

公司代码：601162

公司简称：天风证券

天风证券股份有限公司 2020 年半年度报告

重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。

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

五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

不适用

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

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

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、重大风险提示

公司已在本报告中详细披露存在的风险，敬请查阅本报告“第四节 经营情况的讨论与分析——二、其他披露事项——（二）可能面对的风险”。

十、其他

适用 不适用

目录

第一节	释义	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	公司业务概要.....	13
第四节	经营情况的讨论与分析.....	16
第五节	重要事项.....	27
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	43
第七节	优先股相关情况.....	47
第八节	董事、监事、高级管理人员情况.....	48
第九节	公司债券相关情况.....	49
第十节	财务报告.....	60
第十一节	备查文件目录.....	189
第十二节	证券公司信息披露.....	190

第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

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

第二节 公司简介和主要财务指标

一、 公司信息

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

注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00
净资产	12,254,578,774.56	8,751,580,558.96

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

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

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

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

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

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

6、经国家外汇管理局核准或认可的业务资格：经营外汇业务许可证。

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

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

9、经全国银行间同业拆借中心核准或认可的业务资格：银行间债券市场尝试做市业务权限。

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

二、联系人和联系方式

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

三、基本情况变更简介

公司注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
公司注册地址的邮政编码	430000
公司办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
公司办公地址的邮政编码	430000
公司网址	www.tfzq.com
电子信箱	dongban@tfzq.com
报告期内变更情况查询索引	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
登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.sse.com.cn/
公司半年度报告备置地点	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
报告期内变更情况查询索引	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	天风证券	601162	不适用

六、其他有关资料

□适用 √不适用

七、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比 上年同期增 减(%)
营业收入	2,061,307,013.11	1,814,478,415.81	13.60
归属于母公司股东的净利润	404,988,465.61	168,189,542.25	140.79
归属于母公司股东的扣除非 经常性损益的净利润	407,891,864.44	128,410,037.63	217.65
经营活动产生的现金流量净 额	-980,922,497.96	-511,048,581.77	不适用
其他综合收益	-224,935,008.58	-281,270,960.07	不适用
	本报告期末	上年度末	本报告期末 比上年度末 增减(%)
资产总额	74,082,878,337.20	59,920,334,525.05	23.64
负债总额	51,229,985,732.55	42,413,087,992.68	20.79
归属于母公司股东的权益	17,727,350,912.43	12,123,150,062.81	46.23
所有者权益总额	22,852,892,604.65	17,507,246,532.37	30.53

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期 增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.068	0.032	112.50
稀释每股收益(元/股)	0.068	0.032	112.50
扣除非经常性损益后的基本每股收益 (元/股)	0.069	0.025	176.00
加权平均净资产收益率(%)	2.71	1.39	增加1.32个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资 产收益率(%)	2.73	1.06	增加1.67个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

□适用 √不适用

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	12,254,578,774.56	8,751,580,558.96
净资产	16,960,004,642.90	11,350,179,324.21
净资本/各项风险准备之和(%)	169.26	170.72
资本杠杆率(%)	15.12	15.66

流动性覆盖率(%)	713.86	372.07
净稳定资金率(%)	140.47	139.81
净资本/净资产(%)	72.26	77.11
净资本/负债(%)	32.61	26.74
净资产/负债(%)	45.14	34.68
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	18.29	27.36
自营固定收益类证券/净资本(%)	203.61	250.08

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	-97,595.55	
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	317,398.02	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		

受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-3,957,115.35	
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	960,151.78	
所得税影响额	-126,237.73	
合计	-2,903,398.83	

十、其他

√适用 □不适用

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

（一）合并财务报表主要项目

项目	2020年6月30日	2019年12月31日	增减幅度(%)
货币资金	12,415,856,335.91	8,879,676,149.48	39.82
结算备付金	3,512,661,195.49	1,887,047,540.15	86.15
拆出资金	200,040,000.00	150,102,500.00	33.27
融出资金	5,735,476,576.81	6,068,122,661.53	-5.48
衍生金融资产	65,084.41		不适用
存出保证金	2,579,390,915.43	1,914,546,749.91	34.73
应收款项	1,555,324,762.22	747,858,938.94	107.97
买入返售金融资产	3,415,092,733.22	3,505,744,837.42	-2.59
交易性金融资产	27,723,728,836.43	23,141,487,599.28	19.80
其他债权投资	933,390,123.43	979,663,520.62	-4.72
其他权益工具投资	3,796,823,024.91	3,838,700,733.98	-1.09
长期股权投资	4,698,572,028.32	644,871,981.39	628.61
投资性房地产	153,499,774.52	156,642,036.79	-2.01
固定资产	107,741,379.70	113,148,035.12	-4.78
在建工程	479,151,851.80	395,860,677.04	21.04
无形资产	568,182,697.67	584,113,695.22	-2.73
商誉	67,343,299.74	66,634,466.97	1.06
递延所得税资产	226,428,661.38	176,750,717.71	28.11
其他资产	5,914,109,055.81	6,669,361,683.50	-11.32
资产总计	74,082,878,337.20	59,920,334,525.05	23.64
应付短期融资款	3,682,770,493.13	4,101,653,977.00	-10.21
拆入资金	400,081,111.11	150,068,750.00	166.60
衍生金融负债	872,444.00	274,923.17	217.34
卖出回购金融资产款	8,754,939,653.06	10,037,807,023.02	-12.78
代理买卖证券款	11,046,627,571.97	7,512,796,666.15	47.04
应付职工薪酬	284,955,237.83	237,678,307.95	19.89
应交税费	156,263,870.19	68,841,127.56	126.99
应付款项	48,016,517.89	34,316,294.16	39.92

