

公司代码：601555

公司简称：东吴证券

# 东吴证券股份有限公司 2020 年年度报告

## 重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人范力、主管会计工作负责人袁维静及会计机构负责人（会计主管人员）王菁声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

### 五、经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

以公司实施分配方案时股权登记日在册的全体股东所持股份数为基数（扣除公司回购专户持有的本公司股份后的股份数）拟向全体股东每 10 股派送现金红利 1.57 元（含税），以公司现有扣除回购股份后的股本 3,838,817,394 股计算，共派送现金红利 602,694,330.86 元，占当年母公司可供股东现金分配的利润比例为 56.99%，占当年合并报表中归属于母公司所有者的净利润比例为 35.30%。本次分配后，母公司剩余未分配利润 2,883,062,962.65 元，转入下一年度。

### 六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告中所涉及的未来计划等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请投资者注意投资风险。

### 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

### 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

### 九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露年度报告的真实性、准确性和完整性

否

### 十、重大风险提示

公司主营业务与国内宏观经济环境、资本市场走势高度相关，经济金融政策变化和资本市场的波动都将对公司经营业绩产生重大影响。

公司已在本报告中详细描述在日常经营活动中可能面临的风险，本公司面临的重大风险主要包括政策风险、市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、声誉风险等。敬请查阅本报告第四节中可能面对的风险及应对措施。

## 十一、其他

适用 不适用

## 目录

第一节	释义.....	5
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	公司业务概要.....	17
第四节	经营情况讨论与分析.....	20
第五节	重要事项.....	43
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	65
第七节	优先股相关情况.....	73
第八节	董事、监事、高级管理人员和员工情况.....	74
第九节	公司治理.....	84
第十节	公司债券相关情况.....	90
第十一节	财务报告.....	95
第十二节	备查文件目录.....	236
第十三节	证券公司信息披露.....	236

## 第一节 释义

### 一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
东吴证券/本公司/公司	指	东吴证券股份有限公司
苏州证券/苏州证券公司	指	苏州证券有限责任公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
江苏证监局	指	中国证券监督管理委员会江苏监管局
国发集团	指	苏州国际发展集团有限公司
《章程》	指	《东吴证券股份有限公司章程》
上交所	指	上海证券交易所
东吴创投	指	东吴创业投资有限公司
东吴创新资本	指	东吴创新资本管理有限责任公司
东吴期货	指	东吴期货有限公司
东吴基金	指	东吴基金管理有限公司
东吴新加坡	指	东吴证券中新（新加坡）有限公司
东吴香港	指	东吴证券（香港）金融控股有限公司
元	指	人民币元

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、 公司信息

公司的中文名称	东吴证券股份有限公司
公司的中文简称	东吴证券
公司的外文名称	SoochowSecuritiesCo., Ltd.
公司的外文名称缩写	SCS
公司的法定代表人	范力
公司总经理	范力

公司注册资本和净资本

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	3,880,518,908	3,000,000,000
净资本	19,590,074,763.47	14,782,210,610.56

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

公司各主要单项业务资格情况详见附录。

## 二、 联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	冯恂	平磊
联系地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号	江苏省苏州工业园区星阳街5号
电话	0512-62601555	0512-62601555
传真	0512-62938812	0512-62938812
电子信箱	fengx@dwzq.com.cn	pingl@dwzq.com.cn

## 三、 基本情况简介

公司注册地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号
公司注册地址的邮政编码	215021
公司办公地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号
公司办公地址的邮政编码	215021
公司网址	www.dwzq.com.cn
电子信箱	dwzqdb@dwzq.com.cn

## 四、 信息披露及备置地点

公司选定的信息披露媒体名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.sse.com.cn
公司年度报告备置地点	江苏省苏州工业园区星阳街5号公司董事会办公室

## 五、 公司股票简况

公司股票简况			
股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码
A股	上海证券交易所	东吴证券	601555

## 六、 公司其他情况

### （一）公司历史沿革的情况，主要包括以前年度经历的改制重组、增资扩股等情况

√适用 □不适用

东吴证券股份有限公司系由东吴证券有限责任公司整体变更设立，东吴证券有限责任公司的前身为苏州证券公司。1992年9月4日，中国人民银行以“银复[1992]361号”文批准设立苏州证券公司。1993年4月10日，苏州证券公司取得了苏州市工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》，注册号为13772051-9，注册资金3,000万元。

1997年2月14日，中国人民银行以“非银证[1997]11号”文同意苏州证券公司与中国人民银行脱钩改制并增资扩股；公司名称变更为“苏州证券有限责任公司”，注册资本增至10,400万元。1998年4月16日，公司完成了工商变更登记手续，注册号变更为3205001103389。

2001年12月18日，中国证监会以“证监机构字[2001]308号”文核准苏州证券有限责任公司增资扩股至10亿元，并更名为“东吴证券有限责任公司”。2002年4月12日，公司完成了工商变更登记手续。

2008年6月23日，中国证监会以“证监许可[2008]831号”文核准东吴证券有限责任公司增资扩股至15亿元。2008年8月8日，公司完成了工商变更登记手续，注册号变更为32050000004432。

2010年3月17日，中国证监会以“证监许可[2010]310号”文核准东吴证券有限责任公司整体变更为东吴证券股份有限公司。2010年5月28日，公司完成了工商变更登记手续，并取得了江苏省工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》。

2011年11月23日，经中国证监会“证监许可[2011]1887号”《关于核准东吴证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》核准，公司以6.50元/股的价格首次公开发行了50,000万股A股。经上海证券交易所“上证发字[2011]48号”文核准，公司股票于2011年12月12日起上市交易。公司注册资本增加至20亿元，并于2012年2月21日完成了工商变更登记手续。

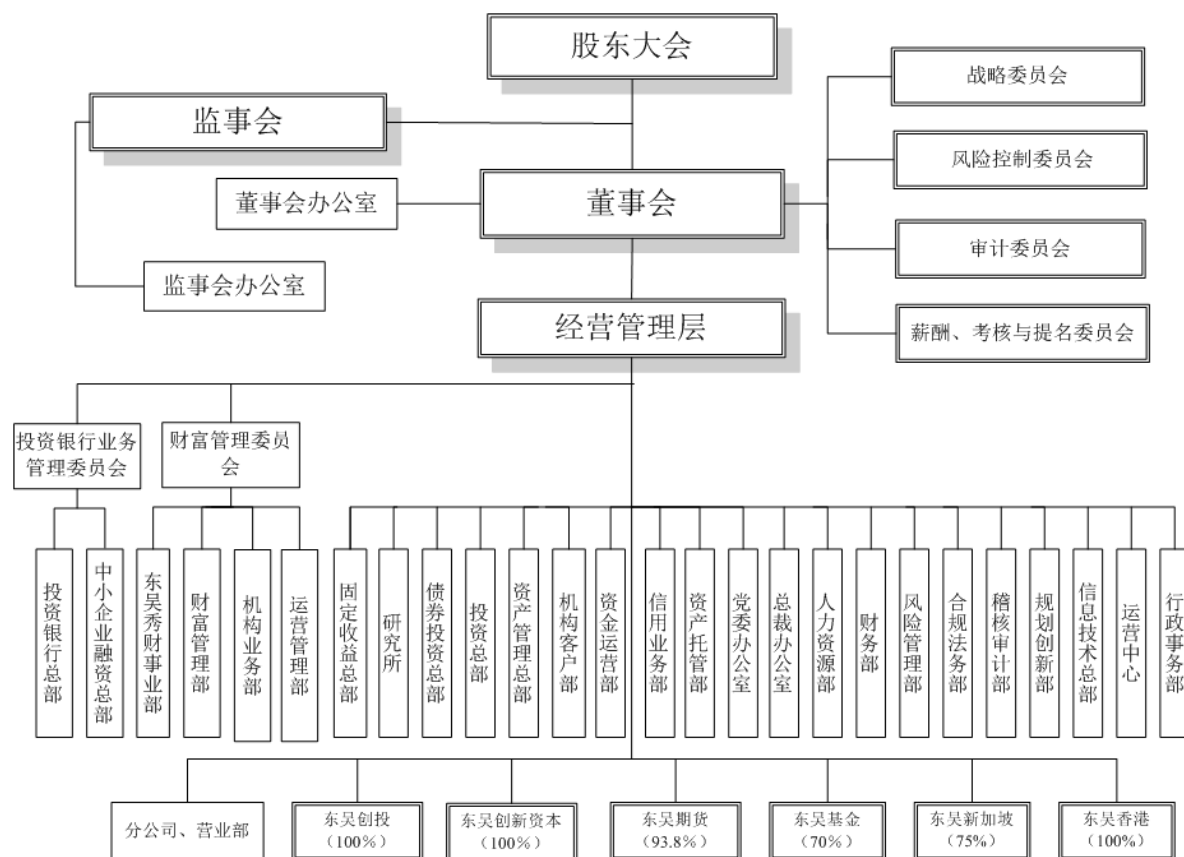
2014年2月13日，经中国证监会“证监许可[2014]200号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》核准，公司非公开发行不超过70,000万股新股。2014年8月5日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量7亿股，公司注册资本增加至27亿元，并于2014年8月12日完成了工商变更登记手续。

2015年12月23日，经中国证监会“证监许可[2015]3035号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》，核准公司非公开发行不超过3亿股（含3亿股）新股。2016年1月20日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量为3亿股，公司注册资本增加至30亿元，并于2016年2月5日完成了工商变更登记手续，统一社会信用代码为91320000137720519P。

2019年12月27日，经中国证监会“证监许可〔2019〕2984号”《关于核准东吴证券股份有限公司配股的批复》，核准公司向原股东配售股份。2020年3月，公司完成配股发行，发行数量880,518,908股，并于2020年4月8日完成了工商变更登记手续，公司注册资本增加至3,880,518,908元。

## （二）公司组织机构情况

√适用 □不适用



### (三) 公司证券营业部的数量和分布情况

√适用 □不适用

公司证券营业部的数量和分部情况详见附表。

### (四) 其他分支机构数量与分布情况

√适用 □不适用

#### 1、公司主要控股、参股公司情况

##### (1) 东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

成立时间：2004 年 9 月

注册资本：人民币 10,000 万元

持股比例：70%

法定代表人：邓晖

联系电话：021-50509888



经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。

（2）东吴期货有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 1208 号 6 楼、12 楼 ABC 座

成立时间：1993 年 3 月

注册资本：人民币 77,000 万元

持股比例：93.80%

法定代表人：汪健

联系电话：021-63123019

经营范围：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理。[依法须经审批的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动]

（3）东吴创业投资有限公司

注册地址：花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦

成立时间：2010 年 1 月

注册资本：人民币 120,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：瞿炜

联系电话：0512-62938022

经营范围：创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。

（4）东吴创新资本管理有限责任公司

注册地址：花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦

成立时间：2012 年 6 月

注册资本：人民币 500,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：成军

联系电话：0512-62938925

经营范围：另类投资业务

(5) 东吴证券中新（新加坡）有限公司

英文名称：SoochowSecuritiesCSSD(Singapore)Pte.Ltd.

注册地址：80RAFFLESPLACE, #43-01, UOBPLAZA1, SINGAPORE048624

成立时间：2015 年 8 月 28 日

注册资本：新加坡元 6,000 万元

持股比例：75%

董事长：刘辉

(6) 东吴证券（香港）金融控股有限公司

英文名称：SOOCHOWSECURITIES(HONGKONG)FINANCIALHOLDINGSLIMITED

注册地址：Level17, Three Pacific Place, No.1 Queen's Road East, Wai Chai, Hong Kong

成立时间：2016 年 6 月 27 日

注册资本：港币 12.60 亿元

持股比例：100%

董事长：刘辉

## 2、分公司情况

截至目前，公司共设立 18 家分公司，具体情况见下表：

名称	公司地址	成立日期	营运资金 (单位:万元)	负责人	联系电话
吴江分公司	江苏省吴江市中山北路 172 号	2009.6.19	2000	刘先雁	0512-63427860

昆山分公司	江苏省昆山市前进中路 269 号	2009.6.22	2000	陈正晖	0512-57312926
张家港分公司	江苏省张家港市杨舍镇新风桥东堍	2009.6.22	2000	郭淳	0512-58211473
常熟分公司	江苏省常熟市阜湖路 9 号	2009.6.23	2000	王倬	0512-52705000
太仓分公司	江苏省太仓市城厢镇上海东路 6 号	2009.6.24	2000	董伟年	0512-53593539
北京分公司	北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 1003 室	2009.7.3	2500	于颖	010-84139198
上海分公司	上海市黄浦区西藏南路 1208 号 19-20 层	2009.7.10	2000	王振亚	021-63122796
南京分公司	南京市中山南路 501 号江苏通服大厦 7 楼	2011.12.16	2000	王耀柱	025-83226660
常州分公司	常州市新北区通江中路 266 号	2013.6.26	2000	蒋幸福	0519-88153791
无锡分公司	无锡市锡山区东亭街道东亭中路 20 号晶石国际中心 1601-1603 号	2013.7.4	2000	浦江	0510-88229901
泰州分公司	江苏省泰州市海陵南路 360-6、360-7 号	2013.9.17	2000	秦国军	0523-86336333
徐州分公司	江苏省徐州市泉山区软件园 6 号徐州软件园 2 号楼 C 座 701-707 室	2013.11.4	2000	张希斌	0516-66601555
南通分公司	江苏省南通市苏通科技产业园江成路 1088 号 8 号楼 8403 室	2013.11.4	2000	王秋鸣	0513-55010310
深圳分公司	深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街 1 号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室	2013.12.9	2000	姬洪涛	0755-86561999
嘉兴分公司	嘉兴市花园路 886 号-A 室	2013.12.13	2000	虞光宇	0573-82850255
福建分公司	福建省福州市鼓楼区五四路 19 号国泰大厦三楼 A 区	2015.11.26	2000	宁文宾	0591-87502720
浙江分公司	浙江省杭州市江干区瑞晶国际商务中心 1703 室	2018.12.29	2000	杨骁	0571-86791957
宁波分公司	浙江省宁波市鄞州区福明街道民安东路 275 号三层 L3-019A 室	2020.6.18	2000	柴婉萍	0574-88008065

## 七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所（境内）	名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
	办公地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
	签字会计师姓名	赵英、莫艾琦
报告期内履行持续督导职责的保荐机构	名称	南京证券股份有限公司
	办公地址	南京市江东中路 389 号
	签字的保荐代表人姓名	王刚、李建勤
	持续督导的期间	2020.4.2-2021.12.31

## 八、近三年主要会计数据和财务指标

## (一) 主要会计数据

单位：元币种：人民币

主要会计数据	2020年	2019年	本期比上年同期增减(%)	2018年
营业收入	7,356,492,441.10	5,130,373,462.68	43.39	4,161,925,425.29
归属于母公司股东的净利润	1,707,245,952.72	1,037,174,921.82	64.61	358,411,175.29
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,703,094,171.38	1,032,012,482.47	65.03	347,381,071.69
经营活动产生的现金流量净额	-431,156,189.10	1,137,377,673.57	-137.91	7,044,696,006.62
其他综合收益	-116,130,047.08	169,670,219.59	-168.44	-554,124,810.60
	2020年末	2019年末	本期末比上年同期末增减(%)	2018年末
资产总额	105,474,550,200.92	96,234,645,048.15	9.60	84,209,078,368.51
负债总额	77,264,229,402.54	74,978,852,821.05	3.05	63,783,091,648.30
归属于母公司股东的权益	27,879,893,402.91	20,955,913,171.46	33.04	20,160,273,459.37
所有者权益总额	28,210,320,798.38	21,255,792,227.10	32.72	20,425,986,720.21

## (二) 主要财务指标

主要财务指标	2020年	2019年	本期比上年同期增减(%)	2018年
基本每股收益(元/股)	0.46	0.33	39.39	0.11
稀释每股收益(元/股)	0.46	0.33	39.39	0.11
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.46	0.32	43.75	0.11
加权平均净资产收益率(%)	6.61	5.07	增加1.54个百分点	1.75
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	6.59	5.04	增加1.55个百分点	1.70

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

√适用 □不适用

2020年3月，本公司配股方案实施完成。根据《企业会计准则第34号—每股收益》，考虑配

股中包含的送股因素，计算每股收益时已调整上表中各列报期间发行在外的普通股加权平均数。报告期和上年同期每股收益的计算过程详见财务报表附注 5.57。

### (三) 母公司的净资本及风险控制指标

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	19,590,074,763.47	14,782,210,610.56
净资产	27,346,839,994.08	20,525,688,784.19
风险覆盖率(%)	245.21	173.22
资本杠杆率(%)	21.28	16.76
流动性覆盖率(%)	261.77	215.06
净稳定资金率(%)	156.29	144.54
净资本/净资产(%)	71.64	72.02
净资本/负债(%)	41.20	31.73
净资产/负债(%)	57.51	44.06
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	29.53	35.58
自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%)	162.08	218.79
融资(含融券)的金额/净资本(%)	107.29	124.13

注：上年度末的净资本等风控指标已根据《证券公司风险控制指标计算标准规定》（证监会公告[2020]10号）相关规定进行重述。

### 九、境内外会计准则下会计数据差异

(一) 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

□适用 √不适用

(二) 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

□适用 √不适用

(三) 境内外会计准则差异的说明：

□适用 √不适用

### 十、2020 年分季度主要财务数据

单位：元币种：人民币

	第一季度 (1-3 月份)	第二季度 (4-6 月份)	第三季度 (7-9 月份)	第四季度 (10-12 月份)
营业收入	1,245,120,133.88	2,344,148,577.78	1,743,049,538.69	2,024,174,190.75
归属于上市公司股	371,541,437.90	658,994,602.46	461,206,724.40	215,503,187.96

东的净利润				
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	372,524,264.17	656,285,126.15	461,818,438.52	212,466,342.54
经营活动产生的现金流量净额	3,881,239,666.25	3,141,839,539.48	-10,587,552,877.79	3,133,317,482.96

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

#### 十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位:元币种:人民币

非经常性损益项目	2020 年金额	附注（如适用）	2019 年金额	2018 年金额
非流动资产处置损益	-3,569,948.71		-315,765.87	-4,563,055.51
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	25,467,571.65		10,993,832.49	23,383,772.25
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-26,249,358.81		-2,222,955.38	-4,732,393.44
其他符合非经常性损益定义的损益项目	11,315,257.31		555,786.50	
少数股东权益影响额	-1,268,429.42		-1,616,026.83	476,555.10
所得税影响额	-1,543,310.68		-2,232,431.56	-3,534,774.80
合计	4,151,781.34		5,162,439.35	11,030,103.60

#### 十二、采用公允价值计量的项目

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期初余额	期末余额	当期变动	对当期利润的影响金额
交易性金融资产	37,142,619,699.52	34,115,122,757.46	-3,027,496,942.06	2,156,399,896.43
交易性金	5,609,206,692.41	1,978,636,180.90	-3,630,570,511.51	-140,652,049.73

融负债				
衍生金融工具	-4,407,437.95	4,413,742.44	8,821,180.39	-15,194,265.83
其他债权投资	5,796,376,967.37	6,264,932,127.78	468,555,160.41	306,039,206.76
其他权益工具投资	4,372,178,679.85	3,843,359,653.81	-528,819,026.04	126,548,387.14
合计	52,915,974,601.20	46,206,464,462.39	-6,709,510,138.81	2,433,141,174.77

### 十三、 其他

√适用 □不适用

#### (1) 合并报表财务数据

项目名称	2020 年末	2019 年末	增减百分比 (%)
融出资金	18,049,801,302.82	11,603,902,720.20	55.55
衍生金融资产	7,949,263.29	515,945.01	1,440.72
应收票据		60,000.00	-100.00
应收款项	376,891,916.23	157,516,730.15	139.27
债权投资	224,095,373.07	142,062,707.25	57.74
长期股权投资	1,538,178,928.49	1,179,023,133.40	30.46
在建工程	879,705,555.60		-
商誉	315,844,316.37	149,905,260.26	110.70
递延所得税资产	854,571,053.96	620,316,429.24	37.76
其他资产	405,936,918.57	270,799,585.02	49.90
短期借款	1,069,956,134.02	362,188,067.17	195.41
应付短期融资款	8,400,919,247.63	4,894,327,023.67	71.65
交易性金融负债	1,978,636,180.90	5,609,206,692.41	-64.73
应付职工薪酬	1,184,966,047.79	786,812,209.05	50.60
应交税费	417,602,767.42	116,009,444.57	259.97
应付票据	177,170,000.00	30,000,000.00	490.57
应付款项	405,002,473.26	39,020,993.89	937.91
合同负债	20,248,472.58		-
递延所得税负债	57,846,309.94	4,650,589.76	1,143.85
其他负债	802,986,871.92	2,032,068,150.66	-60.48
资本公积	16,738,719,260.67	11,765,216,102.69	42.27
其他综合收益	10,214,293.84	125,477,406.24	-91.86
归属于母公司所有者权益	27,879,893,402.91	20,955,913,171.46	33.04
项目名称	2020 年度	2019 年度	增减百分比 (%)
营业总收入	7,356,492,441.10	5,130,373,462.68	43.39
利息净收入	596,033,856.04	327,585,104.71	81.95
手续费及佣金净收入	2,898,120,849.15	2,001,888,885.20	44.77
公允价值变动收益	154,025,828.18	-437,166,281.54	-

汇兑收益	-3,437,643.66	-6,329,478.39	-
资产处置收益	-1,920,647.50	77,924.75	-2,564.75
营业总支出	5,055,307,538.37	3,794,185,952.48	33.24
信用减值损失	726,520,642.60	169,304,036.71	329.12
其他资产减值损失		89,343,191.51	-100.00
营业利润	2,301,184,902.73	1,336,187,510.20	72.22
营业外支出	31,279,910.19	6,431,929.75	386.32
利润总额	2,273,286,242.71	1,333,570,864.20	70.47
所得税费用	559,663,358.96	354,325,271.06	57.95
净利润	1,713,622,883.75	979,245,593.14	74.99
其他综合收益的税后净额	-116,130,047.08	169,670,219.59	-168.44
综合收益总额	1,597,492,836.67	1,148,915,812.73	39.04

## (2) 母公司报表财务数据

项目名称	2020 年末	2019 年末	增减百分比 (%)
融出资金	17,773,535,774.34	11,603,902,720.20	53.17
衍生金融资产		80,262.68	-100.00
存出保证金	225,822,171.01	115,896,068.79	94.85
应收票据		60,000.00	-100.00
应收款项	33,407,859.54	92,477,807.21	-63.87
在建工程	879,705,555.60		-
递延所得税资产	732,027,730.35	504,071,252.13	45.22
其他资产	157,293,737.79	120,136,077.54	30.93
应付短期融资款	8,400,919,247.63	4,894,327,023.67	71.65
交易性金融负债	46,900,714.00	12,037,000.00	289.64
应付职工薪酬	971,315,109.00	651,934,582.57	48.99
应交税费	338,098,956.34	57,305,805.09	489.99
应付款项	109,682,445.87	20,217,652.51	442.51
合同负债	18,769,809.43		-
资本公积	16,625,441,979.30	11,657,819,494.42	42.61
项目名称	2020 年度	2019 年度	增减百分比 (%)
营业总收入	4,712,111,504.43	3,268,249,102.56	44.18
利息净收入	455,831,634.66	197,359,989.48	130.96
手续费及佣金净收入	2,560,510,447.54	1,709,720,510.85	49.76
投资收益	1,681,954,577.03	1,176,292,224.23	42.99
其他收益	17,652,911.26	3,708,959.38	375.95
公允价值变动收益	-3,030,034.76	175,973,605.00	-101.72
汇兑收益	-2,832,906.64	956,462.70	-396.19
资产处置收益	-1,782,373.09	82,461.41	-2,261.46
营业总支出	2,802,450,048.24	1,895,211,455.03	47.87
信用减值损失	576,949,021.37	108,942,017.10	429.59
营业利润	1,909,661,456.19	1,373,037,647.53	39.08



营业外收入	466,535.16	210,314.91	121.83
营业外支出	27,128,702.05	5,859,984.02	362.95
利润总额	1,882,999,289.30	1,367,387,978.42	37.71
净利润	1,523,942,876.15	1,061,080,300.90	43.62
其他综合收益的税后净额	-26,302,727.77	164,807,435.29	-115.96

### 第三节 公司业务概要

#### 一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

##### (一) 报告期内公司从事的主要业务及经营模式

公司从事的主要业务包括经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务。

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，代销金融产品，通过互联网交易平台提供专业化研究和投资咨询服务，协助投资者作出投资决策，获取手续费、佣金及相关收入。

投资银行业务主要是向企业、机构（包括个人）、政府等提供金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板推荐、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务，获得承销费、保荐费、财务顾问费等相关收入。

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、直接投资类、衍生工具、做市业务及其他另类金融产品的投资交易，获取投资收益。

资管及基金管理业务是根据资产规模及客户需求开发资产管理产品、基金产品及提供相关服务，包括集合资产管理业务、单一资产管理业务、专项资产管理业务及基金管理业务，获取管理费、业绩报酬及其他收入。

信用交易业务主要包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务，获取利息及相关收入。

##### (二) 报告期内公司所属行业的发展阶段、周期性特点以及公司所处的行业地位

当前我国经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段，推进金融供给侧结构性改革，是推动经济高质量发展的重要保障。年内新证券法落地，在注册制、投资者保护制度、信息披露要求、证券交易制度等方面作出了改革完善，进一步健全证券市场基础制度。随着资本市场改革的持续深入，全面实行股票发行注册制有序推进，退市新规出台，直接融资比重大幅提升，进一步增强

资本市场服务实体经济的能力。报告期内，面对国内外复杂的经济形势，我国在有效防控疫情的情况下，经济逐步复苏，证券行业景气度上升，沪深两市股指同比增长，上证指数上涨 13.87%，深证综指上涨 38.73%，行业表现总体向好。据中国证券业协会统计，截止 2020 年末，证券行业总资产为 8.90 万亿元，同比增加 22.50%；净资产 2.31 万亿元，同比增加 14.10%；实现营业收入 4484.79 亿元，同比增长 24.41%；实现净利润 1575.34 亿元，同比增长 27.98%。

近年来，公司坚持以建设规范化、市场化、科技化、国际化现代证券控股集团为发展愿景，以“坚持根据地、融入长三角、服务中小微”为战略导向，以客户为中心，立足新发展阶段，贯彻新发展理念，服务新发展格局，充分发挥多元化业务平台优势、全产业链服务的综合金融优势，持续提升风险合规管理水平，各项业务经营稳步推进，行业影响力逐年提升，公司连续六年获得证券公司分类评价 A 类 A 级。

报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

适用 不适用

报告期公司的资产变化情况详见第四节二、（三）资产、负债情况分析

其中：境外资产 1,301,958,816.08（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 1.23%。

## 二、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

### （一）扎根苏州、深耕长三角，具备显著的区位优势和发展潜力

2020 年苏州市 GDP 总量超两万亿元，当前正处战略利好叠加、重大布局叠加的历史机遇期，证券业务发展空间巨大。长三角地区是中国经济最具竞争力和发展潜力的区域板块，根据国家部署，未来一段时间长三角将打造世界级城市群，苏州作为长三角具有世界级水平的重要中心城市，商务、金融等特大型城市功能将更加全面完善，以金融业为重点的服务业将迎来广阔发展空间。公司扎根苏州，并积极融入长三角一体化发展国家战略，在长三角地区复制成熟有效的根据地工作模式，深度服务区域客户。苏州区域以及长三角地区巨大的市场空间、蓬勃的发展潜力，以及公司多年来的布局和对区域客户、业务的熟悉、理解，为公司未来更好、更快发展奠定了坚实基础。

### （二）组织优势、专业优势持续积累，综合业务竞争实力不断提升

公司有效推进战略布局、业务布局，持续积累组织优势和专业优势。投行业务以打造“一流

投行”为愿景，坚持以企业需求为导向，依托专业优势，紧抓科创板、创业板及试点注册制改革机遇，围绕企业发展的全生命周期，为客户提供全产业链的综合金融服务；研究业务以提升研究和服务能力为核心目标，坚持“专业创造价值”的理念，为客户提供一流的品牌化投研服务，在市场影响力逐年提升的同时，为公司各项业务提供智力支撑，推动业务协同发展；境内外一体化的金融服务平台加快推进，实现了在新加坡、香港等境外资本市场的业务布局，更好服务长三角实体企业的海外金融需求；大运营优化成效明显，从流程、管理以及 IT 等各方面构建了大运营体系，实现了经纪、资管、自营条线运营集中，全面提升服务和运营支撑能力。

### （三）信息技术开发持续投入，金融科技赋能财富管理转型

公司在业务引领、科技赋能的战略方针下不断推动金融科技发展，满足提升客户需求，改善服务模式，提升服务水平，打造高质量客户服务体系。在完善信息技术基础设施和安全运维的同时，通过增强自主研发能力、鼓励新兴技术应用等手段实现公司业务创新发展。建设完成了新一代集中交易平台、数据与技术中台、秀财财富管理 APP、新一代 CRM、全面风险管理平台、大投行管理等一批行业领先的信息系统，实现了混合云基础建设、大数据分析治理、智慧服务体系等关键技术领域的核心竞争力提升。

### （四）具有完善的全面风险管理体系，合规风控管理审慎高效

公司坚持把“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化建设要求落到实处，全面提升公司合规风控管理的能力、质量和效率，连续 6 年保持券商分类评价 A 类评级。公司建立了良好的公司治理结构和规范的合规风控组织架构，各级管理和监督机构之间权责明确、运作规范；制定了有效的合规风控管理机制，包括风险应对和处理机制、常态化监督检查机制、有效激励和问责机制在内的各项机制；持续加大合规风险信息投入，运用科技手段不断提升合规风控能力，实现了风险合规管理与业务发展的统筹兼顾和动态均衡，保障了公司业务的持续健康发展。

### （五）坚持党建引领、文化聚力，形成了东吴特色的企业文化和人才机制

公司始终坚持加强党的建设，将党的领导融入公司法人治理结构和现代企业制度，运用党的创新理论解决经营管理实际问题和推动事业发展，为企业深化改革、转型发展营造良好的发展环境，为公司建设成为规范化、市场化、科技化、国际化现代证券控股集团提供了重要保障。

公司深入贯彻证券行业文化建设要求，秉承“为实体经济增添活力、为美好生活创造价值”的企业使命，坚持“规范化、市场化、科技化、国际化的现代证券控股集团”的企业愿景，倡导

“待人忠、办事诚、共享共赢”的核心价值观。公司核心管理团队长期保持稳定，高管团队具备丰富的金融从业和管理经验。公司不断完善用人机制和激励机制，加强干部队伍建设和人才培养工作，创新人才机制，释放人才活力，同时加大人才引进力度，搭建平台、营造氛围，打造了一支专业突出、素质过硬、作风优良的人才队伍。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2020年，新冠肺炎疫情蔓延全球，各国政府出台刺激政策应对疫情带来的冲击。在党中央的正确领导下，中国不仅率先控制住疫情，而且率先恢复经济正增长，全年GDP同比增速2.3%，为世界经济注入信心和活力。在这一背景下，中国A股市场保持平稳运行，交易活跃度显著提升，叠加资本市场改革加速推进，证券行业经营环境和经营业绩持续改善。

面对复杂严峻的形势，公司全面统筹疫情防控和业务发展，积极把握资本市场改革的历史机遇，牢固树立“坚持根据地、融入长三角、服务中小微”的战略导向，各项工作取得显著成效，经营业绩持续上扬，有力巩固、扩大了上年以来的向好态势，为实现高质量发展打下坚实基础。一是服务实体勇创佳绩。2020年保荐承销科创板单数进入行业前十，IPO承销项目数排名位列行业第14位，行业排名显著提升。在双创债领域持续探索，成功发行全国首单知识产权质押创新创业疫情防控债券、全国首单绿色创新创业疫情防控债券，累计发行双创债30单，发行数量连续5年位居行业第一。新三板业务保持行业领先，2020年新增挂牌企业10家，市场排名第3，2家企业首批挂牌精选层，累计完成新三板挂牌437家，行业排名第五。二是改革转型步伐坚定。财富管理转型不断深化，资产管理业务持续向主动管理转型，投资管理体系加快建立，研究业务市场化改革成效进一步显现，新财富排名前十。三是金融科技实现突破。坚持科技赋能，在自主可控的集中交易系统、区块链等关键技术领域取得突破性成果，位于行业领先。四是海外业务走上正轨。东吴香港完成对中投证券（香港）整体收购，获得香港证监会规管下全牌照业务资格。五是合规风控稳步向好，连续六年获评A类A级券商，全年未出现重大违法违规事件和重大风险事件。

### 二、报告期内主要经营情况

报告期内，公司实现营业收入73.56亿元，实现归属于母公司股东的净利润17.07亿元。报告期末，公司总资产1,054.75亿元，归属于上市公司股东的净资产278.80亿元。

## (一) 主营业务分析

## 利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位:元 币种:人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	7,356,492,441.10	5,130,373,462.68	43.39
营业成本	5,055,307,538.37	3,794,185,952.48	33.24
经营活动产生的现金流量净额	-431,156,189.10	1,137,377,673.57	-137.91
投资活动产生的现金流量净额	-441,214,682.69	678,346,412.14	-165.04
筹资活动产生的现金流量净额	6,934,197,331.87	3,647,710,227.22	90.10

## 1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

公司实现营业收入 73.56 亿元，同比上升 43.39%，主要原因为：经纪与财富管理业务收入同比上升 40.54%，投资银行业务收入同比上升 71.31%，投资与交易业务收入同比上升 31.74%，资管及基金管理业务收入同比上升 121.14%，信用交易业务收入同比上升 56.12%。公司营业成本 50.55 亿元，同比上升 33.24%。主要原因为：经纪与财富管理业务成本同比上升 32.57%，投资银行业务成本同比上升 39.66%，投资与交易业务成本同比上升 18.35%，信用交易业务成本同比上升 392.68%。

## 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位:元币种:人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
经纪及财富管理业务	1,948,657,867.14	1,291,605,946.52	33.72	40.54	32.57	增加 3.99 个百分点
投资银行业务	1,102,499,970.82	561,626,925.54	49.06	71.31	39.66	增加 11.54 个百分点
投资与交易业务	3,160,950,372.87	1,772,386,278.45	43.93	31.74	18.35	增加 6.34 个百分点
资管及基金管	170,901,196.63	370,727,121.09	-116.92	121.14	-19.50	增加 378.98

理业务						个百分点
信用交易业务	982,798,431.36	744,202,375.93	24.28	56.12	392.68	减少 51.72 个百分点
主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
江苏省内	1,129,209,937.07	447,120,975.88	60.40	23.80	0.15	增加 9.35 个百分点
江苏省外	309,525,458.51	108,112,530.97	65.07	70.15	6.79	增加 20.72 个百分点
总部及子公司	5,917,757,045.52	4,500,074,031.52	23.96	46.61	38.61	增加 4.39 个百分点
合计	7,356,492,441.10	5,055,307,538.37	31.28	43.39	33.24	增加 5.24 个百分点

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

√适用 □不适用

#### ① 经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，通过提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。报告期内，经纪及财富管理业务实现营业收入 19.49 亿元，同比增长 40.54%。

2020 年，沪深两市指数全面上涨，沪深股票日均成交额 8478.08 亿元，同比增加 63.05%。公司经纪业务积极把握市场机遇，深化财富管理转型，持续提升数字化运营水平，为客户创造价值。

公司深化经纪改革，坚定向财富管理转型。基本实现金融产品体系化、货架化，提升产品遴选专业化能力，建立涵盖产品代销、大类资产配置、资产配置 FOF 专户，家庭财富管理等业务形态的体系，售前、售中、售后全流程支撑体系渐趋成熟，多元化服务能力逐步增强。根据内部统计，金融产品销售规模 150.59 亿元，同比增长 83%，金融产品销售业务规模实现跨越式增长。

公司坚持科技赋能，数字化运营成效初显。2020 年，上线行业首个全内存、全业务集中交易

系统 A5，对维护国家金融安全具有积极意义，交易速度处于市场领先水平。公司践行普惠金融理念，让普通客户和机构客户都能享受高端极速交易服务，为客户创造价值。公司积极建设智能化运营中台，稳步推进客户分类分级，升级完善 CRM 系统，优化秀财 APP 客户端，上线行业首批代销私募基金电子化签约，全面提升客户服务水平，改善客户体验。

公司创新渠道引流模式，强化线上线下融合。通过信息流广告投放、开户断点抢单、同花顺联合运营等创新模式，拓展线上开户渠道，强化线上线下融合，提高线上客户转化率，获客效果显著。报告期内，全渠道新增开户 18.36 万户，有效户 6.83 万户。

报告期内，公司经纪业务客户数量同比增长 11%，代理买卖业务成交量（A 股+基金）44,886 亿元，同比增长 37%，股票交易市场份额 1.021%。

公司通过控股子公司东吴期货有限公司开展期货经纪业务。在期货市场高速发展，成交量创历史新高的背景下，东吴期货积极抢抓业务机遇，持续推进业务转型，加大机构客户开发力度与产业企业对接服务，加快在经济发达地区设点布局，拓展线上引流渠道，深耕主动管理业务，稳步开展风险管理业务，审慎开展自有资金投资，取得良好经营业绩。报告期内，东吴期货实现营业收入 18.53 亿元，实现净利润 5,923.21 万元。在各家交易所的成交排名持续提升，其中大商所成交量排名由 2019 年的 35 名上升至 26 名，郑商所成交量排名由去年的第 10 名上升至第 6 名。疫情期间，积极参与“金融抗疫”，成功开展“口罩期权”业务，帮助实体企业通过衍生工具管理价格风险。

证券研究业务竞争日趋激烈，在注册制背景下，券商研究定价能力将成为核心竞争力之一。公司研究业务成功向卖方业务转型，持续推进研究团队建设，研究能力显著增强。目前，已形成以总量金融、上游能源、高端制造、大消费和 TMT 五大产业链研究为核心的证券投资研究体系，覆盖包括宏观、固定收益、金融工程、策略、新三板、海外及二十余个行业研究领域，并在以上领域形成领先优势。公司着力提升研究服务质量，为机构客户、上市公司和非上市公司提供一站式金融服务平台，并为地方政府、行业协会和监管部门提供智库支持，为区域经济发展出谋划策。报告期内，公司荣获新财富本土最佳研究团队第九名，最具影响力研究机构第十名，市场影响力稳步提升。完善研究业务对内服务，积极探索投行、经纪、研究一体化的服务模式，发挥产业链优势服务公司核心客户，提升研究定价能力，为客户创造更高价值。

## ② 投资银行业务

投资银行业务主要是向机构客户提供企业金融服务，包括股票承销与保荐、债券承销、新三板业务、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务。

报告期内，资本市场全面深化改革扎实推进，随着科创板注册制日趋成熟，创业板注册制顺利实施，新三板精选层正式推出，全面注册制日益临近，提高直接融资比重的目标正在不断落实，全年沪深两市 IPO 融资规模超过 4,699.63 亿元，新上市公司中，科创板和改革后的创业板公司占比超过 52.53%，资本市场服务“双循环”枢纽功能突出体现，市场活力和动力进一步释放。

2020 年，公司积极把握市场和政策机遇，坚持创新发展与风控合规双轮驱动，围绕核心客户需求打造全产业链服务，提升直接融资规模，全面助力实体经济发展。经过多年积累，公司投行业务已具备较强的专业实力和市场影响力。报告期内，公司投资银行业务实现收入 11.02 亿元，同比增长 71.31%。

股权融资方面，报告期内，公司股票承销业务呈现良好增长势头，完成股权融资项目 21 个，其中 IPO 项目 10 个、再融资项目 9 个、精选层项目 2 个，承销金额人民币 126.37 亿元。公司聚焦长三角区域、聚焦优势行业，整合内外部资源，全产业链联动，提升直接融资规模，保荐主承销 10 家企业 IPO 上市，承销规模 57.10 亿元，保荐主承销项目数排名行业第 14 位，其中，龙腾光电为科创板首家江苏国资项目、福立旺为首家江苏台企科创板项目。完成再融资项目 9 单，其中定增项目 4 单、可转债项目 2 单、配募项目 3 单，承销金额人民币 67.11 亿元。完成盛虹主体综合融资服务项目，以股权再融资、产业基金结合的方式，募集资金 91.1 亿元，为省重大建设项目提供融资支持。

公司持续完善基金产业链，主动服务地方发展。2020 年，发起设立规模 5 亿元的苏州市乡村振兴投资基金，管理 25 亿规模的苏州市上市发展引导基金，着手设立首期 13 亿元规模的苏州市并购母基金，加速推进苏州市科创培育基金。

债券承销方面，公司积极抢抓市场发展机遇，持续深化根据地战略，债券承销规模和行业排名取得新突破。报告期内，公司债券承销业务主承销项目 170 只，主承销总金额人民币 885.09 亿元(wind 口径)。根据 wind 统计，公司在苏州区域企业债及公司债承销占比超过 50%、保持领先，徐州、南通、无锡等新根据地培育成效初显，市场份额进入前列，一超多强格局初步形成。在江苏市场保持竞争优势，承销江苏省内企业债及公司债规模达 525.70 亿元，市场占比 10.88%、排名第一。



公司围绕服务中小微企业、服务地方发展开展固定收益业务，疫情发生以来，积极落实“六稳”“六保”任务，助力企业发行疫情防控债 8 只，募集总金额 53.7 亿元。创新业务多点开花，成绩显著，保持在双创债和信用保护工具领域的领先优势，大力推进 ABS、绿色债等创新业务发展。2020 年成功发行 5 只创新创业公司债，3 单 ABS，5 只绿色公司债券，8 只疫情防控债，1 只扶贫债，创设 2 单信用保护合约。成功发行全国首单知识产权质押创新创业疫情防控债券、全国首单绿色创新创业疫情防控债券，成功设立中国建筑首批工程尾款 ABS，为服务优质央企客户积累经验。

面对复杂多变的经济环境，公司在坚持创新发展的同时，以高标准、严要求开展业务质量控制及合规风控管理，优化业务管理系统，持续排查到期兑付及回售债券的信用风险，重点关注民营企业、偏远地区城投、低层级城投、大额兑付/回售等公司债券兑付资金准备情况，规避实质风险，严防不合规事项发生。

公司持续做精服务中小微品牌特色，发力新三板业务，保持行业领先。2020 年新增新三板挂牌家数 10 家、行业排名第 3，累计挂牌家数 437 家、行业排名第 5。新三板挂牌企业股票发行（包括定向发行和公开发行）27 次，市场融资次数排名第 6 名，累计募集资金 6.07 亿元。2020 年，精选层规则正式落地，公司积极对接精选层改革，充分挖掘优质项目，保荐苏轴股份、旭杰科技首批挂牌精选层，14 家精选层项目立项，储备项目丰富。

报告期内，公司在证券时报主办的“2020 中国区投资银行&证券经纪商君鼎奖”颁奖典礼中获得“2020 中国区交易所债券投行君鼎奖”、“2020 中国区债券项目君鼎奖”、“2020 中国区新三板主办券商君鼎奖”、“2020 中国区新三板服务团队君鼎奖”、“2020 中国区新三板项目君鼎奖”五大奖项；在 2020 中国资本年会上荣获“最佳成长投行”称号；在 2020 第四届中国新三板年度风云榜活动中荣获“优秀服务机构”称号；在 2020 年江苏省绿色金融年度峰会上荣获“2020 年江苏省绿色金融十大杰出机构”称号；被上交所授予“2020 年度公司债券优秀承销商”、“优秀受托管理人”，被深交所授予“2020 年度优秀疫情防控固定收益业务承销机构”。

### ③ 投资与交易业务

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。报告期内，公司投资与交易业务共实现业务收入 31.61 亿元，同比增长 31.74%。

权益类证券投资方面。2020 年，权益市场跌宕起伏，呈现：“结构牛”行情，板块差异明显。公司坚持绝对收益导向，进一步优化资产配置结构，打造底层稳健资产、中间层资产以及顶层战略资产的金字塔型资产配置架构。加强投研能力的提升，强化投资“安全垫”和仓位管理。组建金融衍生品团队，推进场内外衍生品业务开展，提升应对市场波动的能力，有效控制回撤幅度。总体实现稳健投资收益。

固定收益证券方面。2020 年，债券市场走出宽幅震荡行情，利率债收益率呈先下后上的 V 型走势，四季度受华晨、永煤等信用事件冲击，利差大幅走扩。面对大幅波动的市场行情，公司持续加强信用风险控制，加强对信用风险的前瞻判断，提升信评的专业能力，信用债持仓保持较好资质水平，在重大事件冲击下显示较好抗风险能力。加快建立投资管理体系，扩大研究覆盖范围，搭建投研分析框架，将研究成果转化为投资产能，努力向主动交易型策略转型，全年保持稳定收益。

新三板做市业务方面，报告期内，公司持续优化新三板做市业务结构，推动优质企业上市，做市投资取得良好收益。截至报告期末，公司做市持仓的新三板股票中，已上市企业 6 家，精选层企业 3 家，多家企业已申报或待申报 IPO 及精选层，服务中小微企业的能力持续提升，形成做市投资培育企业成长的良好模式。

公司通过全资子公司东吴创新资本开展另类投资业务，形成战略投资、股权投资、稳健投资以及权益类及私募基金投资等投资板块。服务地方实体经济，落实公司协同战略布局，顺利推进产业金融项目，主要项目有苏州市吴中产业优化基金、苏州市东吴城乡一体化建设引导基金、国寿东吴（苏州）城市产业投资基金、苏州资产管理有限公司等。积极把握科创板投资机会，重点布局符合国家战略发展目标的行业领域，实现良性循环的投资模式。报告期内，东吴创新资本实现营业收入 37,656.47 万元，净利润 26,966.22 万元，业绩实现历史性突破。

公司通过全资子公司东吴创投开展私募股权投资基金业务。在对外投资方面，东吴创投管理的基金主要投资了生物医药、网络、炼化、文旅开发等 8 个项目，投后发展状况良好；在基金投资和管理方面，公司成功推动设立苏州市东吴乡村振兴产业发展引导基金、苏州市吴企创新基金、吴基创新基金、苏上健康基金等一批重大项目，助力实体经济发展。报告期内，东吴创投实现营业收入 15,066.17 万元，净利润 6,998.72 万元。

#### ④ 资管及基金管理业务

资管及基金管理业务是提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。报告期内，资产管理业务实现收入 1.71 亿元，同比增长 121.14%。

2020 年以来，资管新规加速落地，金融开放不断深化，券商资管业务持续转型，通道型业务规模大量缩减，行业头部效应日趋明显。报告期内，公司资管业务持续向主动管理转型，主动管理规模基本维持稳定，符合资管新规导向的净值型债券产品、权益类产品均有所新增，带业绩基准的固收产品业绩均超越业绩基准，新增产品投资未发生重大风险事件。进一步丰富产品线布局，拓宽银行等外部代销渠道，启动大集合公募改造，规范产品运行。私募资管整改工作有序推进，整改完成率达 67.45%。截至报告期末，公司受托管理总规模为 697.53 亿元。

公司通过控股子公司东吴基金开展基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。2020 年，东吴基金坚定不移回归业务本源，梳理各项制度流程，加强风险控制，完善投研各项业务体系，积极拓展专户定增业务，成功发行公募新产品，为提升业绩、打响品牌奠定基础。截至报告期末，东吴基金管理的资产总规模 322.56 亿元，其中，公募基金规模 154.69 亿元，专户资产规模 157 亿元，子公司专项资产规模 10.87 亿元。

## ⑤ 信用交易业务

信用交易业务主要为个人及机构客户提供包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等资本中介业务。报告期内，信用交易业务实现营业收入 9.83 亿元，同比增长 56.12%。

融资融券业务方面。2020 年，证券市场融资融券业务规模稳中有升。报告期内，公司持续完善利率定价策略和开户流程，重点拓展私募机构客户和高端客户，融资融券业务实现较快增长。截止 2020 年 12 月 31 日，公司融资融券业务规模为 187.58 亿元，总体维持担保比例为 291%。

股票质押业务方面。公司持续压降规模、调优结构，一方面，多措并举扎实推进风险化解工作，稳妥压降股票质押业务规模，有效化解存量风险，风险项目处置取得较好成效。另一方面，坚持服务实体经济，严把项目质量关，重点围绕公司核心客户，审慎开展新增及展期业务，确保信用业务高质量发展。截止 2020 年 12 月 31 日，表内股票质押业务规模 53.90 亿元，表内股票质押担保物市值 71.52 亿元，维持担保比例为 133%，表外股票质押规模为 44.11 亿元。

## 2. 费用

√适用 □不适用

报告期内，本公司的业务及管理费参见本年度报告“第十一节财务报告附注 5、合并财务报

表项目注释 50、业务及管理费”。

### 3. 研发投入

#### 研发投入情况表

适用 不适用

#### 情况说明

适用 不适用

### 4. 现金流

适用 不适用

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
经营活动产生的现金流量净额	-431,156,189.10	1,137,377,673.57	-137.91
投资活动产生的现金流量净额	-441,214,682.69	678,346,412.14	-165.04
筹资活动产生的现金流量净额	6,934,197,331.87	3,647,710,227.22	90.10

(1) 经营活动产生的现金净流出为 4.31 亿元，主要流出项目为：支付的其他与经营活动有关的现金为 77.36 亿元；融出资金净增加额为 62.11 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金为 15.11 亿元，回购业务资金净减少额为 7.78 亿元；支付利息、手续费及佣金的现金为 13.07 亿元；支付的各项税费为 9.20 亿元。主要流入项目为：收取利息、手续费及佣金的现金为 61.40 亿元；为交易目的而持有的金融资产净减少额为 52.51 亿元；代理买卖证券收到的现金净额为 47.47 亿元；收到的其他与经营活动有关的现金为 18.61 亿元。经营活动产生的现金净流出较去年增加的主要原因是公司回购业务及融出资金业务产生的现金净流出增加。

(2) 投资活动产生的现金净流出为 4.41 亿元，主要流出项目为：投资支付的现金为 34.43 亿元；购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金为 10.98 亿元。主要流入项目为：收回投资所收到的现金为 33.75 亿元；取得投资收益所收到的现金为 4.89 亿元；处置子公司及其他营业单位收到的现金净额为 1.70 亿元。投资活动产生的现金净流出较去年增加的主要原因是投资支付的现金和购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金的增加，以及取得投资收益所收到的现金的减少。

(3) 筹资活动产生的现金净流入为 69.34 亿元，主要流入项目为：取得借款收到的现金为 303.45 亿元；发行债券收到的现金为 82.89 亿元；吸收投资收到的现金 59.43 亿元。主要流出项目为：偿还债务支付的现金为 355.58 亿元；分配股利、利润或偿付利息支付的现金为 20.40 亿元。筹资活动产生的现金净流入较去年增长的主要原因为取得借款收到的现金的增加以及吸收投资收

到的现金的增加。

## (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

## (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例(%)	上期期末数	上期期末数占总资产的比例(%)	本期期末金额较上期期末变动比例(%)	情况说明
融出资金	18,049,801,302.82	17.11	11,603,902,720.20	12.06	55.55	主要是由于本期末融出资金规模增加所致
衍生金融资产	7,949,263.29	0.01	515,945.01	0.00	1,440.72	主要是由于本期末货币衍生工具规模增加所致
应收票据		0.00	60,000.00	0.00	-100.00	主要是由于本期末应收银行承兑汇票减少所致
应收款项	376,891,916.23	0.36	157,516,730.15	0.16	139.27	主要是由于本期末应收清算款增加所致
债权投资	224,095,373.07	0.21	142,062,707.25	0.15	57.74	主要是由于本期末定向工具规模增加所致
长期股权投资	1,538,178,928.49	1.46	1,179,023,133.40	1.23	30.46	主要是由于本期对联营企业的投资增加所致
在建工程	879,705,555.60	0.83			-	主要是由于本期末在建工程规模增

						加所致
商誉	315,844,316.37	0.30	149,905,260.26	0.16	110.70	主要是由于本期购买子公司商誉增加所致
递延所得税资产	854,571,053.96	0.81	620,316,429.24	0.64	37.76	主要是由于本期末可抵扣暂时性差异增加所致
其他资产	405,936,918.57	0.38	270,799,585.02	0.28	49.90	主要是由于本期末待抵扣进项税增加所致
短期借款	1,069,956,134.02	1.01	362,188,067.17	0.38	195.41	主要是由于本期末信用借款增加所致
应付短期融资款	8,400,919,247.63	7.96	4,894,327,023.67	5.09	71.65	主要是由于本期末应付短期收益凭证规模增加所致
交易性金融负债	1,978,636,180.90	1.88	5,609,206,692.41	5.83	-64.73	主要是由于本期末合并结构化主体产生的交易性金融负债减少所致
应付职工薪酬	1,184,966,047.79	1.12	786,812,209.05	0.82	50.60	主要是由于本期末应付工资、奖金、津贴和补贴增加所致
应交税费	417,602,767.42	0.40	116,009,444.57	0.12	259.97	主要是由于本期末应付企业所得税增加所致
应付票据	177,170,000.00	0.17	30,000,000.00	0.03	490.57	主要是由于本期末应付银行承兑汇票增加所致
应付款项	405,002,473.26	0.38	39,020,993.89	0.04	937.91	主要是由于本期末应付

						清算款增加所致
合同负债	20,248,472.58	0.02			-	按照新收入准则新设科目
递延所得税负债	57,846,309.94	0.05	4,650,589.76	0.00	1,143.85	主要是由于本期末应纳税暂时性差异增加所致
其他负债	802,986,871.92	0.76	2,032,068,150.66	2.11	-60.48	主要是由于本期末合并结构化主体形成的其他负债减少所致

## 2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见财务报表附注“5.61 所有权或使用权受到限制的资产”的相关内容。

## 3. 其他说明

适用 不适用

### (四) 行业经营性信息分析

适用 不适用

### (五) 投资状况分析

#### 1、 对外股权投资总体分析

适用 不适用

报告期末，公司长期股权投资 15.38 亿元，与上年末相比增加 3.59 亿元，增幅 30.46%，主要是由于本期对联营企业的投资增加所致。具体内容请参见“第十一节 财务报告”之“附注 5、13 长期股权投资”。

