

公司代码：601108

公司简称：财通证券

财通证券股份有限公司 2021 年半年度报告



财通证券股份有限公司
CAITONG SECURITIES CO.,LTD.

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、公司负责人陆建强、主管会计工作负责人王跃军及会计机构负责人(会计主管人员)周瀛声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

本公司2021年半年度未拟定利润分配预案和公积金转增股本预案。

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、发展战略等前瞻性陈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的真实性和完整性

否

十、重大风险提示

公司在经营过程中面临的主要风险包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险及信息技术风险等，具体体现为：因整体经济及外部环境影响，如宏观经济及货币政策、监管市场价格的不利变动而使公司可能发生损失的风险；证券发行人、交易对手、债务人未能履行合同所规定的义务或由于信用评级的变动、履约能力的变化导致债务的市场价值变动，从而对公司造成损失的风险；公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险；由于内部制度流程失效、员工行为不当、信息技术风险，以及外部事件影响所

造成损失的风险；及因公司经营、管理及其他行为或外部事件导致对公司声誉产生负面评价的风险等。

公司建立了有效的内部控制体系、合规管理体系和动态的风险控制指标监管体系，以确保公司经营在风险可测、可控、可承受的范围内开展。有关公司经营面临的风险，敬请投资者认真阅读本报告第三节“管理层讨论与分析”的相关内容。

十一、其他

适用 不适用

本报告中若出现总数与各分项数值之和尾数有不符的情况，均系四舍五入原因造成。

目录

| | | |
|------|------------------|-----|
| 第一节 | 释义 | 5 |
| 第二节 | 公司简介和主要财务指标..... | 6 |
| 第三节 | 管理层讨论与分析..... | 16 |
| 第四节 | 公司治理..... | 37 |
| 第五节 | 环境与社会责任..... | 39 |
| 第六节 | 重要事项..... | 42 |
| 第七节 | 股份变动及股东情况..... | 48 |
| 第八节 | 优先股相关情况..... | 51 |
| 第九节 | 债券相关情况..... | 51 |
| 第十节 | 财务报告..... | 58 |
| 第十一节 | 证券公司信息披露..... | 227 |

| | |
|--------|-------------------------------------|
| 备查文件目录 | 载有公司法定代表人签名并加盖公司公章公司2021年半年度报告文本 |
| | 载有法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名并盖章的财务报表 |
| | 其他有关材料 |

第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

| 常用词语释义 | | |
|-------------|---|----------------------|
| 公司/本公司/财通证券 | 指 | 财通证券股份有限公司 |
| 报告期 | 指 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 财通有限 | 指 | 财通证券有限责任公司 |
| 财通经纪 | 指 | 财通证券经纪有限责任公司，系财通有限前身 |
| 实际控制人 | 指 | 浙江省财政厅 |
| 浙江金控/控股股东 | 指 | 浙江省金融控股有限公司 |
| 浙江财开 | 指 | 浙江省财务开发有限责任公司 |
| 天和证券 | 指 | 天和证券经纪有限公司 |
| 财通证券资管 | 指 | 财通证券资产管理有限公司 |
| 财通资本 | 指 | 浙江财通资本投资有限公司 |
| 财通创新 | 指 | 财通创新投资有限公司 |
| 永安期货 | 指 | 永安期货股份有限公司 |
| 财通基金 | 指 | 财通基金管理有限公司 |
| 财通香港 | 指 | 财通证券（香港）有限公司 |
| 财通国际证券 | 指 | 财通国际证券有限责任公司 |
| 财通国际资管 | 指 | 财通国际资产管理有限公司 |
| 财通国际投资 | 指 | 财通国际投资有限公司 |
| 财缘通 | 指 | 财缘通（上海）投资咨询有限公司 |
| 中国证监会 | 指 | 中国证券监督管理委员会 |
| 上交所 | 指 | 上海证券交易所 |
| 浙江证监局 | 指 | 中国证券监督管理委员会浙江监管局 |
| 全国社保基金理事会 | 指 | 中华人民共和国全国社会保障基金理事会 |
| 公司法/《公司法》 | 指 | 《中华人民共和国公司法》 |
| 证券法/《证券法》 | 指 | 《中华人民共和国证券法》 |
| 《上市规则》 | 指 | 《上海证券交易所股票上市规则》 |
| 《公司章程》 | 指 | 现行有效的《财通证券股份有限公司章程》 |
| 董事会 | 指 | 财通证券股份有限公司董事会 |
| 监事会 | 指 | 财通证券股份有限公司监事会 |

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 | 财通证券股份有限公司 |
| 公司的中文简称 | 财通证券 |
| 公司的外文名称 | CAITONG SECURITIES CO.,LTD |
| 公司的外文名称缩写 | CAITONGSECURITIES |
| 公司的法定代表人 | 陆建强 |
| 公司总经理 | 黄伟建 |

备注：2021年8月25日，经公司第三届董事会第十三次会议审议通过，聘任黄伟建先生为公司总经理。

注册资本和净资产

| | 本报告期末 | 上年度末 |
|------|-------------------|-------------------|
| 注册资本 | 3,589,000,000.00 | 3,589,000,000.00 |
| 净资产 | 15,508,265,441.84 | 16,552,723,746.87 |

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

本公司及其控股子公司所处的证券行业实行严格的市场准入制度，本公司及其控股子公司从事的业务已取得相关主管部门的业务许可或者取得其颁发的业务许可证书或者资格证书。

（一）经营证券期货业务许可证

本公司持有《营业执照》和中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。

（二）其他主要业务资格

1、公司取得的其他主要业务资格

| 序号 | 业务资质名称 | 文号/证件号 | 发证机构 |
|----|-----------------|---------------------------|----------------|
| 1 | 证券经纪业务资格 | 证监机构字（2003）66号 | 中国证监会 |
| 2 | 网上证券委托业务资格 | 证监信息字（2004）2号 | 中国证监会 |
| 3 | 结算参与人资格 | 《中国证券登记结算有限责任公司结算参与人结算协议》 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 4 | 开放式证券投资基金代销业务资格 | 证监基金字（2006）136号 | 中国证监会 |

| 序号 | 业务资质名称 | 文号/证件号 | 发证机构 |
|----|---------------------------|----------------------------------|----------------------|
| 5 | 代理“上证基金通”业务资格 | 《关于同意财通证券经纪有限责任公司开展“上证基金通”业务的函》 | 上海证券交易所 |
| 6 | 提供中间介绍业务资格 | 证监许可（2008）1214号 | 中国证监会 |
| 7 | 参加全国银行间同业拆借中心组织的债券交易资格 | 中汇交公告（2008）62号 | 中国外汇交易中心、全国银行间同业拆借中心 |
| 8 | 自营业务和证券承销业务资格 | 证监许可（2008）1467号 | 中国证监会 |
| 9 | 全国银行间同业拆借市场资格 | 银总部复（2009）69号 | 中国人民银行上海总部 |
| 10 | 证券资产管理业务和证券投资咨询业务资格 | 证监许可（2009）1292号 | 中国证监会 |
| 11 | 保荐机构资格 | 证监许可（2010）430号 | 中国证监会 |
| 12 | 代办系统主办券商业务资格 | 中证协函（2011）469号 | 中国证券业协会 |
| 13 | 融资融券业务资格 | 证监许可（2012）644号 | 中国证监会 |
| 14 | 中小企业私募债券承销资格 | 中证协函（2012）371号 | 中国证券业协会 |
| 15 | 约定购回式证券交易权限 | 上证会字（2012）222号 | 上海证券交易所 |
| 16 | 约定购回式证券交易权限 | 深证会（2013）15号 | 深圳证券交易所 |
| 17 | 代销金融产品业务资格 | 浙证监许可（2013）19号 | 中国证监会浙江证监局 |
| 18 | 作为转融通业务借入人参与转融通业务资格 | 中证金函（2013）117号 | 中国证券金融公司 |
| 19 | 浙江股权交易中心推荐商会员资格 | 《关于授予中信证券股份有限公司等66家机构推荐商会员资格的通告》 | 浙江股权交易中心 |
| 20 | 股票质押式回购交易权限 | 深证会（2013）63号 | 深圳证券交易所 |
| 21 | 股票质押式回购交易权限 | 上证会字（2013）98号 | 上海证券交易所 |
| 22 | 全国中小企业股份转让系统从事推荐业务和经纪业务资格 | 股转系统函（2013）942号 | 全国中小企业股份转让系统有限责任公司 |
| 23 | 转融券业务资格 | 上证函（2014）371号 | 上海证券交易所 |
| 24 | 作为主办券商在全国中小企业股份转让系统从事做市业务 | 股转系统公告（2014）80号 | 全国中小企业股份转让系统 |
| 25 | 港股通业务交易权限 | 上证函（2014）595号 | 上海证券交易所 |
| 26 | 互联网证券业务试点 | 中证协函（2014）727号 | 中国证券业协会 |
| 27 | 柜台市场试点资格 | 中证协函（2014）774号 | 中国证券业协会 |
| 28 | 股票期权经纪业务交易资格 | 上证函（2015）134号 | 上海证券交易所 |
| 29 | 中国人民银行全国银行间债券市场准入备案 | 2008006 | 中国人民银行上海总部 |
| 30 | 进入利率互换市场的资格 | - | 全国银行间同业拆借中心 |
| 31 | 上市公司股权激励行权融资业务资格 | 深证函（2019）677号 | 深圳证券交易所 |

| 序号 | 业务资质名称 | 文号/证件号 | 发证机构 |
|----|-----------------------|-----------------|------------|
| 32 | 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问业务 | 浙证监许可(2020)6号 | 中国证监会浙江证监局 |
| 33 | 证券投资基金托管资格 | 证监许可(2020)2829号 | 中国证监会 |

2、控股子公司取得的其他主要业务资格

| 序号 | 业务资质名称 | 文号/证件号 | 发证机构 |
|---------------|---|------------------|----------------|
| 财通资管 | | | |
| 1 | 公开募集证券投资基金管理业务资格 | 证监许可(2015)3010号 | 中国证监会 |
| 2 | 经营证券期货业务许可证 | 流水号 000000000976 | 中国证监会 |
| 财通资本 | | | |
| 1 | 证券业协会会员 | 1107 | 中国证券业协会 |
| 2 | 证券投资基金业协会观察会员 | 00031580 | 中国证券投资基金业协会 |
| 财通创新 | | | |
| 1 | 证券业协会会员 | 1331 | 中国证券业协会 |
| 财通香港 | | | |
| 1 | 放债人牌照 | 编号 1855/2020 | 牌照法庭 |
| 财通国际资管 | | | |
| 1 | 牌照《证券及期货条例》(第1类: 证券交易; 第4类: 就证券提供意见; 第9类: 提供资产管理) | BBB678 | 香港证券及期货事务监察委员会 |
| 财通国际证券 | | | |
| 1 | 牌照《证券及期货条例》(第1类: 证券交易; 第4类: 就证券提供意见) | AZF063 | 香港证券及期货事务监察委员会 |
| 2 | 香港联合交易所有限公司的交易参与者资格 | 交易所参与者证明书 P1608 | 香港交易所 |
| 财通国际融资 | | | |
| 1 | 牌照《证券及期货条例》(第1类: 证券交易; 第6类: 就机构融资提供意见) | BN0823 | 香港证券及期货事务监察委员会 |

二、联系人和联系方式

| | 董事会秘书 | 证券事务代表 |
|----|-------|--------|
| 姓名 | 官勇华 | 何干良 |

| | | |
|------|---------------------------|---------------------------|
| 联系地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼 | 浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼 |
| 电话 | 0571-87821312 | 0571-87821312 |
| 传真 | 0571-87823288 | 0571-87823288 |
| 电子信箱 | ir@ctsec.com | heganliang@ctsec.com |

三、基本情况变更简介

| | |
|---------------|--|
| 公司注册地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼 |
| 公司注册地址的历史变更情况 | 2020年7月22日，公司注册地址由“杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201, 501, 502, 1103, 1601-1615, 1701-1716室”变更为“浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼”。 |
| 公司办公地址 | 浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼 |
| 公司办公地址的邮政编码 | 310007 |
| 公司网址 | http://www.ctsec.com |
| 电子信箱 | ir@ctsec.com |
| 报告期内变更情况查询索引 | 不适用 |

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 | 财通证券股份有限公司董事会办公室 |
| 报告期内变更情况查询索引 | 不适用 |

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 | 财通证券 | 601108 | 不适用 |

六、其他有关资料

适用 不适用

| | | |
|-----------------|---------|--------------------------|
| 公司聘请的会计师事务所（境内） | 名称 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） |
| | 办公地址 | 北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层 |
| | 签字会计师姓名 | 王国蓓、黄小熠 |

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 | 3,187,063,102.17 | 2,883,914,246.44 | 10.51 |
| 归属于母公司股东的净利润 | 1,045,386,539.97 | 820,335,289.45 | 27.43 |
| 归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 1,031,153,100.49 | 824,631,712.02 | 25.04 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 2,793,444,916.82 | 1,405,478,197.12 | 98.75 |
| 其他综合收益 | 2,867,556.38 | 44,991,292.56 | -93.63 |
| | 本报告期末 | 上年度末 | 本报告期末比上年度末增减(%) |
| 资产总额 | 97,510,213,245.40 | 96,658,845,911.30 | 0.88 |
| 负债总额 | 74,245,656,734.48 | 73,201,841,046.60 | 1.43 |
| 归属于母公司股东的权益 | 23,255,091,550.69 | 23,447,794,571.04 | -0.82 |
| 所有者权益总额 | 23,264,556,510.92 | 23,457,004,864.70 | -0.82 |

(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) | 0.29 | 0.22 | 31.82 |
| 稀释每股收益(元/股) | 0.28 | 0.22 | 27.27 |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股) | 0.28 | 0.22 | 27.27 |
| 加权平均净资产收益率(%) | 4.40 | 3.79 | 增加0.61个百分点 |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%) | 4.34 | 3.81 | 增加0.53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

净资产收益率和每股收益按照《公开发行证券的公司信息披露编报规则第9号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》的规定计算。

(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 | 15,508,265,441.84 | 16,552,723,746.87 |
| 净资产 | 20,883,391,599.40 | 21,421,496,766.38 |
| 风险覆盖率(%) | 232.87 | 254.48 |
| 净资本/净资产(%) | 74.26 | 77.27 |
| 净资本/负债(%) | 28.85 | 30.81 |
| 净资产/负债(%) | 38.85 | 39.87 |
| 资本杠杆率(%) | 15.01 | 15.13 |
| 融资(含融券)的金额/净资本(%) | 137.20 | 135.74 |
| 流动性覆盖率(%) | 331.29 | 245.63 |
| 净稳定资金率(%) | 142.60 | 160.43 |
| 自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%) | 9.71 | 11.57 |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%) | 233.38 | 196.52 |

报告期内，母公司净资本和流动性等主要风险控制指标持续符合《证券公司风险控制指标管理办法》规定的监管标准。

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 | 33,971.48 | 主要是固定资产处置收益 |
| 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 | 18,232,391.95 | 主要是政府补助 |
| 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 | | |

| | | |
|---|---------------|-----------------------|
| 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 | 1,258,385.60 | 主要是收到已单独计提坏账准备的应收款的还款 |
| 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 | -1,005,384.93 | 主要是对外捐赠和赔偿支出 |
| 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 | | |
| 所得税影响额 | -4,285,924.62 | |
| 合计 | 14,233,439.48 | |

十、其他

√适用 □不适用

公司根据《证券公司年度报告内容与格式准则（2013年修订）》（证监会公告[2013]41号）的相关规定编制财务报告中主要项目会计数据。

公司从 2021 年 1 月 1 日起施行财政部修订的《关于修订印发〈企业会计准则第 21 号——租赁〉的通知》（财会〔2018〕35 号）（以下简称“新租赁准则”），本期财务报告个别科目的增减变动受新租赁准则的影响，存在重分类及科目调整的情况，参阅“本报告第十节财务报告五、50、重要会计政策和会计估计的变更”。

（一）合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

| 项 目 | 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 增减幅度 |
|-----------|-------------------|-------------------|----------|
| 货币资金 | 19,058,086,581.26 | 20,521,337,750.35 | -7.13% |
| 结算备付金 | 5,252,497,849.32 | 4,234,817,326.72 | 24.03% |
| 融出资金 | 19,517,331,753.37 | 19,983,550,132.30 | -2.33% |
| 衍生金融资产 | 192,923,368.00 | 63,404,936.60 | 204.27% |
| 存出保证金 | 320,149,714.71 | 533,420,494.66 | -39.98% |
| 应收款项 | 217,035,427.23 | 258,105,399.31 | -15.91% |
| 买入返售金融资产 | 2,639,744,375.42 | 3,505,415,741.42 | -24.70% |
| 交易性金融资产 | 24,739,422,345.68 | 24,938,451,516.22 | -0.80% |
| 债权投资 | 8,386,363,518.98 | 6,481,371,854.01 | 29.39% |
| 其他债权投资 | 6,789,949,514.53 | 7,036,028,384.00 | -3.50% |
| 其他权益工具投资 | 132,828,205.70 | 131,444,319.58 | 1.05% |
| 长期股权投资 | 7,138,583,191.40 | 6,700,813,877.62 | 6.53% |
| 投资性房地产 | 20,609,079.21 | 21,481,423.71 | -4.06% |
| 固定资产 | 300,385,020.34 | 336,495,307.46 | -10.73% |
| 使用权资产 | 679,345,017.25 | - | 不适用 |
| 在建工程 | 198,914.31 | 687,775.15 | -71.08% |
| 无形资产 | 364,970,596.85 | 384,777,019.29 | -5.15% |
| 递延所得税资产 | 551,753,575.72 | 561,411,829.21 | -1.72% |
| 其他资产 | 1,208,035,196.12 | 965,830,823.69 | 25.08% |
| 短期借款 | 432,816,051.70 | 485,797,765.03 | -10.91% |
| 应付短期融资款 | 5,642,730,244.08 | 10,156,894,839.47 | -44.44% |
| 拆入资金 | 300,173,694.44 | 1,300,381,555.60 | -76.92% |
| 衍生金融负债 | 52,133,624.48 | 90,573,908.30 | -42.44% |
| 卖出回购金融资产款 | 15,655,943,492.51 | 14,342,315,565.97 | 9.16% |
| 代理买卖证券款 | 18,852,927,560.34 | 17,630,613,478.65 | 6.93% |
| 代理承销证券款 | - | 218,000,000.00 | -100.00% |

| | | | |
|--------------|-------------------|-------------------|---------|
| 应付职工薪酬 | 2,361,863,384.57 | 2,335,779,691.28 | 1.12% |
| 应交税费 | 357,638,393.68 | 505,321,588.67 | -29.23% |
| 应付款项 | 1,195,596,124.63 | 641,055,098.03 | 86.50% |
| 合同负债 | 25,145,881.76 | 29,853,723.38 | -15.77% |
| 租赁负债 | 649,763,153.70 | - | 不适用 |
| 应付债券 | 27,302,228,611.93 | 23,804,092,796.22 | 14.70% |
| 递延所得税负债 | 69,555,480.71 | 246,745,706.32 | -71.81% |
| 其他负债 | 1,347,141,035.95 | 1,414,415,329.68 | -4.76% |
| 股本 | 3,589,009,508.00 | 3,589,000,000.00 | 0.00% |
| 其他权益工具 | 488,104,985.32 | 988,121,041.93 | -50.60% |
| 资本公积 | 8,266,043,454.66 | 8,266,110,425.27 | 0.00% |
| 其他综合收益 | 58,835,390.25 | 55,967,833.87 | 5.12% |
| 盈余公积 | 1,059,918,968.73 | 1,059,976,416.21 | -0.01% |
| 一般风险准备 | 3,197,451,331.66 | 3,148,566,936.75 | 1.55% |
| 未分配利润 | 6,595,727,912.07 | 6,340,051,917.01 | 4.03% |
| 归属于母公司股东权益合计 | 23,255,091,550.69 | 23,447,794,571.04 | -0.82% |
| 少数股东权益 | 9,464,960.23 | 9,210,293.66 | 2.77% |
| 项 目 | 2021年1-6月 | 2020年1-6月 | 增减幅度 |
| 手续费及佣金净收入 | 1,528,932,652.69 | 1,437,764,413.66 | 6.34% |
| 利息净收入 | 407,518,889.53 | 378,929,206.36 | 7.54% |
| 投资收益 | 1,879,395,261.71 | 627,669,981.90 | 199.42% |
| 其他收益 | 18,232,391.95 | 11,372,718.41 | 60.32% |
| 公允价值变动收益 | -649,067,646.63 | 426,446,405.36 | 不适用 |
| 汇兑收益 | -203,627.10 | -35,034.61 | 不适用 |
| 其他业务收入 | 2,255,180.02 | 1,766,555.36 | 27.66% |
| 税金及附加 | 22,237,427.75 | 13,856,113.54 | 60.49% |
| 业务及管理费 | 2,003,588,886.01 | 1,866,203,281.83 | 7.36% |
| 信用减值损失 | -45,656,603.44 | 16,649,409.24 | 不适用 |
| 其他业务成本 | 904,979.73 | 884,893.22 | 2.27% |
| 营业外收入 | 90,455.91 | 908,736.17 | -90.05% |
| 营业外支出 | 1,061,943.31 | 18,010,278.73 | -94.10% |
| 利润总额 | 1,205,016,924.72 | 969,219,006.05 | 24.33% |
| 所得税费用 | 159,375,718.18 | 149,036,578.99 | 6.94% |

| | | | |
|-------------|------------------|----------------|---------|
| 净利润 | 1,045,641,206.54 | 820,182,427.06 | 27.49% |
| 其他综合收益的税后净额 | 2,867,556.38 | 44,991,292.56 | -93.63% |
| 综合收益总额 | 1,048,508,762.92 | 865,173,719.62 | 21.19% |

(二) 母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

| 项 目 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 | 增减幅度 |
|-----------|-------------------|-------------------|---------|
| 货币资金 | 17,275,411,255.90 | 18,877,795,845.65 | -8.49% |
| 结算备付金 | 5,246,176,958.00 | 4,225,776,760.40 | 24.15% |
| 融出资金 | 18,922,185,912.04 | 19,427,460,229.15 | -2.60% |
| 衍生金融资产 | 190,470,847.66 | 57,210,883.15 | 232.93% |
| 存出保证金 | 309,944,940.17 | 430,204,425.55 | -27.95% |
| 应收款项 | 12,392,609.27 | 16,137,378.97 | -23.21% |
| 买入返售金融资产 | 2,587,402,435.77 | 3,271,653,026.44 | -20.91% |
| 交易性金融资产 | 22,711,746,749.57 | 23,035,821,882.39 | -1.41% |
| 债权投资 | 8,354,743,718.98 | 6,481,371,854.01 | 28.90% |
| 其他债权投资 | 6,789,949,514.53 | 7,036,028,384.00 | -3.50% |
| 其他权益工具投资 | 132,828,205.70 | 131,444,319.58 | 1.05% |
| 长期股权投资 | 8,087,986,296.50 | 7,816,356,789.97 | 3.48% |
| 投资性房地产 | 20,609,079.21 | 21,481,423.71 | -4.06% |
| 固定资产 | 293,920,780.90 | 327,591,188.53 | -10.28% |
| 使用权资产 | 538,585,491.67 | - | 不适用 |
| 在建工程 | 198,914.31 | 552,455.47 | -63.99% |
| 无形资产 | 357,949,523.60 | 376,496,532.69 | -4.93% |
| 递延所得税资产 | 401,486,808.49 | 431,781,339.43 | -7.02% |
| 其他资产 | 1,109,893,506.63 | 858,629,734.80 | 29.26% |
| 应付短期融资款 | 5,642,730,244.08 | 10,156,894,839.47 | -44.44% |
| 拆入资金 | 300,173,694.44 | 1,300,381,555.60 | -76.92% |
| 衍生金融负债 | 52,133,624.48 | 90,573,908.30 | -42.44% |
| 卖出回购金融资产款 | 15,655,943,492.51 | 14,342,315,565.97 | 9.16% |
| 代理买卖证券款 | 18,700,473,475.02 | 17,458,094,346.47 | 7.12% |
| 代理承销证券款 | - | 218,000,000.00 | 不适用 |
| 应付职工薪酬 | 1,747,006,169.05 | 1,611,147,036.85 | 8.43% |
| 应交税费 | 295,859,615.57 | 358,004,808.34 | -17.36% |
| 应付款项 | 1,193,844,008.36 | 640,791,197.67 | 86.31% |
| 合同负债 | 22,280,316.11 | 25,500,999.56 | -12.63% |
| 租赁负债 | 508,204,259.87 | - | 不适用 |
| 应付债券 | 27,302,228,611.93 | 23,804,092,796.22 | 14.70% |
| 递延所得税负债 | 55,977,937.99 | 233,929,615.87 | -76.07% |
| 其他负债 | 983,636,500.09 | 1,162,571,017.19 | -15.39% |
| 股本 | 3,589,009,508.00 | 3,589,000,000.00 | 0.00% |
| 其他权益工具 | 488,104,985.32 | 988,121,041.93 | -50.60% |
| 资本公积 | 8,454,138,426.34 | 8,454,205,396.95 | 0.00% |
| 其他综合收益 | 59,479,458.40 | 51,245,658.46 | 16.07% |
| 盈余公积 | 1,090,220,122.75 | 1,090,220,122.75 | - |
| 一般风险准备 | 2,537,851,052.63 | 2,537,851,052.63 | - |
| 未分配利润 | 4,664,588,045.96 | 4,710,853,493.66 | -0.98% |
| 项 目 | 2021年1-6月 | 2020年1-6月 | 增减幅度 |

| | | | |
|-------------|------------------|------------------|---------|
| 手续费及佣金净收入 | 926,756,885.40 | 789,908,148.83 | 17.32% |
| 利息净收入 | 362,477,010.92 | 319,235,079.99 | 13.55% |
| 投资收益 | 1,596,153,533.19 | 394,710,353.16 | 304.39% |
| 其他收益 | 10,620,025.92 | 6,396,704.64 | 66.02% |
| 公允价值变动收益 | -648,057,354.82 | 419,544,671.46 | 不适用 |
| 汇兑收益 | -460,224.35 | 765,858.24 | 不适用 |
| 其他业务收入 | 2,243,976.57 | 1,267,138.77 | 77.09% |
| 税金及附加 | 18,438,892.05 | 9,687,941.02 | 90.33% |
| 业务及管理费 | 1,466,133,228.40 | 1,287,914,668.93 | 13.84% |
| 信用减值损失 | -41,652,030.01 | 14,192,557.88 | 不适用 |
| 其他业务成本 | 904,979.73 | 884,893.22 | 2.27% |
| 营业外收入 | 82,698.12 | 101,625.29 | -18.62% |
| 营业外支出 | 1,052,986.38 | 14,010,240.74 | -92.48% |
| 利润总额 | 804,938,494.40 | 605,239,278.59 | 33.00% |
| 所得税费用 | 110,377,792.10 | 91,341,491.02 | 20.84% |
| 净利润 | 694,560,702.30 | 513,897,787.57 | 35.16% |
| 其他综合收益的税后净额 | 8,233,799.94 | 34,604,556.17 | -76.21% |
| 综合收益总额 | 702,794,502.24 | 548,502,343.74 | 28.13% |

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) 报告期内公司所从事的主要业务及经营模式

公司始终坚持合规经营、稳健发展，抓住管理体制调整和行业创新发展的机遇，从一家区域性的经纪类券商发展成为全国性的综合类券商，构建了跨证券、期货、基金、资管、股权投资以及境外金融等业务的全链条、综合化的服务体系。公司坚守金融服务实体本源，始终围绕客户需求，为企业壮大、百姓富足奉献专业能力，致力于向个人、机构及企业客户提供多元化、全方位的金融产品和服务。公司从事的主要业务分为十大板块，分别是财富管理业务、投资银行业务、证券资产管理业务、证券投资业务、证券信用业务、期货业务、境外证券业务、基金业务、私募股权投资基金业务、另类投资业务。

财富管理业务是通过线下线上相结合的方式为客户提供证券经纪及期货 IB、产品销售、投资顾问等一揽子财富管理服务。

投资银行业务是运用股权融资、债权融资、新三板、并购、财务顾问等多种手段为企业和政府客户提供直接融资服务，主要包括证券承销与保荐业务、新三板业务及财务顾问业务等。

证券资产管理业务是通过集合计划、专项计划、定向计划以及公募基金为机构和个人客户提供券商资产管理服务。

证券投资业务是指公司以自有资金在价值投资、稳健经营的前提下，从事股票、债券、衍生品等多种自营证券、交易和做市业务。

证券信用业务是为客户提供融资融券、股票质押式回购、约定式购回等资金融通服务。

期货业务是为客户提供期货经纪、财富管理、资产管理、风险管理等服务。

境外证券业务是为境内外客户提供跨境投资、融资、理财等综合服务。

基金业务是为机构和个人客户提供公募产品、专户产品等资产管理服务。

私募股权投资基金业务是从事私募股权投资基金、并购基金、政府产业基金等各类股权投资基金的管理。

另类投资业务是从事《证券公司证券自营投资品种清单》所列品种以外的股权投资、金融产品等投资。

公司业务主要围绕上述主营业务展开,通过提供综合金融产品和服务获取各类手续费及佣金收入、利息收入、投资收入等。

(二) 报告期内公司所属行业的情况说明

2021年以来,随着疫情形势逐步好转,全球经济明显复苏,美国政府出台多轮财政刺激计划,各国货币政策产生分化。中国经济运行保持活跃,延续去年二季度以来的稳固复苏趋势。在此背景下,市场风险偏好上升,全球主要股指录得史上少有的同期涨幅。A股上半年以整体上涨收官,结构性行情明显,上证综指上涨3.40%,深成指上涨4.78%,创业板指上涨17.22%,科创50指数上涨14.01%。市场交易活跃度明显提升,日均交易量同比增长21%。

2021年上半年度,139家证券公司实现营业收入2,324.14亿元,各主营业务收入分别为代理买卖证券业务净收入(含交易单元席位租赁)580.40亿元、证券承销与保荐业务净收入267.81亿元、财务顾问业务净收入30.54亿元、投资咨询业务净收入24.01亿元、资产管理业务净收入144.68亿元、利息净收入308.54亿元、证券投资收益(含公允价值变动)697.88亿元;2021年上半年度实现净利润902.79亿元,125家证券公司实现盈利。

规模方面,证券行业中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。(数据来自证券业协会)

二、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

(一) 共同富裕示范区前景广阔,有力拓展公司发展空间

浙江省肩负建设共同富裕示范区的历史使命,有力承接“一带一路”、长江经济带、长三角一体化发展等重大战略,深入贯彻国家金融工作部署,努力打造中国特色金融高质量发展样板省和区域金融现代治理先行示范省。省内各项经济指标均处于全国领先水平。2017-2020年浙江省人均可支配收入分别为42046元、45,840元、49,899元及52,397元,均位列全国第3,仅次于上海与北京,较高的经济水平及居民财富水平为公司发展提供潜在动力,省内民营经济发达,优质企业资源众多,民间资本活跃,投资需求旺盛,聚集了大量高净值客户,为公司业务的发展提供了良好的客户资源和广阔的拓展空间。

作为浙江省属券商，公司大力推进“深耕浙江”战略，以深耕浙江、服务浙江为己任，牢固树立“以客户为中心，服务至上”的理念，开展综合金融服务。充分发挥区位优势，优化区域布局，实现省内区域、业务的全覆盖，形成了以长三角为依托、辐射全国的业务布局。公司 80%以上分支机构集中在浙江，是浙商总会金融服务委员会和浙江省并购联合会的牵头单位，已与 60 余个地市政府、国有企业和金融机构达成战略合作，推荐优质企业进入资本市场。

（二）“凤凰行动”为高质量发展赋能，明显增强投行业务发展动力

股权业务在服务省内大型国企和民企方面初显成效。一是大型国企项目服务优势逐渐显现。随着运达股份、浙江新能、浙版传媒等 IPO 项目成功发行上市，浙江文投、省二轻、省国贸、浙商资产、下城国投、镇海国资等上市公司控股权收购顺利实施，公司作为省属券商服务省内大型国企项目的示范效应和优势开始逐渐显现。二是中大型民营企业项目示范效应开始打开局面。随着金田铜业、李子园等中大型民企 IPO 项目成功上市，以及万向集团等大型民企服务项目逐步落地，公司服务省内中大型民营企业的示范效应开始打开局面。三是股权团队能力和项目储备呈现较大提升。随着投行职业化和市场化改革逐步推进，市场优秀团队逐渐加盟，股权团队能力呈现较大提升。根据浙江证监局 6 月辅导（含精选层）数据，财通以辅导 24 家位列辖区第一。

债券业务竞争力稳步提升，省内保持前列，部分品种全国领先。2018 年以来，公司债券业务稳步发展，省内排名保持前三，2021 年上半年公司债和企业债累计承销金额排名首次位列行业第 18 名。同时，公司充分抓住浙江省地域优势寻求差异化发展，在 AA 级债券和项目收益债细分品种建立了相对优势。

作为省属券商的社会化影响力和综合金融服务能力明显新提升。财通证券 43 个金融顾问专班小组走进企业全面深耕，以 ESOP“金服宝”等数字化服务载体，打开了浙江金融供给侧改革的全新格局，实现县县有服务团队的伴随式深耕。牵头实施金融支持浙商境内外双循环一体化发展行动，发挥专业能力支持境外浙商稳链补链强链，送去家乡的温暖和支持。统筹浙江省并购联合会、山南基金小镇委员会客厅，成功举办凤凰榜发布会，扩大了财通证券在金融业中的影响力。

（三）数字化改革推进成果丰厚，努力打造 N 个生态链接

中国的数字化看浙江。2021 年伊始，浙江省全面推进数字化改革，在全国数字化改革方面走在了前列。公司身处金融科技高地，外部资源丰富。过去 3 年间，公司在数字化改革方面持续发力，搭建“三中心、两平台、一朵云”公司整体体系架构，贯彻以客户为中心的理念，突出数字资源积累、业务中台构建，注重迭代创新能力，为数字化改革打下坚实基础。报告期内，公司明确数字化改革规划“1+6+N”，即 1 个数字化平台、6 大业务板块、N 个生态链接。公司六大业务板块“WISDOM”包含财富、管理、投行、监督、投研、运营，打造“数智财通”品牌，在赋能前台展业人员、信评、提升用户体验、后台无纸化办公等方面实现降本增效。数字化改革取得阶段性成果，公司与蚂蚁在内容服务、理财师、金融科技等多方面开展合作。公司自主研发的为企业提供综合金融服务的 ESOP“金服宝”，服务客户横跨医疗、科技、电子、金属、视频等多个行业，后续将继

续推广至浙江省各公司，市场空间巨大。

（四）全员协同加速推进，推动集团化发展提质增效

公司旗下拥有永安期货、财通证券资管、财通基金、财通香港、财通资本、财通创新等重点参、控股公司，已形成集团化协同发展模式，包括但不限于：永安期货私募客户交易及托管推荐、财通证券资管投行项目推荐及认购、财通基金上市公司及高净值客户转化、财通创新科创板跟投、财通资本依托产业基金进行投行投资联动、香港子公司境内外客户互荐等。同时，公司内部大力推进建设投行业务、财富管理两大协同体系，建立“关系确认、分配备案、收益结算”的协同机制和系统，协同成果丰富。

（五）资产端与资金端紧密联动，加快财富管理全价值链构建

公司始终坚持以客户为导向，以好产品、好渠道、好投顾、好机制、好运营“五好”为路径，构建财富管理全价值链，打造财通赢家财富管理品牌，满足客户综合金融服务需求。

在资产端，构建强大的金融产品中心，搭建数字化的财富产品体系，努力推进大类资产配置，降低产品净值波动，提高收益水平，满足群众多元化、差异化的理财需求。充分挖掘永安期货、永安国富、财通证券资管、财通基金等集团内部优质产品，并积极引进外部优质管理人和产品。集团内部的产品已树立良好口碑。以财通证券资管为例，其持续推进业务均衡稳健发展，不断创新产品体系，积极加强主动管理。截至报告期末，非货币公募基金保有规模 887 亿元，同比增长 298%，市场排名上升 31 位至第 39 名，在券商资管系公募中排名第 3。投资能力受到认可，斩获“资产管理券商君鼎奖”、“券商主动管理金帆奖”、“中国最佳固收类券商资管奖”等多个奖项。

在客户端，依托线下分支机构与线上各类平台渠道，深挖浙江省内高净值客户与长尾客户。优化服务触达系统，通过 APP、支付宝财富号、营业部等各类立体化的服务渠道，提升服务质量。深化“财通赢家”系列活动，加强基于数字化的普惠金融服务，依托金融顾问和财富顾问走进企业、走进基层送政策、送服务，有效提高产品和服务的可得性，让好产品覆盖更多的群众。

（六）合规风控体系健全有效，切实保障公司稳健经营

公司着力培养内生性合规文化理念，并持续建立健全合规管理制度，确保合规管理工作的有效落实。强化员工合规培训，加强合规宣导，持续推进合规文化建设。建立并完善审慎的风险管理意识和全面有效的风险管理体系，致力于推行风险管理创造价值的理念。面对证券市场中的各种风险，在切实做好按业务条线划分的纵向条线风险管理的基础上，借助量化模型和信息系统等工具，建立起按风险类别划分的横向条线风险管理体系，全面覆盖公司各项业务及重要环节，准确有效地识别、评估、监测和管理各类风险。

公司高度重视各项业务的稳健经营，建立起全方位多层级的合规风控体系，制定了完备的合规风控制度，实现了对各项业务及其各个环节合规风控的全覆盖。报告期内，公司持续保持稳健经营。

三、经营情况的讨论与分析

2021 年是十四五的开局之年，上半年公司按照既定规划，科学有序地做出部署，为新一轮改革谋篇布局，积极推动各项措施落地。一是明确了今后五年的行动目标与路线图；二是加强数字赋能，推进公司数字化转型；三是推动“深耕浙江”提质增效，提升服务实体经济的能力；四是践行以客户为中心理念，积极打造财富管理新优势，继续深入开展“财通赢家”品牌营销活动。五是改革破题释放活力，推进“能力提升三年行动计划”，建立上海人才发展中心，启动配股再融资工作，加强企业文化宣贯，丰富文化宣贯载体。

公司未来在业务竞争力持续提升、重点工作落实推进、数字化改革落深落细等方面将对照全年目标任务，研判进度，分析问题，明确措施，抓好贯彻落实。

（一）财富管理业务

财富管理业务发展迎来新蓝海，财富人群与可投资资产快速增加，理财市场加速扩容，传统卖方模式正在向买方模式转型。公司始终坚持以客户为导向，以好产品、好渠道、好投顾、好机制、好运营“五好”为路径，构建财富管理服务全价值链，以满足客户综合金融需求。

1. 证券经纪

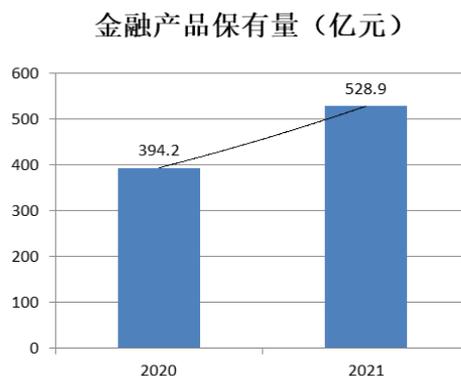
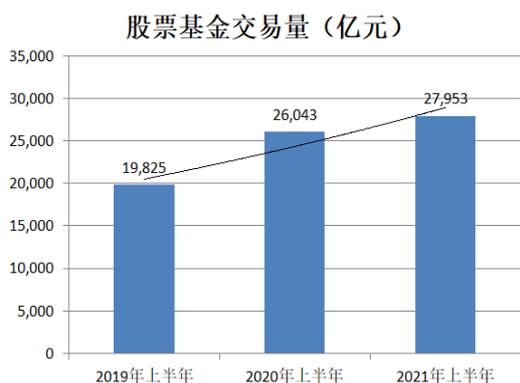
2021 年上半年，A 股市场震荡上行，上证指数较年初上涨 3.4%；创业板指较年初上涨 17.2%，创 2015 年以来新高。截至 6 月末，A 股总市值约 91.26 万亿元，较今年年初增长 6.8 万亿元，增幅为 8%。传统经纪业务受到股基交易额增长叠加佣金率下滑的影响，代理买卖收入同比微增 4.40%至 471 亿元。（数据来自 wind、中证协）

报告期内，公司依托金融科技赋能，聚焦财富管理转型发展，持续推进分支机构提质增效，积极落实人才梯队建设，充分发挥统筹协调职能，进一步提升财富管理整体竞争力。截至报告期末，上半年公司累计股票基金交易量 27,953 亿元，较上年同期增长 7.3%；日均客户资产较上年增长 19.2%；经纪业务客户数量较上年末增长 5.8%（数据来自公司内部统计）。

2. 产品代销

2021 年上半年，产品销售业务延续去年以来的高增长局面，公募基金发行规模突破 1.6 万亿元，其中权益类基金占据半壁江山，带动代销收入大增 118%至 101 亿元。（数据来自 wind）

报告期内，公司累计实现金融产品销售量 361.2 亿元，同比增长 21%，其中权益类产品销售规模 114.4 亿元，同比增长 211.3%；金融产品日均保有 528.9 亿份，较 2020 年增长 34.17%；实现代销金融产品业务收入同比增长 183.29%。



(二) 投资银行业务

2021 年上半年,按照发行日统计市场累计发行股权项目(含可转债)497 只,同比增长 40.40%,发行金额 6,487.12 亿元,同比增长 8.34%;其中 IPO 发行 237 家,发行金额 2,068.88 亿元,同比增长 85.15%和 44.04%。2021 年上半年全市场共发行信用债(不含同业存单、可转债)9,799 只,发行总额 9.25 万亿元,分别同比增长 10.04%和 1.31%。其中,公司债、企业债发行 2,164 只,发行总额 1.89 万亿元,分别同比增长 13.06%和 3.85%。(数据来自 wind)

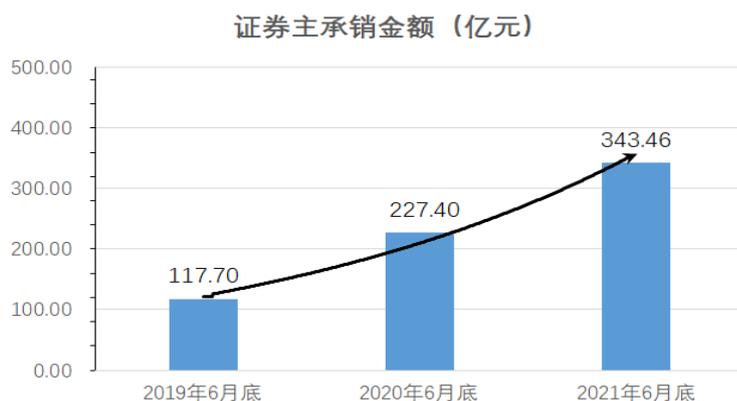
公司积极贯彻落实“凤凰行动”计划和“融资畅通”工程,紧紧围绕“深耕浙江、服务全国、争创一流”的公司愿景,确立“以客户为中心”的职业投行发展理念,全力打造“更接地气的本土专业投行”,践行“承销保荐+融资规范+战略咨询+产业赋能+直接投资”的“1+4”展业模式,集聚服务资源,着力为客户提供综合金融服务,成为企业的行业顾问和政府产业顾问,做伴随中国成长的投资银行,报告期内,公司投资银行业务竞争力呈现较大进步。