合同负债	45,201,032.05		不适用
应付债券	24,054,165,675.02	18,020,388,943.79	33.48
递延收益	195,000.00	195,000.00	
递延所得税负债	89,390,035.33	99,850,963.76	-10.48
其他负债	2,666,507,090.97	2,149,216,016.12	24.07
负债合计	51,229,985,732.55	42,413,087,992.68	20.79
实收资本	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00	28.69
资本公积	8,100,185,352.18	4,259,929,865.37	90.15
其他综合收益	-331,685,649.81	-241,330,968.35	不适用
盈余公积	292,289,870.75	292,289,870.75	
一般风险准备	628,846,808.64	619,594,651.18	1.49
未分配利润	2,371,747,250.67	2,012,666,643.86	17.84
归属于母公司所有者权益合计	17,727,350,912.43	12,123,150,062.81	46.23
少数股东权益	5,125,541,692.22	5,384,096,469.56	-4.80
所有者权益合计	22,852,892,604.65	17,507,246,532.37	30.53
负债和所有者权益总计	74,082,878,337.20	59,920,334,525.05	23.64
项目	2020 年半年度	2019 年半年度	增减幅度(%)
营业收入	2,061,307,013.11	1,814,478,415.81	13.60
利息净收入	-200,239,813.36	-166,738,298.39	不适用
手续费及佣金净收入	1,357,199,164.46	987,733,640.55	37.41
投资收益	830,490,935.06	594,903,767.13	39.60
其他收益	4,649,322.36	1,241,293.39	274.55
公允价值变动收益	44,284,321.61	158,418,630.22	-72.05
汇兑收益	-247,537.45	-77,341.06	不适用
其他业务收入	25,092,925.01	239,000,626.91	-89.50
资产处置收益	77,695.42	-3,902.94	不适用
营业支出	1,442,455,076.59	1,602,818,360.47	-10.01
税金及附加	16,340,729.91	13,786,797.76	18.52
业务及管理费	1,314,331,982.16	1,204,007,094.47	9.16
信用减值损失	107,810,821.25	146,343,201.72	-26.33
其他资产减值损失		8,846,560.21	-100.00
其他业务成本	3,971,543.27	229,834,706.31	-98.27
营业利润	618,851,936.52	211,660,055.34	192.38
营业外收入	2,097,937.38	57,049,894.28	-96.32
营业外支出	10,562,268.04	5,181,783.67	103.83
利润总额	610,387,605.86	263,528,165.95	131.62
所得税费用	70,145,249.26	45,587,417.02	53.87
净利润	540,242,356.60	217,940,748.93	147.88
归属于母公司股东的净利润	404,988,465.61	168,189,542.25	140.79
少数股东损益	135,253,890.99	49,751,206.68	171.86
其他综合收益的税后净额	-224,935,008.58	-281,270,960.07	不适用
综合收益总额	315,307,348.02	-63,330,211.14	不适用

(一) 母公司财务报表主要项目

项目	2020年6月30日	2019年12月31日	增减幅度(%)
货币资金	9,560,636,502.48	7,087,678,848.26	34.89
结算备付金	3,895,848,150.35	2,195,561,198.20	77.44
拆出资金	200,040,000.00	150,102,500.00	33.27
融出资金	5,735,476,576.81	6,068,122,661.53	-5.48
存出保证金	418,992,358.47	284,663,124.79	47.19
应收款项	992,965,310.58	730,261,330.94	35.97
买入返售金融资产	2,623,572,051.23	3,119,101,139.14	-15.89
交易性金融资产	24,491,592,457.26	20,720,477,933.83	18.20
债权投资	101,345,947.76	105,116,439.56	-3.59
其他债权投资	933,390,123.43	979,663,520.62	-4.72
其他权益工具投资	260,549,056.59	258,656,402.89	0.73
长期股权投资	7,599,125,699.67	3,328,033,987.00	128.34
投资性房地产	16,702,440.06	17,083,290.24	-2.23
固定资产	72,789,902.55	76,616,522.21	-4.99
在建工程	109,775,497.71	91,258,949.32	20.29
无形资产	83,775,351.46	90,927,995.09	-7.87
递延所得税资产	109,962,041.24	84,100,480.78	30.75
其他资产	5,033,056,144.73	3,656,231,203.49	37.66
资产总计	62,239,660,696.79	49,043,657,527.89	26.91
应付短期融资款	3,682,770,493.13	4,101,653,977.00	-10.21
拆入资金	400,081,111.11	150,068,750.00	166.60
衍生金融负债	872,444.00	274,923.17	217.34
卖出回购金融资产款	8,749,936,157.22	9,972,434,386.59	-12.26
代理买卖证券款	7,705,488,039.36	4,968,008,458.78	55.10
应付职工薪酬	270,040,222.13	222,587,143.24	21.32
应交税费	179,497,286.28	59,938,479.88	199.47
合同负债	18,237,188.56		不适用
应付债券	24,028,954,910.54	18,000,551,095.47	33.49
递延所得税负债	107,586,138.41	104,957,045.41	2.50
其他负债	136,192,063.15	113,003,944.14	20.52
负债合计	45,279,656,053.89	37,693,478,203.68	20.13
实收资本	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00	28.69
资本公积	7,295,985,273.63	3,457,303,927.45	111.03
其他综合收益	-150,838,487.57	-151,253,075.11	不适用
盈余公积	292,289,870.75	292,289,870.75	
一般风险准备	628,846,808.64	619,594,651.18	1.49
未分配利润	2,227,753,897.45	1,952,243,949.94	14.11
所有者权益合计	16,960,004,642.90	11,350,179,324.21	49.42
负债和所有者权益总计	62,239,660,696.79	49,043,657,527.89	26.91
项目	2020年半年度	2019年半年度	增减幅度(%)
营业收入	1,658,776,363.87	1,434,032,054.77	15.67