#### (1) 重大的股权投资

适用 不适用

本年度被投资公司名称	主要业务	持股比例	期末账面价值	报告期投资收益
------------	------	------	--------	---------

苏州资产管理有限公司	不良资产管理	20.00%	894,129,284.23	79,075,087.82
东吴(苏州)金融科技有限公司	网络技术服务	32.00%	239,383,719.09	7,952,195.83

**(2) 重大的非股权投资**

适用 不适用

**(3) 以公允价值计量的金融资产**

适用 不适用

参见本年度报告“第二节公司简介和主要财务指标十二、采用公允价值计量的项目”。

**(六) 重大资产和股权出售**

适用 不适用

**(七) 主要控股参股公司分析**

适用 不适用

(1) 东吴基金管理有限公司，注册资本为1亿元人民币，公司持有70%的股权。截止2020年12月31日，东吴基金总资产4.29亿元，净资产3.14亿元，2020年实现营业收入15,811.78万元，实现净利润11.30万元。

(2) 东吴期货有限公司，注册资本为7.7亿元人民币，本公司持有93.8%的股权。截止2020年12月31日，东吴期货总资产73.60亿元，净资产9.43亿元，2020年实现营业收入185,339.42万元，实现净利润5,923.21万元。

(3) 东吴创业投资有限公司，注册资本为12亿元人民币，为公司全资子公司。截止2020年12月31日，东吴创投总资产12.68亿元，净资产12.18亿元，2020年实现净利润6,998.72万元。

(4) 东吴创新资本管理有限责任公司，注册资本为50亿元人民币，为公司全资子公司。截止2020年12月31日，东吴创新资本总资产44.06亿元，净资产43.87亿元，2020年实现净利润26,966.22万元。

(5) 东吴证券中新(新加坡)有限公司，注册资本为6,000万新加坡元，为公司控股子公司。截止2020年12月31日，东吴新加坡总资产3.66亿元人民币，净资产2.69亿元人民币，2020年实现营业收入3,382.15万元人民币，实现净利润1,031.93万元人民币。

(6) 东吴证券(香港)金融控股有限公司，注册资本12.60亿港元，为公司全资子公司。截止



2020 年 12 月 31 日, 东吴香港总资产 36.69 亿元人民币, 净资产 12.81 亿元人民币, 2020 年实现营业收入 27,013.34 万元人民币, 实现净利润 13,781.35 万元人民币。

#### (八) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

本集团合并的结构化主体主要为本公司作为管理人或投资者的资产管理计划。本集团综合评估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是否将使本集团面临可变回报的影响重大, 并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。

本年纳入本集团合并报表范围的结构化产品共 29 个 (其中有 8 个产品已于 2020 年度清算)。于 2020 年 12 月 31 日, 合并资产管理计划的总资产为人民币 4,376,202,291.14 元。

### 三、公司关于公司未来发展的讨论与分析

#### (一) 行业格局和趋势

√适用 □不适用

##### 1、证券行业的发展趋势

“十四五”规划提出, 全面实行股票发行注册制, 建立常态化退市机制, 提高直接融资比例, 完善现代化金融监管体系, 提高金融监管透明和法制化。随着科创板试点注册制成功落地, 创业板、新三板等一批重大改革相继推出, 全市场实行注册制稳步推进。“十四五”期间, 我国将加快构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局, 这为提高直接融资比重提供了宝贵的战略机遇。注册制改革即是提高直接融资比重的核心举措, 券商大投行业务将迎来新的发展机遇。

监管层鼓励长期资金入市, 长期资金对于提高企业融资可持续性以及资本市场稳定性都有重要意义。随着居民资产规模上升以及理财意识的普及, 居民扩大权益投资的需求快速上升, 在此背景下, 将居民储蓄有效转化为资本市场长期资金, 既为实体经济的发展提供有力支持, 也为资本市场发挥主动管理功能创造了重要条件。资产管理能力和财富管理将是未来券商创造增量业绩、打造竞争优势的发力点, 券商的业务收入结构将迈入主动优化的进程。

2020 年 3 月 14 日证监会明确, 自 2020 年 4 月 1 日起取消证券公司外资股比例限制; 9 月各交易所分别发布了新修订的 QFII、RQFII 实施细则, 允许合格境外投资者投资于存托凭证、股票期权、政府支持债券等, 同时允许其参与融资融券交易、转融通证券出借交易以及债券回购交易,

并于11月1日开始实施。同时“十四五”规划指出，我国在新发展阶段将建设更高水平、更高质量的开放型经济，持续深化对外开放，我国资本市场将加快打造更为开放融合的直接融资体系，进一步便利跨境投融资活动。资本市场的双向开放，为券商提升国际化水平、开展跨境业务提供保障。

## 2、证券行业的竞争格局

目前我国券商的发展路径较为趋同，行业集中度较高。随着金融扩大开放和全面深化资本市场改革的持续推进，未来将形成错位发展、功能互补、有机联系的多层次市场体系，证券行业的竞争格局将从渠道竞争转变为资本和专业能力的竞争，券商可分化为龙头券商、区域型券商和互联网券商。

龙头券商业务结构趋于多元化，整体业务排名靠前，凭借自身在资本金实力、风险定价能力、机构客户布局等方面的优势持续提升市场占比；区域型券商，多以地方国资委或地方政府为实际控制人，深耕地区，各业务形成区域性发展，抓住本土化优势，深度服务本土企业和客户，帮助当地企业做大做强，提升企业影响力，最终实现共赢；互联网券商凭借平台优势+低佣金率，推动平台活跃用户持续向证券经纪业务用户转化，利用大数据提升客户精准度，围绕高粘性用户打造财富管理生态圈。

## (二) 公司发展战略

适用 不适用

**公司使命：**为实体经济增添活力，为美好生活创造价值

**发展愿景：**坚持“待人忠、办事诚、共享共赢”核心价值观，坚持以客户为中心、以服务实体经济为责任、以人才为根本、以回馈股东和社会为宗旨，深耕地方、布局全球，追求创新、敢于超越，以打造国内一流核心竞争力为目标，充分发挥多元化业务平台优势，立足专业领域、提升协同效应，努力把公司建设成为规范化、市场化、科技化、国际化现代证券控股集团。

**战略举措：**立足新发展阶段、贯彻新发展理念、服务新发展格局，以“稳健、争先、突破”为总基调，牢固树立“坚持根据地、融入长三角、服务中小微”战略导向，坚持“做强合规风控、做大资本实力、做优人才队伍”发展路径，推进“科技赋能、文化聚力、协同提效”工作抓手，深化“党建引领发展、公司治理规范、社会责任彰显”事业布局，加快实现高质量发展。

### (三) 经营计划

√适用 □不适用

2021年，公司将以习近平中国特色社会主义思想为指导，深入学习贯彻党的十九届五中全会精神，进一步融入长三角一体化战略，把握沪苏同城化机遇，践行服务实体经济的使命，促进公司高质量发展。重点工作包括：

精准施策、分类推进、协同发展。投行业务把握注册制改革机遇，聚焦优势行业、优势区域，提供全产业链的综合金融服务。研究业务进一步扩大品牌影响力、提升协同效应。经纪与财富管理业务精准服务不同客群的财富管理需求，全面提升数字化、科技化水平。投资业务坚持绝对收益理念、提升专业能力。资管业务全面提升主动管理专业能力。

开拓发展新赛道，构建发展新平台，释放发展新活力。践行普惠金融理念，让广大普通投资者享受极速交易服务和高端研究服务，为客户创造卓越价值。引进在行业乃至社会有显著影响力的高端人才，联手顶流财经自媒体，拓展投资者教育内涵，打造新一代数字化财富管理模式。抓住沪苏同城化机遇，以建设新上海业务总部为载体，集聚优秀人才，汇聚前沿信息，加快创新步伐，构建发展新平台。加快体制机制改革步伐，对标市场、结合实际，推进管理体制现代化改革，深化薪酬制度改革，加大市场化选人用人力度，加快实施股权激励计划，进一步释放发展活力。

### (四) 可能面对的风险（包括落实全面风险管理以及合规风控、信息技术投入情况）

√适用 □不适用

#### 1、公司经营活动面临的主要风险

##### (1) 政策性风险

政策性风险指国家宏观调控措施、与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等的变动，对公司经营产生的不利影响。一方面，国家宏观调控措施对证券市场影响较大，宏观政策、利率、汇率的变动及调整力度与金融市场的走势密切相关，直接影响公司的经营状况；另一方面，证券行业是受高度监管的行业，监管部门出台的监管政策直接关系到证券公司的经营情况变动，若公司在日常经营中因不适应或违反法规、政策或监管要求，可能会受到监管机构罚款、暂停或取消业务资格等行政处罚，导致公司遭受经济损失或声誉损失。

## （2）市场风险

市场风险指因市场利率、汇率、证券及商品价格的不利变动或急剧波动而导致公司所持有的金融资产发生损失的风险。市场风险包括利率风险、股票价格风险、汇率风险及衍生品标的价格波动风险等。公司的市场风险主要涉及股票投资、债券投资、产品投资、衍生品交易及资产管理相关投资业务。主要表现为所投资证券价格发生不利变动或波动引起的投资损失的可能性。

## （3）信用风险

信用风险是指公司在开展业务时，发行人、交易对手未能履行合同规定的义务或由于信用等级下降、履约能力下降，给证券公司带来损失的风险。公司的信用风险主要源于融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易等信用业务以及非权益类投资业务等。主要表现为债券等主体违约、交易对手违约、客户违约等造成公司损失的可能性。

## （4）操作风险

操作风险主要指在公司业务范畴内，由于不完善或有问题的内部程序、员工和信息系统或外部事件给公司业务造成直接或间接损失的风险。主要表现在由内部程序、人员、信息系统、外部事件等原因，引发客户投诉、信访、诉讼，或导致账户透支、各类业务差错、系统故障事件，甚至收到内外部监管函件等，最终给公司带来直接损失或造成监管扣分、负面影响的可能性。

## （5）流动性风险

流动性风险，指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。公司的流动性风险可能来自于资产负债结构不匹配、资产变现困难、交易对手延期支付或违约，以及市场风险、信用风险、声誉风险等类别风险向流动性风险的转化等。

## （6）声誉风险

声誉风险是指因公司经营管理及其他行为或外部事件导致证券公司股东、员工、客户、第三方合作机构及监管机构等对证券公司的负面评价的风险。证券公司声誉风险主要是由重大经营损失、重大内部控制缺陷、客户投诉、司法诉讼、关联方声誉事件等引起，或流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、法律风险、合规风险和信息技术风险等其他风险转化而来。

## 2、公司已经或计划采取的风险应对措施

报告期内，公司风险管理工作围绕增强风险防控能力、推动公司高质量发展的工作部署，认真落实公司总体风控政策，实施风险总量管理、风险分类管理、业务分类风险管理，建立科学有效的风险控制指标体系，对公司面临的风险及其变化趋势进行识别、评估、监测、分析，提出相应控制措施及应对方案，始终做到公司风险的可知、可控、可承受。

#### （1）持续推进全面风险管理体系

公司的风险管理组织架构由公司董事会下设的风险控制委员会、经营管理层下设的风险管理委员会及首席风险官、风险管理部门、业务部门和分支机构设立的合规风控专员四个层级构成。公司设首席风险官负责公司全面风险管理工作，风险管理部门推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构和子公司的风险管理工作。各业务部门、分支机构和子公司在日常工作中全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

公司风险管理制度体系基本健全，自上至下覆盖各类别风险、各项业务，为日常风险管理工作提供明确的依据和指导原则。公司制订了《风险管理基本制度》，并按照风险类型分别制订了公司层级的《风险管理办法》、《市场风险管理实施细则》、《信用风险管理实施细则》、《操作风险管理实施细则》、《流动性风险管理办法》、《子公司风险管理实施细则》等，同时针对各业务分别制订了相应的具体风险管理工作规则。

公司制定了年度风险偏好、风险容忍度及风险限额等风险控制指标体系，强化风险控制指标落实执行。风险偏好按照公司经营和风险管理目标、风险应对政策以及外部信用评级方面进行描述；风险容忍度指标按照流动性风险、市场风险、操作风险、信用风险分别设置；风险限额管理根据公司资本、业务和风控监管指标情况，针对不同风险种类和各业务条线的特点，由公司经营层根据市场及经营情况在授权范围内对风险容忍度指标进一步分解、细化和落实经营授权限额指标和风险分类关键指标。

公司通过制度建设、分级授权建立完善了覆盖各项业务的风险控制措施及应对机制，根据风险监测和评估结果，选择与公司风险偏好相适应的风险回避、降低、转移和承受等应对策略，建立起合理、有效的资产负债管理、资本补充、资产减值、风险对冲、规模调整等应对机制。建立了风险应急机制以应对流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件，制定及时有效的应急响应措施和预案，明确应急触发条件、风险处置的组织体系、措施、方法和程序，并通过压力测试、应急演练等机制进行持续改进。建立了顺畅的风险报告与应对机制，对于一般风险事件由各

部门、分支机构、子公司提出处理方案，风险管理部门监督并跟踪执行情况；对于重大风险事件，各部门、分支机构、子公司、风险管理部门将有关情况连同处理建议报首席风险官和相关领导，风险事件处置完成后，各部门、分支机构及子公司会同风险管理部门评估原因，并据此完善制度流程；对于风险责任人，按照公司制度问责或处罚。

公司风险管理系统基于业务复杂程度和风险指标体系，运用科技手段实现符合整体风险管理需要的系统化管理，系统对业务与风险信息进行采集、汇总、计量、预警和监控，覆盖各风险类型、业务条线、业务部门、分支机构及子公司，并致力于实现同一业务、同一客户相关风险信息的集中管理。根据公司信息系统建设规划和数据管理规划，每年制定风险管理信息技术系统专项预算，推进风险管理系统建设工作，完善风险数据管理和质量保障机制，明确风险管理系统和风险数据集市的应用目标、管理范围、实现手段、工作流程，逐步提升风险管理系统管控能力和风险数据应用价值。

公司开展业务或者产品创新建立内部评估和审查机制，对创新业务或产品的合规性、可行性和可能产生的风险进行充分的评估论证，并制定管理制度，明确操作流程、风险控制措施和保护客户利益的措施。风险管理及合规部门全程参与创新业务的方案论证、风险与收益特征评估、多元化风险应对策略制定、风控指标设定等，财务部、信息技术部等中后台部门参与相关制度的制定和系统建设等，确保中后台的意见在方案、制度、策略中体现。创新活动开展后，注重过程的控制，及时纠正偏离目标行为，建立覆盖公司全部业务的动态监控系统，针对不同业务和产品制定相应的风险限额，对于超越风险限额的情况进行准确计算、动态监控和自动预警，并建立资本补充与业务规模、结构调整机制，明确异常情况的报告路径和处理办法。

公司建立健全信息披露及信息报告机制，规范各类重要信息收集、处理、传递、贮存及使用流程，保障各部门、分支机构及子公司、风险管理部门、经营管理层、董事会之间风险信息传递与反馈的及时、准确、完整，保障信息披露及信息报告的规范、及时。各部门、分支机构及子公司对所负责事项的内部控制执行情况、风险暴露状况以及实质性风险损失进行定期和不定期评估与分析，形成内部控制与风险评估报告。

## （2）各类风险的应对措施

### ① 市场风险的控制

公司主要从限额管理、证券池管理、风险评估及风险对冲等方面来控制公司的市场风险。

限额管理：公司建立自上而下的风险限额指标，包括市场风险敞口、投资集中度以及止盈止损等关键风控指标，通过交易系统及风险管理系统，事前控制和动态监测投资交易行为及资产变动情况，及时进行风险预警提示。设置单一标的在多个业务条线及投资组合的集中度指标，分散单证投资风险；通过设置单项投资的止盈止损、各业务条线损失限额以及公司市场风险总容忍度，有效控制单项投资和公司自营投资业务市场风险亏损过大的情况。

证券池管理：公司建立证券池管理机制，通过证券池分级管理，细化投资标的优选标准及投资额度，严格把控投资标的资质，强化事前投资准入审核；持续监测跟踪标的资质变动，及时更新证券池标的；定期评估证券池准入标准，结合业务开展需求和市场行情，优化准入要求。

风险评估：公司根据市场环境变化，结合投资策略，强化对标的跟踪及产品投资的风险穿透式管理，全面评估业务承担的市场风险；运用市场风险计量等方法定期评估公司面临的市场风险状态和风险承受能力，包括但不限于投资绩效分析、市场风险指标（在险价值、希腊字母风险指标等）的测算、压力测试等方法；针对市场大幅波动或面临较强下跌风险时，加大测算频率，控制公司在极端情况下可能承担的风险损失，确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。

风险对冲：公司积极研究量化对冲等投资策略，灵活运用量化模型及金融衍生工具，开展风险中性的投资交易业务、对冲部分市场风险敞口。公司通过期货、期权、互换等场内外衍生品对冲股票价格波动、利率变化等风险因子对组合收益的影响，同时积极寻找市场套利机会，通过Delta、Gamma、DV01、久期等风险敏感性指标，跟踪监测市场风险指标，有效控制方向性风险敞口。

## ② 信用风险的控制

公司主要采取证券标的信用评估、交易对手管理、尽职调查、限额管理、风险化解与处置及合同管理等方式控制信用风险。

证券标的信用评估：在非权益类证券投资业务中，公司通过建立证券池管理机制和统一内部信用评级机制，细化投资标的筛选标准，定期、不定期评估、更新证券池准入标准和证券池标的，强化事前准入审核，严防非权益类证券信用风险；持续跟踪债券发行人信用变化，对信用风险显著增加的投资标的，及时调整内评等级。在信用业务中，建立标的证券评级、评估体系，审慎评估标的资质，确定证券质押率，密切跟踪质押、担保标的风险事项，评估对客户及公司的影响。

交易对手管理：在非权益类证券投资业务中，选择资本实力强，盈利状况好，管理和运作规范、信用良好的交易对手，建立交易对手库，并定期、不定期评估、更新交易对手清单，减少不

良交易对手产生的信用风险，持续跟踪交易对手信用状况变化，评估其偿债能力。对信用业务客户，全面了解客户资信水平和风险承受能力，综合确定客户信用评级、授信额度，采取盯市、回访等措施及时了解客户信用资质变化，评估其偿债能力，对于失信客户执行黑名单管理。

**尽职调查:**在非权益类证券投资中，对债券发行人、交易对手开展必要的尽职调查，研究债券发行人、交易对手的偿债、履约能力，规避兑付风险。在信用业务中，加强事前尽职调查，从融入方资信状况、资金用途、还款来源及增信措施等多方面了解、评估项目风险情况，提交全面的项目可行性分析报告、尽职调查报告等，为公司业务决策提供支持。

**限额管理:**在非权益类证券投资业务方面，设定同一标的、同一发行人风险敞口、集中度指标；在信用业务方面，设定单一客户、单一证券信用风险敞口、集中度指标，控制单一品种、单一业务或单一客户的信用风险。通过信用风险限额管理，进一步加强对债券投资、股票质押等重点业务领域风险管控。

**风险化解与处置:**定期对投资的非权益类证券、信用业务开展风险排查工作，第一时间发现潜在风险，及时采取必要的风险化解措施，避免债券发行人、信用业务融资人资信情况恶化给客户、公司带来的损失。对于违约风险项目，及时采取风险处置措施，并充分做好与客户的沟通工作，尽可能避免或降低信用风险给客户、公司造成的损失。

**合同管理:**公司在合同订立的过程中严格贯彻公司的有关制度，实行分级审批，防止欺诈或不公平条款产生的合同风险。

### ③ 操作风险的控制

公司主要通过制度流程管理、决策授权管理、人员和权限管理、系统管理等措施控制操作风险。

**制度流程管理:**公司建立和完善各项业务制度，优化操作流程，定期梳理和评估各业务的操作风险点，制定相应的控制措施，事先建立重大操作风险应急预案和风险处置流程。

**决策授权管理:**公司建立业务决策授权体系，定期调整各决策委员会、业务部门的职责与决策授权权限，明确授权的范围、事项、权限、时效和责任，并严格按照授权逐级审批、设置相应的系统权限，定期检查权限执行情况，确保授权管理的有效落实。

**人员和权限管理:**公司通过细化部门岗位职责和权限、建立培训机制、优化考核机制，加强



人员管理。公司依据重要业务部门、关键岗位之间不相容、适当分离及相互制约的原则，逐步细化各部门的岗位职责，合理分配人员权限，完善各业务系统的权限管理，确保人员岗位精确覆盖业务操作各个环节；公司通过加强人员业务知识、专业技能、系统操作、合规风控、职业道德等培训，提高员工素质、防范道德风险、减少操作失误；同时公司通过激励与约束并行的绩效考核机制，提高员工责任心，降低操作差错。

系统管理：公司建立设计严谨、逻辑清晰的业务生产及业务管理系统，设置必要的操作风险控制节点，通过系统自动化，有效控制业务操作中的人为失误与差错；公司建立操作风险系统，收集操作风险数据，识别重点业务的重点操作风险部位，形成操作风险预警机制；同时通过建立应急预案和定期演练，在信息系统发生故障时，降低负面影响，减少实际损失。

#### ④ 流动性风险的控制

公司主要通过对流动性的统筹管理、跟踪监测以及应急测试等措施控制流动性风险。

流动性统筹管理：公司坚持资金的整体运作，由资金运营部负责管理公司的资金调配。在境内交易所和银行间市场，公司具有较好的资信水平，维持着比较稳定的拆借、回购等短期融资通道；同时也通过公募或私募的方式发行公司债、次级债、收益凭证等补充公司长期运营资金，从而使公司的整体流动性状态保持在较为安全的水平。

公司不断完善流动性管理体系，在微观操作上，公司强化资金头寸管理，确保日间流动性安全；在宏观策略上，公司建立优质流动性资产储备池，持有充足的高流动性资产以满足公司应急流动性需求。

流动性跟踪监测：公司对未来一段时间内的资金负债情况进行每日监测与评估，通过对特定时间点和时间段的资产负债匹配情况的分析以及对资金缺口等指标的计算，来评估公司的资金支付能力。

公司严格按照监管部门风险控制指标中有关规定进行证券投资，并设定了更为严格的公司预警指标，对达到公司预警指标的投资及时跟踪和处置；定期开展流动性风险的监测分析、压力测试和情景分析，监测流动性风险限额执行情况，并结合流动性风控指标测算情况合理制定公司融资计划。

流动性应急测试：公司制定流动性风险应急方案，并定期开展应急演练，模拟极端情形下应急处置流程，有效提高风险化解能力，防范公司流动性风险事件。

### ⑤声誉风险的控制

公司将声誉风险管理纳入全面风险管理体系，建立声誉风险管理机制，要求各部门、分公司、营业部、子公司主动有效地防范声誉风险和应对声誉风险事件，对经营管理过程中存在的声誉风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理，最大限度地减少对公司声誉及品牌形象造成的损失和负面影响。

公司在开展业务过程中对合规性风险、操作风险、流动风险、信用风险等进行充分评估，从源头上防范声誉风险。强化舆情监测，落实舆情报告制度，积极应对、妥善预防声誉风险，强化与媒体的沟通，为公司营造良好的媒体环境。

报告期内，整体舆情平稳，未发生重大声誉风险事件。

### 3、公司合规风控及信息技术投入情况

公司高度重视合规风控工作，加强合规风控专业队伍建设，推进合规风控管理相关信息技术系统和数据治理建设，完善重点业务和子公司风险合规管理机制，持续推进风险合规管理体系建设工作，确保公司经营合法合规、风险可控。公司合规风控投入主要包括（母公司口径）：合规风控管理相关信息系统购置和开发支出、合规风控部门日常运营费用以及合规风控人员投入等。2020年，公司合规风控投入总额为14847.16万元。

2020年，公司紧跟行业技术发展趋势与监管要求，提升东吴金融科技的影响力，重点开展新一代交易系统全面迁移、金融科技规划、管理信息化自主研发、南方中心灾备体系建设、数据平台与数据应用建设等工作。公司高度重视金融科技发展，以内部咨询视角规划十四五期间金融科技发展的宏伟蓝图，促进公司逐步实现自主可控、中台赋能与全面数字化转型的战略目标。公司投入重点力量完成行业首个自主可控新一代交易系统A5的全面建设，核心技术指标较上一代交易系统提升逾十倍，在高并发下依旧保持毫秒级的响应，依靠自研的内存数据库与业务中间件彻底实现了核心IT技术国产化，获得第七届证券期货科学技术奖二等奖。公司持续加大软件自主研发规模，加强人才队伍的建设，推进行业及公司重点信息技术项目的实施，在自主架构设计、技术平台构建、应用系统开发等方面取得了长足的进步。东吴证券信息技术投入主要包括：IT投入固定资产和无形资产的折旧摊销费用、IT日常运营费用、基础设施租赁费用、自主研发费用及IT人员投入等。公司信息技术投入总额为2.68亿元。

## (五) 内部控制实施情况

√适用 □不适用

### 1、公司动态风险控制指标监控和补足机制建立情况

根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》等相关规定，公司制定了动态风险控制指标监控和补足相关制度，明确了有关风险控制指标的动态监控和补足机制、压力测试机制、建立风险管理及控制指标监控系统。

公司按要求完成净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表以及流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表、风险控制指标计算表的编制工作并及时向监管机构报送。公司设立专人专岗对风险控制指标进行动态监控，按照风控指标报表的编制要求及时调整监控内容，不断完善动态监控系统，并定期对动态监控系统进行有效性评估，保证了净资本、流动性风控指标动态监控系统正常有效运行。公司建立了资本补足机制，当主要风控指标触及监管预警标准时，采用压缩风险较高、指标占用较大业务规模，发行次级债，股权融资等方式补充资本，有效落实风险控制指标补足机制。公司定期实施综合压力测试，并对重大业务及可能影响风险控制指标的情况进行了多次压力测试，对公司可能面临极端情况的冲击下，公司财务指标和风控指标的影响进行评估，并针对可能的结果制定风险应对措施。

### 2、报告期内公司风险控制指标触及预警标准、不符合规定标准的情况及采取的整改措施、整改效果

报告期内，公司各项业务发展稳健，各项主要风险控制指标均未触及预警标准且符合监管规定标准，整体风控指标运行情况良好。

## 四、公司因不适用准则规定或国家秘密、商业秘密等特殊原因，未按准则披露的情况和原因说明

□适用 √不适用

## 第五节 重要事项

### 一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

#### (一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

√适用 □不适用

公司历来重视对股东的合理投资回报，执行持续、稳定的利润分配政策。在公司盈利、符合净资本等监管要求及公司正常经营和长期发展的前提下，公司将积极采取现金方式分配股利。公司《章程》第一百九十九条明确了公司利润分配政策，第二百条明确了公司股利分配具体方案的决策程序及公司调整利润分配政策的决策程序。

公司现金分红政策的制定、执行或调整情况符合相关法律法规的规定；分红标准和比例明确清晰；相关的决策程序和机制完备；中小股东有充分表达意见和诉求的机会，中小股东的合法权益得到了充分保护。

报告期内，公司实施了 2019 年度利润分配方案：以 38.78 亿股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 1.30 元（含税），共计派发现金红利 5.04 亿元（含税）。

## （二）公司近三年（含报告期）的普通股股利分配方案或预案、资本公积金转增股本方案或预案

单位：元币种：人民币

分红年度	每 10 股送红股数（股）	每 10 股派息数（元）（含税）	每 10 股转增数（股）	现金分红的数额（含税）	分红年度合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润	占合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润的比率（%）
2020 年	0	1.57	0	602,694,330.86	1,707,245,952.72	35.30
2019 年	0	1.30	0	504,090,237.04	1,037,174,921.82	48.60
2018 年	0	0.90	0	269,738,847.00	358,411,175.29	75.26

公司 2020 年度利润分配方案：

根据《中华人民共和国公司法》、《公司章程》有关规定，公司拟订了 2020 年度利润分配方案，具体情况如下：

经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，公司 2020 年度合并报表中归属于母公司所有者的净利润为 1,707,245,952.72 元，母公司 2020 年度净利润为 1,523,942,876.15 元。

根据《公司法》、《金融企业财务规则》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及中国证监会发布的《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》（证监机构字[2007]320 号）、《上市公司监管指引第 3 号——上市公司现金分红》等相关规定，母公司分配当年净利润时应分别提取法定公积金、交易风险准备金和一般风险准备金，具体为：按税后利润的 10%提取法定公积金 152,394,287.62 元、按税后利润的 10%提取交易风险准备金 152,394,287.62 元、按税后利润的 10%提取一般风险准备金 152,394,287.62 元、按资产管理产品管理费收入的 10%计提一般风险准备金 9,247,523.81 元，四项合计金额为 466,430,386.67 元，扣除上述提取后，母公司 2020 年当年实现的未分配利润为 1,057,512,489.48 元，加上年初未分配利润 2,929,729,702.05 元，减去

2020 年已分配的现金股利 504,090,237.04 元，减去 2020 年所有者权益内部结转对未分配利润的影响 -2,605,339.02 元，2020 年末累计未分配利润为 3,485,757,293.51 元。

综合考虑公司长远发展和投资者利益，2020 年度公司利润分配方案为：

以公司实施分配方案时股权登记日在册的全体股东所持股份数为基数（扣除公司回购专户持有的本公司股份后的股份数）拟向全体股东每 10 股派送现金红利 1.57 元（含税），以公司现有扣除回购股份后的股本 3,838,817,394 股计算，共派送现金红利 602,694,330.86 元，占当年母公司可供股东现金分配的利润比例为 56.99%，占当年合并报表中归属于母公司所有者的净利润比例为 35.30%。本次分配后，母公司剩余未分配利润 2,883,062,962.65 元，转入下一年度。

### （三） 以现金方式要约回购股份计入现金分红的情况

适用 不适用

### （四） 报告期内盈利且母公司可供普通股股东分配利润为正，但未提出普通股现金利润分配方案预案的，公司应当详细披露原因以及未分配利润的用途和使用计划

适用 不适用

## 二、承诺事项履行情况

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

适用 不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行
与首次公开发行相关的承诺	解决同业竞争	苏州国际发展集团有限公司	苏州国际发展集团有限公司出具了《有关消除或避免同业竞争的承诺函》，承诺苏州国际发展集团有限公司及其附属公司、参股公司：将不会在中国境内单独或与他人，以任何形式（包括但不限于投资、并购、联营、合资、合作、合伙、承包或租赁经营、购买上市公司股票或参股）直接或间接从事或参与或协助从事或参与任何与前述本公司开展的业务构成竞争或可能构成竞争的业务或活动。目前及将来不会利用在发行人的控股股东地位，损害发行人及其他发行人股东的利益。	永久有效	否	是

### （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，公司就资产或项目是否达到原盈利预测及其原因作出说明

已达到 未达到 不适用

**(三) 业绩承诺的完成情况及其对商誉减值测试的影响**

□适用 √不适用

**三、报告期内资金被占用情况及清欠进展情况**

□适用 √不适用

**四、公司对会计师事务所“非标准意见审计报告”的说明**

□适用 √不适用

**五、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明****(一) 公司对会计政策、会计估计变更原因及影响的分析说明**

√适用 □不适用

报告期内，本公司因实施财政部新修订和颁布的准则的影响详见“第十一节财务报告”之“附注3、33 重要会计政策和会计估计的变更”

**(二) 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明**

□适用 √不适用

**(三) 与前任会计师事务所进行的沟通情况**

□适用 √不适用

**(四) 其他说明**

□适用 √不适用

**六、聘任、解聘会计师事务所情况**

单位：万元币种：人民币

	现聘任
境内会计师事务所名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬	96
境内会计师事务所审计年限	4

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	40
保荐人	南京证券股份有限公司	3,180

注：保荐费为公司 2020 年配股保荐费。

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

√适用 □不适用

报告期内，公司续聘安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为公司 2020 年度年度会计报表和内部控制审计服务机构，对公司财务报告和内部控制进行审计，聘期一年，审计服务费为 136 万

元。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

## 七、面临暂停上市风险的情况

### (一) 导致暂停上市的原因

适用 不适用

### (二) 公司拟采取的应对措施

适用 不适用

## 八、面临终止上市的情况和原因

适用 不适用

## 九、破产重整相关事项

适用 不适用

## 十、重大诉讼、仲裁事项

本年度公司有重大诉讼、仲裁事项 本年度公司无重大诉讼、仲裁事项

## 十一、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况

适用 不适用

公司及董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人在披露报告期内不存在未履行法院生效判决、不存在所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

## 十二、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

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

## 十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

### (一) 相关激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

(二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

十四、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用



**2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**

适用 不适用

经公司第三届董事会第三十一次（临时）会议和第三届董事会第三十六次（临时）会议审议批准，公司全资子公司东吴创新资本以现金方式向苏州资产管理有限公司增资，认缴股本 6 亿元，出资金额 7.44 亿元。东吴创新资本已与各相关方签署了增资协议，实缴资本金已到位。增资完成后，公司与东吴创新资本合计持有苏州资产管理有限公司 20%的股权。

**3、临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(四) 关联债权债务往来****1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项**

适用 不适用

**2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**

适用 不适用

**3、临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(五) 其他**

适用 不适用

**十五、重大合同及其履行情况****(一) 托管、承包、租赁事项****1、托管情况**

适用 不适用

**2、承包情况**

适用 不适用

**3、租赁情况**

适用 不适用

**(二) 担保情况**

适用 不适用

## (三) 其他重大合同

□适用 √不适用

## 十六、其他重大事项及期后事项

√适用 □不适用

## (一) 分支机构设立、迁址、撤销情况

## 1、新设分公司、营业部

序号	名称	设立时间
1	东吴证券股份有限公司宁波分公司	2020. 6. 18
2	东吴证券股份有限公司杭州金城路证券营业部	2020. 1. 23
3	东吴证券股份有限公司绍兴胜利东路证券营业部	2020. 8. 6
4	东吴证券股份有限公司苏州姑苏区胥江路证券营业部	2020. 11. 19
5	东吴证券股份有限公司慈溪寺山路证券营业部	2020. 12. 7
6	东吴证券股份有限公司宁波江东北路证券营业部	2020. 12. 14

## 2、营业部迁址

序号	迁址后名称	迁址前名称	备注
1	东吴证券股份有限公司苏州吴江区中山北路证券营业部	东吴证券股份有限公司吴江鲈乡南路证券营业部	
2	东吴证券股份有限公司苏州工业园区苏州大道东证券营业部	东吴证券股份有限公司苏州胥江路证券营业部	
3	东吴证券股份有限公司苏州相城大道证券营业部	东吴证券股份有限公司苏州相城太平证券营业部	
4	东吴证券股份有限公司吴江体育路证券营业部	东吴证券股份有限公司吴江中山北路证券营业部	
5	东吴证券股份有限公司宜兴阳羨东路证券营业部	东吴证券股份有限公司宜兴解放东路证券营业部	
6	东吴证券股份有限公司无锡新华路证券营业部	东吴证券股份有限公司无锡荡口鹅湖路证券营业部	
7	东吴证券股份有限公司宁波前河南路证券营业部	东吴证券股份有限公司宁波江南路证券营业部	
8	东吴证券股份有限公司太仓浏河	东吴证券股份有限公司太仓浏河	同一镇区，未更名

	镇证券营业部	镇证券营业部	
9	东吴证券股份有限公司苏州相城区青龙港路证券营业部	东吴证券股份有限公司苏州相城高铁新城证券营业部	
10	东吴证券股份有限公司苏州吴中区东安路证券营业部	东吴证券股份有限公司苏州吴中区郭新东路证券营业部	
11	东吴证券股份有限公司嘉兴纺工路证券营业部	东吴证券股份有限公司嘉兴常秀街证券营业部	
12	东吴证券股份有限公司南京分公司	东吴证券股份有限公司南京分公司	
13	东吴证券股份有限公司南京国睿大厦证券营业部	东吴证券股份有限公司南京中山南路证券营业部	
14	东吴证券股份有限公司上海奉贤程普路证券营业部	东吴证券股份有限公司上海奉贤环城东路证券营业部	

### 3、撤销

序号	分支机构名称	撤销日期
1	东吴证券股份有限公司淄博人民西路证券营业部	2020.3
2	东吴证券股份有限公司张家港塘桥镇证券营业部	2020.3
3	东吴证券股份有限公司昆山祖冲之南路证券营业部	2020.3
4	东吴证券股份有限公司张家港杨舍镇沙洲中路证券营业部	2020.6
5	东吴证券股份有限公司苏州吴江区桃源镇华盛大道证券营业部	2020.6
6	东吴证券股份有限公司北京宣武门证券营业部	2020.12
7	东吴证券股份有限公司昆山高新区前进西路证券营业部	2021.2
8	东吴证券股份有限公司苏州广济北路证券营业部	2021.2
9	东吴证券股份有限公司苏州友新路证券营业部	2021.2
10	东吴证券股份有限公司贵州分公司	2021.3

#### (二) 公司及子公司收到的行政监管措施及整改情况

1、2020年4月9日，中国证监会上海证监局下发了〔2020〕86号行政监管措施决定书

东吴基金收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对东吴基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行整改，并对公司相关责任人员采取出具警示函措施。东吴基金高度重视，按照法律法规相关要求全面梳理了相关业务流程，制定相关整改措施，落实整改工作，东吴基金已完成整改工作并向监管部门提交了整改报告。

2、2020 年 11 月 26 日，中国证监会福建证监局下发了（2020）46 号行政监管措施决定书

东吴期货泉州营业部被福建证监局出具了责令改正函的监管措施（福建证监局【2021】46 号文），东吴期货积极指导泉州营业部及时完成规范整改工作，后经福建证监局验收检查，2021 年 3 月 9 日，福建证监局向东吴期货泉州营业部出具了《关于东吴期货有限公司泉州营业部整改验收意见的函》（闽证监函（2021）74 号），泉州营业部通过验收检查。

### （三）前期已披露诉讼事项进展及新增诉讼

序号	起诉(申请)方	应诉(被申请)方	案由	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)基本情况及诉讼进展
1	公司	中弘卓业集团有限公司	公司起诉中弘卓业集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金 2.5 亿元及相应的利息、违约金，并承担诉讼费、律师费等费用。	中弘卓业集团有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。判决生效后，公司申请强制执行。2020 年 6 月 15 日第一次拍卖，第一次拍卖流拍后以一拍保留价抵债。法院裁定终结本次执行。公司发现被执行人有可供执行财产的，可以申请恢复执行。
2	公司	张跃飞	公司起诉张跃飞承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金 5,000 万元及相应的利息、违约金，并承担诉讼费、律师费等费用	张跃飞股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。2018 年 12 月 25 日作出一审判决，支持本公司诉讼请求，判决生效后，公司申请强制执行，因未取得处置权终结本次执行程序。公司将积极推进后续执行程序。
3	公司	浙江大东南集团有限公司、黄水寿、黄飞刚	公司起诉大东南集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金 2 亿元以及相应利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用；要求黄水寿、黄飞刚对上述全部债务承担连带清偿责任。	大东南集团有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。目前判决已生效，公司就保证人申请强制执行，正在执行程序中。另大东南进入破产重整，已收到首期分配款。
4	公司	深圳市江河资本管理有限公司	公司起诉深圳市江河资本管理有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 7,131.19 万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	深圳市江河资本管理有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。判决生效后，公司申请执行，执行中获得部分清偿，法院裁定终结本次执行。公司发现被执行人有可供执行财产的，可以申请恢复执行。
5	公司	绍兴金晖越商投资合伙企业(有限合伙)	公司起诉绍兴金晖越商投资合伙企业(有限合伙)承担股票质押式回购业务违约的	借款本金余额 4,817.55 万元及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	绍兴金晖越商投资合伙企业(有限合伙)股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。判决生效后，公司申请执行，正在执行过程中。

序号	起诉(申请)方	应诉(被申请人)方	案由	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)基本情况及诉讼进展
			民事责任		
6	公司	长城影视文化企业集团有限公司	公司起诉长城影视文化企业集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 2.9 亿元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	长城影视文化企业集团有限公司股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼。判决生效后,公司申请执行,全额执行到位,执行已终结。
7	公司	国购投资有限公司、袁启宏、国购产业控股有限公司	公司起诉国购投资有限公司承担 16 国购 01 债券违约的民事责任	债券本金 4,861.9 万元以及相应的利息,并承担律师费、诉讼费等费用;要求袁启宏以其质押物对前述债务承担清偿责任;要求国购控股对前述债务承担连带清偿责任。	国购投资有限公司 16 国购 01 债券违约,公司向安徽省高级人民法院提起诉讼。法院作出判决,支持公司诉讼请求。因国购投资有限公司、合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司已被合肥中院裁定进入破产程序,目前已申报债权。
8	公司	上海华信国际集团有限公司	公司起诉上海华信国际集团有限公司承担 18 沪信 02 违约的民事责任	债券本金 3,000 万元以及相应的利息,并承担律师费、诉讼费等费用。	上海华信国际集团有限公司 18 沪信 02 违约,公司向苏州工业园区人民法院提起诉讼。法院作出判决,支持公司诉讼请求。债务人上海华信已进入破产清算程序,已向管理人申报债权,且债权已经管理人审查认定。
9	公司	安徽省外经建设集团有限公司	公司起诉安徽省外经建设集团有限公司承担 16 皖经 02、16 皖经 03 债券违约的民事责任	债券本金 9,993 万元以及相应利息,并承担律师费、诉讼费等费用。	安徽省外经建设集团有限公司 16 皖经 02、16 皖经 03 债券违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院将该案件移送合肥中院管辖。合肥中院已于 2020 年 10 月 20 日开庭审理。2020 年 12 月 15 日收到判决书,支持公司诉请,该判决已生效。2020 年 12 月 25 日,合肥中院裁定受理安徽省华安外经建设(集团)有限公司破产重整一案。
10	公司	海航实业集团有限公司	公司起诉海航实业集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 27,581.74 万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	海航实业集团有限公司股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼。海南一中院已于 2020 年 6 月 18 日开庭。2021 年 3 月 15 日法院判决支持公司诉请,该判决尚未生效。另 2021 年 2 月 10 日,海南高院受理海航实业集团有限公司破产重整一案,公司已向管理人申报债权。
11	公司	金花投资控股集团有限公司、吴一坚	公司起诉金花投资控股集团有限公司承担股票质	借款本金余额 2.7 亿元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等	金花投资控股集团有限公司股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼,法院已调解结案,后公司申

序号	起诉(申请)方	应诉(被申请人)方	案由	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)基本情况及诉讼进展
			押式回购业务违约的民事责任	费用;要求吴一坚对上述全部债务承担连带清偿责任。	请执行,全额执行到位,执行已终结。
12	公司	高玉根	公司起诉高玉根承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 1.34 亿元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	高玉根股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼。法院于 2020 年 12 月 22 日判决,支持公司诉请,判决已生效。公司已申请执行,正在执行过程中。
13	公司	长海县獐子岛投资发展中心、长海县獐子岛大耗经济发展中心	公司起诉长海县獐子岛投资发展中心承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 1.4 亿元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用;要求长海县獐子岛大耗经济发展中心以其质押物对上述债务承担清偿责任。	长海县獐子岛投资发展中心股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼。法院于 2020 年 9 月 17 日开庭。2021 年 1 月 19 日收到法院判决,支持公司诉请,该判决已生效。公司已申请执行,正在执行过程中。
14	公司	山东永华投资有限公司、王勇、张树芳、西王集团有限公司	公司起诉山东永华投资有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 1.32 亿元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用;要求西王集团有限公司以其质押物对上述债务承担清偿责任;要求王勇、张树芳、西王集团有限公司对上述债务承担连带清偿责任。	山东永华投资有限公司股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼。已于 2020 年 12 月 22 日收到判决书,支持公司诉请,被告已上诉。
15	公司	北京昂展科技发展有限公司、成都市家锦置业有限公司	公司起诉北京昂展科技发展有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 26,910 万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用;要求成都市家锦置业有限公司以其抵押物对上述债务承担清偿责任。	北京昂展科技发展有限公司股票质押式回购业务违约,公司在苏州中院提起诉讼。2020 年 8 月 31 日双方调解结案。因债务人未履行调解协议,公司已申请执行,正在执行过程中。
16	公司	上海大新华实业有限公司	公司起诉上海大新华实业有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额 13,750 万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	上海大新华实业有限公司股票质押式回购业务违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院已判决,支持公司诉请,被告已上诉。
17	公司	新沂必康、李宗松	公司起诉新沂必康新医药产业综合体投资有限公司、李宗松承担股票质押式回购	借款本金余额 19,741.18 万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	新沂必康新医药产业综合体投资有限公司、李宗松质押式回购合同违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。2020 年 11 月 19 日判决,支持公司诉请,被告已上诉。

序号	起诉(申请)方	应诉(被申请)方	案由	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)基本情况及诉讼进展
			业务违约的民事责任		
18	公司	敦化康平投资	公司起诉敦化市康平投资有限责任公司承担证券回购合同违约的民事责任	借款本金余额 13,036.11 万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	敦化市康平投资有限责任公司证券回购合同违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。法院于 12 月 14 日开庭。
19	东吴创业投资有限公司	吕国才、宋美容、吕艳坤、辽宁国美农牧集团有限公司、辽宁国美农牧集团绿色养殖有限公司、辽宁国美农牧集团生物有机肥有限公司、辽宁国美农牧集团牧业有限公司、昌图国美投资管理有限公司	公司起诉吕国才、宋美容、吕艳坤等被告承担未按股权回购协议支付股权回购款项违约的民事责任	吕国才、宋美容、吕艳坤支付股权回购款 2,904.11 万元及利息,并承担相应违约金、损失赔偿金、诉讼费等;其他被告承担连带清偿责任。	吕国才、宋美容、吕艳坤等被告未按股权回购协议支付股权回购款项,东吴创投向苏州市工业园区人民法院提起诉讼。2019 年 6 月 10 日经法院审理判决东吴创投胜诉,目前正在执行过程中。
20	江南农商行	天弘基金管理有限公司	原告江南农商行起诉被告天弘基金管理有限公司承担违约赔偿损失约为 2.13 亿元,列公司为第三人,承担连带责任。	被告天弘基金管理有限公司承担违约赔偿损失约为 2.13 亿元,列公司为第三人,承担连带责任。	常州中院已立案,待开庭。

截止目前,公司作为产品管理人(代资产管理计划)涉及的涉案金额在 1,000 万元以上的诉讼、仲裁案件进展情况如下:

序号	起诉(申请)方	应诉(被申请)方	案由	审理法院/仲裁机构	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)基本情况及诉讼进展
1	公司	富贵鸟股份有限公司、爱建证券有限责任公司	公司起诉富贵鸟股份有限公司承担“16 富贵 01”债券违约的民事	上海国际经济贸易仲裁委员会	债券本金 5,000 万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、仲裁费	富贵鸟股份有限公司“16 富贵 01”债券违约,公司代表资管计划向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。泉州中院已裁定进入破产清算程序,

			责任		等费用；爱建证券有限责任公司对上述债务承担连带清偿责任。	资产拍卖结束，收到分配方案，待分配。
2	公司	国购投资有限公司、合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司	公司起诉国购投资有限公司承担“17 国购 01”债券违约的民事责任	苏州市中级人民法院	债券本金 7,000 万元以及相应的利息，并承担律师费、诉讼费等费用，要求合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司对前述债券承担连带清偿责任。	国购投资有限公司“17 国购 01”债券违约，公司代表资管计划向苏州市中级人民法院提起诉讼，法院于 2019 年 12 月 18 日判决，支持公司诉请，判决已生效。2020 年 6 月 12 日，安徽合肥市中院裁定国购投资有限公司等 43 家公司合并重整，目前已申报债权。
3	公司	国购投资有限公司、袁启宏、国购产业控股有限公司	公司起诉国购投资有限公司承担“16 国购 01”、“16 国购 02”、“16 国购 03”债券违约的民事责任	安徽省高级人民法院	债券本金 12,040 万元及相应的利息，并承担律师费、诉讼费等费用；要求袁启宏以其质押物对前述债务承担清偿责任；要求国购产业控股有限公司对前述债务承担连带清偿责任。	国购投资有限公司“16 国购 01”、“16 国购 02”、“16 国购 03”债券违约，公司代表资管计划向安徽省高级人民法院提起诉讼。法院于 2019 年 3 月 1 日立案受理，并于 5 月 21 日开庭审理，后作出判决，支持公司诉讼请求。目前判决已生效。因国购投资有限公司、合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司已被合肥中院裁定进入破产程序，目前已申报债权。
4	公司	康得投资集团有限公司	公司起诉康得投资集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	苏州市中级人民法院	借款本金余额 46,300 万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	康得投资集团有限公司股票质押式回购业务违约，公司代表资管计划向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院判决公司胜诉，后申请执行，目前法院已依职权终结本次执行。
5	公司	新沂必康、李宗松、GUOXIAOJIA	公司起诉新沂必康、李宗松、GUOXIAOJIA 承担质押式证券回购合同违约的民事责任	苏州市中级人民法院	借款本金余额 28443 万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用	新沂必康、李宗松、GUOXIAOJIA 质押式证券回购合同违约，公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。2020 年 8 月 18 日证据交换，待开庭。
6	公司	李宗松、新沂必康、GUOXIAOJIA	公司起诉李宗松、新沂必康、GUOXIAOJIA 承担质押式证券回购合同违约的民事责任	苏州市中级人民法院	借款本金余额 2746.08 万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用	李宗松、新沂必康、GUOXIAOJIA 质押式证券回购合同违约，公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。2020 年 8 月 18 日证据交换，待开庭。



7	上海浦发银行苏州分行	公司	上海浦发银行苏州分行就公司资管合同违约向贸仲委上海分会提起仲裁	上海国际经济贸易仲裁委员会	全额兑付未付款项 3611.63 万元	公司资管合同违约，未全额兑付资管计划资金，上海浦发银行苏州分行向贸仲委上海分会提起仲裁。已调解结案并已按调解协议分配完毕。
8	公司	何志涛	公司起诉何志涛承担股票质押式回购业务违约的民事责任	苏州市中级人民法院	借款本金余额 19,530 万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用	何志涛股票质押式回购业务违约，公司代表“东吴汇智 7 号”集合资管计划向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院于 2020 年 2 月 18 日立案受理，已进行证据交换。

#### （四）公司回购事项

2021年3月5日，公司召开第三届董事会第四十次（临时）会议审议通过了《关于回购公司A股股份的议案》。2021年3月10日，公司披露了《东吴证券关于以集中竞价交易方式回购A股股份的回购报告书》。2021年3月30日，公司完成回购，已完成回购公司A股股份38,799,814股，占公司总股本的0.9999%，回购最高价为人民币9.76元/股，回购最低价为人民币8.78元/股，回购均价为人民币9.05元/股，使用资金总额为人民币350,977,160.28元（不含交易费用）。公司本次回购A股股份全部存放于公司回购专用证券账户，拟作为限制性股票股权激励计划的股票来源。

#### （五）董监高变动情况

2021年4月9日，公司董事会收到公司副总裁、董事会秘书冯恂女士提交的书面辞职报告，冯恂女士因工作变动原因，申请辞去公司副总裁、董事会秘书职务。公司指定公司执委杨伟先生代行董事会秘书职责，代行期限不超过三个月。

2021年4月23日，公司完成第四届董监事会换届选举、高管聘任等事项，具体详见2021年4月24日公司公告。

### 十七、积极履行社会责任的工作情况

#### （一）上市公司扶贫工作情况

√适用 □不适用

##### 1. 精准扶贫规划

基本方略：公司以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，紧紧围绕“五位一体”总体布局和“四个全面”战略布局，积极落实《中共中央国务院关于打赢脱贫攻坚战的决定》、《“十三五”脱贫攻坚规划》以及《中国证监会关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》的要求，响应中国证券业协会“一司一县”、“一县一企”结对帮扶行动号召，把打赢脱贫攻坚战作

为崇高的政治责任。公司发挥证券行业优势，以消除贫困为目标，以精准扶贫为手段，以制度创新为动力，明确教育、产业、金融三大帮扶举措，形成多层次、多渠道、多方位的精准扶贫工作格局，不断提升贫困地区自我发展能力。

总体目标：公司利用自身专业优势，在贫困地区设立证券营业部，与当地政府建立长效帮扶机制，成为当地政府的金融顾问，支持贫困地区企业利用多层次资本市场融资，资助贫困乡镇留守儿童完成学业，实现教育脱贫。

主要任务：

(1) 深入了解和掌握贫困地区企业的实际情况，因地制宜地完善企业发展规划，发挥专业优势，通过资本市场服务实体经济。

(2) 在贫困地区设立证券营业部等分支机构，帮助当地企业融资，扎实开展居民投资理财和投资者教育等工作。

(3) 增加贫困地区教育、医疗等基础设施建设投入，支持贫困地区幼儿园、中小学的宿舍、食堂、图书室以及医疗卫生室等基础设施建设。

(4) 资助贫困地区中小學生，使他们在学业中有基本的生活保障，充实更多的知识与技能，再回报家乡和社会。

(5) 设立防贫预警专项资金，向困难家庭给予资金帮扶，防止因病、因灾、因学、因意外等情况致贫或返贫，增加当地民生福祉。

保障措施：

(1) 与对口帮扶地区签订战略合作协议，保障扶贫工作的落实。

(2) 发挥当地分支机构扶贫阵地作用，探索恰当的扶贫模式，推进落实既定事项。

(3) 选派业务骨干赴贫困地区走访调研，保持金融团队的稳定与专业性，充分挖掘、提升当地企业的潜力，支持当地企业利用多层次资本市场融资。

(4) 发起设立“东吴证券慈善基金会”，依托专业的慈善组织开展精准扶贫工作。

## 2. 年度精准扶贫概要

公司始终坚持经济效益与社会效益并重，秉持“待人忠、办事诚、共享共赢”的核心价值观，

扎实开展精准扶贫、捐资助学、改善民生等公益慈善工作。报告期内，公司及下属子公司合计出资 862.84 万元，专项用于精准扶贫。

### （1）持续教育扶贫，改善教学环境

报告期内，公司持续开展“牵手行动”教育帮扶，向贵州省铜仁市石阡县、思南县及松桃苗族自治县等 3 个国家级贫困县捐赠 100 万元，结对帮扶 500 名建档立卡的贫困学生，资助其完成学业。在“六一”儿童节前后，前往思南县、松桃苗族自治县开展捐资助学活动，将助学帮扶资金送到建档立卡贫困学生手中，并对公司近年来资助的部分学生进行了入户走访慰问，赠送书包、文具等学习用品。积极助力贫困地区学校教学设施建设，向甘肃省天水市秦安县（国家级贫困县）捐赠 24.15 万元，用于幼儿园教学楼防水设施建设；向贵州省铜仁市沿河县（脱贫攻坚挂牌督战县）石灰小学捐赠 13.7 万元，修建塑胶篮球场、篮球架、乒乓球台等基础教学设施；向山西省延安市延长县（国家级贫困县）捐赠 10 万元，改善延长县交口镇中心幼儿园的硬件设施和幼儿生活质量；向贵州省铜仁市思南县特殊教育学校捐赠多功能数码复合一体机，价值 2.68 万元，有效改善贫困地区学校教学环境，提高教师办公现代化水平。

