

公司代码：601162

公司简称：天风证券

天风证券股份有限公司

2021 年半年度报告

重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人余磊、主管会计工作负责人王琳晶及会计机构负责人(会计主管人员)许欣声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司2021年半年度拟以实施权益分派股权登记日登记的总股本为基数分配利润，向全体股东每10股派发现金红利0.05元（含税）。截至2021年6月30日，公司总股本8,665,757,464股，以此计算合计拟派发现金红利43,328,787.32元（含税）。本预案尚需提交公司股东大会审议。

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、发展战略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半年度报告内容的真实性、准确性和完整性

否

十、重大风险提示

公司已在本报告中详细披露存在的风险，敬请查阅本报告“第三节 管理层讨论与分析——五、其他披露事项——（一）可能面对的风险”。

十一、其他

适用 不适用

目录

第一节	释义	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	管理层讨论与分析.....	13
第四节	公司治理.....	25
第五节	环境与社会责任.....	28
第六节	重要事项.....	31
第七节	股份变动及股东情况.....	42
第八节	优先股相关情况.....	50
第九节	债券相关情况.....	51
第十节	财务报告.....	57
第十一节	证券公司信息披露.....	181

备查文件目录	载有法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的会计报表 报告期内在中国证监会指定报刊上公开披露过的公司文件正本及公告的原稿
--------	--

第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
天风证券/天风/本公司/公司/母公司	指	天风证券股份有限公司
审计机构/大信	指	大信会计师事务所（特殊普通合伙）
元	指	人民币元，文中另指除外
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
湖北证监局	指	中国证券监督管理委员会湖北监管局
商贸集团	指	武汉商贸集团有限公司（曾用名“武汉国有资产经营有限公司”）
人福医药	指	人福医药集团股份公司（曾用名“武汉人福高科技产业股份有限公司”）
湖北省联发	指	湖北省联合发展投资集团有限公司
陕西大德	指	陕西大德投资集团有限责任公司
宁波信达	指	宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）
中航信托	指	中航信托股份有限公司
苏州建丰	指	苏州建丰投资中心（有限合伙）
当代科技	指	武汉当代科技产业集团股份有限公司
上海天阖	指	上海天阖投资合伙企业（有限合伙）
当代文体	指	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司（曾用名“武汉道博股份有限公司”“武汉当代明诚文化股份有限公司”）
三特索道	指	武汉三特索道集团股份有限公司
宜宾商行	指	宜宾市商业银行股份有限公司
天风天睿	指	天风证券股份有限公司控股子公司，天风天睿投资股份有限公司
天风期货	指	天风证券股份有限公司控股子公司，天风期货有限公司，2015年5月股份制改制后更名为天风期货股份有限公司
天风创新	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风创新投资有限公司
天风国际	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风国际证券集团有限公司（TFInternationalSecuritiesGroupLimited）
天风资管	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风（上海）证券资产管理有限公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》	指	《天风证券股份有限公司章程》
《股东大会议事规则》	指	《天风证券股份有限公司股东大会议事规则》
报告期	指	2021年1月1日-2021年6月30日
报告期末	指	2021年6月30日

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	天风证券股份有限公司
公司的中文简称	天风证券
公司的外文名称	TIANFENGSECURITIESCO., LTD
公司的外文名称缩写	TFSECURITIES
公司的法定代表人	余磊
公司总经理	王琳晶

注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	8,665,757,464.00	6,665,967,280.00
净资产	17,218,687,508.07	9,840,771,799.18

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

1、经中国证券监督管理委员会、中国证券监督管理委员会湖北监管局核准或认可的业务资格：债券质押式报价回购业务试点、同意实施证券经纪人制度、开展集合资产管理电子签名合同试点、开展客户资金第三方存管单客户多存管业务函、参与股指期货业务（自营业务）、参与股指期货业务（资产管理业务）、见证开户业务、参与国债期货业务、自营业务参与利率互换交易、国债期货做市业务。

2、经中国银行保险监督管理委员会核准或认可的业务资格：受托管理保险资金业务资格。

3、经深圳证券交易所核准或认可的业务资格：约定购回式证券交易权限、股票质押式回购交易权限、深港通下港股通业务交易权限资格、上市公司股权激励行权融资业务、股票期权业务交易权限。

4、经上海证券交易所核准或认可的业务资格：固定收益证券综合电子平台交易商资格、债券质押式报价回购业务试点、约定购回式证券交易权限、债券质押式报价回购交易权限、股票质押式回购交易权限、转融通证券出借交易权限、港股通业务交易权限、上海证券交易所股票期权交易参与人。

5、经中国人民银行上海总部核准或认可的业务资格：进入全国银行间同业拆借市场。

6、经国家外汇管理局核准或认可的业务资格：经营外汇业务许可证。

7、经中国证券业协会核准或认可的业务资格：证券公司中小企业私募债券承销业务试点、场外期权业务交易商、收益互换业务。

8、经全国中小企业股份转让系统核准或认可的业务资格：推荐业务及经纪业务、做市业务资格。

- 9、经全国银行间同业拆借中心核准或认可的业务资格：银行间债券市场尝试做市业务权限。
- 10、经中国证券登记结算有限责任公司核准或认可的业务资格：代理证券质押登记业务资格。
- 11、经中国证券投资者保护基金公司核准或认可的业务资格：开展私募基金综合托管业务。
- 12、经中国证券金融股份有限公司核准或认可的业务资格：转融通业务。
- 13、经上海票据交易所核准或认可的业务资格：接入中国票据交易系统、（存托）接入中国票据交易系统。
- 14、经中国外汇交易中心核准或认可的业务资格：债券通业务报价资格。
- 15、经香港证券及期货事务监察委员会（SFC）核准或认可的业务资格：第1类（证券交易）业务、第2类（期货合约交易）业务、第4类（就证券提供意见）业务、第5类（就期货合约提供意见）业务、附条件的第6类（就机构融资提供意见）业务、第9类（提供资产管理）业务。

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	诸培宁	诸培宁
联系地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
电话	027-87618867	027-87618867
传真	027-87618863	027-87618863
电子信箱	dongban@tfzq.com	dongban@tfzq.com

三、基本情况变更简介

公司注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
公司注册地址的历史变更情况	2008年2月，经中国证监会和武汉市工商局批准，公司注册地由四川省成都市变更至湖北省武汉市。
公司办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
公司办公地址的邮政编码	430000
公司网址	www.tfzq.com
电子信箱	dongban@tfzq.com
报告期内变更情况查询索引	报告期内未发生变更

四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的网站地址	http://www.sse.com.cn/
公司半年度报告备置地点	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
报告期内变更情况查询索引	报告期内未发生变更

五、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称
A股	上海证券交易所	天风证券	601162	不适用

六、其他有关资料

适用 不适用

七、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
营业收入	1,627,361,723.29	2,061,307,013.11	-21.05
归属于母公司股东的净利润	329,788,428.62	404,988,465.61	-18.57
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	287,091,034.60	407,891,864.44	-29.62
经营活动产生的现金流量净额	-39,361,476.20	-980,922,497.96	不适用
其他综合收益	-38,873,675.34	-224,935,008.58	不适用
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年同期增减 (%)
资产总额	94,313,848,403.33	81,405,106,781.45	15.86
负债总额	63,946,501,738.50	59,162,069,868.75	8.09
归属于母公司股东的权益	25,881,933,894.69	17,460,091,857.72	48.23
所有者权益总额	30,367,346,664.83	22,243,036,912.70	36.53

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.04	0.07	-42.86
稀释每股收益(元/股)	0.04	0.07	-42.86
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.04	0.07	-42.86
加权平均净资产收益率(%)	1.62	2.71	减少 1.09 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	1.41	2.73	减少 1.32 个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	17,218,687,508.07	9,840,771,799.18
净资产	25,083,242,330.43	16,816,462,537.05
各项风险资本准备之和	8,237,560,083.23	6,218,702,336.34
表内外资产总额	74,048,088,626.56	63,844,687,060.04
风险覆盖率(%)	209.03	158.24
资本杠杆率(%)	20.73	12.37

流动性覆盖率 (%)	1,080.53	279.37
净稳定资金率 (%)	138.47	130.55
净资本/净资产 (%)	68.65	58.52
净资本/负债 (%)	36.30	21.94
净资产/负债 (%)	52.89	37.49
自营权益类证券及证券衍生品/净资本 (%)	18.59	28.32
自营非权益类证券及证券衍生品/净资本 (%)	176.99	262.74

八、境内外会计准则下会计数据差异

□适用 √不适用

九、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	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-202,570.74	
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免		
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	54,800,542.79	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		

对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	2,521,501.14	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
少数股东权益影响额	-184,732.12	
所得税影响额	-14,237,347.05	
合计	42,697,394.02	

十、其他

√适用 □不适用

公司根据《证券公司年度报告内容和格式准则（2013年修订）》（证监会公告[2013]41号）相关规定编制的财务报表中主要项目的数据和增减百分比。

（一）合并财务报表主要项目

项目	2021年6月30日	2020年12月31日	增减幅度(%)
货币资金	17,689,997,977.08	14,622,925,091.99	20.97
结算备付金	2,968,391,374.12	2,092,593,710.63	41.85
拆出资金	1,000,578,305.55	600,408,750.00	66.65
融出资金	4,960,458,031.84	5,617,229,266.37	-11.69
衍生金融资产	99,139.95		不适用
存出保证金	3,969,215,511.65	3,234,252,212.13	22.72
应收款项	1,460,074,231.47	1,395,310,400.35	4.64
买入返售金融资产	2,690,026,255.04	3,624,293,940.73	-25.78
交易性金融资产	32,478,496,814.90	27,805,124,322.55	16.81
债权投资	1,371,592,290.62		不适用
其他债权投资	1,304,530,152.48	1,468,154,478.25	-11.14
其他权益工具投资	3,171,314,910.83	3,279,330,455.93	-3.29
长期股权投资	4,531,064,077.99	4,520,616,956.01	0.23
投资性房地产	147,215,249.98	150,357,512.25	-2.09
固定资产	714,438,954.34	116,727,952.18	512.05
在建工程	130,136,913.12	562,819,585.16	-76.88
使用权资产	376,856,269.14		不适用
无形资产	373,585,711.89	573,323,775.92	-34.84
商誉	66,634,466.97	66,634,466.97	
递延所得税资产	291,649,675.19	294,193,220.00	-0.86
其他资产	14,617,492,089.18	11,380,810,684.03	28.44
资产总计	94,313,848,403.33	81,405,106,781.45	15.86
短期借款	610,672,724.00	630,073,044.46	-3.08
应付短期融资款	4,767,215,436.48	8,132,246,488.92	-41.38
拆入资金	1,130,427,277.78	1,446,215,777.77	-21.84
交易性金融负债	86,543,621.84	26,120,694.97	231.32
衍生金融负债	33,239,107.51	5,389,968.02	516.68

卖出回购金融资产款	11,911,176,842.71	8,308,264,661.37	43.37
代理买卖证券款	13,746,616,611.23	11,584,902,888.04	18.66
代理承销证券款	150,000,000.00		不适用
应付职工薪酬	180,022,503.98	338,522,881.20	-46.82
应交税费	107,833,855.33	168,357,651.12	-35.95
应付款项	146,629,069.65	279,975,921.11	-47.63
合同负债	43,437,323.31	51,784,278.10	-16.12
长期借款	1,189,305,876.00	1,189,306,800.00	0.00
应付债券	26,429,749,094.86	24,371,607,466.49	8.44
租赁负债	370,675,685.15		不适用
递延收益	87,000.00	87,000.00	
递延所得税负债	359,030,396.93	287,172,116.59	25.02
其他负债	2,683,839,311.74	2,342,042,230.59	14.59
负债合计	63,946,501,738.50	59,162,069,868.75	8.09
实收资本	8,665,757,464.00	6,665,967,280.00	30.00
资本公积	14,041,610,564.26	7,915,543,266.46	77.39
其他综合收益	-494,558,670.87	-469,026,061.83	不适用
盈余公积	331,425,315.71	331,425,315.71	
一般风险准备	731,149,806.83	722,474,379.80	1.20
未分配利润	2,606,549,414.76	2,293,707,677.58	13.64
归属于母公司所有者权益合计	25,881,933,894.69	17,460,091,857.72	48.23
少数股东权益	4,485,412,770.14	4,782,945,054.98	-6.22
所有者权益合计	30,367,346,664.83	22,243,036,912.70	36.53
负债和所有者权益总计	94,313,848,403.33	81,405,106,781.45	15.86
项目	2021年半年度	2020年半年度	增减幅度(%)
营业收入	1,627,361,723.29	2,061,307,013.11	-21.05
利息净收入	-297,891,994.19	-200,239,813.36	不适用
手续费及佣金净收入	1,140,346,893.23	1,357,199,164.46	-15.98
投资收益	657,671,321.61	830,490,935.06	-20.81
其他收益	8,105,691.67	4,649,322.36	74.34
公允价值变动收益	99,090,189.31	44,284,321.61	123.76
汇兑收益	-7,125,167.37	-247,537.45	不适用
其他业务收入	27,365,725.91	25,092,925.01	9.06
资产处置收益	-200,936.88	77,695.42	-358.62
营业支出	1,184,301,801.21	1,442,455,076.59	-17.90
税金及附加	11,610,720.63	16,340,729.91	-28.95
业务及管理费	1,242,721,124.91	1,314,331,982.16	-5.45
信用减值损失	-73,710,647.50	107,810,821.25	-168.37
其他业务成本	3,680,603.17	3,971,543.27	-7.33
营业利润	443,059,922.08	618,851,936.52	-28.41
营业外收入	58,485,097.25	2,097,937.38	2,687.74
营业外支出	9,270,378.85	10,562,268.04	-12.23
利润总额	492,274,640.48	610,387,605.86	-19.35
所得税费用	96,341,241.26	70,145,249.26	37.35
净利润	395,933,399.22	540,242,356.60	-26.71

归属于母公司股东的净利润	329,788,428.62	404,988,465.61	-18.57
少数股东损益	66,144,970.60	135,253,890.99	-51.10
其他综合收益的税后净额	-38,873,675.34	-224,935,008.58	不适用
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	-33,803,873.45	-87,014,579.12	不适用
综合收益总额	357,059,723.88	315,307,348.02	13.24

(二) 母公司报表主要项目

项目	2021年6月30日	2020年12月31日	增减幅度(%)
货币资金	13,131,835,539.16	10,090,785,509.59	30.14
结算备付金	2,590,154,450.07	2,504,785,598.08	3.41
拆出资金	1,000,578,305.55	600,408,750.00	66.65
融出资金	4,896,526,012.13	5,579,441,537.05	-12.24
存出保证金	607,970,799.12	586,304,207.86	3.70
应收款项	911,639,721.49	918,302,873.83	-0.73
买入返售金融资产	2,600,197,216.95	3,313,798,523.37	-21.53
交易性金融资产	29,619,458,799.66	25,126,889,082.80	17.88
债权投资	1,472,927,908.26	105,116,439.56	1,301.23
其他债权投资	556,142,771.50	737,136,193.01	-24.55
其他权益工具投资	221,637,522.05	238,149,768.75	-6.93
长期股权投资	8,709,645,814.75	7,921,404,635.70	9.95
投资性房地产	15,940,739.70	16,321,589.88	-2.33
固定资产	78,146,739.64	81,303,783.18	-3.88
在建工程	130,136,913.12	118,371,851.75	9.94
使用权资产	348,867,670.61		不适用
无形资产	89,920,044.01	95,266,955.58	-5.61
递延所得税资产	164,038,007.40	175,991,974.73	-6.79
其他资产	12,816,615,230.30	9,800,327,174.05	30.78
资产总计	79,962,380,205.47	68,010,106,448.77	17.57
短期借款	610,672,724.00	612,673,200.00	-0.33
应付短期融资款	4,767,215,436.48	8,132,246,488.92	-41.38
拆入资金	1,130,427,277.78	1,446,215,777.77	-21.84
衍生金融负债	33,239,107.51	5,071,235.02	555.44
卖出回购金融资产款	11,833,312,757.88	8,216,523,682.00	44.02
代理买卖证券款	7,299,993,151.92	6,343,644,072.56	15.08
代理承销证券款	150,000,000.00		不适用
应付职工薪酬	129,437,371.70	246,760,777.21	-47.55
应交税费	65,176,517.54	134,084,641.52	-51.39
合同负债	21,029,206.55	19,486,098.98	7.92
长期借款	1,189,305,876.00	1,189,306,800.00	0.00
应付债券	26,414,211,387.05	24,351,406,216.99	8.47
租赁负债	343,096,279.24		不适用
递延所得税负债	217,204,175.62	168,485,852.62	28.92
其他负债	674,816,605.77	327,739,068.13	105.90
负债合计	54,879,137,875.04	51,193,643,911.72	7.20
实收资本	8,665,757,464.00	6,665,967,280.00	30.00
资本公积	13,237,408,851.62	7,111,460,823.71	86.14

其他综合收益	-180,280,765.54	-175,783,833.99	不适用
盈余公积	331,425,315.71	331,425,315.71	
一般风险准备	718,153,198.51	716,560,701.48	0.22
未分配利润	2,310,778,266.13	2,166,832,250.14	6.64
所有者权益合计	25,083,242,330.43	16,816,462,537.05	49.16
负债和所有者权益总计	79,962,380,205.47	68,010,106,448.77	17.57
项目	2021年半年度	2020年半年度	增减幅度 (%)
营业收入	976,508,171.86	1,658,776,363.87	-41.13
利息净收入	-444,158,078.52	-258,972,667.10	不适用
手续费及佣金净收入	738,962,020.53	1,241,741,245.40	-40.49
投资收益	504,767,947.65	660,817,662.05	-23.61
其他收益	7,794,023.01	4,489,851.38	73.59
公允价值变动收益	161,143,796.98	10,441,902.65	1,443.24
汇兑收益	-2,034,111.17	134,494.66	-1,612.41
其他业务收入	10,207,395.45	135,795.15	7,416.76
资产处置收益	-174,822.07	-11,920.32	不适用
营业支出	827,327,963.31	1,242,104,544.85	-33.39
税金及附加	9,112,695.77	14,789,313.73	-38.38
业务及管理费	896,793,922.78	1,123,814,124.55	-20.20
信用减值损失	-78,959,505.42	103,120,256.39	-176.57
其他业务成本	380,850.18	380,850.18	
营业利润	149,180,208.55	416,671,819.02	-64.20
营业外收入	57,921,259.15	1,870,172.93	2,997.11
营业外支出	9,088,629.11	10,506,741.67	-13.50
利润总额	198,012,838.59	408,035,250.28	-51.47
所得税费用	50,245,928.22	83,276,892.82	-39.66
净利润	147,766,910.37	324,758,357.46	-54.50
其他综合收益的税后净额	-6,725,328.90	414,138.73	-1,723.93
综合收益总额	141,041,581.47	325,172,496.19	-56.63

第三节 管理层讨论与分析

一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

（一）公司所从事的主要业务及经营模式

公司及子公司从事的主要业务包括证券经纪业务、自营业务、投资银行业务、资产管理业务、期货经纪业务、私募基金管理业务以及海外业务等。

公司开展证券经纪业务，并为客户提供融资融券、股票质押回购等信用交易业务服务。证券经纪业务主要是公司通过所属证券营业部接受客户委托代理客户买卖证券，是证券公司的一项传统业务。此外，还包括代理销售金融产品、期货中间介绍、代理还本付息、分红派息、证券代保管、鉴证以及代理登记开户等服务。公司通过提供相关服务，获得手续费、佣金等收入。信用交易业务主要是指公司向客户出借资金或出借证券并收取担保物，收取利息等收入。

投资银行业务主要是为机构客户提供股票承销与保荐、债券发行与承销、上市公司资产重组、兼并收购、改制辅导及股权激励等财务顾问业务以及股转系统挂牌推荐、持续督导及并购重组、融资等服务，获得承销费、保荐费、财务顾问费等收入。

自营业务主要是公司以自有资金和依法筹集的资金进行权益类证券、固定收益类证券及证券衍生品等金融产品的投资和交易，获取投资收益。

研究业务主要是公司研究所立足和深耕产业资源，发布研究报告，为客户提供产业和上市公司调研、研究成果路演、委托课题研究、会议推介沟通、各类定制研究咨询等服务。

公司通过全资子公司天风资管开展资产管理业务，根据有关法律法规规定与客户签订资产管理合同，根据约定的方式、条件、要求及限制，作为资产管理人对客户资产进行经营，为客户提供证券及其他金融产品投资管理服务，获取管理费、业绩报酬等收入。

公司控股子公司天风期货为客户提供期货经纪、期货投资咨询和资产管理服务，并收取手续费、管理费等收入。公司控股子公司天风天睿开展私募投资基金业务，获得管理费、投资收益等收入。公司通过境外子公司天风国际集团拓展海外业务。

（二）行业情况说明及公司所处的行业地位

今年上半年，全球经济增长迎来复苏曙光，同时呈现明显不均衡特征。我国经济则保持了快速增长势头，就业形势基本平稳，对外贸易快速增长，高质量发展取得新成效。为应对疫情冲击、实现经济高质量发展，我国深入推进供给侧结构性改革，着眼于落实创新驱动发展战略，着眼于完善资本市场基础制度，坚持“建制度、不干预、零容忍”的工作方针，坚持市场化、法治化、国际化的改革理念，对有效发挥资本市场功能作用提出了新的更高要求。随着改革的持续推进，以信息披露为核心的注册制理念日益深入人心，市场主体的归位尽责意识明显增强，优胜劣汰机制进一步健全，市场法治供给取得突破性进展，投资者保护渠道更加畅通，市场预期明显稳定，市场整体生态呈现积极向好变化。

报告期内证券行业景气度呈现上升趋势，A股市场稳中向好，上证综指与深证成指分别较上年末上涨3.40%和4.78%。据中国证券业协会统计，截至2021年6月30日，139家证券公司总资产为9.72万亿元，净资产为2.39万亿元，净资本为1.86万亿元，客户交易结算资金余额（含信用交易资金）1.79万亿元，受托管理资金本金总额10.45万亿元。

近年来，公司坚持综合金融发展方向，打造以全天候资产管理能力、全方位大投行服务能力双轮驱动、两翼齐飞的证券公司。在从以产品为中心转向以客户为中心的综合金融服务转型过程中，着力增强服务实体经济能力，持续提升合规风控水平，稳步推进各项业务发展，行业影响力逐年提升，继续稳定在证券公司分类评价A类A级。

二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

1、适应市场趋势的业务布局

公司坚持综合金融发展方向，打造以全天候财富管理能力和全方位大投行服务能力双核驱动、两翼齐飞的证券公司。一方面，以为投资者提供全面的资产管理服务为目标，不断提升主动管理的专业能力，力求满足各类型客户的财富管理需求。另一方面，持续突出服务实体经济的功能定位，坚持服务实体经济、服务中小企业的经营宗旨，为客户提供股权、债权融资、并购重组等“一站式”投行服务。与此同时，公司高度重视研究所建设，除二级市场研究外，公司还加大对宏观经济的研究，强化研究业务服务国家战略和实体经济的能力。

2、有效的风险控制

公司高度重视风险管理和内部控制，建立了有效的风险管理和内部控制体系。公司建立了风险管理组织架构的四个层级并相应形成了风险管理的四道防线，覆盖了公司各部门、分支机构、子公司（含比照子公司管理的孙公司）及全体成员。全面的风险管理体系帮助公司及时把握行业改革机遇，经营业绩在风险可控、可承受的前提下实现了稳健增长。

3、富有竞争力的人才团队

公司具有较强的多行业金融人才集聚能力和良好的年轻求职者吸聚、培训、再发掘的机制，报告期内，公司通过人才的吸引和培养实现了较快发展。公司高管团队年轻化、学历高、综合金融领域管理经验丰富、业务能力强，是公司快速稳定发展的重要因素。与此同时，公司近年来引进和培养了一批年轻的业务骨干，为未来持续保持市场竞争力提供了充裕的人才储备。

三、经营情况的讨论与分析

2021年上半年，我国宏观经济延续去年疫情后较高的景气度，相对去年同期较低基数表现出高速增长态势。货币信用环境平稳偏紧，资本市场维持二级市场总体稳定的同时，各项改革有序推进，结构性行情分化明显。公司在抓好疫情防控的同时，稳步推进经营发展，大力提升内部管理，强化落实经营决策，围绕重大经营问题研究部署，在分类监管评级中保持A类评级。

1、经纪业务

报告期内，公司经纪业务保持稳步上涨势头，其中客户数较上年度显著增长。截至报告期末，托管资产规模为 2514.85 亿元，报告期内新增客户 26.72 万户，总客户数达到 110.55 万户，同比增长 47%。实现证券经纪业务营业收入 6.70 亿元。为推进财富管理转型，积极完善业务布局，推进分支机构调整，截至报告期末公司营业部及分公司数量分别为 102 家和 23 家。

2、投行业务

报告期内，公司实现投资银行业务收入 3.56 亿元。股权投资方面，帮助金鹰重工完成 IPO 注册，完成上海新阳、天华超净、长源电力、京山轻机等 4 个非公开发行项目以及长源电力发行股份及支付现金购买资产项目。债权投行方面，客户结构持续优化，各项指标市场排名保持稳定。报告期内，公司债券发行金额排名第 16 位，发行只数排名第 11 位；企业债券发行金额排名第 8 位，发行只数排名第 6 位；作为管理人发行的企业 ABS 项目共 13 单，规模合计 88.02 亿元，管理规模在交易所市场（含报价系统）排名第 18 位，发行数量排名第 13 位。（数据来源：万得资讯）

3、资产管理业务

公司通过全资子公司天风资管开展境内资产管理业务。报告期内，天风资管实现营业收入 2.80 亿元，资产管理业务净收入排名第 14 位（数据来源：中国证券业协会），截至报告期末天风资管资产管理业务受托客户资金规模为 1,283.80 亿元。

4、自营业务

报告期内，公司较好地把握了股债市场节奏和板块轮动，运用多种工具和策略实现了稳定收益。报告期内，公司证券自营业务实现营业收入人民币 8.98 亿元，同比上升 16.41%。

5、研究业务

报告期内，公司共发布研究报告 3,190 篇，其中深度报告 674 篇，深度报告同比增加 15.41%。客户拓展方面取得积极进展，入选国家社保基金境内签约券商。

6、私募基金业务

公司通过控股子公司天风天睿从事私募基金业务。截至报告期末，天风天睿及下属机构共管理备案基金数量 25 只，管理基金实缴规模 36.59 亿元。报告期内，天风天睿完成设立和备案的基金数量有 1 只，实缴规模 1000 万元。

7、期货业务

公司通过控股子公司天风期货从事期货业务。报告期内，天风期货总成交量 2,339 万手，较上年度增长 2%；总成交额 19,649 亿元，同比增长 9%。

8、海外业务

公司通过境外全资子公司天风国际从事海外业务。获得香港证券及期货事务监察委员会(SFC)核准或认可的业务资格包括：第 1 类（证券交易）业务、第 2 类（期货合约交易）业务、第 4 类（就证券提供意见）业务、第 5 类（就期货合约提供意见）业务、附条件的第 6 类（就机构融资提供意见）业务和第 9 类（提供资产管理）业务。

报告期内公司经营情况的重大变化，以及报告期内发生的对公司经营情况有重大影响和预计未来会有重大影响的事项

适用 不适用

四、报告期内主要经营情况

(一) 主营业务分析

1 财务报表相关科目变动分析表

单位：元币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例(%)
营业收入	1,627,361,723.29	2,061,307,013.11	-21.05
营业成本	1,184,301,801.21	1,442,455,076.59	-17.90
经营活动产生的现金流量净额	-39,361,476.20	-980,922,497.96	不适用
投资活动产生的现金流量净额	-1,501,643,352.56	-3,885,741,110.98	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	5,484,916,161.77	9,975,913,882.51	-45.02

营业收入变动原因说明：2021年上半年，本公司实现营业收入16.27亿元，同比下降21.05%，其中，投资银行业务实现营业收入人民币3.56亿元，同比下降28.77%；资产管理业务实现营业收入人民币3.3亿元，同比下降27.65%；

营业成本变动原因说明：2021年上半年，本公司发生营业支出11.84亿元，同比下降17.90%，主要是证券经纪业务与资产管理业务的业务成本较上期有所下降导致；

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是回购业务导致经营活动产生的现金流量净额增加导致；

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是投资支付的现金同比减少所致；

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是偿还债务支付的现金同比增加所致。

2 本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

(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(%)	上年期末数	上年期末数占总资产的比例(%)	本期期末金额较上年期末变动比例(%)	情况说明
货币资金	17,689,997,977.08	18.76	14,622,925,091.99	17.96	20.97	/
结算备付金	2,968,391,374.12	3.15	2,092,593,710.63	2.57	41.85	主要为结算备付金

						规模增加所致
拆出资金	1,000,578,305.55	1.06	600,408,750.00	0.74	66.65	主要为拆出资金规模增加所致
衍生金融资产	99,139.95	0.00			不适用	主要为衍生金融资产规模增加所致
存出保证金	3,969,215,511.65	4.21	3,234,252,212.13	3.97	22.72	/
应收款项	1,460,074,231.47	1.55	1,395,310,400.35	1.71	4.64	/
合同资产						/
债权投资	1,371,592,290.62	1.45			不适用	主要为债权投资规模增加所致
长期股权投资	4,531,064,077.99	4.80	4,520,616,956.01	5.55	0.23	/
投资性房地产	147,215,249.98	0.16	150,357,512.25	0.18	-2.09	/
固定资产	714,438,954.34	0.76	116,727,952.18	0.14	512.05	主要为在建工程转入固定资产所致
在建工程	130,136,913.12	0.14	562,819,585.16	0.69	-76.88	主要为在建工程转入固定资产所致
使用权资产	376,856,269.14	0.40			不适用	主要为执行新租赁准则所致
无形资产	373,585,711.89	0.40	573,323,775.92	0.70	-34.84	主要为土地使用权处置所致
短期借款	610,672,724.00	0.65	630,073,044.46	0.77	-3.08	/
应付短期融资款	4,767,215,436.48	5.05	8,132,246,488.92	9.99	-41.38	主要为短期融资券、短期收益凭证规模减少所致
交易性金融负债	86,543,621.84	0.09	26,120,694.97	0.03	231.32	主要为交易性金融负债规模增加所致
衍生金融负债	33,239,107.51	0.04	5,389,968.02	0.01	516.68	主要为衍生金融负债规模增加所致
卖出回购金融资产款	11,911,176,842.71	12.63	8,308,264,661.37	10.21	43.37	主要为卖出回购负债规模增加所致
代理承销证券款	150,000,000.00	0.16			不适用	主要为代理承销证券款规模增加所致
应付职工薪酬	180,022,503.98	0.19	338,522,881.20	0.42	-46.82	主要为应付职工薪酬规模减少所致
应交税费	107,833,855.33	0.11	168,357,651.12	0.21	-35.95	主要为应交企业所得税减少所致
应付款项	146,629,069.65	0.16	279,975,921.11	0.34	-47.63	主要为应付清算款项减少所致
合同负债	43,437,323.31	0.05	51,784,278.10	0.06	-16.12	/
长期借款	1,189,305,876.00	1.26	1,189,306,800.00	1.46	0.00	/
租赁负债	370,675,685.15	0.39			不适用	主要为执行新租赁准则所致
实收资本(或股本)	8,665,757,464.00	9.19	6,665,967,280.00	8.19	30.00	主要为所有者投入资本增加所致
资本公积	14,041,610,564.26	14.89	7,915,543,266.46	9.72	77.39	主要为所有者投入资本增加所致

其他说明

截至2021年6月30日，本公司资产总额为943.14亿元，较年初增长129.09亿元，增幅15.86%。扣除代理买卖证券款及代理承销证券款后，本公司资产总额为804.17亿元，较年初增长105.97亿元，增幅15.18%。其中：交易性金融资产324.78亿元，占总资产的34.44%；货币资金176.9亿元，占总资产的18.76%；融出资金49.6亿元，占总资产的5.26%。公司整体资产流动性较强。

截至2021年6月30日，本公司负债总额为639.47亿元，较年初增长47.84亿元，增幅8.09%。扣除代理买卖证券款及代理承销证券款后，本公司负债总额为500.5亿元，较年初增长24.73亿元，增幅5.20%。其中，应付债券264.3亿元，占总负债的41.33%；代理买卖证券款137.47亿元，占总负债的21.50%；卖出回购金融资产款119.11亿元，占总负债的18.63%。

