



国信证券
GUOSEN SECURITIES

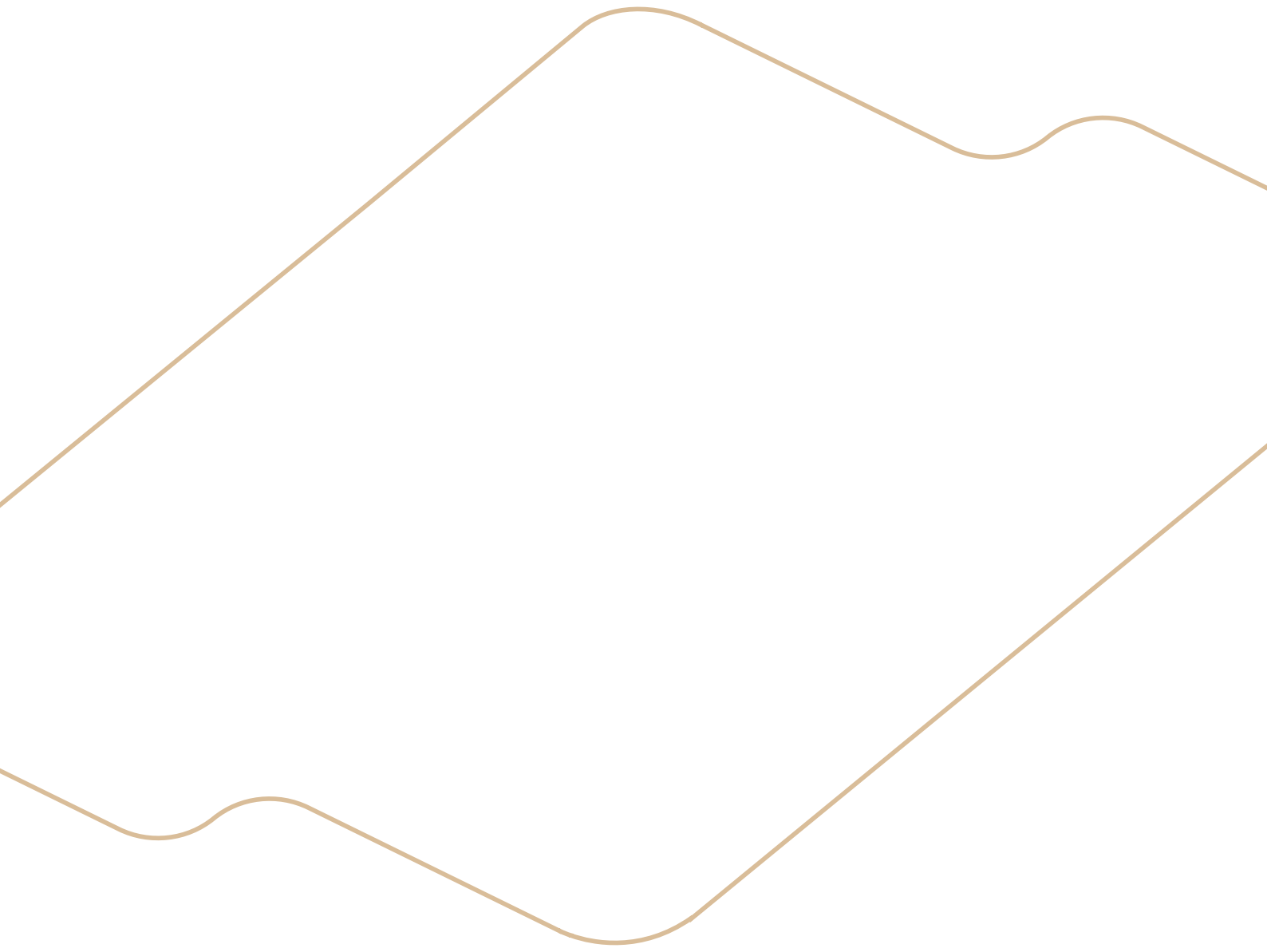
2023

国信证券股份有限公司

年度报告

GUOSEN SECURITIES ANNUAL REPORT

股票代码 Stock Code: 002736



战略愿景

打造全球视野、本土优势、创新驱动、科技引领的
世界一流综合型投资银行

价值观念

创造价值 成就你我 服务社会

文化理念

合规自律 专业务实 诚信稳健 和谐担当



GOEN
USN

董事长致辞

各位股东：

2023年是充满考验和挑战的一年。国际环境复杂严峻，多重困难挑战交织叠加。受发达经济体货币紧缩、社会预期偏弱等因素叠加影响，国内证券市场主要指数不同程度下跌，沪深交易所全年股票成交额同比减少5.5%，A股IPO融资规模同比下降约39%，债券收益率整体震荡下行，证券公司主要业务面临诸多压力。

惟其艰难，方显勇毅。面对复杂的市场环境，公司激流勇进，始终保持战略定力，坚持党建引领，不断改革创新，深化业务转型，夯实稳健经营基础，稳步走好高质量发展之路，各项工作不断取得新成效。公司2023年实现营业收入173.17亿元、净利润64.27亿元，年末总资产达4,629.60亿元、净资产达1,104.60亿元，资本实力和抗风险能力进一步增强。财富管理、投行等传统优势业务市场地位稳固，投资与交易、资产管理等业务进步明显，获批多项创新业务资格，公司高质量发展基础更加扎实。主动承担国有金融企业与上市公司的双重社会责任，聚焦“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道持续发力，首次发布ESG报告。

公司经营发展获得监管机构及市场各方充分认可，保持证监会“白名单”资格和境内券商最高的国际信用评级（惠誉“BBB+”），入选中国上市公司协会董事会最佳实践案例和ESG最佳实践案例，公司法治宣传教育基地获评深圳市五星级法治宣传教育基地，荣获首届中国证券业数字化转型全能君鼎奖等近百个奖项。我谨代表公司董事会对长期以来关心和支持国信证券发展的各级党委和政府、监管机构、广大投资者和客户、合作伙伴、社会各界朋友表示衷心的感谢！

三十而立正风华，继往开来启新程。2024年是中华人民共和国成立75周年，是实现“十四五”规划目标任务的关键一年，是落实中央金融工作会议精神的开局之年，也是公司成立30周年。公司将深刻理解和把握金融在经济高质量发展中的定位、国有大型券商在金融高质量发展中的定位，扎实开展“质量回报双提升”行动，发挥综合金融服务优势，做好“五篇大文章”，助力加快形成新质生产力，锚定“十四五”规划目标和年度经营任务，努力争取实现最好的发展成果，为经济社会发展大局作出最大程度贡献，以更加优异的成绩回报股东、回馈社会。

党委书记、董事长：张纳沙

2024年4月16日

01

第一节

重要提示、目录和释义



重要提示

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

公司负责人张纳沙、主管会计工作负责人及会计机构负责人周中国声明：保证本年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本报告经公司第五届董事会第二十六次会议（定期）审议通过。所有董事均已出席了审议本报告的董事会会议。未有董事、监事、高级管理人员对本报告提出异议。

公司 2023 年度财务报告已经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了无保留意见的审计报告。

本报告中涉及的未来发展计划等前瞻性陈述属于计划性事项，不构成公司对投资者的实质性承诺，敬请投资者注意投资风险。

公司经营中面临的风险主要有市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险等，公司建立了完善的内部控制体系、合规管理体系和风险控制指标动态监管体系，确保公司经营在风险可测、可控、可承受的范围内开展。请投资者认真阅读本年度报告第四节“公司治理”，并特别注意上述风险因素。

经公司第五届董事会第二十六次会议（定期）审议通过的利润分配预案为：以 2023 年 12 月 31 日总股本 9,612,429,377 为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 2.70 元（含税），不进行送股或以公积金转增股本。

目 录

| | |
|-----------------------|-----|
| 董事长致辞..... | 01 |
| 第一节 重要提示、目录和释义 | 03 |
| 第二节 公司简介和主要财务指标 | 07 |
| 第三节 管理层讨论与分析 | 28 |
| 第四节 公司治理 | 59 |
| 第五节 环境和社会责任 | 92 |
| 第六节 重要事项 | 98 |
| 第七节 股份变动及股东情况..... | 115 |
| 第八节 优先股相关情况 | 123 |
| 第九节 债券相关情况 | 125 |
| 第十节 财务报告 | 137 |
| 第十一节 证券公司信息披露..... | 273 |

| | |
|----------------|--|
| 备查 文件 目录 | (一) 载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报表。 |
| | (二) 载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。 |
| | (三) 报告期内公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。 |

释义

| 释义项 | 指 | 释义内容 |
|-------------|---|--------------------|
| 国信证券、公司、本公司 | 指 | 国信证券股份有限公司 |
| 董事会 | 指 | 国信证券股份有限公司董事会 |
| 中国证监会 | 指 | 中国证券监督管理委员会 |
| 中国保监会 | 指 | 原中国保险监督管理委员会 |
| 香港证监会 | 指 | 香港证券及期货事务监察委员会 |
| 深圳证监局 | 指 | 中国证券监督管理委员会深圳监管局 |
| 浙江证监局 | 指 | 中国证券监督管理委员会浙江监管局 |
| 上交所 | 指 | 上海证券交易所 |
| 深交所 | 指 | 深圳证券交易所 |
| 北交所 | 指 | 北京证券交易所 |
| 香港联交所 | 指 | 香港联合交易所有限公司 |
| 中证协 | 指 | 中国证券业协会 |
| 股转公司 | 指 | 全国中小企业股份转让系统有限责任公司 |
| 中登公司 | 指 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 证金公司 | 指 | 中国证券金融股份有限公司 |
| 深圳市国资委 | 指 | 深圳市人民政府国有资产监督管理委员会 |
| 深投控 | 指 | 深圳市投资控股有限公司 |
| 华润信托 | 指 | 华润深国投信托有限公司 |
| 云南红塔 | 指 | 原云南红塔集团有限公司 |
| 云南合和 | 指 | 云南合和（集团）股份有限公司 |
| 中国一汽 | 指 | 中国第一汽车集团有限公司 |
| 一汽投资 | 指 | 一汽股权投资（天津）有限公司 |
| 北京城建 | 指 | 北京城建投资发展股份有限公司 |
| 国信弘盛 | 指 | 国信弘盛私募基金管理有限公司 |
| 国信期货 | 指 | 国信期货有限责任公司 |
| 国信香港 | 指 | 国信证券（香港）金融控股有限公司 |
| 国信资本 | 指 | 国信资本有限责任公司 |
| 鹏华基金 | 指 | 鹏华基金管理有限公司 |
| REITs | 指 | 基础设施证券投资基金 |
| QFII | 指 | 合格境外机构投资者 |
| ETF | 指 | 交易型开放式指数基金 |
| 《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》 |
| 《公司章程》 | 指 | 《国信证券股份有限公司章程》 |
| 报告期 | 指 | 2023 年 |
| 报告期末 | 指 | 2023 年 12 月 31 日 |
| 元 | 指 | 人民币元 |

2023 年年度报告中，部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异，这些差异是由于四舍五入造成的。

02

第二节

公司简介和主要财务指标



一、公司信息

| | | | |
|--------------|---|------|--------|
| 股票简称 | 国信证券 | 股票代码 | 002736 |
| 变更后的股票简称 | 不适用 | | |
| 股票上市证券交易所 | 深圳证券交易所 | | |
| 公司的中文名称 | 国信证券股份有限公司 | | |
| 公司的中文简称 | 国信证券 | | |
| 公司的外文名称 | GUOSEN SECURITIES CO.,LTD. | | |
| 公司的外文名称缩写 | GUOSEN SECURITIES | | |
| 公司的法定代表人 | 张纳沙 | | |
| 公司的总经理 | 邓舸 | | |
| 注册地址 | 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 | | |
| 注册地址的邮政编码 | 518001 | | |
| 公司注册地址历史变更情况 | 不适用 | | |
| 主要办公地址 | 深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 | | |
| 主要办公地址的邮政编码 | 518046 | | |
| 公司网址 | http://www.guosen.com.cn | | |
| 电子信箱 | ir@guosen.com.cn | | |
| 公司注册资本 | 96.12 亿元 | | |
| 公司净资本 | 821.40 亿元 | | |

二、联系人和联系方式

| | | | |
|-------|---------------------------------|--------|---------------------------------|
| 董事会秘书 | 谌传立 | 证券事务代表 | 蔡妮芬 |
| 联系地址 | 深圳市福田区福华一路 125 号 国信金融大厦 45 楼 | 联系地址 | 深圳市福田区福华一路 125 号 国信金融大厦 45 楼 |
| 电 话 | 0755-82130188 | 电 话 | 0755-82130188 |
| 传 真 | 0755-82133453 | 传 真 | 0755-82133453 |
| 电子信箱 | ir@guosen.com.cn | 电子信箱 | ir@guosen.com.cn |

三、信息披露及备置地点

| | |
|------------------|--|
| 公司披露年度报告的证券交易所网站 | 深交所网站 (http://www.szse.cn) |
| 公司披露年度报告的媒体名称及网址 | 《证券时报》 (http://www.stcn.com) 《中国证券报》 (https://www.cs.com.cn) 《上海证券报》 (https://www.cnstock.com) 《证券日报》 (http://www.zqrb.cn) |
| 公司年度报告备置地点 | 深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 45 楼董事会办公室 |

四、注册变更情况

| | |
|-----------------|---|
| 统一社会信用代码 | 914403001922784445 |
| 公司上市以来主营业务的变化情况 | 公司的经营范围为：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；金融产品代销；为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管业务；股票期权做市；上市证券做市交易。 公司上市以来主营业务未发生重大变化。 |
| 历次控股股东的变更情况 | 公司控股股东为深投控，报告期内未发生变更。 |

五、各单项业务资格

(一) 报告期末，公司及控股子公司获取的各单项业务资格情况

1. 财富管理与机构业务

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|---------------------------|-------------|
| 1 | 2001年2月5日 | 网上证券委托业务资格 | 中国证监会 |
| 2 | 2002年8月6日 | 开放式证券投资基金代销业务资格 | 中国证监会 |
| 3 | 2005年8月22日 | 权证买入合资格结算参与人 | 中登公司 |
| 4 | 2006年3月28日 | 中国证券登记结算有限责任公司结算参与人 | 中登公司 |
| 5 | 2008年2月1日 | 中国证券登记结算有限公司甲类结算参与人 | 中登公司 |
| 6 | 2008年5月13日 | 为国信期货提供中间介绍业务资格 | 中国证监会 |
| 7 | 2011年2月23日 | 向保险机构投资者提供交易单元 | 中国保监会 |
| 8 | 2011年5月20日 | 开展客户资金第三方存管单客户多银行服务资格 | 深圳证监局 |
| 9 | 2011年9月16日 | 外币有价证券经纪业务、承销业务资格 | 国家外汇管理局 |
| 10 | 2012年12月21日 | 私募基金资产托管业务试点资格 | 中国证监会 |
| 11 | 2013年3月14日 | 代销金融产品业务资格 | 深圳证监局 |
| 12 | 2013年12月31日 | 证券投资基金托管资格 | 中国证监会 |
| 13 | 2014年3月11日 | 开展客户证券资金消费支付服务资格 | 中国证监会 |
| 14 | 2014年9月17日 | 开展互联网证券业务试点资格 | 中证协 |
| 15 | 2014年10月14日 | A股交易单元的港股通业务交易权限 | 上交所 |
| 16 | 2015年1月16日 | 股票期权经纪业务、自营业务交易参与人资格 | 上交所 |
| 17 | 2015年1月16日 | 期权业务结算资格 | 中登公司 |
| 18 | 2015年1月22日 | 衍生品合约账户开户资格 | 中登公司 |
| 19 | 2015年4月21日 | 私募基金份额登记外包服务资格、估值核算外包服务资格 | 中国证券投资基金业协会 |
| 20 | 2016年11月3日 | 深港通下港股通业务交易权限 | 深交所 |
| 21 | 2019年3月26日 | 证券账户业务无纸化业务资格 | 中登公司 |
| 22 | 2019年12月9日 | 股票期权经纪业务、自营业务交易参与人资格 | 深交所 |
| 23 | 2021年6月2日 | 基金投资顾问业务试点资格 | 中国证监会 |
| 24 | 2021年11月30日 | 账务管理功能优化试点业务资格 | 中国证监会 |
| 25 | 2022年11月18日 | 个人养老金基金销售业务资格 | 中国证监会 |

2. 投资银行业务

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|-----------------------|--------------|
| 1 | 2004年 | 保荐机构资格 | 中国证监会 |
| 2 | 2005年10月31日 | 从事短期融资券承销业务资格 | 中国人民银行 |
| 3 | 2012年6月11日 | 中小企业私募债承销业务资格 | 中证协 |
| 4 | 2013年1月4日 | 银行间非金融企业债务融资工具主承销业务资格 | 中国银行间市场交易商协会 |
| 5 | 2013年3月21日 | 全国股转系统主办券商资格 | 股转公司 |
| 6 | 2013年5月8日 | 军工涉密业务咨询服务 | 国家国防科技工业局 |
| 7 | 2013年8月29日 | 浙江股权交易中心会员 | 中证协 |
| 8 | 2013年12月30日 | 新疆股权交易中心会员 | 中证协 |
| 9 | 2014年2月19日 | 海峡股权交易中心会员 | 中证协 |
| 10 | 2020年12月18日 | 非金融企业债务融资工具独立主承销商资质 | 中国银行间市场交易商协会 |

3. 投资与交易业务

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|---|----------------|
| 1 | 1999年9月21日 | 进入银行间同业市场资格 | 中国人民银行 |
| 2 | 2007年7月10日 | 上交所固定收益证券综合电子平台交易商资格 | 上交所 |
| 3 | 2009年4月24日 | 从事债券质押式报价回购业务试点资格 | 中国证监会 |
| 4 | 2011年3月21日 | 自营业务参与股指期货交易资格 | 深圳证监局 |
| 5 | 2012年12月21日 | 柜台交易业务资格 | 中证协 |
| 6 | 2013年7月29日 | 柜台市场股票协议逆回购业务、场外期权柜台交易业务、柜台市场权益收益互换交易业务方案备案 | 中证协 |
| 7 | 2013年12月18日 | 期权全真模拟交易经纪业务 | 上交所 |
| 8 | 2013年12月18日 | 期权全真模拟交易自营业务 | 上交所 |
| 9 | 2013年12月18日 | 全真模拟交易做市业务 | 上交所 |
| 10 | 2014年5月21日 | 开展场外市场收益凭证业务试点资格 | 中证协 |
| 11 | 2014年5月23日 | 修改收益互换与场外期权业务方案的备案 | 中证协 |
| 12 | 2014年7月2日 | 作为主办券商从事做市业务的资格 | 股转公司 |
| 13 | 2015年2月6日 | 股票期权做市业务资格 | 中国证监会 |
| 14 | 2015年3月4日 | 非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务资格 | 北京金融资产交易所有限公司 |
| 15 | 2015年3月19日 | 债券交易净额清算业务资格 | 银行间市场清算所股份有限公司 |
| 16 | 2015年4月3日 | 标准债券远期集中清算业务资格 | 银行间市场清算所股份有限公司 |

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|----------------------|--------------|
| 17 | 2015年5月5日 | 非金融企业债务融资工具报价业务资格 | 中国银行间市场交易商协会 |
| 18 | 2016年3月1日 | 上证50ETF期权合约品种主做市商资格 | 上交所 |
| 19 | 2018年7月31日 | 场外期权业务二级交易商资格 | 中证协 |
| 20 | 2019年2月28日 | 信用衍生品业务资格 | 中国证监会 |
| 21 | 2019年3月22日 | 银行间债券市场尝试做市业务资格 | 全国银行间同业拆借中心 |
| 22 | 2019年4月8日 | 上交所信用保护合约核心交易商 | 上交所 |
| 23 | 2019年7月3日 | 深交所信用保护合约核心交易商 | 深交所 |
| 24 | 2019年12月11日 | 信用保护凭证创设机构 | 上交所 |
| 25 | 2019年12月11日 | 深交所沪深300ETF期权主做市商资格 | 深交所 |
| 26 | 2019年12月18日 | 中金所沪深300股指期货期权主做市商资格 | 中国金融期货交易所 |
| 27 | 2019年12月23日 | 上交所沪深300ETF期权主做市商资格 | 上交所 |
| 28 | 2020年4月8日 | 债券通报价机构 | 中国外汇交易中心 |
| 29 | 2021年6月29日 | 信用缓释工具一般交易商资格 | 中国银行间交易商协会 |
| 30 | 2022年3月23日 | 信用保护凭证创设机构 | 深交所 |
| 31 | 2022年4月13日 | 受信用保护债券质押式回购业务合格创设机构 | 中登公司 |
| 32 | 2022年7月22日 | 中证1000股指期货期权主做市商资格 | 中国金融期货交易所 |
| 33 | 2022年9月15日 | 上市证券做市交易业务资格 | 中国证监会 |
| 34 | 2022年9月16日 | 中证500ETF期权主做市商资格 | 上交所 |
| 35 | 2022年9月19日 | 创业板ETF期权主做市商资格 | 深交所 |
| 36 | 2022年9月19日 | 中证500ETF期权主做市商资格 | 深交所 |
| 37 | 2022年12月12日 | 深证100ETF期权主做市商资格 | 深交所 |
| 38 | 2022年12月19日 | 上证50股指期货期权主做市商资格 | 中国金融期货交易所 |
| 39 | 2023年2月3日 | 交易所债券做市商 | 深交所、上交所 |
| 40 | 2023年2月20日 | 北交所股票做市交易业务 | 北交所 |
| 41 | 2023年6月2日 | 科创50ETF期权主做市商 | 上交所 |
| 42 | 2023年12月25日 | 信用风险缓释工具核心交易商 | 银行间交易商协会 |
| 43 | 2023年12月25日 | 信用风险缓释凭证创设机构 | 银行间交易商协会 |
| 44 | 2023年12月25日 | 信用联结票据创设机构 | 银行间交易商协会 |

4. 资产管理业务

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|------------|-----------------------|-------|
| 1 | 2002年6月23日 | 客户资产管理业务资格 | 中国证监会 |
| 2 | 2008年3月2日 | 合格境内机构投资者从事境外证券投资业务资格 | 中国证监会 |
| 3 | 2011年6月14日 | 资产管理业务参与股指期货交易资格 | 深圳证监局 |
| 4 | 2012年7月31日 | 开展现金管理产品试点 | 中国证监会 |
| 5 | 2013年3月5日 | 受托保险资金管理业务资格 | 中国保监会 |

5. 资本中介业务

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|--------------------|-------|
| 1 | 2010年3月18日 | 融资融券业务资格 | 中国证监会 |
| 2 | 2012年5月22日 | 约定购回式证券交易业务试点资格 | 中国证监会 |
| 3 | 2012年5月29日 | 约定购回式证券交易权限 | 上交所 |
| 4 | 2012年8月29日 | 转融通业务试点资格 | 证金公司 |
| 5 | 2012年10月26日 | 上市公司股权激励行权融资业务试点资格 | 中国证监会 |
| 6 | 2013年1月12日 | 约定购回式证券交易权限 | 深交所 |
| 7 | 2013年2月25日 | 转融通证券出借交易权限 | 深交所 |
| 8 | 2013年2月27日 | 转融通证券出借交易权限 | 上交所 |
| 9 | 2013年6月21日 | 股票质押式回购交易权限 | 上交所 |
| 10 | 2013年6月21日 | 股票质押式回购交易权限 | 深交所 |
| 11 | 2014年5月30日 | 上市公司限制性股票融资业务资格 | 中国证监会 |
| 12 | 2019年7月18日 | 科创板转融券业务资格 | 证金公司 |
| 13 | 2020年8月19日 | 创业板转融券业务资格 | 证金公司 |

6. 国信弘盛获取的单项业务资格

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|------------|--------------------|--------------|
| 1 | 2008年6月17日 | 开展直投业务资格 | 中国证监会 |
| 2 | 2012年9月19日 | 开展直投基金业务资格 | 中国证监会 |
| 3 | 2022年8月24日 | 外商投资股权投资试点企业（QFLP） | 深圳市地方金融监督管理局 |

7. 国信期货获取的单项业务资格

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|--------------------|------------|
| 1 | 2007年12月10日 | 金融期货经纪业务资格 | 中国证监会 |
| 2 | 2008年2月14日 | 上海期货交易所会员资格 | 上海期货交易所 |
| 3 | 2008年12月19日 | 大连商品交易所会员资格 | 大连商品交易所 |
| 4 | 2008年3月5日 | 金融期货交易结算业务资格 | 中国证监会 |
| 5 | 2008年4月2日 | 中国金融期货交易所交易结算会员 | 中国金融期货交易所 |
| 6 | 2009年3月25日 | 郑州商品交易所的会员资格 | 郑州商品交易所 |
| 7 | 2010年3月12日 | 委托国信证券提供IB业务资格 | 中国证监会河南监管局 |
| 8 | 2012年1月29日 | 期货投资咨询业务资格 | 中国证监会 |
| 9 | 2013年2月1日 | 资产管理业务资格 | 中国证监会 |
| 10 | 2013年11月4日 | 为保险机构提供期货经纪服务资格的备案 | 中国保监会 |
| 11 | 2017年6月5日 | 上海国际能源交易中心会员资格 | 上海国际能源交易中心 |
| 12 | 2022年6月1日 | 广州期货交易所会员资格 | 广州期货交易所 |

8. 国信香港及其控股子公司获取的单项业务资格

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|---------------------------|--------------|
| 1 | 2010年2月26日 | 第1类：证券交易（经纪公司） | 香港证监会 |
| 2 | 2010年2月26日 | 第4类：就证券提供意见（经纪公司） | 香港证监会 |
| 3 | 2010年3月15日 | 联交所参与者 | 香港联交所 |
| 4 | 2010年3月15日 | 香港结算参与者 | 香港中央结算有限公司 |
| 5 | 2010年6月29日 | 第4类：就证券提供意见（资管公司） | 香港证监会 |
| 6 | 2010年6月29日 | 第9类：提供资产管理（资管公司） | 香港证监会 |
| 7 | 2010年6月30日 | 第1类：证券交易（融资公司）（注2、3） | 香港证监会 |
| 8 | 2010年6月30日 | 第6类：就机构融资提供意见（融资公司）（注2、3） | 香港证监会 |
| 9 | 2011年3月14日 | 第2类：期货合约交易（经纪公司） | 香港证监会 |
| 10 | 2011年3月14日 | 第5类：就期货合约提供意见（经纪公司） | 香港证监会 |
| 11 | 2011年4月11日 | 期交所参与者 | 香港期货交易所有限公司 |
| 12 | 2011年4月11日 | 期货结算公司参与者 | 香港期货结算有限公司 |
| 13 | 2011年10月28日 | 第1类：证券交易（资管公司） | 香港证监会 |
| 14 | 2016年12月5日 | 中华通交易所参与者 | 香港交易及结算所有限公司 |
| 15 | 2016年12月5日 | 中华通结算参与者 | 香港交易及结算所有限公司 |
| 16 | 2020年7月21日 | 经营证券期货业务许可证（国信香港）（注4） | 中国证监会 |
| 17 | 2021年12月21日 | 经营证券期货业务许可证（资管公司）（注5） | 中国证监会 |

注1：“经纪公司”指国信证券（香港）经纪有限公司；“资管公司”指国信证券（香港）资产管理有限公司；“融资公司”指国信证券（香港）融资有限公司。

注2：就第1类受规管活动而言，持牌人不得从事涉及企业融资以外的交易活动。

注3：持牌人不得持有客户资产。“持有”及“客户资产”的定义已在《证券及期货条例》的释义条文内界定。

注4：国信香港于2011年12月22日获取的《证券投资业务许可证》已经由《经营证券期货业务许可证》替代。

注5：资管公司于2013年9月29日获取的《合格境外机构投资者证券投资业务许可》已经由《经营证券期货业务许可证》替代。

（二）报告期内公司及控股子公司获取的单项业务资格情况

| 序号 | 获取时间 | 业务资格 | 批准机构 |
|----|-------------|---------------|----------|
| 1 | 2023年2月3日 | 交易所债券做市商 | 深交所、上交所 |
| 2 | 2023年2月20日 | 北交所股票做市交易业务 | 北交所 |
| 3 | 2023年6月2日 | 科创50ETF期权主做市商 | 上交所 |
| 4 | 2023年12月25日 | 信用风险缓释工具核心交易商 | 银行间交易商协会 |
| 5 | 2023年12月25日 | 信用风险缓释凭证创设机构 | 银行间交易商协会 |
| 6 | 2023年12月25日 | 信用联结票据创设机构 | 银行间交易商协会 |

六、公司历史沿革

（一）公司成立

公司前身深圳国投证券有限公司于1994年6月由深圳国际信托投资公司与中国国际企业合作公司共同出资设立，注册资本为10,000万元，深圳国际信托投资公司及中国国际企业合作公司各占注册资本的70%及30%。

（二）第一次股权转让、增资及更名

1996年6月，中国国际企业合作公司将持有的公司30%股权转让给深圳市投资管理公司，本次股权转让后，公司的股东变更为深圳国际信托投资公司和深圳市投资管理公司，各占注册资本的70%及30%。

1997年6月，公司以扣除公益金后的公积金及未分配利润转增注册资本，并引入新投资者深圳市深业投资开发有限公司对公司增资。本次增资完成后，公司注册资本增加至80,000万元，股东变更为深圳国际信托投资公司、深圳市投资管理公司和深圳市深业投资开发有限公司，各占注册资本的51%、29%及20%。

1997年6月，公司名称变更为“国信证券有限公司”。

（三）第二次股权转让、增资及更名

1999年4月，深圳市深业投资开发有限公司将持有公司20%股权转让给深圳市机场股份有限公司。

1999年7月，公司股东会决议，以可分配利润及公积金向原股东转增注册资本，并引入云南红塔实业有限责任公司、

中国一汽和北京城建股份有限公司等 3 家新投资者，同时深圳国际信托投资公司和深圳市投资管理公司分别向深圳市机场股份有限公司转让部分股权。

2000 年 6 月公司名称规范为“国信证券有限责任公司”，注册资本变更为 200,000 万元，股东为深圳国际信托投资公司、深圳市投资管理公司、深圳市机场股份有限公司、云南红塔实业有限责任公司、中国第一汽车集团有限公司和北京城建股份有限公司，各占注册资本的 30%、20%、20%、20%、5.10% 及 4.90%。

(四) 第三次股权转让

2006 年 4 月，深圳市机场股份有限公司将其持有公司的 20% 股权转让给深圳市机场（集团）有限公司。

(五) 第四次股权转让

2007 年 1 月，深圳市机场（集团）有限公司将其持有公司 20% 的股权转让给深投控。

(六) 整体变更为股份有限公司

2008 年 3 月，公司以 2007 年 12 月 31 日经审计的净资产折股变更为股份有限公司，注册资本变更为 700,000 万元，股东为深投控、华润信托、云南红塔、中国一汽和北京城建，持股比例分别为 40%、30%、20%、5.10% 及 4.90%。

(七) 2014 年 12 月首次公开发行股票并上市

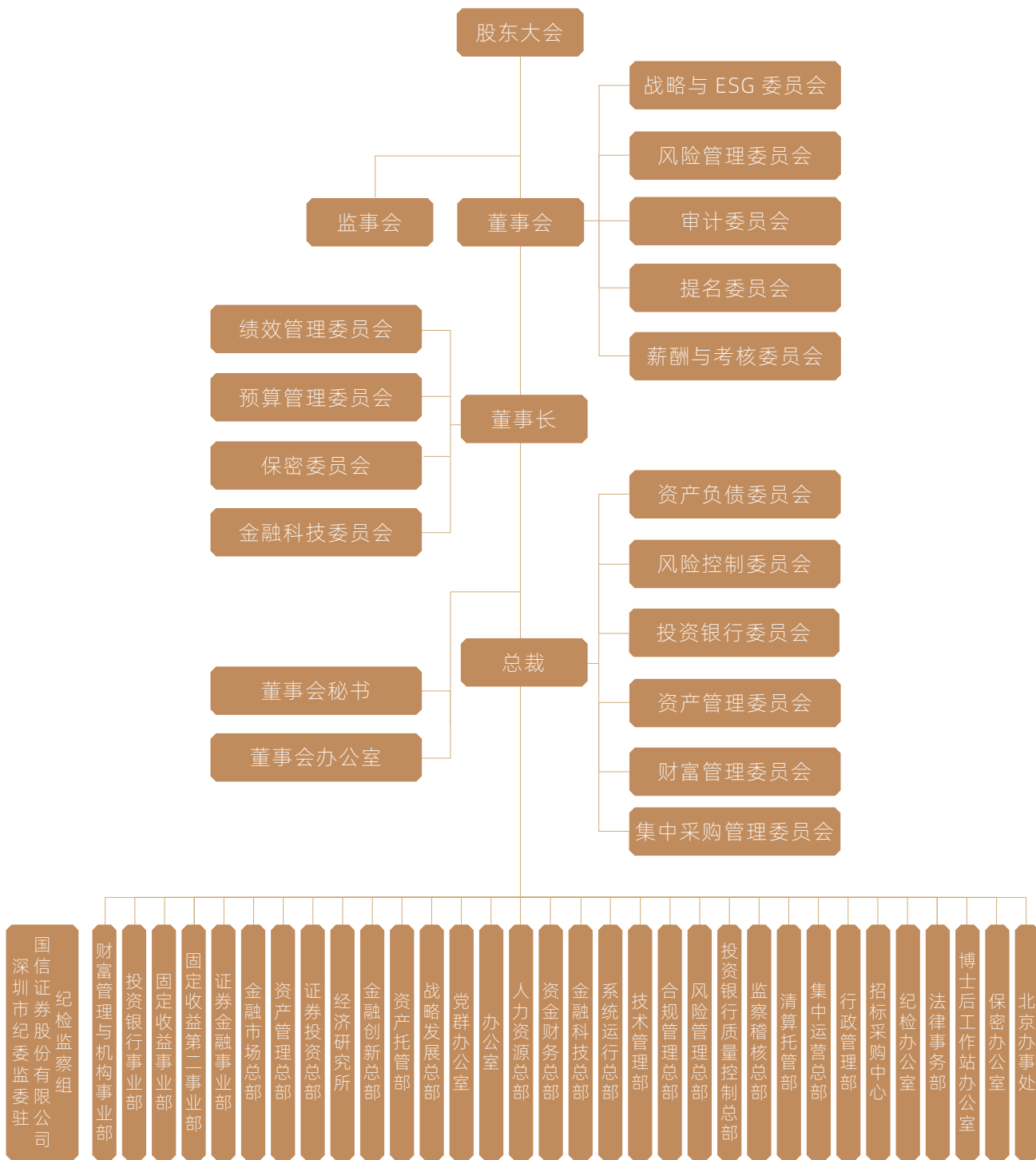
2014 年 12 月 10 日，公司收到中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》（证监许可[2014]1335 号），核准公司公开发行新股不超过 12 亿股。2014 年 12 月 29 日，公司发行的 12 亿股人民币普通股股票在深交所上市交易。2015 年 3 月 4 日，公司完成相关的工商变更登记及备案手续，注册资本由 700,000 万元变更为 820,000 万元。

(八) 2020 年 8 月非公开发行 A 股股票

经中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2020]471 号）核准，公司向深投控、华润信托、云南合和、全国社会保障基金理事会等 10 名特定投资者非公开发行 1,412,429,377 股 A 股股票。2020 年 8 月 14 日，新股在深交所上市。2020 年 11 月 12 日，公司完成相关的工商变更登记及备案手续，注册资本由 820,000 万元变更为 961,242.9377 万元。

七、公司组织机构情况

(一) 公司组织机构



(二) 境内外重要分公司

| 序号 | 分公司名称 | 营业地址 | 成立日期 | 负责人 |
|----|------------|--|------------------|-----|
| 1 | 深圳分公司 | 深圳市福田区华强北街道华航社区华富路 1018 号中航中心西座 21 层 01、03-08 单元 | 2013 年 4 月 12 日 | 魏 辉 |
| 2 | 深圳红岭分公司 | 深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 6 号免税商务大厦 1601 楼整层 | 2021 年 6 月 22 日 | 谢庆伟 |
| 3 | 深圳深南分公司 | 深圳市福田区南园街道巴登社区深南中路 1099 号平安银行大厦 18 层 | 2014 年 9 月 2 日 | 钱湘平 |
| 4 | 深圳泰九分公司 | 深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1258 号卓越后海金融中心 2601-2612 | 2015 年 12 月 29 日 | 张世光 |
| 5 | 深圳科技园分公司 | 深圳市南山区粤海街道铜鼓路 39 号大冲商务中心（三期）4 栋 32A3BC1 | 2002 年 4 月 23 日 | 周国柳 |
| 6 | 深圳前海分公司 | 深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 170102A | 2021 年 5 月 27 日 | 邹 青 |
| 7 | 深圳互联网分公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路 125 号国信金融大厦 7 层及裙楼 1 层东南角 | 2010 年 9 月 9 日 | 王燕华 |
| 8 | 浙江互联网分公司 | 浙江省杭州市滨江区长河街道滨盛路 1688 号明豪大厦 1002、1005、1007 室 | 2020 年 7 月 9 日 | 王建维 |
| 9 | 西南互联网分公司 | 中国（四川）自由贸易试验区成都高新区天府大道北段 1777 号 7 栋 1 单元 8 层 02、03、04 单元 | 2020 年 7 月 8 日 | 段 志 |
| 10 | 上海分公司 | 中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄 1 号楼 1108 室 -1112 室 | 2009 年 9 月 24 日 | 殷红华 |
| 11 | 上海自贸试验区分公司 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 807-808 室 | 2015 年 5 月 6 日 | 张 芬 |
| 12 | 北京分公司 | 北京市海淀区三里河路 13 号 1、10、11 层 | 2000 年 7 月 5 日 | 谢 青 |
| 13 | 广州分公司 | 广州市天河区天河北路 183-187 号 1901-1916 室，2001-2016 室 | 2009 年 8 月 13 日 | 陈奕辉 |
| 14 | 广西分公司 | 广西省南宁市青秀区民族大道 146 号三祺广场 2801、2803A 单元 | 2014 年 8 月 5 日 | 胡晓波 |
| 15 | 浙江分公司 | 浙江省杭州市萧山区宁围街道诺德财富中心 1 幢 102 室、2901-2904 室 | 2001 年 3 月 1 日 | 章海波 |
| 16 | 金华分公司 | 中国（浙江）自由贸易试验区金华市义乌市福田街道城北路国信证券大厦 1 楼、601、607-609 号 | 2010 年 4 月 29 日 | 叶 玲 |
| 17 | 浙江自贸区分公司 | 中国（浙江）自由贸易试验区舟山市普陀区东港街道文康街 53 号、55 号 | 2022 年 5 月 20 日 | 袁如佳 |
| 18 | 杭州分公司 | 浙江省杭州市上城区万象城 3 幢 901-902、908 室 | 2009 年 8 月 13 日 | 王 帆 |
| 19 | 绍兴分公司 | 浙江省绍兴市越城区解放大道 713-1、越发大厦 1803 室 | 2014 年 7 月 21 日 | 陈 锋 |
| 20 | 温州分公司 | 浙江省温州市鹿城区南汇街道温州大道 2088 号悦尚大厦 1 幢 106 号、1 幢 701 室、707 室 | 2009 年 8 月 3 日 | 殷 俊 |

| 序号 | 分公司名称 | 营业地址 | 成立日期 | 负责人 |
|----|--------|---|------------------|-----|
| 21 | 台州分公司 | 浙江省台州市台州湾新区海虹街道市府大道 211、213、215、217 号 | 2014 年 9 月 22 日 | 沈金丹 |
| 22 | 宁波分公司 | 浙江省宁波市海曙区厂堂街 80 号 (8-2) - (8-5) 室、88 号 (1-4) 室 | 2014 年 7 月 31 日 | 夏 映 |
| 23 | 福建分公司 | 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场 30 层 01-09 室 | 2014 年 6 月 27 日 | 陈茹娟 |
| 24 | 四川分公司 | 四川省成都市武侯区人民南路四段 46 号附 1 号上善国际写字楼 2 栋 22 楼 1 号 | 2013 年 1 月 11 日 | 刘应达 |
| 25 | 江苏分公司 | 南京市鼓楼区汉中路 2 号亚太商务楼第 17 层 19 层 | 2013 年 1 月 24 日 | 张 宁 |
| 26 | 苏州分公司 | 中国 (江苏) 自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区苏州中心广场 58 幢 3401 室内中的 35 层 03 号 | 2021 年 6 月 22 日 | 张旭薇 |
| 27 | 湖北分公司 | 湖北省武汉市江岸区沿江大道 159 号时代广场 1 座 16-17 层 | 1998 年 1 月 9 日 | 文德军 |
| 28 | 江西分公司 | 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1568 号红谷凯旋商业办公综合楼及商业六 101、901、902、904、906 室 | 2014 年 8 月 7 日 | 徐汉坤 |
| 29 | 佛山分公司 | 广东省佛山市禅城区季华六路三号一区 2 座 24 楼 | 2000 年 11 月 17 日 | 王厚伟 |
| 30 | 陕西分公司 | 陕西省西安市浐灞生态区东二环 6589 号陕西建工第五建设集团有限公司总部办公大楼 20 层 -2 层 L2-16A | 2012 年 4 月 27 日 | 卢龙斌 |
| 31 | 甘肃分公司 | 甘肃省兰州市城关区甘南路 122 号至诚首府写字楼 13 楼 | 2010 年 4 月 6 日 | 陈兔明 |
| 32 | 珠海分公司 | 广东省珠海市香洲区拱北九州大道西 2021 号富华里中心写字楼 A 座 28 层 2801、02、03、04、05、06 室 | 2014 年 7 月 15 日 | 田 赛 |
| 33 | 湖南分公司 | 湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道茶子山东路 102 号浦发金融大厦第 7 层 | 2014 年 7 月 15 日 | 鞠 玮 |
| 34 | 天津分公司 | 天津市和平区小白楼街解放北路与哈尔滨道交口东北侧金之谷大厦 1-102 号、1-901 号、1-902 号、1-903 号、1-904 号 | 2012 年 7 月 25 日 | 朱 勇 |
| 35 | 粤西分公司 | 广东省佛山市顺德区大良街道德和社区国泰南路 3 号保利商贸中心 1 栋 10 层办公室 1001-1012 单元 | 2006 年 8 月 14 日 | 林 枫 |
| 36 | 中山分公司 | 中山市东区中山五路 2 号紫马奔腾广场 6 座 9 层 | 2012 年 7 月 30 日 | 黄文熹 |
| 37 | 山东分公司 | 济南市历城区华信路 3 号鑫苑鑫中心 7 号楼历城金融大厦 112-113、1801-1804、1810-1812 | 2009 年 8 月 25 日 | 姜仁东 |
| 38 | 烟台分公司 | 山东省烟台市经济技术开发区珠江路 66 号正海大厦 104、1709、1710 室 | 2014 年 9 月 10 日 | 冯 杨 |
| 39 | 惠州分公司 | 惠州市文明一路 9 号富绅大厦 24 层 01 号 01、02、03、04、05、10、11、12 单元 | 2014 年 9 月 25 日 | 朱林峰 |
| 40 | 大连分公司 | 辽宁省大连市沙河口区高尔基路 737 号 3 层 1 号 | 1997 年 7 月 15 日 | 杨春生 |
| 41 | 黑龙江分公司 | 黑龙江省哈尔滨市道里区群力新区景江西路 1 栋商业 1-4 层 009 号 | 2014 年 7 月 4 日 | 郑少友 |

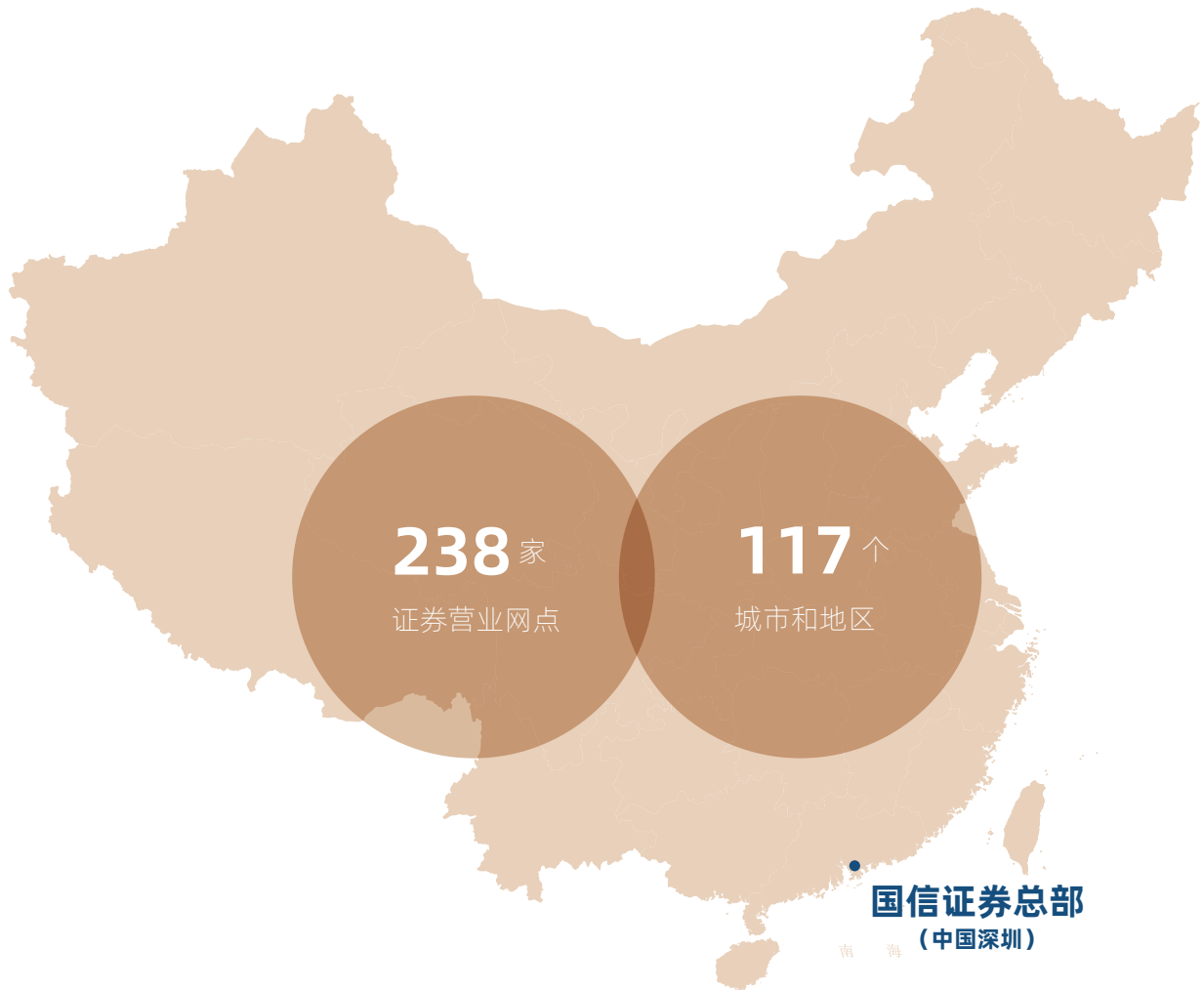
| 序号 | 分公司名称 | 营业地址 | 成立日期 | 负责人 |
|----|---------|--|-----------------|-----|
| 42 | 云南分公司 | 云南省昆明市西山区前卫西路润城小区 A4 块地 2 栋 8 层 | 2014 年 8 月 15 日 | 陈正鑫 |
| 43 | 江苏苏南分公司 | 江苏省无锡市滨湖区万达广场 A 区梁溪路 51 号 12 楼 | 2014 年 8 月 6 日 | 阎 肃 |
| 44 | 河南分公司 | 河南省郑州市二七区民主路 10 号华润大厦 20 层 2004 室至 2006 室 | 2014 年 6 月 25 日 | 贾少飞 |
| 45 | 东莞分公司 | 广东省东莞市南城区胜和路金盈大厦主附楼二楼 | 2010 年 3 月 4 日 | 王 凌 |
| 46 | 吉林分公司 | 吉林省长春市朝阳区西安大路万达时代商务中心 101 号 | 2003 年 7 月 7 日 | 王 浩 |
| 47 | 重庆分公司 | 重庆市江北区庆云路 16 号 18-1 至 18-3、18-5 至 18-11 | 2014 年 7 月 4 日 | 高 莉 |
| 48 | 安徽分公司 | 安徽省合肥市包河区马鞍山路 130 号包河万达广场 7 号楼 12 层 | 2007 年 1 月 11 日 | 代汉军 |
| 49 | 辽宁分公司 | 沈阳市和平区南京南街 52 号鸿源大厦一楼大堂北侧、五楼 | 2007 年 1 月 5 日 | 孟 寰 |
| 50 | 山西分公司 | 山西省太原市晋源区长兴南街 8 号环球金融中心 29 层 | 2014 年 8 月 11 日 | 曹 星 |
| 51 | 河北分公司 | 河北省石家庄市裕华区建设南大街 59 号 1-2 层 | 2014 年 9 月 1 日 | 朱晓科 |
| 52 | 青岛分公司 | 青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦七层 | 2014 年 8 月 20 日 | 杨 翔 |
| 53 | 海南分公司 | 海南省海口市龙华区世贸北路 1 号海岸壹号之佳景国际之第 1 层前左 2 垮和第 4 层前大半层 | 2010 年 3 月 15 日 | 陈协明 |
| 54 | 内蒙古分公司 | 内蒙古呼和浩特市赛罕区大学东街 68 号印象北京 1 号楼 18 层 1801 号 | 2010 年 4 月 1 日 | 徐洁静 |
| 55 | 贵州分公司 | 贵州省贵阳市观山湖区长岭北路 6 号东原财富广场一期 1 号楼 1 单元 1 层 1 室门面, 5 层 7-14 号房 | 2015 年 6 月 10 日 | 陈雄滨 |
| 56 | 宁夏分公司 | 宁夏银川市兴庆区上海东路北侧、民族北街东侧中环大厦 11 层 1、2、3、4、12 号房、1 层 6 号房 (自主申报) | 2014 年 7 月 14 日 | 冯啟枝 |
| 57 | 新疆分公司 | 新疆乌鲁木齐新市区北京南路 203 号中厦大厦 1 栋 9 层北向半层、10 层 | 2014 年 8 月 5 日 | 屈娜娜 |

(三) 境内外控股子公司、参股公司

| 序号 | 公司名称 | 注册地址 | 设立时间 | 注册资本 (万元) | 持股比例 | 负责人 |
|----|-------------------|---|------------------|--------------|---------|-----|
| 1 | 国信弘盛 | 深圳市罗湖区桂园街道红村社区红岭中路 1012 号国信证券 1601 | 2008 年 8 月 8 日 | 280,625 | 100.00% | 成 飞 |
| 2 | 国信期货 | 上海市虹口区东大名路 358 号 2001、2002、2003、2005、2006、2007、2008、2009、2010、2013、2015、2016、2017 室 | 1995 年 5 月 4 日 | 200,000 | 100.00% | 邓 舸 |
| 3 | 国信香港 | 香港金钟道 88 号太古广场 1 座 32 楼 3207-3212 室 | 2008 年 11 月 13 日 | 港币 263,000 | 100.00% | 谌传立 |
| 4 | 国信资本 | 深圳市龙华区民治街道北站社区汇隆商务中心 2 号楼 3312 | 2019 年 6 月 18 日 | 300,000 | 100.00% | 周中国 |
| 5 | 鹏华基金 | 广东省深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层 | 1998 年 12 月 22 日 | 15,000 | 50.00% | 张纳沙 |
| 6 | 青岛蓝海股权交易中心有限责任公司 | 山东省青岛市崂山区松岭路 169 号国际创新园 B 座 17 层 B1、B2 | 2014 年 2 月 13 日 | 10,000 | 20.00% | 蒲晓煜 |
| 7 | 前海股交投资控股(深圳)有限公司 | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) | 2011 年 11 月 15 日 | 117,740 | 10.62% | 林 凡 |
| 8 | 哈尔滨股权登记托管中心有限责任公司 | 黑龙江省哈尔滨市松北区滨北街 2140 号 | 1993 年 6 月 4 日 | 260 | 7.69% | 孙名扬 |
| 9 | 红塔创新投资股份有限公司 | 云南省昆明市二环西路 398 号高新科技信息中心主楼 14 层 | 2000 年 6 月 15 日 | 90,000 | 2.50% | 许永明 |
| 10 | 证通股份有限公司 | 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 1 号楼 | 2015 年 1 月 8 日 | 251,875 | 1.99% | 范 宇 |
| 11 | 深圳市雅都软件股份有限公司 | 广东省深圳市南山区高新南七道 022 号高新工业村 T2-A 栋 402 | 1997 年 1 月 29 日 | 3,261 | 1.86% | 李 毅 |
| 12 | 中证信用增进股份有限公司 | 深圳市前海深港合作区南山街道金融街 1 号前海弘毅大厦 8 层 B2 单元 | 2015 年 5 月 27 日 | 458,598 | 1.09% | 牛冠兴 |
| 13 | 中证机构间报价系统股份有限公司 | 北京市西城区金融大街 4 号楼 8-10 层 | 2013 年 2 月 27 日 | 755,024 | 0.66% | 李亚琳 |

(四) 证券营业网点数量和分布情况

截至报告期末，公司共设有 238 家证券营业网点，分布于全国 117 个城市和地区。具体情况如下：



| 省 / 直辖市 / 自治区 | 证券营业网点数量 | 省 / 直辖市 / 自治区 | 证券营业网点数量 |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 广东 | 67 | 重庆 | 4 |
| 浙江 | 28 | 云南 | 4 |
| 四川 | 15 | 安徽 | 4 |
| 江苏 | 14 | 江西 | 4 |
| 北京 | 12 | 河南 | 3 |
| 上海 | 10 | 吉林 | 3 |
| 福建 | 9 | 广西 | 3 |
| 陕西 | 9 | 海南 | 2 |

| 省 / 直辖市 / 自治区 | 证券营业网点数量 | 省 / 直辖市 / 自治区 | 证券营业网点数量 |
|---------------|----------|---------------|----------|
| 山东 | 9 | 河北 | 2 |
| 湖南 | 7 | 新疆 | 1 |
| 辽宁 | 6 | 甘肃 | 1 |
| 湖北 | 5 | 宁夏 | 1 |
| 山西 | 5 | 内蒙古 | 1 |
| 黑龙江 | 4 | 贵州 | 1 |
| 天津 | 4 | | |

（五）其他分支机构数量与分布情况

公司子公司国信期货共设有 22 家分支机构，分布于全国 19 个城市。

八、其他有关资料

（一）公司聘请的会计师事务所

| | |
|------------|------------------------|
| 会计师事务所名称 | 天健会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 会计师事务所办公地址 | 浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼 |
| 签字会计师姓名 | 燕玉嵩、黄燕 |

（二）公司聘请的报告期内履行持续督导职责的保荐机构

报告期内，公司未聘请履行持续督导职责的保荐机构。

（三）公司聘请的履行持续督导职责的财务顾问

报告期内，公司未聘请履行持续督导职责的财务顾问。

九、主要会计数据和财务指标

(一) 合并报表

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | 2022 年度 | 本年比上年增减 | 2021 年度 |
|------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| 营业收入 | 1,731,686.85 | 1,587,576.83 | 9.08% | 2,381,803.70 |
| 归属于上市公司股东的净利润 | 642,729.41 | 608,799.47 | 5.57% | 1,011,475.88 |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 640,126.56 | 595,188.32 | 7.55% | 985,006.41 |
| 其他综合收益的税后净额 | 102,851.68 | -38,592.38 | 不适用 | -98,977.31 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -4,785,559.97 | -734,151.63 | 不适用 | -671,538.78 |
| 基本每股收益（元 / 股） | 0.54 | 0.52 | 3.85% | 0.97 |
| 稀释每股收益（元 / 股） | 0.54 | 0.52 | 3.85% | 0.97 |
| 加权平均净资产收益率 | 6.57% | 6.50% | 上升 0.07 个百分点 | 12.71% |

| 项目 | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 | 本年末比上年末增减 | 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|------------------|-----------|------------------|
| 资产总额 | 46,296,016.98 | 39,433,077.89 | 17.40% | 36,230,144.23 |
| 负债总额 | 35,250,064.57 | 28,744,574.65 | 22.63% | 26,537,452.29 |
| 归属于上市公司股东的净资产 | 11,045,952.41 | 10,688,503.24 | 3.34% | 9,691,011.01 |

(二) 母公司

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | 2022 年度 | 本年比上年增减 | 2021 年度 |
|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| 营业收入 | 1,378,140.11 | 1,334,076.98 | 3.30% | 1,931,947.41 |
| 净利润 | 600,915.81 | 620,081.81 | -3.09% | 868,009.57 |
| 扣除非经常性损益的净利润 | 599,093.48 | 610,865.14 | -1.93% | 841,253.56 |
| 其他综合收益的税后净额 | 106,569.53 | -41,832.64 | 不适用 | -78,495.48 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -2,497,939.35 | -586,338.86 | 不适用 | -674,971.17 |
| 基本每股收益（元 / 股） | 0.49 | 0.53 | -7.55% | 0.82 |
| 稀释每股收益（元 / 股） | 0.49 | 0.53 | -7.55% | 0.82 |
| 加权平均净资产收益率 | 6.25% | 6.88% | 下降 0.63 个百分点 | 11.06% |

| 项目 | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 | 本年末比上年末增减 | 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|------------------|------------------|-----------|------------------|
| 资产总额 | 43,396,919.21 | 37,510,763.10 | 15.69% | 34,499,967.57 |
| 负债总额 | 32,639,130.87 | 27,072,328.19 | 20.56% | 25,067,066.96 |
| 所有者权益总额 | 10,757,788.34 | 10,438,434.91 | 3.06% | 9,432,900.61 |

| | |
|-------------------------|---------------|
| 截至披露前一交易日的公司总股本（股） | 9,612,429,377 |
| 支付的优先股股利 | - |
| 支付的永续债利息（万元） | 127,650 |
| 用最新股本计算的全面摊薄每股收益（元 / 股） | 0.54 |

十、境内外会计准则下会计数据差异

不适用。公司未按照国际会计准则编制 2023 年财务报告。

十一、分季度主要财务指标

（一）合并报表

单位：万元

| 项目 | 第一季度 | 第二季度 | 第三季度 | 第四季度 |
|------------------------|-------------|------------|---------------|---------------|
| 营业收入 | 416,348.58 | 404,422.83 | 423,483.69 | 487,431.75 |
| 归属于上市公司股东的净利润 | 176,829.34 | 182,127.02 | 128,410.06 | 155,362.99 |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 175,487.52 | 181,365.12 | 127,304.35 | 155,969.57 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -487,062.31 | 628,806.76 | -2,078,002.61 | -2,849,301.81 |

（二）母公司

单位：万元

| 项目 | 第一季度 | 第二季度 | 第三季度 | 第四季度 |
|---------------|------------|------------|---------------|---------------|
| 营业收入 | 382,343.65 | 373,814.47 | 311,556.45 | 310,425.54 |
| 净利润 | 161,558.17 | 179,616.93 | 121,979.37 | 137,761.34 |
| 扣除非经常性损益的净利润 | 161,033.05 | 178,767.59 | 120,882.66 | 138,410.18 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 49,844.13 | 854,067.86 | -1,629,853.09 | -1,771,998.25 |

上述财务指标及其加总数与公司已披露季度报告、半年度报告相关财务指标不存在重大差异。

十二、非经常性损益项目及金额

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | 2022 年度 | 2021 年度 | 说明 |
|--|-----------|-----------|-----------|---------|
| 非流动性资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分） | 158.55 | 209.84 | -26.08 | |
| 计入当期损益的政府补助（与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照确定的标准享有、对公司损益产生持续影响的政府补助除外） | 6,278.92 | 11,420.72 | 6,172.58 | 收到政府补贴。 |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回 | 80.67 | 1,452.32 | - | |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益 | -1,823.04 | 5,429.78 | 32,898.73 | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | -1,223.68 | -758.15 | -3,152.77 | |
| 减：所得税影响额 | 868.57 | 4,143.37 | 9,422.98 | |
| 合计 | 2,602.85 | 13,611.15 | 26,469.47 | |

公司不存在其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况。

公司将《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》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益项目的情况说明：

单位：万元

| 项目 | 涉及金额 | 原因 |
|--|------------|---|
| 持有交易性金融工具、衍生金融工具和其他权益工具投资产生的公允价值变动损益及取得的投资收益 | 735,791.23 | 公司属于证券业金融企业，证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司持有交易性金融工具、衍生金融工具和其他权益工具投资期间产生的公允价值变动损益及取得的投资收益，不作为非经常性损益项目。 |
| 处置交易性金融工具、债权投资、其他债权投资和衍生金融工具取得的投资收益 | -97,295.21 | 公司属于证券业金融企业，证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司处置交易性金融工具、债权投资、其他债权投资和衍生金融工具取得的投资收益不作为非经常性损益项目。 |

十三、母公司净资本及有关风险控制指标

单位：万元

| 项目 | 2023年12月31日 | 2022年12月31日 | 本年末比上年末增减 | 预警标准 | 监管标准 |
|---------------------|---------------|---------------|----------------|--------|--------|
| 核心净资本 | 5,476,012.73 | 5,295,639.81 | 3.41% | - | - |
| 附属净资本 | 2,738,006.36 | 2,647,819.90 | 3.41% | - | - |
| 净资本 | 8,214,019.09 | 7,943,459.71 | 3.41% | - | - |
| 净资产 | 10,757,788.34 | 10,438,434.91 | 3.06% | - | - |
| 各项风险资本准备之和 | 2,825,471.09 | 1,922,809.26 | 46.94% | - | - |
| 表内外资产总额 | 40,421,254.19 | 33,151,604.49 | 21.93% | - | - |
| 风险覆盖率 | 290.71% | 413.12% | 下降 122.41 个百分点 | ≥ 120% | ≥ 100% |
| 资本杠杆率 | 13.55% | 15.97% | 下降 2.42 个百分点 | ≥ 9.6% | ≥ 8% |
| 流动性覆盖率 | 267.92% | 236.62% | 上升 31.30 个百分点 | ≥ 120% | ≥ 100% |
| 净稳定资金率 | 133.51% | 171.89% | 下降 38.38 个百分点 | ≥ 120% | ≥ 100% |
| 净资本 / 净资产 | 76.35% | 76.10% | 上升 0.25 个百分点 | ≥ 24% | ≥ 20% |
| 净资本 / 负债 | 30.25% | 37.32% | 下降 7.07 个百分点 | ≥ 9.6% | ≥ 8% |
| 净资产 / 负债 | 39.62% | 49.04% | 下降 9.42 个百分点 | ≥ 12% | ≥ 10% |
| 自营权益类证券及其衍生品 / 净资本 | 50.73% | 20.58% | 上升 30.15 个百分点 | ≤ 80% | ≤ 100% |
| 自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 | 300.74% | 254.32% | 上升 46.42 个百分点 | ≤ 400% | ≤ 500% |

03

第三节

管理层讨论与分析



一、报告期内公司所处行业的情况

2023年是全面贯彻党的二十大精神开局之年，以习近平同志为核心的党中央团结带领全国各族人民，全面深化改革开放，扎实推进高质量发展，全面建设社会主义现代化国家迈出坚实步伐。中央经济工作会议、中央金融工作会议召开，对金融服务经济社会高质量发展提出新的更高要求，吹响了建设金融强国的号角。资本市场全面深化改革持续深入推进，市场枢纽作用进一步提升。

证券行业的经营业绩受资本市场变化影响较大，呈现明显的波动性和周期性特征。2023年末，上证指数收于2,974.93点，下跌3.70%；深证成指收于9,524.69点，下跌13.54%。两市全年成交额212.2万亿元，同比减少5.5%。据中证协统计，全行业145家证券公司实现营业收入4,059.02亿元，同比增长2.77%，实现净利润1,378.33亿元，同比减少3.14%。截至2023年末，行业总资产为11.83万亿元，净资产为2.95万亿元，净资本为2.18万亿元，分别较上年末增长6.92%、5.85%、4.20%。

根据中证协公布的证券公司会员经营业绩排名，近年来，公司净资产、净资本、营业收入、净利润等主要指标排名行业前列。报告期内，公司继续保持行业领先的市场地位，各项主要业务实现稳健发展。财富管理、投行等传统优势业务市场地位稳固，投资与交易、资产管理等业务进步明显，业务发展更加均衡，为客户提供综合金融服务的能力进一步提升。公司保持境内券商最高的国际信用评级，并获得央行、证监会、沪深交易所、《中国证券报》《证券时报》等机构和权威财经媒体授予的“金牛证券公司”“数字化转型全能君鼎奖”等近百个奖项。

二、报告期内公司从事的主要业务

公司向个人、机构客户提供全方位的金融产品和服务，并自营相关金融产品的投资与交易业务，主要业务如下：

财富管理与机构业务，为个人和机构客户提供证券及期货经纪、证券投资顾问、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、股票质押式回购、约定购回、行权融资、资产托管等全价值链财富管理服务。

投资银行业务，为企业客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问、新三板挂牌推荐等金融服务。

投资与交易业务，从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募股权及另类投资业务等。

资产管理业务，根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合、单一、专项资产管理及私募股权基金管理等。

三、核心竞争力分析

公司自1994年成立以来，秉承“敢闯、敢试、敢为人先”的特区精神，依靠“国企体制、市场化机制”，从地方性单一经纪牌照公司，发展壮大成为拥有内地及中国香港市场证券业务全牌照的全国性大型综合类证券公司。目前，公司的核心竞争力主要包括：

（一）深圳“双区”建设和国资国企综改试点中的区位优势

目前，深圳市处在“双区”建设、“双区”叠加、“双改”示范的重大战略机遇期，将在深化改革扩大开放、科技创新、基础设施互联互通建设、战略性新兴产业、金融创新、国际及港澳专业服务等领域大力推进体制机制创新。作为粤港澳大湾区唯一一家本地国资控股的头部券商，公司具备良好的业务专业能力和客户基础，区位优势较为明显。

公司发挥本土优势，植根粤港澳大湾区，成为为深圳打造全球创新资本形成中心、金融创新中心和金融科技中心提供综合金融服务的标杆企业，保持深圳国资国企的领军地位。公司打造产业服务和企业服务双向推进的服务模式，加大对全产业链综合金融服务的推进力度，持续提升服务深圳“双区”建设的深度和广度，以综合服务为产业升级和企业发展提供金融支撑，在服务大湾区企业高质量发展上坚持当好“排头兵”。截至2023年底，公司累计服务大湾区企业IPO92家、再融资98家，融资规模超1,200亿元；服务93家大湾区企业发行各类债券540只，发行规模超6,000亿元；为大湾区超600万客户提供财富管理服务。

（二）实力强劲的股东背景

公司前六大股东均为实力强劲的央地两级国有企事业单位，国有股东持股占比合计超80%，构成支持公司稳定发展的“基本盘”。近年来，公司与国资国企的协同成效较为明显，成立了服务深圳“双区”建设和综改试点的领导小组及专项工作小组，大力提升对国资客户的服务能力和服务质量，公司积极与深圳市多个行政区及其他部分城市开展战略合作，与多家国企、大型企业集团、金融机构建立了良好的业务合作关系。

（三）突出的市场化能力及业务创新能力

公司具有市场定位准确、客户服务能力强的优势，在经营中具备较强的前瞻性及市场敏感性，善于迅速把握市场机遇。公司是行业前八家创新试点证券公司之一，首创了“银证通”“金天利”等众多具有示范效应的业务模式。

当前，公司坚持一手抓传统优势业务转型，一手抓创新业务发展。公司财富管理转型不断深化，秉承“以客户为中心”的理念，构建“国信鑫投顾”“国信鑫智投”“国信鑫优选”“国信鑫私享”“国信鑫享传承”等财富管理系列品牌，形成了基于市场多层次需求的财富管理服务；面向机构和高净值客户，提供定制化综合金融服务，串联起财富管理、资产管理、投资银行服务链条，实现“全价值链财富管理”。公司获得首批个人养老金代销展业资格，发挥投研优势，践行普惠金融，为投资者提供专业养老财富管理服务。公司致力于抓住全面注册制落地实行的机遇，服务实体经济发展、推动科技创新，为符合注册制要求的企业提供专业的投资银行服务，同时积极响应国家产业发展战略，并以注册制全面实施、科创板设立、创业板改革以及北交所设立为契机，为新兴产业、创新创业企业提供高质量、全生命周期的金融支持，助推国家战略新兴产业发展和实体经济转型升级。公司坚持推进业务协同发展，着力强化区域协同、产业协同，形成“三投联动”赋能的产业协同模式，管理效能持续提升，综合服务能力不断增强。

公司把握国家深化金融供给侧结构性改革的总体要求，主动创新求变，抢占发展先机。2023年，公司获得交易所债券做市商、科创50ETF期权主做市商、北交所做市商、信用联结票据创设机构、信用风险缓释工具核心交易商及凭证创设机构等多项新业务资格，业务布局进一步拓宽。公司推出自选债券做市业务，打造“自营+私募”混合做市服务新模式；助力发行全国首单央企融资租赁公司绿色明珠债、首单工程机械类经销商-终端客户分期保理ABS等。一批新业务、新产品加速落地，业务规模稳步增长。

（四）领先的金融科技水平

公司秉承“技术引领业务、以客户为导向”的理念，以“加快金融科技创新，做好数字金融大文章，助力金融强国建设”为己任，以“创新驱动、科技引领，打造世界一流投行信息技术”为公司金融科技战略愿景，以“数字化”“智慧化”“敏捷化”“生态化”为战略方向，综合应用人工智能、大数据、云计算、区块链、交易技术等新兴技术，打造金融科技核心竞争力，持续优化体系建设，提升业务效率，为客户提供个性化、定制化、智能化的金融服务，助力公司高质量发展。多年来，公司各类信息系统持续保持安全稳定运行，得到了行业及客户的肯定。

自主掌控和科技创新已成为公司 IT 文化的 DNA，打造“国信金太阳”手机证券、“企明星”上市公司综合服务平台和极速交易科技平台等一批明星产品，为公司实现经营战略目标提供技术支撑。财富管理领域，强化以金太阳 APP 为中心的生态建设，构建了一站式多渠道一体化的综合财富管理平台。机构业务领域，打造了覆盖客户全生命周期的一站式综合服务解决方案，高效响应机构客户的个性化需求。价值投资领域，建成三大投资平台，形成“衍生品+做市+投资”的数字化体系。投行固收领域，整合投行业务智能平台，全面提升数字化投行服务能力。研究服务领域，建设覆盖研究管理、研究服务、智能研究的智慧投研体系，助力研究服务进入发展快车道。风控合规领域，构筑主动风险管理防控机制，助力集团级风险防控能力提升。金融科技领域，公司以“云计算大后台”建设基础架构基座，为业务长远发展奠定基础；构建人工智能等六大金融科技平台，实现各业务领域 AI 赋能 100% 覆盖；创新尝试数据赋能经营决策、探索区块链在证券行业的实践应用；围绕云原生技术体系和 BizDevOps（业务、开发、运营一体化）工作体系，自主建成数字化技术平台、云原生智能研运一体化平台，打造敏捷高效的新一代自主研发模式，提升金融科技交付能力。数据治理和数据安全领域，公司积极探索数据治理与业务管理、技术实践的深入应用，在数据标准、数据质量、数据安全、数据模型等方面进行融合打通，构建数据治理生态化体系，切实保障公司和客户数据的安全、合规、可靠。网络信息安全领域，公司建立了完善的管理保障体系和技术保障体系，实现了运行管理的“全流程、全过程、全覆盖”管控，确保信息系统的可控、能控和在控。

（五）稳健经营的理念

公司自成立以来，始终秉持稳健经营理念，坚持依法合规运作。公司建立了科学、稳健的经营决策体系，重大事项决策均采用集体决策机制。公司成立了资产负债委员会、风险控制委员会、金融科技委员会等专业委员会，由董事长或经营管理层成员担任委员会主任，由业务部门负责人、合规风控等相关人员担任成员。公司针对各重要业务线设置了相应的业务管理委员会，如投资银行委员会、资产管理委员会、财富管理委员会等。公司坚持风险可控下追求合理收益的风险管理理念，贯彻全面性、有效性、制衡性的基本原则。在长期的业务发展中，公司建立健全了包括组织体系、授权体系、制度体系、防火墙体系、技术防范体系、监控体系、监督与评价体系在内的内部控制体系。公司建立多层次的内部控制机构，内控制度覆盖各项业务的日常运行，对违规行为实行严格问责。公司对流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等实施精准管理，在风险可测、可控和可承受的范围内稳健开展各项业务。公司完善风险导向的内部审计体系，把风险、合规管理制度建设及实施情况纳入大内控体系监督评价范畴，构建了合规、风控、法务、稽核等高效协同的联合监督机制，形成了稳健经营、守法合规的国信特色。公司首批入选中国证监会“白名单”证券公司。

四、主营业务分析

(一) 概述

公司通过总部下设机构以及下属分公司、营业部从事财富管理与机构、投资银行、投资与交易、资产管理等业务；通过全资子公司国信弘盛、国信期货、国信资本、国信香港分别开展私募基金管理、期货、另类投资和境外金融服务等业务。2023年度,公司实现营业收入173.17亿元,同比上升9.08%;实现归属于上市公司股东的净利润64.27亿元,同比上升5.57%。

(二) 收入与成本

1. 营业总收入构成

◆按会计科目分类

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 同比增减幅度 |
|--------------|--------------|----------|--------------|----------|------------|
| | 金额 | 占营业总收入比重 | 金额 | 占营业总收入比重 | |
| 手续费及佣金净收入 | 647,070.73 | 37.37% | 757,725.96 | 47.73% | -14.60% |
| 投资收益 | 532,739.01 | 30.76% | 727,220.82 | 45.81% | -26.74% |
| 其他业务收入 | 248,420.55 | 14.35% | 211,693.31 | 13.33% | 17.35% |
| 利息净收入 | 174,775.80 | 10.09% | 182,962.68 | 11.52% | -4.47% |
| 公允价值变动收益(损失) | 128,903.47 | 7.44% | -297,073.40 | -18.71% | 不适用 |
| 其他收益 | 3,465.48 | 0.20% | 4,494.98 | 0.28% | -22.90% |
| 资产处置收益 | 158.55 | 0.01% | 209.84 | 0.01% | -24.45% |
| 汇兑收益(损失) | -3,846.73 | -0.22% | 342.63 | 0.02% | -1,222.70% |
| 营业总收入合计 | 1,731,686.85 | 100.00% | 1,587,576.83 | 100.00% | 9.08% |

(1) 手续费及佣金净收入 64.71 亿元, 同比减少 11.07 亿元和 14.60%, 主要是经纪业务及投资银行业务手续费净收入减少;

(2) 投资收益 53.27 亿元, 同比减少 19.45 亿元和 26.74%, 主要是金融工具投资收益减少;

(3) 公允价值变动收益 12.89 亿元, 同比增加 42.60 亿元, 主要是交易性金融资产公允价值变动增加;

(4) 汇兑收益 -0.38 亿元, 同比减少 0.42 亿元, 主要是汇率变动。

◆按业务类型分类

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 同比增减 |
|-----------|--------------|----------|--------------|----------|---------|
| | 收入金额 | 占营业总收入比重 | 收入金额 | 占营业总收入比重 | |
| 财富管理与机构业务 | 746,811.14 | 43.13% | 830,034.89 | 52.28% | -10.03% |
| 投资银行业务 | 141,938.34 | 8.20% | 188,185.57 | 11.85% | -24.58% |
| 投资与交易业务 | 533,118.37 | 30.79% | 274,673.40 | 17.30% | 94.09% |
| 资产管理业务 | 53,073.82 | 3.06% | 36,543.68 | 2.30% | 45.23% |
| 其他业务 | 256,745.18 | 14.82% | 258,139.28 | 16.27% | -0.54% |
| 合计 | 1,731,686.85 | 100.00% | 1,587,576.83 | 100.00% | 9.08% |

(1) 财富管理与机构业务

公司财富管理与机构业务主要包括：为个人和机构客户提供证券及期货经纪、证券投资顾问、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、股票质押式回购、约定购回、行权融资、资产托管等全价值链财富管理服务。报告期内，财富管理与机构业务实现营业收入 74.68 亿元，同比下降 10.03%。

① 证券类零售业务

市场环境

2023 年，国民经济回升向好，转型升级成效显著，资本市场加快推进各项改革举措，交易机制优化，投资交易便利性提升，公募基金费率改革全面落地，鼓励各类资金通过指数化投资入市。2023 年 A 股市场整体呈现震荡分化格局，股票日均成交额 8,763 亿元，较 2022 年下降 5%；ETF 交投活跃，份额增长显著，ETF 日均成交额较 2022 年增长 20%。