截至报告期末,实现投行业务净收入 3.06 亿元,同比增长 23.89%。累计完成股债项目 54 单,同比增长 92.86%;实现承销金额 343.46 亿元,同比增长 51.04%。股权业务方面,完成 3 单 IPO 及再融资项目,承销金额 30.06 亿元;债券业务方面,完成债券承销 51 单,承销金额 313.40 亿元,同比增长 48.14%;新三板业务方面,持续督导企业 173 家。

单位:万元

| 项目 | | 2019 年上半年 | 2020 年上半年 | 2021 年上半年 |
|------------|----------|------------|------------|------------|
| IPO | 承销次数(次) | 1 | 1 | 2 |
| | 承销金额(万元) | 47,915.48 | 158,510.00 | 150,562.80 |
| 再融资(不含可转债) | 承销次数(次) | 0 | 0 | 0 |
| | 承销金额(万元) | 0 | 0 | 0 |
| 可转债 | 承销次数(次) | 1 | 0 | 1 |
| | 承销金额(万元) | 36,800.00 | 0.00 | 150,000.00 |
| 企业债 | 承销次数(次) | 3 | 0 | 11 |
| | 承销金额(万元) | 230,000.00 | 0.00 | 924,700.00 |
| 公司债 | 承销次数(次) | 13 | 25 | 40 |

| | | | | |
|------|----------|--------------|--------------|--------------|
| | 承销金额（万元） | 862,266.67 | 2,045,500.00 | 2,209,333.33 |
| 其他债券 | 承销次数（次） | 0 | 2 | 0 |
| | 承销金额（万元） | 0 | 70,000.00 | 0 |
| 合计 | 承销次数（次） | 18.00 | 28.00 | 54 |
| | 承销金额（万元） | 1,176,982.15 | 2,274,010.00 | 3,434,596.13 |



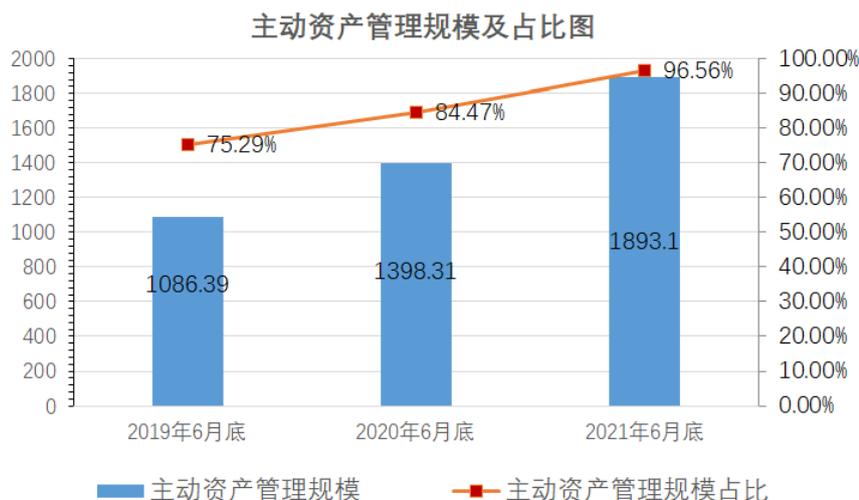
（三）证券资产管理业务

2021年上半年，在资管新规等政策指导下，证券行业资管业务转型立足居民财富管理需求，不断创新产品体系，积极加强主动管理，通道类资管规模持续压缩，业务结构进一步优化。截至报告期末，证券行业资产管理业务规模为 10.52 万亿元，较年初增长 0.15%，实现资管业务净收入 145.56 亿元，同比增长 1.85%（数据来自证监会）。

报告期内，公司通过全资子公司财通证券资管开展境内证券资产管理业务。公司深入落实“五大战略”部署，迎难而上、奋力展业，保持了平稳发展态势。报告期内，实现营收 6.34 亿元，实现净利润 1.11 亿元，同比增长 10%。截至报告期末，受托管理总规模 1,961 亿元，较期初增长 28%。其中，主动规模 1,893 亿元，较期初增长 34%；公募基金管理规模 940 亿元，较期初增长 96%；非货币公募基金管理规模 817 亿元，较年初增长 160%。

2021 年 6 月末受托资产管理规模（单位：亿元）

| 项目 | 2020 年 6 月末 | 2021 年 6 月末 |
|-------------|-------------|-------------|
| 资产管理总规模 | 1,655.36 | 1,960.59 |
| 其中：定向资产管理规模 | 382.85 | 362.59 |
| 集合资产管理规模 | 592.31 | 484.67 |
| 专项资产管理规模 | 93.34 | 172.97 |
| 公募基金管理规模 | 586.86 | 940.36 |
| 主动管理规模 | 1,398.31 | 1,893.10 |



（四）证券投资业务

2021 年上半年，受国家货币政策“不急转弯”的边际收紧、机构持仓集中、核心资产交易拥挤和全球经济复苏进程不一、疫情反复等因素影响。一季度资本市场出现了核心资产踩踏式下跌，公募基金平均净值自高点回撤 13.23%，核心资产指数自高点回落 19.76%，创业板指数回调 27.3%；截止 6 月 30 日，各大分类指数中的万得全 A、上证指数、沪深 300 指数的表现分别为 5.45%、3.40%、0.24%。（数据来自 wind）

报告期内，公司不断完善投研体系、探索去方向性投资策略、搭建数字化研究平台，积极做好投资管理工作。公司股票自营业务以新能源汽车、TMT、医药、消费为配置重点，上半年部门投资管理的账户净值经历了先扬后抑再回升的走势。截至报告期末，投资规模 13.03 亿元。

报告期内，公司荣获中央国债登记结算有限责任公司 2020 年度“债券业务进步奖”。公司根据市场情况，坚持稳中选优的策略，共申购或二级买入债券近 100 只，扩大地方债品种的配置规模。截至报告期末，投资规模 250.29 亿元，同比增长 115.47%。

（五）证券信用业务

2021 年上半年，融资融券业务在市场行情的带动下，资金余额同比增长 53%至 1.78 万亿元，两融利息收入增长 46%至 547 亿元，两融利息收入历史性地超越代买业务。（数据来自 wind）

报告期内，公司以金融服务实体经济为己任，坚持数字化改革主线，推动 ESOP“金服宝”项目落地实施；推动建立“产品销售+公募基金+私募基金”合作机制；推动地方政府控股平台合作。截至报告期末，公司两融规模 196.22 亿元，同比增长 30%；两融日均规模 195.7 亿元，同比增长 51%；两融业务收入 6.21 亿元，同比增长 44%。股权质押规模 41.55 亿，其中资管计划出资 20.69 亿元，自有资金出资规模 20.86 亿元，约定购回规模 461 万元。

2021 年 6 月底公司融资融券业务规模（单位：亿元）：

| 项 目 | 2020 年 6 月底 | 2021 年 6 月底 |
|------------|-------------|-------------|
| 融出资金余额 | 149.23 | 191.16 |
| 融出证券余额（市值） | 2.28 | 5.23 |

| | | |
|----------|---------|---------|
| 期末维持担保比例 | 282.84% | 290.93% |
|----------|---------|---------|

（六）期货业务

2021 年上半年,期货市场累计成交量约 37 亿手同比上涨 47%,成交额 286 万亿元同比上涨 73%,成交额已经接近 2019 年全年。其中,商品期货持仓量达到 2444 万手,较去年底增加 10%,创历史新高。企业套期保值需求和财富管理配置需求持续增加,期货市场客户权益历史性地突破 1 万亿元。(数据来自期货业协会)

2021 年上半年,永安期货紧紧围绕“国内领先、国际知名的衍生品投资银行”企业愿景,践行“一切为了客户,一切为了发展”核心价值观,坚持服务实体经济,整体经营业绩大幅增长,分类监管、社会责任担当继续走在行业前列,保持 AAA 信用评级,头部优质企业的品牌形象更加全面、稳固、突出。

（七）境外证券业务

2021 年上半年,香港市场受益于持续货币和经济宽松措施所带来对市场的充裕流动性及正面情绪,抵消部分去年新冠疫情对经济所带来的负面影响。恒生指数上半年累计仅微升 5.9%或 1596 点,市场上 46 只新股融资大约 2,097 亿港元,相比 2020 年上半年则有 59 只新股融资 880 亿港元,新股数量方面虽然下跌 22%,但是融资总额跃升 138%。(数据来自 wind、德勤统计)

报告期内,公司全资境外子公司财通香港有效应对了香港社会的新冠疫情,以及上半年全球市场出现的剧烈波动等不利影响,保持了经营活动的稳定,经营业绩仍有较大增长。

（八）基金业务

2021 年上半年,公募基金市场共有 795 只产品发起募集,累计发行份额 15,034 亿份,创下历史同期新高。其中,混合型基金都是今年的重点,尤其是偏股混合型基金。共新发 401 只混合型基金,占全部新发产品数量的 50%,募集份额共计 9,626 亿份,占全部新发产品募集份额的 64%。相比之下,包括纯债、一级债和二级债产品在内的债券型基金的发行量较往年有所下降。(数据来自 wind)

报告期内,公司通过参股公司财通基金开展基金管理业务。截至报告期末,财通基金资产管理总规模为 751.16 亿元,较年初有所增长。公募基金新发 3 只,存量基金达到 40 只,规模为 383.48 亿元;专户存续新发 179 只,达到 571 只,规模为 367.68 亿元。

财通基金 2021 年 6 月底基金业务情况:

| 项目 | | 2020 年 6 月底 | | 2021 年 6 月底 | |
|----|--------|-------------|--------|-------------|--------|
| | | 公募 | 专户 | 公募 | 专户 |
| 新发 | 只数 | 3 | 85 | 3 | 179 |
| | 规模(亿元) | 58.26 | 14.74 | 26.74 | 45.22 |
| 存续 | 只数 | 32 | 321 | 40 | 571 |
| | 规模(亿元) | 264.74 | 248.20 | 383.48 | 367.68 |

（九）另类投资业务

2021 年上半年，另类投资子公司业务普遍向好，券商科创板跟投获配投入资金达到 27 亿元。

（数据来自 wind）

报告期内，公司全资子公司财通创新稳步推进经营计划，继续坚持并优化投资策略，深度聚焦重点投资领域与重点区域，进一步挖掘产业资源和平台资源，加强项目储备及与省内机构合作联动，提升团队投资能力及渠道开发能力。报告期内，完成投资项目 3 个，新增投资金额合计 1.15 亿元。截至报告期末，持有股权投资项目合计 27 个，实缴投资金额合计 33.75 亿元。

（十）私募股权投资基金业务

报告期内，公司全资子公司财通资本稳步推进经营计划，公司以政府产业基金业务为抓手，主动融入共同富裕示范区建设，围绕地方经济特点和政府需求，充分发挥产业基金的撬动和引导作用，帮助当地产业整合与项目招引落地。围绕政府产业基金业务省内全覆盖目标，新增服务政府产业基金 2 只，新增规模 28 亿元。截至报告期末，累计管理政府产业基金共计 19 支，管理规模 160.50 亿元。公司推动私募股权基金业务特色化发展。上半年新设私募股权基金 2 只，规模 11.7 亿。布局股权投资项目 6 个，聚焦聚力半导体、医疗健康等重点行业投资机会。

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 | 3,187,063,102.17 | 2,883,914,246.44 | 10.51% |
| 营业成本 | 1,981,074,690.05 | 1,897,593,697.83 | 4.40% |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 2,793,444,916.82 | 1,405,478,197.12 | 98.75% |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 21,843,311.10 | -392,693,458.85 | 不适用 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | - 3,002,576,458.17 | 4,434,125,592.91 | 不适用 |

营业收入变动原因说明：上半年，公司财富管理业务实现收入 7.62 亿元，同比增长 12.10%；证券自营业务实现收入 2.04 亿元，同比下降 38.70%；投资银行业务实现收入 3.03 亿元，同比增长 13.73%；资产管理业务实现收入 6.63 亿元，同比下降 10.99%；证券信用业务实现收入 3.01 亿元，同比增长 19.01%；境外证券业务实现收入 0.75 亿元，同比增长 45.70%；总部后台及其他实现收入 8.80 亿元，同比增长 58.19%。详情请参见本节“主营业务分行业、分地区情况”。

营业成本变动原因说明：上半年，公司营业支出为19.81亿元，同比增加4.40%。详情请参见本节“成本分析表”。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：上半年，公司经营活动产生的现金流量净额为27.93亿元，净流入同比增加13.88亿元，主要系为交易目的而持有的金融资产净减少额增加、融出资金净增加额减少。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：上半年，公司投资活动产生的现金流量净额为0.22亿元，上年同期净流出3.93亿元，主要系投资支付的现金减少。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：上半年，公司筹资活动产生的现金流量净额为-30.03亿元，上年同期净流入44.34亿元，主要系发行债券收到的现金减少。

2、主营业务分行业、分地区情况

单位：元 币种：人民币

| 分行业 | 营业收入 | 营业成本 | 毛利率 (%) | 营业收入 比上年增 减(%) | 营业成本 比上年增 减(%) | 毛利率比上年增减 (%) |
|------------|------------------|------------------|------------|----------------------|----------------------|-----------------|
| 财富管理业务 | 761,533,978.77 | 510,167,301.96 | 33.01 | 12.10 | 25.10 | 减少6.96个百分点 |
| 证券自营业务 | 204,463,681.16 | 32,284,747.95 | 84.21 | -38.70 | -80.65 | 增加34.22个百分点 |
| 投资银行业务 | 302,502,276.80 | 222,699,435.48 | 26.38 | 13.73 | 4.32 | 增加6.64个百分点 |
| 资产管理业务 | 662,740,731.59 | 484,025,295.59 | 26.97 | -10.99 | -12.59 | 增加1.34个百分点 |
| 证券信用业务 | 300,633,420.56 | -44,170,044.57 | 114.69 | 19.01 | -212.28 | 增加30.26个百分点 |
| 境外证券业务 | 74,980,594.67 | 46,658,949.19 | 37.77 | 45.70 | 39.96 | 增加2.55个百分点 |
| 总部后台及其他 | 880,208,418.62 | 729,409,004.45 | 17.13 | 58.19 | 50.98 | 增加3.96个百分点 |
| 合计 | 3,187,063,102.17 | 1,981,074,690.05 | 37.84 | 10.51 | 4.40 | 增加3.64个百分点 |
| 分地区 | 营业收入 | 营业成本 | 毛利率 (%) | 营业收入 比上年增 减(%) | 营业成本 比上年增 减(%) | 毛利率比上年增减 (%) |
| 浙江省内 | 555,306,859.55 | 253,229,449.50 | 54.40 | -0.31 | -7.70 | 增加3.65个百分点 |
| 浙江省外 | 47,046,255.03 | 60,788,052.85 | -29.21 | 15.69 | 15.89 | 减少0.22个百分点 |
| 境外子公司 | 74,980,594.67 | 46,658,949.19 | 37.77 | 45.70 | 39.96 | 增加2.55个百分点 |
| 总部及其他境内子公司 | 2,509,729,392.92 | 1,620,398,238.51 | 35.44 | 12.30 | 5.39 | 增加4.24个百分点 |
| 合计 | 3,187,063,102.17 | 1,981,074,690.05 | 37.84 | 10.51 | 4.40 | 增加3.64个百分点 |

3、成本分析表

单位：元 币种：人民币

| 分行业 | 成本构成项目 | 本期金额 | 本期占总成本比例(%) | 上年同期金额 | 上年同期占总成本比例(%) | 本期金额较上年同期变动比例(%) | 情况说明 |
|---------|--------|------------------|-------------|------------------|---------------|------------------|-------------|
| 财富管理业务 | 营业支出 | 510,167,301.96 | 25.75 | 407,798,844.77 | 21.49 | 25.1 | 收入增长,相应费用增加 |
| 证券自营业务 | 营业支出 | 32,284,747.95 | 1.63 | 166,814,438.33 | 8.79 | -80.65 | 收入下降,相应费用减少 |
| 投资银行业务 | 营业支出 | 222,699,435.48 | 11.24 | 213,468,736.86 | 11.25 | 4.32 | 收入增长,相应费用增加 |
| 资产管理业务 | 营业支出 | 484,025,295.59 | 24.43 | 553,717,548.40 | 29.18 | -12.59 | 收入下降,相应费用减少 |
| 证券信用业务 | 营业支出 | -44,170,044.57 | -2.23 | 39,339,862.68 | 2.07 | -212.28 | 减值转回 |
| 境外证券业务 | 营业支出 | 46,658,949.19 | 2.36 | 33,338,345.80 | 1.76 | 39.96 | 收入增长,相应费用增加 |
| 总部后台及其他 | 营业支出 | 729,409,004.45 | 36.83 | 483,115,920.99 | 25.46 | 50.98 | 收入增长,相应费用增加 |
| 合计 | | 1,981,074,690.05 | 100.00 | 1,897,593,697.83 | 100.00 | 4.40 | |

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 | 19,058,086,581.26 | 19.54 | 20,521,337,750.35 | 21.23 | -7.13 | 主要系自有资金存款减少 |
| 结算备付金 | 5,252,497,849.32 | 5.39 | 4,234,817,326.72 | 4.38 | 24.03 | 主要系客户备付金增加 |
| 融出资金 | 19,517,331,753.37 | 20.02 | 19,983,550,132.30 | 20.67 | -2.33 | 基本持平 |

| | | | | | | |
|----------|-------------------|-------|-------------------|-------|--------|------------------------|
| 衍生金融资产 | 192,923,368.00 | 0.20 | 63,404,936.60 | 0.07 | 204.27 | 主要系场外期权规模增加 |
| 存出保证金 | 320,149,714.71 | 0.33 | 533,420,494.66 | 0.55 | -39.98 | 主要系自有存出保证金减少 |
| 应收款项 | 217,035,427.23 | 0.22 | 258,105,399.31 | 0.27 | -15.91 | 主要系应收资产管理费减少 |
| 买入返售金融资产 | 2,639,744,375.42 | 2.71 | 3,505,415,741.42 | 3.63 | -24.70 | 主要系债券质押式回购和股票质押式回购规模减少 |
| 交易性金融资产 | 24,739,422,345.68 | 25.37 | 24,938,451,516.22 | 25.80 | -0.80 | 基本持平 |
| 债权投资 | 8,386,363,518.98 | 8.60 | 6,481,371,854.01 | 6.71 | 29.39 | 主要系企业债投资增加 |
| 其他债权投资 | 6,789,949,514.53 | 6.96 | 7,036,028,384.00 | 7.28 | -3.50 | 基本持平 |
| 其他权益工具投资 | 132,828,205.70 | 0.14 | 131,444,319.58 | 0.14 | 1.05 | 基本持平 |
| 长期股权投资 | 7,138,583,191.40 | 7.32 | 6,700,813,877.62 | 6.93 | 6.53 | 主要系联营企业投资收益增加 |
| 投资性房地产 | 20,609,079.21 | 0.02 | 21,481,423.71 | 0.02 | -4.06 | 主要系计提摊销 |
| 固定资产 | 300,385,020.34 | 0.31 | 336,495,307.46 | 0.35 | -10.73 | 主要系计提折旧 |
| 使用权资产 | 679,345,017.25 | 0.70 | - | - | 不适用 | 主要系施行新租赁准则 |
| 在建工程 | 198,914.31 | - | 687,775.15 | - | -71.08 | 主要系在建工程转出 |
| 无形资产 | 364,970,596.85 | 0.37 | 384,777,019.29 | 0.40 | -5.15 | 主要系计提摊销 |
| 递延所得税资产 | 551,753,575.72 | 0.57 | 561,411,829.21 | 0.58 | -1.72 | 基本持平 |
| 其他资产 | 1,208,035,196.12 | 1.24 | 965,830,823.69 | 1.00 | 25.08 | 主要系收益互换及场外期权保证金增加 |
| 短期借款 | 432,816,051.70 | 0.44 | 485,797,765.03 | 0.50 | -10.91 | 主要系保证借款减少 |

| | | | | | | |
|-----------|-------------------|-------|-------------------|-------|--------|--------------------------|
| 应付短期融资款 | 5,642,730,244.08 | 5.79 | 10,156,894,839.47 | 10.51 | -44.44 | 主要系收益凭证减少 |
| 拆入资金 | 300,173,694.44 | 0.31 | 1,300,381,555.60 | 1.35 | -76.92 | 主要系银行金融机构拆入减少 |
| 衍生金融负债 | 52,133,624.48 | 0.05 | 90,573,908.30 | 0.09 | -42.44 | 主要系收益互换公允价值变动 |
| 卖出回购金融资产款 | 15,655,943,492.51 | 16.06 | 14,342,315,565.97 | 14.84 | 9.16 | 主要系质押式回购规模增加 |
| 代理买卖证券款 | 18,852,927,560.34 | 19.33 | 17,630,613,478.65 | 18.24 | 6.93 | 主要系经纪业务客户结算资金增加 |
| 代理承销证券款 | - | - | 218,000,000.00 | 0.23 | 不适用 | 主要系应付承销债券款减少 |
| 应付职工薪酬 | 2,361,863,384.57 | 2.42 | 2,335,779,691.28 | 2.42 | 1.12 | 基本持平 |
| 应交税费 | 357,638,393.68 | 0.37 | 505,321,588.67 | 0.52 | -29.23 | 主要系应交企业所得税减少 |
| 应付款项 | 1,195,596,124.63 | 1.23 | 641,055,098.03 | 0.66 | 86.50 | 主要系应付清算款增加 |
| 合同负债 | 25,145,881.76 | 0.03 | 29,853,723.38 | 0.03 | -15.77 | 主要系预收保荐费、财务顾问费和资产管理服务费减少 |
| 租赁负债 | 649,763,153.70 | 0.67 | - | - | 不适用 | 主要系施行新租赁准则 |
| 应付债券 | 27,302,228,611.93 | 28.00 | 23,804,092,796.22 | 24.63 | 14.70 | 主要系公司债增加 |
| 递延所得税负债 | 69,555,480.71 | 0.07 | 246,745,706.32 | 0.26 | -71.81 | 主要系金融资产浮盈减少 |
| 其他负债 | 1,347,141,035.95 | 1.38 | 1,414,415,329.68 | 1.46 | -4.76 | 基本持平 |

其他说明

截至2021年6月30日，公司资产总额为975.10亿元，较上年末基本持平。其中：货币资金为190.58亿元，占总资产的19.54%；融出资金为195.17亿元，占总资产的20.02%；交易性金融资产为247.39亿元，占总资产的25.37%。公司资产流动性良好、结构合理。

截至2021年6月30日，公司负债总额742.46亿元，较上年末基本持平。扣除代理买卖证券款和代理承销证券款后，自有负债为553.93亿元，其中一年以上付息债券273.02亿元，占自有负债比例为49.29%，其他负债为280.91亿元，占自有负债比例为50.71%。自有负债主要包括应付债券273.02亿元，占自有负债的49.29%；卖出回购金融资产款156.56亿元，占自有负债的28.26%；应付短期融资款56.43亿元，占自有负债的10.19%。公司资产负债率为76.14%，扣除代理买卖证券款后的资产负债率为70.42%，较上年末基本持平，公司负债结构合理，无到期未偿付债务。

2. 境外资产情况

√适用 □不适用

(1) 资产规模

其中：境外资产1,142,564,952.50（单位：元币种：人民币），占总资产的比例为1.17%。

(2) 境外资产相关说明

√适用 □不适用

公司境外资产主要是全资境外子公司财通香港。

3. 截至报告期末主要资产受限情况

√适用 □不适用

报告期内，主要资产受限情况参阅“本报告第十节财务报告七、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，公司长期股权投资余额71.39亿元，与年初相比增加4.38亿元，增幅为6.53%。

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位 | 期初投资 | 本期增加变动 | 期末投资 |
|-------------------------|------------------|----------------|------------------|
| 永安期货 | 2,975,729,106.38 | 244,238,301.93 | 3,219,967,408.31 |
| 财通基金 | 609,821,896.14 | 27,391,204.60 | 637,213,100.74 |
| 金华市民营企业稳健发展投资合伙企业（有限合伙） | 3,475,682.95 | - | 3,475,682.95 |
| 杭州财通月桂股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 7,679,373.70 | -3,498,640.70 | 4,180,733.00 |
| 杭州财通盛穗股权投资合伙企业（有限合伙） | 3,575,725.31 | 98,584.67 | 3,674,309.98 |

| | | | |
|----------------------------|------------------|----------------|------------------|
| 杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 12,978,581.46 | 6,983,954.72 | 19,962,536.18 |
| 杭州财通尤创创业投资合伙企业（有限合伙） | 2,551,547.09 | 380,789.42 | 2,932,336.51 |
| 长兴泰特股权投资合伙企业（有限合伙） | - | 32,077,720.17 | 32,077,720.17 |
| 德清锦焯财股权投资基金管理合伙企业（有限合伙） | 9,214,987.40 | 1,660,778.15 | 10,875,765.55 |
| 义乌通杰股权投资合伙企业（有限合伙） | 1,972,225.93 | 30,268.77 | 2,002,494.70 |
| 杭州博拉网络科技有限公司 | 555,253.38 | 933.91 | 556,187.29 |
| 杭州财通金榛股权投资合伙企业（有限合伙） | 3,260,699.79 | -1,755,519.75 | 1,505,180.04 |
| 绍兴市上虞区财通春晖股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 6,416,735.04 | 883,339.54 | 7,300,074.58 |
| 杭州财通富榕股权投资合伙企业（有限合伙） | 3,660,239.60 | -13,294.72 | 3,646,944.88 |
| 杭州财通恒芯创业投资合伙企业（有限合伙） | 10,003,950.08 | -191,239.49 | 9,812,710.59 |
| 杭州酒通投资管理有限公司 | 4,314,098.43 | -183,917.47 | 4,130,180.96 |
| 浙江省浙商资产管理有限公司 | 2,759,426,812.75 | 135,505,017.54 | 2,894,931,830.29 |
| 云和梯田投资发展有限公司 | 60,091,765.34 | 151,995.86 | 60,243,761.20 |
| 迈得医疗工业设备股份有限公司 | 54,200,610.24 | -961,753.70 | 53,238,856.54 |
| 北京信安世纪科技股份有限公司 | 89,630,379.13 | -15,874.16 | 89,614,504.97 |
| 天道金科股份有限公司 | 43,773,500.47 | -4,816,536.63 | 38,956,963.84 |
| 北京三清互联科技股份有限公司 | 35,396,800.45 | -159,287.22 | 35,237,513.23 |
| 浙江财和通易企业发展有限公司 | 3,083,906.56 | -37,511.66 | 3,046,394.90 |
| 合 计 | 6,700,813,877.62 | 437,769,313.78 | 7,138,583,191.4 |

(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

单位：元 币种：人民币

| 项目名称 | 期初余额 | 期末余额 | 当期变动 | 对当期利润的影响金额 |
|---------|-------------------|-------------------|-----------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 24,938,451,516.22 | 24,739,422,345.68 | -199,029,170.54 | 827,419,337.56 |
| 其他债权投资 | 7,036,028,384.00 | 6,789,949,514.53 | -246,078,869.47 | 136,962,975.41 |
| 其他权益工具 | 131,444,319.58 | 132,828,205.70 | 1,383,886.12 | - |
| 衍生金融工具 | -61,818,830.68 | 141,545,127.86 | 203,363,958.54 | -88,310,583.56 |
| 合计 | 32,044,105,389.12 | 31,803,745,193.77 | -240,360,195.35 | 876,071,729.41 |

注：对当期利润的影响金额包括：（1）持有处置上述项目取得的投资收益；（2）除其他债权投资和其他权益工具外的其他项目发生的公允价值变动损益；（3）其他债权投资发生的减值损失和利息收入。上述对当期利润影响金额均为企业所得税前发生额。

(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

截至2021年6月30日，公司有一级子公司4家，主要参股公司3家，简要情况如下：

| 名称 | 持股比例 | 设立时间 | 注册资本 | 办公地址 | 注册地址 | 负责人 | 联系电话 |
|-------------------|---------|------------|-----------------------------|--|--------------------------------------|-----|---------------|
| 财通证券资管 | 100.00% | 2014/12/15 | 人民币20,000万元 | 上海市浦东新区栖霞路26弄2号富汇大厦B栋8-9层 | 浙江省杭州市上城区白云路26号143室 | 马晓立 | 021-20568200 |
| 财通资本 | 100.00% | 2015/3/24 | 人民币50,000万元 | 浙江省杭州市上城区甘水巷142号 | 浙江省杭州市上城区白云路22号161室 | 阮雳 | 0571-87652128 |
| 财通创新 | 100.00% | 2015/10/15 | 人民币380,000万元 | 上海市浦东新区栖霞路26弄2号富汇大厦B栋1202室 | 中国（上海）自由贸易试验区栖霞路26弄2号1202室 | 张昊 | 021-68592191 |
| 财通香港 | 100.00% | 2011/8/12 | 已发行股份数目：50,000万股每股面值：1.00港币 | 香港中环皇后大道中181号新纪元广场24楼2401-03室 | 香港中环皇后大道中181号新纪元广场24楼2401-03室 | 钱斌 | 0571-87130303 |
| 财通基金 | 40.00% | 2011/6/21 | 人民币20,000万元 | 上海市银城中路68号时代金融中心41楼 | 上海市虹口区吴淞路619号505室 | 夏理芬 | 021-20537888 |
| 永安期货 | 33.54% | 1992/9/7 | 人民币131,000万元 | 杭州市新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层，2604室、2702室 | 杭州市新业路200号华峰国际商务大厦16-17层，2603室、2702室 | 葛国栋 | 0571-88398228 |
| 浙江省浙商资产管理有 限公司 | 20.81% | 2013/8/6 | 人民币709,711万元 | 杭州市西湖大道193号301室 | 杭州市西湖大道193号301室 | 孙建华 | 0571-89773800 |

主要子公司、参股公司基本情况如下：

(1) 财通证券资管注册资本 20,000 万元，截至报告期末，财通证券资管总资产人民币 237,486.08 万元，净资产人民币 130,363.15 万元；报告期内，财通证券资管实现营业收入人民币 63,383.59 万元，利润总额人民币 15,051.69 万元，净利润人民币 11,127.48 万元。

(2) 财通资本注册资本 50,000 万元，截至报告期末，财通资本总资产人民币 63,539.45 万元，净资产人民币 57,854.55 万元；报告期内，财通资本实现营业收入人民币 2,417.89 万元，利润总额人民币 872.03 万元，净利润人民币 867.14 万元。

(3) 财通创新注册资本人民币 380,000 万元，截至报告期末，财通创新总资产人民币 427,454.55 万元，净资产人民币 424,299.09 万元；报告期内，财通创新实现营业收入人民币 22,501.96 万元，利润总额人民币 21,251.3 万元，净利润人民币 21,218.29 万元。

(4) 财通香港已发行股份数目 50,000 万股，每股面值 1.00 港币，截至报告期末，财通香港总资产 137,311.01 万港元，净资产 58,273.15 万港元；报告期内，财通香港实现营业收入 9,011.01 万港元，利润总额 3,386.93 万港元，净利润 2,260.24 万港元。

(5) 财通基金注册资本人民币 20,000 万元，截至报告期末，财通基金总资产人民币 244,932.28 万元，净资产人民币 159,871.54 万元；报告期内，财通基金实现营业收入人民币 26,404.66 万元，利润总额人民币 8,008.93 万元，净利润人民币 6,823.81 万元。

(6) 永安期货注册资本人民币 131,000 万元，截至报告期末，永安期货总资产人民币 5,691,498.29 万元，净资产人民币 852,647.71 万元；报告期内，永安期货实现营业收入人民币 1,668,457.94 万元，利润总额人民币 89,487.34 万元，净利润人民币 73,964.60 万元。

(7) 浙江省浙商资产管理有限公司注册资本人民币 709,711 万元，截至报告期末，浙江省浙商资产管理有限公司总资产人民币 6,599,457.43 万元，净资产人民币 1,465,731.01 万元；报告期内，浙江省浙商资产管理有限公司实现营业收入人民币 301,728.32 万元，利润总额人民币 141,809.77 万元，净利润人民币 104,998.06 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，公司共合并 4 个结构化主体，合并结构化主体的总资产为人民币 1,047,969,537.55 元。本公司持有上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产中，总金额为人民币 1,042,498,911.31 元。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险

适用 不适用

1、公司经营活动面临的风险

公司经营中面临的风险主要有：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、信息技术风险等。

（1）市场风险

市场风险是指因市场价格（利率、汇率、股票价格和商品价格）的不利变动而使公司投资组合发生损失的风险。公司市场风险源自于自营证券、做市业务以及其他投资活动。市场风险主要分为权益价格风险、利率风险、商品价格风险和汇率风险等。其中权益类风险主要是因股票、基金、股指期货以及资产管理计划等权益品种价格或波动率的变化所致；利率风险主要是因债券等固定收益投资收益率曲线结构、利率和信用利差等变化所致；商品价格风险主要是因各类商品价格变化所致；汇率风险主要是因外汇汇率变化所致。

报告期内，公司涉及的市场风险主要为自营固定收益类投资的利率风险和自营权益类证券投资的价格风险。公司使用基点价值作为衡量固定收益类资产市场风险状况的指标之一，报告期内，公司固定收益类投资组合年度平均基点价值为 511.51 万元（基点价值衡量利率上升 1 个 BP，债券组合的市值减少量）。公司使用 VaR 作为衡量权益类资产市场风险状况的指标之一，报告期内，公司自营股票投资的平均日 VaR 比例为 2.24%（取样天数：250 日，置信水平：95%）。

（2）信用风险

信用风险是指因借款人、交易对手或发行人未能履行其合约责任而导致损失的可能性，或由于借款人、交易对手、发行人的信用评级的变动和履约能力的变化而导致其债务市场价值变动而引起损失的可能性。公司的信用风险源于信用类产品（包括债券和其他债权投资等）投资的违约风险，证券信用业务（包括融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务等），场外衍生品交易的交易对手方违约风险等方面。主要表现为债券等主体违约、信用评级下调，客户违约，交易对手违约等给公司造成损失的可能性。

报告期内公司存在个别信用类产品及部分证券信用业务违约风险，公司积极采取处置措施妥善推进风险的缓释和化解并取得有效进展，整体信用风险可控。

（3）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

报告期内公司流动性指标均符合监管标准。

（4）操作风险

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

报告期内，公司未发生重大操作风险事件。为强化操作风险管理，公司持续健全和完善管理制度及机制、优化业务流程、加强业务培训、严格落实问责，有效控制操作风险的发生频率和造成的影响。

（5）信息技术风险

信息技术风险是指公司经营及业务开展过程中所依赖的电子信息系统可能会面临软硬件故障、通讯线路故障、恶意入侵等不可预料事件带来的信息系统风险隐患，影响公司的声誉和服务质量，甚至会带来经济损失和法律纠纷。

报告期内，公司未发生重大信息技术风险事件。

2、全面风险管理情况

公司严格遵守监管要求，坚持依法、合规经营，并提倡稳健、审慎的风险偏好。公司通过建立健全风险管理制度体系及组织架构、丰富完善风险防范和管控措施，持续提升全面风险管理能力，实现各类风险的可测、可控、可承受。

（1）风险管理制度体系

公司建立了全面的风险管理和内部控制流程，以监督、评估、管理和各项业务相关的风险敞口。公司按照《证券公司全面风险管理规范》的要求，持续建立完善三层级的风险管理制度体系，其中：第一层级是以《风险管理基本制度》作为根本指导的公司基本制度；第二层级是根据市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险和声誉风险等不同风险类型和经纪业务、自营业务、信用类业务、投行业务等不同业务类型分类制定的矩阵式风险管理核心制度，以及围绕风险控制指标管理、风险限额管理、压力测试、应急管理、业务连续性管理、新业务风险管理等专项工作制定的核心制度；第三层级是根据风险管理核心制度制定的具体实施细则，以及围绕子公司风险管理、风险管理考核、风险管理问责、模型管理等工作制定的具体风险管理制度。

（2）风险管理组织架构

公司根据全面风险管理的要求建立分工合理、职责明确、报告关系清晰的风险管理组织架构，包括董事会（风险控制委员会）、监事会，经理层（风险管理委员会），风险管理部、合规部、各职能部门，业务部门及子公司共四个层级。公司设置首席风险官，领导风险管理部推动公司全面风险管理工作。

（3）主要风险的防范对策和措施

1) 市场风险

针对市场风险，公司建立了自上而下的风险限额管理体系，根据风险偏好设定公司市场风险容忍度及整体风险限额，并将整体风险限额在各业务条线之间细化分解。公司董事会确定自营业务年度规模、市场风险损失容忍度、损失限额等重大风险限额；公司经营管理层将董事会确定的年度规模、市场风险损失容忍度、重大风险限额等进行分解，并审批确定相应风险限额，包括各自营部门业务规模、投资集中度、平均久期、DV01 以及 VaR 等。公司自营部门在上述基础上进一步细化部门层级的风险限额，并通过组合投资、逐日盯市、对冲缓释、监控预警等手段进行风险控制；风险管理部对公司各项风险限额每日进行监控，当发现有接近或突破风险限额的情况时会及时向公司经营管理层与相关业务部门发送预警和风险提示，业务部门相应提出应对措施。

2) 信用风险

针对信用风险，在证券信用业务方面，公司通过尽职调查、审查等手段对客户进行征授信管理，依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理，对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制，逐日盯市、强化实时监控交易等措施强化信用风险的控制；在债券类产品投资方面，公司通过内评系统采用定性与定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、密切跟踪债券发行人经营情况和资信水平、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理；在衍生品交易业务方面，公司对交易对手进行授信管理，利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等风险缓释措施，以及明确违约事件、提前终止事件的处理流程等措施控制信用风险。

3) 流动性风险

针对流动性风险，公司通过加强日间流动性管理和日常融资管理，实施流动性风险限额管理、开展高评级债券类资产流动性管理业务，建立三级流动性储备池，改善公司负债结构，强化融资渠道建设，建立健全流动性风险管理信息系统等手段，积极应对流动性压力，防范和控制流动性风险。同时，公司在出现新增投资、新业务开展等情形时，根据业务规模、性质、复杂程度及风险状况，对流动性风险指标进行压力测试，并将压力测试结果运用于公司的相关决策过程。此外，公司制定了有效的流动性风险应急计划，并定期开展应急演练，以确保公司可以应对紧急情况下的流动性需求。

4) 操作风险

公司制定了《财通证券股份有限公司操作风险管理办法》，明确了操作风险的组织架构及职责分工、操作风险管理流程、操作风险管理文化建设等内容，强化了操作风险管理各道防线的职责。公司持续加强业务流程管理和信息技术系统建设，并通过培训宣导、强化问责等手段，减少操作风险发生的可能性；同时，公司通过操作风险关键风险指标、损失数据收集、风险与控制自我评估等风险管理工具的建设和运用，以进一步提升操作风险管理能力；此外，公司充分重视创新产品、创新业务操作风险的识别与控制，建立新业务风险管理制度和流程，明确需满足的条件和审批路径，确保新业务的组织结构、业务模式、风险状况经过充分论证，公司通过上述多样化的操作风险管理手段，保障总体操作风险处于可控、可承受的水平。

5) 信息技术风险

公司通过以下措施加强信息技术风险的管控：一是持续做好制度体系建设，夯实信息技术安全保障体系；二是对信息系统实行分级管理、加强对重要信息系统的运维保障能力；三是建立健全全方位信息安全防护体系；四是加强人员的安全意识宣导和技能培训；五是建立和加强分支机构信息系统安全管控体系；六是完善信息技术风险的有效沟通和共享机制。

(4) 公司风险控制指标监控和补足机制建立情况

公司高度重视风险管理工作，按照《证券公司风险控制指标管理办法》《证券公司全面风险管理规范》等监管及自律要求，结合公司实际情况，建立了与公司自身发展战略相适应的全面风险管理体系。

按照《证券公司风险控制指标管理办法》的要求，公司已制定了《财通证券股份有限公司风险控制指标管理办法》《财通证券股份有限公司风险控制指标动态监控管理办法》，同时持续完善动态风险控制指标的监控系统，实现了风险控制指标的动态监控和预警。

公司已建立净资本补足机制，保证净资本等风险控制指标持续符合证券监管部门的要求，报告期内，公司各项风险控制指标均持续符合监管标准，未出现触及监管标准的情况。

公司建立了风险控制指标压力测试机制。根据《证券公司压力测试指引》等相关要求，结合市场环境变化和公司业务发展状况，定期或不定期开展综合或专项压力测试，全面衡量公司风险承受能力，并拟订相关应对措施，保障公司健康、持续、稳定发展。

(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3月31日 | http://www.sse.com.cn | 2021年4月1日 | 详见《财通证券股份有限公司2021年第一次临时股东大会决议公告》(公告编号:2021-021) |
| 2020年年度股东大会 | 2021年5月19日 | http://www.sse.com.cn | 2021年5月20日 | 详见《财通证券股份有限公司2020年年度股东大会决议公告》(公告编号:2021-040) |

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

2021年3月31日，公司在总部1102会议室以现场结合网络投票方式召开2021年第一次临时股东大会。会议审议通过了2项议案：1. 关于选举董事的议案；2. 关于选举监事的议案。上述议案均为普通议案，均获审议通过。相关决议情况详见刊登在上交所网站

(<http://www.sse.com.cn>)和《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》上的《财通证券股份有限公司2020年第一次临时股东大会决议公告》(公告编号:2021-021)。

2021年5月19日，公司在总部1102会议室以现场结合网络投票方式召开2020年年度股东大会。会议审议通过了16项议案：1. 关于审议2020年度董事会工作报告的议案；2. 关于审议2020年度监事会工作报告的议案；3. 关于审议2020年年度报告的议案；4. 关于审议2020年度财务决算报告的议案；5. 关于审议2020年度利润分配方案的议案；6. 关于确认2020年关联交易的议案；7.