本期期末扣除代理买卖证券款及代理承销证券款的资产负债率为62.24%，较年初的68.14%有所下降，资产负债结构稳定。

截至2021年6月30日，公司表内股票质押式回购业务规模12.12亿元，平均维持担保比例为160.07%，表外股票质押式回购业务规模为22.19亿元。

项目	本期末业务规模 (亿元)	2020年业务规模 (亿元)	业务规模变动 (同比)
股票质押式回购业务	12.12	14.88	-18.55%
融资融券业务融出资金	50.26	56.79	-11.50%
合计	62.38	71.67	-12.96%

2. 境外资产情况

适用 不适用

(1) 资产规模

其中：境外资产3,598,629,836.06（单位：元币种：人民币），占总资产的比例为3.82%。

(2) 境外资产相关说明

适用 不适用

3. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

详见本报告“第十节财务报告七、合并财务报表注释项目75、所有权或使用权受到限制的资产”的相关内容。

4. 其他说明

适用 不适用

(四) 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，公司合并报表口径长期股权投资 453,106.41 万元，期初值为 452,061.70 万元，期末较期初增加 1,044.71 万元。

(1) 重大的股权投资

适用 不适用

(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

具体内容详见本半年度报告“第十节财务报告七、合并财务报表项目注释 6、衍生金融工具，13、交易性金融资产，15、其他债权投资，16、其他权益工具投资”。

(五) 重大资产和股权出售

适用 不适用

(六) 主要控股参股公司分析

适用 不适用

1、天风天睿投资股份有限公司，主营业务：管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务。注册资本人民币 154,328 万元，公司持有其 65.72%股权。截至报告期末，天风天睿总资产人民币 1,618,093 万元，净资产人民币 430,651 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 8,127 万元，利润总额人民币 3,833 万元，净利润人民币 2,638 万元。

2、天风期货股份有限公司，主营业务：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询。注册资本人民币 31,440 万元，公司持有其 62.94%股权。截至报告期末，天风期货总资产人民币 686,890 万元，净资产人民币 39,041 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 8,406 万元，利润总额人民币 555 万元，净利润人民币 408 万元。

3、天风创新投资有限公司，主营业务：投资管理。注册资本人民币 79,473.17 万元，公司持有其 100%股权。截至报告期末，天风创新总资产人民币 95,936 万元，净资产人民币 93,484 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 503 万元，利润总额人民币 419 万元，净利润人民币 310 万元。

4、天风国际证券集团有限公司，主营业务：金融公司的投资和管理，注册资本港币 80,000 万元，公司持有其 100%的股权。截至报告期末，天风国际集团总资产人民币 359,863 万元，净资产人民币 69,326 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 14,855 万元，利润总额人民币 6,075 万元，净利润人民币 5,338 万元。

5、天风（上海）证券资产管理有限公司，主营业务：证券资产管理业务，注册资本人民币 100,000 万元，公司持有其 100%的股权。截至报告期末，天风资管总资产人民币 118,195 万元，

净资产人民币 110,889 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 27,981 万元，利润总额人民币 12,727 万元，净利润人民币 9,574 万元。

6、宜宾市商业银行股份有限公司，主营业务：吸收公众存款，发放短期、中期和长期贷款，办理国内结算，办理票据承兑和贴现，发行金融债券，代理发行、代理兑付、承销政府债券，买卖政府债券、金融债券，从事同业拆借，从事银行卡业务，提供信用证服务及担保，代理收收付款项及代理保险业务，提供保管箱服务，经银行业监督管理机构批准的其它业务。注册资本人民币 282,254 万元，公司持有其 7.16%的股权。截至报告期末，宜宾商行总资产人民币 5,992,513 万元，净资产人民币 543,074 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 74,396 万元，利润总额人民币 25,819 万元，净利润人民币 19,254 万元。

7、恒泰证券股份有限公司，主营业务：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。注册资本人民币 260,457 万元，公司持有其 26.49%的股权。截至报告期末，恒泰证券总资产人民币 3,523,527 万元，净资产人民币 942,410 万元；2021 年上半年实现营业收入人民币 98,607 万元，利润总额人民币-1,599 万元，净利润人民币-1,193 万元。

(七) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司合并 25 家结构化主体，主要为资产管理计划。公司对担任结构化主体的管理人或投资顾问，且持有产品份额的结构化主体，综合考虑公司拥有的投资决策权、可变回报的敞口及运用投资决策权影响可变回报等因素后，将公司拥有控制权的结构化主体纳入合并报表范围。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险

√适用 □不适用

1、可能面对的风险

报告期内，公司业务经营活动中可能面临的主要风险包括市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、声誉风险、合规及法律风险、洗钱风险等。

(1) 市场风险

公司面临的市场风险是指公司的持仓投资组合因风险因子发生不利变动导致投资损失的风险。公司面临的市场风险主要分为如下三类：第一类是权益类风险，来自于持仓组合的股票投资、股指期货、期权等权益类证券价格及其波动率变化上的风险暴露；第二类是利率类风险，来自于持仓组合在固定收益投资收益率曲线结构、利率波动性和信用利差等变化上的风险暴露；第三类是商品类风险，来自于商品远期价格及波动率变化上的风险暴露。

(2) 信用风险

公司面临的信用风险指借款人或交易对手未能或不愿履行协议中约定的义务而造成经济损失的风险。公司的信用风险主要来自以下三个方面：一是融资融券业务、股票质押式回购交易业务、债券回购业务的客户/交易对手出现违约，不能及时向本公司履行相应债务的风险；二是债券、信托产品以及其他信用类产品的投资业务，由于发行人或融资人违约而导致相应的本息无法及时支付的风险；三是经纪业务代理客户买卖证券、期货及其他金融产品，在结算当日发生客户资金不足的，代客户进行结算后，因客户违约而形成的损失。

（3）操作风险

公司面临的操作风险指由不完善的内部流程、人为操作失误、信息系统故障、交易故障等原因而导致的风险，也包括外部事件造成损失的风险。操作风险事件主要表现为：内部欺诈，外部欺诈，就业制度和 workplace 安全，客户、产品和业务活动，实物资产损坏、营业中断和信息技术系统瘫痪，执行、交割和流程管理。

（4）流动性风险

流动性风险，是指证券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其他资金需求的风险。

（5）声誉风险

声誉风险指由公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价的风险。

（6）合规及法律风险

合规及法律风险指由于公司外部监管环境或内部管理制度发生变化，相关行为主体未按照监管要求或制度规定从事相关工作，而对公司造成不利后果的可能性。

（7）洗钱风险

反洗钱是指为了预防通过证券交易掩饰、隐瞒毒品犯罪、黑社会性质的组织犯罪、恐怖活动犯罪、走私犯罪、贪污贿赂犯罪、破坏金融管理秩序犯罪、金融诈骗犯罪等犯罪所得及其收益的来源和性质的洗钱活动，依照有关法律法规及规章制度的规定采取相关措施的行为。

2、风险管理措施

公司根据中国证券业协会发布的《证券公司全面风险管理规范》的要求，秉承“全面风险管理”的宗旨，以风险管理工作为核心，持续完善和提高公司全面风险管理各项工作和水平，保障风险管理全覆盖、风险监测监控有效、风险计量科学合理、风险分析报告及时全面准确、风险应对机制切实有效。

（1）建立全面的风险防控体系

公司致力于建立与自身经营战略及风险偏好相匹配的、全面的风险管理架构体系。公司建立了风险管理组织架构的四个层级，覆盖公司各部门、分支机构及子公司以及比照子公司管理的孙公司。

公司风险管理架构体系如下：第一层为董事会及其下设的风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会以及监事会；第二层为公司总裁办公会及其下设的合规与风险管理委员会、公司

其他专业委员会、首席风险官、合规总监；第三层为风险管理部门，包括风险管理部、合规法律部、投行内核部、稽核审计部、资金计划部、财务核算部、品牌管理部；第四层为公司除风险管理部门之外的各部门、分支机构、子公司及公司全体成员。

此外，公司承担管理职能的业务部门均配备了专职风险管理人员。

（2）各类风险应对措施

①市场风险管理

公司根据董事会制定的风险偏好、风险容忍度指标，结合各类投资的风险与收益状况进行资本分配，并根据业务之间的相关性与分散化效应，将公司的整体风险限额划分至各业务部门并制定相应的授权。业务部门是市场风险的承担者，负责一线风险管理工作。投资经理在其授权范围内开展交易并负责相关投资风险管理工作，动态管理其持仓部分暴露的市场风险，主动采取降低敞口或对冲等风险缓释措施控制风险。风险管理部作为独立的风险管理部门，向公司首席风险官负责，运用专业的风险管理工具和管理方法对各投资策略、业务部门/条线和全公司等不同层级的市场风险状况进行独立监控、测量和管理，并按日、周、月等不同频率生成相应的风险报表和分析评估报告，及时发送给公司经营管理层以及相应业务部门的主要负责人。当发生接近或超过风险限额情况时，风险管理部及时向公司经营管理层以及相应业务部门/条线的主要负责人发送风险提示或预警，并根据公司相关领导/委员会的审批意见，监督业务部门落实应对措施。风险管理部将持续与业务部门/条线人员直接沟通最新市场状况、当前风险暴露和可能出现的极端压力情景等问题。

②信用风险管理

信用风险管理方面，公司在展业时坚持业务发展的安全性、流动性与效益性的有效统一。公司坚持在有效控制交易对手及违约损失的前提下，主动进行审慎、可测、可控、可承受的风险管理，确保公司资产组合不会因投资品种、交易场所的不同及集中度的信用风险冲击而对公司的持续经营产生重大影响。

③操作风险管理

公司强调业务规模、获利与风险承受度的匹配，不因对利润的追求而牺牲对操作风险的管控，坚持在稳健经营的前提下开展各项业务。公司持续强化操作风险管理，公司持续监控并统计各项操作风险事项，同时搜集整理市场上其他相关机构可统计的操作风险事项，纳入操作风险案例库。针对操作风险事项，风险管理部门向涉事部门进行风险提示或警示，对已发生的风险事项分析其产生的原因及造成的影响并按照涉及部门进行分类汇总，根据操作风险发生的原因及时管控操作风险。

④流动性风险管理

公司对流动性风险的管理采用逐日盯市、动态监控、分层汇总、定期报告，通过流动性监控指标、资产结构、负债结构、资产负债期限匹配结构、现金流量分析、压力测试等方法对流动性风险进行识别与分析。公司流动性风险管理部门每日计算并监控关键风险指标的情况，判断和预

测各类风险指标的变化，定期将流动性指标、负债情况向公司经营管理层报告。资金计划部每月报送融资管理业务月度信息简报，对公司存续的主要债务融资工具的品种、规模、原始期限、剩余期限等进行分析，对公司近期资金缺口情况进行汇报，对未来可能发生垫资的风险进行提示。同时，公司流动性风险管理部门跟进公司融资项目进展，包括但不限于公司债、次级债等债务融资工具申请发行额度、交易所审批意见、证监会审核进展、银行授信维护情况等，对金融市场交易量和价格等变动情况进行汇报，评估市场流动性对公司融资能力的影响。此外，在特定业务或交易开展之前，流动性风险管理部门将充分评估其可能对流动性风险产生的影响，并出具流动性风险评估报告供业务部门和公司总裁办公会参考，作为评判该项业务是否开展的重要依据。

⑤声誉风险管理

公司品牌管理部负责公司整体舆情的监测，将可能对声誉产生影响的风险因素进行提炼，按业务、部门和风险类型等进行分类，综合分析潜在声誉风险因素转化为具体声誉风险事件的可能性，评估对公司业务、财务状况和声誉的影响，分析转化和进一步发展的可能性，并按照影响程度和紧迫性进行排序。公司通过舆情监测系统监测主要以公司名称、分（子）公司名称、核心高管名单为主的关键词，动态监控公司业务开展与产品运作过程中可能引发的声誉风险，因内部组织机构变化、政策制度变化、财务指标变化、机构裁撤变更等可能引发的声誉风险，因客户投诉和监管部门检查等揭示出的声誉风险，以及公司未正式披露的经营管理等信息，对各种舆情信息中可能存在风险隐患进行人工分析判断，以便提前应对。

⑥合规法律风险管理

合规法律部、投行内核部是公司在合法、合规方面的主要内部控制职能部门，对公司经营与管理活动的合法、合规进行控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务，保障公司在合法、合规的前提下开展业务经营。合规法律部、投行内核部主要负责合规管理制度、流程的建设与实施；提供日常合规建议与咨询；新业务新产品合规风险审核；合规风险事项调查、督促整改与落实；起草公司法律文书、代理公司诉讼、调解和仲裁等事务；反洗钱管理及反洗钱制度的制定和实施；组织合规培训、推动合规文化建设、培养公司员工合规意识等工作。

⑦洗钱风险管理

公司根据《金融机构反洗钱监督管理办法（试行）》要求，结合自身的反洗钱工作实际特点，从反洗钱机构设置、人员配备、反洗钱制度建设与执行、客户身份识别、客户资料和交易记录保存、客户风险等级划分工作、大额交易和可疑交易报送、反洗钱宣传和培训、反洗钱协查工作、反洗钱监控系统运行、反洗钱检查评估等方面积极开展了工作。公司将继续加强战略层面布局，加大人才队伍建设与科研技术投入，构建起更加坚实、严密的反洗钱管控体系，同时继续加强反洗钱宣传工作，努力将反洗钱宣传融入到日常工作中，并提升相关岗位人员的反洗钱意识，确保其掌握必要的反洗钱技能，增强反洗钱工作的紧迫感和主动性。

(二) 其他披露事项

适用 不适用

第四节 公司治理

一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2021 年第一次临时股东大会	2021 年 1 月 22 日	上海证券交易所网站	2021 年 1 月 23 日	审议通过《关于公司前次募集资金使用情况报告的议案》。详见《2021 年第一次临时股东大会决议公告》（公告编号：2021-007 号）
2020 年年度股东大会	2021 年 5 月 18 日	上海证券交易所网站	2021 年 5 月 19 日	审议通过《2020 年度董事会工作报告》《2020 年年度报告》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于选举公司第四届非独立董事的议案》等 14 项议案。详见《2020 年年度股东大会决议公告》（公告编号：2021-034 号）

表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

股东大会情况说明

适用 不适用

报告期内，公司共召开股东大会 2 次，其中年度股东大会 1 次，临时股东大会 1 次。上述股东大会的召集和召开程序、出席会议人员资格、会议表决程序及表决结果均符合《公司法》《证券法》等法律、法规、规范性文件和《公司章程》《股东大会议事规则》的相关规定，上述股东大会通过的有关决议合法有效。

上述股东大会的议案全部审议通过，不存在否决议案的情况。

二、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
何国华	独立董事	选举
孙晋	独立董事	选举
武亦文	独立董事	选举
黄孝武	原独立董事	离任
宁立志	原独立董事	离任
陈波	原独立董事	离任
余皓	非职工监事	选举
范晓玲	原非职工监事	离任
洪琳	副总裁	聘任
	原合规总监	离任

付春明	合规总监	聘任
肖函	首席运营官	聘任
	原首席人力资源官	离任
刘全胜	副总裁	聘任
冯琳	常务副总裁	离任

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

公司第三届董事会独立董事黄孝武先生、宁立志先生、陈波先生已连续担任公司独立董事 6 年，根据《公司章程》“独立董事每届任期与公司其他董事的任期相同，连选可以连任，但是连任时间不得超过 6 年”的规定，上述人员已任期届满，公司股东大会选举何国华先生、孙晋先生、武亦文先生为第四届董事会独立董事。

公司第三届监事会非职工监事范晓玲女士已退休，公司股东武汉高科国有控股集团有限公司更换派驻监事，公司股东大会选举余皓先生为第四届监事会非职工监事。

公司董事会收到冯琳女士提交的辞职报告，冯琳女士因工作需要，申请辞去公司常务副总裁职务；因工作变动原因，洪琳女士不再担任公司合规总监职务、肖函女士不再担任公司首席人力资源官职务。2021 年 6 月 18 日，公司第四届董事会第二次会议聘任洪琳女士为公司副总裁、聘任付春明先生为公司合规总监、聘任肖函女士为公司首席运营官、聘任刘全胜先生为公司副总裁。

三、利润分配或资本公积金转增预案

半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	是
每 10 股送红股数（股）	-
每 10 股派息数（元）（含税）	0.05
每 10 股转增数（股）	-
利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明	
<p>公司 2021 年半年度拟以实施权益分派股权登记日登记的总股本为基数分配利润，向全体股东每 10 股派发现金红利 0.05 元（含税）。截至 2021 年 6 月 30 日，公司总股本 8,665,757,464 股，以此计算合计拟派发现金红利 43,328,787.32 元（含税）。</p> <p>该预案符合公司章程以及审议程序的规定，已经公司第四届董事会第七次会议审议通过并经独立董事发表意见，但尚需提交公司股东大会审议。本次利润分配方案符合法律法规及《公司章程》的规定，从长远来看，有利于保证公司持续稳定发展，不存在损害公司及股东特别是中小股东利益的情形。</p>	

四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

(一) 相关股权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

第五节 环境与社会责任

一、环境信息情况

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

适用 不适用

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

1. 因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

2. 参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

3. 未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

公司不属于重点排污单位。

作为持续践行环境责任的企业，公司严格遵守《环境保护法》等法律法规。报告期内，公司积极助力实现双碳目标，率先发布碳中和行动倡议书与行动方案，发布行业首份环境信息披露专项报告，持续支持绿色研究，推进绿色业务，多举措践行低碳运营。

(三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

(四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

适用 不适用

公司将助力碳达峰、碳中和等履行绿色金融责任提升至公司战略规划的高度，资助科研院所开展有关绿色金融的研究，积极培育交叉学科人才，全面推动低碳经济、低碳社会相关产学研合作发展。公司全力推进绿色金融产品和项目落地，让绿色金融更好地服务实体经济，在国家产业和经济的可持续发展中发挥更好的引擎作用。此外，公司将绿色环保理念潜移默化地融入公司的日常业务运营过程中，科学管理排放物，节约资源能源，积极保护生态环境。

(五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

适用 不适用

报告期内，公司积极履行环境责任，在证券行业内首个发布碳中和行动倡议书与行动方案，发布证券行业首份环境信息披露专项报告《天风证券环境信息披露报告（2016-2021）》。报告期内，公司以身作则从十个方面制定了下一步推进碳达峰、碳中和具体工作方向，率先垂范金融机构在节能减排中的作用，为推动中国实现碳达峰、碳中和目标作出贡献，助力实体经济绿色可持

续发展。在绿色金融方面，公司支持绿色研究，聚焦绿色业务，履行低碳运营，让绿色金融更好地推动经济的可持续增长。

二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

√适用 □不适用

全面进入小康社会后，公司坚持党的领导，明确自身责任担当，接续推进乡村振兴。

报告期内，公司将原精准扶贫工作领导小组调整为乡村振兴工作领导小组，针对性制定《天风证券助推乡村振兴工作方案（试行）》，切实服务国家战略。根据方案，公司拟围绕产业振兴、智力振兴、消费振兴、公益振兴、抗疫支持、理论支持等方面助推欠发达地区发展。

2021年3月，公司在湖北省房县成立证券行业首个“证券公司乡村振兴工作站”。目前，已累计在房县、台江县、秭归县、苍溪县设立4个乡村振兴工作站。2021年6月底，公司首次参与湖北省房县的定点帮扶工作，向房县窑淮镇窑场村委派党员青年志愿者，该名志愿者作为驻村工作队队员深度参与乡村振兴。

在产业振兴方面，公司帮助脱贫县企业开展规范治理、上市挂牌、融资发债的辅导工作。2021年上半年，已帮助完成20临泉交投债02等脱贫县债券融资项目发行工作。

在智力振兴方面，公司帮助脱贫县政府、企业及群众更新融资观念。报告期内，利用研究业务在行业较为领先的优势，公司结合在利川等地助力脱贫攻坚的实践，撰写天风证券助力巩固脱贫攻坚成果推进乡村振兴的相关县域发展研究报告，并委派投行、债券、研究、中小等领域金融专家，深入脱贫县为县委县政府提供乡村振兴产业发展建议，开展资本市场培训与投教活动，开设“少儿财商课”课程。

在消费振兴方面，公司为脱贫地区特色农产品提供品牌打造支持。报告期内，通过832平台、武汉农畜产品交易所、楼兰蜜语等线上线下消费平台，公司助力房县花菇、利川红茶、凉山蜂蜜等特色农产品打开销路。

在公益振兴方面，天风证券欣鑫慈善基金会驰援脱贫县学子完成学业。2021年6月1日前后，启动天风欣鑫“梦想计划”圆梦工程，深入湖北省秭归县，助力42名困境儿童成长。捐资设立天风证券欣鑫慈善“台江乡村振兴奖助学金”，助力台江接续培育乡村振兴人才。启动“橙风计划”营养早餐项目，为贵州、四川、新疆、宁夏、湖北等地学子捐助营养早餐9,000件。

在抗疫支持方面，天风证券欣鑫慈善基金会积极响应党和政府关于2021年春节就地过年的号召，为6,000余名湖北省留校大学生、300余名脱贫县学子捐助春节暖心包，为他们增添春节的“温暖”。

在理论支持方面，公司启动证券公司乡村振兴绩效评价指标体系研究。作为全国唯一开展证券公司脱贫攻坚绩效评价指标体系研究的证券公司，公司在脱贫攻坚期间积极参与扶贫理论研究，为标准化扶贫提供参考依据。报告期内，公司联合武汉大学马克思主义学院、华中师范大学经管

学院等科研院所，组织专家学者赴农村、企业与脱贫县政府开展乡村振兴实地实践调研，开展乡村振兴理论研究。

此外，在助力脱贫县推进碳中和行动方面，公司积极响应由人民银行、证监会、国家乡村振兴局等部委发布的《关于金融服务乡村振兴的指导意见》中关于推进绿色乡村振兴的要求，努力围绕脱贫县实际，创新探索结合绿色金融属性和乡村振兴属性的金融产品。

在党建引领下，公司积极助力脱贫县跨越与发达地区之间的资本鸿沟、知识鸿沟、市场鸿沟、社会鸿沟，巩固脱贫成果，接续乡村振兴，持续担起时代责任。

第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

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

适用 不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	商贸集团、人福医药、湖北省联发、陕西大德、宁波信达、中航信托、苏州建丰、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	自公司股票上市之日起36个月内，不转让或者委托他人管理直接或间接持有的公司公开发行股票前已发行的股份，也不由公司回购该部分股份。	自上市之日起满36个月	是	是	-	-
	股份限售	商贸集团、人福医药、湖北省联发	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的5%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	当代科技	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的3.18%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	上海天阖	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的2.18%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	当代文体	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的1.05%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-

	股份限售	三特索道	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的0.55%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	商贸集团、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	若未履行相关承诺，本公司将在股东大会及中国证监会指定媒体上进行公开道歉。同时在符合法律、法规及规范性文件规定的情况下10个交易日内回购该违规卖出的股票，且自回购完成之日起自动延长持有的全部股份的锁定期6个月。在认定未履行上述承诺的事实发生之日起停止在公司的分红、持有的公司股份将不得转让，直至原违规卖出的股票已购回完毕。	长期有效	否	是	-	-
	解决同业竞争	商贸集团、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	<ol style="list-style-type: none"> 1. 本公司/企业确认：本公司/企业及本公司/企业直接、间接控制的公司、企业不存在与天风证券及其子公司构成实质性同业竞争的业务和经营； 2. 本公司/企业作为天风证券股东期间，不会在中国境内或境外，以任何方式（包括但不限于单独经营、通过合资经营或拥有另一公司或企业的股份及其它权益，或通过他人代本公司/企业经营）直接或间接从事与天风证券（包括其控股子公司，下同）相同或相似的业务； 3. 本公司/企业承诺：将采取合法及有效的措施，促使本公司/企业的其他控股、参股子公司不从事与天风证券相同或相似的业务，如果有同时适用于天风证券和本公司/企业其他控股、参股子公司进行商业开发的机会，天风证券在同等条件下享有优先选择权； 4. 本公司/企业承诺给予天风证券与本公司/企业其他控股、参股子公司同等待遇，避免损害天风证券及天风证券中小股东的利益； 5. 对于天风证券的正常生产、经营活动，本公司/企业保证不利用股东地位损害天风证券及天风证券中小股东的利益； 6. 本公司/企业保证上述承诺在 	长期有效	否	是	-	-

			<p>本公司/企业作为天风证券股东期间持续有效，并不可撤销。如有任何违反上述承诺的事项发生，本公司/企业承担因此给天风证券造成的一切损失（含直接损失和间接损失），如本公司/企业因违反本承诺的内容而从中受益，本公司/企业同意将所得收益返还给天风证券；</p> <p>7. 本公司/企业无合法理由违反与避免同业竞争有关的事项，或者未依法执行相应措施的，天风证券有权扣留应向本公司/企业支付的分红款，本公司/企业持有的天风证券股份不得转让，直至本公司/企业依法遵守有关承诺或依法执行有关约束措施。</p>					
解决关联交易	商贸集团、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	<p>1. 本公司/企业将尽量减少和规范与天风证券及其控股子公司之间发生关联交易；</p> <p>2. 不以向天风证券拆借、占用天风证券资金或采取由天风证券代垫款项、代偿债务等任何方式侵占天风证券资金或挪用、侵占天风证券资产或其他资源；不要求天风证券及其控股子公司违法违规提供担保；</p> <p>3. 对于与天风证券及其控股子公司之间确有必要进行的关联交易，均将严格遵守公平公允、等价有偿的原则，公平合理地进行；关联交易均以签订书面合同或协议形式明确约定，并严格遵守有关法律、规范性文件以及天风证券公司章程、股东大会事规则、关联交易实施细则等相关规定，履行各项审批程序和信息披露义务，切实保护天风证券和天风证券其他股东利益；</p> <p>4. 不通过关联交易损害天风证券以及天风证券其他股东的合法权益，如因违反上述承诺而损害天风证券及天风证券其他股东合法权益的，本公司/企业自愿赔偿由此对天风证券造成的一切损失；</p>	长期有效	否	是	-	-	

			5. 本公司/企业将促使并保证本公司的关联方遵守上述承诺，如有违反，本公司/企业自愿承担由此对天风证券造成的一切损失。					
	其他	商贸集团、人福医药、湖北省联发、陕西大德、宁波信达、中航信托、苏州建丰	在公司就稳定股价回购股份事宜召开的股东大会上，将对公司承诺的回购股份方案的相关议案投赞成票。	公司上市后三年内	是	是	-	-
	其他	全体董事	在公司就稳定股价回购股份事宜召开的董事会上，将对公司承诺的回购股份方案的相关议案投赞成票等。	公司上市后三年内	是	是	-	-
	其他	全体董事及高级管理人员	公司董事、高级管理人员针对公司填补回报措施能够得到切实履行作出如下承诺： 1. 承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益； 2. 承诺对董事和高级管理人员的职务消费行为进行约束； 3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动； 4. 承诺由董事会或薪酬委员会制定的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 5. 承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。	长期有效	否	是	-	-
与再融资相关的承诺	其他	全体董事、高级管理人员	1. 承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益； 2. 承诺对自身的职务消费行为进行约束； 3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动； 4. 承诺由董事会或董事会薪酬与考核委员会制定的薪酬制度与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相挂钩；	长期有效	否	是	-	-

			<p>5. 如公司未来实施股权激励计划，承诺拟公布的公司股权激励计划的行权条件与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相挂钩；</p> <p>6. 公司本次发行实施完毕前，若中国证券监督管理委员会作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足中国证监会该等规定的，届时将按照中国证监会的最新规定出具补充承诺；</p> <p>7. 若违反上述承诺或拒不履行上述承诺给公司或者股东造成损失的，愿意依法承担对公司或者股东的补偿责任。</p>					
	股份限售	非公开发行股票全体配售对象	<p>1. 认购本次非公开发行的股份，自本次非公开发行结束并上市之日起六个月内不得转让。</p> <p>2. 所取得的本次非公开发行的天风证券股票因天风证券分配股票股利、资本公积金转增股本等形式衍生取得的股票亦应遵守上述股份锁定安排。</p>	非公开发行结束之日起六个月内	是	是	-	-

二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

三、违规担保情况

适用 不适用

四、半年报审计情况

五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

□适用 √不适用

六、破产重整相关事项

□适用 √不适用

七、重大诉讼、仲裁事项

□本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 √本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司未发生上海证券交易所《股票上市规则》中规定的涉案金额超过人民币 1,000 万元且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10%以上的重大诉讼、仲裁事项。其他涉案金额超过 1,000 万元的诉讼及进展情况如下：

(一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

√适用 □不适用

事项概述及类型	查询索引
王国起与天风证券专利纠纷案	2019 年 2 月 21 日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007 号）
天风证券与银亿控股有限公司借款合同纠纷案	2019 年 2 月 21 日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007 号）
天风证券与龙跃实业集团有限公司借款合同纠纷案	2019 年 2 月 21 日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007 号）
天示(上海)企业管理有限公司与中拓(福建)实业有限公司、杭州华速实业有限公司期货纠纷案	2019 年 7 月 25 日披露的天风证券股份有限公司《关于控股子公司涉及诉讼的公告》（公告编号：2019-066 号）及 2021 年 4 月 28 日披露的《2020 年年度报告》

(二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

报告期内：									
起诉(申请)方	应诉(被申请)方	承担连带责任方	诉讼仲裁类型	诉讼(仲裁)基本情况	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)是否形成预计负债及金额	诉讼(仲裁)进展情况	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况
天风证券	方锦程、张莉莉	/	合同纠纷	见表下概述	277,395,300	/	见表下概述	见表下概述	见表下概述

天风证券诉方锦程、张莉莉、刘可武借款合同纠纷案，天风证券与方锦程开展股票质押业务，因方锦程质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天

风证券于2018年10月向湖北省高级人民法院提起对方锦程、配偶张莉莉、保证人刘可武的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币241,914,200.75元及利息、违约金等。为加快诉讼进程，我司于2019年8月2日向法院撤回对刘可武的起诉，2019年11月11日，湖北省高级人民法院作出（2018）鄂民初98号民事判决书，判决：1、方锦程向天风证券支付融资本金241,914,200.75元及利息（2018年3月21日至2018年8月12日欠付利息总额为2,707,636.05元；2018年8月14日之后的利息计算方式为以241,914,200.75元为基数，以年利率百分之十为标准，自2018年8月13日起计付至实际清偿之日止）；2、方锦程向天风证券支付违约金（以241,914,200.75元为基数，以日利率万分之三为标准，自2017年12月13日起计付至2018年9月13日；以241,914,200.75元为基数，以年利率百分之十四为标准，自2018年9月14日起计付至实际清偿之日止）；3、方锦程向天风证券支付律师费20万元，财产保全责任保险费166,437.16元，公告费780元；4、天风证券可在本判决第一、二、三项确定的融资本金、利息、违约金以及相关实现债权费用范围内以方锦程提供质押的31,273,400股方盛制药股票（证券代码603998）折价、拍卖或变卖所得价款优先受偿；5、驳回天风证券其他诉讼请求。2019年12月6日，天风证券收到张莉莉的民事上诉状，上诉请求为：1、请求撤销判决第四项，改判涉案31,273,400股方盛制药股票（证券代码603998）中的二分之一属无效抵押，方锦程仅以涉案31,273,400股方盛制药股票中的二分之一折价、拍卖或变卖所得价款支付本案债务；2、上诉费由天风证券承担。2020年11月，最高院作出二审判决，判决驳回上诉，维持原判。同月，武汉市中级人民法院执行立案，案号为2020鄂01执2281号，目前尚在执行程序中。2021年2月，武汉中院作出执行裁定，将标的股票由不可售冻结变更为可售冻结，并在债权范围内强制卖出方盛制药股票及相应孳息等，天风证券已通过二级市场处置部分质押物。2021年5月，最高人民法院受理张莉莉的再审申请，案号为（2021）最高法民申3045号。

（三）公司本报告期被处罚和公开谴责的情况

适用 不适用

（四）其他说明

适用 不适用

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

适用 不适用

九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

公司无控股股东及实际控制人。报告期内，公司及第一大股东不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十、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) 资产收购或股权收购、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

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) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务

适用 不适用

(六) 其他重大关联交易

适用 不适用

(七) 其他

适用 不适用

公司严格按照上海证券交易所《股票上市规则》《上市公司关联交易实施指引》及公司内部有关规章制度开展关联交易。公司关联交易遵循公平、公开、公允的原则，关联交易协议的签订遵循平等、自愿、等价、有偿的原则，按照市场价格进行。