利息净收入	-258,972,667.10	-194,384,136.42	不适用
手续费及佣金净收入	1,241,741,245.40	937,780,253.36	32.41
投资收益	660,817,662.05	463,406,018.29	42.60
其他收益	4,489,851.38	1,098,608.05	308.69
公允价值变动收益	10,441,902.65	226,146,362.18	-95.38
汇兑收益	134,494.66	13,545.19	892.93
其他业务收入	135,795.15		不适用
资产处置收益	-11,920.32	-28,595.88	不适用
营业支出	1,242,104,544.85	1,162,748,727.94	6.82
税金及附加	14,789,313.73	11,737,462.81	26.00
业务及管理费	1,123,814,124.55	1,000,938,245.43	12.28
信用减值损失	103,120,256.39	149,692,169.52	-31.11
其他业务成本	380,850.18	380,850.18	
营业利润	416,671,819.02	271,283,326.83	53.59
营业外收入	1,870,172.93	56,438,860.95	-96.69
营业外支出	10,506,741.67	4,849,534.61	116.65
利润总额	408,035,250.28	322,872,653.17	26.38
所得税费用	83,276,892.82	85,273,941.68	-2.34
净利润	324,758,357.46	237,598,711.49	36.68
其他综合收益的税后净额	414,138.73	-136,616,384.43	不适用
综合收益总额	325,172,496.19	100,982,327.06	222.01

第三节 公司业务概要

一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

（一）公司所从事的主要业务及经营模式

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

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

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

资产管理业务主要是公司作为资产管理人，根据有关法律法规规定与客户签订资产管理合同，根据约定的方式、条件、要求及限制，对客户资产进行经营，为客户提供证券及其他金融产品投资管理服务，获取管理费、业绩报酬等收入。

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

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

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

（二）行业情况说明

2020 年上半年，面对新冠肺炎疫情的重大考验，金融监管部门推出一系列增加流动性、刺激经济的对冲政策，加快推进资本市场全面深化改革：科创板再融资、减持等关键制度创新持续深化，创业板改革并试点注册制准备工作基本就绪，新三板改革平稳落地……新证券法的实施为改革提供了法律保障，资本市场迎来新一轮的发展窗口期。据中国证券业协会统计，截至 2020 年 6 月末，我国证券行业的总资产、净资产分别为 8.03 万亿元、2.09 万亿元，同比增加 13.06%、6.66%。

2020 年上半年证券行业实现营业收入 2,134.04 亿元,同比增长 19.39%;实现净利润 831.47 亿元,同比增长 24.73%。

从 A 股市场表现看,资本市场展现出强大韧性。节后受新冠肺炎疫情及海外市场剧烈波动影响,A 股市场也出现下挫。在 3 月中旬再次探底后,A 股开始逐步摆脱国内疫情和国际金融市场动荡两轮“冲击波”的影响,在震荡中企稳、调整、蓄势上升。截至 6 月末,上证指数较年初仅下跌 2.15%,深证成指上涨近 15%,创业板指上涨 35%。

二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

√适用 □不适用

截至 2020 年 6 月 30 日,本公司总资产人民币 740.83 亿元,较上年增加 23.64%。其中,以金融资产投资合计人民币 324.54 亿元,较上年增 16.07%,主要系自营业务规模的增加所致;长期股权投资合计人民币 46.99 亿元,较上年增 628.61%,主要是新增权益法核算的长期股权投资所致。

其中:境外资产 29.11 (单位:亿元 币种:人民币),占总资产的比例为 3.93%。

三、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

1、适应市场趋势的业务布局

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

2、有效的风险控制

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

3、富有竞争力的人才团队

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

第四节 经营情况的讨论与分析

一、经营情况的讨论与分析

2020 年上半年,在新冠肺炎疫情影响下,全球金融市场动荡,对中国经济也带来了严重冲击。面对复杂严峻的国内外形势,我国一方面积极应对疫情变化,在全球范围内率先控制住疫情;另一方面,果断加大货币政策逆周期调节力度,维护金融市场稳定,防范化解重大金融风险,进一步深化金融改革开放。从宏观层面看,各地通过扎实做好“六稳”工作,全面落实“六保”任务,正推进国民经济快速复苏。

