,438,488,518.13	29,375,760.87	103,870,387.45	41,571,734,666.45
其他债权投资				
账面价值	49,400,900,096.32	-	-	49,400,900,096.32
减值损失准备	533,493,043.06	-	44,000,000.00	577,493,043.06

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

22. 短期借款

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
信用借款	9,508,583,378.12	3,661,986,969.06
抵押借款	1,085,629,284.62	1,348,384,247.10
合计	<u>10,594,212,662.74</u>	<u>5,010,371,216.16</u>

于2021年6月30日，本集团短期借款利率区间为0.80%至2.00%(2020年12月31日：0.79%至2.00%)。于2021年6月30日，本集团上述借款抵质押物账面价值为人民币3,690,293,729.82元(2020年12月31日：人民币3,795,805,237.22元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

23. 应付短期融资款

2021年1月1日至6月30日止期间

债券名称	发行日期	到期日期	票面利率	期初账面余额	本期增加额	本期减少额	期末账面余额
20 中证 08	02/06/2020	02/06/2021	2.08%	1,010,832,541.55	9,967,458.45	1,020,800,000.00	-
20 中证 S1	28/07/2020	28/04/2021	2.84%	505,474,853.97	5,184,872.06	510,659,726.03	-
20 中证 S2	07/08/2020	07/08/2021	2.95%	2,828,387,772.42	45,004,394.70	-	2,873,392,167.12
CITICSMTNECP08	26/05/2020	25/05/2021	0.00%	323,671,285.23	2,565,042.07	326,236,327.30	-
CITICSMTNECP10	20/08/2020	19/08/2021	0.00%	194,138,450.27	1,255,874.92	1,931,716.97	193,462,608.22
CITICSMTNECP11	17/09/2020	16/09/2021	0.94%	653,786,183.98	3,416,860.90	6,502,944.90	650,700,099.98
CITICSMTNECP12	16/10/2020	20/01/2021	0.00%	195,666,514.18	80,485.75	195,746,999.93	-
CITICSMTNECP13	19/11/2020	19/05/2021	0.00%	251,605,146.71	899,482.86	252,504,629.57	-
CITICSMTNECP14	25/11/2020	24/11/2021	0.00%	64,661,954.62	322,010.29	643,116.95	64,340,847.96
CITICSMTNECP15	15/12/2020	14/12/2021	0.00%	775,514,659.06	3,861,987.08	7,713,137.85	771,663,508.29
CITICSMTNECP16	19/01/2021	18/01/2022	0.75%	-	326,980,370.69	3,236,520.33	323,743,850.36
CITICSMTNECP17	01/02/2021	02/08/2021	0.00%	-	646,687,862.68	1,078,990.38	645,608,872.30
CITICSMTNECP18	09/02/2021	09/08/2021	0.00%	-	643,401,754.53	1,073,531.93	642,328,222.60
CITICSMTNECP19	08/03/2021	30/11/2021	0.00%	-	193,534,885.82	334,817.55	193,200,068.27
CITICSMTNECP20	25/05/2021	24/05/2022	0.00%	-	160,657,415.67	174,949.83	160,482,465.84
CITICSMTNECP21	02/06/2021	01/06/2022	0.00%	-	192,549,110.09	-	192,549,110.09
收益凭证	08/07/2020	04/01/2021	1.70%	-	-	-	-
合计	~30/06/2021	~28/12/2021	~4.00%	5,138,131,859.61	9,403,290,485.71	12,104,928,364.23	2,436,493,981.09
				11,941,871,221.60	11,639,660,354.27	14,433,565,773.75	9,147,965,802.12

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

23. 应付短期融资款(续)

2020年度

债券名称	发行日期	到期日期	票面利率	年初账面余额	本年增加额	本年减少额	年末账面余额
19 中信 CP010	18/10/2019	16/01/2020	2.95%	6,036,084,689.87	7,439,900.29	6,043,524,590.16	-
19 中信 CP011	19/11/2019	18/02/2020	3.10%	5,017,421,175.57	21,117,075.80	5,038,538,251.37	-
19 中信 CP012	13/12/2019	12/03/2020	3.05%	3,004,354,001.96	18,145,998.04	3,022,500,000.00	-
20 中信 CP001	17/01/2020	16/04/2020	2.78%	-	4,028,664,073.64	4,028,664,073.64	-
20 中信证券 CP002	28/02/2020	18/05/2020	2.50%	-	4,025,985,668.62	4,025,985,668.62	-
20 中信证券 CP003	25/02/2020	25/05/2020	2.45%	-	4,025,577,276.02	4,025,577,276.02	-
20 中信证券 CP004	05/03/2020	03/06/2020	2.39%	-	4,024,610,338.59	4,024,610,338.59	-
20 中信证券 CP005	13/03/2020	11/06/2020	2.16%	-	5,027,717,898.27	5,027,717,898.27	-
20 中信证券 CP006	25/03/2020	23/06/2020	1.78%	-	5,022,596,634.83	5,022,596,634.83	-
20 中信证券 CP007	08/04/2020	07/07/2020	1.50%	-	6,023,473,417.17	6,023,473,417.17	-
20 中信证券 CP008	20/04/2020	17/07/2020	1.40%	-	6,021,819,708.53	6,021,819,708.53	-
20 中信证券 CP009	13/05/2020	11/08/2020	1.55%	-	5,020,246,488.70	5,020,246,488.70	-
20 中信证券 CP010	25/05/2020	21/08/2020	1.55%	-	5,019,711,096.95	5,019,711,096.95	-
20 中信证券 CP011	28/05/2020	26/08/2020	1.58%	-	4,016,543,059.87	4,016,543,059.87	-
20 中信证券 CP012	15/06/2020	11/09/2020	2.20%	-	4,022,013,780.44	4,022,013,780.44	-
20 中信证券 CP013	09/07/2020	30/09/2020	1.95%	-	5,023,353,863.93	5,023,353,863.93	-
20 中证 08	02/06/2020	02/06/2021	2.08%	-	1,013,945,786.83	3,113,245.28	1,010,832,541.55
20 中证 S1	28/07/2020	28/04/2021	2.84%	-	506,947,221.90	1,472,367.93	505,474,853.97
20 中证 S2	07/08/2020	07/08/2021	2.95%	-	2,836,502,989.40	8,115,216.98	2,828,387,772.42
CITICSMTNECP03	20/11/2019	20/05/2020	0.00%	690,726,863.38	6,915,699.64	697,642,563.02	-
CITICSMTNECP04	11/03/2020	11/09/2020	0.00%	-	700,690,907.82	700,690,907.82	-
CITICSMTNECP05	13/03/2020	14/09/2020	0.00%	-	350,344,578.43	350,344,578.43	-
CITICSMTNECP06	25/03/2020	26/06/2020	0.00%	-	700,703,802.35	700,703,802.35	-
CITICSMTNECP07	22/05/2020	23/11/2020	0.00%	-	1,234,797,280.60	1,234,797,280.60	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

23. 应付短期融资款(续)

2020年度(续)

债券名称	发行日期	到期日期	票面利率	年初账面余额	本年增加额	本年减少额	年末账面余额
CITICSMTNECP08	26/05/2020	25/05/2021	0.00%	-	349,968,667.83	26,297,382.60	323,671,285.23
CITICSMTNECP09	26/05/2020	27/11/2020	0.00%	-	352,795,544.71	352,795,544.71	-
CITICSMTNECP10	20/08/2020	19/08/2021	0.00%	-	207,790,532.82	13,652,082.55	194,138,450.27
CITICSMTNECP11	17/09/2020	16/09/2021	0.94%	-	687,370,816.84	33,584,632.86	653,786,183.98
CITICSMTNECP12	16/10/2020	20/01/2021	0.00%	-	204,212,641.12	8,546,126.94	195,666,514.18
CITICSMTNECP13	19/11/2020	19/05/2021	0.00%	-	259,190,615.82	7,585,469.11	251,605,146.71
CITICSMTNECP14	25/11/2020	24/11/2021	0.00%	-	66,625,882.92	1,963,928.30	64,661,954.62
CITICSMTNECP15	15/12/2020	14/12/2021	0.00%	-	781,849,611.51	6,334,952.45	775,514,659.06
收益凭证	11/10/2019 ~31/12/2020	02/01/2020 ~13/10/2021	1.39% ~4.00%	5,388,706,560.01	58,095,240,678.44	58,345,815,378.84	5,138,131,859.61
合计				20,137,293,290.79	129,704,909,538.67	137,900,331,607.86	11,941,871,221.60

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

24. 拆入资金

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
银行拆入资金	12,110,934,850.37	8,480,225,939.62
转融通融入资金(1)	-	2,023,888,888.90
合计	<u>12,110,934,850.37</u>	<u>10,504,114,828.52</u>

(1) 转融通融入资金剩余期限及利率区间

项目	2021年 6月30日		2020年 12月31日	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1个月以内	-	-	2,023,888,888.90	3.00%
合计	<u>-</u>		<u>2,023,888,888.90</u>	

25. 交易性金融负债

项目	2021年6月30日		
	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
债券	2,830,201,209.67	-	2,830,201,209.67
股票	1,784,842,922.03	-	1,784,842,922.03
收益凭证	-	48,346,096,981.59	48,346,096,981.59
结构化主体其他份额持有人投资份额及其他	64,661,982.91	13,235,928,029.27	13,300,590,012.18
合计	<u>4,679,706,114.61</u>	<u>61,582,025,010.86</u>	<u>66,261,731,125.47</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

25. 交易性金融负债(续)

项目	2020年12月31日		
	为交易目的而持有的金融负债	指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
债券	5,675,783,392.27	-	5,675,783,392.27
股票	1,678,510,228.15	-	1,678,510,228.15
收益凭证	-	40,404,592,606.14	40,404,592,606.14
结构化主体其他份额持有人投资份额及其他	28,478,064.62	10,621,379,504.73	10,649,857,569.35
合计	7,382,771,685.04	51,025,972,110.87	58,408,743,795.91

截至2021年6月30日及2020年12月31日, 本集团指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值并未发生由于本集团自身信用风险变化导致的重大变动。

26. 卖出回购金融资产款

(1) 按标的物类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
债券	126,698,247,648.74	120,952,729,240.94
其中: 国债	53,802,663,910.87	55,505,567,864.61
金融债	21,419,483,469.47	21,050,371,793.90
企业债	8,269,974,730.29	44,396,789,582.43
股票	17,324,152,633.52	24,922,470,487.14
贵金属	12,754,217,535.15	16,282,953,294.44
其他	57,559,870,500.01	36,141,247,014.18
合计	214,336,488,317.42	198,299,400,036.70

(2) 按业务类别列示

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
质押式回购	134,548,034,861.92	108,222,611,184.15
质押式报价回购	34,572,158,117.91	34,427,448,350.53
买断式回购	32,462,077,802.44	39,366,387,207.58
黄金掉期业务	12,754,217,535.15	16,282,953,294.44
合计	214,336,488,317.42	198,299,400,036.70

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

26. 卖出回购金融资产款(续)

(3) 质押式报价回购的剩余期限和利率区间

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
1个月以内	31,444,950,655.72	28,751,461,520.11
1个月以上至3个月内	2,330,412,742.11	3,529,247,765.68
3个月以上至1年以内	796,794,720.08	2,146,739,064.74
合计	<u>34,572,158,117.91</u>	<u>34,427,448,350.53</u>

于2021年6月30日，质押式报价回购利率区间为1.20%-6.00%(2020年12月31日：2.20%-6.00%)。

(4) 担保物金额

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
债券	139,507,227,529.59	133,667,191,314.50
股票	19,029,986,791.73	28,110,260,267.03
其他	71,416,285,517.55	54,991,240,354.17
合计	<u>229,953,499,838.87</u>	<u>216,768,691,935.70</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

27. 代理买卖证券款

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
境内：		
普通经纪业务	196,288,215,259.89	158,517,403,570.23
个人	75,858,404,531.47	75,546,995,233.67
机构	120,429,810,728.42	82,970,408,336.56
信用业务	19,373,687,022.94	18,837,590,152.03
个人	7,936,815,781.37	7,327,360,842.77
机构	11,436,871,241.57	11,510,229,309.26
小计	<u>215,661,902,282.83</u>	<u>177,354,993,722.26</u>
境外：	<u>29,516,592,373.13</u>	<u>25,755,593,891.53</u>
合计	<u>245,178,494,655.96</u>	<u>203,110,587,613.79</u>

28. 代理承销证券款

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
股票	570,195,674.00	929,975,680.92
债券	196,523,385.89	141,259,462.57
其中：公司债	63,565,890.00	48,913,688.00
金融债及其他	132,957,495.89	92,345,774.57
合计	<u>766,719,059.89</u>	<u>1,071,235,143.49</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

29. 应付职工薪酬

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
短期薪酬	17,401,002,385.29	10,038,895,210.74	9,556,410,398.23	17,883,487,197.80
离职后福利(设定提存计划)	170,977,217.73	577,571,209.79	576,013,954.51	172,534,473.01
辞退福利	12,003,881.38	2,208,795.75	3,991,664.00	10,221,013.13
合计	<u>17,583,983,484.40</u>	<u>10,618,675,216.28</u>	<u>10,136,416,016.74</u>	<u>18,066,242,683.94</u>

项目	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日
短期薪酬	14,514,711,382.49	14,506,164,013.52	11,619,873,010.72	17,401,002,385.29
离职后福利(设定提存计划)	93,522,554.06	902,750,376.05	825,295,712.38	170,977,217.73
辞退福利	-	20,814,900.34	8,811,018.96	12,003,881.38
合计	<u>14,608,233,936.55</u>	<u>15,429,729,289.91</u>	<u>12,453,979,742.06</u>	<u>17,583,983,484.40</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

29. 应付职工薪酬(续)

短期薪酬如下：

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
工资、奖金、津贴和补贴	16,839,280,533.93	9,091,781,971.72	8,689,118,645.07	17,241,943,860.58
职工福利费	3,249,380.59	63,072,153.77	64,410,747.60	1,910,786.76
社会保险费	269,399,510.11	282,004,232.28	267,800,600.70	283,603,141.69
其中：医疗保险费	268,332,489.61	274,822,322.49	261,010,643.52	282,144,168.58
工伤保险费	337,968.57	2,452,454.29	2,014,470.90	775,951.96
生育保险费	405,386.28	2,040,193.23	2,034,924.97	410,654.54
住房公积金	11,211,314.18	361,170,173.19	370,643,074.40	1,738,412.97
工会经费和职工教育经费	265,057,891.60	188,308,216.69	112,662,997.62	340,703,110.67
短期带薪缺勤	12,803,754.88	52,558,463.09	51,774,332.84	13,587,885.13
合计	17,401,002,385.29	10,038,895,210.74	9,556,410,398.23	17,883,487,197.80

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

29. 应付职工薪酬(续)

短期薪酬如下：

项目	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日
工资、奖金、津贴和补贴	14,131,101,309.75	12,848,036,339.23	10,139,857,115.05	16,839,280,533.93
职工福利费	-	219,290,724.68	216,041,344.09	3,249,380.59
社会保险费	224,389,922.26	385,133,415.72	340,123,827.87	269,399,510.11
其中：医疗保险费	228,530,997.82	373,134,682.64	333,333,190.85	268,332,489.61
工伤保险费	680,399.84	1,555,056.84	1,897,488.11	337,968.57
生育保险费	652,847.87	4,706,268.10	4,953,729.69	405,386.28
住房公积金	8,712,838.40	670,309,647.80	667,811,172.02	11,211,314.18
工会经费和职工教育经费	150,506,760.33	308,676,278.36	194,125,147.09	265,057,891.60
短期带薪缺勤	551.75	74,717,607.73	61,914,404.60	12,803,754.88
合计	14,514,711,382.49	14,506,164,013.52	11,619,873,010.72	17,401,002,385.29

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

29. 应付职工薪酬(续)

设定提存计划如下：

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
基本养老保险	17,225,141.53	360,186,140.56	357,430,824.41	19,980,457.68
失业保险费	589,180.12	12,555,934.99	11,901,233.59	1,243,881.52
企业年金缴费	153,162,896.08	204,829,134.24	206,681,896.51	151,310,133.81
合计	170,977,217.73	577,571,209.79	576,013,954.51	172,534,473.01

项目	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日
基本养老保险	15,831,966.91	375,382,232.89	373,989,058.27	17,225,141.53
失业保险费	977,058.67	7,532,071.17	7,919,949.72	589,180.12
企业年金缴费	76,713,528.48	519,836,071.99	443,386,704.39	153,162,896.08
合计	93,522,554.06	902,750,376.05	825,295,712.38	170,977,217.73

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

30. 应交税费

税费项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
企业所得税	3,674,399,188.45	6,242,968,788.21
个人所得税	936,483,930.37	711,855,807.56
增值税	230,355,608.74	350,855,017.62
城市维护建设税	14,746,254.85	22,960,466.10
教育费附加及地方教育费附加	11,065,722.68	17,528,569.91
其他	25,764,303.86	35,812,688.80
合计	<u>4,892,815,008.95</u>	<u>7,381,981,338.20</u>

31. 应付款项

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
应付客户保证金	101,356,307,100.71	77,905,317,525.93
应付清算款	13,972,071,747.90	14,941,963,020.01
应付代理商	24,502,824,104.41	16,213,051,299.50
应付手续费及佣金	698,359,075.99	662,587,905.98
其他	18,304,127,457.14	9,224,626,039.38
合计	<u>158,833,689,486.15</u>	<u>118,947,545,790.80</u>

32. 预计负债

项目	2020年		2021年	
	12月31日	本期增加	本期减少	6月30日
预计负债	<u>305,979,812.67</u>	90,478,617.30	93,901,503.65	<u>302,556,926.32</u>

项目	2019年		2020年	
	12月31日	本年增加	本年减少	12月31日
预计负债	<u>22,737,711.14</u>	362,165,226.66	78,923,125.13	<u>305,979,812.67</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

33. 长期借款

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
抵押借款	802,590,230.69	893,535,664.41
合计	<u>802,590,230.69</u>	<u>893,535,664.41</u>

于2021年6月30日, 本集团长期借款利率区间为1.29%至10.00%(2020年12月31日: 1.37%至10.00%)。于2021年6月30日, 本集团上述借款抵质押物账面价值为人民币1,307,608,382.74元(2020年12月31日: 人民币1,390,812,002.68元)。

34. 应付债券

	2021年 6月30日	2020年 12月31日
已发行债券及中期票据 (1)	179,046,542,315.83	164,606,906,064.42
已发行收益凭证 (2)	<u>3,469,751,303.48</u>	<u>7,380,913,360.52</u>
合计	<u>182,516,293,619.31</u>	<u>171,987,819,424.94</u>

于2021年6月30日及2020年12月31日, 本集团发行的债务证券没有出现拖欠本金、利息或赎回款项的违约情况。

(1) 已发行债券及中期票据

	2021年 6月30日	2020年 12月31日
06 中信债 (i)	-	1,537,551,369.86
13 中信 02 (ii)	12,032,697,946.86	12,336,466,030.28
15 中信 02 (iii)	2,501,688,280.80	2,565,917,104.81
CITIC SEC N2204 (iv)	3,245,930,205.35	3,275,980,476.86
CITIC SEC N2112 (iv)	1,940,920,075.22	1,958,812,861.87
CITIC SEC N2410 (iv)	1,288,881,582.32	1,300,556,333.45
CITIC SEC N2210 (iv)	3,234,194,644.73	3,262,455,056.60
CITIC SEC N2306 (iv)	3,223,799,873.92	3,253,678,555.01
CITIC SEC N2506 (iv)	3,218,637,527.27	3,249,222,037.21
16 中信 G2 (v)	2,552,306,647.52	2,510,386,073.46

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

		2021年 6月30日	2020年 12月31日
17 中信 C2	(vi)	2,312,325,507.84	2,373,759,727.47
17 中信 C4	(vii)	5,074,677,612.68	4,947,069,916.72
17 中信 G2	(viii)	2,032,287,913.97	2,076,635,085.20
18 中信 02	(ix)	-	2,582,244,074.84
18 中信 G1	(x)	-	1,768,305,620.27
18 中证 C1	(xi)	5,155,428,344.87	5,042,628,278.56
18 中证 C2	(xii)	4,112,815,864.35	4,024,188,031.24
18 中证 G1	(xiii)	-	2,461,939,611.57
18 中证 G2	(xiv)	601,269,192.96	616,085,343.88
18 广证 01	(xv)	-	1,039,315,711.16
19 中证 01	(xvi)	2,735,326,919.55	2,788,294,325.19
19 中证 02	(xvii)	3,033,305,509.19	3,093,455,174.13
19 中证 03	(xviii)	3,021,725,964.67	3,086,404,605.13
19 中证 04	(xix)	1,502,749,604.28	1,532,973,486.94
19 中证 05	(xx)	5,111,218,755.96	5,018,152,888.45
19 中证 C1	(xxi)	2,518,117,397.14	2,570,019,144.46
19 中证 C2	(xxii)	3,007,540,871.63	3,068,558,409.75
19 中证 G1	(xxiii)	2,054,514,729.54	2,020,854,322.11
19 中证 G2	(xxiv)	1,030,399,980.63	1,011,648,508.52
19 中信金融债 01	(xxv)	9,298,032,702.95	9,136,908,153.16
20 中证 09	(xxvi)	4,501,173,131.01	4,560,305,904.71
20 中证 11	(xxvii)	1,998,153,010.17	2,028,466,365.21
20 中证 13	(xxviii)	3,097,480,008.16	3,042,804,591.25
20 中证 15	(xxix)	7,727,096,934.49	7,593,807,240.38
20 中证 16	(xxx)	5,355,147,592.40	5,261,189,807.77
20 中证 17	(xxxi)	4,303,597,496.86	4,236,170,764.24
20 中证 18	(xxxii)	2,877,120,093.13	2,827,500,800.61
20 中证 19	(xxxiii)	2,255,691,191.87	2,217,315,601.32
20 中证 20	(xxxiv)	824,770,945.99	808,013,052.04
20 中证 21	(xxxv)	7,666,443,472.35	7,531,703,003.09
20 中证 22	(xxxvi)	816,242,469.70	802,561,734.34
20 中证 23	(xxxvii)	4,391,617,650.97	4,315,024,820.92
20 中证 24	(xxxviii)	923,395,472.38	904,231,376.67

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

		2021年 6月30日	2020年 12月31日
20 中证 C1	(xxxix)	2,014,660,678.07	2,047,208,833.28
20 中证 F1	(xl)	5,715,339,538.87	5,609,368,553.82
20 中证 G1	(xli)	3,027,427,053.23	3,071,686,977.01
20 中证 G2	(xlii)	2,019,361,202.00	2,052,198,818.28
20 中证 G3	(xliii)	2,216,400,112.49	2,248,069,338.38
20 中证 G4	(xliv)	2,015,547,025.98	2,047,275,283.99
20 中证 G5	(xlv)	-	1,518,981,007.54
20 中证 G6	(xlvi)	3,312,123,210.23	3,352,818,436.82
20 中证 G7	(xlvii)	1,004,383,920.30	1,019,737,434.59
21 中证 01	(xlviii)	2,223,502,135.04	-
21 中证 02	(xlix)	4,658,918,076.80	-
21 中证 03	(l)	3,247,343,476.02	-
21 中证 04	(li)	1,514,132,880.14	-
21 中证 05	(lii)	3,032,520,566.89	-
21 中证 06	(liii)	2,521,988,366.51	-
21 中证 07	(liv)	1,408,072,768.11	-
21 中证 08	(lv)	999,076,669.67	-
21 中证 09	(lvi)	2,498,194,397.83	-
21 中证 C1	(lvii)	3,038,827,111.97	-
		<hr/>	<hr/>
账面余额		179,046,542,315.83	164,606,906,064.42