报告期内，公司日常关联交易按照公司 2020 年度股东大会审议通过的《关于确认 2020 年度日常关联交易及预计 2021 年度日常关联交易的议案》执行，具体披露情况详见本报告第十节财务报告附注中的“关联方及关联交易”内容（依据企业会计准则编制）。

十一、 重大合同及其履行情况

1 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

2 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）															
担保方	担保方与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期（协议签署日）	担保起始日	担保到期日	担保类型	主债务情况	担保物（如有）	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	反担保情况	是否为关联方担保	关联关系
无															
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）							0								
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）							0								
公司对子公司的担保情况															
报告期内对子公司担保发生额合计							0								
报告期末对子公司担保余额合计（B）							8.18								
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）															
担保总额（A+B）							8.18								
担保总额占公司净资产的比例（%）							3.16								
其中：															
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）							0								
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）							0								
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）							0								
上述三项担保金额合计（C+D+E）							0								
未到期担保可能承担连带清偿责任说明							不适用								
担保情况说明							1. 报告期内，公司的担保事项为：为子公司天风资管提供净资本担保承诺。截至2021年6月30日，上述担保余额为8.18亿元。 2. 担保发生额为当年新增额，不含当年减少额。								

3 其他重大合同

适用 不适用

十二、 其他重大事项的说明

适用 不适用

第七节 股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、股份变动情况表

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	2,827,487,342	42.42	+1,999,790,184	/	/	/	+1,999,790,184	4,827,277,526	55.71
1、国家持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
2、国有法人持股	1,366,012,479	20.49	+259,961,338	/	/	/	+259,961,338	1,625,973,817	18.76
3、其他内资持股	1,461,474,863	21.92	+1,739,828,846	/	/	/	+1,739,828,846	3,201,303,709	36.94
其中：境内非国有法人持股	1,461,474,863	21.92	+1,739,828,846	/	/	/	+1,739,828,846	3,201,303,709	36.94
境内自然人持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
4、外资持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
其中：境外法人持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
境外自然人持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
二、无限售条件流通股份	3,838,479,938	57.58	/	/	/	/	/	3,838,479,938	44.29
1、人民币普通股	3,838,479,938	57.58	/	/	/	/	/	3,838,479,938	44.29
2、境内上市的外资股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
3、境外上市的外资股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
4、其他	/	/	/	/	/	/	/	/	/
三、股份总数	6,665,967,280	100.00	+1,999,790,184	/	/	/	+1,999,790,184	8,665,757,464	100.00

2、 股份变动情况说明

√适用 □不适用

经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]962号文《关于核准天风证券股份有限公司非公开发行股票的批复》核准，同意公司非公开发行不超过1,999,790,184股新股。报告期内，公司非公开发行1,999,790,184股限售流通股，限售期6个月。本次非公开发行后，公司股本总数变更为8,665,757,464股。（详见公司公告，公告编号：2021-031号）

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

□适用 √不适用

4、 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

□适用 √不适用

(二) 限售股份变动情况

√适用 □不适用

单位：股

股东名称	期初限售股数	报告期解除限售股数	报告期增加限售股数	报告期末限售股数	限售原因	解除限售日期
中国人寿资管-广发银行-国寿资产-优势甄选2102 保险资产管理产品	0	0	244,498,777	244,498,777	认购非公开发行股份	2021-10-29
广东恒健国际投资有限公司	0	0	195,599,022	195,599,022	认购非公开发行股份	2021-10-29
武汉金融控股（集团）有限公司	0	0	195,599,022	195,599,022	认购非公开发行股份	2021-10-29
西安自贸港供应链管理有限公司	0	0	146,699,266	146,699,266	认购非公开发行股份	2021-10-29
文峰大世界连锁发展股份有限公司	0	0	122,249,388	122,249,388	认购非公开发行股份	2021-10-29
西安曲江祥汇投资管理有限公司-西安曲江祥汇睿恒2号私募证券投资基金	0	0	122,249,388	122,249,388	认购非公开发行股份	2021-10-29
中国银河证券股份有限公司	0	0	121,795,080	121,795,080	认购非公开发行股份	2021-10-29
中意资管-兴业银行-中意资产-优势企业16号资产管理产品	0	0	100,244,498	100,244,498	认购非公开发行股份	2021-10-29
申万宏源证券有限公司	0	0	91,442,542	91,442,542	认购非公开发行股份	2021-10-29
开源证券股份有限公司	0	0	61,124,694	61,124,694	认购非公开发行股份	2021-10-29

四川国经资本控股有限公司	0	0	61,124,694	61,124,694	认购非公开发行股份	2021-10-29
联储证券有限责任公司	0	0	61,124,694	61,124,694	认购非公开发行股份	2021-10-29
南方天辰(北京)投资管理有限公司-南方天辰景晟7期私募证券投资基金	0	0	61,124,694	61,124,694	认购非公开发行股份	2021-10-29
东海证券股份有限公司	0	0	61,124,694	61,124,694	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-中国国际金融股份有限公司-财通基金玉泉添鑫1号单一资产管理计划	0	0	7,823,961	7,823,961	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-野村东方国际证券有限公司-财通基金建兴定增2103号单一资产管理计划	0	0	30,073,350	30,073,350	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-上海潞安投资有限公司-财通基金潞安定增优选1号单一资产管理计划	0	0	36,674,816	36,674,816	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-华贵人寿保险股份有限公司-分红险资金-财通基金增值1号单一资产管理计划	0	0	31,784,841	31,784,841	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-陕西金资金风投资基金(有限合伙)-财通基金金资金风1号单一资产管理计划	0	0	25,672,371	25,672,371	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-华泰证券股份有限公司-财通基金君泰一期单一资产管理计划	0	0	63,569,682	63,569,682	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-莫明华-财通基金玉泉1098号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-保盛和锐1号私募证券投资基金-财通基金玉泉1100号单一资产管理计划	0	0	3,765,281	3,765,281	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-谭勇-财通基金玉泉1101号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-中珏中钜增利一号私募证券投资基金-财通基金玉泉1102号单一资产管理计划	0	0	1,955,990	1,955,990	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-王云峰-财通基金玉泉1105号单一资产管理计划	0	0	4,865,526	4,865,526	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-周志斌-财通基金玉泉1106号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-宦茹-财通基金玉泉1107号单一资产管理计划	0	0	2,567,237	2,567,237	认购非公开发行股份	2021-10-29

财通基金-首创证券股份有限公司-财通基金汇通 1 号单一资产管理计划	0	0	1,222,494	1,222,494	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-杨愈静-财通基金玉泉 1108 号单一资产管理计划	0	0	4,889,976	4,889,976	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-孙韬雄-财通基金玉泉 963 号单一资产管理计划	0	0	244,499	244,499	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-汉汇韬略对冲 2 号私募证券投资基金-财通基金添盈增利 8 号单一资产管理计划	0	0	122,249	122,249	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-郑海鹏-财通基金安吉 259 号单一资产管理计划	0	0	3,422,983	3,422,983	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-黄锋-财通基金安吉 266 号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-汇誉锐进 1 号私募证券投资基金-财通基金安吉 267 号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-曾子熙-财通基金安吉 269 号单一资产管理计划	0	0	2,933,985	2,933,985	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-朱孔峰-财通基金安吉 276 号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-西部证券股份有限公司-财通基金西部定增 1 号单一资产管理计划	0	0	12,224,939	12,224,939	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-厦门国贸投资有限公司-财通基金国贸定增 2 号单一资产管理计划	0	0	19,559,902	19,559,902	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-上海朗程投资管理有限公司-财通基金玉泉 1006 号单一资产管理计划	0	0	244,499	244,499	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-湖南日报优选定增 1 号私募证券投资基金-财通基金湘报优选 1 号单一资产管理计划	0	0	733,496	733,496	认购非公开发行股份	2021-10-29
认购非公开发行股份财通基金-季利琴-财通基金安吉 257 号单一资产管理计划	0	0	2,444,988	2,444,988	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-荆州市古城国有投资有限责任公司-财通基金安吉 258 号单一资产管理计划	0	0	4,816,626	4,816,626	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-财信证券有限责任公司-财通基金财	0	0	1,222,494	1,222,494	认购非公开发行股份	2021-10-29

信长盈 1 号单一资产管理计划						
财通基金-悬铃增强 21 号私募证券投资基金-财通基金悬铃 1 号单一资产管理计划	0	0	244,499	244,499	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-叶峰-财通基金安吉 260 号单一资产管理计划	0	0	14,914,425	14,914,425	认购非公开发行股份	2021-10-29
财通基金-中航信托股份有限公司-财通基金安吉 225 号单一资产管理计划	0	0	61,124,694	61,124,694	认购非公开发行股份	2021-10-29
合计	0	0	1,999,790,184	1,999,790,184	/	/

二、股东情况

(一) 股东总数:

截止报告期末普通股股东总数(户)	199,589
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	不适用

(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、标记或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
武汉商贸集团有限公司	-62,000,000	698,988,942	8.07	636,652,755	无	/	国有法人
人福医药集团股份有限公司	0	680,087,537	7.85	523,144,259	质押	523,144,259	境内非国有法人
湖北省联合发展投资集团有限公司	0	519,359,753	5.99	519,359,724	无	/	国有法人
中国人寿资管—广发银行—国寿资产—优势甄选2102保险资产管理产品	244,498,777	244,498,777	2.82	244,498,777	无	/	境内非国有法人
陕西大德投资集团有限责任公司	-5,739,940	243,360,153	2.81	229,410,093	无	/	境内非国有法人
宁波信达天赢投资合伙企业(有限合伙)	0	240,498,500	2.78	210,000,000	无	/	境内非国有法人
中航信托股份有限公司	0	200,000,000	2.31	200,000,000	无	/	境内非国有法人
武汉金融控股(集团)有限公司	195,599,022	195,599,022	2.26	195,599,022	无	/	国有法人
广东恒健国际投资有限公司	195,599,022	195,599,022	2.26	195,599,022	无	/	境内非国有法人
苏州建丰投资中心(有限合伙)	0	184,000,000	2.12	184,000,000	无	/	境内非国有法人

注:武汉商贸集团有限公司将其持有的6,200万股公司股份进行了转融通出借业务,该部分股份所有权未发生转移。

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
人福医药集团股份公司	156,943,278	人民币普通股	156,943,278
武汉高科国有控股集团有限公司	148,186,629	人民币普通股	148,186,629
湖北省科技投资集团有限公司	87,432,180	人民币普通股	87,432,180
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	71,831,760	人民币普通股	71,831,760
香港中央结算有限公司	69,112,858	人民币普通股	69,112,858
上海天霁投资合伙企业（有限合伙）	67,600,000	人民币普通股	67,600,000
武汉商贸集团有限公司	62,336,187	人民币普通股	62,336,187
四川华西集团有限公司	52,424,362	人民币普通股	52,424,362
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	51,850,760	人民币普通股	51,850,760
张武	35,000,000	人民币普通股	35,000,000
前十名股东中回购专户情况说明	无		
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	无		
上述股东关联关系或一致行动的说明	无		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用		

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件
适用 不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	武汉商贸集团有限公司	636,652,755	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月
2	人福医药集团股份公司	523,144,259	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月
3	湖北省联合发展投资集团有限公司	519,359,724	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月
4	中国人寿资管—广发银行—国寿资产—优势甄选2102保险资产管理产品	244,498,777	2021-10-29	0	自上市之日起满6个月
5	陕西大德投资集团有限责任公司	229,410,093	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月
6	宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	210,000,000	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月

7	中航信托股份有限公司	200,000,000	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月
8	武汉金融控股(集团)有限公司	195,599,022	2021-10-29	0	自上市之日起满6个月
9	广东恒健国际投资有限公司	195,599,022	2021-10-29	0	自上市之日起满6个月
10	苏州建丰投资中心(有限合伙)	184,000,000	2021-10-19	0	自上市之日起满36个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		无			

(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

三、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

(三) 其他说明

适用 不适用

四、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

第八节 优先股相关情况

适用 不适用

第九节 债券相关情况

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

√适用 □不适用

(一) 企业债券

□适用 √不适用

(二) 公司债券

√适用 □不适用

1. 公司债券基本情况

单位：万元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在 终止上市 交易的风 险
天风证券股份有限公司2016年公司债券 (第二期)	16天风02	136676.SH	2016-8-30	2016-08-31	2021-08-31	130,000	3.48	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2020年公开发行短期公司债券(第一期)	20天风S1	163826.SH	2020-10-15	2020-10-19	2021-10-19	200,000	3.65	到期一次还本付息	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

天风证券股份有限公司2020年公开发行短期公司债券（第二期）	20 天风 S2	163850. SH	2020-12-03	2020-12-08	2021-12-08	100,000	3.8	到期一次还本付息	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2017年次级债券	17 天风次	145466. SH	2017-04-10	2017-04-11	2022-04-11	100,000	5.2	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券（第一期）	19 天风 01	151401. SH	2019-04-15	2019-04-18	2022-04-18	120,000	4.3	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司公开发行2017年公司债券（第一期）	17 天风 01	143127. SH	2017-06-23	2017-06-26	2022-06-26	150,000	2.9	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2019年次级债券（第一期）	19 天风 C1	151841. SH	2019-08-23	2019-08-27	2022-08-27	75,000	4.99	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券（第二期）	19 天风 02	162113. SH	2019-09-09	2019-09-11	2022-09-11	130,000	4.47	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券（第三期）	19 天风 03	162279. SH	2019-10-16	2019-10-18	2022-10-18	50,000	4.3	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司公开发行2017年公司债券（第二期）	17 天风 02	143358. SH	2017-10-24	2017-10-25	2022-10-25	50,000	4	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

天风证券 N2022	天风证券 4.3% N2022	40090. HK	2019-12-09	2019-12-09	2022-12-09	129,202	4.3	每半年付息一次,到期一次还本	澳门金交所	面向专业投资者发行	场外市场报价询价交易	否
天风证券 N2022	天风证券 4.3% N2022(重开)	40090x. HK	2019-12-09	2019-12-09	2022-12-09	64,601	4.3	每半年付息一次,到期一次还本	澳门金交所	面向专业投资者发行	场外市场报价询价交易	否
天风证券股份有限公司 2020 年次级债券 (第一期)品种一	20 天风 C1	166128. SH	2020-02-25	2020-02-27	2023-02-27	67,000	3.9	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年公司债券 (第二期)	21 天风 02	175815. SH	2021-03-10	2021-03-12	2023-03-12	80,000	4.5	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券 (第一期)	18 天风 01	143497. SH	2018-03-09	2018-03-14	2023-03-14	208,400	4	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券 (第二期)	18 天风 02	143534. SH	2018-03-22	2018-03-27	2023-03-27	59,347	4.1	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券(第一期)(疫情防控债)	20 天风 01	163423. SH	2020-04-13	2020-04-15	2023-04-15	150,000	2.87	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2020 年非公开发行	20 天风 C3	167109. SH	2020-06-19	2020-06-23	2023-06-23	180,000	4.7	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

次级债券（第一期） （品种一）												
天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年公司债券（第三期）	21 天风 04	188302.SH	2021-06-24	2021-06-28	2023-06-28	200,000	4.12	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年公司债券（第一期）	21 天风 01	175645.SH	2021-01-15	2021-01-19	2024-01-19	70,000	4.18	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2020 年次级债券（第一期）品种二	20 天风 C2	166129.SH	2020-02-25	2020-02-27	2025-02-27	108,000	4.9	每年付息一次，到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

逾期未偿还债券

适用 不适用

关于逾期债项的说明

适用 不适用

2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

3. 信用评级结果调整情况

适用 不适用

4. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及其影响

适用 不适用

5. 公司债券其他情况的说明

□适用 √不适用

(三) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

□适用 √不适用

(四) 主要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	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)	变动原因
流动比率	2.81	2.45	14.69	
速动比率	2.55	2.16	18.06	
资产负债率(%)	62.24	68.14	-8.66	
	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)	变动原因
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	287,091,034.60	407,891,864.44	-29.62	
EBITDA 全部债务比	0.03	0.03		
利息保障倍数	1.52	1.81	-16.02	
现金利息保障倍数	1.03	-0.52	不适用	经营活动产生的现金流量净额增加导致
EBITDA 利息保障倍数	1.63	1.88	-13.30	
贷款偿还率(%)	100.00	100.00		
利息偿付率(%)	100.00	100.00		

(五) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

二、可转换公司债券情况

□适用 √不适用

第十节 财务报告

一、审计报告

□适用 √不适用

二、财务报表

合并资产负债表

2021年6月30日

编制单位：天风证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年6月30日	2020年12月31日
资产：			
货币资金	1	17,689,997,977.08	14,622,925,091.99
其中：客户资金存款		10,045,449,981.64	8,914,812,690.27
结算备付金	2	2,968,391,374.12	2,092,593,710.63
其中：客户备付金		1,705,434,958.75	1,180,195,256.20
贵金属	3		
拆出资金	4	1,000,578,305.55	600,408,750.00
融出资金	5	4,960,458,031.84	5,617,229,266.37
衍生金融资产	6	99,139.95	
存出保证金	7	3,969,215,511.65	3,234,252,212.13
应收款项	8	1,460,074,231.47	1,395,310,400.35
应收款项融资	9		
合同资产	10		
买入返售金融资产	11	2,690,026,255.04	3,624,293,940.73
持有待售资产	12		
金融投资：			
交易性金融资产	13	32,478,496,814.90	27,805,124,322.55
债权投资	14	1,371,592,290.62	
其他债权投资	15	1,304,530,152.48	1,468,154,478.25
其他权益工具投资	16	3,171,314,910.83	3,279,330,455.93
长期股权投资	17	4,531,064,077.99	4,520,616,956.01
投资性房地产	18	147,215,249.98	150,357,512.25
固定资产	19	714,438,954.34	116,727,952.18
在建工程	20	130,136,913.12	562,819,585.16
使用权资产	21	376,856,269.14	
无形资产	22	373,585,711.89	573,323,775.92
商誉	23	66,634,466.97	66,634,466.97
递延所得税资产	24	291,649,675.19	294,193,220.00
其他资产	25	14,617,492,089.18	11,380,810,684.03
资产总计		94,313,848,403.33	81,405,106,781.45
负债：			

短期借款	29	610,672,724.00	630,073,044.46
应付短期融资款	30	4,767,215,436.48	8,132,246,488.92
拆入资金	31	1,130,427,277.78	1,446,215,777.77
交易性金融负债	32	86,543,621.84	26,120,694.97
衍生金融负债	6	33,239,107.51	5,389,968.02
卖出回购金融资产款	33	11,911,176,842.71	8,308,264,661.37
代理买卖证券款	34	13,746,616,611.23	11,584,902,888.04
代理承销证券款	35	150,000,000.00	
应付职工薪酬	36	180,022,503.98	338,522,881.20
应交税费	37	107,833,855.33	168,357,651.12
应付款项	38	146,629,069.65	279,975,921.11
合同负债	39	43,437,323.31	51,784,278.10
持有待售负债	40		
预计负债	41		
长期借款	42	1,189,305,876.00	1,189,306,800.00
应付债券	43	26,429,749,094.86	24,371,607,466.49
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	44	370,675,685.15	
递延收益	45	87,000.00	87,000.00
递延所得税负债	24	359,030,396.93	287,172,116.59
其他负债	46	2,683,839,311.74	2,342,042,230.59
负债合计		63,946,501,738.50	59,162,069,868.75
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	47	8,665,757,464.00	6,665,967,280.00
其他权益工具	48		
其中：优先股			
永续债			
资本公积	49	14,041,610,564.26	7,915,543,266.46
减：库存股	50		
其他综合收益	51	-494,558,670.87	-469,026,061.83
盈余公积	52	331,425,315.71	331,425,315.71
一般风险准备	53	731,149,806.83	722,474,379.80
未分配利润	54	2,606,549,414.76	2,293,707,677.58
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		25,881,933,894.69	17,460,091,857.72
少数股东权益		4,485,412,770.14	4,782,945,054.98
所有者权益（或股东权益）合计		30,367,346,664.83	22,243,036,912.70
负债和所有者权益（或股东权益）总计		94,313,848,403.33	81,405,106,781.45

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司资产负债表

2021年6月30日

编制单位：天风证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年6月30日	2020年12月31日
资产：			
货币资金		13,131,835,539.16	10,090,785,509.59
其中：客户资金存款		6,801,460,770.82	5,501,192,472.76
结算备付金		2,590,154,450.07	2,504,785,598.08
其中：客户备付金		902,004,995.75	1,180,195,256.20
贵金属			
拆出资金		1,000,578,305.55	600,408,750.00
融出资金		4,896,526,012.13	5,579,441,537.05
衍生金融资产			
存出保证金		607,970,799.12	586,304,207.86
应收款项		911,639,721.49	918,302,873.83
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产		2,600,197,216.95	3,313,798,523.37
持有待售资产			
金融投资：			
交易性金融资产		29,619,458,799.66	25,126,889,082.80
债权投资		1,472,927,908.26	105,116,439.56
其他债权投资		556,142,771.50	737,136,193.01
其他权益工具投资		221,637,522.05	238,149,768.75
长期股权投资	1	8,709,645,814.75	7,921,404,635.70
投资性房地产		15,940,739.70	16,321,589.88
固定资产		78,146,739.64	81,303,783.18
在建工程		130,136,913.12	118,371,851.75
使用权资产		348,867,670.61	
无形资产		89,920,044.01	95,266,955.58
商誉			
递延所得税资产		164,038,007.40	175,991,974.73
其他资产		12,816,615,230.30	9,800,327,174.05
资产总计		79,962,380,205.47	68,010,106,448.77
负债：			
短期借款		610,672,724.00	612,673,200.00
应付短期融资款		4,767,215,436.48	8,132,246,488.92
拆入资金		1,130,427,277.78	1,446,215,777.77
交易性金融负债			
衍生金融负债		33,239,107.51	5,071,235.02

卖出回购金融资产款		11,833,312,757.88	8,216,523,682.00
代理买卖证券款		7,299,993,151.92	6,343,644,072.56
代理承销证券款		150,000,000.00	
应付职工薪酬	2	129,437,371.70	246,760,777.21
应交税费		65,176,517.54	134,084,641.52
应付款项			
合同负债		21,029,206.55	19,486,098.98
持有待售负债			
预计负债			
长期借款		1,189,305,876.00	1,189,306,800.00
应付债券		26,414,211,387.05	24,351,406,216.99
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		343,096,279.24	
递延收益			
递延所得税负债		217,204,175.62	168,485,852.62
其他负债		674,816,605.77	327,739,068.13
负债合计		54,879,137,875.04	51,193,643,911.72
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		8,665,757,464.00	6,665,967,280.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		13,237,408,851.62	7,111,460,823.71
减：库存股			
其他综合收益		-180,280,765.54	-175,783,833.99
盈余公积		331,425,315.71	331,425,315.71
一般风险准备		718,153,198.51	716,560,701.48
未分配利润		2,310,778,266.13	2,166,832,250.14
所有者权益（或股东权益）合计		25,083,242,330.43	16,816,462,537.05
负债和所有者权益（或股东权益）总计		79,962,380,205.47	68,010,106,448.77

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

合并利润表

2021年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年半年度	2020年半年度
一、营业总收入		1,627,361,723.29	2,061,307,013.11
利息净收入	55	-297,891,994.19	-200,239,813.36

其中：利息收入		674,898,365.91	572,227,576.53
利息支出		972,790,360.10	772,467,389.89
手续费及佣金净收入	56	1,140,346,893.23	1,357,199,164.46
其中：经纪业务手续费净收入		454,307,706.99	334,011,803.28
投资银行业务手续费净收入		365,648,412.79	522,973,050.00
资产管理业务手续费净收入		284,981,207.23	421,900,555.43
投资收益（损失以“-”号填列）	57	657,671,321.61	830,490,935.06
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		7,166,437.29	75,733,250.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）	58		
其他收益	59	8,105,691.67	4,649,322.36
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	60	99,090,189.31	44,284,321.61
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,125,167.37	-247,537.45
其他业务收入	61	27,365,725.91	25,092,925.01
资产处置收益（损失以“-”号填列）	62	-200,936.88	77,695.42
二、营业总支出		1,184,301,801.21	1,442,455,076.59
税金及附加	63	11,610,720.63	16,340,729.91
业务及管理费	64	1,242,721,124.91	1,314,331,982.16
信用减值损失	65	-73,710,647.50	107,810,821.25
其他资产减值损失	66		
其他业务成本	67	3,680,603.17	3,971,543.27
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		443,059,922.08	618,851,936.52
加：营业外收入	68	58,485,097.25	2,097,937.38
减：营业外支出	69	9,270,378.85	10,562,268.04
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		492,274,640.48	610,387,605.86
减：所得税费用	70	96,341,241.26	70,145,249.26
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		395,933,399.22	540,242,356.60
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		395,933,399.22	540,242,356.60
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）		329,788,428.62	404,988,465.61
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		66,144,970.60	135,253,890.99
六、其他综合收益的税后净额	71	-38,873,675.34	-224,935,008.58
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-33,803,873.45	-87,014,579.12
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-36,249,516.41	-67,726,458.11

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		-36,249,516.41	-67,726,458.11
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		2,445,642.96	-19,288,121.01
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		3,280,684.69	105,835.17
2. 其他债权投资公允价值变动		1,705,952.97	-1,144,689.00
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		-1,338,015.23	26,600.71
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额		-1,202,979.47	-18,275,867.89
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		-5,069,801.89	-137,920,429.46
七、综合收益总额		357,059,723.88	315,307,348.02
归属于母公司所有者的综合收益总额		295,984,555.17	317,973,886.49
归属于少数股东的综合收益总额		61,075,168.71	-2,666,538.47
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益(元/股)		0.04	0.07
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.04	0.07

本期发生同一控制下企业合并的，被合并方在合并前实现的净利润为：0 元，上期被合并方实现的净利润为：0 元。

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司利润表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021 年半年度	2020 年半年度
一、营业总收入		976,508,171.86	1,658,776,363.87
利息净收入	3	-444,158,078.52	-258,972,667.10
其中：利息收入		416,866,523.58	459,229,958.83
利息支出		861,024,602.10	718,202,625.93
手续费及佣金净收入	4	738,962,020.53	1,241,741,245.40
其中：经纪业务手续费净收入		401,479,592.20	325,986,611.81
投资银行业务手续费净收入		312,404,761.57	472,602,287.02
资产管理业务手续费净收入			417,807,369.91
投资收益（损失以“—”号填列）	5	504,767,947.65	660,817,662.05
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		8,035,756.27	75,679,656.55

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		7,794,023.01	4,489,851.38
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6	161,143,796.98	10,441,902.65
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,034,111.17	134,494.66
其他业务收入		10,207,395.45	135,795.15
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-174,822.07	-11,920.32
二、营业总支出		827,327,963.31	1,242,104,544.85
税金及附加		9,112,695.77	14,789,313.73
业务及管理费	7	896,793,922.78	1,123,814,124.55
信用减值损失		-78,959,505.42	103,120,256.39
其他资产减值损失			
其他业务成本		380,850.18	380,850.18
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		149,180,208.55	416,671,819.02
加：营业外收入		57,921,259.15	1,870,172.93
减：营业外支出		9,088,629.11	10,506,741.67
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		198,012,838.59	408,035,250.28
减：所得税费用		50,245,928.22	83,276,892.82
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		147,766,910.37	324,758,357.46
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		147,766,910.37	324,758,357.46
（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		-6,725,328.90	414,138.73
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-11,603,104.87	1,426,391.85
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		-11,603,104.87	1,426,391.85
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		4,877,775.97	-1,012,253.12
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		3,280,684.69	105,835.17
2. 其他债权投资公允价值变动		1,705,952.97	-1,144,689.00
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		-108,861.69	26,600.71
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		141,041,581.47	325,172,496.19
八、每股收益：			

(一) 基本每股收益(元/股)			
(二) 稀释每股收益(元/股)			

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

合并现金流量表

2021年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年半年度	2020年半年度
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
向其他金融机构拆入资金净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,655,631,492.54	1,659,149,354.19
拆入资金净增加额		-310,000,000.00	200,074,861.11
回购业务资金净增加额		4,584,164,623.99	-1,223,272,225.76
融出资金净减少额		671,776,452.44	332,646,084.72
代理买卖证券收到的现金净额		1,640,484,601.68	3,551,066,341.46
收到其他与经营活动有关的现金	72(1)	1,932,615,861.76	312,980,528.86
经营活动现金流入小计		10,174,673,032.41	4,832,644,944.58
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,523,699,519.83	3,735,056,004.21
拆出资金净增加额		426,937,019.18	
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		356,420,379.80	317,768,831.29
支付给职工及为职工支付的现金		903,072,055.32	852,436,763.15
支付的各项税费		214,776,768.14	245,580,832.29
支付其他与经营活动有关的现金	72(2)	4,789,128,766.34	662,725,011.60
经营活动现金流出小计		10,214,034,508.61	5,813,567,442.54
经营活动产生的现金流量净额		-39,361,476.20	-980,922,497.96
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		873,233,662.26	730,000,000.00
取得投资收益收到的现金		64,774,633.40	45,964,547.47
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		4,736.12	
收到其他与投资活动有关的现金		104,549,835.78	
投资活动现金流入小计		1,042,562,867.56	775,964,547.47
投资支付的现金		2,426,585,294.58	4,360,338,147.98
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		77,615,925.54	297,664,984.60

取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金		40,005,000.00	3,702,525.87
投资活动现金流出小计		2,544,206,220.12	4,661,705,658.45
投资活动产生的现金流量净额		-1,501,643,352.56	-3,885,741,110.98
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		8,125,738,211.91	5,324,648,626.18
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		3,280,852,298.64	5,901,800,000.00
发行债券收到的现金		7,030,000,000.00	6,130,086,491.02
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		18,436,590,510.55	17,356,535,117.20
偿还债务支付的现金		11,665,010,000.00	6,684,662,532.53
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		943,122,195.41	676,360,211.14
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金		343,542,153.37	19,598,491.02
筹资活动现金流出小计		12,951,674,348.78	7,380,621,234.69
筹资活动产生的现金流量净额		5,484,916,161.77	9,975,913,882.51
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-16,843,889.45	-247,537.45
五、现金及现金等价物净增加额		3,927,067,443.56	5,109,002,736.12
加：期初现金及现金等价物余额		16,664,104,074.30	10,740,413,953.43
六、期末现金及现金等价物余额		20,591,171,517.86	15,849,416,689.55

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司现金流量表

2021年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年半年度	2020年半年度
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
向其他金融机构拆入资金净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,336,375,589.49	1,548,955,365.99
拆入资金净增加额		-310,000,000.00	200,074,861.11
回购业务资金净增加额		4,408,481,047.02	-797,636,238.29
融出资金净减少额		671,776,452.44	332,911,184.39
代理买卖证券收到的现金净额		1,106,349,079.36	2,737,628,046.51
收到其他与经营活动有关的现金		524,636,951.83	20,000,000.00

经营活动现金流入小计		7,737,619,120.14	4,041,933,219.71
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,778,778,220.12	3,119,031,702.74
拆出资金净增加额		400,000,000.00	
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		341,100,952.69	235,450,015.54
支付给职工及为职工支付的现金		750,229,695.41	739,538,159.04
支付的各项税费		162,785,934.57	240,702,872.56
支付其他与经营活动有关的现金		3,548,371,920.45	3,287,929,771.93
经营活动现金流出小计		8,981,266,723.24	7,622,652,521.81
经营活动产生的现金流量净额		-1,243,647,603.10	-3,580,719,302.10
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		295,068,483.94	730,000,000.00
取得投资收益收到的现金		2,739,919.25	
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			34,622,493.73
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		297,808,403.19	764,622,493.73
投资支付的现金		2,061,636,954.58	3,357,968,604.35
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		32,783,231.79	33,094,262.26
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		2,094,420,186.37	3,391,062,866.61
投资活动产生的现金流量净额		-1,796,611,783.18	-2,626,440,372.88
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		8,125,738,211.91	5,324,648,626.18
取得借款收到的现金		2,532,600,000.00	5,901,800,000.00
发行债券收到的现金		7,030,000,000.00	6,130,086,491.02
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		17,688,338,211.91	17,356,535,117.20
偿还债务支付的现金		10,668,310,000.00	6,387,900,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		852,908,329.93	588,050,996.95
支付其他与筹资活动有关的现金			9,566,491.02
筹资活动现金流出小计		11,521,218,329.93	6,985,517,487.97
筹资活动产生的现金流量净额		6,167,119,881.98	10,371,017,629.23
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-2,034,111.17	134,494.66
五、现金及现金等价物净增加额		3,124,826,384.53	4,163,992,448.91
加：期初现金及现金等价物余额		12,557,098,288.06	9,264,237,625.72
六、期末现金及现金等价物余额		15,681,924,672.59	13,428,230,074.63