### （2）用好扶贫阵地，促进产业发展

2016 年 12 月，公司获批在贵州省铜仁市成立营业部，一方面填补了公司在中西部贫困地区没有营业网点的空白，另一方面也成为公司精准帮扶铜仁的前沿阵地。报告期内，铜仁营业部积极参加金融服务脱贫攻坚铜仁小分队，赴贵州省铜仁市碧江区、万山区、玉屏县等 10 个县区开展帮扶调研，结合县域实际深入挖掘精准帮扶项目；积极对接铜仁市城投集团、贵州康盛达食品有限公司、贵州金羽农牧发展有限公司等本地企业，扎实做好财务顾问等金融服务工作；大力邀约江西正邦科技集团、贵州东太企业集团、铁骑力士集团等国内优质企业，赴贵州省石阡县、思南县开展产业合作项目调研考察；同时，公司联合控股子公司东吴期货在铜仁市 12 个县区扎实开展金融知识专题培训和投资者教育，集中培训人数达 200 余人。报告期内，公司为贵州省铜仁市产业发展发挥了积极作用，帮助当地招商引资工作取得新突破，引进中国 500 强企业江西正邦集团入驻贵州省铜仁市石阡县。2020 年 6 月 11 日，正邦科技集团与贵州省石阡县签署了年出栏 50 万头“正邦福猪”标准化养殖生态循环产业发展项目协议，该项目总投资 8.6 亿元，将建成仔猪繁殖场 1 个，育肥场 30 个，总建筑面积约 10.7 万平方米，该项目已于 2020 年 9 月开工建设，预计 2021 年 5 月投产。项目建成后，将成为贵州乃至我国西南片区最大的种猪繁殖场。

### （3）发挥专业优势，助力乡村振兴

公司大力支持乡村振兴战略，充分发挥专业优势，针对贫困地区企业“融资难、融资贵”等现状，选派专业团队为企业出谋划策，积极运用金融手段扶持贫困地区乡村振兴项目。2020年3月30日，公司作为主承销商，帮助重庆市黔江区（国家级贫困县）区属国有重点企业重庆鸿业实业(集团)有限公司，成功发行重庆鸿业实业(集团)有限公司非公开发行2020年扶贫项目收益专项公司债券(第一期)，并在上海证券交易所挂牌转让，债券简称S20鸿业1，债券代码166485.SH。该债券发行规模4.5亿元，募集资金扣除发行费用后用于重庆市黔江区乡村振兴文化旅游项目和补充公司流动资金。公司大力支持贫困地区企业利用多层次资本市场融资，为决战脱贫攻坚目标任务、大力实施乡村振兴战略贡献了积极力量。

#### （4）创新扶贫模式，保障农户收益

公司积极响应中国证监会、中国期货业协会关于金融服务实体经济与发挥专业优势开展扶贫工作的号召，联合控股子公司东吴期货捐赠60万元，在贵州省铜仁市石阡县开展鸡蛋价格“保险+期货”试点项目，该项目于2020年6月29日正式签约并启动，覆盖石阡县本庄镇等5个乡镇的蛋鸡养殖合作社及养殖场，覆盖蛋鸡存栏约18万羽，为农户提供累计2000吨、保期4个月的鸡蛋价格保险，承包货值累计1588万元，投保农户主体实现保费“零支出”，为农户提供价格托底保障，有效减少因农产品价格剧烈波动所导致的二次返贫现象。该项目有效填补了铜仁乃至贵州地区“保险+期货”金融手段服务“三农”实例的空白，为东西部对口帮扶模式创新提供了新思路。

报告期内，东吴期货还在云南省德宏州芒市、贵州省赫章县、新疆克州阿图什市、河南省桐柏县、河南省兰考县、贵州省纳雍县等6个国家级贫困县及河南省开封市祥符区，分别开展了玉米、鸡蛋、天然橡胶及棉花等7个“保险+期货”精准扶贫项目，为当地种植、养殖企业和农户提供价格和收入保险，累计覆盖玉米25034吨、鸡蛋1633吨、天然橡胶1500吨、棉花900吨，货值达12545万元，保障了超过20000户建档立卡贫困户的切身利益，有效带动贫困人口增收脱贫。

#### （5）成立慈善组织，巩固脱贫成果

2020年10月13日，公司全额出资1000万元发起设立的“东吴证券慈善基金会”获批成立，该基金会本着“扶贫帮困、奉献爱心、感恩社会、和谐发展”的宗旨，持续推动慈善事业发展，扎实开展精准扶贫工作，助力乡村振兴。设立贵州省铜仁市防贫预警专项资金，公司及控股子公司捐赠124.8万元，向铜仁市10个区县1073户困难家庭给予资金帮扶，防止因病、因灾、因学、因意外等情况致贫或返贫，增加当地民生福祉，助力铜仁市巩固提升脱贫攻坚成果。积极响应上交所倡议，捐赠30万元支持安徽省宿松县“爱心救助专项支持计划”，帮助未脱贫户、监测户、

边缘户面临的各种生活困难，确保已脱贫人口稳定脱贫，防止脱贫之后再返贫。

#### (6) 助力消费扶贫，促进农户增收

公司积极响应大力开展消费扶贫行动号召，助力疫情后经济社会加快恢复重启。报告期内，公司及控股子公司东吴期货累计出资 47.1 万元，采购山西省萍乡市、安徽省太湖县（国家级贫困县）及湖北等贫困地区铁皮石斛、山茶油、菜籽油、硒米、香菇、木耳脐橙等农副产品，以实际行动开展消费扶贫；同时，向安徽省太湖县捐赠 10 万元，用于太湖县北中镇莲花村发展产业，有效促进贫困户稳定增收脱贫。捐赠 20 万元，帮扶甘肃省天水市秦安县（国家级贫困县）开展农产品扶贫宣传推广，激发社会各界参与消费扶贫的积极性，帮助企业拓宽销售渠道，精准匹配供销两端，持续有力地推动消费扶贫行动形成长效机制，巩固脱贫攻坚成果。

#### (7) 兴建基础设施，改善民生环境

报告期内，控股子公司东吴期货紧紧围绕“两不愁，三保障”目标任务，向贵州省铜仁市思南县、松桃县、印江县等 8 个县区累计捐赠 80 万元，用于易地扶贫搬迁安置点基础设施建设、社会救助、医疗器材采购等民生改善项目，有效改善易地扶贫搬迁安置点人居环境，助力安置点居民安居居住、安全出行、安心就医。向河南省南阳市桐柏县（国家级贫困县）捐赠 20 万元，援建桐柏县大河镇土门村党群服务中心，打造集教育、管理、服务、展示于一体的综合服务平台，为更好地服务当地人民群众打下了坚实的基础。

报告期内，除上述精准扶贫外，公司及下属机构还出资 2824.98 万元，用于开展疫情防控、捐资助学、帮扶慰问等各类公益慈善项目。新冠肺炎疫情暴发后，公司积极驰援鄂苏两地抗击疫情，先后捐赠 1120 万元用于疫情防控，其中，500 万元驰援湖北武汉等地购置紧缺物资和医疗器械，500 万元支持苏州大学抗击新冠肺炎专项公益性项目，120 万元支持苏州市第五人民医院建设负压隔离病房。先后三次组织党团员及员工开展专项募捐活动，累计捐款 1746 人次，捐款总额超 30 万元。向苏州市慈善总会捐赠 500 万元，支持苏州公益慈善事业发展。在南京大学、苏州大学设立奖学金、奖教金、助学金，向 125 名优秀师生发放资助金 109 万元。公司全额出资 1000 万元发起设立了“东吴证券慈善基金会”，在更大范围、更宽领域、更高层次上开展公益慈善工作，为全面推进乡村振兴，巩固拓展脱贫攻坚成果贡献东吴力量。

### 3. 精准扶贫成效

适用 不适用

单位：万元币种：人民币

指标	数量及开展情况
一、总体情况	
其中：1.资金	860.1564
2.物资折款	2.688
3.帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	2063
二、分项投入	
1.产业发展脱贫	
其中：1.1 产业扶贫项目类型	<input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫 <input type="checkbox"/> 旅游扶贫 <input type="checkbox"/> 电商扶贫 <input type="checkbox"/> 资产收益扶贫 <input type="checkbox"/> 科技扶贫 <input type="checkbox"/> 其他
1.2 产业扶贫项目个数（个）	9
1.3 产业扶贫项目投入金额	390.3975
4. 教育脱贫	
其中：4.1 资助贫困学生投入金额	67.8
4.2 资助贫困学生人数（人）	339
4.3 改善贫困地区教育资源投入金额	50.5457
5.健康扶贫	
其中：5.1 贫困地区医疗卫生资源投入金额	10
7.兜底保障	
7.3 帮助贫困残疾人投入金额	32.2
7.4 帮助贫困残疾人数（人）	161
9.其他项目	
其中：9.1 项目个数（个）	16
9.2 投入金额	311.9012
9.4 其他项目说明	<p><b>1.招商引资方面。</b>帮助贵州省铜仁市招商引资工作取得新突破，促成正邦科技集团与贵州省铜仁市石阡县签署了年出栏 50 万头“正邦福猪”标准化养殖生态循环产业发展项目协议，该项目总投资 8.6 亿元，已于 2020 年 9 月开工建设，预计 2021 年 5 月投产。</p> <p><b>2.助力乡村振兴方面。</b>成功承销重庆鸿业实业(集团)有限公司非公开发行 2020 年扶贫项目收益专项公司债券(第一期)，发行规模 4.5 亿元，募集资金扣除发行费用后用于重庆市黔江区乡村振兴文化旅游项目和补充公司流动资金。</p> <p><b>3.巩固脱贫攻坚成果方面。</b>建立防贫预警专项资金池，捐赠 124.8 万元，向铜仁市 10 个区县 1073 户困难家庭给予资金帮扶；捐赠 30 万元支持安徽省宿松县“爱心救助专项支持计划”，防止因病、因灾、因学、因意外等情况致贫或返贫，巩固提升脱贫攻坚成果。</p>

	<p><b>4.消费扶贫方面。</b>出资 47.1012 万元，分别在山西省萍乡市、安徽省太湖县及湖北地区开展 3 个农副产品消费扶贫采购项目；捐赠 20 万元，帮扶甘肃省秦安县开展农产品扶贫宣传推广项目，有效促进贫困户稳定增收脱贫。</p> <p><b>5.改善民生方面。</b>捐赠 70 万元，在贵州省铜仁市思南县、松桃县、印江县等 7 个县区开展了 7 个易地扶贫搬迁安置点基础设施建设、社会救助等民生改善项目，有效改善易地扶贫搬迁安置点人居环境。捐赠 20 万元，援建桐柏县大河镇土门村党群服务中心，打造集教育、管理、服务、展示于一体的综合服务平台。</p>
三、所获奖项（内容、级别）	
1.第五届江苏慈善奖“最具爱心慈善捐赠企业或单位”——江苏省人民政府	
2.第四届苏州慈善奖“最具爱心捐赠企业（单位）”——苏州市人民政府	
3.苏州市优秀慈善单位——苏州市慈善总会	

注：情况表中含控股子公司东吴期货有限公司精准扶贫工作数据。

#### 4. 后续精准扶贫计划

2021 年 2 月 25 日，习近平总书记在全国脱贫攻坚总结表彰大会上庄严宣告，我国脱贫攻坚战取得了全面胜利，现行标准下 9899 万农村贫困人口全部脱贫，832 个贫困县全部摘帽。公司将继续贯彻落实“摘帽不摘责任、摘帽不摘政策、摘帽不摘帮扶、摘帽不摘监管”的精神，以 832 个贫困县全部摘帽为新的起点，持续开展帮扶工作，为全面推进乡村振兴，巩固拓展脱贫攻坚成果贡献东吴力量。

（1）大力推进乡村振兴产业发展引导基金，着力解决乡村融资难、融资贵等痛点，引导社会资本向特色田园、美丽乡村、农旅融合等乡村特色产业项目投资，促进产业发展，服务地方经济发展，以金融创新赋能乡村振兴。

（2）充分发挥资本市场在服务全面推进乡村振兴战略中的作用，积极通过多层次资本市场，为脱贫地区企业提供全方位融资服务，助力企业发展，服务实体经济。

（3）为脱贫地区提供多方位的资本市场教育培训服务，举办各类资本市场发展研讨会，开展业务交流，不断深入探讨证券行业支持脱贫地区实体经济发展、解决中小微企业融资难等方面的举措思路。

（4）有针对性地设计开展脱贫地区投资者教育活动，提高投资者风险责任意识，配合有关部门严厉打击金融欺诈、非法集资等非法金融活动，维护脱贫地区投资者合法权益。畅通投资者投

诉的处理渠道，完善多元化纠纷调解机制，优化资本市场生态环境，促进资本市场长期健康稳定运行。

(5) 支持脱贫地区特色产品，充分利用消费扶贫平台发挥互联网在助推脱贫攻坚中的作用，帮助脱贫地区特色产品树立品牌形象，拓宽销售市场。对于需要大批量采购的商品，公司优先考虑从定点帮扶地区购买，并建立较为长期的购货渠道，支持当地产业发展。

(6) 扎实用好“东吴证券慈善基金会”，依托专业力量，更加系统化地推进公益慈善工作。持续做好 2019 年新增帮扶 500 名建档立卡贫困学生的资助金发放和防贫预警工作，确保已脱贫人口稳定脱贫，防止脱贫之后再返贫。适时开展“粉笔画人生·携手绘百年”贵州乡村少年绘画艺术公益项目，将推广粉笔画艺术与关心关爱留守儿童完美融合，让乡村留守儿童通过粉笔画描绘梦想，以饱满的精神状态迎接建党 100 周年。

## (二) 社会责任工作情况

适用  不适用

公司将在披露 2020 年年度报告的同时，披露《东吴证券 2020 年度社会责任报告》，详见上海证券交易所网站 (<http://www.sse.com.cn>)。

## (三) 环境信息情况

### 1. 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其重要子公司的环保情况说明

适用  不适用

### 2. 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用  不适用

### 3. 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明

适用  不适用

### 4. 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用  不适用

## (四) 其他说明

适用  不适用

## 十八、可转换公司债券情况

适用  不适用



## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、普通股股本变动情况

#### (一) 普通股股份变动情况表

##### 1、普通股股份变动情况表

单位：股

	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	0	0	0	0	0	0	0	0	0
1、国家持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2、国有法人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
3、其他内资持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
其中：境内非国有法人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
境内自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、外资持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
其中：境外法人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
境外自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
二、无限售条件流通股份	3,000,000,000	100	+880,518,908	0	0	0	+880,518,908	3,880,518,908	100
1、人民币普通股	3,000,000,000	100	+880,518,908	0	0	0	+880,518,908	3,880,518,908	100
2、境内上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
3、境外上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、其他	0	0	0	0	0	0	0	0	0
三、普通股股份总数	3,000,000,000	100	+880,518,908	0	0	0	+880,518,908	3,880,518,908	100

##### 2、普通股股份变动情况说明

√适用 □不适用

2019年12月31日，经中国证监会“证监许可〔2019〕2984号”《关于核准东吴证券股

份有限公司配股的批复》，核准公司向原股东配售股份。2020 年 3 月，公司完成配股发行，发行数量 880,518,908 股。

### 3、普通股股份变动对最近一年和最近一期每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）

适用 不适用

公司本次配股方案实施完成后，考虑到总股本增加的影响，每股收益和每股净资产将被摊薄，报告期和上年同期的每股收益及发行在外的普通股加权平均数等指标具体详见财务报表附注 5.57。

### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

#### （二）限售股份变动情况

适用 不适用

## 二、证券发行与上市情况

### （一）截至报告期内证券发行情况

适用 不适用

单位：股币种：人民币

股票及其衍生证券的种类	发行日期	发行价格（或利率）	发行数量	上市日期	获准上市交易数量	交易终止日期
普通股股票类						
A 股	2020-3-19	6.8	880,518,908	2020-04-02	880,518,908	不适用
可转换公司债券、分离交易可转债、公司债类						
20 东吴 C1	2020-02-25	3.80%	10 亿元	2020-03-04	10 亿元	2023-02-24
20 东吴 C2	2020-06-10	3.80%	5 亿元	2020-06-17	5 亿元	2023-06-09
20 东吴 G1	2020-09-21	3.29%	26 亿元	2020-09-30	26 亿元	2021-09-23
20 东吴 G2	2020-09-21	3.81%	14 亿元	2020-09-30	14 亿元	2023-09-20
20 东吴 S1	2020-11-26	3.55%	28 亿元	2020-12-01	28 亿元	2021-05-24
20 东吴证券 CP001	2020-01-13	2.73%	10 亿元	2020-01-14	10 亿元	2020-03-26
20 东吴证券 CP002	2020-02-28	2.48%	8 亿元	2020-03-02	8 亿元	2020-05-28
20 东吴证券 CP003	2020-03-11	2.27%	10 亿元	2020-03-12	10 亿元	2020-06-09
20 东吴证券 CP004	2020-03-18	2.18%	10 亿元	2020-03-19	10 亿元	2020-06-16
20 东吴证	2020-03-26	1.80%	10 亿元	2020-03-27	10 亿元	2020-06-22

券 CP005						
20 东吴证 券 CP006	2020-05-22	1.59%	10 亿元	2020-05-25	10 亿元	2020-08-20
20 东吴证 券 CP007	2020-06-16	2.25%	10 亿元	2020-06-17	10 亿元	2020-09-14
20 东吴证 券 CP008	2020-06-23	2.39%	10 亿元	2020-06-24	10 亿元	2020-09-21
20 东吴证 券 CP009	2020-07-21	2.73%	10 亿元	2020-07-22	10 亿元	2020-10-19
20 东吴证 券 CP010	2020-08-19	2.65%	10 亿元	2020-08-20	10 亿元	2020-10-27
20 东吴证 券 CP011	2020-09-22	2.80%	20 亿元	2020-09-23	20 亿元	2020-11-26
20 东吴证 券 CP012	2020-10-21	2.66%	20 亿元	2020-10-22	20 亿元	2020-12-21
20 东吴证 券 CP013	2020-11-16	3.28%	20 亿元	2020-11-17	20 亿元	2021-02-03
20 东吴证 券 CP014	2020-12-18	2.85%	20 亿元	2020-12-21	20 亿元	2021-03-03

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

√适用 □不适用

#### 1、配股

2019 年 12 月 27 日，经中国证监会“证监许可〔2019〕2984 号”《关于核准东吴证券股份有限公司配股的批复》，核准公司向原股东配售股份。2020 年 3 月，公司完成配股发行，发行数量 880,518,908 股。

#### 2、公司债券

报告期内，公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一），债券简称为“20 东吴 G1”，发行规模为 26 亿元，发行利率为 3.29%，发行期限为 368 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二），债券简称为“20 东吴 G2”，发行规模为 14 亿元，发行利率为 3.81%，发行期限为 3 年。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期），债券简称为“20 东吴 S1”，发行规模为 28 亿元，发行利率为 3.55%，发行期限为 180 天。

### 3、次级债券

报告期内，公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期)(疫情防控债),债券简称为“20 东吴 C1”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 3.80%，发行期限为 3 年。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第二期),债券简称为“20 东吴 C2”，发行规模为 5 亿元，发行利率为 3.80%，发行期限为 3 年。

### 4、短期融资券

报告期内，公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第一期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP001”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.73%，发行期限为 74 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第二期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP002”，发行规模为 8 亿元，发行利率为 2.48%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第三期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP003”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.27%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第四期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP004”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.18%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第五期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP005”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 1.80%，发行期限为 89 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第六期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP006”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 1.59%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第七期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP007”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.25%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第八期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP008”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.39%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第九期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券 CP009”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.73%，发行期限为 91 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第十期短期融资券,债券简称为“20 东吴证券

CP010”，发行规模为 10 亿元，发行利率为 2.65%，发行期限为 70 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第十一期短期融资券，债券简称为“20 东吴证券 CP011”，发行规模为 20 亿元，发行利率为 2.80%，发行期限为 66 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第十二期短期融资券，债券简称为“20 东吴证券 CP012”，发行规模为 20 亿元，发行利率为 2.66%，发行期限为 62 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第十三期短期融资券，债券简称为“20 东吴证券 CP013”，发行规模为 20 亿元，发行利率为 3.28%，发行期限为 80 天。

公司发行东吴证券股份有限公司 2020 年度第十四期短期融资券，债券简称为“20 东吴证券 CP014”，发行规模为 20 亿元，发行利率为 2.85%，发行期限为 76 天。

## (二) 公司普通股股份总数及股东结构变动及公司资产和负债结构的变动情况

适用  不适用

2020 年 3 月，公司完成配股发行，发行完成后，公司总股本为 3,880,518,908 股。公司资产和负债结构变动情况详见本报告“第四节 经营情况讨论与分析”之“资产、负债情况分析”的相关内容。

## (三) 现存的内部职工股情况

适用  不适用

## 三、 股东和实际控制人情况

### (一) 股东总数

截止报告期末普通股股东总数(户)	111,056
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	108,417

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

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内增 减	期末持股数量	比例(%)	持有 有限 售条 件股 份数 量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	

苏州国际发展集团有限公司	211,666,343	917,220,819	23.64	0	质押	260,000,000	国有法人
中新苏州工业园区投资管理有限公司	30,000,000	130,000,000	3.35	0	无	0	国有法人
张家港市直属公有资产经营有限公司	15,790,030	115,790,030	2.98	0	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	24,573,690	114,273,835	2.94	0	无	0	未知
苏州高新国有资产经营管理集团有限公司	21,000,000	91,000,000	2.35	0	无	0	国有法人
苏州营财投资集团有限公司	19,373,566	83,952,120	2.16	0	无	0	国有法人
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	18,549,831	80,382,601	2.07	0	无	0	国有法人
苏州物资控股(集团)有限责任公司	1,300,892	71,300,892	1.84	0	无	0	国有法人
苏州信托有限公司	15,936,000	69,056,000	1.78	0	无	0	国有法人
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	40,768,166	66,287,018	1.71	0	无	0	未知

## 前十名无限售条件股东持股情况

股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
苏州国际发展集团有限公司	917,220,819	人民币普通股	917,220,819
中新苏州工业园区投资管理有限公司	130,000,000	人民币普通股	130,000,000
张家港市直属公有资产经营有限公司	115,790,030	人民币普通股	115,790,030
中国证券金融股份有限公司	114,273,835	人民币普通股	114,273,835
苏州高新国有资产经营管理集团有限公司	91,000,000	人民币普通股	91,000,000
苏州营财投资集团有限公司	83,952,120	人民币普通股	83,952,120
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	80,382,601	人民币普通股	80,382,601
苏州物资控股(集团)有限责任公司	71,300,892	人民币普通股	71,300,892
苏州信托有限公司	69,056,000	人民币普通股	69,056,000
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	66,287,018	人民币普通股	66,287,018

上述股东关联关系或一致行动的说明	苏州国际发展集团有限公司和苏州营财投资集团有限公司、苏州信托有限公司之间为存在控制关系的关联方。苏州国际发展集团有限公司持有苏州营财投资集团有限公司 100%的股权，同时持有苏州信托有限公司 70.01%的股权，因此，苏州国际发展集团有限公司、苏州营财投资集团有限公司和苏州信托有限公司为一致行动人。未发现上述其他股东之间存在关联关系，也未发现上述其他股东属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	无

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

适用 不适用

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

#### 四、控股股东及实际控制人情况

(一) 控股股东情况

1 法人

适用 不适用

名称	苏州国际发展集团有限公司
单位负责人或法定代表人	黄建林
成立日期	1995 年 8 月 3 日
主要经营业务	授权范围内的国有资产经营管理，国内商业、物资供销业（国家规定的专营、专项审批商品除外），提供各类咨询服务。
报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况	无

2 自然人

适用 不适用

3 公司不存在控股股东情况的特别说明

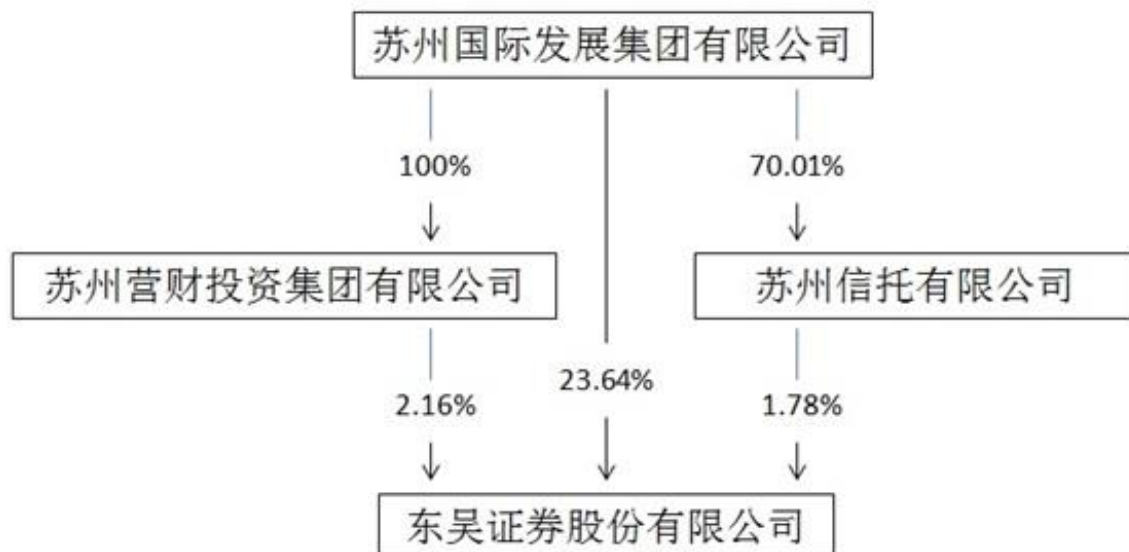
适用 不适用

4 报告期内控股股东变更情况索引及日期

适用 不适用

5 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用



## (二) 实际控制人情况

### 1 法人

适用  不适用

名称	苏州国际发展集团有限公司
----	--------------

### 2 自然人

适用  不适用

### 3 公司不存在实际控制人情况的特别说明

适用  不适用

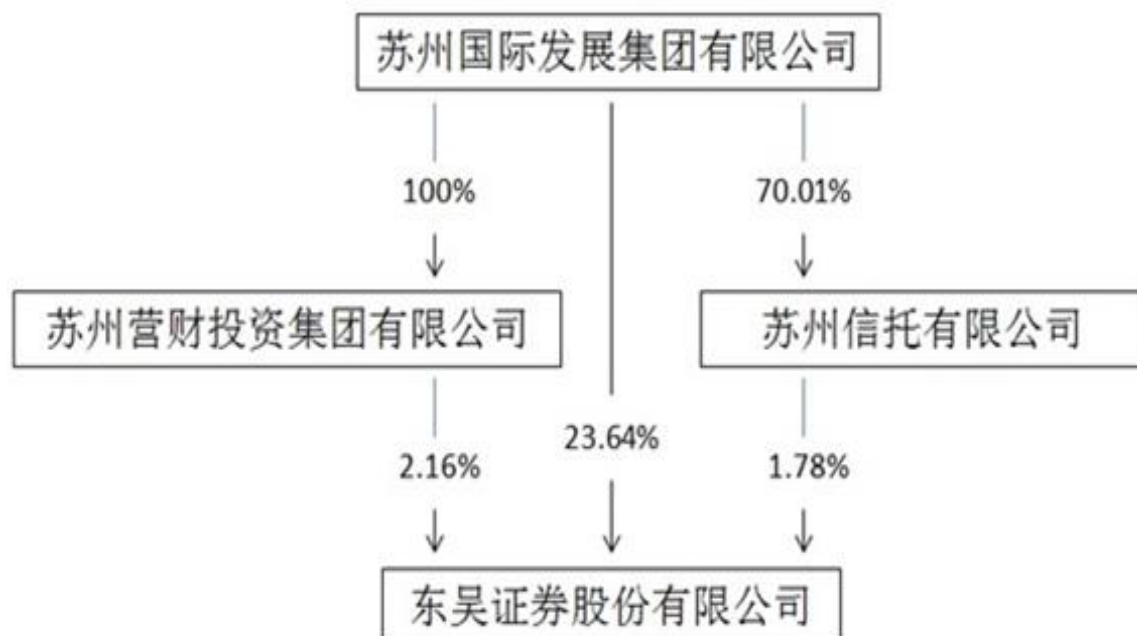
### 4 报告期内实际控制人变更情况索引及日期

适用  不适用

### 5 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图

适用  不适用





6 实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司

适用 不适用

(三) 控股股东及实际控制人其他情况介绍

适用 不适用

五、其他持股在百分之十以上的法人股东

适用 不适用

六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

### 一、持股变动情况及报酬情况

#### (一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动及报酬情况

√适用 □不适用

单位：股

姓名	职务(注)	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	年初持股数	年末持股数	年度内股份增减变动量	增减变动原因	报告期内从公司获得的税前报酬总额(万元)	是否在公司关联方获取报酬
范力	董事长	男	54	2014-1-18	至今	0	0	0	-	47.436	否
	总裁			2012-3-13	至今						
朱剑	董事	男	56	2015-9-8	至今	0	0	0	-	0	是
宋子洲	董事 (离任)	男	59	2014-11-18	2020-4-16	0	0	0	-	0	是
刘凡	董事	男	50	2020-5-15	至今	0	0	0	-	0	否
黄艳	董事	女	46	2019-5-13	至今	0	0	0	-	0	是
朱建根	董事	男	57	2015-9-8	至今	0	0	0	-	0	是
郑刚	董事	男	46	2017-11-6	至今	0	0	0	-	0	是
孙中心	董事	男	51	2018-7-4	至今	0	0	0	-	42.696	否
	常务副总裁			2018-7-17	至今						
	首席信息官			2021-1-18	至今						
金德环	独立董事 (离任)	男	66	2014-4-16	2020-7-31	0	0	0	-	9.35	否
裴平	独立董事	男	63	2016-5-20	至今	0	0	0	-	16	否
尹晨	独立董事	男	45	2017-11-6	至今	0	0	0	-	16	否
权小锋	独立董事	男	39	2017-11-6	至今	0	0	0	-	16	否
陈忠阳	独立董事	男	52	2020-8-1	至今	0	0	0	-	6.65	否
王晋康	职工监事	男	49	2020-6-5	至今	0	0	0	-	24.906	否
	监事会主席			2020-6-8	至今						
沈光俊	监事	男	49	2018-8-13	至今	0	0	0	-	0	是
唐烨	监事	男	57	2010-5-8	至今	0	0	0	-	0	是
郦美英	监事	女	59	2016-5-20	至今	0	0	0	-	0	否

马晓	监事	男	54	2013-5-8	至今	0	0	0	-	0	是
陈建国	职工监事	男	48	2017-4-24	至今	0	0	0	-	89.272	否
袁维静	职工监事 (离任)	女	57	2018-7-4	2020-6-4	0	0	0	-	42.696	否
	监事会主席 (离任)			2018-12-6	2020-6-4						
	副总裁			2020-4-23	至今						
	财务负责人			2020-4-2	至今						
魏纯	副总裁(离任)	女	41	2012-5-14	2020-4-20	0	0	0	-	14.232	否
	董事会秘书 (离任)			2008-6-25	2020-4-20						
	财务负责人 (离任)			2019-8-30	2020-4-20						
冯恂	副总裁	女	43	2016-12-13	2021-4-9	0	0	0	-	42.696	否
	董事会秘书			2020-7-8	2021-4-9						
高海明	副总裁	男	49	2019-2-15	至今	0	0	0	-	42.696	否
李齐兵	合规总监	男	54	2018-9-28	至今	0	0	0	-	179.98	否
	首席风险官			2019-1-25	至今						
刘辉	公司执委	男	50	2018-9-27	至今	0	0	0	-	248.5344	否
杨伟	公司执委	男	49	2018-9-27	至今	0	0	0	-	322.704	否
姚眺	公司执委	女	48	2018-9-27	至今	0	0	0	-	412.884	否
潘劲松	公司执委	男	49	2018-9-27	至今	0	0	0	-	338.684	否
合计									-	1,913.4164	

姓名	主要工作经历
范力	中国国籍，1966年12月出生；硕士，高级经济师。现任公司党委书记、董事长、总裁、苏州国际发展集团有限公司副董事长、江苏省第十三届人民代表大会代表、江苏省证券业协会会长、江苏省上市公司协会副会长、苏州市上市公司协会会长。1989年8月至1997年11月在共青团苏州市委员会历任常委、办公室主任兼事业部部长。1997年11月至2002年4月在苏州证券历任投资部副经理、办公室主任、人事部经理、总裁助理；2002年4月至2012年3月在东吴证券历任董事会秘书、经纪分公司总经理、副总裁、董事、常务副总裁；2012年3月至2013年5月在东吴证券任总裁、董事；2013年5月至2014年1月在东吴证券任总裁、副董事长。2014年1月至今任公司党委书记、董事长、总裁。
朱剑	中国国籍，1963年12月出生，本科。现任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事、副总经理。1982年6月至1996年8月历任苏州市财政局办事员、科员、副科长、科长；1996年9月至2002年2月任苏州丝绸集团公司总会计师；2002年3月至2008年6月任苏州工业投资有限公司总会计师；2008年7月至2018年6月任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事，2018年6月至今任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事、副总经理。
刘凡	中国国籍，1971年6月出生，硕士。1993年参加工作，历任中信证券北京投资银行总部高级经理、投委会执行总经理、投委会委员/董事总经理；中国人寿资

	产管理有限公司创新业务投资总监、投资总监。现任中国人寿资产管理有限公司总裁助理、国寿安保基金管理有限公司董事。
黄艳	中国国籍，1974 年 12 月出生，硕士，1997 年参加工作，历任苏州工业园区地产经营管理公司综合部副总经理、总经理，总裁助理、副总裁。现任苏州工业园区经济发展有限公司副总裁。
朱建根	中国国籍，现任苏州营财投资集团有限公司董事长。1963 年 6 月出生，本科。1983 年 8 月至 1993 年 8 月任职于苏州市总工会财务科；1993 年 9 月至 1996 年 10 月任苏州市财政局所属江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司总经理助理；1996 年 11 月至今历任苏州营财投资集团有限公司投资部职员、投资部经理、副总经理、总经理、董事长。
郑刚	中国国籍，1974 年 7 月出生，本科学历，硕士学位，高级经济师，注册会计师。现任苏州国际发展集团有限公司任资本运营部总经理。1993 年 7 月至 1998 年 6 月在苏州互感器厂历任会计、财务科副科长、财务科科长；1998 年 6 月至 2000 年 11 月在苏州电器发展实业有限公司任财务部经理；2000 年 11 月至 2013 年 7 月在苏州市住房置业担保有限公司历任财务部经理、总经理助理、副总经理、总经理、董事长；2013 年 7 月至今在苏州国际发展集团有限公司任资本运营部总经理。
孙中心	中国国籍，1969 年 5 月出生；硕士。现任东吴证券党委委员、董事、常务副总裁、首席信息官。1990 年 8 月至 1994 年 11 月在上海铁路分局苏州电务段工作；1994 年 11 月至 2002 年 4 月历任苏州证券狮山路营业部电脑部经理、总经理助理、网上交易部总经理；2002 年 4 月至 2010 年 5 月历任东吴证券有限责任公司网上交易部总经理、经纪分公司（筹）副总经理、狮山路证券营业部总经理、总裁助理兼苏州新区总部总经理、总裁助理兼苏州分公司总经理；2010 年 5 月至 2012 年 5 月任总裁助理兼苏州分公司总经理；2012 年 5 月至 2018 年 6 月任公司副总裁；2018 年 7 月起任公司董事、常务副总裁；2021 年 1 月起任东吴证券董事、常务副总裁、首席信息官。
裴平	中国国籍，1957 年 4 月出生；管理学博士。现任南京大学国际金融管理研究所所长、二级教授、博士生导师。曾任南京大学金融与保险学系主任、南京大学商学院副院长等。2016 年 5 月 20 日起担任公司独立董事。
尹晨	中国国籍，1975 年 5 月出生，经济学博士研究生学历，副教授。现任复旦大学社会发展与公共政策学院党委书记。2017 年 11 月 6 日起担任公司独立董事。
权小锋	中国国籍，1981 年 4 月出生，博士研究生学历，教授。现任苏州大学东吴商学院教授。历任鲁东大学管理学院助教、苏州大学东吴商学院会计系副教授、教授。2017 年 11 月 6 日起担任公司独立董事。
陈忠阳	中国国籍，1968 年 9 月出生，金融学博士。现任中国人民大学财政金融学院教授。曾任中国人民大学计划经济系团总支书记、中国人民大学国际学院（苏州研究院）副院长。2020 年 8 月 1 日起担任公司独立董事。
王晋康	中国国籍，1972 年 2 月出生，硕士研究生；历任苏州市委组织部科员、副处长、处长，苏州市人大代联工委副主任。现任本公司党委副书记、监事会主席、职工监事、工会主席。
沈光俊	中国国籍，1971 年 3 月出生，本科，注册评估师。现任苏州信托有限公司董事长 1994 年 8 月至 2003 年 12 月历任江苏仁合资产评估有限公司项目助理、项目经理、部门经理、董事，南京分公司总经理；2004 年 1 月至今历任苏州信托有限公司部门经理、总经理助理、副总经理、总经理（总裁）、董事长。
唐焯	中国国籍，1964 年 6 月出生；本科。现任昆山创业控股集团有限公司总裁。1984 年至 1992 年在昆山市变压器配件厂任技术员、副厂长。1992 年至 1994 年在昆山市乡镇工业局任办公室秘书。1994 年至 2000 年在昆山市信托投资公司任业务部经理。2000 年起至今任昆山创业控股集团有限公司副总裁、总裁。
邴美英	中国国籍，1962 年 5 月出生，大专，会计师。1981 年 7 月至 1998 年 2 月在张家港市粮食系统历任粮食工业企业财务科长，1998 年 3 月至 2002 年 3 月任张家港市财政局财政稽查大队办事员，2002 年 4 月至 2003 年 12 月任张家港市市级机关事业单位会计核算中心常务副主任，2004 年 1 月至 8 月任张家港市财政会计函授学校常务副校长，2004 年 9 月至 2008 年 4 月任张家港市财政局企业国资科科长，2008 年 5 月至 2015 年 2 月任张家港市财政国库收付中心常务副主任，2015 年 3 月至 2018 年 8 月任张家港市直属国有资产经营有限公司总经理。
马晓	中国国籍，1966 年 12 月出生；大专。现任国发集团计划财务部经理。1986 年 7 月至 1994 年 12 月任苏州光明纺织厂统计、会计；1994 年 12 月至 1999 年 8 月任苏盘投资咨询公司会计；1999 年 8 月至今在苏州国际发展集团有限公司任计划财务部会计、计划财务部副经理、计划财务部经理。
陈建国	中国国籍，1972 年 3 月出生，硕士学历，硕士学位。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理；东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山前进中路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理；东吴证券经纪业务事业部副总经理、经纪管理总部副总经理（主持工作），人力资源

	部总经理；现任东吴证券职工监事，人力资源总监兼人力资源部总经理。
袁维静	中国国籍，1963年7月出生；本科，高级会计师。现任公司党委委员、副总裁、财务负责人。1981年10月至1994年3月在苏州市财政局任工交企财处科员。1994年3月至1996年11月在苏州财政局所属江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司任副总经理；1996年11月至1997年3月在苏州市财政局所属苏州市营财发展集团总公司任副总经理。1997年3月至2002年3月在苏州市工业发展有限公司任副总经理。2002年3月至2004年6月在营财投资任副总经理、总经理、党支部书记。2004年7月起在国发集团历任副总会计师、总会计师、董事、党委委员。2014年9月至2018年6月兼任苏州信托有限公司董事长。2018年7月起在东吴证券任职工监事、监事会主席；2020年6月起任公司副总裁、财务负责人。
冯恂	中国国籍，1977年7月出生；经济学博士2002年8月至2004年4月任职于东吴证券；2004年4月至2012年5月历任国联证券研究发展部副经理，总经理、国联证券研究所所长、经纪业务管理总部总经理、国联证券总裁助理、副总裁（兼董事会秘书）；2012年6月起历任东吴证券总规划师兼研究所所长、总规划师兼资产管理总部总经理、公司副总裁。2020年7月至2021年4月任公司副总裁、董事会秘书。
高海明	中国国籍，1971年2月出生；硕士；现任本公司党委委员、副总裁兼信用业务部总经理。1992年7月至1993年12月在国营五二六厂工作，1993年12月起历任苏州证券营业部总经理助理、东吴证券营业部副总经理、东吴资管副总经理、理财工作筹备组负责人、太仓总部总监、太仓分公司总经理、苏州分公司总经理、东吴期货总经理、信用业务部总经理，2019年2月至今任本公司副总裁兼信用业务部总经理。
李齐兵	中国国籍，1966年9月出生；大学，硕士，会计师、审计师、注册会计师（非执业会员）。现任本公司合规总监、首席风险官。1988年8月至2000年10月在南京市审计局历任科员、副主任科员、主任科员。2000年10月至2002年9月在中国证监会南京特派员办事处稽查处任主任科员。2002年9月至2010年5月在江苏证监局机构监管处历任副处长、处长。2010年6月至2011年5月在国发集团任副总经理。2011年5月至2013年6月任公司副总裁。2013年7月至11月任公司副总裁、合规总监；2013年11月至2018年9月任公司副总裁。2018年10月至今任公司合规总监，2019年1月起兼任首席风险官。
刘辉	中国国籍，1970年7月出生；硕士。历任中国光大银行海口证券部交易部经理；君安证券有限责任公司零售客户部总经理助理；平安证券有限责任公司北京营业部、北区机构部副总经理；东吴证券北京鼓楼外大街证券营业部副总经理、总经理；东吴证券总裁助理兼北京分公司总经理、场外市场总部总经理；公司副总裁兼北京分公司总经理、场外市场总部总经理；东吴证券董事长助理兼深圳分公司总经理、东吴证券（香港）金融控股有限公司董事长、行政总裁、东吴证券中新（新加坡）有限公司董事长；现任公司执委，董事长助理、东吴证券（香港）金融控股有限公司董事长、行政总裁、东吴证券中新（新加坡）有限公司董事长。
杨伟	中国国籍，1971年10月出生，硕士，注册会计师（非执业会员）、保荐代表人。历任东吴证券投资银行总部苏州业务总部副总经理（主持工作）；投资银行总部业务总监兼事业三部总经理；投资银行总部副总经理；投资银行总部常务副总经理；投资银行总部总经理兼投行总部直属事业部总经理；东吴证券总裁助理兼投资银行总部总经理。现任公司执委、总裁助理、投资银行总部总经理。
姚眺	中国国籍，1972年6月出生，硕士。历任东吴证券嘉善县嘉善大道证券营业部总经理、嘉兴分公司总经理、固定收益总部总经理、东吴证券总裁助理兼固定收益总部总经理。现任公司执委、总裁助理、固定收益总部总经理。
潘劲松	中国国籍，1971年9月出生，硕士。历任浙江省国际信托投资公司营业部副经理；金通证券股份有限公司营业部总经理；中信金通证券有限责任公司营业部总经理、财富管理中心、高端业务部总经理；中信证券（浙江）有限责任公司营业部总经理、财富管理中心负责人、高端业务部总经理、客户服务总监、证券投融资总监等职务；中信证券股份有限公司浙江分公司财富管理总监、浙江分公司副总经理、工会主席、党委委员；东吴证券总裁助理。现任公司执委、总裁助理。

## 其它情况说明

√适用 □不适用

- 1、非独立董事、职工监事和高级管理人员的薪酬为当年履职期间实际支付的税前收入；
- 2、公司执委刘辉在香港子公司取得报酬，折算为人民币，未在母公司领取薪酬；
- 3、公司非独立董事、职工监事、高级管理人员薪酬仍在确认过程中，其余部分待确认后再另行披露；
- 4、公司根据相关规定，对相关人员的绩效实行延期支付；

5、公司董事、监事及高级管理人员不存在非现金薪酬的情况。

(二) 董事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

二、现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员的任职情况

(一) 在股东单位任职情况

适用 不适用

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务
范力	苏州国际发展集团有限公司	副董事长
朱剑	苏州国际发展集团有限公司	党委委员、董事、副总经理
黄艳	苏州工业园区经济发展有限公司	董事、副总裁
朱建根	苏州营财投资集团有限公司	总经理
郑刚	苏州国际发展集团有限公司	资本运营部经理
	苏州信托有限公司	董事
沈光俊	苏州信托有限公司	董事长
唐烨	昆山创业控股集团有限公司	总裁
	昆山市创业投资有限公司	董事长
在股东单位任职情况的说明		

(二) 在其他单位任职情况

适用 不适用

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务
朱剑	江苏省苏州宿迁工业园区开发有限公司	董事
	苏州国发创业投资控股有限公司	董事
刘凡	中国人寿资产管理有限公司	总裁助理
	国寿安保基金管理有限公司	董事
	中保投资有限责任公司	董事
黄艳	智瑞达科技（苏州）有限公司	董事长

	苏州财融产业投资有限公司	董事长、总经理
	霍尔果斯苏新置业有限公司	董事长
	苏州市沿海合作开发建设投资有限公司	副董事长
	苏州元禾控股股份有限公司	董事
	江苏广融实业有限公司	董事
	苏州市融风科技小额贷款有限公司	董事
	苏州产权交易中心有限公司	董事
	苏州新时代文体会展集团有限公司	董事
	苏州新建元控股集团有限公司	董事
	苏州恒泰控股集团有限公司	董事
	东吴人寿股份有限公司	董事
	国金基金管理有限公司	董事
	苏州集成电路产业投资有限公司	董事
	江苏省海外合作投资有限公司	董事
	苏州中方财团控股股份有限公司	监事
朱建根	苏州国发创业投资控股有限公司	董事
	苏州企业征信服务有限公司	董事
	苏州市基础设施投资管理有限公司	董事
	苏州中方财团控股股份有限公司	监事
	紫金财产保险股份有限公司	董事
	苏州银杏置业有限公司	董事长
	苏州工业园区时尚舞台国际名品经营有限公司	董事长
	苏州市住房置业融资担保有限公司	董事长
	苏州盘门旅游开发有限公司	总经理
郑刚	苏州国发融资担保有限公司	董事
	苏州国发创业投资控股有限公司	董事
	苏州市产业投资集团有限公司	董事
	苏州信托有限公司	董事
	江苏银行股份有限公司	监事
裴平	南京大学商学院	教授、博士生导师

	张家港农业商业银行股份有限公司	独立董事
尹晨	复旦大学社会发展与公共政策学院	党委书记
	苏州大学东吴商学院	教授
权小锋	苏州赛腾精密电子股份有限公司	独立董事
	苏州苏试试验集团股份有限公司	独立董事
	苏州三鑫时代新材料股份有限公司	独立董事
陈忠阳	中国人民大学财政金融学院	教授
唐焯	昆山市国科创业投资公司	董事长
邴美英	张家港市金宏投资发展有限公司	董事长
	张家港市信用再担保有限公司	董事长
	张家港市现代农业投资有限公司	董事
	张家港市长江文化投资发展有限公司	董事
	张家港市蔬菜园艺有限公司	董事
	华润张家港百禾医药有限公司	董事
	张家港市通州沙西水道综合整治有限公司	董事
	张家港保税区长源热电有限公司	董事
	张家港市农业担保有限公司	董事
	张家港市高铁投资发展有限公司	董事长
马晓	苏州国发融资担保有限公司	董事长
	江苏东吴保险经纪股份有限公司	监事会主席
	苏州市信用再担保有限公司	董事长
	苏州国发创业投资控股有限公司	监事长
陈建国	东吴期货有限公司	董事
	东吴基金管理有限公司	董事
孙中心	苏州资产管理有限公司	董事
	苏州股权投资基金管理有限公司	董事
	东吴创新资本管理有限责任公司	董事长
袁维静	东吴基金管理有限公司	监事会主席
冯恂	东吴国际资本有限责任公司	董事
高海明	东吴期货有限公司	董事长



刘辉	东吴证券（香港）金融控股有限公司	董事长、行政总裁
	东吴证券中新（新加坡）有限公司	董事长
	东吴（香港）投资有限公司	董事长
	东吴国际资本有限责任公司	董事长
	东吴证券（国际）金融控股有限公司	董事
	东吴中新资产管理（亚洲）有限公司	董事
杨伟	东吴证券（香港）金融控股有限公司	董事
	东吴（香港）投资有限公司	董事
姚眺	东吴证券（香港）金融控股有限公司	董事
	东吴（香港）投资有限公司	董事
	中证信用增进股份有限公司	董事
在其他单位任职情况的说明		

### 三、董事、监事、高级管理人员报酬情况

√适用 □不适用

董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序	公司董事、监事的报酬由董事会、监事会审议通过后，报股东大会审议决定。公司董事长、总裁、副总裁级领导班子成员由薪酬、考核和提名委员会审议后，再提交公司董事会审议决定。其他经营班子成员的报酬按公司有关规定执行。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	公司外部董事、监事不在公司领取报酬，公司独立董事报酬在参考同行业上市公司的平均水平后确定；公司内部董事、监事和高级管理人员的报酬由公司薪酬考核体系决定。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	公司外部董事、监事不在公司领取除津贴以外的其他薪酬。公司高级管理人员（非市管干部）薪酬由基本工资和年度奖金构成，基本工资按月发放，年度奖金根据公司经营目标完成情况提取，结合高级管理人员绩效考核情况进行分配发放。2020 年度基本工资均已按月全额发放，年度奖金按照相关规定分配并预留，预留部分奖金分三年递延发放。 公司高级管理人员（市管干部）薪酬由基本年薪、绩效年薪、任期激励构成，基本年薪按月发放，绩效年薪根据公司经营目标完成情况提取，结合高级管理人员绩效考核情况进行分配发放；2020 年度基本年薪、绩效年薪根据相关规定确定；任期激励：依据《苏州市国资委履行出资人职责企业负责人薪酬管理实施办法》（苏国资[2017]17 号）文规定，任期激励收入实行延期支付办法，任期考核完成后或者离任经考核后当期支付 50%，次年支付 50%。

报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计	1,913.42 万元
-----------------------------	-------------

#### 四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用  不适用

姓名	担任的职务	变动情形	变动原因
宋子洲	董事	离任	工作原因
刘凡	董事	选举	-
金德环	独立董事	离任	担任独董满六年
陈忠阳	独立董事	选举	-
袁维静	职工监事、监事会主席	离任	工作原因
	副总裁、财务负责人	聘任	-
王晋康	职工监事、监事会主席	选举	-
魏纯	副总裁、董事会秘书、财务负责人	离任	工作原因
冯恂	董事会秘书	聘任	-

#### 五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

适用  不适用

## 六、母公司和主要子公司的员工情况

### (一) 员工情况

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共有在职员工 3,722（含经纪人），其中，母公司 3,136 人，主要子公司 586 人。员工结构如下：

母公司在职员工的数量	3,136
主要子公司在职员工的数量	586
在职员工的数量合计	3,722
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	0
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
经纪业务	2,253
投资银行	439
证券投资	81
资产管理	104
财务人员	85
研究	165
合规及稽核	89
信息技术	214
其他管理及行政人员	292
合计	3,722
教育程度	
教育程度类别	数量（人）
博士	24
硕士	997
本科	2,003
大专及以下	698
合计	3,722

### (二) 薪酬政策

√适用 □不适用

公司建立与发展战略相匹配的薪酬管理体系，规范薪酬管理行为，健全激励约束机制，促进公司稳健经营和可持续发展，实现公司价值与员工个人价值的一体化发展。薪酬体系遵循“外部具有竞争力，内部具有公平性，依岗依能依绩付薪，能升能降动态调整”的基本原则。

公司员工的薪酬由基本薪酬、绩效薪酬、社保福利构成，基本薪酬以公司岗位工资体系为基础，依据员工所任职岗位的职责、重要性、市场水平等因素，并根据个人的管理和专业能力综合确定。绩效薪酬与公司整体效益、部门经营情况相关，并依据员工绩效考核结果确定。公司和员工按照国家法律法规的规定缴纳各项法定社会保险及公积金，并按属地化原则进行管理。

### (三) 培训计划

√适用 □不适用

2020 年度，公司紧盯“做优人才队伍”目标不放松，坚持做深做细做实教育培训各项工作。

这一年，大力推进教育培训数字化转型工作，以东吴秀财学苑为主阵地，坚持“云端课程+在线项目”双轮驱动，着力将培训搬到线上，把课程载入云端，多措并举，持续提升培训氛围和工作成效。2020 全年制作课件 2382 个，比上年增长 447.6%；举办直播 116 场，增长 28.9%；总学习次数、学习总时长、人均学习时长、人均学习次数等均实现指数级增长，在线学习氛围浓厚，教育培训数字化转型成效显著。

2021 年，公司将持续改进教育培训工作，以打造学习型组织为目标，建立面向客户业务需求、面向员工成长需要、面向业务发展趋势、面向监管政策要求的培训内容管理体系，以新员工、业务骨干、青年人才为主要对象，将教育培训打造成符合员工需求、满足业务需要的基石，打造成帮助员工成长、促进公司发展的基石。