四、合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (i) 经证监会证监发行字[2006]14号文件《关于核准中信证券股份有限公司发行债券的通知》和中国人民银行银复[2006]18号文件《中国人民银行关于办理中信证券股份有限公司债券登记托管有关问题的批复》的批准，本公司于2006年6月发行了15年期面值总额为15亿元的2006年中信证券股份有限公司债券，到期日为2021年5月31日，票面年利率为4.25%，中国中信有限公司为本次债券发行提供了不可撤销的连带责任担保。本公司于2021年5月31日到期兑付全部本息。
- (ii) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司公开发行公司债券的批复》(证监许可[2013]706号)，本公司于2013年6月发行了10年期面值总额为人民币120亿元的公司债券，到期日为2023年6月7日，票面年利率为5.05%，本次债券为无担保债券。
- (iii) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2015]1215号)，本公司于2015年6月发行了10年期面值总额为人民币25亿元的公司债券，到期日为2025年6月25日，票面年利率为5.10%，本次债券为无担保债券。
- (iv) 根据本公司2013年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd. 于2014年10月17日设立有担保的本金总额最高为30亿美元(或以其他货币计算的等值金额)的中国大陆以外地区中期票据计划。2014年度，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.对本次中期票据计划进行6.5亿美元的首次提取；2015年度，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.对该次中期票据计划进行了八次提取，发行规模共计4.40亿美元，皆于当年到期清偿。2017年度，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.对该次中期票据计划分别进行了5亿美元和3亿美元的再次提取。2018年度，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd. 对该次中期票据计划进行了五次提取，发行规模共计7.29亿美元，当期清偿共计2.29亿美元。2019年度，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.对该次中期票据计划分别进行了5亿美元和2亿美元的再次提取，本期清偿8.5亿美元。本公司均为上述中期票据计划提供担保，上述担保无反担保安排。2020年度，CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.对该次中期票据计划进行了10亿美元的再次提取，其中三年期品种发行规模5亿美元，五年期品种发行规模5亿美元。本公司均为上述中期票据计划提供担保，上述担保无反担保安排。
- (v) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2016]2390号)，本公司于2016年11月发行了为5年期面额值总额为人民币25亿元的公司债券，到期日为2021年11月17日，票面利率为3.38%。本次债券为无担保债券。

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (vi) 根据本公司 2013 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2017 年 5 月发行了 5 年期面值总额为人民币 23 亿元的次级债券，到期日为 2022 年 5 月 25 日，票面年利率为 5.30%，本次债券为无担保债券。
- (vii) 根据本公司 2013 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2017 年 10 月发行了 5 年期面值总额为人民币 49 亿元的次级债券，到期日为 2022 年 10 月 26 日，票面年利率为 5.25%，本次债券为无担保债券。
- (viii) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2016]2390 号)，本公司于 2017 年 2 月发行了 5 年期面值总额为人民币 20 亿元的公司债券，到期日为 2022 年 2 月 17 日，票面利率为 4.40%。本次债券为无担保债券。
- (ix) 根据本公司 2016 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2018 年 5 月发行了 3 年期面值总额为人民币 25 亿元的债券，到期日为 2021 年 5 月 10 日，票面利率为 5.09%。本次债券为无担保债券。本公司于 2021 年 5 月 10 日到期兑付全部本息。
- (x) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2017]1774 号)，本公司于 2018 年 3 月发行了 3 年期面值总额为人民币 17 亿元的债券，到期日为 2021 年 3 月 20 日，票面利率为 5.14%。本次债券为无担保债券。本公司于 2021 年 3 月 22 日到期兑付全部本息。
- (xi) 根据本公司 2016 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2018 年 10 月发行了 3 年期面值总额为人民币 50 亿元的次级债券，到期日为 2021 年 10 月 19 日，票面年利率为 4.48%，本次债券为无担保债券。
- (xii) 根据本公司 2016 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2018 年 11 月发行了 3 年期面值总额为人民币 40 亿元的次级债券，到期日为 2021 年 11 月 7 日，票面年利率为 4.40%，本次债券为无担保债券。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (xiii) 根据证监会《中信证券股份有限公司关于面向合格投资者公开发行公司债券的申请》(证监许可[2018]855号)，本公司于2018年6月发行了3年期面值总额为人民币24亿元的公司债券，到期日为2021年6月15日，票面利率为4.80%。本次债券为无担保债券。本公司于2021年6月15日到期兑付全部本息。
- (xiv) 根据证监会《中信证券股份有限公司关于面向合格投资者公开发行公司债券的申请》(证监许可[2018]855号)，本公司于2018年6月发行了5年期面值总额为人民币6亿元的公司债券，到期日为2023年6月15日，票面利率为4.90%。本次债券为无担保债券。
- (xv) 根据《关于广州证券股份有限公司2018年证券公司次级债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函[2018]278号)，中信证券华南(原名“广州证券”)于2018年6月发行了3年期面值总额为人民币10.10亿元的次级债券，到期日为2021年6月22日，票面利率为5.50%。本次债券为担保债券，担保人为本公司。中信证券华南于2021年6月22日到期兑付全部本息。
- (xvi) 根据本公司2016年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于2019年2月发行了3年期面值总额为人民币27亿元的债券，到期日为2022年2月28日，票面利率为3.90%。本次债券为无担保债券。
- (xvii) 根据本公司2016年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于2019年3月发行了3年期面值总额为人民币30亿元的债券，到期日为2022年3月21日，票面利率为3.98%。本次债券为无担保债券。
- (xviii) 根据本公司2018年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于2019年4月发行了3年期面值总额为人民币30亿元的债券，到期日为2022年4月29日，票面年利率为4.28%，本次债券为无担保债券。
- (xix) 根据本公司2018年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于2019年6月发行了3年期面值总额为人民币15亿元的债券，到期日为2022年6月14日，票面年利率为4.00%，本次债券为无担保债券。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (xx) 根据本公司 2017 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2019 年 11 月发行了 3 年期面值总额为人民币 50 亿元的债券，到期日为 2022 年 11 月 26 日，票面年利率为 3.75%，本次债券为无担保债券。
- (xxi) 根据本公司 2018 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2019 年 4 月发行了 3 年期面值总额为人民币 25 亿元的次级债券，到期日为 2022 年 4 月 23 日，票面年利率为 4.20%，本次债券为无担保债券。
- (xxii) 根据本公司 2018 年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，且经相关监管机构的批准，本公司于 2019 年 6 月发行了 3 年期面值总额为人民币 30 亿元的次级债券，到期日为 2022 年 6 月 3 日，票面年利率为 4.10%，本次债券为无担保债券。
- (xxiii) 根据证监会《中信证券股份有限公司关于面向合格投资者公开发行公司债券的申请》(证监许可[2018]1442 号)，本公司于 2019 年 9 月发行了 3 年期面值总额为人民币 20 亿元的公司债券，到期日为 2022 年 9 月 10 日，票面利率为 3.39%。本次债券为无担保债券。
- (xxiv) 根据证监会《中信证券股份有限公司关于面向合格投资者公开发行公司债券的申请》(证监许可[2018]1442 号)，本公司于 2019 年 9 月发行了 5 年期面值总额为人民币 10 亿元的公司债券，到期日为 2024 年 9 月 10 日，票面利率为 3.78%。本次债券为无担保债券。
- (xxv) 根据中国人民银行《中国人民银行准予行政许可决定书》(银市场许准予字[2019]第 108 号)，本公司于 2019 年 7 月发行了 3 年期面值总额为人民币 90 亿元的金融债券，票面利率 3.58%，到期日为 2022 年 7 月 25 日，本次债券为无担保债券。
- (xxvi) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892 号)，本公司于 2020 年 6 月发行了 3 年期面值总额为人民币 45 亿元的公司债券，到期日为 2023 年 6 月 2 日，票面利率为 2.70%。本次债券为无担保债券。
- (xxvii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892 号)，本公司于 2020 年 6 月发行了 3 年期面值总额为人民币 20 亿元的公司债券，到期日为 2023 年 6 月 19 日，票面利率为 3.10%。本次债券为无担保债券。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (xxviii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年7月发行了3年期面值总额为人民币30亿元的公司债券，到期日为2023年7月14日，票面利率为3.58%。本次债券为无担保债券。
- (xxix) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年7月发行了3年期面值总额为人民币75亿元的公司债券，到期日为2023年7月28日，票面利率为3.49%。本次债券为无担保债券。
- (xxx) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年8月发行了3年期面值总额为人民币52亿元的公司债券，到期日为2023年8月7日，票面利率为3.55%。本次债券为无担保债券。
- (xxxi) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年8月发行了期限370天面值总额为人民币42亿元的公司债券，到期日为2021年8月29日，票面利率为2.95%。本次债券为无担保债券。
- (xxxii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年8月发行了3年期面值总额为人民币28亿元的公司债券，到期日为2023年8月24日，票面利率为3.48%。本次债券为无担保债券。
- (xxxiii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年9月发行了期限370天面值总额为人民币22亿元的公司债券，到期日为2021年9月16日，票面利率为3.23%。本次债券为无担保债券。
- (xxxiv) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年9月发行了10年期面值总额为人民币8亿元的公司债券，到期日为2030年9月11日，票面利率为4.20%。本次债券为无担保债券。
- (xxxv) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号)，本公司于2020年10月发行了2年期面值总额为人民币75亿元的公司债券，到期日为2022年10月21日，票面利率为3.48%。本次债券为无担保债券。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (xxxvi) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号), 本公司于2020年10月发行了期限370天面值总额为人民币8亿元的公司债券, 到期日为2021年11月2日, 票面利率为3.16%。本次债券为无担保债券。
- (xxxvii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号), 本公司于2020年10月发行了2年期面值总额为人民币43亿元的公司债券, 到期日为2022年10月28日, 票面利率为3.45%。本次债券为无担保债券。
- (xxxviii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]892号), 本公司于2020年10月发行了10年期面值总额为人民币9亿元的公司债券, 到期日为2030年10月28日, 票面利率为4.27%。本次债券为无担保债券。
- (xxxix) 根据本公司2017年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的议案》, 且经相关监管机构的批准, 本公司于2020年3月发行了3年期面值总额为人民币20亿元的次级债券, 到期日为2023年3月24日, 票面利率为3.32%。本次债券为无担保债券。
- (xl) 根据本公司2018年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债务融资工具的预案》, 且经相关监管机构的批准, 本公司于2020年11月发行了期限370天面值总额为人民币56亿元的次级债券, 到期日为2021年11月24日, 票面利率为3.53%。本次债券为无担保债券。
- (xli) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号), 本公司于2020年2月发行了3年期面值总额为人民币30亿元的公司债券, 到期日为2023年2月21日, 票面利率为3.02%。本次债券为无担保债券。
- (xlii) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号), 本公司于2020年2月发行了5年期面值总额为人民币20亿元的公司债券, 到期日为2025年2月21日, 票面利率为3.31%。本次债券为无担保债券。
- (xliii) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号), 本公司于2020年3月发行了3年期面值总额为人民币22亿元的公司债券, 到期日为2023年3月10日, 票面利率为2.95%。本次债券为无担保债券。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

- (xliv) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号)，本公司于2020年3月发行了5年期面值总额为人民币20亿元的公司债券，到期日为2025年3月10日，票面利率为3.20%。本次债券为无担保债券。
- (xlv) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号)，本公司于2020年4月发行了期限367天面值总额为人民币15亿元的公司债券，到期日为2021年4月16日，票面利率为1.88%。本次债券为无担保债券。本公司于2021年4月16日到期兑付全部本息。
- (xlvi) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号)，本公司于2020年4月发行了3年期面值总额为人民币33亿元的公司债券，到期日为2023年4月14日，票面利率为2.54%。本次债券为无担保债券。
- (xlvii) 根据证监会《关于核准中信证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2020]64号)，本公司于2020年4月发行了5年期面值总额为人民币10亿元的公司债券，到期日为2025年4月14日，票面利率为3.10%。本次债券为无担保债券。
- (xlviii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年1月发行了期限370天面值总额为人民币22亿元的公司债券，到期日为2022年1月30日，票面利率为2.90%。本次债券为无担保债券。
- (xlix) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年1月发行了3年期面值总额为人民币46亿元的公司债券，到期日为2024年1月25日，票面利率为3.56%。本次债券为无担保债券。
- (l) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年1月发行了10年期面值总额为人民币32亿元的公司债券，到期日为2031年1月25日，票面利率为4.10%。本次债券为无担保债券。
- (li) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年3月发行了3年期面值总额为人民币15亿元的公司债券，到期日为2024年3月1日，票面利率为3.60%。本次债券为无担保债券。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、 合并财务报表主要项目附注(续)

34. 应付债券(续)

(1) 已发行债券及中期票据(续)

(lii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年3月发行了10年期面值总额为人民币30亿元的公司债券，到期日为2031年3月1日，票面利率为4.10%。本次债券为无担保债券。

(liii) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年3月发行了10年期面值总额为人民币25亿元的公司债券，到期日为2031年3月19日，票面利率为4.10%。本次债券为无担保债券。

(liv) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年4月发行了10年期面值总额为人民币14亿元的公司债券，到期日为2031年4月13日，票面利率为4.04%。本次债券为无担保债券。

(lv) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年6月发行了5年期面值总额为人民币10亿元的公司债券，到期日为2026年6月11日，票面利率为3.70%。本次债券为无担保债券。

(lvi) 根据证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2020]3675号)，本公司于2021年6月发行了10年期面值总额为人民币25亿元的公司债券，到期日为2031年6月11日，票面利率为4.03%。本次债券为无担保债券。

(lvii) 根据本公司2017年度股东大会审议通过的《关于再次授权公司发行境内外公司债券融资工具的议案》及证监会《关于同意中信证券股份有限公司向专业投资者公开发行次级公司债券注册的批复》(证监许可[2020]2117号)，本公司于2021年2月发行了3年期面值总额为人民币30亿元的次级债券，到期日为2024年2月8日，票面利率为3.97%。本次债券为无担保债券。

(2) 已发行收益凭证

于2021年6月30日，本公司发行尚未到期的原始期限大于一年的收益凭证，余额为人民币3,469,751,303.48元，票面年利率区间为1.70%至3.65%(2020年12月31日：人民币人民币7,380,913,360.52元，票面年利率区间为1.70%至3.40%)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

35. 合同负债

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
预收货款	1,062,239,190.71	2,192,867,698.06
其他	23,340,067.04	1,352,930.30
合计	<u>1,085,579,257.75</u>	<u>2,194,220,628.36</u>

合同负债主要涉及本集团销售货物收取的预收款。该预收款在合同签订时收取，该合同的相关收入在本集团履行履约义务后确认。

36. 租赁负债

	2021年6月30日	2020年12月31日
租赁负债	<u>1,876,195,840.38</u>	<u>1,705,734,564.74</u>
其中：一年以内到期的租赁负债	<u>498,643,328.81</u>	<u>494,208,978.31</u>

于资产负债表日，本集团作为承租人已签订但尚未开始执行的租赁合同现金流量按到期日列示如下：

	2021年6月30日	2020年12月31日
一年以内	23,465,666.49	25,627,237.27
一到二年	9,668,769.32	7,728,705.28
二到五年	11,447,105.44	15,385,106.07
五年以上	-	1,392,426.00
合计	<u>44,581,541.25</u>	<u>50,133,474.62</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

37. 其他负债

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
应付股利	5,175,105,968.78	2,049,357.37
其他应付款(1)	6,271,805,509.66	6,131,501,062.28
代理兑付证券款	168,417,084.83	168,699,038.94
应付利息	263,232,523.23	258,306,505.55
其他	1,325,315,306.34	1,119,480,535.40
合计	<u>13,203,876,392.84</u>	<u>7,680,036,499.54</u>

(1) 其他应付款

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
应付次级债务	1,702,714,097.22	2,289,319,023.41
递延收益(i)	987,642,782.36	1,004,080,725.62
仓单质押金	497,230,896.00	639,865,428.00
预提费用	485,835,907.77	253,930,648.32
其他	2,598,381,826.31	1,944,305,236.93
合计	<u>6,271,805,509.66</u>	<u>6,131,501,062.28</u>

(i) 其中，购地补贴款为人民币 978,296,407.87 元(2020年12月31日：人民币 986,795,121.85 元)。

(ii) 应付关联方款项参见“十、关联方关系及其重大交易”。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

38. 金融工具计量基础分类表

金融资产项目	2021年6月30日账面价值					
	以摊余成本计量的 金融资产	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量 且其变动计入其他综合 收益的金融资产	指定为以公允价值计量 且其变动计入其他综合 收益的非交易性权益工 具投资	分类为以公允价值计 量且其变动计入当期损 益的金融资产	按照金融工具确认和 计量准则指定为以公 允价值计量且其变动 计入当期损益的金融 资产	按照套期会计准则指定 为以公允价值计量且其 变动计入当期损益的金 融资产
货币资金	266,284,494,640.72	-	-	-	-	-
结算备付金	37,739,297,424.71	-	-	-	-	-
融出资金	124,786,429,551.65	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	36,264,339,190.14	-	-	-	-	-
应收款项	66,919,086,798.64	-	-	-	-	-
存出保证金	38,510,507,446.64	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	20,428,111,123.29	-	-
交易性金融资产	-	-	-	457,230,640,247.05	11,978,317,915.82	-
其他债权投资	-	58,019,065,775.32	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	166,328,755.33	-	-	-
其他金融资产	2,160,751,504.95	-	-	-	-	-
合计	572,664,906,557.45	58,019,065,775.32	166,328,755.33	477,658,751,370.34	11,978,317,915.82	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

38. 金融工具计量基础分类表(续)

金融负债项目	2021年6月30日账面价值			
	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照金融工具确认和计量准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照套期会计准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
交易性金融负债	-	4,679,706,114.61	61,582,025,010.86	-
衍生金融负债	-	34,678,892,817.38	-	-
应付债券	182,516,293,619.31	-	-	-
应付短期融资款	9,147,965,802.12	-	-	-
拆入资金	12,110,934,850.37	-	-	-
卖出回购金融资产	214,336,488,317.42	-	-	-
代理买卖证券款	245,178,494,655.96	-	-	-
应付款项	158,833,689,486.15	-	-	-
长期借款	802,590,230.69	-	-	-
短期借款	10,594,212,662.74	-	-	-
租赁负债	1,876,195,840.38	-	-	-
其他金融负债	12,476,863,061.56	-	-	-
合计	847,873,728,526.70	39,358,598,931.99	61,582,025,010.86	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

38. 金融工具计量基础分类表(续)

金融资产项目	2020年12月31日账面价值					
	以摊余成本计量的 金融资产	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量 且其变动计入其他综合 收益的金融资产	指定为以公允价值计量 且其变动计入其他综合 收益的非交易性权益工 具投资	分类为以公允价值计 量且其变动计入当期损 益的金融资产	按照金融工具确认和 计量准则指定为以公 允价值计量且其变动 计入当期损益的金融 资产	按照套期会计准则指定 为以公允价值计量且其 变动计入当期损益的金 融资产
货币资金	233,693,264,600.98	-	-	-	-	-
结算备付金	56,934,000,392.55	-	-	-	-	-
融出资金	116,741,431,729.57	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	39,226,613,451.99	-	-	-	-	-
应收款项	39,352,598,397.78	-	-	-	-	-
存出保证金	3,877,774,046.76	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	20,157,990,448.68	-	-
交易性金融资产	-	-	-	405,377,531,918.09	14,603,327,905.81	-
其他债权投资	-	49,400,900,096.32	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	16,635,500,511.08	-	-	-
其他金融资产	2,615,933,323.21	-	-	-	-	-
合计	492,441,615,942.84	49,400,900,096.32	16,635,500,511.08	425,535,522,366.77	14,603,327,905.81	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

38. 金融工具计量基础分类表(续)

金融负债项目	2020年12月31日账面价值			
	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照金融工具确认和计量准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照套期会计准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
交易性金融负债	-	7,382,771,685.04	51,025,972,110.87	-
衍生金融负债	-	46,876,205,555.31	-	-
应付债券	171,987,819,424.94	-	-	-
应付短期融资款	11,941,871,221.60	-	-	-
拆入资金	10,504,114,828.52	-	-	-
卖出回购金融资产	198,299,400,036.70	-	-	-
代理买卖证券款	203,110,587,613.79	-	-	-
应付款项	118,947,545,790.80	-	-	-
长期借款	893,535,664.41	-	-	-
短期借款	5,010,371,216.16	-	-	-
租赁负债	1,705,734,564.74	-	-	-
其他金融负债	7,463,092,068.67	-	-	-
合计	729,864,072,430.33	54,258,977,240.35	51,025,972,110.87	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

39. 股本

项目	2020年12月31日	本期变动增(+)/减(-)					2021年6月30日
		发行新股	送股	公积金转增	其他	小计	
股份总数	<u>12,926,776,029.00</u>	-	-	-	-	-	<u>12,926,776,029.00</u>

项目	2019年12月31日	本年变动增(+)/减(-)					2020年12月31日
		发行新股	送股	公积金转增	其他	小计	
股份总数	<u>12,116,908,400.00</u>	<u>809,867,629.00</u>	-	-	-	<u>809,867,629.00</u>	<u>12,926,776,029.00</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

40. 资本公积

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
股本溢价	72,823,946,777.94	-	-	72,823,946,777.94
资本公积转增股本	(6,630,467,600.00)	-	-	(6,630,467,600.00)
其他资本公积	(565,185,607.74)	-	1,390,376.29	(566,575,984.03)
合计	65,628,293,570.20	-	1,390,376.29	65,626,903,193.91

项目	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日
股本溢价	61,466,584,677.85	11,357,362,100.09	-	72,823,946,777.94
资本公积转增股本	(6,630,467,600.00)	-	-	(6,630,467,600.00)
其他资本公积	(684,086,569.81)	160,708,227.72	41,807,265.65	(565,185,607.74)
合计	54,152,030,508.04	11,518,070,327.81	41,807,265.65	65,628,293,570.20

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

41. 其他综合收益

资产负债表中归属于母公司的其他综合收益累积余额：

项目	2020年12月31日	增减变动	2021年6月30日
权益法下不能转损益的其他综合收益	7,719,115.11	-	7,719,115.11
其他权益工具投资公允价值变动	413,611,108.55	(599,871,399.41)	(186,260,290.86)
权益法下可转损益的其他综合收益	12,395,490.32	698,627.92	13,094,118.24
其他债权投资公允价值变动	(127,759,143.69)	(382,736,723.99)	(510,495,867.68)
其他债权投资信用损失准备	350,954,922.75	(155,094,088.46)	195,860,834.29
外币财务报表折算差额	(155,873,744.00)	(229,410,873.71)	(385,284,617.71)
其他	(184,233,537.23)	23,368,995.66	(160,864,541.57)
合计	316,814,211.81	(1,343,045,461.99)	(1,026,231,250.18)

项目	2019年12月31日	增减变动	2020年12月31日
权益法下不能转损益的其他综合收益	5,770,743.25	1,948,371.86	7,719,115.11
其他权益工具投资公允价值变动	156,944,450.27	256,666,658.28	413,611,108.55
权益法下可转损益的其他综合收益	20,396,422.68	(8,000,932.36)	12,395,490.32
其他债权投资公允价值变动	83,713,857.64	(211,473,001.33)	(127,759,143.69)
其他债权投资信用损失准备	113,472,791.70	237,482,131.05	350,954,922.75
外币财务报表折算差额	765,465,233.24	(921,338,977.24)	(155,873,744.00)
其他	(191,415,386.28)	7,181,849.05	(184,233,537.23)
合计	954,348,112.50	(637,533,900.69)	316,814,211.81

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

41. 其他综合收益(续)

利润表中归属于母公司的其他综合收益当期发生额：

2021年1月1日至6月30日止期间

项目	税前金额	减：所得税	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存	小计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益	(788,031,300.70)	(191,340,808.78)	-	-	(596,690,491.92)	(596,690,491.92)	-
权益法下不能转损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-	-
其他权益工具投资公允价值变动	(791,212,208.19)	(191,340,808.78)	-	-	(599,871,399.41)	(599,871,399.41)	-
其他	3,180,907.49	-	-	-	3,180,907.49	3,180,907.49	-
(二) 将重分类进损益的其他综合收益	(1,045,070,710.19)	(194,232,890.40)	(92,813,111.51)	-	(758,024,708.28)	(746,354,970.07)	(11,669,738.21)
权益法下可转损益的其他综合收益	931,503.89	232,875.97	-	-	698,627.92	698,627.92	-
其他债权投资公允价值变动	(541,057,597.66)	(124,068,490.03)	(34,252,383.64)	-	(382,736,723.99)	(382,736,723.99)	-
其他债权投资信用损失准备	(284,052,092.67)	(70,397,276.34)	(58,560,727.87)	-	(155,094,088.46)	(155,094,088.46)	-
外币财务报表折算差额	(241,080,611.92)	-	-	-	(241,080,611.92)	(229,410,873.71)	(11,669,738.21)
其他	20,188,088.17	-	-	-	20,188,088.17	20,188,088.17	-
其他综合收益合计	<u>(1,833,102,010.89)</u>	<u>(385,573,699.18)</u>	<u>(92,813,111.51)</u>	-	<u>(1,354,715,200.20)</u>	<u>(1,343,045,461.99)</u>	<u>(11,669,738.21)</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

41. 其他综合收益(续)