关于预计2021年日常关联交易的议案；8.关于核准2021年度证券投资额度的议案；9.关于境内外债务融资工具的一般性授权的议案；10.关于公司符合配股发行条件的议案；11.关于配股公开发行证券方案的议案；12.关于配股公开发行证券预案的议案；13.关于配股公开发行募集资金使用可行性报告的议案；14.关于前次募集资金使用情况报告的议案；15.关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的议案；16.关于提请股东大会授权董事会全权办理本次配股相关事宜的议案。其中，议案8、9.00（即9.01-9.11）、10、11.00（即11.01-11.11）、12、13、14、15、16为特别决议议案，均获得有效表决权股份总数的2/3以上通过，其他为普通议案，均获审议通过。相关决议情况详见刊登在上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）和《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》上的《财通证券股份有限公司2020年年度股东大会决议公告》（公告编号：2021-040）。

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 |
|-----|------------|------|
| 黄伟建 | 董事 | 选举 |
| | 总经理 | 聘任 |
| 方敬华 | 董事 | 选举 |
| 郑联胜 | 监事会主席 | 选举 |
| 韩洪灵 | 独立董事 | 选举 |
| 申建新 | 合规总监 | 聘任 |
| 官勇华 | 董事会秘书 | 聘任 |
| 王跃军 | 财务总监兼首席风险官 | 聘任 |
| 阮琪 | 原董事、总经理 | 离任 |
| 徐爱华 | 原董事 | 离任 |
| 汪炜 | 独立董事 | 离任 |
| 叶元祖 | 原监事会主席 | 离任 |
| 夏理芬 | 首席风险官 | 离任 |
| 申建新 | 董事会秘书 | 离任 |
| 官勇华 | 合规总监 | 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

2021年1月，徐爱华女士因工作原因申请辞去董事及董事会风险控制委员会委员职务；2021年1月，叶元祖先生因工作调动原因申请辞去监事、监事会主席职务；2021年2月，阮琪先生因组织调

动原因申请辞去董事、董事会风险控制委员会委员及总经理职务。

2021年3月31日，公司2021年第一次临时股东大会选举黄伟建先生、方敬华先生为第三届董事会董事，选举郑联胜先生为第三届监事会监事；公司第三届监事会第七次会议选举郑联胜先生为监事会主席。

2021年3月15日，公司第三届董事会第九次会议聘任申建新先生担任公司合规总监，官勇华先生不再担任合规总监；聘任官勇华先生担任公司董事会秘书，申建新先生不再担任董事会秘书；聘任王跃军先生担任公司首席风险官，夏理芬先生不再担任首席风险官。

2021年7月19日，公司2021年第二次临时股东大会选举韩洪灵先生为第三届董事会独立董事，汪炜先生因任职期满不再担任公司独立董事。

2021年8月25日，公司第三届董事会第十三次会议聘任黄伟建先生为公司总经理。

三、利润分配或资本公积金转增预案

半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

| | |
|-----------------------|---|
| 是否分配或转增 | 否 |
| 每 10 股送红股数（股） | 0 |
| 每 10 股派息数(元)（含税） | 0 |
| 每 10 股转增数（股） | 0 |
| 利润分配或资本公积金转增预案的相关情况说明 | |
| 无 | |

四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

（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

(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

公司提倡绿色办公理念，从办公环境、办公方式等方面全面落实低碳环保要求。如在大额采购、供应商选择上选择环保材料；无纸化办公（OA 系统）、低碳办公（视频会议）等。目前，公司采用 OA 系统、企业微信工作台进行无纸化办公。同时，公司已全面应用华为云会议系统，覆盖总部及所有分支机构，节约会议成本，提升会议效率；公司总部部分会议室建成无纸化会议系统，利用平板作为资料载体，节约会议成本，控制内部商业信息流转。

(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

公司鼓励绿色出行，降低能源消耗，实施节能减排，切实履行环境保护主体责任。如鼓励公交出行、就餐光盘行动等。公司借力企业微信工作平台，每周统计预估用餐量，合理准备食材。提倡光盘行动，杜绝食堂浪费；公司新大楼，建造屋顶光伏发电。加强物业管理，严控空调温度，节约水电使用；公司强化公车管理，合理安排公车资源，节省用车成本。

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

公司以习近平总书记系列重要讲话精神为指导，紧紧围绕“五位一体”总体布局和“四个全面”战略布局，积极响应中国证券业协会“一司一县”结对县帮扶行动号召，把乡村振兴作为崇高的政治责任。我司坚持政府规划与企业帮扶相衔接、帮扶促进与自我提高相结合的帮扶原则，从解决建档立卡贫困人口“两不愁三保障”为重点转向实现乡村产业兴旺、生态宜居、乡风文明、治理有效、生活富裕，集中资源支持脱贫攻坚转向巩固拓展脱贫攻坚成果和全面推进乡村振兴，认真做好“一司一县”以及“东西部扶贫协作”帮扶工程，将精准帮扶与区域特色开发结合，在基础设施、公共服务、产业发展、教育教学等不同领域为当地提供帮扶，助力其实现“造血功能”。

2021 年上半年，公司向新疆阿克苏地区启明学校捐款 30 万元，为启明学校学术交流厅添置全彩色电子屏、灯光等设备以及建设完善教师培训交流场所以及启明学校特殊儿童活动场所；同时，组织员工向阿克苏柯柯牙镇第一小学捐款 8.29 万元，帮助孩子们的学习生活条件；向浙江省残联捐赠 10 万元，支持参与“学党史 感党恩 我为残疾儿童献爱心”助残公益慈善活动，进一步弘扬

人道主义精神，传播党的声音，传递社会正能量；向衢州市柯城区衢化街道捐赠 20 万元，建设“博爱菜园”（研学基地）帮扶项目；委托浙江同方律师事务所对“一司一县”帮扶（公益）项目进行合规性检查以及绩效评价。全资子公司财通资管结对向浙江省遂昌县蔡源乡投入 40 万元，帮助其改善农业集体经营所必须的道路、水、电等基础设施建设，同时推出了“一亩茶园”公益认领项目，发动公司员工认领村集体所属的 60 亩茶山，总计募集认领款近 20 万元，用于买断茶山的年度产出，从而实现惠农支农。在公司的帮助下，永兴村已连续两年摘除“集体经济薄弱村”的帽子。

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 | 其他 | 浙江金控 | 本公司所持发行人本次发行前的股票在锁定期满后2年内减持的,其减持价格不低于发行价,本公司每年减持上述发行人股份数量不超过发行人股份总数的5%,减持方式包括二级市场集中竞价交易、大宗交易,或协议转让等证券监督管理部门及证券交易所认可的合法方式。本公司拟减持发行人股份时,将提前3个交易日通知发行人并予以公告,并承诺将按照《公司法》、《证券法》、证券监督管理部门及证券交易所相关规定办理。 | 锁定期满后2年内 | 是 | 是 | | |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决同业竞争 | 浙江金控、浙江开其控制的其他企业 | 不存在直接或间接从事与财通证券及其控制的企业相同或相似并构成竞争关系的业务的情形。严格遵守《证券公司监督管理条例》等有关法律、法规、规范性文件的规定及中国证监会的要求,不在中国境内或境外,直接或间接从事与财通证券及其控制的企业相同或相似并构成竞争关系的业务,亦不会直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权。严格遵守《证券公司监督管理条例》等有关法律、法规、规范性文件的规定及中国证监会的要求,不在中国境内或境外,直接或间接从事与财通证券现有主营业务相同或相似并构成竞争关系的投资业务,亦不会直接或间接获取从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权。在任何投资机会中与财通证券构成或可能构成直接或间接竞争的,在同等条件下,应优先将该等投资机会让与财通证券。 | 长期有效 | 是 | 是 | | |
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决关联交易 | 浙江金控、浙江开其控制的其 | 保证不会实施影响公司的独立性的行为,并将保持公司在资产、人员、财务、业务和机构等方面的独立性;将尽量避免与公司之间产生关联交易事项,对于不可避免发生的关联业务往来或交易,将在平等、自愿的基础上,按照公平、公允和等价有偿的原则进行,交易价格将按照市场公认 | 长期有效 | 是 | 是 | | |

| | | | | | | | | |
|-----------|----|-----------|--|----|---|---|--|--|
| | | 他 企 业 | 的合理价格确定。保证不会利用关联交易转移本公司的利润，不会通过影响公司的经营决策来损害本公司及其他股东的合法权益，不以任何方式违法违规占用公司资金及要求公司违规提供担保。 | | | | | |
| 与再融资相关的承诺 | 其他 | 浙 江 金控 | 本公司将根据本次配股股权登记日收市后的持股数量，按照财通证券与保荐机构协商确定的配股价格和配股比例，以现金方式全额认购根据本次配股方案确定的本公司可获得的配售股份；本公司用于认购配售股份的资金来源合法合规，为本公司的自有资金或自筹资金。本公司认购本次配股项下可配售股份，不存在接受他人委托投资或股份代持的情形；本公司承诺若本次配股方案根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）的规定和要求进行调整，将按照中国证监会最终核准的配股比例以现金方式全额认购可配股份；本公司将在本次配股获得财通证券股东大会审议通过，并经中国证监会及/或其他有权机构核准或批准后实际履行上述承诺。 | -- | 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

适用 不适用

五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

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

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

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

本公司严格按照《上海证券交易所股票上市规则》、公司《信息披露管理制度》和《关联交易管理制度》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，本公司日常关联交易按照公司 2020 年度股东大会审议通过的《关于预计 2021 年日常关联交易的议案》执行，具体披露情况详见财务报表附注中的关联交易数额（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：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 | |
| 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 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 报告期末对子公司担保余额合计（B） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | 683,062,000.00 | |
| 公司担保总额情况（包括对子公司的担保） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 担保总额（A+B） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | 683,062,000.00 | |
| 担保总额占公司净资产的比例（%） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | 2.94% | |
| 其中： | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 担保总额超过净资产50%部分的金额（E） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 上述三项担保金额合计（C+D+E） | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未到期担保可能承担连带清偿责任说明 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 担保情况说明 | | | | | | | | | 截至2021年6月30日，公司累计为全资子公司提供的担保总额为等值人民币6.83亿元；其中通过内保外贷形式为财通香港提供了等值人民币1.83亿元的融资担保；为财通证券资管提供了人民币5亿元的净资本担保。公司不存在逾期担保情形。 | | | | | | | |

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

1. 再融资情况

（1）可转换公司债券

详见本报告“第九节二、可转换公司债券情况”。

（2）配股

2021年5月19日，公司召开2020年年度股东大会，审议通过了《关于公司符合配股发行条件的议案》《关于配股公开发行证券方案的议案》《关于配股公开发行证券预案的议案》《关于配股公开发行募集资金使用可行性报告的议案》《关于前次募集资金使用情况报告的议案》《关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的议案》《关于提请股东大会授权董事会全权办理本次配股相关事宜的议案》等配股公开发行证券的相关议案。

2021年5月24日，公司取得浙江省财政厅下发的《浙江省财政厅关于同意财通证券股份有限公司以配股方式实施再融资的函》（浙财金〔2021〕14号）。2021年7月26日，公司取得中

国证券监督管理委员会下发的《关于财通证券股份有限公司 A 股配股公开发行事项的监管意见书》（机构部函（2021）2316 号）。

2021 年 8 月 9 日，中国证券监督管理委员会出具了我司配股申请文件反馈意见，目前我司正准备答复反馈意见。

公司本次配股事项尚需获得中国证券监督管理委员会核准后方可实施。公司将积极推进相关工作，并根据相关事项的进展情况及时履行信息披露义务。

2. 权益分派实施情况

2021 年 5 月 19 日，公司召开 2020 年年度股东大会，审议通过了《关于审议 2020 年度利润分配方案的议案》，2020 年度利润分配采用现金分红方式，以总股本 3,589,000,000 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 2.0 元（含税），共派发现金红利 717,800,000.00 元，公司分配的现金股利总额占 2020 年合并口径下归属于母公司股东净利润的 31.32%。

2021 年 6 月 1 日，公司通过《证券日报》《证券时报》《中国证券报》《上海证券报》和上海证券交易所网站披露了《财通证券股份有限公司 2020 年年度权益分派实施公告》，本次权益分派股权登记日为 2021 年 6 月 4 日，现金发放日为 2021 年 6 月 7 日。截至本报告披露日，2020 年度权益分派已实施完毕。

3. 涉及诉讼事项

（1）2018 年 5 月 31 日，公司起诉北京东方君盛投资管理有限公司、冯彪合同纠纷一案获杭州杭州市中级人民法院受理，公司诉请：（1）判令被告北京东方君盛投资管理有限公司立即向原告财通证券股份有限公司支付转让价款通 1.5 亿元及其溢价和违约金；（2）判令被告冯彪对上述债务承担连带清偿责任；（3）要求两被告连带承担本案的全部案件受理费、财产保全费和律师费。该案经一审、二审，法院判决支持公司上述诉求。2020 年 6 月，公司向杭州中院申请执行，并且已就债务履行达成执行和解。截至目前，该案件正处于分期还款阶段。

（2）截至目前，公司主要因融资融券交易纠纷，就相关十九起违约案件陆续向杭州仲裁委员会申请仲裁或杭州市西湖区人民法院提起诉讼，其中 15 起案件已取得仲裁裁决书并申请法院强制执行，1 起案件先在法院达成调解后因对方违约再申请执行，剩余 3 起案件还在审理中，上述十九起案件涉案金额合计约为 3.16 亿元。

（3）报告期内，公司收到北京金融法院送达的民事起诉状，原告金元顺安基金管理有限公司诉称公司为山东金茂纺织化工集团有限公司发行的“15 金茂债”的主承销商，要求赔偿其持有的“15 金茂债”本息损失，共三个案件，标的额合计 126,490,524.63 元。

4. 分支机构情况

截至报告披露日，公司已设立证券分支机构 149 家（不含筹建网点），其中分公司 27 家，营业部 122 家。

5. 重要参股公司永安期货上市进程

2020 年 12 月 15 日，公司重要参股公司永安期货向证监会报送了首次公开发行股票并在上

海证券交易所上市的申请。2020年12月17日，永安期货收到证监会下发的《中国证监会行政许可申请受理单》（203416号），首次公开发行股票并在上海证券交易所主板上市的申请被证监会受理。2021年1月15日，公司收到了《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》（203416号）。公司及相关中介机构已组织完成反馈意见回复并已上报中国证监会。2021年7月1日，公司完成了招股说明书（申报稿）预披露更新，并在证监会网站披露。

6. 参股公司经营风险情况

公司的联营企业财通基金之子公司上海财通资产管理有限公司（以下简称：上海财通资产）因其相关产品涉及阜兴事件。阜兴事件于2018年6月下旬爆发，7月，中央有关部门联合成立了阜兴事件工作领导小组；2019年底，阜兴集团主要负责人涉嫌刑事犯罪已被公安批捕回国。阜兴集团及其实际控制人朱一栋等人涉及集资诈骗罪一案在2020年11月30日至12月3日期间进行了开庭审理，截止目前，该案仍未宣判。从目前掌握的情况看，上海财通资产可能面临一定的潜在风险。

7. 试点开展基金投资顾问业务

2021年6月，公司收到中国证券监督管理委员会《关于财通证券股份有限公司试点开展基金投资顾问业务有关事项的复函》（机构部函〔2021〕1698号）。根据该复函，中国证监会对公司试点开展基金投资顾问业务无异议。公司将按照《关于做好公开募集证券投资基金投资顾问业务试点工作的通知》以及公司报送的试点业务方案尽快完成基金投资顾问业务相关筹备工作，待通过验收后，正式开展基金投资顾问试点业务。

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 | | | | | | | | | |
| 1、国家持股 | | | | | | | | | |
| 2、国有法人持股 | | | | | | | | | |
| 3、其他内资持股 | | | | | | | | | |
| 其中：境内非国有法人持股 | | | | | | | | | |
| 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 | 3,589,000,000 | 100 | | | | 9,508 | 9,508 | 3,589,009,508 | 100 |
| 1、人民币普通股 | 3,589,000,000 | 100 | | | | 9,508 | 9,508 | 3,589,009,508 | 100 |
| 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 | 3,589,000,000 | 100 | | | | 9,508 | 9,508 | 3,589,009,508 | 100 |

2、股份变动情况说明

√适用 □不适用

公司可转债 2021 年 6 月 16 日进入转股期，自 2021 年 6 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日期间，A 股可转债有 125,000 元转换为公司 A 股股份，转股数量为 9,508 股。

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

报告期后到半年报披露日期间发生的普通股股份变动对财务指标无重大影响。

4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

□适用 √不适用

(二) 限售股份变动情况

□适用 √不适用

二、股东情况

(一) 股东总数：

| | |
|------------------------|---------|
| 截止报告期末普通股股东总数(户) | 158,061 |
| 截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户) | 0 |

(二) 截止报告期末前十名股东、前十名流通股（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 | |
| 浙江省金融控股 有限公司 | 0 | 1,041,769,700 | 29.03 | 0 | 无 | 0 | 国有法人 |

| | | | | | | | |
|---------------------------------------|-------------|-------------|------|---|----|------------|---------|
| 浙江省财务开发有限责任公司 | 0 | 115,752,189 | 3.23 | 0 | 无 | 0 | 国有法人 |
| 台州市金融投资集团有限公司 | -3,620,000 | 102,709,439 | 2.86 | 0 | 无 | 0 | 国有法人 |
| 景宁跃泰科技有限公司 | -600 | 79,149,300 | 2.21 | 0 | 无 | 0 | 境内非国有法人 |
| 维科控股集团股份有限公司 | 0 | 62,600,000 | 1.74 | 0 | 无 | 0 | 境内非国有法人 |
| 中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 | -5,040,600 | 48,619,910 | 1.35 | 0 | 无 | 0 | 其他 |
| 香港中央结算有限公司 | -12,300,114 | 46,342,335 | 1.29 | 0 | 无 | 0 | 境外法人 |
| 莱恩达集团有限公司 | 2,392,700 | 43,178,591 | 1.20 | 0 | 无 | 0 | 境内非国有法人 |
| 回音必集团有限公司 | 0 | 37,406,583 | 1.04 | 0 | 质押 | 37,406,583 | 境内非国有法人 |
| 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 | 5,417,678 | 35,278,448 | 0.98 | 0 | 无 | 0 | 其他 |

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 |
| 浙江省金融控股有限公司 | 1,041,769,700 | 人民币普通股 | 1,041,769,700 |
| 浙江省财务开发有限责任公司 | 115,752,189 | 人民币普通股 | 115,752,189 |
| 台州市金融投资集团有限公司 | 102,709,439 | 人民币普通股 | 102,709,439 |
| 景宁跃泰科技有限公司 | 79,149,300 | 人民币普通股 | 79,149,300 |
| 维科控股集团股份有限公司 | 62,600,000 | 人民币普通股 | 62,600,000 |
| 中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 | 48,619,910 | 人民币普通股 | 48,619,910 |
| 香港中央结算有限公司 | 46,342,335 | 人民币普通股 | 46,342,335 |
| 莱恩达集团有限公司 | 43,178,591 | 人民币普通股 | 43,178,591 |
| 回音必集团有限公司 | 37,406,583 | 人民币普通股 | 37,406,583 |
| 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 | 35,278,448 | 人民币普通股 | 35,278,448 |
| 前十名股东中回购专户情况说明 | 不适用 | | |
| 上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明 | 不适用 | | |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 浙江省金融控股有限公司和浙江省财务开发有限责任公司均由浙江省财政厅控制，两者为一致行动人。 | | |

| | |
|---------------------|-----|
| 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

(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：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 |
|-------------------------------|--------|--------|------------|------------|------------|---------------|-----------|------------------------------------|----------|------------------------------|------------|-----------------------|
| 财通证券股份有限公司2018年第三期次级债券 | 18财通C3 | 150618 | 2018年8月23日 | 2018年8月23日 | 2021年8月23日 | 2,500,000,000 | 5.19 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向合格投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司2019年第一期次级债券(品种一) | 19财通C1 | 151073 | 2019年1月11日 | 2019年1月11日 | 2022年1月11日 | 3,000,000,000 | 4.40 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向合格投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司2019年第二期次级债券 | 19财通C3 | 151337 | 2019年4月8日 | 2019年4月8日 | 2022年4月8日 | 2,000,000,000 | 4.25 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向合格投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司2021年非公开发行公司债券(第一期) | 21财通F1 | 178285 | 2021年4月8日 | 2021年4月8日 | 2022年5月10日 | 2,500,000,000 | 3.33 | 单利计息, 不计复利, 到期一次还本付息, 利息随本金的兑付一起支付 | 上交所 | 面向专业投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司2020年第一期次级债券 | 20财通C1 | 166362 | 2020年3月24日 | 2020年3月24日 | 2023年3月24日 | 3,000,000,000 | 3.55 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向合格投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司公开发行2020 | 20财通01 | 163455 | 2020年4月22日 | 2020年4月22日 | 2023年4月22日 | 2,500,000,000 | 2.59 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一 | 上交所 | 面向合格投资者 | 竞价、报价、询价 | 否 |

| | | | | | | | | | | | | |
|---------------------------------------|----------|--------|------------------|------------------|------------------|---------------|------|--------------------------------|-----|---------|---------------|---|
| 年第一期公司债券 (品种一) | | | | | | | | 次, 到期一次还本付息 | | | 和协议交易 | |
| 财通证券股份有限公司公开发行 2020 年第一期公司债券 (品种二) | 20 财通 02 | 163456 | 2020 年 4 月 22 日 | 2020 年 4 月 22 日 | 2025 年 4 月 22 日 | 1,000,000,000 | 3.25 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向合格投资者 | 竞价、报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券 (第一期) | 20 财通 F1 | 166973 | 2020 年 6 月 16 日 | 2020 年 6 月 16 日 | 2023 年 6 月 16 日 | 2,000,000,000 | 3.40 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向专业投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司 2020 年第二期次级债券 | 20 财通 C2 | 167435 | 2020 年 8 月 14 日 | 2020 年 8 月 14 日 | 2023 年 8 月 14 日 | 2,000,000,000 | 4.09 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向专业投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司 2020 年第三期次级债券 | 20 财通 C3 | 167887 | 2020 年 10 月 22 日 | 2020 年 10 月 22 日 | 2023 年 10 月 22 日 | 1,500,000,000 | 4.20 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向专业投资者 | 报价、询价和协议交易 | 否 |
| 财通证券股份有限公司公开发行 2021 年第一期次级债券 | 21 财通 C1 | 175868 | 2021 年 3 月 19 日 | 2021 年 3 月 19 日 | 2024 年 3 月 19 日 | 1,000,000,000 | 4.09 | 单利按年计息, 不计复利, 每年付息一次, 到期一次还本付息 | 上交所 | 面向专业投资者 | 竞价、报价、询价和协议交易 | 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

(1) “16财通Y1”是公司向机构投资者发行的、清偿顺序在普通债之后的有价证券，该债券依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在公司依据发行条款的约定赎回时到期。该债券附第5个和其后每个付息日，公司有权按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）一次性全额赎回本次债券，公司已于2021年2月26日行使赎回权，完成了兑付。报告期内，其他债券无选择权条款。

(2) 报告期内，公司无债券触发投资者保护条款。

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影响

适用 不适用

(1) 担保情况：报告期内，公司无债券存在担保情况。

(2) 偿债计划：

公司债券的偿债资金主要来源于公司的营业收入及利润积累。2018年、2019年、2020年和2021年1-6月，公司实现合并财务报表营业收入分别为人民币31.68亿元、人民币49.52亿元、人民币65.28亿元和人民币31.87亿元，归属于母公司股东的净利润分别为人民币8.19亿元、人民币18.73亿元、人民币22.92亿元和人民币10.45亿元。良好的盈利能力为公司债券的偿付提供了有力保障。

公司一向坚持稳健的财务政策，资产流动性良好，必要时可以通过高流动性资产变现来补充偿债资金。另外，公司经营稳健，信用记录良好，各项风险监管指标均满足相关要求，外部融资渠道畅通。截至报告期末，母公司获得的外部授信规模约人民币1000亿元，一旦债券兑付时遇到突发性的资金周转问题，公司将通过各种可行的融资方式予以解决。

公司为保证债券按时、足额偿付制定了一系列工作计划，包括了制定《债券持有人会议规则》、设立偿付工作小组、充分发挥债券受托管理人的作用和严格履行信息披露义务等内容。公司将根

据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于每年的利息支付和到期的本金兑付，以充分保障投资者的利益。

5. 公司债券其他情况的说明

适用 不适用

(三) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

(四) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

适用 不适用

(五) 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 | 213.80% | 192.12% | 增加 21.68 个百分点 | 主要系流动负债减少所致 |
| 速动比率 | 213.80% | 192.12% | 增加 21.68 个百分点 | 主要系流动负债减少所致 |
| 资产负债率 (%) | 70.42 | 70.24 | 增加 0.18 个百分点 | |
| | 本报告期 (1-6月) | 上年同期 | 本报告期比上年同期增减 (%) | 变动原因 |
| 扣除非经常性损益后净利润 | 1,031,153,100.49 | 824,631,712.02 | 25.04% | 主要系利润增加所致 |
| EBITDA 全部债务比 | 4.48% | 4.81% | 减少 0.33 个百分点 | 主要系债务增幅相对较大所致 |
| 利息保障倍数 | 2.46 | 2.85 | -13.68 | 主要系利息支出增加所致 |
| 现金利息保障倍数 | 4.80 | 3.89 | 23.39 | 主要系经营活动产生的现金流量净额增加所致 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.68 | 3.00 | -11.00 | 主要系利息支出增加所致 |
| 贷款偿还率 (%) | 100 | 100 | | |

| | | | |
|----------|-----|-----|--|
| 利息偿付率(%) | 100 | 100 | |
|----------|-----|-----|--|

二、可转换公司债券情况

√适用 □不适用

(一) 转债发行情况

经中国证监会核准，公司于2020年12月10日公开发行规模为人民币38亿元的可转债，并于2020年12月28日在上交所挂牌上市，债券简称“财通转债”，债券代码为113043。

(二) 报告期转债持有人及担保人情况

| | | |
|-------------------------------|-------------|---------|
| 可转换公司债券名称 | 财通转债 | |
| 期末转债持有人数 | 34,601 | |
| 本公司转债的担保人 | 不适用 | |
| 担保人盈利能力、资产状况和信用状况重大变化情况 | 不适用 | |
| 前十名转债持有人情况如下： | | |
| 可转换公司债券持有人名称 | 期末持债数量(元) | 持有比例(%) |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(中国工商银行) | 614,454,000 | 16.17 |
| 中国工商银行股份有限公司—易方达安心回报债券型证券投资基金 | 158,353,000 | 4.17 |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(中国建设银行) | 137,624,000 | 3.62 |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(招商银行股份有限公司) | 110,338,000 | 2.90 |
| 中国光大银行股份有限公司—博时转债增强债券型证券投资基金 | 72,903,000 | 1.92 |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(交通银行) | 69,475,000 | 1.83 |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(中国农业银行) | 69,063,000 | 1.82 |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(宁波银行股份有限公司) | 65,927,000 | 1.73 |
| MERRILL LYNCH INTERNATIONAL | 62,000,000 | 1.63 |
| 登记结算系统债券回购质押专用账户(中国银行) | 60,418,000 | 1.59 |

(三) 报告期转债变动情况

单位：元 币种：人民币

| 可转换公司 债券名称 | 本次变动前 | 本次变动增减 | | | 本次变动后 |
|---------------|---------------|----------|----|----|---------------|
| | | 转股 | 赎回 | 回售 | |
| 财通转债 | 3,800,000,000 | -125,000 | | | 3,799,875,000 |

(四) 报告期转债累计转股情况

| 可转换公司债券名称 | 财通转债 |
|-----------------------|---------------|
| 报告期转股额（元） | 125,000 |
| 报告期转股数（股） | 9,508 |
| 累计转股数（股） | 9,508 |
| 累计转股数占转股前公司已发行股份总数（%） | 0.0003 |
| 尚未转股额（元） | 3,799,875,000 |
| 未转股转债占转债发行总量比例（%） | 99.9997 |

(五) 转股价格历次调整情况

单位：元 币种：人民币

| 可转换公司债券名称 | | | | |
|---------------|---------|-----------|-----------------------|---------------------------|
| 转股价格调整日 | 调整后转股价格 | 披露时间 | 披露媒体 | 转股价格调整说明 |
| 2021年6月7日 | 13.13 | 2021年6月2日 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 公司派发2020年年度股东红利，每股人民币0.2元 |
| 截止本报告期末最新转股价格 | | 13.13 | | |

(六) 公司的负债情况、资信变化情况及在未来年度还债的现金安排

截至2021年6月末，公司总资产975.10亿元，扣除代理买卖证券款后的资产负债率为70.42%。中诚信国际信用评级有限公司（简称“中诚信国际”）于2021年6月21日出具了《财通证券股份有限公司公开发行A股可转换公司债券跟踪评级报告（2021）》（信评委函字[2021]跟踪0835号），维持公司主体信用等级AAA，评级展望稳定，维持“财通转债”信用等级为AAA。

未来公司偿付A股可转债本息的资金主要来源于公司经营活动所产生的现金流。最近三年，公司主营业务稳定，财务状况良好，经营活动产生的现金流量充足，具有较强的偿债能力。

(七) 转债其他情况说明

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：财通证券股份有限公司

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 | 七、1 | 19,058,086,581.26 | 20,521,337,750.35 |
| 其中：客户资金存款 | | 15,451,439,283.70 | 14,881,250,454.84 |
| 结算备付金 | 七、2 | 5,252,497,849.32 | 4,234,817,326.72 |
| 其中：客户备付金 | | 4,081,100,159.15 | 3,308,155,345.40 |
| 贵金属 | | | |
| 拆出资金 | | | |
| 融出资金 | 七、5 | 19,517,331,753.37 | 19,983,550,132.30 |
| 衍生金融资产 | 七、6 | 192,923,368.00 | 63,404,936.60 |
| 存出保证金 | 七、7 | 320,149,714.71 | 533,420,494.66 |
| 应收款项 | 七、8 | 217,035,427.23 | 258,105,399.31 |
| 应收款项融资 | | | |
| 合同资产 | | | |
| 买入返售金融资产 | 七、11 | 2,639,744,375.42 | 3,505,415,741.42 |
| 持有待售资产 | | | |
| 金融投资： | | | |
| 交易性金融资产 | 七、13 | 24,739,422,345.68 | 24,938,451,516.22 |
| 债权投资 | 七、14 | 8,386,363,518.98 | 6,481,371,854.01 |
| 其他债权投资 | 七、15 | 6,789,949,514.53 | 7,036,028,384.00 |
| 其他权益工具投资 | 七、16 | 132,828,205.70 | 131,444,319.58 |
| 长期股权投资 | 七、17 | 7,138,583,191.40 | 6,700,813,877.62 |
| 投资性房地产 | 七、18 | 20,609,079.21 | 21,481,423.71 |
| 固定资产 | 七、19 | 300,385,020.34 | 336,495,307.46 |
| 在建工程 | 七、20 | 198,914.31 | 687,775.15 |
| 使用权资产 | 七、21 | 679,345,017.25 | |
| 无形资产 | 七、22 | 364,970,596.85 | 384,777,019.29 |
| 商誉 | | | |
| 递延所得税资产 | 七、24 | 551,753,575.72 | 561,411,829.21 |
| 其他资产 | 七、25 | 1,208,035,196.12 | 965,830,823.69 |
| 资产总计 | | 97,510,213,245.40 | 96,658,845,911.30 |
| 负债： | | | |

| | | | |
|----------------------|------|-------------------|-------------------|
| 短期借款 | 七、29 | 432,816,051.70 | 485,797,765.03 |
| 应付短期融资款 | 七、30 | 5,642,730,244.08 | 10,156,894,839.47 |
| 拆入资金 | 七、31 | 300,173,694.44 | 1,300,381,555.60 |
| 交易性金融负债 | | | |
| 衍生金融负债 | 七、6 | 52,133,624.48 | 90,573,908.30 |
| 卖出回购金融资产款 | 七、33 | 15,655,943,492.51 | 14,342,315,565.97 |
| 代理买卖证券款 | 七、34 | 18,852,927,560.34 | 17,630,613,478.65 |
| 代理承销证券款 | 七、35 | | 218,000,000.00 |
| 应付职工薪酬 | 七、36 | 2,361,863,384.57 | 2,335,779,691.28 |
| 应交税费 | 七、37 | 357,638,393.68 | 505,321,588.67 |
| 应付款项 | 七、38 | 1,195,596,124.63 | 641,055,098.03 |
| 合同负债 | 七、39 | 25,145,881.76 | 29,853,723.38 |
| 持有待售负债 | | | |
| 预计负债 | | | |
| 长期借款 | | | |
| 应付债券 | 七、43 | 27,302,228,611.93 | 23,804,092,796.22 |
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | | | |
| 租赁负债 | 七、44 | 649,763,153.70 | |
| 递延收益 | | | |
| 递延所得税负债 | 七、24 | 69,555,480.71 | 246,745,706.32 |
| 其他负债 | 七、46 | 1,347,141,035.95 | 1,414,415,329.68 |
| 负债合计 | | 74,245,656,734.48 | 73,201,841,046.60 |
| 所有者权益（或股东权益）： | | | |
| 实收资本（或股本） | 七、47 | 3,589,009,508.00 | 3,589,000,000.00 |
| 其他权益工具 | 七、48 | 488,104,985.32 | 988,121,041.93 |
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | | | 500,000,000.00 |
| 资本公积 | 七、49 | 8,266,043,454.66 | 8,266,110,425.27 |
| 减：库存股 | | | |
| 其他综合收益 | 七、51 | 58,835,390.25 | 55,967,833.87 |
| 盈余公积 | 七、52 | 1,059,918,968.73 | 1,059,976,416.21 |
| 一般风险准备 | 七、53 | 3,197,451,331.66 | 3,148,566,936.75 |
| 未分配利润 | 七、54 | 6,595,727,912.07 | 6,340,051,917.01 |
| 归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计 | | 23,255,091,550.69 | 23,447,794,571.04 |
| 少数股东权益 | | 9,464,960.23 | 9,210,293.66 |
| 所有者权益（或股东权益）合计 | | 23,264,556,510.92 | 23,457,004,864.70 |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | | 97,510,213,245.40 | 96,658,845,911.30 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

母公司资产负债表

2021年6月30日

编制单位：财通证券股份有限公司

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 | | 17,275,411,255.90 | 18,877,795,845.65 |
| 其中：客户资金存款 | | 15,300,656,837.53 | 14,699,316,495.33 |
| 结算备付金 | | 5,246,176,958.00 | 4,225,776,760.40 |
| 其中：客户备付金 | | 4,081,100,159.15 | 3,308,155,345.40 |
| 贵金属 | | | |
| 拆出资金 | | | |
| 融出资金 | | 18,922,185,912.04 | 19,427,460,229.15 |
| 衍生金融资产 | | 190,470,847.66 | 57,210,883.15 |
| 存出保证金 | | 309,944,940.17 | 430,204,425.55 |
| 应收款项 | | 12,392,609.27 | 16,137,378.97 |
| 应收款项融资 | | | |
| 合同资产 | | | |
| 买入返售金融资产 | | 2,587,402,435.77 | 3,271,653,026.44 |
| 持有待售资产 | | | |
| 金融投资： | | | |
| 交易性金融资产 | | 22,711,746,749.57 | 23,035,821,882.39 |
| 债权投资 | | 8,354,743,718.98 | 6,481,371,854.01 |
| 其他债权投资 | | 6,789,949,514.53 | 7,036,028,384.00 |
| 其他权益工具投资 | | 132,828,205.70 | 131,444,319.58 |
| 长期股权投资 | 十九、1 | 8,087,986,296.50 | 7,816,356,789.97 |
| 投资性房地产 | | 20,609,079.21 | 21,481,423.71 |
| 固定资产 | | 293,920,780.90 | 327,591,188.53 |
| 在建工程 | | 198,914.31 | 552,455.47 |
| 使用权资产 | | 538,585,491.67 | |
| 无形资产 | | 357,949,523.60 | 376,496,532.69 |
| 商誉 | | | |
| 递延所得税资产 | | 401,486,808.49 | 431,781,339.43 |
| 其他资产 | | 1,109,893,506.63 | 858,629,734.80 |
| 资产总计 | | 93,343,883,548.90 | 92,823,794,453.89 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | | |
| 应付短期融资款 | | 5,642,730,244.08 | 10,156,894,839.47 |
| 拆入资金 | | 300,173,694.44 | 1,300,381,555.60 |
| 交易性金融负债 | | | |
| 衍生金融负债 | | 52,133,624.48 | 90,573,908.30 |
| 卖出回购金融资产款 | | 15,655,943,492.51 | 14,342,315,565.97 |
| 代理买卖证券款 | | 18,700,473,475.02 | 17,458,094,346.47 |
| 代理承销证券款 | | | 218,000,000.00 |
| 应付职工薪酬 | 十九、2 | 1,747,006,169.05 | 1,611,147,036.85 |
| 应交税费 | | 295,859,615.57 | 358,004,808.34 |
| 应付款项 | | 1,193,844,008.36 | 640,791,197.67 |
| 合同负债 | | 22,280,316.11 | 25,500,999.56 |
| 持有待售负债 | | | |
| 预计负债 | | | |
| 长期借款 | | | |
| 应付债券 | | 27,302,228,611.93 | 23,804,092,796.22 |

| | | | |
|----------------------|--|-------------------|-------------------|
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | | | |
| 租赁负债 | | 508,204,259.87 | |
| 递延收益 | | | |
| 递延所得税负债 | | 55,977,937.99 | 233,929,615.87 |
| 其他负债 | | 983,636,500.09 | 1,162,571,017.19 |
| 负债合计 | | 72,460,491,949.50 | 71,402,297,687.51 |
| 所有者权益（或股东权益）： | | | |
| 实收资本（或股本） | | 3,589,009,508.00 | 3,589,000,000.00 |
| 其他权益工具 | | 488,104,985.32 | 988,121,041.93 |
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | | | 500,000,000.00 |
| 资本公积 | | 8,454,138,426.34 | 8,454,205,396.95 |
| 减：库存股 | | | |
| 其他综合收益 | | 59,479,458.40 | 51,245,658.46 |
| 盈余公积 | | 1,090,220,122.75 | 1,090,220,122.75 |
| 一般风险准备 | | 2,537,851,052.63 | 2,537,851,052.63 |
| 未分配利润 | | 4,664,588,045.96 | 4,710,853,493.66 |
| 所有者权益（或股东权益）合计 | | 20,883,391,599.40 | 21,421,496,766.38 |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | | 93,343,883,548.90 | 92,823,794,453.89 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

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 | | 3,187,063,102.17 | 2,883,914,246.44 |
| 利息净收入 | 七、55 | 407,518,889.53 | 378,929,206.36 |
| 其中：利息收入 | | 1,268,662,002.81 | 934,204,644.57 |
| 利息支出 | | 861,143,113.28 | 555,275,438.21 |
| 手续费及佣金净收入 | 七、56 | 1,528,932,652.69 | 1,437,764,413.66 |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | | 598,099,000.67 | 518,832,339.16 |
| 投资银行业务手续费净收入 | | 310,469,889.06 | 250,489,284.25 |
| 资产管理业务手续费净收入 | | 606,931,884.97 | 652,933,556.74 |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 七、57 | 1,879,395,261.71 | 627,669,981.90 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | 493,461,084.74 | 294,725,340.38 |
| 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 | 七、59 | 18,232,391.95 | 11,372,718.41 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 七、60 | -649,067,646.63 | 426,446,405.36 |

| | | | |
|-----------------------------|------|------------------|------------------|
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -203,627.10 | -35,034.61 |
| 其他业务收入 | 七、61 | 2,255,180.02 | 1,766,555.36 |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列） | | | |
| 二、营业总支出 | | 1,981,074,690.05 | 1,897,593,697.83 |
| 税金及附加 | 七、63 | 22,237,427.75 | 13,856,113.54 |
| 业务及管理费 | 七、64 | 2,003,588,886.01 | 1,866,203,281.83 |
| 信用减值损失 | 七、65 | -45,656,603.44 | 16,649,409.24 |
| 其他资产减值损失 | | | |
| 其他业务成本 | 七、67 | 904,979.73 | 884,893.22 |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列） | | 1,205,988,412.12 | 986,320,548.61 |
| 加：营业外收入 | 七、68 | 90,455.91 | 908,736.17 |
| 减：营业外支出 | 七、69 | 1,061,943.31 | 18,010,278.73 |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,205,016,924.72 | 969,219,006.05 |
| 减：所得税费用 | 七、70 | 159,375,718.18 | 149,036,578.99 |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,045,641,206.54 | 820,182,427.06 |
| （一）按经营持续性分类 | | | |
| 1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,045,641,206.54 | 820,182,427.06 |
| 2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | | |
| （二）按所有权归属分类 | | | |
| 1. 归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,045,386,539.97 | 820,335,289.45 |
| 2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列） | | 254,666.57 | -152,862.39 |
| 六、其他综合收益的税后净额 | | 2,867,556.38 | 44,991,292.56 |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额 | | 2,867,556.38 | 44,991,292.56 |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益 | | | |
| 1. 重新计量设定受益计划变动额 | | | |
| 2. 权益法下不能转损益的其他综合收益 | | | |
| 3. 其他权益工具投资公允价值变动 | | 1,037,914.59 | 5,036,612.73 |
| 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 | | | |
| 1. 权益法下可转损益的其他综合收益 | | -3,576,797.24 | 5,667,990.01 |
| 2. 其他债权投资公允价值变动 | | 10,898,950.67 | 13,518,518.70 |
| 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 | | -126,268.08 | 10,381,434.73 |
| 5. 现金流量套期储备 | | | |
| 6. 外币财务报表折算差额 | | -5,366,243.56 | 10,386,736.39 |
| 7. 其他 | | | |

| | | | |
|---------------------|--|------------------|----------------|
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额 | | | |
| 七、综合收益总额 | | 1,048,508,762.92 | 865,173,719.62 |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额 | | 1,048,254,096.35 | 865,326,582.01 |
| 归属于少数股东的综合收益总额 | | 254,666.57 | -152,862.39 |
| 八、每股收益： | | | |
| （一）基本每股收益(元/股) | | 0.29 | 0.22 |
| （二）稀释每股收益(元/股) | | 0.28 | 0.22 |

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：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

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 | | 2,249,733,852.83 | 1,931,827,955.09 |
| 利息净收入 | 十九、3 | 362,477,010.92 | 319,235,079.99 |
| 其中：利息收入 | | 1,217,037,314.73 | 862,937,617.82 |
| 利息支出 | | 854,560,303.81 | 543,702,537.83 |
| 手续费及佣金净收入 | 十九、4 | 926,756,885.40 | 789,908,148.83 |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | | 612,998,293.59 | 535,675,775.60 |
| 投资银行业务手续费净收入 | | 306,380,117.56 | 247,380,531.81 |
| 资产管理业务手续费净收入 | | | |
| 投资收益（损失以“-”号填列） | 十九、5 | 1,596,153,533.19 | 394,710,353.16 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | 275,390,565.30 | 156,464,477.82 |
| 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 | | 10,620,025.92 | 6,396,704.64 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 十九、6 | -648,057,354.82 | 419,544,671.46 |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | -460,224.35 | 765,858.24 |
| 其他业务收入 | | 2,243,976.57 | 1,267,138.77 |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列） | | | |
| 二、营业总支出 | | 1,443,825,070.17 | 1,312,680,061.05 |
| 税金及附加 | | 18,438,892.05 | 9,687,941.02 |
| 业务及管理费 | 十九、7 | 1,466,133,228.40 | 1,287,914,668.93 |
| 信用减值损失 | | -41,652,030.01 | 14,192,557.88 |
| 其他资产减值损失 | | | |
| 其他业务成本 | | 904,979.73 | 884,893.22 |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列） | | 805,908,782.66 | 619,147,894.04 |

| | | | |
|------------------------|--|----------------|----------------|
| 加：营业外收入 | | 82,698.12 | 101,625.29 |
| 减：营业外支出 | | 1,052,986.38 | 14,010,240.74 |
| 四、利润总额（亏损总额以“－”号填列） | | 804,938,494.40 | 605,239,278.59 |
| 减：所得税费用 | | 110,377,792.10 | 91,341,491.02 |
| 五、净利润（净亏损以“－”号填列） | | 694,560,702.30 | 513,897,787.57 |
| （一）持续经营净利润（净亏损以“－”号填列） | | 694,560,702.30 | 513,897,787.57 |
| （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 | | 8,233,799.94 | 34,604,556.17 |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益 | | 1,037,914.59 | 5,036,612.73 |
| 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 | | 1,037,914.59 | 5,036,612.73 |
| 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 | | 7,195,885.35 | 29,567,943.44 |
| 1. 权益法下可转损益的其他综合收益 | | -3,576,797.24 | 5,667,990.01 |
| 2. 其他债权投资公允价值变动 | | 10,898,950.67 | 13,518,518.70 |
| 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 | | -126,268.08 | 10,381,434.73 |
| 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 | | 702,794,502.24 | 548,502,343.74 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