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

合并所有者权益变动表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年半年度											
	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)	其他权益工具			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
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	6,665,967,280.00				7,915,543,266.46		-469,026,061.83	331,425,315.71	722,474,379.80	2,293,707,677.58	4,782,945,054.98	22,243,036,912.70
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	6,665,967,280.00				7,915,543,266.46		-469,026,061.83	331,425,315.71	722,474,379.80	2,293,707,677.58	4,782,945,054.98	22,243,036,912.70
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	1,999,790,184.00				6,126,067,297.80		-25,532,609.04		8,675,427.03	312,841,737.18	-297,532,284.84	8,124,309,752.13
(一) 综合收益总额							-33,803,873.45			329,788,428.62	61,075,168.71	357,059,723.88
(二) 所有者投入和减少资本	1,999,790,184.00				6,126,067,297.80						-358,607,453.55	7,767,250,028.25
1. 所有者投入的普通股	1,999,790,184.00				6,125,948,027.91							8,125,738,211.91
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					119,269.89						-358,607,453.55	-358,488,183.66
(三) 利润分配									8,675,427.03	-8,675,427.03		
1. 提取盈余公积												
2. 提取一般风险准备									8,675,427.03	-8,675,427.03		
3. 对所有者(或股东)的分配												
4. 其他												

(四) 所有者权益内部结转						8,271,264.41				-8,271,264.41		
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						8,271,264.41				-8,271,264.41		
6. 其他												
四、本期期末余额	8,665,757,464.00				14,041,610,564.26	-494,558,670.87	331,425,315.71	731,149,806.83	2,606,549,414.76	4,485,412,770.14	30,367,346,664.83	

项目	2020 年半年度											
	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)	其他权益工具			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
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	5,180,000,000.00				4,259,929,865.37		-241,330,968.35	292,289,870.75	619,594,651.18	2,012,666,643.86	5,384,096,469.56	17,507,246,532.37
加：会计政策变更								-389,150.95	-778,301.90	-2,724,056.61		-3,891,509.46
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	5,180,000,000.00				4,259,929,865.37		-241,330,968.35	291,900,719.80	618,816,349.28	2,009,942,587.25	5,384,096,469.56	17,503,355,022.91
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	1,485,967,280.00				3,840,255,486.81		-90,354,681.46		9,252,157.46	359,080,606.81	-258,554,777.34	5,345,646,072.28
(一) 综合收益总额							-87,014,579.12			404,988,465.61	-2,666,538.47	315,307,348.02
(二) 所有者投入和减少资本	1,485,967,280.00				3,840,255,486.81						-257,623,562.35	5,068,599,204.46
1. 所有者投入的普通股	1,485,967,280.00				3,838,681,346.18							5,324,648,626.18
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					1,574,140.63						-257,623,562.35	-256,049,421.72

(三) 利润分配											9,252,157.46	-49,247,961.14		-39,995,803.68
1. 提取盈余公积														
2. 提取一般风险准备											9,252,157.46	-9,252,157.46		
3. 对所有者(或股东)的分配													-39,995,803.68	-39,995,803.68
4. 其他														
(四) 所有者权益内部结转														
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														
6. 其他														
四、本期期末余额	6,665,967,280.00				8,100,185,352.18		-331,685,649.81	291,900,719.80	628,068,506.74	2,369,023,194.06	5,125,541,692.22		22,849,001,095.19	

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司所有者权益变动表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			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
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	6,665,967,280.00				7,111,460,823.71		-175,783,833.99	331,425,315.71	716,560,701.48	2,166,832,250.14	16,816,462,537.05
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	6,665,967,280.00				7,111,460,823.71		-175,783,833.99	331,425,315.71	716,560,701.48	2,166,832,250.14	16,816,462,537.05

2021 年半年度报告

三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	1,999,790,184.00			6,125,948,027.91		-4,496,931.55		1,592,497.03	143,946,015.99	8,266,779,793.38
(一) 综合收益总额						-6,725,328.90			147,766,910.37	141,041,581.47
(二) 所有者投入和减少资本	1,999,790,184.00			6,125,948,027.91						8,125,738,211.91
1. 所有者投入的普通股	1,999,790,184.00			6,125,948,027.91						8,125,738,211.91
2. 其他权益工具持有者投入资本										
3. 股份支付计入所有者权益的金额										
4. 其他										
(三) 利润分配								1,592,497.03	-1,592,497.03	
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备								1,592,497.03	-1,592,497.03	
3. 对所有者(或股东)的分配										
4. 其他										
(四) 所有者权益内部结转						2,228,397.35			-2,228,397.35	
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						2,228,397.35			-2,228,397.35	
6. 其他										
四、本期期末余额	8,665,757,464.00			13,237,408,851.62		-180,280,765.54	331,425,315.71	718,153,198.51	2,310,778,266.13	25,083,242,330.43

项目	2020 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			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
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		-151,253,075.11	292,289,870.75	619,594,651.18	1,952,243,949.94	11,350,179,324.21

2021 年半年度报告

加：会计政策变更							-389,150.95	-778,301.90	-2,724,056.61	-3,891,509.46
前期差错更正										
其他										
二、本年期初余额	5,180,000,000.00			3,457,303,927.45		-151,253,075.11	291,900,719.80	618,816,349.28	1,949,519,893.33	11,346,287,814.75
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	1,485,967,280.00			3,838,681,346.18		414,587.54		9,252,157.46	275,509,947.51	5,609,825,318.69
(一) 综合收益总额						414,138.73			324,758,357.46	325,172,496.19
(二) 所有者投入和减少资本	1,485,967,280.00			3,838,681,346.18						5,324,648,626.18
1. 所有者投入的普通股	1,485,967,280.00			3,838,681,346.18						5,324,648,626.18
2. 其他权益工具持有者投入资本										
3. 股份支付计入所有者权益的金额										
4. 其他										
(三) 利润分配								9,252,157.46	-49,247,961.14	-39,995,803.68
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备								9,252,157.46	-9,252,157.46	
3. 对所有者(或股东)的分配									-39,995,803.68	-39,995,803.68
4. 其他										
(四) 所有者权益内部结转						448.81			-448.81	
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						448.81			-448.81	
6. 其他										
四、本期期末余额	6,665,967,280.00			7,295,985,273.63		-150,838,487.57	291,900,719.80	628,068,506.74	2,225,029,840.84	16,956,113,133.44

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

三、公司基本情况

1. 公司概况

√适用 □不适用

天风证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）原名四川省天风证券经纪有限责任公司，原注册资本为人民币 7,700 万元。2004 年 4 月，公司更名为天风证券有限责任公司，并办理了工商变更登记手续。2008 年公司将注册地迁至湖北省武汉市，于 2008 年 2 月 27 日取得武汉市工商行政管理局核发的 420100000055793 号《企业法人营业执照》。

2012 年 2 月 14 日，根据公司 2011 年第四次临时股东会决议及修改后的章程规定，并经中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复》（证监许可[2012]96 号）核准，公司各股东以公司截至 2011 年 08 月 31 日止经审计的净资产折成天风证券股份有限公司股份 837,000,000 股，每股面值 1 元。该改制验资业经大信会计师事务所有限公司审验并出具大信验字[2012]第 2-0007 号验资报告验证。

2018 年 5 月 28 日，经中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券股份有限公司首次公开发行股票批复》（证监许可[2018]885 号）核准，公司采用公开发行方式发行人民币普通股（A 股）51,800 万股（每股面值 1 元），发行价格为每股 1.79 元，增加注册资本人民币 518,000,000.00 元，变更后的注册资本为人民币 5,180,000,000.00 元。

公司股票于 2018 年 10 月 19 日在上海交易所上市，股票代码：601162。

2020 年 1 月 18 日，经中国证券监督管理委员会证监许可（2020）39 号文核准，公司按每 10 股配售 3 股的比例配售股份。本次配股公开发行有效认购数量为 1,485,967,280 股，新增注册资本人民币 1,485,967,280.00 元，变更后的注册资本为人民币 6,665,967,280.00 元。

2021 年 3 月，经中国证券监督管理委员会证监许可（2021）962 号文核准，公司非公开发行 A 股股票 1,999,790,184 股，每股发行价格为人民币 4.09 元，增加注册资本人民币 1,999,790,184 元，变更后的注册资本为人民币 8,665,757,464.00 元。

公司地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法人代表：余磊

注册资本：人民币捌拾陆亿陆仟伍佰柒拾伍万柒仟肆佰陆拾肆元整

经营范围：为期货公司提供中间介绍业务。（上述经营范围中国家有专项规定的项目经审批后或凭许可证在核定范围与期限内经营）；证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；代销金融产品（凭许可证在核定范围及期限内经营）。（涉及许可经营项目，应取得相关部门许可后方可经营）。

公司对营业部实行了统一结算、统一风险管理、统一资金调拨、统一财务管理和会计核算。截止 2021 年 6 月 30 日，本公司共设有营业执照的 102 家营业部及 23 家分公司。

2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

本公司将全部子公司（包括本公司所控制的单独主体）纳入合并财务报表范围，包括被本公司控制的企业、被投资单位中可分割的部分以及结构化主体。

本公司纳入合并报表范围的子公司详见本报告“第十节财务报告十、1、在子公司中的权益”。

四、财务报表的编制基础

1. 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》和具体会计准则等规定（以下合称“企业会计准则”），并基于以下所述重要会计政策、会计估计进行编制。

2. 持续经营

√适用 □不适用

本公司财务报表以持续经营为基础，自报告期末起 12 个月不存在对持续经营能力产生重大怀疑。

五、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

本公司下列重要会计政策、会计估计根据企业会计准则制定。未提及的业务按企业会计准则中相关会计政策执行。

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. 营业周期

√适用 □不适用

本公司以一年 12 个月作为正常营业周期，并以营业周期作为资产和负债的流动性划分标准。

4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

5. 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) 同一控制下的企业合并

同一控制下企业合并形成的长期股权投资合并方以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式作为合并对价的，本公司在合并日按照所取得的被合并方在最终控制方合并财务报表中的净资产的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。合并方以发行权益性工具作为合并对价的，按发行股份的面值总额作为股本。长期股权投资的初始投资成本与合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，应当调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

(2) 非同一控制下的企业合并

对于非同一控制下的企业合并，合并成本为购买方在购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值之和。非同一控制下企业合并中所取得的被购买方符合确认条件的可辨认资产、负债及或有负债，在购买日以公允价值计量。购买方对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，体现为商誉价值。购买方对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，经复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期营业外收入。

6. 合并财务报表的编制方法

√适用 □不适用

(1) 合并财务报表范围

本公司将全部子公司（包括本公司所控制的单独主体）纳入合并财务报表范围，包括被本公司控制的企业、被投资单位中可分割的部分以及结构化主体。

本公司在评估是否控制结构化主体时，需要考虑：①投资方对被投资方的权力；②参与被投资方的相关活动而享有的可变回报；③有能力运用对被投资方的权力影响其回报的金额。

本公司在评估对结构化主体拥有的权力时，通常考虑下列四方面：

在设立被投资方时的决策及本公司的参与度；

相关合同安排；

仅在特定情况或事项发生时开展的相关活动；

本公司对被投资方做出的承诺。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需考虑本公司之决策行为是以主要责任人的身份进行还是以代理人的身份进行。考虑的因素通常包括本公司对结构化主体的决策权范围、其他方享有的实质性权利、本公司的报酬水平，以及本公司因持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。

(2) 统一母子公司的会计政策、统一母子公司的资产负债表日及会计期间

子公司与本公司采用的会计政策或会计期间不一致的，在编制合并财务报表时，按照本公司的会计政策或会计期间对子公司财务报表进行必要的调整。

（3）合并财务报表抵销事项

合并财务报表以母公司和子公司的资产负债表为基础，已抵销了母公司与子公司、子公司相互之间发生的内部交易。子公司所有者权益中不属于母公司的份额，作为少数股东权益，在合并资产负债表中所有者权益项目下以“少数股东权益”项目列示。子公司持有母公司的长期股权投资，视为企业集团的库存股，作为所有者权益的减项，在合并资产负债表中所有者权益项目下以“减：库存股”项目列示。

（4）合并取得子公司会计处理

对于同一控制下企业合并取得的子公司，视同该企业合并于自最终控制方开始实时控制时已经发生，从合并当期的期初起将其资产、负债、经营成果和现金流量纳入合并财务报表；对于非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其个别财务报表进行调整。

7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

√适用 □不适用

（1）合营安排的分类

合营安排分为共同经营和合营企业。未通过单独主体达成的合营安排，划分为共同经营。单独主体，是指具有单独可辨认的财务架构的主体，包括单独的法人主体和不具备法人主体资格但法律认可的主体。通过单独主体达成的合营安排，通常划分为合营企业。相关事实和情况变化导致合营方在合营安排中享有的权利和承担的义务发生变化的，合营方对合营安排的分类进行重新评估。

（2）共同经营的会计处理

共同经营参与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：确认单独所持有的资产或负债，以及按其份额确认共同持有的资产或负债；确认出售其享有的共同经营产出份额所产生的收入；按其份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；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。

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，参照共同经营参与方的规定进行会计处理；否则，应当按照相关企业会计准则的规定进行会计处理。

（3）合营企业的会计处理

合营企业参与方应当按照《企业会计准则第2号—长期股权投资》的规定对合营企业的投资进行会计处理，不享有共同控制的参与方应当根据其对该合营企业的影响程度进行会计处理。

8. 现金及现金等价物的确定标准

本公司在编制现金流量表时所确定的现金，是指本公司库存现金以及可以随时用于支付的存款。在编制现金流量表时所确定的现金等价物，是指持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

√适用 □不适用

(1) 外币业务折算

本公司对发生的外币交易，采用与交易发生日折合本位币入账。资产负债表日外币货币性项目按资产负债表日即期汇率折算，因该日的即期汇率与初始确认时或者前一资产负债表日即期汇率不同而产生的汇兑差额，除符合资本化条件的外币专门借款的汇兑差额在资本化期间予以资本化计入相关资产的成本外，均计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其记账本位币金额。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，折算后的记账本位币金额与原记账本位币金额的差额，作为公允价值变动(含汇率变动)处理，计入当期损益或确认为其他综合收益。

(2) 外币财务报表折算

本公司的控股子公司、合营企业、联营企业等，若采用与本公司不同的记账本位币，需对其外币财务报表折算后，再进行会计核算及合并财务报表的编报。资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率折算。折算产生的外币财务报表折算差额，在资产负债表中所有者权益项目其他综合收益下列示。外币现金流量按照系统合理方法确定的，采用交易发生日的即期汇率折算。汇率变动对现金的影响额，在现金流量表中单独列示。处置境外经营时，与该境外经营有关的外币报表折算差额，全部或按处置该境外经营的比例转入处置当期损益。

10. 金融工具

金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

√适用 □不适用

(1) 金融工具的分类及重分类

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。

1) 金融资产

本公司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本公司管理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。

本公司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：①本公司管理金融资产的业务模式既以收取合同现金流量又以出售该金融资产为目标；

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。

对于非交易性权益工具投资，本公司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。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

除分类为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之外的金融资产，本公司将其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，如果能消除或减少会计错配，本公司可以将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。

本公司改变管理金融资产的业务模式时，将对所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，且自重分类日起采用未来适用法进行相关会计处理，不对以前已经确认的利得、损失（包括减值损失或利得）或利息进行追溯调整。

2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；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；以摊余成本计量的金融负债。所有的金融负债不进行重分类。

(2) 金融工具的计量

本公司金融工具初始确认按照公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。因销售产品或提供劳务而产生的、未包含或不考虑重大融资成分的应收账款或应收票据，本公司按照预期有权收取的对价金额作为初始确认金额。金融工具的后续计量取决于其分类。

1) 金融资产

①以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

②以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产（除属于套期关系的一部分金融资产外），以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益。

③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

初始确认后，对于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、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失均计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

④指定为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

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。除获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益外，其他相关利得和损失均计入其他综合收益，且后续不转入当期损益。

2) 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

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，交易性金融负债公允价值变动形成的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

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，由企业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，计入其他综合收益，其他公允价值变动计入当期损益。如果对该金融负债的自身信用风险变动的影响计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配的，本公司将该金融负债的全部利得或损失计入当期损益。

②以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对此类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(3) 本公司对金融工具的公允价值的确认方法

如存在活跃市场的金融工具，以活跃市场中的报价确定其公允价值；如不存在活跃市场的金融工具，采用估值技术确定其公允价值。估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

在有限情况下，如果用以确定公允价值的近期信息不足，或者公允价值的可能估计金额分布范围很广，而成本代表了该范围内对公允价值的最佳估计的，该成本可代表其在该分布范围内对公允价值的恰当估计。本公司利用初始确认日后可获得的关于被投资方业绩和经营的所有信息，判断成本能否代表公允价值。

(4) 金融资产和金融负债转移的确认依据和计量方法

1) 金融资产

本公司金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；②该金融资产已转移，且本公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬；③该金融资产已转移，虽然本公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有报酬的，但未保留对该金融资产的控制。

本公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有报酬的，且未保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入被转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认相关负债。

金融资产转移整体满足终止确认条件的，将以下两项金额的差额计入当期损益：①被转移金融资产在终止确认日的账面价值；②因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益

的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为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）之和。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，先按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，然后将以下两项金额的差额计入当期损益：①终止确认部分在终止确认日的账面价值；②终止确认部分收到的对价，与原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）之和。

针对本公司指定为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终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

2) 金融负债

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本公司终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

金融负债（或其一部分）终止确认的，本公司将其账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，计入当期损益。

(5) 预期信用损失的确定方法及会计处理方法

1) 预期信用损失的确定方法

本公司以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产（含应收款项）、分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资（含应收款项融资）、租赁应收款进行减值会计处理并确认损失准备。

本公司在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否显著增加，将金融工具发生信用减值的过程分为三个阶段，对于不同阶段的金融工具减值采用不同的会计处理方法：第一阶段，金融工具的信用风险自初始确认后未显著增加的，本公司按照该金融工具未来12个月的预期信用损失计量损失准备，并按照其账面余额（即未扣除减值准备）和实际利率计算利息收入；第二阶段，金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加但未发生信用减值的，本公司按照该金融工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备，并按照其账面余额和实际利率计算利息收入；第三阶段，初始确认后发生信用减值的，本公司按照该金融工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备，并按照其摊余成本（账面余额减已计提减值准备）和实际利率计算利息收入。

①较低信用风险的金融工具计量损失准备的方法

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本公司可以不用与其初始确认时的信用风险进行比较，而直接做出该工具的信用风险自初始确认后未显著增加的假定。

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

②应收款项、租赁应收款计量损失准备的方法

对于不含重大融资成分的应收款项、合同资产，本公司始终按整个存续期预期信用损失计量损失准备。本公司基于历史信用损失经验计算上述金融资产的预期信用损失，相关历史经验根据资产负债表日债务人的特定因素、以及对当前状况和未来经济状况预测的评估进行调整。

③其他金融资产计量损失准备的方法

对于除上述以外的金融资产，如：债权投资、其他债权投资、其他应收款、除租赁应收款以外的长期应收款等，本公司按照一般方法，即“三阶段”模型计量损失准备。

本公司在计量金融工具发生信用减值时，评估信用风险是否显著增加考虑了以下因素：

- A. 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；
- B. 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；
- C. 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。

当出现以下一项或多项可观察信息时，本公司认为相关金融资产已发生信用减值：

- A. 债券发行人、交易对手或债务人发生重大财务困难；
- B. 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- C. 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何情况下都不会做出的让步；
- D. 债务人、债券发行人或交易对手很可能破产或进行其他债务重组；
- E. 债券发行人、交易对手或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；
- F. 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；
- G. 融资类业务采取强制平仓措施、担保物价值已经不能覆盖融资金额；
- H. 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别；
- I. 债权人由于债务人、债券发行人或交易对手的财务困难作出让步。

2) 预期信用损失的会计处理方法

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本公司在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益，并根据金融工具的种类，抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值或计入预计负债（贷款承诺或财务担保合同）或计入其他综合收益（以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资）。

11. 贵金属

适用 不适用

12. 应收款项

应收款项的预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节 10、（5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

13. 应收款项融资

适用 不适用

14. 合同资产

(1). 合同资产的确认方法及标准

适用 不适用

本公司将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。

(2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

合同资产的减值准备计提参照金融工具预期信用损失法。对于不包含或重大融资成分的合同资产，本公司采用简化方法计量损失准备。对于包含重大融资成分的合同资产，本公司按照一般方法计量损失准备。

合同资产发生减值损失，按应减记金额，借记“资产减值损失”，贷记合同资产减值准备；转回已计提的资产减值准备时，做相反分录。详见本节 10、（5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

15. 持有待售资产

适用 不适用

16. 债权投资

债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节 10、（5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

17. 其他债权投资

其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节 10、（5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

18. 长期股权投资

适用 不适用

（1）初始投资成本确定

对于企业合并取得的长期股权投资，如为同一控制下的企业合并，应当按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额确认为初始成本；非同一控制下的企业合并，应当按购买日确定的合并成本确认为初始成本；以支付现金取得的长期股权投资，初始投资成本为实际支付的购买价款；以发行权益性证券取得的长期股权投资，初始投资成本为发行权益性证券的公允价值；通过债务

重组取得的长期股权投资，其初始投资成本应当按照《企业会计准则第 12 号—债务重组》的有关规定确定；非货币性资产交换取得的长期股权投资，初始投资成本根据准则相关规定确定。

(2) 后续计量及损益确认方法

投资方能够对被投资单位实施控制的长期股权投资应当采用成本法核算，对联营企业和合营企业的长期股权投资采用权益法核算。投资方对联营企业的权益性投资，其中一部分通过风险投资机构、共同基金、信托公司或包括投连险基金在内的类似主体间接持有的，无论以上主体是否对这部分投资具有重大影响，投资方都应当按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定，对间接持有的该部分投资选择以公允价值计量且其变动计入损益，并对其余部分采用权益法核算。

(3) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

对被投资单位具有共同控制，是指对某项安排的回报产生重大影响的活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，包括商品或劳务的销售和购买、金融资产的管理、资产的购买和处置、研究与开发活动以及融资活动等；对被投资单位具有重大影响，是指当持有被投资单位 20%以上至 50%的表决权资本时，具有重大影响。或虽不足 20%，但符合下列条件之一时，具有重大影响：在被投资单位的董事会或类似的权力机构中派有代表；参与被投资单位的政策制定过程；向被投资单位派出管理人员；被投资单位依赖投资公司的技术或技术资料；与被投资单位之间发生重要交易。

19. 投资性房地产

(1). 如果采用成本计量模式的

折旧或摊销方法

本公司投资性房地产的类别，包括出租的建筑物。投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量。

本公司投资性房地产中出租的建筑物采用年限平均法计提折旧，具体核算政策与固定资产部分相同。

20. 固定资产

(1). 确认条件

√适用 不适用

固定资产指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。同时满足以下条件时予以确认：与该固定资产有关的经济利益很可能流入企业；该固定资产的成本能够可靠地计量。

(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
----	------	---------	-----	------

房屋及建筑物	年限平均法	40	5%	2.38%
运输设备	年限平均法	6	3%	16.17%
电子设备及其他	年限平均法	5	3%	19.40%

(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

融资租入固定资产为实质上转移了与资产所有权有关的全部风险和报酬的租赁。融资租入固定资产初始计价为租赁期开始日租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值较低者作为入账价值；融资租入固定资产后续计价采用与自有固定资产相一致的折旧政策计提折旧及减值准备。

21. 在建工程

√适用 □不适用

本公司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以及其他相关费用等。在建工程在工程完工达到预定可使用状态时，结转固定资产。预定可使用状态的判断标准，应符合下列情况之一：固定资产的实体建造（包括安装）工作已经全部完成或实质上已经全部完成；该项建造的固定资产上的支出金额很少或者几乎不再发生；所购建的固定资产已经达到设计或合同要求，或与设计或合同要求基本相符。

22. 借款费用

√适用 □不适用

(1) 借款费用资本化的确认原则

本公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时根据其发生额确认为费用，计入当期损益。符合资本化条件的资产，是指需要经过相当长时间的购建或者生产活动才能达到预定可使用或者可销售状态的固定资产、投资性房地产和存货等资产。

(2) 资本化金额计算方法

资本化期间，是指从借款费用开始资本化时点到停止资本化时点的期间。借款费用暂停资本化的期间不包括在内。在购建或生产过程中发生非正常中断、且中断时间连续超过 3 个月的，应当暂停借款费用的资本化。

借入专门借款，按照专门借款当期实际发生的利息费用，减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额确定；占用一般借款按照累计资产支出超过专门借款部分的资产支出加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率计算确定，资本化率为一般借款的加权平均利率；借款存在折价或溢价的，按照实际利率法确定每一会计期间应摊销的折价或溢价金额，调整每期利息金额。

实际利率法是根据借款实际利率计算其摊余折价或溢价或利息费用的方法。其中实际利率是借款在预期存续期间的未来现金流量，折现为该借款当前账面价值所使用的利率。

23. 使用权资产

√适用 □不适用

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

本公司使用权资产折旧采用年限平均法分类计提。对于能合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁资产预计剩余使用寿命内计提折旧；对于无法合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。

本公司按照《企业会计准则第8号——资产减值》的相关规定来确定使用权资产是否已发生减值并进行会计处理。

24. 无形资产

(1). 计价方法、使用寿命、减值测试

√适用 □不适用

①无形资产的计价方法

本公司无形资产按照成本进行初始计量。购入的无形资产，按实际支付的价款和相关支出作为实际成本。投资者投入的无形资产，按投资合同或协议约定的价值确定实际成本，但合同或协议约定价值不公允的，按公允价值确定实际成本。自行开发的无形资产，其成本为达到预定用途前所发生的支出总额。

本公司无形资产后续计量方法分别为：使用寿命有限无形资产采用直线法摊销，并在年度终了，对无形资产的使用寿命和摊销方法进行复核，如与原先估计数存在差异的，进行相应的调整；使用寿命不确定的无形资产不摊销，但在年度终了，对使用寿命进行复核，当有确凿证据表明其使用寿命是有限的，则估计其使用寿命，按直线法进行摊销。

②使用寿命不确定的判断依据

本公司将无法预见该资产为公司带来经济利益的期限，或使用期限不确定等无形资产确定为使用寿命不确定的无形资产。使用寿命不确定的判断依据为：来源于合同性权利或其他法定权利，但合同规定或法律规定无明确使用年限；综合同行业情况或相关专家论证等，仍无法判断无形资产为公司带来经济利益的期限。

每年年末，对使用寿命不确定无形资产使用寿命进行复核，主要采取自下而上的方式，由无形资产使用相关部门进行基础复核，评价使用寿命不确定判断依据是否存在变化等。

(2). 内部研究开发支出会计政策

√适用 □不适用

内部研究开发项目研究阶段的支出，于发生时计入当期损益；开发阶段的支出，同时满足下列条件的，确认为无形资产：①完成该无形资产以使其能够使用或出售在技术上具有可行性；②具有完成该无形资产并使用或出售的意图；③无形资产产生经济利益的方式，包括能够证明运用该无形资产生产的产品存在市场或无形资产自身存在市场，无形资产将在内部使用的，能证明其有用性；④有足够的技术、财务资源和其他资源支持，以完成该无形资产的开发，并有能力使用或出售该无形资产；⑤归属于该无形资产开发阶段的支出能够可靠地计量。

划分内部研究开发项目的研究阶段和开发阶段的具体标准：为获取新的技术和知识等进行的有计划的调查阶段，应确定为研究阶段，该阶段具有计划性和探索性等特点；在进行商业性生产或使用前，将研究成果或其他知识应用于某项计划或设计，以生产出新的或具有实质性改进的材料、装置、产品等阶段，应确定为开发阶段，该阶段具有针对性和形成成果的可能性较大等特点。

25. 长期资产减值

√适用 □不适用

长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、无形资产、商誉等长期资产于资产负债表日存在减值迹象的，进行减值测试。减值测试结果表明资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额计提减值准备并计入减值损失。

可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。资产减值准备按单项资产为基础计算并确认，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，以该资产所属的资产组确定资产组的可收回金额。资产组是能够独立产生现金流入的最小资产组合。

在财务报表中单独列示的商誉，无论是否存在减值迹象，至少每年进行减值测试。减值测试时，商誉的账面价值分摊至预期从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合。测试结果表明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。减值损失金额先抵减分摊至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，以后期间不予转回价值得以恢复的部分。

26. 长期待摊费用

√适用 □不适用

本公司长期待摊费用是指已经支出，但受益期限在一年以上（不含一年）的各项费用。长期待摊费用按费用项目的受益期限分期摊销。若长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益，则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

27. 附回购条件的资产转让

√适用 □不适用

买入返售交易根据协议承诺将于未来某确定日期返售的金融资产不在资产负债表内予以确认。买入该等资产所支付的成本，在资产负债表中作为买入返售金融资产列示。买入价与返售价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息收入。

卖出回购交易根据协议承诺将于未来某确定日期回购的已售出的金融资产不在资产负债表内予以终止确认。出售该等资产所得的款项，在资产负债表中作为卖出回购金融资产款列示。售价与回购价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息支出。

本公司股票质押式回购业务根据合约的履约保障比例、合同期限等情况，结合相关业务的风险监控管理标准，综合考虑债务人信用情况、持续还款情况、还款能力及担保品等情况，按照信用风险认定方法将其信用风险阶段划分标准设置如下：

对于合约未逾期且未触发平仓线（平仓线一般不低于 130%）且正常付息的股票质押式回购业务，划分为“阶段一”；

对于合约未逾期且触发平仓线合约、合约逾期且正常付息、合约未正常付息或已平仓且维持担保比例大于 100%的股票质押式回购业务，划分为“阶段二”；

对于未正常付息或合约已平仓且维持担保比例小于 100%、及其他被认为实质性违约的股票质押式回购业务，划分为“阶段三”。

本公司采用预期信用损失模型进行减值计量，预期信用损失计量的关键参数包括违约概率（PD）、违约损失率（LGD）和违约风险敞口（EAD）。预期违约损失由违约概率、违约损失率和违约风险敞口相乘得出，并通过前瞻性调整确认最终减值结果。其中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；违约损失率是指本公司对违约风险暴露发生损失程度作出的预期；违约风险敞口是指在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时本公司应被偿付的金额。

对于阶段一和阶段二的上述金融资产，本公司的违约概率及违约损失率根据公司历史违约信息，对违约概率进行估计并设定，结合前瞻性调整因素，确认预期信用损失。对于阶段三已发生信用减值的上述金融资产，由于已经发生违约，因此违约概率设置为 1，违约损失率通过综合考虑担保品的价值、可变现能力及处置周期，融资人的信用状况及还款能力等进行估计，并结合前瞻性调整因素，计提相应的减值准备。

28. 合同负债

合同负债的确认方法

√适用 □不适用

本公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品或提供服务的义务列示为合同负债。

29. 职工薪酬

(1)、短期薪酬的会计处理方法

√适用 □不适用

在职工为本公司提供服务的会计期间,将实际发生的短期薪酬确认为负债,并计入当期损益,其他会计准则要求或允许计入资产成本的除外。本公司发生的职工福利费,在实际发生时根据实际发生额计入当期损益或相关资产成本。职工福利费为非货币性福利的,按照公允价值计量。企业为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金,以及按规定提取的工会经费和职工教育经费,在职工提供服务的会计期间,根据规定的计提基础和计提比例计算确定相应的职工薪酬金额,并确认相应负债,计入当期损益或相关资产成本。

(2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

本公司在职工提供服务的会计期间,根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债,并计入当期损益或相关资产成本。根据预期累计福利单位法确定的公式将设定受益计划产生的福利义务归属于职工提供服务的期间,并计入当期损益或相关资产成本。

(3)、辞退福利的会计处理方法

√适用 □不适用

企业向职工提供辞退福利时,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:企业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;企业确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