利润表中归属于母公司的其他综合收益当期发生额(续):

2020年1月1日至6月30日止期间

项目	税前金额	减：所得税	减：前期计入 其他综合收 益当期转入 损益	减：前期计入其他 综合收益当 期转入留存	小计	税后归属于母公 司	税后归属于少 数股东
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益	(513,013,697.09)	(119,734,527.58)	-	-	(393,279,169.51)	(393,279,169.51)	-
权益法下不能转损益的其他综合收益	(3,838,756.16)	(959,689.04)	-	-	(2,879,067.12)	(2,879,067.12)	-
其他权益工具投资公允价值变动	(506,760,490.91)	(118,774,838.54)	-	-	(387,985,652.37)	(387,985,652.37)	-
其他	(2,414,450.02)	-	-	-	(2,414,450.02)	(2,414,450.02)	-
(二) 将重分类进损益的其他综合收益	309,726,025.35	32,848,530.53	90,268,777.51	-	186,608,717.31	181,296,409.67	5,312,307.64
权益法下可转损益的其他综合收益	(1,080,278.99)	(270,069.74)	-	-	(810,209.25)	(810,209.25)	-
其他债权投资公允价值变动	(64,917,225.86)	(16,748,867.89)	10,546,754.24	-	(58,715,112.21)	(58,715,112.21)	-
其他债权投资信用损失准备	206,130,167.15	49,867,468.16	79,722,023.27	-	76,540,675.72	76,540,675.72	-
外币财务报表折算差额	184,324,387.20	-	-	-	184,324,387.20	179,012,079.56	5,312,307.64
其他	(14,731,024.15)	-	-	-	(14,731,024.15)	(14,731,024.15)	-
其他综合收益合计	<u>(203,287,671.74)</u>	<u>(86,885,997.05)</u>	<u>90,268,777.51</u>	<u>-</u>	<u>(206,670,452.20)</u>	<u>(211,982,759.84)</u>	<u>5,312,307.64</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

42. 少数股东权益

本公司重要子公司少数股东权益如下：

子公司名称	2021年6月30日	2020年12月31日
华夏基金	3,795,068,059.00	3,782,390,817.33
金石投资	157,354,328.02	150,729,189.74
中信证券海外投资	100,055,077.60	113,613,293.99
中信证券国际	51,324,111.40	51,978,514.74
新疆股权交易中心	51,655,357.02	53,172,761.10
中信证券华南	6,744,492.86	8,156,546.38
中信期货	10,731,976.80	10,626,044.11
合计	<u>4,172,933,402.70</u>	<u>4,170,667,167.39</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

43. 手续费及佣金净收入

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
证券经纪业务净收入	6,321,257,401.59	4,834,762,113.55
证券经纪业务收入	8,128,329,810.36	6,227,229,511.23
其中：代理买卖证券业务	5,867,227,377.88	5,011,752,500.90
交易单元席位租赁	831,737,893.48	513,005,777.20
代销金融产品业务	1,428,270,208.48	699,342,059.56
证券经纪业务支出	1,807,072,408.77	1,392,467,397.68
其中：代理买卖证券业务	1,806,717,910.19	1,391,256,290.25
期货经纪业务净收入	420,606,664.45	173,643,256.73
期货经纪业务收入	1,209,347,302.67	478,348,602.45
期货经纪业务支出	788,740,638.22	304,705,345.72
投资银行业务净收入	3,306,766,633.47	2,220,929,171.01
投资银行业务收入	3,497,452,260.63	2,304,806,140.03
其中：证券承销业务	3,108,644,813.51	1,959,287,492.81
证券保荐业务	93,769,339.16	44,375,894.69
财务顾问业务	295,038,107.96	301,142,752.53
投资银行业务支出	190,685,627.16	83,876,969.02
其中：证券承销业务	187,276,514.17	80,168,566.45
财务顾问业务	3,409,112.99	3,708,402.57
资产管理业务净收入	1,869,957,263.82	913,233,187.60
资产管理业务收入	1,869,957,263.82	917,233,765.48
资产管理业务支出	-	4,000,577.88
基金管理业务净收入	3,701,887,155.29	2,376,799,501.55
基金管理业务收入	3,717,545,104.25	2,381,692,506.34
基金管理业务支出	15,657,948.96	4,893,004.79
投资咨询业务净收入	128,462,068.30	174,614,889.85
投资咨询业务收入	128,462,068.30	175,205,225.78
投资咨询业务支出	-	590,335.93
其他手续费及佣金净收入	261,127,036.08	132,586,530.46
其他手续费及佣金收入	384,087,495.31	207,859,349.02
其他手续费及佣金支出	122,960,459.23	75,272,818.56
合计	16,010,064,223.00	10,826,568,650.75
其中：手续费及佣金收入合计	18,935,181,305.34	12,692,375,100.33
手续费及佣金支出合计	2,925,117,082.34	1,865,806,449.58

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

44. 利息净收入

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
利息收入		
拆出资金利息收入	4,264,041.96	1,765,386.35
买入返售利息收入	844,349,331.86	1,371,096,024.11
其中：约定式购回利息收入	-	65,953.10
股权质押回购利息收入	717,993,834.71	1,158,818,651.00
货币资金及结算备付金利息收入	3,107,851,953.20	2,437,352,451.94
融资融券利息收入	4,903,060,736.34	2,712,580,084.37
其他债权投资利息收入	869,808,967.96	332,394,822.33
其他	126,551,471.57	102,291,647.28
利息收入小计	<u>9,855,886,502.89</u>	<u>6,957,480,416.38</u>
利息支出		
代理买卖证券款利息支出	537,204,703.66	284,346,077.48
卖出回购利息支出	2,099,827,339.82	1,835,336,462.50
其中：报价回购利息支出	426,424,768.59	343,022,611.97
短期借款利息支出	114,974,644.87	140,604,430.10
拆入资金利息支出	903,123,821.77	445,811,471.77
其中：转融通利息支出	767,545,566.69	158,586,879.97
长期借款利息支出	14,142,570.65	13,209,748.82
应付债券利息支出	3,476,021,635.46	2,799,465,401.06
其中：次级债券利息支出	670,642,715.66	707,255,495.52
应付短期融资券利息支出	124,463,913.15	340,934,426.55
其他	262,589,788.98	287,401,788.59
利息支出小计	<u>7,532,348,418.36</u>	<u>6,147,109,806.87</u>
利息净收入	<u>2,323,538,084.53</u>	<u>810,370,609.51</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

45. 投资收益

投资收益明细情况

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
权益法确认的收益	427,533,871.28	91,804,295.60
处置长期股权投资产生的投资收益	-	51,352,915.91
金融工具投资收益	9,592,293,209.48	7,987,129,903.39
其中：持有期间取得的收益	6,267,650,871.62	5,931,549,144.60
处置金融工具取得的收益	3,324,642,337.86	2,055,580,758.79
合计	<u>10,019,827,080.76</u>	<u>8,130,287,114.90</u>

46. 公允价值变动收益

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
交易性金融资产	(11,545,973,239.13)	10,324,999,478.36
交易性金融负债	(1,125,351,755.88)	(2,103,546,173.21)
衍生金融工具	14,507,848,102.54	(4,464,687,866.80)
合计	<u>1,836,523,107.53</u>	<u>3,756,765,438.35</u>

47. 其他业务收入

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
大宗商品贸易收入	7,065,963,162.08	2,557,472,888.97
其他	280,992,820.23	278,784,773.80
合计	<u>7,346,955,982.31</u>	<u>2,836,257,662.77</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

48. 税金及附加

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
城市维护建设税	91,910,643.57	77,621,869.94
教育费附加及地方教育费附加	68,239,227.99	56,609,575.39
其他	50,200,270.59	51,741,137.82
合计	210,350,142.15	185,972,583.15

49. 业务及管理费

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
职工费用	10,383,395,248.89	7,506,473,837.61
基金销售及管理费用	899,148,581.36	364,577,114.15
使用权资产折旧费	330,180,829.23	340,365,576.83
电子设备运转费	302,879,351.03	279,749,406.86
折旧费	195,644,779.81	189,531,998.89
业务宣传费	156,683,099.50	84,509,357.79
差旅费	148,751,084.07	60,736,366.71
咨询费	145,033,711.43	141,236,549.10
无形资产摊销	134,659,177.23	193,578,338.09
租赁费	98,011,498.05	113,031,393.34
其他	551,313,213.22	503,705,873.69
合计	13,345,700,573.82	9,777,495,813.06

50. 信用减值损失

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
应收款项和其他应收款	61,325,401.42	181,489,495.84
买入返售金融资产	312,995,443.82	1,140,543,313.76
其他债权投资	(134,553,889.38)	229,932,784.81
融出资金	432,200,316.30	482,725,659.68
其他	19,709,980.63	-
合计	691,677,252.79	2,034,691,254.09

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

51. 其他业务成本

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
大宗商品贸易成本	6,965,665,153.77	2,458,174,819.72
出租资产折旧	75,750,332.08	80,779,379.86
其他	40,923,849.08	63,347,852.61
合计	<u>7,082,339,334.93</u>	<u>2,602,302,052.19</u>

52. 所得税费用

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
按税法及相关规定计算的当期所得税	4,096,576,777.26	2,513,878,548.58
其中：中国大陆	4,010,000,846.71	2,480,406,899.23
中国大陆以外地区	86,575,930.55	33,471,649.35
递延所得税	<u>(399,703,520.26)</u>	<u>139,601,091.85</u>
合计	<u>3,696,873,257.00</u>	<u>2,653,479,640.43</u>

53. 每股收益

基本每股收益按照归属于本公司普通股股东的当期净利润，除以发行在外的普通股的加权平均数计算。于2021年6月30日，本公司已发行股份按加权平均计算的股数为12,926,776,029股(2020年6月30日：12,792,543,825股)。基本每股收益的具体计算如下：

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
收益：		
归属于本公司普通股股东的当期净利润	12,197,983,849.06	8,925,877,416.81
股份：		
本公司发行在外普通股的加权平均数	12,926,776,029	12,792,543,825
基本每股收益	0.94	0.70

本公司无稀释性潜在普通股。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

54. 收到其他与经营活动有关的现金

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
应付款项及其他应付款增加	31,983,048,270.55	41,997,009,903.03
应收款项及其他应收款减少	413,622,060.20	20,969,407.44
其他业务收入及营业外收入	7,874,610,649.67	4,600,825,600.93
其他	2,179,301,438.61	622,534,536.22
合计	<u>42,450,582,419.03</u>	<u>47,241,339,447.62</u>

55. 支付其他与经营活动有关的现金

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
应付款项及其他应付款减少	758,204,406.80	539,704,260.48
应收款项及其他应收款增加	50,162,414,495.61	10,998,560,297.06
其他业务成本	5,359,321,302.51	3,163,191,427.56
以现金支付的营业费用	940,133,960.16	812,580,793.87
其他	857,764,733.48	3,538,873,552.21
合计	<u>58,077,838,898.56</u>	<u>19,052,910,331.18</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

56. 现金流量表补充资料

补充资料	2021年1月1日至6月30日止期间		2020年1月1日至6月30日止期间	
	合并	公司	合并	公司
1. 将净利润调节为经营活动现金流量				
净利润	12,594,349,703.65	8,526,381,791.61	9,220,264,165.64	6,180,048,920.11
加：资产及信用减值损失	739,657,000.58	669,467,130.07	2,301,105,138.28	1,823,072,593.34
固定资产、投资性房地产及使用权资产折旧	601,575,941.12	350,056,712.37	610,676,955.58	339,700,371.37
无形资产摊销	134,829,946.47	61,658,665.67	193,730,645.79	63,176,562.62
长期待摊费用摊销	45,437,333.64	30,641,195.19	50,564,015.02	32,303,594.95
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的(收益)/损失	(790,470.44)	256,865.26	1,359,605.28	578,863.73
公允价值变动(收益)/损失	(1,836,523,107.53)	1,675,178,985.51	(3,756,765,438.35)	303,379,611.88
利息支出/(收益)	3,886,087,378.79	3,340,999,106.81	3,335,608,598.49	2,792,359,032.71
汇兑损失/(收益)	(45,594,075.48)	75,382,260.58	(288,585,305.58)	(88,351,976.25)
投资损失/(收益)	(2,291,729,190.40)	(2,670,339,211.53)	(625,686,945.33)	(1,109,375,060.01)
递延所得税资产减少/(增加)	(320,068,109.68)	(160,200,780.14)	(1,119,273,137.91)	(1,068,559,651.47)
递延所得税负债增加/(减少)	(95,534,185.28)	(223,003,473.55)	1,273,607,431.94	782,302,733.84
交易性金融资产的减少/(增加)	(49,144,089,225.23)	(43,223,818,920.04)	(66,697,725,483.23)	(60,121,819,619.26)
存货的减少/(增加)	2,262,419,486.27	-	(1,357,535,247.38)	-
经营性应收项目的(增加)/减少	(18,742,960,081.50)	(26,058,488,894.37)	(11,948,824,309.69)	(7,849,762,902.74)
经营性应付项目的增加/(减少)	54,442,975,582.51	51,963,123,455.85	99,706,600,006.54	68,991,317,077.59
经营活动产生的现金流量净额	2,230,043,927.49	(5,642,705,110.71)	30,899,120,695.09	11,070,370,152.41
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动				
债务转为资本	-	-	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-	-	-
融资租入固定资产	-	-	-	-
3. 现金及现金等价物净变动情况				
现金的期末余额	297,090,020,058.13	174,213,561,010.39	222,585,097,892.65	119,317,752,657.48
减：现金的期初余额	282,856,754,711.52	169,674,443,679.08	177,822,867,101.68	107,321,586,680.16
加：现金等价物的期末余额	-	-	-	-
减：现金等价物的期初余额	-	-	-	-
现金及现金等价物净增加额	14,233,265,346.61	4,539,117,331.31	44,762,230,790.97	11,996,165,977.32

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

57. 取得子公司及其他营业单位的有关信息

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
1. 取得子公司及其他营业单位的价格	-	12,191,465,810.44
2. 取得子公司及其他营业单位支付的 现金和现金等价物	-	12,046,259.54
减：子公司及其他营业单位持有 的现金和现金等价物	-	13,738,756,869.66
3. 取得子公司及其他营业单位支付 /(取得)的现金净额	-	(13,726,710,610.12)
4. 取得子公司的净资产	-	11,258,741,686.72
其中：流动资产	-	26,546,331,811.20
非流动资产	-	1,715,968,289.35
流动负债	-	12,489,362,590.38
非流动负债	-	4,514,195,823.45

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

四、合并财务报表主要项目附注(续)

58. 现金和现金等价物

项目	2021年6月30日	2020年6月30日
一、现金		
其中：库存现金	298,026.78	347,478.89
可随时用于支付的银行存款	257,974,043,490.06	177,174,225,408.65
可随时用于支付的结算备付金	37,739,297,424.71	44,649,743,807.11
可随时用于支付的其他货币资金	1,376,381,116.58	760,781,198.00
二、现金等价物	-	-
三、期末现金及现金等价物余额	<u>297,090,020,058.13</u>	<u>222,585,097,892.65</u>

59. 外币货币性项目

中国大陆以外地区经营实体主要报表项目的折算汇率：

	2021年6月30日	2020年12月31日
美元	6.46010	6.52490
港币	0.83208	0.84164

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注

1. 长期股权投资

(1) 按类别列示

项目	2021年6月30日	2020年12月31日
子公司	42,011,623,748.92	45,091,316,599.76
联营企业	5,055,020,271.75	4,885,532,659.03
小计	47,066,644,020.67	49,976,849,258.79
减：减值准备	-	-
合计	47,066,644,020.67	49,976,849,258.79

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注(续)

1. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细

2021年1月1日至6月30日止期间

被投资单位名称	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
成本法:				
中信证券华南股份有限公司	12,154,270,660.00	-	4,995,000,000.00	7,159,270,660.00
中信证券(山东)有限责任公司	1,145,741,644.95	-	-	1,145,741,644.95
中信期货有限公司	3,949,233,557.52	2,000,000,000.00	-	5,949,233,557.52
金石投资有限公司	1,700,000,000.00	-	-	1,700,000,000.00
中信证券国际有限公司	5,759,088,337.40	-	-	5,759,088,337.40
中信证券投资有限公司	14,000,000,000.00	-	-	14,000,000,000.00
CITICS GLOBAL ABSOLUTE RETURN FUND	11,685,324.72	-	4,692,850.84	6,992,473.88
华夏基金管理有限公司	4,059,138,848.43	-	-	4,059,138,848.43
青岛中信证券培训中心	700,000.00	-	-	700,000.00
中信证券信息与量化服务(深圳)有限责任公司	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
中信证券海外投资有限公司	7,892.70	-	-	7,892.70
中信中证投资服务有限责任公司	100,000,000.00	-	-	100,000,000.00
新疆股权交易中心	60,000,000.00	-	-	60,000,000.00
天津京证物业服务有限公司	336,859,400.00	-	-	336,859,400.00
天津深证物业服务有限公司	244,869,800.00	-	-	244,869,800.00
广证领秀投资有限公司	1,340,207,488.62	-	-	1,340,207,488.62
金通证券有限责任公司	35,000,000.00	-	-	35,000,000.00
证券行业支持民企发展系列之中信证券2号单一资产管理计划	81,787,818.39	-	80,000,000.00	1,787,818.39
证券行业支持民企发展系列之中信证券4号单一资产管理计划	102,725,827.03	-	-	102,725,827.03
小计	45,091,316,599.76	2,000,000,000.00	5,079,692,850.84	42,011,623,748.92
权益法:				
中信产业投资基金管理有限公司	1,733,847,563.29	-	55,448,775.06	1,678,398,788.23
青岛蓝海股权交易中心	35,146,332.66	460,839.29	-	35,607,171.95
中信建投证券股份有限公司	3,116,538,763.08	224,475,548.49	-	3,341,014,311.57
中信标普指数信息服务(北京)有限公司	-	-	-	-
小计	4,885,532,659.03	224,936,387.78	55,448,775.06	5,055,020,271.75
合计	49,976,849,258.79	2,224,936,387.78	5,135,141,625.90	47,066,644,020.67

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注(续)

1. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

2020年度

被投资单位名称	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日
成本法：				
金通证券有限责任公司	35,000,000.00	-	-	35,000,000.00
中信证券华南股份有限公司	-	12,154,270,660.00	-	12,154,270,660.00
中信证券(山东)有限责任公司	1,151,941,641.83	-	6,199,996.88	1,145,741,644.95
中信期货有限公司	3,949,233,557.52	-	-	3,949,233,557.52
金石投资有限公司	1,700,000,000.00	-	-	1,700,000,000.00
中信证券国际有限公司	5,759,088,337.40	-	-	5,759,088,337.40
中信证券投资有限公司	14,000,000,000.00	-	-	14,000,000,000.00
CITICS Global Absolute Return Fund	36,439,037.86	-	24,753,713.14	11,685,324.72
华夏基金管理有限公司	4,059,138,848.43	-	-	4,059,138,848.43
青岛中信证券培训中心	700,000.00	-	-	700,000.00
中信证券信息与量化服务(深圳)有限责任公司	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00
中信证券海外投资有限公司	7,892.70	-	-	7,892.70
中信中证投资服务有限责任公司	100,000,000.00	-	-	100,000,000.00
新疆股权交易中心有限公司	60,000,000.00	-	-	60,000,000.00
天津京证物业服务服务有限公司	336,859,400.00	-	-	336,859,400.00
天津深证物业服务服务有限公司	244,869,800.00	-	-	244,869,800.00
广证领秀投资有限公司	-	1,340,207,488.62	-	1,340,207,488.62
证券行业支持民企发展系列之中信证券2号单一资产管理计划	2,284,500,000.00	-	2,202,712,181.61	81,787,818.39
证券行业支持民企发展系列之中信证券4号单一资产管理计划	215,500,000.00	2,712,181.61	115,486,354.58	102,725,827.03
小计	33,943,278,515.74	13,497,190,330.23	2,349,152,246.21	45,091,316,599.76

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注(续)

1. 长期股权投资(续)

(2) 长期股权投资明细(续)

2020年度(续)

被投资单位名称	2019年12月31日	本年增加	本年减少	2020年12月31日
权益法：				
中信产业投资基金管理有限公司	1,530,743,396.50	203,104,166.79	-	1,733,847,563.29
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	32,646,354.51	3,699,978.15	1,200,000.00	35,146,332.66
中信建投证券股份有限公司	2,618,699,234.73	587,809,106.33	89,969,577.98	3,116,538,763.08
中信标普指数信息服务(北京)有限公司	-	-	-	-
小计	4,182,088,985.74	794,613,251.27	91,169,577.98	4,885,532,659.03
合计	38,125,367,501.48	14,291,803,581.50	2,440,321,824.19	49,976,849,258.79

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注(续)

2. 手续费及佣金净收入

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
证券经纪业务净收入	4,483,259,782.74	3,106,039,791.59
证券经纪业务收入	5,638,796,986.79	3,963,813,469.11
其中：代理买卖证券业务	3,557,139,870.37	2,870,046,944.31
交易单元席位租赁	849,760,310.30	506,324,635.52
代销金融产品业务	1,231,896,806.12	587,441,889.28
证券经纪业务支出	1,155,537,204.05	857,773,677.52
其中：代理买卖证券业务	1,155,537,204.05	857,773,677.52
投资银行业务净收入	2,609,097,669.61	1,799,637,977.34
投资银行业务收入	2,799,783,296.77	1,882,089,946.36
其中：证券承销业务	2,461,706,221.95	1,603,099,381.48
保荐服务业务	68,152,452.83	33,983,018.87
财务顾问业务	269,924,621.99	245,007,546.01
投资银行业务支出	190,685,627.16	82,451,969.02
其中：证券承销业务	187,276,514.17	78,743,566.45
财务顾问业务	3,409,112.99	3,708,402.57
投资咨询业务净收入	113,533,596.90	171,601,928.30
投资咨询服务收入	113,533,596.90	171,601,928.30
资产管理业务净收入	1,782,439,824.45	886,417,776.83
资产管理业务收入	1,782,439,824.45	886,417,776.83
其他手续费及佣金净收入	132,836,119.98	88,239,900.64
其他手续费及佣金收入	193,338,890.24	126,345,785.04
其他手续费及佣金支出	60,502,770.26	38,105,884.40
合计	<u>9,121,166,993.68</u>	<u>6,051,937,374.70</u>
其中：手续费及佣金收入小计	10,527,892,595.15	7,030,268,905.64
手续费及佣金支出小计	1,406,725,601.47	978,331,530.94

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注(续)

3. 利息净收入

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
利息收入		
买入返售利息收入	827,735,144.92	1,292,972,024.29
其中：约定式购回利息收入	-	65,953.10
股权质押回购利息收入	716,929,136.22	1,134,541,706.33
货币资金及结算备付金利息收入	1,831,118,606.61	1,542,526,635.91
融资融券利息收入	4,239,025,476.51	2,292,059,044.85
其他债权投资利息收入	859,323,832.10	341,865,846.47
其他	343,926,059.98	270,289,522.57
利息收入小计	<u>8,101,129,120.12</u>	<u>5,739,713,074.09</u>
利息支出		
代理买卖证券款利息支出	252,723,814.80	134,975,090.01
卖出回购利息支出	1,919,208,119.16	1,615,747,762.34
其中：报价回购利息支出	353,379,510.28	299,713,586.26
拆入资金利息支出	907,539,859.38	496,554,900.37
其中：转融通利息支出	766,046,099.59	158,460,753.32
应付债券利息支出	3,193,814,126.96	2,432,966,914.26
其中：次级债券利息支出	586,201,485.75	583,248,623.38
应付短期融资券利息支出	107,253,600.04	322,564,665.96
其他	296,613,280.95	289,630,946.28
利息支出小计	<u>6,677,152,801.29</u>	<u>5,292,440,279.22</u>
利息净收入	<u>1,423,976,318.83</u>	<u>447,272,794.87</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

五、 公司财务报表主要项目附注(续)

4. 投资收益

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
权益法确认的收益	168,556,108.82	316,768,858.08
成本法确认的收益	648,238,730.29	298,526,343.97
处置长期股权投资产生的投资收益	(165,810.84)	3,974,287.67
金融工具投资收益	8,438,162,386.74	7,615,785,917.08
其中：金融工具持有期间取得的收益	5,154,468,638.11	3,682,430,275.52
处置金融工具取得的收益	3,283,693,748.63	3,933,355,641.56
合计	9,254,791,415.01	8,235,055,406.80