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 | | 3,017,897,340.36 | 2,886,845,362.10 |
| 拆入资金净增加额 | | | |
| 回购业务资金净增加额 | | 2,285,259,522.04 | 1,841,606,070.35 |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | 1,396,075,127.65 | 5,207,681,592.30 |
| 融出资金净减少额 | | 503,043,367.55 | |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额 | | 1,081,357,329.84 | |

| | | | |
|---------------------------|------|-------------------|-------------------|
| 收到其他与经营活动有关的现金 | 七、72 | 732,840,662.48 | 553,641,129.49 |
| 经营活动现金流入小计 | | 9,016,473,349.92 | 10,489,774,154.24 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | | | 1,259,898,960.83 |
| 拆出资金净增加额 | | | |
| 返售业务资金净增加额 | | | |
| 融出资金净增加额 | | | 3,229,347,047.16 |
| 支付利息、手续费及佣金的现金 | | 303,827,896.81 | 414,509,520.65 |
| 支付给职工及为职工支付的现金 | | 1,277,196,165.27 | 971,348,169.00 |
| 支付的各项税费 | | 588,533,818.26 | 332,067,850.20 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | 七、72 | 4,053,470,552.76 | 2,877,124,409.28 |
| 经营活动现金流出小计 | | 6,223,028,433.10 | 9,084,295,957.12 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | | 2,793,444,916.82 | 1,405,478,197.12 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | |
| 收回投资收到的现金 | | 2,720,000.00 | 4,375,243.19 |
| 取得投资收益收到的现金 | | 115,120,762.14 | 121,837,569.29 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | 153,993.33 | 549,785.57 |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额 | | | |
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流入小计 | | 117,994,755.47 | 126,762,598.05 |
| 投资支付的现金 | | 32,500,000.00 | 471,409,653.43 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | | 63,651,444.37 | 48,046,403.47 |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额 | | | |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流出小计 | | 96,151,444.37 | 519,456,056.90 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | 21,843,311.10 | -392,693,458.85 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | | |
| 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 | | 1,980,398,000.00 | 618,371,800.00 |
| 发行债券收到的现金 | | 13,741,970,000.00 | 25,602,340,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流入小计 | | 15,722,368,000.00 | 26,220,711,800.00 |
| 偿还债务支付的现金 | | 17,256,987,700.00 | 21,100,312,800.00 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | | 1,385,320,076.10 | 686,273,407.09 |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润 | | | |
| 偿还租赁负债支付的现金 | | 82,636,682.07 | |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流出小计 | | 18,724,944,458.17 | 21,786,586,207.09 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | -3,002,576,458.17 | 4,434,125,592.91 |

| | | | |
|--------------------|--|-------------------|-------------------|
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | | -533,053.03 | 24,764,104.17 |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | | -187,821,283.28 | 5,471,674,435.35 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | | 23,801,688,159.44 | 14,969,235,935.48 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | | 23,613,866,876.16 | 20,440,910,370.83 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

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 | | 2,347,091,852.53 | 2,146,667,654.26 |
| 拆入资金净增加额 | | | |
| 回购业务资金净增加额 | | 2,061,078,491.23 | 1,841,774,708.91 |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | 1,414,651,958.60 | 5,197,563,785.91 |
| 融出资金净减少额 | | 541,436,285.57 | |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额 | | 1,205,403,385.86 | |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | | 403,301,009.76 | 206,278,020.46 |
| 经营活动现金流入小计 | | 7,972,962,983.55 | 9,392,284,169.54 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | | | 945,233,404.47 |
| 拆出资金净增加额 | | | |
| 返售业务资金净增加额 | | | |
| 融出资金净增加额 | | | 3,224,361,798.58 |
| 支付利息、手续费及佣金的现金 | | 300,973,993.81 | 411,704,537.63 |
| 支付给职工及为职工支付的现金 | | 912,908,167.27 | 697,077,529.14 |
| 支付的各项税费 | | 493,028,581.21 | 228,552,691.99 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | | 3,906,691,656.87 | 2,776,471,915.74 |
| 经营活动现金流出小计 | | 5,613,602,399.16 | 8,283,401,877.55 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | | 2,359,360,584.39 | 1,108,882,291.99 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | |
| 收回投资收到的现金 | | | |
| 取得投资收益收到的现金 | | 52,721,739.00 | 52,721,739.00 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | 130,657.49 | 542,076.03 |
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流入小计 | | 52,852,396.49 | 53,263,815.03 |
| 投资支付的现金 | | | 562,000,000.00 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | | 60,921,404.84 | 39,787,274.17 |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | | | |

| | | | |
|---------------------------|--|-------------------|-------------------|
| 投资活动现金流出小计 | | 60,921,404.84 | 601,787,274.17 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | -8,069,008.35 | -548,523,459.14 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | | |
| 取得借款收到的现金 | | | |
| 发行债券收到的现金 | | 13,741,970,000.00 | 25,602,340,000.00 |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流入小计 | | 13,741,970,000.00 | 25,602,340,000.00 |
| 偿还债务支付的现金 | | 15,229,160,000.00 | 20,422,570,000.00 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | | 1,375,400,895.75 | 674,209,244.55 |
| 偿还租赁负债支付的现金 | | 70,224,848.09 | |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流出小计 | | 16,674,785,743.84 | 21,096,779,244.55 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | -2,932,815,743.84 | 4,505,560,755.45 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | | -460,224.35 | |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | | -581,984,392.15 | 5,065,919,588.30 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | | 22,889,372,606.05 | 14,378,644,837.78 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | | 22,307,388,213.90 | 19,444,564,426.08 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

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 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | 488,121,041.93 | 8,266,110,425.27 | | 55,967,833.87 | 1,059,976,416.21 | 3,148,566,936.75 | 6,340,051,917.01 | 9,210,293.66 | 23,457,004,864.70 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | | | |
| 二、本年期初余额 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | 488,121,041.93 | 8,266,110,425.27 | | 55,967,833.87 | 1,059,976,416.21 | 3,148,566,936.75 | 6,340,051,917.01 | 9,210,293.66 | 23,457,004,864.70 |
| 三、本期增减变动金额 (减少以“—”号填列) | 9,508.00 | | -500,000,000.00 | -16,056.61 | -66,970.61 | | 2,867,556.38 | -57,447.48 | 48,884,394.91 | 255,675,995.06 | 254,666.57 | -192,448,353.78 |
| (一) 综合收益总额 | | | | | | | 2,867,556.38 | | | 1,045,386,539.97 | 254,666.57 | 1,048,508,762.92 |
| (二) 所有者投入和减少资本 | 9,508.00 | | -500,000,000.00 | -16,056.61 | 117,290.92 | | | | | | | -499,889,257.69 |
| 1. 所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | | | |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | 9,508.00 | | -500,000,000.00 | -16,056.61 | 117,290.92 | | | | | | | -499,889,257.69 |

2021 年半年度报告

| | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|------------------|--|--|----------------|------------------|--|---------------|------------------|------------------|------------------|--------------|-------------------|
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | | |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | | | |
| (三) 利润分配 | | | | | | | | 48,884,394.91 | -789,710,544.91 | | | -740,826,150.00 |
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | | | | 48,884,394.91 | -48,884,394.91 | | | |
| 3. 对所有者(或股东)的分配 | | | | | | | | | -717,800,000.00 | | | -717,800,000.00 |
| 4. 其他 | | | | | | | | | -23,026,150.00 | | | -23,026,150.00 |
| (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 | | | | | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | | -184,261.53 | | | -57,447.48 | | | | -241,709.01 |
| 四、本期期末余额 | 3,589,009,508.00 | | | 488,104,985.32 | 8,266,043,454.66 | | 58,835,390.25 | 1,059,918,968.73 | 3,197,451,331.66 | 6,595,727,912.07 | 9,464,960.23 | 23,264,556,510.92 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|-------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--------|
| 项目 | 2020 年半年度 | | | | | | | | | | |
| | 归属于母公司所有者权益 | | | | | | | | | | 少数股东权益 |

| | 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 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | | 8,266,130,824.98 | | 104,993,982.95 | 917,546,705.97 | 2,677,250,571.24 | 5,284,530,610.33 | 8,949,018.80 | 21,348,401,714.27 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | | | |
| 二、本年期初余额 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | | 8,266,130,824.98 | | 104,993,982.95 | 917,546,705.97 | 2,677,250,571.24 | 5,284,530,610.33 | 8,949,018.80 | 21,348,401,714.27 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） | | | | | -20,399.71 | | 44,991,292.56 | -4,531,857.81 | 31,206,246.09 | 191,887,893.36 | -152,862.39 | 263,380,312.10 |
| （一）综合收益总额 | | | | | | | 44,991,292.56 | | | 820,335,289.45 | -152,862.39 | 865,173,719.62 |
| （二）所有者投入和减少资本 | | | | | | | | | | | | |
| 1. 所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | | | |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | | | | | | | | | | | | |
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | | |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | | | |
| （三）利润分配 | | | | | | | | | 31,206,246.09 | -628,447,396.09 | | -597,241,150.00 |
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | | | | | 31,206,246.09 | -31,206,246.09 | | |
| 3. 对所有者（或股东）的分配 | | | | | | | | | | -574,240,000.00 | | -574,240,000.00 |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | -23,001,150.00 | | -23,001,150.00 |
| （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 | | | | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | -20,399.71 | | | -4,531,857.81 | | | | -4,552,257.52 |
| 四、本期期末余额 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | 8,266,110,425.27 | | 149,985,275.51 | 913,014,848.16 | 2,708,456,817.33 | 5,476,418,503.69 | 8,796,156.41 | 21,611,782,026.37 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

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 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | 488,121,041.93 | 8,454,205,396.95 | | 51,245,658.46 | 1,090,220,122.75 | 2,537,851,052.63 | 4,710,853,493.66 | 21,421,496,766.38 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | | |
| 二、本年期初余额 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | 488,121,041.93 | 8,454,205,396.95 | | 51,245,658.46 | 1,090,220,122.75 | 2,537,851,052.63 | 4,710,853,493.66 | 21,421,496,766.38 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） | 9,508.00 | | 500,000,000.00 | -16,056.61 | -66,970.61 | | 8,233,799.94 | | | -46,265,447.70 | -538,105,166.98 |

| | | | | | | | | | | | |
|-------------------|----------|--|---|------------|------------|--|--------------|--|--|-----------------|-----------------|
| (一) 综合收益总额 | | | | | | | 8,233,799.94 | | | 694,560,702.30 | 702,794,502.24 |
| (二) 所有者投入和减少资本 | 9,508.00 | | - | -16,056.61 | 117,290.92 | | | | | | -499,889,257.69 |
| 1. 所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | | |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | 9,508.00 | | - | -16,056.61 | 117,290.92 | | | | | | -499,889,257.69 |
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | | |
| (三) 利润分配 | | | | | | | | | | -740,826,150.00 | -740,826,150.00 |
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | | | | | | | |
| 3. 对所有者(或股东)的分配 | | | | | | | | | | -717,800,000.00 | -717,800,000.00 |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | -23,026,150.00 | -23,026,150.00 |
| (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 | | | | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | | -184,261.53 | | | | | | -184,261.53 |
| 四、本期期 末余额 | 3,589,009,508.00 | | | 488,104,985.32 | 8,454,138,426.34 | | 59,479,458.40 | 1,090,220,122.75 | 2,537,851,052.63 | 4,664,588,045.96 | 20,883,391,599.40 |

| 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 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | | 8,454,225,796.66 | | 72,927,203.42 | 922,702,326.64 | 2,202,815,460.41 | 4,135,470,070.89 | 19,877,140,858.02 |
| 加：会 计政策 变更 | | | | | | | | | | | |
| 前 期差 错 更 正 | | | | | | | | | | | |
| 其 他 | | | | | | | | | | | |
| 二、本 年期初 余额 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | | 8,454,225,796.66 | | 72,927,203.42 | 922,702,326.64 | 2,202,815,460.41 | 4,135,470,070.89 | 19,877,140,858.02 |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------|--|--|--|--|--|------------|--|---------------|--|--|--|----------------|-----------------|-----------------|
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） | | | | | | -20,399.71 | | 34,604,556.17 | | | | -83,343,362.43 | | -48,759,205.97 |
| （一）综合收益总额 | | | | | | | | 34,604,556.17 | | | | 513,897,787.57 | | 548,502,343.74 |
| （二）所有者投入和减少资本 | | | | | | | | | | | | | | |
| 1. 所有者投入的普通股 | | | | | | | | | | | | | | |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | | | | | | | | | | | | | | |
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | | | | | |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | | | | | |
| （三）利润分配 | | | | | | | | | | | | | -597,241,150.00 | -597,241,150.00 |

| | | | | | | | | | | | |
|------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|-----------------|-----------------|
| 1. 提取盈余公积 | | | | | | | | | | | |
| 2. 提取一般风险准备 | | | | | | | | | | | |
| 3. 对所有者（或股东）的分配 | | | | | | | | | | -574,240,000.00 | -574,240,000.00 |
| 4. 其他 | | | | | | | | | | -23,001,150.00 | -23,001,150.00 |
| （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 | | | | | | | | | | | |
| (五) 其他 | | | | | -20,399.71 | | | | | | -20,399.71 |
| 四、本期期末余额 | 3,589,000,000.00 | | 500,000,000.00 | | 8,454,205,396.95 | | 107,531,759.59 | 922,702,326.64 | 2,202,815,460.41 | 4,052,126,708.46 | 19,828,381,652.05 |

公司负责人：陆建强 主管会计工作负责人：王跃军 会计机构负责人：周瀛

三、 公司基本情况

1. 公司概况

√适用 □不适用

财通证券股份有限公司（以下简称“本公司”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）批准，由财通证券有限责任公司改制设立，于2013年10月15日在浙江省工商行政管理局登记注册，总部位于浙江省杭州市。本公司现持有统一社会信用代码为913300007519241679的营业执照，注册资本358,900万元，折成358,900万股，每股面值1元；无限售条件的流通股份A股3,589,009,508股。公司股票已于2017年10月24日在上海证券交易所挂牌交易。

本公司及子公司（以下简称“本集团”），主要从事：证券经纪；证券投资咨询；证券自营；证券承销与保荐；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；证券投资基金托管；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问。

截至2021年6月30日止，公司拥有14家控股子公司（含全资子公司）、24家分公司及121家证券营业部；拥有员工3,169人（母公司口径），其中高级管理人员11名。

本财务报表业经公司2021年8月25日第三届董事会第十三次会议批准对外报出。

2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

本公司纳入本期合并财务报表范围的子公司和结构化主体情况详见本财务报表附注合并范围的变更和在其他主体中的权益之说明。

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。

本集团自2019年1月1日和2020年1月1日起分别执行了中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）2017年度修订的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》等新金融工具准则和《企业会计准则第14号——收入》，并自2021年1月1日起执行了财政部2018年度修订的《企业会计准则第21号——租赁》（参见附注五、50(1)）。

2. 持续经营

√适用 □不适用

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

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

1. 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本公司 2021 年 6 月 30 日的合并财务状况和财务状况、2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间合并经营成果和经营成果及合并现金流量和现金流量。

此外，本公司的财务报表同时符合证监会 2014 年修订的《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》有关财务报表及其附注的披露要求。

2. 会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表信息的会计期间为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

3. 营业周期

适用 不适用

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本公司及本公司子公司选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。本公司的部分子公司采用本公司记账本位币以外的货币作为记账本位币，在编制本财务报表时，这些子公司的外币财务报表按照附注五、9 进行了折算。

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

本集团取得对另一个或多个企业（或一组资产或净资产）的控制权且其构成业务的，该交易或事项构成企业合并。企业合并分为同一控制下的企业合并和非同一控制下的企业合并。对于非同一控制下的交易，购买方在判断取得的资产组合等是否构成一项业务时，将考虑是否选择采用“集中度测试”的简化判断方式。如果该组合通过集中度测试，则判断为不构成业务。如果该组合未通过集中度测试，仍应按照业务条件进行判断。当本集团取得了不构成业务的一组资产或净资产时，应将购买成本按购买日所取得各项可辨认资产、负债的相对公允价值基础进行分配，不按照以下企业合并的会计处理方法进行处理。

(1). 同一控制下的企业合并

参与合并的企业在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时性的，为同一控制下的企业合并。合并方在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。为进行企业合并发生的直接相关费用，于发生时计入当期损益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

(2). 非同一控制下的企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下的企业合并。本集团作为购买方，为取得被购买方控制权而付出的资产（包括购买日之前所持有的被购买方的股权）、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和，减去合并中取得的被购买方可辨认净资产于购买日公允价值份额的差额，如为正数则确认为商誉；如为负数则计入当期损益。本集团将作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。本集团为进行企业合并发生的其他各项直接费用计入当期损益。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。本集团在购买日按公允价值确认所取得的被购买方符合确认条件的各项可辨认资产、负债及或有负债。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。

通过多次交易分步实现非同一控制企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方的股权，本集团会按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益或其他综合收益。购买日之前持有的被购买方的股权涉及的以后可重分类进损益的其他综合收益及权益法核算下的其他所有者权益变动（参见附注五、18(2)(b)）于购买日转入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的，购买日之前确认的其他综合收益于购买日转入留存收益。

6. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

(1). 总体原则

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定，包括本公司、本公司控制的子公司及受本公司控制的结构化主体。控制，是指本集团拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本集团是否拥有对被投资方的权力时，本集团仅考虑与被投资方相关的实质性权利（包括本集团自身所享有的及

其他方所享有的实质性权利)。子公司的财务状况、经营成果和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

子公司少数股东应占的权益、损益和综合收益总额分别在合并资产负债表的股东权益中和合并利润表的净利润及综合收益总额项目后单独列示。

如果子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的,其余额仍冲减少数股东权益。

当子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时,合并时已按照本公司的会计期间或会计政策对子公司财务报表进行必要的调整。合并时所有集团内部交易及余额,包括未实现内部交易损益均已抵销。集团内部交易发生的未实现损失,有证据表明该损失是相关资产减值损失的,则全额确认该损失。

(2). 合并取得子公司

对于通过同一控制下企业合并取得的子公司,在编制合并当期财务报表时,以被合并子公司的各项资产、负债在最终控制方财务报表中的账面价值为基础,视同被合并子公司在本公司最终控制方对其开始实施控制时纳入本公司合并范围,并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。

对于通过非同一控制下企业合并取得的子公司,在编制合并当期财务报表时,以购买日确定的被购买子公司各项可辨认资产、负债的公允价值为基础自购买日起将被购买子公司纳入本公司合并范围。

(3). 处置子公司

本集团丧失对原有子公司控制权时,由此产生的任何处置收益或损失,计入丧失控制权当期的投资收益。对于剩余股权投资,本集团按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量,由此产生的任何收益或损失,也计入丧失控制权当期的投资收益。

通过多次交易分步处置对子公司长期股权投资直至丧失控制权的,按下述原则判断是否为一揽子交易:

- 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的;
- 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果;
- 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生;
- 一项交易单独考虑时是不经济的,但是和其他交易一并考虑时是经济的。

如果各项交易不属于一揽子交易的,则在丧失对子公司控制权以前的各项交易,按照不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资的会计政策进行处理(参见附注五、6(4))。

如果各项交易属于一揽子交易的，本公司将各项交易作为一项处置原有子公司并丧失控制权的交易进行处理，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司自购买日开始持续计算的净资产账面价值的份额之间的差额，在合并财务报表中计入其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

(4). 少数股东权益变动

本公司因购买少数股权新取得的长期股权投资成本与按照新增持股比例计算应享有子公司的净资产份额之间的差额，以及在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司净资产的差额，均调整合并资产负债表中的资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）不足冲减的，调整留存收益。

7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

8. 现金及现金等价物的确定标准

现金和现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

本集团收到投资者以外币投入资本时按当日即期汇率折合为人民币，其他外币交易在初始确认时按交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折合为人民币。

即期汇率是中国人民银行公布的人民币外汇牌价。即期汇率的近似汇率是按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的当期平均汇率。

于资产负债表日，外币货币性项目采用该日的即期汇率折算，除与购建符合资本化条件资产有关的专门借款本金和利息的汇兑差额（参见附注五、21）外，其他汇兑差额计入当期损益。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。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，由此产生的汇兑差额，属于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的差额，计入其他综合收益；其他差额计入当期损益。

对境外经营的财务报表进行折算时，资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，股东权益项目中除未分配利润及其他综合收益中的外币财务报表折算差额项目外，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

汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，在其他综合收益中列示。处置境外经营时，相关的外币财务报表折算差额自其他综合收益转入处置当期损益。

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

本集团的金融工具包括货币资金、债券投资、除长期股权投资（参见附注五、18）以外的股权投资、应收款项、应付款项、借款、应付债券及股本等。

(1). 金融资产及金融负债的确认和初始计量

金融资产和金融负债在本集团成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收账款，本集团按照根据附注五、35的会计政策确定的交易价格进行初始计量。

(2). 金融资产的分类和后续计量

(a) 本集团金融资产的分类

本集团通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

本集团将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本集团管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 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。

本集团将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产：

- 本集团管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标；

- 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，本集团可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。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。

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本集团将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本集团可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

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

(b) 本集团金融资产的后续计量

- 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，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 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一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资

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。

- 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量。股利收入计入损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(3). 金融负债的分类和后续计量

本集团将金融负债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、财务担保负债及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，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 财务担保负债

财务担保合同指，当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求本集团向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。

初始确认后，财务担保合同相关收益依据相关会计政策的规定分摊计入当期损益。财务担保负债以按照依据金融工具的减值原则（参见附注五、10(6)）所确定的损失准备金额以及其初始确认金额扣除财务担保合同相关收益的累计摊销额后的余额孰高进行后续计量。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(4). 抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本集团具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本集团计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

(5). 金融资产和金融负债的终止确认

满足下列条件之一时，本集团终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本集团将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入

方：

- 该金融资产已转移，虽然本集团既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制。

金融资产转移整体满足终止确认条件的，本集团将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 被转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资）之和。

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

(6). 金融资产的减值

本集团以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产；
- 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资；
- 非以公允价值计量且其变动计入当期损益的财务担保合同。

本集团持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型，包括以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资或权益工具投资，指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资，以及衍生金融资产。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本集团按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本集团需考虑的最长期间为企业面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本集团始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。本集团基于历史信用损失经验、使用准备矩阵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借款人的特定因素、以及对当前状况和未来经济状况预测的评估进行调整。

除应收账款外，本集团对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

具有较低的信用风险

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，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借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

信用风险显著增加

本集团通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本集团考虑无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。本集团考虑的信息包括：

- 债务人未能按合同到期日支付本金和利息的情况；
- 已发生的或预期的金融工具的外部或内部信用评级（如有）的严重恶化；
- 已发生的或预期的债务人经营成果的严重恶化；
- 现存的或预期的技术、市场、经济或法律环境变化，并将对债务人对本集团的还款能力产生重大不利影响。

根据金融工具的性质，本集团以单项金融工具或金融工具组合为基础评估信用风险是否显著增加。以金融工具组合为基础进行评估时，本集团可基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，例如逾期信息和信用风险评级。

如果逾期超过 30 日，本集团确定金融工具的信用风险已经显著增加。

已发生信用减值的金融资产

本集团在资产负债表日评估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债权投资是否已发生信用减值。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或债务人发生重大财务困难；
- 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 本集团出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本集团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。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，本集团在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

核销

如果本集团不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本集团确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本集团催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

(7). 权益工具

本公司发行权益工具收到的对价扣除交易费用后，计入股东权益。回购本公司权益工具支付的对价和交易费用，减少股东权益。

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

库存股注销时，按注销股票面值总额减少股本，库存股成本超过面值总额的部分，应依次冲减资本公积（股本溢价）、盈余公积和未分配利润；库存股成本低于面值总额的，低于面值总额的部分增加资本公积（股本溢价）。

库存股转让时，转让收入高于库存股成本的部分，增加资本公积（股本溢价）；低于库存股成本的部分，依次冲减资本公积（股本溢价）、盈余公积、未分配利润。

(8). 可转换工具

- 含权益成分的可转换工具

对于本集团发行的可转换为权益股份且转换时所发行的股份数量和对价的金额固定的可转换工具，本集团将其作为包含负债和权益成分的复合金融工具。

在初始确认时，本集团将相关负债和权益成分进行分拆，先确定负债成分的公允价值（包括其中可能包含的非权益性嵌入衍生工具的公允价值），再从复合金融工具公允价值中扣除负债成分的公允价值，作为权益成分的价值，计入权益。发行复合金融工具发生的交易费用，在负债成分和权益成分之间按照各自占总发行价款的比例进行分摊。

初始确认后，对于没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的负债成分，采用实际利率法按摊余成本计量。权益成分在初始计量后不再重新计量。

当可转换工具进行转换时，本集团将负债成分和权益成分转至权益相关科目。当可转换工具被赎回时，赎回支付的价款以及发生的交易费用被分配至权益和负债成分。分配价款和交易费用的方法与该工具发行时采用的分配方法一致。价款和交易费用分配后，其与权益和负债成分账面价值的差异中，与权益成分相关的计入权益，与负债成分相关的计入损益。

- 不含权益成分的其他可转换工具

对于本集团发行的不含权益成分的其他可转换工具，在初始确认时，可转换工具的衍生工具成分以公允价值计量，剩余部分作为主债务工具的初始确认金额。

初始确认后，衍生工具成分以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于主债务工具，采用实际利率法按摊余成本计量。

当可转换工具进行转换时，本集团将主债务工具和衍生工具成分转至权益相关科目。当可转换工具被赎回时，赎回支付的价款与主债务工具和衍生工具成分账面价值的差异计入损益。

(9). 永续债

本集团根据所发行的永续债的合同条款及其所反映的经济实质，结合金融资产、金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将这些金融工具或其组成部分分类为金融资产、金融负债或权益工具。

本集团对于其发行的同时包含权益成分和负债成分的永续债，按照与含权益成分的可转换工具相同的会计政策进行处理。本集团对于其发行的不包含权益成分的永续债，按照与不含权益成分的其他可转换工具相同的会计政策进行处理。

本集团对于其发行的应归类为权益工具的永续债，按照实际收到的金额，计入权益。存续期间分派股利或利息的，作为利润分配处理。按合同条款约定赎回永续债的，按赎回价格冲减权益。

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

参见本附注五、10之说明。

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

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值（参见附注五、10(6)）。本集团拥有的、无条件（仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示。

(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

参见本附注五、10之说明。

15. 持有待售资产

适用 不适用

(1). 持有待售

本集团主要通过出售而非持续使用一项非流动资产或处置组收回其账面价值时，将该非流动资产或处置组划分为持有待售类别。

处置组，是指在一项交易中作为整体通过出售或其他方式一并处置的一组资产，以及在该交易中转让的与这些资产直接相关的负债。

本集团将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：

- 根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，该非流动资产或处置组在其当前状况下即可立即出售；

- 出售极可能发生，即本集团已经就一项出售计划作出决议且已与其他方签订了具有法律约束力的购买协议，预计出售将在一年内完成。

本集团按账面价值与公允价值（参见附注五、44）减去出售费用后净额之孰低者对持有待售的非流动资产（不包括金融资产（参见附注五、10）及递延所得税资产（参见附注五、39）或处置组进行初始计量和后续计量，账面价值高于公允价值（参见附注五、44）减去出售费用后净额的差额确认为资产减值损失，计入当期损益。

(2). 终止经营

本集团将满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已被本集团处置或划分为持有待售类别的界定为终止经营：

- 该组成部分代表一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区；

- 该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区进行处置的一项相关计划的一部分；

- 该组成部分是专为转售而取得的子公司。

本集团对于当期列报的终止经营，在当期利润表中分别列示持续经营损益和终止经营损益，并在比较期间的利润表中将原来作为持续经营损益列报的信息重新作为可比会计期间的终止经营损益列报。

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

参见本附注五、10之说明。

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

参见本附注五、10之说明。

18. 长期股权投资

√适用 □不适用

(1). 长期股权投资投资成本确定

(a) 通过企业合并形成的长期股权投资

- 对于同一控制下的企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照合并日取得的被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付对价账面价值之间的差额，调整资本公积中的股本溢价；资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。通过非一揽子的多次交易分步实现的同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按上述原则确认的长期股权投资的初始投资成本与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减时，调整留存收益。

- 对于非同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，本公司按照购买日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，作为该投资的初始投资成本。通过非一揽子的多次交易分步实现的非同一控制下企业合并形成的对子公司的长期股权投资，其初始投资成本为本公司购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和。

(b) 其他方式取得的长期股权投资

- 对于通过企业合并以外的其他方式取得的长期股权投资，在初始确认时，对于以支付现金取得的长期股权投资，本集团按照实际支付的购买价款作为初始投资成本；对于发行权益性证券取得的长期股权投资，本集团按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

(2). 长期股权投资后续计量及损益确认方法

(a) 对子公司的投资

在本公司个别财务报表中，本公司采用成本法对子公司的长期股权投资进行后续计量，除非投资符合持有待售的条件（参见附注五、15）。对被投资单位宣告分派的现金股利或利润由本公司享有的部分确认为当期投资收益，但取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润除外。

对子公司的投资按照成本减去减值准备后在资产负债表内列示。

对子公司投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见附注五、25。

在本集团合并财务报表中，对子公司按附注五、6 进行处理。

(b) 对合营企业和联营企业的投资

合营企业指本集团与其他合营方共同控制（参见附注五、18(3)）且仅对其净资产享有权利的一项安排。

联营企业指本集团能够对其施加重大影响（参见附注五、18(3)）的企业。

后续计量时，对合营企业和联营企业的长期股权投资采用权益法核算，除非投资符合持有待售的条件（参见附注五、15）。

本集团在采用权益法核算时的具体会计处理包括：

- 对于长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，以前者作为长期股权投资的成本；对于长期股权投资的初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，以后者作为长期股权投资的成本，长期股权投资的成本与初始投资成本的差额计入当期损益。

- 取得对合营企业和联营企业投资后，本集团按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资损益和其他综合收益并调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。对合营企业或联营企业除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动（以下简称“其他所有者权益变动”），本集团按照应享有或应分担的份额计入股东权益，并同时调整长期股权投资的账面价值。

- 在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益、其他综合收益及其他所有者权益变动的份额时，本集团以取得投资时被投资单位可辨认净资产公允价值为基础，按照本集团的会计政策或会计期间进行必要调整后确认投资收益和其他综合收益等。本集团与联营企业及合营企业之间内部交易产生的未实现损益按照应享有的比例计算归属于本集团的部分，在权益法核算时予以抵销。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

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

本集团对合营企业和联营企业投资的减值测试方法及减值准备计提方法参见附注五、25。

(3). 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的判断标准

共同控制指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动（即对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。

本集团在判断对被投资单位是否存在共同控制时，通常考虑下述事项：

- 是否任何一个参与方均不能单独控制被投资单位的相关活动；
- 涉及被投资单位相关活动的决策是否需要分享控制权参与方一致同意。

重大影响指本集团对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。

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

本集团将持有的为赚取租金或资本增值，或两者兼有的房地产划分为投资性房地产。本集团采用成本模式计量投资性房地产，即以成本减累计折旧、摊销及减值准备后在资产负债表内列示。本集团将投资性房地产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在使用寿命内按年限平均法计提折旧或进行摊销，除非投资性房地产符合持有待售的条件（参见附注五、15）。减值测试方法及减值准备计方法参见附注五、25。

投资性房地产的使用寿命、残值率和年折旧率分别为：

| 类别 | 使用寿命（年） | 残值率（%） | 年折旧率（%） |
|--------|---------|--------|-----------|
| 房屋及建筑物 | 30 - 45 | 3 | 3.23-2.16 |

20. 固定资产

(1). 确认条件

√适用 □不适用

固定资产指本集团为经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。

外购固定资产的初始成本包括购买价款、相关税费以及使该资产达到预定可使用状态前所发生的可归属于该项资产的支出。自行建造固定资产按附注五、21 确定初始成本。

对于构成定资产的各组成部分，如果各自具有不同使用寿命或者以不同方式为本集团提供经济利益，适用不同折旧率或折旧方法的，本集团分别将各组成部分确认为单项固定资产。

对于固定资产的后续支出，包括与更换固定资产某组成部分相关的支出，在与支出相关的经济利益很可能流入本集团时资本化计入固定资产成本，同时将被替换部分的账面价值扣除；与固定资产日常维护相关的支出在发生时计入当期损益。

固定资产以成本减累计折旧及减值准备后在资产负债表内列示。

(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 | 30-45 | 3 | 3.23-2.16 |
| 机器设备 | 年限平均法 | 5-11 | 3 | 19.40-8.82 |
| 运输工具 | 年限平均法 | 4-6 | 3 | 24.25-16.17 |
| 电子设备 | 年限平均法 | 2-5 | 0-3 | 50.00-19.40 |

本集团将固定资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后在其使用寿命内按年限平均法计提折旧，除非固定资产符合持有待售的条件（参见附注五、15）。固定资产的使用寿命、残值率和年折旧率详见上表。另外，本集团至少在每年年度终了对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核。

(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

(4). 减值测试方法及减值准备计提方法

适用 不适用

参见附注五、25。

(5). 固定资产处置

适用 不适用

资产满足下述条件之一时，本集团会予以终止确认。

- 固定资产处于处置状态；
- 该固定资产预期通过使用或处置不能产生经济利益。

报废或处置固定资产项目所产生的损益为处置所得款项净额与项目账面金额之间的差额，并于报废或处置日在损益中确认。

21. 在建工程

适用 不适用

自行建造的固定资产的成本包括工程用物资、直接人工、符合资本化条件的借款费用和使该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出。

自行建造的固定资产于达到预定可使用状态时转入固定资产，此前列于在建工程，且不计提折旧。

在建工程以成本减减值准备（参见附注五、25）在资产负债表内列示。

22. 借款费用

适用 不适用

23. 使用权资产

√适用 □不适用

参见本附注五、40 之说明。

24. 无形资产**(1). 计价方法、使用寿命、减值测试**

√适用 □不适用

无形资产以成本减累计摊销（仅限于使用寿命有限的无形资产）及减值准备（参见附注五、25）后在资产负债表内列示。对于使用寿命有限的无形资产，本集团将无形资产的成本扣除预计净残值和累计减值准备后按直线法在预计使用寿命期内摊销，除非该无形资产符合持有待售的条件（参见附注五、15）。

各项无形资产的摊销年限为：

| 项目 | 摊销年限（年） |
|-------|---------|
| 土地使用权 | 40 |
| 软件使用权 | 3 |
| 交易席位费 | 10 |

本集团至少在每年年度终了对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核。

本集团将无法预见未来经济利益期限的无形资产视为使用寿命不确定的无形资产，并对这类无形资产不予摊销。截至资产负债表日，本集团没有使用寿命不确定的无形资产。

(2). 内部研究开发支出会计政策

√适用 □不适用

本集团内部研究开发项目的支出分为研究阶段支出和开发阶段支出。

研究阶段的支出，于发生时计入当期损益。开发阶段的支出，如果开发形成的某项产品或工序等在技术和商业上可行，而且本集团有充足的资源和意向完成开发工作，并且开发阶段支出能够可靠计量，则开发阶段的支出便会予以资本化。资本化开发支出按成本减减值准备（参见附注五、25）在资产负债表内列示。其他开发费用则在其产生的期间内确认为费用。

25. 除金融资产外的其他资产减值

√适用 □不适用

本集团在资产负债表日根据内部及外部信息以确定下列资产是否存在减值的迹象，包括：

- 固定资产
- 在建工程

- 使用权资产
- 无形资产
- 采用成本模式计量的投资性房地产
- 长期股权投资
- 商誉
- 长期待摊费用等

本集团对存在减值迹象的资产进行减值测试，估计资产的可收回金额。此外，无论是否存在减值迹象，本集团至少每年对尚未达到可使用状态的无形资产估计其可收回金额，于每年年度终了对使用寿命不确定的无形资产估计其可收回金额。本集团依据相关资产组或者资产组组合能够从企业合并的协同效应中的受益情况分摊商誉账面价值，并在此基础上进行商誉减值测试。

可收回金额是指资产（或资产组、资产组组合，下同）的公允价值（参见附注五、44）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较高者。

资产组由创造现金流入相关的资产组成，是可以认定的最小资产组合，其产生的现金流入基本上独立于其他资产或者资产组。

资产预计未来现金流量的现值，按照资产在持续使用过程中和最终处置时所产生的预计未来现金流量，选择恰当的税前折现率对其进行折现后的金额加以确定。

可收回金额的估计结果表明，资产的可收回金额低于其账面价值的，资产的账面价值会减记至可收回金额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。与资产组或者资产组组合相关的减值损失，先抵减分摊至该资产组或者资产组组合中商誉的账面价值，再根据资产组或者资产组组合中除商誉之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，但抵减后的各资产的账面价值不得低于该资产的公允价值减去处置费用后的净额（如可确定的）、该资产预计未来现金流量的现值（如可确定的）和零三者之中最高者。

资产减值损失一经确认，在以后会计期间不会转回。

26. 长期待摊费用

适用 不适用

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

27. 附回购条件的资产转让

适用 不适用

28. 合同负债

合同负债的确认方法

√适用 □不适用

本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务作为合同负债列示。

29. 职工薪酬

(1)、短期薪酬的会计处理方法

√适用 □不适用

本集团在职工提供服务的会计期间，将实际发生或按规定的基准和比例计提的职工工资、奖金、医疗保险费、工伤保险费和生育保险费等社会保险费和住房公积金，确认为负债，并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

本集团所参与的设定提存计划是按照中国有关法规要求，本集团职工参加的由政府机构设立管理的社会保障体系中的基本养老保险、失业保险以及企业年金等。设定提存计划的缴费金额按国家规定的基准和比例计算。本集团在职工提供服务的会计期间，将应缴存的金额确认为负债，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

本集团在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或者为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，在下列两者孰早日，确认辞退福利产生的负债，同时计入当期损益：

- 本集团不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；
- 本集团有详细、正式的涉及支付辞退福利的重组计划；并且，该重组计划已开始实施，

或已向受其影响的各方通告了该计划的主要内容，从而使各方形成了对本集团将实施重组的合理预期时。

(4)、其他长期职工福利的会计处理方法

√适用 □不适用

本集团的其他长期职工福利是指除短期薪酬、离职后福利、辞退福利之外所有的职工薪酬，包括长期带薪缺勤、长期残疾福利、长期利润分享计划等，本集团根据职工提供服务而获取的未来报告期间预计获得的福利金额，将其予以折现后的现值确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

30. 预计负债

适用 不适用

如果与或有事项相关的义务是本集团承担的现时义务，且该义务的履行很可能会导致经济利益流出本集团，以及有关金额能够可靠地计量，则本集团会确认预计负债。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。对于货币时间价值影响重大的，预计负债以预计未来现金流量折现后的金额确定。在确定最佳估计数时，本集团综合考虑了与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素。所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

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

本集团在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核，并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

参见本附注五、40之说明。

32. 股份支付

适用 不适用

33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

参见本附注五、10之说明。

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

收入是本集团在日常活动中形成的、会导致股东权益增加且与股东投入资本无关的经济利益的总流入。

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。

合同中包含两项或多项履约义务的，本集团在合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务，按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。单独售价，是指本集团向客户单独销售商品或提供服务的价格。单独售价无法直接观察的，本集团综合考虑能够合理取得的全部相关信息，并最大限度地采用可观察的输入值估计单独售价。

交易价格是本集团因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项。本集团确认的交易价格不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。预期将退还给客户的款项作为退货负债，不计入交易价格。合同中存在重大融资成分的，本集团按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，本集团预计客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

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

- 客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益；
- 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；
- 本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，本集团在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，本集团已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。

对于在某一时点履行的履约义务，本集团在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品或服务控制权时，本集团会考虑下列迹象：

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

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值（参见附注五、10(6)）。本集团拥有的、无条件（仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示。本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务作为合同负债列示。

与本集团取得收入的主要活动相关的具体会计政策描述如下：

手续费及佣金收入

手续费及佣金收入的金额按照本集团在日常经营活动中提供劳务时，已收或应收合同或协议价款的公允价值确定。

本集团履行了合同中的履约义务，客户取得相关商品或服务的控制权时，确认相关的手续费及佣金收入：

(a) 经纪业务收入

代理买卖证券业务手续费收入在交易日确认为收入。

(b) 投资银行业务收入

承销收入于本集团完成承销合同中的履约义务时确认收入。

根据合约条款，保荐收入在本集团履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

(c) 咨询服务业务收入

根据咨询服务的性质及合约条款，咨询服务业务收入在本集团履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

(d) 资产管理及基金管理业务收入

根据合同条款，受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入在本集团履行履约义务的过程中，根据合同或协议约定的收入计算方法，且已确认的累计收入金额很可能不会发生重大转回时，确认为当期收入。

(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

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是指本集团不取得合同就不会发生的成本（如销售佣金等）。该成本预期能够收回的，本集团将其作为合同取得成本确认为一项资产。本集团为取得合同发生的、除预期能够收回的增量成本之外的其他支出于发生时计入当期损益。

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，本集团将其作为合同履约成本确认为一项资产：

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

- 该成本增加了本集团未来用于履行履约义务的资源；
- 该成本预期能够收回。

合同取得成本确认的资产和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或服务收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。合同取得成本确认的资产摊销期限不超过一年的，在发生时计入当期损益。

当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，本集团对超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失：

- 本集团因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价；
- 为转让该相关商品或服务估计将要发生的成本。

37. 利润分配

√适用 □不适用

资产负债表日后，经审议批准的利润分配方案中拟分配的股利或利润，不确认为资产负债表日的负债，在附注中单独披露。

本公司根据《金融企业财务规则》（中华人民共和国财政部令第42号）及其实施指南（财金[2007]23号）的规定，以及证监会颁布的《关于证券公司2007年年度报告工作的通知》（证监机构字[2007]320号）的要求，按照当期净利润的10%提取一般风险准备；本公司根据《证券法》和证监机构字[2007]320号的规定，按照当期净利润的10%提取交易风险准备。本公司相关子公司亦根据相关监管规定的要求计提一般风险准备和交易风险准备。计提的一般风险准备和交易风险准备计入一般风险准备项目核算。

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

政府补助是本集团从政府无偿取得的货币性资产或非货币性资产，但不包括政府以投资者身份向本集团投入的资本。

政府补助在能够满足政府补助所附条件，并能够收到时，予以确认。

政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量。

本集团取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助作为与资产相关的政府补助。

与资产相关的政府补助，本集团将其确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入其他收益或营业外收入。

(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

本集团取得的与资产相关之外的其他政府补助作为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助，如果用于补偿本集团以后期间的相关成本费用或损失的，本集团将其确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入其他收益或营业外收入；否则直接计入其他收益或营业外收入。

39. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

除因企业合并和直接计入所有者权益（包括其他综合收益）的交易或者事项产生的所得税外，本集团将当期所得税和递延所得税计入当期损益。

当期所得税是按本年度应税所得额，根据税法规定的计算的预期应交所得税，加上以往年度应付所得税的调整。

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

递延所得税资产与递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减。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。

如果不属于企业合并交易且交易发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损），则该项交易中产生的暂时性差异不会产生递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生相关的递延所得税。

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

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

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

- 纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；

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

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，本集团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。