#### (四) 劳务外包情况

√适用 □不适用

劳务外包的工时总数	149,476 小时
劳务外包支付的报酬总额	5,801,181 元

#### 七、经纪人情况

√适用 □不适用

2020 年公司在证券经纪人管理方面继续对制度进行了修订和完善：根据中国证券业协会 2020 年下发的《关于证券从业人员登记管理有关事项通知》，对经纪人证书等说明进行了规范；为继续优化经纪人队伍，从制度层面增加了经纪人首次续签以及后续签约的相关要求。2020 年公司严格按照证监会《证券经纪人暂行管理规定》（[2009]2 号）以及内部制度等有关规定，在证券经纪人实施分级管理模式的基础上，指定营业部负责人为第一管理人，全面指导并负责本营业部经纪人的管理工作，同时接受公司总部管理、监督以及检查。截至报告期末，公司下属共 65 家证券营业部实际开展证券经纪人业务，证券经纪人 704 人。2020 年公司通过规范执业管理以及考核淘汰，持续压缩经纪人规模，经纪人业务运行平稳，整体状况良好。

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

公司严格遵循《公司法》、《证券法》、《证券公司治理准则》、《上市公司治理准则》等法律法规和规范性文件的要求，不断完善公司治理。建立了股东大会、董事会、监事会和内部管理机构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范的相互协调和相互制衡机制，均衡有效的公司治理结构确保了公司的规范运作，为公司发展提供制度保障。

公司治理与中国证监会相关规定的要求是否存在重大差异；如有重大差异，应当说明原因

适用 不适用

## 二、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期
2019 年年度股东大会	2019-5-15	上海证券交易所网站	2019-5-16
2020 年第二次临时股东大会	2019-6-29	上海证券交易所网站	2019-6-30

股东大会情况说明

适用 不适用

因受疫情影响，2020 年第一次临时股东大会取消。

## 三、董事履行职责情况

### (一) 董事参加董事会和股东大会的情况

董事姓名	是否独立董事	参加董事会情况						参加股东大会情况 出席股东大会的次数
		本年应参加董事会次数	亲自出席次数	以通讯方式参加次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参加会议	
范力	否	9	9	0	0	0	否	1
朱剑	否	9	8	1	1	0	否	2
宋子洲 (离任)	否	2	2	2	0	0	否	0
黄艳	否	9	7	3	2	0	否	0
刘凡	否	4	4	3	0	0	否	0
朱建根	否	9	7	1	2	0	否	0
郑刚	否	9	9	2	0	0	否	0
孙中心	否	9	9	0	0	0	否	2
金德环 (离任)	是	7	7	4	0	0	否	2
裴平	是	9	9	4	0	0	否	1
尹晨	是	9	9	8	0	0	否	0
权小锋	是	9	9	3	0	0	否	2
陈忠阳	是	2	2	1	0	0	否	0

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

年内召开董事会会议次数	9
其中：现场会议次数	1
通讯方式召开会议次数	0
现场结合通讯方式召开会议次数	8

### (二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

适用 不适用

## (三) 其他

√适用 □不适用

2020 年度，公司董事会共召开会议 9 次，审议议案 50 项，全部议案表决通过，具体见下表：

会议时间	会议名称	会议议题
2020 年 1 月 6 日	第三届董事会第三十次（临时）会议	1、关于授权两位董事签署配股章程和代表公司办理配股章程香港认可 / 注册有关事宜的议案
2020 年 4 月 2 日	第三届董事会第三十一次（临时）会议	1、关于向苏州资管增资暨关联交易的议案
2020 年 4 月 23 日	第三届董事会第三十二次会议	1、2019 年度经营管理工作报告（非表决事项）
		2、关于 2020 年度经营管理计划的议案
		3、关于 2019 年年度报告及其摘要的议案
		4、关于 2019 年度董事会工作报告的议案
		5、关于 2019 年度财务决算报告的议案
		6、关于 2019 年度利润分配预案的议案
		7、关于变更会计政策的议案
		8、关于调整公司高级管理人员的议案
		9、关于确定员工基本薪酬总额的议案
		10、关于 2019 年度合规报告的议案
		11、关于 2019 年度内部控制评价报告的议案
		12、关于 2019 年度全面风险评估报告的议案
		13、关于 2020 年度风险偏好体系的议案
		14、关于确认 2019 年日常关联交易及预计 2020 年日常关联交易的议案
		15、关于 2020 年度自营投资额度的议案
		16、关于修订公司章程的议案
		17、关于修订股东大会议事规则的议案
		18、关于修订内幕信息知情人及对外信息报送登记管理制度的议案
		19、关于公司公开发行公司债券的议案
		20、关于提名第三届董事会成员（非职工代表董事）的议案
		21、关于 2019 年度信息技术管理专项报告的议案
		22、关于 2019 年度社会责任报告的议案
		23、审计委员会 2019 年履职情况报告（非表决事项）
		24、2019 年度独立董事述职报告（非表决事项）
		25、关于重大关联交易审计情况的报告（非表决事项）
		26、关于召开年度股东大会的议案
2020 年 4 月 29 日	第三届董事会第三十三次（临时）会议	1、关于 2020 年第一季度报告的议案
2020 年 5 月 15 日	第三届董事会第三十四次（临时）会议	1、关于向东吴证券（香港）金融控股有限公司增资的议案
		2、关于聘请审计机构的议案

		3、关于召开 2020 年第一次临时股东大会的议案
2020 年 6 月 11 日	第三届董事会第三十五次（临时）会议	1、关于 2019 年度反洗钱工作报告的议案
		2、关于 2019 年洗钱风险自评估报告
		3、关于 2019 年度反洗钱工作稽核审计报告的议案
		4、关于变更公司公开发行公司债券规模和期限的议案
		5、关于变更公司次级债券发行方式及对象的议案
		6、关于授权经营管理层决定新设、撤销分支机构事宜的议案
		7、关于提名公司第三届董事会成员（非职工代表董事）的议案
		8、关于聘任公司高级管理人员的议案
		9、关于召开公司 2020 年第一次临时股东大会的议案
2020 年 7 月 30 日	第三届董事会第三十六次（临时）会议	1、关于变更对苏州资产管理有限公司出资主体暨关联交易的议案
2020 年 8 月 20 日	第三届董事会第三十七次会议	1、关于 2020 年半年度报告及其摘要的议案
		2、关于 2020 年上半年度全面风险评估报告的议案
		3、关于 2020 年上半年度风险控制指标执行情况报告的议案
		4、关于调整董事会专门委员会组成方案的议案
		5、关于 2020 年半年度募集资金存放与使用情况专项报告的议案
		6、关于公司资产管理业务和私募子公司业务整改方案的议案
2020 年 10 月 29 日	第三届董事会第三十八次（临时）会议	1、关于 2020 年第三季度报告的议案
		2、关于公司高级管理人员 2019 年度薪酬总额的议案

2020 年度，公司监事会共召开会议 5 次，审议议案 15 项，全部议案表决通过，具体见下表：

会议时间	会议名称	会议议题
2020 年 4 月 23 日	第三届监事会第十七次会议	1、关于 2019 年年度报告及其摘要的议案
		2、关于 2019 年度监事会工作报告的议案
		3、关于 2019 年度利润分配预案的议案
		4、关于 2019 年度内部控制评价报告的议案
		5、关于变更会计政策的议案
		6、2019 年度稽核审计工作报告（非表决事项）
		7、公司 2019 年度合规管理有效性评估报告（非表决事项）
		8、公司 2019 年度全面风险管理有效性评估报告（非表决事项）
2020 年 4 月 29 日	第三届监事会第十八次（临时）会议	1、关于 2020 年第一季度报告的议案
2020 年 6 月 11 日	第三届监事会第十九次（临时）会议	1、关于 2019 年度反洗钱工作报告的议案
		2、关于 2019 年度反洗钱工作稽核审计报告的议案
		3、关于选举监事会主席的议案
2020 年 8 月 20 日	第三届监事会第二	1、关于 2020 年半年度报告及其摘要的议案

	十次会议	2、关于 2020 年半年度募集资金存放与使用情况专项报告的议案
2020 年 10 月 29 日	第三届监事会第二十一一次（临时）会议	1、关于 2020 年第三季度报告的议案

#### 四、董事会下设专门委员会在报告期内履行职责时所提出的重要意见和建议，存在异议事项的，应当披露具体情况

适用 不适用

名称	成员
战略委员会	范力（主任）、朱剑、黄艳、刘凡、陈忠阳、裴平
风险控制委员会	陈忠阳（主任）、尹晨、权小锋、郑刚、孙中心
审计委员会	权小锋（主任）、裴平、尹晨、黄艳、朱建根、孙中心
薪酬、考核与提名委员会	裴平（主任）、陈忠阳、尹晨、朱剑、孙中心

报告期内，公司董事会战略委员会共召开会议 1 次，薪酬、考核与提名委员会召开会议 3 次，审计委员会召开会议 7 次，风险控制委员会召开会议 4 次。公司董事会专业委员会根据公司章程、公司董事会议事规则及各委员会工作细则的规定，分别对新证券法的适用、高管提名、薪酬考核、财务审计、内控审计、风险控制、关联交易等提出了建议，为公司规范运作发挥了重要作用。

#### 五、监事会发现公司存在风险的说明

适用 不适用

#### 六、公司就其与控股股东在业务、人员、资产、机构、财务等方面存在的不能保证独立性、不能保持自主经营能力的情况说明

适用 不适用

存在同业竞争的，公司相应的解决措施、工作进度及后续工作计划

适用 不适用

#### 七、报告期内对高级管理人员的考评机制，以及激励机制的建立、实施情况

适用 不适用

公司依据《东吴证券股份有限公司董事监事薪酬管理制度》、《东吴证券股份有限公司高级管理人员管薪酬和绩效管理办法》，通过公正透明的董事、监事、及高级管理人员的绩效考核制度，并以年度公司及各项业务实现的经营业绩对公司高级管理人员进行绩效评价，依据考核结果实施薪酬分配。薪酬分配中将高级管理人员个人收入与公司整体经营业绩、个人分管业务业绩紧密挂钩，激励与约束相结合，发挥正向激励作用。

#### 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

公司内部控制评价报告同日披露于上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）。



报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

## 九、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

安永华明会计师事务所出具了《内部控制审计报告》，认为公司于 2020 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。《公司内部控制审计报告》详见上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）。

是否披露内部控制审计报告：是

内部控制审计报告意见类型：标准的无保留意见

## 十、内部控制责任的声明、内部控制制度建设情况

适用 不适用

### （一）内部控制责任声明

公司董事会对建立和维护充分的财务报告相关内部控制制度负责。财务报告相关内部控制的目标是保证财务报告信息真实完整和可靠、防范重大错报风险。由于内部控制存在固有局限性，因此仅能对上述目标提供合理保证。

公司董事会已按照《企业内部控制基本规范》要求对财务报告相关内部控制进行了评价，并认为其在 2020 年 12 月 31 日有效。公司在内部控制自我评价过程中未发现与非财务报告相关的内部控制存在重大缺陷。

### （二）建立财务报告内部控制的依据

公司依据《企业内部控制基本规范》、《证券公司内部控制指引》、《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等相关规定，按照“全面性、重要性、制衡性、适应性、成本效益”的原则，建立了财务报告内部控制机制。

### （三）内部控制制度建设情况

报告期内，公司依据监管要求、经营环境变化及业务发展需要，新增或修订了投行、研究、融资融券、股票质押、约定购回、基金代销、基金服务、QFII 和 RQFII 等业务制度，以及债务融资、印章管理、合规风控、反洗钱、信息技术等管理制度。

## 十一、公司合规管理体系建设情况，合规、稽核部门报告期内完成的检查稽核情况。

### （一）公司合规管理体系建设及运行情况

公司的合规管理组织架构由董事会、合规总监、合规法务部、各部门及分支机构合规风控专员等四个层级构成。

报告期内，公司按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》要求，重点从优化

合规管理工作机制、从严落实监管要求、强化合规管理基础与保障等方面细化完善了合规管理机制，不断提升合规管理有效性。公司合规态势整体平稳、良好。

## （二）合规、稽核检查情况

报告期内，公司合规法务部根据监管要求及业务新规出台情况，对投行业务、债券交易、研究业务、资管业务、境外子公司相关新规落实情况开展了 5 次专项合规检查；对经纪、股票质押、融资融券等业务开展了常规合规检查，对 20 家分支机构开展了常规合规检查。

报告期内，公司稽核审计部对机构业务部、资金运营部、机构客户部和财富管理部等部门开展了业务管理、内部控制、合规及风险管理的内部审计，稽核审计部还进行了分支机构及营业部负责人离任审计、强制休假审计及其他专项审计、评估等工作。稽核审计部 2020 年共完成业务部门年度审计、分支机构负责人离任审计、强制休假审计及专项审计等 89 项。稽核审计部按照监管部门的要求组织完成了公司 2020 年度合规管理有效性评估、全面风险管理有效性评估、信息系统专项审计、反洗钱专项审计、投资银行内控评估、私募业务评估报告和重大关联交易专项审计工作。

## 第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、公司债券基本情况

单位:元币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易所
东吴证券 2017 年面向合格投资者公开发行公司债券	17 东吴债	143021	2017-03-13	2022-03-13	25.00	4.70	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海 证券 交易所
东吴证券非公开发行 2017 年次级债券（第一期）品种二	17 东吴 02	145495	2017-04-26	2022-04-26	16.50	5.50	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海 证券 交易所
东吴证券非公开发行 2017 年次级债券（第二期）（品种二）	17 东吴 04	145551	2017-05-22	2022-05-22	12.30	5.60	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海 证券 交易所
东吴证券 2018 年非公开发行公司债券（第一期）	18 东吴 F1	150105	2018-01-29	2021-01-29	45.00	5.70	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海 证券 交易所
东吴证券 2018 年非公开发行公司债券（第二期）	18 东吴 F2	151059	2018-12-29	2021-12-29	10	4.60	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海 证券 交易所

东吴证券 2019 年非公开发行次级债券(第一期)	19 东吴 C1	151255	2019-03-18	2022-03-18	20	4.25	支付。 每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2019 年非公开发行公司债券(第一期)	19 东吴 F1	151420	2019-04-16	2022-04-16	20	4.20	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2019 年公开发行公司债券	19 东吴债	155596	2019-08-12	2022-08-12	30	3.60	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2020 年非公开发行次级债券(第一期)(疫情防控债)	20 东吴 C1	166134	2020-02-25	2023-02-25	10	3.80	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2020 年非公开发行次级债券(第二期)	20 东吴 C2	166981	2020-06-10	2023-06-10	5	3.80	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	20 东吴 G1	175162	2020-09-21	2021-09-24	26	3.29	到期一次还本付息	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	20 东吴 G2	175163	2020-09-21	2023-09-21	14	3.81	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上 海 证 券 交 易 所
东吴证券 2020 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第一期)	20 东吴 S1	163846	2020-11-26	2021-05-25	28	3.55	到期一次还本付息	上 海 证 券 交 易 所

公司债券付息兑付情况

适用 不适用

上述债券存续期内均按时兑付兑息

公司债券其他情况的说明

适用 不适用

## 二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

“17 东吴债”、“17 东吴 02”、“17 东吴 04”债券受托管理人	名称	西部证券股份有限公司
	办公地址	陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室
	联系人	滕晶、李晶
	联系电话	029-87406130

“18 东吴 F1” 债券受托管理人	名称	华融证券股份有限公司
	办公地址	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦
	联系人	石川、耿文强
	联系电话	010-85556311
“18 东吴 F2”、“19 东吴 F1”、“20 东吴 C1”、“20 东吴 C2” “20 东吴 G1” “20 东吴 G2” 债券受托管理人	名称	中国国际金融股份有限公司
	办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
	联系人	刘浏
	联系电话	010-65051166
“19 东吴 C1” 债券受托管理人	名称	南京证券股份有限公司
	办公地址	江苏省南京市江东中路 389 号南京证券股份有限公司
	联系人	徐欣
	联系电话	025-58519350
“19 东吴债” “20 东吴 S1” 债券受托管理人	名称	光大证券股份有限公司
	办公地址	上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 1 期 51 层
	联系人	邢一唯
	联系电话	021-52523023
“17 东吴债” “19 东吴债” “20 东吴 G1” “20 东吴 G2” “20 东吴 S1” 资信评级机构	名称	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
	办公地址	上海市汉口路 398 号华盛大厦 14F

其他说明：

适用 不适用

### 三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

公司发行的公司债券募集资金扣除发行等相关费用后，均用于补充公司营运资金，偿还公司有息债务等，满足公司业务发展的需要，进一步优化负债结构和改善财务结构。资金主要用于与公司主营业务相关的用途，以支持公司的长期发展及核心竞争力的培育，与募集说明书中约定的资金运用安排保持一致。

### 四、公司债券评级情况

适用 不适用

公司聘请上海新世纪资信评估投资服务有限公司对“17 东吴债”、“19 东吴债”、“20 东吴 G1”、“20 东吴 G2”、“20 东吴 S1”进行评级。

根据上海新世纪资信评估投资服务有限公司 2020 年 5 月 15 日为“17 东吴债”、“19 东吴债”出具的跟踪评级报告和评级报告，评级结果为：主体评级/展望为“AAA/稳定”，债项评级为“AAA”。

根据上海新世纪资信评估投资服务有限公司 2020 年 5 月 25 日为“20 东吴 G1”、“20 东吴 G2”出具的评级报告，评级结果为：主体评级/展望为“AAA/稳定”，债项评级为“AAA”。

根据上海新世纪资信评估投资服务有限公司 2020 年 8 月 31 日为“20 东吴 S1”出具的评级

报告，评级结果为：主体评级/展望为“AAA/稳定”，债项评级为“A-1”。上海新世纪资信评估投资服务有限公司已在官方网站上进行披露。

#### 五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

适用 不适用

公司将按时履行各期债券年度付息及到期还本付息义务。公司偿债能力良好。公司偿债资金将主要来源于公司日常的盈利积累及经营活动所产生的现金流。公司的收入规模和盈利积累，较大程度上保证了公司按期偿本付息的能力。

#### 六、公司债券持有人会议召开情况

适用 不适用

#### 七、公司债券受托管理人履职情况

适用 不适用

西部证券作为“17 东吴债、17 东吴 02、17 东吴 04”的受托管理人、华融证券作为“18 东吴 F1”的受托管理人、中金公司作为“18 东吴 F2、19 东吴 F1、20 东吴 C1、20 东吴 C2、20 东吴 G1、20 东吴 G2”的受托管理人、南京证券作为“19 东吴 C1”的受托管理人、光大证券作为“19 东吴债、20 东吴 S1”受托管理人，以维护全体债券持有人的最大利益为行事原则，严格按照《债券受托管理协议》的约定，持续关注公司的资信状况、经营情况、财务状况及募集资金管理运用等情况，根据受托管理协议的有关约定及监管要求履行受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。

#### 八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标

适用 不适用

单位:元币种:人民币

主要指标	2020 年	2019 年	本期比上年同期增减 (%)	变动原因
息税折旧摊销前利润	4,251,531,155.34	3,560,879,118.51	19.40	
流动比率	1.70	1.63	4.29	
速动比率	1.70	1.63	4.29	
资产负债率 (%)	64.86%	72.21%	-10.18	
EBITDA 全部债务比	8.72%	6.74%	29.38	
利息保障倍数	2.23	1.63	36.81	主要是本期利润总额增加、利息支出减少所致
现金利息保障倍数	1.01	1.74	-41.95	主要是本期经营活动现金流量净额减少所致
EBITDA 利息保障倍数	2.29	1.69	35.50	主要是本期利润总额增

				加、利息支出减少所致
贷款偿还率 (%)	100.00%	100.00%		
利息偿付率 (%)	100.00%	100.00%		

#### 九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用  不适用

2020 年，公司其他债务融资工具有：短期融资券、收益凭证、同业拆借、融资业务债权收益权转让等。各项融资均按时兑付本金及利息。

#### 十、公司报告期内的银行授信情况

√适用  不适用

2020 年末，公司金融机构授信总额达 1134.68 亿元，尚存未使用授信额度 888.85 亿元，授信金融机构 39 家。公司信誉良好，报告期内公司按时偿还银行贷款，未发生贷款展期、减免情况。

#### 十一、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

√适用  不适用

报告期内，公司各期债券严格执行募集说明书的相关约定及承诺，发行文件真实、准确和完整，发行程序合规，募集资金用途合法合规、严格在约定的范围内使用，严格按照募集说明书中的约定、公司内部制度及专项账户的规定履行资金使用的程序，专项账户运作正常。履行相关的信息披露义务，按期支付到期的利息及本金，未发生违约事件。

#### 十二、公司发生的重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用  不适用

## 第十一节 财务报告

### 一、审计报告

√适用 □不适用

#### 审计报告

安永华明（2021）审字第 61346989\_B01 号  
东吴证券股份有限公司

东吴证券股份有限公司全体股东：

#### 一、审计意见

我们审计了东吴证券股份有限公司的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的合并及公司资产负债表，2020 年度的合并及公司利润表、股东权益变动表和现金流量表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的东吴证券股份有限公司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，公允反映了东吴证券股份有限公司 2020 年 12 月 31 日的合并及公司财务状况以及 2020 年度的合并及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，我们独立于东吴证券股份有限公司，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，认为对本年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。我们对下述每一事项在审计中是如何应对的描述也以此为背景。

我们已经履行了本报告“注册会计师对财务报表审计的责任”部分阐述的责任，包括与这些关键审计事项相关的责任。相应地，我们的审计工作包括执行为应对评估的财务报表重大错报风险而设计的审计程序。我们执行审计程序的结果，包括应对下述关键审计事项所执行的程序，为财务报表整体发表审计意见提供了基础。

关键审计事项：	该事项在审计中是如何应对：
<b>融出资金及买入返售金融资产减值评估</b>	
东吴证券股份有限公司及其子公司（“贵集团”）于每个资产负债表日，以预期信用损失为基础对融出资金与买入返售金融资产进行减值测试并确认损失准备。如果信用风险自初始确认后未显著增加，贵集团按照相当于未来 12 个月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已显著增加，贵集团按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果已发生信用损失，贵	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 我们评估和测试了贵集团融出资金及买入返售金融资产减值计提流程的内部控制设计、运行的有效性；</li> <li>2. 我们评价了管理层所采用的预期信用损失模型中对于减值阶段划分标准的合理性；</li> <li>3. 我们选取样本，对样本的减值阶段划分结果与预期信用损失模型的标准进行</li> </ol>

<p>集团确认整个存续期内的信用减值。贵集团在评估预期信用损失时，考虑所有合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。</p> <p>于 2020 年 12 月 31 日，贵集团融出资金的账面净值为人民币 180.50 亿元，其中减值准备余额为人民币 0.47 亿元；买入返售金融资产的账面净值为 70.18 亿元，其中减值准备余额为人民币 22.17 亿元。</p> <p>由于相关资产金额重大，其减值评估需要管理层作出重大判断，包括对减值阶段的划分及未来现金流量的估计等，因此我们将融出资金及买入返售金融资产减值评估认定为关键审计事项。</p> <p>有关融出资金及买入返售金融资产减值的相关披露，请参阅财务报表附注三、9，财务报表附注三、32，财务报表附注五、3，财务报表附注五、5，财务报表附注五、21、财务报表附注五、22 及财务报表附注五、51。</p>	<p>对比；</p> <p>4. 我们选取样本，对管理层在计算减值损失时使用的关键参数的合理性进行评估，包括损失率、风险敞口、前瞻性调整因子等，并结合市场惯例和历史损失经验等，复核了管理层减值模型计算结果的合理性；</p> <p>5. 我们评价了贵集团在合并财务报表中对融出资金及买入返售金融资产减值的相关披露。</p>
<b>商誉的减值</b>	
<p>贵集团每年定期对商誉的账面价值进行检查，以判断是否发生减值。在进行减值测试时，管理层将商誉分配到相应的资产组或资产组组合，对资产组或资产组组合的可收回金额进行估计。</p> <p>于 2020 年 12 月 31 日，贵集团商誉的账面原值为人民币 4.21 亿元，累计计提减值准备人民币 1.05 亿元，其中收购东吴基金管理有限公司时形成的商誉原值为人民币 2.31 亿元，累计确认商誉减值准备人民币 1.05 亿元；收购东吴证券（国际）金融控股有限公司形成的商誉期末账面原值为人民币 1.66 亿元，未确认商誉减值准备。</p> <p>在预计相关资产组组合的可收回金额时，管理层作出的关键假设包括收入增长率、费用增长率以及折现率等，这些关键假设具有不确定性，不同的判断和估计会对财务报表产生重大影响。因此，我们将商誉减值测试认定为关键审计事项。</p> <p>有关商誉减值的相关披露，请参见财务报表附注三、21，财务报表附注三、32，财务报表附注五、17 及财务报表附注五、21。</p>	<p>1. 我们评估和测试了贵集团商誉减值评估流程的内部控制设计和执行的有效性；</p> <p>2. 我们评估了管理层对商誉减值的判断、各资产组或资产组合的认定以及商誉在各资产组或资产组合之间的分摊；</p> <p>3. 我们评价了管理层所采用的商誉减值测试的模型，通过比较分析相关资产组或资产组组合的历史财务数据，结合行业趋势和管理层预期，评价了管理层编制预计未来现金流现值时所采用的关键假设的合理性；</p> <p>4. 我们还评价了贵集团在合并财务报表中对商誉减值的披露。</p>
<b>合并结构化主体的考虑</b>	
<p>结构化主体通常是为实现具体而明确的目的设计并成立的，并在确定的范围内开展业务活动。贵集团在多个资产管理计划、信托计划、有限合伙企业等结构化主体中担任管理人或投资人，可以通过发起设立、持有投资或保留权益份额等方式在结构化主体中享有权益。</p> <p>于 2020 年 12 月 31 日，贵集团在由第三方机构发起设立但未纳入合并范围的结构化主体中持有的权益的账面价值为人民币 112.06 亿元。在由贵集团发起设立但未纳入合并范围的结构化主体中持有的权益的账面价值为人民币 6.74 亿元。</p>	<p>1. 我们评估和测试了贵集团在确定结构化主体是否纳入合并财务报表的合并范围时建立的内部控制设计和执行的有效性；</p> <p>2. 我们抽样检查了结构化主体相关合同、设立文件以及其他公开披露信息，以了解结构化主体的设立目的，从对结构化主体拥有的权力、享有的可变回报以及影响结构化主体可变回报的能力等方面，评价了管理层就结构化主体是否应纳入合并范围所作出的判断；</p> <p>3. 我们还评价了贵集团在合并财务报表</p>



<p>在考虑是否将结构化主体纳入合并范围时，管理层评价其对结构化主体相关活动拥有的权力，享有的可变回报，以及通过运用该权力影响可变回报的能力。这些因素并非完全可以量化，因此需要管理层作出重大判断和估计，不同的判断结果可能会对合并财务报表产生重大影响。因此，我们将贵集团结构化主体的合并识别为关键审计事项。</p> <p>有关在结构化主体中的权益，请参见财务报表附注三、5，财务报表附注三、32，财务报表附注七、3及财务报表附注七、4。</p>	<p>中对结构化主体的相关披露。</p>
---	----------------------

#### 四、其他信息

东吴证券股份有限公司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，管理层负责评估东吴证券股份有限公司的持续经营能力，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。

治理层负责监督东吴证券股份有限公司的财务报告过程。

#### 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：

(1) 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。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

(3) 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。

(4) 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，就可能导致对东吴证券股份有限公司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东吴证券股份有限公司不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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

(6) 就东吴证券股份有限公司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年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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国北京

中国注册会计师：赵 英  
（项目合伙人）

中国注册会计师：莫艾琦

2021 年 4 月 28 日

## 二、财务报表

## 合并资产负债表

2020 年 12 月 31 日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	5.01	23,550,623,073.76	18,198,632,387.91
其中：客户资金存款		19,972,497,020.66	14,885,031,765.25
结算备付金	5.02	4,022,703,604.97	3,352,807,143.85
其中：客户备付金		3,635,439,157.44	3,043,809,592.17
融出资金	5.03	18,049,801,302.82	11,603,902,720.20
衍生金融资产	5.04	7,949,263.29	515,945.01
买入返售金融资产	5.05	7,018,448,234.30	9,806,267,228.49
应收票据	5.06		60,000.00
应收款项	5.07	376,891,916.23	157,516,730.15
存出保证金	5.08	3,125,558,058.04	2,578,212,328.38
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	5.09	34,115,122,757.46	37,142,619,699.52
债权投资	5.10	224,095,373.07	142,062,707.25
其他债权投资	5.11	6,264,932,127.78	5,796,376,967.37
其他权益工具投资	5.12	3,843,359,653.81	4,372,178,679.85
长期股权投资	5.13	1,538,178,928.49	1,179,023,133.40
固定资产	5.14	649,911,472.33	676,034,148.75
在建工程	5.15	879,705,555.60	
无形资产	5.16	230,916,590.07	187,413,953.50
商誉	5.17	315,844,316.37	149,905,260.26
递延所得税资产	5.18	854,571,053.96	620,316,429.24
其他资产	5.19	405,936,918.57	270,799,585.02
资产总计		105,474,550,200.92	96,234,645,048.15
<b>负债：</b>			
短期借款	5.23	1,069,956,134.02	362,188,067.17
应付短期融资款	5.24	8,400,919,247.63	4,894,327,023.67
交易性金融负债	5.25	1,978,636,180.90	5,609,206,692.41
衍生金融负债	5.04	3,535,520.85	4,923,382.96
卖出回购金融资产款	5.26	10,717,911,545.84	13,125,823,986.35
代理买卖证券款	5.27	25,197,694,220.26	19,734,231,640.82
应付职工薪酬	5.28	1,184,966,047.79	786,812,209.05
应交税费	5.29	417,602,767.42	116,009,444.57
应付票据	5.30	177,170,000.00	30,000,000.00
应付款项	5.31	405,002,473.26	39,020,993.89
合同负债	5.32	20,248,472.58	
应付债券	5.33	26,829,753,610.13	28,239,590,639.74
递延所得税负债	5.18	57,846,309.94	4,650,589.76
其他负债	5.34	802,986,871.92	2,032,068,150.66
负债合计		77,264,229,402.54	74,978,852,821.05
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	5.35	3,880,518,908.00	3,000,000,000.00

资本公积	5.36	16,738,719,260.67	11,765,216,102.69
减：库存股	5.37	19,220,540.31	19,220,540.31
其他综合收益	5.38	10,214,293.84	125,477,406.24
盈余公积	5.39	999,241,215.48	848,900,937.29
一般风险准备	5.40	2,479,309,440.09	2,153,950,217.90
未分配利润	5.41	3,791,110,825.14	3,081,589,047.65
归属于母公司所有者权益（或 股东权益）合计		27,879,893,402.91	20,955,913,171.46
少数股东权益		330,427,395.47	299,879,055.64
所有者权益（或股东权益） 合计		28,210,320,798.38	21,255,792,227.10
负债和所有者权益（或股东 权益）总计		105,474,550,200.92	96,234,645,048.15

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

## 母公司资产负债表

2020 年 12 月 31 日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金		16,557,112,668.94	14,328,230,464.59
其中：客户资金存款		15,111,886,948.19	12,930,943,949.11
结算备付金		4,217,793,091.85	3,419,412,323.04
其中：客户备付金		3,635,439,157.44	3,043,809,592.17
融出资金		17,773,535,774.34	11,603,902,720.20
衍生金融资产			80,262.68
存出保证金		225,822,171.01	115,896,068.79
应收票据			60,000.00
应收款项	15.01	33,407,859.54	92,477,807.21
买入返售金融资产		6,270,089,161.84	6,878,482,591.04
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产		27,343,180,782.74	27,484,330,874.02
其他债权投资		6,272,297,615.32	5,783,648,902.77
其他权益工具投资		3,803,934,935.10	4,287,302,784.61
长期股权投资	15.02	8,476,183,686.25	7,521,590,895.96
固定资产		603,211,298.13	634,648,702.07
在建工程		879,705,555.60	
无形资产		195,908,850.11	177,628,275.93
商誉		11,749,999.80	11,749,999.80
递延所得税资产		732,027,730.35	504,071,252.13
其他资产	15.03	157,293,737.79	120,136,077.54

资产总计		93,553,254,918.71	82,963,650,002.38
<b>负债：</b>			
应付短期融资款		8,400,919,247.63	4,894,327,023.67
交易性金融负债		46,900,714.00	12,037,000.00
衍生金融负债		3,508,078.35	4,267,800.83
卖出回购金融资产款		10,626,015,724.81	12,414,099,831.28
代理买卖证券款		18,659,000,563.40	15,855,895,259.65
应付职工薪酬		971,315,109.00	651,934,582.57
应交税费		338,098,956.34	57,305,805.09
应付款项		109,682,445.87	20,217,652.51
合同负债		18,769,809.43	
应付债券		26,829,753,610.13	28,239,590,639.74
其他负债		202,450,665.67	288,285,622.85
负债合计		66,206,414,924.63	62,437,961,218.19
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		3,880,518,908.00	3,000,000,000.00
资本公积		16,625,441,979.30	11,657,819,494.42
减：库存股		19,220,540.31	19,220,540.31
其他综合收益		101,058,271.37	129,966,338.16
盈余公积		999,241,215.48	848,900,937.29
一般风险准备		2,274,042,866.73	1,964,114,786.54
未分配利润		3,485,757,293.51	2,944,107,768.09
所有者权益（或股东权益）合计		27,346,839,994.08	20,525,688,784.19
负债和所有者权益（或股东权益）总计		93,553,254,918.71	82,963,650,002.38

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

## 合并利润表

2020 年 1—12 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020 年度	2019 年度
一、营业总收入		7,356,492,441.10	5,130,373,462.68
利息净收入	5.42	596,033,856.04	327,585,104.71
其中：利息收入		2,544,025,876.41	2,501,030,081.16
利息支出		1,947,992,020.37	2,173,444,976.45
手续费及佣金净收入	5.43	2,898,120,849.15	2,001,888,885.20
其中：经纪业务手续费净收入		1,524,514,930.41	1,050,491,645.86
投资银行业务手续费净收入		1,082,877,329.31	625,083,630.67
资产管理业务手续费净收入		138,523,625.07	161,216,479.25
投资收益（损失以“-”号填列）	5.44	2,150,889,651.98	1,907,256,840.08
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		105,043,531.40	73,254,131.49
其他收益	5.45	36,782,828.96	11,549,618.99
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5.46	154,025,828.18	-437,166,281.54
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-3,437,643.66	-6,329,478.39
其他业务收入	5.47	1,525,997,717.95	1,325,510,848.88
资产处置收益（损失以“-”号填列）	5.48	-1,920,647.50	77,924.75

二、营业总支出		5,055,307,538.37	3,794,185,952.48
税金及附加	5.49	46,831,931.30	37,401,886.49
业务及管理费	5.50	2,755,310,416.25	2,175,155,235.93
信用减值损失	5.51	726,520,642.60	169,304,036.71
其他资产减值损失	5.52		89,343,191.51
其他业务成本	5.53	1,526,644,548.22	1,322,981,601.84
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		2,301,184,902.73	1,336,187,510.20
加：营业外收入	5.54	3,381,250.17	3,815,283.75
减：营业外支出	5.55	31,279,910.19	6,431,929.75
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,273,286,242.71	1,333,570,864.20
减：所得税费用	5.56	559,663,358.96	354,325,271.06
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,713,622,883.75	979,245,593.14
（一）按经营持续性分类			
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,713,622,883.75	979,245,593.14
2.终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
（二）按所有权归属分类			
1.归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列）		1,707,245,952.72	1,037,174,921.82
2.少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		6,376,931.03	-57,929,328.68
六、其他综合收益的税后净额		-116,130,047.08	169,670,219.59
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	5.38	-112,657,455.88	168,295,111.05
（一）不能重分类进损益的其他综合收益			
1.重新计量设定受益计划变动额			
2.权益法下不能转损益的其他综合收益		3,757,019.42	1,236,628.23
3.其他权益工具投资公允价值变动		-7,127,910.98	149,234,027.97
（二）将重分类进损益的其他综合收益			
1.权益法下可转损益的其他综合收益		-42,621.94	6,395,083.22
2.其他债权投资公允价值变动		-52,650,400.94	-19,152,260.82
3.金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4.其他债权投资信用损失准备		13,099,197.25	11,651,023.64
5.现金流量套期储备			
6.外币财务报表折算差额		-69,692,738.69	18,930,608.81
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	5.38	-3,472,591.20	1,375,108.54
七、综合收益总额		1,597,492,836.67	1,148,915,812.73
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,594,588,496.84	1,205,470,032.87
归属于少数股东的综合收益总额		2,904,339.83	-56,554,220.14
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)			
	5.57	0.46	0.33
（二）稀释每股收益(元/股)			
	5.57	0.46	0.33

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

**母公司利润表**  
2020 年 1—12 月

单位:元币种:人民币

项目	附注	2020 年度	2019 年度
一、营业总收入		4,712,111,504.43	3,268,249,102.56
利息净收入	15.04	455,831,634.66	197,359,989.48
其中: 利息收入		2,271,215,497.31	2,142,355,407.87
利息支出		1,815,383,862.65	1,944,995,418.39
手续费及佣金净收入	15.05	2,560,510,447.54	1,709,720,510.85
其中: 经纪业务手续费净收入		1,363,145,157.96	964,910,830.32
投资银行业务手续费净收入		1,086,118,955.35	625,083,630.67
资产管理业务手续费净收入		75,918,595.12	102,035,447.81
投资收益(损失以“—”号填列)	15.06	1,681,954,577.03	1,176,292,224.23
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益		88,329,687.67	62,318,853.59
其他收益		17,652,911.26	3,708,959.38
公允价值变动收益(损失以“—”号填列)	15.07	-3,030,034.76	175,973,605.00
汇兑收益(损失以“—”号填列)		-2,832,906.64	956,462.70
其他业务收入		3,807,248.43	4,154,889.51
资产处置收益(损失以“—”号填列)		-1,782,373.09	82,461.41
二、营业总支出		2,802,450,048.24	1,895,211,455.03
税金及附加		42,012,543.04	32,650,042.69
业务及管理费		2,183,488,483.83	1,753,619,395.24
信用减值损失		576,949,021.37	108,942,017.10
三、营业利润(亏损以“—”号填列)		1,909,661,456.19	1,373,037,647.53
加: 营业外收入		466,535.16	210,314.91
减: 营业外支出		27,128,702.05	5,859,984.02
四、利润总额(亏损总额以“—”号填列)		1,882,999,289.30	1,367,387,978.42
减: 所得税费用		359,056,413.15	306,307,677.52
五、净利润(净亏损以“—”号填列)		1,523,942,876.15	1,061,080,300.90
(一) 持续经营净利润(净亏损以“—”号填列)		1,523,942,876.15	1,061,080,300.90
(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		-26,302,727.77	164,807,435.29
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益		15,519,895.80	172,694,249.27
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		15,519,895.80	172,694,249.27
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		-41,822,623.57	-7,886,813.98
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-42,621.94	-391,427.39
2. 其他债权投资公允价值变动		-26,489,271.25	-19,146,410.23
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用损失准备		-15,290,730.38	11,651,023.64
七、综合收益总额		1,497,640,148.38	1,225,887,736.19

法定代表人: 范力

主管会计工作负责人: 袁维静

会计机构负责人: 王菁

## 合并现金流量表

2020 年 1—12 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020年度	2019年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		5,251,099,055.71	
为交易目的而持有的金融负债净增加额		34,414,396.07	
收取利息、手续费及佣金的现金		6,140,019,268.80	4,984,535,003.19
回购业务资金净增加额			10,750,529,296.63
代理买卖证券收到的现金净额		4,746,857,496.50	5,914,270,315.06
收到其他与经营活动有关的现金	5.58（1）	1,860,576,674.03	2,140,035,345.48
经营活动现金流入小计		18,032,966,891.11	23,789,369,960.36
为交易目的而持有的金融资产净增加额			6,361,218,170.76
为交易目的而持有的金融负债净减少额			69,056,770.16
融出资金净增加额		6,211,365,061.44	4,467,719,970.43
拆入资金净减少额			30,000,000.00
回购业务资金净减少额		778,451,841.25	
支付利息、手续费及佣金的现金		1,306,660,024.11	1,000,547,773.14
支付给职工及为职工支付的现金		1,510,887,303.26	1,275,500,805.17
支付的各项税费		920,435,764.87	815,845,357.95
支付其他与经营活动有关的现金	5.58（2）	7,736,323,085.28	8,632,103,439.18
经营活动现金流出小计		18,464,123,080.21	22,651,992,286.79
经营活动产生的现金流量净额	5.59（1）	-431,156,189.10	1,137,377,673.57
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		3,375,476,618.88	2,351,356,745.35
取得投资收益收到的现金		488,882,874.94	706,765,882.00
取得子公司及其他营业单位收到的现金净额		65,379,382.45	
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		169,523,651.74	
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		1,143,866.00	1,566,804.11
投资活动现金流入小计		4,100,406,394.01	3,059,689,431.46
投资支付的现金		3,443,348,807.14	2,303,024,223.19
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		1,098,272,269.56	78,318,266.87
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额	5.59（2）		529.26
投资活动现金流出小计		4,541,621,076.70	2,381,343,019.32
投资活动产生的现金流量净额		-441,214,682.69	678,346,412.14



<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		5,943,328,574.40	92,197,500.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		30,000,000.00	92,197,500.00
取得借款收到的现金		30,344,548,443.25	22,606,157,576.00
发行债券收到的现金		8,289,343,000.00	8,225,812,500.00
筹资活动现金流入小计		44,577,220,017.65	30,924,167,576.00
偿还债务支付的现金		35,557,836,000.00	25,398,175,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,040,186,685.78	1,874,034,402.95
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		2,356,000.00	1,551,748.82
支付其他与筹资活动有关的现金	5.58 (3)	45,000,000.00	4,247,945.83
筹资活动现金流出小计		37,643,022,685.78	27,276,457,348.78
筹资活动产生的现金流量净额		6,934,197,331.87	3,647,710,227.22
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-120,249,475.48	18,003,066.53
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	5.59 (1)	5,941,576,984.60	5,481,437,379.46
加：期初现金及现金等价物余额		21,305,468,663.16	15,824,031,283.70
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	5.59 (3)	27,247,045,647.76	21,305,468,663.16

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

## 母公司现金流量表

2020 年 1—12 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020年度	2019年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		1,421,895,432.11	
为交易目的而持有的金融负债净增加额		34,414,396.07	
收取利息、手续费及佣金的现金		5,220,258,745.61	4,114,080,469.87
回购业务资金净增加额			9,603,911,351.70
代理买卖证券收到的现金净额		2,841,845,085.13	4,090,240,525.04
收到其他与经营活动有关的现金		37,621,426.89	38,884,006.89
经营活动现金流入小计		9,556,035,085.81	17,847,116,353.50
为交易目的而持有的金融资产净增加额			9,359,422,422.55
为交易目的而持有的金融负债净减少额			69,056,770.16
融出资金净增加额		6,100,355,323.74	4,467,719,970.43
拆入资金净减少额			30,000,000.00
回购业务资金净减少额		1,684,043,302.81	
支付利息、手续费及佣金的现金		976,089,593.73	803,137,900.42
支付给职工及为职工支付的现金		1,237,434,380.18	1,049,124,366.60
支付的各项税费		647,168,854.57	690,176,728.17

支付其他与经营活动有关的现金		882,616,494.74	449,882,722.83
经营活动现金流出小计		11,527,707,949.77	16,918,520,881.16
经营活动产生的现金流量净额	15.08 (1)	-1,971,672,863.96	928,595,472.34
<b>二、投资活动产生的现金流量:</b>			
收回投资收到的现金		3,347,876,166.89	2,348,082,016.82
取得投资收益收到的现金		770,162,230.29	759,277,563.42
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		985,777.71	1,327,689.89
投资活动现金流入小计		4,119,024,174.89	3,108,687,270.13
投资支付的现金		3,345,100,708.34	2,135,904,835.79
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		1,063,793,591.33	65,033,608.00
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		887,000,000.00	1,330,532,500.00
投资活动现金流出小计		5,295,894,299.67	3,531,470,943.79
投资活动产生的现金流量净额		-1,176,870,124.78	-422,783,673.66
<b>三、筹资活动产生的现金流量:</b>			
吸收投资收到的现金		5,913,328,574.40	
取得借款收到的现金		29,582,935,640.00	22,598,251,000.00
发行债券收到的现金		8,289,343,000.00	8,225,812,500.00
筹资活动现金流入小计		43,785,607,214.40	30,824,063,500.00
偿还债务支付的现金		35,557,836,000.00	25,398,175,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,004,184,854.81	1,859,607,885.93
支付其他与筹资活动有关的现金		45,000,000.00	4,247,945.83
筹资活动现金流出小计		37,607,020,854.81	27,262,030,831.76
筹资活动产生的现金流量净额		6,178,586,359.59	3,562,032,668.24
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-12,176,924.76	3,536,579.28
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	15.08 (2)	3,017,866,446.09	4,071,381,046.20
加: 期初现金及现金等价物余额		17,735,736,367.79	13,664,355,321.59
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	15.08 (3)	20,753,602,813.88	17,735,736,367.79

法定代表人: 范力

主管会计工作负责人: 袁维静

会计机构负责人: 王菁

## 合并所有者权益变动表

2020 年 1—12 月

单位:元币种:人民币

项目	2020 年度								
	归属于母公司所有者权益							少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	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		
一、上年年末余额	3,000,000,000.00	11,765,216,102.69	19,220,540.31	125,477,406.24	848,900,937.29	2,153,950,217.90	3,081,589,047.65	299,879,055.64	21,255,792,227.10
加:会计政策变更					-2,054,009.43	-4,108,018.86	-14,378,066.04		-20,540,094.33
前期差错更正									
其他									
二、本年初余额	3,000,000,000.00	11,765,216,102.69	19,220,540.31	125,477,406.24	846,846,927.86	2,149,842,199.04	3,067,210,981.61	299,879,055.64	21,235,252,132.77
三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列)	880,518,908.00	4,973,503,157.98		-115,263,112.40	152,394,287.62	329,467,241.05	723,899,843.53	30,548,339.83	6,975,068,665.61
(一)综合收益总额				-112,657,455.88			1,707,245,952.72	2,904,339.83	1,597,492,836.67
(二)所有者投入和减少资本	880,518,908.00	4,973,503,157.98						30,000,000.00	5,884,022,065.98
1.所有者投入的普通股	880,518,908.00	4,970,209,617.45						30,000,000.00	5,880,728,525.45
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		3,293,540.53							3,293,540.53
(三)利润分配					152,394,287.62	329,467,241.05	-985,951,765.71	-2,356,000.00	-506,446,237.04
1.提取盈余公积					152,394,287.62		-152,394,287.62		
2.提取一般风险准备						329,467,241.05	-329,467,241.05		
3.对所有者(或股东)的分配							-504,090,237.04	-2,356,000.00	-506,446,237.04
4.其他									
(四)所有者权益内部结转				-2,605,656.52			2,605,656.52		
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				-2,605,656.52			2,605,656.52		
6. 其他									
四、本年年末余额	3,880,518,908.00	16,738,719,260.67	19,220,540.31	10,214,293.84	999,241,215.48	2,479,309,440.09	3,791,110,825.14	330,427,395.47	28,210,320,798.38

项目	2019 年度								
	归属于母公司所有者权益							少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	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		
一、上年年末余额	3,000,000,000.00	11,763,810,687.76	14,972,594.48	-363,358,462.59	785,248,236.72	1,994,598,147.20	2,994,947,444.76	265,713,260.84	20,425,986,720.21
加：会计政策变更				280,248,172.95	-42,455,329.52	-86,040,838.44	-289,000,947.87	604,026.03	-136,644,916.85
前期差错更正									
其他									
二、本年初余额	3,000,000,000.00	11,763,810,687.76	14,972,594.48	-83,110,289.64	742,792,907.20	1,908,557,308.76	2,705,946,496.89	266,317,286.87	20,289,341,803.36
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)		1,405,414.93	4,247,945.83	208,587,695.88	106,108,030.09	245,392,909.14	375,642,550.76	33,561,768.77	966,450,423.74
(一) 综合收益总额				168,295,111.05			1,037,174,921.82	-56,554,220.14	1,148,915,812.73
(二) 所有者投入和减少资本		1,405,414.93	4,247,945.83					91,667,737.73	88,825,206.83
1. 所有者投入的普通股								92,197,500.00	92,197,500.00
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		1,405,414.93	4,247,945.83					-529,762.27	-3,372,293.17
(三) 利润分配					106,108,030.09	245,392,909.14	-621,239,786.23	-1,551,748.82	-271,290,595.82
1. 提取盈余公积					106,108,030.09		-106,108,030.09		
2. 提取一般风险准备						245,392,909.14	-245,392,909.14		

3. 对所有者（或股东）的分配							-269,738,847.00	-1,551,748.82	-271,290,595.82
4. 其他									
（四）所有者权益内部结转				40,292,584.83			-40,292,584.83		
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				40,292,584.83			-40,292,584.83		
6. 其他									
四、本年年末余额	3,000,000,000.00	11,765,216,102.69	19,220,540.31	125,477,406.24	848,900,937.29	2,153,950,217.90	3,081,589,047.65	299,879,055.64	21,255,792,227.10

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

母公司所有者权益变动表

2020 年 1—12 月

单位：元币种：人民币

项目	2020 年度							
	实收资本(或股本)	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	3,000,000,000.00	11,657,819,494.42	19,220,540.31	129,966,338.16	848,900,937.29	1,964,114,786.54	2,944,107,768.09	20,525,688,784.19
加：会计政策变更					-2,054,009.43	-4,108,018.86	-14,378,066.04	-20,540,094.33
前期差错更正								
其他								
二、本年年初余额	3,000,000,000.00	11,657,819,494.42	19,220,540.31	129,966,338.16	846,846,927.86	1,960,006,767.68	2,929,729,702.05	20,505,148,689.86
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）	880,518,908.00	4,967,622,484.88		-28,908,066.79	152,394,287.62	314,036,099.05	556,027,591.46	6,841,691,304.22
（一）综合收益总额				-26,302,727.77			1,523,942,876.15	1,497,640,148.38

(二) 所有者投入和减少资本	880,518,908.00	4,967,622,484.88						5,848,141,392.88
1. 所有者投入的普通股	880,518,908.00	4,970,209,617.45						5,850,728,525.45
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		-2,587,132.57						-2,587,132.57
(三) 利润分配					152,394,287.62	314,036,099.05	-970,520,623.71	-504,090,237.04
1. 提取盈余公积					152,394,287.62		-152,394,287.62	
2. 提取一般风险准备						314,036,099.05	-314,036,099.05	
3. 对所有者(或股东)的分配							-504,090,237.04	-504,090,237.04
4. 其他								
(四) 所有者权益内部结转				-2,605,339.02			2,605,339.02	
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				-2,605,339.02			2,605,339.02	
6. 其他								
四、本年年末余额	3,880,518,908.00	16,625,441,979.30	19,220,540.31	101,058,271.37	999,241,215.48	2,274,042,866.73	3,485,757,293.51	27,346,839,994.08

项目	2019 年度							
	实收资本(或股本)	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	3,000,000,000.00	11,656,995,851.83	14,972,594.48	-366,605,684.62	785,248,236.72	1,827,084,777.17	2,818,480,252.06	19,706,230,838.68
加：会计政策变更				291,286,654.77	-42,455,329.52	-84,910,659.04	-297,187,306.65	-133,266,640.44
前期差错更正								
其他								
二、本年初余额	3,000,000,000.00	11,656,995,851.83	14,972,594.48	-75,319,029.85	742,792,907.20	1,742,174,118.13	2,521,292,945.41	19,572,964,198.24
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)		823,642.59	4,247,945.83	205,285,368.01	106,108,030.09	221,940,668.41	422,814,822.68	952,724,585.95
(一) 综合收益总额				164,807,435.29			1,061,080,300.90	1,225,887,736.19
(二) 所有者投入和减少资本		823,642.59	4,247,945.83					-3,424,303.24

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		823,642.59	4,247,945.83					-3,424,303.24
(三) 利润分配					106,108,030.09	221,940,668.41	-597,787,545.50	-269,738,847.00
1. 提取盈余公积					106,108,030.09		-106,108,030.09	
2. 提取一般风险准备						221,940,668.41	-221,940,668.41	
3. 对所有者(或股东)的分配							-269,738,847.00	-269,738,847.00
4. 其他								
(四) 所有者权益内部结转				40,477,932.72			-40,477,932.72	
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				40,477,932.72			-40,477,932.72	
6. 其他								
四、本年年末余额	3,000,000,000.00	11,657,819,494.42	19,220,540.31	129,966,338.16	848,900,937.29	1,964,114,786.54	2,944,107,768.09	20,525,688,784.19

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

## 附注 1、公司基本情况

### 1. 公司概况

√适用 □不适用

东吴证券股份有限公司（原名苏州证券公司、苏州证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司，以下简称“本公司”，本公司及其子公司以下简称“本集团”）成立于 1993 年 4 月 10 日，1998 年 1 月 9 日经中国人民银行江苏省分行苏银复（1998）30 号批复同意增资改制，注册资本增至 10,400 万元，公司名称变更登记为苏州证券有限责任公司，2001 年 12 月 19 日经中国证监会证监机构字（2001）308 号“关于苏州证券有限责任公司增资扩股并更名的批复”，注册资本由 10,400 万增至 100,000 万元人民币，公司更名为东吴证券有限责任公司。

2008 年 6 月 23 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]831 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更注册资本的批复”，增加注册资本人民币 50,000 万元，变更后的注册资本为人民币 150,000 万元。

2009 年 12 月 8 日经公司 2009 年度第二次临时股东会决议并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]310 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复”批准，本公司整体变更为东吴证券股份有限公司，变更后，公司的注册资本为人民币 150,000 万元，由全体股东以截至 2009 年 9 月 30 日经审计后的公司净资产折股。

2011 年 1 月 25 日经公司 2011 年第一次临时股东大会决议并经中国证券监督管理委员会“证监许可[2011]1887 号”文核准，公司首次公开发行 50,000 万股新股。公司股票于 2011 年 12 月 12 日起在上海证券交易所上市交易，注册资本变更为人民币 200,000 万元。

2013 年 9 月 9 日经公司 2013 年第二次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2014 年 2 月 13 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可[2014]200 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 70,000 万股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 70,000 万元，变更后公司注册资本为人民币 270,000 万元。