5. 公允价值变动收益

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
交易性金融资产	(1,115,344,761.07)	3,005,147,389.23
交易性金融负债	(771,416,698.70)	(201,290,428.56)
衍生金融工具	211,582,474.26	(3,107,236,572.55)
合计	(1,675,178,985.51)	(303,379,611.88)

6. 业务及管理费

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
职工费用	5,482,932,063.64	3,954,974,254.99
使用权资产折旧费	295,284,406.01	299,956,736.18
差旅费	113,324,315.94	49,010,788.30
投资者保护基金	85,299,773.24	68,090,517.50
咨询费	78,681,329.37	58,643,726.73
无形资产摊销	61,628,665.67	63,146,562.62
折旧费	52,781,412.70	37,752,741.53
业务招待费	37,262,233.88	17,889,288.87
租赁费	33,631,025.73	32,868,397.66
业务宣传费	31,422,776.35	18,186,240.60
其他	176,200,473.29	162,606,803.90
合计	6,448,448,475.82	4,763,126,058.88

六、 合并范围的变更

1. 纳入合并范围的结构化主体

本集团对结构化主体是否应纳入合并范围进行判断，包括本公司或本公司子公司作为管理人的结构化主体和本公司或本公司子公司投资的由其他机构发行的结构化主体。

本集团对于本公司或本公司子公司作为管理人的结构化主体和本公司或本公司子公司投资的由其他机构发行的由本公司或本公司子公司作为投资顾问制定投资决策的结构化主体拥有权力。本集团参与该等结构化主体的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。于2021年6月30日，共有27只产品因本集团享有的可变回报重大而纳入本集团财务报表的合并范围(2020年12月31日：24只)。

2021年6月30日，本集团纳入合并财务报表范围的结构化主体的总资产账面价值为人民币33,014,479,179.31元(2020年12月31日：人民币13,456,906,604.45元)，总负债账面价值为人民币1,519,644,025.57元(2020年12月31日：人民币97,638,278.89元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益

1. 在子公司中的权益

本集团重要子公司的情况如下：

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
金石投资有限公司	全资子公司	北京市	金剑华	实业投资、投资咨询、管理	300,000 万元	实业投资、投资咨询、管理
中信证券国际有限公司	全资子公司	香港	不适用	控股、投资	不适用	控股、投资
中信证券投资有限公司	全资子公司	山东省青岛市	张佑君	金融产品投资、证券投资、股权投资	1,400,000 万元	金融产品投资、证券投资、股权投资
CITICS Global Absolute Return Fund	全资子公司	开曼群岛	不适用	境外组合对冲基金、投资基金	不适用	境外二级市场组合对冲基金投资
CITIC Securities Finance 2013 Co., Ltd.	全资子公司	英属维尔京群岛	不适用	发行债券	不适用	发行债券
CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.	全资子公司	英属维尔京群岛	不适用	发行债券	不适用	发行债券
CITIC Securities Regal Holding Limited	全资子公司	英属维尔京群岛	不适用	投资控股	不适用	投资控股
青岛中信证券培训中心	全资子公司	山东省青岛市	杜平	业务培训	100 万元	在职人员培训；业内技能及后续教育；各类培训咨询；业内会议承办
中信证券信息与量化服务(深圳)有限责任公司	全资子公司	广东省深圳市	宋群力	计算机软硬件的技术开发；技术咨询；技术服务；系统集成和销售；数据处理(不含限制项目)	1,000 万元	计算机软硬件的技术开发；技术咨询；技术服务；系统集成和销售；数据处理(不含限制项目)
中信证券海外投资有限公司	全资子公司	香港	不适用	控股、投资	不适用	控股、投资
金通证券有限责任公司	全资子公司	浙江省杭州市	李勇进	证券经纪	13,500 万元	证券经纪(限浙江省苍南县、天台县)；证券投资咨询(限浙江省苍南天台县的证券投资顾问业务)；融资融券(限浙江省苍南县、天台县)

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
中信中证投资服务有限责任公司	全资子公司	广东省深圳市	吴俊文	投资管理、咨询服务，金融外包服务	10,000 万元	受托管理股权投资基金(不得从事证券投资活动，不得以公开方式募集资金开展投资活动；不得从事公开募集基金管理业务)等
新疆股权交易中心有限公司	控股子公司	乌鲁木齐	钱炜	金融业	11,000 万元	为非上市公司的股权、债券、资产和相关金融产品及其衍生品的挂牌、转让、登记、托管、融资、结算、过户等提供场所、设施和服务；组织和监督市场活动；发布市场信息；为各类市场参与主体提供投融资对接、培训咨询、人力资源等综合性服务
青岛金石暴风投资咨询有限公司	全资子公司	山东省青岛市	陈虹	投资管理、咨询服务	5,010 万元	以自有资金对外投资及管理、以及投资咨询服务
青岛金石润汇投资管理有限公司	全资子公司	山东省青岛市	陈平进	投资管理、咨询服务，以自有资金对外投资	1,010 万元	投资管理，投资咨询，以自有资金对外投资
青岛金石灏纳投资有限公司	全资子公司	山东省青岛市	王丽平	投资管理、咨询服务，以自有资金对外投资	80,500 万元	投资管理，投资咨询，以自有资金对外投资
金津投资(天津)有限公司	全资子公司	天津市	陈平进	投资	10,000 万元	以自有资金对工业，商业，农业，文化产业，医药行业，建筑工程业，制造业，高科技行业，生物工业，仓储运输业进行投资
中信金石基金管理有限公司	全资子公司	天津市	陈平进	投资、投资管理及咨询	10,000 万元	筹集并管理客户资金进行股权投资，为客户提供股权投资的财务顾问服务，投资管理及相关咨询，使用自有资金对境内企业进行股权投资，中国证监会同意的其他业务

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
金石泽信投资管理有限公司	全资子公司	广东省深圳市	张长义	投资管理、投资咨询、投资顾问、受托管理股权投资基金	100,000 万元	投资管理(不含限制项目); 投资咨询(不含限制项目); 投资顾问(不含限制项目); 受托管理股权投资基金; 创业投资; 创业投资咨询; 物业管理; 自有物业租赁; 酒店管理; 建筑装饰材料的购销
中信并购基金管理有限公司	全资子公司	广东省深圳市	胡柏风	投资管理、咨询服务	10,000 万元	股权投资基金管理; 受托资产管理; 发起设立股权投资基金; 投资咨询; 提供股权投资的财务顾问服务
中信并购投资基金(深圳)合伙企业(有限合伙)	控股子公司	广东省深圳市	不适用	投资、咨询服务	不适用	发起和设立股权投资基金(不含私募证券投资基金); 股权投资、投资管理、投资咨询服务(以上不含限制项目)
金石博信投资管理有限公司	全资子公司	广东省深圳市	陈平进	投资管理、投资咨询	50,000 万元	投资管理(不含限制项目); 投资咨询(不含限制项目); 投资顾问(不含限制项目); 受托管理股权投资基金(不得以任何方式公开募集和发行基金)
三峡金石私募基金管理有限公司	控股子公司	湖北省武汉市	张佑君	投资管理	10,000 万元	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务(不含国家法律法规、国务院决定限制和禁止的项目; 不得以任何方式公开募集和发行基金; 不得从事吸收公众存款或变相吸收公众存款, 不得从事发放贷款等金融业务)
安徽信安并购私募基金管理有限公司	控股子公司	安徽省合肥市	陈平进	投资管理	2,000 万元	投资管理; 股权投资基金管理; 证券投资基金管理; 受托资产管理; 发起设立股权投资基金; 发起设立证券投资基金; 提供股权投资的财务顾问服务

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
金石泮投资管理(杭州)有限公司	全资子公司	浙江省 杭州市	陈平进	投资管理	3,000 万元	投资管理、投资咨询
安徽交控金石私募基金管理有限公司	控股子公司	安徽省 合肥市	陈平进	投资与资产管理	3,000 万元	股权投资基金管理、证券投资基金管理、资产管理；发起设立股权投资基金、发起设立证券投资基金
中证寰球商贸(上海)有限公司	全资子公司	上海市	方兴	从事货物及技术的进出口业务，转口贸易，区内企业间的贸易及贸易代理，区内商业性简单加工，国内货物运输代理，商务咨询服务，自有设备租赁	100,000 万元	从事货物及技术的进出口业务，转口贸易，区内企业间的贸易及贸易代理，区内商业性简单加工，国内货物运输代理，商务咨询服务，自有设备租赁

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
中信中证资本管理有限公司	全资子公司	上海市	方兴	投资与资产管理	200,000 万元	资产管理、投资管理、投资咨询、实业投资、经营进出口业务、数据处理、软件服务、贸易、贸易经纪与代理、掉期、期权及其他套期保值、仓单服务、合作套保、定价服务和基差交易
盈蒨(上海)资产管理有限公司	全资子公司	上海市	朱琳	资产管理	20,000 万元	资产管理
信期国际金融控股有限公司	全资子公司	香港	不适用	控股	30,000 万元	控股
CSI Corporate Finance (HK) Limited	全资子公司	香港	不适用	投资银行业务	不适用	投资银行业务
CSI AMC Company Limited	全资子公司	香港	不适用	投资服务	不适用	投资服务
CSI Principal Investment Holding Limited	全资子公司	英属维京群岛	不适用	投资控股	5 万美元	投资控股
CLSA Europe B.V.	全资子公司	荷兰	不适用	投资银行业务、证券经纪业务	75 万欧元	投资银行业务、证券经纪业务
上海华夏财富投资管理有限公司	全资子公司	上海市	毛淮平	资产管理	2,000 万元	证券投资基金销售业务及证监会许可的其他业务，投资管理，资产管理，投资咨询
新疆小微金融服务中心有限公司	控股子公司	新疆乌鲁木齐	钱炜	金融产品的研究开发、组合设计、咨询服务等	182 万元	金融产品的研究开发、组合设计、咨询服务等

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	期末实际出资额	持股比例(%)		表决权比例(%)		是否合并报表
		直接	间接	直接	间接	
金石投资有限公司	170,000 万元	100%	-	100%	-	是
中信证券国际有限公司	651,605 万港元	100%	-	100%	-	是
中信证券投资有限公司	1,400,000 万元	100%	-	100%	-	是
CITICS Global Absolute Return Fund	137.94 万美元	82.03%	17.97%	不适用	不适用	是
CITIC Securities Finance 2013 Co., Ltd.	1 美元	-	100%	-	100%	是
CITIC Securities Finance MTN Co., Ltd.	1 美元	-	100%	-	100%	是
CITIC Securities Regal Holding Limited	1 美元	-	100%	-	100%	是
青岛中信证券培训中心	100 万元	70%	30%	70%	30%	是
中信证券信息与量化服务(深圳)有限责任公司	1,000 万元	100%	-	100%	-	是
中信证券海外投资有限公司	10,000 港元	100%	-	100%	-	是
金通证券有限责任公司	3,500 万元	100%	-	100%	-	是
中信中证投资服务有限责任公司	10,000 万元	100%	-	100%	-	是
新疆股权交易中心有限公司	6,000 万元	54.55%	-	54.55%	-	是
青岛金石暴风投资咨询有限公司	5,010 万元	-	100%	-	100%	是

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	期末实际出资额	持股比例(%)		表决权比例(%)		是否合并报表
		直接	间接	直接	间接	
青岛金石润汇投资管理有限公司	1,010 万元	-	100%	-	100%	是
青岛金石灏纳投资有限公司	200,000 万元	-	100%	-	100%	是
金津投资(天津)有限公司	50,000 万元	-	100%	-	100%	是
中信金石基金管理有限公司	10,000 万元	-	100%	-	100%	是
金石泽信投资管理有限公司	100,000 万元	-	100%	-	100%	是
中信并购基金管理有限公司	10,000 万元	-	100%	-	100%	是
中信并购投资基金(深圳)合伙企业(有限合伙)	85,354.10 万元	-	25.25%	-	25.25%	是
金石博信投资管理有限公司	-	-	100%	-	100%	是
三峡金石私募基金管理有限公司	6,000 万元	-	60%	-	60%	是
安徽信安并购私募基金管理有限公司	1,600 万元	-	80%	-	80%	是
金石沣纳投资管理(杭州)有限公司	-	-	100%	-	100%	是
安徽交控金石私募基金管理有限公司	1,050 万元	-	70%	-	70%	是

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(1) 通过设立或投资等方式取得的子公司(续)

子公司全称	期末实际出资额	持股比例(%)		表决权比例(%)		是否合并报表
		直接	间接	直接	间接	
中证寰球商贸(上海)有限公司	40,000 万元	-	100%	-	100%	是
中信中证资本管理有限公司	100,000 万元	-	100%	-	100%	是
盈蒔(上海)资产管理有限公司	10,000 万元	-	100%	-	100%	是
信期国际金融控股有限公司	30,000 万元	-	100%	-	100%	是
CSI Corporate Finance (HK) Limited	38,000 万港元	-	100%	-	100%	是
CSI AMC Company Limited	1 港元	-	100%	-	100%	是
CSI Principal Investment Holding Limited	1 美元	-	100%	-	100%	是
CLSA Europe B.V.	75 万欧元	-	100%	-	100%	是
上海华夏财富投资管理有限公司	2,000 万元	-	62.20%	-	62.20%	是
新疆小微金融服务中心有限公司	91 万元	-	54.55%	-	54.55%	是

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(2) 通过非同一控制下企业合并取得的子公司

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
中信证券(山东)有限责任公司	全资子公司	山东省青岛市	冯恩新	证券业务	249,380万元	中国保监会批准的人身险和财产险(航意险及替代产品除外); 外币有价证券经纪业务; 证券经纪(限山东省、河南省); 证券投资咨询(限山东省、河南省的证券投资顾问业务); 融资融券; 证券投资基金代销; 为期货公司提供中间介绍业务; 代销金融产品(限山东省、河南省)
中信期货有限公司	全资子公司	广东省深圳市	张皓	期货经纪、资产管理、基金代销业务	560,000万元	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
华夏基金管理有限公司	控股子公司	北京市	杨明辉	基金管理	23,800万元	基金募集; 基金销售; 资产管理; 从事特定客户资产管理业务; 中国证监会核准的其他业务
天津京证物业服务服务有限公司	全资子公司	天津市	田兴农	房地产业	30万元	对自有房屋的物业服务, 自有房屋租赁, 企业管理咨询(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)
天津深证物业服务服务有限公司	全资子公司	天津市	田兴农	房地产业	30万元	对自有房屋的物业服务, 自有房屋租赁, 企业管理咨询(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)
中信证券华南股份有限公司	全资子公司	广东省深圳市	胡伏云	证券业务	509,113.7318万元	证券经纪; 证券投资咨询(仅限于证券投资顾问业务); 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问; 证券承销与保荐; 证券自营; 证券资产管理; 融资融券; 证券投资基金代销; 代销金融产品

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(2) 通过非同一控制下企业合并取得的子公司(续)

子公司全称	子公司类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	经营范围
广州广证恒生证券研究所有限公司	控股子公司	广东省广州市	王伟	研究咨询	4,468万元	资本市场服务
广证领秀投资有限公司	全资子公司	广东省深圳市	方浩	另类投资	155,000万元	实业项目投资(具体项目另行申报);股权投资;投资管理(不得从事信托、金融资产管理、证券资产管理等业务);投资顾问、投资咨询、财务顾问咨询(以上不含限制项目);金融信息咨询(根据法律法规、行政法规、国务院决定等规定需要审批的,依法取得相关审批文件后方可经营)。
广州证券创新投资管理有限公司	全资子公司	广东省广州市	金剑华	资本市场服务	50,000万元	企业自有资金投资;投资咨询服务;企业财务咨询服务;
深圳前海领秀资本投资管理有限公司	控股子公司	广东省深圳市	卢振宁	投资管理、投资顾问、投资咨询、股权投资、财务顾问咨询、金融信息咨询。	1,000万元	投资管理、投资顾问、投资咨询、股权投资、财务顾问咨询、金融信息咨询服务。
金尚(天津)投资管理有限公司	全资子公司	天津市	陈平进	投资管理、咨询服务	1,250万元	投资管理服务;企业管理咨询;商务信息咨询;财务顾问
华夏基金(香港)有限公司	全资子公司	香港	不适用	资产管理	20,000万港元	提供资产管理,就证券提供意见
华夏资本管理有限公司	全资子公司	广东省深圳市	骆红艳	资产管理	35,000万元	特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务
CLSA Premium Limited	控股子公司	开曼群岛	不适用	杠杆式外汇交易及其他交易、现金交易业务及其他服务	不适用	杠杆式外汇交易及其他交易、现金交易业务及其他服务
CSI Capricornus Limited	全资子公司	英属维尔京群岛	不适用	股权投资	50,000美元	股权投资
里昂证券	全资子公司	荷兰	不适用	投资控股	不适用	投资控股

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

本集团重要子公司的情况如下(续):

(2) 通过非同一控制下企业合并取得的子公司(续)

子公司全称	期末实际出资额	持股比例(%)		表决权比例(%)		是否合并报表
		直接	间接	直接	间接	
中信证券(山东)有限责任公司	114,574 万元	100%	-	100%	-	是
中信期货有限公司	594,923.36 万元	100%	-	100%	-	是
华夏基金管理有限公司	266,395 万元	62.20%	-	62.20%	-	是
天津京证物业服务有限公司	33,685.94 万元	100%	-	100%	-	是
天津深证物业服务有限公司	24,486.98 万元	100%	-	100%	-	是
中信证券华南股份有限公司	716,773 万元	99.90%	0.10%	99.90%	0.10%	是
广州广证恒生证券研究所有限公司	2,993.56 万元	-	67%	-	67%	是
广证领秀投资有限公司	155,000 万元	100%	-	100%	-	是
广州证券创新投资管理有限公司	50,000 万元	-	100%	-	100%	是
深圳前海领秀资本投资管理有限公司	1,000 万元	-	100%	-	100%	是
金尚(天津)投资管理有限公司	1,858.98 万元	-	100%	-	100%	是
华夏基金(香港)有限公司	20,000 万港元	-	62.20%	-	62.20%	是
华夏资本管理有限公司	35,000 万元	-	62.20%	-	62.20%	是
CLSA Premium Limited	78,020 万港元	-	59%	-	59%	是
CSI Capricornus Limited	-	-	100%	-	100%	是
里昂证券	109,030 万美元	-	100%	-	100%	是

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

1. 在子公司中的权益(续)

存在重要少数股东权益的子公司如下：

2021年1月1日至6月30日止期间

	少数股东 持股比例	归属少数 股东损益	向少数股东 支付股利	期末累计少 数股东权益
华夏基金管理有限公司	37.80%	396,412,301.58	380,080,078.28	3,795,068,059.00

2020年度

	少数股东 持股比例	归属少数 股东损益	向少数股东 支付股利	年末累计少 数股东权益
华夏基金管理有限公司	37.80%	603,863,570.07	181,419,546.66	3,782,390,817.33

下表列示了华夏基金管理有限公司主要财务信息。这些信息为本集团内各企业之间相互抵消前的金额：

	2021年1月1日至 6月30日止期间 (未经审计)	2020年度 (经审计)
资产	14,105,865,473.08	13,694,617,408.84
负债	4,066,002,883.14	3,688,292,495.27
营业收入	3,651,947,195.41	5,539,135,267.47
净利润	1,048,709,792.53	1,597,522,672.14
综合收益合计	1,039,040,528.95	1,541,791,698.76
经营活动产生的现金流量净额	1,073,488,378.30	790,062,592.01

根据《修改基金管理公司提取风险准备金有关问题的通知》，华夏基金管理有限公司按照基金管理费收入的10%计提风险准备金，该部分资金使用受到限制。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

2. 在合营企业和联营企业中的权益

合营企业：

	注册地	业务性质	注册资本	持股比例(%)		会计处理
				直接	间接	
中信标普指数信息服务(北京)有限公司	北京市	金融服务业	802.70万元	50%	-	权益法
Double Nitrogen Fund GP, Limited	开曼群岛	投资管理	5万美元	-	48%	权益法
Sino-Ocean Land Logistics Investment Management Limited	开曼群岛	资产管理	5万美元	-	50%	权益法
CSOBOR Fund GP Limited	开曼群岛	资产管理	5万美元	-	49%	权益法
Merchant Property Limited	根西岛	置业投资	725万英镑	-	50%	权益法
Bright Lee Capital Limited	英属维尔京群岛	资产管理	5万美元	-	48%	权益法
Sunrise Capital Holdings IV Limited	开曼群岛	资产管理	5万美元	-	50%	权益法
Kingvest Limited	开曼群岛	资产管理	500,000万日元	-	44.85%	权益法

联营企业：

	注册地	业务性质	注册资本	持股比例(%)		会计处理
				直接	间接	
中信产业投资基金管理有限公司	四川省绵阳市	投资基金管理	180,000万元	35%	-	权益法
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	山东省青岛市	股权交易	10,000万元	24%	16%	权益法
中信建投证券股份有限公司	北京市	证券经纪、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销等。	775,669.4797万元	4.9357%	-	权益法
北京金石农业投资基金管理中心(有限合伙)	北京市	基金管理	3,000万元	-	33%	权益法

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

2. 在合营企业和联营企业中的权益(续)

联营企业(续):

	注册地	业务性质	注册资本	持股比例(%)		会计处理
				直接	间接	
北京农业产业投资基金(有限合伙)	北京市	投资	62,000万元	-	32.26%	权益法
西安明日宇航工业有限责任公司	陕西省西安市	航天航空机加零部件、钣金零部件的制造；型架、夹具、模具、航空航天地面设备(许可项目除外)的制造。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可展开经营活动)一般经营项目：型架、夹具、模具、航空航天地面设备(许可项目除外)的研发、设计；系统内员工培训；液压、电子系统的研发与技术服务	5,000万元	-	35%	权益法
深圳市信融客户服务俱乐部有限公司	广东省深圳市	金融服务业	1,000万元	-	25%	权益法
苏宁金石(天津)基金管理有限公司	天津市	受托管理股权投资企业，从事投资管理及相关咨询服务	5,000万元	-	40%	权益法
泰富金石(天津)基金管理有限公司	天津市	受托管理股权投资企业，从事投资管理及相关咨询服务	5,000万元	-	40%	权益法
信保(天津)股权投资基金管理有限公司	天津市	受托管理股权投资基金，从事投融资管理及相关咨询服务	10,000万元	-	33%	权益法
中证基金管理有限公司	山东省青岛市	投资咨询(不含金融、证券、期货)，投资管理，股权投资，自有资金对外投资。(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)	11,000万元	-	29%	权益法

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

2. 在合营企业和联营企业中的权益(续)

联营企业(续):

	注册地	业务性质	注册资本	持股比例(%)		会计处理
				直接	间接	
深圳前海基础设施投资基金管理有限公司	广东省深圳市	基金管理	30,000万元	-	11.67%	权益法
赛领国际投资基金(上海)有限公司	上海市	投资, 投资管理, 投资咨询	536,000万元	-	11.10%	权益法
赛领资本管理有限公司	上海市	股权投资管理, 股权投资, 投资管理, 投资咨询	28,050万元	-	9.09%	权益法
西藏信昇股权投资合伙企业(有限合伙)	西藏自治区	私募股权投资	309,650万元	-	10.35%	权益法
CITICPE Holdings Limited	英属维尔京群岛	资产管理	2,200万美元	-	35%	权益法
Aria Investment Partners III, L.P.	开曼群岛	私募股权基金	不适用	-	14%	权益法
Aria Investment Partners IV, L.P.	开曼群岛	私募股权基金	不适用	-	39.14%	权益法
Aria Investment Partners V, L.P.	开曼群岛	私募股权基金	不适用	-	45.45%	权益法
Clean Resources Asia Growth Fund L.P.	开曼群岛	对冲基金	不适用	-	17.59%	权益法
Fudo Capital II, L.P.	开曼群岛	房地产基金	不适用	-	6.13%	权益法
Fudo Capital III, L.P.	开曼群岛	房地产基金	不适用	-	5%	权益法
Fudo Capital IV, L.P.	开曼群岛	房地产基金	不适用	-	2.65%	权益法
Sunrise Capital II, L.P.	开曼群岛	私募股权基金	不适用	-	23.99%	权益法
Sunrise Capital III, L.P.	开曼群岛	私募股权基金	不适用	-	6.08%	权益法
Sunrise Capital IV, L.P.	开曼群岛	私募股权基金	不适用	-	5.49%	权益法
CLSA Aviation Private Equity Fund I	韩国	直接投资基金	不适用	-	6.86%	权益法
CLSA Aviation Private Equity Fund II	韩国	直接投资基金	不适用	-	0.08%	权益法