经营举措及业绩

公司秉持“以客户为中心”的发展理念，全面推进全价值链财富管理转型，搭建分层分类的综合服务体系，推动客户规模不断增长、客户结构持续优化。一是加强线上营销与服务，精细化运营，纵深打造手机证券 APP 生态圈。精准推荐能力、理财规划服务能力全面提升，“线上化”服务能力持续增强，金太阳 APP 月活量创历史新高。二是高净值客户定制服务载体不断丰富，专业投顾团队稳步壮大，财富管理品牌影响力持续提高。“国信鑫投顾”“国信鑫汇盈”等投顾品牌客户覆盖率进一步提升；“国信鑫私享”高端财富管理品牌综合服务谱系形成，满足客户定制化需求；创新推出“国信鑫享传承”家庭服务信托品牌，满足家庭财富保值、增值、传承等场景需求。扩大资讯和工具类投顾产品供给，通过持续输出投资建议及多样投顾策略，全面优化客户投资体验。三是积极引导投资者树立长期投资理念，持续推进北交所、绿色金融、养老金融、ETF 等业务知识的宣传及投资者教育工作，助力实体经济发展。

截至 2023 年末，公司经纪业务客户托管资产超过 2.1 万亿元，金太阳手机证券用户总数近 2,500 万，微信公众号用户数近 300 万。

2024 年展望

公司将秉承高质量发展理念，优化财富管理服务水平，构建全业务链服务门户。提升线上、线下客户渠道的合作效率和质量，持续扩大客户规模；纵深打造数字生态，推进平台迭代升级，提升客户体验；挖掘各类客户账户服务需求，丰富证券投顾产品供应，精进投资顾问服务专业化水平；不断创新，优化产品研究、基金投顾策略研究机制，丰富产品货架，扩大普惠金融优质产品供给，为不同投资需求的客户提供专业化、差异化、个性化的投资选择，并持续做好客户陪伴。

② 证券类机构业务

市场环境

2023 年，公募基金、保险资管、私募基金、银行理财等各类机构投资者规模持续扩大，A 股市场机构化程度不断加深，为券商财富管理业务发展带来重大机遇。券商积极整合内部资源，提升专业服务能力，提高响应效率，积极拓展机构业务。

经营举措及业绩

公司聚焦机构客户的金融服务需求，增强协同效率，为客户提供跨业务、全周期、全链条服务，代销产品量质齐升，量化客户股基市场份额逆势提升，企业服务覆盖面不断扩大，与客户实现合作共赢。2023 年，公司完善金融产品配置体系，优化产品研究和组织管理机制。成立机构经纪客户委员会，充分发挥统筹协调作用，搭建客户分级分类协同服务体系。探索合作新模式，与公私募机构、银行、理财子公司的合作不断深化。升级“GTrade+”私募机构综合服务品牌，持续优化量化私募交易体验，形成了以交易为核心的极速交易、策略交易、智能算法等综合交易解决方案；打造“国信企明星+”企业综合金融服务品牌，平台功能颗粒度位居行业前列，服务实体经济走深走实；上线国信“机构通”基金投资交易服务平台，机构综合服务水平进一步增强。公司与海外机构密切合作，通过挖掘细分赛道需求，为海外机构提供个性化、全方位服务，将互联互通向纵深化发展。

2024 年展望

公司将继续强化先进平台的服务优势，提升投资研究专业能力，整合服务资源，探索高效专业的个性化服务方案，持续加强与公私募基金管理人、银行及理财子公司、保险资管、企业等客户的合作，全力打造机构客户服务生态圈。

③ 研究业务

公司经济研究所始终把专业能力建设作为根本，以“深度研究，创造价值”为核心理念，依托国家战略需要布局研究业务，加强国内宏观总量研究以及全球资本市场的研判，跟踪覆盖一批重点产业和重点企业，对外为公募、社保、保险、私募、银行理财子公司、资产管理公司及其他专业投资机构提供高质量的研究服务，对内为公司其他各项业务提供研究支持。2023 年，公司研究业务继续保持良好发展态势，专业研究能力稳步提升，客户服务取得积极进展，与公司其他业务协同联动不断加强，外部影响力与内部赋能持续增强。

公司经济研究所将以提升研究实力和机构客户服务能力为抓手，将研究资源重点聚焦在符合未来经济发展方向的领域，围绕战略性新兴产业、未来产业、重点区域产业以及大湾区核心产业的发展 and 产业政策开展研究，积极推进研究和服务的智能化、数字化转型，通过高质量的研究成果和专业化的研究服务，有效提升研究业务的市场认可度和业务支撑力。

④ 资本中介业务

市场环境

2023年，随着北交所启动融资融券交易、全面注册制实施落地，两融标的范围逐步扩大，加之融资保证金比例下调，融资融券业务呈现稳步增长趋势，期末全市场融资融券余额为16,508.96亿元，较2022年末增长7.17%。全市场股票质押式回购业务规模保持平稳。

经营举措及业绩

2023年，公司坚持以客户为中心，加快推动业务创新、科技赋能和综合协同，提升风险管控精细化水平，为客户提供多元化、个性化服务。公司稳步提升融资融券业务，期末融资融券余额573.19亿元，较2022年末增长6.55%；通过完善制度、优化系统、丰富风险化解手段等措施，稳步提升股票质押规模，发挥金融服务实体经济作用。此外，公司行权融资业务连续两年实现正增长，保持发展优势。

2024年展望

公司将结合数字金融手段，挖掘客户潜力，丰富客群；建立分类分层服务框架，为客户提供一体化综合性服务方案；持续探索产品及服务创新，丰富业务服务场景，建立国信特色的资本中介服务体系；强化合规风控，进一步提升精细化风险管控水平。

⑤ 期货类经纪业务

市场环境

2023年，国内期货交易所手续费返还政策收紧，经纪业务同质化竞争激烈，期货行业“增产不增收”。按照中国期货业协会统计的母公司口径数据，年内全国150家期货公司手续费收入和净利润分别同比下降4.85%、9.88%。

经营举措及业绩

报告期内，子公司国信期货继续夯实经纪业务基本盘，完善网点布局，拓展互联网营销，着力开拓金融机构和产业客户，客户权益规模持续扩大。资产管理业务产品体系进一步丰富，业务合作不断深化，已全面覆盖银行、券商、信托、三方理财、上市公司、高净值等客户群体，业绩得到行业认可。风险管理业务的发展重点转向低风险业务，并推动实现风险管理产品化、响应行业号召大力开展“保险+期货”，服务实体质效进一步提升。2023年，国信期货净利润相较行业实现逆势增长，同比增长2%。

2024年展望

国信期货将强化“一体两翼”体系建设，围绕三大客群，充分发挥公司在衍生品业务上的专业优势，通过业务协同、资源整合、优化服务等措施，全力提升期货业务综合服务水平。

⑥ 资产托管业务

2023年新规落地，市场结构发生较大变化，行业同质化竞争日趋激烈，公司资产托管业务规模及收入有所下降，但整体业务结构持续优化，运营质效逐步提升，多样化服务载体与形式稳步落地。公司建立营销精细化管理体系建设，加强私募机构业务拓展，在巩固重点客户跟踪机制的同时，增强客户覆盖率。精攻服务，优化客户分级服务、分类管理机制，提升服务质量和效率。与商业银行、信托公司、保险公司、上市公司等建立资方服务对接，构建资金驱动、资产驱动的

全生态驱动能力。公司资产托管业务将不断提升专业水平和服务能力，持续优化客户和产品结构，更加有效地发挥作为服务机构客户的“连接点”作用。

(2) 投资银行业务

公司投资银行业务主要是向企业客户提供金融服务，主要包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问和新三板挂牌推荐等业务。报告期内，公司投资银行业务实现营业收入 14.19 亿元，同比下降 24.58%。

① 股票承销保荐业务

市场环境

2023 年，在注册制改革全面落地的背景下，各市场板块进一步明晰定位，多层次资本市场体系更趋完善。A 股市场共发行股票项目 762 个，同比下降 15.61%，募集资金 9,719 亿元，同比下降 33.82%；IPO 上会审核项目 285 家，同比下降 51.2%；市场发行 IPO 项目 313 个，同比下降 26.87%，募集资金 3,565.39 亿元，同比下降 39.26%；发行股权再融资项目 449 个，同比下降 5.47%，募集资金 6,153.52 亿元，同比下降 30.20%。

经营举措及业绩

2023 年，公司不断提升保荐承销服务能力，夯实传统优势业务市场地位。报告期内，公司完成股票主承销项目 23.83 家，募集资金 260.45 亿元，分别位居行业第 10、第 8。完成 IPO 项目 11.5 家，行业排名第 10，其中完成主板 IPO 项目 4 家，居于行业第 3；完成再融资项目 12.33 个，行业排名第 12。公司完成的南矿集团项目是全面注册制实行以来，首批在主板挂牌上市的 10 家 IPO 公司之一。公司聚焦“双区”建设和大湾区发展，报告期内完成深圳地区主承销项目 4 家，募集资金 58.51 亿元；其中 IPO 项目 2 家，募集资金 22.51 亿元，居于行业第 3。公司和多家深圳国企建立业务合作关系，并积极提供股权融资、财务顾问等资本运作服务。公司荣获第十六届新财富“本土最佳投行”“最佳 IPO 投行”等奖项。报告期内，公司股票承销保荐业务的具体情况如下：

| 类别 | 2023 年度 | | 2022 年度 | |
|--------|---------------|-------|---------------|-------|
| | 主承销金额 (亿元) | 承销家数 | 主承销金额 (亿元) | 承销家数 |
| 首次公开发行 | 89.98 | 11.5 | 139.65 | 14.5 |
| 再融资发行 | 170.46 | 12.33 | 156.27 | 14.25 |
| 合计 | 260.45 | 23.83 | 295.92 | 28.75 |

注：联合主承销家数及金额以 1/N 计算

2024 年展望

公司将进一步做好服务实体经济发展工作，大力支持科技创新，打造“积极稳健型投行”。紧抓注册制全面实施、深圳“双区”建设等机遇，进一步提高公司研究、价值发现、质量控制、客户服务、直投等能力，切实提升项目质量，加强定价、估值和销售能力的培养及平台资源的整合，拓深服务企业客户或投资的深度与广度，以专业能力为客户提供一体化、全生命周期的金融服务。着力构建“投行+”生态体系，发挥投行业务企业客户流量入口的作用，打造“投研+投行+投资”三位一体的协同模式，进一步提升战略客户综合性服务水平。

② 债券承销业务

市场环境

2023年，在中央金融工作会议精神指引下，国内政策组合拳持续发力，年底经济温和复苏，债市低位宽幅震荡，驱动债券市场逐步回暖，债券市场整体规模较去年同期小幅上升。

经营举措及业绩

公司坚守服务实体经济金融主力军使命，积极融入国家发展大局，持续为区域经济发展、国资国企改革、ESG发展等国家重点支持领域提供金融支撑。2023年，公司为实体经济发展提供直接融资支持，完成债券承销608只，承销规模2,294亿元，同比增长11%，多只创可比债券最低利率，有效降低企业融资成本、促进区域经济平衡发展。公司围绕发展科技金融、绿色金融提供专业服务，发行科技创新、创新创业债券22只，实际承销规模约75亿元，发行绿色债券14只，实际承销规模71亿元。为积极推进业务布局调整，公司稳定城投债基本盘，重点突破产业债、金融债业务，金融债实现国有六大行全覆盖。继续深耕深圳本土区域优势，大力支持“双区”建设，年内公司为深圳企业发行债券99只，实际承销规模约377亿元，客户群体实现各级国企全覆盖。报告期内，公司债券承销情况具体如下：

| 类别 | 2023年度 | | 2022年度 | |
|---------|---------------|--------|---------------|--------|
| | 主承销金额 (亿元) | 承销家数 | 主承销金额 (亿元) | 承销家数 |
| 公司债 | 771.68 | 95.11 | 628.13 | 71.69 |
| 金融债 | 707.16 | 24.78 | 695.48 | 23.44 |
| 债务融资工具 | 647.09 | 92.67 | 521.73 | 79.17 |
| 资产支持证券化 | 54.81 | 15.50 | 187.70 | 26.83 |
| 企业债 | 19.03 | 3.42 | 153.69 | 16.89 |
| 合计 | 2,199.77 | 231.48 | 2,186.73 | 218.02 |

注：联合主承销家数及金额以1/N计算

2024年展望

公司将深入贯彻落实国家战略部署，不断增强债券融资创新力度，大力开拓绿色债、双创债/科创债、乡村振兴债等业务，助力推动经济社会绿色转型、产业升级、巩固脱贫攻坚成果，进一步提升服务实体经济质效。充分利用区位优势、专业优势，逐步形成差异化竞争优势，持续推动业务布局调整及结构优化，满足客户多元需求。

③ 并购重组业务

2023年，并购重组市场总体低迷，坚守主业发展、回归并购本源已成为市场共识，基于产业逻辑的上市公司收购成为主流。并购重组市场通过交易所并购重组委审核25家、被否1家、暂缓表决1家、审核期间撤回申请8家，审核通过率96.15%。公司继续夯实并购重组业务基础，做好重点客户维护，积极寻找业务机会，做好项目储备，妥善处置和防范业务风险。公司将进一步拓展TMT、高端装备制造、医药、新材料等行业优质标的储备，加大并购撮合力度，同时防控业务风险。

④ 北交所与新三板业务

市场环境

2023年，北交所上市公司新增77家，总数达239家。北交所上市公司中，中小企业占比超八成，民营企业占比近九成，国家级专精特新“小巨人”企业占比近五成。新三板挂牌公司共6,219家，其中创新层公司1,876家，一部分企业符合北交所上市财务条件，市场服务创新型中小企业的聚集效应初步形成，服务创新驱动发展、经济转型升级等国家战略的功能更加凸显。

经营举措及业绩

公司坚持做好新三板客户的服务、增值及创新业务的拓展，同时注重防范和化解风险；积极布局北交所企业公开发行与承销业务，服务北交所和新三板深化改革。截至2023年末，公司持续督导新三板项目72个，年内完成新三板挂牌项目2个，定增项目5个，合计募集资金10.93亿元。

2024年展望

公司将继续把握北交所和新三板改革机遇，做好项目开发、储备和推荐，积极推动北交所项目申报；持续提升服务水平，促进中小企业和民营经济创新发展；加强对新三板企业的持续督导，做好存量项目的风险排查和处置工作，并持续开拓新的融资项目。

⑤ 境外投行业务

报告期内，子公司国信香港以联席全球协调人、联席账簿管理人、财务顾问、融资安排人等角色总共完成了32个境外资本市场项目，包括境外债券发行、香港上市及上市公司顾问等项目。国信香港将持续与深圳国资国企深化合作，不断推动跨境金融合作走深走实，在服务对外开放新格局中更好地发挥专业服务能力。

(3) 投资与交易业务

公司的投资与交易业务主要是从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募股权及另类投资业务等。报告期内，公司投资与交易业务共实现营业收入53.31亿元，同比上升94.09%。

① 权益类投资业务

2023年，权益市场几乎单边下行，全年缺乏持续性主线。公司权益投资业务顶住市场压力，把握住市场结构性机会；坚持以基本面研究为基础，以风险限额为底线，力争实现中低风险的绝对收益。近年来，公司已经形成了以分红投资策略、折价保护投资策略、价值成长投资策略为主，公私募基金组合投资策略为辅的策略架构，多次经受住市场考验，保障了公司权益投资业务的稳健性与可持续性。

② 固定收益类投资业务

2023年，大类资产显著分化，呈现股弱债强、商品震荡的格局。报告期内，公司固定收益投资业务坚持合理配置各类资产，丰富完善投资策略，有效控制风险并增厚收益；坚持稳健投资理念，围绕市场主线做好大类资产配置，同时围绕低风险中性业务稳步扩大投资规模，积极把握交易性机会，进一步开拓利润来源。在经济运行进入新常态背景下，公司将围绕投资稳定性、收益性和可持续性精耕细作，同时围绕客户需求进一步开拓客户市场，持续推进“自营和客需双驱动”发展。

③ 衍生类产品投资业务

报告期内，公司以场外衍生品业务为抓手，积极发展客需驱动的交易业务。主要业务开展类型包含场外期权、收益互换，连续两年新增名义规模突破千亿大关。公司积极探索产品形式，在挂钩债券、利率、债券指数、商品期货等方面进行业务布局；不断丰富场外衍生品业务产品线，满足机构投资者风险管理等需要，为客户提供定制化的交易服务，保持衍生品业务发展的稳定和可持续性。公司持续提升场外衍生品的综合竞争力，打造以交易与风控为核心的场外衍生品一体化业务平台，为业务高质量发展蓄能。

④ 另类投资业务

2023年，中国股权投资市场投资案例数、投资总金额均同比下降，国家战略、产业升级、前沿技术等领域成为股权投资市场长期关注的焦点。子公司国信资本始终坚持以服务实体经济为根本，积极响应国家战略性新兴产业发展规划，以稳健投资、价值投资为原则，报告期内新增项目投资14个，投资总金额4.03亿元，主要投向新能源、半导体、新材料、信息技术等领域。2023年国信资本实现营业收入2.78亿元，同比上升12%，实现净利润1.77亿元，同比上升5%，经营业绩稳步增长。国信资本将进一步强化投资能力，在战略性、全局性、前瞻性行业加大投资布局，持续增强对“专精特新”及国家战略性新兴产业支持力度，助力经济高质量发展。

(4) 资产管理业务

公司资产管理业务主要是根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合、单一、专项资产管理及私募股权基金管理等。报告期内，公司资产管理业务实现收入5.31亿元，同比上升45.23%。

① 券商资产管理业务

市场环境

2023年，国内经济逐步复苏，中国人民银行继续保持宽松的货币政策，各类资产价格出现了明显分化：债券市场迎来牛市行情，部分债券品种收益率创下新低；权益市场轮动加快，行业分化明显；美联储加息对人民币汇率形成压力。面对复杂的市场环境，券商资管整体业务规模和收入持续下滑，承受较大经营压力，但业务质量持续提升，行业稳步迈向高质量发展新阶段。

经营举措及业绩

2023年，公司持续聚焦主动管理，高质量发展动能不断凝聚，资产管理业务收入和市场份额均大幅提升。一是投资策略更加丰富，在做好固收、权益等传统优势策略基础上，根据客户需求适时推出生衍生品等相关策略的产品，成为新的业务增长点。二是市场布局更加完善，与多家银行机构、互联网及第三方平台深入合作，销售渠道和客户覆盖面进一步扩大。三是经营效能更加凸显，重点资管产品规模持续提升，业务质量和创收能力显著增强。四是积极运用公募REITs和ABS等资本市场工具，帮助实体企业盘活存量资产，为实体经济的高质量发展提供了专业支持。2023年11月，资管子公司设立申请已获中国证监会批复，为公司资管业务后续进一步实现专业化运营、申请公募牌照打开了空间。

报告期内，公司的集合、单一、专项等资产管理业务净值规模为 1,550.60 亿元，较上年提升 14.66%，实现收入 4.96 亿元，同比上升 54.25%。截至报告期末，公司资产管理业务规模具体如下：

单位：亿元

| 类型 | 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 12 月 31 日 | 较上年末增减 |
|----------|------------------|------------------|---------|
| 集合资产管理业务 | 774.82 | 671.00 | 15.47% |
| 单一资产管理业务 | 496.06 | 360.85 | 37.47% |
| 专项资产管理业务 | 279.72 | 320.45 | -12.71% |
| 合计 | 1,550.60 | 1,352.30 | 14.66% |

2024 年展望

公司资产管理业务将继续坚持“立足长远、聚焦投研”的战略方向，不断优化投研体系，坚持以客户为中心，加快推动资管子公司设立和公募牌照申请，全面强化业务协同，努力服务国家重大战略，全力实现高质量发展。

② 私募股权基金管理业务

2023 年，我国私募股权投资市场整体活跃度不高，市场呈现“募资难、投资冷、退出难”的特征，PE/VC 机构在 IPO 项目的渗透率有所下降。随着《私募投资基金监督管理条例》正式发布实施，私募股权投资行业迎来更加规范化的发展局面以及出清节奏加快的竞争态势。

受市场环境等影响，公司私募股权基金管理业务收入同比下降明显。子公司国信弘盛加大私募股权基金新投资平台创设力度，报告期内完成深汕国信基金、鹏鹞弘盛基金、宿迁国信基金、弘盛宝龙基金等 4 支新基金的备案，新增基金管理规模 33 亿元；积极布局智能驾驶、节能环保、数字经济、生物医药等战略性新兴产业方向，在半导体、人工智能、新能源新材料、先进制造等“硬科技”领域持续发力，新增投资 PE、FOF 项目 11 个，累计投资金额超过 5 亿元；积极整合资源，努力构建完善的基金产品体系和“资本+产业”生态圈，进一步强化对新兴产业和科创企业的多维度、全方位赋能。

(5) 其他业务

公司的其他业务主要是通过重要参股公司鹏华基金从事基金管理业务。鹏华基金始终坚持长期投资和价值投资的理念，2023 年紧抓市场机遇，服务国家战略，主要表现在：一是资产管理规模位居行业第一梯队。截至 2023 年末，鹏华基金资产管理总规模（不含子公司）达 11,057 亿，其中公募非货规模 4,242 亿元，位列行业第十。二是服务国家战略，做好科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融、数字金融五篇大文章。2023 年，鹏华基金坚持前瞻性、战略性的产品布局和创新，发行全市场首批混合估值法债基、科创 100ETF，并积极捕捉朝阳行业和战略新兴产业方面的机会，发行芯片产业、高端装备、碳中和等主题产品；积极落实基金费率改革等各项措施，提升投资者获得感。鹏华基金成为国内首家获得联合国可持续基金奖的公募管理人。三是中长期投资业绩表现出色。截至 2023 年末，鹏华基金五年平均股票投资主动管理收益率为 89.5%，在公募非货前二十大公募管理人中位列第八；五年平均债券投资主动管理收益率为 20.64%，在公募非货前二十大公募管理人中位列第五，投资业绩获得市场认可。

2. 已签订的重大销售合同、重大采购合同情况

不适用。

3. 营业成本构成

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 同比增减幅度 |
|----------|--------------|---------|------------|---------|----------|
| | 金额 | 占营业成本比重 | 金额 | 占营业成本比重 | |
| 业务及管理费 | 752,290.53 | 71.85% | 731,744.07 | 74.82% | 2.81% |
| 其他业务成本 | 246,128.89 | 23.51% | 208,462.45 | 21.31% | 18.07% |
| 信用减值损失 | 36,157.66 | 3.45% | 25,084.54 | 2.56% | 44.14% |
| 税金及附加 | 12,433.59 | 1.19% | 12,558.12 | 1.28% | -0.99% |
| 其他资产减值损失 | - | - | 219.11 | 0.02% | -100.00% |
| 合计 | 1,047,010.67 | 100.00% | 978,068.29 | 100.00% | 7.05% |

(1) 信用资产减值损失 3.62 亿元，同比增加 1.11 亿元和 44.14%，主要是融资业务信用减值损失增加；

(2) 其他业务成本 24.61 亿元，同比增加 3.77 亿元和 18.07%，主要是大宗商品销售成本增加；

(3) 其他资产减值损失为 0，同比减少 0.02 亿元，主要是计提的大宗商品跌价准备减少。

4. 报告期内合并范围是否发生变动

具体请参见第六节“七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明”。

5. 公司报告期内业务、产品或服务发生重大变化或调整有关情况

不适用。

(三) 费用

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | 2022 年度 | 同比增减幅度 | 重大变动说明 |
|--------|------------|------------|--------|-------------------------|
| 业务及管理费 | 752,290.53 | 731,744.07 | 2.81% | 主要是业务宣传费、差旅费及电子设备运转费增加。 |

(四) 研发投入

不适用。

（五）现金流

单位：万元

| 项目 | 2023 年度 | 2022 年度 | 同比增减幅度 |
|---------------|---------------|--------------|-----------|
| 经营活动现金流入小计 | 4,203,830.06 | 4,445,550.82 | -5.44% |
| 经营活动现金流出小计 | 8,989,390.03 | 5,179,702.46 | 73.55% |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -4,785,559.97 | -734,151.63 | 不适用 |
| 投资活动现金流入小计 | 37,195.03 | 64,235.60 | -42.10% |
| 投资活动现金流出小计 | 51,842.32 | 65,510.22 | -20.86% |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -14,647.29 | -1,274.62 | 不适用 |
| 筹资活动现金流入小计 | 11,659,577.88 | 7,285,181.99 | 60.05% |
| 筹资活动现金流出小计 | 7,153,268.24 | 7,100,619.53 | 0.74% |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 4,506,309.65 | 184,562.46 | 2,341.62% |
| 现金及现金等价物净增加额 | -294,215.96 | -525,682.89 | 不适用 |

1. 相关数据同比发生重大变动的主要影响因素说明

报告期内，公司（合并）现金流量净额为 -29.42 亿元。各项现金流量中，经营活动的现金流量净额为 -478.56 亿元，其中：现金流入 420.38 亿元，主要是回购业务资金净增加额 175.98 亿元、收取利息、手续费及佣金的现金 145.62 亿元；现金流出 898.94 亿元，主要是其他债权投资净增加额 303.70 亿元、为交易目的而持有的金融资产净增加额 277.93 亿元、支付给职工以及为职工支付的现金 59.08 亿元、支付利息、手续费及佣金的现金 49.42 亿元、代理买卖证券支付的现金净额 33.41 亿元、融出资金净增加额 30.73 亿元、其他权益工具投资净增加额 30.15 亿元、拆入资金净减少额 19.90 亿元、支付的各项税费 17.83 亿元。投资活动的现金流量净额为 -1.46 亿元，其中：投资活动现金流入 3.72 亿元，主要是取得投资收益所收到的现金 3.43 亿元；投资活动现金流出 5.18 亿元，主要是购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 4.15 亿元、投资所支付的现金 1.03 亿元。筹资活动产生的现金流量净额为 450.63 亿元，其中：筹资活动现金流入 1,165.96 亿元，主要是发行债券收到的现金 1,163.50 亿元；筹资活动现金流出 715.33 亿元，主要是偿还债务所支付的现金 650.16 亿元、分配股利、利润或偿付利息所支付的现金 62.06 亿元。

2. 报告期内公司经营活动产生的现金净流量与本年度净利润存在重大差异的原因说明

2023 年公司实现净利润 64.27 亿元，与本年经营活动产生的现金流量净额有差异，主要是自营业务投资规模增加、回购业务资金净增加额、代理买卖证券支付的现金净额、融出资金净增加额、拆入资金净减少额等影响。

五、主营业务构成情况

(一) 主营业务分业务情况

单位：万元

| 业务类别 | 营业总收入 | 营业支出 | 营业利润率 | 营业总收入 同比增减幅度 | 营业支出 同比增减幅度 | 营业利润率 比上年增减 |
|-----------|--------------|--------------|--------|-----------------|----------------|----------------|
| 财富管理与机构业务 | 746,811.14 | 447,543.46 | 40.07% | -10.03% | 1.42% | 下降 6.77 个百分点 |
| 投资银行业务 | 141,938.34 | 117,745.10 | 17.04% | -24.58% | -4.40% | 下降 17.51 个百分点 |
| 投资与交易业务 | 533,118.37 | 70,158.27 | 86.84% | 94.09% | -9.41% | 上升 15.03 个百分点 |
| 资产管理业务 | 53,073.82 | 26,778.29 | 49.55% | 45.23% | 48.33% | 下降 1.05 个百分点 |
| 其他业务 | 256,745.18 | 384,785.54 | 不适用 | -0.54% | 20.95% | 不适用 |
| 合计 | 1,731,686.85 | 1,047,010.67 | 39.54% | 9.08% | 7.05% | 上升 1.15 个百分点 |

报告期内，公司主营业务数据统计口径未发生调整。

(二) 主营业务分地区情况

1. 营业总收入地区分部情况

单位：万元

| 地区 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 营业总收入 同比增减幅度 |
|----|---------|------------|---------|------------|-----------------|
| | 营业网点数量 | 营业总收入 | 营业网点数量 | 营业总收入 | |
| 广东 | 71 | 191,537.88 | 71 | 217,188.33 | -11.81% |
| 浙江 | 31 | 54,330.55 | 31 | 55,235.66 | -1.64% |
| 北京 | 13 | 38,297.25 | 13 | 44,116.05 | -13.19% |
| 上海 | 12 | 36,359.26 | 12 | 39,456.56 | -7.85% |
| 四川 | 15 | 22,385.06 | 16 | 22,115.30 | 1.22% |
| 福建 | 11 | 13,530.93 | 11 | 15,333.07 | -11.75% |
| 江苏 | 14 | 13,223.49 | 14 | 14,016.54 | -5.66% |
| 湖北 | 6 | 12,968.32 | 6 | 14,811.79 | -12.45% |
| 陕西 | 9 | 10,412.27 | 9 | 11,878.17 | -12.34% |
| 山东 | 11 | 9,671.26 | 11 | 10,154.63 | -4.76% |
| 湖南 | 7 | 6,413.93 | 7 | 7,280.05 | -11.90% |
| 天津 | 4 | 4,876.90 | 4 | 5,995.34 | -18.66% |
| 辽宁 | 7 | 4,597.33 | 7 | 5,290.20 | -13.10% |

| 地区 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 营业总收入 同比增减幅度 |
|----------------|---------|--------------|---------|--------------|-----------------|
| | 营业网点数量 | 营业总收入 | 营业网点数量 | 营业总收入 | |
| 云南 | 4 | 4,286.61 | 4 | 4,986.29 | -14.03% |
| 河南 | 6 | 4,075.79 | 7 | 4,465.53 | -8.73% |
| 安徽 | 5 | 3,605.94 | 5 | 3,965.87 | -9.08% |
| 山西 | 5 | 2,813.14 | 5 | 3,297.38 | -14.69% |
| 重庆 | 5 | 2,549.58 | 5 | 2,886.72 | -11.68% |
| 江西 | 4 | 2,343.09 | 4 | 2,524.37 | -7.18% |
| 黑龙江 | 4 | 2,269.81 | 4 | 2,514.13 | -9.72% |
| 海南 | 3 | 1,782.25 | 3 | 2,319.82 | -23.17% |
| 吉林 | 3 | 1,554.76 | 3 | 1,904.60 | -18.37% |
| 广西 | 3 | 1,172.94 | 3 | 1,414.63 | -17.08% |
| 河北 | 2 | 1,107.44 | 2 | 1,248.28 | -11.28% |
| 内蒙古 | 1 | 973.82 | 1 | 1,203.66 | -19.09% |
| 甘肃 | 1 | 770.89 | 1 | 801.61 | -3.83% |
| 贵州 | 1 | 757.30 | 2 | 845.51 | -10.43% |
| 宁夏 | 1 | 707.76 | 1 | 806.63 | -12.26% |
| 新疆 | 1 | 507.25 | 1 | 646.80 | -21.58% |
| 公司总部及 境内子公司 | - | 1,261,735.53 | - | 1,073,108.92 | 17.58% |
| 境外小计 | - | 20,068.55 | - | 15,764.40 | 27.30% |
| 合计 | 260 | 1,731,686.85 | 263 | 1,587,576.83 | 9.08% |

注：营业网点数量包括公司证券及期货营业网点。

2. 营业利润地区分部情况

单位：万元

| 地区 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 营业利润 同比增减幅度 |
|----|---------|-----------|---------|-----------|----------------|
| | 营业网点数量 | 营业利润 | 营业网点数量 | 营业利润 | |
| 广东 | 71 | 81,116.93 | 71 | 91,830.23 | -11.67% |
| 北京 | 13 | 15,702.09 | 13 | 20,012.83 | -21.54% |
| 上海 | 12 | 15,415.50 | 12 | 19,044.13 | -19.05% |
| 浙江 | 31 | 13,764.40 | 31 | 19,576.06 | -29.69% |
| 湖北 | 6 | 4,876.47 | 6 | 5,902.02 | -17.38% |

| 地区 | 2023 年度 | | 2022 年度 | | 营业利润 同比增减幅度 |
|----------------|---------|------------|---------|------------|----------------|
| | 营业网点数量 | 营业利润 | 营业网点数量 | 营业利润 | |
| 陕西 | 9 | 3,241.73 | 9 | 4,734.42 | -31.53% |
| 云南 | 4 | 1,994.57 | 4 | 2,445.29 | -18.43% |
| 福建 | 11 | 1,687.34 | 11 | 3,052.97 | -44.73% |
| 江苏 | 14 | 1,500.31 | 14 | 3,270.53 | -54.13% |
| 湖南 | 7 | 1,342.38 | 7 | 1,835.96 | -26.88% |
| 山东 | 11 | 1,297.79 | 11 | 1,525.28 | -14.91% |
| 安徽 | 5 | 924.07 | 5 | 949.49 | -2.68% |
| 河南 | 6 | 754.03 | 7 | 926.12 | -18.58% |
| 天津 | 4 | 641.87 | 4 | 849.80 | -24.47% |
| 山西 | 5 | 495.71 | 5 | 740.40 | -33.05% |
| 辽宁 | 7 | 478.04 | 7 | 882.56 | -45.83% |
| 江西 | 4 | 327.13 | 4 | 353.55 | -7.48% |
| 吉林 | 3 | 152.73 | 3 | 154.62 | -1.22% |
| 内蒙古 | 1 | 123.01 | 1 | 82.63 | 48.87% |
| 黑龙江 | 4 | 63.51 | 4 | 167.26 | -62.03% |
| 海南 | 3 | 14.51 | 3 | 357.99 | -95.95% |
| 新疆 | 1 | -54.46 | 1 | -119.23 | 不适用 |
| 河北 | 2 | -72.51 | 2 | -98.35 | 不适用 |
| 甘肃 | 1 | -72.55 | 1 | -85.82 | 不适用 |
| 宁夏 | 1 | -75.03 | 1 | -111.73 | 不适用 |
| 重庆 | 5 | -145.73 | 5 | -81.99 | 不适用 |
| 广西 | 3 | -363.69 | 3 | -213.73 | 不适用 |
| 贵州 | 1 | -443.46 | 2 | -498.80 | 不适用 |
| 四川 | 15 | -1,070.88 | 16 | 2,424.71 | -144.17% |
| 公司总部及 境内子公司 | - | 537,468.06 | - | 429,428.13 | 25.16% |
| 境外小计 | - | 3,592.31 | - | 171.20 | 1,998.30% |
| 合计 | 260 | 684,676.19 | 263 | 609,508.54 | 12.33% |

注：营业网点数量包括公司证券及期货营业网点。

六、非主要经营业务情况

不适用。

七、资产及负债状况分析

(一) 资产及负债构成重大变动情况

单位：万元

| 项目 | 2023 年末 | | 2023 年初 | | 占比增减 (百分点) |
|------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|
| | 金额 | 占总资产比例 | 金额 | 占总资产比例 | |
| 资产： | | | | | |
| 货币资金 | 6,190,474.49 | 13.37% | 6,497,782.63 | 16.48% | -3.11 |
| 结算备付金 | 1,517,751.61 | 3.28% | 1,573,479.93 | 3.99% | -0.71 |
| 交易性金融资产 | 19,598,354.39 | 42.33% | 15,947,257.32 | 40.44% | 1.89 |
| 债权投资 | 29,189.83 | 0.06% | 6,926.62 | 0.02% | 0.04 |
| 其他债权投资 | 8,444,491.09 | 18.24% | 5,150,147.28 | 13.06% | 5.18 |
| 其他权益工具投资 | 1,531,150.42 | 3.31% | 1,042,979.10 | 2.64% | 0.67 |
| 应收账款 | 408,391.84 | 0.88% | 472,893.49 | 1.20% | -0.32 |
| 投资性房地产 | 27,491.66 | 0.06% | 27,912.25 | 0.07% | -0.01 |
| 长期股权投资 | 358,656.42 | 0.77% | 346,846.82 | 0.88% | -0.11 |
| 固定资产 | 244,661.23 | 0.53% | 264,891.56 | 0.67% | -0.14 |
| 在建工程 | 5,242.61 | 0.01% | 2,056.94 | 0.01% | 0.00 |
| 使用权资产 | 44,631.31 | 0.10% | 41,788.02 | 0.11% | -0.01 |
| 融出资金 | 5,588,151.15 | 12.07% | 5,267,209.46 | 13.36% | -1.29 |
| 衍生金融资产 | 56,849.50 | 0.12% | 16,420.40 | 0.04% | 0.08 |
| 买入返售金融资产 | 812,424.23 | 1.75% | 1,582,451.74 | 4.01% | -2.26 |
| 存出保证金 | 982,733.28 | 2.12% | 790,022.15 | 2.00% | 0.12 |
| 无形资产 | 75,554.87 | 0.16% | 70,840.32 | 0.18% | -0.02 |
| 商誉 | 1,026.02 | 0.00% | 1,026.02 | 0.00% | 0.00 |
| 递延所得税资产 | 280,985.04 | 0.61% | 284,815.29 | 0.72% | -0.11 |
| 其他资产 | 97,806.01 | 0.21% | 45,330.55 | 0.11% | 0.10 |

| 项目 | 2023 年末 | | 2023 年初 | | 占比增减 (百分点) |
|------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|
| | 金额 | 占总资产比例 | 金额 | 占总资产比例 | |
| 负债： | | | | | |
| 拆入资金 | 703,196.36 | 1.52% | 900,616.25 | 2.28% | -0.76 |
| 卖出回购金融资产款 | 12,427,559.30 | 26.84% | 11,418,385.94 | 28.96% | -2.12 |
| 短期借款 | 364.00 | 0.00% | - | - | 0.00 |
| 合同负债 | 303.65 | 0.00% | 43.30 | 0.00% | 0.00 |
| 租赁负债 | 44,323.27 | 0.10% | 41,212.99 | 0.10% | 0.00 |
| 应付短期融资款 | 5,554,017.28 | 12.00% | 2,251,599.53 | 5.71% | 6.29 |
| 交易性金融负债 | 127,920.15 | 0.28% | 178,984.74 | 0.45% | -0.17 |
| 衍生金融负债 | 71,326.70 | 0.15% | 32,467.24 | 0.08% | 0.07 |
| 代理买卖证券款 | 5,607,094.69 | 12.11% | 5,941,381.45 | 15.07% | -2.96 |
| 代理承销证券款 | 4,400.00 | 0.01% | - | - | 0.01 |
| 应付职工薪酬 | 530,847.98 | 1.15% | 586,369.82 | 1.49% | -0.34 |
| 应交税费 | 20,793.39 | 0.04% | 47,124.47 | 0.12% | -0.08 |
| 应付款项 | 1,988,307.44 | 4.29% | 1,269,883.13 | 3.22% | 1.07 |
| 预计负债 | 1,490.06 | 0.00% | 3,999.94 | 0.01% | -0.01 |
| 应付债券 | 6,748,365.95 | 14.58% | 4,885,043.67 | 12.39% | 2.19 |
| 递延收益 | 11,933.79 | 0.03% | 12,281.38 | 0.03% | 0.00 |
| 递延所得税负债 | 101,200.37 | 0.22% | 39,027.48 | 0.10% | 0.12 |
| 其他负债 | 1,306,620.20 | 2.82% | 1,136,153.33 | 2.88% | -0.06 |

公司 2023 年末总资产 4,629.60 亿元，较年初增加 686.29 亿元和 17.40%；剔除客户资金后的总资产 4,068.89 亿元，较年初增加 719.72 亿元和 21.49%，其中货币资金及结算备付金 118.86 亿元、融出资金 558.82 亿元、交易性金融资产 1,959.84 亿元、买入返售金融资产 81.24 亿元、其他债权投资 844.45 亿元、其他权益工具投资 153.12 亿元，这七类资产合计占总资产（扣除客户资金）的 91.33%，公司资产结构合理、具有较强的流动性。

公司 2023 年末负债总额 3,525.01 亿元，较年初增加 650.55 亿元和 22.63%；扣除代理买卖证券款后，公司负债 2,964.30 亿元，其中：公司债 696.39 亿元，收益凭证 165.35 亿，短期融资券 370.07 亿元，其余均为正常的经营性短期负债。公司 2023 年底资产负债率 76.14%，剔除代理买卖证券款后资产负债率 72.85%。

公司不存在境外资产占比较高的情况。

(二) 以公允价值计量的资产和负债

单位：万元

| 项目 | 期初数 | 本期公允价值变动损益 | 计入权益的累计公允价值变动 | 本期计提的减值 | 本期购买金额 | 本期出售金额 | 其他变动 | 期末数 |
|--------------------------|---------------|------------|---------------|----------|--------------|-----------|------|---------------|
| 金融资产 | | | | | | | | |
| 1. 交易性金融资产 (不含衍生金融资产) | 15,947,257.32 | 52,138.67 | - | - | 3,596,623.45 | - | - | 19,598,354.39 |
| 2. 衍生金融资产 | 16,420.40 | 92,913.34 | - | - | 33,517.03 | - | - | 56,849.50 |
| 3. 其他债权投资 | 5,150,147.28 | - | 45,160.69 | 8,626.65 | 3,209,457.13 | - | - | 8,444,491.09 |
| 4. 其他权益工具投资 | 1,042,979.10 | - | 24,307.65 | - | 391,887.01 | - | - | 1,531,150.42 |
| 合计 | 22,156,804.10 | 145,052.01 | 69,468.35 | 8,626.65 | 7,231,484.63 | - | - | 29,630,845.39 |
| 金融负债 | 211,451.98 | -16,148.54 | - | - | - | 47,560.17 | - | 199,246.85 |

注：因证券自营业务为证券公司的主营业务，交易频繁，因此，以本期成本变动来反映公司购买、出售金融资产变动的情况。

报告期内，公司主要资产计量属性未发生重大变化。

(三) 截至报告期末的资产权利受限情况

详见公司 2023 年度财务报表附注“五、合并财务报表项目注释”之“(一)合并财务报表项目注释 22. 所有权或使用权受限制的资产”。

(四) 比较式财务报表中变动幅度超过 30% 以上项目的情况

单位：万元

| 项目 | 2023 年末 | 2022 年末 | 同比增减幅度 | 变动原因 |
|----------|--------------|--------------|---------|-------------------------|
| 衍生金融资产 | 56,849.50 | 16,420.40 | 246.21% | 主要是场外期权公允价值变动。 |
| 买入返售金融资产 | 812,424.23 | 1,582,451.74 | -48.66% | 主要是债券质押式回购规模减少。 |
| 债权投资 | 29,189.83 | 6,926.62 | 321.42% | 主要是债权投资规模增加。 |
| 其他债权投资 | 8,444,491.09 | 5,150,147.28 | 63.97% | 主要是其他债权投资规模增加。 |
| 其他权益工具投资 | 1,531,150.42 | 1,042,979.10 | 46.81% | 主要是其他权益工具投资规模增加。 |
| 在建工程 | 5,242.61 | 2,056.94 | 154.87% | 主要是装修投入规模增加。 |
| 其他资产 | 97,806.01 | 45,330.55 | 115.76% | 主要是预缴税金增加。 |
| 短期借款 | 364.00 | - | 不适用 | 主要是信用借款增加。 |
| 应付短期融资券 | 5,554,017.28 | 2,251,599.53 | 146.67% | 主要是短期融资券及收益凭证增加。 |
| 衍生金融负债 | 71,326.70 | 32,467.24 | 119.69% | 主要是收益互换公允价值变动。 |
| 代理承销证券款 | 4,400.00 | - | 不适用 | 收到定向增发认购保证金。 |
| 应交税费 | 20,793.39 | 47,124.47 | -55.88% | 主要是应交企业所得税减少。 |
| 应付款项 | 1,988,307.44 | 1,269,883.13 | 56.57% | 主要是收益互换业务相关款项及待交付清算款增加。 |
| 合同负债 | 303.65 | 43.30 | 601.24% | 主要是大宗商品货款增加。 |

| 项目 | 2023 年末 | 2022 年末 | 同比增减幅度 | 变动原因 |
|---------------|---------------|--------------|------------|-----------------------------|
| 预计负债 | 1,490.06 | 3,999.94 | -62.75% | 主要是部分诉讼案件了结。 |
| 应付债券 | 6,748,365.95 | 4,885,043.67 | 38.14% | 主要是发行的公司债增加。 |
| 递延所得税负债 | 101,200.37 | 39,027.48 | 159.31% | 主要是金融工具公允价值变动产生的递延所得税负债增加。 |
| 其他综合收益 | 76,751.00 | -35,983.53 | 不适用 | 主要是其他权益工具投资及其他债权投资公允价值变动增加。 |
| 项目 | 2023 年度 | 2022 年度 | 同比增减幅度 | 变动原因 |
| 公允价值变动收益（损失） | 128,903.47 | -297,073.40 | 不适用 | 主要是交易性金融资产公允价值变动增加。 |
| 汇兑损失 | -3,846.73 | 342.63 | -1,222.70% | 主要是汇率变动。 |
| 信用减值损失 | 36,157.66 | 25,084.54 | 44.14% | 主要是融资业务信用减值损失增加。 |
| 其他资产减值损失 | - | 219.11 | -100.00% | 主要是计提的大宗商品跌价准备减少。 |
| 营业外收入 | 3,997.22 | 8,294.91 | -51.81% | 主要是收到的政府补助减少。 |
| 营业外支出 | 3,157.77 | -4,413.08 | 不适用 | 主要是计提诉讼案件损失。 |
| 所得税费用 | 42,786.23 | 13,757.55 | 211.00% | 主要是利润总额增加及免税收入减少所致。 |
| 少数股东损益 | - | -340.49 | 不适用 | 子公司少数股东损益变动。 |
| 其他综合收益的税后净额 | 102,851.68 | -38,592.38 | 不适用 | 主要是其他权益工具投资及其他债权投资公允价值变动增加。 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -4,785,559.97 | -734,151.63 | 不适用 | 主要是本期自营业务投资净流出较去年同期增加。 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -14,647.29 | -1,274.62 | 不适用 | 主要是取得投资收益所收到的现金减少。 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 4,506,309.65 | 184,562.46 | 2,341.62% | 主要是发行债券收到的现金增加。 |

（五）融资渠道、长短期负债结构分析

1. 融资渠道

从融资方式来看，公司的融资渠道包括股权融资和债权融资两种方式。从融资期限来看，公司的短期融资渠道包括银行间市场同业拆借、债券回购、转融通、融资资产债权收益权转让与回购、债券借贷等，以及发行短期融资券、短期公司债券、收益凭证等；中长期融资渠道包括发行公司债券、次级债券、永续次级债券、融出资金债权资产证券化，以及发行股票、可转换公司债券等。

2023 年，公司综合运用短期和中长期融资渠道筹措资金，包括开展同业拆借、债券回购、转融通、发行短期融资券、收益凭证、公司债券等。

2. 负债结构

2023 年末，公司总负债 3,525.01 亿元。扣除客户存放的交易结算资金后，自有负债 2,964.30 亿元，其中应付债券占比 22.77%、应付短期融资款占比 18.74%、卖出回购金融资产款占比 41.92%、拆入资金（含转融通）占比 2.37%。截至报告期末，公司无到期未偿还的债务。

3. 流动性管理措施与政策

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。

报告期内，公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

(1) 积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平；

(2) 加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求；

(3) 持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地；

(4) 持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口；

(5) 适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施；

(6) 持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

4. 融资能力分析

公司经营稳健，信誉良好，盈利能力和偿付能力较强。公司积极拓展融资渠道和交易对手，与各大国有商业银行、股份制商业银行等金融机构均保持良好的合作关系，有充足的银行授信额度，具备能够以合适的成本随时获得短期和长期资金的能力。

八、投资状况分析

(一) 对外股权投资总体情况

单位：万元

| 报告期投资额 | 上年同期投资额 | 变动幅度 |
|-----------|------------|---------|
| 51,021.24 | 150,746.18 | -66.15% |

(二) 报告期内获取的重大的股权投资情况

不适用。

(三) 报告期内正在进行的重大的非股权投资情况

不适用。

(四) 金融资产投资

1. 证券投资情况

单位：万元

| 证券品种 | 证券代码 | 证券简称 | 最初投资成本 | 会计计量模式 | 期初账面价值 | 本期公允价值变动损益 | 计入权益的累计公允价值变动 | 本期购买金额 | 本期出售金额 | 报告期损益 | 期末账面价值 | 会计核算科目 | 资金来源 |
|-----------------|--------|------------|----------------|--------|---------------|------------|---------------|----------------|----------------|------------|---------------|--------------------|------|
| 基金 | 000621 | 易方达现金增利货币B | 206,698.05 | 公允价值计量 | 270,623.83 | - | - | 50,000.00 | 120,000.00 | 6,074.22 | 206,698.05 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 债券 | 230210 | 23国开10 | 191,926.68 | 公允价值计量 | - | 811.61 | - | 1,238,775.90 | 1,046,429.28 | 1,760.99 | 196,034.76 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 境内外股票 | 601328 | 交通银行 | 119,268.08 | 公允价值计量 | 113,736.72 | -12.62 | 20,414.92 | 13,457.14 | 11,500.98 | -10.42 | 139,670.38 | 其他权益工具投资 / 交易性金融资产 | 自有 |
| 境内外股票 | 600028 | 中国石化 | 108,231.95 | 公允价值计量 | 102,530.90 | 49.25 | 24,252.88 | 18,534.43 | 17,210.35 | 31.49 | 132,532.32 | 其他权益工具投资 / 交易性金融资产 | 自有 |
| 债券 | 230018 | 23附息国债18 | 121,710.54 | 公允价值计量 | - | 721.07 | - | 800,796.74 | 679,644.41 | 1,714.74 | 123,518.16 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 境内外股票 | 00941 | 中国移动 | 90,068.28 | 公允价值计量 | 93,547.02 | - | 29,216.72 | - | - | 9,326.85 | 119,285.00 | 其他权益工具投资 / 交易性金融资产 | 自有 |
| 基金 | 003474 | 南方天天利货币B | 116,992.02 | 公允价值计量 | 207,839.51 | - | - | 157.62 | 95,122.82 | 4,181.16 | 116,992.02 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 基金 | 009824 | 鹏华添利宝货币B | 111,225.10 | 公允价值计量 | 33,487.10 | -0.22 | - | 80,312.73 | 3,402.09 | 1,621.95 | 11,225.10 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 基金 | 003281 | 广发活期宝货币B | 110,230.18 | 公允价值计量 | 107,807.94 | - | - | - | - | 2,422.24 | 110,230.18 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 债券 | 230008 | 23附息国债08 | 102,670.16 | 公允价值计量 | - | 339.74 | - | 248,969.23 | 146,007.17 | 985.89 | 104,915.63 | 交易性金融资产 | 自有 |
| 期末持有的其他证券投资 | | | 279,988,194.31 | - | 21,217,737.29 | 50,229.83 | -4,416.17 | 191,093,417.34 | 179,706,384.88 | 685,272.18 | 28,242,084.11 | - | - |
| 合计 | | | 29,267,215.35 | - | 22,147,310.32 | 52,138.67 | 69,468.35 | 193,544,421.12 | 181,825,701.97 | 713,381.29 | 29,603,185.72 | - | - |
| 证券投资审批董事会公告披露日期 | | | 不适用 | | | | | | | | | | |
| 证券投资审批股东会公告披露日期 | | | 不适用 | | | | | | | | | | |

2. 衍生品投资情况

不适用。

(五) 募集资金使用情况

报告期内，公司无募集资金使用情况。

九、重大资产和股权出售

(一) 出售重大资产情况

不适用。

(二) 出售重大股权情况

不适用。

十、主要控股参股公司分析

单位：万元

| 公司名称 | 公司类型 | 主要业务 | 注册资本 | 2023 年末 总资产 | 2023 年末 净资产 | 2023 年度 营业总收入 | 2023 年度 营业利润 | 2023 年度 净利润 |
|------|------|---|---------------|----------------|----------------|------------------|-----------------|----------------|
| 国信期货 | 子公司 | 商品期货 经纪、金 融期货经 纪、期货 投资咨询、 资产管理 | 200,000.00 | 2,086,298.62 | 348,431.06 | 298,555.19 | 29,651.48 | 22,860.91 |
| 国信弘盛 | 子公司 | 私募股权 基金管理 业务 | 280,625.27 | 332,160.91 | 306,381.42 | 9,874.39 | 2,557.87 | 2,005.39 |
| 国信香港 | 子公司 | 股票及期 货经纪、 投资银行、 资产管理 | 港币 263,000.00 | 300,058.25 | 141,426.34 | 20,068.55 | 3,592.31 | 3,584.98 |
| 国信资本 | 子公司 | 股权投资 | 300,000.00 | 536,659.07 | 508,819.28 | 27,773.69 | 23,163.71 | 17,690.30 |
| 鹏华基金 | 参股公司 | 基金募集、 基金销售、 资产管理 | 15,000.00 | 794,311.08 | 436,586.60 | 394,666.75 | 111,300.73 | 83,945.18 |

报告期内，公司未新增或处置子公司。

十一、公司控制的结构化主体情况

公司合并的结构化主体包括公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。公司通过综合评估公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2023年12月31日，纳入公司财务报表合并范围的结构化主体共67个，合并的结构化主体的总资产为人民币4,193,429.61万元。公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产和其他权益工具投资的金额为人民币4,044,354.57万元。

十二、公司未来发展的展望

（一）证券行业的发展趋势和竞争格局

在金融供给侧结构性改革的引领下，中国经济正处在从总量扩张向结构优化转变、产业结构转型升级的新时代。中国经济的高质量发展，需要金融体系进一步深化改革，也需要涌现更多高质量发展的证券公司。站在新的历史起点上，证券行业正面临向财富管理转型、跨境业务投入加大、机构业务持续拓展、行业供给侧改革加剧等发展趋势。

1. 财富管理转型不断加快

我国居民财富模式变化为券商经纪和财富管理业务转型带来契机。我国居民存款保持较高增长，但风险偏好较低，资产主要集中在现金、银行存款和储蓄型保险上；同时，高净值人群不断扩大。高净值人群倾向稳中求进，风险偏好更高，随着高净值人群资产的快速增长，财富管理的需求日渐增多。

未来，证券公司将通过资管子公司、基金公司加大财富管理转型，为居民资产配置创造相协调的市场环境和生态，不断丰富资本市场的产品供给，创设稳健、低波动产品，并通过财富渠道销售发展投顾业务，吸引居民特别是高净值人群加大权益类投资的占比。

2. 机构业务拓展空间广阔

机构投资者规模扩张和结构调整为证券公司增加了新的服务需求。近年来，机构投资者流通市值占比逐年增加，增量资金主要来自于公募基金、险资、银行理财和私募基金。资本市场机构投资化趋势持续提升，未来ETF、衍生品、FICC等业务发展壮大有助于券商持续拓展机构业务。

机构客户作为专业化的投资者，券商研究服务是吸引机构客户的主要途径；同时，机构客户交易需求多元，比如，私募客户关注收益互换工具，而公募、银行理财子则对多市场和多品种有更多的要求，为机构持续构建一站式综合交易服务，有助于进一步提升客户黏性。未来，券商将致力于通过研究、交易、资本中介等职能形成业务闭环，持续构建机构服务生态吸引机构客户。

3. 跨境业务投入需要加大

随着市场无风险利率的下行，国内高收益资产不足，“走出去”成为国内券商重要战略拓展方向。随着我国资本市场对外开放的进一步推进，券商加大跨境业务的投入，帮助企业“走出去”，同时积极拓展海外高收益资产，有助于打开新的盈利模式。尤其是“一带一路”国家发展可能复制我国过去经济转型历程，结合相关历史经验，推动综合金融服务和资产挖掘成为后续国内券商重要布局和业务拓展方向。

4. 行业供给侧改革加剧

当前我国证券行业牌照众多，但竞争力不强，通过兼并收购发挥规模优势有现实必要性。目前，全国证券公司超过140家，特别是中小券商数量多，但竞争力不强，严重依赖牌照提供的通道服务；同时，证券行业公司间产品差异较小，业务同质化严重，行业产能过剩，内耗式竞争严重。中国证监会表态支持头部证券公司通过业务创新、集团化经营、并购重组等方式做优做强，打造一流投资银行，预计未来头部券商将加大并购重组做大做强，部分中小券商将发挥差异化特色，实现经济的高质量发展。

（二）公司发展战略

作为资本市场的参与者和建设者，公司在服务实体经济、创新驱动发展等国家重大发展战略过程中，业务空间不断拓展，发展模式不断优化，管理效能不断提升。公司坚持不断提升自身发展质量，持续助力更好发挥资本市场枢纽功能，做好金融“五篇大文章”，助力金融强国建设。在整体战略上，公司坚持“对外一个国信、对内一个客户”理念，全力实施“一个打造、两翼驱动、六大推进、八大支撑”（即“1268”）工程，服务经济高质量发展。“一个打造”，即公司的战略愿景是“打造全球视野、本土优势、创新驱动、科技引领的世界一流综合型投资银行”。“两翼驱动”，即将夯实资本硬实力与提升管理能力作为驱动公司发展的两翼；夯实资本硬实力就是要积极扩大资本规模和境内外影响力，为实现公司行业地位的跨越提供坚实支撑；提升管理能力就是要以加强管理体系和管理能力建设为主线，夯实管理基础，优化管理流程，推动管理创新，全面提升管理现代化水平，不断增强公司的核心竞争力。公司的发展目标是“六大推进”，即推进“全价值链财富管理”“积极稳健型投行服务”“多平台价值投资”“全方位研究服务”“金融科技驱动发展”“多渠道国际化发展”六大业务主线。为实现公司总体战略愿景和业务规划，公司将重点实施“八大支撑”，即重点实施金融控股战略、非有机增长战略、客户服务战略、金融科技领先战略、内部管控战略、人才优先战略、深耕深圳本土战略、国资国企协同发展战略等八大战略支撑。与此同时，进一步落实党建责任、完善公司治理、提升管理效能、加强战略协同、夯实人才支撑、强化风险管控、提升运行保障、鼓励创新发展、推进文化建设、履行社会责任等十大战略保障，发挥券商综合金融服务功能，服务产业科技高质量发展，以此确保公司“十四五”战略规划目标顺利实现。

（三）2024年度公司经营计划

2024年，公司将继续贯彻落实中央、省、市决策部署，紧紧围绕高质量发展要求，全力以赴完成各项经营管理任务，不断开创高质量发展新局面。一是坚持立足主责主业，提升主要业务发展质量。直面降佣降费、融资收紧、重点领域存在风险等方面的影响，补足各项业务短板，不断提高展业质量。二是继续深化合规管理，严格落实金融监管要求。把合规管理放在更加重要的位置，把各项监管要求落到实处，身体力行维护资本市场健康发展。三是牢牢守住风险底线，切实保障业务稳健发展。将防范化解风险作为金融工作的永恒主题，保障各项业务在风险可控的前提下稳健发展。四是大力推动科技赋能，加快数字化转型的步伐。加强金融科技建设与创新，以科技赋能为各项业务的长远发展蓄足后劲。五是不断强化协同赋能，提高综合化服务的能力。进一步提升协同服务水平，更好地挖掘和满足客户的全方位服务需求。六是持续促进

人才赋能，打造专业化的干部队伍。加强干部队伍建设，为各项重点工作的落地落实提供组织保证。七是有效加强管理赋能，增进精细化运营的水平。在成本管控、运营服务、生产经营等方面加强精细管理，为实现各项任务目标做好支持保障。

（四）公司各业务线的创新及风险控制

1. 报告期内业务创新情况

2023年，公司积极把握资本市场和证券行业改革创新的发展机遇，稳步推动新资格申请、新业务拓展。报告期内，公司获得交易所债券做市商、科创50ETF期权主做市商、北交所做市商、信用联结票据创设机构、信用风险缓释工具核心交易商及凭证创设机构等多项新业务资格；推出自选债券做市业务，打造“自营+私募”混合做市服务新模式；助力发行全国首单央企融资租赁公司绿色明珠债、全国首单经销商分期出表型ABS等。公司各相关业务加速推进，继续开创公司在新市场、新客户、新品种等方面的业务新局面，助力中国资本市场高质量发展。

2. 业务创新的风险控制情况

公司将创新业务一并纳入多层次、全方位的内部控制和风险管理体系中，确保风险可控。公司制定并实施了《国信证券股份有限公司新产品新业务管理办法》，对创新业务的筹备、业务评估与决策、业务开展及后续管理进行要求。

在经营创新类业务时，公司始终坚持合法合规、制度先行、流程优先的原则，在业务开展之前制定一系列完备的管理制度、业务流程和风控制度，确保创新业务有条不紊地开展。事前，内控部门全面参与每项创新业务，业务筹备之初介入业务研讨，进行合规论证，商定业务方案，对风险予以识别分析；业务开展后，业务部门和内控部门各自独立进行持续监控和报告，确保各项风控措施落到实处。

十三、报告期内接待调研、沟通、采访等活动

| 序号 | 接待时间 | 接待地点 | 接待方式 | 接待对象类型 | 接待对象 | 谈论的主要内容及提供的资料 | 调研的基本情况索引 |
|----|------------|---|--------------|--------|------------------------------|--|---|
| 1 | 2023年3月3日 | 国信金融大厦 | 实地调研 | 机构 | 兴业证券 | 公司发展战略、经营情况。 | 详见公司于2023年3月7日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》 |
| 2 | 2023年5月19日 | “全景路演”网络平台 (http://rs.p5w.net) | 网络平台 线上交流 | 其他 | 参与国信证券2022年度业绩说明会的媒体、分析师及投资者 | 公司发展战略、经营情况、年度报告相关披露内容。业绩说明会演示材料已随该次活动的投资者关系活动记录表公开披露。 | 详见公司于2023年5月23日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》 |

| 序号 | 接待时间 | 接待地点 | 接待方式 | 接待对象类型 | 接待对象 | 谈论的主要内容及提供的资料 | 调研的基本情况索引 |
|----|-------------|---|--------------|--------|---------------------------------|---------------|--|
| 3 | 2023年7月6日 | 国信金融大厦 | 实地调研 | 机构 | 参加国信证券2023年度投资者开放日的机构投资者及分析师 | 公司发展战略、经营情况。 | 详见公司于2023年7月10日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》 |
| 4 | 2023年8月8日 | 国信金融大厦 | 实地调研 | 机构 | 华安证券 | 公司发展战略、经营情况。 | 详见公司于2023年8月10日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》 |
| 5 | 2023年11月15日 | “全景路演”网络平台 (http://rs.p5w.net) | 网络平台 线上交流 | 其他 | 参加深圳辖区上市公司2023年投资者网上集体接待日活动的投资者 | 公司发展战略、经营情况。 | 详见公司于2023年11月16日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》 |

十四、“质量回报双提升”行动方案贯彻落实情况

为践行以“投资者为本”的上市公司发展理念，维护全体股东利益，基于对公司未来发展前景的信心及价值的认可，公司制定了“质量回报双提升”行动方案，并于2024年3月20日在深交所及指定媒体披露了《关于“质量回报双提升”行动方案的公告》。公司具体举措如下：

（一）抓实高质量发展主线，提升金融服务实体经济质效

1. 积极发挥专业能力优势，大力支持实体经济高质量发展

公司坚守金融服务实体经济本源，以综合金融服务持续为实体经济提供更高质量、更效率的金融服务，积极助力实体经济高质量发展。截至2023年底，公司累计完成股权类项目656个，融资规模约5,906亿元。其中，主板项目209家，排名行业第一；IPO315家，募集资金2,128亿元，排名行业第二；创业板IPO85家，排名行业第一。公司债权融资服务客户覆盖全国30个省市区、880家企业，融资规模近4万亿。累计发行创新创业、科技创新债券42只，实际承销规模约190亿元，积极支持科技创新引领现代化产业体系建设。公司通过IPO，直接股权投资、基金投资、可转债、公司债、再融资、财务顾问等方式，在光伏、锂电、汽车、医疗健康、高端制造等产业形成了覆盖全产业链、全生命周期的深度服务模式。公司秉持“以客户为中心”的发展理念，打造了“鑫投顾”“国信优选”“国信智投”“国信私享”等财富管理品牌，为投资者提供差异化专业的投前一投中一投后全周期闭环服务。

2. 坚持聚焦主责主业，全方位服务国家战略落地落实

公司履行金融国企责任担当，助力国家重大战略实施。一是全力投入粤港澳大湾区和深圳“双区”建设。累计服务大湾区企业 IPO92 家、再融资 98 家，融资规模超 1,200 亿元；服务 93 家大湾区企业发行各类债券 540 只，发行规模超 6,000 亿元；为大湾区超 600 万客户提供财富管理服务。二是多维度支持科技创新。国信在光伏、锂电、汽车、高端装备、医疗健康、智能终端等多个行业形成了全产业链服务覆盖，在做好股权融资服务基础上，加强科创债、科创票据、公募 REITs、知识产权 ABS 等工具和模式的创新，陪伴贝特瑞等多家企业发展壮大为全球细分领域的行业龙头。三是全方位助力区域协同发展。国信围绕“粤港澳大湾区、长三角、京津冀、川渝、鲁豫”等国家重点产业区域，各业务条线协同联动，统筹推进，打造公司的重点区域发展战略。在全国 117 个城市和地区共设有 238 家证券营业网点，全面服务当地居民财富管理和企业投融资需求。

3. 坚决扛起金融国企责任担当，努力践行金融强国使命

公司将可持续发展理念融入公司发展战略、经营管理，勇担上市公司及国有企业的双重社会责任。2022-2023 年接连披露公司首份环境信息披露报告、首份 ESG 报告，向市场全面展现公司 ESG 实践成果。深入贯彻 ESG 管理要求和可持续发展理念，公司将董事会战略委员会更名为战略与 ESG 委员会，持续完善 ESG 治理架构。公司发挥资本市场中介机构职能，借助资本市场支持帮扶地区产业升级和经济结构转型；积极开发多元化的绿色金融产品和服务，引导社会资本流向符合可持续发展理念的实体领域，推动绿色产业发展壮大。此外，公司还从产业扶持、民生帮扶、文化帮扶、教育帮扶、消费帮扶等多方面开展公益慈善活动，助力帮扶地区巩固拓展脱贫攻坚成果。

下一步，公司将发挥券商综合金融服务功能，扎实做好科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融、数字金融五篇大文章，加快形成新质生产力，为资本市场健康稳定发展、为加快建设金融强国贡献更多力量。

（二）全面深化业务转型发展，持续提升综合金融服务能力

公司坚持以高质量发展统揽公司发展全局，全面贯彻新发展理念，聚焦主责主业，扎实推进各项业务转型升级和管理提升。财富管理业务完善以客户为中心的分类分层服务体系，加强买方投顾能力建设，加速向线上化、机构化转型；投行业务在合规前提下，打造“投行+投研+投资”产业协同服务模式，进一步提升企业客户全生命周期服务能力；投资业务坚持稳健投资理念，持续加强投资管理能力，积极开发低风险和市场中性交易业务；研究业务积极布局新能源、新材料、高端制造等战略新兴产业研究，探索专业化、精品化、国际化研究路径；国际业务打造内外联动、协同作战的业务拓展模式，稳步推进国际化进程；金融科技提升关键系统自研能力，探索前沿科技应用，聚焦业务实际痛点，深化业技融合，建设多渠道一体化金融科技平台，满足客户差异化需求，加快全面数字化转型，赋能业务发展和内部管理。

（三）践行以投资者为本的理念，与投资者共享发展成果

公司重视对投资者的合理投资回报，通过持续、稳定、科学的利润分配政策，与投资者共享公司发展成果。现金分红作为实现投资回报的重要形式，是尊重和保护投资者权益的重要体现。根据《公司章程》，在具备现金分红条件的情况下，公司每年以现金方式分配的利润不少于当年实现的可供现金分配利润的 20%，且在任何三个连续年度内以现金方式累计分配的利润不少于该三年实现的年均可分配利润的 30%。

上市十年来，公司年均现金分红比例达 35.24%，2021 年度、2022 年度现金分红比例均超过 40%，坚持以真金白银回报全体股东，入选中国上市公司协会 2021 年度“上市公司丰厚回报榜”。公司 2023 年度利润分配预案为：向全体股东每

10 股派发现金红利 2.70 元（含税），合计派发现金红利 25.95 亿元。2023 年度现金分红总额占 2023 年度归属于上市公司股东净利润的比例为 40.38%。

公司将继续统筹好业务发展与股东回报的动态平衡，在制定利润分配政策时充分听取中小投资者的意见和建议，长期保持连续、稳定的现金分红政策，提升广大投资者的获得感。

（四）夯实公司治理基础，持续提升规范运作水平

公司将始终坚持“两个一以贯之”，在完善公司治理中加强党的领导，充分发挥公司党委“把方向、管大局、保落实”的领导作用，持续夯实公司治理基础。为各治理主体发挥自身职能作用提供坚实保障，支持董事、监事依法参与公司治理决策，同时积极为中小股东参与公司治理提供支持和便利，保障各治理主体高效沟通、协调有力，为公司股东合法权益提供有力保障。

公司将顺应监管层简政放权、优化制度供给的形势，认真贯彻落实关于公司治理、内部控制、合规风控相关要求。公司董事会将持续提升科学决策水平，充分发挥“定战略、作决策、防风险”作用；监事会将依法依规履行监督职能，切实维护公司及股东利益；经理层落实任期制和契约化管理各项要求，认真落实董事会各项决议；不断提高公司核心竞争力，确保公司长期稳定发展，以更好的经营业绩回馈广大投资者。

（五）严格履行信披责任，主动加强与资本市场的深度交流

信息披露质量直接关系到投资者的合法权益，直接关系到资本市场的运行效率和效果。公司自上市以来，始终按照监管要求依法依规履行信息披露义务，充分展示公司经营管理成果，已连续三年获评深交所信息披露 A 级。除了从信息披露上保障投资者知情权外，公司还给股东提供多种方式获得公司信息，不断丰富投资者关系活动的形式和手段，搭建全方位及时有效的沟通平台，比如日常调研接待、专人负责投资者热线、举办年度业绩说明会及各类电话会议交流活动等。2022 年以来，公司主动举办投资者开放日、半年度业绩交流电话会活动，加强与机构投资者的沟通，积极向市场传递投资价值，增进投资者对公司的进一步了解和认同。

公司将严格按照证监会、深交所的相关信息披露要求，在披露内容上严格遵守“真实、准确、完整”的要求，在工作程序上秉持“及时、公平”的原则，持续提升信息披露质量。持续健全、完善信息披露主管部门与业务部门的定期交流和信息共享机制，力求通过简明清晰、通俗易懂的语言，使用图文并茂的方式，充分展示公司的主要财务指标、业务经营情况、核心竞争力及各项经营发展成果；同时，以投资者需求为导向，做好对各类投资者的服务和保障，通过高质量的信息披露、积极主动的投资者关系管理工作增进投资者对行业及公司价值的理解。

04 第四节

公司治理



一、公司治理的基本状况

公司严格按照《公司法》《证券法》及中国证监会相关规章及规范性文件要求，规范运作，持续致力于维护和提升公司良好的市场形象。公司不断完善公司治理结构，持续健全合规风控制度和内控管理体系，形成了股东大会、董事会、监事会和经营管理层相互分离、相互制衡的公司治理结构，各层级在各自职责、权限范围内，各司其职、各负其责，确保公司治理的规范有效。

（一）股东与股东大会

公司严格按照相关规定召集、召开股东大会，确保所有股东，特别是中小股东享有平等的地位，能够充分行使自己的权利。公司控股股东及实际控制人能够按照相关法律、法规及《公司章程》的规定行使其享有的权利，不存在超越股东大会直接或间接干预公司决策和经营活动的情形，没有占用公司资金，没有要求公司为其担保或为他人担保，在人员、资产、财务、机构和业务方面做到与公司明确分开。

（二）董事与董事会

公司董事会不断完善董事会议事规则，董事会会议的召集、召开及表决程序合法有效。公司建立了独立董事制度，董事会成员中现有三名独立董事，独立客观地维护公司整体利益和保护中小股东合法权益，充分发挥了“参与决策、监督制衡、专业咨询”的职责。

（三）监事与监事会

公司监事会不断完善监事会议事规则，监事会会议的召集、召开及表决程序合法有效。公司监事会向股东大会负责，本着对全体股东负责的精神，对公司财务以及公司董事会、高级管理人员履行职责的合法合规性进行了有效监督。

（四）经营管理层

公司经营管理层产生的程序符合《公司法》《公司章程》的规定。公司全面推行经理层成员任期制和契约化管理，对经理层成员实行个性化针对性考核，进一步健全市场化经营机制，激发公司高质量发展活力，能够依照法律、法规和董事会的授权，依法合规经营，忠实勤勉，努力实现股东利益和社会效益的最大化。

（五）报告期内建立和完善的公司治理制度情况

报告期内，公司及时组织更新和修订《公司章程》《董事会专门委员会议事规则》《独立董事工作细则》等公司治理制度。公司治理结构完善，与《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。

二、公司相对于控股股东、实际控制人在保证公司资产、人员、财务、机构、业务等方面的独立情况

公司与控股股东在资产、人员、财务、机构、业务等方面完全分开，具有独立完整的业务及自主经营能力。

（一）公司资产独立完整情况

公司经营和办公场所独立，具备与经营有关的业务体系及相关资产，各种资产权属清晰、完整，不存在依赖控股股东的资产进行经营的情况；不存在资产、资金被控股股东占用而损害公司利益的情况。

（二）公司人员独立完整情况

公司具有完善的人力资源管理体系、独立的职工薪酬制度及完整的职工培训计划，与控股股东完全分离。

公司董事、监事和高级管理人员的选聘符合《公司法》《证券法》及《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的有关规定，公司高级管理人员不存在在控股股东及其关联方任职的情形。

（三）公司财务独立完整情况

公司按照《企业会计准则》《企业会计准则 - 应用指南》等规定建立了独立的财务会计核算体系，具有完善的财务管理制度体系，并且设立了独立的财务部门，配备了独立的财务会计人员，不存在财务会计人员在股东单位兼职的现象。

公司开设了独立的银行账户，办理了独立的税务登记，依法纳税，未与股东单位混合纳税。

截至报告期末，公司不存在为股东单位及其他关联方提供担保的情况。

（四）公司机构独立完整情况

公司具备完善的法人治理结构，股东大会、董事会、监事会、经营管理层职责明确，各机构严格按照《公司法》《公司章程》等规定高效运行。公司拥有独立、完善的组织架构，业务部门与职能部门，公司总部与分公司、营业部相互协调，工作有序开展。公司的办公机构和各项经营业务完全独立于股东及关联方，与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业间没有机构混同的情形。

（五）公司业务独立完整情况

公司已获得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》，各项业务资质及经营许可文件齐备，具有独立完整的经营体系。公司业务与控股股东及其他关联方不存在同业竞争的情形，亦不受其控制与影响。

三、同业竞争情况

报告期内，公司控股股东除持有本公司股权外，未在中国境内或境外，直接或间接从事与公司相同或相似并构成竞争关系的业务，亦未直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权，与公司不存在同业竞争。

公司控股股东深投控出具了《避免同业竞争及利益冲突的承诺及约束措施》，详见本报告第六节“一、承诺事项履行情况”。

四、报告期内召开的年度股东大会和临时股东大会的有关情况

(一) 本报告期股东大会情况

| 会议届次 | 会议类型 | 投资者参与比例 | 召开日期 | 披露日期 | 会议决议 |
|-------------------------|--------|----------|-----------------|-----------------|--|
| 2022 年度 股东大会 | 年度股东大会 | 83.1474% | 2023 年 6 月 1 日 | 2023 年 6 月 2 日 | 审议通过以下议案： 1.2022 年度财务决算报告； 2.2022 年度利润分配方案； 3.2022 年年度报告及其摘要； 4.2022 年度董事会工作报告； 5.2022 年度监事会工作报告； 6.2022 年度独立董事工作报告； 7.关于 2022 年度关联交易及预计 2023 年度日常关联交易的议案； 8.关于聘请 2023 年度审计机构及其报酬的议案； 9.关于 2023 年度自营投资额度的议案； 10.关于国信证券（香港）金融控股有限公司 2023 年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案； 11.关于修订公司章程及其附件的议案； 12.关于修订独立董事工作细则的议案； 13.关于修订关联交易管理制度的议案； 14.关于修订对外担保管理制度的议案； 15.关于修订募集资金管理办法的议案； 16.关于选举公司董事的议案； 17.关于选举公司监事的议案。 此外，股东大会审阅了如下议题： 1.2022 年度董事履职考核和薪酬情况专项说明； 2.2022 年度监事履职考核和薪酬情况专项说明； 3.2022 年度高级管理人员履职情况、绩效考核和薪酬情况专项说明。 |
| 2023 年第 一次临时 股东大会 | 临时股东大会 | 82.0997% | 2023 年 9 月 11 日 | 2023 年 9 月 12 日 | 审议通过关于公司发行境内外公司债券融资工具的议案。 |
| 2023 年第 二次临时 股东大会 | 临时股东大会 | 82.3083% | 2023 年 11 月 3 日 | 2023 年 11 月 4 日 | 审议通过关于选举公司独立董事的议案。 |