(4)、其他长期职工福利的会计处理方法

√适用 □不适用

本公司向职工提供的其他长期职工福利,符合设定提存计划条件的,应当按照有关设定提存计划的规定进行处理;除此外,根据设定受益计划的有关规定,确认和计量其他长期职工福利净负债或净资产。

30. 预计负债

√适用 □不适用

当与或有事项相关的义务是公司承担的现时义务,且履行该义务很可能导致经济利益流出,同时其金额能够可靠地计量时确认该义务为预计负债。本公司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,最佳估计数按照该范围内的中间值确定;如涉及多个项目,按照各种可能结果及相关概率计算确定最佳估计数。资产负债表日应当对预计负债账面价值进行复核,有确凿证据表明该账面价值不能真实反映当前最佳估计数,应当按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

31. 租赁负债

适用 不适用

租赁负债按照租赁期开始日尚未支付的租赁付款额的现值进行初始计量。租赁付款额包括：①固定付款额（包括实质固定付款额），存在租赁激励的，扣除租赁激励相关金额；②取决于指数或比率的可变租赁付款额；③根据承租人提供的担保余值预计应支付的款项；④购买选择权的行权价格，前提是承租人合理确定将行使该选择权；⑤行使终止租赁选择权需支付的款项，前提是租赁期反映出承租人将行使终止租赁选择权。

本公司采用租赁内含利率作为折现率；如果无法合理确定租赁内含利率的，则采用本公司的增量借款利率作为折现率。本公司按照固定的周期性利率计算租赁负债在租赁期内各期间的利息费用，并计入财务费用。该周期性利率是指公司所采用的折现率或修订后的折现率。

未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

当本公司对续租选择权、终止租赁选择权或者购买选择权的评估结果发生变化的，则按变动后的租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值。当实质租赁付款额、担保余值预计的应付金额或者取决于指数或比率的可变租赁付款额发生变动的，则按变动后的租赁付款额和原折现率计算的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值。

32. 股份支付

适用 不适用

本公司股份支付包括以权益结算的股份支付和以现金结算的股份支付。以权益结算的股份支付换取职工提供服务的，以授予职工权益工具的公允价值计量。存在活跃市场的，按照活跃市场中的报价确定；不存在活跃市场的，采用估值技术确定，包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

在各个资产负债表日，根据最新取得的可行权人数变动、业绩指标完成情况等后续信息，修正预计可行权的股票期权数量，并以此为依据确认各期应分摊的费用。对于跨越多个会计期间的期权费用，一般可以按照该期权在某会计期间内等待期长度占整个等待期长度的比例进行分摊。

33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

34. 回购本公司股份

适用 不适用

35. 收入

(1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

本公司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控制权时，按照分摊至该项履约义务的交易价格确认收入。取得相关商品控制权，是指能够主导该商品的使用并从中获得几乎全部的经济利益。履约义务是指合同中本公司向客户转让可明确区分商品的承诺。交易价格是指本公司因向客户转让商品而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项以及本公司预期将退还给客户的款项。

履约义务是在某一时段内履行、还是在某一时点履行，取决于合同条款及相关法律规定。如果履约义务是在某一时段内履行的，则本公司按照履约进度确认收入。否则，本公司于客户取得相关资产控制权的某一时点确认收入。

1) 手续费及佣金收入

代理客户买卖证券的手续费收入，在与客户办理买卖证券款项清算时确认收入。代兑付证券的手续费收入，于代兑付证券业务基本完成，与委托方结算时确认收入。

证券承销收入，在包销及代销方式下的承销业务手续费收入，在承销业务提供的相关服务完成时确认收入。

保荐业务收入和财务顾问业务收入于各项业务提供服务完成时按权责发生制确认收入。

受托客户资产管理业务收入，在相关服务提供后，按合同约定方式确认当期收入或损失。

2) 利息收入

根据相关本金及实际利率按权责发生制原则确认。

3) 其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入。

(2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

适用 不适用

36. 合同成本

适用 不适用

本公司的合同成本包括为取得合同发生的增量成本及合同履约成本。为取得合同发生的增量成本（“合同取得成本”）是指不取得合同就不会发生的成本。该成本预期能够收回的，本公司将其作为合同取得成本确认为一项资产。

本公司为履行合同发生的成本，不属于存货等其他企业会计准则规范范围且同时满足下列条件的，作为合同履约成本确认为一项资产：

(1) 该成本与一份当前或预期取得的合同直接相关，包括直接人工、直接材料、制造费用（或类似费用）、明确由用户承担的成本以及仅因该合同而发生的其他成本；

(2) 该成本增加了本公司未来用于履行履约义务的资源；

(3) 该成本预期能够收回。

本公司将确认为资产的合同履约成本，初始确认时摊销期限不超过一年或一个正常营业周期的，在资产负债表计入“存货”项目；初始确认时摊销期限在一年或一个正常营业周期以上的，在资产负债表中计入“其他非流动资产”项目。

本公司将确认为资产的合同取得成本，初始确认时摊销期限不超过一年或一个正常营业周期的，在资产负债表计入“其他流动资产”项目；初始确认时摊销期限在一年或一个正常营业周期以上的，在资产负债表中计入“其他非流动资产”项目。

本公司对合同取得成本、合同履约成本确认的资产（以下简称“与合同成本有关的资产”）采用与该资产相关的商品收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。取得合同的增量成本形成的资产的摊销年限不超过一年的，在发生时计入当期损益。

与合同成本有关的资产的账面价值高于下列两项的差额时，本公司将超出部分计提减值准备并确认为资产减值损失：

(1) 因转让与该资产相关的商品预期能够取得的剩余对价；

(2) 为转让该相关商品估计将要发生的成本。

以前期间减值的因素之后发生变化，使得前述两项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超过假定不计提减值准备情况该资产在转回日的账面价值。

37. 利润分配

适用 不适用

公司当期实现的净利润按下列顺序分配：(1) 弥补以前年度亏损；(2) 按 10% 提取法定盈余公积金；(3) 按 10% 提取一般交易风险准备；(4) 并按财政部及证监会等监管机构规定的比例 10% 提取交易风险准备；(5) 按经审议通过的利润分配方案进行分配。公司法定盈余公积达到累计达到注册资本的 50%，可不再提取。公司计提的一般风险准备金和交易风险准备金，用于弥补证券交易的损失，提取的公积金可用于弥补亏损或者转增股本。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公司注册资本的 25%。

38. 政府补助

(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

与资产相关的政府补助，确认为递延收益的金额，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入当期损益。其中与本公司日常活动相关的，计入其他收益，与本公司日常活动无关的，计入营业外收入。

按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法√适用 不适用

与收益相关的政府补助，分别下列情况处理：用于补偿企业以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关费用的期间，计入当期损益。用于补偿企业已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。计入当期损益时，与本公司日常活动相关的政府补助，计入其他收益；与本公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收入。

39. 递延所得税资产/递延所得税负债√适用 不适用

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

(2) 递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。资产负债表日，有确凿证据表明未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异的，确认以前会计期间未确认的递延所得税资产。如未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的，则减记递延所得税资产的账面价值。

(3) 对与子公司及联营企业投资相关的应纳税暂时性差异，确认递延所得税负债，除非本公司能够控制暂时性差异转回的时间且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。对与子公司及联营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，当该暂时性差异在可预见的未来很可能转回且未来很可能获得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额时，确认递延所得税资产。

40. 租赁**(1)、经营租赁的会计处理方法** 适用 不适用**(2)、融资租赁的会计处理方法** 适用 不适用**(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法**√适用 不适用

租赁，是指在一定期间内，出租人将资产的使用权让与承租人以获取对价的合同。

在合同开始日，本公司评估合同是否为租赁或者包含租赁。如果合同中一方让渡了在一定期间内控制一项或多项已识别资产使用的权利以换取对价，则该合同为租赁或者包含租赁。

合同中同时包含多项单独租赁的，承租人和出租人将合同予以分拆，并分别各项单独租赁进行会计处理。合同中同时包含租赁和非租赁部分的，承租人和出租人将租赁和非租赁部分进行分

拆。

1) 承租人

①使用权资产的会计政策详见本附注五、23。

②租赁负债的会计政策详见本附注五、31。

③短期租赁和低价值资产租赁

本公司选择对短期租赁和低价值资产租赁不确认使用权资产和租赁负债，并将相关的租赁付款额在租赁期内各个期间按照直线法计入当期损益或相关资产成本。短期租赁，是指在租赁期开始日，租赁期不超过 12 个月且不包含购买选择权的租赁。低价值资产租赁，是指单项租赁资产为全新资产时价值较低的租赁。公司转租或预期转租租赁资产的，原租赁不属于低价值资产租赁。

④租赁变更

租赁发生变更且同时符合下列条件的，公司将该租赁变更作为一项单独租赁进行会计处理：该租赁变更通过增加一项或多项租赁资产的使用权而扩大了租赁范围；增加的对价与租赁范围扩大部分的单独价格按该合同情况调整后的金额相当。

租赁变更未作为一项单独租赁进行会计处理的，在租赁变更生效日，公司重新分摊变更后合同的对价，重新确定租赁期，并按照变更后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债。

2) 出租人

①经营租赁会计处理

本公司在租赁期内各个期间采用直线法，将经营租赁的租赁收款额确认为租金收入。本公司将发生的与经营租赁有关的初始直接费用予以资本化，在租赁期内按照与租金收入相同的确认基础分期计入当期收益。

②融资租赁会计处理

本公司在租赁开始日，将应收融资租赁款，未担保余值之和与其现值的差额确认为未实现融资收益，在将来收到租金的各期间内确认为租赁收入。本公司发生的与出租交易相关的初始直接费用，计入应收融资租赁款的初始入账价值中。

41. 融资融券业务

√适用 □不适用

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

融资业务，本公司对于融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，本公司对于融出的证券，不终止确认该证券，但确认相应利息收入。
本公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

42. 资产证券化业务

适用 不适用

43. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

(1) 客户资产管理业务

公司资产管理业务包括定向资产管理业务和集合资产管理业务。

定向资产管理业务以每个客户的委托资产为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务会计报告。不同的客户资产管理之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面应当相互独立。进行每日资产管理业务投资交易清算复核，保证各个管理帐户的净值、股份、资金等数据与会计估值保持一致。

集合资产管理财务报表由公司和托管银行按规定分别独立编制。托管银行在收到公司编制的集合资产管理财务报表后，进行独立的复核。

在编制报表时，资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表中反映，但列入财务报表附注。

(2) 转融通业务

转融通业务是指中国证券金融股份有限公司将自有或者依法筹集的资金或证券出借给本公司，供本公司办理融资融券业务的经营。本公司发生的转融通业务包括转融资业务和转融券业务。

1) 转融资业务

本公司对于融入的资金，确认对出借方的负债，并确认相应利息费用。

2) 转融券业务

本公司对于融入的证券，由于其主要收益或风险不由本公司享有或承担，不确认该证券，但确认相应利息费用。

(3) 分部报告政策

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础，结合经营分部规模，确定报告分部并披露分部信息。

经营分部，是指本公司内同时满足下列条件的组成部分：

- 1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 2) 本公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 3) 本公司能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，本公司将其合并为一个经营分部。

44. 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

会计政策变更的内容和原因	审批程序	备注(受重要影响的报表项目名称和金额)
本公司于2021年1月1日开始执行财政部于2018年修订的《企业会计准则第21号-租赁》。	2021年4月27日,公司第三届董事会第四十四次会议、第三届监事会第十五次会议审议通过了《关于会计政策变更的议案》。	详见本节44、(3)

其他说明:

无。

(2)、重要会计估计变更

□适用 √不适用

(3)、2021年起首次执行新租赁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	2020年12月31日	2021年1月1日	调整数
资产:			
货币资金	14,622,925,091.99	14,622,925,091.99	
其中:客户资金存款	8,914,812,690.27	8,914,812,690.27	
结算备付金	2,092,593,710.63	2,092,593,710.63	
其中:客户备付金	1,180,195,256.20	1,180,195,256.20	
贵金属			
拆出资金	600,408,750.00	600,408,750.00	
融出资金	5,617,229,266.37	5,617,229,266.37	
衍生金融资产			
存出保证金	3,234,252,212.13	3,234,252,212.13	
应收款项	1,395,310,400.35	1,395,310,400.35	
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	3,624,293,940.73	3,624,293,940.73	
持有待售资产			
金融投资:			
交易性金融资产	27,805,124,322.55	27,805,124,322.55	
债权投资			
其他债权投资	1,468,154,478.25	1,468,154,478.25	
其他权益工具投资	3,279,330,455.93	3,279,330,455.93	
长期股权投资	4,520,616,956.01	4,520,616,956.01	
投资性房地产	150,357,512.25	150,357,512.25	
固定资产	116,727,952.18	116,727,952.18	
在建工程	562,819,585.16	562,819,585.16	
使用权资产		384,345,882.73	384,345,882.73

无形资产	573,323,775.92	573,323,775.92	
商誉	66,634,466.97	66,634,466.97	
递延所得税资产	294,193,220.00	294,193,220.00	
其他资产	11,380,810,684.03	11,367,982,323.19	-12,828,360.84
资产总计	81,405,106,781.45	81,776,624,303.34	371,517,521.89
负债：			
短期借款	630,073,044.46	630,073,044.46	
应付短期融资款	8,132,246,488.92	8,132,246,488.92	
拆入资金	1,446,215,777.77	1,446,215,777.77	
交易性金融负债	26,120,694.97	26,120,694.97	
衍生金融负债	5,389,968.02	5,389,968.02	
卖出回购金融资产款	8,308,264,661.37	8,308,264,661.37	
代理买卖证券款	11,584,902,888.04	11,584,902,888.04	
代理承销证券款			
应付职工薪酬	338,522,881.20	338,522,881.20	
应交税费	168,357,651.12	168,357,651.12	
应付款项	279,975,921.11	279,975,921.11	
合同负债	51,784,278.10	51,784,278.10	
持有待售负债			
预计负债			
长期借款	1,189,306,800.00	1,189,306,800.00	
应付债券	24,371,607,466.49	24,371,607,466.49	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		371,937,208.04	371,937,208.04
递延收益	87,000.00	87,000.00	
递延所得税负债	287,172,116.59	287,172,116.59	
其他负债	2,342,042,230.59	2,341,622,544.44	-419,686.15
负债合计	59,162,069,868.75	59,533,587,390.64	371,517,521.89
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	6,665,967,280.00	6,665,967,280.00	
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	7,915,543,266.46	7,915,543,266.46	
减：库存股			
其他综合收益	-469,026,061.83	-469,026,061.83	
盈余公积	331,425,315.71	331,425,315.71	
一般风险准备	722,474,379.80	722,474,379.80	
未分配利润	2,293,707,677.58	2,293,707,677.58	
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	17,460,091,857.72	17,460,091,857.72	
少数股东权益	4,782,945,054.98	4,782,945,054.98	
所有者权益（或股东权益）合计	22,243,036,912.70	22,243,036,912.70	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	81,405,106,781.45	81,776,624,303.34	371,517,521.89

各项目调整情况的说明：

√适用 □不适用

根据财政部《关于修订印发〈企业会计准则第 21 号-租赁〉的通知》以及《企业会计准则第 21 号-租赁》的要求（以下简称“新租赁准则”），公司自 2021 年 1 月 1 日起执行新租赁准则，因采用新租赁准则引起的具体影响科目及金额见上述调整报表。

母公司资产负债表

单位：元 币种：人民币

项目	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日	调整数
资产：			
货币资金	10,090,785,509.59	10,090,785,509.59	
其中：客户资金存款	5,501,192,472.76	5,501,192,472.76	
结算备付金	2,504,785,598.08	2,504,785,598.08	
其中：客户备付金	1,180,195,256.20	1,180,195,256.20	
贵金属			
拆出资金	600,408,750.00	600,408,750.00	
融出资金	5,579,441,537.05	5,579,441,537.05	
衍生金融资产			
存出保证金	586,304,207.86	586,304,207.86	
应收款项	918,302,873.83	918,302,873.83	
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	3,313,798,523.37	3,313,798,523.37	
持有待售资产			
金融投资：			
交易性金融资产	25,126,889,082.80	25,126,889,082.80	
债权投资	105,116,439.56	105,116,439.56	
其他债权投资	737,136,193.01	737,136,193.01	
其他权益工具投资	238,149,768.75	238,149,768.75	
长期股权投资	7,921,404,635.70	7,921,404,635.70	
投资性房地产	16,321,589.88	16,321,589.88	
固定资产	81,303,783.18	81,303,783.18	
在建工程	118,371,851.75	118,371,851.75	
使用权资产		375,199,121.57	375,199,121.57
无形资产	95,266,955.58	95,266,955.58	
商誉			
递延所得税资产	175,991,974.73	175,991,974.73	
其他资产	9,800,327,174.05	9,788,045,356.39	-12,281,817.66
资产总计	68,010,106,448.77	68,373,023,752.68	362,917,303.91
负债：			
短期借款	612,673,200.00	612,673,200.00	
应付短期融资款	8,132,246,488.92	8,132,246,488.92	
拆入资金	1,446,215,777.77	1,446,215,777.77	
交易性金融负债			
衍生金融负债	5,071,235.02	5,071,235.02	
卖出回购金融资产款	8,216,523,682.00	8,216,523,682.00	

代理买卖证券款	6,343,644,072.56	6,343,644,072.56	
代理承销证券款			
应付职工薪酬	246,760,777.21	246,760,777.21	
应交税费	134,084,641.52	134,084,641.52	
应付款项			
合同负债	19,486,098.98	19,486,098.98	
持有待售负债			
预计负债			
长期借款	1,189,306,800.00	1,189,306,800.00	
应付债券	24,351,406,216.99	24,351,406,216.99	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		363,336,990.06	363,336,990.06
递延收益			
递延所得税负债	168,485,852.62	168,485,852.62	
其他负债	327,739,068.13	327,319,381.98	-419,686.15
负债合计	51,193,643,911.72	51,556,561,215.63	362,917,303.91
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	6,665,967,280.00	6,665,967,280.00	
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	7,111,460,823.71	7,111,460,823.71	
减：库存股			
其他综合收益	-175,783,833.99	-175,783,833.99	
盈余公积	331,425,315.71	331,425,315.71	
一般风险准备	716,560,701.48	716,560,701.48	
未分配利润	2,166,832,250.14	2,166,832,250.14	
所有者权益（或股东权益）合计	16,816,462,537.05	16,816,462,537.05	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	68,010,106,448.77	68,373,023,752.68	362,917,303.91

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

根据财政部《关于修订印发〈企业会计准则第 21 号-租赁〉的通知》以及《企业会计准则第 21 号-租赁》的要求（以下简称“新租赁准则”），公司自 2021 年 1 月 1 日起执行新租赁准则，因采用新租赁准则引起的具体影响科目及金额见上述调整报表。

(4)、2021 年起首次执行新租赁准则追溯调整前期比较数据的说明

适用 不适用

45. 其他

适用 不适用

六、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	应税收入	13%、9%、6%、5%、3%、1%
城市维护建设税	应纳流转税额	7%、5%、1%
企业所得税	应纳税所得额	25%、16.5%
教育费附加	应纳流转税额	3%

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(%)
TFIAssetManagementLimited	16.5
TFInternationalSecuritiesGroupLimited	16.5
TFISecuritiesLimited	16.5
TFICapitalLimited (原名: TFInternationalHoldingsLimited)	16.5
TFISecuritiesandFuturesLimited	16.5
除上述以外的其他纳税主体	25

2. 税收优惠

□适用 √不适用

3. 其他

□适用 √不适用

七、合并财务报表项目注释

1. 货币资金

√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
现金：	/	/	230,078.64	/	/	222,832.79
人民币	/	/	230,078.64	/	/	222,832.79
银行存款：	/	/	17,689,767,898.44	/	/	14,622,702,259.20
其中：自有资金	/	/	7,644,317,916.80	/	/	5,707,889,568.93
人民币	/	/	7,167,941,855.02	/	/	5,327,608,858.88
美元	14,417,135.76	6.4601	93,136,174.77	13,052,507.48	6.5249	85,166,285.30
港元	460,115,397.98	0.8321	382,852,820.35	350,149,101.18	0.8416	294,699,489.52
欧元	50,358.83	7.6862	387,066.66	53,151.06	8.0250	414,935.23
客户资金	/	/	10,045,449,981.64	/	/	8,914,812,690.27
人民币	/	/	10,044,106,936.10	/	/	8,494,070,628.91
美元	118,573.81	6.4601	765,998.67	52,990,344.51	6.5249	345,756,607.33
港元	693,499.28	0.8321	577,046.87	88,743,445.01	0.8416	74,690,033.06

欧元				37,841.90	8.0250	295,420.97
其他货币资金：	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
合计	/	/	17,689,997,977.08	/	/	14,622,925,091.99

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	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
客户信用资金	/	/	659,472,423.68	/	/	605,144,742.56
人民币	/	/	659,472,423.68	/	/	605,144,742.56
美元						
港元						
合计	/	/	659,472,423.68	/	/	605,144,742.56

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

适用 不适用

截至 2021 年 6 月 30 日，受限制的货币资金为人民币 47,156,346.20 元，为风险准备金专户存款及司法冻结。

货币资金的说明：

适用 不适用

2、 结算备付金

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
公司自有备付金：	/	/	1,262,247,226.07	/	/	912,363,553.45
人民币	/	/	1,262,190,997.19	/	/	912,363,527.14
美元	8,700.02	6.4601	56,203.00	0.02	6.5249	0.13
港元	31.10	0.8321	25.88	31.10	0.8416	26.18
公司信用备付金：	/	/	709,189.30	/	/	34,900.98
人民币	/	/	709,189.30	/	/	34,900.98
美元						
港元						
客户普通备付金：	/	/	1,198,922,995.52	/	/	739,625,510.67
人民币	/	/	391,985,812.41	/	/	736,466,195.41

美元	90,025,460.76	6.4601	581,573,722.18	131,660.26	6.5249	859,070.01
港元	270,298,042.83	0.8321	224,909,595.51	2,733,051.24	0.8416	2,300,245.25
欧元	59,049.60	7.6862	453,865.42			
客户信用备付金:	/	/	506,511,963.23	/	/	440,569,745.53
人民币	/	/	506,511,963.23	/	/	440,569,745.53
美元						
港元						
合计	/	/	2,968,391,374.12	/	/	2,092,593,710.63

结算备付金的说明:

无

3、贵金属

适用 不适用

4、拆出资金

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
拆放银行		
拆放非银行金融机构	1,000,578,305.55	600,408,750.00
合计	1,000,578,305.55	600,408,750.00

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明:

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的拆出资金余额显著变动的情况说明:

适用 不适用

拆出资金的说明:

无

5、融出资金

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
境内	4,962,034,919.05	5,641,606,343.48
其中: 个人	3,097,447,788.20	3,071,428,727.72
机构	1,864,587,130.85	2,570,177,615.76
减: 减值准备	65,863,609.88	62,164,806.43
账面价值小计	4,896,171,309.17	5,579,441,537.05
境外	64,289,259.68	37,819,041.65
其中: 个人	9,450,237.25	8,630,966.45
机构	54,839,022.43	29,188,075.20
减: 减值准备	2,537.01	31,312.33
账面价值小计	64,286,722.67	37,787,729.32

账面价值合计	4,960,458,031.84	5,617,229,266.37
--------	------------------	------------------

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
资金	739,187,580.54	654,579,195.11
债券	60,899,830.16	58,676,301.57
股票	18,021,049,706.51	19,195,272,721.85
基金	126,905,475.58	81,139,457.28
合计	18,948,042,592.79	19,989,667,675.81

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

相关预期信用损失减值准备情况详见本节七、合并财务报表注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表。

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

融出资金的说明：

适用 不适用

6、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
利率衍生工具 (按类别列示)			15,096,273,950.00					18,748,730,700.00		
—利率互换			13,125,000,000.00					14,025,000,000.00		
—国债期货			1,971,273,950.00					4,723,730,700.00		
权益衍生工具 (按类别列示)	193,868,480.00		2,103,310,604.76	99,139.95	15,129,426.56	512,489,040.00		675,354,300.00		3,403,432.00
—股指期货	193,868,480.00		876,391,380.00			512,489,040.00		345,439,260.00		
—期权			1,226,919,224.76	99,139.95	15,129,426.56			329,915,040.00		3,403,432.00
其他衍生工具 (按类别列示)			429,086,550.30		18,109,680.95			265,519,196.91		1,986,536.02
—商品期货			221,323,665.00					177,255,925.00		
—收益互换			207,762,885.30		18,109,680.95			88,263,271.91		1,986,536.02
合计	193,868,480.00		17,628,671,105.06	99,139.95	33,239,107.51	512,489,040.00		19,689,604,196.91		5,389,968.02

已抵销的衍生金融工具：

□适用 √不适用

衍生金融工具的说明：

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，衍生金融资产/负债项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示为0元。

7、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	/	/	3,910,071,688.45	/	/	3,092,904,533.35
其中：人民币	/	/	3,809,331,261.57	/	/	3,036,506,108.06
美元	14,257,072.99	6.4601	92,102,155.04	279,993.46	6.5249	1,826,929.33
港元	10,381,540.04	0.8321	8,638,271.84	64,839,475.26	0.8416	54,571,495.96
信用保证金	/	/	59,143,823.20	/	/	141,347,678.78
其中：人民币	/	/	59,143,823.20	/	/	141,347,678.78
美元						
港元						
履约保证金	/	/		/	/	
其中：人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
合计	/	/	3,969,215,511.65	/	/	3,234,252,212.13

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的存出保证金余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

存出保证金的说明：

无

8、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
应收清算款	439,990,886.48	500,056,722.98
应收资产管理费	914,082,076.85	819,619,469.64
应收手续费及佣金	181,212,233.22	149,949,818.56
应收票据		
应收租金收入	5,730,358.42	2,150,927.05
其他	4,079,683.13	1,966,417.20
合计	1,545,095,238.10	1,473,743,355.43
减：坏账准备(按简化模型计提)	85,021,006.63	78,432,955.08
减：坏账准备(按一般模型计提)		
应收款项账面价值	1,460,074,231.47	1,395,310,400.35

(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	1,222,217,825.22	79.10	1,149,552,714.55	78.00
1-2年	231,224,197.21	14.97	232,538,384.79	15.78
2-3年	91,225,115.37	5.90	91,224,155.79	6.19
3年以上	428,100.30	0.03	428,100.30	0.03
合计	1,545,095,238.10	100.00	1,473,743,355.43	100.00

(3) 按计提坏账列示

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

账龄	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	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备:								
单项计小计								
组合计提坏账准备:								
1年以内	1,222,217,825.22	79.10	45,192,274.81	3.70	1,149,552,714.55	78.00	38,490,590.17	3.35
1-2年	231,224,197.21	14.97	21,369,658.60	9.24	232,538,384.79	15.78	21,483,290.89	9.24
2-3年	91,225,115.37	5.90	18,245,023.07	20.00	91,224,155.79	6.19	18,245,023.87	20.00
3年以上	428,100.30	0.03	214,050.15	50.00	428,100.30	0.03	214,050.15	50.00
组合小计	1,545,095,238.10	100.00	85,021,006.63	5.50	1,473,743,355.43	100.00	78,432,955.08	5.32
合计	1,545,095,238.10	100.00	85,021,006.63	5.50	1,473,743,355.43	100.00	78,432,955.08	5.32

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明:

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明:

□适用 √不适用

9、应收款项融资

□适用 √不适用

10、合同资产

(1). 合同资产情况

□适用 √不适用

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

□适用 √不适用

(3). 本期合同资产计提减值准备情况

□适用 √不适用

其他说明:

□适用 √不适用

11、 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		
股票质押式回购	1,211,834,564.90	1,488,437,061.92
债券质押式回购	1,482,929,799.73	2,206,300,396.86
债券买断式回购	64,432,229.98	92,577,474.41
其他		
减：减值准备	69,170,339.57	163,020,992.46
账面价值合计	2,690,026,255.04	3,624,293,940.73

(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	1,211,834,564.90	1,488,437,061.92
债券	1,547,362,029.71	2,298,877,871.27
基金		
其他		
减：减值准备	69,170,339.57	163,020,992.46
买入返售金融资产账面价值	2,690,026,255.04	3,624,293,940.73

(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
担保物	3,727,648,681.56	4,571,027,057.44
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	181,255,139.13	93,130,590.00
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		93,130,590.00

(4) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	1,201,602,186.83	1,231,512,117.30
一个月至三个月内	10,232,378.07	
三个月至一年内		256,924,944.62
一年以上		
合计	1,211,834,564.90	1,488,437,061.92

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

相关预期信用损失减值准备情况详见本节七、合并财务报表项目注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表。

股票质押式回购按减值阶段列示：

项目	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)	
账面余额	242,542,060.94		969,292,503.96	1,211,834,564.90
减值准备	80,395.70		69,089,943.87	69,170,339.57
账面价值	242,461,665.24		900,202,560.09	1,142,664,225.33
担保物价值	718,143,587.89		1,221,590,006.30	1,939,733,594.19

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

买入返售金融资产的说明：

□适用 √不适用

12、持有待售资产

□适用 √不适用

13、交易性金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末余额					
	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	16,707,743,973.91		16,707,743,973.91	16,418,094,453.02		16,418,094,453.02
公募基金	2,194,607,833.88		2,194,607,833.88	2,121,952,438.05		2,121,952,438.05
股票/股权	5,186,353,928.24		5,186,353,928.24	4,709,725,182.74		4,709,725,182.74
银行理财产品	22,111,689.05		22,111,689.05	21,900,000.00		21,900,000.00
券商资管产品	1,779,913,280.17		1,779,913,280.17	1,746,586,147.58		1,746,586,147.58
信托计划	680,353,596.09		680,353,596.09	644,221,269.66		644,221,269.66
其他	5,907,412,513.56		5,907,412,513.56	5,059,913,912.57		5,059,913,912.57
合计	32,478,496,814.90		32,478,496,814.90	30,722,393,403.62		30,722,393,403.62
类别	期初余额					
	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价	指定为	公允价值合计	分类为以公允价	指定为	初始成本合计

	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 金融资 产		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 金融资 产	
债券	13,315,469,600.68		13,315,469,600.68	13,090,220,195.55		13,090,220,195.55
公募基金	1,693,427,329.58		1,693,427,329.58	1,621,213,763.07		1,621,213,763.07
股票/股权	4,957,787,670.39		4,957,787,670.39	4,428,129,015.16		4,428,129,015.16
银行理财产品	137,945,339.87		137,945,339.87	137,800,000.00		137,800,000.00
券商资管产品	1,743,133,031.49		1,743,133,031.49	1,711,685,410.94		1,711,685,410.94
信托计划	729,821,115.93		729,821,115.93	677,155,525.00		677,155,525.00
其他	5,227,540,234.61		5,227,540,234.61	4,576,899,050.85		4,576,899,050.85
合计	27,805,124,322.55		27,805,124,322.55	26,243,102,960.57		26,243,102,960.57

对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的描述性说明

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

14、 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
国债								
地方债								
金融债	178,000,000.00	4,470,466.10	166,122.66	182,304,343.44				
企业债								
其他	1,178,000,000.00	12,166,843.89	878,896.71	1,189,287,947.18				
合计	1,356,000,000.00	16,637,309.99	1,045,019.37	1,371,592,290.62				

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

相关预期信用损失减值准备情况详见本节七、合并财务报表注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表。

对本期发生损失准备变动的债权投资余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他说明：

无

15、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
国债										
地方债										
金融债										
企业债	1,231,683,087.13	80,407,141.81	-7,560,076.46	1,304,530,152.48	1,821,446.86	1,453,052,285.70	24,936,872.97	-9,834,680.42	1,468,154,478.25	2,090,430.46
其他										
合计	1,231,683,087.13	80,407,141.81	-7,560,076.46	1,304,530,152.48	1,821,446.86	1,453,052,285.70	24,936,872.97	-9,834,680.42	1,468,154,478.25	2,090,430.46

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

相关预期信用损失减值准备情况详见本节七、合并财务报表注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表。

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

其他说明：

无

16、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	

非交易性权益工具	4,183,319,820.52	3,171,314,910.83	880,000.00	4,123,691,837.73	3,279,330,455.93	1,619,230.00	战略投资
合计	4,183,319,820.52	3,171,314,910.83	880,000.00	4,123,691,837.73	3,279,330,455.93	1,619,230.00	/

(2). 本期终止确认的其他权益工具

√适用 □不适用

由于上述权益工具并非为交易目的而持有，本公司将其指定为其他权益工具投资。由于公司战略调整，本公司对部分其他权益工具进行处置，相应的损益金额 8,271,264.41 元从其他综合收益重分类为留存收益。