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

2. 在合营企业和联营企业中的权益(续)

联营企业(续):

	注册地	业务性质	注册资本	持股比例(%)		会计处理
				直接	间接	
CLSA Aviation II Investments (Cayman) Limited	开曼群岛	直接投资基金	不适用	-	12.39%	权益法
CT CLSA Holdings Limited	斯里兰卡	投资控股	50,000万卢比	-	25%	权益法
Pan Asia Realty Ltd.	开曼群岛	资产管理	1,000万美元	-	30%	权益法
CLSA Infrastructure Private Equity Fund I	韩国	资产管理	不适用	-	0.14%	权益法
CSOBOR Fund, L.P.	开曼群岛	资产管理	不适用	-	25.10%	权益法
Holisol Logistics Private Ltd.	印度	资产管理	1,080万卢比	-	20.29%	权益法
Alfalah Securities (Private) Limited	巴基斯坦	投资银行业务、证券经纪业务	40,000万卢比	-	24.90%	权益法
Pine Tree Special Opportunity FMC LLC	开曼群岛	基金管理	不适用	-	50%	权益法
CLSA Real Estate Limited	开曼群岛	房地产投资顾问	5万美元	-	40%	权益法
Lending Ark Asia Secured Private Debt Fund I (Non-US), LP	开曼群岛	资产管理	不适用	-	22.16%	权益法
Lending Ark Asia Secured Private Debt Holdings Limited	开曼群岛	资产管理	5万美元	-	30%	权益法

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

七、 在其他主体中的权益(续)

2. 在合营企业和联营企业中的权益(续)

中信产业投资基金管理有限公司，作为本集团重要的联营公司，主要从事投资基金管理，并采用权益法核算。相关未经审计财务信息如下(均以人民币百万元列示)：

项目	2021年1月1日至 6月30日止期间	2020年度
资产	5,073.54	5,404.92
负债	278.12	451.07
按持股比例享有的净资产份额	1,678.40	1,733.85
投资的账面价值	1,678.40	1,733.85
营业收入	(5.92)	771.83
净利润	(156.69)	446.33
综合收益合计	(156.69)	446.33
收到的股利	-	-

中信建投证券股份有限公司，作为本集团重要的联营公司，主要从事证券经纪、证券投资咨询等业务，采用权益法核算。相关财务信息如下(均以人民币百万元列示)：

项目	2021年1月1日至 6月30日止期间 (未经审计)	2020年度 (经审计)
资产	404,024.07	371,228.14
按持股比例享有的净资产份额	3,164.44	3,343.21
投资的账面价值	3,341.01	3,116.54
归属于母公司股东的净利润	4,529.13	9,509.43
收到的股利	-	89.97

八、金融工具风险管理

概况

公司始终认为，有效的风险管理和内部控制对公司的成功运作至关重要。通过实施全面的风险管理机制和内部控制流程，公司对业务活动中的金融、操作、合规、法律风险进行监测、评估与管理，对子公司通过业务指导、运营支持、决策管理等不同模式进行垂直的风险管理。

根据各类法律法规及监管要求，公司建立了完整有效的治理结构体系。公司股东大会、董事会和监事会根据《公司法》、《证券法》、公司《章程》履行职权，对公司的经营运作进行监督管理。董事会通过加强对内部控制有关工作的安排、完善公司的内部控制环境和内部控制结构，使内部控制与风险管理成为公司决策的必要环节。

风险管理架构

公司董事会下设的风险管理委员会，经营管理层下设的专业委员会，相关内部控制部门与业务部门/业务线共同构成公司风险管理的主要组织架构，形成由委员会进行集体决策、内部控制部门与业务部门/业务线密切配合，较为完善的三层次风险管理体系，从审议、决策、执行和监督等方面管理风险。在部门和业务线层面，确立了由业务部门/业务线承担风险管理的首要责任、风险管理部及合规部等内部控制部门对各类风险进行专业化管理、稽核审计部负责事后监督与评价的风险管理三道防线。

第一层：董事会

董事会风险管理委员会对公司的总体风险管理进行监督，并将之控制在合理的范围内，以确保公司能够对与经营活动相关联的各种风险实施有效的风险管理计划；制定总体风险管理政策供董事会审议；规定用于公司风险管理的战略结构和资源，并使之与公司的内部风险管理政策相兼容；制定重要风险的界限；对相关的风险管理政策进行监督、审查和向董事会提出建议。

第二层：经营管理层

公司设立资产负债管理委员会。该委员会在公司董事会和经营管理层的授权范围内，对涉及公司自有资金运用的重要事项及相关制度进行决策审批，利用科学、规范的管理手段，坚持稳健的原则，严格控制和管理风险，在保证公司资金安全的基础上，优化资产配置，提高资金使用效率。

公司设立资本承诺委员会。该委员会在公司董事会和经营管理层的授权范围内，对承销业务的资本承诺进行最终的风险审查和审批，所有可能动用公司资本的企业融资业务均需要经过资本承诺委员会批准，确保企业融资业务风险的可承受性和公司资本的安全。

八、 金融工具风险管理(续)

风险管理架构(续)

公司设立风险管理委员会。该委员会向公司董事会风险管理委员会、公司经营管理层汇报，并在授权范围内，负责公司日常的风险监控和管理工作，对涉及风险管理的重要事项及相关制度进行决策审批，制定风险限额。风险管理委员会下设风险管理工作小组和声誉风险管理工作小组，其中，风险管理工作小组是负责对公司买方业务的金融风险实行日常监控管理的协调决策机构，推进落实公司风险管理委员会的决策。风险管理工作小组在定期工作会议的机制上，针对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险分别设置由专岗风险管理专家牵头、主要涉及业务部门/业务线参与的专项工作组，通过建立执行层面的协调机制，及时响应日常监控所发现的待处理事项或上级机构制订的决策事项。声誉风险管理工作小组是声誉风险的日常管理机构，负责建立相关制度和管理机制，防范和识别声誉风险，主动、有效地应对和处置声誉事件，最大程度地减少负面影响。

公司任命首席风险官负责协调全面风险管理工作。

公司设立产品委员会。产品委员会在公司董事会和经营管理层的授权范围内，对公司产品与服务业务进行统一规划、部署及决策，对公司发行或销售产品、提供相关服务进行审批，是公司金融产品准入与适当性管理的决策机构。产品委员会下设风险评估小组、适当性管理小组和指数专业委员会。风险评估小组负责公司代销产品的委托人资格审查，负责组织产品评估的具体工作，制定公司产品或服务风险分级的标准和方法，对产品或服务进行风险评估与风险评级，督促存续期管理等工作。适当性管理小组负责制定投资者分类的标准、对投资者进行适当性匹配的原则和流程，督促各部门落实投资者适当性管理工作，组织开展适当性培训和公司级别的适当性自查及整改，督促建立并完善投资者适当性评估数据库等适当性管理相关的工作。指数专业委员会负责对公司自创指数业务的规划和运维进行统一的管理，具体包括制定公司指数业务开展和运维的制度与标准，明确风险事件的处理预案和责任机制，规划公司指数业务布局，对公司自创指数进行上线审核等工作。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

风险管理架构(续)

第三层：部门/业务线

在部门和业务线层面，公司对前、中、后台进行了分离，分别行使不同的职责，建立了相应的制约机制，形成由业务部门/业务线、风险管理部及合规部等内部控制部门、稽核审计部共同构筑的风险管理三道防线。

公司的前台业务部门/业务线作为公司风险管理的第一道防线，承担风险管理的第一线责任，负责建立各项业务的业务管理制度与风险管理制度，对业务风险进行监控、评估、报告，并将业务风险控制在授权范围内。

公司风险管理部、合规部等内部控制部门是公司风险管理的第二道防线，其中：

公司风险管理部对公司面临的风险进行识别、测量、分析、监控、报告和管理，分析、评价公司总体及业务线风险，对优化公司的风险资源配置提出建议；协助公司风险管理委员会制订公司的风险限额等风险管理指标，监控、报告风险限额等指标的执行情况；建立和完善业务风险在前台、风险管理部门、经营管理层间的快速报告、反馈机制，定期向经营管理层全面揭示公司的整体风险状况，为公司风险管理提供建议；建立健全压力测试，为公司重大决策和日常经营调整提供依据，并满足监管要求；对新产品、新业务进行事前的风险评估和控制设计。

公司合规部组织拟订并实施公司合规管理的基本制度；为公司经营管理层及各部门/业务线和分支机构提供合规建议及咨询，并对其经营管理活动的合法合规性进行监督；督导公司各部门/业务线和分支机构根据法律法规和准则的变化，评估、制定、修订、完善内部管理制度和业务流程；对公司内部管理制度、重大决策、新产品、新业务及重要业务活动等进行事前合规审查；履行向监管部门定期、临时报告义务；依据公司反洗钱有关制度，组织开展洗钱风险防控工作等。

公司法律部负责控制公司及相关业务的法律风险等。

公司董事会办公室会同总经理办公室、风险管理部、合规部、人力资源部、法律部、信息技术中心、稽核审计部及相关部门，共同推进管理公司的声誉风险。

公司信息技术中心负责管理公司的信息技术风险。

公司稽核审计部是公司风险管理的第三道防线，全面负责内部稽核审计，计划并实施对公司各部门/业务线、子公司及分支机构的内部审计工作，监督内部控制制度的执行情况，防范各种道德风险和政策风险，协助公司对突发事件进行核查。

其他内部控制部门分别在各部门职责范围内行使相应的风险管理职能。

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险

信用风险是指因借款人、交易对手或持仓金融头寸的发行人无法履约或信用资质恶化而带来损失的风险。

本集团的信用风险主要来自四个方面：一是经纪业务代理客户买卖证券及进行期货交易，若没有提前要求客户依法缴足交易保证金，在结算当日客户的资金不足以支付交易所需的情况下，或客户资金由于其他原因出现缺口，本集团有责任代客户进行结算而造成损失的风险；二是融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购等证券融资类业务的信用风险，指由于客户未能履行合同约定而带来损失的风险；三是信用类产品投资的违约风险，即所投资信用类产品之融资人或发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致资产损失和收益变化的风险；四是利率互换、股票收益互换、场外期权、远期交易等场外衍生品交易的对手方违约风险，即交易对手方到期未能按照合同约定履行相应支付义务的风险。

公司通过内部信用评级体系对交易对手或发行人的信用级别进行评估，采用压力测试、敏感性分析等手段进行计量，并基于这些结果通过授信制度来管理信用风险。同时，公司通过信息管理系统对信用风险进行实时监控，跟踪业务品种及交易对手的信用风险状况、出具分析及预警报告并及时调整授信额度。

在中国境内代理客户进行的证券交易均以全额保证金结算，很大程度上控制了交易业务相关的结算风险。

证券融资类业务的信用风险主要涉及客户提供虚假资料、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、交易行为违反监管规定、提供的担保物资产涉及法律纠纷等。公司主要通过对客户风险教育、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式，控制此类业务的信用风险。

信用类产品投资方面，对于私募类投资，公司制定了产品准入标准和投资限额，通过风险评估、风险提示和司法追索等方式对其信用风险进行管理；对于公募类投资，公司通过交易对手授信制度针对信用评级制定相应的投资限制。

场外衍生品交易的交易对手主要为金融机构或其他专业机构，主要涉及交易对手未能按时付款、在投资发生亏损时未能及时补足保证金、交易双方计算金额不匹配等风险。公司对交易对手设定保证金比例和交易规模限制，通过每日盯市、追保、强制平仓等手段来控制交易对手的信用风险敞口，并在出现强制平仓且发生损失后通过司法程序进行追索。

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

预期信用损失计量

对于以摊余成本计量的金融资产(包括融出资金、买入返售金融资产等)、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益计量的金融资产(包括其他债权投资)及融出证券，其预期信用损失的计量中使用了模型和假设。这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况和客户的信用行为(例如，客户违约的可能性及相应损失)。

对纳入预期信用损失计量的金融工具，本公司运用自金融工具初始确认之后信用质量发生“三阶段”变化的减值模型分别计量预期信用损失，具体包括：

- 自初始确认后信用风险未发生显著增加的金融工具进入“阶段一”，且本公司对其信用风险进行持续监控。
- 如果识别出自初始确认后信用风险发生显著增加，但并未将其视为已发生信用减值的工具，则本公司将其转移至“阶段二”。
- 对于已发生信用减值的金融工具，则划分为“阶段三”。

阶段一金融工具按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，阶段二和阶段三金融工具按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。购入或源生已发生信用减值的金融资产是指在初始确认时即存在信用减值的金融资产。这些金融资产按照相当于该金融资产整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

对于阶段一和阶段二的债券投资类金融资产(即其他债权投资)及融资类金融资产(包括融出资金、融出证券、买入返售金融资产中的股票质押式回购及约定购回式证券)，管理层运用包含违约概率(PD)、违约损失率(LGD)、违约风险敞口(EAD)及损失率比率(LR)等关键参数的风险参数模型法评估损失准备。对于阶段三已发生信用减值的上述金融工具，通过预估未来与该金融工具相关的现金流，计量损失准备。上述阶段一、阶段二以及阶段三金融工具的减值评估，管理层均考虑了前瞻性因素。

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

预期信用损失计量(续)

预期信用损失计量的参数、假设及估计技术

本公司根据会计准则的要求在预期信用损失计量中使用了判断、假设和估计，包括：

- 选择计量预期信用损失的适当模型和假设；
- 判断信用风险显著增加及已发生信用减值的标准；
- 针对不同类型的产品，在计量预期信用损失时确定需要使用的前瞻性信息和权重。

对债券投资类金融资产，预期信用损失为考虑了前瞻性影响的违约概率(PD)、违约风险敞口(EAD)、违约损失率(LGD)三者乘积作为未来现金流折现至当期的结果，对融资类金融资产，预期信用损失为违约风险敞口(EAD)及考虑前瞻性影响的损失率比率(LR)二者乘积折现后的结果：

- 违约概率是指借款人在未来 12 个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。本公司计算违约概率考虑的主要因素有：债券发行人经评估后的信用评级信息等；
- 违约损失率是指本公司对违约风险敞口发生损失程度作出的预期。本公司计算违约损失率主要考虑的因素有：债券发行人或交易对手的类型等；
- 违约风险敞口是指在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本公司应被偿付的金额；
- 损失率比率是指本公司对违约风险敞口发生损失金额作出的预期。本公司使用基于公开市场数据测算的历史损失率并评估其适当性。本公司计算融资类金融资产损失率比率考虑的主要因素有：融资类金融资产维持担保比例及担保证券的波动特征、担保物变现的价值等。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

预期信用损失计量(续)

信用风险显著增加的判断标准

本公司在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本公司在进行金融工具损失准备阶段划分时，充分考虑了反映金融工具的信用风险是否发生显著变化的各种合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。当触发以下一个或多个定量和定性指标时，本公司认为金融工具的信用风险已发生显著增加。

针对债券投资类金融资产，如果债券的最新内部评级较购买日时点债券发行人或债券的评级下迁超过 2 级，且债券发行人或债券的最新内部评级在投资级别以下，本公司认为该类债券的信用风险显著增加。

针对融资类金融资产，如果维持担保比例低于平仓线，则表明其信用风险已经显著增加。

如果借款人或债务人在合同付款日后逾期超过 30 天仍未付款，则视为该金融工具已经发生信用风险显著增加。

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司未将任何金融工具视为具有较低信用风险而不再比较资产负债表日的信用风险与初始确认时相比是否显著增加。

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

预期信用损失计量(续)

已发生信用减值资产的定义

判断金融工具是否发生信用减值时，本公司所采用的界定标准，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，本公司将该金融工具界定为已发生信用减值，其标准与已发生违约的定义一致：

- 债务人在合同付款日后逾期超过 90 天仍未付款；
- 融资类金融资产采取强制平仓措施、担保物价值已经不能覆盖融资金额；
- 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别；
- 债务人、债券发行人或交易对手发生重大财务困难；
- 由于债务人财务困难导致相关金融工具的活跃市场消失；
- 债权人由于债务人、债券发行人或交易对手的财务困难作出让步；
- 债务人、债券发行人或交易对手很可能破产或其他财务重组等。

金融工具发生信用减值时，有可能是多个事件的共同作用所致，未必是可单独识别的事件所致。

前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。

对于债券投资类金融资产，本公司通过进行历史数据分析，识别出影响信用风险及预期信用损失的关键经济指标，主要包括国内生产总值、生产价格指数和社会消费品零售总额。本公司通过进行回归分析确定这些经济指标历史上与违约概率、违约敞口和违约损失率之间的关系，对债券投资业务的预期损失进行前瞻性的调整。对于融资类金融资产，本公司基于对产品特性进行分析，识别出与融资类金融资产风险相关的经济指标，即：上证综指和深证成指的波动率。通过构建这些经济指标与业务风险特征之间的关系，对融资类金融资产的预期损失进行前瞻性的调整。

除了提供基本经济情景外，本公司的管理层专家小组也提供了其他可能的情景及情景权重。针对每一个主要产品类型分析、设定不同的情景，以确保考虑到指标非线性发展特征。本公司在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及其特征。

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

预期信用损失计量(续)

前瞻性信息(续)

本公司认为，在 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，对于公司的债券投资类金融资产以及融资类金融资产组合，应当考虑应用乐观、基准及悲观这三种不同情景来恰当反映关键经济指标发展的非线性特征。本公司结合统计分析及专家判断来确定情景权重，也同时考虑了各情景所代表的可能结果的范围，目前本公司采用的三种情景权重基本相若。

本公司以加权的 12 个月预期信用损失(阶段一)或加权的整个存续期预期信用损失(阶段二及阶段三)计量相关的损失准备。上述加权的信用损失是由各情景下预期信用损失乘以相应情景的权重计算得出。

与其他经济预测类似，对预计经济指标和发生可能性的估计具有高度的固有不确定性，因此实际结果可能同预测存在重大差异。本公司认为这些预测体现了公司对可能结果的最佳估计。

敏感性分析

预期信用损失计量模型会使用到模型参数、前瞻性预测的宏观经济变量、经济场景权重及运用专家判断时考虑的其他因素等，上述参数、假设和判断的变化将对信用风险显著增加以及预期信用损失计量产生影响。本公司每年定期对模型进行重检并根据具体情况对模型中使用的假设和参数进行适当的修正，本期对模型及参数的调整对预期信用损失结果的影响不重大。

本公司对前瞻性计量所使用的经济指标进行了敏感性分析，当乐观、悲观情景权重变动 10%时，对本公司已计提的预期信用损失的影响不重大。

同时，本公司还对信用风险阶段分类进行了敏感性分析。于 2021 年 6 月 30 日，假设信用风险自初始确认后未发生显著变化，导致阶段二的金融工具全部进入阶段一，则对资产负债表中确认的预期信用损失影响不重大。

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

预期信用损失计量(续)

担保物及其他信用增级措施

本公司采用一系列政策和信用增级措施来降低信用风险敞口至可接受水平。其中，最为普遍的方法是提供抵押物或担保。本公司根据交易对手的信用风险评估决定所需的担保物金额及类型。融资类金融资产的担保物主要为股票、债券和基金等。本公司管理层会定期检查担保物的市场价值，根据相关协议要求追加担保物，并在进行损失准备的充足性审查时监视担保物的市场价值变化。

融资类金融资产损失率情况

本公司充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券所属板块、流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况、发行人经营情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的预警线和平仓线，其中预警线一般不低于 150%，平仓线一般不低于 130%。

- 对于维持担保比例大于平仓线，并且本金或利息逾期 30 日及以内的融资类金融资产，属于“阶段一”；
- 对于维持担保比例大于 100%，小于等于平仓线的融资类金融资产，或者本金或利息发生逾期，且逾期天数超过 30 日且未超 90 日的，属于“阶段二”；
- 对于维持担保比例小于等于 100%的融资类金融资产，或者本金或利息发生逾期，且逾期天数超过 90 日的，属于“阶段三”。

本公司的融资类金融资产不同阶段对应的损失率比率如下：

阶段一：资产根据不同的维持担保比例，损失率区间为 0.3%~0.5%；

阶段二：资产损失率不低于 10%；

阶段三：根据逐项折现现金流量模型，计算预期损失率。

信用风险敞口分析

本公司融资类金融资产客户资产质量良好，于 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，绝大部分融资类金融资产的维持担保比达到平仓线以上，且存在充分的抵押物信息表明资产预期不会发生违约。于 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本公司持有的债券投资大部分为投资级以上。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(1) 最大信用风险敞口

计提减值准备后不考虑任何担保物及其他信用增级措施的最大信用风险敞口详情如下：

本集团

	2021年6月30日	2020年12月31日
项目		
银行存款及其他货币资金	266,284,196,613.94	233,692,947,133.62
其中：客户资金存款	182,752,847,196.02	158,250,995,008.88
结算备付金	37,739,297,424.71	56,934,000,392.55
其中：客户备付金	24,510,765,476.10	41,266,582,125.23
融出资金	124,786,429,551.65	116,741,431,729.57
交易性金融资产	303,738,735,050.87	244,791,230,692.65
衍生金融资产	20,428,111,123.29	20,157,990,448.68
买入返售金融资产	36,264,339,190.14	39,226,613,451.99
应收款项	66,919,086,798.64	39,352,598,397.78
存出保证金	38,510,507,446.64	3,877,774,046.76
其他债权投资	58,019,065,775.32	49,400,900,096.32
其他	2,346,488,311.42	2,865,802,956.48
	<hr/>	<hr/>
最大信用风险敞口	955,036,257,286.62	807,041,289,346.40
	<hr/>	<hr/>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(1) 最大信用风险敞口(续)

计提减值准备后不考虑任何担保物及其他信用增级措施的最大信用风险敞口详情如下：

本公司

	2021年6月30日	2020年12月31日
项目		
银行存款及其他货币资金	147,488,107,641.11	151,261,028,568.02
其中：客户资金存款	96,595,457,172.36	89,431,459,030.03
结算备付金	27,427,957,862.47	20,726,530,638.24
其中：客户备付金	21,447,617,522.11	18,710,816,936.26
融出资金	102,911,430,158.30	96,834,509,753.63
交易性金融资产	264,514,502,336.58	209,011,026,096.93
衍生金融资产	19,101,711,171.55	26,428,901,521.03
买入返售金融资产	33,848,119,556.45	34,778,736,015.77
应收款项	42,188,705,785.38	23,807,245,628.95
存出保证金	8,557,197,839.02	8,603,714,321.31
其他债权投资	64,517,214,401.94	56,477,261,960.15
其他	30,077,298,850.05	17,192,657,405.61
	<hr/>	<hr/>
最大信用风险敞口	740,632,245,602.85	645,121,611,909.64

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(2) 风险集中度

如交易对手集中于某一行业或地区，或共同具备某些经济特性，其信用风险通常会相应提高。同时，不同行业和经济地区的发展均有其独特的特点，因此不同的行业和经济地区的信用风险亦不相同。

本集团在计提减值准备后不考虑任何担保物及其他信用增级措施的最大信用风险敞口按地区分布如下：

2021年6月30日	按地区划分		
	中国大陆地区	中国大陆以外地区	合计
银行存款及其他货币资金	239,829,151,044.46	26,455,045,569.48	266,284,196,613.94
其中：客户资金存款	171,171,995,062.08	11,580,852,133.94	182,752,847,196.02
结算备付金	35,985,278,675.05	1,754,018,749.66	37,739,297,424.71
其中：客户备付金	23,507,588,312.73	1,003,177,163.37	24,510,765,476.10
融出资金	119,030,686,698.18	5,755,742,853.47	124,786,429,551.65
交易性金融资产	273,087,209,661.75	30,651,525,389.12	303,738,735,050.87
衍生金融资产	16,887,099,070.08	3,541,012,053.21	20,428,111,123.29
买入返售金融资产	34,431,319,648.70	1,833,019,541.44	36,264,339,190.14
应收款项	14,411,785,119.15	52,507,301,679.49	66,919,086,798.64
存出保证金	36,382,025,253.97	2,128,482,192.67	38,510,507,446.64
其他债权投资	56,286,332,198.42	1,732,733,576.90	58,019,065,775.32
其他	1,766,813,594.04	579,674,717.38	2,346,488,311.42
最大信用风险敞口	828,097,700,963.80	126,938,556,322.82	955,036,257,286.62

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(2) 风险集中度(续)