注：“投资者参与比例”是指出席会议的股东及股东授权委托代表所代表股份数量占公司表决权股份总数的比例。

(二) 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

不适用。

五、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 基本情况

| 姓名 | 职务 | 任职状态 | 性别 | 年龄 | 任期起始日期 | 任期终止日期 | 期初持股数(股) | 本期增持股份数量(股) | 本期减持股份数量(股) | 其他增减变动(股) | 期末持股数(股) | 股份增减变动的原因 |
|-----|-----------------|------|----|----|--|-----------|----------|-------------|-------------|-----------|----------|-----------|
| 张纳沙 | 董事长 | 现任 | 女 | 54 | 2021年4月26日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 邓 舸 | 董事、总裁 | 现任 | 男 | 55 | 董事职务： 2020年6月15日 总裁职务： 2020年5月14日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 姚 飞 | 董事 | 现任 | 男 | 56 | 2018年8月6日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 刘小腊 | 董事 | 现任 | 男 | 54 | 2017年10月16日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 李石山 | 董事 | 现任 | 男 | 53 | 2024年2月1日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 张雁南 | 董事 | 现任 | 男 | 43 | 2023年6月1日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 金 李 | 独立董事 | 现任 | 男 | 53 | 2021年9月3日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 张 蕊 | 独立董事 | 现任 | 女 | 61 | 2023年11月3日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 李进一 | 独立董事 | 现任 | 男 | 60 | 2024年2月1日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 洪伟南 | 监事会召集人、 职工监事 | 现任 | 男 | 59 | 2021年9月3日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 谢晓隽 | 监事 | 现任 | 女 | 39 | 2024年3月25日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 许禄德 | 监事 | 现任 | 男 | 55 | 2023年6月1日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 陈 华 | 副总裁 | 现任 | 男 | 58 | 2017年7月10日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 吴国舫 | 副总裁 | 现任 | 男 | 52 | 2024年4月16日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 谌传立 | 董事会秘书 | 现任 | 男 | 60 | 2018年12月28日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 杜海江 | 副总裁 | 现任 | 男 | 53 | 2018年5月15日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 揭冠周 | 副总裁 | 现任 | 男 | 45 | 2021年4月26日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 成 飞 | 副总裁 | 现任 | 男 | 40 | 2021年5月25日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 陈 勇 | 合规总监 | 现任 | 男 | 59 | 2009年4月16日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 袁 超 | 首席营销官 | 现任 | 男 | 55 | 2021年11月23日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 曾 信 | 首席风险官 | 现任 | 男 | 48 | 2017年7月31日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 周中国 | 财务负责人 | 现任 | 男 | 50 | 2018年1月16日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 刘汉西 | 首席信息官 | 现任 | 男 | 59 | 2021年11月23日 | 2024年9月2日 | - | - | - | - | - | - |
| 李双友 | 原董事 | 离任 | 男 | 55 | 2015年11月20日 | 2024年1月8日 | - | - | - | - | - | - |

| 姓名 | 职务 | 任职状态 | 性别 | 年龄 | 任期起始日期 | 任期终止日期 | 期初持股数 (股) | 本期增持股份数量 (股) | 本期减持股份数量 (股) | 其他增减变动 (股) | 期末持股数 (股) | 股份增减变动的原因 |
|-----|--------|------|----|----|-------------|------------|-----------|--------------|--------------|------------|-----------|-----------|
| 赵军 | 原董事 | 离任 | 男 | 55 | 2021年9月3日 | 2023年4月28日 | - | - | - | - | - | - |
| 白涛 | 原独立董事 | 离任 | 女 | 59 | 2016年12月23日 | 2023年11月3日 | - | - | - | - | - | - |
| 郑学定 | 原独立董事 | 离任 | 男 | 60 | 2017年12月21日 | 2024年2月1日 | - | - | - | - | - | - |
| 李保军 | 原监事会主席 | 离任 | 男 | 60 | 2021年9月3日 | 2024年3月25日 | - | - | - | - | - | - |
| 张财广 | 原监事 | 离任 | 男 | 61 | 2012年4月16日 | 2023年6月1日 | - | - | - | - | - | - |

1. 报告期是否存在任期内董事、监事离任和高级管理人员解聘的情况

报告期内，公司收到原董事赵军先生的辞职报告。因工作调整原因，赵军先生申请辞去公司第五届董事会董事以及董事会审计委员会委员职务，其辞职之后将不再担任公司及公司控股子公司任何职务。公司收到原监事张财广先生的辞职报告。因个人原因，张财广先生申请辞去公司第五届监事会监事职务，其辞职之后将不再担任公司及公司控股子公司任何职务。

2. 公司董事、监事、高级管理人员变动情况

| 姓名 | 担任的职务 | 类型 | 日期 | 原因 |
|-----|--------|----|------------|---|
| 李石山 | 董事 | 选举 | 2024年2月1日 | 经公司2024年第一次临时股东大会审议通过，选举李石山先生为公司第五届董事会董事。 |
| 张雁南 | 董事 | 选举 | 2023年6月1日 | 经公司2022年度股东大会审议通过，选举张雁南先生为公司第五届董事会董事。 |
| 张蕊 | 独立董事 | 选举 | 2023年11月3日 | 经公司2023年第二次临时股东大会审议通过，选举张蕊女士为公司第五届董事会独立董事。 |
| 李进一 | 独立董事 | 选举 | 2024年2月1日 | 经公司2024年第一次临时股东大会审议通过，选举李进一先生为公司第五届董事会独立董事。 |
| 谢晓隽 | 监事 | 选举 | 2024年3月25日 | 经公司2024年第二次临时股东大会审议通过，选举谢晓隽女士为公司第五届监事会监事。 |
| 许禄德 | 监事 | 选举 | 2023年6月1日 | 经公司2022年度股东大会审议通过，选举许禄德先生为公司第五届监事会监事。 |
| 吴国舫 | 副总裁 | 聘任 | 2024年4月16日 | 经公司第五届董事会第二十六次会议审议通过，聘任吴国舫先生担任公司副总裁。 |
| 李双友 | 原董事 | 离任 | 2024年1月8日 | 个人原因。 |
| 赵军 | 原董事 | 离任 | 2023年4月28日 | 工作调整。 |
| 白涛 | 原独立董事 | 离任 | 2023年11月3日 | 任期满离任。 |
| 郑学定 | 原独立董事 | 离任 | 2024年2月1日 | 任期满离任。 |
| 李保军 | 原监事会主席 | 离任 | 2024年3月25日 | 到龄退休。 |
| 张财广 | 原监事 | 离任 | 2023年6月1日 | 个人原因。 |
| 谌传立 | 原副总裁 | 离任 | 2024年4月16日 | 工作调整。 |

（二）任职情况

1. 公司现任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历以及目前在公司的主要职责

（1）董事

张纳沙女士，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1969年12月，硕士。张纳沙女士曾任深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副主任、党委委员，深圳市龙华区委常委、区政府党组副书记、常务副区长等职务。2021年2月加入公司，现任公司党委书记、董事长，兼任鹏华基金管理有限公司董事长、中国证券业协会副会长、合规管理与廉洁从业委员会主任委员，深圳市证券业协会会长，上海证券交易所政策咨询委员会主任委员，深圳证券交易所会员理事、上诉复核委员会主任委员。2021年4月起任公司董事长。

邓舸先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年9月，硕士。邓舸先生曾任中国证券监督管理委员会副处长、处长、证监会新闻发言人、上市公司监管部副主任等职务。2020年5月加入公司，现任公司董事、总裁，兼任国信期货有限责任公司董事长、中国证券业协会风险管理委员会主任委员、中国上市公司协会第三届并购融资委员会主任委员、上海证券交易所债券发展委员会主任委员、深圳证券交易所股票发行规范委员会副主任委员。2020年6月起任公司董事。

姚飞先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1967年9月，博士，教授级经济师。姚飞先生曾任中油资产管理有限公司副总经理、党委委员，兼任昆仑信托有限责任公司副总裁、海通昆仑股权投资管理（上海）有限公司董事长、黑龙江龙煤矿业集团股份有限公司监事等职务；现任深圳市投资控股有限公司党委委员，副总经理；兼任深圳资产管理有限公司董事长、总经理、党总支书记，深圳市投控资本有限公司董事长，深圳担保集团有限公司董事、深圳市怡亚通供应链股份有限公司董事、华润深国投信托有限公司董事等职务。2018年8月起任公司董事。

刘小腊先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1970年1月，博士。刘小腊先生曾任招商银行股份有限公司资金交易部总经理、资产管理部总经理兼同业金融综合管理部总经理、同业金融总部常务副总经理兼资产管理部总经理、佛山分行党委书记，珠海华润银行股份有限公司常务副行长，华润深国投信托有限公司党委副书记、总经理等职务。现任华润深国投信托有限公司党委书记、董事长，兼任深圳红树林创业投资有限公司董事长。2017年10月起任公司董事。

李石山先生，中国国籍，无境外永久居留权，出生于1970年8月，经济学学士。李石山先生曾任红河卷烟厂会计、财务部综合科副科长、科长、财统总部会计部部长；红烟宾馆会计室主任；红河卷烟厂华南市场部副主任、副经理、华中市场部经理；红河集团营销中心副总经理；红云红河烟草（集团）有限责任公司营销中心副总监、财务部副部长、多元化投资管理部部长；云南合和（集团）股份有限公司财务管理部部长、副总经理、董事；红塔证券股份有限公司董事长。现任云南合和（集团）股份有限公司党委委员，兼任红塔证券股份有限公司党委副书记及监事会主席、红塔沈阳工业有限公司副董事长。2024年2月起任公司董事。

张雁南先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1980年12月，硕士。张雁南先生曾任全国社会保障基金理事会股权资产部（实业投资部）项目投资二处主任科员、运营处副处长、运营处处长、渤海产业投资基金管理有限公司董事等职务，现任全国社会保障基金理事会股权资产部（实业投资部）直接股权投资一处处长。2023年6月起任公司董事。

金李先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1970年12月，博士。金李先生历任复旦大学国际金融系教员，哈佛商学院金融学助理教授，哈佛商学院金融学副教授，北京大学经济与管理学部副主任，兼任牛津大学金融学终身教职正教授；现任南方科技大学副校长、商学院代理院长，南方科技金融研究院院长、金融系讲席教授，北京大学国家金融研究

中心主任、光华管理学院金融系讲席教授，中国人民政治协商会议全国委员会委员、经济委员会委员，九三学社中央常委、经济委员会副主任，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司独立董事、苏州元禾控股股份有限公司独立董事。2021年9月起任公司独立董事。

张蕊女士，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1962年6月，博士。张蕊女士曾任江西财经大学会计发展研究中心主任、会计学院院长。现任江西财经大学会计学资深教授、博士生导师，兼任奈雪的茶控股有限公司独立董事、深圳市爱施德股份有限公司独立董事。2023年11月起任公司独立董事。

李进一先生，中国国籍，无境外永久居留权，出生于1964年3月，硕士。现任暨南大学管理学院副教授，广东胜伦律师事务所执业律师，兼任广电运通集团股份有限公司独立董事、国义招标股份有限公司独立董事，盛京银行股份有限公司独立非执行董事。2024年2月起任公司独立董事。

（2）监事

洪伟南先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年9月，硕士，审计师。洪伟南先生曾任深圳国际信托投资公司深圳红岭中路证券营业部员工、证券发行科经理；深圳国投证券有限公司发行部副经理、投资银行一部总经理；国信证券投资银行总部副总经理，国信财务顾问有限公司副总经理，国信证券深圳红岭中路证券营业部发展科经理，国信证券稽核审计部高级经理、监察稽核总部高级经理、主任审计师、稽核总监、副总经理、总经理等职务。现任公司监事会召集人、职工监事、监察稽核总部总经理、工会常委、工会经费审查委员会主任。2021年9月起任公司职工监事，2024年3月起任公司监事会召集人。

谢晓隽女士，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1985年4月，硕士。谢晓隽女士曾任中国工商银行深圳分行罗湖支行公司部客户经理、平石资产管理有限公司销售及产品总监、平安磐海资本有限责任公司管理岗、深圳市投控东海投资有限公司投资副总监，深圳市投资控股有限公司金融发展部高级主管、经理。现任深圳市投资控股有限公司金融发展部副部长，深圳市深投物业发展有限公司董事。2024年3月起任公司监事。

许禄德先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年4月，本科，工程师。许禄德先生曾任北京城建投资发展股份有限公司投资证券部部长、北京京城佳业物业股份有限公司副总经理、董事会秘书及联席公司秘书。现任北京城建投资发展股份有限公司董事、副总经理、董事会秘书，深圳市中科招商创业投资有限公司董事长，北京市中科远东创业投资有限公司董事长，南微医学科技股份有限公司董事。2023年6月起任公司监事。

（3）高级管理人员

邓舸先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年9月，硕士。邓舸先生曾任中国证券监督管理委员会副处长、处长、证监会新闻发言人、上市公司监管部副主任等职务。2020年5月加入公司，现任公司董事、总裁，兼任国信期货有限责任公司董事长、中国证券业协会风险管理委员会主任委员、中国上市公司协会第三届并购融资委员会主任委员、上海证券交易所债券发展委员会主任委员、深圳证券交易所股票发行规范委员会副主任委员。

陈华先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1965年10月，大学本科，高级审计师。陈华先生曾任审计署驻武汉特派员办事处科员、副主任科员、主任科员、副处长，审计署外资司副处长（主持工作）、处长，审计署驻武汉特派员办事处法制处处长，深圳市审计局总审计师、党组成员，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副主任、党委委员等职务。2017年7月加入公司，现任公司副总裁，兼任中国上市公司协会 ESG 委员会委员。

吴国舫先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1971年7月，博士。吴国舫先生曾任中国证监会法律部处长、创业板股票发行审核委员会委员（兼）、发行监管部处长、北京市中关村管委会主任助理（挂职）、中国证监会法律部副主任，中国银河证券股份有限公司执行委员会委员、业务总监等职务。2024年3月加入公司，现任公司副总裁、投资银行事业部总裁。

谌传立先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年2月，硕士，高级工程师。谌传立先生曾任深圳证监局（证管办）科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长、上市公司监管二处处长，中国证监会第六届创业板发审委委员，深圳证监局稽查二处处长等职务。2017年12月加入公司，曾任公司副总裁、投资银行事业部总裁，现任公司董事会秘书、国信证券（香港）金融控股有限公司董事长、中国证券业协会投资银行专业委员会委员、中国上市公司协会董事会秘书委员会执行副主任委员。

杜海江先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1971年2月，大学本科。杜海江先生2001年3月加入公司，历任杭州萧然东路证券营业部电子商务部经理、杭州保俶路证券营业部总经理助理、浙江营销中心总经理、浙江管理总部总经理、杭州分公司总经理、浙江分公司总经理、浙江金融资产交易中心董事等职务。现任公司副总裁、财富管理与机构事业部总裁，兼任鹏华基金管理有限公司董事、中国证券业协会证券经纪与财富管理专业委员会副主任委员、上海证券交易所会员自律管理委员会委员。

揭冠周先生，中国国籍，美国永久居留权，出生于1978年10月，博士。揭冠周先生曾任美国富国银行固定收益部执行总经理、资深证券银行家，美国美银美林全球银行及资本市场部执行总经理、资深量化金融分析师等职务。2021年4月加入公司，现任公司副总裁。

成飞先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1983年9月，硕士。成飞先生曾任国泰君安证券固定收益证券总部助理研究员、资产管理总部研究员、投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部副总经理、总经理、公司总裁助理、公司副总裁等职务。2021年5月加入公司，现任公司副总裁兼资产管理总部总经理，兼任国信弘盛私募基金管理有限公司董事长、中国证券业协会投资者服务与保护委员会委员。

陈勇先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年10月，博士。陈勇先生曾任君安证券有限责任公司投资发展部业务经理、法律部部门负责人，国泰君安证券股份有限公司法律事务部副总经理，联合证券有限责任公司董事会秘书等职务；2006年11月加入公司，历任公司法律事务部总经理、董事会办公室主任、合规管理总部总经理、首席风险官等职务；现任公司合规总监，兼任中国证券业协会自律处分和内审委员会副主任委员、中国证券业协会合规管理与廉洁从业委员会秘书长、深圳市合规专家委员会专家委员、深圳经济特区金融学会反洗钱专业委员会副主任委员、深圳国际仲裁院仲裁员、中国恒大风险化解委员会委员。

袁超先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1969年2月，硕士。袁超先生曾任美国纽约瑞士信贷第一波士顿公司固定收益部金融衍生品风险管理经理，美国纽约巴克莱银行美元金融衍生品交易部金融衍生品交易员、美国纽约摩尔对冲基金管理公司风险管理部副总裁，美国芝加哥堡垒对冲基金管理公司风险管理部副总裁，鹏华基金管理有限公司总经理助理，人保资本投资管理有限公司党委书记、董事长、总裁等职务；2015年7月加入公司，曾任公司首席投资官兼资产管理总部总经理、国信弘盛私募基金管理有限公司董事长，现任公司首席营销官，兼任深圳市证券业协会理事、深圳市投资基金同业公会理事。

曾信先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1975年6月，硕士。曾信先生曾任大鹏证券融资服务公司上海行业组副组长、执行副董事。2005年2月加入公司，历任投资银行事业部业务十一部副总经理、业务十二部总经理助理、内

核办公室副主任、内核办公室主任兼投资银行业务内核负责人、内核总部副总经理（主持工作）、内核总部总经理等职务；现任公司首席风险官、投资银行质量控制总部总经理、投资银行业务内核负责人，兼任中国证券业协会风险管理委员会秘书长。

周中国先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1973年12月，硕士，高级会计师，注册会计师。周中国先生曾任深圳华为技术有限公司定价中心经理助理。2000年7月加入公司，历任资金财务总部业务经理，深圳金地证券服务部财务经理，资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理，人力资源总部副总经理、人力资源总部总经理等职务。现任公司财务负责人兼资金财务总部总经理、国信资本有限责任公司董事长、鹏华基金管理有限公司董事、中国证券业协会财务会计委员会委员、深圳市会计协会副会长。

刘汉西先生，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年10月，大学本科。刘汉西先生曾任国家经委经济信息中心系统处工程师、国家物资部中国物资信息中心数据库处主任科员。1994年6月加入公司，历任电脑部副总经理、经纪管理总部电子商务部总经理、电子商务总部副总经理、信息技术中心总经理、信息技术总部技术总监、总裁助理兼信息技术总部总经理、厦门两岸股权交易中心有限公司董事；现任公司首席信息官、系统运行总部总经理、技术管理部总经理，兼任证通股份有限公司监事、中国证券业协会证券科技专业委员会副主任委员。

2. 在股东单位任职情况

| 任职人员姓名 | 股东单位名称 | 在股东单位担任的职务 | 任期期间 | 在股东单位是否领取报酬津贴 |
|--------|----------------|----------------------------|---------------------------------|---------------|
| 姚 飞 | 深圳市投资控股有限公司 | 党委委员、副总经理 | 2017年2月至今 | 是 |
| 刘小腊 | 华润深国投信托有限公司 | 党委书记、董事长 | 党委书记：2017年5月至今 董事长：2023年1月至今 | 是 |
| 李石山 | 云南合和（集团）股份有限公司 | 党委委员 | 2022年5月至今 | 是 |
| 张雁南 | 全国社会保障基金理事会 | 股权资产部（实业投资部） 直接股权投资一处处长 | 2022年10月至今 | 是 |
| 谢晓隼 | 深圳市投资控股有限公司 | 金融发展部副部长 | 2021年4月至今 | 是 |
| 许禄德 | 北京城建投资发展股份有限公司 | 董事、副总经理、董事会秘书 | 2022年8月至今 | 是 |

3. 在其他单位任职情况

| 任职人员姓名 | 其他单位名称 | 在其他单位担任的职务 | 任期期间 | 在其他单位是否 领取报酬津贴 |
|--------|----------------------------|---------------|----------------------|-------------------|
| 姚 飞 | 深圳资产管理有限公司 | 董事长、总经理、党总支书记 | 2019年12月至今 | 否 |
| | 深圳担保集团有限公司 | 董事 | 2017年9月至今 | 否 |
| | 深圳市投控资本有限公司 | 董事长 | 2020年6月至今 | 否 |
| | 深圳市怡亚通供应链股份有限公司 | 董事 | 2018年9月至今 | 否 |
| | 深圳投控湾区股权投资基金合伙企业 (有限合伙) | 执行事务合伙人委派代表 | 2018年5月至今 | 否 |
| | 华润深国投信托有限公司 | 董事 | 2019年12月至今 | 否 |
| | 中国北欧投资控股有限公司 | 董事 | 2017年10月至今 | 否 |
| | 中国国有资本风险投资基金股份 有限公司 | 董事 | 2021年9月至今 | 否 |
| 刘小腊 | 深圳红树林创业投资有限公司 | 董事长 | 2017年5月至今 | 否 |
| 李石山 | 红塔证券股份有限公司 | 党委副书记、监事会主席 | 2022年8月至今 | 否 |
| | 红塔沈阳工业有限公司 | 副董事长 | 2023年9月至今 | 否 |
| 金 李 | 北京大学 | 光华管理学院金融系讲席教授 | 2012年10月至今 | 否 |
| | 南方科技大学 | 副校长、商学院代理院长 | 2022年7月至今 | 是 |
| | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 独立董事 | 2021年8月至今 | 是 |
| | 苏州元禾控股股份有限公司 | 独立董事 | 2023年10月至今 | 否 |
| 张 蕊 | 江西财经大学 | 会计学院资深教授 | 2021年5月至今 | 是 |
| | 奈雪的茶控股有限公司 | 独立董事 | 2021年6月至今 | 是 |
| | 深圳市爱施德股份有限公司 | 独立董事 | 2019年10月至今 | 是 |
| | 恒邦财产保险股份有限公司 | 独立董事 | 2015年2月至 2023年8月 | 是 |
| 李进一 | 广东胜伦律师事务所 | 执业律师 | 2017年12月至今 | 是 |
| | 广电运通集团股份有限公司 | 独立董事 | 2020年12月至今 | 是 |
| | 国义招标股份有限公司 | 独立董事 | 2020年6月至今 | 是 |
| | 盛京银行股份有限公司 | 独立非执行董事 | 2018年2月至 2024年2月 | 是 |
| | 广州酒家集团股份有限公司 | 独立董事 | 2019年1月至 2023年12月 | 是 |
| 谢晓隽 | 深圳市深投物业发展有限公司 | 董事 | 2021年12月至今 | 否 |
| 许禄德 | 深圳市中科招商创业投资有限公司 | 董事长 | 2022年10月至今 | 否 |
| | 南微医学科技股份有限公司 | 董事 | 2022年12月至今 | 否 |
| | 北京市中科远东创业投资有限公司 | 董事长 | 2022年11月至今 | 否 |

4. 公司现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员近三年证券监管机构处罚的情况

无。

(三) 董事、监事、高级管理人员报酬情况

1. 公司报告期内董事、监事和高级管理人员报酬情况

单位：万元

| 姓名 | 职务 | 性别 | 年龄 | 任职状态 | 从公司获得的 税前报酬总额 | 是否在公司 关联方获取报酬 |
|-----|-------------|----|----|------|------------------|------------------|
| 张纳沙 | 董事长 | 女 | 54 | 现任 | 310.77 | 否 |
| 邓 舸 | 董事、总裁 | 男 | 55 | 现任 | 310.68 | 否 |
| 姚 飞 | 董事 | 男 | 56 | 现任 | 13.10 | 是 |
| 刘小腊 | 董事 | 男 | 54 | 现任 | - | 是 |
| 李石山 | 董事 | 男 | 53 | 现任 | - | 是 |
| 张雁南 | 董事 | 男 | 43 | 现任 | - | 否 |
| 金 李 | 独立董事 | 男 | 53 | 现任 | 28.57 | 否 |
| 张 蕊 | 独立董事 | 女 | 61 | 现任 | 4.76 | 否 |
| 李进一 | 独立董事 | 男 | 60 | 现任 | - | 否 |
| 洪伟南 | 监事会召集人、职工监事 | 男 | 59 | 现任 | 136.66 | 否 |
| 谢晓隽 | 监事 | 女 | 39 | 现任 | - | 是 |
| 许禄德 | 监事 | 男 | 55 | 现任 | - | 是 |
| 陈 华 | 副总裁 | 男 | 58 | 现任 | 292.23 | 否 |
| 吴国舫 | 副总裁 | 男 | 52 | 现任 | - | 否 |
| 谌传立 | 董事会秘书 | 男 | 60 | 现任 | 298.16 | 否 |
| 杜海江 | 副总裁 | 男 | 53 | 现任 | 298.46 | 否 |
| 揭冠周 | 副总裁 | 男 | 45 | 现任 | 299.13 | 否 |
| 成 飞 | 副总裁 | 男 | 40 | 现任 | 298.82 | 否 |
| 陈 勇 | 合规总监 | 男 | 59 | 现任 | 293.06 | 否 |
| 袁 超 | 首席营销官 | 男 | 55 | 现任 | 289.07 | 否 |
| 曾 信 | 首席风险官 | 男 | 48 | 现任 | 293.01 | 否 |
| 周中国 | 财务负责人 | 男 | 50 | 现任 | 293.00 | 否 |
| 刘汉西 | 首席信息官 | 男 | 59 | 现任 | 293.01 | 否 |
| 李双友 | 原董事 | 男 | 55 | 离任 | - | 是 |
| 赵 军 | 原董事 | 男 | 55 | 离任 | - | 否 |
| 白 涛 | 原独立董事 | 女 | 59 | 离任 | 23.81 | 是 |
| 郑学定 | 原独立董事 | 男 | 60 | 离任 | 28.57 | 是 |
| 李保军 | 原监事会主席 | 男 | 60 | 离任 | 292.23 | 否 |
| 张财广 | 原监事 | 男 | 61 | 离任 | - | 否 |
| 合计 | - | - | - | - | 4,097.1 | - |

注 1：公司不存在支付非现金薪酬的情况。公司未实行股权激励计划，董事、监事和高级管理人员期初、期末均未持有公司股份。

注 2：报告期内，董事、监事及高级管理人员从公司获得的税前报酬总额为担任相应职务期间领取的薪酬，包括基本工资、绩效工资、津贴补贴及福利。职工监事在报告期内从公司获得的报酬为其作为公司职工取得的薪酬。

注 3：公司董事会于 2024 年 4 月 12 日收到独立董事金李先生的《辞呈》。因工作原因，金李先生向公司董事会申请辞去公司第五届董事会独立董事及董事会专门委员会委员职务。该辞职申请将自公司股东大会选举产生新任独立董事之日起生效。

注 4：公司于 2024 年 4 月 16 日召开第五届董事会第二十六次会议，审议通过《关于聘任公司副总裁的议案》，同意聘任吴国航先生为公司副总裁，其任期从公司董事会审议通过之日起至公司第五届董事会履职期限届满之日止；免去谌传立先生公司副总裁职务。

2. 董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序、确定依据、实际支付情况

公司董事、监事、高级管理人员薪酬标准和发放方式根据外部相关规定及公司内部薪酬管理相关制度的有关规定执行。其中，董事、监事的薪酬由股东大会审议确定，公司董事会负责对高级管理人员进行绩效考核以及薪酬分配。公司高级管理人员薪酬事项经过薪酬与考核委员会出具书面意见后提交董事会审议。

根据《国信证券股份有限公司董事监事薪酬与考核管理办法》的有关规定，公司对董事、监事 2023 年度的履职考核原则主要包括：出席董监事会会议情况、在会议上发言情况、是否受到监管部门处罚以及是否存在严重损害公司利益等方面。对内部董事还应根据其实际履职情况依照公司相关规定进行考核。对职工监事还应根据其其在公司任职情况依照公司相关规定进行考核。公司高级管理人员依照公司《全面推行经理层成员任期制和契约化管理工作方案》《国信证券关于开展 2023 年度经理层成员业绩考核工作的通知》《高级管理人员合规性专项考核实施细则》《合规总监考核实施细则》等相关制度和办法执行考核。公司董事会按照与经理层成员签订的年度经营业绩责任书对经理层成员年度经营业绩进行考核，形成考核意见，并根据考核结果兑现薪酬和实施聘任（或解聘）。考核重点关注内容主要包括公司年度经营业绩目标的完成情况，国家重大决策部署和公司“十四五”规划的落实情况，合规专项考核情况，党风廉政建设情况，安全稳定与生态文明情况等。根据中国证监会发布的《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等相关要求，证券基金经营机构董事会对合规负责人进行年度考核时，应当就其履行职责情况及考核意见书面征求中国证监会相关派出机构的意见，中国证监会相关派出机构可以根据掌握的情况建议董事会调整考核结果。

根据《国信证券股份有限公司董事监事薪酬与考核管理办法》的有关规定，公司对董事、监事 2023 年度的薪酬管理原则主要包括：（一）薪酬与所承担的责任、风险相一致的原则；（二）薪酬与公司效益及工作目标挂钩的原则；（三）薪酬与中长期激励相结合的原则；（四）公开、透明的原则。公司董事、监事的薪酬参考以下因素确定：同行业企业（尤其是与公司主要经营指标相同或相近的同行业企业）董事的薪酬水平；消费物价指数；公司盈利水平；公司主要经营指标的市场排名、公司合规经营情况、风险管理情况。公司高级管理人员薪酬标准和发放方式根据外部相关规定及公司内部薪酬管理相关制度的有关规定执行。

《证券公司治理准则》规定，证券公司高级管理人员的绩效年薪由董事会根据高级管理人员的年度绩效考核结果决定，并且应当采取延期支付的方式，延期支付期限不少于3年。《证券公司建立稳健薪酬制度指引》规定，证券公司在制定薪酬制度时，应当对董事长、高级管理人员等建立薪酬递延支付机制，薪酬支付计划应当确保公司资本充足和可持续经营，递延支付年限应当与相关业务的风险持续期限相匹配。根据证券公司治理准则及稳健薪酬制度等相关要求，公司内部董事、监事、高级管理人员实行绩效薪酬递延支付机制，上述人员担任相应职务期间归属于以前年度的递延税前薪酬金额分别为（2022年/2021年及以前）：张纳沙 179.92/144.75 万元；邓舸 129.40/225.90 万元；李保军 70.25/63.86 万元；陈华 61.20/205.15 万元；谌传立 105.42/217.87 万元；杜海江 106.05/222.50 万元；揭冠周 99.74/116.11 万元；成飞 50.01/135.75 万元；陈勇 75.87/225.48 万元；袁超 49.89/232.50 万元；曾信 82.39/219.62 万元；周中国 102.67/220.59 万元；刘汉西 81.80/217.78 万元；洪伟南 109.09/0 万元。公司外部董事、监事无归属于以前年度递延薪酬。

根据《国信证券股份有限公司董事监事薪酬与考核管理办法》，公司外部董事、监事津贴按月发放，无递延发放安排。公司内部董事、职工监事的薪酬，根据其在公司担任的具体职务，按照公司有关制度执行。张纳沙董事长、邓舸总裁为公司内部董事，洪伟南先生为监事会召集人、职工监事。

六、报告期内召开的董事会会议、监事会会议的有关情况

（一）本报告期董事会情况

| 会议届次 | 召开日期 | 披露日期 | 会议决议 |
|--------------|------------|------------|--|
| 第五届董事会第十四次会议 | 2023年3月30日 | 2023年3月31日 | 审议通过如下议案： 1. 关于审议公司 2022 年度信息技术工作报告的议案； 2. 关于审议公司 2022 年度廉洁从业工作报告的议案； 3. 关于审议参公大集合 2022 年年度报告的议案； 4. 关于向商业银行申请 2023 年度综合授信额度的议案； 5. 关于修订《国信证券股份有限公司子公司管理办法（试行）》的议案； 6. 关于向国信弘盛私募基金管理有限公司委派董事、监事的议案； 7. 关于向国信资本有限责任公司委派董事、监事及推荐总经理人选的议案。 此外，董事会审阅了 2022 年度反洗钱工作报告；集体学习了 2022 年下半年监管新规动态。 |
| 第五届董事会第十五次会议 | 2023年4月28日 | 2023年4月29日 | 审议通过如下议案： 1. 2022 年度经营工作报告； 2. 2022 年度财务决算报告； 3. 2022 年度利润分配方案； 4. 2022 年年度报告及其摘要； 5. 2022 年度董事会工作报告； 6. 2022 年度独立董事工作报告； 7. 关于 2022 年度风险控制情况考核评价的议案； 8. 2022 年度董事履职考核和薪酬情况专项说明； 9. 2022 年度高级管理人员履职情况、绩效考核和薪酬情况专项说明； 10. 2022 年度合规总监考核报告； 11. 2022 年度合规报告； 12. 2022 年度风险管理报告； 13. 2022 年度内部控制评价报告； 14. 2022 年度合规管理有效性评估报告； |

| 会议届次 | 召开日期 | 披露日期 | 会议决议 |
|--------------|-----------------|-----------------|---|
| | | | <p>15.2022 年度流动性风险管理报告；</p> <p>16.2022 年度环境、社会及管治报告；</p> <p>17.关于 2022 年度关联交易及预计 2023 年度日常关联交易的议案；</p> <p>18.2022 年度内控体系工作报告；</p> <p>19.关于聘请 2023 年度审计机构及其报酬的议案；</p> <p>20.关于 2023 年度风险偏好和风险容忍度的议案；</p> |
| | | | <p>21.2023 年度重大风险评估报告；</p> <p>22.2023 年度内部审计工作计划；</p> <p>23.关于 2023 年度自营投资额度的议案；</p> <p>24.关于国信证券（香港）金融控股有限公司 2023 年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案；</p> <p>25.2023 年第一季度报告；</p> <p>26.2023 年第一季度风险管理报告；</p> <p>27.2023 年第一季度流动性风险报告；</p> <p>28.关于修订公司章程及其附件的议案；</p> <p>29.关于修订董事会专门委员会议事规则的议案；</p> <p>30.关于修订独立董事工作细则的议案；</p> <p>31.关于修订总裁工作细则的议案；</p> <p>32.关于修订董事会秘书工作细则的议案；</p> <p>33.关于修订关联交易管理制度的议案；</p> <p>34.关于修订对外担保管理制度的议案；</p> <p>35.关于修订信息披露事务管理制度的议案；</p> <p>36.关于修订重大信息内部报告制度的议案；</p> <p>37.关于修订投资者关系管理制度的议案；</p> <p>38.关于修订内幕信息知情人登记管理制度的议案；</p> <p>39.关于修订董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及变动管理制度的议案；</p> <p>40.关于修订募集资金管理办法的议案；</p> <p>41.关于审议诚信从业管理办法的议案；</p> <p>42.关于提名董事候选人的议案；</p> <p>43.关于提议召开公司 2022 年度股东大会的议案。</p> <p>此外，董事会审阅了如下议题：2022 年度董事会审计委员会履职情况报告、2022 年度内部控制审计报告、2022 年度董事会决议和董事会授权事项执行情况报告、2023 年度财务预算方案、董事会审计委员会 2023 年第一季度履职情况报告。</p> |
| 第五届董事会第十六次会议 | 2023 年 5 月 26 日 | 2023 年 5 月 27 日 | <p>审议通过如下议案：</p> <p>关于公司转让中证机构间报价系统股份有限公司股份的议案。</p> <p>此外，董事会审阅了关于 2022 年度投资项目后评价工作报告的议案。</p> |
| 第五届董事会第十七次会议 | 2023 年 8 月 25 日 | 2023 年 8 月 26 日 | <p>审议通过如下议案：</p> <p>1.2023 年半年度经营工作报告；</p> <p>2.2023 年半年度报告及其摘要；</p> <p>3.2023 年半年度合规报告；</p> <p>4.2023 年半年度风险管理报告；</p> <p>5.2023 年半年度流动性风险管理报告；</p> <p>6.关于审议参公大集合 2023 年中期报告的议案；</p> <p>7.关于公司发行境内外公司债券融资工具的议案；</p> <p>8.关于新一代核心交易系统建设项目立项的议案；</p> <p>9.关于调整公司第五届董事会专门委员会成员的议案；</p> <p>10.关于提议召开 2023 年第一次临时股东大会的议案。</p> <p>此外，董事会审阅了如下议题：2023 年上半年董事会决议和董事会授权事项执行情况报告、董事会审计委员会 2023 年半年度履职情况报告、2023 年半年度反洗钱工作报告、2022 年度诚信从业情况监督检查报告；集体学习了 2023 年上半年监管新规动态。</p> |

| 会议届次 | 召开日期 | 披露日期 | 会议决议 |
|--------------|-------------|-------------|--|
| 第五届董事会第十八次会议 | 2023年10月17日 | 2023年10月18日 | 审议通过如下议案： 1. 关于提名公司独立董事候选人的议案； 2. 关于提议召开2023年第二次临时股东大会的议案。 |
| 第五届董事会第十九次会议 | 2023年10月27日 | 2023年10月28日 | 审议通过如下议案： 1. 2023年第三季度报告； 2. 2023年第三季度风险管理报告； 3. 2023年第三季度流动性风险管理报告； 4. 关于审议公司经理层成员《2023年度经营业绩责任书》的议案； 5. 关于东莞高性能核心交易机房技术升级改造立项的议案； 6. 关于审议资产减值准备财务核销管理暂行规定的议案； 7. 关于向前海股交投资控股（深圳）有限公司推荐董事人选的议案； 8. 关于向国信证券（香港）金融控股有限公司委派董事的议案。 此外，董事会审阅了2023年前三季度经营工作报告、董事会审计委员会2023年第三季度履职情况报告。 |
| 第五届董事会第二十次会议 | 2023年12月29日 | 2023年12月30日 | 审议通过如下议案： 1. 关于审议《国信证券股份有限公司“十四五”规划中期评估报告》的议案； 2. 关于公司2023年度有关薪酬事项的议案； 3. 关于公司2024年度内部审计工作计划的议案； 4. 关于调整公司第五届董事会专门委员会成员的议案。 |

（二）董事出席董事会及股东大会的情况

| 董事出席董事会及股东大会的情况 | | | | | | | |
|-----------------|--------------|-----------|--------------|-----------|---------|------------------|----------|
| 董事姓名 | 本报告期应参加董事会次数 | 现场出席董事会次数 | 以通讯方式参加董事会次数 | 委托出席董事会次数 | 缺席董事会次数 | 是否连续两次未亲自参加董事会会议 | 出席股东大会次数 |
| 张纳沙 | 7 | 5 | 2 | - | - | 否 | 3 |
| 邓 舸 | 7 | 5 | 2 | - | - | 否 | 3 |
| 姚 飞 | 7 | 1 | 6 | - | - | 否 | 3 |
| 刘小腊 | 7 | 1 | 6 | - | - | 否 | 3 |
| 张雁南 | 4 | 1 | 3 | - | - | 否 | 2 |
| 金 李 | 7 | 2 | 5 | - | - | 否 | 3 |
| 张 蕊 | 1 | - | 1 | - | - | 否 | 1 |
| 李双友 | 7 | 1 | 6 | - | - | 否 | 3 |
| 赵 军 | 2 | - | 2 | - | - | 否 | - |
| 白 涛 | 6 | 1 | 5 | - | - | 否 | 3 |
| 郑学定 | 7 | 3 | 4 | - | - | 否 | 3 |

报告期内，不存在董事连续两次未亲自出席董事会的情况。

（三）董事对公司有关事项提出异议的情况

报告期内，董事对公司有关事项未提出异议。

（四）董事履行职责的其他说明

1. 董事对公司有关建议是否被采纳

报告期内，董事对公司有关建议已被采纳。

2. 董事对公司有关建议被采纳或未被采纳的说明

第五届董事会审计委员会 2023 年第三次会议上，与会董事提出建议：管理建议书仍需要进一步完善加强，根据审计委员会意见，会同公司经营管理层，对管理建议书作出修改完善，提出有可行性的具体举措。

公司采纳董事提出的重要意见和建议，并予以落实。第五届董事会审计委员会 2023 年第四次会议审阅了《国信证券 2022 年度管理建议书》。

七、董事会下设专门委员会在报告期内的情况

| 委员会名称 | 成员情况 | 召开会议次数 | 召开日期 | 会议内容 | 提出的重要意见和建议 | 其他履行职责的情况 | 异议事项具体情况（如有） |
|-------------|-----------------------------|-------------------------|------------------|--|---|-----------|--------------|
| 战略与 ESG 委员会 | 张纳沙 刘小腊 李双友 金李 | 第五届董事会战略委员会 2023 年第一次会议 | 2023 年 12 月 21 日 | 审议通过《国信证券股份有限公司“十四五”规划中期评估报告》。 | 战略与 ESG 委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 无 | 无 |
| | 郑学定 姚飞 赵军 白涛 金李 | 第五届董事会审计委员会 2023 年第一次会议 | 2023 年 2 月 14 日 | 审阅国信证券 2022 年度外部审计工作方案。 | 审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 无 | 无 |
| 审计委员会 | 郑学定 姚飞 白涛 金李 | 第五届董事会审计委员会 2023 年第二次会议 | 2023 年 4 月 14 日 | 审议通过如下议案： 1.2022 年度财务报告（经审计）； 2.2022 年度财务决算报告； 3.2022 年度利润分配方案； 4.2022 年年度报告； 5.关于 2022 年度关联交易及预计 2023 年度日常关联交易的议案； 6.2022 年度内部审计工作报告； 7.2022 年度内部控制评价报告； 8.2022 年度募集资金存放及使用情况检查报告； 9.2022 年度反洗钱工作专项审计报告； 10.公司重大事项 2022 年专项检查报告； 11.天健会计师事务所 2022 年度审计工作总结； 12.2022 年度内部控制审计报告； 13.董事会审计委员会 2022 年度履职情况报告； 14.2023 年度财务预算方案； 15.2023 年度内部审计工作计划； 16.关于聘请 2023 年度审计机构及其报酬的议案； 17.2023 年第一季度报告； 18.2023 年第一季度内部审计工作报告； 19.董事会审计委员会 2023 年第一季度履职情况报告。 | 审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。建议在提交管理建议书，并在建议书中增加股票质押回购业务风险提示，从内控缺陷方面分析原因等要素。 | 无 | 无 |

| 委员会名称 | 成员情况 | 召开会议次数 | 召开日期 | 会议内容 | 提出的重要意见和建议 | 其他履行职责的情况 | 异议事项具体情况(如有) |
|---------|------------------------------|---------------------------|------------------|--|---|---|--------------|
| | 郑学定 姚飞 白涛 金李 | 第五届董事会审计委员会 2023 年第三次会议 | 2023 年 8 月 11 日 | 审议通过如下议案： 1.2023 年半年度报告； 2.2023 年半年度内部审计工作报告案； 3. 董事会审计委员会 2023 年半年度履职情况报告。 | 审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 建议管理建议书再进一步完善加强，根据审计委员会意见，会同公司经营管理层，对管理建议书作出修改完善，提出有可行性的具体举措。 | 听取天健会计师事务所 2023 年半年度审阅工作总结、国信证券 2022 年度内部控制审计管理建议书。 | 无 |
| | 郑学定 姚飞 张雁南 白涛 金李 | 第五届董事会审计委员会 2023 年第四次会议 | 2023 年 10 月 20 日 | 审议通过如下议案： 1.2023 年三季度报告； 2.2023 年三季度内部审计工作报告； 3. 董事会审计委员会 2023 年三季度履职情况报告。 | 审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 听取国信证券 2022 年度管理建议书。 | 无 |
| | 郑学定、 姚飞、 张雁南、 金李 | 第五届董事会审计委员会 2023 年第五次会议 | 2023 年 12 月 25 日 | 审议通过公司 2024 年度内部审计工作计划。 | 审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 听取国信证券 2023 年度外部审计工作方案。 | 无 |
| | 邓舸 姚飞 刘小腊 郑学定 | 第五届董事会风险管理委员会 2023 年第一次会议 | 2023 年 3 月 30 日 | 审议通过公司 2022 年度廉洁从业工作报告。 | 风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 听取公司 2022 年度反洗钱工作报告。 | 无 |
| 风险管理委员会 | 邓舸 姚飞 刘小腊 郑学定 | 第五届董事会风险管理委员会 2023 年第二次会议 | 2023 年 4 月 28 日 | 审议通过如下议案： 1.2022 年度合规报告； 2.2022 年度合规管理有效性评估报告； 3.2022 年度风险管理报告； 4.2022 年度流动性风险管理报告； 5.2023 年第一季度风险管理报告； 6.2023 年第一季度流动性风险管理报告； 7.2023 年度重大风险评估报告。 | 风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 无 | 无 |
| | 邓舸 姚飞 刘小腊 郑学定 | 第五届董事会风险管理委员会 2023 年第三次会议 | 2023 年 8 月 25 日 | 审议通过如下议案： 1.2023 年半年度合规报告； 2.2023 年半年度风险管理报告； 3.2023 年半年度流动性风险管理报告。 | 风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 听取公司 2023 年半年度反洗钱工作报告、2022 年度诚信从业情况监督检查报告。 | 无 |
| | 邓舸 姚飞 刘小腊 郑学定 | 第五届董事会风险管理委员会 2023 年第四次会议 | 2023 年 10 月 27 日 | 审议通过如下议案： 1.2023 年第三季度风险管理报告； 2.2023 年第三季度流动性风险管理报告。 | 风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 无 | 无 |

| 委员会名称 | 成员情况 | 召开会议次数 | 召开日期 | 会议内容 | 提出的重要意见和建议 | 其他履行职责的情况 | 异议事项具体情况(如有) |
|----------|------------------|---------------------------|-------------|---|---|----------------------------------|--------------|
| 薪酬与考核委员会 | 白涛 郑学定 金李 | 第五届董事会薪酬与考核委员会2023年第一次会议 | 2023年4月14日 | 审议通过如下议案： 1.2022年度高级管理人员履职情况报告； 2.2022年度高级管理人员履职情况、绩效考核和薪酬情况专项说明； 3.2022年度合规总监考核报告； 4.关于2022年度风险控制情况考核评价的议案； 5.2022年度独立董事工作报告； 6.2022年度董事履职考核和薪酬情况专项说明。 | 薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 审查董事、高级管理人员的履职履行情况，并对其进行年度绩效考核。 | 无 |
| | 郑学定 金李 | 第五届董事会薪酬与考核委员会2023年第二次会议 | 2023年12月25日 | 审议通过关于公司2023年度有关薪酬事项的议案。 | 薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 审查公司2023年度薪酬方案。 | 无 |
| | 郑学定 金李 张蕊 | 第五届董事会薪酬与考核委员会2023年度第三次会议 | 2023年12月29日 | 审议通过如下议案： 1.关于选举薪酬与考核委员会主任委员的议案； 2.关于公司高级管理人员2023年度有关薪酬事项的议案。 | 薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 审查公司高级管理人员2023年度薪酬事项。 | 无 |
| 提名委员会 | 金李 张纳沙 郑学定 | 第五届董事会提名委员会2023年第一次会议 | 2023年4月14日 | 审议通过如下议案： 1.关于提名公司董事候选人的议案； 2.关于提名独立董事候选人的议案。 | 提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 审查董事候选人的选任标准和程序，并对董事人选的资格条件进行审议。 | 无 |
| | 金李 张纳沙 郑学定 | 第五届董事会提名委员会2023年第二次会议 | 2023年10月16日 | 审议通过关于提名独立董事候选人的议案。 | 提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 | 审查董事候选人的选任标准和程序，并对董事人选的资格条件进行审议。 | 无 |

注：2024年3月8日，公司第五届董事会第二十三次会议审议通过《关于调整公司第五届董事会专门委员会设置及成员的议案》，公司原董事会战略委员会调整为董事会战略与ESG委员会。

八、监事会工作情况

报告期内，监事会对监督事项无异议。

九、公司员工情况

(一) 员工数量、专业构成及教育程度

单位：人

| | |
|----------------------|-----------|
| 母公司在职工的数量 | 11,327 |
| 子公司在职工的数量 | 700 |
| 在职工的数量合计 | 12,027 |
| 当期领取薪酬员工总人数 | 12,027 |
| 母公司及子公司需承担费用的离退休职工人数 | - |
| 专业构成 | |
| 类别 | 人数 |
| 财富管理与机构业务 | 8,922 |
| 投资银行 | 1,146 |
| 资产管理 | 245 |
| 投资与交易 | 252 |
| 研究 | 209 |
| 资金财务 | 141 |
| 信息技术 | 630 |
| 法律、合规、风控、稽核 | 240 |
| 其他 | 242 |
| 合计 | 12,027 |
| 教育程度 | |
| 类别 | 人数 |
| 博士 | 84 |
| 硕士 | 3,737 |
| 本科 | 7,772 |
| 大专及以下 | 434 |
| 合计 | 12,027 |

注：上述员工情况包含公司内退人员 4 人，公司无额外需要承担费用的离退休员工。

（二）薪酬政策

公司依据“贯彻稳健经营理念、确保合规底线要求、促进形成正向激励、提升公司长期价值”的原则，持续优化薪酬激励约束机制，将员工专业胜任能力、执业质量、合规情况、业绩情况以及市场水平作为薪酬分配的重要依据；严格落实各项监管要求，根据不同业务风险收益特征、业务周期、岗位重要性等制定差异化的递延支付政策，通过风险扣减、递延发放等机制，实现风险收益的有效捆绑，避免短期激励、过度激励，推动公司稳健长远发展。

公司员工薪酬由工资、津贴补贴与福利构成。公司按照国家有关规定为员工缴纳各项社会保险和住房公积金，同时为提高员工的福利保障水平，公司还为员工提供企业年金。

（三）培训计划

根据公司战略“加强多层次、高质量培训，打造现代学习型组织”的总体要求，积极构建“统筹整合、上下贯通”的培训格局，坚持教育引导，坚决落实人才队伍培育工程，以培训为抓手提升组织能力，持续打造具有国信特色的全程培养体系，提升人才对公司文化的认同感，强化公司的凝聚力和战斗力，全面为公司人才队伍赋能。

2023年，在公司党委的统筹部署下，积极举办“国信大讲堂”之“高管课堂”“业务专题”等一系列学习活动，充分发挥领导干部带头作用；加强校企合作，组织公司法务人员走进中国政法大学开展“履职能力提升专题研修班”项目；通过线上+线下多元混合学习模式定期举办“扬帆计划”新员工训练营，助力新人快速成长，增强对公司的归属感和凝聚力；针对专业序列人才开展“攀登计划（人力资源）（产品经理）”等专题培训，高效赋能业务及组织人才发展；择优选派关键人才参加主管部门、监管机构举办的各类学习活动。同时，公司全面升级“国信互学E”线上学习平台，完善知识管理体系，提升培训系统化管理水平，切实满足员工日常学习需求，促进现代学习型组织建设，为人才队伍持续成长发展提供有力保障。

（四）劳务外包情况

公司不存在劳务外包数量较大的情况。

十、委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况

公司无证券经纪人。

十一、公司利润分配及资本公积金转增股本情况

（一）报告期内利润分配政策，特别是现金分红政策的制定、执行或调整情况

1. 公司股利分配的原则

公司重视对投资者的合理投资回报，保护投资者合法权益，制定持续、稳定、科学的利润分配政策，其中，在制定现金分红政策时，公司将结合所处行业特点、发展阶段和自身经营模式、盈利水平、资金需求等因素，选择有利于投资者分享公司成长和发展结果、取得合理投资回报的现金分红政策。

2. 公司股利分配政策的具体内容和条件

公司实行同股同利的股利分配政策。公司可以采取现金、股票、或者现金和股票相结合的方式分配股利，但应优先采用现金分红的利润分配方式。公司应保持利润分配政策的连续性和稳定性，在具备现金分红条件的情况下，公司将积极采取现金分红政策。在具备利润分配的条件下，公司原则上每年度进行一次利润分配。经董事会和股东大会审议决定，公司可以进行中期利润分配。公司进行现金分红应同时具备以下条件：（1）公司该年度实现的可供现金分配的利润为正值且累计未分配利润为正值；（2）未来十二个月内公司无重大投资计划或重大现金支出等特殊情况发生；（3）公司现金分红方案实施后公司各项风险控制指标符合监管部门规定。在具备上述现金分红条件的情况下，公司每年以现金方式分配的利润不少于当年实现的可供现金分配利润的百分之二十，且在任何三个连续年度内以现金方式累计分配的利润不少于该三年实现的年均可分配利润的百分之三十。若现金充裕，经董事会和股东大会审议决定，公司可根据实际情况提高现金分红比例。公司可根据需要采取股票股利的方式进行利润分配。公司采取股票方式分配股利的条件为：（1）公司经营情况良好；（2）因公司股票价格与公司股本规模不匹配或者公司有重大投资计划或重大现金支出、公司具有成长性、每股净资产的摊薄等真实合理因素，以股票方式分配股利有利于公司和股东整体利益；（3）公司的现金分红符合有关法律法规及《公司章程》的规定。

现金分红政策的专项说明

| | |
|--|-----|
| 是否符合公司章程的规定或股东大会决议的要求： | 是 |
| 分红标准和比例是否明确和清晰： | 是 |
| 相关的决策程序和机制是否完备： | 是 |
| 独立董事是否履职尽责并发挥了应有的作用： | 是 |
| 公司未进行现金分红的，应当披露具体原因，以及下一步为增强投资者回报水平拟采取的措施： | 不适用 |
| 中小股东是否有充分表达意见和诉求的机会，其合法权益是否得到了充分保护： | 是 |
| 现金分红政策进行调整或变更的，条件及程序是否合规、透明： | 是 |

3. 公司报告期内盈利且母公司可供股东分配利润为正但未提出现金红利分配预案

不适用。

4. 董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

| | |
|-------------------------|-------------------|
| 每 10 股送红股数（股） | - |
| 每 10 股派息数（元）（含税） | 2.70 |
| 每 10 股转增数（股） | - |
| 分配预案的股本基数（股） | 9,612,429,377 |
| 现金分红金额（元）（含税） | 2,595,355,931.79 |
| 以其他方式（如回购股份）现金分红金额（元） | - |
| 现金分红总额（含其他方式）（元） | 2,595,355,931.79 |
| 可分配利润（元） | 24,721,353,716.93 |
| 现金分红总额（含其他方式）占利润分配总额的比例 | 100% |

本次现金分红情况

以2023年末总股本9,612,429,377股为基数，向全体股东每10股派送现金红利2.70元（含税），共派送现金红利2,595,355,931.79元，尚未分配的利润22,331,811,507.48元转入下一年度。

利润分配或资本公积金转增预案的详细情况说明

经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，母公司2023年度实现净利润6,009,158,107.96元。根据《公司法》《证券法》《金融企业财务规则》及公司章程等有关规定，分别提取10%的一般风险准备金、10%的交易风险准备金共计1,201,831,621.60元；计提永续次级债券利息1,276,500,000.00元；根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，按照公募基金托管费收入的2.5%提取一般风险准备金374,576.94元；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，按不低于大集合资产管理业务管理费收入的10%计提一般风险准备金13,796,561.39元。进行上述利润分配事项后，本年度实现可供投资者分配的利润为3,516,655,348.03元。

加上年初未分配利润24,083,194,642.51元，减去2023年度指定的非交易性权益工具处置转出未分配利润77,326,619.48元，减去公司2023年已实施的2022年度利润分配方案分配的股利2,595,355,931.79元，年末累计可供投资者分配的利润24,927,167,439.27元。根据相关规定，可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得向股东进行现金分配，年末累计可供分配利润中公允价值变动（税后）为205,813,722.34元，因此，公司2023年末可供投资者现金分红部分为24,721,353,716.93元。

从公司发展和股东利益等综合因素考虑，公司2023年度利润分配方案如下：以2023年末总股本9,612,429,377股为基数，向全体股东每10股派送现金红利2.70元（含税），共派送现金红利2,595,355,931.79元，尚未分配的利润22,331,811,507.48元转入下一年度。

十二、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

报告期内，公司无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

十三、报告期内的内部控制制度建设及实施情况

（一）内部控制建设及实施情况

报告期内，公司根据《公司法》《证券法》《企业内部控制基本规范》及其配套指引、《证券公司内部控制指引》《证券公司监督管理条例》等法律、法规及规章制度，持续推进内部控制制度和体系的建设和完善。公司内部控制体系建设与经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，内部控制制度建设工作能够合理保证涵盖业务开展的事前、事中、事后等过程，合理保证对重点领域、关键环节的设计健全、执行有效和适时改进。

公司董事会督促、检查和评价公司内部控制制度的建立与执行情况，对内部控制体系的有效性负责。公司监事会对董事会建立和实施内部控制情况进行监督。公司内部控制部门及业务管理部门按照有效制衡、协同配合的原则，对业务开展发挥监督、保障等作用。

公司根据上级单位有关进一步加强监督体系建设的指导意见，结合实际情况，积极开展机制建设及推进落实等工作，整合各监督主体的履职范围及专业优势，积极构建“六位一体”的大监督格局，为公司规范管理、有效决策、健康发展保驾护航。

公司建立以内控体系建设与监督制度为统领，各项具体操作规范为支撑的内控制度体系，并建立制度定期跟踪评估机制，持续评估管理制度的有效性和全面性，及时做好内控制度的废、改、立工作。

公司开展新业务时，依照法律法规和监管要求，全面评估风险，完善管理制度，优化操作流程，确保主要风险保持可控、可测、可承受。公司各项业务在合规运营的前提下持续、稳定、健康地发展。

公司每年开展内部控制有效性评价工作，对业务经营、组织管理相关的制度设计及其实际运行的有效性，以及对内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督相关的内控机制设计、运行情况是否完整、持续及适时等情况进行核查及认定。

报告期内，公司内部控制体系在完整性、合规性、有效性等方面不存在重大缺陷。

（二）报告期内发现的内部控制重大缺陷的具体情况

无。

十四、公司报告期内对子公司的管理控制情况

公司已建立完备的子公司管理制度体系，包括《国信证券股份有限公司子公司管理办法》《国信证券股份有限公司子公司合规管理工作指引》《国信证券股份有限公司子公司风险管理工作指引》《国信证券股份有限公司子公司财务管理办法》《国信证券股份有限公司内部审计制度》，将子公司管理纳入公司统一财务管理和内部审计体系以及统一合规管理和风险管理体系，从合规、风控、财务、审计等方面对子公司进行全面、有效管控。

报告期内，公司不存在新增子公司的情况。2023年11月，中国证监会核准公司设立国信证券资产管理有限公司从事证券资产管理业务。目前，公司正在积极推进资管子公司设立工作。

十五、内部控制评价报告或内部控制审计报告

（一）内控评价报告

| | |
|------------------------------|--|
| 内部控制评价报告全文披露日期 | 2024年4月17日 |
| 内部控制评价报告全文披露索引 | 详见2024年4月17日刊登于深交所网站(http://www.szse.cn)的《2023年度内部控制评价报告》 |
| 纳入评价范围单位资产总额占公司合并财务报表资产总额的比例 | 100% |
| 纳入评价范围单位营业收入占公司合并财务报表营业收入的比例 | 100% |

| 缺陷认定标准 | | |
|----------------|--|--|
| 类别 | 财务报告 | 非财务报告 |
| 定性标准 | <p>1. 重大缺陷</p> <p>A. 董事、监事和高级管理人员的舞弊行为；</p> <p>B. 注册会计师已发现，未被内部控制所识别的当期财务报告的严重错报；</p> <p>C. 对财务报告的内部监督为无效。</p> <p>2. 重要缺陷</p> <p>A. 没有依照公认会计准则选择和应用会计政策；</p> <p>B. 没有建立和执行反舞弊机制，导致或者未能及时发现关键岗位的舞弊行为；</p> <p>C. 对期末财务报告的内部控制存在缺陷，不能合理保证财务报表的真实、完整。</p> <p>3. 一般缺陷</p> <p>未构成重大缺陷、重要缺陷的其他控制缺陷。</p> | <p>1. 重大缺陷</p> <p>A. 业务经营和内部管理违反法律法规，并且造成严重后果；</p> <p>B. 中高层管理人员流失严重；</p> <p>C. 内部控制系统地严重失效；</p> <p>D. 重要的分公司、子公司缺乏内部控制建设，管理散乱；</p> <p>E. 在内部控制过程中发现的重大或者重要缺陷没有获得整改；</p> <p>F. 对信息披露的内部控制严重失效，导致被监管部门予以严重处罚。</p> <p>2. 重要缺陷</p> <p>A. 关键岗位或者关键技能人员流失严重；</p> <p>B. 主要业务存在严重的制度缺陷和执行偏差。</p> <p>3. 一般缺陷</p> <p>未构成重大缺陷、重要缺陷的其他控制缺陷</p> |
| 定量标准 | <p>1. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过税前利润的 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入的 2%），并且反映为严重偏离公司内部控制目标的，则为重大缺陷；</p> <p>2. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过税前利润的 3% 但小于 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入 1% 但小于 2%），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的，则为重要缺陷；</p> <p>3. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果小于税前利润的 3%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为小于营业收入的 1%），则为一般缺陷。</p> | <p>1. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过税前利润的 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入的 2%），并且反映为严重偏离公司内部控制目标的，则为重大缺陷；</p> <p>2. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过税前利润的 3% 但小于 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入 1% 但小于 2%），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的，则为重要缺陷；</p> <p>3. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果小于税前利润的 3%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为小于营业收入的 1%），则为一般缺陷。</p> |
| 财务报告重大缺陷数量（个） | 无 | |
| 非财务报告重大缺陷数量（个） | 无 | |
| 财务报告重要缺陷数量（个） | 无 | |
| 非财务报告重要缺陷数量（个） | 无 | |

（二）内部控制审计报告

内部控制审计报告中的审议意见段

国信证券于 2023 年 12 月 31 日按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

| | |
|----------------|--|
| 内控审计报告披露情况 | 披露 |
| 内部控制审计报告全文披露日期 | 2024 年 4 月 17 日 |
| 内部控制审计报告全文披露索引 | 详见 2024 年 4 月 17 日刊登于深交所网站 (http://www.szse.cn) 的内部控制审计报告 (天健审 [2024]7-356 号) |
| 内控审计报告意见类型 | 标准无保留意见 |
| 非财务报告是否存在重大缺陷 | 否 |

会计师事务所未出具非标准意见的内部控制审计报告，出具的内部控制审计报告与董事会的内部控制评价报告意见一致。

十六、动态风险控制指标监控和补足机制建立情况

（一）公司动态的风险控制指标监控机制建立情况

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常监控与分析，及时向监管部门报告风险指标变动及超预警、超标情况；按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等；将新开展业务及时纳入风控指标计算；对监控系统的有效性、准确性进行校对及维护。

（二）风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

公司每年于年初就未来一年业务状况对母公司和集团进行综合性的压力测试，考察风险控制指标承压情况。另外，为好事前业务规模风险控制，保证公司净资本和流动性风险控制指标任一时点均在安全标准之内，公司设定涵盖多项业务及投资决策的压力测试情景库，并根据风控指标和公司业务状况每半年更新一次。2023 年公司共开展了一次集团年度综合压力测试、一次母公司年度综合压力测试及数次专项压力测试。压力测试结果显示公司和集团各项风控指标在压力情景下处于安全范围内，整体风险可承受。

（三）资本补足机制

公司正积极按照制定的资本补足规划，有计划地推动公司各类债券发行，积极研究创新债务融资工具，丰富融资方式，以支持业务创新发展并确保净资本等各项风险控制指标持续符合监管要求。

（四）报告期内风险控制指标达标情况

2023 年，公司以净资本和流动性为核心的风险控制指标整体运行良好。报告期末，母公司净资产为 1,075.78 亿元，较上年末增加 31.94 亿元；净资本为 821.40 亿元，较上年末增加 27.06 亿元；各项风险资本准备之和为 282.55 亿元，较上年末增加 90.27 亿元。风险覆盖率为 290.71%，较上年末下降 122.41 个百分点；资本杠杆率为 13.55%，较上年末下降 2.42

个百分点；流动性覆盖率为 267.92%，较上年末上升 31.30 个百分点；净稳定资金率为 133.51%，较上年末下降 38.38 个百分点。公司各项风险控制指标均符合监管要求。

十七、风险管理情况

（一）全面风险管理概况

报告期内，公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》和《证券公司全面风险管理规范》等监管文件要求，不断提升风险管理工作的专业性，加大合规风控体系建设投入，持续完善全面风险管理工作。在风险计量方面，引入“经济资本”有效计量和评估公司总体风险水平。在限额管理方面，从业务层级精细到投资策略层级，建立规模、风险值、止损、压力测试限额、敏感性等多维度的限额体系。在内部评级方面，采取优化内部评级模型、负面清单管理和授信管理等措施，为公司和客户避免了投资损失。公司定期开展各项风险排查和专项检查，独立研判重大风险；推进风险管理系统建设、数据治理和信息技术风险管理；子公司风险垂直管理不断深入，持续完善并表管理内规制度体系，公司层面制定发布了《子公司风险管理工作指引》《子公司风险管理负责人管理办法》，并向各子公司派出风险管理负责人及监事等，整体达到并表监管各项要求。公司注重培育风险管理文化，不断加大风险管理人财物投入，持续扩大风险管理专业队伍。

1. 风险管理组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

（1）董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

（2）经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

（3）独立的风险管理机构

公司风险管理总部、合规管理总部、监察稽核总部等部门作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的全面风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，起草公司整体的风险偏好和容忍度方案，合理配置风险限额。对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行检查和考评。资金运营部、信息技术部门、党群办公室分别牵头开展流动性风险管理、信息技术风险管理、声誉风险管理工作。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。监察稽核总部通过事后

稽核审计等方式，对内部控制制度的完整性、合理性及其实施的有效性进行检查和评估。

(4) 业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

2. 风险管理机制

(1) 全方位的风险管理机制

为推动公司风险管理体系的有效运作，确保公司各项业务经营活动在合规运作及风险可测、可控、可承受的前提下开展，公司制定并实施了涵盖各项业务运营和管理的一整套规章制度，明确了风险管理的目标、原则、组织架构、授权体系、相关职责、基本程序等，并通过事前审核、事中监控、事后检查的一系列执行机制，实现了对公司各项业务的合法性、合规性、风险程度的全方位和系统化的监控、预警、报告和处理。

(2) 风险管理量化指标体系建设

公司自上而下建立了风险偏好、风险容忍度和风险限额的风险管理量化指标体系。公司董事会负责审批公司风险偏好和风险容忍度（含重大风险限额）。根据董事会确定的风险容忍度，公司建立覆盖“集团-部门及子公司-业务-投资策略”的多层次的风险限额体系，引导资源向收益风险比高的业务配置，有效提升公司风险管理水平和企业价值。

(3) 压力测试机制

根据《证券公司压力测试指引》，公司制订了《压力测试管理办法》和《压力测试情景库》，明确压力测试触发情景的定性定量标准、压力测试频率、压力测试方案确定、压力测试数据收集方法、压力测试结果分析与反馈、压力测试相关资料的保存与管理均进行了规范，通过建立常规化的压力测试机制有效评估压力情况下公司风险控制指标、各类型风险限额指标的状况。

(4) 专业人才

公司风险管理总部、各业务部门配备了熟悉证券业务与风险管理技能的专业人员，并提供相应的资源支持。积极引进风险管理高层次人才，不断提升团队专业化水平。

(5) 系统建设

公司十分重视风险管理系统建设，持续推进各类风险管理信息系统的开发和升级工作，建立并完善与业务复杂程度及风险指标体系相适应的风险管理信息系统，逐步实现对各类风险的准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。报告期内，公司深化全面风险管理工作平台、市场风险管理系统、信用风险管理系统、流动性风险管理系统、操作风险管理系统、“鑫智控”企业全景风控平台等的建设，稳步推进风险数据库建设以及风险数据治理，开展信息技术风险管理、业务连续性体系建设和交易运维管理等，提升了风险管理效率以及精细化水平。公司将继续加强风控系统和业务系统的数据对接，推进集团层面数据治理工作。

3. 风险管理指标体系

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常实时监控与分析，并按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等。

公司积极开展并表监管试点申报工作，建立并表口径下的风险控制指标管理体系，进一步提升集团公司层面风险管理能力。

（二）公司面临的风险因素及对策

1. 市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益投资业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，根据各业务的特点不断丰富限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和风险价值（VaR）限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母、集中度等限额并进行日常监控。另外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过 VaR 等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR 值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR 模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

2. 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

- （1）具有债权性质的债券等投资交易业务；
- （2）融资融券、约定购回和股票质押式回购等资本中介业务；
- （3）场外衍生品业务；
- （4）存放银行的活期存款及定期存款；
- （5）其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、舆情监控、信用风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务的主要信用风险为发行人违约导致损失的风险。公司通过建立内评系统并采用定性与定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、持续监控报告发行人资信状况、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理。

融资融券、股票质押式回购交易等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理，并适时进行逆周期调节；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 253.92%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 210.33%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 175.94%。

衍生品交易业务存在交易对手于约定日期未履行支付义务的信用风险。对此，公司对交易对手进行评级并授信；寻求资质好的担保方项目进行交易；利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等措施进行风险缓释；明确违约事件、提前终止事件的处理流程等措施。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中登公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

3. 操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格遵守监管要求，落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理流程相关风险；三是运用关键风险指标开展日常监控，及时预警、处置风险，并加强业务风险检查；四是持续完善风险事件收集机制，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是积极开展风险管理文化宣导，以案例分析、现场培训等多种形式组织公司各部门风险教育培训。

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。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司流动性风险管理组织架构包括董事会、经理层、资金运营部、风险管理总部、相关部门及子公司等，公司董事会承担流动性风险管理的最终责任，资金运营部是公司流动性风险管理的负责部门，统筹公司资金来源与融资管理。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：（1）积极拓展维护融资渠道，保障公司融资来源的多元化和稳定程度，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平。（2）加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。（3）持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。（4）持续优化现金流管理，动态计量未来不同时间段的现金流，提前做好应对安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。（5）适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施。（6）持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

（三）合规风控及信息技术投入情况

公司高度重视合规管理和风险控制，不断完善合规管理体系和制度建设，持续提升全面风险管理的能力与水平。2023年，公司合规风控投入为4.5亿元，主要包括合规风控人员薪酬、日常运营支出及相关系统建设投入等。

公司以“创新驱动、科技引领、打造世界一流投行信息技术”为战略愿景，持续发力金融科技，不断深化业务与技术融合发展，切实做好“数字金融”大文章。2023年，母公司信息技术投入为12.09亿元，同比增长17.95%，主要包括信息系统建设投入、信息技术日常支出及人员薪酬等。

十八、合规管理体系建设情况和稽核部门稽核情况

（一）合规管理体系建设情况

报告期内，公司以持续提高合规管理有效性为目标，进一步推动合规管控机制的完善，不断推进合规管理体系和制度建设。

为跟进落实监管规则，公司制定、修订了多项公司层面的合规内控管理制度，包括《国信证券股份有限公司合规守则》《国信证券股份有限公司合规审查与合规咨询规则》《国信证券股份有限公司业务部门合规管理人员工作指引》《国信证券股份有限公司合规管理人员考核实施细则》《国信证券股份有限公司各部门、分支机构及子公司合规性专项考核实施细则》《国信证券股份有限公司违规举报处理规则》《国信证券股份有限公司投资银行类业务合规检查规则》《国信证券股份有限公司场外衍生品业务合规管理办法》《国信证券股份有限公司从业人员执业行为管理办法》《国信证券股份有限公司证券交易行为管理办法》《国信证券股份有限公司投资者适当性管理办法》等制度。为进一步落实中国人民银行关于反洗钱的要求，公司修订完善了《国信证券股份有限公司客户尽职调查和洗钱风险分类管理办法》《国信证券股份有限公司大额和可疑交易报告管理办法》《国信证券股份有限公司反洗钱监控名单管理办法》等反洗钱内控制度。

报告期内，公司持续加强各业务合规管理工作，推动落实各项监管要求。公司积极贯彻落实经纪业务、两融业务、私募资管业务、债券发行业务、程序化交易报告及管理、全面实行股票发行注册制、廉洁从业等系列新规要求。对重点监管要求，

公司组织相关部门进行探讨与学习，并根据新规要求及时督促相关单位修订制度，梳理完善业务流程，进一步加强对相关业务条线的合规管理。

报告期内，公司高度重视子公司的合规管理工作，通过合规审查、合规咨询、合规检查、合规培训等措施，有效防范、控制子公司合规管理风险。

报告期内，公司为及时发现和化解风险，开展了多次合规检查，检查事项主要包括客户交易行为管理、反洗钱、适当性管理、员工执业行为、研究业务、投资银行类业务、托管业务、公募基金投顾业务、期货 IB 业务等。

报告期内，公司根据日常业务需要及合规风险预防重点，就《证券经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《证券经纪业务管理办法》《私募投资基金监督管理条例》等开展了法规解读培训，还围绕经纪业务、证券投资顾问业务、融资融券业务、投资银行类业务、研究业务、私募基金业务、员工执业行为、廉洁从业、反洗钱、适当性管理、客户交易行为管理、信息隔离墙管理等举行了多场合规培训。

（二）稽核审计部门的履职情况

公司稽核审计部门作为公司内控监督体系的主要组成部分，对公司财务收支、经济活动、内控合规、风险管理等情况实施独立、客观的检查监督并作出评价和建议，对发现的问题及时进行反映并提出整改意见，对整改落实情况进行跟踪及督导。

报告期内，公司稽核审计部门检查范围覆盖经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资产管理业务等公司主要业务，按照监管规定及公司要求，高质量实施例行审计、离任审计、离岗稽核、专项审计等项目，保持对公司部门、经纪业务分支机构、控股子公司的审计覆盖。

报告期内，公司稽核审计部门以风险控制为导向，以发现问题、推进整改为目标，加强对公司重要部门的监督，强化对重要岗位及关键人员在履职行为、职业操守、廉洁从业等方面的核查及评价，及时、全面地完成各项审计工作任务。

报告期内，公司稽核审计部门充分履行内部审计部门在公司治理方面的职责，持续推进公司内部控制体系建设。

报告期内，公司稽核审计部门严格遵循审计程序和质量标准，独立、客观地审查和评价业务经营及内部控制的真实性、合规性、有效性，推进公司完善制度及提升效率。

十九、董事会关于内部控制责任的声明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告是公司董事会的责任。公司监事会对董事会建立和实施内部控制情况进行监督。公司经营管理层负责组织、领导内部控制的日常运行。

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证内部控制评价报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并且对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司内部控制的目标是合理保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，

促进实现发展战略。由于内部控制存在的固有局限性，故仅能为实现上述目标提供合理保证。此外，由于情况的变化，可能导致内部控制变得不恰当，或者对控制政策和程序的遵循程度降低，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的风险。

二十、建立财务报告内部控制的依据

公司重视与财务报告相关内部控制制度的建设和完善，根据《会计法》《企业会计准则》及相关财务制度的要求，在业务核算、成本费用支出、财务管理、会计信息系统管理等方面建立了相应的管理制度，并且根据监管要求及时进行修订和完善。

公司采取了建立适当的财务会计组织架构、配备合格的财务会计专业人员、选用恰当的会计政策和合理的会计估计、使用安全的会计核算信息系统等控制措施，保证公司编制的财务报告符合会计准则的要求，能够真实、准确、完整地反映公司财务状况、经营成果等有关信息。

公司财务报告由公司法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名盖章，并且聘请会计师事务所出具独立审计报告。

公司根据财政部、中国证监会 2022 年 3 月 2 日颁布的《关于进一步提升上市公司财务报告内部控制有效性的通知》，结合内部控制缺陷的认定标准，将资金资产活动、收入、成本费用、投资活动、关联交易、重要风险业务和重大风险事件、财务报告编制等 7 个领域纳入财务报告内部控制有效性的评价范围，评价重点包括相关舞弊、错报风险及其控制情况。

报告期内，公司财务报告相关内部控制制度健全，运行情况良好。根据公司财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司不存在财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。

董事会认为，公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求，在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

二十一、上市公司治理专项行动自查问题整改情况

根据中国证监会《关于开展上市公司治理专项行动的公告》（证监会公告[2020]69号）的要求，公司对照上市公司治理专项自查清单，认真梳理查摆存在问题，于 2021 年完成了相关整改工作。详见《国信证券股份有限公司 2021 年年度报告》第四节“二十一、上市公司治理专项行动自查问题整改情况”。