为确定合同是否让渡了在一定期间内控制已识别资产使用的权利，本集团进行如下评估：

- 合同是否涉及已识别资产的使用。已识别资产可能由合同明确指定或在资产可供客户使用时隐性指定，并且该资产在物理上可区分，或者如果资产的某部分产能或其他部分在物理上不可区分但实质上代表了该资产的全部产能，从而使客户获得因使用该资产所产生的几乎全部经济利益。如果资产的供应方在整个使用期间拥有对该资产的实质性替换权，则该资产不属于已识别资产；

- 承租人是否有权获得在使用期间内因使用已识别资产所产生的几乎全部经济利益；

- 承租人是否有权在该使用期间主导已识别资产的使用。

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。在分拆合同包含的租赁和非租赁部分时，承租人按照各租赁部分单独价格及非租赁部分的单独价格之和的相对比例分摊合同对价。出租人按附注五、35 所述会计政策中关于交易价格分摊的规定分摊合同对价。

(1). 本集团作为承租人

在租赁期开始日，本集团对租赁确认使用权资产和租赁负债。使用权资产按照成本进行初始计量，包括租赁负债的初始计量金额、在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额（扣除已享受的

租赁激励相关金额)，发生的初始直接费用以及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。

本集团使用直线法对使用权资产计提折旧。对能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，本集团在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。否则，租赁资产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。使用权资产按附注五、25所述的会计政策计提减值准备。

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，折现率为租赁内含利率。无法确定租赁内含利率的，采用本集团增量借款利率作为折现率。

本集团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，并计入当期损益或相关资产成本。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或相关资产成本。

租赁期开始日后，发生下列情形的，本集团按照变动后租赁付款额的现值重新计量租赁负债：

- 根据担保余值预计的应付金额发生变动；
- 用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动；
- 本集团对购买选择权、续租选择权或终止租赁选择权的评估结果发生变化，或续租选择权或终止租赁选择权的实际行使情况与原评估结果不一致。

在对租赁负债进行重新计量时，本集团相应调整使用权资产的账面价值。使用权资产的账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，本集团将剩余金额计入当期损益。

本集团已选择对短期租赁（租赁期不超过12个月的租赁）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。

(2) 本集团作为出租人

在租赁开始日，本集团将租赁分为融资租赁和经营租赁。融资租赁是指无论所有权最终是否转移但实质上转移了与租赁资产所有权有关的几乎全部风险和报酬的租赁。经营租赁是指除融资租赁以外的其他租赁。

本集团作为转租出租人时，基于原租赁产生的使用权资产，而不是原租赁的标的资产，对转租进行分类。如果原租赁为短期租赁且本集团选择对原租赁应用上述短期租赁的简化处理，本集团将该转租赁分类为经营租赁。

融资租赁下，在租赁期开始日，本集团对融资租赁确认应收融资租赁款，并终止确认融资租赁资产。本集团对应收融资租赁款进行初始计量时，将租赁投资净额作为应收融资租赁款的入账

价值。租赁投资净额为未担保余值和租赁期开始日尚未收到的租赁收款额按照租赁内含利率折现的现值之和。

本集团按照固定的周期性利率计算并确认租赁期内各个期间的利息收入。应收融资租赁款的终止确认和减值按附注五、10所述的会计政策进行会计处理。未纳入租赁投资净额计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

经营租赁的租赁收款额在租赁期内按直线法确认为租金收入。本集团将其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确认相同的基础进行分摊，分期计入当期损益。未计入租赁收款额的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

41. 融资融券业务

适用 不适用

本集团按照融资融券业务所融出的资金确认应收债权，作为融出资金列示并将相应利息收入计入当期损益；为融券业务购入的金融资产在融出前按照附注五、10的相关规定进行列示，融出后在资产负债表中不终止确认，继续按照附注五、10的相关规定进行会计处理，同时将相应利息收入计入当期损益。

42. 资产证券化业务

适用 不适用

43. 买入返售金融资产和卖出回购金融资产款

买入返售金融资产，是指本集团按返售协议先买入再按固定价格返售金融资产所融出的资金。卖出回购金融资产款，是指本集团按回购协议先卖出再按固定价格回购金融资产所融入的资金。

买入返售和卖出回购金融资产款按业务发生时实际支付或收到的款项入账并在资产负债表中反映。买入返售的已购入标的资产不予以确认，在表外记录；卖出回购的标的资产在资产负债表中不终止确认。

买入返售和卖出回购业务的买卖差价在相关交易期间以实际利率法摊销，分别确认为利息收入和利息支出。

买入返售金融资产的初始成本减减值准备(参见附注五、10(6))在资产负债表内列示。

44. 公允价值的计量

除特别声明外，本集团按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本集团估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。

45. 转融通业务核算的方法

本集团通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由本集团享有或承担，不将其计入资产负债表。本集团根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

46. 关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可为个人或企业。仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成关联方。

此外，本公司同时根据证监会颁布的《上市公司信息披露管理办法》确定本集团或本公司的关联方。

47. 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部。如果两个或多个经营分部存在相似经济特征且同时在各单项产品或劳务的性质、生产过程的性质、产品或劳务的客户类型、销售产品或提供劳务的方式、生产产品及提供劳务受法律及行政法规的影响等方面具有相同或相似性的，可以合并为一个经营分部。本集团以经营分部为基础考虑重要性原则后确定报告分部。

本集团在编制分部报告时，分部间交易收入按实际交易价格为基础计量。编制分部报告所采用的会计政策与编制本集团财务报表所采用的会计政策在所有重大方面一致。

48. 主要会计估计及判断

编制财务报表时，本集团管理层需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本集团管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

(1). 主要会计估计

除投资性房地产、固定资产及无形资产等资产的折旧及摊销（参见附注五、19、20 和 24）和各类资产减值（参见附注七、5、8、11、14、15、17、18、19、21、22 和 25）以及附注十九、1 涉及的会计估计外，其他主要的会计估计如下：

- (a) 附注七、24- 递延所得税资产的确认；
- (b) 附注十二 - 公允价值的披露。

(2). 主要会计判断

本集团在运用会计政策过程中做出的重要判断如下：

- (a) 附注七、48 - 永续债等其他金融工具划分为金融负债或权益工具；及
- (b) 附注十 - 结构化主体或通过受托经营等方式形成控制权的经营实体

49. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

50. 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) |
|--|------------|---------------------|
| 本集团于 2021 年度起执行财政部修订的《企业会计准则第 21 号——租赁（修订）》（财会〔2018〕35 号）（“新租赁准则”） | 经公司董事会审议批准 | 详见（3）说明 |

其他说明：

新租赁准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 21 号——租赁》（简称“原租赁准则”）。本集团自 2021 年 1 月 1 日起执行新租赁准则，对会计政策相关内容进行调整。

新租赁准则完善了租赁的定义，本集团在新租赁准则下根据租赁的定义评估合同是否为租赁或者包含租赁。对于首次执行日前已存在的合同，本集团在首次执行日选择不重新评估其是否为租赁或者包含租赁。

- 本集团作为承租人

原租赁准则下，本集团根据租赁是否实质上将与资产所有权有关的全部风险和报酬转移给本集团，将租赁分为融资租赁和经营租赁。

新租赁准则下，本集团不再区分融资租赁与经营租赁。本集团对所有租赁（选择简化处理方法的短期租赁和低价值资产租赁除外）确认使用权资产和租赁负债。

在分拆合同包含的租赁和非租赁部分时，本集团按照各租赁部分单独价格及非租赁部分的单独价格之和的相对比例分摊合同对价。

本集团选择根据首次执行新租赁准则的累积影响数，调整首次执行新租赁准则当年年初留存收益及财务报表其他相关项目金额，不调整可比期间信息。

对于首次执行日前的经营租赁，本集团在首次执行日根据剩余租赁付款额按首次执行日本集团增量借款利率折现的现值计量租赁负债，并按照以下方法计量使用权资产：

- 与租赁负债相等的金额，并根据预付租金进行必要调整。本集团对所有其他租赁采用此方法。

对于首次执行日前的经营租赁，本集团应用上述方法时同时采用了如下简化处理：

- 计量租赁负债时，对具有相似特征的租赁采用同一折现率；
- 使用权资产的计量不包含初始直接费用；
- 存在续租选择权或终止租赁选择权的，根据首次执行日前选择权的实际行使及其他最新情况确定租赁期；

- 作为使用权资产减值测试的替代，根据首次执行日前按照《企业会计准则第 13 号——或有事项》计入资产负债表的亏损合同的亏损准备金额调整使用权资产；

- 对首次执行新租赁准则当年年初之前发生的租赁变更，不进行追溯调整，根据租赁变更的最终安排，按照新租赁准则进行会计处理。

对于首次执行日前的融资租赁，本集团在首次执行日按照融资租入资产和应付融资租赁款的原账面价值，分别计量使用权资产和租赁负债。

- 本集团作为出租人

本集团无需对其作为出租人的租赁调整首次执行新租赁准则当年年初留存收益及财务报表其他相关项目金额。本集团自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

• 2021 年 1 月 1 日执行新租赁准则对财务报表的影响

在计量租赁负债时，本集团使用 2021 年 1 月 1 日的增量借款利率对租赁付款额进行折现。本集团和本公司使用的加权平均利率分别为 3.24%和 3.30%。

(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 | 20,521,337,750.35 | 20,521,337,750.35 | |
| 其中：客户资金存款 | 14,881,250,454.84 | 14,881,250,454.84 | |
| 结算备付金 | 4,234,817,326.72 | 4,234,817,326.72 | |
| 其中：客户备付金 | 3,308,155,345.40 | 3,308,155,345.40 | |
| 贵金属 | | | |
| 拆出资金 | | | |
| 融出资金 | 19,983,550,132.30 | 19,983,550,132.30 | |
| 衍生金融资产 | 63,404,936.60 | 63,404,936.60 | |
| 存出保证金 | 533,420,494.66 | 533,420,494.66 | |
| 应收款项 | 258,105,399.31 | 258,105,399.31 | |
| 应收款项融资 | | | |
| 合同资产 | | | |
| 买入返售金融资产 | 3,505,415,741.42 | 3,505,415,741.42 | |
| 持有待售资产 | | | |
| 金融投资： | | | |
| 交易性金融资产 | 24,938,451,516.22 | 24,938,451,516.22 | |
| 债权投资 | 6,481,371,854.01 | 6,481,371,854.01 | |
| 其他债权投资 | 7,036,028,384.00 | 7,036,028,384.00 | |
| 其他权益工具投资 | 131,444,319.58 | 131,444,319.58 | |
| 长期股权投资 | 6,700,813,877.62 | 6,700,813,877.62 | |
| 投资性房地产 | 21,481,423.71 | 21,481,423.71 | |
| 固定资产 | 336,495,307.46 | 336,495,307.46 | |
| 在建工程 | 687,775.15 | 687,775.15 | |
| 使用权资产 | | 720,281,532.79 | 720,281,532.79 |

| | | | |
|----------------------|-------------------|-------------------|----------------|
| 无形资产 | 384,777,019.29 | 384,777,019.29 | |
| 商誉 | | | |
| 递延所得税资产 | 561,411,829.21 | 561,411,829.21 | |
| 其他资产 | 965,830,823.69 | 933,847,255.16 | -31,983,568.53 |
| 资产总计 | 96,658,845,911.30 | 97,347,143,875.56 | 688,297,964.26 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | 485,797,765.03 | 485,797,765.03 | |
| 应付短期融资款 | 10,156,894,839.47 | 10,156,894,839.47 | |
| 拆入资金 | 1,300,381,555.60 | 1,300,381,555.60 | |
| 交易性金融负债 | | | |
| 衍生金融负债 | 90,573,908.30 | 90,573,908.30 | |
| 卖出回购金融资产款 | 14,342,315,565.97 | 14,342,315,565.97 | |
| 代理买卖证券款 | 17,630,613,478.65 | 17,630,613,478.65 | |
| 代理承销证券款 | 218,000,000.00 | 218,000,000.00 | |
| 应付职工薪酬 | 2,335,779,691.28 | 2,335,779,691.28 | |
| 应交税费 | 505,321,588.67 | 505,321,588.67 | |
| 应付款项 | 641,055,098.03 | 641,055,098.03 | |
| 合同负债 | 29,853,723.38 | 29,853,723.38 | |
| 持有待售负债 | | | |
| 预计负债 | | | |
| 长期借款 | | | |
| 应付债券 | 23,804,092,796.22 | 23,804,092,796.22 | |
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | | | |
| 租赁负债 | | 688,297,964.26 | 688,297,964.26 |
| 递延收益 | | | |
| 递延所得税负债 | 246,745,706.32 | 246,745,706.32 | |
| 其他负债 | 1,414,415,329.68 | 1,414,415,329.68 | |
| 负债合计 | 73,201,841,046.60 | 73,890,139,010.86 | 688,297,964.26 |
| 所有者权益（或股东权益）： | | | |
| 实收资本（或股本） | 3,589,000,000.00 | 3,589,000,000.00 | |
| 其他权益工具 | 988,121,041.93 | 988,121,041.93 | |
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 | |
| 资本公积 | 8,266,110,425.27 | 8,266,110,425.27 | |
| 减：库存股 | | | |
| 其他综合收益 | 55,967,833.87 | 55,967,833.87 | |
| 盈余公积 | 1,059,976,416.21 | 1,059,976,416.21 | |
| 一般风险准备 | 3,148,566,936.75 | 3,148,566,936.75 | |

| | | | |
|----------------------|-------------------|-------------------|----------------|
| 未分配利润 | 6,340,051,917.01 | 6,340,051,917.01 | |
| 归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计 | 23,447,794,571.04 | 23,447,794,571.04 | |
| 少数股东权益 | 9,210,293.66 | 9,210,293.66 | |
| 所有者权益（或股东权益）合计 | 23,457,004,864.70 | 23,457,004,864.70 | |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | 96,658,845,911.30 | 97,347,143,875.56 | 688,297,964.26 |

各项目调整情况的说明：

√适用 □不适用

根据财会〔2018〕35号文的要求，公司于2021年1月1日开始执行《企业会计准则第21号——租赁》（以下简称“新租赁准则”）。在新租赁准则实施日，公司采用“按首次执行日承租人尚未支付的租赁付款额的现值计量租赁负债；与租赁负债相等的金额并根据预付租赁进行必要调整计量使用权资产”的方式进行账务处理，“使用权资产”和“租赁负债”单独列示在资产负债表中，期初增加使用权资产账面价值720,281,532.79元，减少其他资产账面价值31,983,568.53元，增加租赁负债账面价值688,297,964.26元。

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 | 18,877,795,845.65 | 18,877,795,845.65 | |
| 其中：客户资金存款 | 14,699,316,495.33 | 14,699,316,495.33 | |
| 结算备付金 | 4,225,776,760.40 | 4,225,776,760.40 | |
| 其中：客户备付金 | 3,308,155,345.40 | 3,308,155,345.40 | |
| 贵金属 | | | |
| 拆出资金 | | | |
| 融出资金 | 19,427,460,229.15 | 19,427,460,229.15 | |
| 衍生金融资产 | 57,210,883.15 | 57,210,883.15 | |
| 存出保证金 | 430,204,425.55 | 430,204,425.55 | |
| 应收款项 | 16,137,378.97 | 16,137,378.97 | |
| 应收款项融资 | | | |
| 合同资产 | | | |
| 买入返售金融资产 | 3,271,653,026.44 | 3,271,653,026.44 | |
| 持有待售资产 | | | |
| 金融投资： | | | |
| 交易性金融资产 | 23,035,821,882.39 | 23,035,821,882.39 | |
| 债权投资 | 6,481,371,854.01 | 6,481,371,854.01 | |
| 其他债权投资 | 7,036,028,384.00 | 7,036,028,384.00 | |

| | | | |
|----------------------|-------------------|-------------------|----------------|
| 其他权益工具投资 | 131,444,319.58 | 131,444,319.58 | |
| 长期股权投资 | 7,816,356,789.97 | 7,816,356,789.97 | |
| 投资性房地产 | 21,481,423.71 | 21,481,423.71 | |
| 固定资产 | 327,591,188.53 | 327,591,188.53 | |
| 在建工程 | 552,455.47 | 552,455.47 | |
| 使用权资产 | | 571,268,419.93 | 571,268,419.93 |
| 无形资产 | 376,496,532.69 | 376,496,532.69 | |
| 商誉 | | | |
| 递延所得税资产 | 431,781,339.43 | 431,781,339.43 | |
| 其他资产 | 858,629,734.80 | 828,323,028.17 | -30,306,706.63 |
| 资产总计 | 92,823,794,453.89 | 93,364,756,167.19 | 540,961,713.30 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | | |
| 应付短期融资款 | 10,156,894,839.47 | 10,156,894,839.47 | |
| 拆入资金 | 1,300,381,555.60 | 1,300,381,555.60 | |
| 交易性金融负债 | | | |
| 衍生金融负债 | 90,573,908.30 | 90,573,908.30 | |
| 卖出回购金融资产款 | 14,342,315,565.97 | 14,342,315,565.97 | |
| 代理买卖证券款 | 17,458,094,346.47 | 17,458,094,346.47 | |
| 代理承销证券款 | 218,000,000.00 | 218,000,000.00 | |
| 应付职工薪酬 | 1,611,147,036.85 | 1,611,147,036.85 | |
| 应交税费 | 358,004,808.34 | 358,004,808.34 | |
| 应付款项 | 640,791,197.67 | 640,791,197.67 | |
| 合同负债 | 25,500,999.56 | 25,500,999.56 | |
| 持有待售负债 | | | |
| 预计负债 | | | |
| 长期借款 | | | |
| 应付债券 | 23,804,092,796.22 | 23,804,092,796.22 | |
| 其中：优先股 | | | |
| 永续债 | | | |
| 租赁负债 | | 540,961,713.30 | 540,961,713.30 |
| 递延收益 | | | |
| 递延所得税负债 | 233,929,615.87 | 233,929,615.87 | |
| 其他负债 | 1,162,571,017.19 | 1,162,571,017.19 | |
| 负债合计 | 71,402,297,687.51 | 71,943,259,400.81 | 540,961,713.30 |
| 所有者权益（或股东权益）： | | | |
| 实收资本（或股本） | 3,589,000,000.00 | 3,589,000,000.00 | |
| 其他权益工具 | 988,121,041.93 | 988,121,041.93 | |
| 其中：优先股 | | | |

| | | | |
|-------------------|-------------------|-------------------|----------------|
| 永续债 | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 | |
| 资本公积 | 8,454,205,396.95 | 8,454,205,396.95 | |
| 减：库存股 | | | |
| 其他综合收益 | 51,245,658.46 | 51,245,658.46 | |
| 盈余公积 | 1,090,220,122.75 | 1,090,220,122.75 | |
| 一般风险准备 | 2,537,851,052.63 | 2,537,851,052.63 | |
| 未分配利润 | 4,710,853,493.66 | 4,710,853,493.66 | |
| 所有者权益（或股东权益）合计 | 21,421,496,766.38 | 21,421,496,766.38 | |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | 92,823,794,453.89 | 93,364,756,167.19 | 540,961,713.30 |

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

根据财会〔2018〕35号文的要求，公司于2021年1月1日开始执行新租赁准则。在新租赁准则实施日，公司采用“按首次执行日承租人尚未支付的租赁付款额的现值计量租赁负债；与租赁负债相等的金额并根据预付租赁进行必要调整计量使用权资产”的方式进行账务处理，“使用权资产”和“租赁负债”单独列示在资产负债表中，期初增加使用权资产账面价值571,268,419.93元，减少其他资产账面价值30,306,706.63元，增加租赁负债账面价值540,961,713.30元。

(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

51. 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 | 以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税 | 3%、5%、6%、9%、13% |

| | | |
|---------|--|------------|
| 房产税 | 从价计征的，按房产原值一次减除30%后余值的1.2%计缴； 从租计征的，按租金收入的12%计缴 | 1.2%、12% |
| 城市维护建设税 | 实际缴纳的流转税税额 | 5%、7% |
| 教育费附加 | 实际缴纳的流转税税额 | 3% |
| 地方教育附加 | 实际缴纳的流转税税额 | 2% |
| 企业所得税 | 应纳税所得额 | 16.50%、25% |

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(%) |
|---|----------|
| 财通香港 | 16.50 |
| 财通国际证券 | 16.50 |
| 财通国际资管 | 16.50 |
| 财通国际投资 | 16.50 |
| 财通国际融资有限公司 | 16.50 |
| Caitong International Overseas Investment Limited | 0 |
| 合伙企业及纳入合并范围的结构化主体 | 0 |
| 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 |
|---------|----------------|--------|-------------------|----------------|--------|-------------------|
| 银行存款： | / | / | 19,058,086,581.26 | / | / | 20,521,337,750.35 |
| 其中：自有资金 | / | / | 3,606,647,297.56 | / | / | 5,640,087,295.51 |
| 人民币 | / | / | 3,416,429,785.97 | / | / | 5,478,856,041.78 |
| 美元 | 10,712,743.65 | 6.4601 | 69,205,395.23 | 13,392,281.78 | 6.5249 | 87,383,299.39 |
| 港元 | 145,429,775.70 | 0.8321 | 121,012,116.36 | 87,747,094.04 | 0.8416 | 73,847,954.34 |
| 客户资金 | / | / | 15,451,439,283.70 | / | / | 14,881,250,454.84 |
| 人民币 | / | / | 15,256,964,616.68 | / | / | 14,651,644,866.00 |
| 美元 | 7,584,690.61 | 6.4601 | 48,997,859.84 | 15,212,989.48 | 6.5249 | 99,263,235.06 |
| 港元 | 174,830,918.37 | 0.8321 | 145,476,807.18 | 154,874,469.80 | 0.8416 | 130,342,353.78 |
| 合计 | / | / | 19,058,086,581.26 | / | / | 20,521,337,750.35 |

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 | / | / | 190,583.06 | / | / | 101,925.85 |
| 人民币 | / | / | 190,583.06 | / | / | 101,925.85 |
| 客户信用资金 | / | / | 1,601,578,819.14 | / | / | 1,950,845,670.88 |
| 人民币 | / | / | 1,601,578,819.14 | / | / | 1,950,845,670.88 |
| 合计 | / | / | 1,601,769,402.20 | / | / | 1,950,947,596.73 |

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

于2021年6月30日，本公司以存放在永隆银行上海分行的人民币存款214,000,000.00元作为保证金，为子公司财通香港向永隆银行申请贷款提供担保；本公司以存放在中国银行杭州城东支行的人民币存款200,000.00元作为开立保函保证金，使用受限。

于2021年6月30日，子公司财通资管期末银行存款人民币481,107,233.27元，主要为风险准备金及待缴纳结构化主体增值税等，使用受限。

于2021年6月30日，子公司财通资本期末银行存款人民币1,410,321.15元为风险准备金，使用受限。

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： | / | / | 1,073,110,563.09 | / | / | 812,339,837.31 |
| 人民币 | / | / | 1,072,019,851.75 | / | / | 806,475,453.04 |
| 美元 | 37,092.88 | 6.4601 | 239,623.71 | 817,745.26 | 6.5249 | 5,335,706.05 |
| 港元 | 1,022,818.93 | 0.8321 | 851,087.63 | 628,182.30 | 0.8416 | 528,678.22 |
| 公司信用备付金： | / | / | 98,287,127.08 | / | / | 114,322,144.01 |
| 人民币 | / | / | 98,287,127.08 | / | / | 114,322,144.01 |
| 客户普通备付金： | / | / | 3,074,599,811.66 | / | / | 2,821,430,871.81 |
| 人民币 | / | / | 3,035,285,368.83 | / | / | 2,793,785,888.97 |
| 美元 | 5,510,999.70 | 6.4601 | 35,601,609.16 | 3,928,528.07 | 6.5249 | 25,633,252.80 |
| 港元 | 4,462,004.17 | 0.8321 | 3,712,833.67 | 2,390,363.64 | 0.8416 | 2,011,730.04 |
| 客户信用备付金： | / | / | 390,691,477.06 | / | / | 373,980,080.23 |
| 人民币 | / | / | 390,691,477.06 | / | / | 373,980,080.23 |
| 客户股票期权备付金： | / | / | 615,808,870.43 | / | / | 112,744,393.36 |
| 人民币 | / | / | 615,808,870.43 | / | / | 112,744,393.36 |
| 合计 | / | / | 5,252,497,849.32 | / | / | 4,234,817,326.72 |

结算备付金的说明：

期末无抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项。

3、贵金属

□适用 √不适用

4、拆出资金

□适用 √不适用

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 | 19,342,131,012.10 | 19,896,454,390.95 |
| 其中：个人 | 16,204,866,718.29 | 15,530,135,604.88 |
| 机构 | 3,137,264,293.81 | 4,366,318,786.07 |
| 减：减值准备 | 419,945,100.06 | 468,994,161.80 |
| 账面价值小计 | 18,922,185,912.04 | 19,427,460,229.15 |
| 境外 | 619,903,871.11 | 581,510,953.09 |
| 其中：个人 | 299,058,063.16 | 293,397,852.12 |
| 机构 | 320,845,807.95 | 288,113,100.97 |
| 减：减值准备 | 24,758,029.78 | 25,421,049.94 |
| 账面价值小计 | 595,145,841.33 | 556,089,903.15 |
| 账面价值合计 | 19,517,331,753.37 | 19,983,550,132.30 |

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 | 1,951,433,607.23 | 2,393,503,165.27 |
| 债券 | 77,168,860.19 | 168,852,608.24 |
| 股票 | 63,421,428,859.20 | 57,894,623,724.59 |
| 基金 | 830,384,890.85 | 1,561,567,089.15 |
| 合计 | 66,280,416,217.47 | 62,018,546,587.25 |

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

详见本节“七、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

详见本节“七、28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

融出资金的说明：

√适用 □不适用

本期融资融券业务累计发生强制平仓 39 次，经强制平仓期末仍未收回的债权金额为 332,431,974.20 元。

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 | | 资 产 | 负 债 |
| 利率衍生工 具(按类别列 | | | | 2,006,756,088.06 | 10,331,922.00 | | | | | 3,724,860,231.40 | 14,594,228.95 | |
| 国债期货 | | | | 237,615,681.25 | | | | | | 1,162,016,984.10 | | |
| 利率互换 | | | | 1,200,000,000.00 | | | | | | 1,950,000,000.00 | | |
| 收益互换 | | | | 569,140,406.81 | 10,331,922.00 | | | | | 612,843,247.30 | 14,594,228.95 | |
| 权益衍生工 具(按类别列 | | | | 4,205,587,047.64 | 22,386,281.61 | 49,792,950.38 | | | | 4,763,161,662.62 | 20,419,017.81 | 88,768,257.30 |
| 股指期货 | | | | 671,387,254.57 | | | | | | 799,698,639.28 | | |
| 场外期权 | | | | 1,937,877,021.53 | 7,819,411.83 | 16,836,109.76 | | | | 1,686,837,654.66 | 15,574,964.36 | 13,521,069.25 |

| | | | | | | | | | | | | |
|-------------|--|--|--|------------------|----------------|---------------|--|--|--|------------------|---------------|---------------|
| 收益互换 | | | | 1,596,322,771.54 | 14,566,869.78 | 32,956,840.62 | | | | 2,276,625,368.68 | 4,844,053.45 | 75,247,188.05 |
| 其他衍生工具(按类别列 | | | | 2,813,889,355.97 | 160,205,164.39 | 2,340,674.10 | | | | 500,000,000.00 | 28,391,689.84 | 1,805,651.00 |
| 商品期货 | | | | 313,889,355.97 | | | | | | | | |
| 场外期权 | | | | 2,500,000,000.00 | 160,205,164.39 | 2,340,674.10 | | | | 500,000,000.00 | 28,391,689.84 | 1,805,651.00 |
| 合计 | | | | 9,026,232,491.67 | 192,923,368.00 | 52,133,624.48 | | | | 8,988,021,894.02 | 63,404,936.60 | 90,573,908.30 |

已抵销的衍生金融工具：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 抵销前总额 | 抵销金额 | 抵销后净额 |
|------|--------------|--------------|-------|
| 期货合约 | 1,736,182.61 | 1,736,182.61 | |
| 利率互换 | -980,798.27 | -980,798.27 | |
| 合计 | 755,384.34 | 755,384.34 | |

衍生金融工具的说明：

于2021年6月30日，本公司持有的标准期货合约名义本金为人民币1,222,892,291.79元，利率互换合约名义本金为人民币1,200,000,000.00元。期货交易每日无负债结算确认衍生金融工具人民币1,736,182.61元与应付款项人民币1,736,182.61元，按抵销后的金额列示为人民币0.00元。利率互换合约每日无负债结算确认衍生金融工具人民币-980,798.27元与应付款项人民币-980,798.27元，按抵销后的金额列示为人民币0.00元。

于2020年12月31日，本公司持有的标准期货合约名义本金为人民币1,961,715,623.38元，利率互换合约名义本金为人民币1,950,000,000.00元。期货交易每日无负债结算确认衍生金融工具人民币-33,174,016.62元与应付款项人民币-33,174,016.62元，按抵销后的金额列示为人民币0.00元。利率互换合约每日无负债结算确认衍生金融工具人民币-1,475,842.36元与应付款项人民币-1,475,842.36元，按抵销后的金额列示为人民币0.00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 | / | / | 180,305,239.32 | / | / | 309,037,313.28 |
| 其中：人民币 | / | / | 177,812,122.32 | / | / | 306,854,790.28 |
| 美元 | 270,000.00 | 6.4601 | 1,744,227.00 | 270,000.00 | 6.5249 | 1,761,723.00 |
| 港元 | 900,000.00 | 0.8321 | 748,890.00 | 500,000.00 | 0.8416 | 420,800.00 |
| 信用保证金 | / | / | 36,511,832.88 | / | / | 42,220,419.56 |

| | | | | | | |
|--------|---|---|----------------|---|---|----------------|
| 其中：人民币 | / | / | 36,511,832.88 | / | / | 42,220,419.56 |
| 履约保证金 | / | / | 103,332,642.51 | / | / | 182,162,761.82 |
| 其中：人民币 | / | / | 103,332,642.51 | / | / | 182,162,761.82 |
| 合计 | / | / | 320,149,714.71 | / | / | 533,420,494.66 |

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 | 13,331,433.74 | 5,785,460.54 |
| 应收资产管理费 | 205,550,371.92 | 249,062,016.29 |
| 应收手续费及佣金 | 2,382,450.20 | 9,980,146.68 |
| 应收期权结算费 | 6,625,560.00 | 6,625,560.00 |
| 合计 | 227,889,815.86 | 271,453,183.51 |
| 减：坏账准备(按简化模型计提) | 10,854,388.63 | 13,347,784.20 |
| 应收款项账面价值 | 217,035,427.23 | 258,105,399.31 |

(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 | 213,715,252.01 | 99.61 | 265,238,402.67 | 99.84 |
| 1-2年 | 843,130.11 | 0.39 | 429,320.30 | 0.16 |
| 合计 | 214,558,382.12 | 100.00 | 265,667,722.97 | 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: | | | | | | | | |
| 单项计提坏账准备 | 13,331,433.74 | 5.85 | - | - | 5,785,460.54 | 2.13 | - | - |
| 单项计小计 | 13,331,433.74 | 5.85 | - | - | 5,785,460.54 | 2.13 | - | - |
| 组合计提坏账准备: | | | | | | | | |
| 1年以内 | 213,715,252.01 | 93.78 | 10,685,762.60 | 5.00 | 265,238,402.67 | 97.71 | 13,261,920.14 | 5.00 |
| 1-2年 | 843,130.11 | 0.37 | 168,626.03 | 20.00 | 429,320.30 | 0.16 | 85,864.06 | 20.00 |
| 组合小计 | 214,558,382.12 | 94.15 | 10,854,388.63 | 5.06 | 265,667,722.97 | 97.87 | 13,347,784.20 | 5.02 |
| 合计 | 227,889,815.86 | 100.00 | 10,854,388.63 | 4.76 | 271,453,183.51 | 100.00 | 13,347,784.20 | 4.92 |

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

详见本节“七、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 | 4,815,997.54 | 4,655,973.70 |
| 股票质押式回购 | 2,149,842,354.65 | 2,515,579,604.50 |
| 债券质押式回购 | 500,062,961.76 | 1,067,694,994.92 |
| 减：减值准备 | 14,976,938.53 | 82,514,831.70 |
| 账面价值合计 | 2,639,744,375.42 | 3,505,415,741.42 |

(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 | 2,154,658,352.19 | 2,520,235,578.20 |
| 债券 | 500,062,961.76 | 693,348,781.37 |
| 其他 | | 374,346,213.55 |
| 减：减值准备 | 14,976,938.53 | 82,514,831.70 |
| 买入返售金融资产账面价值 | 2,639,744,375.42 | 3,505,415,741.42 |

(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 | 9,096,292,639.04 | 8,813,577,044.59 |
| 其中：可出售或可再次向外 抵押的担保物 | | |

| | | |
|--------------------|--|---|
| 其中：已出售或已再次向外抵押的担保物 | | - |
|--------------------|--|---|

注：通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因无法获知对手方质押库信息而无法披露，其所担保的买入返售金融资产 2021 年 6 月 30 日余额为人民币 500,062,961.76 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 500,057,904.11 元）。

(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 | 125,055,564.26 | 108,879,480.56 |
| 一个月至三个月内 | 503,738,833.34 | 65,403,086.11 |
| 三个月至一年内 | 1,253,100,861.42 | 2,056,314,403.20 |
| 一年以上 | 272,763,093.17 | 289,638,608.33 |
| 合计 | 2,154,658,352.19 | 2,520,235,578.20 |

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

详见本节“七、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

股票质押式回购融出资金期末减值准备明细情况

| 2021年6月30日 | | | |
|---------------------|------------------|---------------|------------------|
| 风险阶段划分 | 账面余额 | 减值准备 | 担保物市值 |
| 阶段一 未来12个月预期信用损失 | 2,149,842,354.65 | 14,943,918.02 | 9,081,167,039.04 |
| 阶段二 | | | |

| | | | |
|-----------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | | | |
| 阶段三 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | | | |
| 合计 | 2,149,842,354.65 | 14,943,918.02 | 9,081,167,039.04 |

| 2020 年 12 月 31 日 | | | |
|-----------------------------|------------------|---------------|------------------|
| 风险阶段划分 | 账面余额 | 减值准备 | 担保物市值 |
| 阶段一 未来 12 个月预期信用损失 | 2,300,316,161.01 | 25,578,325.13 | 7,837,161,272.10 |
| 阶段二 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 64,600,000.00 | 4,704,495.00 | 128,051,576.05 |
| 阶段三 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 150,663,443.49 | 52,179,200.00 | 234,761,559.55 |
| 合计 | 2,515,579,604.50 | 82,462,020.13 | 8,199,974,407.70 |

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 | | | 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 | 8,441,856,075.32 | | 8,441,856,075.32 | 8,380,349,588.46 | | 8,380,349,588.46 |
| 公募基金 | 8,330,043,199.33 | | 8,330,043,199.33 | 8,273,910,535.74 | | 8,273,910,535.74 |
| 私募基金及专户 | 4,444,096,877.35 | | 4,444,096,877.35 | 4,384,464,353.18 | | 4,384,464,353.18 |
| 股票/股权 | 2,001,730,723.32 | | 2,001,730,723.32 | 1,770,848,455.00 | | 1,770,848,455.00 |
| 券商资管产 | 757,177,510.89 | | 757,177,510.89 | 787,517,790.77 | | 787,517,790.77 |

| | | | | | | |
|---------|---------------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|---------------------------|-------------------|
| 品 | | | | | | |
| 银行理财产品 | 748,984,996.30 | | 748,984,996.30 | 748,137,077.17 | | 748,137,077.17 |
| 信托计划 | 14,535,821.50 | | 14,535,821.50 | 48,000,000.00 | | 48,000,000.00 |
| 其他 | 997,141.67 | | 997,141.67 | 997,141.67 | | 997,141.67 |
| 合计 | 24,739,422,345.68 | | 24,739,422,345.68 | 24,394,224,941.99 | | 24,394,224,941.99 |
| 期初余额 | | | | | | |
| 类别 | 公允价值 | | | 初始成本 | | |
| | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计 | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 初始成本合计 |
| 债券 | 9,181,666,608.38 | | 9,181,666,608.38 | 9,213,578,521.00 | | 9,213,578,521.00 |
| 公募基金 | 8,561,359,124.10 | | 8,561,359,124.10 | 8,535,547,598.43 | | 8,535,547,598.43 |
| 私募基金及专户 | 3,206,813,697.33 | | 3,206,813,697.33 | 2,569,351,337.42 | | 2,569,351,337.42 |
| 股票/股权 | 2,844,254,148.48 | | 2,844,254,148.48 | 2,330,494,040.82 | | 2,330,494,040.82 |
| 券商资管产品 | 607,819,437.49 | | 607,819,437.49 | 677,500,000.00 | | 677,500,000.00 |
| 银行理财产品 | 527,793,700.44 | | 527,793,700.44 | 525,234,978.33 | | 525,234,978.33 |
| 信托计划 | 8,744,800.00 | | 8,744,800.00 | 43,000,000.00 | | 43,000,000.00 |
| 合计 | 24,938,451,516.22 | | 24,938,451,516.22 | 23,894,706,476.00 | | 23,894,706,476.00 |

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

变现有限制的金融资产

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2021年6月30日账面价值 | 受限原因 |
|---------|------------------|--------------------|
| 交易性金融资产 | 6,708,954,295.62 | 用于正回购交易担保物 |
| 交易性金融资产 | 268,162,344.80 | 融出证券业务 |
| 交易性金融资产 | 269,243,865.33 | 以管理人身份认购的基金和资产管理计划 |

| | | |
|---------|---------------|-------------------|
| 交易性金融资产 | 24,780,880.81 | 持有股票处于限售期内/未流通而受限 |
|---------|---------------|-------------------|

14、债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末余额 | | | |
|------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| | 初始成本 | 利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 企业债 | 4,357,509,651.22 | 113,088,437.03 | 8,256,740.69 | 4,462,341,347.56 |
| 公司债 | 1,434,962,428.65 | 31,572,427.46 | 2,236,579.49 | 1,464,298,276.62 |
| 中期票据 | 2,155,161,371.34 | 56,208,663.02 | 4,157,231.73 | 2,207,212,802.63 |
| 地方债 | 219,994,675.81 | 1,204,397.26 | 307,780.90 | 220,891,292.17 |
| 其他 | 83,210,000.00 | | 51,590,200.00 | 31,619,800.00 |
| 合计 | 8,250,838,127.02 | 202,073,924.77 | 66,548,532.81 | 8,386,363,518.98 |

| 项目 | 期初余额 | | | |
|------|------------------|---------------|---------------|------------------|
| | 初始成本 | 利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 企业债 | 4,271,861,125.99 | 58,632,860.29 | 7,794,343.53 | 4,322,699,642.75 |
| 公司债 | 69,988,543.65 | 2,897,342.47 | 141,881.53 | 72,744,004.59 |
| 中期票据 | 2,054,625,459.61 | 35,278,552.53 | 3,975,805.47 | 2,085,928,206.67 |
| 合计 | 6,396,475,129.25 | 96,808,755.29 | 11,912,030.53 | 6,481,371,854.01 |

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

详见本节“七、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：

变现有限制的债权投资

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2021年6月30日账面价值 | 受限原因 |
|------|------------------|------------|
| 债权投资 | 5,897,452,590.50 | 用于正回购交易担保物 |

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 | | | | |
|------|------------------|----------------|----------------|------------------|---------------|
| | 初始成本 | 利息 | 公允价值变动 | 账面价值 | 累计减值准备 |
| 企业债 | 2,450,745,934.02 | 67,099,183.86 | 32,414,525.98 | 2,550,259,643.86 | 4,695,118.25 |
| 公司债 | 1,160,900,963.69 | 30,672,424.69 | -43,054,523.69 | 1,148,518,864.69 | 51,881,488.15 |
| 中期票据 | 1,471,637,803.39 | 33,294,128.76 | 15,345,416.61 | 1,520,277,348.76 | 3,067,799.85 |
| 地方债 | 1,313,029,748.12 | 26,429,337.75 | 3,081,994.08 | 1,342,541,079.95 | 1,849,984.78 |
| 金融债 | 160,000,000.00 | 4,047,002.75 | 2,340,000.00 | 166,387,002.75 | 228,251.41 |
| 定向工具 | 60,000,000.00 | 1,891,594.52 | 73,980.00 | 61,965,574.52 | 132,483.85 |
| 合计 | 6,616,314,449.22 | 163,433,672.33 | 10,201,392.98 | 6,789,949,514.53 | 61,855,126.29 |

| 项目 | 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 |
| 企业债 | 4,335,725,613.12 | 103,521,737.81 | -11,105,583.12 | 4,428,141,767.81 | 57,476,330.77 |
| 公司债 | 430,000,000.00 | 8,720,794.52 | 325,890.00 | 439,046,684.52 | 450,323.92 |
| 中期票据 | 1,562,150,805.35 | 31,417,867.25 | 6,586,814.65 | 1,600,155,487.25 | 3,258,998.53 |
| 地方债 | 402,186,003.08 | 4,862,191.80 | 737,797.21 | 407,785,992.09 | 567,406.80 |
| 金融债 | 100,000,000.00 | 1,262,876.71 | | 101,262,876.71 | 140,895.41 |
| 其他 | 60,000,000.00 | 511,035.62 | -875,460.00 | 59,635,575.62 | 129,528.30 |
| 合计 | 6,890,062,421.55 | 150,296,503.71 | -4,330,541.26 | 7,036,028,384.00 | 62,023,483.73 |

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

详见本节“七、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：

变现有限制的其他债权投资

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2021年6月30日账面价值 | 受限原因 |
|----|----------------|------|
| | | |

| | | |
|--------|------------------|------------|
| 其他债权投资 | 4,503,259,523.00 | 用于正回购交易担保物 |
|--------|------------------|------------|

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 | |
| 股权投资 | 114,600,000.00 | 132,828,205.70 | | 114,600,000.00 | 131,444,319.58 | 4,340,000.00 | 战略投资 |
| 合计 | 114,600,000.00 | 132,828,205.70 | | 114,600,000.00 | 131,444,319.58 | 4,340,000.00 | |