2015 年 11 月 16 日经公司 2015 年第四次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2015 年 12 月 23 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可[2015]3035 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 30,000 万股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 30,000 万元，变更后公司注册资本为人民币 300,000 万元。

2019 年 12 月 27 日，经中国证监会“证监许可（2019）2984 号”《关于核准东吴证券股份有限公司配股的批复》，核准公司向原股东配售股份。2020 年 3 月，公司完成配股发行，发行数量 880,518,908 股，并于 2020 年 4 月 8 日完成了工商变更登记手续，公司注册资本增加至 3,880,518,908 元。

公司住所：苏州工业园区星阳街 5 号。

2020 年 4 月 8 日，取得由苏州市工商行政管理局核准变更登记的新企业法人营业执照，统一社会信用代码：91320000137720519P



经营范围：许可经营项目：证券经纪；证券投资咨询；与证券投资交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。

本财务报表业经本公司董事会于 2021 年 4 月 28 日决议批准。根据本公司章程，本财务报表将提交股东大会审议。

## 2. 合并财务报表范围

适用 不适用

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，本年度变化情况详见本附注六“合并范围的变更”。

## 附注 2、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

本财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制。

本财务报表以持续经营为基础列报。

编制本财务报表时，除某些金融工具外，均以历史成本为计价原则。资产如果发生减值，则按照相关规定计提相应的减值准备。

### 2. 持续经营

适用 不适用

本公司已评价自报告期末起至少 12 个月的持续经营能力，本公司管理层相信公司能自本财务报表批准日后不短于 12 个月的可预见未来期间内持续经营。因此，本公司以持续经营为基础编制截至 2020 年 12 月 31 日止的财务报表。

## 附注 3、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

适用 不适用

本集团金融工具的核算、承销证券业务的核算、融资融券的核算、转融通业务的核算、收入的确认和计量、资产减值准备等交易和事项的会计政策和会计估计，是按照公司实际业务特点制定的，详见本附注 3 之相关描述。

### 1. 遵循企业会计准则的声明

本公司所编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了公司的财务状况、经营成果、股东权益变动和现金流量等有关信息。

### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 3. 记账本位币

本公司记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

本集团下属子公司、合营企业及联营企业，根据其经营所处的主要经济环境自行决定其记账本位币，编制财务报表时折算为人民币。

### 4. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

√适用 □不适用

#### (1) 同一控制下企业合并

参与合并的各方在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时性的，为同一控制下企业合并。合并方在企业合并中取得的资产和负债，以被合并方的资产、负债（包括最终控制方收购被合并方而形成的商誉）在最终控制方合并财务报表中的账面价值为基础，进行相关会计处理。合并方取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）不足以冲减的，调整留存收益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

通过多次交易分步实现的同一控制下企业合并，合并方在取得被合并方控制权之前持有的长期股权投资，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一方最终控制之日孰晚日与合并日之间已确认有关损益、其他综合收益和其他所有者权益变动，分别冲减比较报表期间的期初留存收益或当期损益。

#### (2) 非同一控制下的企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下企业合并。购买方支付的合并成本是为取得被购买方控制权而支付的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和。购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。购买方在购买日对合并成本进行分配，确认所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。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（参见附注 3、19）；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的差额，计入当期损益。

通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并的，对于购买日之前持有的被购买方的长期股权投资，按照该长期股权投资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损益；购买日之前持有的被购买方的长期股权投资涉及在权益法核算下的其他综合收益的，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理，除净损益、其他综合收益和利润分配外的其他股东权益变动，转为购买日所属当期损益。对于购买日之前持有的被购买方的其他权益工具投资，该权益工具投资在购买日之前累计在其他综合收益的公允价值变动转入留存损益。

## 5. 合并财务报表的编制方法

√适用 □不适用

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，包括本公司及本公司的子公司（指被本公司控制的主体，包括企业、被投资单位中可分割部分、以及企业所控制的结构化主体等）。控制，是指拥有对被投资单位的权力，通过参与被投资单位的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资单位的权力影响其回报金额。子公司的经营成果、财务状况和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

本公司通过同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，视同被合并子公司在本公司最终控制方对其实施控制时纳入合并范围，并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。

本公司通过非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以购买日确定的各项可辨认资产、负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整，并自购买日起将被合并子公司纳入合并范围。

子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时，在编制合并财务报表时按本公司的会计期间或会计政策对子公司的财务报表进行必要的调整。合并范围内企业之间所有重大交易、余额以及未实现损益在编制合并财务报表时予以抵消。内部交易发生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则不予抵消。

子公司少数股东应占的权益、损益和综合收益总额分别在合并资产负债表的股东权益中和合并利润表的净利润及综合收益总额项目后单独列示。如果子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的，其余仍冲减少数股东权益。

对于购买子公司少数股权或因处置部分股权投资但没有丧失对该子公司控制权的交易，作为权益性交易核算，调整归属于母公司所有者权益和少数股东权益的账面价值以反映其在子公司中相关权益的变化。少数股东权益的调整额与支付/收到对价的公允价值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。

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，对于剩余股权，按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司自购买日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益、其他所有者权益变动，在丧失控制权时转为当期投资收益，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。

通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，需考虑各项交易是否构成一揽子交易，处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：(1)这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；(2)这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；(3)一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；(4)一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

不属于一揽子交易的，对其中每一项交易分别按照前述进行会计处理；若各项交易属于一揽

子交易的，将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

## 6. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

√适用 □不适用

合营安排分为共同经营和合营企业。共同经营，是指合营方享有该安排相关资产且承担该安排相关负债的合营安排。合营企业，是指合营方仅对该安排的净资产享有权利的合营安排。

共同经营的合营方应当确认其与共同经营中利益份额相关的下列项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理：（一）确认单独所持有的资产，以及按其份额确认共同持有的资产；（二）确认单独所承担的负债，以及按其份额确认共同承担的负债；（三）确认出售其享有的共同经营产出份额所产生的收入；（四）按其份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；（五）确认单独所发生的费用，以及按其份额确认共同经营发生的费用。

合营方向共同经营投出或出售资产等（该资产构成业务的除外），在该资产等由共同经营出售给第三方之前，应当仅确认因该交易产生的损益中归属于共同经营其他参与方的部分。投出或出售的资产发生符合《企业会计准则第 8 号——资产减值》等规定的资产减值损失的，合营方应当全额确认该损失。

合营方自共同经营购买资产等（该资产构成业务的除外），在将该资产等出售给第三方之前，应当仅确认因该交易产生的损益中归属于共同经营其他参与方的部分。购入的资产发生符合《企业会计准则第 8 号——资产减值》等规定的资产减值损失的，合营方应当按其承担的份额确认该部分损失。

对共同经营不享有共同控制的参与方，如果享有该共同经营相关资产且承担该共同经营相关负债的，应当按照前述规定进行会计处理。

## 7. 现金及现金等价物的确定标准

现金及现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、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。

## 8. 外币业务和外币报表折算

√适用 □不适用

### (1) 外币交易的会计处理

发生外币交易时，采用按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的汇率折算。于资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，除根据借款费用核算方法应予资本化的，计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，于资产负债表日仍采用交易发生日的即期汇率折算。

### (2) 外币财务报表的折算

境外经营的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，股东权益项目除未分配利润项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。境外经营的利润表中的收入和

费用项目，采用年平均汇率折算。上述折算产生的外币报表折算差额，在其他综合收益中单独列示。

## 9. 金融工具

√适用 □不适用

金融工具，是指形成一方的金融资产，并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

金融工具包括金融资产、金融负债和权益工具。

### (一) 金融资产和金融负债的确认和终止确认

本集团成为金融工具合同的一方时，应当确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或负债终止确认，是指本集团将之前确认的金融资产或金融负债从资产负债表中予以转出。

#### 1、金融资产的终止确认：

满足下列条件之一时，本集团终止确认该金融资产：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 本集团将收取金融资产现金流量的合同权利转移给其他方；
- (3) 本集团保留了收取金融资产现金流量的合同权利，但承担了将收取的现金流量支付给一个或多个最终收款方的合同义务，且(a)实质上转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，或(b)虽然实质上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，但未保留对该金融资产的控制。

#### 2、金融负债的终止确认

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本集团终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。本集团与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，本集团应当终止确认原金融负债，同时确认一项新金融负债。

本集团对原金融负债（或其一部分）的合同条款做出实质性修改的，应当终止确认原金融负债，同时按照修改后的条款确认一项新金融负债。

### (二) 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

金融资产在初始确认时，根据本集团企业管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分为：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金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

除非本集团改变管理金融资产的业务模式，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

管理金融资产的业务模式，是指本集团如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本集团所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本集团以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本集团对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本集团对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (1) 以摊余成本计量的金融资产

本集团将同时符合下列条件的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- ①管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

#### (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（债务工具）

本集团将同时符合下列条件的金融资产，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（债务工具）：

- ①本集团管理该金融资产的业务模式是既以收取合同现金流量为目标又以出售金融资产为目标；
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

#### (3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）

对于非交易性权益工具投资，本集团可在初始确认时将其不可撤销地指定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。

满足下列条件之一的，表明本集团持有该金融资产的目的是交易性的：取得相关金融资产的目的主要是为了近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但符合财务担保合同的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从工具发行方的角度符合权益工具的定义。

#### (4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本集团将其余所有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。

在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，企业可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地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。

## 2、金融负债的分类

金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；以摊余成本计量的金融负债。

企业对所有金融负债均不得进行重分类。

### (1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。

在初始计量时，符合以下条件之一的金融负债，企业可将其不可撤销地指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债：

①能够消除或显著减少会计错配；

②根据正式书面文件载明的企业风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在公司内部以此为基础向关键管理人员报告。

### (2) 以摊余成本计量的金融负债

除下列各项外，本集团将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债：

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不属于上述情形的财务担保合同，以及不属于上述情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

## (三) 金融资产和金融负债的计量

### 1、初始计量

初始确认的金融资产或金融负债，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或金融负债，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。

企业取得金融资产所支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的利息或现金股利，应当单独确认为应收项目进行处理。

## 2、后续计量

### (1) 以摊余成本计量的金融资产

该类金融资产采用实际利率法以摊余成本进行后续计量。在其终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时产生的利得或损失，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金融资产（债务工具）

该类金融资产以公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息收入、减值损失或利得和汇兑损益计入当期损益，其余公允价值变动均计入其他综合收益。当金融资产终止确认时，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金融资产（权益工具）

该类金融资产以公允价值进行后续计量。其公允价值的后续变动计入其他综合收益，不计提减值准备。除了获得的股利收入（明确作为投资成本部分收回的股利收入除外）计入当期损益外，其他相关的利得和损失（包括汇兑损益）均计入其他综合收益，且后续不得转入损益。当金融资产终止确认时，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

该类金融资产以公允价值进行后续计量，其产生的所有利得或损失计入当期损益。

### (5) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债以公允价值进行后续计量。其产生的所有利得或损失计入当期损益，除非是将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的，则该金融负债所产生的利得或损失按照下列规定进行处理：①由本集团自身信用风险变动引起的该金融负债公允价值的变动金额，应当计入其他综合收益；②该金融负债的其他公允价值变动计入当期损益。按照①对该金融负债的自身信用风险变动的影响进行处理会造成或扩大损益中的会计错配的，本集团应当将该金融负债的全部利得或损失（包括自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

被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终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失应当从其他综合收益中转出，计入留存收益。

### (6) 以摊余成本计量的金融负债

该类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。在其终止确认或按照实际利率法摊销时产生的利得或损失，计入当期损益。



#### (四) 金融资产和金融负债公允价值的确定

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产或者转移一项负债所需支付的价格。本集团以主要市场的价格计量相关资产或负债的公允价值；不存在主要市场的，以最有利市场的价格计量相关资产或负债的公允价值。在确定公允价值时，本集团采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

##### 1、公允价值确定的基本原则

对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

对不存在活跃市场的投资品种，应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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。对于以公允价值计量的金融负债，本集团已考虑不履约风险，并假定不履约风险在负债转移前后保持不变。不履约风险是指企业不履行义务的风险，包括但不限于企业自身信用风险。

##### 2、公允价值层次

本集团对于以公允价值计量的金融资产和金融负债，按照其公允价值计量所使用的输入值分为以下三个层次：

第一层次：输入值是计量日能够取得的相同金融资产或金融负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：输入值是除第一层次输入值外相关金融资产或金融负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：输入值是相关金融资产或金融负债的不可观察输入值。

#### (五) 金融工具减值

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。信用损失是指企业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。

本集团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进行减值会计处理并确认损失准备。

##### 1、金融工具减值阶段的划分

本集团可基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行调整：

第一阶段：在资产负债表日信用风险较低的金融工具，或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，本集团按照相当于该金融工具未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）预期信用损失的金额计量其损失准备；

第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；

第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

上述三阶段的划分，适用于购买或源生时未发生信用减值的金融工具。对于购买或源生时已发生信用减值的金融工具，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。对于符合准则规定条件且适用本集团已做出相应会计政策选择的应收款项和其他应收款，始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

## 2、金融工具减值的账务处理

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，本集团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。在每个资产负债表日，本集团将整个存续期内预期信用损失的变动金额作为减值损失或利得计入当期损益。

本集团在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本集团在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具），本集团在其他综合收益中确认其损失准备，并将减值损失或利得计入当期损益，且不减少金融资产在资产负债表上列示的账面价值。

### （六）金融资产转移的确认依据和计量方法

本集团在判断金融资产转移是否满足金融资产终止确认条件时，采用实质重于形式的原则。本集团已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

本集团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：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其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（或部分）转移满足终止确认条件的，本集团将下列两项金额的差额计入当期损益：

(1) 被转移金融资产（或终止确认部分）在终止确认日的账面价值；

(2) 因转移金融资产（或终止确认部分）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。

金融资产转移不满足终止确认条件的，继续确认该金融资产，并将收到的对价确认为一项金融负债。

#### (七) 衍生工具及嵌入衍生工具

衍生工具包括股指期货、国债期货、商品期货、利率互换、权益互换及场内期权等。衍生工具于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量。衍生工具的公允价值变动计入当期损益。因股指期货、国债期货、商品期货及部分利率互换合约每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与业务相关的暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

对于包含嵌入衍生工具的混合合同，若主合同属于金融资产，本集团不从该混合合同中分拆嵌入衍生工具，而将该混合合同作为一个整体适用关于金融资产分类的会计准则规定。

若主合同不属于金融资产，且同时符合下列条件的，本集团从混合工具中分拆嵌入衍生工具，作为单独的衍生金融工具处理：嵌入衍生工具与该主合同在经济特征及风险方面不紧密相关；与该嵌入衍生工具具有相同条款的单独工具符合衍生工具的定义；该混合合同不是以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。该嵌入衍生工具在取得日或后续资产负债表日的公允价值无法单独计量，则将混合合同整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

#### (八) 金融资产和金融负债的抵销

当本集团具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### (九) 权益工具

发行权益工具收到的对价扣除交易费用后，计入股东权益。回购自身权益工具支付的对价和交易费用，减少股东权益。权益工具的公允价值变动不予确认。

回购自身股份时，回购的股份作为库存股管理，回购股份的全部支出转为库存股成本，同时进行备查登记。库存股不参与利润分配，在资产负债表中作为股东权益的备抵项目列示。

库存股注销时，按注销股票面值总额减少股本，库存股成本超过面值总额的部分，应调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）的余额不足冲减的，调整留存收益；库存股成本低于面值总额的，低于面值总额的部分增加资本公积（股本溢价）。

库存股转让时，转让收入高于库存股成本的部分，增加资本公积（股本溢价）；低于库存股成本的部分，应调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）的余额不足冲减的，调整留存收益。

## 10. 客户交易结算资金

本集团接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等有价值证券而收到的款项，全额存入本集团指定的银行账户，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。

本集团接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等有价值证券时，如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额加上代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用之和减少客户交易结算资金；如卖出证券成交总额大于买入证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额减去代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用后的余额增加客户交易结算资金。

## 11. 承销证券业务

证券公司承销证券时，在证券发行日根据承销合同确认的证券发行总额，按承销价款，在备查簿中记录承销证券的情况。

承销证券结束，将承销证券款交付委托单位并确认承销手续费。

承销期结束，如有未售出证券、采用余额包销方式承销证券的，按合同规定由公司认购，应按承销价款转为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

## 12. 买入返售和卖出回购业务

买入返售交易按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括股票、债券、票据等），合同或协议到期日，再以约定价格返售相同之金融产品。

卖出回购交易按照合同或协议的约定，以一定的价格将相关资产（包括股票、债券、票据等）出售给交易对手，合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。

买入返售及卖出回购业务按发生时实际支付或收到的款项入账，并在资产负债表中确认；买入返售的标的资产在表外作备查登记，卖出回购的标的资产仍在资产负债表中确认。买入返售及卖出回购业务的买卖差价分别按实际利率法在返售或回购期间内确认为利息收入和利息支出。

## 13. 融资融券业务

融资融券业务，是指证券公司向客户出借资金供其买入上市证券或者出借上市证券供其卖出，并收取担保物的经营活动。融资融券业务类型主要包括融资业务和融券业务。

融资业务：证券公司将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。融出资金按借给客户资金的本金计量。

融券业务：将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，此项业务融出的证券不满足终止确认条件，继续确认该金融资产，计入融出证券。

融资融券利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等按期确认利息收入。

证券公司对客户融资融券并代理客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

## 14. 转融通业务

转融通业务包括转融资业务和转融券业务。转融资业务是指中国证券金融股份有限公司(以下简称证金公司)将自有或者依法筹集的资金出借给证券公司, 供其办理融资业务的经营。转融券业务是指证金公司将自有或者融入的证券出借给证券公司, 供其办理融券业务的经营。

转融资业务: 对于融入的资金, 证券公司在资产负债表内确认为资产, 同时确认一项对出借方的负债, 计入“拆入资金”科目, 并在“利息支出”科目核算转融通业务产生的利息费用。

转融券业务: 对于融入的证券, 由于其主要收益或风险不由证券公司享有或承担, 公司不将其计入资产负债表, 但在财务报表附注中披露转融通融入的证券期末市值和转融通融入后拆借给客户的证券期末市值等信息。

## 15. 长期股权投资

√适用 □不适用

### (一) 控制、共同控制、重大影响的判断标准

控制是指投资方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回报金额。共同控制是指按照相关约定对某项安排所共有的控制, 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。重大影响是指对被投资方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。在确定能否对被投资单位实施控制或施加重大影响时, 已考虑投资方和其他方持有的被投资单位当期可转换公司债券、当期可执行认股权证等潜在表决权因素。

### (二) 投资成本确定

企业合并形成的长期股权投资, 按以下方法确定投资成本:

(1) 对于同一控制下企业合并形成的对子公司投资, 以在合并日取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中账面价值的份额作为长期股权投资的投资成本。

分步实现的同一控制下企业合并, 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, 确定长期股权投资的初始投资成本; 初始投资成本与达到合并前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/股本溢价), 资本公积不足冲减的, 冲减留存收益。合并日之前持有的股权投资, 因采用权益法核算而确认的其他综合收益暂不进行会计处理, 直至处置该项投资时采用与投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理; 因采用权益法核算而确认的被投资单位净资产总除净损益、其他综合收益和利润分配以外的所有者权益其他变动, 暂不进行会计处理, 直至处置该项投资时转入当期损益。其中, 处置后的剩余股权采用成本法或权益法核算的, 其他综合收益和其他所有者权益应按比例结转, 处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量准则进行会计处理的, 其他综合收益和其他所有者权益应全部结转。

(2) 对于非同一控制下企业合并形成的对子公司投资, 以企业合并成本作为投资成本。

追加投资能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的, 以购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和, 作为改按成本法核算的初始投资成本; 购买日之前

持有的被购买方的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在处置该项投资时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。

除企业合并形成的长期股权投资以外，其他方式取得的长期股权投资，按以下方法确定投资成本：

- (1) 以支付现金取得的长期股权投资，按实际支付的购买价款作为投资成本。
- (2) 以发行权益性证券取得的长期股权投资，按发行权益性证券的公允价值作为投资成本。

因追加投资等原因，能够对被投资单位单位施加重大影响或实施共同控制但不构成控制的，应当按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》确定的原持有股权的公允价值加上新增投资成本之和，作为改按权益法核算的初始投资成本。

### （三）后续计量及损益确认方法

#### 1、对子公司投资

在母公司财务报表中，对子公司投资采用成本法核算，在被投资单位宣告分派的现金股利或利润时，确认投资收益。

#### 2、对合营企业投资和对联营企业投资

对合营企业投资和对联营企业投资采用权益法核算，具体会计处理包括：

对于初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额包含在长期股权投资成本中；对于初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资成本。

取得对合营企业投资和对联营企业投资后，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资损益和其他综合收益并调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的现金股利或利润应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。

在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益的份额时，以取得投资时被投资单位可辨认净资产的公允价值为基础确定，对于被投资单位的会计政策或会计期间与本集团不同的，权益法核算时按照本集团的会计政策或会计期间对被投资单位的财务报表进行必要调整。与合营企业和联营企业之间内部交易产生的未实现损益按照持股比例计算归属于本集团的部分，在权益法核算时予以抵消。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

对合营企业或联营企业发生的净亏损，除本集团负有承担额外损失义务外，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限。被投资企业以后实现净利润的，在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入资本公积。处置该项投资时，将原计入资本公积的部分按相应比例转入当期损益。

处置长期股权投资，其账面价值与实际取得价款的差额计入当期损益，采用权益法核算的长期股权投资，处置时，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础，按相应比例对原计入其他综合收益的部分进行会计处理。

减值方法及减值准备计提方法参见附注 3、21。

因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》核算，其在丧失共同控制或重大影响之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，应当在终止采用权益法核算时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。

因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位控制的，在编制个别财务报表时，处置后的剩余股权能够对被投资单位实施共同控制或重大影响的，改按权益法核算，并对剩余股权视同自取得时即采用权益法核算进行调整。处置后剩余股权不能对被投资单位实施共同控制或重大影响的，按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定进行会计处理，其在丧失控制权之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。

## 16. 固定资产

### (1). 确认条件

√适用 □不适用

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的并且使用年限超过一年的有形资产。固定资产在取得时，按取得时的成本入账。与购买或建造固定资产有关的一切直接或间接成本，在所购建资产达到预定可使用状态前所发生的，全部资本化为固定资产的成本。固定资产折旧采用直线法平均计算，并按固定资产的原值扣除残值和其预计使用年限制定折旧率。

当固定资产处于处置状态或预期通过使用或处置不能产生经济利益时，终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

### (2). 折旧方法

√适用 □不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋建筑物	年限平均法	30~35	3~5	2.71~3.23
运输设备	年限平均法	5~10	3~5	9.5~19.4
办公设备及其他	年限平均法	5	3~5	19~19.4

当固定资产处于处置状态或预期通过使用或处置不能产生经济利益时，终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

减值测试方法及会计处理方法参见附注 3、21。

**(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法**

适用 不适用

**17. 在建工程**

适用 不适用

在建工程按实际成本计量，实际成本包括在建期间发生的各项工程支出、工程达到预定可使用状态前的资本化的借款费用以及其他相关费用等。在建工程不计提折旧。

当所建工程项目达到预定可使用状态时，转入固定资产核算；尚未办理竣工决算的，按估计价值转帐，待办理竣工决算手续后再作调整。

减值测试方法及会计处理方法参见附注 3、21。

**18. 无形资产****(1). 计价方法、使用寿命、减值测试**

适用 不适用

无形资产是指本集团拥有或者控制的没有实物形态的可辨认非货币性资产。

无形资产按照成本进行初始计量。

使用寿命有限的无形资产，自其可供使用时起在使用寿命内采用年限平均法摊销，计入当期损益；每年年度终了，对其使用寿命及摊销方法进行复核，若与以前估计不同的，改变摊销期限和摊销方法。

各项无形资产的摊销年限如下：

类别	摊销年限(年)
土地使用权	40
交易席位费	10
软件及其他	5

使用寿命不确定的无形资产不摊销；在每个会计期间对其使用寿命进行复核，如果有证据表明其使用寿命是有限的，估计其使用寿命并按上述方法进行摊销。

**19. 商誉**

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是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。对商誉不摊销，以其成本扣除累计减值准备后的金额计量。商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。商誉的减值方法及会计处理方法参见附注 3、21。

**20. 长期待摊费用**

适用 不适用

长期待摊费用按实际发生额入账，按费用项目的受益期限采用直线法平均摊销。本集团对以经营租赁方式租入的固定资产改良支出，其发生符合资本化条件的各项支出，计入本项目，按剩余租赁期与 5 年两者中较短的期限平均摊销。如果 5 年内同一经营租入固定资产又发生类似改良支出，将上次未摊完的长期待摊费用余额一次性计入当期损益。



## 21. 资产减值

√适用 □不适用

除附注三、9 所述金融工具的减值以外，本集团在资产负债表日检查长期股权投资、固定资产、在建工程及使用寿命确定的无形资产是否存在可能发生减值的迹象；如果该等资产存在减值迹象，则估计其可收回金额。使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

估计资产的可收回金额以单项资产为基础，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，则以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。可收回金额为资产或者资产组的公允价值减去处置费用后的净额与其预计未来现金流量的现值两者之中的较高者。如果资产的可收回金额低于其账面价值，按其差额计提资产减值准备，并计入当期损益。

商誉至少在每年年度终了进行减值测试。对商誉进行减值测试时，结合与其相关的资产组或者资产组组合进行。即自购买日起将商誉的账面价值按照合理的方法分摊到能够从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合，如包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额首先抵减分摊到该资产组或资产组组合的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

## 22. 应付职工薪酬

√适用 □不适用

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。本集团在职工提供服务的会计期间，将应付的职工薪酬确认为负债。

本集团按规定参加由政府机构设立的职工社会保障体系，包括基本养老保险、医疗保险、住房公积金及其他社会保障制度，相应的支出于发生时计入相关资产成本或当期损益。

在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，本集团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：本集团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；本集团确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

## 23. 预计负债

√适用 □不适用

与或有事项相关的义务同时满足下列条件的，应当确认为预计负债：

- (1) 该义务是企业承担的现时义务；
- (2) 履行该义务很可能导致经济利益流出企业；
- (3) 该义务的金额能够可靠地计量。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。

如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定。

在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

- (1) 或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定。
- (2) 或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

## 24. 收入

√适用 □不适用

### 与客户之间的合同产生的收入

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。取得相关商品或服务的控制权，是指能够主导该商品的使用或该服务的提供并从中获得几乎全部的经济利益。

满足下列条件之一时，本集团属于在某一段时间内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：

- (1) 客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益；
- (2) 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；
- (3) 本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团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，本集团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，本集团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，本集团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或服务控制权时，本集团会考虑下列迹象：

- (1) 本集团就该商品或服务享有现时收款权利；
- (2) 本集团已将该商品的实物转移给客户；
- (3) 本集团已将该商品的法定所有权或所有权上的主要风险和报酬转移给客户；
- (4) 客户已接受该商品或服务。

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且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，合同资产以预期信用损失为基础计提减值（参见附注三、9）。本集团拥有的、无条件（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。本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务作为合同负债列示。

与本集团取得与客户之间的合同产生的收入相关的具体会计政策描述如下：

代理买卖证券业务手续费收入及期货经纪业务手续费收入于交易日在达成有关交易后确认。

承销收入于本集团完成承销合同中的履约义务时确认收入。

保荐业务、财务顾问业务和投资咨询服务业务收入根据合同条款在本集团履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

受托客户资产管理业务收入，于受托投资管理合同到期，与委托人结算时，本集团按合同规定的比例计算应由本集团享有的管理费收益，确认为当期收益；或合同中规定本集团按约定比例收取管理费和业绩报酬，则在合同期内分期确认管理费和业绩报酬收益。

其他收入在客户取得相关商品或服务的控制权时确认。

### 投资收益

持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）在持有期间取得的利息、红利、股息或现金股利计入投资收益。

金融资产转移满足终止确认条件的，除了初始确认时指定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（权益工具），应当将下列两项金额的差额计入投资收益：

- (1) 终止确认部分的账面价值；
- (2) 终止确认部分的对价，与原计入股东权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分派的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据应享有或应分担的被投资单位实现的净损益确认投资收益。

### 利息收入

存款利息收入：在相关的收入金额能够可靠地计量，相关的经济利益可以收到时，按资金使用时间和实际利率确认利息收入。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入。

买入返售证券收入：在当期到期返售的，按返售价格与买入成本价格的差额，确认利息收入；在当期没有到期的，根据买入返售金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入，但对于已发生信用减值的金融资产，改按该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

融资融券业务利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等确认利息收入。

其他以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）：根据相关金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入，但对于已发生信用减值的金融资产，改按该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

## 25. 合同资产与合同负债

√适用 □不适用

本集团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。

### 合同资产

合同资产是指已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利，且该权利取决于时间流逝之外的其他因素。

### 合同负债

合同负债是指已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务。

## 26. 与合同成本有关的资产

√适用 □不适用

本集团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。

本集团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，除非该资产摊销期限不超过一年。

本集团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的，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) 该成本增加了企业未来用于履行履约义务的资源；
- (3) 该成本预期能够收回。

本集团对与合同成本有关的资产采用与该资产相关的收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。

与合同成本有关的资产，其账面价值高于下列两项差额的，本集团将超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失：

- (1) 企业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；
- (2) 为转让该相关商品或服务估计将要发生的成本。

以前期间减值的因素之后发生变化，使得（1）减（2）的差额高于该资产账面价值的，应当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应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。

## 27. 政府补助

√适用 □不适用

政府补助在能够满足其所附的条件并且能够收到时，予以确认。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；公允价值不能够可靠取得的，按照名义金额计量。

政府文件规定用于购建或以其他方式形成长期资产的，作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，除此之外的作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，并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。

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，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期平均分配，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，尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

## 28. 所得税

本集团采用资产负债表债务法进行所得税会计处理。

除与直接计入股东权益的交易或事项有关的所得税影响计入股东权益外，当期所得税费用和递延所得税费用（或收益）计入当期损益。

当期所得税费用是按本年度应纳税所得额和税法规定的税率计算的预期应交所得税，加上对以前年度应交所得税的调整。

资产负债表日，如果纳税主体拥有以净额结算的法定权利并且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行，那么当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列示。

递延所得税资产和递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定，按照预期收回资产或清偿债务期间的适用税率计量。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度抵扣的亏损和税款递减。递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

对于既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）的非企业合并交易中产生的资产或负债初始确认形成的暂时性差异，不确认递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生递延所得税。

资产负债表日，根据递延所得税资产和负债的预期收回或结算方式，依据已颁布的税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量该递延所得税资产和负债的账面金额。

资产负债表日，递延所得税资产及递延所得税负债在同时满足以下条件时以抵销后的净额列示：

(1) 纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；

(2) 递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债。

## 29. 经营租赁

### 1、租入资产

经营租赁租入资产的租金费用在租赁期内按直线法确认为相关资产成本或费用。或有租金在实际发生时计入当期损益。

### 2、租出资产

经营租赁租出资产所产生的租金收入在租赁期内按直线法确认为收入。经营租赁租出资产发生的初始直接费用，直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

## 30. 利润分配

适用  不适用

当年实现的税后利润于弥补以前年度亏损后，本公司根据《公司法》的规定，按照当年税后利润的 10% 足额提取法定盈余公积金，但本公司法定盈余公积金累计额达到本公司注册资本的 50% 时，可不再提取；根据《金融企业财务规则》的要求，按照税后利润的 10% 足额提取一般风险准备；根据《证券法》的要求，按不低于税后利润的 10% 提取交易风险准备金。经股东大会批准，本公司可从税后利润中提取任意盈余公积金。

本公司提取的一般风险准备金及交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算，用于弥补证券交易的损失。经股东大会批准，本公司提取的法定盈余公积金和任意盈余公积金可用于弥补本公司的亏损或者转增股本，但法定盈余公积金转为股本时，所留存的该项公积金不得少于转增前本公司注册资本的 25%。

本公司资本公积金不得用于弥补公司的亏损。

本公司可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得用于向股东进行现金分配。以前年度未分配利润，可并入当年度未分配利润向股东分配。

## 31. 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本集团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) 公司管理层能够定期评价该组成部分的经营业绩，以决定向其分配资源、评价业绩；
- (3) 能够取得该部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相同或相类似的经济特征，并且满足一定条件，本集团将其合并为一个经营分部。

## 32. 重大会计判断和估计

√适用 □不适用

运用上述会计政策过程中，由于经营活动内在的不确定性，本集团需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。本集团管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。导致出现重大调整风险的重要会计估计和关键假设如下：

### （一）应用会计政策过程中所作的重要判断

#### 1、金融资产的分类

##### a) 业务模式

金融资产于初始确认时的分类取决于本集团管理金融资产的业务模式，在判断业务模式时，本集团考虑包括企业评价和向关键管理人员报告金融资产业绩的方式、影响金融资产业绩的风险及其管理方式以及相关业务管理人员获得报酬的方式等。在评估是否以收取合同现金流量为目标时，本集团需要对金融资产到期日前的出售原因、时间、频率和价值等进行分析判断。

##### b) 合同现金流量特征

金融资产于初始确认时的分类取决于金融资产的合同现金流量特征，需要判断合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金为基础的利息的支付时，包含对货币时间价值的修正进行评估时，需要判断与基准现金流量相比是否具有显著差异、对包含提前还款特征的金融资产，需要判断提前还款特征的公允价值是否非常小等。

#### 2、金融资产转移

管理层需要就金融资产的转移作出重大判断，确认与否会影响会计核算方法及本集团的财务状况和经营成果。

#### 3、合并范围的确定

评估本集团是否作为投资者控制被投资企业时须考虑所有事实及情况。控制的定义包含以下三项要素：1) 拥有对被投资者的权力；2) 通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；3) 有能力运用对被投资者的权力影响其回报的金额。倘若有事实及情况显示上述一项或多项要素发生了变化，则本集团需要重新评估其是否对被投资企业构成控制。对于本集团管理并投资的结构化主体，本集团会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。在评估时，本集团需要估计结构化主体收益率、管理费、业绩报酬以及持有份额等可变因素，进而测算本集团享有的可变回报及回报的可变性，以分析评估本公司是否达到控制标准。若本集团对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

## （二）会计估计中采用的关键假设和不确定因素

### 1、金融工具的公允价值

对于缺乏活跃交易市场的金融工具，本集团运用估值方法确定其公允价值。在估值时，本集团需对诸如自身和交易对手的信用风险、市场波动率和相关性等方面进行估计，这些相关因素假设的变化会对金融工具的公允价值产生影响。

### 2、金融资产的减值

本集团采用预期信用损失模型对金融工具的减值进行评估，应用预期信用损失模型需要做出重大判断和估计，需考虑所有合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。在做出该等判断和估计时，本集团根据历史还款数据结合经济政策、宏观经济指标、行业风险等因素推断债务人信用风险的预期变动。

### 3、除金融资产和商誉以外的其他资产减值

如附注三、21 所述，本集团于资产负债表日对除金融资产和商誉之外的其他资产（固定资产、在建工程等）判断是否存在可能发生减值的迹象。在进行减值测试时，当资产或资产组的账面价值高于可收回金额，表明发生了减值。预计未来现金流量现值时，管理层必须估计该项资产或资产组的预计未来现金流量，并选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

### 4、商誉减值

本集团每年对商誉进行减值测试。在进行减值测试时，需要将商誉分配到相应的资产组或资产组组合，并预计资产组或者资产组组合未来产生的现金流量，同时选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

### 5、所得税

在正常的经营活动中，涉及的很多交易和事项的最终税务处理都存在不确定性，本集团根据相关税收法规谨慎判断交易对应的所得税影响并相应计提所得税。递延所得税资产只有在未来有足够纳税所得并可用于抵销有关暂时性差异时才可确认。对此需要就某些交易的税务处理作出重大判断。如果这些税务事项的最终认定结果与最初入账的金额存在差异，该差异将对作出上述最终认定期间的所得税费用和递延所得税的金额产生影响。

## 33. 重要会计政策和会计估计的变更

### （1）、重要会计政策变更

√适用 □不适用

#### 新收入准则

2017 年，财政部颁布了修订的《企业会计准则第 14 号——收入》（简称“新收入准则”）。本



集团自 2020 年 1 月 1 日开始按照新修订的上述准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初留存收益。

新收入准则为规范与客户之间的合同产生的收入建立了新的收入确认模型。根据新收入准则，确认收入的方式应当反映主体向客户转让商品或提供服务的模式，收入的金额应当反映主体因向客户转让这些商品或服务而预计有权获得的对价金额。同时，新收入准则对于收入确认的每一个环节所需要进行的判断和估计也做出了规范。本集团仅对在 2020 年 1 月 1 日尚未完成的合同的累积影响数进行调整，对 2020 年 1 月 1 日之前发生的合同变更，本集团采用简化处理方法，对所有合同根据合同变更的最终安排，识别已履行的和尚未履行的履约义务、确定交易价格以及在已履行的和尚未履行的履约义务之间分摊交易价格。

## (2)、重要会计估计变更

适用 不适用

## (3)、2020 年起首次执行新收入准则调整首次执行当年年初财务报表相关情况

适用 不适用

### 合并资产负债表

单位:元币种:人民币

项目	2019 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	调整数
<b>资产：</b>			
货币资金	18,198,632,387.91	18,198,632,387.91	
其中：客户资金存款	14,885,031,765.25	14,885,031,765.25	
结算备付金	3,352,807,143.85	3,352,807,143.85	
其中：客户备付金	3,043,809,592.17	3,043,809,592.17	
融出资金	11,603,902,720.20	11,603,902,720.20	
衍生金融资产	515,945.01	515,945.01	
存出保证金	2,578,212,328.38	2,578,212,328.38	
应收票据	60,000.00	60,000.00	
应收款项	157,516,730.15	157,516,730.15	
合同资产			
买入返售金融资产	9,806,267,228.49	9,806,267,228.49	
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	37,142,619,699.52	37,142,619,699.52	
债权投资	142,062,707.25	142,062,707.25	
其他债权投资	5,796,376,967.37	5,796,376,967.37	
其他权益工具投资	4,372,178,679.85	4,372,178,679.85	
长期股权投资	1,179,023,133.40	1,179,023,133.40	
固定资产	676,034,148.75	676,034,148.75	
无形资产	187,413,953.50	187,413,953.50	
商誉	149,905,260.26	149,905,260.26	
递延所得税资产	620,316,429.24	627,163,127.35	6,846,698.11
其他资产	270,799,585.02	270,799,585.02	
资产总计	96,234,645,048.15	96,241,491,746.26	6,846,698.11

<b>负债：</b>			
短期借款	362,188,067.17	362,188,067.17	
应付短期融资款	4,894,327,023.67	4,894,327,023.67	
交易性金融负债	5,609,206,692.41	5,609,206,692.41	
衍生金融负债	4,923,382.96	4,923,382.96	
卖出回购金融资产款	13,125,823,986.35	13,125,823,986.35	
代理买卖证券款	19,734,231,640.82	19,734,231,640.82	
应付职工薪酬	786,812,209.05	786,812,209.05	
应交税费	116,009,444.57	116,009,444.57	
应付票据	30,000,000.00	30,000,000.00	
应付款项	39,020,993.89	39,020,993.89	
合同负债		27,386,792.44	27,386,792.44
应付债券	28,239,590,639.74	28,239,590,639.74	
递延所得税负债	4,650,589.76	4,650,589.76	
其他负债	2,032,068,150.66	2,032,068,150.66	
负债合计	74,978,852,821.05	75,006,239,613.49	27,386,792.44
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00	
资本公积	11,765,216,102.69	11,765,216,102.69	
减：库存股	19,220,540.31	19,220,540.31	
其他综合收益	125,477,406.24	125,477,406.24	
盈余公积	848,900,937.29	846,846,927.86	-2,054,009.43
一般风险准备	2,153,950,217.90	2,149,842,199.04	-4,108,018.86
未分配利润	3,081,589,047.65	3,067,210,981.61	-14,378,066.04
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	20,955,913,171.46	20,935,373,077.13	-20,540,094.33
少数股东权益	299,879,055.64	299,879,055.64	
所有者权益（或股东权益）合计	21,255,792,227.10	21,235,252,132.77	-20,540,094.33
负债和所有者权益（或股东权益）总计	96,234,645,048.15	96,241,491,746.26	6,846,698.11

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

### 母公司资产负债表

单位：元币种：人民币

项目	2019年12月31日	2020年1月1日	调整数
<b>资产：</b>			
货币资金	14,328,230,464.59	14,328,230,464.59	
其中：客户资金存款	12,930,943,949.11	12,930,943,949.11	
结算备付金	3,419,412,323.04	3,419,412,323.04	

其中：客户备付金	3,043,809,592.17	3,043,809,592.17	
融出资金	11,603,902,720.20	11,603,902,720.20	
衍生金融资产	80,262.68	80,262.68	
存出保证金	115,896,068.79	115,896,068.79	
应收票据	60,000.00	60,000.00	
应收款项	92,477,807.21	92,477,807.21	
合同资产			
买入返售金融资产	6,878,482,591.04	6,878,482,591.04	
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	27,484,330,874.02	27,484,330,874.02	
其他债权投资	5,783,648,902.77	5,783,648,902.77	
其他权益工具投资	4,287,302,784.61	4,287,302,784.61	
长期股权投资	7,521,590,895.96	7,521,590,895.96	
固定资产	634,648,702.07	634,648,702.07	
无形资产	177,628,275.93	177,628,275.93	
商誉	11,749,999.80	11,749,999.80	
递延所得税资产	504,071,252.13	510,917,950.24	6,846,698.11
其他资产	120,136,077.54	120,136,077.54	
资产总计	82,963,650,002.38	82,970,496,700.49	6,846,698.11
<b>负债：</b>			
应付短期融资款	4,894,327,023.67	4,894,327,023.67	
交易性金融负债	12,037,000	12,037,000.00	
衍生金融负债	4,267,800.83	4,267,800.83	
卖出回购金融资产款	12,414,099,831.28	12,414,099,831.28	
代理买卖证券款	15,855,895,259.65	15,855,895,259.65	
应付职工薪酬	651,934,582.57	651,934,582.57	
应交税费	57,305,805.09	57,305,805.09	
应付款项	20,217,652.51	20,217,652.51	
合同负债		27,386,792.44	27,386,792.44
应付债券	28,239,590,639.74	28,239,590,639.74	
其他负债	288,285,622.85	288,285,622.85	
负债合计	62,437,961,218.19	62,465,348,010.63	27,386,792.44
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>		0.00	
实收资本（或股本）	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00	
资本公积	11,657,819,494.42	11,657,819,494.42	
减：库存股	19,220,540.31	19,220,540.31	
其他综合收益	129,966,338.16	129,966,338.16	
盈余公积	848,900,937.29	846,846,927.86	-2,054,009.43
一般风险准备	1,964,114,786.54	1,960,006,767.68	-4,108,018.86
未分配利润	2,944,107,768.09	2,929,729,702.05	-14,378,066.04
所有者权益（或股东权益）合计	20,525,688,784.19	20,505,148,689.86	-20,540,094.33

负债和所有者权益（或股东权益）总计	82,963,650,002.38	82,970,496,700.49	6,846,698.11
-------------------	-------------------	-------------------	--------------

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

#### (4)、2020 年起首次执行新收入准则、新租赁准则追溯调整前期比较数据的说明

适用 不适用

#### (5)、执行新收入准则对的 2020 年度财务报表影响

合并资产负债表

项目	报表数	假设按原准则	影响
<b>资产：</b>			
递延所得税资产	854,571,053.96	853,627,657.74	943,396.22
<b>负债：</b>			
合同负债	20,248,472.58		20,248,472.58
其他负债	802,986,871.92	804,465,535.07	-1,478,663.15
应交税费	417,602,767.42	421,351,823.55	-3,749,056.13
<b>所有者权益：</b>			
盈余公积	999,241,215.48	1,000,648,951.18	-1,407,735.70
一般风险准备	2,479,309,440.09	2,482,124,911.49	-2,815,471.40
未分配利润	3,791,110,825.14	3,800,964,975.12	-9,854,149.98

合并利润表

	报表数	假设按原准则	影响
手续费及佣金净收入	2,898,120,849.15	2,889,503,866.14	8,616,983.01
所得税费用	559,663,358.96	557,509,113.20	2,154,245.76

母公司资产负债表

项目	报表数	假设按原准则	影响
<b>资产：</b>			
递延所得税资产	732,027,730.35	731,084,334.13	943,396.22
<b>负债：</b>			
合同负债	18,769,809.43		18,769,809.43
应交税费	338,098,956.34	341,848,012.47	-3,749,056.13
<b>所有者权益：</b>			
盈余公积	999,241,215.48	1,000,648,951.18	-1,407,735.70
一般风险准备	2,274,042,866.73	2,276,858,338.13	-2,815,471.40
未分配利润	3,485,757,293.51	3,495,611,443.49	-9,854,149.98

母公司利润表

	报表数	假设按原准则	影响
--	-----	--------	----

手续费及佣金净收入	2,560,510,447.54	2,551,893,464.53	8,616,983.01
所得税费用	359,056,413.15	356,902,167.39	2,154,245.76

#### (6)、即将生效的新租赁准则的影响

于2018年12月，财政部颁布了经修订的《企业会计准则第21号——租赁》（以下简称“新租赁准则”）。该准则的核心变化是，取消承租人关于融资租赁与经营租赁的分类，要求承租人对所有租赁（选择简化处理的短期租赁和低价值资产租赁除外）确认使用权资产和租赁负债，并分别确认折旧和利息费用。在出租人方面，该准则基本沿袭了现行租赁准则的会计处理规定，但改进了出租人的信息披露，要求出租人披露对其保留的有关租赁资产的权利所采取的风险管理战略、为降低相关风险所采取的措施等。

本集团将于2021年1月1日起采用新租赁准则。截至2020年12月31日，本集团根据与出租人签订的租赁合同，不可撤销租赁的最低租赁付款额参见附注十二。本集团已经进行了详细评估，上述修订的采用，会增加本集团的总资产和总负债，但不会对本集团的所有者权益产生重大影响。

#### 附注 4、税项

##### 1. 主要税种及税率

主要税种及税率情况

适用 不适用

税种	计税依据	税率
增值税	根据财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36号）、《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税[2016]46号）以及《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》（财税[2016]70号）等规定，自2016年5月1日起，公司的主营业务收入适用增值税，税率为6%。根据财政部和国家税务总局2016年12月21日发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税收政策的通知》，纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于财税[2016]36号的金融商品转让。资管产品运营过程中发生的增	1%-16%

	<p>值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。根据财政部和国家税务总局 2017 年 1 月 6 日发布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳。</p> <p>根据《关于支持个体工商户复工复业增值税政策的公告》（财政部税务总局公告 2020 年第 13 号）以及《关于延长小规模纳税人减免增值政策执行期限的公告》（财政部税务总局公告 2020 年第 24 号）的有关规定，自 2020 年 3 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日，除湖北省外，其他省、自治区、直辖市的增值税小规模纳税人，适用 3% 征收率的应税销售收入，减按 1% 征收增值税。</p>	
城市维护建设税	按流转税额的 7% 计征。城建税实行就地缴纳的办法，公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳城建税。	7%
企业所得税	按应纳税所得额计征	16.5%、17%、25%
教育费附加及地方教育费附加	按流转税额的 5% 计征	5%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

√适用 □不适用

纳税主体名称	所得税税率 (%)
本公司及本公司的境内子公司	25
本公司的香港子公司	16.5
本公司的新加坡子公司	17

## 附注 5、合并财务报表项目注释

## 1、货币资金

(1) 按类别列示

单位：元

项目	期末余额	期初余额
库存现金	165,837.47	205,105.36
银行存款	23,471,843,494.40	18,112,299,247.78
其中：客户存款	19,972,497,020.66	14,885,031,765.25
公司存款	3,499,346,473.74	3,227,267,482.53
其他货币资金	78,613,741.89	86,128,034.77
合计	23,550,623,073.76	18,198,632,387.91

(2) 按币种列示

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	165,837.47	/	/	205,105.36
人民币	/	/	165,837.47	/	/	205,105.36
银 行 存 款：	/	/	23,471,843,494.40	/	/	18,112,299,247.78
其中：自 有资金	/	/	3,499,346,473.74	/	/	3,227,267,482.53
人民币	/	/	2,847,996,404.85	/	/	2,367,257,959.58
美元	13,964,493.06	6.5249	91,116,920.77	16,405,588.04	6.9762	114,448,663.28
港元	609,995,823.66	0.8416	513,372,485.19	787,625,890.17	0.8958	705,555,272.41
新加坡	9,193,214.51	4.9314	45,335,418.03	7,732,191.82	5.1739	40,005,587.26
其他外币			1,525,244.90			
客户资金	/	/	19,972,497,020.66	/	/	14,885,031,765.25
人民币	/	/	18,903,100,363.91	/	/	14,786,314,985.06
美元	34,911,643.65	6.5249	227,794,983.65	11,703,903.76	6.9762	81,648,773.41
港元	997,431,852.72	0.8416	839,438,647.25	19,053,367.69	0.8958	17,068,006.78
新加坡元	31,593.76	4.9314	155,801.47		5.1739	
其他外币			2,007,224.38			
其他货币 资金：	/	/	78,613,741.89	/	/	86,128,034.77
人民币	/	/	9,100,457.27	/	/	86,128,034.77
美元	9,328,269.11	6.5249	60,866,023.12		6.9762	
港元	10,274,787.90	0.8416	8,647,261.50		0.8958	
合计	/	/	23,550,623,073.76	/	/	18,198,632,387.91

其中，融资融券业务：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有信用资金	/	/	124,578,665.69	/	/	17,021,100.08
人民币	/	/	124,578,665.69	/	/	17,021,100.08
客户信用资金	/	/	1,497,137,798.61	/	/	1,215,824,888.35
人民币	/	/	1,497,137,798.61	/	/	1,215,824,888.35
合计	/	/	1,621,716,464.30	/	/	1,232,845,988.43

货币资金的说明：

√适用 □不适用

于2020年12月31日，本集团使用受限制的货币资金为人民币295,003,709.96元，主要是本集团纳入合并范围内的子公司计提的一般风险准备金、被冻结的保证金以及本公司客户交易结算资金被司法机关冻结的金额（2019年12月31日：人民币235,366,828.37元）。

于2020年12月31日，本集团存放在境外（包括香港）的货币资金折合人民币1,985,011,435.81元（2019年12月31日：折合人民币825,319,522.94元）。

## 2、结算备付金

√适用 □不适用

（1）按类别列示

项目	期末余额	期初余额
客户备付金	3,635,439,157.44	3,043,809,592.17
公司备付金	387,264,447.53	308,997,551.68
合计	4,022,703,604.97	3,352,807,143.85

（2）按币种列示

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
公司自有备付金：	/	/	387,264,447.53	/	/	308,997,551.68
人民币	/	/	380,744,746.96	/	/	308,997,551.68
美元	999,203.14	6.5249	6,519,700.57		6.9762	
客户普通备付金：	/	/	3,067,075,276.95	/	/	2,741,437,967.16
人民币	/	/	3,011,665,863.32	/	/	2,683,300,368.67



美元	7,529,015.62	6.5249	49,126,074.02	7,786,782.29	6.9762	54,322,150.61
港元	7,465,945.36	0.8416	6,283,339.61	4,259,263.09	0.8958	3,815,447.88
客户信用备付金：	/	/	568,363,880.49	/	/	302,371,625.01
人民币	/	/	568,363,880.49	/	/	302,371,625.01
合计	/	/	4,022,703,604.97	/	/	3,352,807,143.85

### 3、融出资金

√适用 □不适用

(1) 按开户性质列示

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	17,801,729,464.80	11,623,688,935.47
其中：个人	14,674,345,856.73	10,618,808,316.04
机构	3,127,383,608.07	1,004,880,619.43
减：减值准备	28,193,690.46	19,786,215.27
账面价值小计	17,773,535,774.34	11,603,902,720.20
境外	295,533,857.09	
其中：个人	111,773,498.85	
机构	183,760,358.24	
减：减值准备	19,268,328.61	
账面价值小计	276,265,528.48	
账面价值合计	18,049,801,302.82	11,603,902,720.20

(2) 按类别列示

项目	期末	期初
融资融券业务融出资金	17,801,729,464.80	11,623,688,935.47
孖展业务融资	295,533,857.09	
减：减值准备	47,462,019.07	19,786,215.27
融出资金净值	18,049,801,302.82	11,603,902,720.20

(3) 按账龄列示

账龄	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1个月至3个月	7,695,493,344.71	42.52	9,021,221.52	19.01
3个月至6个月	5,472,050,155.51	30.24	10,416,815.51	21.95
6个月以上	4,929,719,821.67	27.24	28,023,982.04	59.04
合计	18,097,263,321.89	100.00	47,462,019.07	100.00

账龄	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1 个月至 3 个月	5,036,383,818.54	43.33	7,925,575.84	40.05
3 个月至 6 个月	2,389,569,841.24	20.56	3,770,561.15	19.06
6 个月以上	4,197,735,275.69	36.11	8,090,078.28	40.89
合计	11,623,688,935.47	100.00	19,786,215.27	100.00

(4) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
证券	52,617,573,704.83	30,397,952,576.87
资金	1,945,933,045.57	1,385,037,275.91
合计	54,563,506,750.40	31,782,989,852.78

融出资金的说明：

√适用 □不适用

于 2020 年 12 月 31 日，融出资金中有本金人民币 761,864,424.38 元被用于债权收益权转让业务，质押到期日为 2021 年 2 月 25 日（2019 年 12 月 31 日：人民币 1,023,864,853.65 元）。

## 4、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义 金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义 金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债		资产	负债
权益 衍生 工具				731,385,406.32		95,522.12				315,088,021.45	416,945.01	795,172.96
信用 衍生 工具				220,000,000.00		3,256,590.00				170,000,000.00		4,128,210.00
利率 衍生 工具				227,756,800.00								
货币 衍生 工具				146,629,168.26	7,949,263.29							
其他 衍生 工具				1,617,906,780.00		183,408.73				1,929,507,030.00	99,000.00	
合计				2,943,678,154.58	7,949,263.29	3,535,520.85				2,414,595,051.45	515,945.01	4,923,382.96