05

第五节

环境和社会责任



一、重大环保问题

(一) 基本情况

公司及子公司为金融类企业，不属于环境保护部门公布的重点排污单位。报告期内，公司未因环境问题受到行政处罚。

(二) 报告期内，公司为减少碳排放所采取的措施及效果

国信证券将助力绿色产业发展、创新绿色金融产品和服务确定为战略目标，积极为相关政策规则制定建言献策，发挥研究业务专业优势开展相关产业研究，全方位、多途径满足各级政府及企业的绿色金融需求。详细情况请参见公司于 2024 年 4 月 17 日在深交所网站 (<http://www.szse.cn>) 披露的《2023 年度环境、社会和公司治理报告》。

1. 发挥金融专业作用，促进绿色经济发展

公司作为绿色金融服务的积极参与者，响应国家关于绿色转型的号召，立足金融行业本源，深入服务实体经济，助力国家战略实施，长期为环境治理、低碳环保等绿色、环保、节能型企业提供金融服务。积极销售绿色金融主题基金，2023 年将鹏华新能源汽车主题混合型证券投资基金等 56 只基金列入重点产品。2023 年完成绿色股权（含可转债）融资项目 6 个，募集资金超过 73.4 亿元，主要涉及环境治理、绿色建筑、光伏、燃气服务等行业，其中国泰环保为国内污泥处理服务行业首家上市公司，志特新材为绿色新型建筑铝模、防护平台细分领域龙头企业。大力开拓绿色债券业务，助力推动经济社会绿色转型、产业升级。

公司坚持责任投资与绿色投资，致力于将责任投资落实于业务中，在进行投资决策时遵循责任投资策略，关注具备 ESG 属性的资产，把握风电、光伏等可再生能源领域的投资机遇，紧跟国家政策方向，协同国信弘盛、国信资本等子公司，通过股权直投、专项基金投资、债权投资等方式，推动社会可持续发展。国信弘盛与上市公司鹏鹞环保合作创设总规模 4 亿元的“深圳市鹏鹞弘盛绿色产业私募股权投资基金合伙企业”，为公司旗下管理的首只绿色投资产业基金，重点投资环保产业数字化、氢能源、资源回收利用等绿色产业细分领域。国信资本聚焦我国双碳战略实施和新能源产业投资机会，稳步推进绿色投资主题研究，将 ESG 嵌入投资分析和决策过程，通过实施直投 + 基金投资的多样化投资策略，在新能源汽车、太阳能晶硅电池及组件、ITO 靶材等绿色产业完成多个项目投资，形成新能源汽车全产业链投资版图，助力新能源产业高质量发展。

此外，公司亦围绕负责任投资、ESG 主题策略、绿色金融等主题，积极为相关政策规则制定建言献策，发挥研究业务专业优势开展相关产业研究，全方位、多途径满足各级政府及企业的绿色金融需求。

2. 树立绿色经营理念，践行低碳节能环保

国信证券将绿色经营作为目标，积极打造绿色办公环境，提升智能化办公水平，倡导节能减排，做好公司办公场所的治污保洁工作，鼓励员工绿色出行，组织绿色公益行动等，积极创建绿色低碳金融机构。

倡导绿色办公，推进低碳运营。公司积极倡导绿色环保理念，将绿色环保意识贯穿到公司日常经营管理中，持续优化内部资源管控措施。深圳国信金融大厦均使用 LED 照明灯具且实现智能控制，合理布局照明光源，节约用电能耗。大厦的空调系统采用冰蓄冷节能设计，充分利用夜间电网低谷电能进行制冰，白天在用电高峰期融冰放冷，调荷避峰；空调末端

采用 VAV 变风量系统并设计计费系统，根据现场人员需求自动有偿供冷，实现高效节能。大厦各楼层公共区域减少灯光开启数量及时间，科学管控电梯运行模式，最大程度节约能源；公共茶室、洗手间、车库水阀等均安装新型节水器，有效避免浪费，实现节约用水。

推进数字化运营，践行节能环保。公司积极推广数字化办公，倡导使用高清视频会议系统、线上培训系统，优化会议和培训管理模式，在提升工作效率的同时，降低运营过程中的能源消耗。公司积极推行无纸化办公，提倡使用电子签名以减少打印，持续推进会计凭证无纸化建设；在服务客户流程中，为投资者开立账户提供无纸化业务，打造绿色高效服务。

二、社会责任情况

作为一家上市证券公司，国信证券主动承担金融企业与上市公司的双重社会责任，秉承“合规自律、专业务实、诚信稳健、和谐担当”的文化理念和“创造价值、成就你我、服务社会”的价值观念，在经济、社会、环境等各方面积极履行企业社会责任。

详细情况请参见公司于 2024 年 4 月 17 日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）披露的《2023 年度环境、社会和公司治理报告》。

三、持续推进乡村振兴，助力实现共同富裕

党的二十大报告指出：“必须坚持在发展中保障和改善民生，鼓励共同奋斗创造美好生活，不断实现人民对美好生活的向往。”公司切实提高政治站位，全面贯彻习近平总书记重要讲话精神，坚决落实党和政府及监管部门工作要求，有效地发挥行业特色优势和公司专业优势。2023 年，秉持“专业协作，多点推进，平衡发展，构建和谐”的社会责任理念，公司围绕全面推进乡村振兴重点工作，按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路制定精准帮扶规划，通过聚焦金融帮扶、产业帮扶、教育帮扶、民生帮扶、文化帮扶、消费帮扶、生态帮扶七大帮扶“组合拳”，同时兼顾公益捐助，倡导员工积极参与，推动构建具有金融特色的“7+1+1”公益模式，切实做好公益帮扶工作，为巩固拓展脱贫攻坚成果，全面推进乡村振兴新发展作出积极贡献。

（一）持续响应帮扶号召，推进结对帮扶地区乡村振兴

2023 年，公司严格按照党和政府及监管部门的部署要求，持续组织开展 8 县 1 镇 1 村结对帮扶工作。其中，重点协助新疆麦盖提县、新疆塔什库尔干县、新疆英吉沙县、贵州三都水族自治县、内蒙古兴和县及汕尾市海丰县大湖镇等地区开展脱贫攻坚与乡村振兴衔接工作，明确帮扶重点和帮扶措施，致力于实施更具实效性、延续性、成长性的帮扶项目。同时，公司持续选派 1 名第一书记、2 名工作队员到汕尾市海丰县大湖镇开展驻镇帮镇扶村工作，推进与深汕合作区赤石镇明热村党支部结对帮扶。

（二）发挥公司专业优势，创新实施金融帮扶

公司充分利用投行业务优势，发挥资本市场中介机构职能，以产业帮扶为主导，通过加强对帮扶地区重点企业的辅导，继续培育和发展当地特色产业，借助资本市场支持当地产业升级和经济结构转型。2023 年，公司完成帮扶地区江西省广昌

县的江西志特新材料股份有限公司可转债项目再融资项目 1 个，融资金额 6.14 亿元。

子公司国信期货充分利用期货行业风险管理专长，分散农业生产者的价格风险，稳定基本收益，实现产业精准帮扶。2023 年，累计在河北、广东、黑龙江、云南、海南等地开展 31 个“保险+期货”项目，名义本金超 6.9 亿元，赔付金额 896.89 万元。同时，为进一步增强“保险+期货”专业能力，子公司国信期货继续加强与西南财经大学大数据研究院战略合作关系，依托各自优势资源，从产研平台搭建、联合项目研究、人才培育及学术交流四个方面，共同推动“保险+期货”项目开展，全面推进产教深度融合，实现多元共赢，2023 年度共同完成全国金融科技发展奖项目“大宗商品智能管理系统”并荣获全国三等奖，该奖项是中国人民银行和中国证监会唯一共同颁发的金融科技类部级奖项。在金融扶智方面，国信期货采用“线上+线下”方式在安徽、云南、河南等地开展 30 场“期货市场服务三农”专题培训，累计培训农户 300 人次，助力当地农户利用期货工具增强防御市场风险的能力。

（三）多元模式开展公益帮扶，助力实现共同富裕

2023 年，公司继续按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路开展公益帮扶工作，共计投入 2,103.25 万元帮扶资金开展 51 项公益帮扶项目，其中对外捐赠资金及物资 1,243.02 万元，推进完成消费帮扶 860.23 万元，项目内容涵盖产业扶持、教育发展、民生建设、文化推广、智力帮扶、消费认购、绿色生态等 7 个领域，有力支持了帮扶地区巩固脱贫攻坚成果，推进乡村振兴战略实施，持续在经济、社会、环境等各方面履行企业社会责任，积极助力实现共同富裕。

1. 深耕教育帮扶，助推帮扶地区教育事业

公司一贯重视教育帮扶工作，积极发挥教育帮扶在巩固脱贫攻坚成果，接续推进乡村振兴工作中的重要作用。2023 年，公司继续推进员工志愿者支教项目的落地实施，通过内部自愿报名选拔的方式，派出第十批共 6 名员工志愿者赴新疆麦盖提县开展支教活动。截至 2023 年末，已累计派出 10 批共 59 名员工志愿者，持续加强教育帮扶力度，以先进的教育理念和扎实的业务知识，推动提高当地国家通用语言教学水平，提升教学质量，进一步促进民族团结进步和交流交往交融。

此外，公司连续 7 年支持贵州三都县水根村“春晖助学基金”资助项目，积极助力当地奖优助学，提升教育发展动力。在继续推进汕尾市海丰县大湖镇驻镇帮扶工作的同时，捐赠 104.97 万元用于大湖镇实验学校运动场及幼儿园改造提升项目，向广东省教育基金会、贵州省三都县三洞中学捐赠绿色爱心电脑折合人民币 2.88 万元，向三都县鹏城希望学校捐赠 2,200 册爱心图书等，积极改善各地学校办学条件，助力学生健康成长。

2. 深化产业帮扶，促进帮扶地区发展增收

公司积极投入资金助力帮扶地区农副产品规模化、产业化经营，通过开展产业帮扶，促进各帮扶地区发展增收。2023 年，公司向陕西省延长县，河南省桐柏县，云南省西盟佤族自治县、福贡县，新疆麦盖提县、塔什库尔干县及内蒙古兴和县捐赠产业帮扶资金共计 382 万元，进一步加大对当地苹果产业、肉牛养殖、有机蔬菜育苗基地建设、灰枣种植、特色旅游等产业的精准帮扶力度，助力当地巩固产业振兴成效，助推集体经济发展，促进农户稳定增收。

3. 推进消费帮扶，拓宽帮扶地区特色产品销售

公司结合脱贫地区资源优势及员工需求，通过从脱贫地区采购特色农产品积极助力脱贫地区特色产业发展。2023 年公司共计采购脱贫地区特色产品 860.23 万元，以消费帮扶方式，积极助力四川甘孜、南充、阿坝，青海西宁，甘肃平凉，宁

夏吴忠，广西河池、百色，贵州毕节、黔东南、六盘水，云南丽江，江西赣州，吉林延边，黑龙江大庆，内蒙古兴和县等 19 省 32 地的特色产品销售。

4. 提振文化帮扶，支持帮扶地区发挥文化建设效能

公司围绕帮扶地区文化建设，支持开展传承和发展优秀传统文化活动，积极参与乡村公共文化设施建设、党建文化建设。2023 年，公司共计捐赠 161.5 万元，用于帮扶新疆英吉沙县建设党建文化多媒体展示系统、乔勒潘乡尤喀克吾斯塘村文化振兴建设项目，支持塔什库尔干县大同乡千年核桃王旅游景点开发及贵州三都县九阡镇水各村文化体育活动中心建设，通过改善当地文化设施基础建设，进一步支持当地文化振兴发展。

5. 开展民生帮扶，改善帮扶地区生产生活水平

2023 年，公司共计投入资金 396.38 万元，用于支持脑瘫儿童救助公益项目，助力推进新疆英吉沙县残疾人无障碍文化健身中心建设、塔什库尔干县提孜那甫乡提孜那甫村太阳能路灯购置、贵州三都县中和镇地孟村把柄组产业路扩建和县人民医院新院办公物资购置，支持内蒙古兴和县农村互助幸福院维修和县医院医疗器械物资购置，改造提升广东汕尾市海丰县大湖镇新德村村前池塘，向大湖镇新德村原精准扶贫户和五保边缘户捐赠防寒物资等，积极为各类民生事业发展添砖加瓦，进一步助力改善当地人民生活水平。

6. 助力生态建设，共建绿水青山美好家园

2023 年，公司投入资金 100 万元，在新疆麦盖提县认养 1 万亩生态林，资助麦盖提百万亩防风固沙生态林建设项目，帮扶麦盖提县在塔克拉玛干沙漠边缘构建一道绿色屏障、再造一片绿洲，打造宜人、宜居、宜业的发展环境，以实际行动助力生态环境治理改善，支持国家实现“碳达峰”“碳中和”发展目标。

其他公益捐赠方面，2023 年，公司还响应各类帮扶号召捐赠资金 76.30 万元，积极助力各地公益事业发展。

（四）公益帮扶情况表

单位：万元

| 指标 | 数量 / 开展情况 |
|------------------------|------------|
| 一、总体情况 | 2,103.25 |
| 其中：1. 资金 | 2,069.84 |
| 2. 物资折款 | 33.41 |
| 二、分项投入 | |
| 1. 产业发展帮扶 | |
| 其中：1.1 产业发展帮扶项目类型（注 1） | 农林牧等产业帮扶项目 |
| 1.2 产业发展帮扶项目个数 | 7 |
| 1.3 产业发展帮扶项目投入金额 | 382 |

| 指标 | 数量 / 开展情况 |
|--------------------------|--------------|
| 2. 教育帮扶 | |
| 其中：2.1 奖励优秀学生、资助困难学生投入金额 | 10 |
| 2.2 改善帮扶地区教育资源投入金额 | 116.84 |
| 3. 消费帮扶 | |
| 其中：3.1 项目类型（注 2） | 认购农副产品 |
| 3.2 投入金额 | 860.23 |
| 4. 其他项目 | |
| 其中：5.1 项目类型（注 3） | 文化、民生及其他公益项目 |
| 5.2 投入金额 | 734.18 |

三、所获奖项

公司获得中共广东省委平安广东建设领导小组办公室、广东省见义勇为基金会颁发“广东省见义勇为爱心企业”奖项；获得深圳市关爱行动组委会办公室颁发的深圳关爱行动“十佳爱心企业”奖项；公司入选中国上市公司协会 2023 年上市公司 ESG 最佳实践案例和优秀实践案例；公司获得深圳市绿色金融协会“可持续信息披露最佳实践奖”等。

注 1：公司开展的产业帮扶项目为陕西省延长县创建达标美丽果园项目、河南省桐柏县埠江镇付楼村有机蔬菜育苗基地建设项目、云南省西盟佤族自治县肉牛养殖基地建设项目、云南省福贡县蔬菜大棚种植项目、内蒙古兴和县草原露营地建设项目、新疆中国气候好产品 - 麦盖提灰枣气象馆项目、新疆塔什库尔干县达布达尔乡达布达尔村畜牧发展基础设施项目。

注 2：公司开展的消费帮扶项目主要包括认购公司结对帮扶的新疆麦盖提县、内蒙古兴和县、广东省汕尾市海丰县大湖镇农副产品，认购深圳市对口帮扶地区广西河池、百色，广东河源特色农副产品及采购其他脱贫地区的农副产品。

注 3：公司开展的文化、民生及其他公益项目主要包括改善乡村基础设施建设，开展文化活动场所修缮，救助特殊儿童，关心关爱基层困难群众等公益项目。

（五）后续计划

作为资本市场的建设者和国民经济发展的参与者、推动者，2024 年，国信证券将以党的二十大精神为指引，牢记国之大者，继续按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路开展公益帮扶工作，立足行业专长，聚焦七大帮扶领域，兼顾公益捐助，倡导员工参与，持续深耕具有国信特色的“7+1+1”公益模式，探索形成可持续公益生态系统，不断增强帮扶地区自我发展能力，助力实现农业农村现代化和共同富裕，积极服务经济社会高质量发展，在新的征程上更好地履行社会责任。

06

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履行完毕及截至报告期末尚未履行完毕的承诺事项

| 承诺事由 | 承诺方 | 承诺类型 | 承诺内容 | 承诺时间 | 承诺期限 | 履行情况 |
|--------------------|-----|-----------------------|--|------------|------|------|
| 股改承诺 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 收购报告书或权益变动报告书中所作承诺 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 资产重组时所作承诺 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| | | 避免同业竞争的承诺 (首次公开发行) | 作为公司控股股东，深投控已向公司出具《避免同业竞争及利益冲突的承诺及约束措施》，承诺：1. 不在中国境内或境外，直接或间接从事与公司相同或相似并构成竞争关系的业务，亦不会直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权；2. 保证国信证券在资产、业务、财务、人员、机构等方面的独立性，并保证不会利用股东地位促使国信证券股东大会、董事会、监事会、管理层等机构或人员做出损害国信证券及其他股东合法权益的决定或行为；3. 保证不会发生显失公平的关联交易或者通过关联交易损害国信证券及其他股东的合法权益；4. 深投控将促使深投控控制的其他企业按照与深投控同样的标准遵守以上承诺事项。 | 2014年4月15日 | 长期 | 严格履行 |
| 首次公开发行或再融资时所作承诺 | 深投控 | 股份限售的承诺 (首次公开发行) | 如深投控在锁定期满后的两年内减持所持有的国信证券首次公开发行A股股票前已发行股份的，则减持价格不低于发行价，且每年的减持股份数量不超过深投控持有的国信证券首次公开发行A股股票前已发行股份数量的5%。自国信证券上市之日起至深投控减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的，则深投控减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。在锁定期满两年后，如深投控因各种原因需要减持所持有的国信证券首次公开发行A股股票前已发行股份，深投控将严格遵守中国法律法规关于控股股东持股及股份变动的有关规定，规范诚信履行控股股东的义务，并在确定减持时间、方式和价格时充分考虑国信证券股价稳定和中小投资者合法权益。如深投控减持国信证券A股股票的，深投控将在减持前4个交易日通知国信证券，并在减持前3个交易日公告。 | 2014年4月16日 | 长期 | 严格履行 |

| 承诺事由 | 承诺方 | 承诺类型 | 承诺内容 | 承诺时间 | 承诺期限 | 履行情况 |
|------|------|------------------------------|---|------------------|-------|------|
| | | 其他承诺 (首次公开发行) | <p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的，深投控将依法购回已转让的原限售股份。深投控将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效之日起 10 个工作日内制定购回已转让的原限售股份的具体方案，并在该方案取得有权机构批准（如需要）后依法实施。深投控购回已转让的原限售股份的价格按照市场情况确定，但每股购回价格将不低于国信证券首次公开发行股票时的发行价并加算同期银行活期存款利息（若需购回的股票有派息、送股、资本公积金转增股本等除权、除息事项的，购回的股份将包括已转让的原限售股份及其派生股份，发行价格将相应进行除权、除息调整）。如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并致使投资者在证券交易中遭受损失的，深投控将依法赔偿投资者损失。深投控将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效后，本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则，按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的或者致使投资者在证券交易中遭受损失的，并因此触发国信证券回购首次公开发行的全部新股的义务、责任的，或者触发国信证券实际控制人、董事、监事和高级管理人员的赔偿义务、责任的，深投控保证在国信证券股东大会上与上述回购、赔偿有关的议案投赞成票，并将依法督促国信证券及其实际控制人、董事、监事和高级管理人员履行其相关义务和承担相关责任。</p> | 2014 年 12 月 17 日 | 长期 | 严格履行 |
| | 深投控 | 切实履行填补即期 回报措施的承诺 (再融资) | 深投控承诺不越权干预公司的经营管理活动，不侵占公司利益。 | 2018 年 11 月 27 日 | 长期 | 严格履行 |
| | | 股份锁定的承诺 (再融资) | 承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日（2020 年 8 月 14 日）起 60 个月内不进行转让。 | 2020 年 7 月 24 日 | 60 个月 | 严格履行 |
| | | 规范关联交易的承诺 (首次公开发行) | <p>作为公司第二大股东，华润信托已向公司出具了《关于规范关联交易的承诺函》，承诺：1. 不利用股东地位及与公司之间的关联关系损害公司和其他股东的利益；2. 在与公司发生关联交易时，将按照公平合理和正常的商业交易条件进行，将不会要求或接受公司给予比在任何一项市场公平交易中第三者更优惠的条件；3. 将严格和善意地履行与公司签订的各种关联交易协议，不会向公司谋求任何超出上述规定以外的利益或收益。</p> | 2014 年 7 月 22 日 | 长期 | 严格履行 |
| | 华润信托 | 股份限售的承诺 (首次公开发行) | <p>如华润信托在锁定期满后两年后需要减持的，可以任意价格自由减持任何数量的股份。华润信托将在减持前 4 个交易日通知国信证券，并在减持前 3 个交易日公告。自国信证券上市之日起至华润信托减持期间如华润信托有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的，则华润信托减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。</p> | 2014 年 4 月 16 日 | 长期 | 严格履行 |
| | | 股份锁定的承诺 (再融资) | 承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日（2020 年 8 月 14 日）起 36 个月内不进行转让。 | 2020 年 7 月 24 日 | 36 个月 | 已完成 |

| 承诺事由 | 承诺方 | 承诺类型 | 承诺内容 | 承诺时间 | 承诺期限 | 履行情况 |
|------|-----------------------------------|---------------------|---|------------|------|------|
| | 云南合和 | 股份限售的承诺 (首次公开发行) | 如云南合和在锁定期满两年后需要减持的,可以任意价格自由减持。云南合和将在减持前4个交易日通知国信证券,并在减持前3个交易日公告。自国信证券上市之日起至云南合和减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的,则云南合和减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。 | 2014年4月16日 | 长期 | 严格履行 |
| | | 股份锁定的承诺 (再融资) | 承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日(2020年8月14日)起36个月内不进行转让。 | 2020年7月23日 | 36个月 | 已完成 |
| | 一汽投资 | 股份限售的承诺 (首次公开发行) | 如在锁定期满两年后需要减持的,可以任意价格自由减持。一汽投资将在减持前4个交易日通知国信证券,并在减持前3个交易日公告。自国信证券上市之日起至一汽投资减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的,则一汽投资减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。 | 2014年4月24日 | 长期 | 严格履行 |
| | 国信证券 及董事、 监事、高 级管理人 员 | 其他承诺 | <p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定,国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的,国信证券将依法回购首次公开发行的全部新股。国信证券将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效之日起10个工作日内制订回购全部新股的方案,并按照有关法律法规和国信证券章程的规定提交董事会审议,董事会审议通过后及时提交股东大会审议。国信证券回购股份的价格按照市场情况确定,但每股回购价格将不低于首次公开发行股票时的发行价并加算同期银行活期存款利息之和(若国信证券在首次公开发行股票后有派息、送股、资本公积金转增股本等除权、除息事项的,则回购的股份将包括首次公开发行的全部新股及其派生股份,发行价格将相应进行除权、除息调整)。国信证券将按照届时有效的法律法规及股东大会决议实施回购方案。如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定,国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并致使投资者在证券交易中遭受损失的,国信证券将依法赔偿投资者损失。国信证券将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效后,本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则,按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。</p> <p>国信证券全体董事、监事和高级管理人员对首次公开发行股票的招股说明书作出如下声明和承诺:</p> <p>“本人确认发行人首次公开发行股票的招股说明书不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。</p> <p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定,发行人首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并致使投资者在证券交易中遭受损失的,本人将依法赔偿投资者损失。本人将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效后,本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则,按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。”</p> | 2014年4月16日 | 长期 | 严格履行 |

| 承诺事由 | 承诺方 | 承诺类型 | 承诺内容 | 承诺时间 | 承诺期限 | 履行情况 |
|---------------------------------------|-----------------------------|------------------------------|---|-------------|------|------|
| | 国信证券 全体董 事、高级 管理人员 | 切实履行填补即期 回报措施的承诺 (再融资) | 公司全体董事、高级管理人员承诺： “1、本人承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益； 2、本人承诺对个人的职务消费行为进行约束； 3、本人承诺不动用公司资产从事与履行职责无关的投资、消费活动； 4、本人承诺由董事会或薪酬委员会制订的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 5、若公司后续推出股权激励计划，本人承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 6、自本承诺出具日至公司非公开发行股票实施完毕前，若中国证监会作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足中国证监会该等规定时，本人承诺届时将按照中国证监会的最新规定出具补充承诺。” | 2018年11月26日 | 长期 | 严格履行 |
| 股权激励承诺 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 其他对公司中小股东所作承诺 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 承诺是否按时履行 | 是 | | | | | |
| 如承诺超期未履行完毕的，应当详细说明未完成履行的具体原因及下一步的工作计划 | 不适用 | | | | | |

(二) 公司资产或项目存在盈利预测，且报告期仍处在盈利预测期间，公司就资产或项目达到原盈利预测及其原因做出说明

不适用。

二、控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

报告期内，不存在控股股东及其关联方非经营性占用公司资金的情形。

三、违规对外担保情况

报告期内，公司不存在违规对外担保情况。

四、董事会对最近一期“非标准审计报告”相关情况的说明

不适用。

五、董事会、监事会、独立董事对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

不适用。

六、与上年度财务报告相比，会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的情况说明

报告期内，公司无重大会计差错更正的情况。因企业会计准则变化引起的会计政策变更如下：

公司自 2023 年 1 月 1 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 16 号》“关于单项交易产生的资产和负债相关的递延所得税不适用初始确认豁免的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无重大影响。

七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明

（一）合并范围变化情况

报告期内，公司未新增或处置子公司。

（二）纳入合并范围的结构化主体变动情况

公司纳入合并范围的结构化主体主要包括公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。公司综合评估公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使公司面临可变回报的影响重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。公司 2023 年度新增 37 个结构化主体纳入合并报表范围，10 个结构化主体清算或持有份额比例下降丧失控制权不再纳入合并报表范围。

八、聘任、解聘会计师事务所情况

（一）现聘任的会计师事务所情况

| | |
|------------------------|------------------|
| 境内会计师事务所名称 | 天健会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 境内会计师事务所报酬（注） | 170 万元 |
| 境内会计师事务所审计服务的连续年限 | 5 年 |
| 境内会计师事务所注册会计师姓名 | 燕玉嵩、黄燕 |
| 境内会计师事务所注册会计师审计服务的连续年限 | 燕玉嵩 3 年、黄燕 5 年 |

注：为公司年度审计费用，未包括子公司的相关费用。

（二）聘请内部控制审计会计师事务所、财务顾问或保荐人情况

公司聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司 2023 年度内部控制审计会计师事务所，审计费用为人民币 40 万元。

九、年度报告披露后面临退市情况

不适用。

十、公司破产重整，兼并、分立以及子公司、分公司、营业部新设和处置等重大情况

（一）破产重整相关事项

不适用。

（二）公司兼并或分立情况

不适用。

（三）子公司、分公司、营业部新设和处置情况

截至报告期末，公司共设有 4 家全资子公司，相关情况具体请参见第三节“十一、主要控股参股公司分析”；公司于 2023 年 11 月获批设立资产管理子公司，相关情况请参见第六节“十七、公司子公司重大事项”。公司共设有 57 家分公司，181 家证券营业部，分布于全国 117 个城市和地区。相关变化情况具体请参见第六节“十六、其他重大事项的说明”。

（四）重大的资产处置、收购、置换、剥离情况

不适用。

（五）重组其他公司情况

不适用。

十一、重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司未发生涉案金额占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上且绝对金额超过 1,000 万元的重大诉讼、仲裁事项。公司过去十二个月内发生的诉讼、仲裁事项累计涉案金额未超过最近一期经审计净资产绝对值 10%。

报告期内，公司新增（涉案金额超过人民币 1 亿元）或前期已披露且有新进展的与公司经营业务相关的诉讼、仲裁事项，具体如下：

1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2018 年 10 月起，成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称“华泽钴镍”）部分投资者分别向成都市中级人民法院（以下简称“成都中院”）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。成都中院于 2019 年 8 月 1 日起一审开庭审理，公司于 2020 年 1 月起收到部分案件一审判决后提起上诉。四川省高级人民法院（以下简称“四川高院”）于 2020 年 7 月 7 日对 3 起示范案件二审开庭审理，公司于 2021 年 4 月收到四川高院对 3 起示范案件的二审判决，二审对揭露日等相关认定作出改判，其中，1 起案件判决公司等对华泽钴镍赔付义务 0.33 万元承担连带赔偿责任，2 起案件判决驳回原告诉讼请求。2021 年 12 月 27 日，公司收到最高人民法院驳回 3 名原告再申请的裁定。依照终审判决的标准，成都中院、四川高院陆续作出 1,737 起生效判决，要求华泽钴镍相关人员、公司等中介机构对华泽钴镍赔付义务合计 12,838.46 万元及相关诉讼费承担连带赔偿责任；公司另收到部分案件撤诉裁定。目前有 4 起案件尚未结案。2022 年 3 月起，公司收到成都中院及其指定法院对相关案件的执行通知，公司目前已支付合计 13,419.34 万元。

2. 公司与刘某等 2 人基金合同纠纷案

2018 年 6 月，委托人刘某等 2 人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称“天和盈泰”）、基金托管人国信证券签订了《天和盈泰山一号私募投资基金合同》，刘某等 2 人出资认购了该基金份额。2019 年 12 月，刘某等 2 人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计 2,204 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于 2023 年 7 月 25 日重新开庭，截至目前尚未裁决。

3. 公司与新疆嘉酿投资有限公司融资融券纠纷案

2018 年公司作为新疆嘉酿投资有限公司（以下简称“新疆嘉酿”）承做融资融券业务。由于新疆嘉酿信用账户维持担保

比例跌破并长期低于平仓线，构成违约。公司于2020年9月16日向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求新疆嘉酿偿还本金、利息、违约金合计人民币14,582万元。案件已于2021年8月4日开庭，公司于2021年12月收到胜诉判决。债务人随后向广东省高级人民法院上诉，目前案件正处于二审阶段。

4. 公司与邹平市供电公司保证合同纠纷案

公司以“邹平电力购售电合同债权资产支持专项计划”管理人的名义在深圳市中级人民法院立案起诉邹平市供电公司（以下简称“邹平供电”），请求法院确认专项计划中《担保函》合法有效，邹平供电向公司支付16.42亿元。法院于2021年6月、8月两次组织开庭审理。2022年1月6日，公司收到深圳市中级人民法院送达的（2020）粤03民初4632号民事判决书，判决被告邹平供电于判决生效之日起十五日内支付款项7.05亿元。2022年1月17日，公司收到被告邹平供电上诉状。目前该案仍在广东省高级人民法院二审审理中。

5. 亿阳信通投资者与亿阳信通及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年1月起，亿阳信通股份有限公司（以下简称“亿阳信通”）部分投资者分别向北京金融法院、哈尔滨市中级人民法院对亿阳信通及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求亿阳信通赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求亿阳信通相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至本报告披露日，公司共收到案件186起，涉诉金额合计4,910.63万元。目前案件尚未一审开庭。

6. 柏堡龙投资者与柏堡龙及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年6月起，广东柏堡龙股份有限公司（以下简称“柏堡龙”）部分投资者分别向广州市中级人民法院对柏堡龙及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求柏堡龙赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求柏堡龙相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至本报告披露日，公司共收到案件642起，涉诉金额合计23,532.49万元。2023年3月21日，广州中院对部分案件开庭审理。2023年4月21日起，公司收到广州中院对501起案件的一审判决，均认定公司不承担责任。2023年11月14日，广东省高级人民法院对4起案件进行二审开庭审理，目前尚未作出二审判决。

7. 公司与万某等8人、浙江新三板资产管理有限公司基金合同纠纷案

2017年2月，公司为“方际六号并购私募股权投资基金”提供托管服务。2022年10月，公司收到深圳国际仲裁院案件材料，该产品8名投资人为案件申请人，被申请人分别为基金管理人浙江新三板资产管理有限公司及基金托管人国信证券。申请人认为基金未按约定投资并因基金管理人挪用而实际损失，基金托管人未履行托管人职责，申请仲裁，请求浙江新三板资产管理有限公司及国信证券连带赔偿各项损失1,375.02万元。2024年3月29日，深圳国际仲裁院就系列作出裁决书，裁决基金管理人赔偿投资人投资损失共计1,090万元并承担案件仲裁费，驳回投资人其他仲裁请求。

8. 国信弘盛与王某西股权回购纠纷案

国信弘盛于2010年10月通过直接股权投资的方式，投资河北联冠智能环保设备股份有限公司（曾用名：河北联冠电极股份有限公司），并与王某西签署《关于河北联冠电极股份有限公司业绩承诺及投资补偿合同》及相关《补充协议》（以

下统称《股权回购协议》)。在上述《股权回购协议》约定的股份回购条件成就后,王某西未能依约进行回购。国信弘盛向贸仲委申请仲裁,请求被申请人王某西支付股份回购款、逾期付款违约金及律师费等合计10,828.11万元。2023年8月14日,贸仲委出具仲裁裁决书,支持国信弘盛仲裁请求。2023年10月9日,衡水市中级人民法院立案受理国信弘盛的强制执行申请。目前案件处于强制执行阶段。

9. 国信弘盛与中山广银基金合同纠纷案

中山广银投资有限公司(以下简称“中山广银”)系国信弘盛旗下弘盛基金有限合伙人,在基金后续运作过程中,中山广银与国信弘盛及相关方因基金投资收益分配等事项产生纠纷。2023年5月5日,中山广银向深圳国际仲裁院申请仲裁,要求弘盛基金向其支付相关投资收益、弘盛基金GP及管理人向其支付违约金等,合计申请金额2,250.26万元。2023年7月31日,国信弘盛收到深圳国际仲裁院的仲裁通知。后经多方协商,中山广银与国信弘盛相关方达成和解,并于2023年12月28日签署《和解协议》。2024年1月8日、9日,国信弘盛、中山广银分别申请撤案。2024年1月11日,深圳国际仲裁院出具《撤案决定书》,裁定撤销本案。

10. 公司与侯某股票质押式回购合同纠纷案

2017年8月,公司与侯某开展股票质押式回购交易业务,向其融出资金2.6亿元人民币,侯某将其持有的贝瑞基因(证券代码:000710.sz)股票质押给公司。后因侯某未按约定履行回购股票的义务,且拖欠公司的融资本金8,954万元及违约金,公司于2023年10月19日向深圳国际仲裁院申请仲裁维权。经审理,仲裁院于2024年1月31日作出裁决:1.侯某向公司偿还融资本金人民币8,954万元及违约金;2.案件仲裁费用由侯某承担;3.侯某以其出质登记的贝瑞基因股票对上述裁决下的给付义务承担质押担保责任,公司有权申请进行拍卖或变卖,并就所得款项优先受偿。鉴于侯某未按裁决的内容履行还款义务,公司于2024年2月21日向成渝金融法院申请强制执行。

11. 公司与高某股票质押式回购合同纠纷

2017年8月,公司与高某开展股票质押式回购交易业务,向其融出资金4.1亿元人民币,高某将其持有的贝瑞基因(证券代码:000710.sz)股票质押给公司。后因高某未按约定履行回购股票的义务,尚拖欠公司融资本金1.33亿元及违约金,公司于2023年12月7日将之诉至深圳国际仲裁院。在仲裁院审理期间,高某向深圳市中级人民法院提起了确认仲裁协议效力的申请,原仲裁程序已中止审理。

十二、处罚及整改情况

1. 2023年8月14日,浙江证监局出具《关于对国信证券股份有限公司嵊州兴盛街证券营业部采取出具警示函措施的决定》([2023]93号),公司嵊州兴盛街证券营业部存在以下问题:一是存在员工委托他人从事客户招揽活动的行为,营业部对员工客户招揽活动管理不到位,未能严格规范工作人员执业行为;二是营业部在与银行合作营销过程中,未能全面防范合规风险,营业部合规管理、廉洁从业管理不到位。浙江证监局决定对公司嵊州兴盛街证券营业部采取出具警示函的监督管理措施。

整改情况:针对以上问题,公司高度重视、积极部署,要求相关分支机构切实整改。相关分支机构已开展专项检查,

全面梳理完善渠道合作机制，强化合规培训和检查，进一步提升全员合规展业意识，全力防范相关业务的监管风险，并已
向浙江证监局提交整改工作报告。

2. 2023年9月1日，中国证监会出具《关于对国信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2023]19号）《关于对
对谏传立、郭永青采取出具警示函措施的决定》（[2023]20号），因公司存在薪酬考核不合理，未严格落实收入递延支
付要求、部分债券承揽人员薪酬收入与项目直接挂钩，内部问责机制不健全，个别项目内控跟踪落实不到位，部分内核员
工独立性不足，部分岗位人员出现廉洁从业风险，廉洁从业检查流于形式等问题，中国证监会决定对公司及相关责任人分
别采取责令改正及出具警示函的监督管理措施。

整改情况：针对相关问题，公司高度重视，系统部署了整改工作方案，组织各相关部门按照“整体建机制、逐项抓落
实”的原则切实整改，完善加强了薪酬考核管理、内部问责机制、项目内控跟踪落实、内核员工独立性及廉洁从业管控等，
进一步强化了相关内部管理体系和执行情况，推动投行业务质量提升，并已向监管部门提交整改总结报告。

十三、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

报告期内，公司及控股股东、实际控制人不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十四、重大关联交易

公司严格按照《深圳证券交易所股票上市规则》《国信证券股份有限公司关联交易管理制度》和《国信股份有限
公司信息披露事务管理制度》等要求规范管理关联交易。公司的关联交易遵循诚实信用、平等自愿、等价有偿、公开、公平、
公允的原则。报告期内，公司对2023年度关联交易进行了检查，未发现公司在关联交易管理制度建设、决策程序和信息披露
等方面存在不符合现行相关法律法规、规章制度的情况。

报告期内，公司不存在与某一关联方累计关联交易总额在3,000万元以上且占公司报告期末净资产值5%以上的关联
交易。公司根据企业会计准则披露的关联交易情况详见公司2023年度财务报表附注“十一、关联方及关联交易”。

（一）与日常经营相关的关联交易

公司与日常经营相关的关联交易，主要是由于公司向关联方提供证券、期货和金融产品服务等，与关联方开展证券和金
融产品交易，承租关联方房屋、通信管道、及接受关联方物业管理服务等。公司2023年度日常关联交易根据2022年度股
东大会审议通过的《关于2022年度关联交易及预计2023年度日常关联交易的议案》执行。公司2023年度预计日常关联
交易事项在报告期内的执行情况详见公司于2024年4月17日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的《2024
年度日常关联交易预计公告》。

（二）资产或股权收购、出售发生的关联交易

报告期内，公司未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

(三) 共同对外投资的关联交易

报告期内，公司未发生共同对外投资的重大关联交易。

(四) 关联债权债务往来

报告期内，公司与关联方不存在非经营性债权债务往来。

(五) 与存在关联关系的财务公司的往来情况

公司不存在有关联关系的财务公司。

(六) 公司控股的财务公司与关联方的往来情况

公司不存在控股的财务公司。

(七) 其他重大关联交易

报告期内，公司无其他重大关联交易。

十五、重大合同及其履行情况

(一) 托管、承包、租赁事项情况

报告期内，公司不存在重大托管、承包、租赁的情况。

(二) 担保情况

单位：万港元

| 公司及其子公司对外担保情况（不包括对子公司的担保） | | | | | | | | | | |
|---------------------------|----------------------|------|--------|------------|------|-------------|---------------|-----|----------------|------------------|
| 担保对象名称 | 担保额度 相关公告 披露日期 | 担保额度 | 实际发生日期 | 实际担保 金额 | 担保类型 | 担保物 （如有） | 反担保情况 （如有） | 担保期 | 是否 履行 完毕 | 是否为 关联方 担保 |
| 无 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 公司与子公司之间担保情况 | | | | | | | | | | |
| 担保对象名称 | 担保额度 相关公告 披露日期 | 担保额度 | 实际发生日期 | 实际担保 金额 | 担保类型 | 担保物 （如有） | 反担保情况 （如有） | 担保期 | 是否 履行 完毕 | 是否为 关联方 担保 |
| 无 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |

| 子公司对子公司的担保情况 | | | | | | | | | | |
|------------------------------------|--------------|--------|--|-------------------|------|---------|-----------|-------------------------|--------|----------|
| 担保对象名称 | 担保额度相关公告披露日期 | 担保额度 | 实际发生日期 | 实际担保金额 | 担保类型 | 担保物(如有) | 反担保情况(如有) | 担保期 | 是否履行完毕 | 是否为关联方担保 |
| 国信证券(香港)经纪有限公司 | 2023年4月29日 | 3,500 | 2015年3月23日、2017年7月10日 | 3,500 | 一般保证 | 无 | 无 | 自协议签署之日起,至被担保人履行完毕责任为止。 | 否 | 否 |
| 国信(香港)金融产品有限公司 | 2023年4月29日 | 16,500 | 2015年3月23日、2015年6月30日、2017年7月10日、2018年8月2日、2018年7月28日、2019年4月23日 | 16,500 | 一般保证 | 无 | 无 | 自协议签署之日起,至被担保人履行完毕责任为止。 | 否 | 否 |
| 报告期内审批对子公司担保额度合计 | | | 20,000 | 报告期内对子公司担保实际发生额合计 | | | - | | | |
| 报告期末已审批的对子公司担保额度合计 | | | 20,000 | 报告期末对子公司实际担保余额合计 | | | 20,000 | | | |
| 公司担保总额(即前三大项的合计) | | | | | | | | | | |
| 报告期内审批担保额度合计 | | | 20,000 | 报告期内担保实际发生额合计 | | | - | | | |
| 报告期末已审批的担保额度合计 | | | 20,000 | 报告期末实际担保余额合计 | | | 20,000 | | | |
| 实际担保总额占公司净资产的比例 | | | | | | 0.16% | | | | |
| 其中: | | | | | | | | | | |
| 为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额(1) | | | | | | - | | | | |
| 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(2) | | | | | | 16,500 | | | | |
| 担保总额超过净资产50%部分的金额(3) | | | | | | - | | | | |
| 上述三项担保金额合计(1+2+3) | | | | | | 16,500 | | | | |
| 对未到期担保,报告期内已发生担保责任或可能承担连带清偿责任的情况说明 | | | | | | 不适用 | | | | |
| 违反规定程序对外提供担保的说明 | | | | | | 不适用 | | | | |

公司第五届董事会第七次会议于2022年4月29日审议通过《关于设立资产管理子公司的议案》,同意根据监管要求与资管子公司风险控制指标情况,为拟设立的资管子公司提供累计不超过人民币30亿元(含)的净资本担保承诺。净资本担保承诺的有效期自资管子公司成立之日起至其资本状况能够持续满足监管机构要求时止。

公司不存在采用复合方式担保的情况。

(三) 委托他人进行现金资产管理情况

1. 委托理财情况

不适用。

2. 委托贷款情况

报告期内，公司不存在委托贷款。

(四) 其他重大合同

报告期内，公司不存在其他重大合同。

十六、其他重大事项的说明

(一) 证券营业网点的情况

截至报告期末，公司共设有 238 家证券营业网点，分布于全国 117 个城市和地区。报告期内，公司证券营业网点的变更及撤销情况如下：

1. 证券营业网点的变更

| 序号 | 变更类型 | 变更后 | 变更前 |
|----|------|---|---|
| 1 | | 长沙五一大道证券营业部 地址：湖南省长沙市芙蓉区五一大道 766 号中天广场写字楼 8 楼 | 长沙五一大道证券营业部 地址：湖南省长沙市芙蓉区五一大道 766 号中天广场 10050、10051 号房 |
| 2 | | 深圳红岭中路证券营业部 地址：深圳市罗湖区桂园街道红村社区红岭中路 1010 号信托大厦一层 02A、02C0114 号、二层 08 号 | 深圳红岭中路证券营业部 地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 4-11 楼 |
| 3 | 迁址 | 西南互联网分公司 地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区天府大道北段 1777 号 7 栋 1 单元 8 层 02、03、04 单元 | 西南互联网分公司 地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区锦城大道 539 号 B 座 1306 号 |
| 4 | | 肇庆星湖大道证券营业部 地址：肇庆市端州区星湖大道 9 号恒裕海湾综合楼首层 06、07、08 号商铺 | 肇庆星湖大道证券营业部 地址：广东省肇庆市端州区星湖大道臻汇园二期（幸福湖畔）B 区商业四区 A227、A228 卡 |
| 5 | | 江门白石大道证券营业部 地址：江门市蓬江区白石大道 217 号 101 室、103 室、201 室首层之二 | 江门白石大道证券营业部 地址：广东省江门市蓬江区白石大道 120 号 201 室（自编之二） |

| 序号 | 变更类型 | 变更后 | 变更前 |
|----|-------|---|---|
| 6 | | 南京安德门大街营业部 地址：南京市雨花台区铁心桥街道安德门大街 42 号徐家洼紫悦广场 05 幢 6 号 | 南京天印大道营业部 地址：南京市江宁区东山街道天印大道 700 号东山总部商务园 A3 栋一楼 |
| 7 | | 襄阳汉江路证券营业部 地址：湖北省襄阳市樊城区汉江路 42 号汉江悦府写字楼 8 幢 16 层 1 室 | 襄阳春园西路证券营业部 地址：湖北省襄阳市樊城区春园西路 8 号 |
| 8 | | 济南顺河东街证券营业部 地址：济南市市中区顺河东街 66 号银座晶都国际广场 135、235 | 济南文化东路证券营业部 地址：山东省济南市历下区文化东路 51-1 汇东星座 101、201 室 |
| 9 | | 深圳南海大道证券营业部 地址：深圳市南山区招商街道沿山社区南海大道 1079 号花园城数码大厦 A 座 102、B 座 513 | 深圳海德三道证券营业部 地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1126 号卓越后海金融中心 2504 单元 |
| 10 | 迁址并更名 | 阳江新江东路证券营业部 地址：阳江市江城区新江东路 299 号恒隆御景山庄 25 幢 2 层 25、26、27 号铺 | 阳江三环路证券营业部 地址：广东省阳江市江城区三环路 131 号一、二楼、三楼 |
| 11 | | 杭州向往街证券营业部 地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道欧美金融城 2 幢 705 室 | 杭州文一西路证券营业部 地址：浙江省杭州市西湖区文一西路 22 号 |
| 12 | | 金华光南路证券营业部 地址：浙江省金华市金东区多湖街道光南路 8 号 51 车总部大厦 104 室、1008 室 | 金华双龙南街证券营业部 地址：浙江省金华市双龙南街 1274、1278 号 |
| 13 | | 深圳香蜜湖证券营业部 地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7006 号富春东方大厦 8 层 809、810、811、812A 单元 | 深圳振华分公司 地址：深圳市福田区华强北街道华航社区华富路 1018 号中航中心西座 21 层 02 单元 |
| 14 | | 佛山三水证券营业部 地址：佛山市三水区西南街道健力宝南路 44 号富港汇广场 12 座 404、405 | 佛山三水新城证券营业部 地址：广东省佛山市三水区云东海街道鲁村路 6 号万景豪园 1 座 601、602 |
| 15 | | 广州临江大道证券营业部 地址：广州市天河区临江大道 393 号 501 室（部位：自编 04、自编 05、自编 06） | 广州珠江东路证券营业部 地址：广州市天河区珠江东路 16 号 701 房之自编 01C 单元、03 号 |
| 16 | 更名 | 台州分公司 地址：浙江省台州市台州湾新区海虹街道市府大道 211、213、215、217 号 | 台州市府大道证券营业部 地址：浙江省台州市台州湾新区白云街道市府大道 211、213、215、217 号 |

2. 营业网点的撤销

| 序号 | 营业网点名称 | 地址 |
|----|-------------|------------------------------------|
| 1 | 肇庆分公司 | 广东省肇庆市端州四路8号凯德广场4楼01号之一 |
| 2 | 绵阳园艺街证券营业部 | 四川省绵阳市科创区园艺街6号长兴星城7幢2层31号 |
| 3 | 贵阳中华北路证券营业部 | 贵州省贵阳市云岩区中华北路184号天毅商务大厦(2)1单元17层1号 |

(二) 账户规范情况

公司严格执行中国人民银行、中国证监会、证券登记结算机构及公司内部的各项账户管理规定。在证券账户及资金账户开销户各环节，严格落实账户实名制管理、认真履行客户身份识别义务、税收居民身份识别等要求及风险控制措施，杜绝新增不合格账户；明确各类特殊个人、机构或产品开户的要求，确保各类账户开户规范；进一步优化手机、PAD、VTM及柜台操作系统中的关键控制节点；建立健全账户开立及使用环节实名制的管理机制，有效防范账户业务风险。

报告期内公司持续推进不合格账户、休眠账户、风险处置账户等账户规范工作。截至2023年末，公司不合格证券账户3854户，比去年同期减少24户；不合格资金账户29,555户，比去年同期减少634户；休眠证券账户607,753户，比去年同期减少720户；休眠资金账户1,660,098户，比去年同期增加1,108,549户；与去年同期相比无新增风险处置账户。

十七、公司子公司重大事项

(一) 国信弘盛

公司于2021年11月23日召开第五届董事会第三次会议，审议通过《关于审议〈国信弘盛私募基金管理有限公司自有资金直接投资项目规范整改方案〉的议案》，同意国信弘盛将上述规范整改方案所列范围内的自有资金投资项目，按不超过2021年10月31日资产账面净值125,229.37万元，实质性转移给国信资本；授权公司经营管理层出具相应的批复或股东决定，并根据方案实施的具体情况，决定最终对国信弘盛的减资金额，以及对国信资本新增投资的金额。相关划转工作已完成。

国信弘盛已于2023年7月3日完成注册资本工商变更核准等相关事宜，注册资本由“405000万元”变更为“280625.267330万元”。

(二) 国信期货

截至报告期末，国信期货共设有22家期货营业网点，包括9家期货分公司、13家期货营业部，分布于全国19个城市。报告期内，国信期货营业网点的新设、变更及撤销情况如下：

1. 营业网点的新设

| 序号 | 营业网点名称 | 营业地址 | 《经营证券期货业务许可证》获取时间 |
|----|--------|---|-------------------|
| 1 | 佛山分公司 | 广东省佛山市顺德区乐从镇乐从社区东平新城文华南路8号保利商务中心1座3109室 | 2023年12月4日 |

2. 营业网点的变更

| 序号 | 变更类型 | 变更后 | 变更前 |
|----|------|--|--|
| 1 | 迁址 | 郑州营业部 地址：河南省郑州市金水区未来路69号未来公寓1005、1106、1205、1216、1303、1402、1405、1406、1416、1507房间 | 郑州营业部 地址：河南省郑州市金水区未来路街道未来路69号未来公寓1205、1216、1303、1402、1507房间 |
| 2 | | 厦门营业部 地址：福建省厦门市思明区筲箕街道湖滨南路357-359号海晟国际大厦701单元 | 厦门营业部 地址：福建省厦门市思明区莲前街道台东路158号9层02B单元 |
| 3 | 更名 | 安徽分公司 地址：安徽省合肥市蜀山区潜山路190号华邦世贸中心超高层写字楼2305、2307室 | 合肥营业部 地址：安徽省合肥市蜀山区潜山路190号华邦世贸中心超高层写字楼2305、2307室 |

3. 营业网点的撤销

| 序号 | 营业网点名称 | 地址 |
|----|--------|---------------------------------|
| 1 | 南阳营业部 | 河南省南阳市宛城区孔明路以西建业凯旋广场20号楼6层615-A |

(三) 设立资管子公司的进展情况

2023年11月10日，公司收到中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2023]2512号，以下简称“批复”）。根据该批复，中国证监会核准公司设立国信证券资产管理有限公司（以下简称“国信资管”）从事证券资产管理业务，国信资管注册地为深圳市，注册资本为10亿元，由公司现金出资，业务范围为证券资产管理业务，并核准国信资管作为合格境内机构投资者，从事境外证券投资管理业务。同时，中国证监会核准公司自身减少证券资产管理业务。

目前，公司正在积极推进资管子公司设立工作。

十八、报告期内各单项业务资格的变化情况

详见本报告第二节“五、各单项业务资格”。

07

第七节

股份变动及股东情况



一、股份变动情况

(一) 股份变动情况

单位：股

| 项目 | 本次变动前 | | 本次变动增减(+, -) | | | | | 本次变动后 | |
|------------------|---------------|---------|--------------|----|-------|--------------|--------------|---------------|---------|
| | 数量 | 比例 | 发行新股 | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 | 数量 | 比例 |
| 一、有限售条件股份 | 785,310,733 | 8.17% | - | - | - | -311,723,163 | -311,723,163 | 473,587,570 | 4.93% |
| 1. 国家持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 2. 国有法人持股 | 785,310,733 | 8.17% | - | - | - | -311,723,163 | -311,723,163 | 473,587,570 | 4.93% |
| 3. 其他内资持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其中：境内法人持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 4. 外资持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 二、无限售条件股份 | 8,827,118,644 | 91.83% | - | - | - | 311,723,163 | 311,723,163 | 9,138,841,807 | 95.07% |
| 1. 人民币普通股 | 8,827,118,644 | 91.83% | - | - | - | 311,723,163 | 311,723,163 | 9,138,841,807 | 95.07% |
| 2. 境内上市的外资股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 3. 境外上市的外资股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 4. 其他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 三、股份总数 | 9,612,429,377 | 100.00% | - | - | - | - | - | 9,612,429,377 | 100.00% |

1. 股份变动的的原因

2023年8月14日，公司2020年非公开发行的311,723,163股A股普通股解除限售条件上市流通。详见公司于2023年8月11日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）发布的《关于非公开发行股份解除限售上市流通的提示性公告》。

2. 股份变动的批准情况

不适用。

3. 股份变动的过户情况

不适用。

4. 股份变动对最近一年和最近一期基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产等财务指标的影响

不适用。

5. 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

单位：股

| 股东名称 | 期初限售股数 | 本期增加限售股数 | 本期解除限售股数 | 期末限售股数 | 限售原因 | 解除限售日期 |
|------|-------------|----------|-------------|--------|---|-----------------|
| 华润信托 | 74,858,757 | - | 74,858,757 | - | 根据中国证监会《证券公司行政许可审核工作指引第 10 号——证券公司增资扩股和股权变更》(以下简称《第 10 号指引》)第十四条，华润信托作为持股 5% 以上的股东（非控股股东或实际控制人控制的股东），其认购的公司非公开发行的 74,858,757 股股票自持股日起 36 个月内不得转让。 | 2023 年 8 月 14 日 |
| 云南合和 | 236,864,406 | - | 236,864,406 | - | 根据《第 10 号指引》第十四条，云南合和作为持股 5% 以上的股东（非控股股东或实际控制人控制的股东），其认购的公司非公开发行的 236,864,406 股股票自持股日起 36 个月内不得转让。 | 2023 年 8 月 14 日 |
| 合计 | 311,723,163 | - | 311,723,163 | - | - | - |

二、证券发行与上市情况

(一) 报告期内证券发行（不含优先股）情况

不适用。

(二) 公司股份总数及股东结构的变动、公司资产和负债结构的变动情况说明

不适用。

(三) 现存的内部职工股情况

不适用。

三、股东和实际控制人情况

(一) 公司股东数量及持股情况

单位：股

| 报告期末普通股股东总数 | 107,438 户 | 年度报告披露日前上一月末普通股股东总数 | 106,032 户 | 报告期末表决权恢复的优先股股东总数 | - | 年度报告披露日前上一月末表决权恢复的优先股股东总数 | - |
|---------------------------------------|--|---------------------|---------------|-------------------|--------------|---------------------------|------------|
| 持股 5% 以上的股东或前 10 名股东持股情况（不含通过转融通出借股份） | | | | | | | |
| 股东名称 | 股东性质 | 持股比例 | 报告期末持股数量 | 报告期内增减变动情况 | 持有有限售条件的股份数量 | 持有无限售条件的股份数量 | 质押、标记或冻结情况 |
| 深投控 | 国有法人 | 33.53% | 3,223,114,384 | - | 473,587,570 | 2,749,526,814 | 无 |
| 华润信托 | 国有法人 | 22.23% | 2,136,983,667 | 904,200 | - | 2,136,983,667 | 无 |
| 云南合和 | 国有法人 | 16.77% | 1,611,627,813 | - | - | 1,611,627,813 | 无 |
| 全国社会保障基金理事会 | 国有法人 | 4.75% | 456,690,209 | - | - | 456,690,209 | 无 |
| 北京城建 | 国有法人 | 2.94% | 282,550,000 | - | - | 282,550,000 | 无 |
| 一汽投资 | 国有法人 | 1.18% | 113,656,956 | -142,922,263 | - | 113,656,956 | 无 |
| 香港中央结算有限公司 | 境外法人 | 1.15% | 110,441,749 | 22,320,528 | - | 110,441,749 | 无 |
| 中国证券金融股份有限公司 | 国有法人 | 0.78% | 75,086,423 | - | - | 75,086,423 | 无 |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 国有法人 | 0.50% | 48,429,503 | - | - | 48,429,503 | 无 |
| BARCLAYS BANK PLC | 境外法人 | 0.30% | 28,425,356 | 28,176,023 | - | 28,425,356 | 无 |
| 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东的情况 | 全国社会保障基金理事会因认购公司非公开发行 A 股股票 456,690,209 股，认购股数占公司发行后总股本的 4.75%，于 2020 年 8 月成为公司前 10 名股东。 | | | | | | |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49% 的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。 | | | | | | |
| 上述股东涉及委托 / 受托表决权、放弃表决权情况的说明 | 不适用。 | | | | | | |
| 前 10 名股东中存在回购专户的特别说明 | 无。 | | | | | | |

前 10 名无限售条件股东持股情况

| 股东名称 | 报告期末持有无限售条件股份数量 | 股份种类 | |
|-------------------|-----------------|--------|---------------|
| | | 股份种类 | 数量 |
| 深投控 | 2,749,526,814 | 人民币普通股 | 2,749,526,814 |
| 华润信托 | 2,136,983,667 | 人民币普通股 | 2,136,983,667 |
| 云南合和 | 1,611,627,813 | 人民币普通股 | 1,611,627,813 |
| 全国社会保障基金理事会 | 456,690,209 | 人民币普通股 | 456,690,209 |
| 北京城建 | 282,550,000 | 人民币普通股 | 282,550,000 |
| 一汽投资 | 113,656,956 | 人民币普通股 | 113,656,956 |
| 香港中央结算有限公司 | 110,441,749 | 人民币普通股 | 110,441,749 |
| 中国证券金融股份有限公司 | 75,086,423 | 人民币普通股 | 75,086,423 |
| 中央汇金资产管理有限责任公司 | 48,429,503 | 人民币普通股 | 48,429,503 |
| BARCLAYS BANK PLC | 28,425,356 | 人民币普通股 | 28,425,356 |

前 10 名无限售流通股股东之间，以及前 10 名无限售流通股股东和前 10 名股东之间关联关系或一致行动的说明

公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49% 的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。

前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明

公司第二大股东华润信托以其持有的公司无限售流通股与证金公司开展转融通证券出借交易。截至 2023 年末，华润信托已开展的尚在出借期限内交易合计出借股数为 14,200 股，较 2022 年年末尚在出借期限内的出借股数 918,400 股减少 904,200 股。

1. 前十名股东参与转融通业务出借股份情况

单位：股

| 前十名股东参与转融通出借股份情况 | | | | | | | | |
|------------------|---------------|---------|----------------|---------|---------------|---------|----------------|---------|
| 股东名称 | 期初普通账户、信用账户持股 | | 期初转融通出借股份且尚未归还 | | 期末普通账户、信用账户持股 | | 期末转融通出借股份且尚未归还 | |
| | 数量合计 | 占总股本的比例 | 数量合计 | 占总股本的比例 | 数量合计 | 占总股本的比例 | 数量合计 | 占总股本的比例 |
| 华润深国投信托有限公司 | 2,136,079,467 | 22.22% | 918,400 | 0.01% | 2,136,983,667 | 22.23% | 14,200 | 0.00% |

2. 前十名股东较上期的变化情况

单位：股

| 前十名股东较上期未发生变化情况 | | | | | |
|---|-----------------|------------------|---------|---------------------------------------|---------|
| 股东名称 | 本报告期 新增 / 退出 | 期末转融通出借股份且尚未归还数量 | | 期末股东普通账户、信用账户持股及 转融通出借股份且尚未归还的股份数量 | |
| | | 数量合计 | 占总股本的比例 | 数量合计 | 占总股本的比例 |
| 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 | 退出 | - | - | - | - |
| BARCLAYS BANK PLC | 新增 | - | - | 28,425,356 | 0.30% |

公司前 10 名普通股股东、前 10 名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

(二) 持股 10% (含 10%) 以上的前 5 名股东情况

1. 法人

| 股东名称 | 法定 代表人 | 总经理 | 成立日期 | 统一社会信用代码 | 注册资本 (万元) | 主营业务 |
|------|-----------|-----|------------------|--------------------|--------------|--|
| 深投控 | 何建锋 | - | 2004 年 10 月 13 日 | 914403007675664218 | 3,235,900 | 银行、证券、保险、基金、担保等金融和类金融股权投资与并购；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营业务；开展战略性新兴产业领域投资与服务；通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理；市国资委授权开展的其他业务。 |
| 华润信托 | 刘小腊 | - | 1982 年 8 月 24 日 | 914403001921759713 | 1,100,000 | 资金信托；动产信托；不动产信托；有价证券信托；其他财产或财产权信托；作为投资基金或者基金管理公司的发起人从事投资基金业务；经营企业资产的重组、购并及项目融资、公司理财、财务顾问等业务；受托经营国务院有关部门批准的证券承销业务；办理居间、咨询、资信调查等业务；代保管及保管箱业务；以存放同业、拆放同业、贷款、租赁、投资方式运用固有财产；以固有财产为他人提供担保；从事同业拆借；法律法规规定或中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。 |
| 云南合和 | 毕凤林 | 李泓燊 | 2014 年 12 月 31 日 | 915300003253027445 | 600,000 | 实业投资、项目投资及对所投资项目进行管理。 |

2. 自然人

报告期内持股 10%（含 10%）以上的前 5 名股东无自然人。

（三）公司控股股东情况

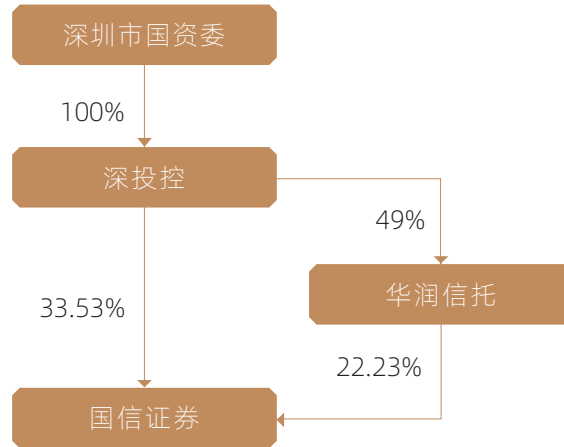
| 控股股东名称 | 控股股东性质 | 控股股东类型 | 法定代表人 / 单位负责人 | 成立日期 | 统一社会信用代码 | 主要经营业务 |
|---------------------------|---|--------|---------------|------------------|--------------------|--|
| 深投控 | 地方国有控股 | 法人 | 何建锋 | 2004 年 10 月 13 日 | 914403007675664218 | 银行、证券、保险、基金、担保等金融和类金融股权投资的投资与并购；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营业务；开展战略性新兴产业领域投资与服务；通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理；市国资委授权开展的其他业务。 |
| 控股股东报告期内控股和参股其他境内外上市公司的情况 | 湾区发展（0737.HK），持股比例 71.83%；深赛格（000058.SZ），持股比例 56.24%；深深房（000029.SZ），持股比例 55.78%；深物业（000011.SZ），持股比例 50.57%；深纺织（000045.SZ），持股比例 46.21%；特发服务（300917.SZ），持股比例 47.78%；深圳国际（0152.HK），持股比例 44.36%；特力 A（000025.SZ），持股比例 47.64%；深水规院（301038），持股比例 37.50%；力合科创（002243.SZ），持股比例 49.96%；英飞拓（002528.SZ），持股比例 26.35%；怡亚通（002183.SZ），持股比例 14.96%；特发信息（000070.SZ），持股比例 36.18%；天音控股（000829.SZ），持股比例 19.03%；麦捷科技（300319.SZ），持股比例 8.31%；国泰君安（601211.SH，2611.HK），持股比例 8.00%；深天地 A（000023.SZ），持股比例 5.91%；中国平安（601318.SH），持股比例 5.27%；招商蛇口（001979.SZ），持股比例 5.03%；铁汉生态（300197.SZ），持股比例 3.84%；万科 A（000002.SZ），持股比例 0.66%；深圳能源（000027.SZ），持股比例 0.14%；交通银行（601328.SH），持股比例 0.01%。 | | | | | |

报告期内，公司控股股东未发生变更。

（四）公司实际控制人及其一致行动人

| 实际控制人名称 | 实际控制人性质 | 实际控制人类型 | 法定代表人 / 单位负责人 | 成立日期 | 统一社会信用代码 | 主要经营业务 |
|----------------------------|----------|---------|---------------|-----------------|--------------------|--------|
| 深圳市国资委 | 地方国资管理机构 | 法人 | 王勇健 | 2004 年 7 月 30 日 | 11440300K317280672 | 不适用。 |
| 实际控制人报告期内控制的其他境内外上市公司的股权情况 | 不适用。 | | | | | |

报告期内，公司实际控制人未发生变更。截至报告期末，公司与实际控制人之间的产权及控制关系图如下：



实际控制人未通过信托或其他资产管理方式控制公司。

（五）公司控股股东或第一大股东及其一致行动人累计质押股份数量占其所持公司股份数量比例达到 80%

不适用。

（六）其他持股在 10% 以上的法人股东

公司无其他持股在 10% 以上的法人股东。

（七）控股股东、实际控制人、重组方及其他承诺主体股份限制减持情况

不适用。

四、股份回购在报告期的具体实施情况

（一）股份回购的实施进展情况

不适用。

（二）采用集中竞价交易方式减持回购股份的实施进展情况

不适用。

08

第八节

优先股相关情况



公司未发行优先股。

09

第九节

债券相关情况



一、企业债券

报告期内，公司不存在企业债券。

二、公司债券

(一) 公司债券基本信息

| 债券名称 | 债券简称 | 债券代码 | 发行日 | 起息日 | 到期日 | 债券余额 (亿元) | 利率 (%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|--|--------|--------|-------------|-------------|-------------|--------------|-----------|---------------------------------------|------|
| 国信证券股份有限公司 2020年非公开发行公司债券（第一期） | 20国信01 | 114650 | 2020年1月9日 | 2020年1月13日 | 2023年1月13日 | - | 3.60 | 已按时兑付本金及利息。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2020年非公开发行公司债券（第二期） | 20国信02 | 114673 | 2020年2月27日 | 2020年3月2日 | 2023年3月2日 | - | 3.17 | 已按时兑付本金及利息。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2020年非公开发行永续次级债券（第一期） | 20国信Y1 | 115117 | 2020年7月9日 | 2020年7月13日 | - | 50 | 4.50 | 在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 非公开发行2020年永续次级债券（第二期） | 20国信Y2 | 115119 | 2020年9月15日 | 2020年9月17日 | - | 50 | 4.80 | 在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2020年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二） | 20国信06 | 149335 | 2020年12月17日 | 2020年12月22日 | 2023年12月22日 | - | 3.70 | 已按时兑付本金及利息。 | 深交所 |
| 国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国信02 | 149375 | 2021年1月27日 | 2021年2月1日 | 2024年2月1日 | - | 3.64 | 已按时兑付本金及利息。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 非公开发行2021年永续次级债券（第一期） | 21国信Y1 | 115123 | 2021年4月8日 | 2021年4月12日 | - | 50 | 4.55 | 在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 非公开发行2021年永续次级债券（第二期） | 21国信Y2 | 115124 | 2021年4月22日 | 2021年4月26日 | - | 50 | 4.38 | 在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。 | 深交所 |

| 债券名称 | 债券简称 | 债券代码 | 发行日 | 起息日 | 到期日 | 债券余额 (亿元) | 利率 (%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|--|--------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|-----------|--|------|
| 国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国信03 | 149535 | 2021年7月 2日 | 2021年7月 6日 | 2024年7月 6日 | 20 | 3.35 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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国信04 | 149536 | 2021年7月 2日 | 2021年7月 6日 | 2026年7月 6日 | 30 | 3.68 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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)(品种一) | 21国信05 | 149557 | 2021年7月 19日 | 2021年7月 21日 | 2024年7月 21日 | 24 | 3.16 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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)(品种二) | 21国信06 | 149558 | 2021年7月 19日 | 2021年7月 21日 | 2026年7月 21日 | 33 | 3.48 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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)(品种一) | 21国信07 | 149544 | 2021年9月 13日 | 2021年9月 15日 | 2024年9月 15日 | 27 | 3.09 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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国信10 | 149673 | 2021年10 月20日 | 2021年10 月22日 | 2024年10 月22日 | 40 | 3.28 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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国信11 | 149674 | 2021年10 月20日 | 2021年10 月22日 | 2026年10 月22日 | 10 | 3.63 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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 六期)(品种一) | 21国信12 | 149709 | 2021年11 月19日 | 2021年11 月23日 | 2024年11 月23日 | 30 | 3.09 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国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 六期)(品种二) | 21国信13 | 149710 | 2021年11 月19日 | 2021年11 月23日 | 2026年11 月23日 | 20 | 3.43 | 采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。 | 深交所 |

| 债券名称 | 债券简称 | 债券代码 | 发行日 | 起息日 | 到期日 | 债券余额 (亿元) | 利率 (%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|--|--------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|-----------|--|------|
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 一期）（品种一） | 22国信01 | 149775 | 2022年1月 7日 | 2022年1月 11日 | 2025年1月 11日 | 30 | 2.92 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 一期）（品种二） | 22国信02 | 149776 | 2022年1月 7日 | 2022年1月 11日 | 2027年1月 11日 | 10 | 3.28 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 二期） | 22国信03 | 149807 | 2022年2月 22日 | 2022年2月 24日 | 2025年2月 24日 | 5 | 2.95 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 三期） | 22国信04 | 149849 | 2022年3月 23日 | 2022年3月 25日 | 2025年3月 25日 | 21 | 3.17 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行短期公司债券 （第一期） | 22国信D1 | 149872 | 2022年4月 1日 | 2022年4月 6日 | 2023年4月 6日 | - | 2.58 | 已按时兑付本金及 利息。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行永续次级债券 （第一期） | 22国信Y1 | 149954 | 2022年6月 17日 | 2022年6月 21日 | - | 50 | 3.63 | 在不行使递延支付 利息权的情况下， 每年付息一次。在 行使赎回选择权前 长期存续。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行永续次级债券 （第二期） | 22国信Y2 | 149974 | 2022年7月 6日 | 2022年7月 8日 | - | 50 | 3.67 | 在不行使递延支付 利息权的情况下， 每年付息一次。在 行使赎回选择权前 长期存续。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 四期） | 22国信05 | 148029 | 2022年8月 12日 | 2022年8月 16日 | 2025年8月 16日 | 29 | 2.64 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2022年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 五期） | 22国信06 | 148087 | 2022年10 月14日 | 2022年10 月18日 | 2025年10 月18日 | 30 | 2.58 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |

| 债券名称 | 债券简称 | 债券代码 | 发行日 | 起息日 | 到期日 | 债券余额 (亿元) | 利率 (%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|--|--------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|-----------|--|------|
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 一期）（品种二） | 23国证02 | 148179 | 2023年2月 3日 | 2023年2月 7日 | 2026年2月 7日 | 45 | 3.22 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 二期） | 23国证03 | 148227 | 2023年3月 23日 | 2023年3月 27日 | 2025年3月 27日 | 25 | 2.97 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行短期公司债券 （第一期） | 23国信D1 | 148242 | 2023年4月 7日 | 2023年4月 11日 | 2024年4月 11日 | - | 2.69 | 已按时兑付本金及 利息。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 三期） | 23国证04 | 148282 | 2023年4月 26日 | 2023年4月 28日 | 2026年4月 28日 | 30 | 2.99 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 四期）（品种二） | 23国证06 | 148313 | 2023年6月 8日 | 2023年6月 12日 | 2026年6月 12日 | 26 | 2.83 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 五期）（品种一） | 23国证07 | 148425 | 2023年8月 14日 | 2023年8月 16日 | 2025年8月 16日 | 8 | 2.53 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 五期）（品种二） | 23国证08 | 148426 | 2023年8月 14日 | 2023年8月 16日 | 2026年8月 16日 | 35 | 2.72 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 六期） | 23国证09 | 148513 | 2023年11 月16日 | 2023年11 月20日 | 2026年11 月20日 | 27 | 2.89 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 七期）（品种一） | 23国证10 | 148531 | 2023年12 月4日 | 2023年12 月6日 | 2025年12 月6日 | 13 | 2.9 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |

| 债券名称 | 债券简称 | 债券代码 | 发行日 | 起息日 | 到期日 | 债券余额 (亿元) | 利率 (%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|--|---|--------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|-----------|--|------|
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 七期）（品种二） | 23国证11 | 148532 | 2023年12 月4日 | 2023年12 月6日 | 2028年12 月6日 | 20 | 3.12 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 八期）（品种一） | 23国证12 | 148549 | 2023年12 月13日 | 2023年12 月15日 | 2026年12 月15日 | 20 | 2.96 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2023年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 八期）（品种二） | 23国证13 | 148550 | 2023年12 月13日 | 2023年12 月15日 | 2028年12 月15日 | 30 | 3.12 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2024年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 一期） | 24国证01 | 148580 | 2024年1月 17日 | 2024年1月 19日 | 2027年1月 19日 | 28 | 2.75 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2024年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 二期）（品种一） | 24国证02 | 148592 | 2024年1月 25日 | 2024年1月 29日 | 2026年1月 29日 | 10 | 2.65 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 国信证券股份有限公司 2024年面向专业投资者 公开发行公司债券（第 二期）（品种二） | 24国证03 | 148593 | 2024年1月 25日 | 2024年1月 29日 | 2029年1月 29日 | 24 | 2.85 | 采用单利按年计 息，不计复利。每 年付息一次，最后 一期利息随本金的 兑付一起支付。 | 深交所 |
| 投资者适当性安排（如有） | 上述债券面向拥有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的合格A股证券账户的专业投资者（法律、法规禁止购买者除外）公开发行。 | | | | | | | | |
| 适用的交易机制 | 在深交所上市，交易方式包括匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交。 | | | | | | | | |
| 是否存在终止上市交易的风险（如有） 和应对措施 | 不适用。 | | | | | | | | |

公司不存在逾期未偿还债券。

（二）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。

(三) 中介机构的情况

| 中介机构名称 | 办公地址 | 签字会计师姓名 | 中介机构联系人 | 联系电话 |
|------------------|---|---------------|------------|---------------|
| 广发证券股份有限公司 | 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 | - | 祝磊 | 020-66338888 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦 | - | 陈曲、邓小霞 | 010-80927231 |
| 中信证券股份有限公司 | 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 | - | 冯源、张陈灵 | 0755-23835062 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 上海市静安区新闻路 669 博华广场 33 楼 | - | 戴蕴乐 | 13761888977 |
| 平安证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 | - | 周顺强 | 0755-22625403 |
| 联合资信评估股份有限公司 | 北京市朝阳区建外大街 2 号院 2 号楼 17 层 | - | 张帆、陈凝 | 010-85679696 |
| 中诚信国际信用评级有限责任公司 | 北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101 | - | 张璐、高阳 | 010-66428877 |
| 天健会计师事务所(特殊普通合伙) | 浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼 | 张云鹤、谢军、崔永强、黄燕 | 黄燕 | 020-37600380 |
| 北京市天元律师事务所 | 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 B 座 10 层 | - | 支毅、敖华芳、曾雪莹 | 010-57763888 |
| 北京德恒律师事务所 | 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层 | - | 罗元清、龚东旭 | 0755-88286488 |
| 广东信达律师事务所 | 广东省深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 11、12 楼 | - | 石之恒、叶子 | 0755-88265288 |