面对新冠疫情及海外市场剧烈波动影响,A 股市场展现出强大韧性。截至报告期末,上证指数较年初仅下跌 2.15%,深证成指上涨近 15%,创业板指上涨 35%。报告期内,公司持续聚焦主业,坚持推进大投行服务能力和财富管理能为双核驱动的综合金融服务能力建设,多项业绩指标较去年同期有所提升。

1、经纪业务

报告期内,在市场行情回暖,投资者情绪升温的背景下,公司经纪业务客户数、托管规模均有显著增长:累计新增普通客户 10.91 万户,同比增长 27.02%;托管客户资产共 2,186 亿元,较 2019 年末增长 22.85%。截至报告期末,公司营业部及分公司数量分别为 103 家和 15 家。

2、投行业务

报告期内,公司实现投资银行业务收入 5 亿元,同比增长 108.33%。债券承销继续保持较快增长势头,共承销债券 290 支,总承销金额 701.46 亿元。其中企业债承销规模排名行业第 5,公司债承销规模排名行业第 10。股权融资业务方面,完成苏州工业园区凌志软件股份有限公司科创板首次公开发行股票;同时协创数据技术股份有限公司创业板首次公开发行股票项目、苏州东山精密制造股份有限公司定向增发项目、深圳市雄韬电源科技股份有限公司定向增发项目获证监会审核通过;北京流金岁月文化传播股份有限公司新三板精选层挂牌项目获证监会核准。

3、资产管理业务

报告期内,公司积极回归资管业务本源,继续提升主动管理能力,在受托资产规模、产品服务类型和经营业绩等方面继续保持稳定态势。报告期内,公司资产管理业务实现营业收入 4.56 亿元,同比增长 20.63%。截至报告期末,公司资产管理规模为 1,494.60 亿元。

4、自营业务

报告期内,公司继续保持稳健的自营投资策略,实现营业收入 7.72 亿元。权益类自营业务进

行投资结构调整，采取高夏普率策略及宏观驱动思路，开展自营投资交易；固定收益业务方面，继续坚持投研一体，打造多资产、多策略的交易框架，探索和丰富基于宏观基本面的大类对冲策略。

5、研究业务

报告期内，公司研究业务依然处于行业顶尖水平，共发布证券研究报告 3,456 篇，其中深度报告 584 篇，深度报告同比增加 42.44%。根据东方财富 choice 数据显示，一季度研报阅读次数公司排名行业第一。此外，报告期内公司研究业务全面推动线上工作，召开线上电话会议 1,389 场，同比增加 238.80%。

6、私募基金业务

公司通过子公司天风天睿从事私募基金业务。截至报告期末，天风天睿及下属机构共管理备案基金数量 26 只，管理基金实缴规模 50.62 亿元。报告期内，天风天睿完成设立和备案的基金数量 3 只，实缴规模 2.8 亿元。

7、期货业务

公司通过子公司天风期货从事期货业务。截至报告期末，客户保证金规模 35.98 亿元，同比增长 39%；报告期内日均保证金规模 34.59 亿元，较上年同期增长 53%。

8、海外业务

公司通过境外子公司天风国际集团从事海外业务。截至报告期末，天风国际集团及其下设机构拥有第 1 类（证券交易）、第 2 类（期货合约交易）、第 4 类（就证券提供意见）、第 5 类（就期货合约提供意见）、第 9 类（提供资产管理）牌照，可开展的业务品种包括证券交易、期货合约交易、证券咨询、期货咨询及资产管理等业务。

(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	2,061,307,013.11	1,814,478,415.81	13.60
营业成本	1,442,455,076.59	1,602,818,360.47	-10.01
经营活动产生的现金流量净额	-980,922,497.96	-511,048,581.77	不适用
投资活动产生的现金流量净额	-3,885,741,110.98	-121,625,200.61	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	9,975,913,882.51	2,336,705,985.94	326.92

营业收入变动原因说明:2020 年上半年，本公司实现营业收入 20.61 亿元，同比增长 13.60%，

其中经纪业务实现收入人民币 3.34 亿元，同比上涨 6.35%；投资银行业务实现收入 5.23 亿元，同比上涨 71.68%，资产管理业务实现收入人民币 4.22 亿元，同比上涨 28.07%

营业成本变动原因说明:营业成本变化主要原因是现货业务的其他业务成本较上期有所下降导致；

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

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明:主要是收回投资收到的现金同比减少所致；

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明:主要是吸收投资收到的现金同比增加所致。

2 其他

(1) 公司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

(2) 其他

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 (%)	上年年末数	上年年末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上年年末变动比例 (%)	情况说明
货币资金	12,415,856,335.91	16.76	8,879,676,149.48	14.82	39.82	主要为货币资金规模增加所致
结算备付金	3,512,661,195.49	4.74	1,887,047,540.15	3.15	86.15	主要为结算备付金规模增加所致
拆出资金	200,040,000.00	0.27	150,102,500.00	0.25	33.27	主要为拆出资金规模增加所致
衍生金融资产	65,084.41	0.00			不适用	主要为衍生金融资产规模增加所致
存出保证金	2,579,390,915.43	3.48	1,914,546,749.91	3.20	34.73	主要为存出保证金规模增加导致