衍生金融工具的说明：

部分本集团持有的衍生金融工具为每日无负债结算，于 2020 年 12 月 31 日本集团持有的未到期的每日无负债结算合约的公允价值为浮亏人民币 20,786,048.16 元（2019 年 12 月 31 日：浮亏人民币 1,480,654.93 元）。

## 5、买入返售金融资产

## (1) 按业务类别

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券		4,802,856.17
股票质押式回购	5,389,771,430.57	9,503,818,547.46
债券质押式回购	3,846,066,461.59	1,317,788,020.19
减：减值准备	2,217,389,657.86	1,020,142,195.33
账面价值合计	7,018,448,234.30	9,806,267,228.49

## (2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	5,389,771,430.57	9,508,621,403.63
债券	3,846,066,461.59	1,317,788,020.19
减：减值准备	2,217,389,657.86	1,020,142,195.33
买入返售金融资产账面价值	7,018,448,234.30	9,806,267,228.49

## (3) 约定购回、股票质押式回购融出资金按剩余期限（不含减值准备）分类披露

项目	期末账面余额		期初账面余额	
	约定购回式证券	股票质押式回购	约定购回式证券	股票质押式回购
1 个月内		4,276,440,847.44		5,309,904,589.82
1 个月至 3 个月		169,466,133.72	4,802,856.17	1,373,156,460.12
3 个月至 1 年		943,864,449.41		2,820,757,497.52
1 年以上				
合计		5,389,771,430.57	4,802,856.17	9,503,818,547.46

## (4) 买入返售业务的担保物情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
担保物	11,123,622,702.66	18,105,019,509.05
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物		9,345,000.00

对于通过交易所操作的债券逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因此无法获知对手方质押库信息，故上述担保物公允价值未包括交易所债券逆回购所取得的担保物资产的公允价值。于 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日，上述交易所债券逆回购的金额分别为人民币 206,758,916.84 元和人民币 71,106,700.00 元。

(5) 于 2020 年 12 月 31 日买入返售金融资产中无债券及资产收益权被用作卖出回购等业务的质押物 (2019 年 12 月 31 日: 无)。

## 6、应收票据

项目	期末余额	期初余额
银行承兑汇票		60,000.00

## 7、应收款项

### (1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

项目	期末余额	期初余额
应收两融业务客户款	21,536,828.68	1,588,882.79
应收清算款	242,395,009.91	91,663,972.92
应收资产管理业务产品管理费	56,919,676.53	30,681,172.89
应收基金业务服务费	10,550,701.54	29,031,492.70
应收其他手续费及佣金	5,912,156.47	20,286,402.19
应收经纪及交易商	22,832,121.06	
定期贷款	53,014,954.22	
其他(注)	4,139,183.66	5,198,389.30
合计	417,300,632.07	178,450,312.79
减:坏账准备(按一般模型计提)	21,536,828.68	1,588,882.79
减:坏账准备(按简化模型计提)	18,871,887.16	19,344,699.85
应收款项账面价值	376,891,916.23	157,516,730.15

注:其他的应收款项主要为应收信用保护合约保护费等,其中并未包含股票质押式回购业务。

### (2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

账龄	期末余额		期初余额	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	386,724,941.54	92.67	167,155,648.53	93.67
1-2年	24,116,355.42	5.78	11,294,664.26	6.33
2-3年	6,459,335.11	1.55		
合计	417,300,632.07	100.00	178,450,312.79	100.00

### (3) 按评估方式列示

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	64,103,804.31	15.36	40,085,487.28	62.53	79,146,953.61	44.35	19,965,262.49	25.23
组合计提坏账准备	353,196,827.76	84.64	323,228.56	0.09	99,303,359.18	55.65	968,320.15	0.98
合计	417,300,632.07	100.00	40,408,715.84	9.68	178,450,312.79	100.00	20,933,582.64	11.73

## (4) 应收款项账面净额前五名

单位名称	账面净额	账龄	占应收款项净额的比例 (%)	款项性质
香港结算中心	44,206,064.23	1 年以内	11.73	应收证券清算款
证券交易所	23,944,647.42	1 年以内	6.35	应收证券清算款
辉立期货公司	12,900,937.10	1 年以内	3.42	应收经纪及交易商
罗广川	8,339,292.68	1 年以内	2.21	定期贷款
平殿敏	5,003,575.61	1 年以内	1.33	定期贷款
合计	94,394,517.04		25.04	

年末应收款项中无应收持有本公司 5%以上（含 5%）股份的股东及其他关联方的款项。

## 8、存出保证金

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末账面余额			期初账面余额		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
交易保证金	/	/	2,995,298,094.59	/	/	2,531,236,687.08
其中：人民币	/	/	2,979,015,132.97	/	/	2,528,905,213.08
美元	270,000.00	6.5249	1,761,723.00	270,000.00	6.9762	1,883,574.00
港元	17,254,323.45	0.8416	14,521,238.62	500,000.00	0.8958	447,900.00
信用保证金	/	/	31,817,421.07	/	/	17,628,374.99
其中：人民币	/	/	31,817,421.07	/	/	17,628,374.99
期货业务结算担保金	/	/	15,703,215.14	/	/	10,480,143.52
其中：人民币	/	/	14,440,815.14	/	/	10,480,143.52
港元	1,500,000.00	0.8416	1,262,400.00		0.8958	
履约保证金	/	/	82,739,327.24	/	/	18,867,122.79
其中：人民币	/	/	82,739,327.24	/	/	18,867,122.79
合计	/	/	3,125,558,058.04	/	/	2,578,212,328.38

## 9、交易性金融资产

√适用 □不适用

(1) 交易性金融资产按投资品种列示

单位：元币种：人民币

期末余额						
类别	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	公允价值合计	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	初始成本合计
债券	22,403,928,229.32		22,403,928,229.32	23,472,000,569.85		23,472,000,569.85
公募基金	2,813,014,611.55		2,813,014,611.55	2,770,690,600.77		2,770,690,600.77
私募基金及专户	2,733,810,082.92		2,733,810,082.92	2,402,458,784.17		2,402,458,784.17
股票	1,735,428,273.21		1,735,428,273.21	1,549,383,322.00		1,549,383,322.00
银行理财产品	725,482,591.84		725,482,591.84	724,000,000.00		724,000,000.00
券商资管产品	23,139,777.35		23,139,777.35	23,209,367.07		23,209,367.07
信托计划	1,504,947,168.29		1,504,947,168.29	1,520,201,400.00		1,520,201,400.00
其他	2,175,372,022.98		2,175,372,022.98	2,221,098,556.23		2,221,098,556.23
合计	34,115,122,757.46		34,115,122,757.46	34,683,042,600.09		34,683,042,600.09
期初余额						
类别	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	公允价值合计	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	初始成本合计
债券	24,678,232,370.34		24,678,232,370.34	25,373,880,260.45		25,373,880,260.45

公募基金	2,939,868,027.77		2,939,868,027.77	2,897,462,743.97		2,897,462,743.97
私募基金及专户	2,369,296,852.48		2,369,296,852.48	2,386,367,301.47		2,386,367,301.47
股票	736,312,161.72		736,312,161.72	720,217,819.67		720,217,819.67
银行理财产品	2,736,194,225.86		2,736,194,225.86	2,736,144,866.49		2,736,144,866.49
券商资管产品	14,953,915.86		14,953,915.86	15,126,717.40		15,126,717.40
信托计划	1,564,580,000.00		1,564,580,000.00	1,605,201,400.00		1,605,201,400.00
其他	2,103,182,145.49		2,103,182,145.49	2,146,633,442.84		2,146,633,442.84
合计	37,142,619,699.52		37,142,619,699.52	37,881,034,552.29		37,881,034,552.29

## (2) 变现有限制的交易性金融资产

项目	限制条件	期末余额	期初余额
债券	质押	9,777,584,017.00	11,716,538,315.90
基金	已融出证券	332,320,728.70	27,982,318.50
股票	已融出证券	47,988,740.61	
股票	存在限售期	509,634,113.80	96,752,859.78
理财产品	质押	84,000,000.00	
合计		10,751,527,600.11	11,841,273,494.18



## 10、债权投资

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额				期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
定向工具	221,841,001.56	3,731,052.46	1,476,680.95	224,095,373.07	139,519,387.40	2,543,319.85		142,062,707.25
合计	221,841,001.56	3,731,052.46	1,476,680.95	224,095,373.07	139,519,387.40	2,543,319.85		142,062,707.25

于 2020 年 12 月 31 日，部分债权投资被用作卖出回购业务的质押物，期末账面价值为人民币 160,252,751.08 元，质押到期日为 2023 年 10 月 13 日（2019 年 12 月 31 日：无）。

## 11、其他债权投资

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
金融债	767,075,823.12	14,822,861.64	6,069,596.88	787,968,281.64	150,531.89	586,615,433.70	16,189,137.55	6,487,830.89	609,292,402.14	343,128.67
企业债	3,030,036,145.24	74,608,652.79	2,757,569.76	3,107,402,367.79	3,171,336.71	1,633,245,681.02	44,769,381.15	22,039,565.98	1,700,054,628.15	1,682,255.09
公司债	1,300,846,515.12	34,935,160.02	-10,789,240.76	1,324,992,434.38	29,606,240.88	1,829,994,631.04	49,148,228.96	42,169,018.95	1,921,311,878.95	1,977,430.50
其他	1,005,067,838.84	28,125,073.97	11,376,131.16	1,044,569,043.97	601,527.53	1,535,575,523.60	29,946,685.49	195,849.04	1,565,718,058.13	21,524,535.63
合计	6,103,026,322.32	152,491,748.42	9,414,057.04	6,264,932,127.78	33,529,637.01	5,585,431,269.36	140,053,433.15	70,892,264.86	5,796,376,967.37	25,527,349.89

其他说明：

于 2020 年 12 月 31 日，其他债权投资中部分债券被用作卖出回购业务的质押物，期末公允价值为人民币 756,545,603.00 元，质押到期日为 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 1 月 5 日（2019 年 12 月 31 日：684,081,578.00 元，质押到期日为 2020 年 1 月 2 日至 2020 年 1 月 12 日。）

## 12、其他权益工具投资

### (1). 按项目披露

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
非交易性证券	1,360,470,179.64	1,293,723,561.00	122,548,387.14	1,861,057,438.15	1,827,971,512.71	102,606,023.63	战略持有
非上市股权	203,888,600.00	160,040,102.30	4,000,000.00	218,888,600.00	207,833,784.23	6,000,000.00	战略持有
证金专户	2,278,350,000.00	2,389,595,990.51		2,278,350,000.00	2,336,373,382.91	149,575,871.45	战略持有
合计	3,842,708,779.64	3,843,359,653.81	126,548,387.14	4,358,296,038.15	4,372,178,679.85	258,181,895.08	/

### (2). 本期终止确认的其他权益工具

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期终止确认时的公允价值	本期股利收入	终止确认时的累计利得或损失本期从其他综合收益转入留存收益的金额	处置该项投资的原因
非上市股权	15,000,000.00		317.50	战略调整
非交易性证券	1,084,091,735.25	41,949,353.66	3,473,785.36	战略调整
合计	1,099,091,735.25	41,949,353.66	3,474,102.86	/

### (3). 变现有限的其他权益工具投资

项目	限制条件	期末余额	期初余额
非交易性证券	已融出证券	94,476,598.11	71,898,570.93
非交易性证券	设定质押	19,626,320.00	
非交易性证券	存在限售期	4,785,955.62	4,913,217.42
合计		118,888,873.73	76,811,788.35

## 13、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	减值准备期末余额
		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		
联营企业										
许昌市绿野农业科技有限公司	6,551,234.77			-3,549,451.95						3,001,782.82
华元恒道（上海）投资管理有限公司	33,324,091.28			-520,672.85	3,757,019.42					36,560,437.85
四川华体照明科技股份有限公司	97,096,200.01		98,887,772.32	2,194,254.20			402,681.89			
东吴（苏州）金融科技有限公司	231,431,523.26			7,952,195.83						239,383,719.09
苏州资产管	454,983,444.35	372,000,000.00		79,075,087.82	70,752.06		12,000,000.00			894,129,284.23

2020 年年度报告

理有限公司											
苏州企业征信服务有限公司	24,366,434.91			-3,400,993.18						20,965,441.73	
中证信用增进股份有限公司	293,949,425.48			23,292,085.38	-113,374.00	3,293,540.53	11,250,000.00			309,171,677.39	
China Reform Puissance Overseas Holdings Ltd	264.63			1,026.15	-71.93					1,218.85	
CDG Overseas Management Co. Ltd.	37,320,514.71				-2,355,148.18					34,965,366.53	
合计	1,179,023,133.40	372,000,000.00	98,887,772.32	105,043,531.40	1,359,177.37	3,293,540.53	23,652,681.89			1,538,178,928.49	

## 14、固定资产

## (1). 固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	房屋及建筑物	运输工具	办公设备及其他	合计
一、账面原值：				
1. 期初余额	728,453,889.99	18,908,153.13	447,796,890.41	1,195,158,933.53
2. 本期增加金额		601,679.65	48,712,480.02	49,314,159.67
(1) 购置			44,097,221.52	44,097,221.52
(2) 在建工程转入				
(3) 企业合并增加		601,679.65	4,615,258.50	5,216,938.15
3. 本期减少金额		804,425.20	79,145,380.99	79,949,806.19
(1) 处置或报废		804,425.20	79,145,380.99	79,949,806.19
外币报表折算差额		-82,935.53	-323,902.00	-406,837.53
4. 期末余额	728,453,889.99	18,622,472.05	417,040,087.44	1,164,116,449.48
二、累计折旧				
1. 期初余额	171,958,638.41	15,670,822.66	331,495,323.71	519,124,784.78
2. 本期增加金额	23,057,977.33	1,420,101.21	46,198,945.34	70,677,023.88
(1) 计提	23,057,977.33	818,421.56	42,148,665.32	66,025,064.21
(2) 企业合并增加		601,679.65	4,050,280.02	4,651,959.67
3. 本期减少金额		797,195.98	74,438,795.50	75,235,991.48
(1) 处置或报废		797,195.98	74,438,795.50	75,235,991.48
外币报表折算差额		-45,859.51	-314,980.52	-360,840.03
4. 期末余额	195,016,615.74	16,247,868.38	302,940,493.03	514,204,977.15
三、减值准备				
1. 期初余额				
2. 本期增加金额				
(1) 计提				
3. 本期减少金额				
(1) 处置或报废				
4. 期末余额				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	533,437,274.25	2,374,603.67	114,099,594.41	649,911,472.33
2. 期初账面价值	556,495,251.58	3,237,330.47	116,301,566.70	676,034,148.75

其他说明：

√适用 □不适用

于 2020 年 12 月 31 日，本集团无用于抵押担保、暂时闲置以及未办妥产权证书的固定资产

(2019 年 12 月 31 日：无)。

## 15、在建工程

### (1). 在建工程情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
上海富源置地广场项目	863,123,084.27		863,123,084.27			
昆山汇金财富广场项目	16,582,471.33		16,582,471.33			
合计	879,705,555.60		879,705,555.60			

### (2). 在建工程项目变动情况

2020 年度	资金来源	年初余额	本年增加	本年减少	年末余额
上海富源置地广场项目	自有		863,123,084.27		863,123,084.27
昆山汇金财富广场项目	自有		16,582,471.33		16,582,471.33
合计			879,705,555.60		879,705,555.60

## 16、无形资产

### (1). 无形资产情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	104,423,670.70	319,378,129.93	14,307,917.10	415,600.00	438,525,317.73
2. 本期增加金额		64,997,304.02	898,700.00	27,721,074.63	93,617,078.65
(1) 购置		63,420,905.13			63,420,905.13
(2) 内部研发					
(3) 企业合并增加		1,576,398.89	898,700.00	27,721,074.63	30,196,173.52
3. 本期减少金额		4,292,359.94			4,292,359.94
(1) 处置		4,292,359.94			4,292,359.94
外币报表折算差额		-102,367.52	-57,100.00	-1,761,292.27	-1,920,759.79
4. 期末余额	104,423,670.70	379,980,706.49	15,149,517.10	26,375,382.36	525,929,276.65
二、累计摊销					
1. 期初余额	29,199,369.05	207,409,311.19	14,087,083.99	415,600.00	251,111,364.23
2. 本期增加金额	2,610,591.84	44,215,380.17	50,000.04	1,497,894.54	48,373,866.59

(1) 计提	2,610,591.84	42,668,759.38	50,000.04	1,497,894.54	46,827,245.80
(2) 企业合并增加		1,546,620.79			1,546,620.79
3. 本期减少金额		4,292,359.94			4,292,359.94
(1) 处置		4,292,359.94			4,292,359.94
外币报表折算差额		-101,436.50		-78,747.80	-180,184.30
4. 期末余额	31,809,960.89	247,230,894.92	14,137,084.03	1,834,746.74	295,012,686.58
三、减值准备					
1. 期初余额					
2. 本期增加金额					
(1) 计提					
3. 本期减少金额					
(1) 处置					
4. 期末余额					
四、账面价值					
1. 期末账面价值	72,613,709.81	132,749,811.57	1,012,433.07	24,540,635.62	230,916,590.07
2. 期初账面价值	75,224,301.65	111,968,818.74	220,833.11		187,413,953.50

其他说明：

√适用 □不适用

于 2020 年 12 月 31 日，本集团无形资产无抵押担保情况（2019 年 12 月 31 日：无）。

## 17、商誉

### (1). 商誉账面原值

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加		本期减少		期末余额
		企业合并形成的		处置	其他	
购买营业部商誉	11,749,999.80					11,749,999.80
购买子公司商誉	242,859,851.97	177,375,859.54			11,436,803.43	408,798,908.08
合计	254,609,851.77	177,375,859.54			11,436,803.43	420,548,907.88

### (2). 商誉减值准备

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加		本期减少		期末余额
		计提		处置		

非同一控制下企业合并形成的商誉	104,704,591.51					104,704,591.51
合计	104,704,591.51					104,704,591.51

本集团商誉主要由收购子公司及营业部形成。其中于 2014 年通过非同一控制下企业合并取得东吴基金管理有限公司股权形成的商誉期末账面原值为人民币 2.31 亿元，累计确认商誉减值准备人民币 1.05 亿元；于 2020 年通过非同一控制下企业合并取得东吴证券（国际）金融控股有限公司股权形成的商誉期末账面原值为人民币 1.66 亿元，未确认商誉减值准备。本集团充分考虑对生产经营活动的管理和监控方式、以及对资产的持续使用和处置，结合企业合并所产生的协同效应，认定能够独立产生现金流量的最小的资产组组合，并将合并形成的商誉分配至该些资产组组合进行减值测试。

#### （1）东吴基金管理有限公司的相关资产组

资产组的可收回金额根据预计未来现金流量现值的方法确定，本集团根据管理层批准的预计未来 5 年财务预算和税前折现率 16.98%（2019 年度：17.13%）计算资产组的未来现金流量现值，该税前折现率已反映相关资产组的特定风险。超过 5 年财务预算之后年份的现金流量以 3% 的长期平均增长率推断，该增长率并不超过资产组所涉及业务的长期平均增长率。其他预测现金流入或流出有关的可收回金额估计值的主要假设包括预测收入增长率及费用率，该估计值是根据该资产组过往的表现及管理层对市场变化的预期而确定。

#### （2）东吴证券（国际）金融控股有限公司的相关资产组

资产组的可收回金额根据预计未来现金流量现值的方法确定，本集团根据管理层批准的预计未来 5 年财务预算和税前折现率 18.52% 计算资产组的未来现金流量现值，该税前折现率已反映相关资产组的特定风险。超过 5 年财务预算之后年份的现金流量以 3% 的长期平均增长率推断，该增长率并不超过资产组所涉及业务的长期平均增长率。其他预测现金流入或流出有关的可收回金额估计值的主要假设包括预测收入增长率及费用率，该估计值是根据该资产组过往的表现及管理层对市场变化的预期而确定。

## 18、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

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	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
尚未支付的职工薪酬	1,114,537,734.33	278,634,433.58	742,924,030.58	185,731,007.65
信用减值准备	2,300,288,640.15	575,072,160.04	1,094,159,009.81	273,539,752.45
交易性金融资产公允价值变动	1,538,029,635.99	384,507,409.00	1,470,853,194.95	367,713,298.74
交易性金融负债公允价值变动	560,714.00	140,178.50		
其他债权投资公允价值变动			7,800.79	1,950.20



其他权益工具投资公允价值变动	199,003,226.35	49,750,806.59	90,388,218.99	22,597,054.75
衍生金融工具公允价值变动	14,468,091.38	3,617,022.85	1,904,840.00	476,210.00
其他	78,360,903.14	19,590,225.79	77,865,931.51	19,466,482.88
合计	5,245,248,945.34	1,311,312,236.35	3,478,103,026.63	869,525,756.67

## (2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	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
交易性金融资产公允价值变动	463,545,473.00	109,332,556.56	248,764,210.72	55,215,168.05
其他债权投资公允价值变动	40,720,746.70	10,180,186.68	96,427,415.54	24,106,853.89
其他权益工具投资公允价值变动	199,525,387.26	49,881,346.82	103,888,469.98	25,972,117.50
衍生金融工具公允价值变动	2,400,438.54	600,109.64	1,363,222.66	340,805.67
其他	1,378,373,170.51	344,593,292.63	565,513,095.88	141,378,273.97
合计	2,084,565,216.01	514,587,492.33	1,015,956,414.78	247,013,219.08

## (3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	456,741,182.39	854,571,053.96	242,362,629.32	627,163,127.35
递延所得税负债	456,741,182.39	57,846,309.94	242,362,629.32	4,650,589.76

## (4). 未确认递延所得税资产明细

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异	127,072,069.06	119,578,999.42
合计	127,072,069.06	119,578,999.42

## 19. 其他资产

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

单位：元币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款	274,370,725.15	288,429,072.78
长期待摊费用	29,930,223.93	21,917,954.72

预付款项	31,215,329.71	51,405,349.44
预交企业所得税	19,999,405.52	4,193.42
待摊费用	18,328,544.99	15,298,177.57
其他	164,407,266.99	17,294,736.92
减：减值准备	132,314,577.72	123,549,899.83
合计	405,936,918.57	270,799,585.02

## (2) 其他应收款

项目	期末账面余额	期初账面余额
其他应收款	271,483,093.42	251,195,535.91
应收股利	2,887,631.73	16,454,011.87
应收利息		20,779,525.00
减：坏账准备	132,314,577.72	123,549,899.83
其他应收款净额	142,056,147.43	164,879,172.95

## 按账龄分析

种类	期末			
	账面金额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	140,448,657.50	51.19	12,104,476.50	9.15
1-2 年	123,325,806.87	44.95	115,963,118.00	87.64
2-3 年	3,279,872.54	1.20	648,789.10	0.49
3 年以上	7,316,388.24	2.66	3,598,194.12	2.72
合计	274,370,725.15	100.00	132,314,577.72	100.00

种类	期初			
	账面金额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	269,298,102.39	93.37	119,277,696.83	96.54
1-2 年	10,642,351.99	3.69	360,614.89	0.29
2-3 年	817,015.98	0.28	157,543.20	0.13
3 年以上	7,671,602.42	2.66	3,754,044.91	3.04
合计	288,429,072.78	100.00	123,549,899.83	100.00

## 按坏账准备计提方式列示

项目	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	127,355,120.74	46.42	127,355,120.74	100.00
组合计提坏账准备	147,015,604.41	53.58	4,959,456.98	3.37
合计	274,370,725.15	100.00	132,314,577.72	48.23

项目	期初	
	账面余额	坏账准备

	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	125,261,251.53	43.43	118,680,710.07	94.75
组合计提坏账准备	163,167,821.25	56.57	4,869,189.76	2.98
合计	288,429,072.78	100.00	123,549,899.83	42.84

于 2020 年 12 月 31 日,其他应收款账面净额中金额较大的前五单位名称、净额及款项性质如下:

单位名称	账面净额	账龄	占其他应 收款净额 的比例 (%)	款项性质
China Reform Soochow Overseas Fund I L.P.	68,035,312.62	1 年以内	47.89	应收基金分红款
昆高新芯微电子(江苏)有限公司	15,000,000.00	1 年以内	10.56	预付投资款
东吴期货剑池一号 FOF 集合资管计划	10,000,000.00	1 年以内	7.04	预付投资款
东吴期货剑池二号 FOF 集合资管计划	10,000,000.00	1 年以内	7.04	预付投资款
Swire Properties Management Limited	5,172,372.61	1 年以内	3.64	租房押金
合计	108,207,685.23		76.17	

年末其他应收款中无持有本公司 5%以上(含 5%)股份的股东单位欠款情况。

### (3) 长期待摊费用

项目	取得方式	期初余额	本期增加	本期减少		外币报表折算差额	期末余额
				本期摊销	其他减少		
装修费	购入	18,814,942.37	13,177,091.76	8,424,978.89		35,813.96	23,602,869.20
网络工程	购入	1,394,050.20	4,018,977.89	1,249,937.42		35,066.21	4,198,156.88
办公家具	购入	1,179,220.31	686,201.30	668,211.23			1,197,210.38
水电增容	购入	56,504.00	1500	30,161.14			27,842.86
消防工程	购入	473,237.84	677,960.42	247,053.65			904,144.61
合计		21,917,954.72	18,561,731.37	10,620,342.33		70,880.17	29,930,223.93

## 20、融券业务情况

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券		
一交易性金融资产	380,309,469.31	27,982,318.50

一转融通融入证券	186,137,167.80	
一其他权益工具	94,476,598.11	71,898,570.93

于 2020 年 12 月 31 日，本集团转融通融入证券总额为人民币 186,141,729.00 元（2019 年 12 月 31 日：无）。

于 2020 年 12 月 31 日，融券业务无违约情况（2019 年 12 月 31 日：无）

## 21、资产减值准备变动表

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少		其他	期末余额
			转回	转/核销		
融出资金减值准备	19,786,215.27	11,038,141.45			16,637,662.35	47,462,019.07
买入返售金融资产减值准备	1,020,142,195.33	1,320,147,333.65	122,899,871.12			2,217,389,657.86
应收款项坏账准备	20,933,582.64	21,008,680.08	1,521,630.93		-11,915.95	40,408,715.84
其他应收款坏账准备	123,549,899.83	9,277,951.55	506,928.20	1,169.99	-5,175.47	132,314,577.72
债权投资减值准备		1,496,953.35			-20,272.40	1,476,680.95
其他债权投资减值准备	25,527,349.89	32,546,004.75	5,562,798.03	17,371,842.19	-1,609,077.41	33,529,637.01
商誉减值准备	104,704,591.51					104,704,591.51
合计	1,314,643,834.47	1,395,515,064.83	130,491,228.28	17,373,012.18	14,991,221.12	2,577,285,879.96

## 22、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

金融工具类别	期末余额			合计
	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)	
融出资金减值准备	28,456,536.79		19,005,482.28	47,462,019.07
买入返售金融资产减值准备	4,518,158.15		2,212,871,499.71	2,217,389,657.86
应收款项坏账准备(一般模型)			21,536,828.68	21,536,828.68
应收款项坏账准备(简化模型)	/	323,228.56	18,548,658.60	18,871,887.16
其他应收款坏账准备	4,959,456.98		127,355,120.74	132,314,577.72

备				
债权投资减值准备	1,476,680.95			1,476,680.95
其他债权投资减值准备	6,001,073.70	185,317.28	27,343,246.03	33,529,637.01
合计	45,411,906.57	508,545.84	2,426,660,836.04	2,472,581,288.45
金融工具类别	期初余额			
	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)	合计
融出资金减值准备	19,784,891.29	1,323.98		19,786,215.27
买入返售金融资产减值准备	19,182,816.60	19,592,703.12	981,366,675.61	1,020,142,195.33
应收款项坏账准备(一般模型)			1,588,882.79	1,588,882.79
应收款项坏账准备(简化模型)	/	968,320.15	18,376,379.70	19,344,699.85
其他应收款坏账准备	62,718.75	4,488,540.54	118,998,640.54	123,549,899.83
其他债权投资减值准备	4,793,352.58	3,362,155.13	17,371,842.18	25,527,349.89
合计	43,823,779.22	28,413,042.92	1,137,702,420.82	1,209,939,242.96

买入返售金融资产的信用减值准备主要为股票质押式回购业务产生，股票质押式回购业务的信用减值准备明细情况如下：

单位：元币种：人民币

2020年12月31日	账面原值	信用减值准备	担保物市值
未来12个月预期信用损失	1,245,228,564.71	4,518,158.16	3,500,836,384.43
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)	4,144,542,865.86	2,212,871,499.70	3,651,109,436.23
合计	5,389,771,430.57	2,217,389,657.86	7,151,945,820.66

### 23、短期借款

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
信用借款	1,069,956,134.02	
保证借款		359,161,667.17
质押借款		3,026,400.00
合计	1,069,956,134.02	362,188,067.17

于2020年12月31日，本集团无逾期借款（2019年12月31日：无）。

## 24、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

债券名称	票面利率	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
短期融资券	1.59%-3.28%	3,815,239,016.39	17,895,964,764.44	17,700,750,082.20	4,010,453,698.63
收益凭证	2.00%-8.18%	1,079,088,007.28	11,778,671,214.38	8,467,293,672.66	4,390,465,549.00
合计	/	4,894,327,023.67	29,674,635,978.82	26,168,043,754.86	8,400,919,247.63

公司于本年共发行 14 期短期融资券，短期融资券的票面利率为 1.59%-3.28%；于本年共发行 1,286 期期限小于 1 年的收益凭证，收益凭证的票面利率为 2.00%-8.18%。

## 25、交易性金融负债

## (1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	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	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	合计
浮动收益凭证	46,900,714.00		46,900,714.00	12,037,000.00		12,037,000.00
其他		1,931,735,466.90	1,931,735,466.90		5,597,169,692.41	5,597,169,692.41
合计	46,900,714.00	1,931,735,466.90	1,978,636,180.90	12,037,000.00	5,597,169,692.41	5,609,206,692.41

对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描述性说明：

√适用 □不适用

于 2020 年 12 月 31 日，本集团指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债是部分合并结构化主体中归属于其他投资者的权益，本集团有义务于结构化主体到期或其他投资者赎回时基于账面净值及该结构化主体的有关条款向其他投资者付款。

## 26、卖出回购金融资产款

## (1) 按业务类别

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券质押式回购	9,967,029,254.17	11,618,776,965.87

信用业务债权收益权	750,882,291.67	1,000,866,666.67
债券买断式回购		506,180,353.81
合计	10,717,911,545.84	13,125,823,986.35

**(2) 按金融资产种类**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	9,967,029,254.17	12,124,957,319.68
信用业务债权收益权	750,882,291.67	1,000,866,666.67
合计	10,717,911,545.84	13,125,823,986.35

**(3) 担保物金额**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	10,594,307,171.08	12,400,619,893.90
信用业务债权收益权	761,864,424.38	1,023,864,853.65
合计	11,356,171,595.46	13,424,484,747.55

**27、代理买卖证券款**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
普通经纪业务		
其中：个人	18,570,425,512.28	15,358,834,700.60
机构	4,265,008,974.88	2,990,260,224.76
小计	22,835,434,487.16	18,349,094,925.36
信用业务		
其中：个人	1,480,005,299.12	1,276,321,801.55
机构	882,254,433.98	108,814,913.91
小计	2,362,259,733.10	1,385,136,715.46
合计	25,197,694,220.26	19,734,231,640.82

**28、应付职工薪酬****(1). 应付职工薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	773,118,039.40	1,812,220,972.65	1,425,113,506.66	1,160,225,505.39
二、离职后福利-设定提存	13,694,169.65	22,906,386.95	11,860,014.20	24,740,542.40

计划				
三、辞退福利		2,213,984.54	2,213,984.54	
合计	786,812,209.05	1,837,341,344.14	1,439,187,505.40	1,184,966,047.79

**(2). 短期薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	764,824,030.57	1,663,710,717.54	1,278,733,641.62	1,149,801,106.49
二、职工福利费		29,337,892.84	27,786,226.60	1,551,666.24
三、社会保险费	717,531.57	33,791,888.80	33,786,273.60	723,146.77
其中：医疗保险费	636,929.31	31,212,914.86	31,189,852.27	659,991.90
工伤保险费	29,082.34	131,832.18	141,292.49	19,622.03
生育保险费	51,519.92	2,447,141.76	2,455,128.84	43,532.84
四、住房公积金	728,338.14	64,523,404.93	64,290,169.03	961,574.04
五、工会经费和职工教育经费	6,848,139.12	20,857,068.54	20,517,195.81	7,188,011.85
合计	773,118,039.40	1,812,220,972.65	1,425,113,506.66	1,160,225,505.39

**(3). 设定提存计划列示**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	1,407,632.88	8,216,229.69	9,132,401.81	491,460.76
2、失业保险费	76,536.77	274,157.26	301,612.39	49,081.64
3、企业年金缴费	12,210,000.00	14,416,000.00	2,426,000.00	24,200,000.00
合计	13,694,169.65	22,906,386.95	11,860,014.20	24,740,542.40

其他说明：

√适用 □不适用

本公司2020年度高级管理人员任职期间从本公司获得的税前报酬总额为人民币1,735.24万元（2019年度：人民币1,388.29万元）。

2020年12月31日，应付职工薪酬余额预计在2021年度及以后年度发放。

**29、应交税费**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
企业所得税	305,038,265.07	46,768,846.09
个人所得税	70,104,645.63	28,901,158.52
增值税	34,355,330.86	33,276,505.67
城市维护建设税	2,356,704.53	2,305,210.24
教育费附加	1,590,253.26	1,552,715.47



其他税费	4,157,568.07	3,205,008.58
合计	417,602,767.42	116,009,444.57

### 30、应付票据

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

种类	期末余额	期初余额
银行承兑汇票	177,170,000.00	30,000,000.00
合计	177,170,000.00	30,000,000.00

### 31、应付款项

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付清算款	218,580,885.06	1,486,602.76
交易所质押借款	133,672,200.00	
应付佣金	18,628,603.23	16,866,125.75
应付第三方存管费	16,427,462.78	13,079,682.98
应付收益互换业务款项	1,132,962.72	
其他	16,560,359.47	7,588,582.40
合计	405,002,473.26	39,020,993.89

### 32、合同负债

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
手续费及佣金预收款	18,769,809.43	27,386,792.44
销售货物预收款	1,478,663.15	
合计	20,248,472.58	27,386,792.44

其他说明：

√适用 □不适用

合同负债主要涉及本集团手续费及佣金业务及销售货物收取的预收款，该合同的相关收入在本集团履行履约义务后确认。

## 33、应付债券

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

债券类型	面值	发行日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
15 东吴债	100	2015/11/9	五年期	2,500,000,000.00	4.15	2,513,387,895.71	90,362,104.29	2,603,750,000.00	
17 东吴债	100	2017/3/13	五年期	2,500,000,000.00	4.70	2,581,158,536.47	123,651,604.63	117,500,000.00	2,587,310,141.10
18 东吴 F1	100	2018/1/29	三年期	4,500,000,000.00	5.70	4,730,383,997.83	262,522,065.20	256,500,000.00	4,736,406,063.03
18 东吴 F2	100	2018/12/29	三年期	1,000,000,000.00	4.60	997,170,619.39	47,572,821.57	46,000,000.00	998,743,440.96
19 东吴 F1	100	2019/4/16	三年期	2,000,000,000.00	4.20	2,052,361,694.25	87,272,814.91	84,000,000.00	2,055,634,509.16
19 东吴债	100	2019/8/12	三年期	3,000,000,000.00	3.60	3,029,492,034.73	112,727,113.54	108,000,000.00	3,034,219,148.27
20 东吴 G1	100	2020/9/21	一年期	2,600,000,000.00	3.29		2,614,969,119.57		2,614,969,119.57
20 东吴 G2	100	2020/9/21	三年期	1,400,000,000.00	3.81		1,408,879,428.84		1,408,879,428.84
20 东吴 S1	100	2020/11/26	半年期	2,800,000,000.00	3.55		2,799,155,786.56		2,799,155,786.56
17 东吴 01 次级债	100	2017/4/26	三年期	4,060,000,000.00	5.20	4,204,207,650.80	66,912,349.20	4,271,120,000.00	
17 东吴 02 次级债	100	2017/4/26	五年期	1,650,000,000.00	5.50	1,711,987,707.20	90,919,827.05	90,750,000.00	1,712,157,534.25
17 东吴 03 次级债	100	2017/5/22	三年期	2,740,000,000.00	5.40	2,830,554,753.00	57,405,247.00	2,887,960,000.00	

## 2020 年年度报告

17 东吴 04 次级债	100	2017/5/22	五 年 期	1,230,000,000.00	5.60	1,272,156,066.18	68,995,495.46	68,880,000.00	1,272,271,561.64
19 东吴 C1 次级债	100	2019/3/18	三 年 期	2,000,000,000.00	4.25	2,058,631,420.29	88,928,090.82	85,000,000.00	2,062,559,511.11
20 东吴 C1 次级债	100	2020/2/25	三 年 期	1,000,000,000.00	3.80		1,032,289,617.49		1,032,289,617.49
20 东吴 C2 次级债	100	2020/6/10	三 年 期	500,000,000.00	3.80		510,671,232.88		510,671,232.88
至尊宝 364 天 199 期	100	2020/2/13	一 年 期	1,857,000.00	3.85		1,920,071.86		1,920,071.86
至尊宝 364 天 200 期	100	2020/2/17	一 年 期	860,000.00	3.85		888,846.53		888,846.53
至尊宝 364 天 201 期	100	2020/2/20	一 年 期	1,194,000.00	3.85		1,233,671.87		1,233,671.87
至尊宝 369 天 213 期	100	2020/4/2	一 年 期	432,000.00	3.55		443,925.01		443,925.01
东吴证券固 定收益凭证 融通 【201906】 号	100	2019/3/26	一 年 期	250,000,000.00	4.15	258,098,263.89	8,472,916.67	266,571,180.56	
合计				35,734,343,000.00		28,239,590,639.74	9,476,194,150.95	10,886,031,180.56	26,829,753,610.13

## 34、其他负债

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付并表结构化主体其他投资者款项	498,671,629.98	1,629,790,475.72
其他应付款	173,339,586.24	300,990,225.73
预提费用	60,939,413.04	40,659,342.95
期货风险准备金	52,599,117.75	45,139,153.07
投资者保护基金	14,018,478.03	7,309,578.07
其他	3,418,646.88	8,179,375.12
合计	802,986,871.92	2,032,068,150.66

其他应付款

项目	期末余额		期初余额	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
其他应付款	173,339,586.24	100.00	300,990,225.73	100.00
其中：逾期应付款项				
合计	173,339,586.24	100.00	300,990,225.73	100.00

年末其他应付款主要明细：

项目	金额	账龄	款项性质
东辰控股集团有限公司	64,110,000.00	1-2年	往来款
北京晋商联盟投资管理有限公司	17,034,073.50	1-2年	股票质押业务保证金
金世旗国际控股股份有限公司	12,750,000.00	1年以内	往来款
员工风险金	11,432,596.74	部分3年以上	员工风险金
海通证券股份有限公司	9,750,000.00	1年以内	应付债券承销费
合计	115,076,670.24		

于2020年12月31日其他应付款中无欠本集团5%以上(含5%)股份的股东单位款项情况(2019年12月31日：无)。

## 35、股本

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	3,000,000,000.00	880,518,908.00				880,518,908.00	3,880,518,908.00

**36、资本公积**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	11,651,007,758.21	4,970,209,617.45		16,621,217,375.66
其他资本公积	114,208,344.48	3,293,540.53		117,501,885.01
合计	11,765,216,102.69	4,973,503,157.98		16,738,719,260.67

**37、库存股**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
库存股	19,220,540.31			19,220,540.31
合计	19,220,540.31			19,220,540.31

## 38、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期发生金额							期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
一、不能重分类进损益的其他综合收益	11,361,816.32	-6,000,645.22	-2,376,076.18		2,605,656.52	-3,624,569.04	-3,370,891.56	-253,677.48	5,385,268.24
权益法下不能转损益的其他综合收益	1,236,628.23	3,757,019.42				3,757,019.42	3,757,019.42		4,993,647.65
其他权益工具投资公允价值变动	10,125,188.09	-9,757,664.64	-2,376,076.18		2,605,656.52	-7,381,588.46	-7,127,910.98	-253,677.48	391,620.59
二、将重分类进损益的其他综合收益	114,115,589.92	-117,433,966.88	-13,924,717.01	8,996,228.17		-112,505,478.04	-109,286,564.32	-3,218,913.72	4,829,025.60
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-383,033.33	-42,621.94				-42,621.94	-42,621.94		-425,655.27
其他债权投资公允价值变动	53,169,198.65	-69,853,821.84	-8,827,806.88	-8,375,614.02		-52,650,400.94	-52,650,400.94		518,797.71
其他债权投资信用损失准备	19,145,512.42	25,374,129.31	-5,096,910.13	17,371,842.19		13,099,197.25	13,099,197.25		32,244,709.67
外币财务报表折算差额	42,183,912.18	-72,911,652.41				-72,911,652.41	-69,692,738.69	-3,218,913.72	-27,508,826.51
其他综合收益合	125,477,406.24	-123,434,612.10	-16,300,793.19	8,996,228.17	2,605,656.52	-116,130,047.08	-112,657,455.88	-3,472,591.20	10,214,293.84

计									
---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

项目	期初余额	上期发生金额							期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-179,401,424.71	198,000,939.86	47,302,971.10		-40,292,584.83	150,697,968.76	150,470,656.20	227,312.56	11,361,816.32
权益法下不能转损益的其他综合收益		1,236,628.23				1,236,628.23	1,236,628.23		1,236,628.23
其他权益工具投资公允价值变动	-179,401,424.71	196,764,311.63	47,302,971.10		-40,292,584.83	149,461,340.53	149,234,027.97	227,312.56	10,125,188.09
二、将重分类进损益的其他综合收益	96,291,135.07	38,322,537.99	-2,500,412.39	21,850,699.55		18,972,250.83	17,824,454.85	1,147,795.98	114,115,589.92
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-6,778,116.55	6,395,083.22				6,395,083.22	6,395,083.22		-383,033.33
其他债权投资公允价值变动	72,321,459.47	-3,685,648.21	-6,384,086.94	21,850,699.55		-19,152,260.82	-19,152,260.82		53,169,198.65
其他债权投资信用损失准备	7,494,488.78	15,534,698.19	3,883,674.55			11,651,023.64	11,651,023.64		19,145,512.42
外币财务报表折算差额	23,253,303.37	20,078,404.79				20,078,404.79	18,930,608.81	1,147,795.98	42,183,912.18
其他综合收益合计	-83,110,289.64	236,323,477.85	44,802,558.71	21,850,699.55	-40,292,584.83	169,670,219.59	168,295,111.05	1,375,108.54	125,477,406.24

**39、盈余公积**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	846,846,927.86	152,394,287.62		999,241,215.48
合计	846,846,927.86	152,394,287.62		999,241,215.48

**40、一般风险准备**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	本期减少	期末余额
一般风险准备	1,188,161,798.48	177,072,953.43		1,365,234,751.91
交易风险准备	961,680,400.56	152,394,287.62		1,114,074,688.18
合计	2,149,842,199.04	329,467,241.05		2,479,309,440.09

一般风险准备的说明：

一般风险准备包括本公司及其子公司根据相关规定计提的一般风险准备及本公司计提的交易风险准备。

**41、未分配利润**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	3,081,589,047.65	2,994,947,444.76
调整期初未分配利润合计数(调增+, 调减-)	-14,378,066.04	-289,000,947.87
调整后期初未分配利润	3,067,210,981.61	2,705,946,496.89
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,707,245,952.72	1,037,174,921.82
减：提取法定盈余公积	152,394,287.62	106,108,030.09
提取一般风险准备	329,467,241.05	245,392,909.14
应付普通股股利	504,090,237.04	269,738,847.00
其他综合收益结转留存收益	-2,605,656.52	40,292,584.83
期末未分配利润	3,791,110,825.14	3,081,589,047.65

调整期初未分配利润明细：

由于执行新收入准则，影响2020年期初未分配利润-14,378,066.04元。

**42、利息净收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	2,544,025,876.41	2,501,030,081.16
融资融券利息收入	996,297,492.69	676,870,061.17
存放金融同业利息收入	623,577,099.55	470,583,530.08
买入返售金融资产利息收入	583,525,335.31	959,704,527.31



其中：约定购回利息收入	70,192.55	4,747,178.45
入股	558,412,482.49	846,789,826.89
其他债权投资利息收入	324,026,185.31	390,896,670.59
债权投资利息收入	16,599,763.55	2,975,292.01
利息支出	1,947,992,020.37	2,173,444,976.45
应付债券利息支出	1,204,537,648.60	1,306,351,580.08
其中：次级债券利息支出	416,499,393.38	587,771,401.63
卖出回购金融资产款利息支出	281,840,023.25	302,316,514.45
应付短期融资款利息支出	173,852,593.93	265,645,213.22
代理买卖证券款利息支出	93,219,760.08	66,701,278.97
拆入资金利息支出	83,496,126.67	39,154,594.39
其中：转融通利息支出	49,658,868.78	
短期借款利息支出	34,565,695.85	14,058,630.20
其他	76,480,171.99	179,217,165.14
利息净收入	596,033,856.04	327,585,104.71

### 43、手续费及佣金净收入

#### (1) 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	1,374,891,239.98	961,552,144.52
证券经纪业务收入	1,877,977,107.67	1,356,514,939.38
其中：代理买卖证券业务	1,590,173,941.45	1,186,524,407.64
交易单元席位租赁	251,794,184.50	159,402,816.06
代销金融产品业务	36,008,981.72	10,587,715.68
证券经纪业务支出	503,085,867.69	394,962,794.86
其中：代理买卖证券业务	503,085,867.69	394,962,794.86
2. 期货经纪业务净收入	149,623,690.43	88,939,501.34
期货经纪业务收入	422,019,251.22	239,741,226.06
期货经纪业务支出	272,395,560.79	150,801,724.72
3. 投资银行业务净收入	1,082,877,329.31	625,083,630.67
投资银行业务收入	1,088,687,989.71	628,252,309.91
其中：证券承销业务	889,357,866.27	446,562,449.25
证券保荐业务	53,009,616.50	17,811,320.75
财务顾问业务	146,320,506.94	163,878,539.91
投资银行业务支出	5,810,660.40	3,168,679.24
其中：证券承销业务	5,810,660.40	3,168,679.24
4. 资产管理业务净收入	138,523,625.07	161,216,479.25
资产管理业务收入	143,990,923.85	167,516,457.96
资产管理业务支出	5,467,298.78	6,299,978.71
5. 基金管理业务净收入	77,029,556.53	96,624,301.88
基金管理业务收入	77,029,556.53	96,624,301.88
6. 投资咨询业务净收入	50,854,800.25	41,232,691.50
投资咨询业务收入	50,854,800.25	41,232,691.50

7. 其他手续费及佣金净收入	24,320,607.58	27,240,136.04
其他手续费及佣金收入	29,495,534.87	29,950,380.77
其他手续费及佣金支出	5,174,927.29	2,710,244.73
合计	2,898,120,849.15	2,001,888,885.20
其中：手续费及佣金收入	3,690,055,164.10	2,559,832,307.46
手续费及佣金支出	791,934,314.95	557,943,422.26

**(2) 财务顾问业务净收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	28,783,018.86	29,981,698.11
其他财务顾问业务净收入	117,537,488.08	133,896,841.80

**(3) 资产管理业务**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	65	168	74
期末客户数量	5,345	168	448
其中：个人客户	5,245	12	277
机构客户	100	156	171
期初受托资金	10,226,279,235.06	88,323,684,884.17	50,150,177,788.59
其中：自有资金投入	1,045,973,727.46		442,172,059.85
个人客户	4,205,524,914.61	775,608,706.24	1,123,698,711.56
机构客户	4,974,780,592.99	87,548,076,177.93	48,584,307,017.18
期末受托资金	7,313,652,848.60	58,069,442,508.05	24,582,347,037.77
其中：自有资金投入	723,958,737.20	20,000,000.00	6,003,393.36
个人客户	3,574,538,594.67	653,374,489.57	676,595,211.87
机构客户	3,015,155,516.73	57,396,068,018.48	23,899,748,432.54
期末主要受托资产初始成本	8,595,978,667.82	60,846,753,720.25	27,101,261,539.79
其中：股票	545,499,003.25	4,687,886,151.88	1,221,916,469.85
国债	89,802,070.00	331,444,930.00	50,526,164.40
其他债券	4,970,966,862.08	8,335,235,200.17	17,528,380,393.98
基金	84,671,388.36	1,734,188,164.13	2,204,486,697.70
信托		3,375,800,000.00	240,000,000.00
理财		1,868,880,000.00	
买入返售	1,758,919,167.82	4,995,320,000.00	148,720,284.89
委托贷款		3,744,630,000.00	620,000,000.00
收益权		27,152,168,870.00	5,047,720,792.46
协议或定期存款			
股权投资	78,790,718.74	2,050,000,000.00	
其他	1,067,329,457.57	2,571,200,404.07	39,510,736.51
当期资产管理业务净收入	13,215,695.95	40,581,402.84	84,726,526.28

## 44、投资收益

## (1) 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	105,043,531.40	73,254,131.49
处置长期股权投资产生的投资收益	63,773,752.58	
金融工具投资收益	1,982,072,368.00	1,834,002,708.59
其中：持有期间取得的收益	1,370,556,723.25	1,616,036,757.46
—交易性金融工具	1,244,008,336.11	1,357,854,862.38
—其他权益工具投资	126,548,387.14	258,181,895.08
处置金融工具取得的收益	611,515,644.75	217,965,951.13
—交易性金融工具	608,389,179.08	219,928,580.13
—其他债权投资	8,996,228.17	21,850,699.55
—衍生金融工具	-5,869,762.50	-23,813,328.55
合计	2,150,889,651.98	1,907,256,840.08

## (2) 交易性金融工具投资收益明细表

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
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	1,244,088,934.16	1,360,225,852.22
	处置取得收益	608,203,490.40	228,078,380.06
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	-80,598.05	-2,370,989.84
	处置取得收益	185,688.68	-8,149,799.93

## 45、其他收益

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	与资产相关/与收益相关
与日常活动相关的政府补助	25,467,571.65	10,993,832.49	
其中：产业扶持资金	21,369,268.22	7,957,206.57	与收益相关
专项资金	3,274,403.43	1,553,725.92	与收益相关
财政国库划入款	823,900.00	1,482,900.00	与收益相关
个税手续费返还	11,315,257.31	555,786.50	
合计	36,782,828.96	11,549,618.99	

其他说明：

上述其他收益均计入当期非经常性损益。

**46、公允价值变动收益**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	304,107,471.87	-139,713,449.33
交易性金融负债	-140,757,140.36	-299,019,305.42
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	-140,566,541.76	-315,088,910.33
衍生金融工具	-9,324,503.33	1,566,473.21
合计	154,025,828.18	-437,166,281.54

**47、其他业务收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
贸易收入	1,518,051,571.04	1,320,518,373.22
其他	7,946,146.91	4,992,475.66
合计	1,525,997,717.95	1,325,510,848.88

**48、资产处置收益**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
固定资产处置收益	318,664.15	213,763.38
固定资产处置损失	-2,239,311.65	-135,838.63
合计	-1,920,647.50	77,924.75

**49、税金及附加**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	22,142,932.84	17,581,495.17
教育费附加	15,347,139.59	12,363,793.64
房产税	6,588,146.94	6,406,364.45
印花税	2,093,099.92	823,448.27
其他税费	660,612.01	226,784.96
合计	46,831,931.30	37,401,886.49

**50、业务及管理费**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工薪酬	1,835,771,117.71	1,433,732,773.22
咨询费	139,468,271.55	69,273,156.16

租赁费及物业费	124,601,316.04	109,165,738.19
业务开发费	81,231,856.47	70,044,916.06
固定资产折旧费	66,025,064.21	66,350,948.14
电子设备运转费	60,783,904.49	47,651,858.47
宣传费	53,700,969.94	38,546,027.01
无形资产摊销费	46,827,245.80	43,870,488.02
交易所会员年费	45,944,982.83	41,833,037.25
交易所设施使用费	25,851,176.24	15,699,538.04
邮电通讯费	25,005,759.17	26,542,541.22
投资者保护基金	22,360,201.71	15,364,068.13
差旅及交通费	15,860,851.13	21,930,784.10
会议费	13,483,392.23	13,186,932.69
其他	198,394,306.73	161,962,429.23
合计	2,755,310,416.25	2,175,155,235.93

### 51、信用减值损失

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
应收款项坏账损失	19,487,049.15	18,396,701.70
其他应收款坏账损失	8,771,023.35	123,548,239.91
买入返售金融资产减值损失	658,744,268.58	-7,351,459.91
融出资金减值损失	11,038,141.45	19,175,856.82
债权投资减值损失	1,496,953.35	
其他债权投资减值损失	26,983,206.72	15,534,698.19
合计	726,520,642.60	169,304,036.71

### 52、其他资产减值损失

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
商誉减值损失		89,343,191.51
合计		89,343,191.51

### 53、其他业务成本

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
贸易成本	1,526,644,548.22	1,322,981,601.84
合计	1,526,644,548.22	1,322,981,601.84

### 54、营业外收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
固定资产报废利得	47,742.31	77,143.31	47,742.31
其他	3,333,507.86	3,738,140.44	3,333,507.86
合计	3,381,250.17	3,815,283.75	3,381,250.17

**55、营业外支出**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
公益性捐赠支出	27,731,420.58	5,736,523.12	27,731,420.58
其他	3,548,489.61	695,406.63	3,548,489.61
合计	31,279,910.19	6,431,929.75	31,279,910.19

**56、所得税费用****(1) 所得税费用表**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	716,706,325.86	396,699,977.34
递延所得税费用	-157,042,966.90	-42,374,706.28
合计	559,663,358.96	354,325,271.06

**(2) 会计利润与所得税费用调整过程**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	2,273,286,242.71
按法定/适用税率计算的所得税费用	568,321,560.68
子公司适用不同税率的影响	-945,296.76
调整以前期间所得税的影响	-18,008,651.12
归属于合营企业和联营企业的损益	-26,260,882.85
非应税收入的影响	-230,154.84
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	13,401,370.55
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	1,873,267.41
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-511,845.12
其他	22,023,991.01
所得税费用	559,663,358.96