报告期内，上述中介机构未发生变化。

(四) 募集资金使用情况

| 债券名称 | 募集资金 总金额 (亿元) | 已使用 金额 (亿元) | 未使用 金额 (亿元) | 募集资金专项 账户运作情况 (如有) | 募集资金违规使 用的整改情况 (如有) | 是否与募集说明书承 诺的用途、使用计划 及其他约定一致 |
|--|---------------------|-------------------|-------------------|--------------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| 国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第一期） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第二期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二） | 20 | 20 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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） | 20 | 20 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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） | 20 | 20 | - | 无 | 无 | 是 |

| 债券名称 | 募集资金 总金额 (亿元) | 已使用 金额 (亿元) | 未使用 金额 (亿元) | 募集资金专项 账户运作情况 (如有) | 募集资金违规使 用的整改情况 (如有) | 是否与募集说明书承 诺的用途、使用计划 及其他约定一致 |
|--|---------------------|-------------------|-------------------|--------------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| 国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） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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）（品种一） | 24 | 24 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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）（品种二） | 33 | 33 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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）（品种一） | 27 | 27 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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） | 40 | 40 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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） | 10 | 10 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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（第六期）（品种一） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国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（第六期）（品种二） | 20 | 20 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二） | 10 | 10 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期） | 5 | 5 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期） | 21 | 21 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期） | 29 | 29 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二） | 45 | 45 | - | 无 | 无 | 是 |

| 债券名称 | 募集资金 总金额 (亿元) | 已使用 金额 (亿元) | 未使用 金额 (亿元) | 募集资金专项 账户运作情况 (如有) | 募集资金违规使 用的整改情况 (如有) | 是否与募集说明书承 诺的用途、使用计划 及其他约定一致 |
|--|---------------------|-------------------|-------------------|--------------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期） | 25 | 25 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期） （品种二） | 26 | 26 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期） （品种一） | 8 | 8 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期） （品种二） | 35 | 35 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第六期） | 27 | 27 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第七期） （品种一） | 13 | 13 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第七期） （品种二） | 20 | 20 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第八期） （品种一） | 20 | 20 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第八期） （品种二） | 30 | 30 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行永续次级债券（第一期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司非公开发行 2020 年永续次级债券（第二期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第一期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第二期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第一期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |
| 国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第二期） | 50 | 50 | - | 无 | 无 | 是 |

报告期内，公司募集资金未用于建设项目，未变更上述债券募集资金用途。

（五）报告期内信用评级结果调整情况

无。

（六）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情况和变化情况及对债券投资者权益的影响

不适用。

三、非金融企业债务融资工具

报告期内，公司不存在非金融企业债务融资工具。

四、可转换公司债券

报告期内，公司不存在可转换公司债券。

五、报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10% 的情况

不适用。

六、报告期末除债券外的有息债务逾期情况

不适用。

七、报告期内是否有违反规章制度的情况

报告期内，公司无违反法律法规、公司章程、信息披露事务管理制度规定的情况以及债券募集说明书约定或承诺的情况。

八、截至报告期末公司近两年的主要会计数据和财务指标

单位：万元

| 项目 | 本报告期末 | 上年末 | 本报告期末比上年末增减 |
|-------|--------|--------|--------------|
| 流动比率 | 1.74 | 1.82 | -4.40% |
| 资产负债率 | 72.85% | 68.09% | 上升 4.76 个百分点 |
| 速动比率 | 1.74 | 1.82 | -4.40% |

| 项目 | 本报告期 | 上年同期 | 本报告期比上年同期增减 |
|---------------|------------|------------|--------------|
| 扣除非经常性损益后净利润 | 640,126.56 | 594,847.83 | 7.61% |
| EBITDA 全部债务比 | 5.16% | 6.06% | 下降 0.90 个百分点 |
| 利息保障倍数 | 2.22 | 2.24 | -0.89% |
| 现金利息保障倍数 | -7.69 | -0.31 | 不适用 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.34 | 2.36 | -0.85% |
| 贷款偿还率 | 100.00% | 100.00% | - |
| 利息偿付率 | 100.00% | 100.00% | - |

九、公司其他债务融资工具

(一) 短期融资券

| 债券简称 | 起息日 | 到期日 | 发行规模 (亿元) | 利率 (%) | 付息兑付情况 |
|---------------|------------------|------------------|-----------|--------|------------|
| 22 国信证券 CP001 | 2022 年 2 月 10 日 | 2023 年 2 月 10 日 | 30 | 2.50 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP004 | 2022 年 2 月 21 日 | 2023 年 2 月 21 日 | 15 | 2.49 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP006 | 2022 年 3 月 1 日 | 2023 年 3 月 1 日 | 23 | 2.58 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP010 | 2022 年 4 月 12 日 | 2023 年 4 月 12 日 | 15 | 2.52 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP012 | 2022 年 4 月 25 日 | 2023 年 4 月 25 日 | 15 | 2.47 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP014 | 2022 年 4 月 28 日 | 2023 年 4 月 28 日 | 15 | 2.42 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP016 | 2022 年 5 月 16 日 | 2023 年 5 月 16 日 | 15 | 2.37 | 已按时兑付本金及利息 |
| 22 国信证券 CP019 | 2022 年 12 月 26 日 | 2023 年 3 月 24 日 | 30 | 2.55 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP001 | 2023 年 1 月 16 日 | 2023 年 5 月 19 日 | 50 | 2.50 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP002 | 2023 年 1 月 18 日 | 2023 年 5 月 26 日 | 15 | 2.50 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP003 | 2023 年 3 月 13 日 | 2023 年 6 月 9 日 | 10 | 2.55 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP004 | 2023 年 3 月 13 日 | 2023 年 9 月 8 日 | 40 | 2.65 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP005 | 2023 年 3 月 20 日 | 2023 年 9 月 15 日 | 30 | 2.62 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP006 | 2023 年 3 月 29 日 | 2023 年 6 月 27 日 | 20 | 2.47 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP007 | 2023 年 3 月 29 日 | 2024 年 3 月 28 日 | 20 | 2.73 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP008 | 2023 年 4 月 17 日 | 2023 年 10 月 13 日 | 20 | 2.56 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP009 | 2023 年 4 月 18 日 | 2023 年 7 月 18 日 | 25 | 2.48 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP010 | 2023 年 5 月 17 日 | 2023 年 11 月 17 日 | 20 | 2.35 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP011 | 2023 年 5 月 22 日 | 2024 年 5 月 21 日 | 11 | 2.52 | 未到兑息兑付日 |

| 债券简称 | 起息日 | 到期日 | 发行规模（亿元） | 利率（%） | 付息兑付情况 |
|---------------|------------------|------------------|----------|-------|------------|
| 23 国信证券 CP012 | 2023 年 7 月 7 日 | 2023 年 10 月 17 日 | 20 | 2.12 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP013 | 2023 年 7 月 17 日 | 2023 年 12 月 15 日 | 20 | 2.13 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP014 | 2023 年 9 月 7 日 | 2024 年 6 月 6 日 | 30 | 2.35 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP015 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 3 月 8 日 | 20 | 2.30 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP016 | 2023 年 9 月 19 日 | 2024 年 2 月 27 日 | 30 | 2.42 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP017 | 2023 年 9 月 26 日 | 2023 年 12 月 22 日 | 30 | 2.35 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP018 | 2023 年 10 月 11 日 | 2024 年 5 月 16 日 | 30 | 2.46 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP019 | 2023 年 10 月 17 日 | 2024 年 8 月 16 日 | 19 | 2.55 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP020 | 2023 年 10 月 24 日 | 2024 年 2 月 21 日 | 15 | 2.59 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP021 | 2023 年 11 月 3 日 | 2024 年 5 月 7 日 | 10 | 2.62 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP022 | 2023 年 11 月 7 日 | 2024 年 5 月 14 日 | 20 | 2.60 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP023 | 2023 年 11 月 13 日 | 2024 年 4 月 16 日 | 40 | 2.65 | 已按时兑付本金及利息 |
| 23 国信证券 CP024 | 2023 年 11 月 16 日 | 2024 年 9 月 11 日 | 26 | 2.65 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP025 | 2023 年 11 月 23 日 | 2024 年 8 月 23 日 | 20 | 2.67 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP026 | 2023 年 11 月 27 日 | 2024 年 6 月 27 日 | 40 | 2.69 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP027 | 2023 年 12 月 7 日 | 2024 年 12 月 6 日 | 17 | 2.80 | 未到兑息兑付日 |
| 23 国信证券 CP028 | 2023 年 12 月 13 日 | 2024 年 3 月 15 日 | 20 | 2.85 | 已按时兑付本金及利息 |
| 24 国信证券 CP001 | 2024 年 1 月 9 日 | 2025 年 1 月 8 日 | 20 | 2.55 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP002 | 2024 年 1 月 17 日 | 2024 年 12 月 12 日 | 29 | 2.48 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP003 | 2024 年 2 月 5 日 | 2025 年 1 月 17 日 | 20 | 2.45 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP004 | 2024 年 3 月 11 日 | 2025 年 3 月 11 日 | 20 | 2.29 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP005 | 2024 年 3 月 15 日 | 2025 年 2 月 21 日 | 20 | 2.33 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP006 | 2024 年 3 月 25 日 | 2025 年 2 月 25 日 | 20 | 2.32 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP007 | 2024 年 4 月 10 日 | 2025 年 4 月 10 日 | 30 | 2.25 | 未到兑息兑付日 |
| 24 国信证券 CP008 | 2024 年 4 月 16 日 | 2025 年 4 月 16 日 | 25 | 2.14 | 未到兑息兑付日 |

（二）收益凭证

报告期内，公司新增发行 1,052 期收益凭证，募集资金 189.08 亿元，均按时兑付本金及利息。收益凭证期末存量规模为 164.5 亿元。

10

第十节

财务报告



审计报告

天健审[2024]7-355号

国信证券股份有限公司全体股东：

一、审计意见

我们审计了国信证券股份有限公司(以下简称国信证券)财务报表,包括2023年12月31日的合并及母公司资产负债表,2023年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表,以及相关财务报表附注。

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了国信证券2023年12月31日的合并及母公司财务状况,以及2023年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国信证券,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、关键审计事项

关键审计事项是我们根据职业判断,认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景,我们不对这些事项单独发表意见。

(一) 融出资金及买入返售金融资产的减值

1. 事项描述

详见财务报表附注三(十一)和五(一)3、7。

截至2023年12月31日,国信证券融出资金及买入返售金融资产账面价值合计人民币640.06亿元,占总资产的13.83%;减值准备合计为人民币14.91亿元。

国信证券管理层(以下简称管理层)运用预期信用损失模型确定融出资金及买入返售金融资产减值准备的过程中涉及较多关键参数和假设的应用,包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露等,这些参数的选取和假设的应用涉及管理层的判断。

由于上述金融资产金额重大,预期信用损失模型涉及较多参数和假设,因此我们将该事项确定为关键审计事项。

2. 审计应对

针对融出资金、买入返售金融资产减值,我们实施的审计程序主要包括:

(1) 了解与金融工具投资审批、投后管理、信用评级、质押品管理以及金融工具减值准备计提相关的关键内部控制,评价这些控制的设计,确定其是否得到执行,并测试相关内部控制的运行有效性;

(2) 对预期信用损失模型及相关参数和假设的合理性进行评估，包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露等，并评估其中所涉及的关键管理层判断的合理性；

(3) 选取样本，检查预期信用损失模型的主要输入值是否正确，包括信用风险敞口和损失率等；

(4) 对于已发生信用减值的金融资产，抽取样本，检查管理层基于相关债务人的财务信息以及担保物的最新评估价值计算的预期信用损失是否适当；

(5) 检查与融出资金及买入返售金融资产减值准备相关的信息是否已在财务报表中作出恰当列报。

(二) 金融工具公允价值的计量

1. 事项描述

详见财务报表附注三（十一）和附注十。

截至 2023 年 12 月 31 日，国信证券公允价值属于第二层次的金融资产账面价值计人民币 2,503.25 亿元、属于第三层次的金融资产账面价值计人民币 85.23 亿元，该等金融资产账面价值合计人民币 2,588.47 亿元；公允价值属于第二层次、第三层次的金融负债账面价值合计人民币 16.31 亿元。

管理层对该等金融资产及金融负债的估值以市场数据和估值模型为基础，估值模型通常需要大量可观察或不可观察的输入值，输入值的确定涉及管理层的重大判断和估计。

由于该等金融资产和金融负债的估值较为复杂，且该等金融资产和金融负债对财务报表的影响重大，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

2. 审计应对

针对金融工具公允价值的计量，我们实施的审计程序主要包括：

(1) 了解与金融工具公允价值评估相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

(2) 针对公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具，抽取样本检查合同，了解合同条款并识别与金融工具估值相关的条款；

(3) 评价国信证券用于公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具的估值模型，并抽取样本检查估值结果是否正确；

(4) 评价财务报表附注中的相关披露是否符合企业会计准则披露要求，恰当反映了金融工具的估值风险。

(三) 结构化主体合并的判断

1. 事项描述

详见财务报表附注七（一）3。

截至 2023 年 12 月 31 日，国信证券纳入合并财务报表合并范围的结构化主体总资产计人民币 419.34 亿元。

国信证券投资了若干结构化主体，包括资产管理计划、信托计划和有限合伙企业等。国信证券对结构化主体合并的判断主要是从是否对结构化主体拥有权力、通过参与结构化主体的相关活动而享有可变回报、并且有能力运用对结构化主体的权力影响其回报三要素进行分析。管理层通过综合评估其持有的份额相应享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬，其由此获取的可变回报的影响是否重大，判断是否对结构化主体形成控制，进而确定是否纳入财务报表的合并范围。

由于对结构化主体是否形成控制涉及管理层的重大判断，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

2. 审计应对

针对结构化主体合并事项的判断，我们实施的审计程序主要包括：

- (1) 了解相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；
- (2) 获取结构化主体相关合同，从国信证券对结构化产品拥有的权力、结构化主体享有的可变回报以及运用权力影响回报金额的能力等方面评价管理层做出的判断是否合理；
- (3) 选取样本复核国信证券在结构化主体中享有的收益情况，检查国信证券运用对结构化主体的权力影响其回报金额；
- (4) 评价国信证券是否已按照企业会计准则的要求对已合并的结构化主体予以恰当列报。

四、其他信息

管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

五、管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估国信证券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

国信证券治理层（以下简称治理层）负责监督国信证券的财务报告过程。

六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于

舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国信证券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国信证券不能持续经营。

（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

（六）就国信证券中实体或业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据，以对财务报表发表审计意见。我们负责指导、监督和执行集团审计，并对审计意见承担全部责任。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明，并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项，以及相关的防范措施（如适用）。

从与治理层沟通过的事项中，我们确定哪些事项对本期财务报表审计最为重要，因而构成关键审计事项。我们在审计报告中描述这些事项，除非法律法规禁止公开披露这些事项，或在极少数情形下，如果合理预期在审计报告中沟通某事项造成的负面后果超过在公众利益方面产生的益处，我们确定不应在审计报告中沟通该事项。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师：燕玉嵩

（项目合伙人）

中国·杭州

中国注册会计师：黄燕

二〇二四年四月十六日

合并资产负债表

2023年12月31日

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 资产 | 注释号 | 期末数 | 上年年末数 | 负债和所有者权益 | 注释号 | 期末数 | 上年年末数 |
|-----------|-----|--------------------|--------------------|---------------|-----|--------------------|--------------------|
| 资产： | | | | 负债： | | | |
| 货币资金 | 1 | 61,904,744,939.58 | 64,977,826,272.53 | 短期借款 | 23 | 3,640,000.00 | |
| 其中：客户资金存款 | | 53,828,578,902.25 | 55,997,913,160.31 | 应付短期融资款 | 24 | 55,540,172,754.04 | 22,515,995,310.97 |
| 结算备付金 | 2 | 15,177,516,074.20 | 15,734,799,287.70 | 拆入资金 | 25 | 7,031,963,594.60 | 9,006,162,483.33 |
| 其中：客户备付金 | | 11,367,972,890.12 | 12,835,634,057.03 | 交易性金融负债 | 26 | 1,279,201,477.28 | 1,789,847,354.62 |
| 贵金属 | | | | 衍生金融负债 | 4 | 713,267,002.89 | 324,672,439.60 |
| 拆出资金 | | | | 卖出回购金融资产款 | 27 | 124,275,592,952.89 | 114,183,859,383.17 |
| 融出资金 | 3 | 55,881,511,468.98 | 52,672,094,624.02 | 代理买卖证券款 | 28 | 56,070,946,875.80 | 59,413,814,509.13 |
| 衍生金融资产 | 4 | 568,494,996.30 | 164,204,033.62 | 代理承销证券款 | 29 | 44,000,000.00 | |
| 存出保证金 | 5 | 9,827,332,808.11 | 7,900,221,491.14 | 应付职工薪酬 | 30 | 5,308,479,845.69 | 5,863,698,182.25 |
| 应收款项 | 6 | 4,083,918,364.27 | 4,728,934,871.75 | 应交税费 | 31 | 207,933,931.79 | 471,244,694.61 |
| 应收款项融资 | | | | 应付款项 | 32 | 19,883,074,417.94 | 12,698,831,315.61 |
| 合同资产 | | | | 合同负债 | 33 | 3,036,485.20 | 433,018.86 |
| 买入返售金融资产 | 7 | 8,124,242,250.38 | 15,824,517,431.75 | 持有待售负债 | | | |
| 持有待售资产 | | | | 预计负债 | 34 | 14,900,556.86 | 39,999,376.78 |
| 金融投资： | | | | 长期借款 | | | |
| 交易性金融资产 | 8 | 195,983,543,875.02 | 159,472,573,237.44 | 应付债券 | 35 | 67,483,659,450.58 | 48,850,436,652.29 |
| 债权投资 | 9 | 291,898,258.32 | 69,266,211.57 | 其中：优先股 | | | |
| 其他债权投资 | 10 | 84,444,910,893.48 | 51,501,472,752.05 | 永续债 | | | |
| 其他权益工具投资 | 11 | 15,311,504,150.13 | 10,429,791,008.15 | 租赁负债 | 36 | 443,232,717.45 | 412,129,927.57 |
| 长期股权投资 | 12 | 3,586,564,199.26 | 3,468,468,220.21 | 递延收益 | 37 | 119,337,931.44 | 122,813,793.48 |
| 投资性房地产 | 13 | 274,916,594.34 | 279,122,466.32 | 递延所得税负债 | 19 | 1,012,003,741.67 | 390,274,752.92 |
| 固定资产 | 14 | 2,446,612,333.70 | 2,648,915,554.79 | 其他负债 | 38 | 13,066,201,995.84 | 11,361,533,333.39 |
| 在建工程 | 15 | 52,426,063.60 | 20,569,441.48 | 负债合计 | | 352,500,645,731.96 | 287,445,746,528.58 |
| 使用权资产 | 16 | 446,313,101.41 | 417,880,205.16 | 所有者权益： | | | |
| 无形资产 | 17 | 755,548,692.88 | 708,403,163.91 | 股本 | 39 | 9,612,429,377.00 | 9,612,429,377.00 |
| 其中：交易席位费 | | 29,752,745.38 | 29,752,745.38 | 其他权益工具 | 40 | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 |
| 商誉 | 18 | 10,260,249.61 | 10,260,249.61 | 其中：优先股 | | | |
| 递延所得税资产 | 19 | 2,809,850,388.55 | 2,848,152,868.05 | 永续债 | | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 |
| 其他资产 | 20 | 978,060,131.25 | 453,305,540.30 | 资本公积 | 41 | 20,136,775,303.52 | 20,146,238,607.58 |
| | | | | 减：库存股 | | | |
| | | | | 其他综合收益 | 42 | 767,509,971.22 | -359,835,343.82 |
| | | | | 盈余公积 | 43 | 4,867,817,456.10 | 4,867,817,456.10 |
| | | | | 一般风险准备 | 44 | 17,571,473,247.71 | 16,330,816,087.88 |
| | | | | 未分配利润 | 45 | 27,503,518,745.86 | 26,287,566,218.23 |
| | | | | 归属于母公司所有者权益合计 | | 110,459,524,101.41 | 106,885,032,402.97 |
| | | | | 少数股东权益 | | | |
| | | | | 所有者权益合计 | | 110,459,524,101.41 | 106,885,032,402.97 |
| 资产总计 | | 462,960,169,833.37 | 394,330,778,931.55 | 负债和所有者权益总计 | | 462,960,169,833.37 | 394,330,778,931.55 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

母公司资产负债表

2023年12月31日

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 资产 | 注释号 | 期末数 | 上年年末数 | 负债和所有者权益 | 注释号 | 期末数 | 上年年末数 |
|-----------|-----|--------------------|--------------------|---------------|-----|--------------------|--------------------|
| 资产： | | | | 负债： | | | |
| 货币资金 | | 49,209,209,182.96 | 51,347,069,178.01 | 短期借款 | | | |
| 其中：客户资金存款 | | 43,504,973,728.66 | 46,878,617,105.40 | 应付短期融资款 | | 55,540,172,754.04 | 22,515,995,310.97 |
| 结算备付金 | | 14,735,577,238.18 | 14,558,502,055.56 | 拆入资金 | | 7,031,963,594.60 | 9,006,162,483.33 |
| 其中：客户备付金 | | 11,008,251,598.92 | 10,875,829,663.62 | 交易性金融负债 | | 915,528,541.23 | 1,337,467,274.50 |
| 贵金属 | | | | 衍生金融负债 | | 712,222,455.17 | 323,480,541.35 |
| 拆出资金 | | | | 卖出回购金融资产款 | | 115,763,532,540.49 | 114,183,859,383.17 |
| 融出资金 | | 55,668,769,358.74 | 52,421,873,900.14 | 代理买卖证券款 | | 54,800,484,511.84 | 57,849,764,776.70 |
| 衍生金融资产 | | 568,494,996.30 | 164,204,033.62 | 代理承销证券款 | | 44,000,000.00 | |
| 存出保证金 | | 3,847,179,646.48 | 3,335,062,661.73 | 应付职工薪酬 | 2 | 4,955,586,287.96 | 5,511,574,420.29 |
| 应收款项 | | 3,378,128,970.67 | 4,427,387,008.07 | 应交税费 | | 169,139,621.68 | 387,740,660.17 |
| 应收款项融资 | | | | 应付款项 | | 16,989,906,330.44 | 9,332,450,614.95 |
| 合同资产 | | | | 合同负债 | | | |
| 买入返售金融资产 | | 8,061,308,862.45 | 15,162,728,003.09 | 持有待售负债 | | | |
| 持有待售资产 | | | | 预计负债 | | 14,900,556.86 | 39,999,376.78 |
| 金融投资： | | | | 长期借款 | | | |
| 交易性金融资产 | | 177,283,539,063.64 | 151,058,135,776.53 | 应付债券 | | 67,483,659,450.58 | 48,850,436,652.29 |
| 债权投资 | | | | 其中：优先股 | | | |
| 其他债权投资 | | 84,444,910,893.48 | 51,501,472,752.05 | 永续债 | | | |
| 其他权益工具投资 | | 17,131,585,623.41 | 12,286,816,441.63 | 租赁负债 | | 375,022,855.48 | 373,366,610.72 |
| 长期股权投资 | 1 | 12,524,770,999.09 | 11,943,045,161.33 | 递延收益 | | 119,337,931.44 | 122,813,793.48 |
| 投资性房地产 | | 358,837,352.61 | 365,782,045.02 | 递延所得税负债 | | 529,483,062.75 | 48,696,290.62 |
| 固定资产 | | 2,336,306,735.45 | 2,532,862,672.38 | 其他负债 | | 946,368,211.91 | 839,473,667.19 |
| 在建工程 | | 52,426,063.60 | 20,569,441.48 | 负债合计 | | 326,391,308,706.47 | 270,723,281,856.51 |
| 使用权资产 | | 379,625,432.77 | 379,582,832.77 | 所有者权益(或股东权益)： | | | |
| 无形资产 | | 746,943,982.50 | 698,276,895.14 | 股本 | | 9,612,429,377.00 | 9,612,429,377.00 |
| 其中：交易席位费 | | 29,752,745.38 | 29,752,745.38 | 其他权益工具 | | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 |
| 商誉 | | | | 其中：优先股 | | | |
| 递延所得税资产 | | 2,334,712,419.20 | 2,490,705,363.70 | 永续债 | | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 |
| 其他资产 | | 906,865,239.62 | 413,554,776.18 | 资本公积 | | 20,136,393,107.40 | 20,145,856,411.46 |
| | | | | 减：库存股 | | | |
| | | | | 其他综合收益 | | 721,134,132.62 | -421,887,827.51 |
| | | | | 盈余公积 | | 4,867,817,456.10 | 4,867,817,456.10 |
| | | | | 一般风险准备 | | 17,312,941,842.29 | 16,096,939,082.36 |
| | | | | 未分配利润 | | 24,927,167,439.27 | 24,083,194,642.51 |
| | | | | 所有者权益合计 | | 107,577,883,354.68 | 104,384,349,141.92 |
| 资产总计 | | 433,969,192,061.15 | 375,107,630,998.43 | 负债和所有者权益总计 | | 433,969,192,061.15 | 375,107,630,998.43 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

合并利润表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------------|-----|-------------------|-------------------|
| 一、营业总收入 | | 17,316,868,517.36 | 15,875,768,261.85 |
| 利息净收入 | 1 | 1,747,757,961.76 | 1,829,626,770.68 |
| 其中：利息收入 | | 7,547,906,445.30 | 7,072,845,943.40 |
| 利息支出 | | 5,800,148,483.54 | 5,243,219,172.72 |
| 手续费及佣金净收入 | 2 | 6,470,707,309.43 | 7,577,259,640.42 |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | | 4,354,518,099.23 | 5,129,294,976.16 |
| 投资银行业务手续费净收入 | | 1,362,985,508.44 | 1,815,715,414.70 |
| 资产管理业务手续费净收入 | | 495,521,341.63 | 321,244,982.02 |
| 投资收益（亏损总额以“-”号填列） | 3 | 5,327,390,132.62 | 7,272,208,200.33 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | 390,972,141.16 | 482,932,846.97 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | | |
| 净敞口套期收益 | | | |
| 其他收益 | 4 | 34,654,783.73 | 44,949,772.78 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 5 | 1,289,034,674.99 | -2,970,734,030.62 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -38,467,342.91 | 3,426,328.32 |
| 其他业务收入 | 6 | 2,484,205,533.18 | 2,116,933,142.59 |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列） | | 1,585,464.56 | 2,098,437.35 |
| 二、营业总支出 | | 10,470,106,656.54 | 9,780,682,878.94 |
| 税金及附加 | 7 | 124,335,868.53 | 125,581,225.36 |
| 业务及管理费 | 8 | 7,522,905,263.13 | 7,317,440,687.21 |
| 信用减值损失 | 9 | 361,576,576.76 | 250,845,439.24 |
| 其他资产减值损失 | 10 | | 2,191,066.98 |
| 其他业务成本 | 11 | 2,461,288,948.12 | 2,084,624,460.15 |
| 三、营业利润（亏损总额以“-”号填列） | | 6,846,761,860.82 | 6,095,085,382.91 |
| 加：营业外收入 | 12 | 39,972,187.43 | 82,949,064.35 |
| 减：营业外支出 | 13 | 31,577,683.61 | -44,130,817.08 |
| 四、利润总额（净亏损以“-”号填列） | | 6,855,156,364.64 | 6,222,165,264.34 |
| 减：所得税费用 | 14 | 427,862,261.50 | 137,575,465.57 |

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------------|-------|------------------|------------------|
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,427,294,103.14 | 6,084,589,798.77 |
| （一）按经营持续性分类： | | | |
| 1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,427,294,103.14 | 6,084,589,798.77 |
| 2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | | |
| （二）按所有权归属分类： | | | |
| 1. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,427,294,103.14 | 6,087,994,695.35 |
| 2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列） | | | -3,404,896.58 |
| 六、其他综合收益的税后净额 | | 1,028,516,831.15 | -385,923,788.79 |
| 归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额 | | 1,028,516,831.15 | -385,923,788.79 |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益 | | 623,303,767.36 | -439,992,935.50 |
| 1. 重新计量设定受益计划变动额 | | | |
| 2. 权益法下不能转损益的其他综合收益 | | | |
| 3. 其他权益工具投资公允价值变动 | | 623,303,767.36 | -439,992,935.50 |
| 4. 企业自身信用风险公允价值变动 | | | |
| 5. 其他 | | | |
| （二）将重分类进损益的其他综合收益 | | 405,213,063.79 | 54,069,146.71 |
| 1. 权益法下可转损益的其他综合收益 | | -1,520,834.00 | 821,378.50 |
| 2. 其他债权投资公允价值变动 | | 414,821,961.51 | 42,689,062.37 |
| 3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额 | | | |
| 4. 其他债权投资信用减值准备 | | -28,041,584.07 | -84,561,914.04 |
| 5. 现金流量套期储备 | | | -15,537,974.68 |
| 6. 外币财务报表折算差额 | | 19,953,520.35 | 110,658,594.56 |
| 7. 其他 | | | |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额 | | | |
| 七、综合收益总额 | | 7,455,810,934.29 | 5,698,666,009.98 |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额 | | 7,455,810,934.29 | 5,702,070,906.56 |
| 归属于少数股东的综合收益总额 | | | -3,404,896.58 |
| 八、每股收益： | | | |
| （一）基本每股收益 | 十五（二） | 0.54 | 0.52 |
| （二）稀释每股收益 | 十五（二） | 0.54 | 0.52 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

母公司利润表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------------|-----|-------------------|-------------------|
| 一、营业总收入 | | 13,781,401,061.48 | 13,340,769,767.26 |
| 利息净收入 | 1 | 1,491,107,398.97 | 1,544,612,737.67 |
| 其中：利息收入 | | 7,167,710,625.23 | 6,775,811,647.50 |
| 利息支出 | | 5,676,603,226.26 | 5,231,198,909.83 |
| 手续费及佣金净收入 | 2 | 6,167,505,871.45 | 7,201,565,697.86 |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | | 4,077,520,638.27 | 4,834,906,276.98 |
| 投资银行业务手续费净收入 | | 1,339,924,584.77 | 1,783,895,521.04 |
| 资产管理业务手续费净收入 | | 522,985,361.79 | 319,213,777.41 |
| 投资收益（亏损总额以“-”号填列） | 3 | 4,754,390,297.13 | 7,097,801,280.62 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | 369,431,013.56 | 494,810,235.12 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | | |
| 净敞口套期收益 | | | |
| 其他收益 | | 33,507,621.13 | 44,113,040.58 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 4 | 1,274,130,825.18 | -2,614,649,931.70 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 2,352,253.51 | 10,981,865.27 |
| 其他业务收入 | | 56,824,794.14 | 54,417,224.43 |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列） | | 1,581,999.97 | 1,927,852.53 |
| 二、营业总支出 | | 7,500,053,350.56 | 7,240,007,251.31 |
| 税金及附加 | | 117,872,719.96 | 117,219,940.13 |
| 业务及管理费 | 5 | 7,017,440,619.04 | 6,849,008,107.61 |
| 信用减值损失 | | 352,169,989.93 | 261,241,006.75 |
| 其他资产减值损失 | | | |
| 其他业务成本 | | 12,570,021.63 | 12,538,196.82 |
| 三、营业利润（亏损总额以“-”号填列） | | 6,281,347,710.92 | 6,100,762,515.95 |
| 加：营业外收入 | | 29,356,042.33 | 47,180,203.72 |
| 减：营业外支出 | | 30,231,275.36 | -39,014,042.71 |
| 四、利润总额（净亏损以“-”号填列） | | 6,280,472,477.89 | 6,186,956,762.38 |
| 减：所得税费用 | | 271,314,369.93 | -13,861,357.58 |

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------|-----|------------------|------------------|
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,009,158,107.96 | 6,200,818,119.96 |
| （一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,009,158,107.96 | 6,200,818,119.96 |
| （二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | | |
| 六、其他综合收益的税后净额 | | 1,065,695,340.65 | -418,326,422.07 |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益 | | 680,435,797.21 | -377,274,948.90 |
| 1. 重新计量设定受益计划变动额 | | | |
| 2. 权益法下不能转损益的其他综合收益 | | | |
| 3. 其他权益工具投资公允价值变动 | | 680,435,797.21 | -377,274,948.90 |
| 4. 企业自身信用风险公允价值变动 | | | |
| 5. 其他 | | | |
| （二）将重分类进损益的其他综合收益 | | 385,259,543.44 | -41,051,473.17 |
| 1. 权益法下可转损益的其他综合收益 | | -1,520,834.00 | 821,378.50 |
| 2. 其他债权投资公允价值变动 | | 414,821,961.51 | 42,689,062.37 |
| 3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额 | | | |
| 4. 其他债权投资信用减值准备 | | -28,041,584.07 | -84,561,914.04 |
| 5. 现金流量套期储备 | | | |
| 6. 外币财务报表折算差额 | | | |
| 7. 其他 | | | |
| 七、综合收益总额 | | 7,074,853,448.61 | 5,782,491,697.89 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

合并现金流量表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------------|-----|--------------------|-------------------|
| 一、经营活动产生的现金流量： | | | |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额 | | | 2,971,760,916.19 |
| 其他权益工具投资净减少额 | | | |
| 收取利息、手续费及佣金的现金 | | 14,562,330,829.94 | 15,991,875,317.46 |
| 拆入资金净增加额 | | | 4,555,000,000.00 |
| 融出资金净减少额 | | | 9,366,599,012.04 |
| 回购业务资金净增加额 | | 17,597,941,567.73 | 8,510,918,688.41 |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | | |
| 代理承销证券收到的现金净额 | | 44,000,000.00 | |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | 1 | 9,834,028,209.77 | 3,059,354,299.49 |
| 经营活动现金流入小计 | | 42,038,300,607.44 | 44,455,508,233.59 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | | 27,793,080,568.33 | |
| 债权投资净增加额 | | 222,632,046.75 | 71,354,630.48 |
| 其他债权投资净增加额 | | 30,370,270,167.16 | 20,742,134,631.48 |
| 拆入资金净减少额 | | 1,990,000,000.00 | |
| 融出资金净增加额 | | 3,072,537,911.99 | |
| 其他权益工具投资净增加额 | | 3,015,261,079.20 | 2,998,251,896.64 |
| 代理买卖证券支付的现金净额 | | 3,341,347,828.50 | 8,016,057,485.03 |
| 代理承销证券支付的现金净额 | | | 27,000,000.00 |
| 支付利息、手续费及佣金的现金 | | 4,942,038,907.00 | 4,461,253,580.76 |
| 支付给职工以及为职工支付的现金 | | 5,908,331,157.31 | 6,033,072,086.65 |
| 支付的各项税费 | | 1,782,756,880.17 | 2,028,973,041.83 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | 2 | 7,455,643,716.59 | 7,418,927,219.74 |
| 经营活动现金流出小计 | | 89,893,900,263.00 | 51,797,024,572.61 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 4 | -47,855,599,655.56 | -7,341,516,339.02 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | |
| 收回投资收到的现金 | | 25,424,284.65 | 109,145,350.34 |
| 取得投资收益收到的现金 | | 343,110,499.50 | 526,670,921.27 |

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------------------|-----|--------------------|-------------------|
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | 3,415,550.45 | 6,539,711.01 |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额 | | | |
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流入小计 | | 371,950,334.60 | 642,355,982.62 |
| 投资支付的现金 | | 102,982,460.00 | 59,250,000.00 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | | 415,440,750.81 | 595,852,178.91 |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额 | | | |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流出小计 | | 518,423,210.81 | 655,102,178.91 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | -146,472,876.21 | -12,746,196.29 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | | 10,000,000,000.00 |
| 其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金 | | | |
| 取得借款收到的现金 | | 245,378,809.09 | 524,892,926.84 |
| 发行债券收到的现金 | | 116,350,400,000.00 | 62,326,927,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流入小计 | | 116,595,778,809.09 | 72,851,819,926.84 |
| 偿还债务支付的现金 | | 65,016,398,394.42 | 62,651,956,578.89 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | | 6,206,000,493.10 | 8,091,907,147.00 |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润 | | | 4,569,686.67 |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | 3 | 310,283,468.05 | 262,331,617.94 |
| 筹资活动现金流出小计 | | 71,532,682,355.57 | 71,006,195,343.83 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | 45,063,096,453.52 | 1,845,624,583.01 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | | -3,183,472.32 | 251,809,092.40 |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | 4 | -2,942,159,550.57 | -5,256,828,859.90 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | 5 | 79,357,424,451.21 | 84,614,253,311.11 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | 5 | 76,415,264,900.64 | 79,357,424,451.21 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

母公司现金流量表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------------------|-----|--------------------|-------------------|
| 一、经营活动产生的现金流量： | | | |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额 | | 3,549,884,130.29 | 4,791,209,102.02 |
| 其他权益工具投资净减少额 | | | |
| 收取利息、手续费及佣金的现金 | | 13,275,946,548.08 | 14,698,209,430.63 |
| 拆入资金净增加额 | | | 4,555,000,000.00 |
| 融出资金净减少额 | | | 9,233,077,394.19 |
| 回购业务资金净增加额 | | 8,494,959,332.88 | 9,106,554,367.63 |
| 代理承销证券收到的现金净额 | | 44,000,000.00 | |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | | |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | | 4,563,971,671.19 | 301,626,538.85 |
| 经营活动现金流入小计 | | 29,928,761,682.44 | 42,685,676,833.32 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | | | |
| 其他债权投资净增加额 | | 30,370,270,167.16 | 20,742,134,631.48 |
| 其他权益工具投资净增加额 | | 3,015,261,079.20 | 2,998,251,896.64 |
| 拆入资金净减少额 | | 1,990,000,000.00 | |
| 融出资金净增加额 | | 3,110,016,525.63 | |
| 代理承销证券支付的现金净额 | | | 27,000,000.00 |
| 代理买卖证券支付的现金净额 | | 3,047,760,460.03 | 7,855,053,329.96 |
| 支付利息、手续费及佣金的现金 | | 4,230,494,986.47 | 3,868,067,168.03 |
| 支付给职工以及为职工支付的现金 | | 5,571,297,788.09 | 5,702,499,314.44 |
| 支付的各项税费 | | 1,568,069,967.08 | 1,627,869,873.55 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | | 2,004,984,197.74 | 5,728,189,183.13 |
| 经营活动现金流出小计 | | 54,908,155,171.40 | 48,549,065,397.23 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | | -24,979,393,488.96 | -5,863,388,563.91 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | |
| 收回投资收到的现金 | | 5,392,212,501.28 | 1,368,527,946.99 |
| 取得投资收益收到的现金 | | 386,155,000.00 | 975,324,436.20 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | 3,333,445.23 | 6,301,218.30 |

| 项目 | 注释号 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------------------|-----|--------------------|-------------------|
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流入小计 | | 5,781,700,946.51 | 2,350,153,601.49 |
| 投资支付的现金 | | 27,430,140,000.06 | 5,699,300,000.01 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | | 401,777,538.71 | 579,262,030.67 |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流出小计 | | 27,831,917,538.77 | 6,278,562,030.68 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | -22,050,216,592.26 | -3,928,408,429.19 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | | 10,000,000,000.00 |
| 取得借款收到的现金 | | | |
| 发行债券收到的现金 | | 116,350,400,000.00 | 62,326,927,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流入小计 | | 116,350,400,000.00 | 72,326,927,000.00 |
| 偿还债务支付的现金 | | 64,774,634,000.00 | 61,897,188,000.00 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | | 6,203,168,763.29 | 8,061,820,611.75 |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | | 286,632,452.46 | 232,669,847.08 |
| 筹资活动现金流出小计 | | 71,264,435,215.75 | 70,191,678,458.83 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | 45,085,964,784.25 | 2,135,248,541.17 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | | 2,352,253.51 | 10,981,865.27 |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | | -1,941,293,043.46 | -7,645,566,586.66 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | | 65,634,734,218.72 | 73,280,300,805.38 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | | 63,693,441,175.26 | 65,634,734,218.72 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

合并所有者权益变动表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 本期数 | | | | | | | | | | | |
|-----------------------|------------------|---------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------|----------------|--------------------|
| | 归属于母公司所有者权益 | | | | | 少数股东权益 | | | 所有者权益合计 | | | |
| | 股本 | 其他权益工具 优先股 | 永续债 | 其他 | 资本公积 | 减： 库存股 | 其他综合收益 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 少数 股东 权益 | 所有者权益合计 |
| 一、上年年末余额 | 9,612,429,377.00 | | 30,000,000,000.00 | 20,146,238,607.58 | 20,146,238,607.58 | -359,835,343.82 | 4,867,817,456.10 | 16,330,816,087.88 | 26,287,566,218.23 | | | 106,885,032,402.97 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | | | |
| 同一控制下企业合并 | | | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | | | |
| 二、本年初余额 | 9,612,429,377.00 | | 30,000,000,000.00 | 20,146,238,607.58 | 20,146,238,607.58 | -359,835,343.82 | 4,867,817,456.10 | 16,330,816,087.88 | 26,287,566,218.23 | | | 106,885,032,402.97 |
| 三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列) | | | | -9,463,304.06 | | 1,127,345,315.04 | | 1,240,657,159.83 | 1,215,952,527.63 | | | 3,574,491,698.44 |
| (一) 综合收益总额 | | | | | | 1,028,516,831.15 | | | 6,427,294,103.14 | | | 7,455,810,934.29 |
| (二) 所有者投入和减少资本 | | | | | | | | | | | | |
| 1.所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | | | |
| 2.其他权益工具持有者投入资本 | | | | | | | | | | | | |
| 3.股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | | |
| 4.其他 | | | | | | | | | | | | |
| (三) 利润分配 | | | | | | | | 1,240,657,159.83 | -5,112,513,091.62 | | | -3,871,855,931.79 |
| 1.提取盈余公积 | | | | | | | | 1,240,657,159.83 | | | | |
| 2.提取一般风险准备 | | | | | | | | | -1,240,657,159.83 | | | |
| 3.对所有者(或股东)的分配 | | | | | | | | | -2,595,355,931.79 | | | -2,595,355,931.79 |
| 4.其他 | | | | | | | | | -1,276,500,000.00 | | | -1,276,500,000.00 |

| 项目 | 本期数 | | | | | | | | | |
|--------------------|------------------|-----|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|----------------|--------------------|
| | 归属于母公司所有者权益 | | | | | 少数股东权益 | | | | |
| | 股本 | 优先股 | 其他权益工具 永续债 其他 | 资本公积 | 减： 库存股 | 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 |
| (四) 所有者权益内部结转 | | | | 98,828,483.89 | | | | | -98,828,483.89 | |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) | | | | | | | | | | |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) | | | | | | | | | | |
| 3. 盈余公积弥补亏损 | | | | | | | | | | |
| 4. 设定受益计划变动额结转留存收益 | | | | | | | | | | |
| 5. 其他综合收益结转留存收益 | | | | 98,828,483.89 | | | | | -98,828,483.89 | |
| 6. 其他 | | | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | -9,463,304.06 | | | | | | -9,463,304.06 |
| 四、本期末余额 | 9,612,429,377.00 | | 30,000,000,000.00 | 20,136,775,303.52 | 767,509,971.22 | 4,867,817,456.10 | 17,571,473,247.71 | 27,503,518,745.86 | | 110,459,524,101.41 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

合并所有者权益变动表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 上年同期数 | | | | | | | 所有者权益合计 | | | |
|-----------------------|------------------|--------|-------------------|-------------------|------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| | 归属于母公司所有者权益 | | | 其他综合收益 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | | 少数股东权益 | | |
| 股本 | 优先股 | 其他权益工具 | 资本公积 | | | | | 减：库存股 | | 其他权益 | 所有者权益合计 |
| | | | | | | | | | | | |
| 一、上年年末余额 | 9,612,429,377.00 | | 20,000,000,000.00 | 20,155,672,569.84 | | -57,553,022.01 | 4,867,817,456.10 | 14,748,272,660.25 | 27,583,471,105.99 | 16,809,304.09 | 96,926,919,451.26 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | | |
| 正 | | | | | | | | | | | |
| 同一控制下企业合并 | | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | | |
| 二、本年初余额 | 9,612,429,377.00 | | 20,000,000,000.00 | 20,155,672,569.84 | | -57,553,022.01 | 4,867,817,456.10 | 14,748,272,660.25 | 27,583,471,105.99 | 16,809,304.09 | 96,926,919,451.26 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列） | | | 10,000,000,000.00 | -9,433,962.26 | | -302,282,321.81 | | 1,582,543,427.63 | -1,295,904,887.76 | -16,809,304.09 | 9,958,112,951.71 |
| （一）综合收益总额 | | | | | | -385,923,788.79 | | 6,087,994,695.35 | | -3,404,896.58 | 5,698,666,009.98 |
| （二）所有者投入和减少资本 | | | 10,000,000,000.00 | | | | | | | -8,834,720.84 | 9,991,165,279.16 |
| 1.所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | -8,834,720.84 | -8,834,720.84 |
| 2.其他权益工具持有者投入资本 | | | 10,000,000,000.00 | | | | | | | | 10,000,000,000.00 |
| 3.股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | |
| 4.其他 | | | | | | | | | | | |
| （三）利润分配 | | | | | | | | 1,582,543,427.63 | -7,300,258,116.13 | -4,569,686.67 | -5,722,284,375.17 |

| 项目 | 上年同期数 | | | | | | |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| | 股本 | 其他权益工具 | 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 |
| | 优先股 | 永续债 | 库存股 | | | | |
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | 1,582,543,427.63 | -1,582,543,427.63 | |
| 3. 对所有者(或股东)的分配 | | | | | -4,806,214,688.50 | -4,569,686.67 | -4,810,784,375.17 |
| 4. 其他 | | | | | -911,500,000.00 | | -911,500,000.00 |
| (四) 所有者权益内部结转 | | | | 83,641,466.98 | | | -83,641,466.98 |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) | | | | | | | |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) | | | | | | | |
| 3. 盈余公积弥补亏损 | | | | | | | |
| 4. 设定受益计划变动额结转留存收益 | | | | | | | |
| 5. 其他综合收益结转留存收益 | | | | 83,641,466.98 | | | -83,641,466.98 |
| 6. 其他 | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | -9,433,962.26 | | | -9,433,962.26 |
| 四、本期末余额 | 9,612,429,377.00 | 30,000,000,000.00 | 20,146,238,607.58 | -359,835,343.82 | 4,867,817,456.10 | 16,330,816,087.88 | 26,287,566,218.23 |
| 额 | | | | | | | 106,885,032,402.97 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

母公司所有者权益变动表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 上期数 | | | | 本期数 | | | | | | |
|-----------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|
| | 股本 | 其他权益工具 优先股 | 永续债 | 其他 | 资本公积 | 减： 库存股 | 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、上年年末余额 | 9,612,429,377.00 | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 | 201,458,564,111.46 | 201,458,564,111.46 | -421,887,827.51 | 4,867,817,456.10 | 16,096,939,082.36 | 24,083,194,642.51 | 104,384,349,141.92 | |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | | |
| 二、本年期初余额 | 9,612,429,377.00 | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 | 201,458,564,111.46 | 201,458,564,111.46 | -421,887,827.51 | 4,867,817,456.10 | 16,096,939,082.36 | 24,083,194,642.51 | 104,384,349,141.92 | |
| 三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列) | | | | -9,463,304.06 | | 1,143,021,960.13 | | 1,216,002,759.93 | | 843,972,796.76 | 3,193,534,212.76 |
| (一) 综合收益总额 | | | | | | 1,065,695,340.65 | | | | 6,009,158,107.96 | 7,074,853,448.61 |
| (二) 所有者投入和减少资本 | | | | | | | | | | | |
| 1. 所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | | |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | | | | | | | | | | | |
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | | |
| (三) 利润分配 | | | | | | | | 1,216,002,759.93 | | -5,087,858,691.72 | -3,871,855,931.79 |
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | | | | 1,216,002,759.93 | | -1,216,002,759.93 | |
| 3. 对所有者(或股东)的分配 | | | | | | | | | | -2,595,355,931.79 | -2,595,355,931.79 |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | -1,276,500,000.00 | -1,276,500,000.00 |
| (四) 所有者权益内部结转 | | | | | | | | | | -77,326,619.48 | -77,326,619.48 |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) | | | | | | | | | | | |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) | | | | | | | | | | | |
| 3. 盈余公积弥补亏损 | | | | | | | | | | | |
| 4. 设定受益计划变动额结转留存收益 | | | | | | | | | | | |
| 5. 其他综合收益结转留存收益 | | | | | | | | | | -77,326,619.48 | -77,326,619.48 |
| 6. 其他 | | | | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | -9,463,304.06 | | | | | | | -9,463,304.06 |
| 四、本期末余额 | 9,612,429,377.00 | 30,000,000,000.00 | 30,000,000,000.00 | 201,364,250,807.40 | 201,364,250,807.40 | 721,134,132.62 | 4,867,817,456.10 | 17,312,941,842.29 | 24,927,167,439.27 | 107,577,883,354.68 | |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

母公司所有者权益变动表

2023 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

| 项目 | 上年同期数 | | | | | | | |
|-----------------------|------------------|-------------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| | 股本 | 其他权益工具 优先股 | 永续债 | 其他 | 减： 库存股 | | | |
| | | | 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、上年年末余额 | 9,612,429,377.00 | 20,000,000,000.00 | 20,155,290,373.72 | -40,468,129.77 | 4,867,817,456.10 | 14,748,272,660.25 | 24,985,664,357.49 | 94,329,006,094.79 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | |
| 二、本年初余额 | 9,612,429,377.00 | 20,000,000,000.00 | 20,155,290,373.72 | -40,468,129.77 | 4,867,817,456.10 | 14,748,272,660.25 | 24,985,664,357.49 | 94,329,006,094.79 |
| 三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列) | | 10,000,000,000.00 | -9,433,962.26 | -381,419,697.74 | | 1,348,666,422.11 | -902,469,714.98 | 10,055,343,047.13 |
| (一) 综合收益总额 | | | | -418,326,422.07 | | 6,200,818,119.96 | | 5,782,491,697.89 |
| (二) 所有者投入和减少资本 | | 10,000,000,000.00 | | | | | | 10,000,000,000.00 |
| 1. 所有者投入的普通股 | | | | | | | | |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | | 10,000,000,000.00 | | | | | | 10,000,000,000.00 |
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | |
| 4. 其他 | | | | | | | | |
| (三) 利润分配 | | | | | | 1,348,666,422.11 | -7,066,381,110.61 | -5,717,714,688.50 |
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | | 1,348,666,422.11 | -1,348,666,422.11 | |
| 3. 对所有者(或股东)的分配 | | | | | | | -4,806,214,688.50 | -4,806,214,688.50 |
| 4. 其他 | | | | | | | -911,500,000.00 | -911,500,000.00 |
| (四) 所有者权益内部结转 | | | | 36,906,724.33 | | | | -36,906,724.33 |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) | | | | | | | | |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) | | | | | | | | |
| 3. 盈余公积弥补亏损 | | | | | | | | |
| 4. 设定受益计划变动额结转留存收益 | | | | | | | | |
| 5. 其他综合收益结转留存收益 | | | | 36,906,724.33 | | | | -36,906,724.33 |
| 6. 其他 | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | -9,433,962.26 | | | | -9,433,962.26 |
| 四、本期期末余额 | 9,612,429,377.00 | 30,000,000,000.00 | 20,145,856,411.46 | -421,887,827.51 | 4,867,817,456.10 | 16,096,939,082.36 | 24,083,194,642.51 | 104,384,349,141.92 |

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

国信证券股份有限公司 财务报表附注 2023 年度

金额单位：人民币元

一、公司基本情况

国信证券股份有限公司（以下简称公司或本公司）系经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准，由国信证券有限责任公司整体改制设立，于 2008 年 3 月 25 日在深圳市工商行政管理局登记注册，总部位于广东省深圳市。公司现持有统一社会信用代码为 914403001922784445 的营业执照，注册资本为人民币 9,612,429,377.00 元，股本总数 9,612,429,377 股（每股面值 1 元）。其中，有限售条件的 A 股流通股份 473,587,570 股；无限售条件的 A 股流通股份 9,138,841,807 股。公司股票已于 2014 年 12 月 29 日在深圳证券交易所挂牌交易。

本公司主要经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；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；股票期权做市；上市证券做市交易。

本公司的母公司为深圳市投资控股有限公司（以下简称深圳投控公司）。

截至 2023 年 12 月 31 日，公司拥有 10 家子公司（含全资子公司），57 家分公司，181 家证券营业部；拥有员工 12,027 人，其中关键高级管理人员 13 人。

本财务报表业经公司 2024 年 4 月 16 日第五届董事会第二十六次会议批准对外报出。

二、财务报表的编制基础

（一）编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

（二）持续经营能力评价

本公司不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况。

三、重要会计政策及会计估计

重要提示：本公司根据实际生产经营特点针对金融工具减值、收入确认、买入返售及卖出回购金融资产、融资融券业务的核算、转融通业务等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

（一）遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了企业的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

（二）会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

（三）记账本位币

本公司及境内子公司采用人民币为记账本位币，国信证券（香港）金融控股有限公司（以下简称国信香港公司）等境外子公司从事境外经营，选择其经营所处的主要经济环境中的货币为记账本位币。

（四）重要性标准确定方法和选择依据

公司根据自身所处的具体环境，从项目的性质和金额两方面判断财务信息的重要性。在判断项目性质的重要性时，公司主要考虑该项目在性质上是否属于日常活动、是否显著影响公司的财务状况、经营成果和现金流量等因素；在判断项目金额大小的重要性时，公司考虑该项目金额占资产总额、负债总额、所有者权益总额、营业收入总额、营业成本总额、净利润、综合收益总额等直接相关项目金额的比重或所属报表明列项目金额的比重。

（五）非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；如果合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益。

（六）控制的判断标准和合并财务报表的编制方法

1. 控制的判断

拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方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可变回报金额的，认定为控制。

2. 合并财务报表的编制方法

母公司将其控制的所有子公司纳入合并财务报表的合并范围。合并财务报表以母公司及其子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，由母公司按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》编制。

(七) 合营安排分类及共同经营会计处理方法

1. 合营安排分为共同经营和合营企业。
2. 当公司为共同经营的合营方时，确认与共同经营中利益份额相关的下列项目：
 - (1) 确认单独所持有的资产，以及按持有份额确认共同持有的资产；
 - (2) 确认单独所承担的负债，以及按持有份额确认共同承担的负债；
 - (3) 确认出售公司享有的共同经营产出份额所产生的收入；
 - (4) 按公司持有份额确认共同经营因出售资产所产生的收入；
 - (5) 确认单独所发生的费用，以及按公司持有份额确认共同经营发生的费用。

(八) 现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

(九) 外币业务和外币报表折算

1. 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，计入当期损益；以历史成本计量的外币非货币性项目仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其人民币金额；以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，差额计入当期损益或其他综合收益。

2. 外币财务报表折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

(十) 客户交易结算资金

公司收到的客户交易结算资金存放在存管银行的专门账户上，与自有资金分开管理，为代理客户证券交易而进行资金清算与交收的款项存入交易所指定的清算代理机构，在结算备付金中核算。公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为资产及负债，公司代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时，按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等相关费用确认为手续费支出，按规定向客户收取的手续费，在与客户办理买卖证券款项清算时确认为手续费收入。

（十一）金融工具

1. 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；（3）不属于上述（1）或（2）的财务担保合同，以及不属于上述（1）并以低于市场利率贷款的贷款承诺；（4）以摊余成本计量的金融负债。

2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

（1）金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第14号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

（2）金融资产的后续计量方法

1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

（3）金融负债的后续计量方法

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》相关规定进行计量。

3) 不属于上述 1) 或 2) 的财务担保合同，以及不属于上述 1) 并以低于市场利率贷款的贷款承诺

在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：① 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；② 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

4) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

(4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：（1）未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；（2）保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）所转移金融资产在终止确认日的账面价值；（2）因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）终止确认部分的账面价值；（2）

终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。

4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

（1）第一层次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；

（2）第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

（3）第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

5. 金融工具减值

（1）金融工具减值计量和会计处理

公司以预期信用损失为基础，对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的债务工具投资、合同资产、租赁应收款、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以外的贷款承诺、不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债或不属于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债的财务担保合同进行减值处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指公司按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于公司购买或源生的已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，公司在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。

对于由《企业会计准则第14号——收入》规范的交易形成，且不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，公司按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，公司按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

公司利用可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

于资产负债表日，若公司判断金融工具只具有较低的信用风险，则假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著

增加。

公司判断金融工具是否已违约，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。如果金融工具逾期超过 30 天，则公司将其界定为违约。

公司判断金融工具已发生信用减值的依据，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，公司将该金融资产界定为已发生信用减值：

- 1) 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 2) 债务人发生重大财务困难；
- 3) 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- 4) 债务人很可能破产或存在其他财务重组等事项；
- 5) 以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实；
- 6) 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 7) 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别。

公司以单项金融工具或金融工具组合为基础评估预期信用风险和计量预期信用损失。当以金融工具组合为基础时，公司以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组合。

公司在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，公司在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

(2) 按组合评估预期信用风险并采用三阶段模型计量预期信用损失的金融工具

| 项目 | 确定组合的依据 | 计量预期信用损失的方法 |
|-------------------------|---------|---|
| 融出资金——融资融券业务 | 业务性质 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、预期信用损失率和前瞻性信息计算预期信用损失。 |
| 买入返售金融资产——约定购回、行权融资和小微通 | 业务性质 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、预期信用损失率和前瞻性信息计算预期信用损失。 |
| 融出资金——孖展业务 | 业务性质 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。 |
| 融出资金——限制性股票融资业务 | 业务性质 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。 |
| 其他债权投资——国债、政策性金融债、央票 | 风险特征 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。 |
| 其他债权投资——信用债以及地方政府债 | 风险特征 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。 |
| 其他应收款——应收往来款组合 | 款项性质 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。 |
| 其他应收款——应收押金保证金组合 | 款项性质 | 根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。 |

(3) 采用简化计量方法，按组合计量预期信用损失的金融工具

| 项目 | 确定组合的依据 | 计量预期信用损失的方法 |
|--------------|---------|---|
| 应收款项——账龄组合 | 应收款账龄 | |
| 应收款项——特定款项组合 | 款项性质 | 参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。 |
| 合同资产——账龄组合 | 合同账龄 | |
| 合同资产——特定款项组合 | 款项性质 | |

6. 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，公司以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：（1）公司具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；（2）公司计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，公司不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

（十二）合同成本

与合同成本有关的资产包括合同取得成本和合同履约成本。

公司为取得合同发生的增量成本预期能够收回的，作为合同取得成本确认为一项资产。如果合同取得成本的摊销期限不超过一年，在发生时直接计入当期损益。

公司为履行合同发生的成本，不适用存货、固定资产或无形资产等相关准则的规范范围且同时满足下列条件的，作为合同履约成本确认为一项资产：

1. 该成本与一份当前或预期取得的合同直接相关，包括直接人工、直接材料、制造费用（或类似费用）、明确由客户承担的成本以及仅因该合同而发生的其他成本；
2. 该成本增加了公司未来用于履行履约义务的资源；
3. 该成本预期能够收回。

公司对于与合同成本有关的资产采用与该资产相关的商品或服务收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。

如果与合同成本有关的资产的账面价值高于因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本，公司对超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失。以前期间减值的因素之后发生变化，使得转让该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本高于该资产账面价值的，转回原已计提的资产减值准备，并计入当期损益，但转回后的资产账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该资产在转回日的账面价值。

（十三）证券承销业务

公司证券承销的方式包括余额包销和代销。在余额包销方式下，对发行期结束后未售出的证券按约定的发行价格转为交易性金融资产等。

公司将发行相关的费用计入当期损益。

(十四) 买入返售与卖出回购款项

买入返售交易是指按照合同或协议以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括债券及票据），合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售按买入返售相关资产时实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”项目列示。

卖出回购交易是指按照合同或协议以一定的价格将相关的资产（包括债券和票据）出售给交易对手，到合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购按卖出回购相关资产时实际收到的款项入账，在资产负债表“卖出回购金融资产款”项目列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内，并按照相关的会计政策核算。

买入返售及卖出回购的利息收支，在返售或回购期间内以实际利率确认。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收支。

(十五) 客户资产管理

公司客户资产管理业务分为单一资产管理业务、集合资产管理业务、专项资产管理业务。

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。对集合资产管理业务产品的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表内反映，在财务报表附注中列示，详见本财务报表附注五（四）3之说明。

(十六) 融资融券业务

融资融券业务，是指公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。公司发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

融资业务，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理。公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，融出的证券按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》有关规定，不终止确认该证券，并确认相应利息收入。

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

公司根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

(十七) 转融通业务

公司通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由公司享有或承担，不将其计入资产负债表。

（十八）长期股权投资

1. 共同控制、重大影响的判断

按照相关约定对某项安排存在共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，认定为共同控制。对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定，认定为重大影响。

2. 投资成本的确定

（1）同一控制下的企业合并形成的，合并方以支付现金、转让非现金资产、承担债务或发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为其初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价的账面价值或发行股份的面值总额之间的差额调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

公司通过多次交易分步实现同一控制下企业合并形成的长期股权投资，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，在合并日，根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额确定初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

（2）非同一控制下的企业合并形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

公司通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

1) 在个别财务报表中，按照原持有的股权投资的账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

2) 在合并财务报表中，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益等的，与其相关的其他综合收益等转为购买日所属当期收益。但由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

（3）除企业合并形成以外的：以支付现金取得的，按照实际支付的购买价款作为其初始投资成本；以发行权益性证券取得的，按照发行权益性证券的公允价值作为其初始投资成本；以债务重组方式取得的，按《企业会计准则第12号——债务重组》确定其初始投资成本；以非货币性资产交换取得的，按《企业会计准则第7号——非货币性资产交换》确定其初始投资成本。

3. 后续计量及损益确认方法

对被投资单位实施控制的长期股权投资采用成本法核算；对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。

（十九）投资性房地产

1. 投资性房地产包括已出租的建筑物。

2. 投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。房屋及建筑物预计可使用年限及残值率分别为：

| 类别 | 折旧方法 | 折旧年限（年） | 残值率（%） | 年折旧率（%） |
|--------|-------|---------|--------|----------|
| 房屋及建筑物 | 年限平均法 | 30-50 | 5 | 1.9-3.17 |

（二十）固定资产

1. 固定资产确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

2. 各类固定资产的折旧方法

| 类别 | 折旧方法 | 折旧年限（年） | 残值率（%） | 年折旧率（%） |
|---------|-------|---------|--------|----------|
| 房屋及建筑物 | 年限平均法 | 30-50 | 5 | 1.9-3.17 |
| 交通工具 | 年限平均法 | 10 | 5 | 9.5 |
| 电子设备 | 年限平均法 | 3-5 | 5 | 19-31.67 |
| 办公设备及其他 | 年限平均法 | 5 | 5 | 19 |

（二十一）在建工程

1. 在建工程同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量则予以确认。在建工程按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的实际成本计量。

2. 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

| 类别 | 在建工程结转为固定资产的标准和时点 |
|--------|---------------------|
| 机器设备 | 安装调试后达到设计要求或合同规定的标准 |
| 装修工程 | 建造完成交付使用时 |
| 房屋及建筑物 | 工程竣工并通过验收 |

（二十二）借款费用

1. 借款费用资本化的确认原则

公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时确认为费用，计入当期损益。

2. 借款费用资本化期间

(1) 当借款费用同时满足下列条件时，开始资本化：1) 资产支出已经发生；2) 借款费用已经发生；3) 为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

(2) 若符合资本化条件的资产在购建或者生产过程中发生非正常中断，并且中断时间连续超过 3 个月，暂停借款费用的资本化；中断期间发生的借款费用确认为当期费用，直至资产的购建或者生产活动重新开始。

(3) 当所购建或者生产符合资本化条件的资产达到预定可使用或可销售状态时，借款费用停止资本化。

3. 借款费用资本化金额

为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入专门借款的，以专门借款当期实际发生的利息费用（包括按照实际利率法确定的折价或溢价的摊销），减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额，确定应予资本化的利息金额；为购建或者生产符合资本化条件的资产占用了一般借款的，根据累计资产支出超过专门借款的资产支出加权平均数乘以占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。

（二十三）无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、计算机软件及交易席位费等，按成本进行初始计量。

2. 使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销，无法可靠确定预期实现方式的，采用直线法摊销。具体如下：

| 项目 | 使用寿命及其确定依据 | 摊销方法 |
|-------|----------------------------|------|
| 土地使用权 | 40-50 年 / 按照房地产证上的土地使用年限摊销 | 直线法 |
| 计算机软件 | 5 年 / 技术评估 | 直线法 |

购入的交易席位费按取得时的实际成本计价，作为一项使用寿命不确定的无形资产核算。使用寿命不确定的无形资产不摊销，公司在每个会计期间均对该无形资产的使用寿命进行复核。使用寿命不确定的判断依据是：是否在不确定的期间内为企业产生现金流量。

（二十四）部分长期资产减值

对长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、使用权资产和使用寿命有限的无形资产等长期资产，在资产负债表日有迹象表明发生减值的，估计其可收回金额。对因企业合并所形成的商誉和使用寿命不确定的

无形资产，无论是否存在减值迹象，每年都进行减值测试。商誉结合与其相关的资产组或者资产组组合进行减值测试。

若上述长期资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额确认资产减值准备并计入当期损益。

(二十五) 长期待摊费用

长期待摊费用核算已经支出，摊销期限在1年以上（不含1年）的各项费用。长期待摊费用按实际发生额入账，在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

(二十六) 职工薪酬

1. 职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

2. 短期薪酬的会计处理方法

在职工为公司提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

(1) 在职工为公司提供服务的会计期间，根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

1) 根据预期累计福利单位法，采用无偏且相互一致的精算假设对有关人口统计变量和财务变量等作出估计，计量设定受益计划所产生的义务，并确定相关义务的所属期间。同时，对设定受益计划所产生的义务予以折现，以确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本；

2) 设定受益计划存在资产的，将设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。设定受益计划存在盈余的，以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产；

3) 期末，将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分，其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

4. 辞退福利的会计处理方法

向职工提供的辞退福利，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：（1）公司不能单方

面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；(2)公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

5. 其他长期职工福利的会计处理方法

向职工提供的其他长期福利，符合设定提存计划条件的，按照设定提存计划的有关规定进行会计处理；除此之外的其他长期福利，按照设定受益计划的有关规定进行会计处理，为简化相关会计处理，将其产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动等组成项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

(二十七) 预计负债

1. 因对外提供担保、诉讼事项、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务，履行该义务很可能导致经济利益流出公司，且该义务的金额能够可靠的计量时，公司将该项义务确认为预计负债。

2. 公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

(二十八) 永续债等其他金融工具

根据金融工具相关准则、《金融负债与权益工具的区分及相关会计处理规定》（财会〔2014〕13号）和《永续债相关会计处理的规定》（财会〔2019〕2号），对发行的永续债，公司依据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融资产、金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该等金融工具或其组成部分分类为金融资产、金融负债或权益工具。

在资产负债表日，对于归类为权益工具的金融工具，其利息支出或股利分配作为公司的利润分配，其回购、注销等作为权益的变动处理；对于归类为金融负债的金融工具，其利息支出或股利分配按照借款费用进行处理，其回购或赎回产生的利得或损失等计入当期损益。

(二十九) 收入

1. 收入确认原则

于合同开始日，公司对合同进行评估，识别合同所包含的各单项履约义务，并确定各单项履约义务是在某一时段内履行，还是在某一时点履行。

满足下列条件之一时，属于在某一时段内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：（1）客户在公司履约的同时即取得并消耗公司履约所带来的经济利益；（2）客户能够控制公司履约过程中在建商品或服务；（3）公司履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，公司在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。对于在某一时点履行的履约义务，在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品控制权时，公司考虑下列迹象：

(1) 公司就该商品享有现时收款权利，即客户就该商品负有现时付款义务；(2) 公司已将该商品的法定所有权转移给客户，即客户已拥有该商品的法定所有权；(3) 公司已将该商品实物转移给客户，即客户已实物占有该商品；(4) 公司已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户，即客户已取得该商品所有权上的主要风险和报酬；(5) 客户已接受该商品；(6) 其他表明客户已取得商品控制权的迹象。

2. 收入计量原则

(1) 公司按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。交易价格是公司因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项以及预期将退还给客户的款项。

(2) 合同中存在可变对价的，公司按照期望值或最可能发生金额确定可变对价的最佳估计数，但包含可变对价的交易价格，不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。

(3) 合同中存在重大融资成分的，公司按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，公司预计客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

(4) 合同中包含两项或多项履约义务的，公司于合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务。

3. 收入确认的具体方法

(1) 手续费及佣金收入

与交易相关的经济利益能够流入公司，相关的收入能够可靠计量且满足下列各项经营活动的特定收入确认标准时，确认相关的手续费及佣金收入。

1) 经纪业务收入

代理买卖证券手续费收入、期货经纪业务手续费收入在交易日确认收入。

2) 投资银行业务收入

证券承销业务收入，按承销方式分别确认收入：①采用全额包销方式的，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认收入；②采用余额包销、代销方式的，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认。

保荐业务和财务顾问业务按照提供劳务收入的确认条件，在保荐服务和财务顾问服务完成且取得收款证据时确认为收入。

3) 资产管理和基金管理业务收入

受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入，在资产管理合同或基金到期或者定期与委托单位结算收益或损失时，按合同规定收益分成方式和比例计算的应该享有的收益或承担的损失，确认为当期损益。

4) 投资咨询业务收入

投资咨询业务收入按照提供劳务收入的确认条件，在投资咨询服务完成且取得收款证据时确认为收入。

(2) 利息收入

对于所有以摊余成本计量的金融工具及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产中计息的金融工具，利息收入以实际利率计量。实际利率是指按金融工具的预计存续期间将其预计未来现金流入或流出折现至该金融资产账面余额或金融负债摊余成本的利率。实际利率的计算需要考虑金融工具的合同条款（例如提前还款权）并且包括所有归属于实际利率组成部分的费用和所有交易成本，但不包括预期信用损失。

公司根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入并列报为“利息收入”，但下列情况除外：1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入；2) 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产的摊余成本（即，账面余额扣除预期信用损失准备之后的净额）和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，并且这一改善在客观上可与应用上述规定之后发生的某一事件相联系，转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

(3) 让渡资产使用权的收入

公司在同时满足相关的经济利益很可能流入、收入金额能够可靠计量时，确认让渡资产使用权的收入。

(三十) 政府补助

1. 政府补助在同时满足下列条件时予以确认：（1）公司能够满足政府补助所附的条件；（2）公司能够收到政府补助。政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量；公允价值不能可靠取得的，按照名义金额计量。

2. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

政府文件规定用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。政府文件不明确的，以取得该补助必须具备的基本条件为基础进行判断，以购建或以其他方式形成长期资产为基本条件的作为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关的政府补助确认为递延收益的，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

3. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助，难以区分与资产相关或与收益相关的，整体归类为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的，确认为递延收益，在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益或冲减相关成本；用于补偿已发生的相关成本费用或损失的，直接计入当期损益或冲减相关成本。

4. 与公司日常经营活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用。与公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

（三十一）合同资产、合同负债

公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中列示合同资产或合同负债。公司将同一合同下的合同资产和合同负债相互抵销后以净额列示。

公司将拥有的、无条件（即，仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示，将已向客户转让商品而有权收取对价的权利（该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示。

公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品的义务作为合同负债列示。

（三十二）递延所得税资产、递延所得税负债

1. 根据资产、负债的账面价值与其计税基础之间的差额（未作为资产和负债确认的项目按照税法规定可以确定其计税基础的，该计税基础与其账面数之间的差额），按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计算确认递延所得税资产或递延所得税负债。

2. 确认递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。资产负债表日，有确凿证据表明未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异的，确认以前会计期间未确认的递延所得税资产。

3. 资产负债表日，对递延所得税资产的账面价值进行复核，如果未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的利益，则减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，转回减记的金额。

4. 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益，但不包括下列情况产生的所得税：（1）企业合并；（2）直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

（三十三）租赁

1. 公司作为承租人

在租赁期开始日，公司将租赁期不超过 12 个月，且不包含购买选择权的租赁认定为短期租赁；将单项租赁资产为全新资产时价值较低的租赁认定为低价值资产租赁。公司转租或预期转租租赁资产的，原租赁不认定为低价值资产租赁。

对于所有短期租赁和低价值资产租赁，公司在租赁期内各个期间按照直线法将租赁付款额计入相关资产成本或当期损益。

除上述采用简化处理的短期租赁和低价值资产租赁外，在租赁期开始日，公司对租赁确认使用权资产和租赁负债。

（1）使用权资产

使用权资产按照成本进行初始计量，该成本包括：1）租赁负债的初始计量金额；2）在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；3）承租人发生的初始直接费用；4）承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。

公司按照直线法对使用权资产计提折旧。能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，公司在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，公司在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者

孰短的期间内计提折旧。

(2) 租赁负债

在租赁期开始日，公司将尚未支付的租赁付款额的现值确认为租赁负债。计算租赁付款额现值时采用租赁内含利率作为折现率，无法确定租赁内含利率的，采用公司增量借款利率作为折现率。租赁付款额与其现值之间的差额作为未确认融资费用，在租赁期各个期间内按照确认租赁付款额现值的折现率确认利息费用，并计入当期损益。未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额于实际发生时计入当期损益。

租赁期开始日后，当实质固定付款额发生变动、担保余值预计的应付金额发生变化、用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动、购买选择权、续租选择权或终止选择权的评估结果或实际行权情况发生变化时，公司按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值，如使用权资产账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，将剩余金额计入当期损益。

2. 公司作为出租人

公司的租赁均为经营租赁。

公司在租赁期内各个期间按照直线法将租赁收款额确认为租金收入，发生的初始直接费用予以资本化并按照与租金收入确认相同的基础进行分摊，分期计入当期损益。公司取得的与经营租赁有关的未计入租赁收款额的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

(三十四) 一般风险准备金和交易风险准备金

公司按当年实现净利润的 10% 分别计提一般风险准备金和交易风险准备金，根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，每月按照不低于公募基金托管费收入的 2.5% 提取一般风险准备金；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，每月按照不低于大集合资产管理业务管理费收入的 10% 计提一般风险准备金。国信弘盛私募基金管理有限公司（以下简称国信弘盛公司）根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》的规定，每月按照不低于管理费收入的 10% 计提一般风险准备金。国信期货有限责任公司（以下简称国信期货公司）按当年实现净利润的 10% 计提一般风险准备金。

(三十五) 分部报告

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，本公司的经营分部是指同时满足下列条件的组成部分：

1. 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
2. 管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
3. 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

（三十六）重要会计政策变更说明

企业会计准则变化引起的会计政策变更

公司自 2023 年 1 月 1 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 16 号》“关于单项交易产生的资产和负债相关的递延所得税不适用初始确认豁免的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无重大影响。

四、税项

（一）主要税种及税率

| 税种 | 计税依据 | 税率 |
|---------|--|----------------|
| 增值税 | 以税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税 | 3%、6%、9% 和 13% |
| 城市维护建设税 | 实际缴纳的流转税税额 | 7% |
| 教育费附加 | 实际缴纳的流转税税额 | 3% |
| 地方教育附加 | 实际缴纳的流转税税额 | 2% |
| 企业所得税 | 应纳税所得额 | 25%、20%、16.5% |

不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

| 纳税主体名称 | 所得税税率 |
|----------------------------|-------|
| 国信香港公司 | 16.5% |
| 国信证券（香港）经纪有限公司 | 16.5% |
| 国信证券（香港）融资有限公司 | 16.5% |
| 国信证券（香港）资产管理有限公司 | 16.5% |
| 国信（香港）金融产品有限公司 | 16.5% |
| 国信咨询服务（深圳）有限公司（以下简称国信咨询公司） | 20% |
| 除上述以外的其他纳税主体 | 25% |

（二）税收优惠

1. 增值税税收优惠

根据《财政部国家税务总局关于将铁路运输和邮政业纳入营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2013〕106号）、《国家税务总局关于发布〈营业税改征增值税跨境应税行为增值税免税管理办法（试行）〉的公告》（国家税务总局公告 2016 年第 29 号），国信咨询公司从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免优惠政策。

2. 企业所得税税收优惠

根据财政部、国家税务总局《关于小微企业和个体工商户所得税优惠政策的公告》（财政部税务总局公告 2023 年第 12 号），国信咨询公司的年应纳税所得额不超过 300 万元的部分，减按 25% 计入应纳税所得额，按 20% 的税率缴纳企业所得税。

（三）其他说明

根据《国家税务总局关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的公告》（国家税务总局公告 2012 年第 57 号），本公司先汇总公司本部和下属分支机构应纳税所得额，其中 50% 应纳税所得额在本部预缴，50% 应纳税所得额按经营收入、职工工资薪金费用和资产总额三因素计算各所属分支机构应分摊所得税额的比例。本公司所属分支机构按分摊的当期应纳税所得额和各自适用税率计缴企业所得税。

五、合并财务报表项目注释

（一）合并资产负债表项目注释

1. 货币资金

（1）类别明细

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 库存现金 | 70,803.80 | 140,842.95 |
| 银行存款 | 61,897,314,287.86 | 64,936,992,136.61 |
| 其中：自有资金存款 | 8,068,735,385.61 | 8,939,078,976.30 |
| 客户资金存款 | 53,828,578,902.25 | 55,997,913,160.31 |
| 其他货币资金 | 7,359,847.92 | 40,693,292.97 |
| 合计 | 61,904,744,939.58 | 64,977,826,272.53 |
| 其中：存放在境外的款项总额 | 1,808,691,807.97 | 2,525,291,407.78 |