应收款项	1,555,324,762.22	2.10	747,858,938.94	1.25	107.97	主要为应收经营性款项增加所致
长期股权投资	4,698,572,028.32	6.34	644,871,981.39	1.08	628.61	主要为对外投资规模增加所致
拆入资金	400,081,111.11	0.54	150,068,750.00	0.25	166.60	主要为拆入资金规模增加所致
衍生金融负债	872,444.00	0.00	274,923.17	0.00	217.34	主要为衍生金融负债规模增加所致
代理买卖证券款	11,046,627,571.97	14.91	7,512,796,666.15	12.54	47.04	主要为代理买卖证券规模增加所致
应交税费	156,263,870.19	0.21	68,841,127.56	0.11	126.99	主要为应纳税额增加所致
应付款项	48,016,517.89	0.06	34,316,294.16	0.06	39.92	主要为应付经营性款项增加所致
合同负债	45,201,032.05	0.06			不适用	主要为执行新收入准则所致
应付债券	24,054,165,675.02	32.47	18,020,388,943.79	30.07	33.48	主要为发行债券规模增加所致
资本公积	8,100,185,352.18	10.93	4,259,929,865.37	7.11	90.15	主要为所有者投入资本增加所致

其他说明

截至2020年6月30日,本公司资产总额为740.83亿元,较年初增长141.63亿元,增幅23.64%。扣除代理买卖证券款后,本公司资产总额为630.36亿元,较年初增长106.29亿元,增幅20.28%。其中交易性金融资产277.24亿元,占总资产37.42%;货币资金124.16亿元,占总资产16.76%,融出资金57.35亿元,占总资产7.74%,公司整体流动性较强。

截至2020年6月30日,本公司负债总额为512.30亿元,较年初增长88.17亿元,增幅20.79%。扣除代理买卖证券款后,本公司负债总额为401.83亿元,较年初增长52.83亿元,增幅15.14%。其中应付债券240.54亿元,占总负债46.95%;卖出回购金融资产款87.55亿元,占总负债17.09%,代理买卖证券款110.47亿,占总负债21.56%。

本期期末扣除代理买卖证券款的资产负债率为63.75%,较年初的66.59%略有下降,资产负债结构稳定。

截至2020年6月30日,表内股票质押式回购业务规模18.26亿元,平均履约保障比例为154.45%,表外股票质押式回购业务规模为93.96亿元。

信用交易业务情况表

项目	本期末业务规模 (亿元)	2019 年业务规模 (亿 元)	业务规模变动 (同比)
股票质押式回购业务	18.26	19.03	-4.08%
融资融券业务融出资金	57.40	60.73	-5.48%
合计	75.66	79.77	-5.15%

2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目 75、所有权或使用权受到限制的资产”的相关内容。

3. 其他说明

适用 不适用

(四) 投资状况分析

1、 对外股权投资总体分析

适用 不适用

具体内容详见本半年度报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 17、长期股权投资”的相关内容。

(1) 重大的股权投资

适用 不适用

公司以支付现金的方式，购买交易对方持有的恒泰证券股份有限公司 29.99%股份，本次交易的交易价格为不超过人民币 45.01 亿元。2020 年 3 月，中国证监会核准公司成为恒泰证券 5%以上股东（证监许可（2020）344 号）。截至报告期末，公司完成标的公司 26.49%股权的收购及过户工作。（详见公司公告，公告编号：2020-007 号、2020-018 号、2020-022 号、2020-037 号、2020-040 号）

(2) 重大的非股权投资

适用 不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产

适用 不适用

具体内容详见本半年度报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 6、衍生金融工具，13、交易性金融资产，15、其他债权投资，16、其他权益工具投资”的相关内容。

(五) 重大资产和股权出售

适用 不适用

(六) 主要控股参股公司分析

适用 不适用

1、天风天睿投资股份有限公司，主营业务：管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务。注册资本 154,328 万元，公司持有其 65.72%股权。截至报告期末，天风天睿总资产人民币 968,316 万元，净资产人民币 453,085 万元；2020 年上半年实现营业收入人民币 9,993 万元，利润总额人民币 4,960 万元，净利润人民币 3,122 万元。

2、天风期货股份有限公司，主营业务：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询。注册资本 31,440 万元人民币，公司持有其 62.94%股权。截至报告期末，天风期货总资产人民币 415,284 万元，净资产人民币 39,598 万元；2020 年上半年实现营业收入人民币 8,028 万元，净利润人民币 1,329 万元。

3、天风创新投资有限公司，主营业务：投资管理。注册资本 79,473.17 万元人民币，公司持有其 100%股权。截至报告期末，天风创新总资产人民币 89,475 万元，净资产人民币 87,916 万元；2020 年上半年实现营业收入人民币 4,676 万元，利润总额人民币 4,484 万元，净利润人民币 3,451 万元。

4、天风国际证券集团有限公司，主营业务：金融公司的投资和管理，注册资本港币 48,684.14 万元，公司持有其 100%的股权。截至报告期末，天风国际集团总资产人民币 291,082 万元，净资产人民币 37,805 万元；2020 年上半年实现营业收入人民币 10,272 万元，利润总额人民币 1,978 万元，净利润人民币 2,012 万元。