(2). 本期终止确认的其他权益工具

□适用 √不适用

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 | | | | | | | | | | | |
| 永安期货 | 2,975,729,106.38 | | | 247,999,360.70 | -3,576,797.24 | -184,261.53 | | | | 3,219,967,408.31 | |
| 财通基金 | 609,821,896.14 | | | 27,391,204.60 | | | | | | 637,213,100.74 | |
| 金华市民营企业稳健发展投资合伙企业（有限合伙） | 3,475,682.95 | | | | | | | | | 3,475,682.95 | |
| 杭州财通月桂股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 7,679,373.70 | | 2,720,000.00 | -778,640.70 | | | | | | 4,180,733.00 | |
| 杭州财通盛穗股权投资合伙企业（有限合伙） | 3,575,725.31 | | | 98,584.67 | | | | | | 3,674,309.98 | |
| 杭州财通胜遇股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 12,978,581.46 | | | 6,983,954.72 | | | | | | 19,962,536.18 | |
| 杭州财通尤创创业投资合伙企业（有限合伙） | 2,551,547.09 | | | 380,789.42 | | | | | | 2,932,336.51 | |

| | | | | | | | | | | | |
|----------------------------|------------------|---------------|--|----------------|--|------------|---------------|--|--|------------------|--|
| 长兴泰特股权投资合伙企业（有限合伙） | | 32,500,000.00 | | -422,279.83 | | | | | | 32,077,720.17 | |
| 德清锦烨财股权投资基金管理合伙企业（有限合伙） | 9,214,987.40 | | | 1,660,778.15 | | | | | | 10,875,765.55 | |
| 义乌通杰股权投资合伙企业（有限合伙） | 1,972,225.93 | | | 30,268.77 | | | | | | 2,002,494.70 | |
| 杭州博拉网络科技有限公司 | 555,253.38 | | | 933.91 | | | | | | 556,187.29 | |
| 杭州财通金臻股权投资合伙企业（有限合伙） | 3,260,699.79 | | | -1,755,519.75 | | | | | | 1,505,180.04 | |
| 绍兴市上虞区财通春晖股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 6,416,735.04 | | | 883,339.54 | | | | | | 7,300,074.58 | |
| 杭州财通富榕股权投资合伙企业（有限合伙） | 3,660,239.60 | | | -13,294.72 | | | | | | 3,646,944.88 | |
| 杭州财通恒芯创业投资合伙企业（有限合伙） | 10,003,950.08 | | | -191,239.49 | | | | | | 9,812,710.59 | |
| 杭州酒通投资管理有限公司 | 4,314,098.43 | | | -196,803.69 | | 12,886.22 | | | | 4,130,180.96 | |
| 浙江省浙商资产管理有限公司 | 2,759,426,812.75 | | | 215,872,953.74 | | -66,171.49 | 80,301,764.71 | | | 2,894,931,830.29 | |
| 云和梯田投资发展有限公司 | 60,091,765.34 | | | 151,995.86 | | | | | | 60,243,761.20 | |
| 迈得医疗工业设备股份有限公司 | 54,200,610.24 | | | 393,908.51 | | -4,162.21 | 1,351,500.00 | | | 53,238,856.54 | |
| 北京信安世纪科技股份有限公司 | 89,630,379.13 | | | -15,874.16 | | | | | | 89,614,504.97 | |
| 天道金科股份有限公司 | 43,773,500.47 | | | -4,816,536.63 | | | | | | 38,956,963.84 | |

2021 年半年度报告

| | | | | | | | | | | | |
|----------------|------------------|---------------|--------------|----------------|---------------|-------------|---------------|--|--|------------------|--|
| 北京三清互联科技股份有限公司 | 35,396,800.45 | | | -159,287.22 | | | | | | 35,237,513.23 | |
| 浙江财和通易企业发展有限公司 | 3,083,906.56 | | | -37,511.66 | | | | | | 3,046,394.90 | |
| 小计 | 6,700,813,877.62 | 32,500,000.00 | 2,720,000.00 | 493,461,084.74 | -3,576,797.24 | -241,709.01 | 81,653,264.71 | | | 7,138,583,191.40 | |
| 合计 | 6,700,813,877.62 | 32,500,000.00 | 2,720,000.00 | 493,461,084.74 | -3,576,797.24 | -241,709.01 | 81,653,264.71 | | | 7,138,583,191.40 | |

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 | 53,848,426.42 | | | 53,848,426.42 |
| 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 | 53,848,426.42 | | | 53,848,426.42 |
| 二、累计折旧和累计摊销 | | | | |
| 1. 期初余额 | 32,367,002.71 | | | 32,367,002.71 |
| 2. 本期增加金额 | 872,344.50 | | | 872,344.50 |
| (1) 计提或摊销 | 872,344.50 | | | 872,344.50 |
| 3. 本期减少金额 | | | | |
| (1) 处置 | | | | |
| (2) 其他转出 | | | | |
| 4. 期末余额 | 33,239,347.21 | | | 33,239,347.21 |
| 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 | 20,609,079.21 | | | 20,609,079.21 |
| 2. 期初账面价值 | 21,481,423.71 | | | 21,481,423.71 |

(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 | 机器设备 | 合计 |
|--------------|----------------|--------------|----------------|---------------|----------------|
| 一、账面原值: | | | | | |
| 1. 期初余额 | 243,311,802.35 | 3,919,865.11 | 369,695,984.72 | 27,110,167.50 | 644,037,819.68 |
| 2. 本期增加金额 | | | 14,413,660.30 | 1,541,398.34 | 15,955,058.64 |
| (1) 购置 | | | 14,475,240.70 | 1,541,398.34 | 16,016,639.04 |
| (2) 在建工程转入 | | | | | |
| (3) 企业合并增加 | | | | | |
| (4) 外币报表折算差额 | | | -61,580.40 | | -61,580.40 |
| 3. 本期减少金额 | | | 7,906,619.28 | 1,084,728.92 | 8,991,348.20 |
| (1) 处置或报废 | | | 7,906,619.28 | 1,084,728.92 | 8,991,348.20 |
| 4. 期末余额 | 243,311,802.35 | 3,919,865.11 | 376,203,025.74 | 27,566,836.92 | 651,001,530.12 |
| 二、累计折旧 | | | | | |
| 1. 期初余额 | 53,737,424.06 | 3,516,752.01 | 229,718,284.62 | 20,570,051.53 | 307,542,512.22 |
| 2. 本期增加金额 | 3,912,857.28 | 28,622.40 | 46,992,377.20 | 1,020,987.27 | 51,954,844.15 |
| (1) 计提 | 3,912,857.28 | 28,622.40 | 47,044,812.02 | 1,020,987.27 | 52,007,278.97 |
| (2) 外币报表折算差额 | | | -52,434.82 | | -52,434.82 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|--------------|----------------|---------------|----------------|
| 3. 本期减少金额 | | | 7,840,057.06 | 1,040,789.53 | 8,880,846.59 |
| (1) 处置或报废 | | | 7,840,057.06 | 1,040,789.53 | 8,880,846.59 |
| 4. 期末余额 | 57,650,281.34 | 3,545,374.41 | 268,870,604.76 | 20,550,249.27 | 350,616,509.78 |
| 三、减值准备 | | | | | |
| 1. 期初余额 | | | | | |
| 2. 本期增加金额 | | | | | |
| (1) 计提 | | | | | |
| 3. 本期减少金额 | | | | | |
| (1) 处置或报废 | | | | | |
| 4. 期末余额 | | | | | |
| 四、账面价值 | | | | | |
| 1. 期末账面价值 | 185,661,521.01 | 374,490.70 | 107,332,420.98 | 7,016,587.65 | 300,385,020.34 |
| 2. 期初账面价值 | 189,574,378.29 | 403,113.10 | 139,977,700.10 | 6,540,115.97 | 336,495,307.46 |

(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

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 |
| 其他零星工程 | 198,914.31 | | 198,914.31 | 687,775.15 | | 687,775.15 |
| 合计 | 198,914.31 | | 198,914.31 | 687,775.15 | | 687,775.15 |

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

□适用 √不适用

(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 | 690,921,771.12 | 29,359,761.67 | 720,281,532.79 |
| 2. 本期增加金额 | 36,580,719.73 | | 36,580,719.73 |
| 3. 本期减少金额 | 3,204,054.97 | 1,303.03 | 3,205,358.00 |
| 4. 期末余额 | 724,298,435.88 | 29,358,458.64 | 753,656,894.52 |
| 二、累计折旧 | | | |
| 1. 期初余额 | | | |
| 2. 本期增加金额 | 72,870,190.27 | 2,254,177.82 | 75,124,368.09 |
| (1) 计提 | 72,870,190.27 | 2,254,177.82 | 75,124,368.09 |
| 3. 本期减少金额 | 812,490.82 | - | 812,490.82 |
| (1) 处置 | 812,490.82 | - | 812,490.82 |
| 4. 期末余额 | 72,057,699.45 | 2,254,177.82 | 74,311,877.27 |
| 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 | 652,240,736.43 | 27,104,280.82 | 679,345,017.25 |
| 2. 期初账面价值 | 690,921,771.12 | 29,359,761.67 | 720,281,532.79 |

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 | 土地使用权 | 软件使用权 | 交易席位费 | 合计 |
|--------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 一、账面原值 | | | | |
| 1. 期初余额 | 305,420,346.84 | 373,600,266.01 | 24,552,880.00 | 703,573,492.85 |
| 2. 本期增加金额 | | 14,802,634.84 | | 14,802,634.84 |
| (1) 购置 | | 14,820,521.11 | | 14,820,521.11 |
| (2) 内部研发 | | | | |
| (3) 企业合并增加 | | | | |
| (4) 外币报表折算差额 | | -17,886.27 | | -17,886.27 |
| 3. 本期减少金额 | | | | |
| (1) 处置 | | | | |
| 4. 期末余额 | 305,420,346.84 | 388,402,900.85 | 24,552,880.00 | 718,376,127.69 |
| 二、累计摊销 | | | | |
| 1. 期初余额 | 51,310,618.40 | 242,932,975.16 | 24,552,880.00 | 318,796,473.56 |
| 2. 本期增加金额 | 3,830,716.38 | 30,778,340.90 | | 34,609,057.28 |
| (1) 计提 | 3,830,716.38 | 30,795,014.54 | | 34,625,730.92 |
| (2) 外币报表折算差额 | | -16,673.64 | | -16,673.64 |
| 3. 本期减少金额 | | | | |
| (1) 处置 | | | | |
| 4. 期末余额 | 55,141,334.78 | 273,711,316.06 | 24,552,880.00 | 353,405,530.84 |
| 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 | 250,279,012.06 | 114,691,584.79 | | 364,970,596.85 |
| 2. 期初账面价值 | 254,109,728.44 | 130,667,290.85 | | 384,777,019.29 |

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

(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

(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 |
| 坏账准备 | 121,266,388.78 | 30,316,597.22 | 105,660,689.55 | 26,415,172.39 |
| 买入返售金融资产减值准备 | 14,976,938.53 | 3,744,234.63 | 30,335,631.70 | 7,583,907.93 |
| 债权投资减值准备 | 14,958,332.81 | 3,739,583.20 | 11,912,030.53 | 2,978,007.63 |
| 融出资金减值准备 | 419,945,100.06 | 104,986,275.02 | 468,994,161.80 | 117,248,540.45 |
| 衍生金融工具公允价值变动 | 23,969,037.31 | 5,992,259.33 | 99,369,574.13 | 24,842,393.53 |
| 其他债权投资公允价值变动 | | | 4,330,541.26 | 1,082,635.32 |
| 应付未付款 | 1,611,898,505.27 | 402,974,626.32 | 1,525,044,687.84 | 381,261,171.96 |
| 合计 | 2,207,014,302.76 | 551,753,575.72 | 2,245,647,316.81 | 561,411,829.21 |

(2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末余额 | | 期初余额 | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| | 应纳税暂时性差异 | 递延所得税负债 | 应纳税暂时性差异 | 递延所得税负债 |
| 交易性金融资产公允价值变动 | 249,792,324.11 | 62,448,081.03 | 970,138,505.68 | 242,534,626.42 |
| 其他债权投资公允价值变动 | 10,201,392.98 | 2,550,348.25 | | |
| 其他权益工具投资公允价值变动 | 18,228,205.70 | 4,557,051.43 | 16,844,319.58 | 4,211,079.90 |

| | | | | |
|----|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 合计 | 278,221,922.79 | 69,555,480.71 | 986,982,825.26 | 246,745,706.32 |
|----|----------------|---------------|----------------|----------------|

(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

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 | 69,715,421.68 | 78,363,852.78 |
| 可抵扣亏损 | 41,748,736.21 | 81,597,017.00 |
| 合计 | 111,464,157.89 | 159,960,869.78 |

(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

单位：元 币种：人民币

| 年份 | 期末金额 | 期初金额 | 备注 |
|-------|---------------|---------------|----|
| 2021年 | 6,584,642.11 | 6,584,642.11 | |
| 2022年 | 1,665,009.52 | 1,665,009.52 | |
| 2023年 | 6,071,391.85 | 6,071,391.85 | |
| 2024年 | 10,704,466.22 | 10,704,466.22 | |
| 2025年 | 16,723,226.51 | 56,571,507.30 | |
| 合计 | 41,748,736.21 | 81,597,017.00 | |

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 |
|--------|------------------|----------------|
| 其他应收款 | 1,074,130,802.72 | 771,616,666.20 |
| 应收股利 | 19,254,241.57 | 52,721,739.00 |
| 长期待摊费用 | 85,674,354.61 | 85,892,036.18 |

| | | |
|------|------------------|----------------|
| 待摊费用 | 5,334,730.36 | 6,655,876.26 |
| 应收利息 | 23,641,066.86 | 16,960,937.52 |
| 合计 | 1,208,035,196.12 | 933,847,255.16 |

其他应收款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 款项性质 | 期末账面余额 | 期初账面余额 |
|--------------|------------------|------------------|
| 债务重组款 | 236,604,748.80 | 237,347,448.80 |
| 股权认购资金 | 16,000,000.00 | 16,000,000.00 |
| 押金及保证金 | 36,277,290.36 | 49,063,462.05 |
| 收益互换及场外期权保证金 | 1,012,397,485.93 | 711,557,739.62 |
| 应收暂付款 | 111,562,822.81 | 80,236,580.14 |
| 其他 | 2,891,149.99 | 1,796,356.75 |
| 合计 | 1,415,733,497.89 | 1,096,001,587.36 |

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

详见本节“七、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) 明细情况

① 类别明细情况

单位：元 币种：人民币

| 种类 | 2021年6月30日 | | | | 账面价值 |
|--------------|----------------|--------|----------------|----------|------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | | |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 计提比例 (%) | |
| 单项计提 坏账准备 | 265,030,467.97 | 18.72 | 265,030,467.97 | 100.00 | - |

| | | | | | |
|--------------|------------------|--------|----------------|-------|------------------|
| 组合计提 坏账准备 | 1,150,703,029.92 | 81.28 | 76,572,227.20 | 6.65 | 1,074,130,802.72 |
| 合计 | 1,415,733,497.89 | 100.00 | 341,602,695.17 | 24.13 | 1,074,130,802.72 |

(续上表)

| 种类 | 2020年12月31日 | | | | |
|--------------|------------------|--------|----------------|----------|----------------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | | 账面价值 |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 计提比例 (%) | |
| 单项计提 坏账准备 | 265,773,167.97 | 24.25 | 265,773,167.97 | 100.00 | - |
| 组合计提 坏账准备 | 830,228,419.39 | 75.75 | 58,611,753.19 | 7.06 | 771,616,666.20 |
| 合计 | 1,096,001,587.36 | 100.00 | 324,384,921.16 | 29.60 | 771,616,666.20 |

②期末单项计提坏账准备的其他应收款

单位：元 币种：人民币

| 其他应收款内容 | 账面余额 | 坏账准备 | 计提比例 (%) | 计提理由 |
|--------------|----------------|----------------|----------|------|
| 应收李国安等债权 | 217,861,393.45 | 217,861,393.45 | 100.00 | 难以收回 |
| 体育馆营业部应收债权 | 8,729,319.52 | 8,729,319.52 | 100.00 | 难以收回 |
| 深圳优威派克科技有限公司 | 16,000,000.00 | 16,000,000.00 | 100.00 | 难以收回 |
| 应收包商银行债权 | 10,014,035.83 | 10,014,035.83 | 100.00 | 难以收回 |
| 应收违约债券利息 | 12,425,719.17 | 12,425,719.17 | 100.00 | 难以收回 |
| 合计 | 265,030,467.97 | 265,030,467.97 | 100.00 | |

③ 采用组合计提坏账准备的其他应收款

单位：元 币种：人民币

| 账龄 | 2021年6月30日 | | | |
|------|------------------|--------|---------------|----------|
| | 账面余额 | | 坏账准备 | |
| | 金额 | 比例 (%) | 金额 | 计提比例 (%) |
| 1年以内 | 1,108,369,186.25 | 96.32 | 55,418,459.32 | 5.00 |

| | | | | |
|------|------------------|--------|---------------|--------|
| 1-2年 | 9,740,895.98 | 0.85 | 1,948,179.19 | 20.00 |
| 2-3年 | 17,475,112.84 | 1.52 | 5,242,533.85 | 30.00 |
| 3-4年 | 1,924,633.35 | 0.17 | 769,853.34 | 40.00 |
| 4年以上 | 13,193,201.50 | 1.14 | 13,193,201.50 | 100.00 |
| 合计 | 1,150,703,029.92 | 100.00 | 76,572,227.20 | 6.65 |

2) 坏账准备变动情况

① 明细情况

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 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) | |
| 2020年12月31日 余额 | 39,513,445.23 | 2,063,681.00 | 282,807,794.93 | 324,384,921.16 |
| - 转入第二阶段 | -487,044.80 | 487,044.80 | | |
| - 转入第三阶段 | | -3,495,022.57 | 3,495,022.57 | |
| - 转回第二阶段 | | | | |
| - 转回第一阶段 | | | | |
| 本期计提 | 16,392,058.89 | 2,892,475.96 | | 19,284,534.85 |
| 本期收回 | | | | |
| 本期转回 | | | 2,574,135.41 | 2,574,135.41 |
| 本期核销 | | | | |
| 其他变动 | | | 507,374.57 | 507,374.57 |
| 2021年6月30日余 额 | 55,418,459.32 | 1,948,179.19 | 284,236,056.66 | 341,602,695.17 |

3) 本期无核销的其他应收款。

4) 其他应收款金额前5名情况

单位：元 币种：人民币

| 单位名称 | 款项性质 | 账面余额 | 账龄 | 占其他应收款 余额的比例 (%) | 坏账准备 |
|------------------|----------|----------------|------|------------------------|----------------|
| 华泰证券股份 有限公司 | 场外衍生品保证金 | 362,315,500.00 | 1年以内 | 25.59 | 18,115,775.00 |
| 李国安 | 债务重组应收款项 | 217,861,393.45 | 5年以上 | 15.39 | 217,861,393.45 |
| 中信证券股份 有限公司 | 收益互换保证金 | 132,742,991.00 | 1年以内 | 9.38 | 6,637,149.55 |
| 国泰君安股份 有限公司 | 收益互换保证金 | 110,669,458.69 | 1年以内 | 7.82 | 5,533,472.93 |
| 浙江永安资本 管理有限公司 | 场外期权保证金 | 107,327,381.31 | 1年以内 | 7.58 | 5,366,369.07 |
| 合计 | | 930,916,724.45 | | 65.76 | 253,514,160.00 |

(2) 应收股利

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2020年12月 31日 | 本期增加 | 本期减少 | 2021年6月30 日 | 未收回原因 | 相关款项是 否发生减值 |
|------------|-----------------|----------------|----------------|----------------|-------|----------------|
| 账龄1年以 内 | 52,721,739.00 | 177,180,633.31 | 210,648,130.74 | 19,254,241.57 | 不适用 | 不适用 |
| 合计 | 52,721,739.00 | 177,180,633.31 | 210,648,130.74 | 19,254,241.57 | | |

(3) 长期待摊费用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2020年12月31日 | 本期增加 | 本期摊销 | 外币报表 折算差额 | 2021年6月30日 |
|-----|---------------|---------------|---------------|--------------|---------------|
| 装修费 | 81,760,408.27 | 16,542,192.75 | 15,947,785.52 | -968.29 | 82,353,847.21 |
| 其他 | 4,131,627.91 | 73,902.79 | 885,023.30 | | 3,320,507.40 |
| 合计 | 85,892,036.18 | 16,616,095.54 | 16,832,808.82 | -968.29 | 85,674,354.61 |

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 | 505,719,013.40 | 1,354,563,366.31 |
| —交易性金融资产 | 268,162,344.80 | 711,093,414.19 |
| —转融通融入证券 | 237,556,668.60 | 643,469,952.12 |
| 转融通融入证券总额 | 358,832,991.80 | 770,171,156.00 |

融券业务违约情况：

√适用 □不适用

详见本节“七、5、融出资金”。

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 | |
| 融出资金 减值准备 | 494,415,211.74 | 27,973,817.48 | 77,685,899.38 | | 444,703,129.84 |
| 应收款项 坏账准备 | 13,347,784.20 | | 1,717,046.27 | 776,349.30 | 10,854,388.63 |
| 买入返售 金融资产 减值准备 | 82,514,831.70 | | 66,948,893.17 | 589,000.00 | 14,976,938.53 |
| 债权投资 减值准备 | 11,912,030.53 | 54,636,502.28 | | | 66,548,532.81 |
| 其他债权 投资减值 准备 | 62,023,483.73 | 1,045,090.25 | | 1,213,447.69 | 61,855,126.29 |
| 其他应收 款坏账准 备 | 324,384,921.16 | 19,284,534.85 | 2,574,135.41 | -507,374.57 | 341,602,695.17 |
| 金融工具 及其他项 目信用减 值准备小 计 | 988,598,263.06 | 102,939,944.86 | 148,925,974.23 | 2,071,422.42 | 940,540,811.27 |

| | | | | | |
|------------|----------------|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 长期股权投资减值准备 | | | | | |
| 投资性房地产减值准备 | | | | | |
| 固定资产减值准备 | | | | | |
| 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 | | | | | |
| 合计 | 988,598,263.06 | 102,939,944.86 | 148,925,974.23 | 2,071,422.42 | 940,540,811.27 |

资产减值准备的说明：

融出资金减值准备本期计提含外币报表折算差额人民币-286,953.40元。

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 | | | |
|--------------------|----------------|--------------------|--------------------|----------------|
| | 未来12个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失未发生信用减值 | 整个存续期预期信用损失已发生信用减值 | 合计 |
| 融出资金减值准备 | 140,023,516.22 | 6,278,936.05 | 298,400,677.57 | 444,703,129.84 |
| 应收款项坏账准备 (简化模型) | | 10,854,388.63 | | 10,854,388.63 |
| 买入返售金融资产减值准备 | 14,976,938.53 | | | 14,976,938.53 |
| 债权投资减值准备 | 14,958,332.81 | | 51,590,200.00 | 66,548,532.81 |
| 其他债权投资减值准备 | 11,855,126.29 | | 50,000,000.00 | 61,855,126.29 |
| 其他应收款坏账准备 | 55,418,459.32 | 1,948,179.19 | 284,236,056.66 | 341,602,695.17 |

| | | | | |
|--------------------|----------------|--------------------|--------------------|----------------|
| 合计 | 237,232,373.17 | 19,081,503.87 | 684,226,934.23 | 940,540,811.27 |
| 金融工具类别 | 期初余额 | | | |
| | 未来12个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失未发生信用减值 | 整个存续期预期信用损失已发生信用减值 | 合计 |
| 融出资金减值准备 | 112,410,696.70 | 74,204,000.15 | 307,800,514.89 | 494,415,211.74 |
| 应收款项坏账准备 (简化模型) | | 13,347,784.20 | | 13,347,784.20 |
| 买入返售金融资产减值准备 | 26,415,219.20 | 3,920,412.50 | 52,179,200.00 | 82,514,831.70 |
| 债权投资减值准备 | 11,912,030.53 | | | 11,912,030.53 |
| 其他债权投资减值准备 | 12,023,483.73 | | 50,000,000.00 | 62,023,483.73 |
| 其他应收款坏账准备 | 39,513,445.23 | 2,063,681.00 | 282,807,794.93 | 324,384,921.16 |
| 合计 | 202,274,875.39 | 93,535,877.85 | 692,787,509.82 | 988,598,263.06 |

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 |
|------|----------------|----------------|
| 保证借款 | 432,816,051.70 | 485,797,765.03 |
| 合计 | 432,816,051.70 | 485,797,765.03 |

短期借款分类的说明：

无

(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 |
|-----------------------------|------------------|------------|------|-------------------|----------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 财通证券股份有限公司 2020 年度第十期短期融资券 | 2,500,000,000.00 | 2020/10/15 | 90 天 | 2,500,000,000.00 | 3.09% | 2,516,508,219.18 | | 2,516,508,219.18 | |
| 财通证券股份有限公司 2020 年度第十一期短期融资券 | 2,500,000,000.00 | 2020/11/18 | 83 天 | 2,500,000,000.00 | 3.34% | 2,510,065,753.42 | 7,091,780.83 | 2,517,157,534.25 | |
| 财通证券股份有限公司 2021 年度第一期短期融资券 | 2,500,000,000.00 | 2021/1/8 | 91 天 | 2,500,000,000.00 | 2.50% | | 2,514,212,328.77 | 2,514,212,328.77 | |
| 财通证券股份有限公司 2021 年度第二期短期融资券 | 2,000,000,000.00 | 2021/2/5 | 91 天 | 2,000,000,000.00 | 3.04% | | 2,014,158,904.11 | 2,014,158,904.11 | |
| 财通证券股份有限公司 2021 年度第三期短期融资券 | 1,500,000,000.00 | 2021/4/28 | 86 天 | 1,500,000,000.00 | 2.57% | | 1,506,759,452.04 | | 1,506,759,452.04 |
| 财通证券股份有限公司 2021 年度第四期短期融资券 | 2,500,000,000.00 | 2021/6/4 | 91 天 | 2,500,000,000.00 | 2.44% | | 2,504,512,328.77 | | 2,504,512,328.77 |
| 收益凭证 | 1,741,970,000.00 | | | 1,741,970,000.00 | | 5,130,320,866.87 | 1,770,071,451.30 | 5,268,933,854.90 | 1,631,458,463.27 |
| 合 计 | / | / | / | 15,241,970,000.00 | / | 10,156,894,839.47 | 10,316,806,245.82 | 14,830,970,841.21 | 5,642,730,244.08 |

应付短期融资款的说明：

期初发行的收益凭证面值合计 50.80 亿元，本期发行收益凭证面值合计 17.42 亿元，期末未到期收益凭证的年利率为 2.00%至 3.95%。

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 | 300,173,694.44 | 1,300,381,555.60 |
| 转融通融入资金 | | |
| 其他 | | |
| 合计 | 300,173,694.44 | 1,300,381,555.60 |

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

(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 |
|---------|-------------------|-------------------|
| 质押式卖出回购 | 14,386,020,205.75 | 14,110,798,507.31 |
| 质押式报价回购 | 1,020,242,966.89 | 231,517,058.66 |

| | | |
|---------|-------------------|-------------------|
| 债券买断式回购 | 249,680,319.87 | - |
| 合计 | 15,655,943,492.51 | 14,342,315,565.97 |

(2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末账面余额 | 期初账面余额 |
|------|-------------------|-------------------|
| 债券 | 14,635,700,525.62 | 14,110,798,507.31 |
| 基金专户 | 1,020,242,966.89 | 231,517,058.66 |
| 合计 | 15,655,943,492.51 | 14,342,315,565.97 |

(3) 担保物金额

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末账面余额 | 期初账面余额 |
|------|-------------------|-------------------|
| 债券 | 15,812,256,543.82 | 15,765,654,166.81 |
| 基金专户 | 1,297,409,865.30 | 270,770,682.47 |
| 合计 | 17,109,666,409.12 | 16,036,424,849.28 |

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 期限 | 期末账面余额 | 利率区间 | 期初账面余额 | 利率区间 |
|----------|------------------|-------------|----------------|-------------|
| 一个月内 | 131,874,141.70 | 2.58%-6.80% | 231,517,058.66 | 0.35%-5.50% |
| 一个月至三个月内 | 841,774,908.31 | 2.90%-3.90% | | |
| 三个月至一年内 | 46,593,916.88 | 2.90%-3.90% | | |
| 合计 | 1,020,242,966.89 | | 231,517,058.66 | |

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 | 12,313,727,300.47 | 11,416,350,424.68 |
| 机构 | 3,710,573,860.21 | 3,597,000,308.52 |
| 小计 | 16,024,301,160.68 | 15,013,350,733.20 |
| 信用业务 | | |
| 其中：个人 | 1,702,453,854.11 | 2,150,379,039.81 |
| 机构 | 248,979,753.12 | 243,124,125.46 |
| 小计 | 1,951,433,607.23 | 2,393,503,165.27 |
| 期权业务 | 877,192,792.43 | 223,759,580.18 |
| 合计 | 18,852,927,560.34 | 17,630,613,478.65 |

代理买卖证券款的说明：

代理买卖证券款——外币款项

单位：元

| 币种 | 2021年6月30日 | | | 2020年12月31日 | | |
|----|----------------|--------|----------------|----------------|--------|----------------|
| | 原币金额 | 汇率 | 折人民币金额 | 原币金额 | 汇率 | 折人民币金额 |
| 美元 | 12,361,929.87 | 6.4601 | 79,859,303.16 | 18,038,386.63 | 6.5249 | 117,698,668.92 |
| 港币 | 185,150,921.43 | 0.8321 | 154,064,081.73 | 155,500,682.96 | 0.8416 | 130,869,374.78 |
| 合计 | | | 233,923,384.89 | | | 248,568,043.70 |

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 |
|-------|--------|----------------|
| 债券 | | 218,000,000.00 |
| 其中：国债 | | |
| 公司债券 | | 218,000,000.00 |
| 合计 | | 218,000,000.00 |

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 | 2,310,205,856.05 | 1,243,340,755.08 | 1,235,094,234.10 | 2,318,452,377.03 |
| 二、离职后福利-设定提存计划 | 25,573,835.23 | 65,120,184.76 | 47,283,012.45 | 43,411,007.54 |

| | | | | |
|--------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 三、辞退福利 | | | | |
| 四、一年内到期的其他福利 | | | | |
| 合计 | 2,335,779,691.28 | 1,308,460,939.84 | 1,282,377,246.55 | 2,361,863,384.57 |

(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 | 2,234,605,979.80 | 1,134,112,638.14 | 1,147,401,544.50 | 2,221,317,073.44 |
| 二、职工福利费 | 5,206,693.58 | 17,042,477.80 | 17,035,377.80 | 5,213,793.58 |
| 三、社会保险费 | 9,969,360.53 | 35,376,860.78 | 23,475,843.45 | 21,870,377.86 |
| 其中：医疗保险费 | 9,959,279.13 | 34,543,958.73 | 22,686,445.85 | 21,816,792.01 |
| 工伤保险费 | 2,388.79 | 398,601.98 | 366,251.67 | 34,739.10 |
| 生育保险费 | 7,692.61 | 425,084.04 | 413,929.90 | 18,846.75 |
| 其他 | | 9,216.03 | 9,216.03 | |
| 四、住房公积金 | 1,099,870.00 | 34,641,315.08 | 33,928,699.08 | 1,812,486.00 |
| 五、工会经费和职工教育经费 | 59,323,952.14 | 22,167,463.28 | 13,252,769.27 | 68,238,646.15 |
| 合计 | 2,310,205,856.05 | 1,243,340,755.08 | 1,235,094,234.10 | 2,318,452,377.03 |

(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 | 3,033,530.80 | 33,972,701.76 | 30,645,300.38 | 6,360,932.18 |
| 2、失业保险费 | 5,685.66 | 957,576.66 | 863,547.99 | 99,714.33 |
| 3、企业年金缴费 | 22,534,618.77 | 30,189,906.34 | 15,774,164.08 | 36,950,361.03 |
| 合计 | 25,573,835.23 | 65,120,184.76 | 47,283,012.45 | 43,411,007.54 |

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 |
|----|------|------|
| | | |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 企业所得税 | 220,859,626.30 | 348,206,014.38 |
| 代扣代缴个人所得税 | 88,964,715.00 | 47,335,929.74 |
| 代缴资管产品增值税及附加税 | 25,288,311.48 | 43,193,983.00 |
| 增值税 | 18,510,656.48 | 59,145,710.68 |
| 城市维护建设税 | 1,199,270.91 | 3,349,579.49 |
| 房产税 | 325,812.95 | 458,418.39 |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 858,420.34 | 2,386,044.04 |
| 其他 | 1,631,580.22 | 1,245,908.95 |
| 合计 | 357,638,393.68 | 505,321,588.67 |

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 | 1,035,297,820.65 | 614,755,098.03 |
| 应付期权结算款 | 160,298,303.98 | 26,300,000.00 |
| 合计 | 1,195,596,124.63 | 641,055,098.03 |

(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 |
|-------------|---------------|---------------|
| 预收保荐与财务顾问服务 | 22,280,316.11 | 25,500,999.56 |
| 资产与基金管理费 | 2,865,565.65 | 4,352,723.82 |
| 合计 | 25,145,881.76 | 29,853,723.38 |

(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

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 |
|---------------------------------|--------|------------|--------|------------------|---------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 财通证券股份有限公司2018年第三期次级债券 | 100.00 | 2018/8/23 | 3年 | 2,500,000,000.00 | 5.19% | 2,546,212,328.77 | 64,341,780.81 | - | 2,610,554,109.58 |
| 财通证券股份有限公司2019年第一期次级债券 | 100.00 | 2019/1/11 | 3年 | 3,000,000,000.00 | 4.40% | 3,128,745,205.48 | 61,841,095.89 | 128,745,205.46 | 3,061,841,095.91 |
| 财通证券股份有限公司2019年第二期次级债券 | 100.00 | 2019/4/8 | 3年 | 2,000,000,000.00 | 4.25% | 2,062,410,958.90 | 40,287,671.23 | 83,136,986.29 | 2,019,561,643.84 |
| 财通证券股份有限公司2020年第一期次级债券 | 100.00 | 2020/3/24 | 3年 | 3,000,000,000.00 | 3.55% | 3,082,573,972.60 | 46,101,369.87 | 99,789,041.11 | 3,028,886,301.36 |
| 财通证券股份有限公司2020年第二期次级债券 | 100.00 | 2020/8/14 | 3年 | 2,000,000,000.00 | 4.09% | 2,031,375,342.47 | 40,563,835.61 | - | 2,071,939,178.08 |
| 财通证券股份有限公司2020年第三期次级债券 | 100.00 | 2020/10/22 | 3年 | 1,500,000,000.00 | 4.20% | 1,512,254,794.52 | 31,241,095.88 | - | 1,543,495,890.40 |
| 财通证券股份有限公司2021年第一期次级债券 | 100.00 | 2021/3/19 | 3年 | 1,000,000,000.00 | 4.09% | - | 1,011,653,698.64 | - | 1,011,653,698.64 |
| 财通证券股份有限公司公开发行2020年第一期公司债券(品种一) | 100.00 | 2020/4/22 | 3年 | 2,500,000,000.00 | 2.59% | 2,545,058,904.12 | 28,383,561.65 | 61,024,657.55 | 2,512,417,808.22 |
| 财通证券股份有限公司公开发行2020年第一期公司债券(品种二) | 100.00 | 2020/4/22 | 5年 | 1,000,000,000.00 | 3.25% | 1,022,616,438.37 | 14,246,575.33 | 30,630,136.97 | 1,006,232,876.73 |
| 财通证券股份有限公司2020年非公开发行公司债券(第一期) | 100.00 | 2020/6/16 | 3年 | 2,000,000,000.00 | 3.40% | 2,037,073,972.61 | 30,926,027.42 | 65,205,479.50 | 2,002,794,520.53 |
| 财通证券股份有限公司2021年非公开发行公司债券(第一期) | 100.00 | 2021/4/8 | 397天 | 2,500,000,000.00 | 3.33% | - | 2,519,158,904.11 | - | 2,519,158,904.11 |
| 财通证券股份有限公司可转换债券 注 | 100.00 | 2020/12/10 | 6年 | 3,799,875,000.00 | 0.20% | 3,308,483,207.15 | 67,186,706.15 | 125,000.00 | 3,375,544,913.30 |
| 财通证券财鑫通48号收益凭证 | | 2019/8/8 | 1,093天 | 300,000,000.00 | 4.40% | 318,516,164.38 | 6,545,753.42 | - | 325,061,917.80 |

| | | | | | | | | | |
|----------------------|--|------------|------------|-------------------|-------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 财通证券财鑫通 49 号 收益凭证 | | 2019/12/30 | 1,092 天 | 200,000,000.00 | 4.35% | 208,771,506.85 | 4,314,246.58 | - | 213,085,753.43 |
| 合 计 | | | | 27,299,875,000.00 | | 23,804,092,796.22 | 3,966,792,322.59 | 468,656,506.88 | 27,302,228,611.93 |

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：

经证监会《关于核准财通证券股份有限公司公开发行可转换公司债券的批复》（证监许可〔2020〕2927号）核准，本公司于2020年12月10日公开发行面值总额人民币38亿元可转换公司债券，存续期限为六年，每年付息一次，到期归还本金和最后一年利息，债券票面利率第一年0.2%，第二年0.4%，第三年0.6%，第四年1.0%，第五年2.0%，第六年2.5%。转股时间为自发行结束之日起满6个月后的第一个交易日起至到期日止（即2021年6月16日至2026年12月9日），初始转股股价为人民币13.33元/股。

本公司本次发行的可转换公司债券募集资金总额为人民币38亿元，扣除承销费及保荐费用人民币9,433,962.26元（不含税）后的募集资金金额为人民币3,790,566,037.74元，另减除律师费用、会计师费用、资信评级费用、登记服务费、信息披露费及发行可转换公司债券直接相关的手续费用人民币2,126,415,10（不含税）后，本次募集资金净额为人民币3,788,439,622.64元。在进行初始计量时，对应负债成分的公允价值扣除应分摊的发行费用后的金额为人民币3,300,318,580.71元，计入应付债券；对应权益部分的公允价值扣除应分摊的发行费用后的金额为人民币488,121,041.93元，计入其他权益工具。

自2021年6月16日至2021年6月30日期间，公司A股可转债有人民币125,000元转换为公司A股股份，转股数量为9,508股，转股价格为人民币13.13元/股，占可转债转股前公司已发行份总额的0.0003%。截至2021年6月30日，公司尚未转股的可转债金额为人民币3,799,875,000元，占可转债发行总量的99.9997%。

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 |
|--------------|----------------|----------------|
| 长期租赁负债 | 503,692,356.93 | 538,796,577.75 |
| 加：一年内到期的租赁负债 | 146,070,796.77 | 149,501,386.51 |
| 合计 | 649,763,153.70 | 688,297,964.26 |

其他说明：
无

45、递延收益

□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 |
|---------|------------------|------------------|
| 其他应付款 | 1,286,711,510.14 | 1,355,622,984.81 |
| 代理兑付债券款 | 8,456,816.89 | 8,456,816.89 |
| 长期应付款 | 51,972,708.92 | 50,335,527.98 |
| 合计 | 1,347,141,035.95 | 1,414,415,329.68 |

其他应付款按款项性质列示：
√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末余额 | 期初余额 |
|--------------|------------------|------------------|
| 应付经纪人佣金及风险金 | 20,363,076.90 | 20,337,370.51 |
| 应付证券投资者保护基金 | 9,326,113.08 | 15,570,045.09 |
| 收益互换及场外期权保证金 | 613,522,811.57 | 867,150,097.80 |
| 购买商品及服务款 | 64,692,592.22 | 101,276,568.18 |
| 债务重组款项 | 17,638,709.02 | 17,638,709.02 |
| 预提费用 | 511,884,444.24 | 306,632,800.51 |
| 其他 | 49,283,763.11 | 27,017,393.70 |
| 合计 | 1,286,711,510.14 | 1,355,622,984.81 |

其他负债的说明：

(1) 账龄超过1年的重要其他应付款

| 项目 | 2021 年 6 月 30 日 | 未偿还或结转的原因 |
|---------------------|-----------------|-----------|
| 吸收合并天和证券经纪有限公司债务重组款 | 17,638,709.02 | 债务重组遗留 |
| 应付恒生电子软件款 | 5,847,110.02 | 尚未达付款条件 |
| 合计 | 23,485,819.04 | |

(2) 代理兑付债券款

| 项目 | 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
|----|-----------------|------------------|
| 国债 | 8,456,816.89 | 8,456,816.89 |
| 合计 | 8,456,816.89 | 8,456,816.89 |

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(+、-) | | | | | 期末余额 |
|------|---------------|-------------|----|-------|-------|-------|---------------|
| | | 发行新股 | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 | |
| 股份总数 | 3,589,000,000 | | | | 9,508 | 9,508 | 3,589,009,508 |

其他说明：

自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间，公司可转债累计转股数量为 9,508 股。

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

经中国证监会核准，公司于 2016 年 2 月发行了 2016 年永续次级债（第一期）5 亿元，起息日为 2016 年 2 月 26 日，前 5 个计息年度的票面利率为 4.60%。本公司发行的永续债无固定到期日，对于永续债票面利息，本公司有权递延支付，发行文件中并未规定交付现金或其他金融资产给其他单位的合同义务，或在潜在不利条件下与其他单位交换金融资产或金融负债的合同义务，符合相关条件而确认为权益工具。

(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

单位：元 币种：人民币

| 发行在外的金融工具 | 期初 | | 本期增加 | | 本期减少 | | 期末 | |
|-----------|------------|----------------|------|------|-----------|----------------|------------|----------------|
| | 数量 | 账面价值 | 数量 | 账面价值 | 数量 | 账面价值 | 数量 | 账面价值 |
| 永续债 | 5,000,000 | 500,000,000.00 | | | 5,000,000 | 500,000,000.00 | | |
| 可转债(注) | 38,000,000 | 488,121,041.93 | | | 1,250 | 16,056.61 | 37,998,750 | 488,104,985.32 |
| 合计 | 43,000,000 | 988,121,041.93 | | | 5,001,250 | 500,016,056.61 | 37,998,750 | 488,104,985.32 |

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

公司于 2021 年 2 月 26 日兑付了 2016 年永续次级债（第一期）自 2020 年 2 月 26 日至 2021 年 2 月 25 日期间的最后一个年度利息和本期债券本金并公告摘牌。

公司可转债 2021 年 6 月 16 日进入转股期，自 2021 年 6 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日期间，A 股可转债有 125,000 元转换为公司 A 股股份，转股数量为 9,508 股。

其他说明：

适用 不适用

可转换公司债券信息，详见本财务报表附注七、43。

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） | 8,262,913,631.63 | 117,290.92 | - | 8,263,030,922.55 |
| 其他资本公积 | 3,196,793.64 | - | 184,261.53 | 3,012,532.11 |
| 合计 | 8,266,110,425.27 | 117,290.92 | 184,261.53 | 8,266,043,454.66 |

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期资本公积变动系可转债转股产生的股本溢价和联营企业永安期货其他权益变动冲减资本公积。

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 | | | | | | | 期末余额 |
|--------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------|----------------------|---------------|---------------|-----------|---------------|
| | | 本期所得税前发生额 | 减：所得税费用 | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益 | 合计 | 税后归属于母公司 | 税后归属于少数股东 | |
| 一、不能重分类进损益的其他综合收益 | 12,633,239.68 | 1,383,886.12 | 345,971.53 | | | 1,037,914.59 | 1,037,914.59 | | 13,671,154.27 |
| 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 | 12,633,239.68 | 1,383,886.12 | 345,971.53 | | | 1,037,914.59 | 1,037,914.59 | | 13,671,154.27 |
| 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 | 43,334,594.19 | 4,391,760.03 | 3,590,894.21 | -1,028,775.97 | | 1,829,641.79 | 1,829,641.79 | | 45,164,235.98 |
| 其中：权益法下可转损益的其他综合收益 | -4,657,288.03 | -3,576,797.24 | | | | -3,576,797.24 | -3,576,797.24 | | -8,234,085.27 |
| 其他债权投资公允价值变动 | -3,247,905.94 | 12,289,710.58 | 3,632,983.57 | -2,242,223.66 | | 10,898,950.67 | 10,898,950.67 | | 7,651,044.73 |
| 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 | 46,517,612.75 | 1,045,090.25 | -42,089.36 | 1,213,447.69 | | -126,268.08 | -126,268.08 | | 46,391,344.67 |
| 现金流量套期储备 | | | | | | | | | |