(2) 币种明细

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|-----------|------------------|--------|-------------------|------------------|--------|-------------------|
| | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |
| 库存现金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 16,350.00 | | | 62,560.43 |
| 美元 | 1,363.00 | 7.0827 | 9,653.72 | 2,203.00 | 6.9646 | 15,343.01 |
| 港元 | 49,437.30 | 0.9062 | 44,800.08 | 70,457.30 | 0.8933 | 62,939.51 |
| 小计 | | | 70,803.80 | | | 140,842.95 |
| 银行存款： | | | | | | |
| 其中：自有资金存款 | | | | | | |
| 人民币 | | | 7,156,688,141.39 | | | 7,821,551,654.12 |
| 美元 | 35,033,342.85 | 7.0827 | 248,130,657.42 | 53,606,984.73 | 6.9646 | 373,351,205.85 |
| 港元 | 729,448,728.16 | 0.9062 | 661,026,437.46 | 830,193,375.51 | 0.8933 | 741,611,742.34 |
| 欧元 | 345,468.20 | 7.8592 | 2,715,103.68 | 345,467.84 | 7.4229 | 2,564,373.23 |
| 英镑 | 0.09 | 9.0411 | 0.81 | 0.09 | 8.3941 | 0.76 |
| 日元 | 100.00 | 0.0502 | 5.02 | | | |
| 新西兰元 | 38,905.52 | 4.4991 | 175,039.83 | | | |
| 小计 | | | 8,068,735,385.61 | | | 8,939,078,976.30 |
| 客户资金存款 | | | | | | |
| 人民币 | | | 51,956,840,081.86 | | | 53,639,862,984.13 |
| 美元 | 68,234,820.65 | 7.0827 | 483,286,764.23 | 115,817,012.46 | 6.9646 | 806,619,165.00 |
| 港元 | 1,530,682,075.47 | 0.9062 | 1,387,104,096.79 | 1,736,741,308.80 | 0.8933 | 1,551,431,011.18 |
| 日元 | 26,821,993.00 | 0.0502 | 1,346,464.05 | | | |
| 新西兰元 | 332.36 | 4.4991 | 1,495.32 | | | |
| 小计 | | | 53,828,578,902.25 | | | 55,997,913,160.31 |
| 银行存款小计 | | | 61,897,314,287.86 | | | 64,936,992,136.61 |
| 其他货币资金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 7,359,847.92 | | | 40,693,292.97 |
| 合计 | | | 61,904,744,939.58 | | | 64,977,826,272.53 |

(3) 融资融券业务信用资金明细情况

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|---------|----------------|--------|------------------|----------------|--------|------------------|
| | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |
| 自有信用资金： | | | | | | |
| 人民币 | | | | | | 452,025.45 |
| 客户信用资金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 4,541,315,877.68 | | | 5,479,172,700.97 |
| 美元 | 7,409,971.32 | 7.0827 | 52,482,603.87 | 13,949,038.51 | 6.9646 | 97,149,473.61 |
| 港元 | 287,795,629.87 | 0.9062 | 260,800,399.79 | 358,058,600.12 | 0.8933 | 319,853,747.49 |
| 小计 | | | 4,854,598,881.34 | | | 5,896,175,922.07 |
| 总计 | | | 4,854,598,881.34 | | | 5,896,627,947.52 |

(4) 其他说明

2023年12月31日，本公司使用受限的货币资金为人民币551,519,571.46元（期初本公司使用受限的货币资金为人民币1,228,187,600.13元）。

2. 结算备付金

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|----------|----------------|--------|-------------------|----------------|--------|-------------------|
| | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |
| 公司自有备付金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 3,805,755,861.19 | | | 2,899,165,230.67 |
| 美元 | 534,728.69 | 7.0827 | 3,787,322.89 | | | |
| 公司备付金总计 | | | 3,809,543,184.08 | | | 2,899,165,230.67 |
| 客户普通备付金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 10,044,891,068.22 | | | 11,226,355,641.05 |
| 美元 | 2,736,727.65 | 7.0827 | 19,383,420.93 | 3,227,496.65 | 6.9646 | 22,478,223.17 |
| 港币 | 341,813,542.03 | 0.9062 | 309,751,431.79 | 380,699,729.48 | 0.8933 | 340,079,068.34 |
| 小计 | | | 10,374,025,920.94 | | | 11,588,912,932.56 |
| 客户信用备付金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 993,946,969.18 | | | 1,246,721,124.47 |
| 客户备付金总计 | | | 11,367,972,890.12 | | | 12,835,634,057.03 |
| 合计 | | | 15,177,516,074.20 | | | 15,734,799,287.70 |

3. 融出资金

(1) 明细情况——按类别

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|-------------------|-------------------|
| 境内 | | |
| 其中：个人 | 51,899,911,725.95 | 49,240,677,848.54 |
| 机构 | 3,918,305,860.60 | 3,322,956,492.03 |
| 减：减值准备 | 149,448,227.81 | 141,760,440.43 |
| 账面价值小计 | 55,668,769,358.74 | 52,421,873,900.14 |
| 境外 | | |
| 其中：个人 | 204,402,446.35 | 237,691,468.77 |
| 机构 | 9,925,471.91 | 14,296,201.50 |
| 减：减值准备 | 1,585,808.02 | 1,766,946.39 |
| 账面价值小计 | 212,742,110.24 | 250,220,723.88 |
| 合计 | 55,881,511,468.98 | 52,672,094,624.02 |

(2) 担保物情况

| 项目 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|----|--------------------|--------------------|
| 股票 | 157,696,556,572.45 | 153,309,197,256.70 |
| 基金 | 7,214,024,970.56 | 5,083,701,370.47 |
| 资金 | 5,582,159,717.10 | 6,934,664,621.32 |
| 债券 | 251,827,156.28 | 262,823,555.68 |
| 合计 | 170,744,568,416.39 | 165,590,386,804.17 |

注：担保物包含融出资金、融出证券、孖展融资及限制性股票融资的担保物

(3) 减值准备变动情况

| 项目 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 小计 |
|------|--------------------|--------------------------|--------------------------|----------------|
| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | |
| 期初数 | 137,631,213.38 | | 5,896,173.44 | 143,527,386.82 |
| 本期计提 | 3,106,255.89 | | 4,390,361.97 | 7,496,617.86 |
| 本期转销 | | | | |
| 其他 | -8,086.05 | | 18,117.20 | 10,031.15 |
| 期末数 | 140,729,383.22 | | 10,304,652.61 | 151,034,035.83 |

4. 衍生金融资产、衍生金融负债

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | | |
|--------|--------------------|----------------|----------------|
| | 名义金额 | 非套期工具 | |
| | | 资产 | 公允价值 负债 |
| 利率衍生工具 | | | |
| 利率互换 | 137,940,000,000.00 | | 50,304,413.21 |
| 国债期货 | 8,729,156,161.08 | | |
| 小计 | 146,669,156,161.08 | | 50,304,413.21 |
| 权益衍生工具 | | | |
| 收益互换 | 25,342,866,064.42 | | 300,928,152.04 |
| 收益凭证 | 16,271,350,000.00 | 1,867,335.69 | |
| 股指期货 | 15,494,515,840.59 | | |
| 股票期权 | 3,165,086,927.33 | | 97,020,094.92 |
| 股指期权 | 9,033,895,000.00 | | 262,592,060.00 |
| 小计 | 69,307,713,832.34 | 1,867,335.69 | 660,540,306.96 |
| 其他衍生工具 | | | |
| 商品期货 | 9,669,429,642.54 | | |
| 信用缓释工具 | 3,667,000,000.00 | | 1,377,735.00 |
| 场外期权 | 42,907,589,381.70 | 560,843,260.61 | 1,044,547.72 |
| 债券远期 | 812,750,000.00 | 5,784,400.00 | |
| 汇率期货 | 1,527,722,443.00 | | |
| 小计 | 58,584,491,467.24 | 566,627,660.61 | 2,422,282.72 |
| 合计 | 274,561,361,460.66 | 568,494,996.30 | 713,267,002.89 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | |
|--------|--------------------|----------------|----------------|
| | 名义金额 | 非套期工具 | |
| | | 资产 | 公允价值 负债 |
| 利率衍生工具 | | | |
| 利率互换 | 155,310,000,000.00 | | 2,762,965.10 |
| 小计 | 155,310,000,000.00 | | 2,762,965.10 |
| 权益衍生工具 | | | |
| 收益互换 | 8,529,686,351.75 | 16,674,964.08 | |
| 收益凭证 | 3,595,584,000.00 | 584,576.34 | |
| 股指期货 | 15,623,176,920.80 | | |
| 股票期权 | 1,717,901,080.87 | | 101,365,316.25 |
| 股指期权 | 6,007,595,000.00 | | 219,352,260.00 |
| 小计 | 35,473,943,353.42 | 17,259,540.42 | 320,717,576.25 |
| 其他衍生工具 | | | |
| 商品期货 | 2,417,805,454.66 | | |
| 信用缓释工具 | 1,677,000,000.00 | 38,747,234.30 | |
| 场外期权 | 27,015,046,321.74 | 108,197,258.90 | 1,191,898.25 |
| 小计 | 31,109,851,776.40 | 146,944,493.20 | 1,191,898.25 |
| 合计 | 221,893,795,129.82 | 164,204,033.62 | 324,672,439.60 |

(2) 股指期货合约和商品期货合约

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本公司于 2023 年 12 月 31 日所持有的股指期货合约、商品期货合约、汇率期货合约和国债期货合约产生的持仓损益，衍生金融负债项下的股指期货合约、商品期货合约、汇率期货合约和国债期货合约与相关的暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，2023 年 12 月 31 日抵销后的净额为人民币零元，公允价值变动损失为人民币 156,130,981.43 元（期初本公司股指期货合约和商品期货合约公允价值变动损失为人民币 87,143,395.10 元）。

5. 存出保证金

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|--------|---------------|--------|------------------|---------------|--------|------------------|
| | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |
| 交易保证金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 9,362,597,793.67 | | | 7,426,234,993.72 |
| 美元 | 270,000.00 | 7.0827 | 1,912,329.00 | 270,000.00 | 6.9646 | 1,880,442.00 |
| 港币 | 31,969,764.64 | 0.9062 | 28,971,000.72 | 13,272,757.74 | 0.8933 | 11,856,554.49 |
| 小计 | | | 9,393,481,123.39 | | | 7,439,971,990.21 |
| 信用保证金： | | | | | | |
| 人民币 | | | 433,851,684.72 | | | 460,249,500.93 |
| 合计 | | | 9,827,332,808.11 | | | 7,900,221,491.14 |

6. 应收款项

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|-----------|------------------|------------------|
| 应收逾期融资款 | 1,449,126,805.53 | 1,204,127,753.04 |
| 场外期权预付金 | 1,412,028,495.96 | 579,533,572.22 |
| 应收清算款项 | 755,581,834.58 | 3,034,359,842.36 |
| 应收手续费及佣金 | 579,746,640.54 | 573,709,946.33 |
| 收益互换预付金 | 517,170,131.71 | 67,100,000.00 |
| 应收期权费 | 240,838,763.85 | 116,315,929.84 |
| 应收利率互换款项 | 230,883,736.52 | 183,386,907.61 |
| 应收代垫款项 | 192,339,401.96 | 192,321,168.57 |
| 应收违约债券 | 131,868,122.74 | 143,186,803.04 |
| 应收融资融券客户款 | 100,256,310.56 | 101,062,052.52 |
| 应收结算担保金 | 74,368,528.68 | 31,387,620.93 |
| 应收期货交易款 | 56,900,292.86 | 42,878,167.28 |

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|-----------------|------------------|------------------|
| 应收大宗商品销售款 | 25,011,559.15 | 25,087,414.32 |
| 其他 | 164,835,428.41 | 35,611,826.56 |
| 减：坏账准备（按简化模型计提） | 1,847,037,688.78 | 1,601,134,132.87 |
| 合计 | 4,083,918,364.27 | 4,728,934,871.75 |

(2) 账龄分析

| 项目 | 期末数 | | 期初数 | |
|------|------------------|--------|------------------|--------|
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 比例 (%) |
| 1年以内 | 3,878,819,537.54 | 65.40 | 4,718,244,502.09 | 74.54 |
| 1-2年 | 453,494,716.93 | 7.65 | 633,621,181.71 | 10.01 |
| 2-3年 | 632,259,796.85 | 10.66 | 35,497,266.42 | 0.56 |
| 3年以上 | 966,382,001.73 | 16.29 | 942,706,054.40 | 14.89 |
| 合计 | 5,930,956,053.05 | 100.00 | 6,330,069,004.62 | 100.00 |

(3) 坏账准备计提明细情况

1) 类别明细情况

| 种类 | 期末数 | | | |
|----------|------------------|-------------------|------------------|------------------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | |
| | 金额 | 占账面余额 合计比例 (%) | 金额 | 坏账准备 计提比例 (%) |
| 单项计提坏账准备 | | | | |
| —应收逾期融资款 | 1,449,126,805.53 | 24.43 | 1,449,126,805.53 | 100.00 |
| —应收违约债券 | 131,868,122.74 | 2.22 | 34,822,923.16 | 26.41 |
| —应收代垫款项 | 192,339,401.96 | 3.24 | 192,013,485.01 | 99.83 |
| —应收融资融券款 | 100,226,606.67 | 1.69 | 100,226,606.67 | 100.00 |
| —其他 | 44,816,616.51 | 0.76 | 44,816,616.51 | 100.00 |
| 小计 | 1,918,377,553.41 | 32.34 | 1,821,006,436.88 | 94.92 |
| 组合计提坏账准备 | | | | |
| 账龄组合 | 365,927,267.90 | 6.17 | 26,031,251.90 | 7.11 |
| 特定款项组合 | 3,646,651,231.74 | 61.49 | | |
| 小计 | 4,012,578,499.64 | 67.66 | 26,031,251.90 | 0.65 |
| 合计 | 5,930,956,053.05 | 100.00 | 1,847,037,688.78 | 31.14 |

(续上表)

| 种类 | 期初数 | | | |
|----------|------------------|---------------|------------------|--------------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | |
| | 金额 | 占账面余额合计比例 (%) | 金额 | 坏账准备计提比例 (%) |
| 单项计提坏账准备 | | | | |
| —应收逾期融资款 | 1,204,127,753.04 | 19.02 | 1,204,127,753.04 | 100.00 |
| —应收违约债券 | 143,186,803.04 | 2.26 | 45,353,968.82 | 31.67 |
| —应收代垫款项 | 192,321,168.57 | 3.04 | 192,043,188.90 | 99.86 |
| —应收融资融券款 | 101,062,052.52 | 1.60 | 101,032,348.63 | 99.97 |
| —其他 | 34,695,189.93 | 0.55 | 34,695,189.93 | 100.00 |
| 小计 | 1,675,392,967.10 | 26.47 | 1,577,252,449.32 | 94.14 |
| 组合计提坏账准备 | | | | |
| 账龄组合 | 412,150,208.54 | 6.51 | 23,881,683.55 | 5.79 |
| 特定款项组合 | 4,242,525,828.98 | 67.02 | | |
| 小计 | 4,654,676,037.52 | 73.53 | 23,881,683.55 | 0.51 |
| 合计 | 6,330,069,004.62 | 100.00 | 1,601,134,132.87 | 25.29 |

2) 按账龄组合计提坏账准备的应收账款

| 账龄 | 期末数 | | 坏账准备 | 期初数 | | 坏账准备 |
|---------|----------------|--------|---------------|----------------|--------|---------------|
| | 账面金额 | 比例 (%) | | 账面金额 | 比例 (%) | |
| 1 年以内 | 180,864,847.28 | 49.43 | 904,324.23 | 302,896,977.90 | 73.49 | 1,490,982.96 |
| 1 至 2 年 | 96,642,725.50 | 26.41 | 4,832,136.28 | 28,918,875.66 | 7.02 | 1,445,943.78 |
| 2 至 3 年 | 19,906,659.23 | 5.44 | 1,990,665.92 | 16,394,543.27 | 3.98 | 1,639,454.33 |
| 3 年以上 | 68,513,035.89 | 18.72 | 18,304,125.47 | 63,939,811.71 | 15.51 | 19,305,302.48 |
| 合计 | 365,927,267.90 | 100.00 | 26,031,251.90 | 412,150,208.54 | 100.00 | 23,881,683.55 |

(4) 应收款项金额前五名情况

| 项目 | 款项性质 | 期末余额 [注 4] | 账龄 | 占应收款项总额的比例 (%) |
|------|-------|------------------|-------|----------------|
| 客户 A | [注 1] | 278,747,120.97 | 2-3 年 | 4.70 |
| 客户 B | [注 1] | 232,741,911.02 | 1 年以内 | 3.92 |
| 客户 C | [注 2] | 228,781,001.41 | 3 年以上 | 3.86 |
| 客户 D | [注 3] | 192,013,485.01 | 3 年以上 | 3.24 |
| 客户 E | [注 1] | 186,292,000.00 | 2-3 年 | 3.14 |
| 合计 | | 1,118,575,518.41 | | 18.86 |

[注 1] 系股票质押回购业务逾期本金

[注 2] 系国信香港公司开展的融资业务逾期本金及利息

[注 3] 系垫付的和解款

[注 4] 期末余额前五名应收账款相应计提的坏账准备期末余额汇总金额为人民币 1,118,575,518.41 元

(5) 应收款项坏账准备变动情况

详见本财务报表附注五（一）21 之说明。

(6) 报告期应收款项中应收持本公司 5%（含 5%）以上有表决权股份的股东单位的款项及关联方的款项

详见本财务报表附注十一（三）之说明。

7. 买入返售金融资产

(1) 明细情况——按业务类别

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|---------|------------------|-------------------|
| 债券质押式回购 | 4,044,156,657.41 | 11,069,642,034.26 |
| 股票质押式回购 | 5,025,640,458.42 | 5,721,712,124.81 |
| 行权融资 | 371,675,959.79 | 300,134,417.38 |
| 约定购回式回购 | 23,083,820.81 | 38,778,507.45 |
| 减：减值准备 | 1,340,314,646.05 | 1,305,749,652.15 |
| 合计 | 8,124,242,250.38 | 15,824,517,431.75 |

(2) 明细情况——按金融资产种类

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|------------------|-------------------|
| 债券 | 4,044,156,657.41 | 11,069,642,034.26 |
| 股票 | 5,048,724,279.23 | 5,760,490,632.26 |
| 其他 | 371,675,959.79 | 300,134,417.38 |
| 减：减值准备 | 1,340,314,646.05 | 1,305,749,652.15 |
| 合计 | 8,124,242,250.38 | 15,824,517,431.75 |

(3) 担保物情况

| 项目 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| 担保物 | 11,410,374,097.39 | 14,157,080,721.92 |
| 其中：可出售或可再次向外抵押的担保物 | | |
| 其中：已出售或已再次向外抵押的担保物 | | |

注：上述担保物不包括交易所质押式逆回购交易取得的担保物的公允价值

(4) 约定购回融出资金

| 剩余期限 | 期末数 | 期初数 |
|-------------|---------------|---------------|
| 1 个月内 | 5,285,205.48 | 7,441,469.78 |
| 1 个月至 3 个月内 | 906,854.52 | 5,468,079.89 |
| 3 个月至 1 年内 | 16,891,760.81 | 25,868,957.78 |
| 1 年以上 | | |
| 小计 | 23,083,820.81 | 38,778,507.45 |

(5) 股票质押式回购融出资金

| 剩余期限 | 期末数 | 期初数 |
|-------------|------------------|------------------|
| 1 个月内 | 2,651,246,975.19 | 3,009,394,234.88 |
| 1 个月至 3 个月内 | 366,514,554.51 | 135,352,771.35 |
| 3 个月至 1 年内 | 2,007,878,928.72 | 2,576,965,118.58 |
| 1 年以上 | | |
| 小计 | 5,025,640,458.42 | 5,721,712,124.81 |

(6) 减值准备变动情况

| 项目 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 小计 |
|-----------|--------------------|--------------------------|--------------------------|------------------|
| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | |
| 期初数 | 3,872,791.54 | | 1,301,876,860.61 | 1,305,749,652.15 |
| 期初数在本期 | — | — | — | |
| -- 转入第二阶段 | -10,571.81 | 10,571.81 | | |
| -- 转入第三阶段 | -50,556.52 | | 50,556.52 | |
| 本期计提 | -2,455,415.91 | 66,471.21 | 36,953,938.60 | 34,564,993.90 |
| 本期转回 | | | | |
| 期末数 | 1,356,247.30 | 77,043.02 | 1,338,881,355.73 | 1,340,314,646.05 |

8. 交易性金融资产

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | | | |
|---------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| | 公允价值 | | 初始成本 | |
| | 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 | 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 | 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 | 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 |
| | 公允价值小计 | 公允价值小计 | 初始成本小计 | 初始成本小计 |
| 债券 | 126,455,457,280.34 | 126,455,457,280.34 | 124,949,850,999.55 | 124,949,850,999.55 |
| 公募基金 | 25,921,905,104.46 | 25,921,905,104.46 | 27,016,136,424.60 | 27,016,136,424.60 |
| 股票 | 20,466,149,759.89 | 20,466,149,759.89 | 20,745,973,643.09 | 20,745,973,643.09 |
| 银行理财产品 | 727,857,095.68 | 727,857,095.68 | 710,000,000.00 | 710,000,000.00 |
| 券商资管产品 | 4,651,334,975.16 | 4,651,334,975.16 | 4,508,933,371.94 | 4,508,933,371.94 |
| 信托计划 | 681,729,109.57 | 681,729,109.57 | 636,118,293.21 | 636,118,293.21 |
| 私募基金及专户 | 14,984,054,321.65 | 14,984,054,321.65 | 14,207,987,770.00 | 14,207,987,770.00 |
| 其他股权投资 | 1,903,088,450.60 | 1,903,088,450.60 | 1,769,279,554.55 | 1,769,279,554.55 |
| 其他 | 191,967,777.67 | 191,967,777.67 | 190,496,939.38 | 190,496,939.38 |
| 合计 | 195,983,543,875.02 | 195,983,543,875.02 | 194,734,776,996.32 | 194,734,776,996.32 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | | |
|---------|-----------------------------------|---|-----------------------------------|---|
| | 公允价值 | | 初始成本 | |
| | 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 | 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 | 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 | 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 |
| | 公允价值小计 | 公允价值小计 | 初始成本小计 | 初始成本小计 |
| 债券 | 119,739,042,711.12 | 119,739,042,711.12 | 119,090,969,047.61 | 119,090,969,047.61 |
| 公募基金 | 16,727,868,981.52 | 16,727,868,981.52 | 17,298,045,187.64 | 17,298,045,187.64 |
| 股票 | 4,389,698,479.05 | 4,389,698,479.05 | 4,360,471,575.19 | 4,360,471,575.19 |
| 银行理财产品 | 6,330,475,561.97 | 6,330,475,561.97 | 6,314,600,000.00 | 6,314,600,000.00 |
| 券商资管产品 | 1,733,867,258.15 | 1,733,867,258.15 | 1,725,206,254.04 | 1,725,206,254.04 |
| 信托计划 | 220,493,801.58 | 220,493,801.58 | 191,754,430.85 | 191,754,430.85 |
| 私募基金及专户 | 8,693,185,323.87 | 8,693,185,323.87 | 8,224,202,070.77 | 8,224,202,070.77 |
| 其他股权投资 | 1,637,041,120.18 | 1,637,041,120.18 | 1,562,393,930.47 | 1,562,393,930.47 |
| 其他 | 900,000.00 | 900,000.00 | 900,000.00 | 900,000.00 |
| 合计 | 159,472,573,237.44 | 159,472,573,237.44 | 158,768,542,496.57 | 158,768,542,496.57 |

(2) 其他说明

1) 2023年12月31日, 本公司为回购交易设定质押或过户的债券的公允价值计人民币 51,833,256,887.28 元, 为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币 12,365,049,927.80 元, 为期货业务充抵保证金设定质押的债券的公允价值计人民币 1,818,552,270.00 元。

2) 2023年12月31日, 本公司持有的限售股的公允价值计人民币 398,060,086.19 元。

9. 债权投资

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | | | |
|-----|----------------|---------------|------------|----------------|
| | 初始成本 | 利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 企业债 | 299,432,448.99 | -7,231,608.16 | 302,582.51 | 291,898,258.32 |
| 合计 | 299,432,448.99 | -7,231,608.16 | 302,582.51 | 291,898,258.32 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | | |
|-----|---------------|-------------|------------|---------------|
| | 初始成本 | 利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 企业债 | 70,040,151.26 | -474,307.23 | 299,632.46 | 69,266,211.57 |
| 合计 | 70,040,151.26 | -474,307.23 | 299,632.46 | 69,266,211.57 |

(2) 减值准备变动情况

| 项目 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 小计 |
|------|--------------------|--------------------------|--------------------------|------------|
| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | |
| 期初数 | 299,632.46 | | | 299,632.46 |
| 本期计提 | 322.58 | | | 322.58 |
| 本期转销 | | | | |
| 其他 | 2,627.47 | | | 2,627.47 |
| 期末数 | 302,582.51 | | | 302,582.51 |

10. 其他债权投资

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | | | | |
|-------------|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|----------------|
| | 初始成本 | 利息 | 公允价值变动 | 账面价值 | 累计减值准备 |
| 国债 | 2,879,715,057.55 | 33,166,945.45 | 29,553,022.45 | 2,942,435,025.45 | |
| 地方债 | 33,900,113,577.54 | 417,598,377.01 | 388,124,098.59 | 34,705,836,053.14 | 9,101,670.51 |
| 金融债 | 722,190,389.92 | 15,724,031.27 | 4,882,764.12 | 742,797,185.31 | 77,991.13 |
| 企业债 | 16,294,544,521.65 | 246,895,695.15 | -111,589,481.14 | 16,429,850,735.66 | 185,976,918.62 |
| 中期票据 | 23,220,610,560.03 | 371,483,665.10 | 125,764,230.97 | 23,717,858,456.10 | 31,562,948.30 |
| 非公开定向债务融资工具 | 621,753,406.20 | 13,766,830.60 | 2,710,953.80 | 638,231,190.60 | 2,975,993.53 |
| 资产支持证券 | 4,140,130,263.17 | 20,667,733.17 | 10,652,881.33 | 4,171,450,877.67 | 7,286,850.60 |
| 其他 | 1,089,891,155.57 | 5,051,759.55 | 1,508,454.43 | 1,096,451,369.55 | 1,875,907.12 |
| 合计 | 82,868,948,931.63 | 1,124,355,037.30 | 451,606,924.55 | 84,444,910,893.48 | 238,858,279.81 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | | | |
|-------------|-------------------|----------------|-----------------|-------------------|----------------|
| | 初始成本 | 利息 | 公允价值变动 | 账面价值 | 累计减值准备 |
| 国债 | 2,607,104,455.74 | 33,420,150.61 | 8,645,919.01 | 2,649,170,525.36 | |
| 地方债 | 25,284,328,996.15 | 414,821,168.84 | 81,626,040.74 | 25,780,776,205.73 | 6,730,808.71 |
| 金融债 | 1,876,401,177.45 | 35,631,765.47 | 4,425,437.68 | 1,916,458,380.60 | 229,733.18 |
| 企业债 | 7,076,590,637.42 | 141,289,192.15 | -239,818,082.42 | 6,978,061,747.15 | 253,635,813.61 |
| 中期票据 | 11,882,585,278.91 | 180,961,287.66 | 36,803,941.09 | 12,100,350,507.66 | 13,014,298.19 |
| 非公开定向债务融资工具 | 19,614,004.17 | 690,350.68 | 81,035.83 | 20,385,390.68 | 62,115.53 |
| 资产支持证券 | 1,365,181,824.59 | 9,582,437.78 | 6,950,121.41 | 1,381,714,383.78 | 2,099,401.02 |
| 其他 | 662,571,207.48 | 12,187,841.09 | -203,437.48 | 674,555,611.09 | 474,888.41 |
| 合计 | 50,774,377,581.91 | 828,584,194.28 | -101,489,024.14 | 51,501,472,752.05 | 276,247,058.65 |

(2) 减值准备变动情况

| 项目 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 小计 |
|------|--------------------|--------------------------|--------------------------|----------------|
| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | |
| 期初数 | 25,580,654.21 | 186,018,560.60 | 64,647,843.84 | 276,247,058.65 |
| 本期计提 | 87,363,165.27 | 1,396,390.72 | -2,493,076.72 | 86,266,479.27 |
| 本期转销 | 35,502,952.56 | 88,097,086.31 | 55,219.24 | 123,655,258.11 |
| 期末数 | 77,440,866.92 | 99,317,865.01 | 62,099,547.88 | 238,858,279.81 |

(3) 其他说明

2023 年 12 月 31 日，本公司为回购交易设定质押的债券的公允价值计人民币 54,633,411,341.21 元，为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币 12,484,578,730.00 元，为期货业务充抵保证金设定质押的债券的公允价值计人民币 688,188,091.00 元。

11. 其他权益工具投资

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | | 本期确认的 股利收入 |
|------------|-------------------|-------------------|------------------|
| | 初始成本 | 公允价值 | |
| 股票 | 12,915,595,610.39 | 13,213,518,800.13 | 960,521,937.02 |
| 其他非交易性权益工具 | 2,152,831,995.14 | 2,097,985,350.00 | 73,436,000.00 |
| 合计 | 15,068,427,605.53 | 15,311,504,150.13 | 1,033,957,937.02 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | 上年同期确认的 股利收入 |
|------------|-------------------|-------------------|-----------------|
| | 初始成本 | 公允价值 | |
| 股票 | 11,149,557,465.26 | 10,429,791,008.15 | 830,660,000.30 |
| 其他非交易性权益工具 | | | |
| 合计 | 11,149,557,465.26 | 10,429,791,008.15 | 830,660,000.30 |

(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的原因

本公司将部分权益工具投资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，主要包括以融出证券为目的持有的证券投资、策略投资持有的证券投资。

上述其他权益工具投资包含本公司以融出证券为目的持有的股票，2023年12月31日该部分非交易性权益工具成本计人民币85,778,311.63元，公允价值计人民币104,019,738.33元。

上述其他权益工具投资包含本公司策略投资持有的股票和永续债，2023年12月31日该部分非交易性权益工具成本计人民币14,981,249,293.90元，公允价值计人民币15,206,084,411.80元。

(3) 本期终止确认的其他权益工具投资

1) 明细情况

| 项目 | 终止确认时公允价值 | 本期股利收入 | 终止确认时从其他综合收益转入留存收益的累计利得和损失 |
|----|----------------|------------|----------------------------|
| 股票 | 495,274,457.13 | 202,345.55 | -131,466,140.05 |
| 小计 | 495,274,457.13 | 202,345.55 | -131,466,140.05 |

2) 处置权益工具投资的原因

其他权益工具投资处置的原因主要系本公司根据融券客户的需求调整融券证券持仓和投资策略调整所致。

(4) 其他说明

2023年12月31日，本公司为债券借贷业务设定质押的证券的公允价值计人民币2,086,221,330.00元。

12. 长期股权投资

(1) 分类情况

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|---------|------------------|------|------------------|------------------|------|------------------|
| | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 对合营企业投资 | 604,360,830.07 | | 604,360,830.07 | 515,415,348.54 | | 515,415,348.54 |
| 对联营企业投资 | 2,982,203,369.19 | | 2,982,203,369.19 | 2,953,052,871.67 | | 2,953,052,871.67 |
| 合计 | 3,586,564,199.26 | | 3,586,564,199.26 | 3,468,468,220.21 | | 3,468,468,220.21 |

(2) 明细情况

| 被投资单位 | 期初数 | | 本期增减变动 | | | | | 期末数 | | |
|---------------------------------|------------------|------|----------------|--------------|----------------|---------------|------------|----------------|------------------|------|
| | 账面价值 | 减值准备 | 追加投资 | 减少投资 | 权益法下确认的投资损益 | 其他综合收益调整 | 其他权益变动 | 宣告发放现金股利或利润 | 账面价值 | 减值准备 |
| 合营企业 | | | | | | | | | | |
| 张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙） | 451,912,634.74 | | | | 15,644,711.68 | | | | 467,557,346.42 | |
| 深圳市弘盛宝龙新兴产业私募基金股权投资基金合伙企业（有限合伙） | | | 40,000,000.00 | | -9,921.43 | | | | 39,990,078.57 | |
| 深圳市鹏鹤弘盛绿色产业私募基金股权投资基金合伙企业（有限合伙） | | | 30,000,000.00 | | -20,038.95 | | | | 29,979,961.05 | |
| 宿迁市国信运东数字经济产业投资基金合伙企业（有限合伙） | | | 30,000,000.00 | | -23,761.19 | | | | 29,976,238.81 | |
| 深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙） | 43,222,500.37 | | | | -13,125,934.78 | | | 13,483,542.73 | 16,613,022.86 | |
| 珠海国信运通股权投资基金（有限合伙） | 10,157,464.67 | | | | -35,344.52 | | | | 10,122,120.15 | |
| 珠海联发安科股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 10,122,748.76 | | | 197,496.00 | 196,809.45 | | | | 10,122,062.21 | |
| 小计 | 515,415,348.54 | | 100,000,000.00 | 197,496.00 | 2,626,520.26 | | | 13,483,542.73 | 604,360,830.07 | |
| 联营企业 | | | | | | | | | | |
| 鹏华基金管理有限公司（以下简称鹏华基金公司） | 2,039,407,110.49 | | | | 419,350,127.11 | | | 286,155,000.00 | 2,172,602,237.60 | |
| 前海股交投资控股（深圳）有限公司 | 194,312,681.71 | | | | -51,314,367.74 | -1,520,834.00 | -29,341.80 | | 141,448,138.17 | |
| 国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙） | 116,612,897.98 | | | | 447,102.02 | | | | 117,060,000.00 | |
| 常州高新创业投资有限公司 | 85,530,740.87 | | | | -3,166,669.63 | | | 2,631,880.00 | 79,732,191.24 | |
| 国铁盛芯（青岛）股权投资企业（有限合伙） | 77,793,315.85 | | | | -2,509,808.18 | | | | 75,283,507.67 | |
| 深圳市国信亿合新兴产业私募基金股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 70,101,386.93 | | | 3,144,468.14 | 821,105.34 | | | | 67,778,024.13 | |
| 北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金（有限合伙） | 79,674,742.35 | | | 3,998,059.87 | 12,556,769.93 | | | 24,201,940.13 | 64,031,512.28 | |
| 南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙） | 45,454,967.55 | | | | 10,972,647.80 | | | | 56,427,615.35 | |
| 厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 40,353,311.79 | | | | -670,519.00 | | | | 39,682,792.79 | |
| 青岛蓝海股权交易中心有限责任公司 | 32,125,222.71 | | | | 1,395,254.19 | | | | 33,520,476.90 | |
| 深圳市天使一号创业投资合伙企业（有限合伙） | 29,785,622.41 | | | | 863,275.50 | | | | 30,648,897.91 | |
| 佛山司南碳伍股权投资合伙企业（有限合伙） | 20,000,000.00 | | | | -311,651.94 | | | | 19,688,348.06 | |
| 深圳市创东方长辉投资企业（有限合伙） | 15,963,356.02 | | | | 415,203.70 | | | | 16,378,559.72 | |

| 被投资单位 | 期初数 | | 本期增减变动 | | | | | 期末数 | | |
|------------------------------|------------------|--------------|----------------|---------------|----------------|---------------|------------|----------------|------------------|------|
| | 账面价值 | 减值准备 | 追加投资 | 减少投资 | 权益法下确认的投资损益 | 其他综合收益调整 | 其他权益变动 | 宣告发放现金股利或利润 | 账面价值 | 减值准备 |
| 深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙) | 37,312,898.51 | | 2,545,868.32 | -3,601,012.63 | | | | 16,276,870.62 | 14,889,146.94 | |
| 深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 14,249,521.47 | | | | 153,399.75 | | | | 14,402,921.22 | |
| 江门市倚锋骏马二期创业投资合伙企业(有限合伙) | 10,042,625.41 | | | | -361,379.62 | | | | 9,681,245.79 | |
| 深圳市前海弘泰基金管理有限公司 | 9,263,570.72 | | | | -342,894.47 | | | | 8,920,676.25 | |
| 盈科值得普泽(平潭)股权投资合伙企业(有限合伙) | 4,924,701.43 | | | | -45,927.19 | | | | 4,878,774.24 | |
| 深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司 | 4,508,887.47 | | | | 29.89 | | | | 4,508,917.36 | |
| 深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙) | 22,346,256.34 | | 18,131,401.01 | | -64,623.10 | | | | 4,150,232.23 | |
| 川渝高竹新区重庆广弘创业投资基金合伙企业(有限合伙) | | 2,982,460.00 | | | -44.74 | | | | 2,982,415.26 | |
| 深圳市五色检测技术服务有限公司 | 2,385,863.70 | | | | -438,186.74 | | | | 1,947,676.96 | |
| 华润宝塔股权投资(延安)有限公司 | 537,512.83 | | | | 1,021,548.29 | | | | 1,559,061.12 | |
| 国铁盛和(青岛)私募股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 365,677.13 | | | | -4,411.11 | | 361,266.02 | | | |
| 深圳弘盛道格体育投资合伙企业(有限合伙) | | | 3,180,653.47 | 3,180,653.47 | | | | | | |
| 小计 | 2,953,052,871.67 | | 2,982,460.00 | 31,000,450.81 | 388,345,620.90 | -1,520,834.00 | -29,341.80 | 329,626,956.77 | 2,982,203,369.19 | |
| 合计 | 3,468,468,220.21 | | 102,982,460.00 | 31,197,946.81 | 390,972,141.16 | -1,520,834.00 | -29,341.80 | 343,110,499.50 | 3,586,564,199.26 | |

13. 投资性房地产

| 项目 | 房屋及建筑物 | 合计 |
|-------------|----------------|----------------|
| 账面原值 | | |
| 期初数 | 356,526,419.62 | 356,526,419.62 |
| 本期增加金额 | 2,775,964.65 | 2,775,964.65 |
| (1) 外购 | | |
| (2) 固定资产转入 | 2,775,964.65 | 2,775,964.65 |
| 本期减少金额 | | |
| (1) 处置 | | |
| (2) 转出至固定资产 | | |
| (3) 其他转出 | | |
| 期末数 | 359,302,384.27 | 359,302,384.27 |
| 累计折旧和累计摊销 | | |

| 项目 | 房屋及建筑物 | 合计 |
|------------|----------------|----------------|
| 期初数 | 77,403,953.30 | 77,403,953.30 |
| 本期增加金额 | 10,653,800.88 | 10,653,800.88 |
| (1) 计提或摊销 | 10,021,533.39 | 10,021,533.39 |
| (2) 固定资产转入 | 632,267.49 | 632,267.49 |
| 本期减少金额 | 3,671,964.25 | 3,671,964.25 |
| (1) 处置 | | |
| (2) 其他转出 | 3,671,964.25 | 3,671,964.25 |
| 期末数 | 84,385,789.93 | 84,385,789.93 |
| 账面价值 | | |
| 期末账面价值 | 274,916,594.34 | 274,916,594.34 |
| 期初账面价值 | 279,122,466.32 | 279,122,466.32 |

14. 固定资产

(1) 账面价值

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|----------|------------------|------------------|
| 固定资产原价 | 4,070,775,402.71 | 3,983,909,228.97 |
| 减：累计折旧 | 1,624,163,069.01 | 1,334,993,674.18 |
| 固定资产减值准备 | | |
| 加：固定资产清理 | | |
| 固定资产合计 | 2,446,612,333.70 | 2,648,915,554.79 |

(2) 固定资产增减变动表

| 项目 | 房屋及建筑物 | 交通工具 | 电子设备 | 办公设备及其他 | 合计 |
|-------------|------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|
| 账面原值 | | | | | |
| 期初数 | 2,670,059,089.59 | 84,125,358.87 | 1,196,431,282.34 | 33,293,498.17 | 3,983,909,228.97 |
| 本期增加金额 | | 4,460,720.81 | 107,546,547.27 | 4,224,880.62 | 116,232,148.70 |
| 1) 购置 | | 4,448,096.39 | 74,334,307.29 | 4,223,728.82 | 83,006,132.50 |
| 2) 在建工程转入 | | | 32,859,851.19 | | 32,859,851.19 |
| 3) 投资性房地产转入 | | | | | |
| 4) 外币报表折算差额 | | 12,624.42 | 352,388.79 | 1,151.80 | 366,165.01 |
| 本期减少金额 | 2,775,964.65 | 6,479,450.08 | 18,617,099.83 | 1,493,460.40 | 29,365,974.96 |
| 1) 处置或报废 | | 6,479,450.08 | 18,617,099.83 | 1,209,852.52 | 26,306,402.43 |

| 项目 | 房屋及建筑物 | 交通工具 | 电子设备 | 办公设备及其他 | 合计 |
|-------------|------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|
| 2) 转入投资性房地产 | 2,775,964.65 | | | | 2,775,964.65 |
| 3) 其他 | | | | 283,607.88 | 283,607.88 |
| 期末数 | 2,667,283,124.94 | 82,106,629.60 | 1,285,360,729.78 | 36,024,918.39 | 4,070,775,402.71 |
| 累计折旧 | | | | | |
| 期初数 | 540,494,605.31 | 58,002,086.86 | 716,517,736.73 | 19,979,245.28 | 1,334,993,674.18 |
| 本期增加金额 | 127,716,400.99 | 4,761,782.34 | 178,096,191.48 | 3,866,580.25 | 314,440,955.06 |
| 1) 计提 | 124,044,436.74 | 4,749,157.92 | 177,776,462.71 | 3,853,094.63 | 310,423,152.00 |
| 2) 投资性房地产转入 | 3,671,964.25 | | | | 3,671,964.25 |
| 3) 外币报表折算差额 | | 12,624.42 | 319,728.77 | 13,485.62 | 345,838.81 |
| 本期减少金额 | 632,267.49 | 6,155,477.57 | 17,420,369.34 | 1,063,445.83 | 25,271,560.23 |
| 1) 处置或报废 | | 6,155,477.57 | 17,426,324.10 | 1,057,491.07 | 24,639,292.74 |
| 2) 转入投资性房地产 | 632,267.49 | | | | 632,267.49 |
| 3) 其他 | | | -5,954.76 | 5,954.76 | |
| 期末数 | 667,578,738.81 | 56,608,391.63 | 877,193,558.87 | 22,782,379.70 | 1,624,163,069.01 |
| 减值准备 | | | | | |
| 期初数 | | | | | |
| 本期增加金额 | | | | | |
| 本期减少金额 | | | | | |
| 期末数 | | | | | |
| 账面价值 | | | | | |
| 期末账面价值 | 1,999,704,386.13 | 25,498,237.97 | 408,167,170.91 | 13,242,538.69 | 2,446,612,333.70 |
| 期初账面价值 | 2,129,564,484.28 | 26,123,272.01 | 479,913,545.61 | 13,314,252.89 | 2,648,915,554.79 |

(3) 暂时闲置固定资产

截至 2023 年 12 月 31 日，公司不存在重大的暂时性闲置固定资产。

(4) 经营租出固定资产

| 项目 | 期末账面价值 |
|--------|---------------|
| 房屋及建筑物 | 14,579,405.07 |
| 小计 | 14,579,405.07 |

(5) 未办妥产权证书的固定资产的情况

| 项目 | 账面价值 | 未办妥产权证书原因 |
|----------------------|------------------|------------------------------|
| 国信金融大厦 | 1,620,770,246.44 | 正在办理中 |
| 绵阳中大财富广场 20-22 层商品房 | 19,039,611.76 | 因开发商涉及诉讼 |
| 深圳市福田区红树福苑小区 20 套人才房 | 4,537,775.53 | 人才安居住房为有限产权, 仅有购房合同, 不予办理房产证 |
| 深圳市罗湖区莲馨家园 6 套人才房 | 3,909,641.66 | |
| 深圳市南山区松坪村三期 4 套人才房 | 998,990.01 | |
| 深圳市福田区信托花园 8 栋 202 房 | 418,661.75 | 因历史原因未办理房产证 |
| 小计 | 1,649,674,927.15 | |

15. 在建工程

| 工程名称 | 期末数 | | 期初数 | | | |
|---------------|---------------|------|---------------|---------------|------|---------------|
| | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 深圳北综合金融服务中心项目 | 43,183,658.64 | | 43,183,658.64 | 2,061,777.72 | | 2,061,777.72 |
| 机房设备建设 | 4,694,024.11 | | 4,694,024.11 | 6,242,398.62 | | 6,242,398.62 |
| 国信金融大厦装修项目 | 1,780,289.69 | | 1,780,289.69 | 5,469,608.06 | | 5,469,608.06 |
| 分支机构装修项目 | | | | 906,415.91 | | 906,415.91 |
| 其他项目 | 2,768,091.16 | | 2,768,091.16 | 5,889,241.17 | | 5,889,241.17 |
| 合计 | 52,426,063.60 | | 52,426,063.60 | 20,569,441.48 | | 20,569,441.48 |

16. 使用权资产

| 项目 | 房屋及建筑物 | 合计 |
|--------|----------------|----------------|
| 账面原值 | | |
| 期初数 | 715,161,472.01 | 715,161,472.01 |
| 本期增加金额 | 218,750,507.90 | 218,750,507.90 |
| 本期减少金额 | 115,375,979.56 | 115,375,979.56 |
| 期末数 | 818,536,000.35 | 818,536,000.35 |
| 累计折旧 | | |
| 期初数 | 297,281,266.85 | 297,281,266.85 |
| 本期增加金额 | 176,941,686.28 | 176,941,686.28 |
| 本期减少金额 | 102,000,054.19 | 102,000,054.19 |
| 期末数 | 372,222,898.94 | 372,222,898.94 |

| 项目 | 房屋及建筑物 | 合计 |
|--------|----------------|----------------|
| 减值准备 | | |
| 期初数 | | |
| 本期增加金额 | | |
| 本期减少金额 | | |
| 期末数 | | |
| 账面价值 | | |
| 期末账面价值 | 446,313,101.41 | 446,313,101.41 |
| 期初账面价值 | 417,880,205.16 | 417,880,205.16 |

17. 无形资产

| 项目 | 土地使用权 | 计算机软件 | 交易席位费 | 其他 | 合计 |
|--------------|----------------|----------------|---------------|--------------|------------------|
| 账面原值 | | | | | |
| 期初数 | 598,127,957.00 | 705,848,305.42 | 66,577,562.50 | 9,115,712.64 | 1,379,669,537.56 |
| 本期增加金额 | | 157,420,424.00 | | | 157,420,424.00 |
| (1) 购置 | | 157,232,542.80 | | | 157,232,542.80 |
| (2) 外币报表折算差额 | | 187,881.20 | | | 187,881.20 |
| 本期减少金额 | | 50,000.00 | | 18.44 | 50,018.44 |
| (1) 处置 | | 50,000.00 | | | 50,000.00 |
| (2) 外币报表折算差额 | | | | 18.44 | 18.44 |
| 期末数 | 598,127,957.00 | 863,218,729.42 | 66,577,562.50 | 9,115,694.20 | 1,537,039,943.12 |
| 累计摊销 | | | | | |
| 期初数 | 175,322,011.52 | 456,019,729.42 | 36,824,817.12 | 3,096,329.48 | 671,262,887.54 |
| 本期增加金额 | 12,078,324.48 | 97,955,208.44 | | 244,840.84 | 110,278,373.76 |
| (1) 计提 | 12,078,324.48 | 97,798,475.80 | | 244,840.84 | 110,121,641.12 |
| (2) 外币报表折算差额 | | 156,732.64 | | | 156,732.64 |
| 本期减少金额 | | 50,000.00 | | 11.06 | 50,011.06 |
| (1) 处置 | | 50,000.00 | | | 50,000.00 |
| (2) 外币报表折算差额 | | | | 11.06 | 11.06 |
| 期末数 | 187,400,336.00 | 553,924,937.86 | 36,824,817.12 | 3,341,159.26 | 781,491,250.24 |
| 减值准备 | | | | | |
| 期初数 | | 3,486.11 | | | 3,486.11 |
| 本期增加金额 | | | | | |

| 项目 | 土地使用权 | 计算机软件 | 交易席位费 | 其他 | 合计 |
|--------|----------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 本期减少金额 | | 3,486.11 | | | 3,486.11 |
| 期末数 | | | | | |
| 账面价值 | | | | | |
| 期末账面价值 | 410,727,621.00 | 309,293,791.56 | 29,752,745.38 | 5,774,534.94 | 755,548,692.88 |
| 期初账面价值 | 422,805,945.48 | 249,825,089.89 | 29,752,745.38 | 6,019,383.16 | 708,403,163.91 |

18. 商誉

(1) 明细情况

| 被投资单位名称或形成商誉的事项 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|-----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 收购证券营业部 | 22,135,974.26 | 22,135,974.26 | | 22,135,974.26 | 22,135,974.26 | |
| 收购子公司 | 10,260,249.61 | | 10,260,249.61 | 10,260,249.61 | | 10,260,249.61 |
| 其中：国信期货公司 | 10,260,249.61 | | 10,260,249.61 | 10,260,249.61 | | 10,260,249.61 |
| 合计 | 32,396,223.87 | 22,135,974.26 | 10,260,249.61 | 32,396,223.87 | 22,135,974.26 | 10,260,249.61 |

(2) 商誉账面原值

| 被投资单位名称或形成商誉的事项 | 期初数 | 本期企业合并形成 | 本期减少 | | 期末数 |
|-----------------|---------------|----------|------|----|---------------|
| | | | 处置 | 其他 | |
| 收购证券营业部 | 22,135,974.26 | | | | 22,135,974.26 |
| 收购子公司 | 10,260,249.61 | | | | 10,260,249.61 |
| 其中：国信期货公司 | 10,260,249.61 | | | | 10,260,249.61 |
| 合计 | 32,396,223.87 | | | | 32,396,223.87 |

(3) 商誉减值准备

| 被投资单位名称或形成商誉的事项 | 期初数 | 本期增加 | | 本期减少 | | 期末数 |
|-----------------|---------------|------|----|------|----|---------------|
| | | 计提 | 其他 | 处置 | 其他 | |
| 收购证券营业部 | 22,135,974.26 | | | | | 22,135,974.26 |
| 小计 | 22,135,974.26 | | | | | 22,135,974.26 |

(4) 商誉减值测试过程

1) 收购证券营业部

本公司收购民安证券有限责任公司（以下简称民安证券）17家营业部计提的商誉减值。本公司于2006年1月收购民安证券17家营业部，收购对价与民安证券17家营业部净资产账面价值的差额12,501,991.26元计入商誉。其余9,633,983.00

元系本公司历年收购其他证券营业部形成的商誉。

2008年本公司对上述商誉余额进行减值测试，计提商誉减值准备 22,135,974.26 元。

2) 收购国信期货公司

本公司于 2007 年 8 月收购国信期货公司，收购对价与国信期货公司净资产账面价值的差额 10,260,249.61 元计入商誉。

目前国内商品期货市场呈现出快速发展的趋势，市场的影响力越来越大，上市品种越来越丰富，相关的资金正不断地进入期货市场，套期保值的能力被越来越多的投资者所接受。在未来较长的时间内，商品期货的发展依然延续。随着期货新品种的不断推出，期货市场的发展空间巨大。国信期货公司业已取得商品期货及金融期货的业务资格，预计国信期货公司的可收回金额高于其账面价值，本公司由此判断该商誉不存在减值迹象。

19. 递延所得税资产、递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

| 项目 | 期末数 | | 期初数 | |
|-------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|
| | 可抵扣暂时性差异 | 递延所得税资产 | 可抵扣暂时性差异 | 递延所得税资产 |
| 计提未付的应付职工薪酬 | 4,925,256,323.42 | 1,231,314,080.86 | 5,478,422,955.23 | 1,369,605,738.81 |
| 资产减值准备 | 2,625,243,645.78 | 656,310,911.45 | 2,349,441,458.19 | 587,360,364.55 |
| 金融工具公允价值变动 | 1,929,598,654.20 | 482,399,663.59 | 2,842,084,836.76 | 710,521,209.15 |
| 可抵扣亏损 | 656,898,597.88 | 164,224,649.47 | | |
| 预计负债 | 14,900,556.86 | 3,725,139.22 | 39,999,376.78 | 9,999,844.20 |
| 递延收益 | 119,337,931.44 | 29,834,483.04 | 122,813,793.48 | 30,703,448.52 |
| 租赁负债 | 390,365,940.74 | 97,591,485.41 | | |
| 其他 | 577,799,901.99 | 144,449,975.51 | 559,849,051.28 | 139,962,262.82 |
| 合计 | 11,239,401,552.31 | 2,809,850,388.55 | 11,392,611,471.72 | 2,848,152,868.05 |

(2) 未经抵销的递延所得税负债

| 项目 | 期末数 | | 期初数 | |
|---------------|------------------|------------------|------------------|----------------|
| | 应纳税暂时性差异 | 递延所得税负债 | 应纳税暂时性差异 | 递延所得税负债 |
| 金融工具公允价值变动 | 3,477,243,353.29 | 869,310,838.40 | 1,417,392,307.90 | 354,348,077.04 |
| 合营 / 联营企业损益变动 | 114,950,033.09 | 28,737,508.27 | 137,490,481.46 | 34,372,620.37 |
| 使用权资产 | 394,720,896.77 | 98,680,224.39 | | |
| 其他 | 61,100,682.44 | 15,275,170.61 | 6,216,222.04 | 1,554,055.51 |
| 合计 | 4,048,014,965.59 | 1,012,003,741.67 | 1,561,099,011.40 | 390,274,752.92 |

(3) 未确认递延所得税资产明细

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|----------|----------------|------------------|
| 可抵扣暂时性差异 | 290,746,714.19 | 592,448,392.08 |
| 可抵扣亏损 | 646,262,092.43 | 583,048,937.31 |
| 小计 | 937,008,806.62 | 1,175,497,329.39 |

(4) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

未确认递延所得税资产的可抵扣亏损系本公司之子公司国信香港公司尚在可补亏年度内的亏损额，预计该公司短期难以补亏，故未确认递延所得税资产，且该亏损额无抵扣时间限制。

20. 其他资产

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|----------------|----------------|
| 预缴税金 | 587,702,847.22 | 7,334,367.67 |
| 长期待摊费用 | 140,877,400.82 | 144,823,319.83 |
| 其他应收款 | 96,393,978.13 | 95,681,952.89 |
| 预付款项 | 86,692,867.14 | 99,499,914.52 |
| 待认证进项税 | 32,714,306.36 | 95,728,819.40 |
| 应收股利 | 23,728,112.09 | 8,370,280.34 |
| 大宗商品 | 9,950,619.49 | |
| 期货会员资格 | | 1,400,000.00 |
| 待抵扣进项税 | | 466,885.65 |
| 合计 | 978,060,131.25 | 453,305,540.30 |

(2) 其他应收款

1) 明细情况

| 款项性质 | 期末数 | 期初数 |
|-------------|---------------|---------------|
| 押金 | 44,094,129.48 | 43,124,874.41 |
| 外单位往来款 | 29,318,125.11 | 26,599,053.80 |
| 代垫诉讼款 | 16,007,907.91 | 15,849,431.91 |
| 社保费 | 4,923,206.15 | 5,200,214.78 |
| 预付款 | 4,189,588.09 | 3,832,396.07 |
| 租金 | 3,862,956.55 | 2,736,332.64 |
| 备用金 | 1,075,937.63 | 2,020,568.87 |
| 其他 | 7,478,042.74 | 10,835,632.18 |
| 减：其他应收款坏账准备 | 14,555,915.53 | 14,516,551.77 |
| 小计 | 96,393,978.13 | 95,681,952.89 |

2) 类别明细情况

| 种类 | 期末数 | | | | |
|------------|----------------|--------|---------------|----------|---------------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | | 账面价值 |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 计提比例 (%) | |
| 单项计提坏账准备 | 7,300,000.00 | 6.58 | 7,300,000.00 | 100.00 | |
| 按组合计提坏账准备 | 103,649,893.66 | 93.42 | 7,255,915.53 | 7.00 | 96,393,978.13 |
| 其中：应收往来款组合 | 38,892,599.79 | 35.05 | 7,255,915.53 | 18.66 | 31,636,684.26 |
| 应收押金保证金组合 | 64,757,293.87 | 58.37 | | | 64,757,293.87 |
| 合计 | 110,949,893.66 | 100.00 | 14,555,915.53 | 13.12 | 96,393,978.13 |

(续上表)

| 种类 | 期初数 | | | | |
|------------|----------------|--------|---------------|----------|---------------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | | 账面价值 |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 计提比例 (%) | |
| 单项计提坏账准备 | 7,300,000.00 | 6.62 | 7,300,000.00 | 100.00 | |
| 按组合计提坏账准备 | 102,898,504.66 | 93.38 | 7,216,551.77 | 7.01 | 95,681,952.89 |
| 其中：应收往来款组合 | 30,994,641.95 | 28.13 | 7,216,551.77 | 23.28 | 23,778,090.18 |
| 应收押金保证金组合 | 71,903,862.71 | 65.25 | | | 71,903,862.71 |
| 合计 | 110,198,504.66 | 100.00 | 14,516,551.77 | 13.17 | 95,681,952.89 |

3) 期末单项计提坏账准备的其他应收款

| 其他应收款内容 | 账面余额 | 坏账准备 | 计提比例 (%) | 计提理由 |
|------------|--------------|--------------|----------|--------|
| 中国华兴(集团)公司 | 7,300,000.00 | 7,300,000.00 | 100.00 | 处于关停状态 |

4) 按组合计提坏账准备的其他应收款

| 种类 | 期末数 | | | |
|---------|----------------|--------|--------------|--------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 比例 (%) |
| 应收押金保证金 | 64,757,293.87 | 62.48 | | |
| 应收往来款组合 | 38,892,599.79 | 37.52 | 7,255,915.53 | 18.66 |
| 其中：1年以内 | 14,536,121.96 | 14.02 | 72,680.61 | 0.50 |
| 1至2年 | 716,246.05 | 0.69 | 35,812.30 | 5.00 |
| 2至3年 | 197,047.16 | 0.19 | 19,704.72 | 10.00 |
| 3年以上 | 23,443,184.62 | 22.62 | 7,127,717.90 | 30.40 |
| 合计 | 103,649,893.66 | 100.00 | 7,255,915.53 | 7.00 |

(续上表)

| 种类 | 期初数 | | | |
|----------|----------------|--------|--------------|--------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 比例 (%) |
| 应收押金保证金 | 71,903,862.71 | 69.88 | | |
| 应收往来款组合 | 30,994,641.95 | 30.12 | 7,216,551.77 | 23.28 |
| 其中：1 年以内 | 6,805,355.86 | 6.61 | 34,026.78 | 0.50 |
| 1 至 2 年 | 197,047.16 | 0.19 | 9,852.36 | 5.00 |
| 2 至 3 年 | 9,325,719.17 | 9.06 | 932,571.92 | 10.00 |
| 3 年以上 | 14,666,519.76 | 14.26 | 6,240,100.71 | 42.55 |
| 合计 | 102,898,504.66 | 100.00 | 7,216,551.77 | 7.01 |

5) 坏账准备变动情况

| 项目 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 小计 |
|----------------|--------------------|--------------------------|--------------------------|---------------|
| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | |
| 期初数 | 7,216,551.77 | | 7,300,000.00 | 14,516,551.77 |
| 本期计提 | 80,209.81 | | | 80,209.81 |
| 本期收回或转回 | 40,846.05 | | | 40,846.05 |
| 本期核销 | | | | |
| 期末数 | 7,255,915.53 | | 7,300,000.00 | 14,555,915.53 |
| 期末坏账准备计提比例 (%) | 18.66 | | 100.00 | 13.12 |

(3) 长期待摊费用

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期摊销 | 其他减少 | 期末数 | 其他减少的原因 |
|--------|----------------|---------------|---------------|------------|----------------|---------|
| 办公家私 | 18,625,459.10 | 7,024,767.47 | 9,871,465.35 | 19,686.73 | 15,759,074.49 | 报废 |
| 装修费及其他 | 126,197,860.73 | 56,353,139.94 | 57,473,316.79 | -40,642.45 | 125,118,326.33 | 外币报表折算 |
| 合计 | 144,823,319.83 | 63,377,907.41 | 67,344,782.14 | -20,955.72 | 140,877,400.82 | |

21. 资产减值准备明细

(1) 明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期计提 | 本期减少 | | 外币报表折算差额 | 期末数 |
|-------------------|------------------|----------------|------------|----------------|---------------|------------------|
| | | | 转回 | 转销 / 核销 | | |
| 融出资金减值准备 | 143,527,386.82 | 7,496,617.86 | | | 10,031.15 | 151,034,035.83 |
| 应收款项坏账准备 | 1,601,134,132.87 | 234,015,465.71 | 806,666.32 | | 12,694,756.52 | 1,847,037,688.78 |
| 买入返售金融资产减值准备 | 1,305,749,652.15 | 34,564,993.90 | | | | 1,340,314,646.05 |
| 债权投资减值准备 | 299,632.46 | 322.58 | | | 2,627.47 | 302,582.51 |
| 其他债权投资减值准备 | 276,247,058.65 | 86,266,479.27 | | 123,655,258.11 | | 238,858,279.81 |
| 其他应收款坏账准备 | 14,516,551.77 | 39,363.76 | | | | 14,555,915.53 |
| 金融工具及其他项目信用减值准备小计 | 3,341,474,414.72 | 362,383,243.08 | 806,666.32 | 123,655,258.11 | 12,707,415.14 | 3,592,103,148.51 |
| 商誉减值准备 | 22,135,974.26 | | | | | 22,135,974.26 |
| 大宗商品跌价准备 | | 55,060.67 | 55,060.67 | | | |
| 无形资产减值准备 | 3,486.11 | | | 3,486.11 | | |
| 其他资产减值准备小计 | 22,139,460.37 | 55,060.67 | 55,060.67 | 3,486.11 | | 22,135,974.26 |
| 合计 | 3,363,613,875.09 | 362,438,303.75 | 861,726.99 | 123,658,744.22 | 12,707,415.14 | 3,614,239,122.77 |

(2) 金融工具及其他项目预期信用损失准备

| 项目 | 期末数 | | | 小计 |
|------------------|----------------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | |
| 买入返售金融资产减值准备 | 1,356,247.30 | 77,043.02 | 1,338,881,355.73 | 1,340,314,646.05 |
| 应收款项坏账准备 (简化模型) | | 26,031,251.90 | 1,821,006,436.88 | 1,847,037,688.78 |
| 融出资金减值准备 | 140,729,383.22 | | 10,304,652.61 | 151,034,035.83 |
| 债权投资减值准备 | 302,582.51 | | | 302,582.51 |
| 其他债权投资减值准备 | 77,440,866.92 | 99,317,865.01 | 62,099,547.88 | 238,858,279.81 |
| 其他应收款减值准备 (一般模型) | 7,255,915.53 | | 7,300,000.00 | 14,555,915.53 |
| 合计 | 227,084,995.48 | 125,426,159.93 | 3,239,591,993.10 | 3,592,103,148.51 |

22. 所有权或使用权受到限制的资产

(1) 期末资产受限情况

| 项目 | 期末账面余额 | 期末账面价值 | 受限类型 | 受限原因 |
|----------|--------------------|--------------------|--------|----------------|
| 货币资金 | 551,519,571.46 | 551,519,571.46 | 冻结、质押等 | 风险准备金、司法冻结等 |
| 交易性金融资产 | 51,833,256,887.28 | 51,833,256,887.28 | 质押 | 为回购业务设定质押或过户 |
| 交易性金融资产 | 12,365,049,927.80 | 12,365,049,927.80 | 质押 | 为债券借贷业务设定质押 |
| 交易性金融资产 | 1,818,552,270.00 | 1,818,552,270.00 | 质押 | 为期货业务充抵保证金设定质押 |
| 交易性金融资产 | 398,060,086.19 | 398,060,086.19 | 限售 | 限售股 |
| 交易性金融资产 | 905,326,793.92 | 905,326,793.92 | 已转移 | 融出证券 |
| 其他债权投资 | 54,633,411,341.21 | 54,633,411,341.21 | 质押 | 为回购业务设定质押 |
| 其他债权投资 | 12,484,578,730.00 | 12,484,578,730.00 | 质押 | 为债券借贷业务设定质押 |
| 其他债权投资 | 688,188,091.00 | 688,188,091.00 | 质押 | 为期货业务充抵保证金设定质押 |
| 其他权益工具投资 | 2,086,221,330.00 | 2,086,221,330.00 | 质押 | 为债券借贷业务设定质押 |
| 其他权益工具投资 | 92,635,449.72 | 92,635,449.72 | 已转移 | 融出证券 |
| 合计 | 137,856,800,478.58 | 137,856,800,478.58 | | |

(2) 期初资产受限情况

| 项目 | 期初账面余额 | 期初账面价值 | 受限类型 | 受限原因 |
|----------|--------------------|--------------------|-------|----------------|
| 货币资金 | 1,228,187,600.13 | 1,228,187,600.13 | 冻结、质押 | 风险准备金、司法冻结等 |
| 交易性金融资产 | 74,507,012,374.44 | 74,507,012,374.44 | 质押 | 为回购业务设定质押或过户 |
| 交易性金融资产 | 11,578,050,552.00 | 11,578,050,552.00 | 质押 | 为债券借贷业务设定质押 |
| 交易性金融资产 | 5,329,114,874.00 | 5,329,114,874.00 | 质押 | 为期货业务充抵保证金设定质押 |
| 交易性金融资产 | 1,218,725,204.49 | 1,218,725,204.49 | 限售 | 限售股 |
| 交易性金融资产 | 1,023,552,825.96 | 1,023,552,825.96 | 已转移 | 融出证券 |
| 其他债权投资 | 41,656,481,476.92 | 41,656,481,476.92 | 质押 | 为回购业务设定质押 |
| 其他债权投资 | 2,438,557,570.00 | 2,438,557,570.00 | 质押 | 为债券借贷业务设定质押 |
| 其他债权投资 | 3,045,642,030.00 | 3,045,642,030.00 | 质押 | 为期货业务充抵保证金设定质押 |
| 其他权益工具投资 | 146,735,038.90 | 146,735,038.90 | 已转移 | 融出证券 |
| 合计 | 142,172,059,546.84 | 142,172,059,546.84 | | |

23. 短期借款

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|------|--------------|-----|
| 信用借款 | 3,640,000.00 | |
| 合计 | 3,640,000.00 | |

24. 应付短期融资款

| 项目 | 面值 | 起息日期 | 债券 期限 | 发行金额 | 票面 利率 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|---------------|--------------------|------------|----------|--------------------|----------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 22 国信证券 CP001 | 3,000,000,000.00 | 2022/2/10 | 365 天 | 3,000,000,000.00 | 2.50% | 3,066,780,821.92 | 8,219,178.08 | 3,075,000,000.00 | |
| 22 国信证券 CP004 | 1,500,000,000.00 | 2022/2/21 | 365 天 | 1,500,000,000.00 | 2.49% | 1,532,131,232.88 | 5,218,767.12 | 1,537,350,000.00 | |
| 22 国信证券 CP006 | 2,300,000,000.00 | 2022/3/1 | 365 天 | 2,300,000,000.00 | 2.58% | 2,349,748,054.79 | 9,591,945.21 | 2,359,340,000.00 | |
| 22 国信证券 CP010 | 1,500,000,000.00 | 2022/4/12 | 365 天 | 1,500,000,000.00 | 2.52% | 1,527,340,273.97 | 10,459,726.03 | 1,537,800,000.00 | |
| 22 国信证券 CP012 | 1,500,000,000.00 | 2022/4/25 | 365 天 | 1,500,000,000.00 | 2.47% | 1,525,478,219.18 | 11,571,780.82 | 1,537,050,000.00 | |
| 22 国信证券 CP014 | 1,500,000,000.00 | 2022/4/28 | 365 天 | 1,500,000,000.00 | 2.42% | 1,524,664,109.59 | 11,635,890.41 | 1,536,300,000.00 | |
| 22 国信证券 CP016 | 1,500,000,000.00 | 2022/5/16 | 365 天 | 1,500,000,000.00 | 2.37% | 1,522,401,369.86 | 13,148,630.14 | 1,535,550,000.00 | |
| 22 国信证券 CP019 | 3,000,000,000.00 | 2022/12/26 | 88 天 | 3,000,000,000.00 | 2.55% | 3,001,257,534.25 | 17,186,301.37 | 3,018,443,835.62 | |
| 23 国信证券 CP001 | 5,000,000,000.00 | 2023/1/16 | 123 天 | 5,000,000,000.00 | 2.50% | | 5,042,123,287.67 | 5,042,123,287.67 | |
| 23 国信证券 CP002 | 1,500,000,000.00 | 2023/1/18 | 128 天 | 1,500,000,000.00 | 2.50% | | 1,513,150,684.93 | 1,513,150,684.93 | |
| 23 国信证券 CP003 | 1,000,000,000.00 | 2023/3/13 | 88 天 | 1,000,000,000.00 | 2.55% | | 1,006,131,147.54 | 1,006,131,147.54 | |
| 23 国信证券 CP004 | 4,000,000,000.00 | 2023/3/13 | 179 天 | 4,000,000,000.00 | 2.65% | | 4,051,841,530.05 | 4,051,841,530.05 | |
| 23 国信证券 CP005 | 3,000,000,000.00 | 2023/3/20 | 179 天 | 3,000,000,000.00 | 2.62% | | 3,038,440,983.61 | 3,038,440,983.61 | |
| 23 国信证券 CP006 | 2,000,000,000.00 | 2023/3/29 | 90 天 | 2,000,000,000.00 | 2.47% | | 2,012,147,540.98 | 2,012,147,540.98 | |
| 23 国信证券 CP007 | 2,000,000,000.00 | 2023/3/29 | 365 天 | 2,000,000,000.00 | 2.73% | | 2,041,472,131.15 | 2,041,472,131.15 | |
| 23 国信证券 CP008 | 2,000,000,000.00 | 2023/4/17 | 179 天 | 2,000,000,000.00 | 2.56% | | 2,025,040,437.16 | 2,025,040,437.16 | |
| 23 国信证券 CP009 | 2,500,000,000.00 | 2023/4/18 | 91 天 | 2,500,000,000.00 | 2.48% | | 2,515,415,300.55 | 2,515,415,300.55 | |
| 23 国信证券 CP010 | 2,000,000,000.00 | 2023/5/17 | 184 天 | 2,000,000,000.00 | 2.35% | | 2,023,628,415.30 | 2,023,628,415.30 | |
| 23 国信证券 CP011 | 1,100,000,000.00 | 2023/5/22 | 365 天 | 1,100,000,000.00 | 2.52% | | 1,116,965,245.90 | 1,116,965,245.90 | |
| 23 国信证券 CP012 | 2,000,000,000.00 | 2023/7/7 | 102 天 | 2,000,000,000.00 | 2.12% | | 2,011,816,393.44 | 2,011,816,393.44 | |
| 23 国信证券 CP013 | 2,000,000,000.00 | 2023/7/17 | 151 天 | 2,000,000,000.00 | 2.13% | | 2,017,575,409.84 | 2,017,575,409.84 | |
| 23 国信证券 CP014 | 3,000,000,000.00 | 2023/9/7 | 273 天 | 3,000,000,000.00 | 2.35% | | 3,022,344,262.30 | 3,022,344,262.30 | |
| 23 国信证券 CP015 | 2,000,000,000.00 | 2023/9/8 | 182 天 | 2,000,000,000.00 | 2.30% | | 2,014,453,551.91 | 2,014,453,551.91 | |
| 23 国信证券 CP016 | 3,000,000,000.00 | 2023/9/19 | 161 天 | 3,000,000,000.00 | 2.42% | | 3,020,629,508.20 | 3,020,629,508.20 | |
| 23 国信证券 CP017 | 3,000,000,000.00 | 2023/9/26 | 87 天 | 3,000,000,000.00 | 2.35% | | 3,016,758,196.72 | 3,016,758,196.72 | |
| 23 国信证券 CP018 | 3,000,000,000.00 | 2023/10/11 | 218 天 | 3,000,000,000.00 | 2.46% | | 3,016,534,426.23 | 3,016,534,426.23 | |
| 23 国信证券 CP019 | 1,900,000,000.00 | 2023/10/17 | 304 天 | 1,900,000,000.00 | 2.55% | | 1,910,060,655.74 | 1,910,060,655.74 | |
| 23 国信证券 CP020 | 1,500,000,000.00 | 2023/10/24 | 120 天 | 1,500,000,000.00 | 2.59% | | 1,507,324,180.33 | 1,507,324,180.33 | |
| 23 国信证券 CP021 | 1,000,000,000.00 | 2023/11/3 | 186 天 | 1,000,000,000.00 | 2.62% | | 1,004,223,497.27 | 1,004,223,497.27 | |
| 23 国信证券 CP022 | 2,000,000,000.00 | 2023/11/7 | 189 天 | 2,000,000,000.00 | 2.60% | | 2,007,814,207.65 | 2,007,814,207.65 | |
| 23 国信证券 CP023 | 4,000,000,000.00 | 2023/11/13 | 155 天 | 4,000,000,000.00 | 2.65% | | 4,014,191,256.83 | 4,014,191,256.83 | |
| 23 国信证券 CP024 | 2,600,000,000.00 | 2023/11/16 | 300 天 | 2,600,000,000.00 | 2.65% | | 2,608,659,562.84 | 2,608,659,562.84 | |
| 23 国信证券 CP025 | 2,000,000,000.00 | 2023/11/23 | 274 天 | 2,000,000,000.00 | 2.67% | | 2,005,690,163.93 | 2,005,690,163.93 | |
| 23 国信证券 CP026 | 4,000,000,000.00 | 2023/11/27 | 213 天 | 4,000,000,000.00 | 2.69% | | 4,010,289,617.49 | 4,010,289,617.49 | |
| 23 国信证券 CP027 | 1,700,000,000.00 | 2023/12/7 | 365 天 | 1,700,000,000.00 | 2.80% | | 1,703,251,366.12 | 1,703,251,366.12 | |
| 23 国信证券 CP028 | 2,000,000,000.00 | 2023/12/13 | 93 天 | 2,000,000,000.00 | 2.85% | | 2,002,959,016.39 | 2,002,959,016.39 | |
| 22 国信 D1 | 3,000,000,000.00 | 2022/4/6 | 365 天 | 3,000,000,000.00 | 2.58% | 3,057,254,794.52 | 20,145,205.48 | 3,077,400,000.00 | |
| 23 国信 D1 | 3,000,000,000.00 | 2023/4/11 | 366 天 | 3,000,000,000.00 | 2.69% | | 3,058,430,327.87 | 3,058,430,327.87 | |
| 收益凭证 [注] | 20,959,276,000.00 | | | 20,959,276,000.00 | | 3,408,938,900.01 | 17,742,701,404.76 | 5,676,760,528.88 | 15,474,879,775.89 |
| 合计 | 109,559,276,000.00 | | | 109,559,276,000.00 | | 22,515,995,310.97 | 88,189,241,135.36 | 55,165,063,692.29 | 55,540,172,754.04 |

[注] 本公司 2023 年共发行 1052 期收益凭证，其中一年期以下 931 期，一年期以上 121 期；一年期以下收益凭证未到期产品 185 期，固定收益率为 0.00%-3.12%；一年期以上收益凭证未到期产品 119 期，固定收益率为 0.00%-2.70%；一年期以上收益凭证未到期产品 5 期，非保本无固定收益率

25. 拆入资金

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|---------|------------------|------------------|
| 银行拆入资金 | 2,970,925,900.01 | 9,003,096,388.97 |
| 转融通拆入资金 | 4,061,037,694.59 | 3,066,094.36 |
| 合计 | 7,031,963,594.60 | 9,006,162,483.33 |

(2) 转融通拆入资金

| 剩余期限 | 期末数 | | 期初数 | |
|--------|------------------|-------------|--------------|------|
| | 金额 | 利率区间 | 金额 | 利率区间 |
| 1个月以内 | 104,579,732.35 | 2.16% | 3,066,094.36 | — |
| 1至3个月 | 445,828,101.13 | 2.30% | | |
| 3至12个月 | 3,510,629,861.11 | 2.85%-3.05% | | |
| 1年以上 | | | | |
| 合计 | 4,061,037,694.59 | | 3,066,094.36 | |

26. 交易性金融负债

| 项目 | 期末数 | | 合计 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|------------------|
| | 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 | 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 | |
| 债券借贷 | 756,206,789.48 | | 756,206,789.48 |
| 收益凭证 | 157,390,186.45 | | 157,390,186.45 |
| 第三方在结构化主体中享有的权益 | 363,672,936.05 | | 363,672,936.05 |
| 融入证券 | 1,931,565.30 | | 1,931,565.30 |
| 合计 | 1,279,201,477.28 | | 1,279,201,477.28 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | 合计 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|------------------|
| | 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 | 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 | |
| 债券借贷 | 703,343,959.76 | | 703,343,959.76 |
| 收益凭证 | 634,123,314.74 | | 634,123,314.74 |
| 第三方在结构化主体中享有的权益 | 430,387,133.47 | | 430,387,133.47 |
| 融入证券 | 21,992,946.65 | | 21,992,946.65 |
| 合计 | 1,789,847,354.62 | | 1,789,847,354.62 |