5、宜宾市商业银行股份有限公司，主营业务：吸收公众存款，发放短期、中期和长期贷款，办理国内结算，办理票据承兑和贴现，发行金融债券，代理发行、代理兑付、承销政府债券，买卖政府债券、金融债券，从事同业拆借，从事银行卡业务，提供信用证服务及担保，代理收收付款项及代理保险业务，提供保管箱服务，经银行业监督管理机构批准的其它业务。注册资本人民币 138,600 万元，公司持有其 14.57%的股权。截至报告期末，宜宾商行总资产人民币 4,504,316 万元，净资产人民币 433,470 万元；2020 年上半年实现营业收入人民币 60,582 万元，利润总额人民币 23,919 万元，净利润人民币 17,940 万元。

6、恒泰证券股份有限公司，主营业务：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。注册资本人民币 260,457 万元，公司持有其 26.49%的股权。截至报告期末，恒泰证券经审阅的合

并总资产为 3,107,994 万元，净资产 910,716 万元，实现营业收入 102,806 万元，利润总额 15,258 万元，净利润 14,596 万元。

(七) 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

截至 2020 年 6 月 30 日，本公司合并 22 家结构化主体，主要为资产管理计划。公司对担任结构化主体的管理人或投资顾问，且持有产品份额的结构化主体，综合考虑公司拥有的投资决策权、可变回报的敞口及运用投资决策权影响可变回报等因素后，将公司拥有控制权的结构化主体纳入合并报表范围。

二、其他披露事项

(一) 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生大幅度变动的警示及说明

适用 不适用

(二) 可能面对的风险

适用 不适用

1、可能面对的风险

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

(1) 市场风险

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

(2) 信用风险

公司面临的信用风险指借款人或交易对手未能或不愿履行协议中约定的义务而造成经济损失的风险。公司的信用风险主要来自以下三个方面：一是融资融券业务、股票质押式回购交易业务、债券回购业务的客户/交易对手出现违约，不能及时向本公司履行相应债务的风险；二是债券、信托产品以及其他信用类产品的投资业务由于发行人或融资人违约而导致相应的本息无法及时支付

的风险；三是经纪业务代理客户买卖证券、期货及其他金融产品，在结算当日发生客户资金不足的，代客户进行结算后，因客户违约而形成的损失。

（3）操作风险

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

（4）流动性风险

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

（5）声誉风险

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

（6）合规及法律风险

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

（7）洗钱风险

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

2、风险管理措施

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

（1）建立全面的风险防控体系

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

公司风险管理架构体系如下：第一层为董事会及其下设的风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会以及监事会；第二层为公司执行委员会及其下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监；第三层为风险管理部门，包括风险管理部、合规法律部、投行内核合规部、稽核审计部、资金计划部、财务核算部、品牌管理部；第四层为公司除风险管理部门之外的各部门、分支机构、子公司及公司全体成员。

（2）各类风险应对措施

①市场风险管理

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

②信用风险管理

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

③操作风险管理

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

产生的原因及造成的影响并按照涉及部门进行分类汇总，根据操作风险发生的原因及时管控操作风险。

④流动性风险管理

公司对流动性风险的管理采用逐日盯市、动态监控、分层汇总、定期报告，通过流动性监控指标、资产结构、负债结构、资产负债期限匹配结构、现金流量分析、压力测试等方法对流动性风险进行识别与分析。公司流动性风险管理部门每日计算并监控关键风险指标的情况，判断和预测各类风险指标的变化，定期将流动性指标、负债情况向公司执行委员会及合规与风险管理委员会报告。资金计划部每月报送融资管理业务月度信息简报，对公司存续的主要债务融资工具的品种、规模、原始期限、剩余期限等进行分析，对公司近期资金缺口情况进行汇报，对未来可能发生垫资的风险进行提示。同时，公司流动性风险管理部门跟进公司融资项目进展，包括但不限于公司债、次级债等债务融资工具申请发行额度、交易所审批意见、证监会审核进展、银行授信维护情况等，对金融市场交易量和价格等变动情况进行汇报，评估市场流动性对公司融资能力的影响。此外，在特定业务或交易开展之前，流动性风险管理部门将充分评估其可能对流动性风险产生的影响，并出具流动性风险评估报告供业务部门和公司执行委员会参考，作为评判该项业务是否开展的重要依据。

⑤声誉风险管理

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

⑥合规法律风险管理

合规法律部、投行内核合规部是公司在合法、合规方面的主要内部控制职能部门，对公司经营与管理活动的合法、合规进行控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务，保障公司在合法、合规的前提下开展业务经营。合规法律部、投行内核合规部主要负责合规管理制度、流程的建设与实施；提供日常合规建议与咨询；新业务新产品合规风险审核；

合规风险事项调查、督促整改与落实；起草公司法律文书、代理公司诉讼、调解和仲裁等事务；反洗钱管理及反洗钱制度的制定和实施；组织合规培训、推动合规文化建设、培养公司员工合规意识等工作。