其他说明：

□适用 √不适用

17、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	其他		
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
湖北三环资本管理有限公司	20,748,710.92			-593,225.85						20,155,485.07	
宜宾市商业银行股份有限公司	383,458,713.54			11,344,334.52	1,303,488.15					396,106,536.21	75,371,122.23
恒泰证券股份有限公司	4,114,549,371.73			-3,308,578.25	1,977,196.54					4,113,217,990.02	
新疆新旅资本管理有限公司	1,860,159.82			-276,093.13						1,584,066.69	
小计	4,520,616,956.01			7,166,437.29	3,280,684.69					4,531,064,077.99	75,371,122.23
合计	4,520,616,956.01			7,166,437.29	3,280,684.69					4,531,064,077.99	75,371,122.23

其他说明

无

18、投资性房地产

投资性房地产计量模式

(1). 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	土地使用权	在建工程	合计
一、账面原值				
1. 期初余额	194,007,810.53			194,007,810.53
2. 本期增加金额				
(1) 外购				
(2) 存货\固定资产\ 在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	194,007,810.53			194,007,810.53
二、累计折旧和累计摊销				
1. 期初余额	43,650,298.28			43,650,298.28
2. 本期增加金额	3,142,262.27			3,142,262.27
(1) 计提或摊销	3,142,262.27			3,142,262.27
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	46,792,560.55			46,792,560.55
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				
(2) 其他转出				
4. 期末余额				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	147,215,249.98			147,215,249.98
2. 期初账面价值	150,357,512.25			150,357,512.25

(2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况：

□适用 √不适用

其他说明

□适用 √不适用

19、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	电子设备及其他	合计
----	--------	------	---------	----

一、账面原值：				
1. 期初余额	86,475,481.54	16,492,430.30	160,260,777.97	263,228,689.81
2. 本期增加金额	606,151,354.60		9,729,680.85	615,881,035.45
(1) 购置			9,729,680.85	9,729,680.85
(2) 在建工程转入	606,151,354.60			606,151,354.60
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额			4,759,224.39	4,759,224.39
(1) 处置或报废			4,759,224.39	4,759,224.39
4. 期末余额	692,626,836.14	16,492,430.30	165,231,234.43	874,350,500.87
二、累计折旧				
1. 期初余额	18,911,141.13	13,591,029.61	113,439,702.00	145,941,872.74
2. 本期增加金额	5,829,017.35	627,256.06	10,889,154.33	17,345,427.74
(1) 计提	5,829,017.35	627,256.06	10,889,154.33	17,345,427.74
3. 本期减少金额			3,934,618.84	3,934,618.84
(1) 处置或报废			3,934,618.84	3,934,618.84
4. 期末余额	24,740,158.48	14,218,285.67	120,394,237.49	159,352,681.64
三、减值准备				
1. 期初余额			558,864.89	558,864.89
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			558,864.89	558,864.89
四、账面价值				
1. 期末账面价值	667,886,677.66	2,274,144.63	44,278,132.05	714,438,954.34
2. 期初账面价值	67,564,340.41	2,901,400.69	46,262,211.08	116,727,952.18

(2). 暂时闲置的固定资产情况

□适用 √不适用

(3). 通过融资租赁租入的固定资产情况

□适用 √不适用

(4). 通过经营租赁租出的固定资产

□适用 √不适用

(5). 未办妥产权证书的固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书的原因
天风证券大厦中北路	601,820,332.72	正在办理中
武汉保利文化广场 31 层	582,073.19	正在办理中

其他说明：

□适用 √不适用

20、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
天风证券光谷一路项目	130,136,913.12		130,136,913.12	118,371,851.75		118,371,851.75
天风证券中北路F地块				444,447,733.41		444,447,733.41
合计	130,136,913.12		130,136,913.12	562,819,585.16		562,819,585.16

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期初余额	本期增加金额	本期转入固定资产金额	本期其他减少金额	期末余额
天风证券光谷一路项目	118,371,851.75	11,765,061.37			130,136,913.12
天风证券中北路F地块	444,447,733.41	161,703,621.19	606,151,354.60		
合计	562,819,585.16	173,468,682.56	606,151,354.60		130,136,913.12

(3). 本期计提在建工程减值准备情况

□适用 √不适用

其他说明

□适用 √不适用

21、使用权资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	其他	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	384,301,524.91	44,357.82	384,345,882.73
2. 本期增加金额	45,725,582.89		45,725,582.89
3. 本期减少金额	2,615,233.99		2,615,233.99
4. 期末余额	427,411,873.81	44,357.82	427,456,231.63
二、累计折旧			
1. 期初余额			
2. 本期增加金额	51,349,823.07	4,669.26	51,354,492.33
(1) 计提	51,349,823.07	4,669.26	51,354,492.33
3. 本期减少金额	754,529.84		754,529.84
(1) 处置	754,529.84		754,529.84
4. 期末余额	50,595,293.23	4,669.26	50,599,962.49
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	376,816,580.58	39,688.56	376,856,269.14
2. 期初账面价值	384,301,524.91	44,357.82	384,345,882.73

其他说明：

无

22、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	交易席位费	软件使用权	土地使用权	特许经营权	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	2,845,780.00	261,240,731.69	525,027,788.00	20,800,000.03	809,914,299.72
2. 本期增加金额		10,737,688.59			10,737,688.59
(1) 购置		10,737,688.59			10,737,688.59
(2) 内部研发					
(3) 企业合并增加					
3. 本期减少金额			211,388,948.41		211,388,948.41
(1) 处置			211,388,948.41		211,388,948.41
4. 期末余额	2,845,780.00	271,978,420.28	313,638,839.59	20,800,000.03	609,263,039.90
二、累计摊销					
1. 期初余额		180,303,969.39	56,286,554.41		236,590,523.80
2. 本期增加金额		17,237,813.76	5,630,247.15		22,868,060.91
(1) 计提		17,237,813.76	5,630,247.15		22,868,060.91
3. 本期减少金额			23,781,256.70		23,781,256.70
(1) 处置			23,781,256.70		23,781,256.70
4. 期末余额		197,541,783.15	38,135,544.86		235,677,328.01
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	2,845,780.00	74,436,637.13	275,503,294.73	20,800,000.03	373,585,711.89
2. 期初账面价值	2,845,780.00	80,936,762.30	468,741,233.59	20,800,000.03	573,323,775.92

本期末通过公司内部研发形成的无形资产占无形资产余额的比例 0%

(2). 未办妥产权证书的土地使用权情况

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

23、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		
天风期货股份有限公司	15,209,584.51					15,209,584.51
武汉光谷创投私募基金管理有限公司 (原名：光谷创投基金管理有限公司)	45,237.49					45,237.49
TFI Asset Management Limited	14,831,718.58					14,831,718.58
企巢天风(武汉)创业投资中心(有限合伙)	593,327.62					593,327.62
TFI Securities and Futures Limited	35,954,598.77					35,954,598.77
合计	66,634,466.97					66,634,466.97

(2). 商誉减值准备

适用 不适用

(3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息

适用 不适用

(4). 说明商誉减值测试过程、关键参数(例如预计未来现金流量现值时的预测期增长率、稳定期增长率、利润率、折现率、预测期等,如适用)及商誉减值损失的确认方法

适用 不适用

注：本公司对因非同一控制下企业合并形成的商誉账面价值进行减值测试。天风期货股份有限公司、TFI Asset Management Limited 及 TFI Securities and Futures Limited 按照市场法并参考可比交易案例的市净率指标，考虑相关影响因素后，对含有商誉资产组的公允价值进行评估。于 2021 年 6 月 30 日，管理层未注意到商誉存在明显减值迹象。

(5). 商誉减值测试的影响

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

24、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
资产减值准备	681,576,678.19	170,394,169.54	746,842,055.81	186,710,513.96
内部交易未实现利润				
可抵扣亏损	63,939,723.78	15,984,930.95	26,643,642.94	6,660,910.74
其他债权投资公允价值变动	7,560,076.46	1,890,019.12	9,834,680.42	2,458,670.11
其他权益工具投资公允价值变动	380,283,114.79	95,070,778.70	381,135,996.54	95,283,999.14
交易性金融资产公允价值变动				
衍生金融工具公允价值变动	33,239,107.51	8,309,776.88	12,316,504.19	3,079,126.05
合计	1,166,598,700.73	291,649,675.19	1,176,772,879.90	294,193,220.00

(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
非同一控制企业合并资产评估增值				
其他债权投资公允价值变动				
其他权益工具投资公允价值变动				
交易性金融资产公允价值变动	1,436,022,452.69	359,005,613.18	1,142,267,235.83	285,566,808.96
衍生金融工具公允价值变动	99,135.00	24,783.75	6,421,230.51	1,605,307.63
合计	1,436,121,587.69	359,030,396.93	1,148,688,466.34	287,172,116.59

(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

(4). 未确认递延所得税资产明细

□适用 √不适用

(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

25、其他资产

√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
应收利息	1,440,461.84	986,805.84
应收股利	12,927,080.64	
其他应收款	923,872,769.52	611,540,154.75
抵债资产		

代理兑付债券		
合同取得成本		
合同履约成本		
应收退货成本		
长期待摊费用	30,244,338.29	37,066,281.28
应收结算担保金	16,551,580.05	14,002,685.81
预付账款	87,717,975.79	100,909,265.28
其他流动资产	6,528,820,432.20	2,694,660,668.15
其他非流动资产	7,015,917,450.85	7,908,816,462.08
合计	14,617,492,089.18	11,367,982,323.19

其他应收款按款项性质列示：

适用 不适用

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他资产的说明：

(1) 其他应收款

1) 按类别明细列示

款项性质	期末余额	期初余额
应收往来款组合	863,788,610.79	872,554,848.92
应收押金组合	41,573,416.28	29,306,656.43
特定款项组合	315,000,000.00	
减：坏账准备	296,489,257.55	290,321,350.60
合计	923,872,769.52	611,540,154.75

2) 其他应收款项账龄分析

账龄	期末余额		期初余额	
	账面余额	比例 (%)	账面余额	比例 (%)
1年以内	969,383,491.98	79.43	641,687,617.08	71.15
1至2年	109,653,396.17	8.99	144,801,736.56	16.06
2至3年	57,682,948.75	4.73	55,548,372.36	6.16
3年以上	83,642,190.17	6.85	59,823,779.35	6.63
合计	1,220,362,027.07	100.00	901,861,505.35	100.00

(2) 长期待摊费用

项目	期初余额	本年增加	本年摊销	其他减少	期末余额
装修改造费	35,426,386.14	4,976,671.70	11,545,526.43		28,857,531.41
软件服务费	1,062,283.99	2,052.83	218,095.73		846,241.09
其他	577,611.15		37,045.36		540,565.79
合计	37,066,281.28	4,978,724.53	11,800,667.52		30,244,338.29

26、 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	30,554,382.00	36,222,990.79
—交易性金融资产		
—转融通融入证券	30,554,382.00	36,222,990.79
转融通融入证券总额	58,995,385.01	63,398,994.00

融券业务违约情况：

√适用 □不适用

于2021年6月30日，本公司融券业务均未发生违约。

融券业务的说明：

无

27、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		期末余额
			转回	转/核销	
拆出资金减值准备					
融出资金减值准备	62,196,118.76	3,670,028.13			65,866,146.89
存出保证金减值准备					
应收款项坏账准备	78,432,955.08	6,589,213.44	1,161.89		85,021,006.63
合同资产减值准备					
买入返售金融资产减值准备	163,020,992.46		93,850,652.89		69,170,339.57
债权投资减值准备		1,045,019.37			1,045,019.37
其他债权投资减值准备	2,090,430.46		115,601.65	153,381.95	1,821,446.86
其他应收款坏账准备	290,321,350.60	6,182,100.01	14,193.06		296,489,257.55
其他金融资产减值准备	200,187,720.57	2,782,963.38			202,970,683.95
金融工具及其他项目信用减值准备小计	796,249,567.93	20,269,324.33	93,981,609.49	153,381.95	722,383,900.82
长期股权投资减值准备	75,371,122.23				75,371,122.23
投资性房地产减值准备					
固定资产减值准备	558,864.89				558,864.89
在建工程减值准备					
无形资产减值准备					
商誉减值准备					
其他资产减值准备小计	75,929,987.12				75,929,987.12
合计	872,179,555.05	20,269,324.33	93,981,609.49	153,381.95	798,313,887.94

资产减值准备的说明：

无

28、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)	

拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	305,192.93	8,110.99	65,552,842.97	65,866,146.89
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备（简化模型）	/	85,021,006.63		85,021,006.63
应收款项坏账准备（一般模型）				
合同资产减值准备（简化模型）	/			
合同资产减值准备（一般模型）				
买入返售金融资产减值准备	80,395.70		69,089,943.87	69,170,339.57
债权投资减值准备	1,045,019.37			1,045,019.37
其他债权投资减值准备	1,821,446.86			1,821,446.86
其他应收款坏账准备		56,133,175.44	240,356,082.11	296,489,257.55
其他金融资产减值准备	5,117,329.91	39,922,823.93	157,930,530.11	202,970,683.95
合计	8,369,384.77	181,085,116.99	532,929,399.06	722,383,900.82
	期初余额			
金融工具类别	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
拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	411,598.49	8,587.95	61,775,932.32	62,196,118.76
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备（简化模型）	/	78,432,955.08		78,432,955.08
应收款项坏账准备（一般模型）				
合同资产减值准备（简化模型）	/			
合同资产减值准备（一般模型）				
买入返售金融资产减值准备	166,928.52		162,854,063.94	163,020,992.46
债权投资减值准备				
其他债权投资减值准备	2,090,430.46			2,090,430.46
其他应收款坏账准备		49,965,268.49	240,356,082.11	290,321,350.60
其他金融资产减值准备	23,522,463.25	69,639,666.31	107,025,591.01	200,187,720.57
合计	26,191,420.72	198,046,477.83	572,011,669.38	796,249,567.93

29、短期借款

(1). 短期借款分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款	610,672,724.00	612,673,200.00
信用借款		17,399,844.46
合计	610,672,724.00	630,073,044.46

短期借款分类的说明：

注：本公司以持有的天风天睿投资股份有限公司股权和天风期货股份有限公司股权质押取得借款。

(2). 已逾期未偿还的短期借款情况

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

30、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	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
收益凭证(注)				1,684,250,000.00	3.7-6.18	3,101,655,869.63	1,566,316,351.74	2,973,284,562.66	1,694,687,658.71
20 天风证券 CP006 短期融资券	2,000,000,000.00	2020/10/20	91 天	2,000,000,000.00	3.4	2,013,562,841.52	3,390,583.13	2,016,953,424.65	
20 天风 S1 短期公司债	2,000,000,000.00	2020/10/19	365 天	2,000,000,000.00	3.65	2,012,166,666.66	38,933,333.33		2,051,099,999.99
20 天风 S2 短期公司债	1,000,000,000.00	2020/12/8	365 天	1,000,000,000.00	3.8	1,004,861,111.11	16,566,666.67		1,021,427,777.78
21 天风证券 CP001 短期融资券	1,000,000,000.00	2021/3/26	91 天	1,000,000,000.00	3		1,007,479,452.05	1,007,479,452.05	
合计	/	/	/	7,684,250,000.00	/	8,132,246,488.92	2,632,686,386.92	5,997,717,439.36	4,767,215,436.48

应付短期融资款的说明：

注：本公司 2021 年 6 月 30 日尚未到期的期限小于一年的收益凭证共计 23 笔，未到期产品的票面利率均在 3.70%-6.18%之间。

31、拆入资金

√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
银行拆入资金	1,130,427,277.78	940,312,999.99
转融通融入资金		505,902,777.78
其他		
合计	1,130,427,277.78	1,446,215,777.77

转融通融入资金：

□适用 √不适用

拆入资金的说明：

无

32、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
债券	86,543,621.84		86,543,621.84	26,120,694.97		26,120,694.97
合计	86,543,621.84		86,543,621.84	26,120,694.97		26,120,694.97

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

(2) 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且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入其他综合收益

□适用 √不适用

(3) 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且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入当期损益

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

33、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
交易所质押式回购	2,232,379,609.04	1,703,058,829.67
银行间质押式卖出回购	9,002,070,737.72	6,605,205,831.70

银行间买断式卖出回购	676,726,495.95	
合计	11,911,176,842.71	8,308,264,661.37

(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		
债券	11,911,176,842.71	8,308,264,661.37
其他		
合计	11,911,176,842.71	8,308,264,661.37

(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
股票		
债券	14,074,548,734.57	10,069,107,678.40
其他		
合计	14,074,548,734.57	10,069,107,678.40

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

□适用 √不适用

卖出回购金融资产款的说明：

□适用 √不适用

34、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	9,069,907,659.49	8,752,009,679.47
机构	3,937,138,240.63	2,178,521,558.79
小计	13,007,045,900.12	10,930,531,238.26
信用业务		
其中：个人	692,099,662.71	640,070,506.51
机构	47,471,048.40	14,301,143.27
小计	739,570,711.11	654,371,649.78
合计	13,746,616,611.23	11,584,902,888.04

代理买卖证券款的说明：

无

35、代理承销证券款

√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
股票		
债券	150,000,000.00	
其中：国债		
金融债券		
企业债券	150,000,000.00	
其他有价证券		
合计	150,000,000.00	

代理承销证券款的说明：

无

36、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	338,109,587.86	710,403,123.35	868,558,776.56	179,953,934.65
二、离职后福利-设定提存计划	167,665.23	36,755,827.80	36,854,923.70	68,569.33
三、辞退福利	245,628.11	1,471,890.77	1,717,518.88	
四、一年内到期的其他福利				
合计	338,522,881.20	748,630,841.92	907,131,219.14	180,022,503.98

(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	336,753,440.45	649,601,074.26	807,800,128.87	178,554,385.84
二、职工福利费		8,494,850.82	8,494,850.82	
三、社会保险费	4,699.22	22,837,513.67	22,821,034.67	21,178.22
其中：医疗保险费	4,427.38	21,113,269.25	21,096,735.01	20,961.62
工伤保险费	29.2	380,120.18	380,135.38	14.00
生育保险费	242.64	1,344,124.24	1,344,164.28	202.60
四、住房公积金	112,593.23	28,794,928.29	28,788,624.89	118,896.63
五、工会经费和职工教育经费	1,238,854.96	674,756.31	654,137.31	1,259,473.96
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	338,109,587.86	710,403,123.35	868,558,776.56	179,953,934.65

(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	161,687.46	35,506,800.64	35,606,675.79	61,812.31
2、失业保险费	5,977.77	1,249,027.16	1,248,247.91	6,757.02
3、企业年金缴费				
合计	167,665.23	36,755,827.80	36,854,923.70	68,569.33

其他说明：

适用 不适用**37、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
增值税	61,008,176.39	59,194,434.96
企业所得税	19,224,590.44	65,895,814.89
个人所得税	24,450,841.09	35,285,979.33
城市维护建设税	1,581,464.77	2,181,772.25
教育费附加及地方教育费附加	1,110,263.09	1,466,249.97
其他	458,519.55	4,333,399.72
合计	107,833,855.33	168,357,651.12

其他说明：

无

38、应付款项**(1). 应付款项列示**适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付清算款项	93,949,180.85	236,889,711.25
期货风险准备金	26,704,281.20	23,718,501.58
应付手续费及佣金	25,975,607.60	19,367,708.28
合计	146,629,069.65	279,975,921.11

(2). 应付票据适用 不适用

其他说明：

适用 不适用**39、合同负债****(1). 合同负债情况**适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
预收账款	43,437,323.31	51,784,278.10
合计	43,437,323.31	51,784,278.10

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

40、持有待售负债

适用 不适用

41、预计负债

适用 不适用

42、长期借款

(1). 长期借款分类

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款	1,189,305,876.00	1,189,306,800.00
抵押借款		
保证借款		
信用借款		
合计	1,189,305,876.00	1,189,306,800.00

长期借款分类的说明：

注：本公司以持有的天风天睿投资股份有限公司股权和天风期货股份有限公司股权质押取得借款。

其他说明，包括利率区间：

适用 不适用

43、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	起息日期	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
16 天风 01	100	2016.6.20	3+2 年	2,000,000,000.00	3.37、4.18	2,040,835,549.98	42,764,450.02	2,083,600,000.00	
16 天风 02	100	2016.8.31	5 年	1,300,000,000.00	3.48	1,314,183,300.99	23,292,524.28		1,337,475,825.27
17 天风 01	100	2017.6.26	3+2 年	1,500,000,000.00	5.38、2.9	1,519,051,797.53	22,839,626.75	43,500,000.00	1,498,391,424.28
17 天风 02	100	2017.10.25	3+2 年	500,000,000.00	5.24、4.0	502,603,602.53	10,286,091.84		512,889,694.37
18 天风 01	100	2018.3.14	3+2 年	2,420,000,000.00	5.95、4.0	2,528,419,914.87	787,484,482.72	1,220,142,030.06	2,095,762,367.53
18 天风 02	100	2018.3.27	3+2 年	880,000,000.00	5.8、4.1	916,502,709.54	520,087,102.81	841,137,369.89	595,452,442.46
19 天风 01	100	2019.4.18	3 年	1,200,000,000.00	4.3	1,234,239,558.47	26,567,815.59	51,600,000.00	1,209,207,374.06
19 天风 02	100	2019.9.11	3 年	1,300,000,000.00	4.47	1,314,911,624.16	29,872,057.32		1,344,783,681.48
19 天风 03	100	2019.10.18	3 年	500,000,000.00	4.3	503,202,214.81	11,064,267.96		514,266,482.77
20 天风 01	100	2020.4.15	3 年	1,500,000,000.00	2.87	1,527,345,035.91	22,220,557.27	43,050,000.00	1,506,515,593.18
21 天风 01	100	2021.1.19	3 年	700,000,000.00	4.18		713,451,799.11	1,981,132.08	711,470,667.03
21 天风 02	100	2021.3.12	2 年	800,000,000.00	4.5		811,234,976.66	2,264,150.94	808,970,825.72
21 天风 04	100	2021.6.28	2 年	2,000,000,000.00	4.12		2,000,709,758.49	5,660,377.36	1,995,049,381.13
17 天风次	100	2017.4.11	5 年	1,000,000,000.00	5.2	1,035,895,085.37	26,621,034.33	52,000,000.00	1,010,516,119.70
18 天风 C1	100	2018.4.26	3 年	900,000,000.00	6	936,750,000.00	17,250,000.00	954,000,000.00	
19 天风 C1	100	2019.8.27	3 年	750,000,000.00	4.99	761,684,399.39	19,065,982.62		780,750,382.01
20 天风 C1	100	2020.2.27	3 年	670,000,000.00	3.9	713,587,294.08	13,198,779.28	26,130,000.00	700,656,073.36
20 天风 C2	100	2020.2.27	5 年	1,080,000,000.00	4.9	1,123,578,509.48	26,582,736.64	52,920,000.00	1,097,241,246.12
20 天风 C3	100	2020.7.2	3 年	1,800,000,000.00	4.7	1,818,524,775.89	42,976,172.58	84,600,000.00	1,776,900,948.47
天庚 4 号	100	2020.6.22	547 天	360,000,000.00	3.5	360,379,726.03	6,213,698.63	6,282,739.73	360,310,684.93
天庚 5 号	100	2020.7.17	546 天	300,000,000.00	4.35	306,006,575.34	6,471,369.87		312,477,945.21
天庚 6 号	100	2020.7.30	545 天	300,000,000.00	4.25	305,414,383.56	6,485,616.44		311,900,000.00
天庚 7 号	100	2020.9.4	728 天	330,000,000.00	4.8	335,164,273.97	7,854,904.11		343,019,178.08
天庚 8 号	100	2020.9.29	488 天	130,000,000.00	4.8	131,607,013.70	3,094,356.16		134,701,369.86
天庚 9 号	100	2020.9.29	489 天	170,000,000.00	4.8	172,101,479.45	4,046,465.76		176,147,945.21
天庚 10 号	100	2020.11.12	729 天	1,000,000,000.00	4.9	1,006,712,328.77	24,298,630.13		1,031,010,958.90
天辛 2 号	100	2021.2.26	544 天	500,000,000.00	4.9		508,323,287.68	7,719,178.09	500,604,109.59
天辛 3 号	100	2021.3.31	548 天	200,000,000.00	4.9		202,470,136.99		202,470,136.99

2021 年半年度报告

天辛 4 号	100	2021.3.30	730 天	300,000,000.00	5.25		304,013,013.70		304,013,013.70
天辛 6 号	100	2021.4.16	546 天	700,000,000.00	5.45		707,943,561.64		707,943,561.64
天辛 7 号	100	2021.4.16	546 天	500,000,000.00	4.9		505,101,369.86		505,101,369.86
天辛 10 号	100	2021.6.30	729 天	100,000,000.00	4.95		100,013,561.64		100,013,561.64
TIANFS4.312/09/22	100 美元	2019.12.09	3 年	200,000,000.00 美元	4.3	1,306,582,509.48	67,915,059.05	80,023,786.04	1,294,473,782.49
TIANFS4.312/09/22	100 美元	2019.12.09	3 年	100,000,000.00 美元	4.3	656,323,803.19	32,864,791.68	39,927,647.05	649,260,947.82
合计						24,371,607,466.49	7,654,680,039.61	5,596,538,411.24	26,429,749,094.86

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：
无

44、租赁负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
房屋及建筑物	370,640,117.08	371,892,850.22
其他	35,568.07	44,357.82
合计	370,675,685.15	371,937,208.04

其他说明：

无

45、递延收益

√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	形成原因
第十批“3551 光谷人才计划”科技（金融）服务人才资助资金	87,000.00			87,000.00	
合计	87,000.00			87,000.00	/

涉及政府补助的项目：

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

46、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
应付利息	5,035,083.33	2,904,776.35
应付股利	8,058,437.06	
其他应付款	427,465,416.21	451,454,092.57
应付账款	288,543,422.59	79,488,174.75
其他流动负债	1,090,368,053.03	690,040,812.88
其他非流动负债	864,368,899.52	1,117,734,687.89
合计	2,683,839,311.74	2,341,622,544.44

其他应付款按款项性质列示：

□适用 √不适用

其他负债的说明：

无

47、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（+、-）				小计	期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他		
股份总数	6,665,967,280.00	1,999,790,184.00				1,999,790,184.00	8,665,757,464.00

其他说明：

2021年3月25日，经中国证券监督管理委员会证监许可（2021）962号文核准，公司非公开发行股票的数量为1,999,790,184股，新增注册资本人民币1,999,790,184元，变更后的注册资本为人民币8,665,757,464.00元。

48、其他权益工具

(1) 其他金融工具划分至其他权益工具的基本情况（划分依据、主要条款和股利或利息的设定机制等）

适用 不适用

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

适用 不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

49、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）	8,091,420,493.48	6,125,948,027.91		14,217,368,521.39
其他资本公积	-175,877,227.02	119,269.89		-175,757,957.13
合计	7,915,543,266.46	6,126,067,297.80		14,041,610,564.26

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期资本溢价增加系公司非公开发行股票所致。

50、库存股

适用 不适用

51、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						税后归属于母公司	税后归属于少数股东	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				
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-423,149,595.38	-37,772,144.89	210,025.60		6,223,111.65	-44,205,282.14	-27,978,252.00	-16,227,030.14	-451,127,847.38	
其中：重新计量设定受益计划变动额										
权益法下不能转损益的其他综合收益										
其他权益工具投资公允价值变动	-423,149,595.38	-37,772,144.89	210,025.60		6,223,111.65	-44,205,282.14	-27,978,252.00	-16,227,030.14	-451,127,847.38	
企业自身信用风险公允价值变动										
二、将重分类进损益的其他综合收益	-45,876,466.45	2,978,006.72	532,363.76			2,445,642.96	2,445,642.96		-43,430,823.49	
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-11,579,025.30	3,280,684.69				3,280,684.69	3,280,684.69		-8,298,340.61	
其他债权投资公允价值变动	-7,376,010.31	2,274,603.96	568,650.99			1,705,952.97	1,705,952.97		-5,670,057.34	
金融资产重分类计入其他综合收益的金额										
其他债权投资信用损失准备	1,917,008.34	-1,374,302.46	-36,287.23			-1,338,015.23	-1,338,015.23		578,993.11	
现金流量套期储备										
外币财务报表折算差额	-28,838,439.18	-1,202,979.47				-1,202,979.47	-1,202,979.47		-30,041,418.65	
其他综合收益合计	-469,026,061.83	-34,794,138.17	742,389.36		6,223,111.65	-41,759,639.18	-25,532,609.04	-16,227,030.14	-494,558,670.87	

项目	期初余额	上期发生金额	期末余额
----	------	--------	------

2021年半年度报告

		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	-242,741,490.86	-228,014,970.70	-22,999,589.16		5,075,425.82	-210,090,807.36	-71,066,560.45	-139,024,246.91	-313,808,051.31
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益									
其他权益工具投资公允价值变动	-242,741,490.86	-228,014,970.70	-22,999,589.16		5,075,425.82	-210,090,807.36	-71,066,560.45	-139,024,246.91	-313,808,051.31
企业自身信用风险公允价值变动									
二、将重分类进损益的其他综合收益	1,410,522.51	-15,959,050.84	552,745.48	2,776,324.69		-19,288,121.01	-19,288,121.01		-17,877,598.50
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-5,815,222.35	105,835.17				105,835.17	105,835.17		-5,709,387.18
其他债权投资公允价值变动	-2,936,734.03	2,040,925.07	510,231.27	2,675,382.80		-1,144,689.00	-1,144,689.00		-4,081,423.03
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	1,347,804.75	170,056.81	42,514.21	100,941.89		26,600.71	26,600.71		1,374,405.46
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	8,814,674.14	-18,275,867.89				-18,275,867.89	-18,275,867.89		-9,461,193.75
其他综合收益合计	-241,330,968.35	-243,974,021.54	-22,446,843.68	2,776,324.69	5,075,425.82	-229,378,928.37	-90,354,681.46	-139,024,246.91	-331,685,649.81

其他综合收益说明：
无

52、 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	331,425,315.71			331,425,315.71
任意盈余公积				
储备基金				
企业发展基金				
其他				
合计	331,425,315.71			331,425,315.71

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

53、 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	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	383,042,819.62	8,675,427.03			391,718,246.65
交易风险准备	339,431,560.18				339,431,560.18
合计	722,474,379.80	8,675,427.03			731,149,806.83

一般风险准备的说明

注：根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（中国证监会公告〔2018〕39号）的规定，本公司按大集合资产管理业务管理费收入计提不低于10%一般风险准备金。

54、 未分配利润

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上年度
调整前上期末未分配利润	2,293,707,677.58	2,012,666,643.86
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		-2,724,056.61
调整后期初未分配利润	2,293,707,677.58	2,009,942,587.25
加：本期归属于母公司所有者的净利润	329,788,428.62	454,871,365.71
减：提取法定盈余公积		39,524,595.91
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备	8,675,427.03	64,133,434.61
应付普通股股利		39,995,803.68
转作股本的普通股股利		
提取交易风险准备		39,524,595.91
其他综合收益结转留存收益	8,271,264.41	-12,072,154.73
期末未分配利润	2,606,549,414.76	2,293,707,677.58

调整期初未分配利润明细：

- 1、由于《企业会计准则》及其相关新规定进行追溯调整，影响期初未分配利润 0 元。
- 2、由于会计政策变更，影响期初未分配利润 0 元。
- 3、由于重大会计差错更正，影响期初未分配利润 0 元。
- 4、由于同一控制导致的合并范围变更，影响期初未分配利润 0 元。
- 5、其他调整合计影响期初未分配利润 0 元。

55、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	674,898,365.91	572,227,576.53
其中：货币资金及结算备付金利息收入	168,142,498.49	124,650,073.99
拆出资金利息收入	16,325,388.84	1,386,666.64
融出资金利息收入	144,533,210.33	210,888,704.49
买入返售金融资产利息收入	132,949,965.29	155,225,620.61
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	21,616,766.99	46,370,121.28
债权投资利息收入	5,314,290.02	43,559,898.84
其他债权投资利息收入	79,982,814.94	28,896,230.68
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	127,650,198.00	7,620,381.28
利息支出	972,790,360.10	772,467,389.89
其中：短期借款利息支出	11,070,536.00	
应付短期融资款利息支出	10,870,035.19	83,218,694.79
拆入资金利息支出	17,988,105.26	6,815,173.50
其中：转融通利息支出	1,245,810.79	
卖出回购金融资产款利息支出	112,409,444.08	98,692,890.93
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	26,388,535.46	17,802,023.92
长期借款利息支出	21,489,864.00	
应付债券利息支出	662,962,412.36	504,425,279.39
其中：次级债券利息支出	145,694,705.45	162,121,935.30
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	109,611,427.75	61,513,327.36
利息净收入	-297,891,994.19	-200,239,813.36