27. 卖出回购金融资产款

(1) 明细情况——按业务类型

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|---------|--------------------|--------------------|
| 质押式卖出回购 | 120,367,581,340.36 | 109,185,313,445.70 |
| 质押式报价回购 | 3,238,836,290.50 | 4,580,114,046.73 |
| 买断式卖出回购 | 669,175,322.03 | 418,431,890.74 |
| 合计 | 124,275,592,952.89 | 114,183,859,383.17 |

(2) 明细情况——按金融资产种类

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|----|--------------------|--------------------|
| 债券 | 124,275,592,952.89 | 114,183,859,383.17 |
| 合计 | 124,275,592,952.89 | 114,183,859,383.17 |

(3) 担保物情况

| 项目 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|----|--------------------|--------------------|
| 债券 | 143,401,541,444.49 | 128,983,026,571.36 |
| 合计 | 143,401,541,444.49 | 128,983,026,571.36 |

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

| 剩余期限 | 期末数 | 利率区间 | 期初数 | 利率区间 |
|----------|------------------|------------|------------------|------------|
| 1个月内 | 3,068,081,035.05 | 1.4%-8.88% | 4,338,458,294.43 | 1.4%-8.18% |
| 1个月至3个月内 | 114,200,937.03 | | 157,160,286.95 | |
| 3个月至1年内 | 56,554,318.42 | | 84,495,465.35 | |
| 1年以上 | | | | |
| 小计 | 3,238,836,290.50 | | 4,580,114,046.73 | |

28. 代理买卖证券款

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|-------------------|-------------------|
| 普通经纪业务 | | |
| 其中：个人 | 39,044,483,501.94 | 39,526,716,492.42 |
| 机构 | 11,152,338,551.32 | 12,715,154,376.88 |
| 小计 | 50,196,822,053.26 | 52,241,870,869.30 |

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|-------|-------------------|-------------------|
| 信用业务 | | |
| 其中：个人 | 4,399,666,119.29 | 5,084,705,483.13 |
| 机构 | 1,474,458,703.25 | 2,087,238,156.70 |
| 小计 | 5,874,124,822.54 | 7,171,943,639.83 |
| 合计 | 56,070,946,875.80 | 59,413,814,509.13 |

(2) 分币种列示

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|--------|------------------|--------|-------------------|------------------|--------|-------------------|
| | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 | 原币金额 | 汇率 | 人民币金额 |
| 人民币 | | | 53,795,683,644.93 | | | 56,670,477,210.72 |
| 美元 | 79,978,020.10 | 7.0827 | 566,460,322.93 | 120,734,342.62 | 6.9646 | 840,866,403.29 |
| 港币 | 1,883,435,698.39 | 0.9062 | 1,706,769,429.95 | 2,129,711,065.67 | 0.8933 | 1,902,470,895.12 |
| 日元 | 39,053,489.00 | 0.0502 | 1,960,485.16 | | | |
| 马来西亚吉特 | 46,381.78 | 1.5415 | 71,497.51 | | | |
| 新西兰元 | 332.36 | 4.4991 | 1,495.32 | | | |
| 合计 | | | 56,070,946,875.80 | | | 59,413,814,509.13 |

29. 代理承销证券款

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|----|---------------|-----|
| 股票 | 44,000,000.00 | |
| 合计 | 44,000,000.00 | |

30. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|--------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 短期薪酬 | 5,858,841,801.20 | 4,670,727,682.12 | 5,226,417,013.36 | 5,303,152,469.96 |
| 离职后福利—设定提存计划 | 4,856,381.05 | 635,152,782.10 | 634,681,787.42 | 5,327,375.73 |
| 辞退福利 | | 989,713.55 | 989,713.55 | |
| 合计 | 5,863,698,182.25 | 5,306,870,177.77 | 5,862,088,514.33 | 5,308,479,845.69 |

(2) 短期薪酬明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|-------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 5,551,616,672.32 | 3,906,101,666.63 | 4,442,935,813.43 | 5,014,782,525.52 |
| 职工福利费 | | 119,682,873.91 | 119,682,873.91 | |
| 社会保险费 | 1,861,901.74 | 203,221,777.19 | 203,844,279.91 | 1,239,399.02 |
| 其中：医疗保险费 | 1,593,720.07 | 187,637,661.99 | 188,193,243.58 | 1,038,138.48 |
| 工伤保险费 | 50,727.30 | 4,557,045.44 | 4,556,414.78 | 51,357.96 |
| 生育保险费 | 217,454.37 | 11,027,069.76 | 11,094,621.55 | 149,902.58 |
| 住房公积金 | 421,538.12 | 335,037,705.20 | 334,980,270.45 | 478,972.87 |
| 工会经费和职工教育经费 | 304,941,689.02 | 91,982,670.71 | 110,272,787.18 | 286,651,572.55 |
| 其他短期薪酬 | | 14,700,988.48 | 14,700,988.48 | |
| 小计 | 5,858,841,801.20 | 4,670,727,682.12 | 5,226,417,013.36 | 5,303,152,469.96 |

(3) 设定提存计划明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|--------------|--------------|----------------|----------------|--------------|
| 基本养老保险 | 2,260,452.41 | 369,972,344.56 | 369,919,217.87 | 2,313,579.10 |
| 失业保险费 | 62,984.55 | 7,290,172.88 | 7,289,739.41 | 63,418.02 |
| 补充养老保险（企业年金） | 2,532,944.09 | 257,890,264.66 | 257,472,830.14 | 2,950,378.61 |
| 小计 | 4,856,381.05 | 635,152,782.10 | 634,681,787.42 | 5,327,375.73 |

31. 应交税费

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------------|----------------|----------------|
| 企业所得税 | 28,483,614.04 | 221,275,525.62 |
| 代扣代缴税金 | 94,088,666.06 | 162,927,929.41 |
| 其中：代扣代缴个人所得税 | 71,465,163.62 | 108,025,313.38 |
| 增值税 | 72,396,618.15 | 74,120,184.62 |
| 城市维护建设税 | 5,140,272.34 | 5,207,191.86 |
| 教育费附加及地方教育附加 | 3,670,371.12 | 3,720,338.48 |
| 房产税 | 2,723,346.79 | 2,697,475.26 |
| 其他 | 1,431,043.29 | 1,296,049.36 |
| 合计 | 207,933,931.79 | 471,244,694.61 |

32. 应付款项

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 收益互换业务相关款项 | 14,277,469,076.26 | 8,394,044,472.30 |
| 待交付清算款 | 4,755,634,048.54 | 2,866,487,556.95 |
| 应付银行承兑汇票 | 335,693,503.14 | 990,152,898.21 |
| 应付场外业务结算款 | 99,175,836.00 | 182,487,861.65 |
| 应付资管产品增值税及附加 | 66,249,201.95 | 57,098,673.58 |
| 应付投行手续费支出 | 31,411,451.69 | 32,253,697.51 |
| 应付投资者保护基金 | 31,222,234.64 | 29,012,856.06 |
| 应付外单位往来款 | 16,722,639.25 | 15,346,869.33 |
| 应付期权费 | 15,142,165.75 | 11,953,554.00 |
| 应付银行三方存管费 | 14,248,941.95 | 18,313,864.42 |
| 利率互换集中清算结算资金 | | 20,540,869.53 |
| 银行中间业务费 | | 668,009.53 |
| 其他 | 240,105,318.77 | 80,470,132.54 |
| 合计 | 19,883,074,417.94 | 12,698,831,315.61 |

33. 合同负债

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|--------------|------------|
| 大宗商品货款 | 3,027,522.94 | |
| 其他 | 8,962.26 | 433,018.86 |
| 合计 | 3,036,485.20 | 433,018.86 |

34. 预计负债

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 未决诉讼 | 39,999,376.78 | 16,476,997.40 | 41,575,817.32 | 14,900,556.86 |
| 合计 | 39,999,376.78 | 16,476,997.40 | 41,575,817.32 | 14,900,556.86 |

35. 应付债券

| 类型 | 债券名称 | 面值 | 起息日期 | 债券期限 | 发行金额 | 票面利率 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额 |
|-----|----------|------------------|------------|------|------------------|-------|------------------|---------------|------------------|------|
| 公司债 | 20 国信 01 | 3,000,000,000.00 | 2020/1/13 | 3 年 | 3,000,000,000.00 | 3.60% | 3,104,449,315.07 | 3,550,684.93 | 3,108,000,000.00 | |
| 公司债 | 20 国信 02 | 5,000,000,000.00 | 2020/3/2 | 3 年 | 5,000,000,000.00 | 3.17% | 5,131,396,987.29 | 27,103,012.71 | 5,158,500,000.00 | |
| 公司债 | 20 国信 06 | 2,000,000,000.00 | 2020/12/22 | 3 年 | 2,000,000,000.00 | 3.70% | 1,998,201,401.44 | 75,798,598.56 | 2,074,000,000.00 | |

| 类型 | 债券名称 | 面值 | 起息日期 | 债券 期限 | 发行金额 | 票面 利率 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额 |
|------|----------|-------------------|------------|----------|-------------------|----------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 公司债 | 21 国信 02 | 2,000,000,000.00 | 2021/2/1 | 3 年 | 2,000,000,000.00 | 3.64% | 2,063,891,619.52 | 75,315,723.32 | 72,800,000.00 | 2,066,407,342.84 |
| 公司债 | 21 国信 03 | 2,000,000,000.00 | 2021/7/6 | 3 年 | 2,000,000,000.00 | 3.35% | 2,029,878,388.27 | 68,896,322.63 | 67,000,000.00 | 2,031,774,710.90 |
| 公司债 | 21 国信 04 | 3,000,000,000.00 | 2021/7/6 | 5 年 | 3,000,000,000.00 | 3.68% | 3,043,714,358.88 | 113,231,218.68 | 110,400,000.00 | 3,046,545,577.56 |
| 公司债 | 21 国信 05 | 2,400,000,000.00 | 2021/7/21 | 3 年 | 2,400,000,000.00 | 3.16% | 2,431,811,903.83 | 77,256,329.95 | 75,840,000.00 | 2,433,228,233.78 |
| 公司债 | 21 国信 06 | 3,300,000,000.00 | 2021/7/21 | 5 年 | 3,300,000,000.00 | 3.48% | 3,347,240,851.90 | 115,944,301.15 | 114,840,000.00 | 3,348,345,153.05 |
| 公司债 | 21 国信 07 | 2,700,000,000.00 | 2021/9/15 | 3 年 | 2,700,000,000.00 | 3.09% | 2,721,855,948.31 | 85,060,664.69 | 83,430,000.00 | 2,723,486,613.00 |
| 公司债 | 21 国信 10 | 4,000,000,000.00 | 2021/10/22 | 3 年 | 4,000,000,000.00 | 3.28% | 4,018,569,755.27 | 135,102,464.87 | 131,200,000.00 | 4,022,472,220.14 |
| 公司债 | 21 国信 11 | 1,000,000,000.00 | 2021/10/22 | 5 年 | 1,000,000,000.00 | 3.63% | 1,003,337,163.49 | 37,273,756.11 | 36,300,000.00 | 1,004,310,919.60 |
| 公司债 | 21 国信 12 | 3,000,000,000.00 | 2021/11/23 | 3 年 | 3,000,000,000.00 | 3.09% | 3,006,445,811.99 | 94,559,729.74 | 92,700,000.00 | 3,008,305,541.73 |
| 公司债 | 21 国信 13 | 2,000,000,000.00 | 2021/11/23 | 5 年 | 2,000,000,000.00 | 3.43% | 1,995,757,535.99 | 71,598,841.02 | 68,600,000.00 | 1,998,756,377.01 |
| 公司债 | 22 国信 01 | 3,000,000,000.00 | 2022/1/11 | 3 年 | 3,000,000,000.00 | 2.92% | 3,081,426,415.08 | 89,486,792.40 | 87,600,000.00 | 3,083,313,207.48 |
| 公司债 | 22 国信 02 | 1,000,000,000.00 | 2022/1/11 | 5 年 | 1,000,000,000.00 | 3.28% | 1,030,391,935.90 | 33,177,358.48 | 32,800,000.00 | 1,030,769,294.38 |
| 公司债 | 22 国信 03 | 500,000,000.00 | 2022/2/24 | 3 年 | 500,000,000.00 | 2.95% | 509,947,263.12 | 16,007,861.60 | 14,750,000.00 | 511,205,124.72 |
| 公司债 | 22 国信 04 | 2,100,000,000.00 | 2022/3/25 | 3 年 | 2,100,000,000.00 | 3.17% | 2,139,985,623.49 | 71,712,493.80 | 66,570,000.00 | 2,145,128,117.29 |
| 公司债 | 22 国信 05 | 2,900,000,000.00 | 2022/8/16 | 3 年 | 2,900,000,000.00 | 2.64% | 2,928,945,972.60 | 86,816,342.44 | 98,446,792.45 | 2,917,315,522.59 |
| 公司债 | 22 国信 06 | 3,000,000,000.00 | 2022/10/18 | 3 年 | 3,000,000,000.00 | 2.58% | 3,015,904,109.59 | 82,073,527.30 | 88,720,754.71 | 3,009,256,882.18 |
| 公司债 | 23 国证 02 | 4,500,000,000.00 | 2023/2/7 | 3 年 | 4,500,000,000.00 | 3.22% | | 4,635,832,576.01 | 18,396,226.42 | 4,617,436,349.59 |
| 公司债 | 23 国证 03 | 2,500,000,000.00 | 2023/3/27 | 2 年 | 2,500,000,000.00 | 2.97% | | 2,558,572,146.60 | 4,245,283.02 | 2,554,326,863.58 |
| 公司债 | 23 国证 04 | 3,000,000,000.00 | 2023/4/28 | 3 年 | 3,000,000,000.00 | 2.99% | | 3,066,440,705.24 | 22,641,509.43 | 3,043,799,195.81 |
| 公司债 | 23 国证 06 | 2,600,000,000.00 | 2023/6/12 | 3 年 | 2,600,000,000.00 | 2.83% | | 2,642,168,207.38 | 6,981,132.08 | 2,635,187,075.30 |
| 公司债 | 23 国证 07 | 800,000,000.00 | 2023/8/16 | 2 年 | 800,000,000.00 | 2.53% | | 807,788,708.11 | 754,716.98 | 807,033,991.13 |
| 公司债 | 23 国证 08 | 3,500,000,000.00 | 2023/8/16 | 3 年 | 3,500,000,000.00 | 2.72% | | 3,537,729,463.52 | 13,207,547.17 | 3,524,521,916.35 |
| 公司债 | 23 国证 09 | 2,700,000,000.00 | 2023/11/20 | 3 年 | 2,700,000,000.00 | 2.89% | | 2,708,954,262.30 | | 2,708,954,262.30 |
| 公司债 | 23 国证 10 | 1,300,000,000.00 | 2023/12/6 | 2 年 | 1,300,000,000.00 | 2.90% | | 1,302,678,142.08 | | 1,302,678,142.08 |
| 公司债 | 23 国证 11 | 2,000,000,000.00 | 2023/12/6 | 5 年 | 2,000,000,000.00 | 3.12% | | 2,004,520,837.20 | 5,283,018.86 | 1,999,237,818.34 |
| 公司债 | 23 国证 12 | 2,000,000,000.00 | 2023/12/15 | 3 年 | 2,000,000,000.00 | 2.96% | | 2,002,749,726.78 | | 2,002,749,726.78 |
| 公司债 | 23 国证 13 | 3,000,000,000.00 | 2023/12/15 | 5 年 | 3,000,000,000.00 | 3.12% | | 3,004,347,540.98 | | 3,004,347,540.98 |
| 收益凭证 | [注] | 1,286,708,000.00 | | | 1,286,708,000.00 | | 247,284,291.26 | 1,052,356,441.39 | 396,875,002.56 | 902,765,730.09 |
| 合计 | | 77,086,708,000.00 | | | 77,086,708,000.00 | | 48,850,436,652.29 | 30,684,104,781.97 | 12,050,881,983.68 | 67,483,659,450.58 |

[注] 详见本财务报表附注五（一）24 应付短期融资款 [注] 之说明，期末未到期一年期以上收益凭证未到期产品 119 期，固定收益率为 0.00%-2.70%

36. 租赁负债

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|-----------------|----------------|----------------|
| 尚未支付的租赁付款额 | 470,998,065.03 | 439,366,922.65 |
| 减：未确认融资费用 | 27,765,347.58 | 27,236,995.08 |
| 合计 | 443,232,717.45 | 412,129,927.57 |
| 其中：一年内到期的流动租赁负债 | 158,780,501.62 | 153,672,127.44 |
| 一年以上到期的非流动租赁负债 | 284,452,215.83 | 258,457,800.13 |

37. 递延收益

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 | 形成原因 |
|------|----------------|------|--------------|----------------|------|
| 政府补助 | 122,813,793.48 | | 3,475,862.04 | 119,337,931.44 | [注] |
| 合计 | 122,813,793.48 | | 3,475,862.04 | 119,337,931.44 | |

[注] 系本公司 2010 年度收到的深圳市人民政府的金融发展专项资金。根据《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》的相关规定，本公司取得该项金融发展专项资金的前提是承诺 10 年内不迁离深圳，本公司于 2010 年度收到深圳市人民政府金融发展专项资金计人民币 168,000,000.00 元，截至 2023 年 12 月 31 日，本公司按照剩余土地使用年限摊销累计结转计人民币 48,662,068.56 元

38. 其他负债

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 应付货币保证金 [注 1] | 11,798,508,947.89 | 9,801,450,632.68 |
| 其他应付款 | 494,604,217.16 | 386,466,484.93 |
| 应付股利 [注 2] | 446,500,000.00 | 446,500,000.00 |
| 应付质押保证金 [注 1] | 170,672,064.00 | 513,889,832.00 |
| 期货风险准备金 | 139,246,614.17 | 127,213,624.50 |
| 应付利息 | 13,216,157.11 | 13,977,788.23 |
| 代理兑付债券款 | 323,800.00 | 323,800.00 |
| 其他 | 3,130,195.51 | 71,711,171.05 |
| 合计 | 13,066,201,995.84 | 11,361,533,333.39 |

[注 1] 系本公司之子公司国信期货公司应付个人及法人的客户保证金

[注 2] 系应付本公司发行的永续次级债利息

(2) 其他应付款

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|----------------|----------------|
| 应付工程款 | 188,751,591.33 | 212,024,978.47 |
| 外单位往来款 | 142,917,936.97 | 54,933,564.05 |
| 押金 | 14,810,844.03 | 15,188,479.89 |
| 预收房屋租金 | 10,428,648.74 | 8,514,879.20 |
| 应付房租 | 7,666,492.37 | 7,301,043.63 |
| 其他 | 130,028,703.72 | 88,503,539.69 |
| 小计 | 494,604,217.16 | 386,466,484.93 |

39. 实收资本

| 项目 | 期初数 | 本期增减变动（减少以“-”表示） | | | | | 期末数 |
|------|------------------|------------------|----|-------|----|----|------------------|
| | | 发行新股 | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 | |
| 股份总数 | 9,612,429,377.00 | | | | | | 9,612,429,377.00 |

40. 其他权益工具

(1) 期末发行在外的永续债基本情况

经本公司第三届董事会第四十四次会议审议通过，并经公司 2017 年第一次临时股东大会审议通过《关于公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，公司可以一次或多次或多期发行境内债务融资工具和境外债务融资工具，公司境内外公司债务融资工具规模合计不超过人民币 800 亿元。根据中国证监会出具的《关于国信证券股份有限公司非公开发行永续次级债券有关意见的复函》（机构部函〔2020〕1372 号），中国证监会对本公司非公开发行永续次级债券无异议。

2020 年 7 月 13 日，本公司完成了 2020 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.50%；2020 年 9 月 17 日，本公司完成了 2020 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.80%；2021 年 4 月 12 日，本公司完成 2021 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.55%；2021 年 4 月 26 日，本公司完成 2021 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.38%；2022 年 6 月 21 日，本公司完成 2022 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 3.63%；2022 年 7 月 7 日，本公司完成 2022 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率为 3.67%。

本公司发行的上述永续次级债券，于本公司依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在本公司依据发行条款的约定赎回时到期；以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期，第 5 个和其后每个付息日发行人都可无条件行使续期选择权；在第 5 个和其后每个付息日，本公司有权按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回本息。上述永续次级债券采用浮动利率形式，单利按年计息，前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起，每 5 年重置一次票面利率；如果本公司不行使赎回权，则从第 2 个重定价周期（即第 6 个计息年度）开始票面利率调整为当期基准利率加上基本利差再加上 300 个基点（当期基准利率 + 基本利差 + 300BP）。

除非发生强制付息事件，上述永续次级债的每个付息日发行人可自行选择将当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制；递延支付的金额将按照当期执行的利率计算复息。在下个利息支付日，若本公司继续选择延后支付，则上述递延支付的金额产生的复息将加入已经递延的所有利息及其孳息中继续计算利息。强制付息事件包括：付息日前 12 个月，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红，（2）减少注册资本。

2023 年度，本公司宣告分配永续次级债券利息合计人民币 1,276,500,000.00 元。

(2) 期末发行在外的永续债变动情况

| 项目 | 期初数 | | 本期增加 | | 本期减少 | | 期末数 | |
|------------------|-----|-------------------|------|------|------|------|-----|-------------------|
| | 数量 | 账面价值 | 数量 | 账面价值 | 数量 | 账面价值 | 数量 | 账面价值 |
| 2020年永续次级债券(第一期) | | 5,000,000,000.00 | | | | | | 5,000,000,000.00 |
| 2020年永续次级债券(第二期) | | 5,000,000,000.00 | | | | | | 5,000,000,000.00 |
| 2021年永续次级债券(第一期) | | 5,000,000,000.00 | | | | | | 5,000,000,000.00 |
| 2021年永续次级债券(第二期) | | 5,000,000,000.00 | | | | | | 5,000,000,000.00 |
| 2022年永续次级债券(第一期) | | 5,000,000,000.00 | | | | | | 5,000,000,000.00 |
| 2022年永续次级债券(第二期) | | 5,000,000,000.00 | | | | | | 5,000,000,000.00 |
| 合计 | | 30,000,000,000.00 | | | | | | 30,000,000,000.00 |

41. 资本公积

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|-----------|-------------------|------|--------------|-------------------|
| 股本溢价 | 20,051,541,942.88 | | | 20,051,541,942.88 |
| 其他资本公积[注] | 94,696,664.70 | | 9,463,304.06 | 85,233,360.64 |
| 合计 | 20,146,238,607.58 | | 9,463,304.06 | 20,136,775,303.52 |

[注] 其他资本公积本期变动主要系作为其他权益工具核算的永续次级债支付的发行费用

42. 其他综合收益

| 项目 | 期初数 | 本期发生额 | | | | | 期末数 |
|--------------------|-----------------|----------------|----------------|--------------------|----------------|--------------------------------|----------------|
| | | 其他综合收益的税后净额 | | | | 减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益(税后归属于母公司) | |
| | | 所得税前发生额 | 减：所得税费用 | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 税后归属于母公司 | | |
| 不能重分类进损益的其他综合收益 | -539,824,842.90 | 831,071,689.84 | 207,767,922.48 | | 623,303,767.36 | -98,828,483.89 | 182,307,408.35 |
| 其中：其他权益工具投资公允价值变动 | -539,824,842.90 | 831,071,689.84 | 207,767,922.48 | | 623,303,767.36 | -98,828,483.89 | 182,307,408.35 |
| 将重分类进损益的其他综合收益 | 179,989,499.08 | 629,025,872.04 | 128,926,792.48 | 94,886,015.77 | 405,213,063.79 | | 585,202,562.87 |
| 其中：权益法下可转损益的其他综合收益 | -4,183,114.82 | -1,520,834.00 | | | -1,520,834.00 | | -5,703,948.82 |

| 项目 | 期初数 | 本期发生额 | | | | | 期末数 |
|--------------|-----------------|------------------|----------------|--------------------|------------------|--------------------------------|-----|
| | | 其他综合收益的税后净额 | | | | 减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益（税后归属于母公司） | |
| | | 所得税前发生额 | 减：所得税费用 | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 税后归属于母公司 | | |
| 其他债权投资公允价值变动 | -76,116,768.10 | 545,028,324.51 | 138,273,987.17 | -8,067,624.17 | 414,821,961.51 | 338,705,193.41 | |
| 其他债权投资信用减值准备 | 207,185,293.90 | 65,564,861.18 | -9,347,194.69 | 102,953,639.94 | -28,041,584.07 | 179,143,709.83 | |
| 外币财务报表折算差额 | 53,104,088.10 | 19,953,520.35 | | | 19,953,520.35 | 73,057,608.45 | |
| 其他综合收益合计 | -359,835,343.82 | 1,460,097,561.88 | 336,694,714.96 | 94,886,015.77 | 1,028,516,831.15 | -98,828,483.89 | |

43. 盈余公积

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|--------|------------------|------|------|------------------|
| 法定盈余公积 | 4,867,817,456.10 | | | 4,867,817,456.10 |
| 合计 | 4,867,817,456.10 | | | 4,867,817,456.10 |

44. 一般风险准备

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|--------|-------------------|------------------|------|-------------------|
| 一般风险准备 | 8,446,673,883.04 | 639,741,349.03 | | 9,086,415,232.07 |
| 交易风险准备 | 7,884,142,204.84 | 600,915,810.80 | | 8,485,058,015.64 |
| 合计 | 16,330,816,087.88 | 1,240,657,159.83 | | 17,571,473,247.71 |

注：一般风险准备包括本公司及本公司之子公司根据相关规定计提的一般风险准备和交易风险准备，详见本财务报表附注三（三十四）之说明

45. 未分配利润

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------------|-------------------|-------------------|
| 期初未分配利润 | 26,287,566,218.23 | 27,583,471,105.99 |
| 加：本期归属于母公司所有者的净利润 | 6,427,294,103.14 | 6,087,994,695.35 |
| 减：提取法定盈余公积 | | |
| 提取一般风险准备 | 1,240,657,159.83 | 1,582,543,427.63 |
| 应付普通股股利 | 2,595,355,931.79 | 4,806,214,688.50 |
| 永续次级债券利息支出 | 1,276,500,000.00 | 911,500,000.00 |
| 其他综合收益结转留存收益 | 98,828,483.89 | 83,641,466.98 |
| 期末未分配利润 | 27,503,518,745.86 | 26,287,566,218.23 |

(二) 合并利润表项目注释

1. 利息净收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------|------------------|------------------|
| 利息收入 | 7,547,906,445.30 | 7,072,845,943.40 |
| 货币资金及结算备付金利息收入 | 1,689,175,109.40 | 1,679,176,856.69 |
| 融资融券利息收入 | 3,590,170,369.41 | 3,899,206,074.70 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 259,605,935.56 | 236,817,721.24 |
| 其中：约定购回利息收入 | 2,029,923.95 | 2,943,779.03 |
| 股权质押回购利息收入 | 157,449,544.08 | 188,509,648.91 |
| 债权投资利息收入 | 11,598,534.44 | |
| 其他债权投资利息收入 | 1,924,914,382.58 | 1,128,290,524.45 |
| 其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入 | 72,442,113.91 | 129,354,766.32 |
| 利息支出 | 5,800,148,483.54 | 5,243,219,172.72 |
| 短期借款利息支出 | 1,251,348.90 | 2,754,504.87 |
| 应付短期融资券利息支出 | 782,390,635.36 | 838,193,951.41 |
| 拆入资金利息支出 | 159,409,065.73 | 184,811,997.93 |
| 其中：转融通利息支出 | 114,561,532.43 | 122,791,497.77 |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 2,790,115,023.01 | 2,186,500,704.71 |
| 其中：报价回购利息支出 | 75,718,168.70 | 98,668,662.80 |
| 代理买卖证券款利息支出 | 166,639,474.95 | 217,045,450.68 |
| 应付债券利息支出 | 1,735,273,418.62 | 1,703,858,222.36 |
| 其中：次级债券利息支出 | | |
| 其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出 | 165,069,516.97 | 110,054,340.76 |
| 利息净收入 | 1,747,757,961.76 | 1,829,626,770.68 |

2. 手续费及佣金净收入

(1) 明细情况

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------|------------------|------------------|
| 证券经纪业务净收入 | 4,103,578,135.02 | 4,870,843,679.99 |
| 证券经纪业务收入 | 5,177,661,232.42 | 5,952,585,815.23 |
| 代理买卖证券业务 | 4,477,242,943.76 | 5,046,542,632.92 |
| 交易单元席位租赁 | 303,625,744.61 | 362,991,905.72 |

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------|------------------|------------------|
| 代销金融产品业务 | 396,792,544.05 | 543,051,276.59 |
| 证券经纪业务支出 | 1,074,083,097.40 | 1,081,742,135.24 |
| 代理买卖证券业务 | 1,074,082,816.39 | 1,081,742,135.24 |
| 交易单元席位租赁 | | |
| 代销金融产品业务 | 281.01 | |
| 期货经纪业务净收入 | 250,939,964.21 | 258,451,296.17 |
| 期货经纪业务收入 | 784,220,539.12 | 761,474,717.56 |
| 期货经纪业务支出 | 533,280,574.91 | 503,023,421.39 |
| 投资银行业务净收入 | 1,362,985,508.44 | 1,815,715,414.70 |
| 投资银行业务收入 | 1,424,981,099.74 | 1,868,237,594.91 |
| 证券承销业务 | 1,278,516,009.36 | 1,734,263,809.22 |
| 证券保荐业务 | 69,806,655.09 | 65,508,734.75 |
| 财务顾问业务 | 76,658,435.29 | 68,465,050.94 |
| 投资银行业务支出 | 61,995,591.30 | 52,522,180.21 |
| 证券承销业务 | 61,813,515.83 | 52,437,274.55 |
| 证券保荐业务 | | |
| 财务顾问业务 | 182,075.47 | 84,905.66 |
| 资产管理业务净收入 | 495,521,341.63 | 321,244,982.02 |
| 资产管理业务收入 | 499,281,738.65 | 324,418,651.07 |
| 资产管理业务支出 | 3,760,397.02 | 3,173,669.05 |
| 基金管理业务净收入 | 24,402,276.17 | 36,463,955.02 |
| 基金管理业务收入 | 33,552,952.69 | 63,304,076.28 |
| 基金管理业务支出 | 9,150,676.52 | 26,840,121.26 |
| 投资咨询业务净收入 | 43,769,631.25 | 52,874,806.01 |
| 投资咨询业务收入 | 44,894,923.75 | 53,615,022.18 |
| 投资咨询业务支出 | 1,125,292.50 | 740,216.17 |
| 其他手续费及佣金净收入 | 189,510,452.71 | 221,665,506.51 |
| 其他手续费及佣金收入 | 189,510,452.71 | 221,665,506.51 |
| 其他手续费及佣金支出 | | |
| 合计 | 6,470,707,309.43 | 7,577,259,640.42 |
| 其中：手续费及佣金收入总计 | 8,154,102,939.08 | 9,245,301,383.74 |
| 手续费及佣金支出总计 | 1,683,395,629.65 | 1,668,041,743.32 |

(2) 财务顾问业务净收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------------|---------------|---------------|
| 并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司 | 26,087,264.14 | 8,113,490.57 |
| 并购重组财务顾问业务净收入——其他 | 6,415,094.34 | 613,207.54 |
| 其他财务顾问业务净收入 | 43,974,001.34 | 59,653,447.17 |
| 小计 | 76,476,359.82 | 68,380,145.28 |

(3) 代理销售金融产品情况

| 项目 | 本期数 | | 上年同期数 | |
|--------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
| | 销售总金额 | 代销收入 | 销售总金额 | 代销收入 |
| 基金 | 20,976,300,803.24 | 236,008,382.23 | 25,142,729,111.73 | 352,230,723.35 |
| 其他金融产品 | 6,902,985,358.91 | 160,784,161.82 | 3,471,047,711.44 | 190,820,553.24 |
| 合计 | 27,879,286,162.15 | 396,792,544.05 | 28,613,776,823.17 | 543,051,276.59 |

3. 投资收益

(1) 明细情况

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 权益法核算的长期股权投资收益 | 390,972,141.16 | 482,932,846.97 |
| 处置长期股权投资产生的投资收益 | | -59,359.85 |
| 金融工具投资收益 | 5,095,925,478.79 | 7,010,553,313.99 |
| 其中：持有期间取得的收益 | 6,068,877,596.44 | 6,144,180,966.60 |
| - 交易性金融工具 | 5,034,919,659.42 | 5,313,520,966.30 |
| - 其他权益工具投资 | 1,033,957,937.02 | 830,660,000.30 |
| - 衍生金融工具 | | |
| 处置金融工具取得的收益 | -972,952,117.65 | 866,372,347.39 |
| - 交易性金融工具 | 441,808,458.71 | 1,117,012,694.26 |
| - 债权投资 | | 452,780.67 |
| - 其他债权投资 | 218,812,901.02 | 252,332,976.05 |
| - 衍生金融工具 | -1,633,573,477.38 | -503,426,103.59 |
| 其他 | -159,507,487.33 | -221,218,600.78 |
| 合计 | 5,327,390,132.62 | 7,272,208,200.33 |

(2) 按权益法核算的长期股权投资收益

| 被投资单位 | 本期数 | 上年同期数 | 本期比上期增减变动的原因 |
|-------------------------------|----------------|----------------|--------------|
| 合营企业 | | | |
| 珠海国信运通股权投资基金（有限合伙） | -35,344.52 | -10,032,736.07 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙） | -13,125,934.78 | 2,471,279.33 | 被投资单位净利润变化 |
| 张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙） | 15,644,711.68 | 19,501,251.57 | 被投资单位净利润变化 |
| 珠海联发安科股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 196,809.45 | -1,001,067.88 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市鹏鹞弘盛绿色产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | -20,038.95 | | 被投资单位净利润变化 |
| 宿迁市国信远东数字经济产业投资基金合伙企业（有限合伙） | -23,761.19 | | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市弘盛宝龙新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | -9,921.43 | | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金（有限合伙） | | 95,687,630.40 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信蓝思基金管理有限公司 | | 2,678.84 | 被投资单位净利润变化 |
| 小计 | 2,626,520.26 | 106,629,036.19 | |
| 联营企业 | | | |
| 鹏华基金公司 | 419,350,127.11 | 506,228,903.96 | 被投资单位净利润变化 |
| 前海股交投资控股（深圳）有限公司 | -51,314,367.74 | -13,029,785.60 | 被投资单位净利润变化 |
| 青岛蓝海股权交易中心有限责任公司 | 1,395,254.19 | 1,611,116.76 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙） | -3,601,012.63 | -35,901,697.52 | 被投资单位净利润变化 |
| 国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙） | 447,102.02 | -447,102.02 | 被投资单位净利润变化 |
| 南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙） | 10,972,647.80 | -10,293,808.36 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙） | -64,623.10 | -7,649,214.79 | 被投资单位净利润变化 |
| 厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙） | -670,519.00 | -21,892,082.23 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 821,105.34 | 2,443,604.52 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 153,399.75 | -478.53 | 被投资单位净利润变化 |
| 川渝高竹新区重庆广弘创业投资基金合伙企业（有限合伙） | -44.74 | | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市五色检测技术服务有限公司 | -438,186.74 | -114,784.01 | 被投资单位净利润变化 |
| 华润宝塔股权投资（延安）有限公司 | 1,021,548.29 | -76,890.08 | 被投资单位净利润变化 |
| 国铁盛芯（青岛）股权投资企业（有限合伙） | -2,509,808.18 | 31,374,725.96 | 被投资单位净利润变化 |
| 常州高新投创业投资有限公司 | -3,166,669.63 | 25,231,327.91 | 被投资单位净利润变化 |

| 被投资单位 | 本期数 | 上年同期数 | 本期比上期增减变动的原因 |
|------------------------------|----------------|----------------|--------------|
| 深圳市前海弘泰基金管理有限公司 | -342,894.47 | -173,121.20 | 被投资单位净利润变化 |
| 国铁盛和（青岛）私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | -4,411.11 | -5,416,532.37 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市天使一号创业投资合伙企业（有限合伙） | 863,275.50 | -214,377.59 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳弘盛道格体育投资合伙企业（有限合伙） | 3,180,653.47 | 2,112,232.74 | 被投资单位净利润变化 |
| 北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金（有限合伙） | 12,556,769.93 | -96,418,909.63 | 被投资单位净利润变化 |
| 盈科值得普泽（平潭）股权投资合伙企业（有限合伙） | -45,927.19 | -75,298.57 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市创东方长辉投资企业（有限合伙） | 415,203.70 | -1,036,643.98 | 被投资单位净利润变化 |
| 江门市倚锋骏马二期创业投资合伙企业（有限合伙） | -361,379.62 | 42,625.41 | 被投资单位净利润变化 |
| 深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司 | 29.89 | | 被投资单位净利润变化 |
| 佛山司南碳伍股权投资合伙企业（有限合伙） | -311,651.94 | | 被投资单位净利润变化 |
| 小计 | 388,345,620.90 | 376,303,810.78 | |
| 合计 | 390,972,141.16 | 482,932,846.97 | |

(3) 交易性金融工具投资收益

| 交易性金融工具 | | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------------------|--------|------------------|------------------|
| 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 | 持有期间收益 | 5,034,919,659.42 | 5,313,520,966.30 |
| | 处置期间收益 | 484,243,171.11 | 1,149,852,437.25 |
| 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 | 持有期间收益 | | |
| | 处置期间收益 | | |
| 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 | 持有期间收益 | | |
| | 处置期间收益 | -42,434,712.40 | -32,839,742.99 |
| 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 | 持有期间收益 | | |
| | 处置期间收益 | | |
| 小计 | | 5,476,728,118.13 | 6,430,533,660.56 |

4. 其他收益

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 | 计入本期非经常性损益的金额 |
|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 与资产相关的政府补助 | 3,475,862.04 | 3,475,862.04 | 3,475,862.04 |
| 与收益相关的政府补助 | 909,572.30 | 1,471,700.54 | 909,572.30 |
| 代扣个人所得税手续费返还 | 30,269,349.39 | 40,002,210.20 | |
| 合计 | 34,654,783.73 | 44,949,772.78 | 4,385,434.34 |

5. 公允价值变动收益

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------------|------------------|-------------------|
| 交易性金融资产 | 521,386,683.92 | -3,293,781,981.14 |
| 其中：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 | | |
| 交易性金融负债 | 730,943.60 | 12,137,831.67 |
| 其中：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 | | |
| 衍生金融工具 | 766,917,047.47 | 310,910,118.85 |
| 合计 | 1,289,034,674.99 | -2,970,734,030.62 |

6. 其他业务收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------|------------------|------------------|
| 大宗商品销售收入 | 2,430,430,808.33 | 2,060,465,376.36 |
| 房租收入 | 40,128,502.12 | 36,634,394.56 |
| 其他 | 13,646,222.73 | 19,833,371.67 |
| 合计 | 2,484,205,533.18 | 2,116,933,142.59 |

7. 税金及附加

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|----------------|----------------|
| 城市维护建设税 | 54,550,989.92 | 61,549,594.01 |
| 教育费附加及地方教育附加 | 38,970,657.45 | 43,983,430.77 |
| 房产税 | 26,965,643.10 | 15,476,162.48 |
| 印花税 | 3,027,940.62 | 3,709,775.09 |
| 土地使用税 | 413,546.72 | 366,028.28 |
| 车船税 | 144,990.00 | 158,115.83 |
| 其他 | 262,100.72 | 338,118.90 |
| 合计 | 124,335,868.53 | 125,581,225.36 |

8. 业务及管理费

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------|------------------|------------------|
| 职工费用 | 5,306,870,177.77 | 5,363,453,646.18 |
| 固定资产折旧费 | 308,909,035.92 | 281,763,365.23 |
| 通讯费 | 227,240,800.71 | 221,644,784.35 |
| 电子设备运转费 | 220,865,323.52 | 171,574,251.51 |
| 业务宣传费 | 204,375,665.66 | 133,593,713.59 |
| 使用权资产折旧费 | 176,197,480.43 | 176,555,073.27 |
| 交易所席位年费 | 155,065,046.49 | 142,932,321.44 |
| 差旅费 | 137,980,091.40 | 76,861,911.42 |
| 无形资产摊销 | 110,121,641.12 | 92,443,696.17 |
| 咨询费 | 109,800,661.18 | 84,540,772.66 |
| 业务活动费 | 79,420,145.59 | 71,435,114.14 |
| 长期待摊费用摊销 | 67,344,782.14 | 56,606,496.98 |
| 投资者保护基金支出 | 66,134,791.13 | 64,103,976.51 |
| 其他 | 352,579,620.07 | 379,931,563.76 |
| 小计 | 7,522,905,263.13 | 7,317,440,687.21 |

9. 信用减值损失

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|----------------|----------------|
| 应收款项坏账损失 | 233,208,799.39 | 52,801,340.00 |
| 其他债权投资减值损失 | 86,266,479.27 | 209,729,357.33 |
| 买入返售金融资产坏账准备 | 34,564,993.90 | 27,989,391.01 |
| 融出资金坏账准备 | 7,496,617.86 | -42,145,533.83 |
| 其他应收款减值损失 | 39,363.76 | 2,166,673.00 |
| 债权投资减值 | 322.58 | 304,211.73 |
| 合计 | 361,576,576.76 | 250,845,439.24 |

10. 其他资产减值损失

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------|-----|--------------|
| 大宗商品跌价准备 | | 2,191,066.98 |
| 合计 | | 2,191,066.98 |

11. 其他业务成本

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------|------------------|------------------|
| 大宗商品销售成本 | 2,430,089,362.30 | 2,062,623,170.54 |
| 投资性房地产折旧 | 10,021,533.39 | 9,924,377.28 |
| 其他 | 21,178,052.43 | 12,076,912.33 |
| 合计 | 2,461,288,948.12 | 2,084,624,460.15 |

12. 营业外收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 | 计入本期非经常性损益的金额 |
|-------------|---------------|---------------|---------------|
| 政府补助 | 38,861,700.00 | 80,363,550.91 | 38,861,700.00 |
| 违约赔偿收入 | 932,677.56 | 2,207,279.35 | 932,677.56 |
| 非流动资产毁损报废利得 | 59,600.96 | 43,786.62 | 59,600.96 |
| 其他 | 118,208.91 | 334,447.47 | 118,208.91 |
| 合计 | 39,972,187.43 | 82,949,064.35 | 39,972,187.43 |

注：本期计入营业外收入的政府补助情况详见本财务报表附注八之说明

13. 营业外支出

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 | 计入本期非经常性损益的金额 |
|------|---------------|----------------|---------------|
| 非常损失 | 17,679,074.89 | -54,390,809.73 | 17,679,074.89 |
| 对外捐赠 | 12,401,441.05 | 13,290,536.15 | 12,401,441.05 |
| 罚款支出 | 30,000.00 | -5,475,350.00 | 30,000.00 |
| 其他 | 1,467,167.67 | 2,444,806.50 | 1,467,167.67 |
| 合计 | 31,577,683.61 | -44,130,817.08 | 31,577,683.61 |

14. 所得税费用

(1) 明细情况

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------|----------------|-----------------|
| 当期所得税费用 | 137,468,336.19 | 806,489,745.68 |
| 递延所得税费用 | 290,393,925.31 | -668,914,280.11 |
| 合计 | 427,862,261.50 | 137,575,465.57 |

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------------------------|-------------------|-------------------|
| 利润总额 | 6,855,156,364.64 | 6,222,165,264.34 |
| 按母公司税率计算的所得税费用 | 1,713,789,091.16 | 1,555,541,316.08 |
| 子公司适用不同税率的影响 | -3,273,292.50 | -965,293.72 |
| 调整以前期间所得税的影响 | 19,824,223.68 | -6,502,047.27 |
| 非应税收入的影响 | -1,051,997,747.32 | -1,103,413,851.43 |
| 不可抵扣的成本、费用和损失的影响 | 59,994,079.48 | 27,023,708.39 |
| 使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响 | -123,006.65 | -2,022,515.09 |
| 本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响 | 8,809,886.90 | 5,715,012.86 |
| 其他 | -319,160,973.25 | -337,800,864.25 |
| 所得税费用 | 427,862,261.50 | 137,575,465.57 |

15. 其他综合收益的税后净额

其他综合收益的税后净额详见本财务报表附注五（一）42 之说明。

(三) 合并现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|------------------|------------------|
| 应付货币保证金净增加额 | 1,997,058,315.21 | |
| 清算资金交收金额净增加 | 4,228,077,531.38 | |
| 大宗商品销售收到的现金 | 2,722,321,906.29 | 2,334,307,014.43 |
| 使用受限的货币资金减少额 | 676,668,028.67 | |
| 租赁收入 | 44,516,916.85 | 36,674,871.13 |
| 收到政府补助 | 38,861,700.00 | 110,731,386.12 |
| 代扣代缴手续费收入 | 30,158,497.27 | 40,002,210.20 |
| 应付质押保证金净增加额 | | 407,883,752.00 |
| 其他 | 96,365,314.10 | 129,755,065.61 |
| 合计 | 9,834,028,209.77 | 3,059,354,299.49 |

2. 支付其他与经营活动有关的现金

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------|------------------|------------------|
| 购买大宗商品支付的现金 | 3,399,335,556.46 | 1,257,876,213.26 |
| 存出保证金净增加额 | 1,926,967,578.56 | 313,155,612.51 |
| 现金支付的业务及管理费 | 1,547,941,624.25 | 1,436,292,390.64 |
| 应付质押保证金净减少额 | 343,217,768.00 | |
| 应收结算担保金净增加 | 42,925,902.83 | |
| 支付诉讼赔偿 | 42,846,049.81 | 87,828,265.98 |
| 代扣代缴税费收到现金净减少金额 | 40,323,752.27 | 113,086,101.51 |
| 捐赠支出 | 12,401,441.05 | 13,290,536.15 |
| 清算资金交收金额净减少 | | 2,745,041,944.87 |
| 使用受限的货币资金增加额 | | 1,146,134,406.71 |
| 应付货币保证金净减少额 | | 227,867,905.94 |
| 罚款支出 | | 1,050,000.00 |
| 其他 | 99,684,043.36 | 77,303,842.17 |
| 合计 | 7,455,643,716.59 | 7,418,927,219.74 |

3. 支付其他与筹资活动有关的现金

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------------|----------------|----------------|
| 支付租赁费 | 189,283,468.05 | 175,896,897.10 |
| 支付发行费用 | 121,000,000.00 | 77,600,000.00 |
| 子公司少数股东退资支付的现金 | | 8,834,720.84 |
| 合计 | 310,283,468.05 | 262,331,617.94 |

4. 现金流量表补充资料

| 补充资料 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------------------|------------------|------------------|
| (1) 将净利润调节为经营活动现金流量： | | |
| 净利润 | 6,427,294,103.14 | 6,084,589,798.77 |
| 加：资产减值准备 | 361,576,576.76 | 253,036,506.22 |
| 固定资产、使用权资产及投资性房地产折旧 | 495,128,049.74 | 468,242,815.78 |
| 无形资产摊销 | 110,121,641.12 | 92,443,696.17 |
| 长期待摊费用摊销 | 67,344,782.14 | 56,606,496.98 |

| 补充资料 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------------------------------|--------------------|--------------------|
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失 (收益以“-”号填列) | -1,395,335.30 | 175,319.21 |
| 公允价值变动损失(收益以“-”号填列) | -1,289,034,674.99 | 2,970,734,030.62 |
| 财务费用(收益以“-”号填列) | 2,544,945,256.45 | 2,566,152,326.10 |
| 汇兑损失(收益以“-”号填列) | 38,467,342.91 | -3,426,328.32 |
| 投资损失(收益以“-”号填列) | -390,972,141.16 | -482,873,487.12 |
| 递延所得税资产减少(增加以“-”号填列) | -167,011,390.79 | -390,684,255.55 |
| 递延所得税负债增加(减少以“-”号填列) | 448,058,121.42 | -306,417,329.26 |
| 交易性金融资产的减少(增加以“-”号填列) | -35,988,000,498.49 | -10,311,796,579.71 |
| 交易性金融负债的增加(减少以“-”号填列) | -509,914,933.73 | 1,341,587,502.03 |
| 其他权益工具投资的减少(增加以“-”号填列) | -3,918,870,140.27 | -3,718,904,034.30 |
| 债权投资的减少(增加以“-”号填列) | -229,392,297.73 | -69,565,844.03 |
| 其他债权投资的减少(增加以“-”号填列) | -32,390,342,192.74 | -21,800,279,555.92 |
| 衍生金融资产的减少(增加以“-”号填列) | 508,349,255.10 | 137,513,852.58 |
| 衍生金融负债的增加(减少以“-”号填列) | -1,087,289.14 | 203,950,608.60 |
| 买入返售金融资产的减少(增加以“-”号填列) | 7,665,710,187.47 | -9,081,512,415.65 |
| 卖出回购金融资产的增加(减少以“-”号填列) | 10,091,733,569.72 | 17,658,929,931.55 |
| 拆入资金的增加(减少以“-”号填列) | -1,974,198,888.73 | |
| 融出资金的减少(增加以“-”号填列) | -3,216,923,493.97 | 9,343,344,320.19 |
| 代理买卖证券款的增加(减少以“-”号填列) | -3,342,867,633.33 | -7,866,477,607.60 |
| 经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列) | -2,051,776,969.29 | -3,795,928,325.19 |
| 经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列) | 8,857,459,338.13 | 9,309,042,218.83 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -47,855,599,655.56 | -7,341,516,339.02 |
| (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 | 76,415,264,900.64 | 79,357,424,451.21 |
| 减: 现金的期初余额 | 79,357,424,451.21 | 84,614,253,311.11 |
| 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 | -2,942,159,550.57 | -5,256,828,859.90 |

5. 现金和现金等价物的构成

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 1) 现金 | 76,415,264,900.64 | 79,357,424,451.21 |
| 其中：库存现金 | 70,803.80 | 140,842.95 |
| 可随时用于支付的银行存款 | 61,241,099,537.66 | 63,626,831,783.48 |
| 可随时用于支付的其他货币资金 | 4,325,583.54 | 3,844,825.47 |
| 可用于支付的结算备付金 | 15,169,768,975.64 | 15,726,606,999.31 |
| 2) 现金等价物 | | |
| 其中：三个月内到期的债券投资 | | |
| 3) 期末现金及现金等价物余额 | 76,415,264,900.64 | 79,357,424,451.21 |

(2) 不属于现金和现金等价物的货币资金

| 项目 | 期末数 | 期初数 | 不属于现金和现金等价物的理由 |
|-------------|----------------|------------------|-----------------|
| 风险准备金及相关利息 | 209,030,834.47 | 180,755,969.10 | 有特定用途 |
| 货币资金其他应计利息 | 107,729,443.12 | 118,821,220.50 | 未实际收到 |
| 结算备付金其他应计利息 | 7,747,098.56 | 8,192,288.39 | 未实际收到 |
| 不可随时提取的定期存款 | 3,000,000.00 | | 预计持有到期，期限长、流动性弱 |
| 应付票据保证金 | 335,568,000.00 | 1,000,000,000.00 | 保证金 |
| 司法冻结资金 | 3,920,736.99 | 12,447,665.54 | 冻结资金 |
| 股票申购款 | | 34,983,965.49 | 有特定用途 |
| 小计 | 666,996,113.14 | 1,355,201,109.02 | |

6. 筹资活动相关负债变动情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | | 本期减少 | | 期末数 |
|-----------------------|-------------------|--------------------|------------------|-------------------|-------|--------------------|
| | | 现金变动 | 非现金变动 | 现金变动 | 非现金变动 | |
| 短期借款 | | 245,378,809.09 | 315,639.27 | 242,054,448.36 | | 3,640,000.00 |
| 应付短期融资款 | 22,515,995,310.97 | 87,408,988,000.00 | 782,390,635.36 | 55,167,201,192.29 | | 55,540,172,754.04 |
| 应付债券（含一年 内到期的应付债券） | 48,850,436,652.29 | 28,941,412,000.00 | 1,741,556,437.50 | 12,049,745,639.21 | | 67,483,659,450.58 |
| 租赁负债（含一年 内到期的租赁负债） | 412,129,927.57 | | 220,386,257.93 | 189,283,468.05 | | 443,232,717.45 |
| 应付股利 | 446,500,000.00 | | 3,871,855,931.79 | 3,871,855,931.79 | | 446,500,000.00 |
| 其他权益工具 | | | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | | |
| 应付票据利息 | | | 2,541,675.87 | 2,541,675.87 | | |
| 小计 | 72,225,061,890.83 | 116,595,778,809.09 | 6,629,046,577.72 | 71,532,682,355.57 | | 123,917,204,922.07 |

7. 净额列报现金流量情况

公司融出资金、拆入资金、回购业务、投资与交易业务等主营业务的相关现金流系交易频繁、金额大的现金流入和流出，上述现金流以净额列报更能说明其对公司支付能力、偿债能力的影响，更有助于评价公司的支付能力和偿债能力、分析公司的未来现金流量，因此公司以净额列报上述业务产生的相关现金流。

(四) 其他

1. 租赁

(1) 公司作为承租人

1) 使用权资产相关信息详见本财务报表附注五（一）16 之说明。

2) 公司对短期租赁和低价值资产租赁的会计政策详见本财务报表附注三（三十三）之说明。计入当期损益的短期租赁费用和低价值资产租赁费用金额如下：

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------------|---------------|--------------|
| 短期租赁费用 | 6,724,221.77 | 7,539,291.63 |
| 低价值资产租赁费用（短期租赁除外） | 4,489,903.23 | 2,179,076.36 |
| 合计 | 11,214,125.00 | 9,718,367.99 |

3) 与租赁相关的当期损益及现金流

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------|----------------|----------------|
| 租赁负债的利息费用 | 16,035,530.33 | 16,037,470.92 |
| 与租赁相关的总现金流出 | 204,253,084.29 | 185,615,265.09 |

4) 租赁负债的到期期限分析和相应流动性风险管理详见本财务报表附注九（四）之说明。

(2) 公司作为出租人

经营租赁

1) 租赁收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 租赁收入 | 40,128,502.12 | 36,634,394.56 |
| 其中：未纳入租赁收款额计量的 可变租赁付款额相关收入 | | |

2) 经营租赁资产

| 项目 | 期末数 | 上年年末数 |
|--------|----------------|----------------|
| 投资性房地产 | 274,916,594.34 | 279,122,466.32 |
| 小计 | 274,916,594.34 | 279,122,466.32 |

3) 根据与承租人签订的租赁合同, 不可撤销租赁未来将收到的未折现租赁收款额

| 剩余期限 | 期末数 | 上年年末数 |
|------|---------------|----------------|
| 1年以内 | 32,167,524.45 | 36,012,680.97 |
| 1-2年 | 25,005,828.68 | 29,185,923.52 |
| 2-3年 | 13,451,326.96 | 24,294,642.63 |
| 3-4年 | 7,769,361.76 | 16,047,995.51 |
| 4-5年 | 7,065,865.76 | 11,203,792.80 |
| 5年以后 | 12,872,825.70 | 19,827,889.00 |
| 合计 | 98,332,733.31 | 136,572,924.43 |

2. 金融工具计量基础

(1) 金融资产计量基础分类表

| 项目 | 期末数 | | | |
|----------|--------------------|-----------------------------|-----------------------------------|---------------------------|
| | 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 |
| 货币资金 | 61,904,744,939.58 | | | |
| 结算备付金 | 15,177,516,074.20 | | | |
| 融出资金 | 55,881,511,468.98 | | | |
| 衍生金融资产 | | | | 568,494,996.30 |
| 存出保证金 | 9,827,332,808.11 | | | |
| 应收款项 | 4,083,918,364.27 | | | |
| 买入返售金融资产 | 8,124,242,250.38 | | | |
| 交易性金融资产 | | | | 195,983,543,875.02 |
| 债权投资 | 291,898,258.32 | | | |
| 其他债权投资 | | 84,444,910,893.48 | | |
| 其他权益工具投资 | | | 15,311,504,150.13 | |
| 其他资产 | 206,814,957.36 | | | |
| 小计 | 155,497,979,121.20 | 84,444,910,893.48 | 15,311,504,150.13 | 196,552,038,871.32 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | | | |
|----------|--------------------|-----------------------------|-----------------------------------|---------------------------|
| | 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 |
| 货币资金 | 64,977,826,272.53 | | | |
| 结算备付金 | 15,734,799,287.70 | | | |
| 融出资金 | 52,672,094,624.02 | | | |
| 衍生金融资产 | | | | 164,204,033.62 |
| 存出保证金 | 7,900,221,491.14 | | | |
| 应收款项 | 4,728,934,871.75 | | | |
| 买入返售金融资产 | 15,824,517,431.75 | | | |
| 交易性金融资产 | | | | 159,472,573,237.44 |
| 债权投资 | 69,266,211.57 | | | |
| 其他债权投资 | | 51,501,472,752.05 | | |
| 其他权益工具投资 | | | 10,429,791,008.15 | |
| 其他资产 | 203,552,147.75 | | | |
| 小计 | 162,111,212,338.21 | 51,501,472,752.05 | 10,429,791,008.15 | 159,636,777,271.06 |

(2) 金融负债计量基础分类表

| 项目 | 期末数 | |
|-----------|--------------------|---------------------------|
| | 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 |
| 短期借款 | 3,640,000.00 | |
| 应付短期融资款 | 55,540,172,754.04 | |
| 拆入资金 | 7,031,963,594.60 | |
| 交易性金融负债 | | 1,279,201,477.28 |
| 衍生金融负债 | | 713,267,002.89 |
| 卖出回购金融资产款 | 124,275,592,952.89 | |
| 代理买卖证券款 | 56,070,946,875.80 | |
| 代理承销证券款 | 44,000,000.00 | |
| 应付款项 | 19,883,074,417.94 | |
| 租赁负债 | 443,232,717.45 | |
| 应付债券 | 67,483,659,450.58 | |
| 其他负债 | 12,479,966,785.95 | |
| 小计 | 343,256,249,549.25 | 1,992,468,480.17 |

(续上表)

| 项目 | 期初数 | |
|-----------|--------------------|--|
| | 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 |
| 短期借款 | | |
| 应付短期融资款 | 22,515,995,310.97 | |
| 拆入资金 | 9,006,162,483.33 | |
| 交易性金融负债 | | 1,789,847,354.62 |
| 衍生金融负债 | | 324,672,439.60 |
| 卖出回购金融资产款 | 114,183,859,383.17 | |
| 代理买卖证券款 | 59,413,814,509.13 | |
| 代理承销证券款 | | |
| 应付款项 | 12,698,831,315.61 | |
| 租赁负债 | 412,129,927.57 | |
| 应付债券 | 48,850,436,652.29 | |
| 其他负债 | 10,787,819,708.89 | |
| 小计 | 277,869,049,290.96 | 2,114,519,794.22 |

3. 受托客户资产管理业务

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|----------|--------------------|--------------------|
| 资产项目 | | |
| 受托管理资金存款 | 10,269,118,396.91 | 8,309,859,585.43 |
| 客户结算备付金 | 864,822,030.06 | 466,046,501.02 |
| 存出保证金 | 191,917,602.60 | 56,621,401.40 |
| 应收款项 | 6,814,326,274.16 | 1,431,438,201.95 |
| 受托投资 | 151,337,057,769.90 | 144,376,400,000.50 |
| 其中：投资成本 | 153,461,026,595.86 | 142,911,630,391.29 |
| 已实现未结算损益 | -2,123,968,825.96 | 1,464,769,609.21 |
| 小计 | 169,477,242,073.63 | 154,640,365,690.30 |
| 负债项目 | | |
| 受托管理资金 | 155,060,153,615.61 | 135,230,386,610.65 |
| 应付款项 | 14,417,088,458.02 | 19,409,979,079.65 |
| 小计 | 169,477,242,073.63 | 154,640,365,690.30 |

(2) 业务分类情况

| 项目 | 集合资产管理业务 | 单一资产管理业务 | 专项资产管理业务 |
|--------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 期末产品数量 | 375 | 186 | 21 |
| 期末客户数量 | 298,800 | 186 | 437 |
| 其中：个人客户 | 296,852 | 90 | |
| 机构客户 | 1,948 | 96 | 437 |
| 期初受托资金 | 62,711,817,230.07 | 52,083,278,237.95 | 32,055,422,300.00 |
| 其中：自有资金投入 | 3,328,141,781.53 | | |
| 个人客户 | 24,902,663,686.20 | 7,127,051,020.71 | |
| 机构客户 | 34,481,011,762.34 | 44,956,227,217.24 | 32,055,422,300.00 |
| 期末受托资金 | 73,952,199,360.99 | 57,885,837,825.80 | 28,043,333,400.00 |
| 其中：自有资金投入 | 6,045,670,822.65 | | |
| 个人客户 | 38,258,466,643.20 | 6,981,604,727.31 | |
| 机构客户 | 29,648,061,895.14 | 50,904,233,098.49 | 28,043,333,400.00 |
| 期末主要受托资产初始成本 | 72,246,714,798.41 | 53,388,869,096.94 | 27,825,442,700.51 |
| 其中：股票 | 2,257,417,111.38 | 13,573,827,125.30 | |
| 国债 | 617,897,404.14 | 33,138,702.68 | |
| 其他债券 | 58,585,409,925.18 | 22,016,655,241.19 | 240,000,000.00 |
| 基金 | 4,403,018,691.71 | 487,776,052.77 | 280,613,767.50 |
| 其他 | 6,382,971,666.00 | 17,277,471,975.00 | 27,304,828,933.01 |
| 本期资产管理业务净收入 | 377,437,318.20 | 104,684,135.61 | 13,399,887.82 |

4. 融资融券业务

(1) 融券业务明细情况

| 项目 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|------------|------------------|------------------|
| 融出证券 | 2,688,947,571.31 | 2,269,427,076.07 |
| 其中：交易性金融资产 | 905,326,793.92 | 1,023,552,825.96 |
| 其他权益工具投资 | 92,635,449.72 | 146,735,038.90 |
| 转融通融入证券 | 1,690,985,327.67 | 1,099,139,211.21 |
| 转融通融入证券总额 | 2,937,423,761.54 | 1,979,764,611.94 |

(2) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

| 担保物类别 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|-------|--------------------|--------------------|
| 股票 | 156,830,533,502.95 | 152,150,591,313.61 |
| 资金 | 5,582,159,533.01 | 6,934,664,621.32 |
| 基金 | 7,214,024,970.56 | 5,083,701,370.47 |
| 债券 | 251,827,156.28 | 262,823,555.68 |
| 小计 | 169,878,545,162.80 | 164,431,780,861.08 |

5. 外币货币性项目

(1) 中国大陆以外地区经营实体主要报表项目的折算汇率

| 项目 | 期末汇率 | 期初汇率 |
|----|--------|--------|
| 港币 | 7.0827 | 6.9646 |

(2) 境外经营实体说明

本公司主要境外经营实体为本公司之子公司国信香港公司，其经营地在香港，记账本位币为港币。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定，本年度未发生变化。

六、母公司财务报表项目注释

(一) 母公司资产负债表项目注释

1. 长期股权投资

(1) 明细情况

| 项目 | 期末数 | | | 期初数 | | |
|------------|-------------------|------|-------------------|-------------------|------|-------------------|
| | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 对子公司投资 | 10,177,200,146.42 | | 10,177,200,146.42 | 9,677,200,146.42 | | 9,677,200,146.42 |
| 对联营、合营企业投资 | 2,347,570,852.67 | | 2,347,570,852.67 | 2,265,845,014.91 | | 2,265,845,014.91 |
| 合计 | 12,524,770,999.09 | | 12,524,770,999.09 | 11,943,045,161.33 | | 11,943,045,161.33 |

(2) 对子公司投资

| 被投资单位 | 期初数 | | 本期增减变动 | | | | 期末数 | |
|--------|------------------|------|----------------|--------------|--------|----|-------------------|------|
| | 账面价值 | 减值准备 | 追加投资 | 减少投资 | 计提减值准备 | 其他 | 账面价值 | 减值准备 |
| 国信期货公司 | 1,890,915,346.42 | | | | | | 1,890,915,346.42 | |
| 国信弘盛公司 | 1,806,252,673.30 | | | 4,508,887.47 | | | 1,801,743,785.83 | |
| 国信香港公司 | 2,236,284,800.00 | | | | | | 2,236,284,800.00 | |
| 国信资本公司 | 3,743,747,326.70 | | 504,508,887.47 | | | | 4,248,256,214.17 | |
| 小计 | 9,677,200,146.42 | | 504,508,887.47 | 4,508,887.47 | | | 10,177,200,146.42 | |

(3) 对联营、合营企业投资

| 被投资单位 | 期初数 | | | | 本期增减变动 | | | | | | 期末数 | |
|------------------|------------------|------|------|------|----------------|---------------|------------|----------------|--------|----|------------------|------|
| | 账面价值 | 减值准备 | 追加投资 | 减少投资 | 权益法下确认的投资损益 | 其他综合收益调整 | 其他权益变动 | 宣告发放现金股利或利润 | 计提减值准备 | 其他 | 账面价值 | 减值准备 |
| 联营企业 | | | | | | | | | | | | |
| 鹏华基金公司 | 2,039,407,110.49 | | | | 419,350,127.11 | | | 286,155,000.00 | | | 2,172,602,237.60 | |
| 前海股交投资控股(深圳)有限公司 | 194,312,681.71 | | | | -51,314,367.74 | -1,520,834.00 | -29,341.80 | | | | 141,448,138.17 | |
| 青岛蓝海股权投资中心有限责任公司 | 32,125,222.71 | | | | 1,395,254.19 | | | | | | 33,520,476.90 | |
| 合计 | 2,265,845,014.91 | | | | 369,431,013.56 | -1,520,834.00 | -29,341.80 | 286,155,000.00 | | | 2,347,570,852.67 | |

2. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|--------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 短期薪酬 | 5,509,844,703.51 | 4,365,094,144.58 | 4,920,944,014.89 | 4,953,994,833.20 |
| 离职后福利—设定提存计划 | 1,729,716.78 | 606,156,727.09 | 606,294,989.11 | 1,591,454.76 |
| 合计 | 5,511,574,420.29 | 4,971,250,871.67 | 5,527,239,004.00 | 4,955,586,287.96 |

(2) 短期薪酬明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|-------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 5,217,246,694.53 | 3,641,712,124.36 | 4,179,445,962.62 | 4,679,512,856.27 |
| 职工福利费 | | 110,542,957.17 | 110,542,957.17 | |
| 社会保险费 | 1,025,034.83 | 193,308,718.89 | 193,404,731.92 | 929,021.80 |
| 其中：医疗保险费 | 837,678.89 | 178,628,151.51 | 178,707,714.89 | 758,115.51 |
| 工伤保险费 | 46,019.54 | 4,348,150.39 | 4,348,038.94 | 46,130.99 |
| 生育保险费 | 141,336.40 | 10,332,416.99 | 10,348,978.09 | 124,775.30 |
| 住房公积金 | 192,609.12 | 319,322,282.24 | 319,311,567.49 | 203,323.87 |
| 工会经费和职工教育经费 | 291,380,365.03 | 87,945,297.29 | 105,976,031.06 | 273,349,631.26 |
| 其他短期薪酬 | | 12,262,764.63 | 12,262,764.63 | |
| 小计 | 5,509,844,703.51 | 4,365,094,144.58 | 4,920,944,014.89 | 4,953,994,833.20 |

(3) 设定提存计划明细情况

| 项目 | 期初数 | 本期增加 | 本期减少 | 期末数 |
|--------|--------------|----------------|----------------|--------------|
| 基本养老保险 | 1,591,645.14 | 350,556,415.29 | 350,607,094.10 | 1,540,966.33 |
| 失业保险费 | 50,138.99 | 7,009,889.74 | 7,012,010.56 | 48,018.17 |
| 企业年金缴费 | 87,932.65 | 248,590,422.06 | 248,675,884.45 | 2,470.26 |
| 小计 | 1,729,716.78 | 606,156,727.09 | 606,294,989.11 | 1,591,454.76 |

(二) 母公司利润表项目注释

1. 利息净收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------|------------------|------------------|
| 利息收入 | 7,167,710,625.23 | 6,775,811,647.50 |
| 货币资金及结算备付金利息收入 | 1,355,539,418.67 | 1,419,162,092.97 |
| 拆出资金利息收入 | | |
| 融资融券利息收入 | 3,558,244,829.41 | 3,876,016,006.40 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 256,774,908.51 | 233,824,700.57 |
| 其中：约定购回利息收入 | 2,029,923.95 | 2,943,779.03 |
| 股权质押回购利息收入 | 157,449,544.08 | 188,509,648.91 |
| 债权投资利息收入 | | |
| 其他债权投资利息收入 | 1,924,914,382.58 | 1,128,290,524.45 |
| 其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入 | 72,237,086.06 | 118,518,323.11 |

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------|------------------|------------------|
| 利息支出 | 5,676,603,226.26 | 5,231,198,909.83 |
| 短期借款利息支出 | 969,627.81 | 477,280.48 |
| 应付短期融资券利息支出 | 782,390,635.36 | 838,193,951.41 |
| 拆入资金利息支出 | 159,409,065.73 | 184,811,997.93 |
| 其中：转融通利息支出 | 114,561,532.43 | 122,791,497.77 |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 2,681,669,265.12 | 2,186,384,717.70 |
| 其中：报价回购利息支出 | 75,718,168.70 | 98,668,662.80 |
| 代理买卖证券款利息支出 | 166,639,474.95 | 217,045,450.68 |
| 应付债券利息支出 | 1,735,273,418.62 | 1,703,858,222.36 |
| 其中：次级债券利息支出 | | |
| 其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出 | 150,251,738.67 | 100,427,289.27 |
| 利息净收入 | 1,491,107,398.97 | 1,544,612,737.67 |

2. 手续费及佣金净收入

(1) 明细情况

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------|------------------|------------------|
| 证券经纪业务净收入 | 4,077,520,638.27 | 4,834,906,276.98 |
| 证券经纪业务收入 | 5,146,889,124.58 | 5,913,458,501.08 |
| 代理买卖证券业务 | 4,446,122,199.29 | 5,007,415,318.77 |
| 交易单元席位租赁 | 303,625,744.61 | 362,991,905.72 |
| 代销金融产品业务 | 397,141,180.68 | 543,051,276.59 |
| 证券经纪业务支出 | 1,069,368,486.31 | 1,078,552,224.10 |
| 代理买卖证券业务 | 1,069,368,486.31 | 1,078,552,224.10 |
| 交易单元席位租赁 | | |
| 代销金融产品业务 | | |
| 投资银行业务净收入 | 1,339,924,584.77 | 1,783,895,521.04 |
| 投资银行业务收入 | 1,401,718,780.64 | 1,836,384,304.58 |
| 证券承销业务 | 1,257,912,197.98 | 1,708,743,848.41 |
| 证券保荐业务 | 69,076,415.09 | 63,532,075.45 |
| 财务顾问业务 | 74,730,167.57 | 64,108,380.72 |
| 投资银行业务支出 | 61,794,195.87 | 52,488,783.54 |
| 证券承销业务 | 61,612,120.40 | 52,403,877.88 |

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------|------------------|------------------|
| 证券保荐业务 | | |
| 财务顾问业务 | 182,075.47 | 84,905.66 |
| 资产管理业务净收入 | 522,985,361.79 | 319,213,777.41 |
| 资产管理业务收入 | 523,020,229.01 | 319,226,726.45 |
| 资产管理业务支出 | 34,867.22 | 12,949.04 |
| 投资咨询业务净收入 | 36,213,345.31 | 41,500,380.64 |
| 投资咨询业务收入 | 37,338,637.81 | 42,240,596.81 |
| 投资咨询业务支出 | 1,125,292.50 | 740,216.17 |
| 其他手续费及佣金净收入 | 190,861,941.31 | 222,049,741.79 |
| 其他手续费及佣金收入 | 190,861,941.31 | 222,049,741.79 |
| 其他手续费及佣金支出 | | |
| 合计 | 6,167,505,871.45 | 7,201,565,697.86 |
| 其中：手续费及佣金收入总计 | 7,299,828,713.35 | 8,333,359,870.71 |
| 手续费及佣金支出总计 | 1,132,322,841.90 | 1,131,794,172.85 |

(2) 财务顾问业务净收入

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------------|---------------|---------------|
| 并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司 | 26,087,264.14 | 8,113,490.57 |
| 并购重组财务顾问业务净收入——其他 | 6,415,094.34 | 613,207.54 |
| 其他财务顾问业务净收入 | 42,045,733.62 | 55,296,776.95 |
| 小计 | 74,548,092.10 | 64,023,475.06 |

(3) 代理销售金融产品情况

| 项目 | 期末数 | | 期初数 | |
|--------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
| | 销售总金额 | 代销收入 | 销售总金额 | 代销收入 |
| 基金 | 21,219,339,600.36 | 236,357,018.86 | 25,142,729,111.73 | 352,230,723.35 |
| 其他金融产品 | 6,902,985,358.91 | 160,784,161.82 | 3,471,047,711.44 | 190,820,553.24 |
| 合计 | 28,122,324,959.27 | 397,141,180.68 | 28,613,776,823.17 | 543,051,276.59 |

3. 投资收益

(1) 明细情况

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------------|-------------------|------------------|
| 成本法核算的长期股权投资收益 | 100,000,000.00 | 650,000,000.00 |
| 权益法核算的长期股权投资收益 | 369,431,013.56 | 494,810,235.12 |
| 金融工具投资收益 | 4,443,912,060.30 | 6,174,207,410.75 |
| 其中：持有期间取得的收益 | 5,482,280,138.49 | 5,984,032,080.94 |
| - 交易性金融工具 | 4,448,233,411.40 | 5,153,372,080.64 |
| - 其他权益工具投资 | 1,034,046,727.09 | 830,660,000.30 |
| 处置金融工具取得的收益 | -1,038,368,078.19 | 190,175,329.81 |
| - 交易性金融工具 | 374,578,837.81 | 479,177,267.64 |
| - 其他债权投资 | 218,812,901.02 | 252,332,976.05 |
| - 衍生金融工具 | -1,631,759,817.02 | -541,334,913.88 |
| 其他 | -158,952,776.73 | -221,216,365.25 |
| 合计 | 4,754,390,297.13 | 7,097,801,280.62 |

(2) 按权益法核算的长期股权投资收益

| 被投资单位 | 本期数 | 上年同期数 | 本期比上期增减变动的原因 |
|------------------|----------------|----------------|--------------|
| 鹏华基金公司 | 419,350,127.11 | 506,228,903.96 | 被投资单位净利润变化 |
| 前海股交投资控股（深圳）有限公司 | -51,314,367.74 | -13,029,785.60 | 被投资单位净利润变化 |
| 青岛蓝海股权交易中心有限责任公司 | 1,395,254.19 | 1,611,116.76 | 被投资单位净利润变化 |
| 小计 | 369,431,013.56 | 494,810,235.12 | |

(3) 交易性金融工具投资收益

| 交易性金融工具 | | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------------------|--------|------------------|------------------|
| 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 | 持有期间收益 | 4,448,233,411.40 | 5,153,372,080.64 |
| | 处置期间收益 | 417,013,550.21 | 512,017,010.63 |
| 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 | 持有期间收益 | | |
| | 处置期间收益 | -42,434,712.40 | -32,839,742.99 |
| 小计 | | 4,822,812,249.21 | 5,632,549,348.28 |

4. 公允价值变动收益

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------------|------------------|-------------------|
| 交易性金融资产 | 516,151,094.39 | -2,965,140,310.90 |
| 其中：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 | | |
| 交易性金融负债 | 1,697,854.00 | 13,519,930.38 |
| 其中：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 | | |
| 衍生金融工具 | 756,281,876.79 | 336,970,448.82 |
| 合计 | 1,274,130,825.18 | -2,614,649,931.70 |

5. 业务及管理费

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------|------------------|------------------|
| 职工薪酬 | 4,971,250,871.67 | 5,040,527,723.61 |
| 固定资产折旧费 | 295,413,126.17 | 266,958,838.03 |
| 通讯费 | 211,920,780.94 | 207,803,217.21 |
| 业务宣传费 | 199,385,367.90 | 132,537,168.50 |
| 电子设备运转费 | 187,773,641.31 | 139,919,201.54 |
| 使用权资产折旧费 | 150,592,221.99 | 148,471,107.30 |
| 交易所席位年费 | 151,221,070.96 | 141,952,321.28 |
| 差旅费 | 129,733,257.62 | 74,239,902.50 |
| 无形资产摊销 | 105,865,864.90 | 88,434,042.12 |
| 咨询费 | 96,965,057.70 | 84,540,772.66 |
| 投资者保护基金支出 | 65,006,608.78 | 62,928,159.28 |
| 其他 | 452,312,749.10 | 460,695,653.58 |
| 小计 | 7,017,440,619.04 | 6,849,008,107.61 |