## 57、每股收益

	2020 年度	2019 年度
归属于本公司普通股股东的合并净利润	1,707,245,952.72	1,037,174,921.82
本公司发行在外普通股的加权平均数	3,704,821,821.12	3,186,492,168.17
基本每股收益（元/股）	0.46	0.33
持续经营	0.46	0.33
稀释每股收益（元/股）	0.46	0.33
持续经营	0.46	0.33

2020 年 3 月，本公司 A 股配股方案实施完成。根据《企业会计准则第 34 号——每股收益》，考虑配股中包含的送股因素，计算每股收益时已调整上表中各列报期间发行在外的普通股加权平均数。

本集团不存在稀释性潜在普通股，因此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。

## 58、现金流量表项目

## (1). 收到的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助	36,782,828.96	11,549,618.99
收到北京金融资产交易所保证金	89,580,000.00	
三个月以上定期存款和使用受限制货币资金净变动		625,507,782.39
其他业务收入	1,723,689,027.18	1,497,499,803.66
其他	10,524,817.89	5,478,140.44
合计	1,860,576,674.03	2,140,035,345.48

## (2). 支付的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付的衍生金融产品现金净流出	25,328,793.43	19,776,247.58
存出保证金净变动	543,763,053.41	1,459,982,670.99
三个月以上定期存款和使用受限制货币资金净变动	76,403,641.59	
支付的业务及管理费	746,005,028.02	539,260,799.26
投资者保护基金	17,996,948.72	22,941,783.61
支付纳入合并范围的结构化主体其他持有人的现金净额	4,467,377,685.54	4,768,113,813.41
支付北京金融资产交易所保证金		89,580,000.00
公益性捐赠支出	27,731,420.58	5,736,523.12
其他业务成本	1,630,101,097.09	1,494,969,210.08
其他	201,615,416.90	231,742,391.13
合计	7,736,323,085.28	8,632,103,439.18

## (3). 支付的其他与筹资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付的配股承销费	45,000,000.00	
库存股回购		4,247,945.83
合计	45,000,000.00	4,247,945.83

## 59、现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>		
净利润	1,713,622,883.75	979,245,593.14
加：信用减值损失	726,520,642.60	169,304,036.71
其他资产减值损失		89,343,191.51
固定资产折旧	66,025,064.21	66,350,948.14
无形资产摊销	46,827,245.80	43,870,488.02
长期待摊费用摊销	10,620,342.33	10,343,120.67
处置报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	3,569,948.71	315,765.87
公允价值变动损益	-313,601,272.46	116,964,283.63
净利息支出	1,072,329,989.52	1,192,183,460.90
投资收益	-304,361,899.29	-353,286,726.12
递延所得税	-157,042,966.90	-42,374,706.28
经营性应收项目的减少/（增加）	-2,321,262,237.94	-7,215,001,317.85
经营性应付项目的（减少）/增加	-1,094,653,404.93	6,098,122,601.76
汇兑损益	120,249,475.50	-18,003,066.53
经营活动产生的现金流量净额	-431,156,189.10	1,137,377,673.57
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b>		
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		
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况：</b>		
现金的期末余额	27,247,045,647.76	21,305,468,663.16
减：现金的期初余额	21,305,468,663.16	15,824,031,283.70
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	5,941,576,984.60	5,481,437,379.46



## (2) 取得子公司及其他营业单位收到的现金净额

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

	金额
取得子公司及其他营业单位持有的现金和现金等价物	867,605,046.45
减：取得子公司及其他营业单位支付的现金和现金等价物	802,225,664.00
取得子公司及其他营业单位收到的现金净额	65,379,382.45

## (3) 现金和现金等价物的构成

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	27,247,045,647.76	21,305,468,663.16
其中：库存现金	165,837.47	205,105.36
可随时用于支付的银行存款	23,145,752,114.69	17,866,330,851.01
可随时用于支付的其他货币资金	78,613,741.89	86,128,034.77
结算备付金	4,022,513,953.71	3,352,804,672.02
二、现金等价物		
三、期末现金及现金等价物余额	27,247,045,647.76	21,305,468,663.16

其他说明：

√适用 □不适用

现金及现金等价物不包含使用受限制的现金和现金等价物。

## 60、外币货币性项目

## (1). 外币货币性项目

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金	-	-	
其中：美元	58,204,405.82	6.5249	379,777,927.53
港币	1,617,702,464.28	0.8416	1,361,458,393.94
新加坡元	9,224,808.27	4.9314	45,491,219.50
其他外币			3,532,469.28
结算备付金	-	-	
其中：美元	8,528,218.76	6.5249	55,645,774.59
港币	7,465,945.36	0.8416	6,283,339.61
存出保证金	-	-	
美元	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港币	18,754,323.45	0.8416	15,783,638.62
代理买卖证券款	-	-	
其中：美元	44,272,292.91	6.5249	288,872,284.01
港币	999,573,383.88	0.8416	841,240,959.87

短期借款	-	-	
其中：港币	1,271,335,710.58	0.8416	1,069,956,134.02

## 61、所有权或使用权受到限制的资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
交易性金融资产	10,751,527,600.11	11,841,273,494.18
融出资金	761,864,424.38	1,023,864,853.65
其他债权投资	756,545,603.00	684,081,578.00
货币资金	295,003,709.96	235,366,828.37
债权投资	160,252,751.08	
其他权益工具投资	118,888,873.73	76,811,788.35
其他资产	57,372,725.15	3,566,972.48
合计	12,901,455,687.41	13,864,965,515.03

## 附注 6、合并范围的变更

## 1、非同一控制下企业合并

√适用 □不适用

## (1). 本期发生的非同一控制下企业合并

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

被购买方名称	股权取得时点	股权取得成本	股权取得比例 (%)	股权取得方式	购买日	购买日的确定依据	购买日至期末被购买方的收入	购买日至期末被购买方的净利润
东吴证券（国际）金融控股有限公司	2020 年 2 月 18 日	430,225,664.00	100	购买	2020 年 2 月 18 日	控制权转移	62,076,101.83	-19,340,174.98

其他说明：

2020 年度本集团以现金港币 478,720,000.00 元取得了东吴证券（国际）金融控股有限公司（Soochow Securities (International) Financial Holdings Limited）100%股权，购买日确定为 2020 年 2 月 18 日。

**(2). 合并成本及商誉**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

合并成本	东吴证券（国际）金融控股有限公司
--现金	430,225,664.00
--非现金资产的公允价值	
--发行或承担的债务的公允价值	
--发行的权益性证券的公允价值	
--或有对价的公允价值	
--购买日之前持有的股权于购买日的公允价值	
--其他	
合并成本合计	430,225,664.00
减：取得的可辨认净资产公允价值份额	252,849,804.46
商誉/合并成本小于取得的可辨认净资产公允价值份额的金额	177,375,859.54

**(3). 被购买方于购买日可辨认资产、负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	东吴证券（国际）金融控股有限公司	
	购买日公允价值	购买日账面价值
资产：	1,108,286,579.83	1,080,565,505.19
货币资金	847,518,408.28	847,518,408.28
融出资金	166,506,165.36	166,506,165.36
无形资产	28,649,552.73	928,478.09
其他资产	65,612,453.46	65,612,453.46
负债：	855,436,775.37	855,436,775.37
净资产	252,849,804.46	225,128,729.82
减：少数股东权益		
取得的净资产	252,849,804.46	225,128,729.82

**2、其他**

√适用 □不适用

纳入合并范围的结构化主体

本集团根据《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》（修订），对于本集团作为管理人或投资人，且综合评估本集团因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本集团面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并。

## 附注 7、在其他主体中的权益

## 1、在子公司中的权益

## (1). 企业集团的构成

√适用 □不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	注册资本	业务性质	持股比例(%)		取得方式
					直接	间接	
东吴期货有限公司	苏州	上海	人民币 77,000 万元	商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理。	93.80		购买
东吴创业投资有限公司	苏州	昆山	人民币 120,000 万元	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。	100.00		设立
东吴创新资本管理有限责任公司	苏州	昆山	人民币 500,000 万元	资产管理、投资管理，投资咨询；项目投资、实业投资、股权投资；贵金属、金属材料、食用农产品、化工原料及产品（不含危险化学品）销售。	100.00		设立
东吴基金管理有限公司	上海	上海	人民币 10,000 万元	基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。	70.00		购买
上海新东吴优胜资产管理有限公司	上海	上海	人民币 5,000 万元	为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。		70.00	设立
东吴并购资本管理（上海）有限公司	上海	上海	人民币 2,000 万元	资产管理，股权投资管理，投资咨询。		100.00	设立
东吴并购股权投资基金（上海）合伙企业（有限合伙）	上海	上海	人民币 50,000 万元	股权投资，股权投资管理，实业投资，资产管理，投资咨询		100.00	设立
上海东吴玖盈投资管理有限公司	上海	上海	人民币 29,900 万元	投资管理及咨询，实物投资等		100.00	设立
东吴证券中新（新加坡）有限公司	新加坡	新加坡	新加坡币 6,000 万元	资产管理业务及监管部门核准的其他证券业务（具体业务范围以监管部门核准为准）	75.00		设立

昆山东吴阳澄创业投资中心（有限合伙）	昆山	昆山	人民币 10,000 万元	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。		50.50	设立
昆山高新科创投资中心(有限合伙)	昆山	昆山	人民币 30,000 万元	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构（以上不得从事金融、类金融业务）		20.00	设立
东吴证券（香港）金融控股有限公司	香港	香港	港币 125,968 万元	投资	100.00		设立
东吴（香港）投资有限公司	香港	香港	港币 50,000 万元	投资		100.00	设立
东吴国际资本有限责任公司	开曼群岛	开曼群岛	美元 5 万元	投资		100.00	设立
东吴中新资产管理（亚洲）有限公司	新加坡	新加坡	新加坡币 200 万元	基金管理		100.00	设立
东吴中新资本（亚洲）有限公司	新加坡	新加坡	新加坡币 501 万元	企业融资及证券交易		100.00	购买
东吴证券（国际）金融控股有限公司	香港	香港	港币 70,000 万元	除持有子公司股份以外，不从事其他经营性活动，不向其子公司以外的第三人提供融资和担保		100.00	购买
东吴证券国际经纪有限公司	香港	香港	港币 70,000 万元	证券经纪		100.00	购买
东吴证券国际融资有限公司	香港	香港	港币 9,000 万元	投资银行		100.00	购买
东吴证券国际资产管理有限公司	香港	香港	港币 4,000 万元	资产管理		100.00	购买
东吴证券国际资本有限公司	香港	香港	港币 1,000 万元	创业投资		100.00	购买
东吴证券国际期货有限公司	香港	香港	港币 3,000 万元	期货交易		100.00	购买
东吴证券国际研究有限公司	香港	香港	港币 1 万元	证券研究咨询		100.00	购买
东吴证券国际期货研究有限公司	香港	香港	港币 1 万元	期货研究咨询		100.00	购买
东吴证券国际外汇有限公司	香港	香港	港币 1 万元	外汇交易		100.00	购买

持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位、以及持有半数以上表决权但不控制被投资单位的依据:

截至 2020 年 12 月 31 日, 本公司间接持有昆山高新科创投资中心(有限合伙) 20.00% 的股权比例。根据昆山高新科创投资中心(有限合伙) 的合伙协议, 本公司的全资子公司东吴创业投资有限公司作为唯一的执行事务合伙人, 可以控制合伙企业的投资决策。因此, 公司管理层认为公司对昆山高新科创投资中心(有限合伙) 具有实际控制, 故将其认定为子公司。

## (2). 重要的非全资子公司

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

子公司名称	少数股东持股比例	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
东吴期货有限公司	6.20%	3,672,391.24	2,356,000.00	58,436,367.23
东吴证券中新(新加坡)有限公司	25%	2,579,824.76		67,293,184.94
东吴基金管理有限公司	30%	1,540,145.90		97,377,491.53

## (3). 重要非全资子公司的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

子公司名称	期末余额		期初余额	
	资产合计	负债合计	资产合计	负债合计
东吴期货有限公司	7,359,574,329.04	6,417,052,276.94	5,232,452,981.13	4,311,163,045.76
东吴证券中新(新加坡)有限公司	366,361,907.67	97,189,167.93	272,491,736.24	762,640.67
东吴基金管理有限公司	428,781,146.03	114,347,484.55	448,881,756.09	134,735,829.17

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量

## 2020 年年度报告

东吴期货有限公司	1,853,394,176.83	59,232,116.73	59,232,116.73	1,453,962,215.70	1,536,195,903.96	41,319,549.27	41,319,549.27	739,204,957.97
东吴证券中新(新加坡)有限公司	33,821,531.18	10,319,299.04	-2,556,355.83	-37,428,417.02	14,036,925.02	-14,755,165.38	-10,163,981.48	-154,102,120.06
东吴基金管理有限公司	158,117,808.66	113,017.02	113,017.02	35,651,158.40	205,606,768.48	-95,322,145.83	-95,322,145.83	-17,610,963.58



## 2、在合营企业或联营企业中的权益

√适用 □不适用

## (1). 重要的合营企业或联营企业基本情况

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

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	
东吴(苏州)金融科技有限公司	苏州	苏州	网络技术服务		32.00	权益法
苏州资产管理有限公司	苏州	苏州	不良资产管理	20.00		权益法

## (2). 不重要的合营企业或联营企业基本情况

合营或联营企业名称	企业类型	注册地	法定代表人	业务性质	注册资本(万元)	持股比例(%)
许昌市绿野农业科技有限公司	有限公司	许昌	吴桐	农产品的种植及销售(不含粮油销售)	人民币 1,590.00	35.00
华元恒道(上海)投资管理有限公司[注]	有限公司	上海	闫颢天	投资管理,资产管理	人民币 20,500.00	19.51
China Reform Puissance Overseas Holdings Ltd	外资	开曼群岛	无	投资	美元 5.00	22.00
CDG Overseas Management Co. Ltd.	外资	开曼群岛	无	投资	美元 5.00	22.00
苏州企业征信服务有限公司[注]	有限公司	苏州	姚康	企业信用征信、管理咨询	人民币 18,000.00	16.67
中证信用增进股份有限公司[注]	有限公司	深圳	牛冠兴	征信业务、信用评级	人民币 458,598.00	4.91

注:本集团对于这些投资企业的持股比例低于20%,然而,根据章程或其他合约中的安排规定,本集团对这些被投资企业具有重大影响,因而将其作为联营企业核算。

## (3). 重要合营企业的主要财务信息

□适用 √不适用

## (4). 重要联营企业的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

	期末余额/ 本期发生额		期初余额/ 上期发生额	
	东吴(苏州)金融科技有限公司	苏州资产管理有限公司	东吴(苏州)金融科技有限公司	苏州资产管理有限公司

资产合计	1,179,290,330.23	19,533,403,322.11	1,020,494,543.29	10,390,009,227.21
负债合计	431,216,208.06	14,029,158,205.68	297,271,033.11	8,115,092,005.44
归属于母 公司股东 权益	748,074,122.17	4,470,646,421.17	723,223,510.18	2,274,917,221.77
按持股比 例计算的 净资产份 额	239,383,719.09	894,129,284.23	231,431,523.26	454,983,444.35
对联营企 业权益投 资的账面 价值	239,383,719.09	894,129,284.23	231,431,523.26	454,983,444.35
营业收入	60,740,229.75	1,052,699,776.86	27,497,086.07	499,745,303.11
净利润	24,850,611.97	395,375,439.10	4,028,355.97	252,273,848.59
其他综合 收益		353,760.30	21,207,845.66	1,876,679.98
综合收益 总额	24,850,611.97	395,729,199.40	25,236,201.63	254,150,528.57
收到的来 自联营企 业的股利		12,000,000.00		8,000,000.00

#### (5). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	404,665,925.17	492,608,165.79
下列各项按持股比例计算的合计数	-	-
--净利润	18,016,247.75	21,510,287.86
--其他综合收益	1,288,425.31	1,003,649.62
--综合收益总额	19,304,673.06	22,513,937.48

### 3、在合并的结构化主体中的权益

本集团合并的结构化主体主要为本公司作为管理人或投资者的资产管理计划。本集团综合评估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是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。

本年纳入本集团合并报表范围的结构化产品共 29 个（其中有 8 个产品已于 2020 年度清算）。于 2020 年 12 月 31 日，合并资产管理计划的总资产为人民币 4,376,202,291.14 元。

### 4、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

√适用 □不适用

本集团作为结构化主体的管理者，在报告期间对资产管理计划及合伙企业拥有管理权。除已于附注七、3 所述本集团已合并的结构化主体外，本集团在结构化主体中因持有份额而享有的可变回报并不重大，因此并未合并该等结构化主体。

合并资产负债表中上述投资的账面金额等同由本集团发行未纳入合并范围但持有权益的结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情列示如下：

项目	2020 年 12 月 31 日	
	账面价值	最大风险敞口
交易性金融资产	673,893,618.11	673,893,618.11

本年度本集团从由本集团发起设立但未有自有资金投入且未纳入合并财务报表范围的结构化主体中获取的管理费收入及业绩报酬为人民币 198,646,040.94 元。

本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益，这些结构化主体未纳入本集团的合并财务报表范围，主要包括资产管理计划、信托计划、基金、合伙企业和其他理财产品等。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。

合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本集团因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情列示如下：

项目	2020 年 12 月 31 日	
	账面价值	最大风险敞口
交易性金融资产	8,816,474,933.14	8,816,474,933.14
其他权益工具投资	2,389,595,990.51	2,389,595,990.51
合计	11,206,070,923.65	11,206,070,923.65

## 附注 8、风险管理

√适用 □不适用

### 1、风险管理政策及组织架构

#### 风险管理政策

为增强集团核心竞争力，保障集团持续、健康、稳定发展，本集团注重对风险的防范与控制，严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化，以保证各类风险可测、可控和可承受，保障集团稳健经营和各项业务创新发展。

董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。

#### 风险管理组织架构

本公司建立由董事会及其风险控制委员会、公司经营管理层及其风险管理委员会、风险管理职能部门、各部门及分支机构组成的四层级全面风险管理组织架构。

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责对公司风险管理进行监督与指导，将公司总体风险控制在合理的范围内，以确保公司能够对经营活动中的风险控制实施有效的管理。董事会设立的风险控制委员会按照本公司章程和工作细则的相关规定，可在董事会授权范围内履行和协助董事会履行风险管理职责。

经营管理层负责管理公司经营过程中的各类风险，推动公司全面风险管理体系的规划、建设与执行。公司经营管理层下设风险管理委员会，在经营管理层授权范围内开展公司风险管理工作。

本公司设首席风险官，负责公司全面风险管理工作。风险管理职能部门在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。

各业务部门、分支机构在日常工作中应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

本公司各子公司根据所在地法律法规和监管要求，按照公司管理政策和要求，有效开展风险管理工作，并纳入证券公司全面风险管理。子公司董事长和总经理承担子公司风险管理直接责任。

## 2、公司面临的主要风险及应对措施

在日常管理中，本集团面临的主要风险包括：流动性风险、信用风险、市场风险和操作风险。本集团通过明确风险管理的各个环节和实施内容，采用目标设定、事件识别、风险评估、风险应对、控制活动、信息沟通与报告等的全面风险管理基本工作方法，科学有效地开展集团的风险管理工作。

### 流动性风险管理

流动性风险是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。

主要包括两个方面：一是资产的流动性风险，是指由于资产不能及时变现或变现成本过高，导致自营投资及客户资产造成损失的风险；二是负债的流动性风险，是指公司缺乏现金不能按时支付债务或正常营业支出的风险。

本集团已建立并健全了资金业务的风险评估和监测制度，重点做好自有资金的合理安排，严格控制资金流动性风险，使各项资金比例严格控制在公司可承受风险范围之内。在资金需求方面，主要体现为日常运营资金需求、自营证券投资、信用业务用资需求、固定资产采购与对外投资等，报告期内集团密切关注市场变化，动态调整资产配置，合理控制各品种证券的投资规模和持仓集中度，剩余期限分布合理，流动性风险不大。同时，公司的融资渠道主要有公司债券、短期融资券、质押回购、拆入资金等，能够满足公司日常运营所需资金以及资本密集型业务快速增长所需要的资金，因此有能力支付可预见的到期债务或承诺。在流动性日常管理和风控指标监测方面，公司每日编制资金头寸表、汇总短期资金预约表、进行日间资金盯市、完成自营业务交收工作；按月计算和报送流动性覆盖率、净稳定资金率；编制公司现金流预测表，关注资金缺口并进行资金预警；定期分析公司资金使用状况，流动比率、资产错配比率等指标；对流动性覆盖率、净稳定资金率动态监测并定期开展流动性风险的监测分析、压力测试和情景分析，监测流动性风险限额执行情况。

随着未来集团业务的快速发展，将对流动性提出更高要求。为满足上述情况带来的挑战，集团将不断完善流动性管理的制度建设、风险防范机制，在监管允许范围之内，努力拓宽融资渠道，合理安排负债结构，努力保持较强的偿债能力，积极提高各项业务的盈利水平和可持续发展能力。

于资产负债表日，本集团各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

2020 年 12 月 31 日								
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	合计
短期借款		1,028,549,703.80	347,160.00	43,121,480.00				1,072,018,343.80
应付短期融资款		99,387,466.88	6,135,759,554.23	2,223,408,539.38				8,458,555,560.49
交易性金融负债		34,121,122.97	1,858,043,806.69	96,382,508.98				1,988,547,438.64
衍生金融负债		246,412.35	134,126.00	74,832.50	3,080,150.00			3,535,520.85
卖出回购金融资产款		9,971,008,759.55	759,920,342.47					10,730,929,102.02
代理买卖证券款	25,197,694,220.26							25,197,694,220.26
代理承销证券款								
应付票据			78,570,000.00	98,600,000.00				177,170,000.00
应付款项	351,362,913.26	53,639,560.00						405,002,473.26
应付债券		4,756,500,000.00	244,561,573.50	7,055,357,336.00	16,054,810,000.00			28,111,228,909.50
其他负债	166,589,586.24	402,109,751.45		96,561,878.53				665,261,216.22
合计	25,715,646,719.76	16,345,562,777.00	9,077,336,562.89	9,613,506,575.39	16,057,890,150.00			76,809,942,785.04

2019 年 12 月 31 日								
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	合计
短期借款		4,306,438.48	2,560,076.96	364,720,192.40				371,586,707.84
应付短期融资款		1,447,418,803.83	3,277,452,086.30	194,920,144.62				4,919,791,034.75
交易性金融负债		1,537,430,992.90	2,850,619,207.84	1,238,259,475.21				5,626,309,675.95
衍生金融负债		277,853.25	168,723.58	368,796.13	4,108,010.00			4,923,382.96
卖出回购金融资产		12,128,403,468.65	1,039,000,000.00					13,167,403,468.65

## 2020 年年度报告

产款								
代理买卖证券款	19,734,231,640.82							19,734,231,640.82
代理承销证券款								
应付票据				30,000,000.00				30,000,000.00
应付款项	39,020,993.89							39,020,993.89
应付债券		256,500,000.00	202,500,000.00	10,427,031,180.56	19,290,760,000.00			30,176,791,180.56
其他负债	214,932,956.39	265,355,430.18	1,022,895,902.87	363,954,576.99				1,867,138,866.43
合计	19,988,185,591.10	15,639,692,987.29	8,395,195,997.55	12,619,254,365.91	19,294,868,010.00			75,937,196,951.85

## 信用风险管理

信用风险是指本集团客户（或交易对手）未能履行合同所规定的义务，或信用质量发生变化影响金融工具价值，从而给本集团带来损失的风险。

本集团的货币资金主要存放在国有商业银行或资产充足率符合规定的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

报告期内，本集团面临的信用风险主要体现在债券投资、融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易、合同履行等方面。具体表现为：一是投资对象的违约或评级下降；二是交易对手的违约。

为控制信用风险，本集团以债券发行人主体信用状况与债项增信措施的综合分析为基础，建立债券信用评级体系，对重点持仓债券进行调研，严控所投债券的品质，密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，研究完善证券池、交易对手库，以实现规避债券违约风险的目标。本集团自营债券投资业务主要投资品种为国债、短期融资券、中期票据、公司债及企业债等。本集团对自营债券投资注重分散投资，对债券等非权益类证券持有量严格控制在集团及监管机构规定的范围内，并密切跟踪投资债项、主体的经营情况和信用评级变化，投资标的信用风险控制良好。另外，本集团在银行间市场开展债券交易时始终坚持按规定选择使用合适的结算方式，并采用 DVP 结算控制交易对手结算违约而产生的信用风险。本集团对债券投资采用违约概率/违约损失率方法，按照单项资产或资产组合，以映射外部评级主标尺方法估计的违约概率、历史违约损失率等风险参数为基础，经前瞻性调整得到各风险参数来计量预期信用损失。

在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务方面，为防范此类业务客户的信用风险，公司设置风险控制指标和预警阈值，强化内控机制，建立逐日盯市制度，对交易进行实时监控、主动预警，公司通过客户资信审核、授信审核、客户账户监控、及时提示交易规则等措施，严格控制融资融券业务的各个风险因素。针对股票质押式回购交易业务，公司设计了业务准入标准，还专门建立了严格的尽职调查、项目审核、规模与集中度控制、盯市、项目跟踪和平仓等制度，从业务开展的各阶段严格控制风险。本集团对融资类业务（含融出资金、约定购回、股票质押式回购等）形成的资产，以及货币市场拆出（借出）资金或证券（含定期存款、银行间或交易所拆出资金、逆回购）等，按信用风险特征的相似性和相关性进行分组，根据历史损失经验、目前经济状况、预计组合中已经存在的损失等计量预期信用损失。

本集团对符合准则规定条件且适用本集团已做出相应会计政策选择的应收款项采用简化模型计量预期信用损失。本集团选择运用简化模型计量预期信用损失时，不再区分信用风险是否显著增加，而是始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

除上述采用简化模型以外的金融资产，本集团采用一般模型计量预期信用损失准备。本集团基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行

调整：

第一阶段：在资产负债表日信用风险较低的金融工具，或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，本集团按照相当于该金融工具未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）预期信用损失的金额计量其损失准备；

第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；



第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

同时，考虑以下情况：

(1) 因融资融券、约定购回交易业务、股票质押式回购交易业务根据合同约定经强制平仓形成的应收款项由于信用风险较高，按照预期回收情况计算预期信用损失；

(2) 因证券清算形成的应收款项、本集团担任管理人或托管人的应收管理费和托管费、业绩报酬、席位佣金等由于信用风险极低，可考虑不计提减值准备；

(3) 已发生信用风险或金额重大的金融资产单独进行减值测试，通过预估其未来现金流量现值或预估其坏账损失率计提减值准备。

对于购买或源生时已发生信用减值的金融工具，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。

#### 信用风险较低的标准

如果金融工具于资产负债表日的信用风险较低，即认为该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其支付合同现金流量义务的能力很强，即使较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化，也不一定会降低借款人履行其支付合同现金流量业务的能力，那么该金融工具具有较低的信用风险。

#### 信用风险显著增加的判断标准

本集团在每个资产负债表日，评估信用风险自初始确认后是否显著增加。在评估信用风险是否显著增加时，本集团考虑事项包括但不限于：

- (1) 可获得有关过去事项、当前状况及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；
- (2) 宏观经济状况、债务人经营和财务情况、内部实际违约率和预期违约概率、外部信用评级和内部信用评级、逾期情况、外部市场定价等信息；
- (3) 金融工具预计存续期内违约风险的相对变化，而非违约风险变动的绝对值。

如果合同付款逾期超过（含）30日，则通常可以推定金融资产的信用风险显著增加，除非本集团以合理成本即可获得合理且有依据的信息，证明即使逾期超过30日，信用风险仍未显著增加。

#### 已发生信用减值的认定

当本集团对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，则该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括但不限于下列可观察信息：

- (1) 发行方或债务人发生重大财务困难；
- (2) 债务人违反合同；
- (3) 公司出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- (4) 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- (5) 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；
- (6) 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。

如果一项金融工具逾期超过（含）90 日，则本集团推定该金融工具已发生违约，除非有合理且有依据的信息，表明以更长的逾期时间作为违约标准更为恰当。

#### 股票质押业务三阶段划分标准

对于股票质押式回购业务，本集团充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券所属板块、流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况、发行人经营情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的平仓线（一般不低于 130%）。

(1) 履约保障比例大于等于平仓线，且本金或利息的逾期天数小于 30 天（不含）的股票质押式回购业务，应确认为第一阶段；

(2) 履约保障比例在 100%（含）至平仓线之间，或本金或利息的逾期天数大于 30 天（含）小于 90 天（不含），或质押标的股票出现司法冻结、特别处理（ST）、司法诉讼等异常现象的股票质押式回购业务，应确认为第二阶段；

(3) 履约保障比例小于 100%（不含），或本金或利息的逾期天数大于 90 天（含），或其他表明已发生信用减值的股票质押式回购业务，应确认为第三阶段。

#### 预期信用损失计量的参数（一般模型）

根据信用风险是否发生显著增加以及是否已发生信用减值，本集团对不同的资产分别以 12 个月或整个存续期的预期信用损失计量减值准备。预期信用损失计量的关键参数包括违约概率、违约损失率和违约风险敞口。本集团考虑历史统计数据（如交易对手评级、担保方式及抵质押物类别、还款方式等）的定量分析及前瞻性信息，建立违约概率、违约损失率及违约风险敞口模型。

- 违约概率是指债务人在未来 12 个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。本集团基于历史违约数据、内部及外部评级信息、前瞻性信息等因素估计违约概率；

- 违约损失率是指本集团对违约风险暴露发生损失程度作出的预期。根据交易对手的类型、追索的方式和优先级，以及担保品的不同，违约损失率也有所不同。违约损失率以违约发生时风险敞口损失的百分比表示；

- 违约风险敞口是指在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本集团应被偿付的金额；

- 前瞻性信息，信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。本集团通过进行历史数据分析，识别出影响各业务类型信用风险及预期信用损失的关键经济指标，定期根据经济指标预测以及专家评估，确定前瞻性信息对违约概率等参数的影响。

#### 股票质押业务预期信用损失计量（一般模型）

本集团基于可获取的内外部信息，如：历史违约数据、履约保障比例、担保物变现能力等因素，定期对融资人进行风险评估。本年末各阶段减值损失率区间如下：

第一阶段：根据不同的履约保障比例，减值损失率一般为 0.1%-2.0%；

第二阶段：于本年末，本集团无划分为第二阶段的股票质押式回购业务；

第三阶段：综合考虑质押物总估值、履约保障比例、融资人信用状况及还款能力、其他担保资产价值情况、第三方提供连带担保等定性与定量指标，逐项评估每笔业务的可收回金额，确定减值准备金额。

下表列示了本集团资产负债表项目的最大信用风险敞口。该最大敞口为考虑担保或其他信用增级方法影响前的金额。

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
货币资金	23,550,457,236.29	18,198,427,282.55
结算备付金	4,022,703,604.97	3,352,807,143.85
融出资金	18,049,801,302.82	11,603,902,720.20
衍生金融资产	7,949,263.29	515,945.01
买入返售金融资产	7,018,448,234.30	9,806,267,228.49
应收款项	376,891,916.23	157,516,730.15
应收票据		60,000.00
存出保证金	3,125,558,058.04	2,578,212,328.38
交易性金融资产	22,589,218,628.21	24,678,232,370.34
债权投资	224,095,373.07	142,062,707.25
其他债权投资	6,264,932,127.78	5,796,376,967.37
其他	142,056,147.43	164,879,172.95
最大信用风险敞口	85,372,111,892.43	76,479,260,596.54

### 市场风险管理

市场风险是指利率、汇率以及其他市场因素变动而引起金融工具的价值变化，进而对未来收益或者未来现金流量可能造成潜在损失的风险。影响本集团业务的市场风险主要包括市场价格风险和利率风险。

#### 其他价格风险

其他价格风险，是指汇率风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险，无论这些变动是由与单项金融工具或其发行方有关的因素引起的，还是由与市场内交易的所有类似金融工具有关的因素引起的。其他价格风险可源于商品价格、股票市场指数、权益工具价格以及其他风险变量的变化。

下表说明了，在所有其他变量保持不变，本集团的净损益和其他综合收益的税后净额对股票及股权投资、基金投资、理财产品、券商资管产品、衍生金融工具等的公允价值的每 10% 的变动（以资产负债表日的账面价值为基础）的敏感性。

2020 年 12 月 31 日/2020 年 1-12 月	金融工具投资公允价值增加/(减少)	净损益增加/(减少)	其他综合收益的税后净额增加/(减少)	股东权益合计增加/(减少)
金融工具	10%	831,646,901.40	288,251,974.04	1,119,898,875.44
金融工具	-10%	-831,646,901.40	-288,251,974.04	-1,119,898,875.44

2019 年 12 月 31 日/2019 年 1-12 月	金融工具投资公允价值增加/(减少)	净损益增加/(减少)	其他综合收益的税后净额增加/(减少)	股东权益合计增加/(减少)
金融工具	10%	933,595,716.84	327,913,400.99	1,261,509,117.83
金融工具	-10%	-933,595,716.84	-327,913,400.99	-1,261,509,117.83

### 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集团持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、融出资金、存出保证金、债券投资与买入返售金融资产等，利率敏感性负债主要为短期借款、应付短期融资券、拆入资金、代理买卖证券款、卖出回购金融资产款、应付债券等。

本集团通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法来衡量上述持有资产的利率风险。

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。

表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

金融资产	2020 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	23,309,369,566.54	110,972,560.00	101,000,000.00	14,794,200.00		14,486,747.22	23,550,623,073.76
结算备付金	4,022,513,953.71					189,651.26	4,022,703,604.97
融出资金	2,852,889,083.17	4,575,677,055.88	10,439,271,451.06			181,963,712.71	18,049,801,302.82
衍生金融资产						7,949,263.29	7,949,263.29
买入返售金融资产	5,906,749,182.07	164,235,600.00	939,657,015.21			7,806,437.02	7,018,448,234.30
应收款项						376,891,916.23	376,891,916.23
存出保证金	563,492,780.97					2,562,065,277.07	3,125,558,058.04
交易性金融资产	241,365,812.03	1,155,764,285.76	9,645,084,715.74	10,187,041,152.89	966,803,758.71	11,919,063,032.33	34,115,122,757.46
债权投资				220,385,064.78		3,710,308.29	224,095,373.07
其他债权投资	18,105,834.13	305,481,819.45	392,874,578.82	4,865,277,607.57	531,471,135.32	151,721,152.49	6,264,932,127.78
其他权益工具投资						3,843,359,653.81	3,843,359,653.81
其他资产						142,056,147.43	142,056,147.43
合计	36,914,486,212.62	6,312,131,321.09	21,517,887,760.83	15,287,498,025.24	1,498,274,894.03	19,211,263,299.15	100,741,541,512.96

金融负债	2020 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
短期借款	1,027,239,643.25		42,080,000.00			636,490.77	1,069,956,134.02
应付短期融资款	98,955,000.00	6,074,191,000.00	2,191,326,000.00			36,447,247.63	8,400,919,247.63
交易性金融负债		1,483,894,762.50	46,900,714.00			447,840,704.40	1,978,636,180.90

2020 年年度报告

衍生金融负债		13,201.60				3,522,319.25	3,535,520.85
卖出回购金融资产款	9,962,746,294.76	750,000,000.00				5,165,251.08	10,717,911,545.84
代理买卖证券款	25,195,518,168.84					2,176,051.42	25,197,694,220.26
应付票据		78,570,000.00	98,600,000.00				177,170,000.00
应付款项						405,002,473.26	405,002,473.26
应付债券	4,499,529,013.85	3,911,000.00	6,379,214,100.51	15,249,899,505.60		697,199,990.17	26,829,753,610.13
其他负债	402,109,751.45		96,561,878.53			166,589,586.24	665,261,216.22
合计	41,186,097,872.15	8,390,579,964.10	8,854,682,693.04	15,249,899,505.60		1,764,580,114.22	75,445,840,149.11
净头寸	-4,271,611,659.53	-2,078,448,643.01	12,663,205,067.79	37,598,519.64	1,498,274,894.03	17,446,683,184.93	25,295,701,363.85

金融资产	2019 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	17,983,825,714.15	56,000,000.00	148,000,000.00			10,806,673.76	18,198,632,387.91
结算备付金	3,352,804,672.02					2,471.83	3,352,807,143.85
融出资金	721,128,991.39	3,392,183,568.19	7,406,409,775.49			84,180,385.13	11,603,902,720.20
衍生金融资产						515,945.01	515,945.01
买入返售金融资产	5,628,030,077.24	1,349,529,762.72	2,809,289,566.12			19,417,822.41	9,806,267,228.49
应收票据						60,000.00	60,000.00
应收款项						157,516,730.15	157,516,730.15
存出保证金	369,051,584.13					2,209,160,744.25	2,578,212,328.38
交易性金融资产	183,916,754.40	553,931,308.26	5,237,643,460.37	15,955,676,108.63	2,322,281,653.42	12,889,170,414.44	37,142,619,699.52
债权投资				139,519,387.40		2,543,319.85	142,062,707.25
其他债权投资	138,151,797.48	3,799,905.58	1,145,980,870.11	4,327,684,108.90	41,637,254.54	139,123,030.76	5,796,376,967.37

2020 年年度报告

其他权益工具投资						4,372,178,679.85	4,372,178,679.85
其他资产						164,879,172.95	164,879,172.95
合计	28,376,909,590.81	5,355,444,544.75	16,747,323,672.09	20,422,879,604.93	2,363,918,907.96	20,049,555,390.39	93,316,031,710.93

金融负债	2019 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
短期借款	3,026,400.00		358,320,000.00			841,667.17	362,188,067.17
拆入资金							
应付短期融资款	1,437,101,000.00	3,241,956,000.00	190,348,000.00			24,922,023.67	4,894,327,023.67
交易性金融负债	6,262,000.00	2,463,074,527.55	158,830,000.00			2,981,040,164.86	5,609,206,692.41
衍生金融负债						4,923,382.96	4,923,382.96
卖出回购金融资产款	12,118,766,624.14	1,000,000,000.00				7,057,362.21	13,125,823,986.35
代理买卖证券款	19,732,884,651.34					1,346,989.48	19,734,231,640.82
代理承销证券款							
应付票据						30,000,000.00	30,000,000.00
应付款项						39,020,993.89	39,020,993.89
应付债券			9,548,363,981.56	17,828,921,456.62		862,305,201.56	28,239,590,639.74
其他负债	264,182,318.67	988,442,355.44	343,331,967.88			253,666,790.12	1,849,623,432.11
合计	33,562,222,994.15	7,693,472,882.99	10,599,193,949.44	17,828,921,456.62		4,205,124,575.92	73,888,935,859.12
净头寸	-5,185,313,403.34	-2,338,028,338.24	6,148,129,722.65	2,593,958,148.31	2,363,918,907.96	15,844,430,814.47	19,427,095,851.81

市场利率的波动主要影响本集团持有的以公允价值计量的生息资产的估值。假设收益率曲线平行移动 100 个基点，对本集团各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

	2020 年 12 月 31 日/2020 年度		2019 年 12 月 31 日/2019 年度	
	股东权益	净利润	股东权益	净利润
收益率曲线向上平移 100 个基点	-285,755,905.40	-205,845,462.87	-476,855,018.38	-429,108,569.57
收益率曲线向下平移 100 个基点	297,885,854.30	213,527,198.34	501,991,578.57	453,312,213.48

### 操作风险管理

操作风险是指在集团业务范畴内，由不完善或有问题的内部程序、员工和信息科技系统，以及外部事件给集团业务造成直接或间接损失的风险。

本集团操作风险管理包括操作风险的识别与评估、限额管理、操作风险监测、操作风险控制、操作风险报告、操作风险处置等流程。本集团通过业务检查、穿行测试、事件分析等方法评估公司整体与各业务的操作风险情况，并针对操作风险较大的业务及部位，以风险提示函、警示函、评估报告等方式，对相关部门进行风险预警，督促整改。

报告期内，经过内部数据的收集与分析，重新修正了操作风险的识别与评估模型；对部分存在操作风险的业务要求建立制度或优化流程进行风险控制；集团对业务授权进行调整，并根据调整的授权梳理各业务的权限管理；集团加强各类培训，提高技能和职业道德，减少操作失误；集团优化信息系统，实现部分业务系统自动化，减少人为失误与差错。

### 4 资本管理

本集团资本管理的主要目标是保障本集团的持续经营，能够通过制定与风险水平相当的产品和服务价格并确保以合理融资成本获得融资的方式，持续为股东提供回报。

本集团根据经济形势以及相关资产的风险特征的变化对其进行调整。为维持或调整资本结构，本集团可以调整对股东的利润分配、向股东归还资本、发行新股、次级债或可转债等

本集团采用净资本来管理资本。净资本是指根据证券公司的业务范围和公司资产负债的流动性特点，在净资产的基础上对资产负债等项目和有关业务进行风险调整后得出的综合性风险控制指标。

于 2020 年 1 月 23 日及 2020 年 3 月 20 日，中国证监会先后颁布了《证券公司风险控制指标计算标准规定》（2020 年修订版）及《证券公司风险控制指标管理办法》（2020 年修订版），对证券公司必须持续符合的风险控制指标体系及标准进行了修改，并要求于 2020 年 6 月 1 日起施行，本公司须就风险控制指标持续达到下列标准：

- (1) 净资本与各项风险资本准备之和的比率不得低于 100%（“比率 1”）；
- (2) 净资本与净资产的比率不得低于 20%（“比率 2”）；
- (3) 净资本与负债的比率不得低于 8%（“比率 3”）；
- (4) 净资产与负债的比率不得低于 10%（“比率 4”）；
- (5) 自营权益类证券及证券衍生品与净资本的比率不得超过 100%（“比率 5”）；



- (6) 自营非权益类证券及证券衍生品与净资本的比率不得超过 500% (“比率 6”);
- (7) 核心净资本与表内外资产总额的比率不得少于 8% (“比率 7”);
- (8) 优质流动性资产与未来 30 天现金净流出量的比率不得少于 100% (“比率 8”);
- (9) 可用稳定资金与所需稳定资金的比率不得少于 100% (“比率 9”);
- (10) 融资 (含融券) 的金额与净资本的比率不得超过 400% (“比率 10”)。

本公司的净资本及上述比例如下:

	标准	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
净资本		19,590,074,763.47	14,782,210,610.56
比率 1	≥100%	245.21%	173.22%
比率 2	≥20%	71.64%	72.02%
比率 3	≥8%	41.20%	31.73%
比率 4	≥10%	57.51%	44.06%
比率 5	≤100%	29.53%	35.58%
比率 6	≤500%	162.08%	218.79%
比率 7	≥8%	21.28%	16.76%
比率 8	≥100%	261.77%	215.06%
比率 9	≥100%	156.29%	144.54%
比率 10	≤400%	107.29%	124.13%

上述比例均系依据中华人民共和国企业会计准则编制的财务信息为基础计算得出。

本公司若干子公司亦须遵守分别由中国证监会及香港证券及期货事务监察委员会所颁布的中国及香港监管要求的资本规定。

## 附注 9、公允价值的披露

### 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

√适用 □不适用

单位:元币种:人民币

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	
<b>一、持续的 公允价值 计量</b>				
(一) 交易 性金融 资产	2,716,795,711.55	29,529,776,290.36	1,868,550,755.55	34,115,122,757.46
债券	1,185,564,230.17	21,003,854,640.56	214,509,358.59	22,403,928,229.32
基金	447,918,146.69	5,098,906,547.78		5,546,824,694.47
股票	1,083,313,334.69	509,634,113.80	142,480,824.72	1,735,428,273.21
其他		2,917,380,988.22	1,511,560,572.24	4,428,941,560.46
(二) 其他 债权投资		6,264,932,127.78		6,264,932,127.78
(三) 其他	1,101,286,794.47	2,398,174,524.76	343,898,334.58	3,843,359,653.81

权益工具投资				
非交易性证券/非上市股权	1,101,286,794.47	8,578,534.25	343,898,334.58	1,453,763,663.30
证金专户		2,389,595,990.51		2,389,595,990.51
(四) 衍生金融资产		7,949,263.29		7,949,263.29
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	3,818,082,506.02	38,200,832,206.19	2,212,449,090.13	44,231,363,802.34
(五) 交易性金融负债		1,978,636,180.90		1,978,636,180.90
(六) 衍生金融负债	107,376.30	15,588.35	3,412,556.20	3,535,520.85
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	107,376.30	1,978,651,769.25	3,412,556.20	1,982,171,701.75

## 2、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

√适用 □不适用

对于存在活跃市场的交易性金融资产及负债、其他债权投资、其他权益工具投资和衍生金融工具，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。

## 3、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

√适用 □不适用

对于交易性金融资产及其他债权投资中的债券投资，其公允价值是按相关债券登记结算机构估值系统报价确定的。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

对于交易性金融资产及负债、其他债权投资和其他权益工具投资中不存在公开市场的债务、权益工具投资及结构化主体等，其公允价值以估值技术确定。估值技术所需的可观察输入值包括但不限于收益率曲线、资产净值等估值参数。

对于衍生金融资产和负债，其公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日，采用类似衍生金融工具的市场利率或汇率将未来现金流折现，以验证报价的合理性。

## 4、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

√适用 □不适用

对于股票、非上市股权投资、债务工具投资及衍生金融工具，本集团从交易对手处询价或者采用估值技术来确定其公允价值，估值技术包括现金流量折现法和市场法等。其公允价值的计量采用了重要的不可观察参数，比如流动性折扣、风险调整折现率、波动率等。持续第三层次公允价值计量的金融工具对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

## 5、不可输入观察值

如下为第三层次公允价值计量的重要不可观察输入值概述：

2020年12月31日	年末公允价值	估值技术	不可观察输入值	对公允价值的影响
股票/非上市股权投资	1,634,276,169.90	市场法	流动性折扣	流动性折扣越大公允价值越低
非上市股权投资	363,663,561.64	近期交易价	不适用	不适用
债务工具投资	214,509,358.59	现金流量折现法	风险调整折现率	风险调整折现率越高公允价值越低
衍生金融负债	-3,412,556.20	现金流量折现法	风险调整折现率	风险调整折现率越高公允价值越低

## 6、公允价值计量的调节

持续的第三层次公允价值计量的调节信息如下：

2020年度	交易性金融资产	其他债权投资	其他权益工具投资	衍生金融资产	衍生金融负债
本年初余额	2,029,944,947.54	16,728,070.28	418,635,725.77	371,350.01	-4,909,989.67
转入第三层次	286,786,727.48				
转出第三层次	-175,518,985.25		-5,420,612.59		
本年损益影响合计	91,750,074.23	5,093,702.49		637,393.37	1,313,691.42
本年其他综合收益影响合计		-425,058.94	-46,583,239.40		
购买	442,921,479.35		3,167,630.69	2,496,438.38	
发行					-5,655,867.06
出售/结算	-807,333,487.80	-21,396,713.83	-25,901,169.89	-3,505,181.76	5,839,609.11
本年年末余额	1,868,550,755.55		343,898,334.58		-3,412,556.20
对于在报告期末持有的资产/负债，计入损益的当期未实现利得或损失的变动	-167,565,507.03			-19,311.03	1,280,810.05

## 7、公允价值层次的转换

对于持续的以公允价值计量的资产和负债，本集团在每个报告期末通过重新评估分类（基于对整体公允价值计量有重大影响的最低层次输入值），判断各层次之间是否存在转换。

于财务报告期间，本集团持有的按公允价值计量的金融工具在第一层次和第二层次之间无重大转换。

## 8、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

√适用 □不适用

本集团管理层认为，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。

## 附注 10、关联方及关联交易

## 1、 第一大股东情况

√适用 □不适用

第一大股东持股情况如下（单位：人民币万股）

关联方名称	关联方关系	期末			期初		
		持股数	持股比例	表决权比例	持股数	持股比例	表决权比例
苏州国际发展集团有限公司	股东	91,722.08	23.64%	23.64%	70,555.45	23.52%	23.52%

关联方名称	注册地	存在控制关系的期间	注册资本			
			期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
苏州国际发展集团有限公司	中国苏州	2006 年起	人民币 250,000.00 万元			人民币 250,000.00 万元

受本公司第一大股东控制的其他股东所持公司股份或权益及其变化

企业名称	2020 年 12 月 31 日			2019 年 12 月 31 日		
	持股数	持股比例	表决权比例	持股数	持股比例	表决权比例
苏州营财投资集团公司	8,395.21 万股	2.16%	2.16%	6,457.86 万股	2.15%	2.15%
苏州信托有限公司	6,905.60 万股	1.78%	1.78%	5,312.00 万股	1.77%	1.77%

苏州国际发展集团有限公司直接或者通过其控制的其他企业合计持有本公司 27.58%股份。

## 2、 本企业的子公司情况

√适用 □不适用

本企业子公司的情况详见附注 7、1

## 3、 本企业合营和联营企业情况

√适用 □不适用

本集团的联营企业及本集团与联营企业之间的主要交易参见附注五、13 与附注七、2。

## 4、 其他关联方情况

√适用 □不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
上海华元恒道资产管理有限公司	联营企业华元恒道（上海）投资管理有限公司的子公司
苏州元禾控股股份有限公司	本公司董事担任董事
国寿安保基金管理有限公司	本公司董事担任董事
弦高（苏州）资产管理有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司
苏州信托有限公司	国发集团的子公司，本公司监事任董事长，本公司董事任董事
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司
信和安（苏州）商业保理有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司
昆山创业控股集团有限公司	本公司监事任总裁
苏州市融资再担保有限公司	国发集团的子公司，本公司监事任董事长
东吴人寿保险股份有限公司	本公司董事任董事
苏州工业园区经济发展有限公司	本公司董事任副总裁
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	苏州工业园区经济发展有限公司的一致行动人
苏州国发创业投资控股有限公司	国发集团的子公司，本公司董事任董事、监事长
苏州市住房置业融资担保有限公司	国发集团的子公司
昆山市国科创业投资有限公司	本公司监事任董事长
苏州国发高新创业投资管理有限公司	国发集团的子公司
苏州国发营财不动产经营管理有限公司	国发集团的子公司
紫金财产保险股份有限公司	本公司董事任董事
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	国发集团的子公司
苏州营财投资集团有限公司	国发集团的子公司，本公司董事任董事长
中证信用云科技（深圳）股份有限公司	联营企业中证信用增进股份有限公司的子公司
中证信用融资担保有限公司	联营企业中证信用增进股份有限公司的子公司
昆山市创业投资有限公司	本公司监事任董事长
光大期货有限公司	本公司董事任独立董事
苏州苏试试验集团股份有限公司	本公司独立董事担任独立董事
中国人寿资产管理有限公司	本公司董事担任副总裁（已于 2020 年 4 月离任）

## 5、主要关联交易

本集团与关联方交易按照市场价格进行，定价机制遵循公允、合理和市场化原则。

### （1）向关联方收取的手续费及佣金收入

#### 1) 证券经纪业务收入

企业名称	2020 年度	2019 年度
上海华元恒道资产管理有限公司	1,528,874.88	138,938.98
苏州元禾控股股份有限公司	617,942.00	113,769.00
苏州国际发展集团有限公司	461,030.91	115,448.89
国寿安保基金管理有限公司	436,472.57	104,163.52
苏州国发创业投资控股有限公司	258,652.97	319,600.00
东吴人寿保险股份有限公司	246,552.01	
苏州信托有限公司	231,139.60	32,898.07
弦高（苏州）资产管理有限公司	206,624.91	68,206.53
东吴（苏州）金融科技有限公司	78,539.42	5,981.77
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	40,000.00	

昆山创业控股集团有限公司	3,530.80	5.00
苏州市融资再担保有限公司	2,000.00	
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	975.98	3,695.10
信和安（苏州）商业保理有限公司	53.65	208.87
中国人寿资产管理有限公司		4,171,034.68
合计	4,112,389.70	5,073,950.41

## 2) 财务顾问业务收入

企业名称	2020 年度	2019 年度
苏州资产管理有限公司		943,396.22
苏州信托有限公司	1,292,286.82	793,068.89
合计	1,292,286.82	1,736,465.11

## 3) 证券承销业务收入

企业名称	2020 年度	2019 年度
苏州国际发展集团有限公司	8,490,566.04	5,660,377.36
四川华体照明科技股份有限公司	6,000,000.00	
苏州苏试试验集团股份有限公司	4,716,981.13	
苏州元禾控股股份有限公司	566,037.74	
昆山创业控股集团有限公司		4,245,283.02
苏州国发创业投资控股有限公司		2,830,188.68
合计	19,773,584.91	12,735,849.06

## 4) 证券保荐业务收入

企业名称	2020 年度	2019 年度
苏州苏试试验集团股份有限公司	943,396.23	
四川华体照明科技股份有限公司		500,000.00
合计	943,396.23	500,000.00

## (2) 向关联方支付的利息支出

企业名称	2020 年度	2019 年度
苏州元禾控股股份有限公司	224,995.31	61,623.25
苏州国际发展集团有限公司	105,677.60	12,325.44
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	60,992.98	
昆山创业控股集团有限公司	52,205.69	50,362.44
苏州国发创业投资控股有限公司	31,587.35	28,239.44
弦高（苏州）资产管理有限公司	25,555.32	2,235.53
苏州信托有限公司	14,076.65	9,770.02
苏州市融资再担保有限公司	6,762.47	55,117.41
苏州工业园区经济发展有限公司	5,912.68	9,098.07
昆山市国科创业投资有限公司	630.06	349.26

东吴（苏州）金融科技有限公司	134.01	513.63
上海华元恒道资产管理有限公司	73.27	292.45
信和安（苏州）商业保理有限公司	57.25	1,111.93
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	24.89	1,095.98
苏州国发高新创业投资管理有限公司	14.19	14.06
苏州市住房置业融资担保有限公司	6.68	6,196.33
华元恒道（上海）投资管理有限公司	1.57	1.55
合计	528,707.97	238,346.79

**(3) 向关联方支付的房屋租赁费**

企业名称	2020 年度	2019 年度
昆山创业控股集团有限公司	2,050,000.00	2,050,000.00
苏州国发营财不动产经营管理有限公司	743,062.00	733,062.00
合计	2,793,062.00	2,783,062.00