⑦洗钱风险管理

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

(三) 其他披露事项

适用 不适用

第五节 重要事项

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
2020 年第一次临时股东大会	2020 年 1 月 15 日	http://www.sse.com.cn/	2020 年 1 月 16 日
2020 年第二次临时股东大会	2020 年 3 月 10 日	http://www.sse.com.cn/	2020 年 3 月 11 日
2020 年第三次临时股东大会	2020 年 5 月 13 日	http://www.sse.com.cn/	2020 年 5 月 14 日
2019 年年度股东大会	2020 年 5 月 29 日	http://www.sse.com.cn/	2020 年 5 月 30 日

股东大会情况说明

√适用 □不适用

报告期内，公司共召开股东大会 4 次，其中年度股东大会 1 次，临时股东大会 3 次，会议情况和决议内容如下：

1、2020 年第一次临时股东大会于 2020 年 1 月 15 日召开，审议通过了《关于修订〈公司章程〉部分条款的议案》《关于修订〈董事会议事规则〉部分条款的议案》《关于修订〈监事会议事规则〉部分条款的议案》《关于公司第三届董事会董事成员调整的议案》。

2、2020 年第二次临时股东大会于 2020 年 3 月 10 日召开，审议通过了《关于公司符合公开发行金融债券条件的议案》《关于公开发行金融债券具体方案的议案》《关于提请股东大会授权公司经营管理层在有关法律法规规定范围内全权办理本次公开发行金融债券相关事宜的议案》《关于公司符合公开发行公司债券条件的议案》《关于公开发行公司债券具体方案的议案》《关于提请股东大会授权公司经营管理层在有关法律法规规定范围内全权办理本次公开发行公司债券相关事宜的议案》。

3、2020 年第三次临时股东大会于 2020 年 5 月 13 日召开，审议通过了《关于发行境内债务融资工具一般性授权的议案》。

4、2019 年年度股东大会于 2020 年 5 月 29 日召开，审议通过了《2019 年度董事会工作报告》《2019 年度监事会工作报告》《2019 年度报告》《2019 年度财务决算报告》《2019 年度利润分配方案》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于确认 2019 年度日常关联交易及预计 2020 年度日常关联交易的议案》《关于预计公司 2020 年自营投资额度的议案》《关于审议公司董事 2019 年度报酬总额的议案》《关于审议公司监事 2019 年度报酬总额的议案》，除审议上述议案外，会议还听取了《2019 年度独立董事工作报告》。

二、利润分配或资本公积金转增预案

(一) 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	

三、承诺事项履行情况

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

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	武汉国资、人福医药、湖北省联发、陕西大德、宁波信达、中航信托、苏州建丰、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	自公司股票上市之日起 36 个月内，不转让或者委托他人管理直接或间接持有的公司公开发行股票前已发行的股份，也不由公司回购该部分股份。	自上市之日起满 36 个月	是	是	-	-
	股份限售	武汉国资、人福医药、湖北省联发	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 5%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	当代科技	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 3.18%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	上海天阖	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 2.18%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	当代文体	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 1.05%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	三特索道	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 0.55%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	武汉国资、人福医药、湖北省联发、当代科技、	若未履行相关承诺，本公司将在股东大会及中国证监会指定媒体上进行公开道歉。同时在符合法律、法规及规范性文件规定	长期有效	否	是	-	-

	上海天闾、当代文体、三特索道	的情况下 10 个工作日内回购该违规卖出的股票，且自回购完成之日起自动延长持有的全部股份的锁定期 6 个月。在认定未履行上述承诺的事实发生之日起停止在公司的分红、持有的公司股份将不得转让，直至原违规卖出的股票已购回完毕。					
解决同业竞争	武汉国资、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天闾、当代文体、三特索道	<p>1. 本公司/企业确认：本公司/企业及本公司/企业直接、间接控制的公司、企业不存在与天风证券及其子公司构成实质性同业竞争的业务和经营；</p> <p>2. 本公司/企业作为天风证券股东期间，不会在中国境内或境外，以任何方式（包括但不限于单独经营、通过合资经营或拥有另一公司或企业的股份及其它权益，或通过他人代本公司/企业经营）直接或间接从事与天风证券（包括其控股子公司，下同）相同或相似的业务；</p> <p>3. 本公司/企业承诺：将采取合法及有效的措施，促使本公司/企业的其他控股、参股子公司不从事与天风证券相同或相似的业务，如果有同时适用于天风证券和本公司/企业其他控股、参股子公司进行商业开发的机会，天风证券在同等条件下享有优先选择权；</p> <p>4. 本公司/企业承诺给予天风证券与本公司/企业其他控股、参股子公司同等待遇，避免损害天风证券及天风证券中小股东的利益；</p> <p>5. 对于天风证券的正常生产、经营活动，本公司/企业保证不利用股东地位损害天风证券及天风证券中小股东的利益；6. 本公司/企业保证上述承诺在本公司/企业作为天风证券股东期间持续有效，并不可撤销。如有任何违反上述承诺的事项发生，本公司/企业承担因此给天风证券造成的一切损失（含直接损失和间接损失），如本公司/企业因违反本承诺的内容而从中受益，本公司/企业同意将所得收益返还给天风证券；</p> <p>7. 本公司/企业无合法理由违反与避免同业竞争有关的事项，或者未依法执行相应措施的，天风证券有权扣留应向本公司/企业支付的分红款，本公司/企业持有的天风证券股份不得转让，直至本公司/企业依法遵守有关承诺或依法执行有关约束措施。</p>	长期有效	否	是	-	-
解决	武汉国资、人福医药、	1. 本公司/企业将尽量减少和规范与天风证券及其控股子公司	长期有效	否	是	-	-