七、在其他主体中的权益

(一) 企业集团的构成

1. 公司将国信弘盛公司、国信期货公司、国信香港公司、国信资本公司等 10 家子公司纳入合并财务报表范围。

2. 子公司基本情况

| 子公司名称 | 注册资本（万元） | 主要经营地及注册地 | 业务性质 | 持股比例（%） | | 取得方式 |
|----------------------|------------------|-----------|------------------|---------|--------|------------|
| | | | | 直接 | 间接 | |
| 国信弘盛公司 | 人民币 280,625.2673 | 深圳 | 股权投资基金管理 | 100.00 | | 设立 |
| 国信香港公司 | 港币 263,000 | 香港 | 金融控股公司 | 100.00 | | 设立 |
| 国信资本公司 | 人民币 300,000 | 深圳 | 科创板跟投；创业投资 | 100.00 | | 设立 |
| 国信期货公司 | 人民币 200,000 | 上海 | 期货经纪、期货投资咨询、资产管理 | 100.00 | | 非同一控制下企业合并 |
| 国信证券(香港)经纪有限公司[注1] | 港币 70,000 | 香港 | 证券及期货经纪业务 | | 100.00 | 设立 |
| 国信证券(香港)融资有限公司[注1] | 港币 51,500 | 香港 | 投资银行 | | 100.00 | 设立 |
| 国信证券(香港)资产管理有限公司[注1] | 港币 19,000 | 香港 | 资产管理 | | 100.00 | 设立 |
| 国信咨询公司[注1] | 港币 1,000 | 深圳 | 提供咨询和支持服务 | | 100.00 | 设立 |
| 国信(香港)金融产品有限公司[注1] | 港币 1.00 | 香港 | 金融产品 | | 100.00 | 设立 |
| 国信金阳资本管理有限公司[注2] | 人民币 60,000 | 上海 | 现货和期货交易 | | 100.00 | 设立 |

[注1] 国信香港公司的下设子公司

[注2] 国信期货公司的下设子公司

3. 其他说明

(1) 对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据

本公司在评估控制时，需考虑：1) 投资方对被投资方的权利；2) 参与被投资方的相关活动而享有的可变回报；3) 有能力运用对被投资方的权利影响其回报的金额。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需要考虑本公司之决策行为是以主要责任人的身份进行还是以代理人的身份进行。考虑的因素通常包括本公司对结构化主体的决策权范围、其他方享有的实质性权利、本公司的报酬水平以及本公司持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。对于本公司担任资产管理方的资产管理计划，本公司会持续评估因管理该资产管理计划而获得的薪酬水平和面临的可变回报风险程度是否表明本公司为该资产管理计划的主要责任人。如本公司为该资产管理计划的主要责任人，应将上述资产管理计划纳入合并范围。

本公司合并的结构化主体包括本公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和本公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。本公司通过综合评估本公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。

(2) 其他说明

2023年12月31日，纳入本公司财务报表合并范围的结构化主体共67个，合并的结构化主体的总资产为人民币41,934,296,050.90元。本公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产和其他权益工具投资的金额为人民币40,443,545,653.85元。

（二）纳入合并范围的结构化主体变动情况

本公司纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。本公司综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使本公司面临可变回报的影响重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。本公司2023年度新增37个结构化主体纳入合并报表范围，10个结构化主体清算或持有份额比例下降丧失控制权不再纳入合并报表范围。

（三）在合营企业或联营企业中的权益

1. 重要的合营企业或联营企业

| 合营企业或联营企业名称 | 主要经营地 | 注册地 | 业务性质 | 持股比例（%） | | 对合营企业或联营企业投资的会计处理方法 |
|-------------|-------|-----|------|---------|----|---------------------|
| | | | | 直接 | 间接 | |
| 鹏华基金公司 | 深圳 | 深圳 | 基金管理 | 50.00 | | 权益法核算 |

2. 重要联营企业的主要财务信息

| 项目 | 期末数 / 本期数 | 期初数 / 上年同期数 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 鹏华基金公司 | 鹏华基金公司 |
| 资产 | 7,943,110,827.75 | 7,555,698,734.80 |
| 负债 | 3,577,244,844.04 | 3,456,974,518.75 |
| 少数股东权益 | | 19,902,571.86 |
| 归属于母公司所有者权益 | 4,365,865,983.71 | 4,078,821,644.19 |
| 按持股比例计算的净资产份额 | 2,182,932,991.86 | 2,039,410,822.10 |
| 调整事项 | -10,330,754.26 | -3,711.61 |
| 对联营企业权益投资的账面价值 | 2,172,602,237.60 | 2,039,407,110.49 |
| 营业总收入 | 3,946,667,523.67 | 4,364,096,385.13 |
| 净利润 | 839,451,767.66 | 1,001,252,692.97 |
| 终止经营的净利润 | | |
| 其他综合收益 | | |
| 综合收益总额 | 839,451,767.66 | 1,001,252,692.97 |
| 本期收到的来自联营企业的股利 | 286,155,000.00 | 323,000,000.00 |

3. 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

| 项目 | 期末数 / 本期数 | 期初数 / 上年同期数 |
|-----------------|----------------|-----------------|
| 合营企业 | | |
| 投资账面价值合计 | 604,360,830.07 | 515,415,348.54 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 | | |
| 净利润 | 2,626,520.26 | 106,629,036.19 |
| 其他综合收益 | | |
| 综合收益总额 | 2,626,520.26 | 106,629,036.19 |
| 联营企业 | | |
| 投资账面价值合计 | 809,601,131.59 | 913,645,761.18 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 | | |
| 净利润 | -31,004,506.21 | -129,925,093.18 |
| 其他综合收益 | -1,520,834.00 | |
| 综合收益总额 | -32,525,340.21 | -129,925,093.18 |

(四) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本公司主要在金融投资等业务中涉及结构化主体，本公司未纳入合并财务报表范围的结构化主体主要包括本公司发起设立的资产管理计划及投资基金，和第三方机构发起设立的资产管理计划、基金等结构化主体。

1. 在本公司发起设立的资产管理计划和投资基金中的权益

本公司发起设立的资产管理计划和投资基金的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费及业绩报酬，其融资方式是向投资者发行投资产品。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入及业绩报酬。

期末本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

| 项目 | 账面价值 | | 最大损失敞口 | |
|---------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 期末数 | 期初数 | 期末数 | 期初数 |
| 交易性金融资产 | 4,582,728,807.84 | 1,695,716,161.79 | 4,582,728,807.84 | 1,695,716,161.79 |

本期本公司从由本公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的资产管理计划及投资基金中获取的管理费及业绩报酬为人民币 532,834,691.34 元。

2. 在第三方机构发起设立的资产管理计划中享有的权益

本公司直接持有的第三方机构发起设立的结构化主体，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括证券公司资产管理计划、基金专户产品和信托产品等。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

期末本公司通过直接持有第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

| 项目 | 账面价值 | | 最大损失敞口 | |
|---------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 期末数 | 期初数 | 期末数 | 期初数 |
| 交易性金融资产 | 42,384,151,798.68 | 32,010,174,765.30 | 42,384,151,798.68 | 32,010,174,765.30 |

八、政府补助

(一) 本期新增的政府补助情况

| 项目 | 本期新增补助金额 |
|------------|---------------|
| 与收益相关的政府补助 | 59,313,380.79 |
| 其中：计入其他收益 | 909,572.30 |
| 计入营业外收入 | 38,861,700.00 |
| 冲减业务及管理费 | 19,542,108.49 |
| 合计 | 59,313,380.79 |

(二) 涉及政府补助的负债项目

| 财务报列报项目 | 期初数 | 本期新上增补助金额 | 本期计入其他收益金额 | 本期计入营业外收入金额 |
|---------|----------------|-----------|--------------|-------------|
| 递延收益 | 122,813,793.48 | | 3,475,862.04 | |
| 小计 | 122,813,793.48 | | 3,475,862.04 | |

(续上表)

| 项目 | 本期冲减成本费用金额 | 本期冲减资产金额 | 其他变动 | 期末数 | 与资产 / 收益相关 |
|------|------------|----------|------|----------------|------------|
| 递延收益 | | | | 119,337,931.44 | 与资产相关 |
| 小计 | | | | 119,337,931.44 | |

(三) 计入当期损益的政府补助金额

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------------|---------------|----------------|
| 计入其他收益的政府补助金额 | 4,385,434.34 | 4,947,562.58 |
| 计入营业外收入的政府补助金额 | 38,861,700.00 | 80,363,550.91 |
| 净额法下，冲减成本费用的金额 | 19,542,108.49 | 28,896,134.67 |
| 合计 | 62,789,242.83 | 114,207,248.16 |

九、与金融工具相关的风险

(一) 风险管理政策及组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

1. 董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

2. 经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

3. 独立的风险管理机构

公司风险管理总部、合规管理总部、监察稽核总部等部门作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的全面风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，起草公司整体的风险偏好和容忍度方案，合理配置风险限额。对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行检查和考评。资金运营部、信息技术部门、党群办公室分别牵头开展流动性风险管理、信息技术风险管理、声誉风险管理工作。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对内部控制制度的完整性、合理性及其实施的有效性进行检查和评估。

4. 业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

(二) 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

1. 具有债权性质的债券等投资交易业务；
2. 融资融券、约定购回和股票质押式回购等资本中介业务；
3. 场外衍生品业务；
4. 存放银行的活期存款及定期存款；
5. 其他可能产生信用风险的业务或活动；

针对上述业务风险，公司已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、舆情监控、信用风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务的主要信用风险为发行人违约导致损失的风险。公司通过建立内评系统并采用定性与定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、持续监控报告发行人资信状况、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理。

融资融券、股票质押式回购交易等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理，并适时进行逆周期调节；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 253.92%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 210.33%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 175.94%。

衍生品交易业务存在交易对手于约定日期未履行支付义务的信用风险。对此，公司对交易对手进行评级并授信；寻求资质好的担保方项目进行交易；利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等措施进行风险缓释；明确违约事件、提前终止事件的处理流程等措施。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中登公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

在不考虑担保物或其他信用增级措施的情况下，于资产负债表日最大信用风险敞口是指金融资产扣除减值准备后的账面价值。公司最大信用风险敞口金额列示如下：

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|----------------|--------------------|--------------------|
| 货币资金 | 61,904,744,939.58 | 64,977,826,272.53 |
| 结算备付金 | 15,177,516,074.20 | 15,734,799,287.70 |
| 存出保证金 | 9,827,332,808.11 | 7,900,221,491.14 |
| 融出资金 | 55,881,511,468.98 | 52,672,094,624.02 |
| 衍生金融资产 | 568,494,996.30 | 164,204,033.62 |
| 交易性金融资产 [注 1] | 127,454,748,685.45 | 120,894,809,734.67 |
| 债权投资 | 291,898,258.32 | 69,266,211.57 |
| 其他债权投资 | 84,444,910,893.48 | 51,501,472,752.05 |
| 其他权益工具投资 [注 2] | 92,635,449.72 | 146,735,038.90 |
| 买入返售金融资产 | 8,124,242,250.38 | 15,824,517,431.75 |
| 应收款项 | 4,083,918,364.27 | 4,728,934,871.75 |
| 其他资产 | 206,814,957.36 | 203,552,147.75 |
| 小计 | 368,058,769,146.15 | 334,818,433,897.45 |

[注 1] 交易性金融资产为债券投资、融出证券业务下融出给客户的证券以及向证金公司借出的证券

[注 2] 其他权益工具投资为融出证券业务下融出给客户的证券

（三）操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格遵守监管要求，落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理流程相关风险；三是运用关键风险指标开展日常监控，及时预警、处置风险，并加强业务风险检查；四是持续完善风险事件收集机制，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是积极开展风险管理文化宣导，以案例分析、现场培训等多种形式组织公司各部门风险教育培训。

（四）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。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司流动性风险管理组织架构包括董事会、经理层、资金运营部、风险管理总部、相关部门及子公司等，公司董事会承担流动性风险管理的最终责任，资金运营部是公司流动性风险管理的负责部门，统筹公司资金来源与融资管理。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

1. 积极拓展维护融资渠道，保障公司融资来源的多元化和稳定程度，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平；
2. 加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求；
3. 持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地；
4. 持续优化现金流管理，动态计量未来不同时间段的现金流，提前做好应对安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口；
5. 适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施；
6. 持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

金融负债按剩余到期日分类

| 项目 | 即期 | 小于3个月 | 3个月至1年 | 1至5年 | 5年以上 | 合计 |
|-----------|-------------------|--------------------|-------------------|-------------------|---------------|--------------------|
| 短期借款 | | 3,640,658.19 | | | | 3,640,658.19 |
| 应付短期融资款 | | 17,074,259,553.96 | 39,087,344,228.52 | | | 56,161,603,782.48 |
| 拆入资金 | | 3,518,168,233.34 | 3,548,503,472.22 | | | 7,066,671,705.56 |
| 交易性金融负债 | | 758,138,354.78 | 167,361,706.24 | 343,986,729.60 | 9,714,686.66 | 1,279,201,477.28 |
| 衍生金融负债 | | 96,186,995.06 | 371,455,475.77 | 245,624,532.06 | | 713,267,002.89 |
| 应付款项 | 4,574,000,949.01 | 2,453,024,315.07 | 1,664,213,280.04 | 11,191,835,873.82 | | 19,883,074,417.94 |
| 卖出回购金融资产款 | | 124,260,055,103.99 | 60,771,011.83 | | | 124,320,826,115.82 |
| 代理买卖证券款 | 56,070,946,875.80 | | | | | 56,070,946,875.80 |
| 应付债券 | | 2,902,109,333.55 | 16,068,055,081.69 | 52,692,690,783.68 | | 71,662,855,198.92 |
| 租赁负债 | | 42,847,349.58 | 128,702,056.94 | 283,496,020.37 | 15,952,638.14 | 470,998,065.03 |
| 其他金融负债 | 11,969,181,011.89 | | | | | 11,969,181,011.89 |
| 合计 | 72,614,128,836.70 | 151,108,429,897.52 | 61,096,406,313.25 | 64,757,633,939.53 | 25,667,324.80 | 349,602,266,311.80 |

(五) 市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益投资业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市

场风险的形成。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，根据各业务的特点不断丰富限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和风险价值（VaR）限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母、集中度等限额并进行日常监控。另外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过 VaR 等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR 值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR 模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

母公司和集团以期末为基期的 VaR 值（1 天，99%）分析概况如下：

单位：万元

| VaR | 母公司层面 | 合并层面 |
|---------|--------|--------|
| 权益类市场风险 | 31,508 | 32,546 |
| 利率类市场风险 | 16,771 | 16,776 |
| 商品类市场风险 | 2 | 33 |
| 外汇类市场风险 | 4,807 | 4,820 |
| 整体风险值 | 31,331 | 30,956 |

价格敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，股票、基金、可转换债券、衍生品等资产类型的价格增加或减少对集团和公司综合收益的影响。假设以 2023 年 12 月 31 日为基期，在其他变量固定的情况下市场权益类及商品价格发生变动，且不考虑管理层为市场价格变化而可能采取的风险管理活动，价格敏感性分析如下：

单位：万元

| 价格变动对综合收益影响 | 母公司层面 | 合并层面 |
|------------------|----------|----------|
| 股票、基金、商品价格上浮 10% | 206,491 | 214,069 |
| 股票、基金、商品价格下跌 10% | -188,697 | -196,256 |

下表汇总了本公司涉及的市场风险敞口：

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|--------------------|--------------------|
| 股票 | 33,679,668,560.02 | 14,819,489,487.20 |
| 公募基金 | 25,921,905,104.46 | 16,727,868,981.52 |
| 债券 | 211,192,266,432.14 | 171,309,781,674.74 |
| 券商资管产品 | 4,651,334,975.16 | 1,733,867,258.15 |
| 银行理财产品 | 727,857,095.68 | 6,330,475,561.97 |

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|--------|--------------------|--------------------|
| 信托计划 | 681,729,109.57 | 220,493,801.58 |
| 其他股权投资 | 1,903,088,450.60 | 1,637,041,120.18 |
| 其他 | 17,274,007,449.32 | 8,694,085,323.87 |
| 合计 | 296,031,857,176.95 | 221,473,103,209.21 |

利率敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，市场整体利率平行变动对集团和公司综合收益的影响。假设以2023年12月31日为基期，在其他变量固定的情况下市场整体利率发生平行变动，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，利率敏感性分析如下：

单位：万元

| 收益率曲线变动对综合收益影响 | 母公司层面 | 合并层面 |
|----------------|----------|----------|
| 上升100个基点 | -462,491 | -463,124 |
| 下降100个基点 | 523,486 | 524,124 |

下表汇总了本公司涉及利率风险的金融资产或金融负债：

1. 期末数

| 项目 | 1个月以内 | 1至3个月 | 3个月至1年 | 1至5年 | 5年以上 | 非生息 | 合计 |
|-------------|---------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| 金融资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 52,435,788,543.88 | 2,861,468,541.51 | 6,499,757,585.46 | | | 107,730,268.73 | 61,904,744,939.58 |
| 结算备付金 | 15,167,955,628.54 | | | | | 9,560,445.66 | 15,177,516,074.20 |
| 融出资金 | 212,742,110.24 | 54,491,621,373.88 | | | | 1,177,147,984.86 | 55,881,511,468.98 |
| 交易性金融资产 | 1,174,463,055.24 | 2,056,346,249.49 | 36,397,519,356.11 | 72,378,385,908.60 | 14,536,161,454.87 | 69,440,667,850.71 | 195,983,543,875.02 |
| 衍生金融资产 | -1,834,638.79 | -906,362.21 | 4,177,274.92 | 431,061.81 | | 566,627,660.57 | 568,494,996.30 |
| 买入返售金融资产 | 4,041,374,242.90 | 374,134,093.80 | 3,636,744,636.07 | | | 71,989,277.61 | 8,124,242,250.38 |
| 存出保证金 | 9,818,259,611.67 | | | | | 9,073,196.44 | 9,827,332,808.11 |
| 其他权益工具投资 | | | | | | 15,311,504,150.13 | 15,311,504,150.13 |
| 其他债权投资 | 992,367,590.00 | 1,384,503,111.00 | 14,831,952,007.91 | 47,537,379,246.67 | 18,574,353,900.60 | 1,124,355,037.30 | 84,444,910,893.48 |
| 债权投资 | | 17,437,343.29 | 261,096,493.60 | 13,364,421.43 | | | 291,898,258.32 |
| 小计 | 83,841,116,143.68 | 61,184,604,350.76 | 61,631,247,354.07 | 119,929,560,638.51 | 33,110,515,355.47 | 87,818,655,872.01 | 447,515,699,714.50 |
| 金融负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | 3,640,000.00 | | | | | | 3,640,000.00 |
| 应付短期融资款 | 2,468,166,000.00 | 14,384,506,000.00 | 38,324,941,000.00 | | | 362,559,754.04 | 55,540,172,754.04 |
| 拆入资金 | 3,070,000,000.00 | 440,000,000.00 | 3,500,000,000.00 | | | 21,963,594.60 | 7,031,963,594.60 |
| 交易性金融负债 | 1,931,565.30 | 749,848,050.00 | 157,390,186.45 | | | 370,031,675.53 | 1,279,201,477.28 |
| 衍生金融负债 | -31,390,683.36 | 9,449,637.61 | 124,381,671.85 | 245,624,532.05 | | 365,201,844.74 | 713,267,002.89 |
| 应付款项 | | | | | | 19,883,074,417.94 | 19,883,074,417.94 |
| 卖出回购金融资产款 | 122,935,546,494.55 | 1,138,978,000.00 | 60,162,000.00 | | | 140,906,458.34 | 124,275,592,952.89 |
| 代理买卖证券款 | 56,065,063,102.79 | | | | | 5,883,773.01 | 56,070,946,875.80 |
| 代理承销证券款 | 44,000,000.00 | | | | | | 44,000,000.00 |
| 应付债券 | 14,424,000.00 | 2,384,472,000.00 | 14,521,354,000.00 | 49,773,487,000.00 | | 789,922,450.58 | 67,483,659,450.58 |
| 租赁负债 | 13,607,650.64 | 25,658,487.04 | 119,514,363.94 | 269,390,733.89 | 15,061,481.94 | | 443,232,717.45 |
| 其他金融负债 | 11,969,181,011.89 | | | | | | 11,969,181,011.89 |
| 小计 | 196,554,169,141.81 | 19,132,912,174.65 | 56,807,743,222.24 | 50,288,502,265.94 | 15,061,481.94 | 21,939,543,968.78 | 344,737,932,255.36 |
| 净头寸 | -112,713,052,998.13 | 42,051,692,176.11 | 4,823,504,131.83 | 69,641,058,372.57 | 33,095,453,873.53 | 65,879,111,903.23 | 102,777,767,459.14 |

2. 期初数

| 项目 | 1个月以内 | 1至3个月 | 3个月至1年 | 1至5年 | 5年以上 | 非生息 | 合计 |
|----------------|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| 金融资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 55,315,015,268.80 | 4,574,265,129.80 | 4,869,724,541.97 | 100,000,000.00 | | 118,821,331.96 | 64,977,826,272.53 |
| 结算备付金 | 15,723,198,799.10 | | | | | 11,600,488.60 | 15,734,799,287.70 |
| 融出资金 | 250,220,723.88 | 51,389,110,165.18 | | | | 1,032,763,734.96 | 52,672,094,624.02 |
| 交易性金融资产 | 2,137,729,963.14 | 4,074,730,863.66 | 42,825,817,976.39 | 60,196,893,944.02 | 10,416,097,283.98 | 39,821,303,206.25 | 159,472,573,237.44 |
| 衍生金融资产 | | | | | | 164,204,033.62 | 164,204,033.62 |
| 买入返售金融资产 | 11,061,342,331.22 | 323,074,261.19 | 4,356,486,947.59 | | | 83,613,891.75 | 15,824,517,431.75 |
| 存出保证金 | 7,898,323,637.82 | | | | | 1,897,853.32 | 7,900,221,491.14 |
| 其他权益工具投资 | | | 146,735,038.90 | | | 10,283,055,969.25 | 10,429,791,008.15 |
| 其他债权投资 | 50,007,250.00 | 390,964,870.00 | 8,459,838,094.40 | 35,215,707,566.36 | 6,556,370,777.01 | 828,584,194.28 | 51,501,472,752.05 |
| 债权投资 | | 24,066,732.47 | 29,550,582.11 | 15,459,581.01 | | 189,315.98 | 69,266,211.57 |
| 小计 | 92,435,837,973.96 | 60,776,212,022.30 | 60,688,153,181.36 | 95,528,061,091.39 | 16,972,468,060.99 | 52,346,034,019.98 | 378,746,766,349.98 |
| 金融负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | | | | | | | |
| 应付短期融资款 | 9,867,721,000.00 | 11,155,499,000.00 | 1,127,068,000.00 | | | 365,707,310.97 | 22,515,995,310.97 |
| 拆入资金 | 9,000,000,000.00 | | | | | 6,162,483.33 | 9,006,162,483.33 |
| 交易性金融负债 | 35,230,000.00 | 1,276,797,860.96 | 18,133,323.78 | | | 459,686,169.88 | 1,789,847,354.62 |
| 衍生金融负债 | 49,551,705.92 | 110,203,242.82 | 160,637,815.35 | 2,261,210.02 | | 2,018,465.49 | 324,672,439.60 |
| 应付款项 | | | | | | 12,698,831,315.61 | 12,698,831,315.61 |
| 卖出回购金融资产款 | 112,467,883,987.72 | 1,527,285,000.00 | 84,272,000.00 | | | 104,418,395.45 | 114,183,859,383.17 |
| 代理买卖证券款 | 59,406,410,931.29 | | | | | 7,403,577.84 | 59,413,814,509.13 |
| 代理承销证券款 | | | | | | | |
| 应付债券 | 3,009,661,000.00 | 5,059,721,000.00 | 2,173,589,000.00 | 37,902,325,000.00 | | 705,140,652.29 | 48,850,436,652.29 |
| 租赁负债 | 14,885,610.42 | 24,415,823.80 | 114,370,693.22 | 238,628,537.71 | 19,829,262.42 | | 412,129,927.57 |
| 其他金融负债 | 10,315,340,464.68 | | | | | | 10,315,340,464.68 |
| 小计 | 204,166,684,700.03 | 19,153,921,927.58 | 3,678,070,832.35 | 38,143,214,747.73 | 19,829,262.42 | 14,349,368,370.86 | 279,511,089,840.97 |
| 净头寸 | -111,730,846,726.07 | 41,622,290,094.72 | 57,010,082,349.01 | 57,384,846,343.66 | 16,952,638,798.57 | 37,996,665,649.12 | 99,235,676,509.01 |

(六) 金融资产转移

本公司进行的某些交易会将已确认的金融资产转让给第三方或客户。这些金融资产转让若符合终止确认条件的，相关金融资产全部或部分终止确认。当本公司保留了已转让资产的绝大部分风险与回报时，本公司继续在资产负债表中确认此类资产。本公司转移金融资产且继续涉入的资产主要包括买断式卖出回购交易、融券业务。

1. 卖出回购交易

卖出回购交易中作为担保物交付给交易对手的证券，交易对手在本公司无任何违约的情况下，可以将上述证券再次用于担保，但同时需承担在协议规定的到期日将上述证券归还于本公司的义务。在某些情况下，若相关证券价值上升或下降，本公司可以要求交易对手归还部分担保物或需要支付额外的担保物。对于上述交易，本公司认为保留了相关证券的大部分风险和报酬，故未对相关证券进行终止确认。同时，本公司将收到的资金确认为一项金融负债。

2. 融券业务

融券业务出借给客户供其卖出的证券，本公司要求客户提供能够完全覆盖融券信用敞口的担保物，按照协议规定，客户需承担将上述证券归还于本公司的义务。在某些情况下，若相关证券价值上升或下降，本公司需要向客户归还部分担保物或可以要求客户支付额外的担保物。对于上述交易，本公司认为保留了相关证券的大部分风险和报酬，故未对相关证券进行终止确认。

本公司转移金融资产且继续涉入的资产的账面价值如下：

| 项目 | 期末数 | 期初数 |
|-----------|------------------|------------------|
| 买断式卖出回购交易 | 690,281,430.00 | 449,237,720.00 |
| 融券业务 | 997,962,243.64 | 1,170,287,864.86 |
| 合计 | 1,688,243,673.64 | 1,619,525,584.86 |

十、公允价值的披露

(一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

| 项目 | 期末公允价值 | | | 合计 |
|-------------------------------|-------------------|--------------------|------------------|--------------------|
| | 第一层次公允价值计量 | 第二层次公允价值计量 | 第三层次公允价值计量 | |
| 持续的公允价值计量 | | | | |
| 1. 交易性金融资产 | 24,268,098,008.84 | 163,783,499,257.13 | 7,931,946,609.05 | 195,983,543,875.02 |
| (1) 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 | 24,268,098,008.84 | 163,783,499,257.13 | 7,931,946,609.05 | 195,983,543,875.02 |
| 债务工具投资 | | 123,497,207,393.24 | 2,958,249,887.10 | 126,455,457,280.34 |
| 权益工具投资 | 24,268,098,008.84 | 40,286,291,863.89 | 4,973,696,721.95 | 69,528,086,594.68 |
| (2) 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 | | | | |
| 债务工具投资 | | | | |
| 2. 衍生金融资产 | | 562,710,596.30 | 5,784,400.00 | 568,494,996.30 |
| 3. 其他债权投资 | | 83,861,371,364.72 | 583,539,528.76 | 84,444,910,893.48 |
| 4. 其他权益工具投资 | 13,193,101,600.13 | 2,117,002,550.00 | 1,400,000.00 | 15,311,504,150.13 |
| 持续以公允价值计量的资产总额 | 37,461,199,608.97 | 250,324,583,768.15 | 8,522,670,537.81 | 296,308,453,914.93 |
| 5. 交易性金融负债 | 1,931,565.30 | 1,252,710,686.38 | 24,559,225.60 | 1,279,201,477.28 |
| (1) 交易性金融负债 | 1,931,565.30 | 1,252,710,686.38 | 24,559,225.60 | 1,279,201,477.28 |
| (2) 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债 | | | | |
| 6. 衍生金融负债 | 359,612,154.92 | 353,654,847.97 | | 713,267,002.89 |
| 持续以公允价值计量的负债总额 | 361,543,720.22 | 1,606,365,534.35 | 24,559,225.60 | 1,992,468,480.17 |

（二）持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

对于存在活跃市场的金融资产或金融负债，本公司采用活跃市场中的报价确定其公允价值。

（三）持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

债券投资的公允价值是采用第三方估值机构估值系统的报价，第三方估值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。不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。场外期权、收益互换、收益凭证的公允价值是通过定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应金融工具的可观察输入值。

（四）持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

| 项目 | 2023年12月31日 公允价值 | 估值技术 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|-----------------------|---------------------|------------------------------|------------------|------------------------------|
| 流通受限的上市公司股票 | 398,060,086.19 | 期权定价模型 | 波动率 | 波动率越高，公允价值越低 |
| 非活跃市场的股票 / 非上市公司股权 | 2,027,233,135.55 | 市值折扣法 / 协议转让 价格 / 净资产调整法等 | 流动性折扣 | 折扣越高，公允价值越低 |
| 理财产品、私募债、 可交债等 | 6,116,152,141.67 | 现金流量折现法 / 期权 定价模型 | 风险调整折现率 / 波动率 | 风险调整折现率越高 / 波 动率越低，公允价值越低 |
| 流通受限的可转债远期合约 | 5,784,400.00 | 期权定价模型 | 波动率 | 波动率越高，公允价值越低 |
| 合计 | 8,547,229,763.41 | | | |

（五）持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析

| 项目 | 期初余额 | 转入第三层次 | 转出第三层次 | 当年利得或损失总额 | |
|----------|------------------|--------------|------------------|----------------|----------|
| | | | | 计入损益 | 计入其他综合收益 |
| 交易性金融资产 | 9,227,388,785.24 | | 1,618,162,821.20 | 398,739,067.41 | |
| 其他权益工具投资 | 20,706,500.00 | 1,400,000.00 | 20,706,500.00 | | |
| 其他债权投资 | | | | 539,528.76 | |
| 衍生金融资产 | | | | 5,784,400.00 | |
| 交易性金融负债 | 31,332,151.20 | | | -1,845,650.48 | |
| 合计 | 9,279,427,436.44 | 1,400,000.00 | 1,638,869,321.20 | 403,217,345.69 | |

(续上表)

| 项目 | 购买、发行、出售和结算 | | | | 期末余额 | 对于在报告期末持有的资产， 计入损益的当期未实现利得 或损失的变动 |
|----------|------------------|----|------------------|----|------------------|---|
| | 购买 | 发行 | 出售 | 结算 | | |
| 交易性金融资产 | 4,118,102,656.43 | | 4,194,121,078.83 | | 7,931,946,609.05 | 312,257,550.66 |
| 其他权益工具投资 | | | | | 1,400,000.00 | |
| 其他债权投资 | 583,000,000.00 | | | | 583,539,528.76 | 539,528.76 |
| 衍生金融资产 | | | | | 5,784,400.00 | 5,784,400.00 |
| 交易性金融负债 | | | 4,927,275.12 | | 24,559,225.60 | -1,845,650.48 |
| 合计 | 4,701,102,656.43 | | 4,199,048,353.95 | | 8,547,229,763.41 | 316,735,828.94 |

(六) 持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

2023 年度，本公司公允价值计量的项目由第三层次转出主要是限售股解禁所致。

(七) 本期发生的估值技术变更及变更原因

2023 年度，本公司公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

(八) 不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

本公司管理层认为，于 2023 年 12 月 31 日除应付短期融资款、应付债券外，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。截至 2023 年 12 月 31 日，本公司所持有的应付短期融资款账面价值为人民币 55,540,172,754.04 元，公允价值为人民币 55,563,133,075.89 元；本公司所持有的应付债券账面价值人民币为 67,483,659,450.58 元，公允价值为人民币 68,046,848,430.09 元。

十一、关联方及关联交易

(一) 关联方情况

1. 本公司的母公司情况

(1) 本公司的母公司

| 母公司名称 | 注册地 | 业务性质 | 注册资本 (万元) | 母公司对本公司的 持股比例 (%) | 母公司对本公司的 表决权比例 (%) |
|--------|-----|---|--------------|----------------------|-----------------------|
| 深圳投控公司 | 深圳 | 通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理 | 3,235,900.00 | 33.53 | 33.53 |

(2) 本公司最终控制方是深圳市人民政府国有资产监督管理委员会。

2. 本公司的子公司情况详见本财务报表附注七（一）之说明。

3. 本公司的合营和联营企业情况

本公司重要的合营或联营企业详见本财务报表附注七（三）之说明。本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下：

| 合营或联营企业名称 | 与本公司关系 |
|-------------------------------|----------|
| 鹏华基金公司 | 本公司之联营企业 |
| 深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之联营企业 |
| 厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之联营企业 |
| 深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙） | 本公司之联营企业 |
| 深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙） | 本公司之联营企业 |
| 深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之联营企业 |
| 南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之联营企业 |
| 张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之合营企业 |
| 深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之合营企业 |
| 深圳市鹏鹏弘盛绿色产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之合营企业 |
| 宿迁市国信运东数字经济产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之合营企业 |
| 深圳市弘盛宝龙新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 本公司之合营企业 |

4. 本公司的其他关联方情况

| 其他关联方名称 | 其他关联方与本公司关系 |
|--------------------------|------------------------|
| 华润深国投信托有限公司（以下简称华润深国投公司） | 持有本公司 5% 以上股份的法人 |
| 深圳国际控股有限公司 | 受同一方控制 |
| 深圳千里马国际猎头有限公司 | 受同一方控制 |
| 深圳市水务规划设计院股份有限公司 | 受同一方控制 |
| 深圳英飞拓科技股份有限公司 | 受同一方控制 |
| 深圳人大干部培训中心有限公司 | 受同一方控制 |
| 深圳市建筑设计研究总院有限公司 | 受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事 |
| 深圳市通产集团有限公司 | 受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事 |
| 深圳市高新投集团有限公司 | 受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事 |
| 深圳市投控资本有限公司 | 受同一方控制、公司董事担任该公司董事长 |

| 其他关联方名称 | 其他关联方与本公司关系 |
|------------------------|----------------------------------|
| 深圳资产管理有限公司 | 受同一方控制、公司董事担任该公司董事长 |
| 国任财产保险股份有限公司 | 受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事 |
| 深圳担保集团有限公司 | 受同一方控制、公司董事担任该公司董事 |
| 深圳市怡亚通供应链股份有限公司 | 受同一方控制、公司董事担任该公司董事 |
| 深圳市特发集团有限公司 | 受同一方控制、深圳投控公司董事、高管担任该公司董事 |
| 深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司 | 深圳投控公司高管担任该公司董事 |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 深圳投控公司监事担任该公司董事 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 深圳投控公司董事及监事担任该公司董事 |
| 深圳市燃气集团股份有限公司 | 深圳投控公司董事担任该公司董事 |
| 四川银行股份有限公司 | 深圳投控公司董事担任该公司董事 |
| 深圳市会计协会 | 深圳投控公司高管担任该协会副会长 |
| 深圳港集团有限公司 | 深圳投控公司董事担任该公司董事 |
| 北京城建投资发展股份有限公司 | 公司监事担任该公司董事 |
| 深圳投控共赢股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 深圳投控董事过去 12 个月曾在该公司担任执行事务合伙人委派代表 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 深圳投控公司董事担任该公司董事至 2023 年 4 月 28 日 |
| 深圳高速公路集团股份有限公司 | 曾受同一方控制至 2023 年 4 月 28 日 |
| 云南白药集团股份有限公司 | 公司董事担任该公司董事至 2023 年 4 月 28 日 |
| 深圳市明达资产管理有限公司 | 公司高管之亲属担任该公司董事至 2023 年 4 月 28 日 |
| 云南红塔银行股份有限公司 | 公司董事担任该公司董事至 2024 年 1 月 9 日 |
| 红塔证券股份有限公司 | 公司董事担任该公司董事至 2024 年 1 月 9 日 |

（二）关联交易情况

1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

（1）佣金收入

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------|------------|---------------|---------------|
| 鹏华基金公司 | 席位佣金收入 | 79,303,018.87 | 94,856,739.41 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 席位佣金收入 | 5,587,075.47 | 10,152,758.06 |
| 华润深国投公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 8,623,930.32 | 8,555,789.50 |
| 深圳投控共赢股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 证券代理买卖交易佣金 | 305,722.91 | 198,656.36 |
| 国任财产保险股份有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 265,277.42 | 34,113.20 |

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 云南白药集团股份有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 116,799.00 | 41,272.72 |
| 深圳英飞拓科技股份有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 71,402.93 | |
| 深圳市高新投集团有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 67,806.42 | 36,353.42 |
| 深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业(有限合伙) | 证券代理买卖交易佣金 | 29,769.77 | 77,275.67 |
| 关联自然人 | 证券代理买卖交易佣金 | 18,102.67 | 17,627.39 |
| 南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业(有限合伙) | 证券代理买卖交易佣金 | 15,220.27 | |
| 深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙) | 证券代理买卖交易佣金 | 13,936.87 | |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 5,739.17 | |
| 深圳市特发集团有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | 1,658.11 | 40,230.37 |
| 深圳投控公司 | 证券代理买卖交易佣金 | | 158,496.24 |
| 深圳市怡亚通供应链股份有限公司 | 证券代理买卖交易佣金 | | 1,504.68 |
| 合计 | | 94,425,460.20 | 114,170,817.02 |

(2) 提供咨询服务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|--------|------------|------------|
| 国泰君安证券股份有限公司 | 咨询服务费 | 330,188.68 | 235,849.06 |
| 合计 | | 330,188.68 | 235,849.06 |

(3) 提供顾问服务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------|--------|--------------|--------------|
| 深圳投控公司 | 财务顾问收入 | 1,179,245.28 | 652,830.19 |
| 深圳市投控资本有限公司 | 财务顾问收入 | 754,716.98 | 700,000.00 |
| 深圳国际控股有限公司 | 财务顾问收入 | 200,000.00 | |
| 深圳市水务规划设计院股份有限公司 | 财务顾问收入 | 89,622.64 | |
| 华润深国投公司 | 投资顾问收入 | 503,944.11 | 1,532,483.98 |
| 深圳市通产集团有限公司 | 财务顾问收入 | | 849,056.60 |
| 深圳英飞拓科技股份有限公司 | 财务顾问收入 | | 92,452.83 |
| 深圳市高新投集团有限公司 | 财务顾问收入 | | 424,528.30 |
| 深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司 | 财务顾问收入 | | 547,169.81 |
| 合计 | | 2,727,529.01 | 4,798,521.71 |

(4) 提供金融产品代销服务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 鹏华基金公司 | 代销金融产品收入 | 37,933,053.66 | 42,043,714.65 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 代销金融产品收入 | 6,982,594.36 | 7,734,273.45 |
| 华润深国投公司 | 代销金融产品收入 | 1,464,033.65 | 2,584,969.75 |
| 深圳市明达资产管理有限公司 | 代销金融产品收入 | 1,398,684.08 | 1,222,230.06 |
| 合计 | | 47,778,365.75 | 53,585,187.91 |

(5) 提供资产管理服务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 18,677,165.75 | 49,001,740.48 |
| 张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 9,622,641.53 | 6,669,940.56 |
| 深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 4,017,063.74 | 4,017,063.69 |
| 深圳市鹏鹞弘盛绿色产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 480,744.36 | |
| 深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 430,188.70 | 3,535.80 |
| 宿迁市国信运东数字经济产业投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 190,746.96 | |
| 深圳市弘盛宝龙新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | 134,401.65 | |
| 深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙） | 基金管理收入 | | 1,509,184.58 |
| 厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 基金管理收入 | | 1,470,018.07 |
| 深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金（有限合伙） | 基金管理收入 | | 12,276,426.58 |
| 深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙） | 基金管理收入 | | -11,643,833.48 |
| 合计 | | 33,552,952.69 | 63,304,076.28 |

(6) 提供外包服务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|------------------------------|--------|----------|-------|
| 深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 外包服务收入 | 7,037.41 | |
| 合计 | | 7,037.41 | |

(7) 提供承销保荐服务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------|--------|---------------|---------------|
| 深圳市燃气集团股份有限公司 | 债券承销收入 | 16,981,132.07 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 债券承销收入 | 10,949,890.01 | 12,343,877.36 |
| 深圳投控公司 | 债券承销收入 | 3,760,377.36 | 5,811,320.75 |
| 北京城建投资发展股份有限公司 | 债券承销收入 | 2,603,773.58 | |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 债券承销收入 | 2,303,377.63 | 478,584.42 |
| 深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司 | 债券承销收入 | 892,452.83 | 1,471,698.11 |
| 深圳资产管理有限公司 | 债券承销收入 | 507,050.87 | |
| 深圳高速公路集团股份有限公司 | 债券承销收入 | 113,867.92 | |
| 国任财产保险股份有限公司 | 债券承销收入 | 25,471.70 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 债券分销收入 | 62,761.70 | 272,641.51 |
| 深圳担保集团有限公司 | 债券承销收入 | | 1,699,056.60 |
| 深圳港集团有限公司 | 债券承销收入 | | 410,566.04 |
| 合计 | | 38,200,155.67 | 22,487,744.79 |

(8) 收取利息

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|-------|--------|-----------|-----------|
| 关联自然人 | 融出资金利息 | 11,274.16 | 10,489.93 |
| 合计 | | 11,274.16 | 10,489.93 |

(9) 卖出回购交易

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|----------|---------------|---------------|
| 南方基金管理股份有限公司 | 卖出回购利息支出 | 39,885,194.16 | 32,599,484.13 |
| 华润深国投公司 | 卖出回购利息支出 | 17,162,291.70 | 3,121,503.01 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 卖出回购利息支出 | 11,571,172.12 | 2,534,269.02 |
| 四川银行股份有限公司 | 卖出回购利息支出 | 987,017.72 | |
| 云南红塔银行股份有限公司 | 卖出回购利息支出 | | 14,136.99 |
| 合计 | | 69,605,675.70 | 38,269,393.15 |

(10) 接受其他劳务

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------|--------------|---------------|---------------|
| 国泰君安证券股份有限公司 | 债券承销 / 分销支出 | 9,447,169.81 | 9,603,773.58 |
| 鹏华基金公司 | 基金管理费 | 2,790,994.67 | 1,438,181.25 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 基金管理费 | 169,938.50 | |
| 国任财产保险股份有限公司 | 购买保险服务 | 754,716.98 | 754,716.98 |
| 深圳千里马国际猎头有限公司 | 咨询服 / 培训务费支出 | 259,067.47 | 1,550,446.19 |
| 深圳市建筑设计研究总院有限公司 | 设计费 | | 1,066,037.74 |
| 深圳人大干部培训中心有限公司 | 培训费 | | 7,281.55 |
| 深圳市会计协会 | 会费、年费 | | 100,000.00 |
| 合计 | | 13,421,887.43 | 14,520,437.29 |

2. 关联租赁情况

公司承租情况

| 出租方名称 | 租赁资产种类 | 本期数 | | | |
|-------------|------------|---|-----------------------------|-------------|---------|
| | | 简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额 | 确认使用权资产的租赁 | | |
| | | | 支付的租金（不包括未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额） | 增加的租赁负债本金金额 | 确认的利息支出 |
| 华润深国投公司 | 房屋 / 广告位租赁 | 160,000.00 | 408,080.04 | 52,379.95 | |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 房屋租赁 | | 789,409.75 | 59,721.89 | |

(续上表)

| 出租方名称 | 租赁资产种类 | 上年同期数 | | | |
|-------------|--------|---|-----------------------------|-------------|---------|
| | | 简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额 | 确认使用权资产的租赁 | | |
| | | | 支付的租金（不包括未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额） | 增加的租赁负债本金金额 | 确认的利息支出 |
| 华润深国投公司 | 房屋租赁 | 2,056,092.71 | 33,743.55 | 878.19 | |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 房屋租赁 | | 806,257.84 | 83,523.80 | |

3. 关键管理人员报酬

单位：万元

| 项目 | 本期数 | 上年同期数 |
|----------|----------|----------|
| 关键管理人员报酬 | 3,861.67 | 3,972.56 |

4. 其他关联交易

(1) 自营交易

单位：万元

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|--------|--------------|--------------|
| 国泰君安证券股份有限公司 | 自营交易 | 1,682,849.08 | 560,896.03 |
| 华润深国投公司 | 自营交易 | 1,390,614.68 | 850,559.23 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 自营交易 | 174,631.72 | 2,228,831.31 |
| 云南红塔银行股份有限公司 | 自营交易 | 5,156.78 | 34,729.50 |
| 红塔证券股份有限公司 | 自营交易 | 5,002.81 | 16,396.58 |
| 合计 | | 3,258,255.07 | 3,691,412.65 |

(2) 衍生品交易

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|---------------------|----------------|---------------|
| 国泰君安证券股份有限公司 | 利率互换投资收益 / 公允价值变动损益 | -9,966,021.96 | 2,261,880.46 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 场外期权投资收益 / 公允价值变动损益 | -3,487,049.33 | 11,217,507.23 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 信用风险缓释工具 | -33,759.71 | |
| 合计 | | -13,486,831.00 | 13,479,387.69 |

(3) 债券销售、分销业务

单位：万元

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|-----------------|-----------------|--------------|------------|
| 华润深国投公司 | 分销本公司承销的债券规模 | 1,096,900.00 | 135,300.00 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 分销本公司承销的债券规模 | 400,100.00 | 100,000.00 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 分销本公司承销的债券规模 | 210,700.00 | 168,000.00 |
| 四川银行股份有限公司 | 分销本公司承销的债券规模 | 26,000.00 | |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 分销本公司承销的债券规模 | 9,000.00 | |
| 南方基金管理股份有限公司 | 认购本公司发行的债券规模 | 412,000.00 | 159,000.00 |
| 深圳市地铁集团有限公司 | 认购关联方作为发行人发行的债券 | 36,000.00 | |
| 深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司 | 认购关联方作为发行人发行的债券 | 20,000.00 | 14,000.00 |

| 关联方 | 关联交易内容 | 本期数 | 上年同期数 |
|--------------|-----------------|--------------|------------|
| 华润深国投公司 | 认购本公司发行的债券规模 | 7,000.00 | 11,000.00 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 认购关联方作为发行人发行的债券 | 6,000.60 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 本公司认购关联方承销的债券规模 | 530,645.73 | 31,000.00 |
| 华润深国投公司 | 本公司认购关联方承销的债券规模 | 800.00 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 本公司分销关联方承销的债券规模 | 2,000.00 | 229,500.00 |
| 红塔证券股份有限公司 | 分销本公司承销的债券规模 | | 9,000.00 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 认购本公司承销的资产支持证券 | | 21,000.00 |
| 华润深国投公司 | 认购本公司承销的资产支持证券 | | 8,900.00 |
| 合计 | | 2,757,146.33 | 886,700.00 |

(4) 持有关联方发行的产品或债券

| 关联方 | 期末数 / 本期数 | | |
|--------------|------------------|------------------|-----------------|
| | 份额 / 数量 | 市值 | 投资收益 / 公允价值变动损益 |
| 鹏华基金公司 | 2,337,717,102.22 | 2,452,431,177.73 | 16,470,967.15 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 1,567,210,198.75 | 2,187,669,219.60 | -11,511,356.08 |
| 合计 | 3,904,927,300.97 | 4,640,100,397.33 | 4,959,611.07 |

(续上表)

| 关联方 | 期初数 / 上年同期数 | | |
|--------------|------------------|------------------|-----------------|
| | 份额 / 数量 | 市值 | 投资收益 / 公允价值变动损益 |
| 鹏华基金公司 | 1,321,148,924.62 | 1,467,141,826.37 | 72,619,665.84 |
| 南方基金管理股份有限公司 | 2,471,508,079.20 | 3,511,360,357.36 | 1,090,316.76 |
| 合计 | 3,792,657,003.82 | 4,978,502,183.73 | 73,709,982.60 |

(5) 共同投资

1) 2022年, 本公司之子公司国信资本公司与深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)(以下简称国信亿合基金)分别出资70,000,000.00元、40,000,000.00元共同投资爱朵护理(浙江)股份有限公司(以下简称爱朵护理公司)。截至2022年12月31日, 爱朵护理公司注册资本252,500,000.00元, 国信资本公司与国信亿合基金持有的股份数分别为4,108,598股、2,347,636股。

2) 2023年, 本公司之子公司国信资本公司与张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)(以下简称张家港母基金)分别出资48,993,200.00元、49,989,600.00元共同投资设立张家港博佳翼开创业投资合伙企业(有限合伙), 认缴出资比例分别为22.59%、23.05%, 基金管理人为北京博佳私募基金管理有限公司。根据《张家港博佳翼开创业投资合伙企业(有限合伙)合伙协议》及其补充协议, 截至2023年12月31日, 国信资本公司与张家港母基金实缴出资总额分别为48,993,200.00元、49,989,600.00元。

(三) 关联方应收应付款项

1. 应收关联方款项

| 项目名称 | 关联方 | 期末数 | | 期初数 | |
|-------|-------------------------------|---------------|------|---------------|------|
| | | 账面余额 | 坏账准备 | 账面余额 | 坏账准备 |
| 应收款项 | 张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙) | 46,415,239.72 | | 36,215,239.72 | |
| 应收款项 | 鹏华基金公司 | 11,663,742.50 | | 28,377,916.87 | |
| 应收款项 | 深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙) | 5,773,662.16 | | | |
| 应收款项 | 深圳投控公司 | 2,380,000.00 | | | |
| 应收款项 | 深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业(有限合伙) | 2,233,707.07 | | | |
| 应收款项 | 深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 2,146,542.79 | | 2,146,542.79 | |
| 应收款项 | 南方基金管理股份有限公司 | 644,133.67 | | 1,280,335.07 | |
| 应收款项 | 深圳市明达资产管理有限公司 | 625,392.54 | | | |
| 应收款项 | 深圳市鹏鹞弘盛绿色产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 378,082.19 | | | |
| 应收款项 | 华润深国投公司 | 203,859.81 | | 168,417.57 | |
| 应收款项 | 宿迁市国信远东数字经济产业投资基金合伙企业(有限合伙) | 152,876.71 | | | |
| 应收款项 | 深圳市弘盛宝龙新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 142,465.75 | | | |
| 应收款项 | 深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 38,728.77 | | 3,747.95 | |
| 小计 | | 72,798,433.68 | | 68,192,199.97 | |
| 其他应收款 | 深圳市地铁集团有限公司 | 283,294.08 | | 283,294.08 | |
| 其他应收款 | 南方基金管理股份有限公司 | | | 500,000.00 | |
| 小计 | | 283,294.08 | | 783,294.08 | |
| 融出资金 | 关联自然人 | 227,133.06 | | | |
| 小计 | | 227,133.06 | | | |
| 合计 | | 73,308,860.82 | | 68,975,494.05 | |

2. 应付关联方款项

| 项目名称 | 关联方 | 期末数 | 期初数 |
|----------|---------------------|------------------|------------------|
| 卖出回购金融资产 | 华润深国投公司 | 1,193,308,323.29 | 851,135,194.52 |
| 卖出回购金融资产 | 国泰君安证券股份有限公司 | 1,001,836,164.38 | 796,778,592.58 |
| 卖出回购金融资产 | 南方基金管理股份有限公司 | 100,180,273.97 | 992,733,622.03 |
| 小计 | | 2,295,324,761.64 | 2,640,647,409.13 |
| 应付款项 | 深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙) | 5,773,662.16 | 5,773,662.16 |
| 应付款项 | 鹏华基金公司 | 1,073,013.84 | 597,670.92 |
| 应付款项 | 南方基金管理股份有限公司 | 113,579.35 | |
| 小计 | | 6,960,255.35 | 6,371,333.08 |
| 合计 | | 2,302,285,016.99 | 2,647,018,742.21 |

十二、或有事项

截至 2023 年 12 月 31 日，本公司作为被告涉诉金额较大的未决诉讼、未决仲裁如下：

1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2018 年 10 月起，成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称华泽钴镍）部分投资者分别向成都市中级人民法院（以下简称成都中院）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。成都中院于 2019 年 8 月 1 日起一审开庭审理，公司于 2020 年 1 月起收到部分案件一审判决后提起上诉。四川省高级人民法院（以下简称四川高院）于 2020 年 7 月 7 日对 3 起示范案件二审开庭审理，公司于 2021 年 4 月收到四川高院对 3 起示范案件的二审判决，二审对揭露日等相关认定作出改判，其中，1 起案件判决公司等对华泽钴镍赔付义务 0.33 万元承担连带赔偿责任，2 起案件判决驳回原告诉讼请求。2021 年 12 月 27 日，公司收到最高人民法院驳回 3 名原告再审申请的裁定。依照终审判决的标准，成都中院、四川高院陆续作出 1,737 起生效判决，要求华泽钴镍相关人员、公司等中介机构对华泽钴镍赔付义务合计 12,838.46 万元及相关诉讼费承担连带赔偿责任；公司另收到部分案件撤诉裁定。目前有 4 起案件尚未结案。2022 年 3 月起，公司收到成都中院及其指定法院对相关案件的执行通知，公司目前已支付合计 13,419.34 万元。

2. 公司与刘某等 2 人基金合同纠纷案

2018 年 6 月，委托人刘某等 2 人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称天和盈泰）、基金托管人国信证券签订了《天和盈泰山一号私募投资基金合同》，刘某等 2 人出资认购了该基金份额。2019 年 12 月，刘某等 2 人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计 2,204 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于 2023 年 7 月 25 日重新开庭审理，截至目前尚未裁决。

3. 亿阳信通投资者与亿阳信通及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年1月起，亿阳信通股份有限公司（以下简称亿阳信通）部分投资者分别向北京金融法院、哈尔滨市中级人民法院对亿阳信通及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求亿阳信通赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求亿阳信通相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至目前，公司共收到案件186起，涉诉金额合计4,910.63万元。目前案件尚未一审开庭。

4. 柏堡龙投资者与柏堡龙及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年6月起，广东柏堡龙股份有限公司（以下简称柏堡龙）部分投资者分别向广州市中级人民法院对柏堡龙及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求柏堡龙赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求柏堡龙相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至目前，公司共收到案件642起，涉诉金额合计23,532.49万元。2023年3月21日，广州中院对部分案件开庭审理。2023年4月21日起，公司收到广州中院对501起案件的一审判决，均认定公司不承担责任。2023年11月14日，广东省高级人民法院对4起案件进行二审开庭审理，目前尚未作出二审判决。

5. 公司与万某等8人、浙江新三板资产管理有限公司基金合同纠纷案

2017年2月，公司为“方际六号并购私募股权投资基金”提供托管服务。2022年10月，公司收到深圳国际仲裁院案件材料，该产品8名投资人为案件申请人，被申请人分别为基金管理人浙江新三板资产管理有限公司及基金托管人国信证券。申请人认为基金未按约定投资并因基金管理人挪用而实际损失，基金托管人未履行托管人职责，仲裁请求浙江新三板资产管理有限公司及国信证券连带赔偿各项损失1,375.02万元。2024年3月29日，深圳国际仲裁院就系列作出裁决书，裁决基金管理人赔偿投资人投资损失共计1,090万元并承担案件仲裁费，驳回投资人其他仲裁请求。

6. 国信弘盛与中山广银基金合同纠纷案

中山广银投资有限公司（以下简称中山广银）系国信弘盛旗下弘盛基金有限合伙人，在基金后续运作过程中，中山广银与国信弘盛及相关方因基金投资收益分配等事项产生纠纷。2023年5月5日，中山广银向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求弘盛基金向其支付相关投资收益、弘盛基金GP及管理人向其支付违约金等，合计申请金额2,250.26万元。2023年7月31日，国信弘盛收到深圳国际仲裁院的仲裁通知。后经多方协商，中山广银与国信弘盛相关方达成和解，并于2023年12月28日签署《和解协议》。2024年1月8日、9日，国信弘盛、中山广银分别申请撤案。2024年1月11日，深圳国际仲裁院出具《撤案决定书》，裁定撤销本案。

十三、资产负债表日后事项

(一) 资产负债表日后利润分配情况

| | |
|-----------------|--|
| 拟分配的利润或股利 | 以 2023 年末总股本 9,612,429,377 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 2.70 元（含税） |
| 经审议批准宣告发放的利润或股利 | 尚需提交股东大会审议 |

(二) 重要的非调整事项

| 序号 | 日期 | 事项说明 |
|----|-----------------|--|
| 1 | 2024 年 1 月 9 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第一期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP001，实际发行规模 2,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.55%，期限为 365 天。 |
| 2 | 2024 年 1 月 17 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第二期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP002，实际发行规模 2,900,000,000.00 元人民币，票面利率 2.48%，期限为 330 天。 |
| 3 | 2024 年 1 月 19 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）发行结束，债券简称 24 国证 01，实际发行规模 2,800,000,000.00 元人民币，票面利率 2.75%，期限为 3 年。 |
| 4 | 2024 年 1 月 29 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）发行结束，分两个品种，品种一债券简称 24 国证 02，实际发行规模 1,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.65%，期限为 2 年；品种二债券简称 24 国证 03，实际发行规模 2,400,000,000.00 元人民币，票面利率 2.85%，期限为 5 年。 |
| 5 | 2024 年 2 月 1 日 | 国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）兑付合计人民币 2,072,800,000.00 元。 |
| 6 | 2024 年 2 月 5 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第三期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP003，实际发行规模 2,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.45%，期限为 347 天。 |
| 7 | 2024 年 2 月 21 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年度第二十期短期融资券兑付合计人民币 1,512,737,704.92 元。 |
| 8 | 2024 年 2 月 27 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年度第十六期短期融资券兑付合计人民币 3,031,936,065.57 元。 |
| 9 | 2024 年 3 月 8 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年度第十五期短期融资券兑付合计人民币 2,022,874,316.94 元。 |
| 10 | 2024 年 3 月 11 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第四期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP004，实际发行规模 2,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.29%，期限为 365 天。 |
| 11 | 2024 年 3 月 15 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第五期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP005，实际发行规模 2,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.33%，期限为 343 天。 |
| 12 | 2024 年 3 月 15 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年度第二十八期短期融资券兑付合计人民币 2,014,483,606.56 元。 |
| 13 | 2024 年 3 月 25 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第六期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP006，实际发行规模 2,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.32%，期限为 337 天。 |
| 14 | 2024 年 3 月 28 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年度第七期短期融资券兑付合计人民币 2,054,450,819.67 元。 |
| 15 | 2024 年 4 月 10 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第七期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP007，实际发行规模 3,000,000,000.00 元人民币，票面利率 2.25%，期限为 365 天。 |
| 16 | 2024 年 4 月 11 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）兑付合计人民币 3,080,700,000.00 元。 |
| 17 | 2024 年 4 月 16 日 | 国信证券股份有限公司 2023 年度第二十三期短期融资券兑付合计人民币 4,044,890,710.38 元。 |
| 18 | 2024 年 4 月 16 日 | 国信证券股份有限公司 2024 年度第八期短期融资券发行结束，债券简称 24 国信证券 CP008，实际发行规模 2,500,000,000.00 元人民币，票面利率 2.14%，期限为 365 天。 |

十四、其他重要事项

(一) 年金计划

本公司依据相关政策建立了企业年金计划，按照参与企业年金职工当年度工资总额及规定的计提比例确定企业年金缴费总额，并为符合年金方案条件的员工缴纳企业年金。

本公司企业年金计划于 2012 年 12 月正式成立。该年金计划受托管理人和账户管理人为泰康养老保险股份有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司，投资管理人为泰康资产管理有限责任公司。

根据本公司与泰康养老保险股份有限公司签订的《企业年金计划受托管理合同》，在合同存续期内，受托人根据法律法规规定制定企业年金基金投资政策。

(二) 分部信息

1. 本公司确定报告分部考虑的因素

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定业务分部，划分为 5 个业务分部：经纪及财富管理业务分部；投资银行业务分部；投资与交易业务分部；资产管理业务分部；其他分部。每个业务分部为单独的业务分部，提供不同的劳务。本公司的管理层定期审阅这些分部的经营成果，以决定向其配置资源。本公司各个业务分部提供的主要服务分别如下：

(1) 财富管理与机构业务分部，主要包括：向个人及机构投资者提供证券经纪、期货经纪、代销金融产品、资产托管、投资咨询、融资融券及其他资本中介等服务；

(2) 投资银行业务分部，主要包括：为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组、新三板推荐等金融服务；

(3) 投资与交易业务分部，主要包括：从事权益类、固定收益类、另类投资类、衍生类产品及其他金融产品的交易和做市业务；

(4) 资产管理业务分部，主要包括：根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务以及基金管理业务等；

(5) 其他分部，主要包括：以上分部业务之外的其他业务以及公司总部运营。

2. 各报告分部利润（亏损）、资产及负债信息

(1) 2023 年度

| 项目 | 财富管理与机构业务 | 投资银行 | 投资与交易 | 资产管理 | 其他 | 合并数 |
|-----------|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|-------------------|
| 1) 营业收入 | 7,468,111,375.13 | 1,419,383,390.73 | 5,331,183,728.41 | 530,738,186.01 | 2,567,451,837.08 | 17,316,868,517.36 |
| 手续费及佣金净收入 | 4,546,883,424.23 | 1,403,857,814.57 | | 519,966,070.63 | | 6,470,707,309.43 |
| 投资收益（损失） | | | 4,957,959,119.06 | | 369,431,013.56 | 5,327,390,132.62 |
| 其他收入 | 2,921,227,950.90 | 15,525,576.16 | 373,224,609.35 | 10,772,115.38 | 2,198,020,823.52 | 5,518,771,075.31 |
| 2) 营业支出 | 4,475,434,567.07 | 1,177,451,045.46 | 701,582,652.86 | 267,782,949.70 | 3,847,855,441.45 | 10,470,106,656.54 |
| 业务及管理费 | 4,127,387,779.96 | 1,167,509,307.85 | 588,136,590.13 | 263,813,934.05 | 1,376,057,651.14 | 7,522,905,263.13 |

| 项目 | 财富管理与机构业务 | 投资银行 | 投资与交易 | 资产管理 | 其他 | 合并数 |
|-----------|--------------------|------------------|--------------------|----------------|-------------------|--------------------|
| 3) 营业利润 | 2,992,676,808.06 | 241,932,345.27 | 4,629,601,075.55 | 262,955,236.31 | -1,280,403,604.37 | 6,846,761,860.82 |
| 4) 利润总额 | 3,027,298,892.01 | 224,655,411.14 | 4,629,538,945.65 | 262,955,236.31 | -1,289,292,120.47 | 6,855,156,364.64 |
| 5) 资产总额 | 142,003,681,581.41 | 1,103,634,700.00 | 309,407,480,382.43 | 576,088,623.13 | 9,869,284,546.40 | 462,960,169,833.37 |
| 递延所得税资产 | | | | | | 2,809,850,388.55 |
| 6) 负债总额 | 130,558,983,574.42 | 809,595,599.13 | 215,594,368,956.78 | 204,000,694.68 | 5,333,696,906.95 | 352,500,645,731.96 |
| 递延所得税负债 | | | | | | 1,012,003,741.67 |
| 7) 补充信息 | | | | | | |
| ①折旧与摊销费用 | 317,821,186.94 | 42,808,820.15 | 18,227,888.13 | 7,636,490.04 | 286,100,087.74 | 672,594,473.00 |
| ②资本性支出 | 116,847,461.91 | 3,845,323.60 | 15,044,213.33 | 14,682,882.88 | 217,913,174.30 | 368,333,056.02 |
| ③信用减值损失 | 275,870,664.65 | | 85,209,869.61 | | 496,042.50 | 361,576,576.76 |
| ④其他资产减值损失 | | | | | | |

(2) 2022 年度

| 项目 | 财富管理与机构业务 | 投资银行 | 投资与交易 | 资产管理 | 其他 | 合并数 |
|-----------|--------------------|------------------|--------------------|----------------|------------------|--------------------|
| 1) 营业收入 | 8,300,348,928.74 | 1,881,855,680.10 | 2,746,734,038.64 | 365,436,789.54 | 2,581,392,824.83 | 15,875,768,261.85 |
| 手续费及佣金净收入 | 5,347,909,434.69 | 1,871,641,268.69 | | 361,313,232.14 | -3,604,295.10 | 7,577,259,640.42 |
| 投资收益(损失) | | | 6,777,397,965.21 | | 494,810,235.12 | 7,272,208,200.33 |
| 其他收入 | 2,952,439,494.05 | 10,214,411.41 | -4,030,663,926.57 | 4,123,557.40 | 2,090,186,884.81 | 1,026,300,421.10 |
| 2) 营业支出 | 4,412,676,808.28 | 1,231,659,789.16 | 774,423,234.10 | 180,533,299.15 | 3,181,389,748.25 | 9,780,682,878.94 |
| 业务及管理费 | 4,311,219,771.94 | 1,218,413,075.26 | 508,828,999.36 | 177,947,318.04 | 1,101,031,522.61 | 7,317,440,687.21 |
| 3) 营业利润 | 3,887,672,120.46 | 650,195,890.94 | 1,972,310,804.54 | 184,903,490.39 | -599,996,923.42 | 6,095,085,382.91 |
| 4) 利润总额 | 3,981,918,443.24 | 646,743,173.86 | 1,971,988,757.76 | 184,903,490.39 | -563,388,600.91 | 6,222,165,264.34 |
| 5) 资产总额 | 141,910,959,752.19 | 1,486,653,216.38 | 242,515,551,899.50 | 804,218,611.62 | 7,613,395,451.86 | 394,330,778,931.55 |
| 递延所得税资产 | | | | | | 2,848,152,868.05 |
| 6) 负债总额 | 131,955,432,117.83 | 818,554,049.74 | 148,643,720,610.84 | 201,653,009.26 | 5,826,386,740.91 | 287,445,746,528.58 |
| 递延所得税负债 | | | | | | 390,274,752.92 |
| 7) 补充信息 | | | | | | |
| ①折旧与摊销费用 | 314,361,517.56 | 46,757,367.18 | 15,049,734.02 | 7,317,029.00 | 233,807,361.17 | 617,293,008.93 |
| ②资本性支出 | 131,232,461.77 | 6,198,498.87 | 2,939,598.23 | 3,853,456.46 | 290,906,362.60 | 435,130,377.93 |
| ③信用减值损失 | 32,071,711.16 | | 225,556,485.63 | | -6,782,757.55 | 250,845,439.24 |
| ④其他资产减值损失 | | | | | 2,191,066.98 | 2,191,066.98 |

(三) 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

1. 出具告慰函

本公司于 2015 年 9 月 29 日就国信香港公司融资事项向大新银行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司 100% 的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会大新银行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对大新银行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对大新银行应尽义务的行动，对将影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会大新银行；本公司和国信香港公司将向大新银行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供大新银行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对大新银行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于 2019 年 8 月就国信香港公司的融资事项向上海银行（香港）出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港 100% 股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港按照银行的要求及时履行并偿付相关债务。安慰函将一直维持有效，直至国信香港在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之

日（以较后发生者为准）失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及 / 或担保的责任。

本公司于 2020 年 7 月就国信香港公司的融资事项向南洋商业银行有限公司出具了承诺函，主要内容为国信证券继续直接或间接地拥有及持有国信香港的全部股份，并且维持对国信香港的最终管理控制权；就合理认为会影响国信香港持续性经营的情况实时通知银行，并督促国信香港履行还款责任。函件内容不构成对授信额度的偿还及 / 或担保的责任。

本公司于 2020 年 10 月就国信香港公司的融资事项向招商永隆银行有限公司出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港 100% 股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港公司按照银行的要求及时履行并偿付相关债务；安慰函将一直维持有效，直至国信香港公司在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效；函件内容不构成对授信额度的偿还及 / 或担保的责任。

本公司于 2021 年 10 月就国信香港公司融资事项向渣打银行（香港）有限公司出具告慰函，本公司确认知晓渣打银行（香港）有限公司、其关联方（包括总行及分行）（合称银行）现时提供予本公司之一个或多个子公司（子公司）以及将来会提供予子公司的一切融资，且本公司知晓子公司与银行会在现时以及将来进行外汇交易和金融衍生产品交易（交易），本公司确认该等安排符合本公司批准程序，并且鉴于银行提供和 / 或继续提供前述融资、给与子公司任何信贷或其他融资、或进行和 / 或继续进行交易或其他交易，本公司向银行保证，不允许子公司在完全清偿其对银行之负债、或履行其对银行之义务之前，进行清算（无论自愿清算或强制清算）或与其债权人达成任何债务重组协议或安排。子公司将作为一项持续经营始终存续。本公司确认，本告慰函将适用于银行今后可能向子公司提供之全新的或额外新增的任何融资或交易。本公司确认，本公司将尽最大努力督促子公司及时偿还其在一切融资和交易项下的债务。本公司亦确认，在未收到银行书面同意或确保子公司对银行之负债完全清偿或确保履行其对银行之义务前，不得处置任何本公司持有的子公司股权以致导致本公司持有的子公司股权减为少数及非控股之股权。本函适用于香港特别行政区法律。

本公司于 2022 年 3 月就国信证券（香港）经纪有限公司融资事项向中国信托商业银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信证券（香港）经纪有限公司 100% 的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会中国信托商业银行香港分行；本公司将关注国信证券（香港）经纪有限公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对中国信托商业银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信证券（香港）经纪有限公司无法经营或无法履行对中国信托商业银行香港分行应尽义务的行动，对将影响国信证券（香港）经纪有限公司持续经营的情况，本公司将知会中国信托商业银行香港分行；本公司和国信证券（香港）经纪有限公司将向中国信托商业银行香港分行提供经审计的财务报表，国信证券（香港）经纪有限公司还将在合理情况下提供中国信托商业银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信证券（香港）经纪有限公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信证券（香港）经纪有限公司履行对中国信托商业银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于 2022 年 3 月就国信证券（香港）经纪有限公司的融资事项向中国民生银行香港分行出具安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港 100% 股本权益及控制权；国信香港的股权发生任何重大变化，本公司将即时通知银行；本公司将促使并监督国信香港按照银行的要求即时履行并偿付所有欠付的债务；本公司将督促国信香港业务运作正常，将尽力向国信香港提供所需的支持及协助，并促使国信香港在任何情况下都能拥有健全的财务状况以承担并偿付所有债务；本公司和国信香港公司将向银行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供银行所要求的其它财务资料；本公司不会做出任何影响国信香港运营之行为或任何导致国信香港无法履行其偿付欠付债务的义务之行为或允许该等行为发生，本公司承诺于得知发生任何影响国信香港运营之情形时及时通知银行。安慰函将一直维持有效，直至国信香港在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及 / 或担保的责任。

本公司于2023年2月就国信香港公司融资事项向中信银行（国际）出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会银行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对银行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对银行应尽义务的行动，将对影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会银行；本公司和国信香港公司将向银行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供银行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对银行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于2023年5月就国信香港公司融资事项向浙商银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会浙商银行香港分行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对浙商银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对浙商银行香港分行应尽义务的行动，将对影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会浙商银行香港分行；本公司和国信香港公司将向浙商银行香港分行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供浙商银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对浙商银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

2. 国信香港公司为全资子公司提供担保

截至2023年12月31日，国信香港公司为其全资子公司的常规业务提供的担保金额计港币20,000万元。

3. 债券借贷

| 债券类别 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|-------|-------------------|-------------------|
| 国债 | 26,257,545,720.00 | 13,245,537,200.00 |
| 地方政府债 | 1,566,870,380.00 | 2,453,548,870.00 |
| 金融债 | 11,559,986,290.00 | 4,148,808,940.00 |
| 合计 | 39,384,402,390.00 | 19,847,895,010.00 |

注：本公司通过借入方式取得的债券为卖出回购业务而设定质押的期末公允价值计人民币36,934,873,216.00元，用于期货业务充抵保证金而设定质押的期末公允价值计人民币980,370,864.00元，用于出售的期末公允价值计人民币756,206,789.48元

十五、其他补充资料

(一) 非经常性损益

| 项目 | 金额 | 说明 |
|--|----------------|----|
| 非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分 | 1,585,464.56 | |
| 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、按照确定的标准享有、对公司损益产生持续影响的政府补助除外 | 62,789,242.83 | |
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，非金融企业持有金融资产和金融负债产生的公允价值变动损益以及处置金融资产和金融负债产生的损益 | | |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费 | | |
| 委托他人投资或管理资产的损益 | | |
| 对外委托贷款取得的损益 | | |
| 因不可抗力因素，如遭受自然灾害而产生的各项资产损失 | | |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回 | 806,666.32 | |
| 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 | | |
| 同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益 | | |
| 非货币性资产交换损益 | | |
| 债务重组损益 | | |
| 企业因相关经营活动不再持续而发生的一次性费用，如安置职工的支出等 | | |
| 因税收、会计等法律、法规的调整对当期损益产生的一次性影响 | | |
| 因取消、修改股权激励计划一次性确认的股份支付费用 | | |
| 对于现金结算的股份支付，在可行权日之后，应付职工薪酬的公允价值变动产生的损益 | | |
| 采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益 | | |
| 交易价格显失公允的交易产生的收益 | | |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益 | -18,230,377.85 | |
| 受托经营取得的托管费收入 | | |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | -12,236,818.33 | |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目 | | |
| 小计 | 34,714,177.53 | |
| 减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示） | 8,685,681.73 | |
| 少数股东权益影响额（税后） | | |
| 归属于母公司所有者的非经常性损益净额 | 26,028,495.80 | |

(二) 净资产收益率及每股收益

1. 明细情况

| 报告期利润 | 加权平均净资产收益率 (%) | 每股收益 (元 / 股) | |
|-------------------------|----------------|--------------|--------|
| | | 基本每股收益 | 稀释每股收益 |
| 归属于公司普通股股东的净利润 | 6.57 | 0.54 | 0.54 |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 6.53 | 0.53 | 0.53 |

2. 加权平均净资产收益率的计算过程

| 项目 | 序号 | 本期数 |
|-------------------------------|---|-------------------|
| 归属于母公司所有者的净利润 | | 6,427,294,103.14 |
| 扣除：其他权益工具股息影响 | | 1,276,500,000.00 |
| 归属于公司普通股股东的净利润 | A | 5,150,794,103.14 |
| 非经常性损益 | B | 26,028,495.80 |
| 扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润 | C=A-B | 5,124,765,607.34 |
| 归属于公司普通股股东的期初净资产 | D | 76,655,805,005.70 |
| 回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产 | E | 2,595,355,931.79 |
| 减少净资产次月起至报告期期末的累计月数 | F | 6 |
| 其他综合收益、资本公积新增的、归属于公司普通股股东的净资产 | G | 1,019,053,527.09 |
| 增减净资产次月起至报告期期末的累计月数 | H | 6 |
| 报告期月份数 | I | 12 |
| 加权平均净资产 | $J=D+A/2-E \times F/I \pm G \times H/I$ | 78,443,050,854.92 |
| 加权平均净资产收益率 | $K=A/J$ | 6.57% |
| 扣除非经常损益加权平均净资产收益率 | $L=C/J$ | 6.53% |

3. 基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

| 项目 | 序号 | 本期数 |
|--------------------------|-------|------------------|
| 归属于母公司所有者的净利润 | | 6,427,294,103.14 |
| 扣除：其他权益工具股息影响 | | 1,276,500,000.00 |
| 归属于公司普通股股东的净利润 | A | 5,150,794,103.14 |
| 非经常性损益 | B | 26,028,495.80 |
| 扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润 | C=A-B | 5,124,765,607.34 |
| 发行在外的普通股加权平均数 | D | 9,612,429,377.00 |
| 基本每股收益 | E=A/D | 0.54 |
| 扣除非经常损益基本每股收益 | F=C/D | 0.53 |

注：稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同

11

第十一节

证券公司信息披露



一、报告期内公司重大行政许可事项的相关情况

| 序号 | 发文日期 | 批复文件 | 文号 |
|----|------------|-----------------------------------|-----------------|
| 1 | 2023年11月7日 | 中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》 | 证监许可[2023]2512号 |

国信证券股份有限公司

法定代表人：张纳沙

董事会批准报送日期：2024年4月16日



国信证券股份有限公司
GUOSEN SECURITIES CO.,LTD.

官方网站：www.guosen.com.cn

客服热线：**95536**

地 址：广东省深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦



国信证券官方微信

封面及内文用纸
使用环保认证纸张印刷