2020年12月31日	按地区划分		
	中国大陆地区	中国大陆以外地区	合计
银行存款及其他货币资金	208,863,469,263.56	24,829,477,870.06	233,692,947,133.62
其中：客户资金存款	144,337,707,462.77	13,913,287,546.11	158,250,995,008.88
结算备付金	55,742,823,954.83	1,191,176,437.72	56,934,000,392.55
其中：客户备付金	41,139,311,254.68	127,270,870.55	41,266,582,125.23
融出资金	111,138,857,626.96	5,602,574,102.61	116,741,431,729.57
交易性金融资产	211,992,426,458.68	32,798,804,233.97	244,791,230,692.65
衍生金融资产	13,902,535,888.18	6,255,454,560.50	20,157,990,448.68
买入返售金融资产	35,214,192,591.01	4,012,420,860.98	39,226,613,451.99
应收款项	5,393,400,884.41	33,959,197,513.37	39,352,598,397.78
存出保证金	3,322,607,544.38	555,166,502.38	3,877,774,046.76
其他债权投资	48,022,268,093.99	1,378,632,002.33	49,400,900,096.32
其他	2,166,829,687.86	698,973,268.62	2,865,802,956.48
最大信用风险敞口	695,759,411,993.86	111,281,877,352.54	807,041,289,346.40

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量

本集团纳入预期信用损失减值评估范围的金融工具的信用风险敞口按损失所处阶段划分如下：

(i) 买入返售款项减值准备

	预期信用损失阶段			合计
	阶段一	阶段二	阶段三	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年12月31日	58,758,443.12	1,331,266,622.37	6,648,913,800.92	8,038,938,866.41
本期计提	25,667,289.81	368,488,166.24	96,158,239.88	490,313,695.93
本期转回	(28,829,429.01)	(19,895,566.30)	(128,593,256.80)	(177,318,252.11)
本期转销	-	-	-	-
阶段转移				
-增加	-	-	-	-
-减少	-	-	-	-
外汇及其他变动	-	-	-	-
2021年6月30日	<u>55,596,303.92</u>	<u>1,679,859,222.31</u>	<u>6,616,478,784.00</u>	<u>8,351,934,310.23</u>

影响买入返售金融资产减值准备变动的主要原因包括个别买入返售合约交易对手方违约，且担保物价值下跌，导致本公司的信用风险敞口不能全额覆盖。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

本集团纳入预期信用损失减值评估范围的金融工具的信用风险敞口按损失所处阶段划分如下：

(i) 买入返售款项减值准备(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第 1 阶段	第 2 阶段	第 3 阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年1月1日	102,601,340.34	385,210,477.63	2,558,096,873.60	3,045,908,691.57
本年计提	70,243,018.53	1,483,755,986.02	3,764,442,925.93	5,318,441,930.48
本年转回	(114,085,915.75)	(157,570,814.53)	(167,512,858.21)	(439,169,588.49)
本年转销	-	-	(553,391,936.06)	(553,391,936.06)
阶段转移				
-增加	-	75,229,613.11	466,344,400.68	541,574,013.79
-减少	-	(466,344,400.68)	(75,229,613.11)	(541,574,013.79)
外汇及其他变动 (包括企业合并)	-	10,985,760.82	656,164,008.09	667,149,768.91
2020年12月31日	58,758,443.12	1,331,266,622.37	6,648,913,800.92	8,038,938,866.41

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(i) 买入返售款项减值准备(续)

股票质押式回购减值准备明细如下：

	2021年6月30日			合计
	预期信用损失阶段			
	阶段一	阶段二	阶段三	
账面余额	16,858,680,358.38	4,108,986,387.03	7,496,346,570.53	28,464,013,315.94
减值准备	55,596,303.92	1,679,859,222.31	6,616,478,784.00	8,351,934,310.23
担保物价值	65,158,841,336.40	8,868,848,891.82	9,003,483,873.11	83,031,174,101.33

	2020年12月31日			合计
	预期信用损失阶段			
	阶段一	阶段二	阶段三	
账面余额	17,964,613,082.38	5,369,838,132.87	8,389,391,946.67	31,723,843,161.92
减值准备	58,758,443.11	1,331,266,622.37	6,648,913,800.93	8,038,938,866.41
担保物价值	74,668,705,446.75	20,699,077,717.96	10,786,817,033.89	106,154,600,198.60

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(ii) 融出资金减值准备

	预期信用损失阶段			合计
	阶段一	阶段二	阶段三	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年12月31日	344,215,075.17	12,546,351.73	1,176,771,372.24	1,533,532,799.14
本期计提	21,350,129.92	41,744,443.30	411,435,194.18	474,529,767.40
本期转回	(2,657,864.37)	(12,229,266.91)	(27,442,319.82)	(42,329,451.10)
本期转销	-	-	-	-
阶段转移				
-增加	353,607.88	707,408.82	2,856,125.66	3,917,142.36
-减少	(3,563,534.48)	(353,607.88)	-	(3,917,142.36)
外汇及其他变动	(4,119.20)	-	333,989.51	329,870.31
2021年6月30日	359,693,294.92	42,415,329.06	1,563,954,361.77	1,966,062,985.75

影响融出资金减值准备重大变动的的原因包括个别融资合约对手方信用风险显著上升，本期计提损失准备金额增加人民币 474,529,767.40 元(2020 年度：人民币 777,226,560.14 元)。截至 2021 年 6 月 30 日，本公司第 3 阶段对应担保物的公允价值为人民币 12,834,542,025.04 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 12,571,907,200.00 元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(ii) 融出资金减值准备(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第 1 阶段	第 2 阶段	第 3 阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年1月1日	198,449,749.65	303,771,845.10	270,263,669.66	772,485,264.41
本年计提	138,179,716.22	24,295,985.84	614,750,858.08	777,226,560.14
本年转回	-	(12,123,028.84)	(54,234,231.21)	(66,357,260.05)
本年转销	-	-	-	-
阶段转移				
-增加	360,467.36	733,862.09	303,771,845.10	304,866,174.55
-减少	(733,862.09)	(304,132,312.46)	-	(304,866,174.55)
外汇及其他变动 (包括企业合并)	7,959,004.03	-	42,219,230.61	50,178,234.64
2020年12月31日	344,215,075.17	12,546,351.73	1,176,771,372.24	1,533,532,799.14

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(iii) 应收款项及其他应收款减值准备

	预期信用损失阶段			合计
	阶段一	阶段二	阶段三	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年12月31日	173,932,070.44	8,130,712.44	1,949,384,565.47	2,131,447,348.35
本期计提	50,702,846.54	6,716,800.82	14,547,185.78	71,966,833.14
本期转回	(4,725,055.53)	(1,131,945.81)	(4,784,430.38)	(10,641,431.72)
本期转销	(92,286.00)	-	-	(92,286.00)
阶段转移				
-增加	-	108,681.90	256,509.60	365,191.50
-减少	(108,681.90)	(256,509.60)	-	(365,191.50)
外汇及其他变动	(6,134,137.17)	-	(6,639,796.41)	(12,773,933.58)
2021年6月30日	213,574,756.38	13,567,739.75	1,952,764,034.06	2,179,906,530.19

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(iii) 应收款项及其他应收款减值准备(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第 1 阶段	第 2 阶段	第 3 阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年1月1日	119,701,092.97	5,596,472.64	1,646,216,814.42	1,771,514,380.03
本年计提	131,831,506.07	10,093,574.52	313,107,321.21	455,032,401.80
本年转回	(80,811,167.62)	(6,842,379.49)	(33,038,272.86)	(120,691,819.97)
本年转销	(2,308,117.76)	(716,955.23)	(78,258,987.09)	(81,284,060.08)
阶段转移				
-增加	-	-	-	-
-减少	-	-	-	-
外汇及其他变动 (包括企业合并)	5,518,756.78	-	101,357,689.79	106,876,446.57
2020年12月31日	173,932,070.44	8,130,712.44	1,949,384,565.47	2,131,447,348.35

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(iv) 其他债权投资减值准备

	预期信用损失阶段			合计
	阶段一	阶段二	阶段三	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年12月31日	533,493,043.06	-	44,000,000.00	577,493,043.06
本期计提	19,981.34	-	-	19,981.34
本期转回	(134,573,870.72)	-	-	(134,573,870.72)
本期转销	(71,419,724.24)	-	-	(71,419,724.24)
阶段转移				
-增加	-	-	-	-
-减少	-	-	-	-
外汇及其他变动	(56,672.72)	-	-	(56,672.72)
2021年6月30日	327,462,756.72	-	44,000,000.00	371,462,756.72

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

1. 信用风险(续)

(3) 预期信用损失计量(续)

(iv) 其他债权投资减值准备(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第 1 阶段	第 2 阶段	第 3 阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2020年1月1日	218,919,870.35	-	44,000,000.00	262,919,870.35
本年计提	581,750,792.71	-	-	581,750,792.71
本年转回	(26,526,999.05)	-	-	(26,526,999.05)
本年转销	(240,299,246.70)	-	-	(240,299,246.70)
阶段转移				
-增加	-	-	-	-
-减少	-	-	-	-
外汇及其他变动 (包括企业合并)	(351,374.25)	-	-	(351,374.25)
2020年12月31日	533,493,043.06	-	44,000,000.00	577,493,043.06

八、 金融工具风险管理(续)

2. 市场风险

市场风险是由于持仓金融头寸的市场价格变动而导致的损失风险。持仓金融头寸来自于自营投资、做市业务以及其他投资活动。持仓金融头寸的变动主要来自客户的要求或自营投资的相关策略。

市场风险的类别主要包括权益价格风险、利率风险、商品价格风险和汇率风险。其中，权益价格风险是由于股票、股票组合、股指期货等权益品种价格或波动率的变化而导致的；利率风险主要由固定收益投资收益率曲线结构、利率波动性和信用利差等变动引起；商品价格风险由各类商品价格发生不利变动引起；汇率风险由非本国货币汇率波动引起。

公司建立了自上而下的风险限额管理体系，通过将公司整体的风险限额分配至各业务部门/业务线、内部控制部门监督执行、重大风险事项及时评估与报告等方式，将公司整体市场风险水平管理在恰当的范围。

公司通过独立于业务部门/业务线的风险管理部对公司整体的市场风险进行全面的评估、监测和管理，并将评估、监测结果向各业务部门/业务线、公司经营管理层和风险管理委员会进行汇报。在具体实施市场风险管理的过程中，前台业务部门/业务线作为市场风险的直接承担者和一线管理人员，动态管理其持仓部分所暴露出的市场风险，并在风险暴露较高时主动采取降低风险敞口或风险对冲等操作；而风险管理部的相关监控人员则会持续地直接与业务部门/业务线的团队沟通风险信息，讨论风险状态和极端损失情景等。

风险管理部通过一系列计量方式估计可能的市场风险损失，既包括在市场正常波动状况下的可能损失，也包括市场极端变动状况下的可能损失。风险管理部主要通过VaR和敏感性分析的方式对正常波动情况下的短期可能损失进行衡量，同时，对于极端情况下的可能损失，采用压力测试的方法进行评估。风险报告包括各业务部门/业务线的市场风险状况以及变化情况，会以每日、周、月、季度等不同频率发送给业务部门/业务线的主要负责人和公司经营管理层。

八、 金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

VaR 是在一定的时间段内、一定置信度下持仓投资组合由于市场价格变动导致的可能损失。公司使用 VaR 作为衡量市场风险状况的主要指标。在具体参数设置上采用 1 天持有期、95%置信度。VaR 的计算模型覆盖了利率风险、权益价格风险、汇率风险等风险类型，能够衡量由于利率曲线变动、证券价格变动、汇率变动等因素导致的市场风险变动。风险管理部通过回溯测试等方法对 VaR 计算模型的准确性进行持续检测，并随公司业务不断拓展，积极改善 VaR 风险计算模型。公司还通过压力测试的方式对持仓面临极端情况的冲击下的可能损失状况进行评估。风险管理部设置了一系列宏观及市场场景，来计算公司全部持仓在单一情景或多情景同时发生的不同状况下的可能损失。这些场景包括：宏观经济状况的大幅下滑、主要市场大幅不利变动、特殊风险事件的发生等。压力测试是公司市场风险管理中的重要组成部分。通过压力测试，可以更为突出的显示公司的可能损失，进行风险收益分析，并对比风险承受能力，衡量公司整体的市场风险状态是否在预期范围内。

公司对业务部门/业务线设置了风险限额以控制盈亏波动水平和市场风险暴露程度，风险管理部对风险限额进行每日监控。当接近或突破风险限额时，风险管理部会向相关管理人员进行预警提示，并和相关业务管理人员进行讨论，按照讨论形成的意见，业务部门/业务线会降低风险暴露程度使之符合风险限额，或者业务部门/业务线申请临时或永久提高风险限额，经相应授权人员或组织批准后实施。

公司对风险限额体系进行持续的完善，明确了统一的限额管理办法和分级授权机制，并根据授权机制调整公司整体、各业务部门/业务线、投资账户等不同层面的风险限额指标体系管理办法。

对于境外资产及子公司资产，公司实行境内外一体化管理，以逐日盯市方式对账户资产价格进行跟踪，并从资产限额、VaR、敏感性分析、压力测试等多个角度进行管理，针对外币资产，公司对汇率风险进行整体监控和管理，并通过调整外汇头寸、用外汇远期/期权对冲、进行货币互换等多种手段管理汇率风险敞口。

(1) 风险价值(VaR)

风险价值(VaR)是一种用以估算在某一给定时间范围，相对于某一给定的置信区间来说，由于市场利率或者股票价格变动而引起的最大可能的持仓亏损的方法。

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

(1) 风险价值(VaR)(续)

本集团根据历史数据计算 VaR 值(置信水平为 95%，观察期为 1 个交易日)。

本集团和本公司按风险类别分类的风险价值(VaR)分析概括如下：

	本集团		本公司			
			单位：人民币万元			
	2021年6月30日	2020年6月30日	2021年6月30日	2020年6月30日		
股价敏感型金融工具	35,256	38,451	21,187	17,355		
利率敏感型金融工具	6,267	18,835	5,108	19,041		
汇率敏感型金融工具	4,338	6,874	284	141		
整体组合风险价值	35,753	39,448	19,756	22,744		
	本公司					
	2021年1月1日至6月30日止期间			2020年1月1日至6月30日止期间		
	平均	最高	最低	平均	最高	最低
股价敏感型金融工具	24,618	35,006	13,388	16,701	33,640	7,520
利率敏感型金融工具	6,515	14,274	4,015	15,363	27,468	4,425
汇率敏感型金融工具	623	1,510	85	825	2,508	141
整体组合风险价值	25,393	41,703	14,614	21,107	30,954	13,675

八、金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

(2) 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值因市场利率不利变动而发生损失的风险。持有的具有利率敏感性的各类金融工具因市场利率不利变动导致公允价值变动的风险是本集团利率风险的主要来源。

本集团利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具。采用敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，年末持有的各类金融工具公允价值变动对收入总额和股东权益产生的影响。

假设市场整体利率发生平行移动，且不考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动，本集团及本公司利率敏感性分析如下：

收入敏感性	本集团		本公司	
	2021年1月-6月	2020年1月-6月	2021年1月-6月	2020年1月-6月
利率基点变化				
上升 25 个基点	(50,240)	(77,037)	(49,306)	(73,538)
下降 25 个基点	51,345	80,001	49,704	76,037

单位：人民币万元

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

(2) 利率风险(续)

单位：人民币万元

权益敏感性	本集团		本公司	
	2021年6月30日	2020年12月31日	2021年6月30日	2020年12月31日
利率基点变化				
上升 25 个基点	(17,126)	(25,573)	(16,345)	(25,498)
下降 25 个基点	17,685	26,773	16,983	26,712

八、 金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

(3) 汇率风险

汇率风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集团面临的汇率变动风险主要与本集团的经营活动(当收支以不同于本集团记账本位币的外币结算时)及其于境外子公司的净投资有关。

下表列示了本集团主要币种外汇风险敞口的汇率敏感性分析。其计算了当其他项目不变时，外币对人民币汇率的合理可能变动对收入和权益的影响。负数表示可能减少税前利润或权益，正数表示可能增加收入或权益。

		单位：人民币万元	
		收入敏感性	
		1月1日至6月30日止期间	
币种	汇率变化	2021年	2020年
美元	-3%	106,730	18,956
港元	-3%	(59,369)	(27,727)
		权益敏感性	
币种	汇率变化	2021年6月30日	2020年12月31日
美元	-3%	(27,391)	(24,975)
港元	-3%	827	663

上表列示了美元及港元相对人民币贬值 3%对收入及权益所产生的影响，若上述币种以相同幅度升值，则将对收入和权益产生与上表相同金额方向相反的影响。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

(3) 汇率风险(续)

本集团

	2021年6月30日				合计
	人民币	美元折合 人民币	港币折合 人民币	其他货币折合 人民币	
资产负债表内敞口净额	150,341,455,331.22	9,607,354,038.40	20,628,144,535.11	11,001,951,277.62	191,578,905,182.35
	2020年12月31日				合计
	人民币	美元折合 人民币	港币折合 人民币	其他货币折合 人民币	
资产负债表内敞口净额	161,705,402,258.73	(4,534,440,991.45)	18,004,275,167.67	10,707,499,313.17	185,882,735,748.12

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

2. 市场风险(续)

(3) 汇率风险(续)

本公司

	2021年6月30日				合计
	人民币	美元折合 人民币	港币折合 人民币	其他货币折合 人民币	
资产负债表内敞口净额	109,337,651,989.81	24,301,359,849.54	17,234,433,380.87	3,073,800,956.55	153,947,246,176.77

	2020年12月31日				合计
	人民币	美元折合 人民币	港币折合 人民币	其他货币折合 人民币	
资产负债表内敞口净额	114,571,587,665.16	17,729,673,743.75	15,821,257,558.30	3,582,336,645.57	151,704,855,612.78

八、 金融工具风险管理(续)

3. 价格风险

价格风险是指权益性证券的公允价值因股票指数水平和个别证券价值的变化而降低的风险。该项风险在数量上表现为交易性金融工具的市价波动影响本集团的利润变动；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益性金融工具的市价波动影响本集团的股东权益变动。

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团权益性投资占资产总额的比例约为 16.46%(2020 年 12 月 31 日：19.54%)。

4. 流动性风险

流动性风险，是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。公司一贯坚持资金的整体运作，并由库务部统一管理公司的资金调配。在境内交易所和银行间市场，公司具有较好的资信水平，维持着比较稳定的拆借、回购等短期融资通道；同时也通过公募或私募的方式发行公司债、次级债、收益凭证等补充公司长期运营资金，从而使公司的整体流动性状态保持在较为安全的水平。

此外，风险管理部会独立地对公司未来一段时间内的资金负债情况进行每日监测与评估，通过对特定时间点和时间段的资产负债匹配情况的分析以及对资金缺口等指标的计算，来评估公司的资金支付能力。公司建立了流动性储备池制度，持有充足的高流动性资产以满足公司应急流动性需求，并由风险管理部每日对储备池规模及流动性情况进行监控。风险管理部每日发布公司流动性风险报告，对公司的资产负债状况、流动性风险限额执行情况、储备池情况进行报告。同时，公司对流动性风险指标设置了预警阈值，当超过阈值时，风险管理部将依照相关制度向公司风险管理委员会和公司管理层以及相关部门进行风险警示，并由相关的管理部门进行适当操作以将公司的流动性风险调整到公司允许的范围内。

于本报告期末，本集团及本公司金融工具未经折现的合同现金流量按到期日分析如下：

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

4. 流动性风险(续)

未经折现合同现金流量的到期日分析

本集团

	2021年6月30日						合计
	逾期/即时偿还	3个月内	3个月至1年	1至5年	5年以上	无期限	
非衍生金融负债：							
短期借款	3,257,306.25	10,588,644,004.84	6,884,587.13	-	-	-	10,598,785,898.22
应付短期融资款	-	6,930,921,752.60	2,246,422,075.76	-	-	-	9,177,343,828.36
拆入资金	-	12,111,341,610.21	-	-	-	-	12,111,341,610.21
交易性金融负债	4,347,096,505.67	13,975,463,937.88	19,219,411,675.83	16,422,035,452.28	1,603,401,597.96	10,694,321,955.85	66,261,731,125.47
卖出回购金融资产款	182,823,673.07	200,880,569,636.21	12,929,366,726.19	622,771,847.15	-	-	214,615,531,882.62
代理买卖证券款	245,178,494,655.96	-	-	-	-	-	245,178,494,655.96
代理承销证券款	766,719,059.89	-	-	-	-	-	766,719,059.89
应付款项	123,840,195,831.18	31,482,821,334.70	125,572,485.78	-	-	3,389,402,091.16	158,837,991,742.82
应付债券	-	9,770,631,621.97	50,929,777,995.44	119,613,183,812.96	17,230,200,000.00	-	197,543,793,430.37
长期借款	-	31,566,493.79	499,859,470.91	297,889,718.38	-	-	829,315,683.08
租赁负债	1,246,485.83	165,126,811.81	393,580,528.95	1,366,377,104.66	112,809,088.31	-	2,039,140,019.56
其他	5,670,093,698.33	4,519,372.34	-	541,012,779.72	-	344,143,279.33	6,559,769,129.72
金融负债合计	379,989,927,216.18	285,941,606,576.35	86,350,875,545.99	138,863,270,715.15	18,946,410,686.27	14,427,867,326.34	924,519,958,066.28
以净额交割的衍生金融负债	380,019,346.69	4,780,875,702.38	7,058,549,501.28	16,333,328,674.54	6,289,962,269.12	-	34,842,735,494.01
以总额交割的衍生金融负债							
应收合约金额	-	-	-	-	-	-	-
应付合约金额	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、 金融工具风险管理(续)

4. 流动性风险(续)

未经折现合同现金流量的到期日分析(续)

本集团

	2020年12月31日						合计
	逾期/即时偿还	3个月内	3个月至1年	1至5年	5年以上	无期限	
非衍生金融负债:							
短期借款	1,217,587.20	5,004,252,778.35	6,950,818.68	-	-	-	5,012,421,184.23
应付短期融资款	-	3,421,695,288.14	8,634,492,197.99	-	-	-	12,056,187,486.13
拆入资金	-	10,377,203,777.77	130,498,717.57	-	-	-	10,507,702,495.34
交易性金融负债	2,969,253,488.10	13,853,516,282.54	19,292,667,216.86	9,737,208,515.43	2,286,499,704.87	10,269,598,588.11	58,408,743,795.91
卖出回购金融资产款	10,347,596.53	176,435,081,503.05	21,533,645,061.11	730,375,153.26	-	-	198,709,449,313.95
代理买卖证券款	203,110,587,613.79	-	-	-	-	-	203,110,587,613.79
代理承销证券款	1,071,235,143.49	-	-	-	-	-	1,071,235,143.49
应付款项	95,784,202,100.59	20,582,248,504.47	306,277,438.34	29,106,448.01	-	2,249,523,299.38	118,951,357,790.79
长期借款	-	3,811,158.84	331,026,894.77	261,857,057.58	354,918,724.56	-	951,613,835.75
应付债券	-	2,452,180,000.00	40,623,242,325.05	138,983,250,620.16	2,060,150,000.00	-	184,118,822,945.21
租赁负债	-	138,990,307.23	415,426,073.76	1,155,554,122.41	141,023,877.24	-	1,850,994,380.64
其他	398,893,645.82	3,449,163.74	-	494,024,857.65	-	312,840,094.04	1,209,207,761.25
金融负债合计	303,345,737,175.52	232,272,428,764.13	91,274,226,744.13	151,391,376,774.50	4,842,592,306.67	12,831,961,981.53	795,958,323,746.48
以净额交割的衍生金融负债	502,258.52	5,188,027,433.91	7,869,401,610.30	16,397,545,763.29	17,673,099,077.39	-	47,128,576,143.41
以总额交割的衍生金融负债							
应收合约金额	-	-	-	-	-	-	-
应付合约金额	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

4. 流动性风险(续)

未经折现合同现金流量的到期日分析(续)