2021 年半年度报告

| | | | | | | | | | |
|------------|---------------|---------------|--------------|---------------|--|---------------|---------------|--|---------------|
| 外币财务报表折算差额 | 4,722,175.41 | -5,366,243.56 | | | | -5,366,243.56 | -5,366,243.56 | | -644,068.15 |
| 其他综合收益合计 | 55,967,833.87 | 5,775,646.15 | 3,936,865.74 | -1,028,775.97 | | 2,867,556.38 | 2,867,556.38 | | 58,835,390.25 |

| 项目 | 期初余额 | 上期发生金额 | | | | | | | 期末余额 |
|--------------------|----------------|---------------|--------------|--------------------|----------------------|---------------|---------------|-----------|----------------|
| | | 本期所得税前发生额 | 减：所得税费用 | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益 | 合计 | 税后归属于母公司 | 税后归属于少数股东 | |
| 一、不能重分类进损益的其他综合收益 | 7,815,669.15 | 6,715,483.64 | 1,678,870.91 | | | 5,036,612.73 | 5,036,612.73 | | 12,852,281.88 |
| 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 | 7,815,669.15 | 6,715,483.64 | 1,678,870.91 | | | 5,036,612.73 | 5,036,612.73 | | 12,852,281.88 |
| 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 | 97,178,313.80 | 54,422,919.32 | 7,966,651.15 | 6,501,588.34 | | 39,954,679.83 | 39,954,679.83 | | 137,132,993.63 |
| 其中：权益法下可转损益的其他综合收益 | 13,200,566.95 | 5,667,990.01 | | | | 5,667,990.01 | 5,667,990.01 | | 18,868,556.96 |
| 其他债权投资公允价值变动 | 20,410,836.99 | 23,081,507.09 | 4,506,172.90 | 5,056,815.49 | | 13,518,518.70 | 13,518,518.70 | | 33,929,355.69 |
| 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 | 31,500,130.33 | 15,286,685.83 | 3,460,478.25 | 1,444,772.85 | | 10,381,434.73 | 10,381,434.73 | | 41,881,565.06 |
| 现金流量套期储备 | | | | | | | | | |
| 外币财务报表折算差额 | 32,066,779.53 | 10,386,736.39 | | | | 10,386,736.39 | 10,386,736.39 | | 42,453,515.92 |
| 其他综合收益合计 | 104,993,982.95 | 61,138,402.96 | 9,645,522.06 | 6,501,588.34 | | 44,991,292.56 | 44,991,292.56 | | 149,985,275.51 |

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 | 1,019,315,429.85 | | 57,447.48 | 1,019,257,982.37 |
| 任意盈余公积 | 40,660,986.36 | | | 40,660,986.36 |
| 储备基金 | | | | |
| 企业发展基金 | | | | |
| 其他 | | | | |
| 合计 | 1,059,976,416.21 | | 57,447.48 | 1,059,918,968.73 |

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期盈余公积减少系联营企业浙江省浙商资产管理有限公司其他权益变动冲减盈余公积。

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 | 1,815,615,719.63 | 48,884,394.91 | | | 1,864,500,114.54 |
| 交易风险准备 | 1,332,951,217.12 | | | | 1,332,951,217.12 |
| 合计 | 3,148,566,936.75 | 48,884,394.91 | | | 3,197,451,331.66 |

一般风险准备的说明

一般风险准备包括公司下属子公司根据所属行业或所属地区适用法律提取的一般风险准备和交易风险准备。

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 | 6,340,051,917.01 | 5,284,530,610.33 |
| 调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-） | | |
| 调整后期初未分配利润 | 6,340,051,917.01 | 5,284,530,610.33 |
| 加：本期归属于母公司所有者的净利润 | 1,045,386,539.97 | 820,335,289.45 |

| | | |
|------------|------------------|------------------|
| 减：提取法定盈余公积 | | |
| 提取任意盈余公积 | | |
| 提取一般风险准备 | 48,884,394.91 | 31,206,246.09 |
| 提取交易风险准备 | | |
| 支付永续债利息 | 23,026,150.00 | 23,001,150.00 |
| 应付普通股股利 | 717,800,000.00 | 574,240,000.00 |
| 期末未分配利润 | 6,595,727,912.07 | 5,476,418,503.69 |

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 | 1,268,662,002.81 | 934,204,644.57 |
| 其中：货币资金及结算备付金利息收入 | 244,422,243.02 | 233,921,034.64 |
| 拆出资金利息收入 | | |
| 融出资金利息收入 | 644,386,393.38 | 457,424,564.65 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 84,953,083.08 | 104,715,474.19 |
| 其中：约定购回利息收入 | 150,965.89 | 251,997.72 |
| 股权质押回购利息收入 | 81,431,219.06 | 102,352,622.04 |
| 债权投资利息收入 | 154,583,690.28 | 8,188,748.04 |
| 其他债权投资利息收入 | 140,250,289.32 | 129,592,272.61 |
| 其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入 | 66,303.73 | 362,550.44 |
| | | |

| | | |
|------------------------|----------------|----------------|
| 利息支出 | 861,143,113.28 | 555,275,438.21 |
| 其中：短期借款利息支出 | 4,367,167.02 | 11,554,414.61 |
| 应付短期融资款利息支出 | 53,586,811.72 | 69,297,593.16 |
| 拆入资金利息支出 | 22,167,149.61 | 20,682,388.81 |
| 其中：转融通利息支出 | 12,277,885.75 | - |
| 卖出回购金融资产款利息支出 | 181,857,952.02 | 77,949,055.22 |
| 其中：报价回购利息支出 | 10,607,695.04 | |
| 代理买卖证券款利息支出 | 34,627,846.43 | 30,595,396.64 |
| 长期借款利息支出 | | |
| 应付债券利息支出 | 476,158,785.91 | 316,576,909.67 |
| 其中：次级债券利息支出 | 313,473,463.71 | 292,566,473.59 |
| 收益凭证利息支出 | 76,101,110.75 | 25,306,661.31 |
| 租赁负债利息支出 | 10,650,173.05 | - |
| 其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出 | 1,626,116.77 | 3,313,018.79 |
| 利息净收入 | 407,518,889.53 | 378,929,206.36 |

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 | 598,099,000.67 | 518,832,339.16 |
| 证券经纪业务收入 | 633,031,867.58 | 557,618,626.87 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 507,725,998.48 | 502,835,946.03 |
| 交易单元席位租赁 | 18,472,550.70 | 17,034,867.41 |
| 代销金融产品业务 | 106,833,318.40 | 37,747,813.43 |
| 证券经纪业务支出 | 34,932,866.91 | 38,786,287.71 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 34,932,866.91 | 38,786,287.71 |
| 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 | 310,469,889.06 | 250,489,284.25 |
| 投资银行业务收入 | 323,900,185.57 | 254,788,812.55 |
| 其中：证券承销业务 | 280,820,125.78 | 222,544,924.53 |
| 证券保荐业务 | 10,481,830.84 | 2,941,581.96 |
| 财务顾问业务 | 32,598,228.95 | 29,302,306.06 |
| 投资银行业务支出 | 13,430,296.51 | 4,299,528.30 |
| 其中：证券承销业务 | 12,916,037.73 | 4,242,924.52 |
| 证券保荐业务 | 457,655.00 | |
| 财务顾问业务 | 56,603.78 | 56,603.78 |
| 4. 资产管理业务净收入 | 606,931,884.97 | 652,933,556.74 |
| 资产管理业务收入 | 606,931,884.97 | 652,933,556.74 |
| 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 | 13,431,877.99 | 15,509,233.51 |
| 投资咨询业务收入 | 13,431,877.99 | 15,509,233.51 |
| 投资咨询业务支出 | | |
| 7. 其他手续费及佣金净收入 | | |
| 其他手续费及佣金收入 | | |
| 其他手续费及佣金支出 | | |
| 合计 | 1,528,932,652.69 | 1,437,764,413.66 |
| 其中：手续费及佣金收入 | 1,577,295,816.11 | 1,480,850,229.67 |
| 手续费及佣金支出 | 48,363,163.42 | 43,085,816.01 |

(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 | 6,399,056.61 | 3,159,905.66 |
| 并购重组财务顾问业务净收入—其他 | 94,339.62 | |
| 其他财务顾问业务净收入 | 26,048,228.94 | 26,085,796.62 |

(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 | 40,039,963,378.16 | 92,808,229.81 | 28,111,504,778.40 | 32,814,034.59 |
| 信托 | 2,953,692,800.00 | 8,691,437.07 | 2,762,262,893.00 | 4,933,778.84 |
| 其他 | 96,549,250.00 | 5,333,651.52 | | |
| 合计 | 43,090,205,428.16 | 106,833,318.40 | 30,873,767,671.40 | 37,747,813.43 |

(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 | 公募基金业务 |
|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| 期末产品数量 | 236 | 107 | 29 | 29 |
| 期末客户数量 | 33,747 | 107 | 313 | 8,382,366 |
| 其中：个人客户 | 32,808 | 6 | | 8,381,125 |
| 机构客户 | 939 | 101 | 313 | 1,241 |
| 期初受托资金 | 48,257,202,436.05 | 32,288,509,671.54 | 24,955,635,400.00 | 47,953,006,618.98 |
| 其中：自有资金投入 | 152,991,917.00 | | | 348,316,949.44 |
| 个人客户 | 30,835,678,094.75 | 180,762,901.67 | | 18,389,686,450.59 |
| 机构客户 | 17,268,532,424.30 | 32,107,746,769.87 | 24,955,635,400.00 | 29,215,003,218.95 |
| 期末受托资金 | 48,466,668,155.64 | 36,259,124,334.43 | 17,296,928,000.00 | 94,036,448,714.63 |
| 其中：自有资金投入 | 184,992,228.11 | | | 408,133,695.43 |
| 个人客户 | 27,439,601,028.73 | 781,296,920.10 | | 64,166,765,714.13 |
| 机构客户 | 20,842,074,898.80 | 35,477,827,414.33 | 17,296,928,000.00 | 29,461,549,305.07 |
| 期末主要受托资产 初始成本 | 48,517,541,343.62 | 38,353,427,551.78 | 17,112,942,669.48 | 102,127,452,308.04 |
| 其中：股票 | 220,872,239.80 | 1,096,970,509.84 | | 9,387,678,526.95 |
| 国债 | 4,818,410.00 | 262,659,962.60 | | 1,918,857,531.68 |
| 其他债券 | 40,670,388,620.65 | 22,321,301,828.83 | | 75,111,520,554.00 |

| | | | | |
|-----------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基金 | 1,844,266,218.18 | 1,327,190,673.96 | | |
| 资产支持证 券 | 166,303,453.42 | 1,364,218,867.15 | | 1,335,277,985.63 |
| 买入返售金 融资产 | 5,523,392,401.57 | 1,157,631,155.50 | | 14,374,117,709.78 |
| 理财产品 | 87,500,000.00 | 10,823,454,553.90 | 17,112,942,669.48 | |
| 当期资产管理业务 净收入 | 352,036,058.74 | 58,539,843.52 | 13,970,639.91 | 171,379,511.12 |

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 | 493,461,084.74 | 294,725,340.38 |
| 处置长期股权投资产生的投资收益 | | -912.25 |
| 金融工具投资收益 | 1,385,934,176.97 | 332,945,553.77 |
| 其中：持有期间取得的收益 | 1,133,841,534.96 | 293,357,908.13 |
| —交易性金融工具 | 1,133,841,534.96 | 293,357,908.13 |
| —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 | 252,092,642.01 | 39,587,645.64 |
| —交易性金融工具 | 418,045,986.05 | 142,015,031.21 |
| —其他债权投资 | -2,242,223.66 | 5,056,815.49 |
| —债权投资 | | |
| —衍生金融工具 | -163,711,120.38 | -107,484,201.06 |
| 其他 | | |
| 债务重组收益 | | |
| 合计 | 1,879,395,261.71 | 627,669,981.90 |

(2) 交易性金融工具投资收益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 交易性金融工具 | | 本期发生额 | 上期发生额 |
|---------------------------|--------|------------------|----------------|
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 持有期间收益 | 1,133,841,534.96 | 293,357,908.13 |
| | 处置取得收益 | 418,045,986.05 | 142,015,031.21 |
| 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 | | |
| | 处置取得收益 | | |
| 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 | 持有期间收益 | | |

投资收益的说明：

本公司不存在投资收益汇回的重大限制。

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 |
|------|---------------|---------------|
| 政府补助 | 18,232,391.95 | 11,372,718.41 |
| 合计 | 18,232,391.95 | 11,372,718.41 |

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 | -724,468,183.45 | 458,954,871.39 |

| | | |
|------------------------------|-----------------|----------------|
| 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 | 75,400,536.82 | -32,508,466.03 |
| 其他 | | |
| 合计 | -649,067,646.63 | 426,446,405.36 |

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 |
|------|--------------|--------------|
| 租赁收入 | 1,864,816.27 | 1,008,373.08 |
| 其他 | 390,363.75 | 758,182.28 |
| 合计 | 2,255,180.02 | 1,766,555.36 |

其他业务收入说明：

无

62、资产处置收益

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 | 9,952,995.99 | 7,666,072.67 | 5%、7% |
| 教育费附加 | 4,304,098.48 | 3,313,576.35 | 3% |
| 地方教育附加 | 2,869,394.07 | 2,210,663.10 | 2% |
| 其他 | 5,110,939.21 | 665,801.42 | 按规定缴纳 |
| 合计 | 22,237,427.75 | 13,856,113.54 | / |

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 | 1,308,460,939.84 | 1,195,059,187.46 |
| 营销支出 | 235,399,710.92 | 227,857,564.23 |
| 使用权资产折旧 | 75,124,368.09 | - |
| 电子设备运转费 | 57,710,737.46 | 44,957,875.49 |
| 折旧费 | 52,007,278.97 | 38,603,058.38 |
| 交易所设施使用费 | 37,294,476.99 | 37,533,841.44 |
| 无形资产摊销 | 34,625,730.92 | 26,371,687.07 |
| 邮电通讯费 | 34,079,187.84 | 38,573,607.95 |
| 业务宣传费 | 25,321,645.23 | 16,724,113.01 |
| 咨询费 | 24,007,782.45 | 14,962,797.68 |
| 租赁费 | 9,540,241.91 | 121,874,516.20 |
| 其他 | 110,016,785.39 | 103,685,032.92 |
| 合计 | 2,003,588,886.01 | 1,866,203,281.83 |

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 |
|----------------|----------------|----------------|
| 坏账损失 | 14,993,353.17 | 9,271,681.06 |
| 融出资金减值（转回）/ 损失 | -49,382,655.97 | 49,066,905.07 |
| 买入返售金融资产减值转回 | -66,948,893.17 | -57,217,718.56 |
| 债权投资减值损失 | 54,636,502.28 | 808,556.66 |
| 其他债权投资减值损失 | 1,045,090.25 | 14,719,985.01 |
| 合计 | -45,656,603.44 | 16,649,409.24 |

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 | 872,344.50 | 872,344.50 |
| 其他 | 32,635.23 | 12,548.72 |
| 合计 | 904,979.73 | 884,893.22 |

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 | 87,451.78 | 97,320.35 | 87,451.78 |
| 其中：固定资产处置利得 | 67,045.54 | 97,320.35 | 67,045.54 |
| 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 | | | |
| 其他 | 3,004.13 | 811,415.82 | 3,004.13 |
| 合计 | 90,455.91 | 908,736.17 | 90,455.91 |

计入当期损益的政府补助

□适用 √不适用

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 | 53,480.30 | 224,020.73 | 53,480.30 |
| 其中：固定资产处置损失 | 53,480.30 | 224,020.73 | 53,480.30 |
| 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 | 616,600.00 | 16,952,000.00 | 616,600.00 |
| 赔偿支出 | 388,556.81 | 832,774.86 | 388,556.81 |
| 地方水利建设基金 | 73.95 | 547.90 | - |
| 其他 | 3,232.25 | 935.24 | 3,232.25 |
| 合计 | 1,061,943.31 | 18,010,278.73 | 1,061,869.36 |

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 | 330,844,556.04 | 138,353,844.60 |
| 递延所得税费用 | -171,468,837.86 | 10,682,734.39 |
| 合计 | 159,375,718.18 | 149,036,578.99 |

(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 | 1,205,016,924.72 |
| 按法定/适用税率计算的所得税费用 | 301,254,231.18 |
| 子公司适用不同税率的影响 | -2,395,527.22 |
| 调整以前期间所得税的影响 | |

| | |
|--------------------------------|-----------------|
| 非应税收入的影响 | -145,820,896.77 |
| 不可抵扣的成本、费用和损失的影响 | 6,337,910.99 |
| 使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响 | |
| 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 | |
| 所得税费用 | 159,375,718.18 |

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

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 |
|------------|----------------|----------------|
| 其他债权投资减少 | 273,916,329.77 | - |
| 定期及保证金存款收回 | 232,186,260.08 | 538,703,173.65 |
| 存出保证金净减少 | 213,270,779.95 | - |
| 其他 | 13,467,292.68 | 14,937,955.84 |
| 合计 | 732,840,662.48 | 553,641,129.49 |

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 |
|----------|------------------|----------------|
| 债权投资增加 | 1,802,772,797.77 | 740,471,409.15 |
| 衍生金融工具增加 | 92,558,178.40 | 148,553,955.54 |
| 拆入资金减少 | 1,000,000,000.00 | 950,000,000.00 |
| 存出保证金净增加 | - | 275,143,077.66 |

| | | |
|--------------|------------------|------------------|
| 押金及保证金净增加 | 302,380,956.74 | 93,048,638.74 |
| 其他债权投资增加 | - | 281,443,926.54 |
| 以现金支付的业务及管理费 | 516,537,759.37 | 334,189,668.76 |
| 代理承销证券款 | 218,000,000.00 | - |
| 其他应付款的减少 | 58,634,726.50 | - |
| 其他 | 62,586,133.98 | 54,273,732.89 |
| 合计 | 4,053,470,552.76 | 2,877,124,409.28 |

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 | 1,045,641,206.54 | 820,182,427.06 |
| 加：资产减值准备 | | |
| 信用减值损失 | -45,656,603.44 | 16,649,409.24 |

| | | |
|----------------------------------|------------------|-------------------|
| 固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧 | 52,912,258.70 | 39,475,402.88 |
| 使用权资产摊销 | 75,124,368.09 | |
| 无形资产摊销 | 34,625,730.92 | 26,371,687.07 |
| 长期待摊费用摊销 | 16,832,808.82 | 11,735,704.73 |
| 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） | -87,451.78 | |
| 固定资产报废损失（收益以“-”号填列） | 53,105.64 | 126,700.38 |
| 公允价值变动损失（收益以“-”号填列） | 649,067,646.63 | -426,446,405.36 |
| 财务费用（收益以“-”号填列） | 620,864,048.45 | 422,735,578.75 |
| 汇兑损失 | 203,627.10 | |
| 投资损失（收益以“-”号填列） | -493,461,084.74 | -294,724,428.13 |
| 递延所得税资产减少（增加以“-”号填列） | 9,658,253.49 | -118,417,160.00 |
| 递延所得税负债增加（减少以“-”号填列） | -177,190,225.61 | 132,560,372.64 |
| 存货的减少（增加以“-”号填列） | | |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的增加 | -631,736,107.49 | -1,564,069,213.73 |
| 经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列） | -270,949,643.58 | -3,532,578,063.41 |
| 经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列） | 1,907,542,979.08 | 5,875,336,663.25 |
| 其他 | | -3,460,478.25 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 2,793,444,916.82 | 1,405,478,197.12 |
| 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 | 23,613,866,876.16 | 20,440,910,370.83 |
| 减：现金的期初余额 | 23,801,688,159.44 | 14,969,235,935.48 |
| 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 | -187,821,283.28 | 5,471,674,435.35 |

(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 | 23,613,866,876.16 | 23,801,688,159.44 |
| 其中：库存现金 | | |
| 可随时用于支付的银行存款 | 18,361,369,026.84 | 19,566,870,832.72 |
| 可随时用于支付的其他货币资金 | | |
| 存放同业款项 | | |
| 拆放同业款项 | | |
| 结算备付金 | 5,252,497,849.32 | 4,234,817,326.72 |
| 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 | 23,613,866,876.16 | 23,801,688,159.44 |
| 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 | 696,717,554.42 | 604,466,917.63 |

其他说明：

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本公司以存放在永隆银行上海分行的人民币存款 214,000,000.00 元作为保证金，为子公司财通香港向永隆银行申请贷款提供担保，本公司以存放在中国银行城东支行的人民币 200,000.00 元作为开立保函保证金。上述保证金不列为现金及现金等价物。

子公司财通资管根据中国证监会《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》（证监会令（第 94 号））要求，计提风险准备金并缴存银行专户。截至 2021 年 6 月 30 日，该风险准备金余额为人民币 455,544,130.14 元，资管产品增值税账户存款余额人民币 25,563,103.13 元，不列为现金及现金等价物。

子公司财通资本根据中国证监会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令（第 151 号））要求，计提风险准备金并缴存银行专户。截至 2021 年 6 月 30 日，该风险准备金余额为人民币 1,410,321.15 元，不列为现金及现金等价物。

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 | 214,200,000.00 | 保证金 |
| 货币资金 | 482,517,554.42 | 产品风险准备金及待缴纳结构化主体增值税 |
| 交易性金融资产 | 6,708,954,295.62 | 用于正回购交易担保物 |
| 交易性金融资产 | 268,162,344.80 | 融出证券业务 |
| 交易性金融资产 | 269,243,865.33 | 以管理人身份认购的基金和资产管理计划 |
| 交易性金融资产 | 24,780,880.81 | 持有股票处于限售期内/未流通而受限 |
| 债权投资 | 5,897,452,590.50 | 用于正回购交易担保物 |
| 其他债权投资 | 4,503,259,523.00 | 用于正回购交易担保物 |
| 合计 | 18,368,571,054.48 | / |

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 | | | 384,692,178.61 |
| 其中：美元 | 18,297,434.26 | 6.4601 | 118,203,255.07 |
| 港币 | 320,260,694.07 | 0.8321 | 266,488,923.54 |
| 买入返售金融资产 | | | 52,341,939.65 |
| 其中：港币 | 62,903,424.65 | 0.8321 | 52,341,939.65 |
| 融出资金 | | | 595,145,841.33 |
| 其中：港币 | 715,233,555.26 | 0.8321 | 595,145,841.33 |
| 应收账款 | | | 18,615,602.36 |
| 其中：美元 | 2.98 | 6.4601 | 19.25 |
| 港币 | 22,371,810.01 | 0.8321 | 18,615,583.11 |
| 其他应收款 | | | 8,662,177.00 |
| 其中：港币 | 10,410,019.23 | 0.8321 | 8,662,177.00 |
| 结算备付金 | | | 40,405,154.17 |
| 其中：美元 | 5,548,092.58 | 6.4601 | 35,841,232.87 |
| 港币 | 5,484,823.10 | 0.8321 | 4,563,921.30 |
| 存出保证金 | | | 2,493,117.00 |
| 其中：美元 | 270,000.00 | 6.4601 | 1,744,227.00 |
| 港币 | 900,000.00 | 0.8321 | 748,890.00 |
| 短期借款 | | | 432,816,051.70 |
| 其中：港币 | 520,149,082.68 | 0.8321 | 432,816,051.70 |
| 应付职工薪酬 | | | 34,558,777.20 |
| 其中：港币 | 41,532,000.00 | 0.8321 | 34,558,777.20 |
| 应交税费 | | | 13,728,791.08 |
| 其中：美元 | 2,501.67 | 6.4601 | 16,161.04 |
| 港币 | 16,479,545.77 | 0.8321 | 13,712,630.04 |
| 代理买卖证券款 | | | 233,923,384.89 |
| 其中：美元 | 12,361,929.87 | 6.4601 | 79,859,303.16 |
| 港币 | 185,150,921.43 | 0.8321 | 154,064,081.73 |
| 应付账款 | | | 1,464,057.84 |
| 其中：港币 | 1,759,473.43 | 0.8321 | 1,464,057.84 |
| 其他应付款 | | | 2,818,018.77 |
| 其中：港币 | 3,386,634.75 | 0.8321 | 2,818,018.77 |

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

公司全资子公司财通香港及其下属境外子公司，主要经营地为香港特别行政区，记账本位币为港币。

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 |
|-----------|--------------|------|--------------|
| 金融业发展扶持补贴 | 6,000,000.00 | 其他收益 | 6,000,000.00 |
| 金融业扶持资金 | 1,151,704.91 | 其他收益 | 1,151,704.91 |
| 金融发展专项资金 | 400,362.60 | 其他收益 | 400,362.60 |
| 金融发展专项资金 | 260,000.00 | 其他收益 | 260,000.00 |
| 金融业扶持资金 | 47,080.66 | 其他收益 | 47,080.66 |
| 个税手续费返还收入 | 9,989,013.31 | 其他收益 | 9,989,013.31 |
| 其他 | 384,230.47 | 其他收益 | 384,230.47 |

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 | |
| 财通证券资管 | 杭州 | 杭州 | 证券资产管理业务，公开募集证券投资基金管理业务 | 100.00 | - | 设立 |
| 财通资本 | 杭州 | 杭州 | 实业投资，股权投资，投资管理，投资咨询，资产管理，财务咨询 | 100.00 | - | 设立 |
| 财通香港 | 香港 | 香港 | 证券交易、孖展融资；就证券投资提供意见；就机构融资提供意见；提供资产管理；放债人业务；咨询业务 | 100.00 | - | 设立 |
| 财通国际证券有限公司 | 香港 | 香港 | 证券交易，就证券提供意见 | - | 100.00 | 设立 |
| 财通国际资产管理有限公司 | 香港 | 香港 | 提供资产管理，就证券提供意见 | - | 100.00 | 设立 |
| 财通国际投资有限公司 | 香港 | 香港 | 投资管理（私人基金）及意见提供 | - | 100.00 | 设立 |
| 财通创新 | 上海 | 上海 | 金融产品投资，股权投资 | 100.00 | - | 设立 |

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：

对于公司管理并投资的结构化主体，公司通过评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明公司对结构化主体拥有控制权。若公司对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

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的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

(3). 重要非全资子公司的主要财务信息

适用 不适用

(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

(1). 在子公司所有者权益份额的变化情况的说明

适用 不适用

(2). 交易对于少数股东权益及归属于母公司所有者权益的影响

适用 不适用

其他说明

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 |
|-------------|-------|-----|------|---------|----|--------------|
| | | | | 直接 | 间接 | |
| | | | | | | |

| | | | | | | 的会计处理方法 |
|---------------|----|----|--|-------|-------|---------|
| 财通基金 | 上海 | 上海 | 基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务 | 40.00 | - | 权益法核算 |
| 永安期货 | 杭州 | 杭州 | 商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询，资产管理，基金销售 | 33.54 | - | 权益法核算 |
| 浙江省浙商资产管理有限公司 | 杭州 | 杭州 | 参与省内金融企业不良资产的批量转让业务（凭浙江省人民政府文件经营）。资产管理、资产投资及资产管理相关的重组、兼并、投资管理咨询服务，企业管理、财务咨询及服务 | - | 20.81 | 权益法核算 |

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：
无

(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 | | |
|---------------|------------------|-------------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------------|
| | 财通基金 (合并) | 永安期货 (合并) | 浙江省浙商资产管理有限公司 (合并) | 财通基金 (合并) | 永安期货 (合并) | 浙江省浙商资产管理有限公司 (合并) |
| 流动资产 | 2,266,019,124.27 | 55,099,290,021.85 | 47,288,360,059.43 | 2,272,374,029.81 | 43,582,344,711.66 | 47,203,178,884.64 |
| 非流动资产 | 183,303,646.97 | 1,819,238,993.24 | 18,706,214,236.40 | 57,778,989.84 | 1,798,583,873.59 | 15,389,075,644.27 |
| 资产合计 | 2,449,322,771.24 | 56,918,529,015.09 | 65,994,574,295.83 | 2,330,153,019.65 | 45,380,928,585.25 | 62,592,254,528.91 |
| 流动负债 | 352,175,173.53 | 48,069,507,921.72 | 21,894,020,945.68 | 634,768,726.14 | 36,844,490,728.26 | 18,414,666,686.29 |
| 非流动负债 | 498,432,195.99 | 318,997,879.51 | 29,443,243,247.05 | 164,906,949.60 | 734,658,133.90 | 30,249,956,706.69 |
| 负债合计 | 850,607,369.52 | 48,388,505,801.23 | 51,337,264,192.73 | 799,675,675.74 | 37,579,148,862.16 | 48,664,623,392.98 |
| 少数股东权益 | 5,682,649.86 | | 2,332,294,139.05 | 5,922,603.56 | | 2,284,198,998.19 |
| 归属于母公司股东权益 | 1,593,032,751.86 | 8,530,023,213.86 | 12,325,015,964.06 | 1,524,554,740.35 | 7,801,779,723.09 | 11,643,432,137.74 |
| 按持股比例计算的净资产份额 | 637,213,100.74 | 2,860,799,172.70 | 2,564,835,822.12 | 609,821,896.14 | 2,616,560,870.77 | 2,422,998,227.86 |
| 调整事项 | | 359,168,235.61 | 330,096,008.17 | | 359,168,235.61 | 336,428,584.89 |
| —商誉 | | 359,168,235.61 | 336,428,584.89 | | 359,168,235.61 | 336,428,584.89 |

| | | | | | | |
|----------------------|----------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|------------------|
| 一内部交易未实现利润 | | | | | | |
| 一其他 | | | -6,332,576.72 | | | |
| 对联营企业权益投资的账面价值 | 637,213,100.74 | 3,219,967,408.31 | 2,894,931,830.29 | 609,821,896.14 | 2,975,729,106.38 | 2,759,426,812.75 |
| 存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值 | | | | | | |
| 营业收入 | 264,046,637.95 | 15,539,375,556.58 | 3,017,283,235.64 | 238,514,314.51 | 11,094,744,238.08 | 2,249,894,575.95 |
| 净利润 | 68,238,057.81 | 739,645,964.41 | 1,049,980,597.57 | 74,993,104.86 | 410,183,388.72 | 683,912,578.93 |
| 终止经营的净利润 | | | | | | |
| 其他综合收益 | | -10,664,909.19 | -4,875,803.11 | | 15,517,724.43 | |
| 综合收益总额 | 68,238,057.81 | 728,981,055.22 | 1,045,104,794.46 | 74,993,104.86 | 425,701,113.15 | 683,912,578.93 |
| 本年度收到的来自联营企业的股利 | | | 61,047,523.14 | | | 68,169,780.29 |

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 | | |
| 一净利润 | | |
| 一其他综合收益 | | |
| 一综合收益总额 | | |
| 联营企业： | | |
| 投资账面价值合计 | 386,470,852.06 | 355,836,062.35 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 | | |
| 一净利润 | 2,197,565.70 | -1,243,435.56 |

| | | |
|---------|--------------|---------------|
| —其他综合收益 | | |
| —综合收益总额 | 2,197,565.70 | -1,243,435.56 |

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

(1) 未纳入合并财务报表范围的结构化主体的基础信息

截至2021年6月30日止，由公司（含子公司）管理的未合并结构化主体的资产总额为人民币2,139.72亿元。2021年1-6月，公司（含子公司）从上述结构化主体中获取的管理费收入为人民币6.01亿元。

(2) 与权益相关资产负债的账面价值和最大损失敞口

单位：人民币亿元

| 财务报表列报项目 | 账面价值 | | 最大损失敞口 | |
|----------|------------|-------------|------------|-------------|
| | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 |
| 交易性金融资产 | 142.85 | 126.14 | 142.85 | 126.14 |

(3) 最大损失敞口的确定方法

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司因投资上述资产而可能遭受损失的最大风险敞口为其在报告日的账面价值。

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

参见本节“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 | 3,033,243,980.24 | 21,275,138,284.67 | 623,963,448.77 | 24,932,345,713.68 |
| 1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 3,033,243,980.24 | 21,275,138,284.67 | 623,963,448.77 | 24,932,345,713.68 |
| (1) 债务工具投资 | 1,400,273,996.70 | 7,040,945,848.62 | 636,230.00 | 8,441,856,075.32 |
| (2) 权益工具投资 | 1,632,969,983.54 | 14,041,269,068.05 | 623,327,218.77 | 16,297,566,270.36 |
| (3) 衍生金融资产 | | 192,923,368.00 | | 192,923,368.00 |
| 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 | 871,561,147.11 | 5,918,388,367.42 | | 6,789,949,514.53 |
| (三) 其他权益工具投资 | | | 132,828,205.70 | 132,828,205.70 |
| (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 | 3,904,805,127.35 | 27,193,526,652.09 | 756,791,654.47 | 31,855,123,433.91 |
| (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 | | 52,133,624.48 | | 52,133,624.48 |
| 其中：发行的交易性债券 | | | | |
| 衍生金融负债 | | 52,133,624.48 | | 52,133,624.48 |
| 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 | | 52,133,624.48 | | 52,133,624.48 |
| 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

取自公开市场查询的期末收盘价。

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

采用估值技术（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）确定其公允价值。

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

估值采用本公司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，包括现金流折现法、净资产价值、市场比较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。不可观测输入值包括加权平均资本成本、波动率、流动性折扣等。

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

| 项 目 | 交易性金融资产 | 其他权益工具投资 | 总 计 |
|------------------|----------------|----------------|----------------|
| 2020 年 12 月 31 日 | 637,293,232.43 | 131,444,319.58 | 768,737,552.01 |
| 本期损益影响合计 | -21,630,621.40 | | -21,630,621.40 |
| 本期其他综合收益影响合计 | | 1,383,886.12 | 1,383,886.12 |
| 本期购入 | 114,222,204.00 | | 114,222,204.00 |
| 本期出售及结算 | 11,163,968.24 | | 11,163,968.24 |
| 转入第三层级 | | | |
| 转出第三层级 | 94,757,398.02 | | 94,757,398.02 |
| 2021 年 6 月 30 日 | 623,963,448.77 | 132,828,205.70 | 756,791,654.47 |

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

对于持续的以公允价值计量的资产和负债，本公司在每个报告年末通过重新评估分类，判断各层级之间是否存在转换。本财务报告期间，公司持有的按公允价值计量的金融工具在各层级之间没有重大转换。

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

9、其他

√适用 □不适用

除了上述以公允价值计量的金融资产和金融负债外，本公司管理层已经评估了货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、应收款项、应收利息、存出保证金、应付短期融资券、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付款项、应付利息等，公允价值与账面价值相若。

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

单位：亿元 币种：人民币

| 母公司名称 | 注册地 | 业务性质 | 注册资本 | 母公司对本企业的持股比例% | 母公司对本企业的表决权比例% |
|-------|-----|------|--------|---------------|----------------|
| 浙江金控 | 杭州市 | 金融控股 | 120 亿元 | 29.03 | 29.03 |

本企业的母公司情况的说明：

浙江金控的实际控制方是浙江省财政厅。

本企业最终控制方是浙江省财政厅。

其他说明：

无

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

本企业子公司的情况详见本报告“第十节十、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

本企业重要的合营或联营企业详见本报告“第十节十、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 |
|--------------|--|
| 财通基金 | 本公司之联营企业 |
| 永安期货 | 本公司之联营企业 |
| 浙江永安资本管理有限公司 | 永安期货之子公司 |
| 义乌通杰 | 财通资本公司之子公司义乌市财通棒杰投资管理有限公司（以下简称义乌棒杰公司）之联营企业 |
| 德清锦烨财 | 财通资本公司之联营企业 |

| | |
|---------------|-------------|
| 财通胜遇 | 财通资本公司之联营企业 |
| 财通月桂 | 财通资本公司之联营企业 |
| 财通尤创 | 财通资本公司之联营企业 |
| 财通金榛 | 财通资本公司之联营企业 |
| 上虞财通 | 财通资本公司之联营企业 |
| 财通盛穗 | 财通资本公司之联营企业 |
| 财通富榕 | 财通资本公司之联营企业 |
| 金华稳健 | 财通资本公司之联营企业 |
| 财通恒芯 | 财通资本公司之联营企业 |
| 长兴泰特 | 财通资本公司之联营企业 |
| 酒通投资公司 | 财通创新公司之联营企业 |
| 浙江省浙商资产管理有限公司 | 财通创新公司之联营企业 |

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 |
|----------------------|---------------------|
| 万向信托股份公司 | 本公司之母公司向其委派董事 |
| 浙江义乌农村商业银行股份有限公司 | 本公司之母公司向其委派董事 |
| 浙商银行股份有限公司 | 本公司之母公司之联营企业 |
| 浙江网商银行股份有限公司 | 本公司原独立董事担任该公司独立董事 |
| 台州市金融投资集团有限公司 | 本公司监事担任该公司高管 |
| 浙江舟山定海海洋农村商业银行股份有限公司 | 本公司之母公司向其委派董事 |
| 浙江省财务开发有限责任公司 | 本公司之母公司之原实际控制方（注 1） |

其他说明：

注 1：2020 年 6 月，本公司之母公司之实际控制方由浙江省财务开发有限责任公司变更为浙江省财政厅。2020 年 7 月，上述事项已完成工商变更。根据《上海证券交易所股票上市规则》，过去十二个月内为公司关联方的，视同关联方进行披露。

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 |
|------|----------|-----------|-----------|
| 永安期货 | 接受期货交易服务 | 39,926.26 | 23,491.67 |

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 |
|---------------|---------------|--------------|--------------|
| 永安期货及其管理之产品 | 提供代理买卖证券服务 | 824,352.71 | 1,311,481.74 |
| 浙江永安资本管理有限公司 | 提供代理买卖证券服务 | 7,099.25 | 12,227.01 |
| 台州市金融投资集团有限公司 | 提供代理买卖证券服务 | 36.06 | |
| 浙江省金融控股有限公司 | 提供代理买卖证券服务 | 5,293.45 | |
| 浙江省财务开发有限责任公司 | 提供代理买卖证券服务 | 18,007.42 | |
| 关联自然人 | 提供代理买卖证券服务 | 5,940.63 | 36,131.59 |
| 财通基金 | 出租交易席位 | 2,856,177.4 | 2,117,439.96 |
| 财通基金 | 提供代销基金产品服务 | 4,404,974.41 | 634,937.44 |
| 永安期货 | 提供代销基金产品服务 | 187,971.70 | |
| 永安期货 | 接受代销基金产品服务 | 11.81 | |
| 酒通投资公司 | 提供代销基金产品服务 | | 848,632.08 |
| 浙江省浙商资产管理有限公司 | 提供承销业务和财务顾问服务 | 99,056.60 | |
| 浙商银行股份有限公司 | 提供承销业务和财务顾问服务 | | 8,962,264.15 |
| 万向信托股份公司 | 提供承销业务和财务顾问服务 | | 924,528.30 |
| 永安期货 | 提供承销业务和财务顾问服务 | | 943,396.23 |
| 永安期货 | 提供中间介绍服务 | 5,183,957.92 | 3,427,010.49 |
| 德清锦烨财 | 提供管理服务 | | 363,006.28 |
| 财通胜遇 | 提供管理服务 | | 997,259.90 |
| 财通月桂 | 提供管理服务 | | 478,077.24 |
| 财通尤创 | 提供管理服务 | | 263,308.50 |
| 财通金榛 | 提供管理服务 | 117,924.53 | 125,000.00 |
| 上虞财通 | 提供管理服务 | | 114,421.58 |

| | | | |
|------|--------|--------------|------------|
| 义乌通杰 | 提供管理服务 | | 117,829.70 |
| 财通盛穗 | 提供管理服务 | | 188,195.20 |
| 财通富裕 | 提供管理服务 | 58,478.37 | 62,329.54 |
| 金华稳健 | 提供管理服务 | 26,416.20 | |
| 财通恒芯 | 提供管理服务 | 930,474.34 | |
| 长兴泰特 | 提供管理服务 | 2,095,171.10 | |

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

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 |
|-------|--------|---------------|--------------|
| 永安期货 | 房屋租赁 | 10,096,018.28 | 5,257,666.59 |

关联租赁情况说明

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 出租方名称 | 租赁资产种类 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 |
|-------|--------|---------------|-------------|
| | | 使用权资产 | 使用权资产 |
| 永安期货 | 房屋建筑物 | 78,090,749.18 | - |
| 小计 | | 78,090,749.18 | - |

单位：元 币种：人民币

| 出租方名称 | 租赁资产种类 | 2021年6月30日 租赁负债 | 2020年12月31日 租赁负债 |
|-------|--------|--------------------|---------------------|
| 永安期货 | 房屋建筑物 | 71,415,341.71 | - |
| 小计 | | 71,415,341.71 | - |

(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 | 1,642.61 | 1,706.60 |

(8). 其他关联交易适用 不适用

1) 期末持有关联方作为管理人募集设立的理财产品

单位：元 币种：人民币

| 关联方 | 购买方 | 产品 | 账面价值 |
|------|-----|---------------|----------------|
| 永安期货 | 公司 | 京财赢 FOF1 号 | 10,002,430.56 |
| 财通基金 | 公司 | 财通裕惠 63 个月定期债 | 305,070,000.00 |
| 合计 | | | 315,072,430.56 |

2) 向关联方出售资产管理产品及基金

公司及子公司向关联方出售资产管理计划产品及基金。期末各关联方持有由公司或子公司募集设立的资产管理计划产品及基金的份额如下：

| 关联方 | 产品 | 产品分级 | 份额 |
|--|-----------------|------|------------------|
| 本公司董监高及其关系密切的家庭成员、直接或间接控制本公司的法人的董监高及其关系密切的家庭成员 | 财通资管宸瑞一年持有期混合 C | 不分级 | 20,000.00 |
| | 财通资管丰乾 39 个月 C | 不分级 | 10.00 |
| | 财通资管鸿达纯债 E | 不分级 | 26,977.44 |
| | 财通资管鸿福短债 C | 不分级 | 745.39 |
| | 财通资管鸿利中短债 A | 不分级 | 99.70 |
| | 财通资管鸿益中短债 C | 不分级 | 110.01 |
| | 财通资管价值成长混合 | 不分级 | 519,989.80 |
| | 财通资管价值发现混合 | 不分级 | 946,151.65 |
| | 财通资管均衡价值一年持有期混合 | 不分级 | 999,665.08 |
| | 财通资管消费精选混合 A | 不分级 | 134,203.38 |
| | 丰和两年定开债券 C | 不分级 | 10.00 |
| 万向信托股份公司 | 通鼎青马 1 号 | 不分级 | 36,716,118.60 |
| 永安期货股份有限公司 | 财通资管鸿运中短债 A | 不分级 | 4,572,891.90 |
| | 财通资管鸿福短债 C | 不分级 | 3,271,333.77 |
| | 财通资管鸿福短债 A | 不分级 | 37,297,985.51 |
| 浙江义乌农村商业银行股份有限公司 | 年年赢丰收 18 号 | 不分级 | 19,380,000.00 |
| | 年年赢丰收 19 号 | 不分级 | 8,910,000.00 |
| | 年年赢丰收 20 号 | 不分级 | 18,050,000.00 |
| | 丰赢一年期 1 号 | 不分级 | 36,649,764.59 |
| | 丰赢一年期 2 号 | 不分级 | 11,647,656.79 |
| | 年年赢丰收 1 号 | 不分级 | 7,590,000.00 |
| | 年年赢丰收 2 号 | 不分级 | 9,600,000.00 |
| | 年年赢丰收 3 号 | 不分级 | 3,540,000.00 |
| | 双季赢丰收一号 | 不分级 | 6,950,000.00 |
| | 双季赢丰收二号 | 不分级 | 17,890,000.00 |
| | 财通资管丰乾 39 个月 A | 不分级 | 49,999,000.00 |
| | 丰和两年定开债券 A | 不分级 | 49,999,000.00 |
| 浙江舟山定海海洋农村商业银行股份有限公司 | 双季赢丰收一号 | 不分级 | 16,940,000.00 |
| 浙商银行股份有限公司 | 睿智 6 个月定期开放债 | 不分级 | 1,299,998,558.33 |