**(4) 应收关联方房租保证金**

企业名称	2020 年度	2019 年度
昆山创业控股集团有限公司	170,000.00	

**(5) 向关联方支付的软件研发及外包服务费**

企业名称	2020 年度	2019 年度
中证信用云科技（深圳）股份有限公司	598,597.43	486,725.66
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	39,502,144.92	12,775,405.66
合计	40,100,742.35	13,262,131.32

**(6) 购买关联方公司发行的保险产品**

企业名称	2020 年度	2019 年度
东吴人寿保险股份有限公司	2,676,064.00	12,815,000.00
紫金财产保险股份有限公司	496,000.00	
合计	3,172,064.00	12,815,000.00

**(7) 向关联方支付的购房款**

企业名称	2020 年度	2019 年度
昆山市创业投资有限公司	18,074,893.75	

**(8) 本集团向关联方发行的信用保护合约**

企业名称	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
苏州市融资再担保有限公司	200,000.00	200,000.00

**(9) 关联方存放在本集团的货币资金（客户资金）**

企业名称	2020年12月31日	2019年12月31日
弦高（苏州）资产管理有限公司	25,525,901.33	864,163.57
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	21,664,816.06	
苏州市融资再担保有限公司	3,750,000.00	689,818.38
苏州工业园区经济发展有限公司	1,269,551.94	2,932,741.05
苏州国发创业投资控股有限公司	1,166,292.69	66,351.03
昆山创业控股集团有限公司	1,084,939.78	18,307,272.68
昆山市国科创业投资有限公司	176,979.32	176,349.26
上海华元恒道资产管理有限公司	69,710.02	292.45
苏州信托有限公司	19,664.31	1,365.00
苏州元禾控股股份有限公司	13,352.06	95,050.12
苏州国发高新创业投资管理有限公司	3,986.14	3,971.95
苏州市住房置业融资担保有限公司	1,874.13	1,867.45
华元恒道（上海）投资管理有限公司	441.62	440.05
东吴（苏州）金融科技有限公司	148.83	64,827.87
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	0.05	0.05
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司		916,542.16
信和安（苏州）商业保理有限公司		118,162.32
苏州国际发展集团有限公司		0.10
合计	54,747,658.28	24,239,215.49

**(10) 关联方持有由本集团作为管理人募集设立的集合资产管理计划份额**

企业名称	2020年12月31日	2019年12月31日
苏州资产管理有限公司	94,470,715.36	104,259,999.00
苏州市住房置业融资担保有限公司	26,000,000.00	26,000,000.00
苏州营财投资集团有限公司	20,000,000.00	20,000,000.00
苏州市融资再担保有限公司	20,000,000.00	20,000,000.00
东吴（苏州）金融科技有限公司	100,000.00	2,690,238.28
合计	160,570,715.36	172,950,237.28

**(11) 关联方持有由本集团作为管理人募集设立的定向资产管理计划份额**

企业名称	2020年12月31日	2019年12月31日
苏州信托有限公司	2,180,000,000.00	2,742,000,000.00
苏州国际发展集团有限公司	117,281,722.80	106,100,000.00
昆山创业控股集团有限公司	22,614,400.00	22,614,400.00
苏州市住房置业融资担保有限公司	50,000,000.00	
合计	2,369,896,122.80	2,870,714,400.00

**(12) 本集团持有由关联方作为管理人募集设立的信托计划净值**

企业名称	2020年12月31日	2019年12月31日
苏州信托有限公司	1,089,580,000.00	1,089,580,000.00

**(13) 本集团持有由关联方作为管理人募集设立的基金净值**



企业名称	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
弦高（苏州）资产管理有限公司	4,215,000.00	

**(14) 关联方持有由本集团作为管理人募集设立的基金份额**

企业名称	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
苏州国际发展集团有限公司	379,012,160.00	
苏州资产管理有限公司	273,304,864.00	
中证信用融资担保有限公司		50,021,855.06
合计	652,317,024.00	50,021,855.06

**(15) 高级管理人员薪酬**

	2020 年度	2019 年度
高级管理人员薪酬	17,352,384.00	13,882,925.28

根据中国证监会 2012 年下发的《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》（第 88 号令）及公司章程，本公司高级管理人员包括总裁、副总裁、财务负责人、董事会秘书、合规总监、首席风险官等。

本公司 2020 年度高级管理人员任职期间从本公司获得的税前报酬总额为人民币 1,735.24 万元（2019 年度：人民币 1,388.29 万元）。

**附注 11、重大或有事项**

√适用 □不适用

于 2020 年 12 月 31 日，本集团不存在重大或有事项。

**附注 12、承诺事项**

√适用 □不适用

**1、经营租赁承诺事项**

根据已签订的不可撤销的经营性租赁合同，本集团未来最低应支付租金汇总如下：

项目	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
1 年以内	75,203,251.81	74,786,141.70
1 年至 2 年	58,091,186.55	53,168,242.46
2 年至 3 年	47,897,392.33	17,513,872.71
3 年以上	77,952,197.88	39,144,275.99
合计	259,144,028.57	184,612,532.86

**2、资本承诺**

项目	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
已签约但未拨付	28,845,213,363.26	13,879,845,826.66

上述资本承诺主要为本集团证券承销的资本承诺。

**附注 13、资产负债表日后事项**

√适用 □不适用

**1、股份回购**

2021年3月5日，本公司召开第三届董事会第四十次（临时）会议，审议通过了《关于回购公司A股股份的议案》。2021年3月10日，本公司披露了《东吴证券关于以集中竞价交易方式回购A股股份的回购报告书》。2021年3月30日，本公司完成回购，已完成回购本公司A股股份38,799,814股，占公司总股本的0.9999%，回购最高价为人民币9.76元/股，回购最低价为人民币8.78元/股，回购均价为人民币9.05元/股，使用资金总额为人民币350,977,160.28元（不含交易费用）。本公司本次回购A股股份全部存放于公司回购专用证券账户，拟作为限制性股票股权激励计划的股票来源。

**2、利润分配**

经本公司2021年4月28日第四届董事会第二次会议审议，通过了2020年度利润分配预案，拟向全体股东（扣除本公司回购专户持有的本公司股份）每10股派送现金红利人民币1.57元（含税），本利润分配预案尚需经股东大会批准。

**附注 14、其他重要事项****1、分部信息****(1). 报告分部的确定依据与会计政策**

√适用 □不适用

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，在经营分部的基础上本集团确定了经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务、公司总部及其他等6个报告分部。分部信息相关的会计政策参见附注三、31。

本集团各个报告分部提供的主要服务分别如下：

(1) 经纪及财富管理业务分部从事于代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，同时也提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。

(2) 投资银行业务分部向客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板挂牌、ABS发行、并购重组等。

(3) 投资与交易业务分部以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券（含非上市股权）、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。

(4) 资管及基金管理业务分部提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。

(5) 信用交易业务分部包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务。

(6) 公司总部及其他分部系总部运营及除上述主营业务外的其他业务。

## (2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

2020 年度报告分部的财务信息

单位：元 币种：人民币

项目	经纪及财富管理业务	投资银行业务	投资与交易业务	资管及基金管理业务	信用交易业务	公司总部及其他	合并抵销	合计
一、营业收入	1,948,657,867.14	1,102,499,970.82	3,160,950,372.87	170,901,196.63	982,798,431.36	322,885,119.19	-332,200,516.91	7,356,492,441.10
其中：手续费及佣金净收入	1,559,733,112.62	1,102,499,970.82	21,992,096.78	232,887,372.30	3,473,324.74		-22,465,028.11	2,898,120,849.15
投资收益			1,951,768,353.83	197,504,501.59		310,644,000.00	-309,027,203.44	2,150,889,651.98
其他	388,924,754.52		1,187,189,922.26	-259,490,677.26	979,325,106.62	12,241,119.19	-708,285.36	2,307,481,939.97
二、营业支出	1,291,605,946.52	561,626,925.54	1,772,386,278.45	370,727,121.09	744,202,375.93	337,160,903.86	-22,402,013.02	5,055,307,538.37
三、营业利润	657,051,920.62	540,873,045.28	1,388,564,094.42	-199,825,924.46	238,596,055.43	-14,275,784.67	-309,798,503.89	2,301,184,902.73
四、利润总额	654,346,877.98	540,793,596.08	1,388,650,068.73	-198,212,246.78	238,454,439.49	-40,102,492.78	-310,644,000.01	2,273,286,242.71
五、资产总额	27,359,263,226.49	41,393,821.95	57,670,909,226.68	3,314,180,080.13	20,819,951,757.08	4,453,030,295.26	-8,184,178,206.67	105,474,550,200.92
六、负债总额	25,792,611,087.73	270,776,723.79	32,610,602,082.69	3,141,147,300.68	15,120,387,659.53	798,895,412.12	-470,190,864.00	77,264,229,402.54
七、补充信息								
折旧与摊销费用	63,870,768.97	1,771,081.53	7,358,916.81	11,425,721.49	99,287.02	38,946,876.52		123,472,652.34
资本性支出	41,414,515.02	463,357.15	9,941,862.55	9,782,318.20	130,404.69	944,052,956.01		1,005,785,413.62
信用减值损失	59,790.20	-211,557.18	27,133,852.91	116,561,959.73	582,754,663.97	221,932.97		726,520,642.60

2019 年度报告分部的财务信息

	经纪及财富管理业务	投资银行业务	投资与交易业务	资管及基金管理业务	信用交易业务	公司总部及其他	合并抵销	合计
一、营业收入	1,386,507,967.92	643,579,876.81	2,399,335,495.19	77,282,174.85	629,508,267.14	52,694,666.32	-58,534,985.55	5,130,373,462.68
其中：手续费及佣金净收入	1,065,079,199.29	625,083,630.67	22,648,773.31	284,717,869.05		6,544,583.36	-2,185,170.48	2,001,888,885.20
投资收益			1,569,066,023.03	337,268,427.75		55,946,000.00	-55,023,610.70	1,907,256,840.08
其他	321,428,768.63	18,496,246.14	807,620,698.85	-544,704,121.95	629,508,267.14	-9,795,917.04	-1,326,204.37	1,221,227,737.40

## 2020 年年度报告

二、营业支出	974,255,878.05	402,125,270.79	1,497,525,709.50	460,522,495.45	151,051,708.09	311,406,521.37	-2,701,630.77	3,794,185,952.48
三、营业利润	412,252,089.87	241,454,606.02	901,809,785.69	-383,240,320.60	478,456,559.05	-258,711,855.05	-55,833,354.78	1,336,187,510.20
四、利润总额	414,858,409.75	241,451,762.09	901,702,658.06	-360,293,881.80	478,456,026.55	-264,058,459.20	-78,545,651.25	1,333,570,864.20
五、资产总额	20,845,627,070.27	14,849,370.45	51,750,356,080.62	9,246,293,000.50	18,440,280,465.91	2,962,815,983.62	-7,025,576,923.22	96,234,645,048.15
六、负债总额	20,190,200,874.95	147,505,690.11	31,326,849,195.20	8,736,329,170.44	14,345,714,848.96	492,588,635.05	-260,335,593.66	74,978,852,821.05
七、补充信息								
折旧与摊销费用	60,845,926.40	1,851,244.35	2,910,307.40	11,980,485.24	572,411.46	42,404,181.98		120,564,556.83
资本性支出	42,867,399.28	579,155.29	4,651,782.00	7,651,436.46	486,508.63	58,157,159.04		114,393,440.70
信用减值损失	1,806,707.17	866,946.76	17,310,928.99	91,579,871.98	55,437,683.76	2,301,898.05		169,304,036.71
其他资产减值损失				89,343,191.51				89,343,191.51

## 2、以公允价值计量的资产和负债

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初金额	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	期末金额
1、交易性金融资产（不含衍生金融资产）	37,142,619,699.52	304,107,471.87			34,115,122,757.46
2、衍生金融工具	-4,407,437.95	-9,324,503.33			4,413,742.44
3、其他债权投资	5,796,376,967.37		518,797.71	26,983,206.72	6,264,932,127.78
4、其他权益工具投资	4,372,178,679.85		391,620.59		3,843,359,653.81
5、交易性金融负债	5,609,206,692.41	-140,757,140.36			1,978,636,180.90

## 3、金融工具项目计量基础分类表

## (1). 金融资产计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

金融资产项目	期末账面价值					
	以摊余成本计量的金融资产	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	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资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	23,550,623,073.76					
结算备付金	4,022,703,604.97					
融出资金	18,049,801,302.82					
衍生金融资产				7,949,263.29		
买入返售金融资产	7,018,448,234.30					
应收票据						
应收款项	376,891,916.23					
存出保证金	3,125,558,058.04					
交易性金融资产				34,115,122,757.46		
债权投资	224,095,373.07					
其他债权投资		6,264,932,127.78				
其他权益工具投资			3,843,359,653.81			
其他资产	142,056,147.43					
合计	56,510,177,710.62	6,264,932,127.78	3,843,359,653.81	34,123,072,020.75		

期初账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	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	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资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	18,198,632,387.91					
结算备付金	3,352,807,143.85					
融出资金	11,603,902,720.20					
衍生金融资产				515,945.01		
买入返售金融资产	9,806,267,228.49					
应收票据	60,000.00					
应收款项	157,516,730.15					
存出保证金	2,578,212,328.38					
交易性金融资产				37,142,619,699.52		
债权投资	142,062,707.25					
其他债权投资		5,796,376,967.37				
其他权益工具投资			4,372,178,679.85			
其他资产	164,879,172.95					
合计	46,004,340,419.18	5,796,376,967.37	4,372,178,679.85	37,143,135,644.53		

## (2). 金融负债计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	1,069,956,134.02			
应付短期融资款	8,400,919,247.63			
交易性金融负债		46,900,714.00	1,931,735,466.90	
衍生金融负债		3,535,520.85		
卖出回购金融资产款	10,717,911,545.84			
代理买卖证券款	25,197,694,220.26			
应付票据	177,170,000.00			
应付款项	405,002,473.26			
应付债券	26,829,753,610.13			
其他负债	665,261,216.22			
合计	73,463,668,447.36	50,436,234.85	1,931,735,466.90	
期初账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	362,188,067.17			
应付短期融资款	4,894,327,023.67			
交易性金融负债		12,037,000.00	5,597,169,692.41	



衍生金融负债		4,923,382.96		
卖出回购金融资产款	13,125,823,986.35			
代理买卖证券款	19,734,231,640.82			
应付票据	30,000,000.00			
应付款项	39,020,993.89			
应付债券	28,239,590,639.74			
其他负债	1,849,623,432.11			
合计	68,274,805,783.75	16,960,382.96	5,597,169,692.41	

#### 4、公益性投入

√适用 □不适用

	2020 年度	2019 年度
慈善捐赠	26,941,420.58	5,736,523.12
教育资助	790,000.00	
合计	27,731,420.58	5,736,523.12

## 附注 15、母公司财务报表主要项目注释

## 1、 应收款项

## (1) 按明细列示

	期末余额	期初余额
应收清算款		48,800,000.00
应收资产管理业务产品管理费	55,872,915.68	51,292,567.94
应收其他手续费及佣金	5,912,156.47	20,286,402.19
应收两融业务客户款	21,536,828.68	1,588,882.79
其他	3,456,128.27	4,294,574.43
合计	86,778,029.10	126,262,427.35
减：坏账准备（按一般模型计提）	21,536,828.68	1,588,882.79
减：坏账准备（按简化模型计提）	31,833,340.88	32,195,737.35
应收款项账面价值	33,407,859.54	92,477,807.21

## (2) 按账龄分析

	期末余额		期初余额	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	43,068,605.95	49.63	112,446,317.65	89.06
1年至2年	34,728,642.60	40.02	13,816,109.70	10.94
2年至3年	8,980,780.55	10.35		
合计	86,778,029.10	100.00	126,262,427.35	100.00

## (3) 按评估方式列示

	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单项计提坏账准备	77,409,744.36	89.20	53,046,941.00	68.53
组合计提坏账准备	9,368,284.74	10.80	323,228.56	3.45
合计	86,778,029.10	100.00	53,370,169.56	61.50

	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单项计提坏账准备	101,681,450.73	80.53	33,098,995.11	32.55
组合计提坏账准备	24,580,976.62	19.47	685,625.03	2.79
合计	126,262,427.35	100.00	33,784,620.14	26.76

## (4) 应收款项账净额前五名

于 2020 年 12 月 31 日，应收款项账面净额中金额较大的前五单位名称、净额及款项性质如下：

单位名称	账面净额	账龄	占应收款项 净额的比例	款项性质
------	------	----	----------------	------

			(%)	
东吴-建行-银华 2 号定向资产管理计划	2,153,018.81	1-2 年	6.44	资产管理业务产品管理费
东吴-建行-银华 3 号定向资产管理计划	2,149,490.02	1-2 年	6.43	资产管理业务产品管理费
东吴-建行-银华 1 号定向资产管理计划	2,146,460.75	1-2 年	6.43	资产管理业务产品管理费
中信证券股份有限公司	1,831,500.00	1 年以内	5.48	应收投资咨询服务款
江苏银行股份有限公司	1,800,000.00	1-2 年	5.39	江苏银行信用保护合约保费
合计	10,080,469.58		30.17	

年末应收款项中无应收持有本公司 5%以上（含 5%）股份的股东及其他关联方的款项。

## 2、 长期股权投资

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

	期末余额	期初余额
子公司	7,635,291,591.22	6,748,291,591.22
联营企业	840,892,095.03	773,299,304.74
合计	8,476,183,686.25	7,521,590,895.96

## (2) 子公司投资情况

被投资单位	核算方法	投资成本	年初余额	增减变动	年末余额	在被投资单位持股比例 (%)	在被投资单位表决权比例 (%)	本年现金红利
东吴期货有限公司	成本法	808,741,736.00	808,741,736.00		808,741,736.00	93.80	93.80	35,644,000.00
东吴创新资本管理有限责任公司	成本法	4,238,263,753.43	3,831,263,753.43	407,000,000.00	4,238,263,753.43	100.00	100.00	235,000,000.00
东吴创业投资有限公司	成本法	1,054,200,000.00	1,054,200,000.00		1,054,200,000.00	100.00	100.00	40,000,000.00
东吴证券中新(新加坡)有限公司	成本法	225,263,250.00	225,263,250.00		225,263,250.00	75.00	75.00	
东吴证券(香港)金融控股有限公司	成本法	1,076,695,566.08	596,695,566.08	480,000,000.00	1,076,695,566.08	100.00	100.00	
东吴基金管理有限公司	成本法	232,127,285.71	232,127,285.71		232,127,285.71	70.00	70.00	
合计		7,635,291,591.22	6,748,291,591.22	887,000,000.00	7,635,291,591.22			310,644,000.00

## (3) 联营企业投资情况

单位：元币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	减值准备期末余额
		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			
苏州资产管理有限公司	454,983,444.35			68,438,595.47	70,752.06	-5,880,673.10	6,857,142.87			510,754,975.91	
中证信用增进股份有限公司	293,949,425.48			23,292,085.38	-113,374.00	3,293,540.53	11,250,000.00			309,171,677.39	
苏州企业征信服务有限公司	24,366,434.91			-3,400,993.18						20,965,441.73	
合计	773,299,304.74			88,329,687.67	-42,621.94	-2,587,132.57	18,107,142.87			840,892,095.03	

### 3、其他资产

#### (1) 按类别列示

	期末余额	期初余额
其他应收款	28,017,413.24	55,061,067.63
长期待摊费用	18,726,528.54	21,345,653.80
待摊费用	13,025,048.37	10,793,063.58
预付款项	29,539,197.64	38,896,711.70
其他	76,709,426.76	1,760,908.60
减：减值准备	8,723,876.76	7,721,327.77
合计	157,293,737.79	120,136,077.54

#### (2) 其他应收款

	期末余额	期初余额
其他应收款	25,129,781.51	20,423,802.63
应收股利	2,887,631.73	16,396,640.00
应收利息		18,240,625.00
减：坏账准备	8,723,876.76	7,721,327.77
其他应收款净额	19,293,536.48	47,339,739.86

#### 按账龄分析

账龄	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	16,269,573.18	58.07	4,509,910.90	51.70
1年至2年	1,957,860.38	6.99	195,786.04	2.24
2年至3年	2,922,700.08	10.43	584,540.02	6.70
3年以上	6,867,279.60	24.51	3,433,639.80	39.36
合计	28,017,413.24	100.00	8,723,876.76	100.00

账龄	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	43,862,124.21	79.66	3,636,887.82	47.10
1年至2年	3,257,086.82	5.92	325,708.68	4.22
2年至3年	707,323.44	1.28	141,464.69	1.83
3年以上	7,234,533.16	13.14	3,617,266.58	46.85
合计	55,061,067.63	100.00	7,721,327.77	100.00

#### 按坏账准备计提方式分析

项目	期末
----	----

	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	4,455,111.53	15.90	4,455,111.53	100.00
组合计提坏账准备	23,562,301.71	84.10	4,268,765.23	18.12
合计	28,017,413.24	100.00	8,723,876.76	31.14

项目	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	3,273,770.50	5.95	3,273,770.50	100.00
组合计提坏账准备	51,787,297.13	94.05	4,447,557.27	8.59
合计	55,061,067.63	100.00	7,721,327.77	14.02

于2020年12月31日,其他应收款账面净额中金额较大的前五单位名称、净额及款项性质如下:

单位名称	账面净额	账龄	占其他应收款 净额的比例 (%)	款项性质
上海陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司	1,836,039.12	部分3年以上	9.52	房屋租赁保证金
鼎和财产保险股份有限公司	1,435,727.83	2-3年	7.44	房屋租赁保证金
陈宁	1,105,856.64	部分3年以上	5.73	房屋租赁保证金
北京鑫景通达置业有限公司	417,331.97	3年以上	2.16	房屋租赁保证金
慈溪市新城河建设投资投资有限公司	792,000.00	1年以内	4.11	履约保证金
合计	5,586,955.56		28.96	

年末其他应收款中无持有本公司5%以上(含5%)股份的股东单位欠款情况。

### (3) 长期待摊费用

项目	取得方式	年初余额	本年增加	本年减少		年末余额
				本年摊销	其他减少	
装修费	购入	18,242,641.45	4,497,780.03	6,885,279.18		15,855,142.30
网络工程	购入	1,394,050.20	336,426.78	596,176.96		1,134,300.02
办公家具	购入	1,179,220.31	686,201.30	668,211.23		1,197,210.38
水电增容	购入	56,504.00	1,500.00	30,161.14		27,842.86
消防工程	购入	473,237.84	241,123.40	202,328.26		512,032.98
合计		21,345,653.80	5,763,031.51	8,382,156.77		18,726,528.54

**4、利息净收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	2,271,215,497.31	2,142,355,407.87
融资融券利息收入	951,669,551.24	676,870,061.17
存放金融同业利息收入	510,268,089.90	376,899,322.31
买入返售金融资产利息收入	494,827,361.04	700,001,471.79
其中：约定购回利息收入	70,192.55	4,747,178.45
股权质押回购利息收入	483,786,454.89	634,680,384.75
其他债权投资利息收入	314,450,495.13	388,584,552.60
利息支出	1,815,383,862.65	1,944,995,418.39
应付债券利息支出	1,204,537,648.60	1,306,351,580.08
其中：次级债券利息支出	416,499,393.38	587,771,401.63
卖出回购金融资产利息支出	274,346,799.38	271,273,790.33
应付短期融资款利息支出	173,852,593.93	265,645,213.22
代理买卖证券款利息支出	78,025,652.79	61,010,349.54
拆入资金利息支出	83,496,126.67	39,154,594.39
其中：转融通利息支出	49,658,868.78	
短期借款利息支出	1,125,041.28	1,559,890.83
利息净收入	455,831,634.66	197,359,989.48

**5、手续费及佣金净收入****(1). 手续费及佣金净收入情况**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	1,363,145,157.96	964,910,830.32
证券经纪业务收入	1,855,240,791.72	1,359,873,625.18
其中：代理买卖证券业务	1,566,916,244.26	1,188,709,578.12
交易单元席位租赁	252,315,565.74	160,576,331.38
代销金融产品业务	36,008,981.72	10,587,715.68
证券经纪业务支出	492,095,633.76	394,962,794.86
其中：代理买卖证券业务	492,095,633.76	394,962,794.86
2. 期货经纪业务净收入		
期货经纪业务收入		
期货经纪业务支出		
3. 投资银行业务净收入	1,086,118,955.35	625,083,630.67
投资银行业务收入	1,091,929,615.75	628,252,309.91
其中：证券承销业务	878,366,290.82	446,562,449.25
证券保荐业务	50,122,641.50	17,811,320.75
财务顾问业务	163,440,683.43	163,878,539.91
投资银行业务支出	5,810,660.40	3,168,679.24



其中：证券承销业务	5,810,660.40	3,168,679.24
4. 资产管理业务净收入	75,918,595.12	102,035,447.81
资产管理业务收入	81,385,893.90	108,335,426.52
资产管理业务支出	5,467,298.78	6,299,978.71
5. 基金管理业务净收入		
基金管理业务收入		
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	25,819,796.53	6,544,583.36
投资咨询业务收入	25,819,796.53	6,544,583.36
7. 其他手续费及佣金净收入	9,507,942.58	11,146,018.69
其他手续费及佣金收入	14,682,869.87	13,856,263.42
其他手续费及佣金支出	5,174,927.29	2,710,244.73
合计	2,560,510,447.54	1,709,720,510.85
其中：手续费及佣金收入	3,069,058,967.77	2,116,862,208.39
手续费及佣金支出	508,548,520.23	407,141,697.54

## (2). 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	28,783,018.86	29,981,698.11
其他财务顾问业务净收入	134,657,664.57	133,896,841.80

## 6、投资收益

## (1). 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益	310,644,000.00	55,946,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	88,329,687.67	62,318,853.59
金融工具投资收益	1,282,980,889.36	1,058,027,370.64
其中：持有期间取得的收益	974,616,369.80	1,088,633,140.85
— 交易性金融工具	848,067,982.66	830,451,245.77
— 其他权益工具投资	126,548,387.14	258,181,895.08
处置金融工具取得的收益	308,364,519.56	-30,605,770.21
— 衍生金融工具	-54,077,790.97	-41,986,357.83
— 交易性金融工具	353,446,082.36	-10,470,111.93
— 其他债权投资	8,996,228.17	21,850,699.55
合计	1,681,954,577.03	1,176,292,224.23

本公司投资收益汇回无重大限制情况。

## (2). 交易性金融工具投资收益明细表

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

交易性金融工具	本期发生额	上期发生额
---------	-------	-------

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	848,148,580.71	832,822,235.61
	处置取得收益	353,260,393.68	-2,320,312.00
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	-80,598.05	-2,370,989.84
	处置取得收益	185,688.68	-8,149,799.93

## 7、公允价值变动收益

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	7,310,859.71	157,739,873.54
交易性金融负债	-560,714.00	16,069,604.92
衍生金融工具	-9,780,180.47	2,164,126.54
合计	-3,030,034.76	175,973,605.00

## 8、现金流量表补充资料

(1) 将净利润调节为经营活动现金流量

	2020 年度	2019 年度
净利润	1,523,942,876.15	1,061,080,300.90
加：信用减值损失	576,949,021.37	108,942,017.10
固定资产折旧	58,170,140.84	59,957,426.09
无形资产摊销	41,005,217.85	38,248,350.37
长期待摊费用摊销	8,382,156.77	9,470,471.65
处置报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	2,344,009.33	288,378.83
公允价值变动收益	-8,460,051.84	-179,988,435.00
净利息支出	1,065,064,788.68	1,184,972,131.53
投资收益	-534,518,302.98	-398,297,448.22
递延所得税	-211,487,965.12	-10,494,540.46
经营性应收项目的减少/（增加）	-6,033,852,605.41	-9,996,439,820.31
经营性应付项目的增加	1,528,610,925.64	9,054,393,219.14
汇兑损益	12,176,924.76	-3,536,579.28
经营活动（使用）/产生的现金流量净额	-1,971,672,863.96	928,595,472.34

(2) 现金及现金等价物净变动情况

	2020 年度	2019 年度
现金的年末余额	20,753,602,813.88	17,735,736,367.79
减：现金的年初余额	17,735,736,367.79	13,664,355,321.59
现金及现金等价物净增加额	3,017,866,446.09	4,071,381,046.20

(3) 现金及现金等价物的构成

项目	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
一、现金	20,753,602,813.88	17,735,736,367.79
其中：库存现金	66,488.61	130,722.68
可随时用于支付的银行存款	16,535,895,177.98	14,230,377,031.81
可随时用于支付的其他货币资金	33,751.34	85,816,290.26
结算备付金	4,217,607,395.95	3,419,412,323.04
二、现金等价物		
三、年末现金及现金等价物余额	20,753,602,813.88	17,735,736,367.79

## 附注 16、补充资料

### 1、当期非经常性损益明细表

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-3,569,948.71	
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	25,467,571.65	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-26,249,358.81	
其他符合非经常性损益定义的损益项目	11,315,257.31	
所得税影响额	-1,543,310.68	
少数股东权益影响额	-1,268,429.42	
合计	4,151,781.34	

本集团对非经常性损益项目的确认依照中国证券监督管理委员会《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》(公告[2008]43 号)的规定执行。

本集团持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及衍生金融工具等，这些金融工具产生的公允价值变动损益，持有期间获得的投资收益以及处置取得的投资收益乃本集团正常经营业务，因此不作为非经常性损益项目。

### 2、净资产收益率及每股收益

√适用 □不适用

报告期利润	加权平均净资产收益率 (%)	每股收益	
		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	6.61	0.46	0.46
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	6.59	0.46	0.46

## 第十二节 备查文件目录

备查文件目录	载有法定代表人签名的年度报告文本。
备查文件目录	载有法定代表人、主管会计机构负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报告原文。
备查文件目录	其他有关资料。

董事长：范力

董事会批准报送日期：2021 年 4 月 30 日

### 修订信息

适用 不适用

## 第十三节 证券公司信息披露

### 一、 公司重大行政许可事项的相关情况

适用 不适用

### 二、 监管部门对公司的分类结果

适用 不适用

公司 2018-2020 年分类评价结果均为 A 类 A 级。

附件：

## 公司证券营业部及期货营业部情况表

截至目前，公司共有证券营业部 130 家，具体情况见下表：

序号	名称	地区	负责人
1	常熟商城中路证券营业部	江苏省	柳凯
2	常熟碧溪新区证券营业部		宗玲芳
3	常熟阜湖路证券营业部		张文华
4	常熟海虞镇证券营业部		顾艳
5	常熟梅李镇证券营业部		马威
6	常州常武中路证券营业部		尤思静
7	常州通江中路证券营业部		戴震凯
8	丹阳华南路证券营业部		倪忠辉
9	淮安淮海南路证券营业部		赵红娟
10	江阴滨江东路证券营业部		吕鸿签
11	江阴绮山路证券营业部		蒋荣
12	姜堰人民中路证券营业部		赵非
13	昆山花桥证券营业部		莫雪岗
14	昆山环城北路证券营业部		鲍蓓蓓
15	昆山陆家镇童泾路证券营业部		陆锡蕃
16	昆山千灯证券营业部		徐仁森
17	昆山前进中路证券营业部		王伟明
18	昆山张浦证券营业部		张勇
19	昆山周市镇萧林东路证券营业部		王向阳
20	南京江东北路证券营业部		卞爱亮
21	南京国睿大厦证券营业部		李斌
22	南通南大街证券营业部		陆磊
23	苏州滨河路证券营业部		王博
24	苏州东吴南路证券营业部		濮兆炜

25	苏州干将东路证券营业部	李庆宇
26	苏州工业园区东沙湖路证券营业部	朱淳亚
27	苏州工业园区敦煌路证券营业部	孙禹言
28	苏州工业园区九华路证券营业部	李明悦
29	苏州工业园区仁爱路证券营业部	吴峰
30	苏州工业园区胜浦证券营业部	顾志敏
31	苏州工业园区唯华路证券营业部	王校
32	苏州工业园区现代大道证券营业部	景振新
33	苏州虎丘区科技城证券营业部	张吴月
34	苏州浒关镇文昌路证券营业部	戴云晟
35	苏州浒关镇证券营业部	陆冰
36	苏州角直迎宾路证券营业部	宗军荣
37	苏州狮山路证券营业部	顾文博
38	苏州石路证券营业部	倪伟
39	苏州通园路证券营业部	王莉
40	苏州吴中区东安路证券营业部	顾希
41	苏州吴中区木渎镇证券营业部	郭家安
42	苏州西北街证券营业部	杨东栋
43	苏州溪翔路证券营业部	李浩然
44	苏州县前街证券营业部	朱亮
45	苏州相城采莲路证券营业部	王南雁
46	苏州相城区青龙港路证券营业部	彭小文
47	苏州相城黄埭中市路证券营业部	严奕
48	苏州相城大道证券营业部	滕亮华
49	苏州小石湖路证券营业部	施伟
50	苏州星湖街证券营业部	朱飏
51	苏州工业园区苏州大道东证券营业部	周金根
52	苏州胥口孙武路证券营业部	张志超

53	苏州长江路证券营业部	秦义
54	苏州竹辉路证券营业部	朱靓
55	苏州姑苏区胥江路证券营业部	潘成丰
56	苏州吴江区中山北路证券营业部	施炯
57	太仓港经济技术开发区浮桥证券营业部	陆红益
58	太仓浏河镇证券营业部	戴伟
59	太仓人民南路证券营业部	赵洪
60	太仓沙溪镇白云中路证券营业部	顾卫东
61	太仓上海东路证券营业部	林玲
62	泰州海陵南路证券营业部	秦国军
63	无锡新华路证券营业部	郁天宇
64	无锡东亭中路证券营业部	吴松鹤
65	无锡和风路证券营业部	何江萍
66	吴江汾湖证券营业部	陈健
67	吴江平望证券营业部	卢建明
68	吴江七都证券营业部	倪春华
69	吴江盛泽镇强武路证券营业部	俞晓艳
70	吴江盛泽镇西环路证券营业部	王琪
71	吴江震泽证券营业部	庄胜祥
72	吴江体育路证券营业部	顾雁飞
73	徐州软件园证券营业部	赵艳
74	盐城人民南路证券营业部	陈喆
75	扬中明珠大道证券营业部	王振中
76	扬州扬子江中路证券营业部	王红叶
77	仪征工农北路证券营业部	沈勇
78	宜兴阳羨东路证券营业部	吴小芳
79	张家港金港镇证券营业部	陈挺
80	张家港锦丰镇证券营业部	周晓兰

81	张家港杨舍证券营业部		郭志荣
82	镇江解放路证券营业部		王永兴
83	北京安定路证券营业部	北京市	藏佳楠
84	北京市陶然桥证券营业部		沈威
85	上海奉贤程普路证券营业部	上海市	郭力
86	上海西藏南路证券营业部		印磊
87	上海新闻路证券营业部		李静芸
88	上海浦东新区杨高南路证券营业部		赵骆强
89	天津华坪路证券营业部	天津市	孙宇
90	重庆聚贤岩广场证券营业部	重庆市	李宏
91	海宁海州西路证券营业部	浙江省	徐伟
92	杭州文晖路证券营业部		王月平
93	杭州金城路证券营业部		王勛骅
94	嘉善体育南路证券营业部		潘魏
95	嘉善西塘镇证券营业部		杨浩
96	嘉兴纺工路证券营业部		费娟芳
97	宁波前河南路证券营业部		王锐
98	宁波江东北路证券营业部		刘云斌
99	慈溪寺山路证券营业部		吕洁
100	平湖三港路证券营业部		许琳怡
101	绍兴金柯桥大道证券营业部		孙志远
102	绍兴胜利东路证券营业部		杨水军
103	台州云西路证券营业部		江志林
104	桐乡世纪大道证券营业部		顾建嘉
105	温州江滨西路证券营业部		叶海丹
106	新昌鼓山西路证券营业部		王德中
107	义乌义东路证券营业部		王沈洁
108	合肥黄山路证券营业部	安徽省	锁永军



109	福州五一北路证券营业部	福建省	宁文宾
110	泉州宝洲路证券营业部		丘志强
111	厦门厦禾路证券营业部		曾晓馥
112	东莞大朗证券营业部	广东省	刘铮
113	东莞鸿福路证券营业部		江楠
114	深圳龟山路证券营业部		李洪全
115	铜仁东太大道证券营业部	贵州省	黄承颐
116	海口丽晶路证券营业部	海南省	段万强
117	三亚凤凰路证券营业部		吴俊
118	石家庄裕华东路证券营业部	河北省	郑世栋
119	郑州花园路证券营业部		吴昊
120	哈尔滨创新路证券营业部	黑龙江省	杨宇峰
121	武汉新华路证券营业部	湖北省	张丽
122	长沙人民中路证券营业部	湖南省	王海宇
123	大连五一广场证券营业部	辽宁省	金伟
124	沈阳滂江街证券营业部		吴曙光
125	营口渤海大街证券营业部		王利明
126	济南明湖东路证券营业部	山东省	郝红
127	成都锦城大道证券营业部	四川省	赵洪平
128	大理振兴街证券营业部	云南省	张晓宇
129	昆明春城路证券营业部		肖鹏程
130	瑞丽人民路证券营业部		熊辉

截至目前，东吴期货有 16 家营业部和 3 家分公司，具体情况见下表：

序号	名称	地址	负责人
1	苏州营业部	苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦 7 楼 701、717 室	孙东亮
2	吴江营业部	吴江市松陵镇中山南路 1729 号上领大厦 907、908 室	宋锐
3	苏州市狮山路营业部	江苏省苏州市三香路 1338 号铂金大厦 1209 室	陶键陈
4	苏州市昆山营业部	昆山市玉山镇人民北路 1 号 4 楼(215300)	曾朝虎

5	上海世纪大道营业部	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 13 楼 7-8 室	王琦
6	上海浦东分公司	中国（上海）自由贸易试验区向城路 288 号、世纪大道 1501 号 1002A 室	包正
7	苏州市常熟营业部	常熟市海虞北路 45 号世界贸易中心 B702 室、B705 室、B724 室	张秋石
8	张家港营业部	张家港市杨舍镇河东路 1 号五楼	庞承
9	沈阳营业部	辽宁省沈阳市浑南区天成街 6-2 号（902）（110179）	金辉
10	上海牡丹江路营业部	上海宝山区牡丹江路 1211 号 309 室、310 室	郝梅萍
11	苏州市太仓营业部	江苏省太仓市上海东路 6 号一楼西区	陈钢
12	江阴营业部	江阴市长江路 218 号名都国际大厦 401 室	谭文杰
13	杭州营业部	浙江省杭州市江干区尊宝大厦银尊 1905 室、1906 室	徐图
14	泉州营业部	福建省泉州市丰泽区宝洲路万达广场写字楼 B 座 3601A	潘宏辉
15	北京营业部	北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼 17C4	张宏杰
16	河南分公司	郑州市金水区未来路 69 号未来大厦 1907 房间	张华
17	宁波营业部	浙江省宁波市鄞州区中河街道鄞县大道东段 1288 号 1711 室	王亮
18	广州分公司	广州市越秀区中山三路 33 号 B 塔 5807、5808 房（自编）“中华国际中心” B 塔 58 楼 5808 单元	梁智欣
19	常州营业部	江苏省常州市新北区通江中路 266 号 2105 室、2107 室	徐志伟

## 公司主要单项业务资格

(1) 2001 年 5 月 6 日, 中国证监会出具“证监信息字[2001]5 号”《关于兴业证券股份有限公司等十家证券公司网上证券委托业务资格的批复》, 核准公司开展网上证券委托业务资格。

(2) 2001 年 8 月 5 日, 中国证监会出具“证监机构字[2001]134 号”《关于苏州证券有限责任公司经营外资股业务资格的批复》, 核准公司从事外资股经纪业务的资格。

(3) 2002 年 8 月 1 日, 中国证监会出具“证监机构字[2002]231 号”《关于东吴证券有限责任公司股票主承销商资格的批复》, 核准公司的股票主承销商资格。

(4) 2002 年 8 月 13 日, 中国证监会出具“证监机构字[2002]244 号”《关于核准东吴证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》, 核准公司从事受托投资管理业务的资格。

(5) 2002 年 12 月 2 日, 中国国债协会出具“财债协[2002]35 号”《关于批准成为中国国债协会会员的通知》, 批准公司成为中国国债协会会员。

(6) 2003 年 4 月 1 日, 中国人民银行出具“银复[2003]68 号”《中国人民银行关于东吴证券股份有限公司等 7 家证券公司成为全国银行间同业拆借市场成员的批复》, 批准公司成为全国银行间同业拆借市场成员, 从事同业拆借业务。

(7) 2003 年 12 月 12 日, 中国证监会出具“证监基金字[2003]141 号”《关于东吴证券有限责任公司开放式证券投资基金代销业务资格的批复》, 核准公司开办开放式证券投资基金代销业务资格。

(8) 2004 年 11 月 25 日, 上海证券交易所出具“上证会字[2004]44 号”《关于上海证券交易所国债买断式回购交易参与主体认定的通知》, 批准公司为上海证券交易所国债买断式回购交易参与主体。

(9) 2005 年 5 月 26 日, 中国证监会出具“机构部部函[2005]208 号”《关于同意东吴证券有限责任公司申请企业年金基金投资管理人资格的函》, 核准公司企业年金基金投资管理人资格。

(10) 2008 年 7 月 10 日, 中国证监会出具“证监许可[2008]909 号”《关于核准东吴证券有限责任公司为期货公司提供中间介绍业务资格的批复》, 核准公司为东吴期货提供中间介绍业务的资格。

(11) 2009 年 3 月 9 日, 中国证券业协会出具“中证协函[2009]78 号”《关于授予从事代办股份转让主办券商业务资格的函》, 中国证券业协会授予公司从事代办股份转让主办券商业务资格。

(12) 2009 年 3 月 9 日, 中国证券业协会出具“中证协函[2009]79 号”《关于授予东吴证券

有限责任公司报价转让业务资格的函》，授予公司报价转让业务资格。

(13) 2009年9月9日，中国证监会出具“机构部部函[2009]416号”《关于对东吴证券有限责任公司开展直接投资业务试点的无异议函》，核准公司设立全资子公司东吴投资有限公司，开展直接投资业务试点。

(14) 2010年5月28日，江苏证监局批准公司自营业务参与股指期货交易。

(15) 2012年4月26日，中国证监会出具“机构部部函[2012]206号”《关于东吴证券股份有限公司从事债券质押式报价回购业务试点方案的无异议函》，核准公司开展债券质押式报价回购业务试点。

(16) 2012年4月27日，中国证监会出具“证监许可[2012]604号”《关于核准东吴证券股份有限公司融资融券业务资格的批复》，核准公司开展融资融券业务。

(17) 2012年5月17日，中国证监会出具“证监许可[2012]63号”《关于东吴证券股份有限公司开展债券质押式报价回购业务试点相关事项的通知》，公司获准开展债券质押式报价回购业务。

(18) 2012年6月11日，中国证券业协会出具“中证协函[2012]373号”《关于反馈证券公司中小企业私募债券承销业务试点实施方案专业评价结果的函》，通过了公司的中小企业私募债券承销业务试点资格。

(19) 2012年7月6日，江苏省证监局出具“苏证监机构函[2012]293号”《关于东吴证券资产管理业务参与股指期货交易的备案函》，批准公司资产管理业务参与股指期货交易资格。

(20) 2012年9月6日，国家外汇管理局颁发“外汇字第SC201219号”《证券业务外汇经营许可证》，公司根据国家外汇管理局的规定每年报送书面报告。

(21) 2012年9月19日，中国保险监督管理委员会出具“资金部函[2012]20号”《关于向保险机构投资者提供综合服务的评估函》，批准公司向保险机构投资者提供交易单元。

(22) 2012年9月27日，上海证券交易所出具“上证会字[2012]191号”《关于确认东吴证券股份有限公司约定购回式证券交易权限的通知》，公司获准开展约定购回式证券交易业务。

(23) 2012年11月8日，中国证券金融股份有限公司出具“中证金函[2012]154号”《关于申请参与转融通业务的复函》，批准公司参与转融通业务。

(24) 2013年1月12日，深圳证券交易所出具“深证会[2013]15号”《关于约定购回式证券交易权限开通的通知》，批准公司开展约定购回式证券交易业务。

(25) 2013年1月28日，江苏证监局出具“苏证监机构字[2013]37号”《关于核准东吴证券股份有限公司代销金融产品业务资格的批复》，核准公司开展代销金融产品业务。

(26) 2013年7月1日，上海证券交易所出具的“上证会字[2013]73号”《关于确认东吴证

券股份有限公司股票质押式回购业务交易权限的通知》，核准公司开展股票质押式回购业务。

(27) 2013 年 11 月 8 日，公司提交《投资管理人受托管理保险资金报告材料》取得中国保险监督管理委员会备案通知，可以开展受托管理保险资金业务。

(28) 2014 年 2 月 14 日，中国证券登记结算有限责任公司以《代理证券质押登记业务资格确认函》，批准公司代理证券质押登记业务资格。

(29) 2014 年 6 月 24 日，全国中小企业股份转让系统有限责任公司出具“股转系统函[2014]727 号”《主办券商业务备案函》，核准公司全国中小企业股份转让系统做市商资格。

(30) 2014 年 10 月 10 日，上海证券交易所出具的“上证函[2014]599 号”《关于同意开通东吴证券股份有限公司港股通业务交易权限的通知》，同意开通公司 A 股交易单元的港通业务交易权限。

(31) 2014 年 11 月 24 日，中国证券投资者保护基金公司出具的“证保函[2014]277 号”《关于东吴证券股份有限公司开展私募基金综合托管业务的无异议函》，批准公司开展私募基金综合托管业务。

(32) 2014 年 12 月 16 日，中国证券业协会出具的“中证协函[2014]776 号”《关于同意开展柜台市场试点的函》，同意公司开展柜台市场试点。

(33) 2015 年 1 月 23 日，上海证券交易所出具“上证函[2015]135 号”《关于东吴证券股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知》，核准公司开通股票期权经纪业务权限。

(34) 2015 年 1 月 28 日，上海证券交易所出具“上证函[2015]197 号”《关于开通股票期权自营交易权限的通知》，同意开通公司股票期权自营业务交易权限。

(35) 2015 年 3 月 3 日，中国证券业协会出具“中证协函[2015]115 号”《关于同意开展互联网证券业务试点的函》，同意公司开展互联网证券业务试点。

(36) 2015 年 6 月 1 日，中国证券登记结算有限责任公司出具“中国结算办字[2015]451 号”《关于东吴证券单向视频开户创新方案的无异议函》，同意公司试点使用单向视频方式验证投资者身份。

(37) 2015 年 6 月 1 日，中国证券登记结算有限责任公司出具“中国结算办字[2015]457 号”《关于东吴证券 H5 引流开户方案的无异议函》，同意公司试点实施引流开户方案。

(38) 2016 年 11 月 3 日，深圳证券交易所出具“深证会[2016]326 号”《关于同意开通国信证券等会员单位深港通下港股通业务交易权限的通知》，同意开通公司相关交易单元的深港通下港股通业务交易权限。

(39) 2018 年 7 月 31 日，中国证券业协会出具的“中证协函 2018[389]号”《关于同意场外

期权业务二级交易商备案的函》，同意公司备案为场外期权业务二级交易商。

(40) 2019年2月28日，中国证监会出具“机构部函[2019]465号”《关于东吴证券申请信用衍生品业务的监管意见书》，同意公司开展银行间市场信用风险缓释工具、交易所市场信用风险缓释工具以及监管认可的其他信用衍生品卖出业务。

(41) 2021年3月23日，深圳证券交易所出具《关于同意东吴证券开展上市公司股权激励行权融资业务试点的函》（深证函〔2021〕210号），同意公司开展上市公司股权激励行权融资业务试点。

(42) 公司现持有中国证监会于2017年11月15日下发的《经营证券期货业务许可证》，统一社会信用代码为：91320000137720519P。

公司还具备上海证券交易所会员资格、深圳证券交易所会员资格、中国国债协会会员资格、中国证券业协会会员资格、江苏省证券业协会会员资格，中国证券登记结算有限责任公司结算参与人资格、中国证券投资基金业协会会员资格。

## 2、子公司拥有的业务资格和业务许可

### (1) 东吴期货

1) 2007年11月2日，中国证监会出具“证监期货字[2007]252号”《关于核准东吴期货有限公司金融期货经纪业务资格的批复》，核准东吴期货金融期货经纪业务资格，经营范围变更为：商品期货经纪、金融期货经纪。

2) 2007年11月2日，中国证监会出具“证监期货字[2007]253号”《关于核准东吴期货有限公司金融期货交易结算业务资格的批复》，核准东吴期货金融期货交易结算业务资格。

3) 2011年9月14日，中国证监会出具“证监许可[2011]1446号”《关于核准东吴期货有限公司期货投资咨询业务资格的批复》，核准东吴期货期货投资咨询业务资格，经营范围变更为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询。

4) 2015年1月16日，中国期货业协会出具“中期协备字[2015]20号”《关于东吴期货有限公司资产管理业务予以登记的通知》，对东吴期货资产管理业务予以登记。

5) 2015年3月9日，中国期货业协会出具“中期协备字[2015]64号”《关于东吴期货有限公司设立风险管理公司予以备案的通知》，对东吴期货关于设立风险管理公司开展以风险管理服务为主的业务试点予以备案。

6) 2016年1月14日，中国证监会核发东吴期货《经营证券期货业务许可证》，统一社会信用代码为913100001321138080，载明证券期货业务范围为商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询，资产管理。

## (2) 东吴基金

1) 2011年12月27日,中国证监会出具“证监许可[2011]2110号”《关于核准东吴基金管理有限公司从事特定客户资产管理业务的批复》,核准东吴基金从事特定资产管理业务。

2) 2017年5月16日,中国证监会核发东吴基金《经营证券期货业务许可证》,统一社会信用代码为913100007664967591,证券期货业务范围为公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。

## (3) 新东吴优胜

1) 2018年1月29日,中国证监会核发新东吴优胜《经营证券期货业务许可证》,统一社会信用代码为:91310101062563511R,证券期货业务范围为特定客户资产管理。

## (4) 东吴新加坡

1) 2016年1月27日,新加坡金融监管局(MAS)核发东吴新加坡《资本市场服务(CMS)许可》,许可东吴新加坡依法经营基金管理。2018年3月16日,东吴新加坡成为控股公司,由子公司东吴中新资产管理(亚洲)有限开展基金管理业务。

2) 2016年10月27日,中国证监会核发东吴新加坡《经营证券期货业务许可证》,统一社会信用代码(境外机构编号)为RQF2016SGF192,证券期货业务范围为境内证券投资。2018年12月3日,该资格由子公司东吴中新资产管理(亚洲)有限公司承继。

## (5) 上海东吴玖盈投资管理有限公司

1) 2015年3月9日,中国期货业协会出具“中期协备字[2015]66号”《关于上海东吴玖盈投资管理有限公司试点业务予以备案的通知》,对上海东吴玖盈投资管理有限公司试点业务予以备案。备案试点业务为仓单服务、基差交易、合作套保、定价服务。

2) 2018年2月1日,中国期货业协会出具“中期协备字[2018]8号”《关于上海东吴玖盈投资管理有限公司试点业务予以备案的通知》,对上海东吴玖盈投资管理有限公司做市业务试点业务予以备案。

## (6) 东吴中新资本(亚洲)有限公司

2018年2月23日,新加坡金融管理局(MAS)核发东吴中新资本(亚洲)有限公司CMS100678号《资本市场服务(CMS)许可证》,许可东吴中新资本(亚洲)有限公司依证券期货法(SFA)从事证券交易和公司金融咨询业务。2018年10月8日,许可范围更新为企业融资顾问业务和资本市场产品交易。

## (7) 东吴中新资产管理(亚洲)有限公司

1) 2018 年 2 月 23 日, 新加坡金融管理局 (MAS) 核发东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司 CMS100679 号《资本市场服务 (CMS) 许可证》, 许可东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司依证券期货法 (SFA) 从事基金管理业务。2018 年 10 月 8 日, 许可范围更新为基金管理业务和资本市场产品交易。

2) 2018 年 3 月 16 日, 东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司承继母公司东吴新加坡基金管理业务资格。

3) 2018 年 12 月 3 日, 中国证监会出具“证监许可[2018]2005 号”《关于核准东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司人民币合格境外机构投资者资格的批复》, 核准东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司承继母公司东吴新加坡境内证券投资业务资格。

4) 2019 年 5 月 23 日, 国家外汇管理局出具“汇复[2019]11 号”《国家外汇管理局关于东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司承继东吴证券中新 (新加坡) 有限公司 RQFII 投资额度的批复》, 批准东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司承继母公司东吴新加坡已获批的 RQFII 投资额度, RQFII 投资额度为 15 亿元人民币。

5) 2019 年 6 月 11 日, 中国证监会核发东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司《经营证券期货业务许可证》, 统一社会信用代码 (境外机构编号) 为 RQF2018SGF222, 证券期货业务范围为境内证券投资。

#### **(8) 东吴香港**

1) 2020 年 5 月 19 日, 中国证监会核发东吴证券 (国际) 金融控股有限公司《经营证券期货业务许可证》, 统一社会信用代码 (境外机构编号) 为 RQF2013HKS014, 证券期货业务范围为境内证券投资。

2) 2020 年 3 月 23 日, 香港证监会核发东吴证券国际期货有限公司第 2 类及第 5 类牌照, 中央编码为: AZQ989, 允许进行期货合约交易及就期货合约提供意见。

3) 2020 年 3 月 23 日, 香港证监会核发东吴证券国际经纪有限公司第 1 类及第 4 类牌照, 中央编码为: AYA587, 允许进行证券交易及就证券提供意见。

4) 2020 年 3 月 19 日, 香港证监会核发东吴证券国际资产管理有限公司第 4 类及第 9 类牌照, 中央编码为: AYA628, 允许提供资产管理及就证券提供意见。

5) 2020 年 3 月 19 日, 香港证监会核发东吴证券国际融资有限公司第 6 类牌照, 中央编码为: BBG379, 允许就机构融资提供意见。