本公司

	2021年6月30日						合计
	逾期/即时偿还	3个月内	3个月至1年	1至5年	5年以上	无期限	
非衍生金融负债:							
应付短期融资款	-	4,904,702,261.13	744,282,164.99	-	-	-	5,648,984,426.12
拆入资金	-	12,111,341,610.21	-	-	-	-	12,111,341,610.21
交易性金融负债	-	5,036,669,844.02	10,361,862,132.14	12,773,907,315.80	157,561,764.56	-	28,330,001,056.52
卖出回购金融资产款	-	175,519,092,247.79	9,634,912,693.32	-	-	-	185,154,004,941.11
代理买卖证券款	115,732,258,825.73	-	-	-	-	-	115,732,258,825.73
代理承销证券款	806,719,059.89	-	-	-	-	-	806,719,059.89
应付款项	122,485,982,072.18	-	-	-	-	-	122,485,982,072.18
应付债券	-	9,770,631,621.97	45,485,466,640.82	111,753,536,958.18	17,230,200,000.00	-	184,239,835,220.97
租赁负债	-	161,189,807.04	459,793,805.13	1,305,366,091.44	63,560,459.29	-	1,989,910,162.90
其他	5,335,312,214.17	-	-	-	-	-	5,335,312,214.17
金融负债合计	244,360,272,171.97	207,503,627,392.16	66,686,317,436.40	125,832,810,365.42	17,451,322,223.85	-	661,834,349,589.80
以净额交割的衍生金融负债	-	3,941,643,364.79	4,705,553,768.89	20,494,983,739.39	12,606,824.14	-	29,154,787,697.21
以总额交割的衍生金融负债							
应收合约金额	-	-	-	-	-	-	-
应付合约金额	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

八、金融工具风险管理(续)

4. 流动性风险(续)

未经折现合同现金流量的到期日分析(续)

本公司

	2020年12月31日						合计
	逾期/即时偿还	3个月内	3个月至1年	1至5年	5年以上	无期限	
非衍生金融负债:							
应付短期融资款	-	3,313,701,836.09	6,353,063,290.40	-	-	-	9,666,765,126.49
拆入资金	-	10,377,203,777.77	130,498,717.57	-	-	-	10,507,702,495.34
交易性金融负债	-	4,633,319,327.90	7,426,416,697.14	7,517,460,075.22	203,464,705.03	-	19,780,660,805.29
卖出回购金融资产款	-	148,444,758,995.23	14,914,108,589.35	-	-	-	163,358,867,584.58
代理买卖证券款	104,957,910,421.19	-	-	-	-	-	104,957,910,421.19
代理承销证券款	1,320,885,071.49	-	-	-	-	-	1,320,885,071.49
应付款项	92,892,670,637.64	-	-	-	-	-	92,892,670,637.64
应付债券	-	2,503,558,767.12	39,204,180,032.93	125,909,192,341.73	2,060,150,000.00	-	169,677,081,141.78
租赁负债	-	156,113,502.84	450,561,765.72	1,484,542,897.94	67,897,089.50	-	2,159,115,256.00
其他	164,879,260.68	-	-	-	-	-	164,879,260.68
金融负债合计	199,336,345,391.00	169,428,656,206.95	68,478,829,093.11	134,911,195,314.89	2,331,511,794.53	-	574,486,537,800.48
以净额交割的衍生金融负债	-	4,315,044,948.65	5,301,656,689.39	27,975,454,516.59	6,378,427.89	-	37,598,534,582.52
以总额交割的衍生金融负债							
应收合约金额	-	-	-	-	-	-	-
应付合约金额	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

九、公允价值的披露

本集团根据以下层级确定及披露金融工具的公允价值：

第一层级：输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层级：输入值是除第一层级输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层级：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

当无法从公开市场获取报价时，本集团通过一些估值技术或者询价来确定公允价值。

本集团在估值技术中使用的主要参数包括标的价格、利率、汇率、波动水平、相关性及交易对手信用差价等，均为可观察到的且可从公开市场获取的参数。

对于本集团持有的未上市股权、私募股权、未流通股、未上市基金及场外期权，管理层从交易对手处询价或使用估值技术确定公允价值。估值技术包括现金流折现法、市场乘数法、期权定价模型和蒙特卡罗模型等。其公允价值的计量可能采用了对估值产生重大影响的不可观察参数，因此本集团将这些资产和负债划分至第三层级。可能对估值产生影响的不可观察参数主要包括流动性折让、市场乘数等，于2021年6月30日，非上市股权投资、基金投资、其他投资、场外期权及金融负债等的公允价值对上述不可观察参数金额的合理变动无重大敏感性。本集团已建立相关内部控制程序监控集团对此类金融工具的敞口。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

九、公允价值的披露(续)

1. 以公允价值计量的资产和负债

2021年6月30日

	活跃市场报价 第一层级	重要可观察输入值 第二层级	重要不可观察 输入值 第三层级	合计
持续的公允价值计量				
金融资产				
交易性金融资产	229,266,319,535.22	202,932,763,790.16	37,009,874,837.49	469,208,958,162.87
-债券投资	33,247,214,587.92	142,898,825,456.47	5,831,847,445.77	181,977,887,490.16
-基金投资	62,676,550,478.54	504,452,092.41	-	63,181,002,570.95
-股票投资	128,797,426,073.72	5,842,249,412.42	4,008,368,156.84	138,648,043,642.98
-券商资管	-	33,213,693,559.68	-	33,213,693,559.68
-银行理财	-	1,948,735,600.50	-	1,948,735,600.50
-信托计划	-	1,781,057,827.60	-	1,781,057,827.60
-指定为以公允价值计量 且其变动计入当期损 益的金融资产	1,211,944.74	1,165,132,252.97	10,811,973,718.11	11,978,317,915.82
-其他	4,543,916,450.30	15,578,617,588.11	16,357,685,516.77	36,480,219,555.18
衍生金融资产	669,418,755.98	18,180,737,867.96	1,577,954,499.35	20,428,111,123.29
其他债权投资	14,842,066,232.92	41,260,816,750.61	1,916,182,791.79	58,019,065,775.32
-国债	2,794,777,548.90	2,831,236,229.19	-	5,626,013,778.09
-金融债	1,452,984,510.38	326,241,551.08	155,334,101.37	1,934,560,162.83
-企业债	2,034,589,660.02	2,545,512,234.57	253,951,123.29	4,834,053,017.88
-同业存单	-	26,496,659,571.98	-	26,496,659,571.98
-超短期融资券	-	3,496,016,658.54	-	3,496,016,658.54
-其他	8,559,714,513.62	5,565,150,505.25	1,506,897,567.13	15,631,762,586.00
其他权益工具投资	-	-	166,328,755.33	166,328,755.33
合计	<u>244,777,804,524.12</u>	<u>262,374,318,408.73</u>	<u>40,670,340,883.96</u>	<u>547,822,463,816.81</u>
金融负债				
交易性金融负债	3,503,891,364.34	33,671,840,857.48	29,085,998,903.65	66,261,731,125.47
-指定为以公允价值计 量且其变动计入当 期损益的金融负债	-	32,496,563,423.88	29,085,461,586.98	61,582,025,010.86
-为交易而持有的金融 负债	3,503,891,364.34	1,175,277,433.60	537,316.67	4,679,706,114.61
衍生金融负债	885,918,447.25	26,905,211,206.09	6,887,763,164.04	34,678,892,817.38
合计	<u>4,389,809,811.59</u>	<u>60,577,052,063.57</u>	<u>35,973,762,067.69</u>	<u>100,940,623,942.85</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外, 金额单位均为人民币元)

九、公允价值的披露(续)

1. 以公允价值计量的资产和负债(续)

2020年12月31日

公允价值计量使用的输入值

	活跃市场报价 第一层级	重要可观察输入值 第二层级	重要不可观察 输入值 第三层级	合计
持续的以公允价值计量的金融工具				
金融资产				
交易性金融资产	222,906,505,658.46	166,398,422,239.83	30,675,931,925.61	419,980,859,823.90
-债券投资	31,831,311,341.18	106,211,632,822.58	2,923,915,014.25	140,966,859,178.01
-基金投资	59,925,624,189.04	2,415,662,430.93	10,610,127.84	62,351,896,747.81
-股票投资	122,924,095,033.22	9,410,844,747.71	3,607,686,713.37	135,942,626,494.30
-券商资管	-	37,196,411,038.98	-	37,196,411,038.98
-银行理财	-	1,709,651,356.61	-	1,709,651,356.61
-信托计划	-	2,344,887,300.95	-	2,344,887,300.95
-指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	3,555,296,664.34	1,192,151,267.60	9,855,879,973.87	14,603,327,905.81
-其他	4,670,178,430.68	5,917,181,274.47	14,277,840,096.28	24,865,199,801.43
衍生金融资产	829,193,492.41	16,963,281,448.93	2,365,515,507.34	20,157,990,448.68
其他债权投资	17,864,405,275.10	30,895,669,615.74	640,825,205.48	49,400,900,096.32
-国债	1,328,320,628.80	5,094,783,468.46	-	6,423,104,097.26
-金融债	2,531,509,501.25	2,794,805,085.07	-	5,326,314,586.32
-企业债	2,663,521,646.45	3,207,121,692.93	-	5,870,643,339.38
-同业存单	-	12,252,722,526.23	-	12,252,722,526.23
-超短期融资券	-	1,638,150,565.35	-	1,638,150,565.35
-其他	11,341,053,498.60	5,908,086,277.70	640,825,205.48	17,889,964,981.78
其他权益工具投资	-	16,440,223,235.14	195,277,275.94	16,635,500,511.08
合计	<u>241,600,104,425.97</u>	<u>230,697,596,539.64</u>	<u>33,877,549,914.37</u>	<u>506,175,250,879.98</u>
金融负债				
交易性金融负债	5,217,237,944.74	29,247,124,520.54	23,944,381,330.63	58,408,743,795.91
-指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	768,047.76	27,081,055,971.48	23,944,148,091.63	51,025,972,110.87
-为交易而持有的金融负债	5,216,469,896.98	2,166,068,549.06	233,239.00	7,382,771,685.04
衍生金融负债	<u>663,811,855.17</u>	<u>37,724,669,371.87</u>	<u>8,487,724,328.27</u>	<u>46,876,205,555.31</u>
合计	<u>5,881,049,799.91</u>	<u>66,971,793,892.41</u>	<u>32,432,105,658.90</u>	<u>105,284,949,351.22</u>

九、公允价值的披露(续)

2. 持续和非持续第二层级公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

对于交易性金融资产及负债、其他债权投资中的债券投资的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

对于交易性金融资产及负债、其他债权投资中不存在公开市场的债务，其公允价值以估值技术确定。估值技术所需的可观察输入值包括但不限于无风险利率、隐含波动率和人民币掉期曲线等估值参数。

对于其他权益工具，其公允价值以第三方提供的投资账户报告确定。

对于衍生金融资产和负债中的远期类和互换类利率衍生合约，公允价值是根据每个合约的条款和到期日，采用市场利率将未来现金流折现来确定。互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用相关市场公开报价计算的回报来确定的。

截至2021年6月30日止期间，本集团上述持续第二层级公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

3. 持续和非持续第三层级公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

对于非上市股权投资、基金投资、债券投资、无公开市场报价的股票投资、限售股、信托产品、场外期权及金融负债，本集团从交易对手处询价或者采用估值技术来确定其公允价值，估值技术包括现金流折现法、市场比较法和蒙特卡罗模型等。其公允价值的计量采用了重要的不可观察参数，比如流动性折扣、波动率、风险调整折扣和市场乘数等。非上市股权投资、基金投资、其他投资、场外期权及金融负债的公允价值对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

截至2021年6月30日止期间，本集团上述持续第三层级公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

九、公允价值的披露(续)

4. 非以公允价值计量的金融资产及金融负债

除应付债券外，下列资产及负债的账面价值与其公允价值相若。

资产	负债
货币资金	短期借款
结算备付金	应付短期融资款
融出资金	拆入资金
买入返售金融资产	卖出回购金融资产款
应收款项	代理买卖证券款
存出保证金	代理承销证券款
其他金融资产	应付款项
	长期借款
	租赁负债
	其他金融负债

下表列示了应付债券的账面价值以及相应的公允价值：

本集团	账面价值		公允价值	
	2021年6月30日	2020年12月31日	2021年6月30日	2020年12月31日
应付债券	182,516,293,619.31	171,987,819,424.94	184,290,755,143.76	173,309,137,228.90

本公司	账面价值		公允价值	
	2021年6月30日	2020年12月31日	2021年6月30日	2020年12月31日
应付债券	169,867,381,866.70	158,486,981,965.38	171,433,692,649.96	159,481,447,548.82

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

九、公允价值的披露(续)

5. 公允价值的调节

	2021年 1月1日	转入第三层级	转出第三层级	本期损益 影响合计	本期其他综合收 益影响合计	增加	减少	2021年 6月30日
金融资产：								
交易性金融资产	30,675,931,925.61	3,869,448,184.14	665,384,544.56	472,409,583.65	(14,803,387.78)	7,167,107,490.79	4,494,834,414.36	37,009,874,837.49
债券投资	2,923,915,014.25	2,552,813,708.29	5,287,750.14	(846,248,337.12)	(2,600,019.62)	4,074,684,537.79	2,865,429,707.68	5,831,847,445.77
基金投资	10,610,127.84	-	-	(188,426.72)	-	-	10,421,701.12	-
股票投资	3,607,686,713.37	1,316,634,475.85	5,482,892.76	(151,587,084.87)	(1,959.79)	472,600,636.71	1,231,481,731.67	4,008,368,156.84
信托计划	-	-	-	-	-	-	-	-
指定为以公允价值计量且其变 动计入当期损益的金融资产	9,855,879,973.87	-	-	958,466,710.76	(4,115,773.58)	15,383,855.17	13,641,048.11	10,811,973,718.11
其他	14,277,840,096.28	-	654,613,901.66	511,966,721.60	(8,085,634.79)	2,604,438,461.12	373,860,225.78	16,357,685,516.77
衍生金融资产	2,365,515,507.34	-	-	558,050,899.06	-	1,227,661,041.39	2,573,272,948.44	1,577,954,499.35
其他债权投资	640,825,205.48	1,324,345,750.69	-	-	(49,209,797.86)	221,633.48	-	1,916,182,791.79
其他权益工具投资	195,277,275.94	-	-	-	(28,948,520.61)	-	-	166,328,755.33
金融负债：								
交易性金融负债	23,944,381,330.63	23,909.46	-	2,397,304,886.29	-	13,846,120,439.64	11,101,831,662.37	29,085,998,903.65
指定为以公允价值计量且其变 动计入当期损益的金融负债	23,944,148,091.63	-	-	2,397,304,886.29	-	13,845,840,271.43	11,101,831,662.37	29,085,461,586.98
为交易而持有的金融负债	233,239.00	23,909.46	-	-	-	280,168.21	-	537,316.67
衍生金融负债	8,487,724,328.27	-	-	4,359,803,752.66	-	3,785,343,554.47	9,745,108,471.36	6,887,763,164.04

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

九、公允价值的披露(续)

5. 公允价值的调节(续)

	2020年 1月1日	转入第三层级	转出第三层级	本年公允价值变动 损益影响合计	本年其他综合收益 影响合计	增加	减少	2020年 12月31日
金融资产:								
交易性金融资产	15,887,245,170.94	9,219,068,835.54	635,228,597.97	2,741,351,700.61	(79,127,962.69)	6,206,706,396.93	2,664,083,617.75	30,675,931,925.61
债券投资	272,223,101.59	1,156,171,436.01	-	(72,372,611.68)	(19,324,853.00)	1,587,217,941.33	-	2,923,915,014.25
基金投资	32,629,729.97	-	-	(6,986,985.13)	-	2,615,826.43	17,648,443.43	10,610,127.84
股票投资	371,714,280.79	3,036,359,029.21	9,214,361.30	192,362,740.60	-	75,850,112.95	59,385,088.88	3,607,686,713.37
信托计划	1,052,204,591.18	-	-	-	-	-	1,052,204,591.18	-
指定为以公允价值计量且其 变动计入当期损益的金融 资产	742,566,672.65	4,851,922,530.72	-	3,778,900,216.88	(25,010,198.48)	669,462,532.23	161,961,780.13	9,855,879,973.87
其他	13,415,906,794.76	174,615,839.60	626,014,236.67	(1,150,551,660.06)	(34,792,911.21)	3,871,559,983.99	1,372,883,714.13	14,277,840,096.28
衍生金融资产	-	2,365,515,507.34	-	-	-	-	-	2,365,515,507.34
其他债权投资	-	327,160,876.71	-	-	-	313,664,328.77	-	640,825,205.48
其他权益工具投资	205,312,776.01	-	-	-	(40,435,500.07)	30,400,000.00	-	195,277,275.94
金融负债:								
交易性金融负债	6,957,617,656.18	14,152,541,989.91	-	2,968,125,294.74	-	-	133,903,610.20	23,944,381,330.63
指定为以公允价值计量且其 变动计入当期损益的金融 负债	6,953,348,961.71	14,152,308,750.37	-	2,968,125,294.74	-	-	129,634,915.19	23,944,148,091.63
为交易而持有的金融负债	4,268,694.47	233,239.54	-	-	-	-	4,268,695.01	233,239.00
衍生金融负债	-	8,487,724,328.27	-	-	-	-	-	8,487,724,328.27

九、 公允价值的披露(续)

5. 公允价值的调节(续)

截至 2021 年 6 月 30 日止期间，本集团持有的第三层级金融工具计入投资收益的金额
为人民币-1,297,631,739.06 元(2020 年度：人民币 420,656,241.95 元)。

6. 公允价值层级转换

截至 2021 年 6 月 30 日止期间，本集团从第一层级转入第二层级的金融资产为人民币
0.02 亿元(2020 年度：人民币 0.62 亿元)，从第二层级转入第一层级的金融资产为人民
币 67.57 亿元(2020 年度：人民币 3.06 亿元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、关联方关系及其重大交易

1. 本公司的第一大股东情况

股东名称	关联关系	企业类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	第一大股东对本公司的持股比例(%)	第一大股东对本公司的表决权比例(%)	社会统一信用代码
中国中信有限公司	第一大股东	国有控股	北京市	朱鹤新	金融、实业及其他服务业	人民币1,390亿元	15.47%	15.47%	911100007178317092
中国中信股份有限公司	第一大股东一致行动人	国有控股	香港	朱鹤新	金融、实业及其他服务业	不适用	2.91%	2.91%	不适用

2. 本公司的重要子公司情况

本公司所属重要子公司情况详见附注七、1。

3. 本公司的合营和联营企业情况

本公司的合营及联营企业情况详见附注七、2。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、关联方关系及其重大交易(续)

4. 本公司的其他主要关联方情况

- (1) 本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司
- (2) 本公司第一大股东的子公司及合营公司
- (3) 广州越秀金融控股集团股份有限公司及广州越秀金融控股集团有限公司¹

5. 关联交易情况

本集团与关联方交易按照市场价格进行，无任何高于或低于正常交易价格的情况发生。

截至2021年6月30日止六个月期间，本集团发生关联交易的其他主要关联方清单如下：

其他关联方名称	其他关联方与本公司关系	统一社会信用代码/ 组织机构代码
中国中信集团有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	9110000010168558XU
中国中信股份有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	不适用
中信泰富有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	不适用
金属矿产有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	不适用
中信国际电讯集团有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	不适用
中信红河产业开发有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	91532522670866858C
中信云网有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	91110105MA007TJG6A
中信正业控股集团有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	911101177650289453
中信资产管理有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	91100000710930042L
中信置业投资控股有限公司	本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	911101051016919124
中国中信有限公司	本公司第一大股东	911100007178317092
中信资源控股有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	不适用
北京中信国际大厦物业管理有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	9111010510169171XC
中信京城大厦有限责任公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	9111010510172450X2
中信保诚人寿保险有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000725010871G
中信信托有限责任公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000101730993Y
中信兴业投资集团有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91310000132289328R
中信环境投资集团有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000675702676C
中信建设有限责任公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000710930579X
中信财务有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000717834635Q
中信银行股份有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000101690725E
中信出版集团股份有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91100000101729466X
中信投资控股有限公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110000710934166R
中信控股有限责任公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	911100007109300856
中信城市开发运营有限责任公司	本公司第一大股东的子公司及合营公司	91110105339861125D
广州越秀金融控股集团股份有限公司	直接或间接持有本公司5%以上股份的股东	914401011904817725
广州越秀金融控股集团股份有限公司	直接或间接持有本公司5%以上股份的股东	91440101190479672H

¹ 越秀金控及其一致行动人金控有限，对本公司的持股比例共计7.09%

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、 关联方关系及其重大交易(续)

5. 关联交易情况(续)

截至2021年6月30日止六个月期间，本集团与关联方的主要交易如下：

(1) 利息收入

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的子公司及合营公司	450,426,787.68	303,230,346.24
合计	450,426,787.68	303,230,346.24

(2) 利息支出

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	280,256.21	399,673.43
本公司第一大股东的子公司及合营公司	8,567,518.55	18,912,252.28
本公司第一大股东	81,688.02	62,185.01
直接或间接持有本公司5%以上股份的股东	58,206,941.07	49,577,322.44
本公司的联营企业	1.70	1,718,631.82
合计	67,136,405.55	70,670,064.98

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、 关联方关系及其重大交易(续)

5. 关联交易情况(续)

(3) 提供劳务取得的收入

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	28,265,185.85	12,153,083.08
本公司第一大股东的子公司及合营公司	163,009,708.38	109,724,472.05
本公司第一大股东	89,028.01	82,028.37
直接或间接持有本公司 5%以上股份的股东	2,531,132.08	-
合计	<u>193,895,054.32</u>	<u>121,959,583.50</u>

(4) 接受劳务支付的费用

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	2,623,289.52	1,930,181.09
本公司第一大股东的子公司及合营公司	122,295,906.57	112,352,049.93
本公司第一大股东	343.75	-
本公司的联营公司	5,542,836.61	3,213,778.84
合计	<u>130,462,376.45</u>	<u>117,496,009.86</u>

(5) 投资收益/(损失)

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的子公司及合营公司	2,449,955.15	19,853,065.26
直接或间接持有本公司 5%以上股份的股东(i)	437,262,269.72	-
本公司的联营公司	(9,850,719.20)	-
合计	<u>429,861,505.67</u>	<u>19,853,065.26</u>

(i) 截至 2021 年 6 月 30 日 6 个月期间，本公司向直接或间接持有本公司 5%以上股份的股东收取的投资收益全部为发行股份购买资产相关《资产保障协议》的补偿款项。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、 关联方关系及其重大交易(续)

5. 关联交易情况(续)

(6) 收取的租赁费

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的子公司及合营公司	16,120,143.37	17,616,531.76
合计	<u>16,120,143.37</u>	<u>17,616,531.76</u>

(7) 股权投资

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司联营公司	-	7,171,674.54
合计	<u>-</u>	<u>7,171,674.54</u>

(8) 其他关联交易

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司及其子公司持有的由本公司管理的集合资产管理计划共计人民币 3.87 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 6.93 亿元)。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司第一大股东的子公司及合营公司持有本公司发行的收益凭证共计人民币 0.60 亿元(2020 年 12 月 31 日：无)。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司第一大股东的子公司及合营公司进行卖出回购交易余额为人民币 11.92 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 14.36 亿元)。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司累计支付给本公司第一大股东的子公司及合营公司有关中信金融中心项目施工总承包合同的金额为人民币 3.06 亿元(2020 年 12 月 31 日：人民币 3.06 亿元)。

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司的联营公司未持有本公司发行的收益凭证(2020 年 12 月 31 日：人民币 9.00 亿元)。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、 关联方关系及其重大交易(续)

6. 关联方往来

(1) 关联方往来—存放关联方款项

关联方	2021年 6月30日	2020年 12月31日
存放于本公司第一大股东的子公司及合营公司的存款	51,065,683,753.96	35,693,164,832.45
其中：客户资金存款	37,722,753,329.34	33,911,223,801.22
自有资金存款	13,342,930,424.62	1,781,941,031.23

(2) 关联方往来—应收类款项

关联方	2021年 6月30日	2020年 12月31日
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	1,422,107.88	1,524,660.47
本公司第一大股东的子公司及合营公司直接或间接持有本公司5%以上股份的股东	62,887,931.18	25,593,601.32
本公司的联营公司	-	209,682.00
合计	3,350,652.05	-
	<u>67,660,691.11</u>	<u>27,327,943.79</u>

(3) 关联方往来—应付类款项

关联方	2021年 6月30日	2020年 12月31日
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	68,000.00	68,000.00
本公司第一大股东的子公司及合营公司直接或间接持有本公司5%以上股份的股东	405,085,578.22	22,721,995.53
本公司的联营企业	1,726,851,807.64	2,290,319,023.41
合计	874,560.77	1,221,837.44
	<u>2,132,879,946.63</u>	<u>2,314,330,856.38</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间
(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、 关联方关系及其重大交易(续)

7. 作为承租方发生的关联交易如下：

与房屋租赁相关的支付

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	18,159,471.13	17,863,716.56
本公司第一大股东的子公司及合营公司	4,918,317.28	5,234,120.66
合计	<u>23,077,788.41</u>	<u>23,097,837.22</u>