利息净收入的说明：

无

56、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	426,159,119.49	334,011,803.28
证券经纪业务收入	573,412,758.19	467,719,132.25

其中：代理买卖证券业务	286,541,454.39	261,305,238.54
交易单元席位租赁	269,029,478.86	197,924,524.97
代销金融产品业务	17,841,824.94	8,489,368.74
证券经纪业务支出	147,253,638.70	133,707,328.97
其中：代理买卖证券业务	147,253,638.70	133,707,328.97
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
2. 期货经纪业务净收入	28,148,587.50	20,193,115.06
期货经纪业务收入	82,894,088.75	60,621,790.75
期货经纪业务支出	54,745,501.25	40,428,675.69
3. 投资银行业务净收入	365,648,412.79	522,973,050.00
投资银行业务收入	367,848,412.80	522,973,050.00
其中：证券承销业务	307,775,954.74	432,288,822.64
证券保荐业务	9,433,962.26	8,018,867.91
财务顾问业务	50,638,495.80	82,665,359.45
投资银行业务支出	2,200,000.01	
其中：证券承销业务	2,200,000.01	
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4. 资产管理业务净收入	284,981,207.23	421,900,555.43
资产管理业务收入	284,981,207.23	421,900,555.43
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入	9,062,773.00	11,793,282.21
基金管理业务收入	9,062,773.00	11,793,282.21
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	21,953,089.22	32,943,244.35
投资咨询业务收入	21,953,089.22	32,943,244.35
投资咨询业务支出		
7. 其他手续费及佣金净收入	4,393,704.00	13,384,114.13
其他手续费及佣金收入	4,393,704.00	13,384,114.13
其他手续费及佣金支出		
合计	1,140,346,893.23	1,357,199,164.46
其中：手续费及佣金收入	1,344,546,033.19	1,531,335,169.12
手续费及佣金支出	204,199,139.96	174,136,004.66

(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		3,773,584.92
并购重组财务顾问业务净收入--其他	424,528.30	
其他财务顾问业务净收入	50,213,967.50	78,891,774.53

(3) 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	8,883,610,200.00	13,758,637.81	1,073,669,725.40	6,931,830.21
银行理财产品				
信托	301,300,000.00	4,031,602.45	533,495,000.00	1,557,538.53
其他	4,885,603.34	51,584.68		
合计	9,189,795,803.34	17,841,824.94	1,607,164,725.40	8,489,368.74

(4) 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	164.00	61.00	78.00
期末客户数量	101,123.00	206.00	744.00
其中：个人客户	100,783.00	147.00	
机构客户	340.00	59.00	744.00
期初受托资金	56,567,416,425.19	27,744,382,488.62	65,955,632,720.00
其中：自有资金投入	141,290,515.59		429,284,150.00
个人客户	41,051,550,858.92	395,121,780.87	
机构客户	15,374,575,050.68	27,349,260,707.75	65,526,348,570.00
期末受托资金	49,023,579,469.12	23,915,285,061.50	55,166,840,510.00
其中：自有资金投入	1,203,241,616.35		384,629,650.00
个人客户	36,351,275,246.03	605,773,147.76	
机构客户	11,469,062,606.74	23,309,511,913.74	54,782,210,860.00
期末主要受托资产初始成本	38,775,200,757.01	24,860,758,829.99	64,255,071,511.65
其中：股票	730,628,655.87	2,452,400,398.88	
国债	601,165,198.32	105,617,107.10	
其他债券	32,128,682,155.34	6,489,384,339.91	
基金	375,291,212.97	1,357,709,296.34	288,041,008.03
资产支持证券	943,515,462.89	226,077,748.80	63,232,173,113.56
信托	3,406,933,774.35	828,939,493.00	
协议或定期存款		100,000,000.00	100,000,000.00
委贷		1,383,636,980.95	
基金专户理财	488,100,000.00	128,954,535.12	
期货保证金	18,687,981.50		
买入返售金融资产	3,558,327,286.61	1,239,643,802.33	
卖出回购金融资产款	-4,557,162,755.66	-867,051,914.59	
收益权		3,152,000,000.00	
债权类资产		4,419,313,052.14	
期货资管计划	97,985,884.03	156,867,085.09	
股票质押式回购		2,641,614,923.34	
其他	983,045,900.79	1,045,651,981.58	634,857,390.06
当期资产管理业务净收入	241,651,629.71	35,236,222.78	8,093,354.74

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

57、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	7,166,437.29	75,733,250.95
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	650,504,884.32	754,757,684.11
其中：持有期间取得的收益	450,278,376.99	425,560,617.93
—交易性金融工具	449,398,376.99	421,330,617.93
—其他权益工具投资	880,000.00	4,230,000.00
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	200,226,507.33	329,197,066.18
—交易性金融工具	232,540,538.45	379,410,313.76
—其他债权投资	-392,910.34	3,321,614.42
—债权投资		
—衍生金融工具	-31,921,120.78	-53,534,862.00
其他		
合计	657,671,321.61	830,490,935.06

(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	450,349,010.43	423,769,815.43
	处置取得收益	234,060,661.34	383,712,765.96
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	-950,633.44	-2,439,197.50
	处置取得收益	-1,520,122.89	-4,302,452.20
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		

投资收益的说明：

无

58、净敞口套期收益

□适用 √不适用

59、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
个税手续费返还	5,490,173.02	3,939,136.64
政府补助	2,341,642.79	
其他	273,875.86	710,185.72
合计	8,105,691.67	4,649,322.36

其他说明：

无

60、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	139,730,325.89	44,573,062.16
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债	-126,951.00	
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	-40,513,185.58	-288,740.55
其他		
合计	99,090,189.31	44,284,321.61

其他说明：

无

61、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
出租收入	5,066,990.47	3,741,853.94
其他	22,298,735.44	21,351,071.07
合计	27,365,725.91	25,092,925.01

其他业务收入说明：

无

62、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
非流动资产处置收益	-94,737.22	77,695.42
使用权资产清理收益	-106,199.66	
合计	-200,936.88	77,695.42

其他说明：

适用 不适用**63、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	计缴标准
城市维护建设税	6,050,724.11	8,174,445.03	
教育费附加及地方教育附加	4,288,710.64	5,677,214.41	
印花税	436,534.90	1,513,897.72	
其他	834,750.98	975,172.75	
合计	11,610,720.63	16,340,729.91	/

其他说明：

无

64、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
职工费用	735,788,821.67	799,093,737.43
租赁费	20,189,099.31	60,688,599.28
折旧费	68,702,281.33	13,268,117.43
无形资产摊销	19,644,416.11	19,968,769.60
长期待摊费用摊销	11,729,292.91	11,549,089.99
差旅费	34,715,621.52	23,861,608.04
业务招待费	49,719,491.37	34,589,213.94
投资者保护基金	5,125,569.53	8,229,119.51
电子设备运转费	37,270,530.17	32,629,030.51
安全防范费	174,228.54	150,534.13
基金管理费及托管费	300,308.64	7,125,409.30
资产管理计划销售费用	100,446,777.74	186,607,184.56
其他	158,914,686.07	116,571,568.44
合计	1,242,721,124.91	1,314,331,982.16

其他说明：

无

65、信用减值损失适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
融出资金减值损失	3,670,031.88	-265,099.67
应收款项及其他应收款信用减值损失	12,755,958.50	31,507,484.72
买入返售金融资产减值损失	-93,850,652.89	70,667,096.83
其他债权投资减值损失	-113,967.74	170,056.82
债权投资减值损失	1,045,019.37	
其他资产减值损失	2,782,963.38	5,731,282.55

合计	-73,710,647.50	107,810,821.25
----	----------------	----------------

其他说明：

无

66、其他资产减值损失

适用 不适用

67、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
投资性房地产摊销	3,142,262.27	3,142,262.27
其他	538,340.90	829,281.00
合计	3,680,603.17	3,971,543.27

其他说明：

无

68、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
非流动资产处置利得合计	238.54		238.54
其中：固定资产处置利得	238.54		238.54
无形资产处置利得			
债务重组利得			
非货币性资产交换利得			
接受捐赠			
政府补助	52,458,900.00	317,398.02	52,458,900.00
其他	6,025,958.71	1,780,539.36	6,025,958.71
合计	58,485,097.25	2,097,937.38	58,485,097.25

计入当期损益的政府补助

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额	与资产相关/与收益相关
财政扶持资金	52,458,900.00		与收益相关
其他		317,398.02	与收益相关

其他说明：

适用 不适用

69、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
非流动资产处置损失合计	108,072.06	176,606.11	108,072.06
其中：固定资产处置损失	108,072.06	176,606.11	108,072.06
无形资产处置损失			
债务重组损失			
非货币性资产交换损失			
对外捐赠	8,286,902.00	9,944,050.00	8,286,902.00
其他	875,404.79	441,611.93	875,404.79
合计	9,270,378.85	10,562,268.04	9,270,378.85

营业外支出的说明：

无

70、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	22,685,000.31	106,911,985.72
递延所得税费用	73,656,240.95	-36,766,736.46
合计	96,341,241.26	70,145,249.26

(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	492,274,640.48
按法定/适用税率计算的所得税费用	123,068,660.12
子公司适用不同税率的影响	-6,570,327.31
调整以前期间所得税的影响	47,045.98
非应税收入的影响	-33,909,438.98
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	11,513,720.16
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	314,280.15
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	2,620,100.25
其他	-742,799.11
所得税费用	96,341,241.26

其他说明：

适用 不适用

71、其他综合收益

√适用 □不适用

详见附注 51

72、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
收财政补贴收入	54,800,542.79	317,398.02
收到的其他往来款	1,727,863,706.47	305,903,130.84
销售现货收到的现金	149,951,612.50	6,760,000.00
合计	1,932,615,861.76	312,980,528.86

收到的其他与经营活动有关的现金说明：

无

(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
现金支付的业务及管理费用	294,600,693.11	470,452,267.71
支付的投资者保护基金	7,355,931.59	8,229,119.51
捐赠支出	8,286,902.00	9,944,050.00
支付其他往来款	4,433,779,804.51	39,770,340.70
支付的存出保证金	45,105,435.13	134,329,233.68
合计	4,789,128,766.34	662,725,011.60

支付的其他与经营活动有关的现金说明：

无

(3). 收到的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

(4). 支付的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

(5). 收到的其他与筹资活动有关的现金

□适用 √不适用

(6). 支付的其他与筹资活动有关的现金

□适用 √不适用

73、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
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	395,933,399.22	540,242,356.60
加：资产减值准备		
信用减值损失	-73,710,647.50	107,810,821.25
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	17,349,014.77	16,410,379.70
使用权资产摊销	52,619,553.64	
无形资产摊销	19,644,416.11	26,427,682.11
长期待摊费用摊销	11,729,292.91	11,549,089.99
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	200,936.88	77,695.42
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	108,072.06	175,290.97
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-99,090,189.31	-44,284,321.61
财务费用（收益以“-”号填列）	601,459,413.35	563,908,277.94
投资损失（收益以“-”号填列）	-668,089,883.22	-83,284,865.37
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	9,622,919.63	-49,677,943.67
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	71,858,280.34	-10,460,928.43
存货的减少（增加以“-”号填列）		
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额	-3,503,699,519.83	-4,582,241,237.15
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	12,536,787.29	-934,145,280.63
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	3,112,166,677.46	3,456,570,484.92
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-39,361,476.20	-980,922,497.96
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	20,591,171,517.86	15,849,416,689.55
减：现金的期初余额	16,664,104,074.30	10,740,413,953.43
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	3,927,067,443.56	5,109,002,736.12

(2) 本期支付的取得子公司的现金净额

□适用 √不适用

(3) 本期收到的处置子公司的现金净额

□适用 √不适用

(4) 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	20,591,171,517.86	16,664,104,074.30
其中：库存现金	230,078.64	222,832.79
可随时用于支付的银行存款	17,622,550,251.17	14,571,287,530.88
可随时用于支付的其他货币资金		
结算备付金	2,968,391,188.05	2,092,593,710.63
存放同业款项		
拆放同业款项		
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	20,591,171,517.86	16,664,104,074.30
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

其他说明：

□适用 √不适用

74、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

□适用 √不适用

75、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	受限原因
货币资金	47,156,346.20	风险准备金专户存款/司法冻结
固定资产	627,349,683.88	其他非流动负债担保物
无形资产	268,657,452.61	其他非流动负债担保物
存出保证金	41,680,496.71	转融通担保物
交易性金融资产	12,171,679,932.44	卖出回购担保物、转融通证券出借
买入返售金融资产	122,449,941.78	卖出回购担保物
债权投资	605,068,665.71	卖出回购担保物
其他债权投资	244,730,967.81	卖出回购担保物
投资性房地产	131,274,510.28	其他非流动负债担保物
交易性金融资产	1,248,289,262.48	其他非流动负债担保物
合计	15,508,337,259.90	/

其他说明：

无

76、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	14,535,709.57	6.4601	93,902,173.44
欧元	50,358.83	7.6862	387,066.66
港币	460,808,897.26	0.8321	383,429,867.22
应收账款			
其中：美元	4,244,696.01	6.4601	27,421,160.69
港币	525,800,016.66	0.8321	437,507,677.86
结算备付金			
其中：美元	90,034,160.78	6.4601	581,629,925.18
欧元	59,049.60	7.6862	453,865.42
港币	270,298,073.93	0.8321	224,909,621.39
存出保证金			
其中：美元	14,257,072.99	6.4601	92,102,155.04
港币	10,381,540.04	0.8321	8,638,271.84
融出资金			
其中：港币	77,260,266.64	0.8321	64,286,722.67
其他资产			
其中：美元	4,968,906.15	6.4601	32,099,630.62
港币	88,307,285.65	0.8321	73,478,726.24
代理买卖证券款			
其中：港币	914,245,837.04	0.8321	760,725,676.08
其他负债			
其中：港币	193,292,396.21	0.8321	160,834,737.04

其他说明：

无

(2). 境外经营实体说明，包括对于重要的境外经营实体，应披露其境外主要经营地、记账本位币及选择依据，记账本位币发生变化的还应披露原因。

√适用 □不适用

公司全资子公司天风国际证券集团有限公司主要经营地为香港特别行政区，记账本位币为港币。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定，本年度未发生变化。

77、套期

□适用 √不适用

78、政府补助**1. 政府补助基本情况**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
财政扶持资金	54,620,900.00	营业外收入/其他收益	54,620,900.00
其他	179,642.79	其他收益	179,642.79

2. 政府补助退回情况

□适用 √不适用

其他说明

无

79、其他

□适用 √不适用

八、资产证券化业务的会计处理

□适用 √不适用

九、合并范围的变更**1、非同一控制下企业合并**

□适用 √不适用

2、同一控制下企业合并

□适用 √不适用

3、反向购买

□适用 √不适用

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

□适用 √不适用

5、其他原因的合并范围变动

说明其他原因导致的合并范围变动（如，新设子公司、清算子公司等）及其相关情况：

□适用 √不适用

6、其他

□适用 √不适用

十、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	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
天风期货股份有限公司	上海市	上海市	商品期货、金融期货经纪、期货投资咨询	62.94		设立
天风天睿投资股份有限公司	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务	65.724		设立
天风创新投资有限公司	上海市	上海市	投资管理	100		设立
天风(上海)证券资产管理有限公司	上海市	上海市	证券资产管理业务	100		设立
深圳天风天成资产管理有限公司	广东深圳	广东深圳	受托资产管理、投资管理		100	设立
武汉光谷创投私募基金管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资及投资咨询		55	非同一控制下企业合并
武汉天阔投资管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		100	设立
天风天睿物业管理(武汉)有限公司 (曾用名:天风天睿置业(武汉)有限公司)	湖北武汉	湖北武汉	物业管理;装饰装修工程		100	设立
天示(上海)企业管理有限公司	上海市	上海市	金融贸易		100	设立
武汉达昇创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资			结构化主体
武汉泰德鑫创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务			结构化主体
武汉惠人生物创业投资基金中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
天风汇盈壹号(武汉)创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
武汉光谷之星生物产业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
汇智易德咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
天风瑞祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体

汇盈通祺（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天风汇城（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
上海天适新股权投资中心（有限合伙）	上海市	上海市	股权投资、投资咨询			结构化主体
企巢天风（武汉）创业投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务			非同一控制下企业合并
TF International Securities Group Limited	中国香港	中国香港	金融公司的投资和管理	100		非同一控制下企业合并
TFI Securities Limited	中国香港	中国香港	行政管理、人事管理		100	非同一控制下企业合并
TFI Capital Limited（原名：TFI Securities Holdings Limited）	中国香港	中国香港	基金投资及运营管理		100	非同一控制下企业合并
TFI Asset Management Limited	中国香港	中国香港	资产管理业务及投资咨询业务	100		非同一控制下企业合并
TFI Asset Management (Cayman) Ltd.	开曼	开曼	投资基金业务		100	设立
TFI Securities and Futures Limited	中国香港	中国香港	证券经纪业务、期货经纪业务		100	非同一控制下企业合并
睿海天泽咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿嘉恒通咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿嘉恒信咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿正天诚咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿海天源咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿泽天航咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天融鼎信（武汉）股权投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天风汇博（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天融鼎宸（武汉）股权投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体

荆门臻慈天善股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北荆门	湖北荆门	股权投资、投资管理			结构化主体
睿泓天祺咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
睿坤津祥咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
若干证券公司及资产管理公司资产管理计划	上海市	上海市	证券投资			结构化主体

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：

无

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：

无

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

本公司发行及管理的纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司发行的资产管理计划及特定客户资产管理计划。本公司作为资产管理计划管理人考虑对该等结构化主体是否存在控制，并基于本公司作为资产管理人的决策范围、资产管理计划持有人的权力、提供管理服务而获得的报酬和面临的可变动收益风险敞口等因素来判断本公司作为资产管理计划管理人是主要责任人还是代理人。经评估后，本公司承担主要责任人的资产管理计划纳入合并范围。

确定公司是代理人还是委托人的依据：

- 1、存在单独一方拥有实质性权利可以无条件罢免决策者的，该为代理人；
- 2、除 1 以外的情况下，综合考虑决策者对被投资方的决策权范围，其他方享有的实质性权利、决策者的薪酬水平、决策者因持有被投资方中其他权益所承担可变回报的风险等相关因素进行判断。

其他说明：

无

(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
天风期货股份有限公司	37.06	1,513,603.45		144,684,518.55
天风天睿投资股份有限公司	34.276	8,576,887.69		1,064,207,716.59

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明：

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

(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
天风期货股份有限公司	6,868,901,902.83	6,478,495,754.56	5,947,354,178.51	5,561,032,227.34
天风天睿投资股份有限公司	16,180,928,947.99	11,874,421,412.28	13,453,841,225.80	9,095,778,404.44

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
天风期货股份有限公司	84,055,327.74	4,084,197.10	4,084,197.10	245,689,629.84	80,281,559.92	13,289,101.53	13,289,101.53	241,647,466.37
天风天睿投资股份有限公司	81,267,739.96	26,382,146.15	-3,334,067.28	402,511,481.57	99,927,644.33	31,224,480.48	-65,265,371.60	98,939,972.13

其他说明：

无

(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制:

适用 不适用

(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持:

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

适用 不适用

3、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

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	
宜宾市商业银行股份有限公司	四川宜宾	四川宜宾	商业银行	7.16		权益法
恒泰证券股份有限公司	内蒙古呼和浩特	内蒙古呼和浩特	证券公司	26.49		权益法

在合营企业或联营企业的持股比例不同于表决权比例的说明:

无

持有 20%以下表决权但具有重大影响, 或者持有 20%或以上表决权但不具有重大影响的依据:

持有 20%以下表决权但具有重大影响的依据为在宜宾市商业银行股份有限公司派驻一名董事。

(2). 重要合营企业的主要财务信息

适用 不适用

(3). 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	
	宜宾市商业银行股份有限公司	恒泰证券股份有限公司	宜宾市商业银行股份有限公司	恒泰证券股份有限公司
资产合计	59,925,127,160.42	35,235,273,968.36	56,410,388,114.64	33,596,030,823.86
负债合计	54,494,386,228.11	25,811,174,140.26	50,794,222,134.31	24,160,265,859.56
少数股东权益	312,547,231.55	397,892,872.62	260,597,355.52	404,532,030.30
归属于母公司股东权益	5,118,193,700.76	9,026,206,955.48	5,355,568,624.81	9,031,232,934.00
按持股比例计算的净资产份额	366,462,668.97	2,391,042,222.51	383,458,713.54	2,392,373,604.22
调整事项		1,722,175,767.51		1,722,175,767.51
--商誉		1,722,175,767.51		1,722,175,767.51

对联营企业权益投资的账面价值	396,106,536.21	4,113,217,990.02	383,458,713.54	4,114,549,371.73
营业收入	743,963,180.51	986,072,618.31	605,820,316.97	1,028,056,978.49
净利润	192,541,668.06	-11,929,071.78	179,402,461.24	145,960,412.40
其他综合收益	18,219,328.73	7,463,935.58	8,784,569.82	-8,015,572.95
综合收益总额	210,760,996.79	-4,465,136.20	194,764,751.22	137,944,839.45
本年度收到的来自联营企业的股利				

其他说明：

无

(4). 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
合营企业：		
投资账面价值合计		
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润		
--其他综合收益		
--综合收益总额		
联营企业：		
投资账面价值合计	21,739,551.76	22,608,870.74
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	-869,318.98	-274,689.42
--其他综合收益		
--综合收益总额	-869,318.98	-274,689.42

其他说明：

无

(5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明：

适用 不适用

(6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损

适用 不适用

(7). 与合营企业投资相关的未确认承诺

适用 不适用

(8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

适用 不适用

4、重要的共同经营

适用 不适用

5、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

本公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本公司发起设立的投资基金和资产管理计划，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。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

期末本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项目	期末余额		期初余额	
	账面价值	最大损失敞口	账面价值	最大损失敞口
集合资产管理计划	1,012,585,953.58	1,012,585,953.58	845,764,810.41	845,764,810.41

注：集合资产管理计划列示在财务报表中的“交易性金融资产”项目中，最大损失敞口为集合资产管理计划在资产负债表日的账面价值（公允价值）。

6、其他

适用 不适用

十一、与金融工具相关的风险

适用 不适用

详见本报告第十节、财务报告十七、风险管理

十二、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			
	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	合计
一、持续的公允价值计量				
（一）交易性金融资产	5,002,104,910.64	19,187,679,809.23	8,288,811,234.98	32,478,595,954.85
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	5,002,104,910.64	19,187,679,809.23	8,288,811,234.98	32,478,595,954.85
（1）债务工具投资	415,470,567.68	16,216,781,109.03	800,361,993.11	17,432,613,669.82
（2）权益工具投资	4,586,634,342.96	2,970,898,700.20	7,488,350,101.92	15,045,883,145.08
（3）衍生金融资产			99,139.95	99,139.95
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
（1）债务工具投资				
（2）权益工具投资				
（二）其他债权投资		556,142,771.50	748,387,380.98	1,304,530,152.48
（三）其他权益工具投资	4,640,000.00	352,237,765.99	2,814,437,144.84	3,171,314,910.83
（四）投资性房地产				
1. 出租用的土地使用权				
2. 出租的建筑物				

3. 持有并准备增值后转让的土地使用权				
(五) 生物资产				
1. 消耗性生物资产				
2. 生产性生物资产				
持续以公允价值计量的资产总额	5,006,744,910.64	20,096,060,346.72	11,851,635,760.80	36,954,441,018.16
(六) 交易性金融负债				
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	86,543,621.84		33,239,107.51	119,782,729.35
其中：发行的交易性债券	86,543,621.84			86,543,621.84
衍生金融负债			33,239,107.51	33,239,107.51
其他				
2. 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债				
持续以公允价值计量的负债总额	86,543,621.84		33,239,107.51	119,782,729.35
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

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

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

本公司持续第二层次公允价值计量项目估值通常基于底层投资(投资组合中公开交易的权益工具)的公允价值计算得出,所有重大输入值均为市场中直接或间接可观察的输入值。债券投资的公允价值是采用第三方估值机构估值系统的报价,第三方估值机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。股指期货合约、商品期货合约及利率互换合约的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

合并财务报表持续第三层次公允价值计量项目估值采用管理层自对手方处获取估值报价,或使用估值技术确定其公允价值,包括现金流贴现分析、净资产价值、市场可比法和期权定价模型等。这些金融工具的公允价值可能基于对估值有重大影响的不可观测输入值,因此公司将其分为第三层次。不可观测输入值包括流动性折扣、风险调整折扣、经调整的波动率和市场乘数等。合并财务报表持续第三层次公允价值计量项目对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

5、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析适用 不适用**6、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策**适用 不适用

报告期内，本公司持有部分全国中小企业股份转让系统挂牌的股票摘牌，或前十二个月累计换手率较低，层级由第二层次调整为第三层次；本公司持有的部分上市股权解除限售期，层级由第二层次调整至第一层次；本公司持有部分全国中小企业股份转让系统挂牌的股票前十二个月累计换手率较低，层级由第一层次调整为第二层次或者第三层次。

7、本期内发生的估值技术变更及变更原因适用 不适用**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

于2021年6月30日，本公司管理层认为除应付债券外，其他金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

截至2021年6月30日，本公司所持有应付债券账面价值为人民币26,429,749,094.86元，公允价值为人民币26,335,291,866.27元。

9、其他适用 不适用**十三、关联方及关联交易****1、本企业的母公司情况**适用 不适用**2、本企业的子公司情况**

本企业子公司的情况详见附注

适用 不适用

详见本报告第十节财务报告十、在其他主体中的权益1、在子公司中的权益。

3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

适用 不适用

详见本报告第十节财务报告十、在其他主体中的权益3、在合营企业或联营企业中的权益。

本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

适用 不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
-----------	--------

湖北三环资本管理有限公司	联营企业
--------------	------

其他说明：

□适用 √不适用

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
武汉商贸集团有限公司	持股 5%以上股东
人福医药集团股份公司	持股 5%以上股东
湖北省联合发展投资集团有限公司	持股 5%以上股东
湖北省融资担保集团有限责任公司	持股 5%以上股东（湖北省联合发展投资集团有限公司）之子公司
武汉当代科技产业集团股份有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	第一大股东武汉商贸集团有限公司之子公司
武汉三特索道集团股份有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业
武汉天盈投资集团有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北天乾资产管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉当代天信财富投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
长瑞当代资本管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
当代国际集团有限公司 (DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED)	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉光谷新技术产业投资有限公司	公司监事担任该公司董事
武汉当代瑞通投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
杭州财悦科技有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉睿通致和投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉光谷融资租赁有限公司	第一大股东武汉商贸集团有限公司之子公司
正隆保险经纪股份有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
崇阳三特隽水河旅游开发有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉当代科技投资有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北人福医药集团有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉高科国有控股集团有限公司	公司监事担任该公司董事
天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之结构化主体
崇阳三特文旅开发有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉当代文化教育产业投资有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业

其他说明：

无

5、关联交易情况**(1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易**

采购商品/接受劳务情况表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
崇阳三特文旅开发有限公司	业务及管理费-招待费	35,926.00	

恒泰证券股份有限公司	业务及管理费-资产管理计划销售费用	371,548.36	
正隆保险经纪股份有限公司	业务及管理费-咨询费	1,125,000.00	2,184,466.05
杭州财悦科技有限公司	业务及管理费-咨询费	7,075,471.70	5,094,339.60
崇阳三特隼水河旅游开发有限公司	业务及管理费-差旅费		41,913.21
武汉当代科技产业集团股份有限公司	利息支出-存款利息支出	651.02	234.44
武汉商贸集团有限公司	利息支出-存款利息支出	3,931.77	10,627.45
武汉光谷新技术产业投资有限公司	利息支出-存款利息支出	6.34	123.68
湖北省联合发展投资集团有限公司	利息支出-存款利息支出	16,811.40	
天凤睿源(武汉)股权投资中心(有限合伙)	利息支出-存款利息支出	390.25	
武汉当代天信财富投资管理有限公司	利息支出-存款利息支出	1.22	
武汉天盈投资集团有限公司	利息支出-存款利息支出	991.35	
武汉当代瑞通投资管理有限公司	利息支出-存款利息支出	477.53	
武汉高科国有控股集团有限公司	利息支出-存款利息支出	29.05	
当代国际集团有限公司(DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED)	利息支出-其他流动负债/其他非流动负债利息支出		201,286.11

出售商品/提供劳务情况表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券承销收入	3,537,735.85	
武汉当代文化教育产业投资有限公司	财务顾问收入	2,830,188.68	
湖北天乾资产管理有限公司	其他业务收入-其他	17,679.20	
湖北天乾资产管理有限公司	证券承销收入		14,150,943.40
湖北人福医药集团有限公司	资产管理收入		754,716.98
人福医药集团股份公司	证券承销收入	17,924,528.30	2,146,226.42
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	证券承销收入		5,660,377.36
杭州财悦科技有限公司	投资咨询收入		1,047,169.80
当代国际集团有限公司(DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED)	资产管理费收入	2,233,927.30	523,000.96
湖北三环资本管理有限公司	其他业务收入-其他		89,393.65
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券经纪收入	99.84	14.15
武汉天盈投资集团有限公司	证券承销收入		5,660,377.36
武汉三特索道集团股份有限公司	资产管理费收入		58,455.71
武汉当代瑞通投资管理有限公司	利息收入		920,028.67
武汉光谷融资租赁有限公司	受托资产收入		69,336.61
武汉商贸集团有限公司	证券承销收入		2,122,641.51
武汉当代科技投资有限公司	证券承销收入		7,075,471.70
武汉当代瑞通投资管理有限公司	证券经纪收入	9,312.08	

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

□适用 √不适用

(2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表：

□适用 √不适用

关联托管/承包情况说明：

适用 不适用

本公司委托管理/出包情况表：

适用 不适用

关联管理/出包情况说明：

适用 不适用

(3). 关联租赁情况

本公司作为出租方：

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	出租办公用房	1,602,407.70	1,602,407.70
武汉当代天信财富投资管理有限公司	出租办公用房	674,529.54	674,529.54
长瑞当代资本管理有限公司	出租办公用房	73,774.33	
武汉睿通致和投资管理有限公司	出租办公用房	72,389.40	72,389.40
正隆保险经纪股份有限公司	出租办公用房		48,838.78

本公司作为承租方：

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

出租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁费	上期确认的租赁费
湖北省融资担保集团有限责任公司	租赁办公用房	1,491,040.28	1,491,040.29
宜宾市商业银行股份有限公司	租赁办公用房	70,780.68	91,800.00

关联租赁情况说明

适用 不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本公司持有关联方的使用权资产金额为人民币 660,619.69 元。

于 2021 年 6 月 30 日，本公司持有关联方的租赁负债金额为人民币 564,671.51 元。

(4). 关联担保情况

本公司作为担保方

适用 不适用

本公司作为被担保方

适用 不适用

关联担保情况说明

适用 不适用

(5). 关联方资金拆借

适用 不适用

(6). 关联方资产转让、债务重组情况

适用 不适用

(7). 关键管理人员报酬

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	3,410.06	4,302.58

(8). 其他关联交易

√适用 □不适用

天风证券 2020 年购买恒泰证券股份有限公司管理的恒泰盈沃致远 1 号集合资产管理计划，截止 2021 年 6 月 30 日其公允价值为 3,590.28 万元，成本为 3,395.96 万元。天风证券担任恒泰盈沃致远 1 号集合资产管理计划的投资顾问，本期确认财务顾问收入 493,685.92 元。

6、关联方应收应付款项

(1). 应收项目

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收账款	湖北三环资本管理有限公司			255,556.49	15,953.13
应收账款	武汉当代天信财富投资管理有限公司	1,416,512.04	70,825.60	1,416,512.04	70,825.60
应收账款	长瑞当代资本管理有限公司	311,285.38	5,903.82	115,056.58	5,903.82
应收账款	武汉天盈投资集团有限公司	149,664.07	60,832.04	149,664.07	60,832.04
应收账款	武汉睿通致和投资管理有限公司	211,576.71	9,756.34	173,572.31	9,756.34
应收账款	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	2,243,370.80	28,042.14	560,842.70	28,042.14
应收账款	湖北天乾资产管理有限公司	13,170.00	658.50	13,170.00	658.50
预付款项	宜宾市商业银行股份有限公司			107,100.00	
预付款项	正隆保险经纪股份有限公司	187,500.00		1,312,500.00	