上表中“财通资管宸瑞一年持有期混合 C”为财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金的简称；“财通资管丰乾 39 个月 C”为财通资管丰乾 39 个月定期开放债券型证券投资基金的简称；“财通资管鸿达纯债 E”为财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金的简称；“财通资管鸿福短债 C”为财通资管鸿福短债债券型证券投资基金的简称；“财通资管鸿利中短债 A”为财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金的简称；“财通资管鸿益中短债 C”为财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金的简称；“财通资管价值成长混合”为财通资管价值成长混合型证券投资基金的简称；“财通资管价值发现混合”为财通资管价值发现混合型证券投资基金的简称；“财通资管均衡价值一年持有期混合”为财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金的简称；“财通资管消费精选混合 A”为财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金的简称；“丰和两年

定开债券 C”为财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金的简称；“通鼎青马 1 号”为财通证券资管通鼎青马 1 号定向资产管理计划的简称；“财通资管鸿运中短债 A”为财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金的简称；“财通资管鸿福短债 C”为财通资管鸿福短债债券型证券投资基金的简称；“财通资管鸿福短债 A”为财通资管鸿福短债债券型证券投资基金的简称；“年年赢丰收 18 号”为财通证券资管年年赢丰收 18 号集合资产管理计划的简称；“年年赢丰收 19 号”为财通证券资管年年赢丰收 19 号集合资产管理计划的简称；“年年赢丰收 20 号”为财通证券资管年年赢丰收 20 号集合资产管理计划的简称；“丰赢一年期 1 号”为财通证券资管丰赢一年期 1 号集合资产管理计划的简称；“丰赢一年期 2 号”为财通证券资管丰赢一年期 2 号集合资产管理计划的简称；“年年赢丰收 1 号”为财通证券资管年年赢丰收 1 号集合资产管理计划的简称；“年年赢丰收 2 号”为财通证券资管年年赢丰收 2 号集合资产管理计划的简称；“年年赢丰收 3 号”为财通证券资管年年赢丰收 3 号集合资产管理计划的简称；“双季赢丰收一号”为财通证券资管双季赢丰收一号集合资产管理计划的简称；“双季赢丰收二号”为财通证券资管双季赢丰收二号集合资产管理计划的简称；“财通资管丰乾 39 个月 A”为财通资管丰乾 39 个月定期开放债券型证券投资基金的简称；“丰和两年定开债券 A”为财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金的简称；“双季赢丰收一号”为财通证券资管双季赢丰收一号集合资产管理计划的简称；“睿智 6 个月定期开放债”为财通资管睿智 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的简称。

2) 债券质押式正回购

单位：元 币种：人民币

| 关联方名称 | 关联交易名称 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间交易金额 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间交易金额 |
|--------------|----------|--|--|
| 浙商银行股份有限公司 | 债券质押式正回购 | 285,000,000.00 | 95,000,000.00 |
| 浙江网商银行股份有限公司 | 债券质押式正回购 | 1,666,000,000.00 | |

4) 衍生金融工具交易投资收益情况

单位：元 币种：人民币

| 关联方名称 | 关联交易名称 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间 |
|--------------|--------|------------------------------------|------------------------------------|
| 浙江永安资本管理有限公司 | 衍生品交易 | 37,647,405.06 | -101,089.87 |

截止 2021 年 6 月 30 日，本公司与浙江永安资本管理有限公司签订的场外期权及收益互换合约浮亏 15,562,648.88 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 |
| 应收股利 | 永安期货 | | | 52,721,739.00 | |
| 应收款项 | 永安期货 | 1,045,140.09 | 52,257.00 | 934,381.16 | 46,719.06 |
| 其他资产 | 永安期货 | | | 7,205,084.50 | |
| 其他应收款 | 浙江永安资本管理有限公司 | 107,327,381.31 | 5,366,369.07 | | |
| 应收股利 | 浙商资产公司 | 19,254,241.57 | | | |

(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 |
|-------|--------------|--------------|---------------|
| 合同负债 | 永安期货 | 2,000,000.00 | 2,000,000.00 |
| 其他应付款 | 浙江永安资本管理有限公司 | | 31,335,010.00 |

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

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

(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

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

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

公司于 2021 年 7 月发行了 2021 年度第五期短期融资券，发行规模 25 亿元。

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

公司建立了全面的风险管理和内部控制流程，以监督、评估、管理和各项业务相关的风险敞口。公司按照《证券公司全面风险管理规范》的要求，持续建立完善三层级的风险管理制度体

系，其中：第一层级是以《风险管理基本制度》作为根本指导的公司基本制度；第二层级是根据市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险和声誉风险等不同风险类型和经纪业务、自营业务、信用类业务、投行业务等不同业务类型分类制定的矩阵式风险管理核心制度，以及围绕风险控制指标管理、风险限额管理、压力测试、应急管理、业务连续性管理等专项工作制定的核心制度；第三层级是根据风险管理核心制度制定的具体实施细则，以及围绕子公司风险管理、风险管理考核、风险管理问责等工作制定的具体风险管理制度。报告期内，公司为完善风险管理工作，制定或修订的风险管理制度包括：《投资银行类业务内核管理办法（2021 年修订）》。

(2). 风险治理组织架构

√适用 □不适用

公司根据全面风险管理的要求建立分工合理、职责明确、报告关系清晰的风险管理组织架构，包括董事会（风险控制委员会）、监事会，经理层，风险管理部、合规部、各职能部门，业务部门及子公司共四个层级。公司设置首席风险官，领导风险管理部推动公司全面风险管理工作。

2、信用风险

√适用 □不适用

信用风险是指因借款人、交易对手或发行人未能履行其合约责任而导致损失的可能性，或由于借款人、交易对手、发行人的信用评级的变动和履约能力的变化而导致其债务市场价值变动而引起损失的可能性。

公司的信用风险主要来自：为客户提供融资融券、约定购回和股票质押式回购交易等信用融资业务，债券投资和非标准化债权资产等债券类产品投资业务，以及互换、场外期权、远期、信用衍生品等场外衍生品业务。针对不同业务的信用风险，公司采取了以下措施：

(1) 融资融券、约定购回和股票质押式回购等业务存在客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对客户进行征授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；逐日盯市、强化实时监控交易；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。

(2) 债权类产品投资业务存在发行人违约导致损失的信用风险。公司通过内评系统采用定性与定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、密切跟

踪债券发行人经营情况和资信水平、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理。

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

若不考虑担保品或其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面余额。本公司最大信用风险敞口列示如下：

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 |
|------------|-------------------|-------------------|
| 货币资金 | 19,058,086,581.26 | 20,521,337,750.35 |
| 结算备付金 | 5,252,497,849.32 | 4,234,817,326.72 |
| 融出资金 | 19,517,331,753.37 | 19,983,550,132.30 |
| 存出保证金 | 320,149,714.71 | 533,420,494.66 |
| 应收款项 | 217,035,427.23 | 258,105,399.31 |
| 买入返售金融资产 | 2,639,744,375.42 | 3,505,415,741.42 |
| 债权投资 | 8,386,363,518.98 | 6,481,371,854.01 |
| 交易性金融资产 | 8,710,018,420.12 | 9,404,532,958.38 |
| 衍生金融资产 | 192,923,368.00 | 63,404,936.60 |
| 其他债权投资 | 6,789,949,514.53 | 7,036,028,384.00 |
| 其他资产（金融资产） | 1,117,026,111.15 | 841,299,342.72 |
| 合计 | 72,201,126,634.09 | 72,863,284,320.47 |

3、流动风险

√适用 □不适用

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

针对流动性风险，公司通过加强日间流动性管理和日常融资管理，开展高评级债券类资产流动性管理业务，建立三级流动性储备池，改善公司负债结构，强化融资渠道建设，建立健全流动性风险管理信息系统等手段，积极应对流动性压力，防范和控制流动性风险。同时，公司在出现新增投资、新业务开展等情形时，根据业务规模、性质、复杂程度及风险状

况，对流动性风险指标进行压力测试，并将压力测试结果运用于公司的相关决策过程。此外，公司制定了有效的流动性风险应急计划，并定期开展应急演练，以确保公司可以应对紧急情况下的流动性需求。

本公司金融负债未经折现的合同现金流量到期日分析如下：

单位：人民币万元

| 项目 | 2021 年 6 月 30 日 | | | | | |
|-------------|-----------------|--------------|------------|--------------|------------|--------------|
| | 即期偿还 | 3 个月以内 | 3-12 个月 | 1-5 年 | 5 年以上 | 合计 |
| 金融负债 | | | | | | |
| 短期借款 | | 43,335.21 | | | | 43,335.21 |
| 拆入资金 | | 30,017.37 | | | | 30,017.37 |
| 衍生金融负债 | | 752.32 | 224.48 | 4,236.56 | | 5,213.36 |
| 卖出回购金融资产款 | | 1,560,975.28 | 4,736.99 | | | 1,565,712.27 |
| 代理买卖证券款 | 1,885,292.76 | | | | | 1,885,292.76 |
| 应付短期融资款 | | 566,238.10 | | | | 566,238.10 |
| 应付债券 | | 271,155.00 | 819,079.84 | 1,430,410.51 | 380,747.48 | 2,901,392.83 |
| 应付款项 | 119,559.61 | | | | | 119,559.61 |
| 租赁负债 | | 3,672.53 | 10,934.55 | 39,470.21 | 10,899.03 | 64,976.32 |
| 其他负债(金融负债) | 16,976.11 | 6,421.15 | 15,358.89 | 45,290.83 | | 84,046.98 |
| 小计 | 2,021,828.48 | 2,482,566.96 | 850,334.75 | 1,519,408.11 | 391,646.51 | 7,265,784.81 |

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | | | | | |
|-------------|------------------|--------------|----------|--------|-------|--------------|
| | 即期偿还 | 3 个月以内 | 3-12 个月 | 1-5 年 | 5 年以上 | 合计 |
| 金融负债 | | | | | | |
| 短期借款 | | 48,635.24 | | | | 48,635.24 |
| 拆入资金 | | 130,078.59 | | | | 130,078.59 |
| 衍生金融负债 | | 7,573.24 | 1,313.65 | 170.51 | | 9,057.40 |
| 卖出回购金融资产款 | | 1,435,373.09 | | | | 1,435,373.09 |
| 代理买卖证券款 | 1,763,061.35 | | | | | 1,763,061.35 |

| | | | | | | |
|----------------|--------------|--------------|------------|--------------|------------|--------------|
| 代理承销证 券款 | | | 21,800.00 | | | 21,800.00 |
| 应付短期融 资款 | | 750,025.23 | 273,175.12 | | | 1,023,200.35 |
| 应付债券 | | 23,850.00 | 305,291.29 | 1,857,112.25 | 380,782.90 | 2,567,036.44 |
| 应付款项 | 64,105.51 | | | | | 64,105.51 |
| 其他负债 (金融负债) | 19,029.69 | 36,915.78 | 31,326.15 | 24,179.82 | | 111,451.44 |
| 小计 | 1,846,196.55 | 2,432,451.17 | 632,906.21 | 1,881,462.58 | 380,782.90 | 7,173,799.41 |

4、市场风险

√适用 □不适用

市场风险是指因市场价格（利率、汇率、股票价格和商品价格）的不利变动而使公司投资组合发生损失的风险。公司市场风险源自于自营证券、做市业务以及其他投资活动。市场风险主要分为权益价格风险、利率风险、商品价格风险和汇率风险等。其中权益类风险主要是因股票、基金、股指期货以及资产管理计划等权益品种价格或波动率的变化所致；利率风险主要是因债券等固定收益投资收益率曲线结构、利率和信用利差等变化所致；商品价格风险主要是因各类商品价格变化所致；汇率风险主要是因外汇汇率变化所致。

针对市场风险，公司建立了自上而下的风险限额管理体系，根据风险偏好设定公司市场风险容忍度及整体风险限额，并将整体风险限额在各业务条线之间细化分解。公司董事会确定自营业务年度规模、市场风险损失容忍度、损失限额等重大风险限额；公司经营管理层将董事会确定的年度规模、市场风险损失容忍度、重大风险限额等进行分解，并审批确定相应风险限额，包括各自营部门业务规模、投资集中度、平均久期、DV01 以及 VaR 等。公司自营部门在上述基础上进一步细化部门层级的风险限额，并通过组合投资、逐日盯市、对冲缓释、监控预警等手段进行风险控制；风险管理部对公司各项风险限额每日进行监控，当发现有接近或突破风险限额的情况时会及时向公司经营管理层与相关业务部门发送预警和风险提示，业务部门相应提出应对措施。

(1) 利率风险

利率风险主要由于债券等固定收益投资收益率曲线结构、利率和信用利差等变化而导致的。

于各资产负债表日，金融资产和金融负债的重新定价日或到期日（较早日）的情况如下：

单位：人民币万元

2021 年半年度报告

| 项目 | 2021 年 6 月 30 日 | | | | | |
|-------------|-----------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | 3 个月以内 | 3-12 个月 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不生息 | 合计 |
| 金融资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 1,884,388.66 | 20.00 | 21,400.00 | | | 1,905,808.66 |
| 结算备付金 | 525,249.78 | | | | | 525,249.78 |
| 交易性金融资产 | 34,976.70 | 107,080.78 | 623,860.39 | 78,267.75 | 1,629,756.61 | 2,473,942.23 |
| 衍生金融资产 | | | | | 19,292.34 | 19,292.34 |
| 买入返售金融资产 | 112,215.82 | 123,663.59 | 26,695.56 | | 1,399.47 | 263,974.44 |
| 存出保证金 | 32,014.97 | | | | | 32,014.97 |
| 债权投资 | | 10,184.80 | 321,473.54 | 506,978.01 | | 838,636.35 |
| 其他债权投资 | 51,397.01 | 23,368.55 | 383,966.62 | 220,262.77 | | 678,994.95 |
| 其他权益工具投资 | | | | | 13,282.82 | 13,282.82 |
| 融出资金 | 732,366.15 | 1,193,664.35 | | | 25,702.68 | 1,951,733.18 |
| 应收款项 | | | | | 21,703.54 | 21,703.54 |
| 其他资产（金融资产） | | | | | 111,702.61 | 111,702.61 |
| 小计 | 3,372,609.09 | 1,457,982.07 | 1,377,396.11 | 805,508.53 | 1,822,840.07 | 8,836,335.87 |
| 金融负债 | | | | | | |
| 短期借款 | 43,281.61 | | | | | 43,281.61 |
| 拆入资金 | 30,017.37 | | | | | 30,017.37 |
| 衍生金融负债 | | | | | 5,213.36 | 5,213.36 |
| 卖出回购金融资产款 | 1,559,772.32 | 4,610.90 | | | 1,211.13 | 1,565,594.35 |
| 代理买卖证券款 | 1,885,292.76 | | | | | 1,885,292.76 |
| 应付短期融资款 | 564,273.02 | | | | | 564,273.02 |
| 应付债券 | 268,249.33 | 728,171.26 | 1,353,814.77 | 379,987.50 | | 2,730,222.86 |
| 应付款项 | | | | | 119,559.61 | 119,559.61 |
| 租赁负债 | 3,672.53 | 10,934.55 | 39,470.21 | 10,899.03 | | 64,976.32 |
| 其他负债（金融负债） | | 250.82 | 4,946.45 | | 78,328.39 | 83,525.66 |
| 小计 | 4,354,558.94 | 743,967.53 | 1,398,231.43 | 390,886.53 | 204,312.49 | 7,091,956.92 |
| 净敞口 | -981,949.85 | 714,014.54 | -20,835.32 | 414,622.00 | 1,618,527.58 | 1,744,378.95 |

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | | | | | |
|-------------|------------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | 3 个月以内 | 3-12 个月 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不生息 | 合计 |
| 金融资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 2,010,733.78 | 20,000.00 | 21,400.00 | | | 2,052,133.78 |
| 结算备付金 | 423,481.73 | | | | | 423,481.73 |
| 交易性金融资产 | 70,274.66 | 119,813.59 | 627,402.98 | 100,675.43 | 1,575,678.49 | 2,493,845.15 |
| 衍生金融资产 | | | | | 6,340.49 | 6,340.49 |
| 买入返售金融资产 | 171,903.14 | 136,489.19 | 42,149.24 | | | 350,541.57 |
| 存出保证金 | 53,342.05 | | | | | 53,342.05 |
| 债权投资 | 13,019.25 | 10,595.45 | 403,702.62 | 220,819.87 | | 648,137.19 |
| 其他债权投资 | 23,952.60 | 81,636.10 | 537,315.81 | 60,698.33 | | 703,602.84 |
| 其他权益工具投资 | | | | | 13,144.43 | 13,144.43 |
| 融出资金 | 1,998,355.01 | | | | | 1,998,355.01 |
| 应收款项 | | | | | 25,810.54 | 25,810.54 |
| 其他资产（金融资产） | | | | | 84,129.93 | 84,129.93 |
| 小计 | 4,765,062.22 | 368,534.33 | 1,631,970.65 | 382,193.63 | 1,705,103.88 | 8,852,864.71 |
| 金融负债 | | | | | | |
| 短期借款 | 48,579.78 | | | | | 48,579.78 |
| 拆入资金 | 130,038.16 | | | | | 130,038.16 |
| 衍生金融负债 | | | | | 9,057.39 | 9,057.39 |
| 卖出回购金融资产款 | 1,434,231.56 | | | | | 1,434,231.56 |
| 代理买卖证券款 | 1,763,061.34 | | | | | 1,763,061.35 |
| 代理承销证券款 | | 21,800.00 | | | | 21,800.00 |
| 应付短期融资款 | 747,652.03 | 268,037.45 | | | | 1,015,689.48 |
| 应付债券 | 21,131.92 | 226,548.59 | 1,752,728.77 | 380,000.00 | | 2,380,409.28 |
| 应付款项 | | | | | 64,105.51 | 64,105.51 |
| 其他负债（金融负债） | | 249.44 | 4,784.11 | | 105,744.70 | 110,778.25 |
| 小计 | 4,144,694.80 | 516,635.48 | 1,757,512.88 | 380,000.00 | 178,907.60 | 6,977,750.76 |
| 净敞口 | 620,367.42 | -148,101.15 | -125,542.23 | 2,193.63 | 1,526,196.28 | 1,875,113.95 |

下表显示了所有货币的利率同时平行上升或下降 100 个基点的情况下，基于资产负债表日的金融资产与金融负债的结构，对净利润及其他综合收益的影响。

单位：人民币万元

| 2021 年 6 月 30 日 | | |
|-----------------|------------|------------|
| 利率变动 | 对利润的影响 | 对其他综合收益的影响 |
| +100 个基点 | -34,351.13 | -11,472.18 |
| - 100 个基点 | 35,702.31 | 12,018.39 |

| 2020 年 12 月 31 日 | | |
|------------------|------------|------------|
| 利率变动 | 对净利润的影响 | 对其他综合收益的影响 |
| +100 个基点 | -14,001.31 | -13,648.53 |
| -100 个基点 | 15,004.40 | 14,313.78 |

对净利润的影响是指基于一定利率变动对净生息头寸一年内的利息及年末持有交易性的金融资产及金融负债所产生的重估影响。

对其他综合收益的影响是指基于在一定利率变动时对年末持有的固定利率其他债权投资进行重估后公允价值变动的的影响。

上述预测假设各期限资产和负债的收益率平行上移或下移，因此，不反映某些利率变动而剩余利率不变所可能带来的影响。这种预测还基于其他简化的假设，包括所有头寸将持有到期。

本公司认为该假设并不代表本公司的资金使用及利率风险管理的政策，因此上述影响可能与实际情况存在差异。

另外，上述利率变动影响分析仅是作为例证，显示在各个预计受益情形及本公司现时利率风险状况下，净利润和其他综合收益的估计变动。但该影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。

(2) 汇率风险

汇率风险主要由于外汇汇率变化而导致的，本公司持有的外币资产及负债占整体资产及负债比重并不重大；在本公司收入结构中，绝大部分赚取收入的业务均以人民币进行交易。由于外币在本公司资产、负债及收入结构中所占比例较低，汇率风险对本公司目前的经营影响并不重大。

(3) 价格风险

本公司的价格风险主要为权益类风险，权益类风险由股票、基金、股指期货以及资产管理计划等权益品种价格或波动率的变化等而导致。

2021 年 6 月 30 日，若本公司持有权益性金融工具的公允价值上升 10%且其他市场变量保持不变，本公司净利润增加 116,614.36 万元，其他综合收益增加 996.21 万元，净资产增加 117,610.57 万元。若本公司持有权益性金融工具的公允价值下降 10%且其他市场变量保持不变，本公司净利润减少 116,614.36 万元，其他综合收益减少 996.21 万元，净资产减少 117,610.57 万元。

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

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

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

当存在相似经济特征的两个或多个经营分部，同时满足下列条件的，可以合并为一个经营分部：

- 1) 各单项产品或劳务的性质相同或相似；
- 2) 生产过程的性质相同或相似；
- 3) 产品或劳务的客户类型相同或相似；
- 4) 销售产品或提供劳务的方式相同或相似；

5) 生产产品或提供劳务受法律、行政法规的影响相同或相似。

公司以内部组织结构、管理要求等为依据确定经营分部，并以经营分部为基础确定报告分部。分别对财富管理业务、自营证券业务、投资银行业务、受托资产管理业务、证券信用业务、境外业务、总部后台及其他等的经营业绩进行考核。

(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 | 财富管理业务 | 证券自营业务 | 投资银行业务 | 资产管理业务 | 证券信用业务 | 境外业务 | 总部后台及其他 | 合计 |
|---------------|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 本期 | | | | | | | | |
| (1) 营业收入 | 761,533,978.77 | 204,463,681.16 | 302,502,276.80 | 662,740,731.59 | 300,633,420.56 | 74,980,594.67 | 880,208,418.62 | 3,187,063,102.17 |
| 其中：手续费及佣金净收入 | 613,770,490.01 | | 306,380,117.56 | 598,919,989.76 | | 13,624,716.49 | -3,762,661.13 | 1,528,932,652.69 |
| 投资收益及公允价值变动损益 | 685,159.16 | 265,277,122.88 | -2,740,950.69 | 71,661,211.14 | 18,477,681.41 | 33,520,111.98 | 843,447,279.20 | 1,230,327,615.08 |
| 利息净收入 | 139,214,719.77 | -60,813,441.72 | -1,136,890.07 | -9,292,898.15 | 282,155,739.15 | 27,567,965.50 | 29,823,695.05 | 407,518,889.53 |
| 其他收入 | 7,863,609.83 | | | 1,452,428.84 | | 267,800.70 | 10,700,105.50 | 20,283,944.87 |
| (2) 营业支出 | 510,167,301.96 | 32,284,747.95 | 222,699,435.48 | 484,025,295.59 | -44,170,044.57 | 46,658,949.19 | 729,409,004.45 | 1,981,074,690.05 |
| (3) 营业利润 | 251,366,676.81 | 172,178,933.21 | 79,802,841.32 | 178,715,436.00 | 344,803,465.13 | 28,321,645.48 | 150,799,414.17 | 1,205,988,412.12 |
| (4) 资产总额 | 17,828,009,277.13 | 27,098,051,658.35 | 308,035,538.51 | 4,478,291,418.37 | 23,841,498,225.59 | 1,142,564,952.50 | 22,813,762,174.95 | 97,510,213,245.40 |
| (5) 负债总额 | 17,603,107,539.26 | 26,682,352,552.07 | 127,204,625.21 | 2,139,407,229.73 | 23,139,665,320.90 | 657,674,041.22 | 3,896,245,426.09 | 74,245,656,734.48 |
| (6) 补充信息 | | | | | | | | |
| 1) 折旧和摊销费用 | 48,616,714.50 | 757,135.57 | 648,031.54 | 13,430,473.46 | 1,014,298.12 | 4,793,323.29 | 110,202,554.82 | 179,462,531.30 |
| 2) 资本性支出 | 32,588,026.01 | 68,146.75 | 897,449.83 | 2,075,395.70 | 318,720.36 | 368,239.87 | 27,335,465.85 | 63,651,444.37 |
| 3) 信用减值损失 | | 8,041,354.86 | 299,376.00 | -4,154,711.73 | -64,407,754.91 | 304,134.28 | 14,260,998.06 | -45,656,603.44 |
| 4) 其他资产减值损失 | | | | | | | | |

2021 年半年度报告

| | | | | | | | | |
|---------------|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 上期 | | | | | | | | |
| (1) 营业收入 | 679,322,641.21 | 333,546,973.96 | 265,975,021.34 | 744,583,669.30 | 252,620,418.65 | 51,460,594.35 | 556,404,927.63 | 2,883,914,246.44 |
| 其中：手续费及佣金净收入 | 535,987,473.71 | | 247,239,022.37 | 649,450,340.59 | | 13,120,278.18 | -8,032,701.19 | 1,437,764,413.66 |
| 投资收益及公允价值变动损益 | 2,359,230.43 | 372,644,701.39 | 21,070,193.92 | 65,533,189.66 | 31,182,741.22 | 3,856,377.49 | 557,469,953.15 | 1,054,116,387.26 |
| 利息净收入 | 135,741,655.82 | -39,097,727.43 | -2,334,194.95 | 24,715,326.57 | 221,427,142.12 | 34,785,414.94 | 3,691,589.29 | 378,929,206.36 |
| 其他收入 | 5,234,281.25 | | | 4,884,812.48 | 10,535.31 | -301,476.26 | 3,276,086.38 | 13,104,239.16 |
| (2) 营业支出 | 407,798,844.77 | 166,814,438.33 | 213,468,736.86 | 553,717,548.40 | 39,339,862.68 | 33,338,345.80 | 483,115,920.99 | 1,897,593,697.83 |
| (3) 营业利润 | 271,523,796.44 | 166,732,535.63 | 52,506,284.48 | 190,866,120.90 | 213,280,555.97 | 18,122,248.55 | 73,289,006.64 | 986,320,548.61 |
| (4) 资产总额 | 16,831,863,430.00 | 14,402,093,248.29 | 296,660,643.93 | 5,034,561,309.07 | 19,882,911,991.56 | 1,317,923,964.81 | 18,968,431,818.73 | 76,734,446,406.39 |
| (5) 负债总额 | 16,590,016,303.47 | 13,889,708,010.50 | 111,778,542.23 | 2,450,916,094.65 | 19,333,908,887.21 | 810,484,326.26 | 1,935,852,215.70 | 55,122,664,380.02 |
| (6) 补充信息 | | | | | | | | |
| 1) 折旧和摊销费用 | 13,687,854.81 | 920,285.41 | 1,814,735.39 | 6,115,237.71 | 803,048.05 | 1,385,174.16 | 51,984,114.65 | 76,710,450.18 |
| 2) 资本性支出 | 9,653,718.44 | 63,110.05 | 722,525.54 | 7,777,278.54 | 43,561.95 | 319,524.44 | 29,466,684.51 | 48,046,403.47 |
| 3) 信用减值损失 | | 15,522,246.24 | | 2,589,265.32 | -8,150,813.49 | 140,144.31 | 6,548,566.86 | 16,649,409.24 |
| 4) 其他资产减值损失 | | | | | | | | |

(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1月1日至2021年6月30日止期间 |
|------------------------------------|-------------------------|
| 选择简化处理方法的短期租赁费用 | 9,540,241.91 |
| 选择简化处理方法的低价值资产租赁费用（低价值资产的短期租赁费用除外） | - |
| 未纳入租赁负债计量的可变付款额 | - |
| 转租使用权资产取得的收入 | - |
| 与租赁相关的总现金流出 | 82,636,682.07 |

8、期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

√适用 □不适用

参见“附注七 43、应付债券”。

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） | 24,938,451,516.22 | -724,468,183.45 | | | 24,739,422,345.68 |
| 2、衍生金融资产 | 63,404,936.60 | 48,054,511.61 | | | 192,923,368.00 |
| 3、其他债权投资 | 7,036,028,384.00 | | 12,289,710.58 | 1,045,090.25 | 6,789,949,514.53 |
| 4、其他权益工具投资 | 131,444,319.58 | | 1,383,886.12 | | 132,828,205.70 |
| 金融资产小计 | 32,169,329,156.40 | -676,413,671.84 | 13,673,596.70 | 1,045,090.25 | 31,855,123,433.91 |
| 投资性房地产 | | | | | |

| | | | | | |
|---------|-------------------|-----------------|---------------|--------------|-------------------|
| 生产性生物资产 | | | | | |
| 其他 | | | | | |
| 上述合计 | 32,169,329,156.40 | -676,413,671.84 | 13,673,596.70 | 1,045,090.25 | 31,855,123,433.91 |
| 金融负债 | 90,573,908.30 | 27,346,025.21 | | | 52,133,624.48 |

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 | 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 | 19,058,086,581.26 | - | - | - | - | - |
| 结算备付金 | 5,252,497,849.32 | - | - | - | - | - |
| 融出资金 | 19,517,331,753.37 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | 192,923,368.00 | - | - |
| 存出保证金 | 320,149,714.71 | - | - | - | - | - |
| 应收款项 | 217,035,427.23 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 2,639,744,375.42 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 24,739,422,345.68 | - | - |
| 债权投资 | 8,386,363,518.98 | - | - | - | - | - |
| 其他债权投资 | - | 6,789,949,514.53 | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | 132,828,205.70 | - | - | - |

2021年半年度报告

| 其他资产金融资产部分 | 1,097,771,869.58 | - | - | - | - | - |
|------------|-------------------|-----------------------------|-----------------------------------|---------------------------|--|-------------------------------------|
| 合计 | 56,488,981,089.87 | 6,789,949,514.53 | 132,828,205.70 | 24,932,345,713.68 | - | - |
| 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 | 20,521,337,750.35 | - | - | - | - | - |
| 结算备付金 | 4,234,817,326.72 | - | - | - | - | - |
| 融出资金 | 19,983,550,132.30 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | 63,404,936.60 | - | - |
| 存出保证金 | 533,420,494.66 | - | - | - | - | - |
| 应收款项 | 258,105,399.31 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 3,505,415,741.42 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 24,938,451,516.22 | - | - |
| 债权投资 | 6,481,371,854.01 | - | - | - | - | - |
| 其他债权投资 | - | 7,036,028,384.00 | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | 131,444,319.58 | - | - | - |
| 其他资产金融资产部分 | 841,299,342.72 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 56,359,318,041.49 | 7,036,028,384.00 | 131,444,319.58 | 25,001,856,452.82 | - | - |

(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 | 432,816,051.70 | - | - | - |
| 应付短期融资款 | 5,642,730,244.08 | - | - | - |
| 拆入资金 | 300,173,694.44 | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | 52,133,624.48 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 15,655,943,492.51 | - | - | - |
| 代理买卖证券款 | 18,852,927,560.34 | - | - | - |
| 代理承销证券款 | - | - | - | - |
| 应付债券 | 27,302,228,611.93 | - | - | - |
| 应付款项 | 1,195,596,124.63 | - | - | - |
| 其他负债金融负债部分 | 835,256,591.71 | - | - | - |
| 合计 | 70,217,672,371.34 | 52,133,624.48 | - | - |
| 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 | 485,797,765.03 | - | - | - |
| 应付短期融资款 | 10,156,894,839.47 | - | - | - |
| 拆入资金 | 1,300,381,555.60 | - | - | - |

| | | | | |
|------------|-------------------|---------------|---|---|
| 衍生金融负债 | - | 90,573,908.30 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 14,342,315,565.97 | - | - | - |
| 代理买卖证券款 | 17,630,613,478.65 | - | - | - |
| 代理承销证券款 | 218,000,000.00 | - | - | - |
| 应付债券 | 23,804,092,796.22 | - | - | - |
| 应付款项 | 641,055,098.03 | - | - | - |
| 其他负债金融负债部分 | 1,107,782,529.17 | - | - | - |
| 合计 | 69,686,933,628.14 | 90,573,908.30 | - | - |

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 | 118,469,071.34 | 3,888,490.52 | | | 135,517,285.87 |
| 2、衍生金融资产 | | | | | |
| 3、债权投资 | | | | 51,590,200.00 | 31,619,800.00 |
| 4、其他债权投资 | | | | | |
| 5、其他权益工具投资 | | | | | |
| 金融资产小计 | 118,469,071.34 | 3,888,490.52 | | 51,590,200.00 | 167,137,085.87 |
| 金融负债 | | | | | |

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 | | | | | | | | | | | |
| 永安期货 | 2,626,558,962.18 | | | 247,999,360.70 | -3,576,797.24 | -184,261.53 | | | | 2,870,797,264.11 | |
| 财通基金 | 609,821,896.14 | | | 27,391,204.60 | | | | | | 637,213,100.74 | |
| 金华民营稳健 | 2,482,630.68 | | | | | | | | | 2,482,630.68 | |
| 小计 | 3,238,863,489.00 | | | 275,390,565.30 | -3,576,797.24 | -184,261.53 | | | | 3,510,492,995.53 | |
| 合计 | 3,238,863,489.00 | | | 275,390,565.30 | -3,576,797.24 | -184,261.53 | | | | 3,510,492,995.53 | |

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 | 1,586,103,382.86 | 989,374,279.38 | 870,322,722.51 | 1,705,154,939.73 |
| 二、离职后福利-设定提存计划 | 25,043,653.99 | 56,631,623.93 | 39,824,048.60 | 41,851,229.32 |
| 三、辞退福利 | | | | |
| 四、一年内到期的其他福利 | | | | |
| 合计 | 1,611,147,036.85 | 1,046,005,903.31 | 910,146,771.11 | 1,747,006,169.05 |

(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 | 1,521,822,131.56 | 893,590,225.69 | 801,185,095.67 | 1,614,227,261.58 |
| 二、职工福利费 | 5,206,693.58 | 13,945,028.80 | 13,955,328.80 | 5,196,393.58 |
| 三、社会保险费 | 9,912,520.68 | 33,903,298.95 | 22,118,902.38 | 21,696,917.25 |
| 其中：医疗保险费 | 9,902,439.28 | 33,206,159.39 | 21,453,678.39 | 21,654,920.28 |
| 工伤保险费 | 2,388.79 | 374,621.43 | 343,319.55 | 33,690.67 |
| 生育保险费 | 7,692.61 | 319,118.90 | 318,505.21 | 8,306.30 |
| 其他 | | 3,399.23 | 3,399.23 | |
| 四、住房公积金 | 953,038.00 | 29,773,530.40 | 29,726,623.40 | 999,945.00 |
| 五、工会经费和职工教育经费 | 48,208,999.04 | 18,162,195.54 | 3,336,772.26 | 63,034,422.32 |
| 六、短期带薪缺勤 | | | | |
| 七、短期利润分享计划 | | | | |
| 合计 | 1,586,103,382.86 | 989,374,279.38 | 870,322,722.51 | 1,705,154,939.73 |

(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 | 2,996,788.89 | 25,546,136.51 | 23,711,000.09 | 4,831,925.31 |
| 2、失业保险费 | 3,477.33 | 895,581.08 | 830,115.43 | 68,942.98 |
| 3、企业年金缴费 | 22,043,387.77 | 30,189,906.34 | 15,282,933.08 | 36,950,361.03 |
| 合计 | 25,043,653.99 | 56,631,623.93 | 39,824,048.60 | 41,851,229.32 |

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 | 1,217,037,314.73 | 862,937,617.82 |
| 其中：货币资金及结算备付金利息收入 | 225,602,174.44 | 208,620,486.80 |
| 拆出资金利息收入 | | |
| 融出资金利息收入 | 621,434,487.14 | 430,687,412.15 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 75,100,369.82 | 85,827,583.22 |
| 其中：约定购回利息收入 | 150,965.89 | 251,997.72 |
| 股权质押回购利息收入 | 72,364,356.66 | 83,773,828.52 |
| 债权投资利息收入 | 154,583,690.28 | 8,188,707.04 |
| 其他债权投资利息收入 | 140,250,289.32 | 129,592,272.61 |
| 其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入 | 66,303.73 | 21,156.00 |
| | | |
| | | |
| 利息支出 | 854,560,303.81 | 543,702,537.83 |
| 其中：短期借款利息支出 | | |
| 应付短期融资款利息支出 | 53,586,811.72 | 69,297,593.16 |
| 拆入资金利息支出 | 22,167,149.61 | 20,682,388.81 |
| 其中：转融通利息支出 | 12,277,885.75 | - |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 181,803,499.05 | 77,930,569.45 |
| 其中：报价回购利息支出 | 10,607,695.04 | |
| 代理买卖证券款利息支出 | 34,627,846.43 | 30,595,396.64 |
| 长期借款利息支出 | | |
| 应付债券利息支出 | 476,158,785.91 | 316,576,909.67 |
| 其中：次级债券利息支出 | 313,473,463.71 | 292,566,473.59 |
| 收益凭证利息支出 | 76,101,110.75 | 25,306,661.31 |
| 租赁负债利息支出 | 8,488,983.57 | - |
| 其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出 | 1,626,116.77 | 3,313,018.79 |
| 利息净收入 | 362,477,010.92 | 319,235,079.99 |

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 | 612,998,293.59 | 535,675,775.60 |

| | | |
|----------------|----------------|----------------|
| 证券经纪业务收入 | 645,707,934.78 | 572,274,594.52 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 499,001,837.09 | 494,233,982.96 |
| 交易单元席位租赁 | 18,472,550.70 | 17,034,867.41 |
| 代销金融产品业务 | 128,233,546.99 | 61,005,744.15 |
| 证券经纪业务支出 | 32,709,641.19 | 36,598,818.92 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 32,709,641.19 | 36,598,818.92 |
| 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 | 306,380,117.56 | 247,380,531.81 |
| 投资银行业务收入 | 319,352,759.07 | 251,680,060.11 |
| 其中：证券承销业务 | 280,820,125.78 | 222,544,924.53 |
| 证券保荐业务 | 6,121,626.84 | 1,023,441.96 |
| 财务顾问业务 | 32,411,006.45 | 28,111,693.62 |
| 投资银行业务支出 | 12,972,641.51 | 4,299,528.30 |
| 其中：证券承销业务 | 12,916,037.73 | 4,242,924.52 |
| 证券保荐业务 | | |
| 财务顾问业务 | 56,603.78 | 56,603.78 |
| 4. 资产管理业务净收入 | | |
| 资产管理业务收入 | | |
| 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 | 7,378,474.25 | 6,851,841.42 |
| 投资咨询业务收入 | 7,378,474.25 | 6,851,841.42 |
| 投资咨询业务支出 | | |
| 7. 其他手续费及佣金净收入 | | |
| 其他手续费及佣金收入 | | |
| 其他手续费及佣金支出 | | |
| 合计 | 926,756,885.40 | 789,908,148.83 |
| 其中：手续费及佣金收入 | 972,439,168.10 | 830,806,496.05 |
| 手续费及佣金支出 | 45,682,282.70 | 40,898,347.22 |

(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 | 6,399,056.61 | 3,159,905.66 |
| 并购重组财务顾问业务净收入--其他 | 94,339.62 | - |
| 其他财务顾问业务净收入 | 25,861,006.44 | 24,895,184.18 |

(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 | 40,039,963,378.16 | 92,808,229.81 | 28,111,504,778.40 | 32,814,034.59 |
| 信托 | 2,953,692,800.00 | 8,691,437.07 | 2,762,262,893.00 | 4,933,778.84 |
| 其他 | 42,612,471,761.72 | 26,733,880.11 | 50,244,266,209.77 | 23,257,930.72 |
| 合计 | 85,606,127,939.88 | 128,233,546.99 | 81,118,033,881.17 | 61,005,744.15 |

(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 | 275,390,565.30 | 156,464,477.82 |
| 处置长期股权投资产生的投资收益 | | |
| 金融工具投资收益 | 1,320,762,967.89 | 238,245,875.34 |
| 其中：持有期间取得的收益 | 1,132,550,790.76 | 250,438,056.65 |
| —交易性金融工具 | 1,132,550,790.76 | 250,438,056.65 |
| —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 | 188,212,177.13 | -12,192,181.31 |
| —交易性金融工具 | 354,165,521.17 | 90,235,204.26 |
| —其他债权投资 | -2,242,223.66 | 5,056,815.49 |
| —债权投资 | | |
| —衍生金融工具 | -163,711,120.38 | -107,484,201.06 |
| 其他 | | |
| 债务重组收益 | | |
| 合计 | 1,596,153,533.19 | 394,710,353.16 |

(2). 交易性金融工具投资收益明细表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 交易性金融工具 | | 本期发生额 | 上期发生额 |
|---------------------------|--------|------------------|----------------|
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 持有期间收益 | 1,132,550,790.76 | 250,438,056.65 |
| | 处置取得收益 | 354,165,521.17 | 90,235,204.26 |
| 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 | | |
| | 处置取得收益 | | |
| 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 | 持有期间收益 | | |
| | 处置取得收益 | | |

投资收益的说明：

本公司不存在投资收益汇回的重大限制。

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 | -723,457,891.64 | 452,053,137.49 |
| 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 | 75,400,536.82 | -32,508,466.03 |
| 其他 | | |
| 合计 | -648,057,354.82 | 419,544,671.46 |

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 | 1,046,005,903.31 | 882,095,301.71 |
| 使用权资产折旧 | 61,995,149.09 | - |
| 电子设备运转费 | 57,857,446.78 | 42,619,462.37 |
| 折旧费 | 48,951,713.56 | 36,251,607.53 |
| 交易所设施使用费 | 37,026,610.05 | 35,356,669.90 |
| 无形资产摊销 | 32,160,386.24 | 23,043,596.42 |
| 邮电通讯费 | 31,952,489.92 | 36,104,884.97 |
| 营销支出 | 23,509,810.66 | 12,188,678.92 |
| 业务宣传费 | 19,298,679.05 | 16,333,561.53 |
| 咨询费 | 18,028,511.98 | 10,818,687.08 |
| 租赁费 | 6,855,369.91 | 112,429,543.33 |
| 其他 | 82,491,157.85 | 80,672,675.17 |
| 合计 | 1,466,133,228.40 | 1,287,914,668.93 |

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 | 33,971.48 | 主要是固定资产处置收益 |
| 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） | 18,232,391.95 | 主要是政府补助 |
| 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 | 1,258,385.60 | 主要是收到已单独计提坏账准备的应收款的还款 |
| 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 | -1,005,384.93 | 主要是对外捐赠和赔偿支出 |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目 | | |
| 所得税影响额 | -4,285,924.62 | |
| 少数股东权益影响额 | | |
| 合计 | 14,233,439.48 | |

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 | 4.40 | 0.29 | 0.28 |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 4.34 | 0.28 | 0.27 |

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：陆建强

董事会批准报送日期：2021年8月25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

| 发文时间 | 文件名称 | 文号 |
|----------------|---------------------------------------|-----------------|
| 2021 年 2 月 8 日 | 《关于同意财通证券股份有限公司向专业投资者公开发行次级公司债券注册的批复》 | 证监许可〔2021〕451 号 |

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2015 年-2020 年，公司在证券公司分类监管评价中获得 A 类 A 级评价。