8. 作为承租方的关联租赁合同对集团的影响如下：

租赁负债利息支出

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	1,157,916.77	1,512,970.01
本公司第一大股东的子公司及合营公司	585,552.02	730,309.52
合计	<u>1,743,468.79</u>	<u>2,243,279.53</u>

业务及管理费-使用权资产折旧费

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	9,174,322.76	9,658,592.22
本公司第一大股东的子公司及合营公司	3,783,606.14	3,775,475.73
合计	<u>12,957,928.90</u>	<u>13,434,067.95</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十、 关联方关系及其重大交易(续)

8. 作为承租方的关联租赁合同对集团的影响如下(续):

业务及管理费-租赁费

关联方	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	7,438,296.79	8,912,156.05
本公司第一大股东的子公司及合营公司	770,718.03	742,864.41
合计	<u>8,209,014.82</u>	<u>9,655,020.46</u>

使用权资产

关联方	2021年6月30日	2020年12月31日
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	50,144,212.47	53,447,948.43
本公司第一大股东的子公司及合营公司	22,821,002.78	25,684,484.39
合计	<u>72,965,215.25</u>	<u>79,132,432.82</u>

租赁负债

关联方	2021年6月30日	2020年12月31日
本公司第一大股东的控股股东和实际控制人及其子公司	50,757,264.44	53,621,100.61
本公司第一大股东的子公司及合营公司	22,083,045.48	25,376,485.49
合计	<u>72,840,309.92</u>	<u>78,997,586.10</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十一、承诺及或有事项

1. 重要承诺事项

资本性支出承诺

项目	2021年 6月30日	2020年 12月31日
已签约但未拨付	<u>3,873,362,125.21</u>	<u>3,874,609,728.15</u>

上述主要为本集团购建房屋和设备的资本性支出承诺。

经营性租赁承诺

作为出租人

于各资产负债表日，本集团就下列期间的不可撤销之重大租赁协议能收取的最低租金为：

	2021年 6月30日	2020年 12月31日
一年以内	316,204,515.92	304,598,179.33
一至二年	302,503,108.17	296,300,370.25
二至三年	292,711,000.83	283,407,488.70
三到四年	261,790,565.78	273,074,646.22
四到五年	225,873,409.81	233,341,567.21
五年以上	131,006,218.66	198,100,386.98
合计	<u>1,530,088,819.17</u>	<u>1,588,822,638.69</u>

2. 或有事项

法律诉讼及其他

本集团在日常经营中会涉及索赔、法律诉讼或监管机构调查。于2021年6月30日及2020年12月31日，本集团没有涉及任何重大法律或仲裁的案件。此类重大案件是指如果发生不利的判决，本集团预期将会对自身财务状况或经营成果产生重大的影响。

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十一、承诺及或有事项(续)

3. 担保物

(1) 作为担保物的资产

本集团部分资产按合同或监管要求用作卖出回购业务(附注四、26 卖出回购金融资产款)的抵质押物。

此外，本集团部分资产按照合同要求用作借款业务(附注四、22 短期借款)(附注四、33 长期借款)的抵质押物。

(2) 收到的担保物

本集团在融资融券业务(附注四、3 融出资金)和买入返售业务(附注四、5 买入返售金融资产)中接受了股票和债券等资产作为抵质押物。

十二、其他重要事项

1. 公益捐赠

项目	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	2020年
慈善捐赠	1,329,470.63	625,000.00
救灾捐款	-	20,263,800.00
其他公益性支出	-	534,314.69
合计	<u>1,329,470.63</u>	<u>21,423,114.69</u>

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十二、其他重要事项(续)

2. 分部报告

本集团管理层出于管理目的，根据业务种类划分成业务单元。本集团的报告分部为：经纪业务、资产管理业务、证券投资业务、证券承销业务及其他业务。

2021年1月1日至6月30日止期间	经纪业务	资产管理业务	证券投资业务	证券承销业务	其他	合计
一、营业收入	9,248,385,841.01	6,360,417,964.15	9,768,061,716.23	2,615,798,111.45	9,727,959,826.31	37,720,623,459.15
手续费及佣金净收入	7,337,501,487.22	5,817,460,699.49	(41,294,376.20)	2,614,646,640.75	281,749,771.74	16,010,064,223.00
利息净收入	1,674,858,962.84	39,366,375.04	632,653,615.46	(4,816.61)	(23,336,052.20)	2,323,538,084.53
其中：利息收入	2,306,451,832.70	61,012,058.09	7,294,789,416.94	367.67	193,632,827.49	9,855,886,502.89
利息支出	631,592,869.86	21,645,683.05	6,662,135,801.48	5,184.28	216,968,879.69	7,532,348,418.36
对联营及合营企业的投资收益	-	-	-	-	427,533,871.28	427,533,871.28
其他净收入	236,025,390.95	503,590,889.62	9,176,702,476.97	1,156,287.31	9,042,012,235.49	18,959,487,280.34
二、营业支出	5,705,087,493.18	3,007,356,812.46	3,606,926,022.98	1,356,661,751.99	7,702,014,970.87	21,378,047,051.48
其中：其他资产减值损失	-	-	-	-	47,979,747.79	47,979,747.79
信用减值损失	(329,053.10)	(358,652.14)	688,892,742.85	-	3,472,215.18	691,677,252.79
三、营业利润	3,543,298,347.83	3,353,061,151.69	6,161,135,693.25	1,259,136,359.46	2,025,944,855.44	16,342,576,407.67
四、所得税费用						3,696,873,257.00
五、资产总额	318,190,969,612.68	33,579,854,813.01	736,343,405,499.14	1,247,283,624.66	79,777,779,751.71	1,169,139,293,301.20
其中：对联营及合营公司的投资	-	-	-	-	9,425,910,287.20	9,425,910,287.20
固定资产和在建工程	313,085,414.23	285,059,188.11	53,207,055.29	46,286,537.00	6,667,590,689.03	7,365,228,883.66
六、负债总额	272,460,115,716.22	22,800,240,046.33	640,518,448,574.48	3,279,749,058.13	38,501,834,723.69	977,560,388,118.85
七、补充信息						
1、折旧和摊销费用	385,171,952.67	95,008,021.16	31,552,818.28	37,082,787.81	233,027,641.31	781,843,221.23
2、资本性支出	124,470,262.19	18,086,528.76	5,635,469.37	11,639,132.66	4,082,429.91	163,913,822.89

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十二、其他重要事项(续)

2. 分部报告(续)

本集团管理层出于管理目的，根据业务种类划分成业务单元。本集团的报告分部为：经纪业务、资产管理业务、证券投资业务、证券承销业务及其他业务。

2020年1月1日至6月30日止期间	经纪业务	资产管理业务	证券投资业务	证券承销业务	其他	合计
一、营业收入	6,574,372,751.24	4,080,209,002.65	8,921,245,992.48	2,125,774,061.56	5,041,953,857.63	26,743,555,665.56
手续费及佣金净收入	4,921,971,737.96	3,553,662,367.77	43,259,522.86	2,126,866,017.91	180,809,004.25	10,826,568,650.75
利息净收入	1,304,143,152.35	67,910,704.37	(273,008,315.02)	547,545.77	(289,222,477.96)	810,370,609.51
其中：利息收入	1,661,914,249.25	81,981,585.33	5,110,429,136.13	547,545.77	102,607,899.90	6,957,480,416.38
利息支出	357,771,096.90	14,070,880.96	5,383,437,451.15	-	391,830,377.86	6,147,109,806.87
对联营及合营企业的投资收益	-	-	-	-	91,804,295.60	91,804,295.60
其他净收入	348,257,860.93	458,635,930.51	9,150,994,784.64	(1,639,502.12)	5,058,563,035.74	15,014,812,109.70
二、营业支出	3,893,735,101.16	1,951,117,475.73	4,636,096,418.68	995,111,189.58	3,390,815,401.53	14,866,875,586.68
其中：其他资产减值损失	-	30,764,560.47	-	-	235,649,323.72	266,413,884.19
信用减值损失	(1,533,418.62)	1,371,967.05	2,017,686,110.51	-	17,166,595.15	2,034,691,254.09
三、营业利润	2,680,637,650.08	2,129,091,526.92	4,285,149,573.80	1,130,662,871.98	1,651,138,456.10	11,876,680,078.88
四、所得税费用						2,653,479,640.43
五、资产总额	232,159,239,643.41	32,574,943,886.84	636,128,194,892.46	608,869,880.03	73,567,725,440.13	975,038,973,742.87
其中：对联营及合营公司的投资	-	-	-	-	8,647,371,132.94	8,647,371,132.94
固定资产和在建工程	357,704,342.43	292,631,437.04	35,618,888.18	32,686,588.93	6,906,811,245.68	7,625,452,502.26
六、负债总额	201,666,912,155.98	17,705,570,603.80	532,994,012,055.51	1,957,996,273.98	40,715,320,185.05	795,039,811,274.32
七、补充信息						
1、折旧和摊销费用	410,850,525.25	98,090,614.03	33,139,179.76	36,287,999.16	276,603,298.19	854,971,616.39
2、资本性支出	64,911,826.85	11,316,191.88	16,230,905.50	37,922,247.79	7,278,753.44	137,659,925.46

中信证券股份有限公司

财务报表附注

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

十三、资产负债表日后事项

重要的资产负债表日后事项说明

公开发行永续次级债券

本公司根据第六届董事会第二十二次会议决议、2017年度股东大会决议及相关授权，经中国证监会机构部函[2020]2367号文核准，获准向专业投资者公开发行面值不超过人民币300亿元的永续次级债券。本公司于2021年7月27日完成了公开发行2021年永续次级债券(第一期)，发行规模为人民币33亿元，票面利率为3.7%，以每5个计息年度为1个重定价周期。本公司于2021年8月10日完成了公开发行2021年永续次级债券(第二期)，发行规模为人民币60亿元，票面利率为3.63%，以每5个计息年度为1个重定价周期。

公开发行公司债券

本公司根据第六届董事会第二十二次会议决议、2017年度股东大会决议及相关授权以及中国证监会的批复(证监许可[2020]3675号)，获准在中国境内面向专业投资者公开发行面值总额不超过人民币800亿元的公司债券。本公司于2021年7月9日完成了公开发行2021年公司债券(第六期)，发行规模为人民币30亿元。其中品种一发行规模为人民币15亿元，期限5年，票面利率为3.62%；品种二发行规模为人民币15亿元，期限10年，票面利率为3.92%。

利润分配

2021年6月29日，本公司2020年度股东大会审议通过了2020年度利润分配方案。本公司2020年度利润分配采用现金分红的方式。本公司2020年度现金红利将于2021年8月20日派发完毕。

十四、财务报表的批准

本财务报表于2021年8月19日经本公司董事会批准。

中信证券股份有限公司

未经审阅补充资料

2021年1月1日至6月30日止期间

(除另有注明外，金额单位均为人民币元)

财务报表补充资料

1. 当期非经常性损益明细表

项目	2021年1月1日至 6月30日止期间
非流动资产处置损益	790,470.44
计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关，按照 国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外)	138,222,464.56
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小 于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允 价值产生的收益	(458,839.81)
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	(51,786,636.67)
减：所得税影响额	22,019,043.58
少数股东权益影响	7,056,429.73
合计	57,691,985.21

本集团对非经常性损益项目的确认依照《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号—非经常性损益》的规定执行。

2. 净资产收益率及每股收益

报告期利润	加权平均净资产收益率	基本每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	6.52%	0.94
扣除非经常性损益后归属于公司 普通股股东的净利润	6.49%	0.94

本公司无稀释性潜在普通股。

董事长：张佑君

董事会批准报送日期：2021 年 8 月 19 日

第十一节 证券公司信息披露



第十一节 证券公司信息披露

一、公司重大行政许可事项的相关情况

序号	批复日期	批复标题及文号
1	2021-06-02	中国证监会关于中信证券股份有限公司试点开展基金投资顾问业务有关事项的复函 (机构部函〔2021〕1681号)

二、监管部门对公司的分类结果

2021 年度证券公司分类评价中，公司与全资证券子公司——中信证券（山东）、中信证券华南、金通证券合并获评中国证券行业 A 类 AA 级。

附录：信息披露索引

报告期内，公司在上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）以及《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》上披露的信息如下：

序号	日期	公告事项
1	2021-01-05	H 股公告 - 截至二零二零年十二月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
2	2021-01-06	关于向专业投资者公开发行公司债券获得中国证监会注册批复的公告
3	2021-01-09	当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告
4	2021-01-23	2020 年度业绩快报公告
5	2021-02-02	H 股公告 - 截至二零二一年一月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
6	2021-02-06	当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告
7		第七届董事会独立非执行董事关于公司第七届董事会第十九次会议相关事项的独立意见
8	2021-02-23	第七届董事会第十九次会议决议公告
9		关于为拟设立的资管子公司提供净资本担保承诺的公告
10		关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的公告
11		截至 2020 年 12 月 31 日止前次募集资金使用情况报告及鉴证报告
12		截至 2020 年 12 月 31 日止前次募集资金使用情况报告
13		关于配股募集资金使用的可行性分析报告
14		配股公开发行证券预案
15	2021-02-27	关于公司符合配股条件的说明
16		第七届董事会独立非执行董事关于第七届董事会第二十次会议相关事项之独立意见
17		第七届董事会第二十次会议决议公告
18		2021—2023 年股东回报规划
19		第七届监事会第八次会议决议公告
20	2021-03-02	H 股公告 - 截至二零二一年二月二十八日止月份之股份发行人的证券变动月报表
21	2021-03-06	H 股公告 - 董事会会议通知
22	2021-03-12	关于召开 2020 年度业绩发布会的公告
23		董事会审计委员会 2020 年度履职情况报告
24		2020 年 12 月 31 日内部控制审计报告
25		2020 年度社会责任报告
26	2021-03-19	2020 年内部控制评价报告
27		2020 年度独立非执行董事述职报告
28		关于中信证券股份有限公司第一大股东及其他关联方占用资金情况专项报告
29		2020 年度财务报表及审计报告

序号	日期	公告事项
30		2020 年年度报告
31		关于计提信用减值损失的公告
32		第七届董事会第二十一次会议决议公告
33		关于修订公司《章程》的公告
34		独立非执行董事关于公司第七届董事会第二十一次会议相关事项的专项说明及独立意见
35	2021-03-19	关于 2021 年日常关联持续性关联交易预计的公告
36		关于续聘会计师事务所的公告
37		关于利润分配方案的公告
38		第七届监事会第九次会议决议公告
39		内幕信息知情人登记制度（2021 年修订）
40		2020 年年度报告摘要
41	2021-04-02	H 股公告 - 截至二零二一年三月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
42		关于第一大股东一致行动人增持公司股票的权益变动提示性公告
43	2021-04-06	关于中信证券股份有限公司发行股份购买资产暨关联交易之 2020 年度独立财务顾问持续督导报告书
44	2021-04-13	H 股公告 - 董事会会议通知
45		第七届董事会独立非执行董事关于第七届董事会第二十二次会议相关事项之独立意见
46		第七届董事会第二十二次会议决议公告
47		独立董事提名人声明
48	2021-04-29	独立董事候选人声明
49		关于独立董事辞职及补选的公告
50		2021 年第一季度报告
51		2021 年第一季度报告正文
52	2021-05-06	关于第一大股东一致行动人增持公司股票的权益变动提示性公告
53	2021-05-07	H 股公告 - 截至二零二一年四月三十日止月份之股份发行人的证券变动月报表
54		当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告
55	2021-05-13	2020 年度股东大会及 2021 年第一次 A 股类别股东会、2021 年第一次 H 股类别股东会会议文件
56		关于召开 2020 年度股东大会、2021 年第一次 A 股类别股东会的通知
57	2021-05-29	关于变更持续督导财务顾问主办人的公告
58	2021-06-02	H 股公告 - 截至二零二一年五月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
59		第七届董事会独立非执行董事关于第七届董事会第二十三次会议相关事项之独立意见
60	2021-06-08	第七届董事会第二十三次会议决议公告
61	2021-06-10	关于召开 2020 年度股东大会、2021 年第一次 A 股类别股东会的第二次通知
62		2021 年第一次临时股东大会会议文件
63	2021-06-24	关于召开 2021 年第一次临时股东大会的通知
64	2021-06-25	关于调整与派发 2020 年度末期股息相关之 H 股股份暂停过户期间及最后登记日的公告
65	2021-06-28	关于试点开展基金投资顾问业务收到中国证监会复函的公告

序号	日期	公告事项
66	2021-06-29	关于第一大股东承诺全额认购可获配股份的公告
67		公司 2020 年度股东大会、2021 年第一次 A 股类别股东会及 2021 年第一次 H 股类别股东会法律意见书
68	2021-06-30	公司章程（2021 年第一次修订）
69		2020 年度股东大会及 2021 年第一次 A 股类别股东会、2021 年第一次 H 股类别股东会决议公告

注：上表“日期”为相关公告于《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和上交所刊登的日期，于香港交易所披露易网站发布的日期为“日期”当日早间或前一日晚间

报告期内，公司在香港交易所披露易网站（<http://www.hkexnews.hk>）披露的信息如下：

序号	日期	公告事项
1	2021-01-04	截至二零二零年十二月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
2	2021-01-05	海外监管公告 - 关于向专业投资者公开发行人公司债券获得中国证监会注册批覆的公告
3	2021-01-08	海外监管公告 - 当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告
4	2021-01-22	二零二零年度业绩快报
5	2021-02-01	截至二零二一年一月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
6	2021-02-05	海外监管公告 - 当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告
7		海外监管公告 - 第七届董事会独立非执行董事关于公司第七届董事会第十九次会议相关事项的独立意见
8	2021-02-22	海外监管公告 - 第七届董事会第十九次会议决议公告
9		海外监管公告 - 关于为拟设立的资管子公司提供净资本担保承诺的公告
10		公告 - 建议以供股方式发行 A 股及 H 股
11		海外监管公告 - 关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的公告
12		海外监管公告 - 截至 2020 年 12 月 31 日止前次募集资金使用情况报告及鉴证报告
13		海外监管公告 - 截至 2020 年 12 月 31 日止前次募集资金使用情况报告
14		海外监管公告 - 关于配股募集资金使用的可行性分析报告
15	2021-02-26	海外监管公告 - 配股公开发行证券预案
16		海外监管公告 - 关于公司符合配股条件的说明
17		海外监管公告 - 第七届董事会独立非执行董事关于第七届董事会第二十次会议相关事项之独立意见
18		海外监管公告 - 第七届董事会第二十次会议决议公告
19		海外监管公告 - 公司 2021—2023 年股东回报规划
20		海外监管公告 - 第七届监事会第八次会议决议公告
21	2021-03-01	截至二零二一年二月二十八日止月份之股份发行人的证券变动月报表
22	2021-03-05	董事会会议通知
23	2021-03-11	自愿性公告 - 召开 2020 年度业绩发布会

序号	日期	公告事项
24		关于计提信用减值损失的公告
25		建议修订公司章程
26		2020 年度社会责任报告
27		2020 年年度业绩公告
28		海外监管公告 - 董事会审计委员会 2020 年度履职情况报告
29		海外监管公告 - 2020 年 12 月 31 日内部控制审计报告
30		海外监管公告 - 2020 年度内部控制评价报告
31		海外监管公告 - 2020 年度独立非执行董事述职报告
32	2021-03-18	海外监管公告 - 第七届董事会第二十一次会议决议公告
33		海外监管公告 - 第一大股东及其他关联方占用资金情况专项报告
34		海外监管公告 - 第七届董事会独立非执行董事关于本公司第七届董事会第二十一次会议相关事项的专项说明及独立意见
35		海外监管公告 - 关于 2021 年日常关联/持续性关联交易预计的公告
36		海外监管公告 - 关于续聘会计师事务所的公告
37		海外监管公告 - 利润分配方案公告
38		海外监管公告 - 第七届监事会第九次会议决议公告
39		海外监管公告 - 内幕信息知情人登记制度
40	2021-04-01	截至二零二一年三月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
41		自愿性公告 - 第一大股东一致行动人增持本公司股票
42	2021-04-06	海外监管公告 - 华西证券股份有限公司关于本公司发行股份购买资产暨关联交易之 2020 年度独立财务顾问持续督导报告书
43	2021-04-12	董事会会议通知
44		2020 年年度报告
45	2021-04-21	致登记股东之通知信函 - 2020 年度报告之发布通知及更改回条
46		致非登记持有人之通知信函 - 2020 年度报告之发布通知及申请表格
47		二零二一年第一季度业绩报告
48		董事名单与其角色和职能
49		公告 - 董事变动
50	2021-04-28	海外监管公告 - 独立董事提名人声明
51		海外监管公告 - 独立董事候选人声明
52		海外监管公告 - 公司第七届董事会独立非执行董事关于第七届董事会第二十二次会议相关事项之独立意见
53		海外监管公告 - 第七届董事会第二十二次会议决议公告
54	2021-04-30	自愿性公告 - 第一大股东一致行动人增持本公司股票
55	2021-05-06	截至二零二一年四月三十日止月份之股份发行人的证券变动月报表

序号	日期	公告事项
56		通函 - (1)2020 年度董事会工作报告; (2)2020 年度监事会工作报告; (3)2020 年年度报告; (4)2020 年度利润分配方案; (5) 关于续聘会计师事务所的议案; (6) 关于预计本公司 2021 年自营投资额度的议案; (7) 关于审议本公司董事、监事 2020 年度报酬总额的议案; (8) 关于预计本公司 2021 年日常关联/持续性关连交易的议案; (9) 建议修订《章程》; (10) 关于再次授权本公司发行境内外公司债券融资工具的议案; (11) 关于本公司发行境内外公司债券融资工具可能涉及的关联/连交易的议案; (12) 建议选举独立非执行董事; (13) 建议以供股方式发行 A 股及 H 股; 年度股东大会通告; 及 2021 年第一次 H 股类别股东会通告
57		年度股东大会通告
58		2021 年第一次 H 股类别股东会通告
59	2021-05-12	代表委任表格 - 适用于将于 2021 年 6 月 29 日 (星期二) 举行的中信证券股份有限公司 2020 年度股东大会及其任何续会
60		代表委任表格 - 适用于将于 2021 年 6 月 29 日 (星期二) 举行的中信证券股份有限公司 2021 年第一次 H 股类别股东会及其任何续会
61		回执 - 适用于将于 2021 年 6 月 29 日 (星期二) 举行的中信证券股份有限公司 2020 年度股东大会及其任何续会
62		回执 - 适用于将于 2021 年 6 月 29 日 (星期二) 举行的中信证券股份有限公司 2021 年第一次 H 股类别股东会及其任何续会
63		致登记股东之通知信函 - 2020 年度股东大会通函、代表委任表格及回条之发布通知及更改回条
64		致非登记持有人之通知信函 - 2020 年度股东大会通函之发布通知及申请表
65		海外监管公告 - 当年累计新增借款超过上年末净资产的百分之二十的公告
66	2021-05-28	海外监管公告 - 关于变更持续督导财务顾问主办人的公告
67	2021-06-01	截至二零二一年五月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表
68	2021-06-07	海外监管公告 - 第七届董事会第二十三次会议决议公告
69		海外监管公告 - 第七届董事会独立非执行董事关于第七届董事会第二十三次会议相关事项之独立意见
70	2021-06-09	2020 年度股东大会第二次通知
71		建议设立资产管理子公司并相应变更公司经营范围; 建议调整公司非执行董事、独立非执行董事及监事补助; 及 2021 年第一次临时股东大会通告
72		2021 年第一次临时股东大会通告
73	2021-06-23	代表委任表格 - 适用于将于 2021 年 8 月 9 日 (星期一) 举行的中信证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会及其任何续会
74		回执 - 适用于将于 2021 年 8 月 9 日 (星期一) 举行的中信证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会及其任何续会
75		致登记股东之通知信函 - 2021 年第一次临时股东大会通函、代表委任表格及回执之发布通知及更改回条
76		致非登记持有人之通知信函 - 2021 年第一次临时股东大会通函之发布通知及申请表
77	2021-06-24	关于调整与派发 2020 年度末期股息相关之 H 股股份暂停过户期间及最后登记日的公告
78	2021-06-27	自愿性公告 - 本公司试点开展基金投资顾问业务收到中国证监会覆函
79	2021-06-28	公告 - 第一大股东承诺全额认购可获配股份
80		公告 2020 年度股东大会、2021 年第一次 A 股类别股东会及 2021 年第一次 H 股类别股东会投票表决结果; 派发 2020 年度末期股息; 及委任独立非执行董事
81	2021-06-30	公司《章程》
82		董事名单与其角色和职能
83		2021 年半年度业绩预增公告