(2). 应付项目

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
代理买卖证券款	武汉商贸集团有限公司	5,938,025.29	7,824.49
代理买卖证券款	武汉当代科技产业集团股份有限公司	312.25	350,852.42
代理买卖证券款	武汉高科国有控股集团有限公司	16,436.91	16,407.86
代理买卖证券款	武汉当代瑞通投资管理有限公司	291.65	883.77
代理买卖证券款	武汉天盈投资集团有限公司	4.08	17,246.63
代理买卖证券款	武汉当代天信财富投资管理有限公司	689.07	687.85
代理买卖证券款	天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	81.50	348,977.10
代理买卖证券款	湖北省联合发展投资集团有限公司	1,566,484.87	
代理买卖证券款	武汉光谷新技术产业投资有限公司	3,588.30	
其他应付款	武汉睿通致和投资管理有限公司	173,572.36	173,572.36

7、关联方承诺

适用 不适用

8、其他

适用 不适用

十四、股份支付

1、股份支付总体情况

适用 不适用

2、以权益结算的股份支付情况

适用 不适用

3、以现金结算的股份支付情况

适用 不适用

4、股份支付的修改、终止情况

适用 不适用

5、其他

适用 不适用

十五、承诺及或有事项

1、重要承诺事项

适用 不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

1) 天风证券股份有限公司于2020年8月4日召开第三届董事会第三十三次会议，同意为设立的全资资产管理子公司天风（上海）证券资产管理有限公司出具担保承诺函，提供最高额度为人民币13.18亿元的净资本担保承诺，截至2021年6月30日，上述担保余额为8.18亿元。

2、或有事项

(1). 资产负债表日存在的重要或有事项

适用 不适用

1) 新疆天山畜牧生物工程股份有限公司诉控股子公司武汉光谷创投私募基金管理有限公司管理的武汉泰德鑫创业投资中心（有限合伙）之股权转让纠纷案

2019年10月28日，天山生物就股权转让一案向昌吉市人民法院提起诉讼，法院于2019年10月28日立案审理。天山生物请求判令撤销与各被告之间的股权转让行为暨撤销原告与33名被告（包含武汉泰德鑫创业投资中心（有限合伙））于2017年9月7日就各被告向原告转让大

象广告股份有限公司之发行股份及现金购买资产协议。请求判令被告武汉泰德鑫创业投资中心（有限合伙）向原告返还天山生物股份 6,088,524 股，由原告将该股份注销；如果其无法足额向原告返还上述股份，则应将交付不足部分的股份数折算现金补偿金支付给原告。目前该案件正处于一审过程中。

(2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

除上述事项外，截至 2021 年 6 月 30 日，本公司无重大需披露的或有事项。

3、其他

适用 不适用

十六、资产负债表日后事项

1、重要的非调整事项

适用 不适用

2、利润分配情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

拟分配的利润或股利	43,328,787.32
经审议批准宣告发放的利润或股利	43,328,787.32

3、销售退回

适用 不适用

4、其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

(1) 发行短期融资券

2021 年 7 月 29 日发行 2021 年第二期短期融资券（简称“21 天风 CP002”），发行总额 10 亿元，短期融资券期限 91 天，票面利率 2.58%。

(2) 公司于 2021 年 7 月 30 日召开第四届董事会第五次会议审议通过《关于天风天睿非公开发行公司债券的议案》，审议通过公司控股子公司天风天睿投资股份有限公司（以下简称“天风天睿”）发行总额不超过人民币 3 亿元、期限不超过 5 年的非公开发行创新创业（或科技创新）公司债券和总额不超过人民币 12 亿元、期限不超过 5 年的非公开发行公司债券，同意由公司对以上债券提供全额无条件不可撤销的连带责任保证担保，天风天睿向公司提供保证反担保。公司于 2021 年 7 月 30 日就本次担保事项与天风天睿签署了《担保协议》与《担保函》。

十七、 风险管理

1、 风险管理政策及组织架构

(1). 风险管理政策

√适用 □不适用

公司始终秉持风险与收益匹配的风险管理理念，定位于稳健的风险偏好，以完善的制度体系为依据，构建全面风险管理监控信息系统，选取适当的风险控制指标和风险限额，运用科学的风险管理方法和风险计量模型，持续完善报告和应对机制，综合管理信用风险、市场风险、流动性风险和操作风险等经营活动中面临的各类风险，保障日常经营活动中的各类风险可测、可控和可承受。

(2). 风险治理组织架构

√适用 □不适用

公司致力于建立与自身经营战略及风险偏好相匹配的、全面的风险管理体系。公司建立风险管理架构的四个层级和四道防线，覆盖风险管理的各个领域，公司风险管理架构体系为：董事会及其下设的风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会以及监事会；公司经营管理层及其下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监；风险管理部门，包括风险管理部、合规法律部、稽核审计部、资金计划部、财务核算部、品牌管理部；公司除风险管理部门之外的各部门、分支机构、子公司及公司全体成员。各风险管理层在各自的职责范围内履行风险管理的职责。

1) 第一层级为董事会及其下设的风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会以及监事会。

董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，负责制定风险管理战略和风险管理政策，推进风险管理文化建设；确定风险管理原则，审议批准公司全面风险管理的基本制度，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；审议公司定期风险评估报告；任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；建立与首席风险官的直接沟通机制；以及公司章程规定的其他事项。

董事会下设风险管理委员会，主要负责研究制定公司总体风险控制和风险管理政策，审查公司风险控制体系及其有效性，监控、检查公司经营管理和业务运作，审查公司内部风险控制制度的落实情况，研究制定公司重要风险的界限以及董事会赋予的其他职责。风险管理委员会对董事会负责，向董事会报告。

董事会下设审计委员会，主要负责监督公司的外部审计，指导公司的内部审计工作，促进公司建立有效的内部控制，评估内部控制的有效性。审计委员会对董事会负责，向董事会报告。

董事会下设薪酬与提名委员会，主要负责拟定高级管理层的薪酬方案、绩效考核制度以及激励方案，审查公司高级管理人员的履行职责情况并对其进行年度绩效考评。薪酬与提名委员会对董事会负责，向董事会报告。

公司设立监事会，承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

2) 第二层级为公司经营管理层及其下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监。

公司经营管理层是公司全面风险管理工作的组织机构，负责制定风险管理制度；建立健全公司全面风险管理的组织架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；制定董事会设定的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保设定要求的有效落实；对突破设定要求的情况进行监督，及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；将风险管理的有效性纳入高级管理人员、各部门、分支机构、子公司及全体工作人员的绩效考核范围；建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制；以及风险管理的其他职责。

公司经营管理层下设合规与风险管理委员会。合规与风险管理委员会主要负责对公司的整体风险状况进行评估，研究确定公司风险控制指标，对公司的总体风险管理进行监督，以确保与公司经营活动相关联的各种风险控制在合理的范围内。

公司经营管理层下设其他专业委员在公司经营管理层的要求下，负责各条线专项发展和研究，根据公司风险管理政策，制定各条线专项质量控制标准。公司其他专业委员会向公司经营管理层汇报。

公司设立首席风险官。首席风险官是公司的高级管理人员，由公司董事会聘任，并经中国证监会派出机构的认可。首席风险官对公司董事会负责，向董事长报告工作，负责全面风险管理工作，具体职权包括：执行合规与风险管理委员会制定的风险管理政策；制定风险管理的程序和操作规程，并监督其实施情况；及时了解公司风险水平及其管理状况；确保公司开展风险管理工作具备足够的人力、物力和恰当的组织机构、管理信息系统以及技术水平；有效识别、计量、监测和控制各项业务所承担的风险；就公司环境、战略、运营过程中所存在的风险提出建议，并定期向董事会报告；参加或者列席与其履行职责相关的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。

公司设立合规总监。合规总监负责为公司内部管理制度和业务规则的合规性把关并监督执行，对公司重大决策和主要业务活动进行合规审核，对公司的合规状况以及内部控制的有效性进行检测和检查，及时发现违法违规行为，按照职责分工和程序进行查处或移交处理。合规总监对董事会负责，向董事会汇报。

3) 第三层级为风险管理部门，包括风险管理部、合规法律部、稽核审计部、资金计划部、财务核算部、品牌管理部。

风险管理部为全面风险管理部门，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、分支机构及子公司的风险管理工作。

合规法律部是公司在合法、合规方面的主要内部控制职能部门，对公司经营与管理活动的合法、合规进行控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务，保障公司在合法、合规的前提下开展业务经营。合规法律部主要负责合规管理制度、流程的建设与实施；提供日常合规建议与咨询；新业务新产品合规风险审核；合规风险事项调查、督促整改与落实；起草公司法律文书、代理公司诉讼、调解和仲裁等事务；反洗钱管理及反洗钱制度的制定和实施；组织合规培训、推动合规文化建设、培养公司员工合规意识等工作。

稽核审计部负责公司稽核审计工作的职能部门，主要通过系统、规范的方法，审查和评价业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性，以促进完善治理、增加价值和实现目标。稽核审计部依据国家法律、法规、制度，以及公司内部的有关规章制度、办法开展稽核审计工作。

资金计划部、财务核算部为流动性风险管理部，统筹公司资金来源与融资管理，协调安排公司资金需求，开展现金流管理，监控优质流动性资产状况，组织流动性风险应急计划制定、演练和评估；负责制定流动性风险管理策略、措施和流程；监测流动性风险限额执行情况，及时报告超限额情况；定期向首席风险官报告流动性风险水平、管理状况及其重大变化；组织开展流动性风险压力测试。

品牌管理部为公司声誉风险管理管理部门，负责管理公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司产生负面评价的风险。

4) 第四层级为公司除风险管理部门之外的各部门、分支机构、子公司及公司全体成员。各风险管理层在各自的职责范围内履行风险管理的职责。

①信息技术中心负责公司各种信息系统的运行与维护，保障公司信息系统的稳定运行，监督整个信息系统的安全性及信息流的规范性。

②结算存管部负责公司客户资金的管理和监控，确保客户资金的安全性。

③人力资源部负责员工从业资格和员工合同管理工作合法合规。

④公司经纪业务、信用交易业务、新三板做市业务、证券投资业务、资产管理业务、投资银行业务等业务部门或分公司、各证券营业部在授权业务范围内履行直接的风险管理、监督职能，负有直接的、基础性的、流程化的风险管理责任。

⑤证券公司对于子公司风险管理工作实行垂直管理，要求并确保子公司在整体风险偏好和风险管理制度框架下，建立自身的风险管理组织架构、制度流程、信息技术系统和风控指标体系，保障全面风险管理的一致性和有效性。子公司风险管理工作负责人的任命由证券公司首席风险官提名，子公司董事会聘任，其解聘应征得证券公司首席风险官同意。子公司风险管理工作负责人应在首席风险官指导下开展风险管理工作，并向首席风险官履行风险报告义务。子公司风险管理工作负责人应由证券公司首席风险官考核，考核权重不低于 50%。

公司确定风险管理的四道防线。公司各部门、分支机构、子公司及全体员工对其职责范围内的风险管理事项进行检查与督导，贯彻执行公司各项风险管理制度，通过部门及岗位的相互制衡实施风险控制措施，形成公司风险管理第一道风险防线；公司风险管理部、合规法律部、资金计

划部、财务核算部、品牌管理部作为公司风险管理部门具体负责公司市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、声誉风险、合规及法律风险的识别、监测、检查和报告，确保公司风险得到有效控制与管理，构成公司风险管理第二道防线；公司稽核审计部通过系统、规范的方法，审查和评价业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性，以促进完善治理，形成公司风险管理第三道防线；公司经营管理层及其下设的合规与风险管理委员会、其他专业委员会、首席风险官、公司合规总监制定并执行风险管理政策，对公司的整体风险状况进行评估与监督，以确保与公司经营活动相关联的各种风险控制在合理的范围内，形成公司风险管理第四道防线。

2、信用风险

√适用 □不适用

公司面临的信用风险指借款人或交易对手未能或不愿履行协议中约定的义务而造成经济损失的风险。公司的信用风险主要来自以下三个方面：（1）融资融券业务、股票质押式回购交易业务、银行间债券回购业务的客户出现违约，不能及时向本公司履行相应债务的风险；（2）债券、信托产品以及其他信用类产品投资业务由于发行人或融资人违约，导致相应的本息无法及时支付的风险；（3）经纪业务代理客户买卖证券、期货及其他金融产品，在结算当日客户资金不足时，代客户进行结算后客户违约而形成的损失。

截至2021年6月30日，公司融资融券业务平均维持担保比例为302.84%，自有资金参与股票质押式回购业务平均履约保障比例为160.07%，客户违约风险有所降低；公司开展银行间债券回购业务选择信用等级高、资本实力雄厚、履约能力强的交易对手开展交易，并监控交易对手信用风险敞口；公司开展债券交易选择高信用等级且具有较强偿付能力融资人发行的高等级债券，公司投资产品的信用风险低。在信用风险管理方面，公司坚持业务发展的安全性、流动性与效益性的有效统一，公司坚持在有效控制交易对手违约损失的前提下，运用审慎、可测、可控、可承受的风险管理方式，确保公司资产组合所面临的信用风险不会对公司持续经营产生重大影响。

报告期末，公司不考虑任何担保物及其他信用增级措施的最大信用风险敞口如下：

单位：
元人民币

项 目	2021年6月30日	2020年12月31日
货币资金	17,689,997,977.08	14,622,925,091.99
结算备付金	2,968,391,374.12	2,092,593,710.63
拆出资金	1,000,578,305.55	600,408,750.00
融出资金	4,960,458,031.84	5,617,229,266.37
交易性金融资产	32,478,496,814.90	27,805,124,322.55
衍生金融资产	99,139.95	
买入返售金融资产	2,690,026,255.04	3,624,293,940.73
应收款项	1,460,074,231.47	1,395,310,400.35
存出保证金	3,969,215,511.65	3,234,252,212.13

债权投资	1,371,592,290.62	
其他债权投资	1,304,530,152.48	1,468,154,478.25
其他权益工具投资	3,171,314,910.83	3,279,330,455.93
最大信用风险敞口	73,064,774,995.53	63,739,622,628.93

3、流动风险

√适用 □不适用

流动性风险，是指证券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其他资金需求的风险。公司建立了流动性管理指标体系，对关键指标进行监控，一旦指标预警，及时进行调整。同时，公司建立最低备付金额度制度，在资金计划中预留以备意外支出的最低备付金额。公司积极开展资金缺口管理，通过测算资金流量缺口，有效管理支付风险。公司持续拓展融资渠道和方式的多元化，避免由于融资渠道过于集中或融资方式过于单一而导致的筹资困难。

4、市场风险

√适用 □不适用

公司面临的市场风险是指公司的持仓投资组合因风险因子发生不利变动导致投资损失的风险，公司的持仓组合主要来自于自营投资、做市业务及其他投资业务。公司持仓组合的市值采用公允价值计算，因此持仓市值随风险因子及持仓组合变动每日发生变动。公司面临的市场风险的主要类别如下：（1）权益类风险：来自于持仓组合的股票、股指期货、期权等权益类证券价格及其波动率变动的风险暴露；（2）利率类风险：来自于持仓组合在固定收益投资收益率曲线结构、利率波动性和信用利差等变化的风险暴露；（3）商品类风险：来自于商品远期价格及波动率变化的风险暴露。

公司根据董事会制定的风险偏好、风险容忍度指标，结合各类投资的风险与收益状况进行资本分配，并根据业务之间的相关性与分散化效应将公司的整体风险限额划分至各业务部门或各业务线，并制定相应的授权。业务部门是市场风险的承担者，负责具体业务开展中的风险管理工作，业务部门负责人及投资经理在其授权范围内进行投资，动态管理其持仓部分暴露的市场风险，通过降低敞口或对冲等风险缓释措施控制风险。

风险管理部作为独立的风险管理部门，向公司首席风险官负责，使用风险管理工具和方法对各投资策略、业务部门/条线和全公司等不同层级的市场风险状况进行独立监控、测量和管理，并按日、周、月等不同频率生成相应的风险报告和分析评估报告，报送公司合规与风险管理委员会、经营管理层以及相应业务部门/条线的主要负责人。当发生接近或超过风险限额情况时，风险管理部及时向业务部门/条线的主要负责人发布预警和提示，并督促业务部门落实应对措施。

报告期内，公司自营投资（含子公司投资）业务按风险类别分别计量的风险价值如下：

1、风险价值（VAR（1Day, 95%））

风险来源	单日 95%VAR（单位：元人民币）	
	2021年6月30日	2020年12月31日
权益类市场风险	60,530,140.11	66,738,184.19
利率类市场风险	33,948,173.99	37,548,474.43
商品类市场风险	18,905,998.37	1,005,844.94
分散化效益	-40,091,226.24	-39,126,033.81
合计	73,293,086.24	66,166,469.75

2、利率敏感性分析

公司使用利率敏感性分析衡量在其他变量假设不变的情况下，因利率变动导致固定收益类投资损失的风险。假设市场整体利率平行变动时，固定收益类持仓的利率敏感性分析情况如下：

情景	利率敏感性（单位：元人民币）	
	2021年6月30日	2020年12月31日
上升 25 个基点	-94,084,800.00	-50,130,000.00
下降 25 个基点	94,084,800.00	50,130,000.00

十八、其他重要事项

1、前期会计差错更正

(1). 追溯重述法

适用 不适用

(2). 未来适用法

适用 不适用

2、债务重组

适用 不适用

3、资产置换

(1). 非货币性资产交换

适用 不适用

(2). 其他资产置换

适用 不适用

4、年金计划

适用 不适用

5、 终止经营

适用 不适用

6、 分部信息

(1). 报告分部的确定依据与会计政策

适用 不适用

本公司的报告分部按照经营业务类型的不同，主要划分为：证券及期货经纪业务分部、证券自营业务分部、投资银行业务分部、资产管理业务分部、私募基金业务分部以及其他业务分部。

(2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	期货公司业务	其他业务	私募基金业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	670,424,519.49	898,309,203.83	356,007,658.28	329,632,366.35	65,778,068.67	-508,567,004.03	14,059,549.76	198,282,639.06	1,627,361,723.29
手续费及佣金净收入	445,911,793.75	7,180,277.70	352,171,609.31	307,646,761.22	28,208,104.17	4,109,986.56	10,294,163.61	15,175,803.09	1,140,346,893.23
投资收益		627,676,778.91		4,267,772.00	5,000,320.00	8,085,789.22	29,011,884.73	16,371,223.25	657,671,321.61
其他收入	224,512,725.74	263,452,147.22	3,836,048.97	17,717,833.13	32,569,644.50	-520,762,779.81	-25,246,498.58	166,735,612.72	-170,656,491.55
二、营业支出	426,771,425.85	123,774,349.22	203,135,762.14	172,442,826.94	60,773,799.09	205,072,963.51	29,090,078.00	36,759,403.54	1,184,301,801.21
三、营业利润	243,653,093.64	774,534,854.61	152,871,896.14	157,189,539.41	5,004,269.58	-713,639,967.54	-15,030,528.24	161,523,235.52	443,059,922.08
四、资产总额	9,404,543,192.36	31,905,333,538.34	747,406,037.12	1,350,639,802.86	6,876,134,460.62	58,799,504,251.44	10,931,342,531.19	25,701,055,410.60	94,313,848,403.33
五、负债总额	7,398,975,409.33	15,938,783,723.09	1,168,538,599.47	135,853,129.28	6,436,890,550.83	39,320,324,691.51	6,674,858,357.34	13,127,722,722.35	63,946,501,738.50
六、补充信息									
七、信用减值损失	-80,355,021.63	1,053,252.40		10,777,534.30	2,587.60	4,720,418.23	-218,916.19	9,690,502.21	-73,710,647.50

(3). 公司无报告分部的，或者不能披露各报告分部的资产总额和负债总额的，应说明原因

适用 不适用

(4). 其他说明

适用 不适用

7、 租赁

适用 不适用

项目	2021年半年度
租赁负债利息费用	9,028,719.91
计入当期损益的采用简化处理的短期租赁费用	20,031,415.90
计入当期损益的采用简化处理的低价值资产租赁费用（短期租赁除外）	157,683.42
与租赁相关的总现金流出	77,946,044.81

8、 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用 不适用

9、 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
金融资产					
1、交易性金融资产（不含衍生金融资产）	27,805,124,322.55	139,730,325.89			32,478,496,814.90

2、衍生金融资产		99,139.95			99,139.95
3、其他债权投资	1,468,154,478.25		-5,091,064.23	-113,967.74	1,304,530,152.48
4、其他权益工具投资	3,279,330,455.93		-451,127,847.38		3,171,314,910.83
金融资产小计	32,552,609,256.73	139,829,465.84	-456,218,911.61	-113,967.74	36,954,441,018.16
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	32,552,609,256.73	139,829,465.84	-456,218,911.61	-113,967.74	36,954,441,018.16
金融负债	31,510,662.99	-40,739,276.53			119,782,729.35

10、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
货币资金	17,689,997,977.08				
结算备付金	2,968,391,374.12				
拆出资金	1,000,578,305.55				
融出资金	4,960,458,031.84				
衍生金融资产				99,139.95	
买入返售金融资产	2,690,026,255.04				
应收款项	1,460,074,231.47				
存出保证金	3,969,215,511.65				
交易性金融资产				32,478,496,814.90	
债权投资	1,371,592,290.62				
其他债权投资		1,304,530,152.48			
其他权益工具投资			3,171,314,910.83		

其他资产	941,864,811.41					
合计	37,052,198,788.78	1,304,530,152.48	3,171,314,910.83	32,478,595,954.85		
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	14,622,925,091.99					
结算备付金	2,092,593,710.63					
拆出资金	600,408,750.00					
融出资金	5,617,229,266.37					
买入返售金融资产	3,624,293,940.73					
应收款项	1,395,310,400.35					
存出保证金	3,234,252,212.13					
交易性金融资产				27,805,124,322.55		
其他债权投资		1,468,154,478.25				
其他权益工具投资			3,279,330,455.93			
其他资产	626,529,646.40					
合计	31,813,543,018.60	1,468,154,478.25	3,279,330,455.93	27,805,124,322.55		

(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	610,672,724.00			
应付短期融资款	4,767,215,436.48			
拆入资金	1,130,427,277.78			

交易性金融负债		86,543,621.84		
衍生金融负债		33,239,107.51		
卖出回购金融资产款	11,911,176,842.71			
代理买卖证券款	13,746,616,611.23			
代理承销证券款	150,000,000.00			
应付款项	146,629,069.65			
长期借款	1,189,305,876.00			
应付债券	26,429,749,094.86			
租赁负债	370,675,685.15			
其他负债	721,043,922.13			
合计	61,173,512,539.99	119,782,729.35		
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	630,073,044.46			
应付短期融资款	8,132,246,488.92			
拆入资金	1,446,215,777.77			
交易性金融负债		26,120,694.97		
衍生金融负债		5,389,968.02		
卖出回购金融资产款	8,308,264,661.37			
代理买卖证券款	11,584,902,888.04			
应付款项	279,975,921.11			
长期借款	1,189,306,800.00			
应付债券	24,371,607,466.49			
其他负债	534,266,729.82			
合计	56,476,859,777.98	31,510,662.99		

11、外币金融资产和金融负债

√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
金融资产					
1、交易性金融资产	442,676,780.22	2,534,260.83			691,850,547.58
2、衍生金融资产					
3、贷款和应收款	465,391,631.89				463,825,983.59
4、其他债权投资	731,018,285.24			-122,200.77	748,387,380.98
5、其他权益工具投资					
金融资产小计	1,639,086,697.35	2,534,260.83		-122,200.77	1,904,063,912.15
金融负债	26,120,694.97	-126,951.00			86,543,621.84

12、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

□适用 √不适用

13、其他

□适用 √不适用

十九、 母公司财务报表主要项目注释

1、 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	其他		
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											

宜宾市商业银行股份有限公司	383,458,713.54			11,344,334.52	1,303,488.15					396,106,536.21	75,371,122.23
恒泰证券股份有限公司	4,114,549,371.73			-3,308,578.25	1,977,196.54					4,113,217,990.02	
小计	4,498,008,085.27			8,035,756.27	3,280,684.69					4,509,324,526.23	75,371,122.23
三、对子公司投资											
天风天睿投资股份有限公司	1,398,047,668.16									1,398,047,668.16	
天风期货股份有限公司	268,537,000.00									268,537,000.00	
TFI Asset Management Limited	18,983,167.90									18,983,167.90	
天风创新投资有限公司	805,955,450.00	20,000,000.00								825,955,450.00	
TFI Securities Group Limited	431,873,264.37	256,924,738.09								688,798,002.46	
天风(上海)证券资产管理有限公司	500,000,000.00	500,000,000.00								1,000,000,000.00	
小计	3,423,396,550.43	776,924,738.09								4,200,321,288.52	
合计	7,921,404,635.70	776,924,738.09		8,035,756.27	3,280,684.69					8,709,645,814.75	75,371,122.23

其他说明：
无

2、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	246,714,542.04	580,589,537.93	697,935,277.60	129,368,802.37
二、离职后福利-设定提存计划	46,235.17	31,021,567.72	30,999,233.56	68,569.33
三、辞退福利		1,387,290.77	1,387,290.77	
四、一年内到期的其他福利				
合计	246,760,777.21	612,998,396.42	730,321,801.93	129,437,371.70

(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	245,358,394.63	528,997,958.72	646,387,099.79	127,969,253.56
二、职工福利费		7,512,888.72	7,512,888.72	
三、社会保险费	4,699.22	19,143,642.85	19,127,163.85	21,178.22
其中：医疗保险费	4,427.38	17,636,161.03	17,619,626.79	20,961.62
工伤保险费	29.20	317,024.09	317,039.29	14.00
生育保险费	242.64	1,190,457.73	1,190,497.77	202.60
四、住房公积金	112,593.23	24,394,605.90	24,388,302.50	118,896.63
五、工会经费和职工教育经费	1,238,854.96	540,441.74	519,822.74	1,259,473.96
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	246,714,542.04	580,589,537.93	697,935,277.60	129,368,802.37

(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	40,257.40	29,961,366.05	29,939,811.14	61,812.31
2、失业保险费	5,977.77	1,060,201.67	1,059,422.42	6,757.02
3、企业年金缴费				
合计	46,235.17	31,021,567.72	30,999,233.56	68,569.33

其他说明：

□适用 √不适用

3、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	416,866,523.58	459,229,958.83
其中：货币资金及结算备付金利息收入	114,092,913.97	93,350,725.59
拆出资金利息收入	16,325,388.84	1,386,666.64
融出资金利息收入	144,533,210.33	210,887,456.29
买入返售金融资产利息收入	37,126,144.03	62,004,457.42
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	19,919,552.85	45,749,136.90
债权投资利息收入	8,822,948.58	3,518,403.97
其他债权投资利息收入	17,648,511.16	28,896,230.68
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	78,317,406.67	59,186,018.24
利息支出	861,024,602.10	718,202,625.93
其中：短期借款利息支出	11,070,536.00	
应付短期融资款利息支出	10,870,035.19	83,218,694.79
拆入资金利息支出	17,988,105.26	6,815,173.50
其中：转融通利息支出	1,245,810.79	
卖出回购金融资产利息支出	112,401,755.53	98,339,299.59
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	15,189,809.81	12,457,386.86
长期借款利息支出	21,489,864.00	
应付债券利息支出	662,962,412.36	504,832,302.16
其中：次级债券利息支出	145,694,705.45	158,392,427.10
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	9,052,083.95	12,539,769.03
利息净收入	-444,158,078.52	-258,972,667.10

利息净收入的说明：

无

4、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	401,479,592.20	325,986,611.81
证券经纪业务收入	548,733,230.90	459,693,940.78
其中：代理买卖证券业务	261,736,939.48	253,280,047.07
交易单元席位租赁	269,029,478.86	197,924,524.97
代销金融产品业务	17,966,812.56	8,489,368.74
证券经纪业务支出	147,253,638.70	133,707,328.97
其中：代理买卖证券业务	147,253,638.70	133,707,328.97
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
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	312,404,761.57	472,602,287.02

投资银行业务收入	314,604,761.58	472,602,287.02
其中：证券承销业务	254,532,303.52	396,631,266.91
证券保荐业务	9,433,962.26	8,018,867.91
财务顾问业务	50,638,495.80	67,952,152.20
投资银行业务支出	2,200,000.01	
其中：证券承销业务	2,200,000.01	
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4. 资产管理业务净收入		417,807,369.91
资产管理业务收入		417,807,369.91
资产管理业务支出		
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	20,797,170.31	21,938,454.19
投资咨询业务收入	20,797,170.31	21,938,454.19
投资咨询业务支出		
7. 其他手续费及佣金净收入	4,280,496.45	3,406,522.47
其他手续费及佣金收入	4,280,496.45	3,406,522.47
其他手续费及佣金支出		
合计	738,962,020.53	1,241,741,245.40
其中：手续费及佣金收入	888,415,659.24	1,375,448,574.37
手续费及佣金支出	149,453,638.71	133,707,328.97

(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		3,773,584.92
并购重组财务顾问业务净收入--其他	424,528.30	
其他财务顾问业务净收入	50,213,967.50	64,178,567.28

(3). 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	8,883,610,200.00	13,883,625.43	1,073,669,725.40	6,931,830.21
银行理财产品				
信托	301,300,000.00	4,031,602.45	533,495,000.00	1,557,538.53
其他	4,885,603.34	51,584.68		
合计	9,189,795,803.34	17,966,812.56	1,607,164,725.40	8,489,368.74

(4). 资产管理业务

□适用 √不适用

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

5、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		
权益法核算的长期股权投资收益	8,035,756.27	75,679,656.55
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	496,732,191.38	585,138,005.50
其中：持有期间取得的收益	350,461,444.49	352,370,259.02
—交易性金融工具	350,461,444.49	352,370,259.02
—其他权益工具投资		
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	146,270,746.89	232,767,746.48
—交易性金融工具	178,275,547.19	282,371,200.77
—其他债权投资	-392,910.34	3,321,614.42
—债权投资		
—衍生金融工具	-31,611,889.96	-52,925,068.71
其他		
合计	504,767,947.65	660,817,662.05

(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	351,412,077.93	354,809,456.52
	处置取得收益	179,795,670.08	286,673,652.97
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	-950,633.44	-2,439,197.50
	处置取得收益	-1,520,122.89	-4,302,452.20
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益		

投资收益的说明：

无

6、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	201,195,305.51	10,599,711.20
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债		
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	-40,051,508.53	-157,808.55
其他		
合计	161,143,796.98	10,441,902.65

公允价值变动收益的说明：

无

7、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
职工费用	599,186,396.39	675,477,913.64
租赁费	16,279,203.86	54,356,934.39
折旧费	57,358,763.79	10,473,672.29
无形资产摊销	15,664,763.47	14,256,702.79
长期待摊费用摊销	9,922,618.50	10,161,564.16
差旅费	31,458,106.64	22,367,071.84
业务招待费	45,257,618.85	32,366,516.23
投资者保护基金	3,598,806.60	8,229,119.51
电子设备运转费	27,694,334.79	13,503,879.24
安全防范费	174,228.54	150,534.13
其他	90,199,081.35	95,863,031.77
资产管理计划销售费用		186,607,184.56
合计	896,793,922.78	1,123,814,124.55

业务及管理费的说明：

无

8、其他

□适用 √不适用

二十、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	-202,570.74	
越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免		
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）	54,800,542.79	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	2,521,501.14	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
所得税影响额	-14,237,347.05	
少数股东权益影响额	-184,732.12	
合计	42,697,394.02	

对公司根据《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》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

适用 不适用

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	1.62	0.04	0.04
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	1.41	0.04	0.04

3、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

4、其他

适用 不适用

董事长：余磊

董事会批准报送日期：2021 年 8 月 30 日

修订信息

适用 不适用

第十一节 证券公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

时间	许可单位	文号	行政许可文件名称
2021 年 3 月 25 日	中国证监会	证监许可[2021]962 号	关于核准天风证券股份有限公司非公开发行股票批复

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

公司 2021 年度分类评级为 A 类 A 级。