关联交易	湖北省联发、当代科技、上海天闾、当代文体、三特索道	<p>之间发生关联交易；</p> <p>2. 不以向天风证券拆借、占用天风证券资金或采取由天风证券代垫款项、代偿债务等任何方式侵占天风证券资金或挪用、侵占天风证券资产或其他资源；不要求天风证券及其控股子公司违法违规提供担保；</p> <p>3. 对于与天风证券及其控股子公司之间确有必要进行的关联交易，均将严格遵守公平公允、等价有偿的原则，公平合理地进行；关联交易均以签订书面合同或协议形式明确约定，并严格遵守有关法律法规、规范性文件以及天风证券公司章程、股东大会会议事规则、关联交易实施细则等相关规定，履行各项审批程序和信息披露义务，切实保护天风证券和天风证券其他股东利益；</p> <p>4. 不通过关联交易损害天风证券以及天风证券其他股东的合法权益，如因违反上述承诺而损害天风证券及天风证券其他股东合法权益的，本公司/企业自愿赔偿由此对天风证券造成的一切损失；</p> <p>5. 本公司/企业将促使并保证本公司的关联方遵守上述承诺，如有违反，本公司/企业自愿承担由此对天风证券造成的一切损失。</p>					
其他	武汉国资、人福医药、湖北省联发、陕西大德、宁波信达、中航信托、苏州建丰	在公司就稳定股价回购股份事宜召开的股东大会上，将对公司承诺的回购股份方案的相关议案投赞成票。	公司上市后三年内	是	是	-	-
其他	全体董事	在公司就稳定股价回购股份事宜召开的董事会上，将对公司承诺的回购股份方案的相关议案投赞成票等。	公司上市后三年内	是	是	-	-
其他	全体董事及高级管理人员	<p>公司董事、高级管理人员针对公司填补回报措施能够得到切实履行作出如下承诺：</p> <p>1. 承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益；</p> <p>2. 承诺对董事和高级管理人员的职务消费行为进行约束；</p> <p>3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动；</p>	长期有效	否	是	-	-

			<p>4. 承诺由董事会或薪酬委员会制定的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩；</p> <p>5. 承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。</p>					
与再融资相关的承诺	其他	全体董事、高级管理人员	<p>1. 承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益；</p> <p>2. 承诺对自身的职务消费行为进行约束；</p> <p>3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动；</p> <p>4. 承诺由董事会或董事会薪酬与考核委员会制定的薪酬制度与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相挂钩；</p> <p>5. 如公司未来实施股权激励计划，承诺拟公布的公司股权激励计划的行权条件与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相挂钩；</p> <p>6. 公司本次发行实施完毕前，若中国证券监督管理委员会作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足中国证监会该等规定的，届时将按照中国证监会的最新规定出具补充承诺；</p> <p>7. 若违反上述承诺或拒不履行上述承诺给公司或者股东造成损失的，愿意依法承担对公司或者股东的补偿责任。</p>	长期有效	否	是	-	-
	其他	武汉国资、人福医药、湖北省联发	<p>公司 5%以上股东承诺自获配股份上市流通日起 6 个月内不减持。若减持，则由此所得的收益归天风证券所有。</p>	获配股份上市流通日起 6 个月内	是	是	-	-

四、聘任、解聘会计师事务所情况

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

√适用 □不适用

公司于 2020 年 5 月 29 日召开的 2019 年年度股东大会审议通过《关于续聘会计师事务所的议案》，同意续聘大信会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2020 年度审计机构。（详见公司公告，公告编号：2020-047 号）

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

□适用 √不适用

公司对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

□适用 √不适用

公司对上年年度报告中的财务报告被注册会计师出具“非标准审计报告”的说明

□适用 √不适用

五、破产重整相关事项

□适用 √不适用

六、重大诉讼、仲裁事项

□本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 √本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司未发生《上交所股票上市规则》中规定披露的涉案金额超过人民币 1,000 万元且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10%以上的重大诉讼、仲裁事项。

(一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

√适用 □不适用

事项概述及类型	查询索引
王国起与天风证券专利纠纷案	2019 年 2 月 21 日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007 号）
天风证券与方锦程、张莉莉借款合同纠纷案	2019 年 2 月 21 日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007 号）

(二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

报告期内：									
起诉(申请)方	应诉(被申请人)方	承担连带责任方	诉讼仲裁类型	诉讼(仲裁)基本情况	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)是否形成预计负债及金额	诉讼(仲裁)进展情况	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况
天风证券	银亿控股有限公司	/	合同纠纷	见表下概述	151,317,600	/	见表下概述	见表下概述	见表下概述

郭敏	天风证券	/	劳动纠纷	见表下概述	1,687,000	/	见表下概述	见表下概述	见表下概述
天风证券	龙跃实业集团有限公司	/	合同纠纷	见表下概述	397,016,100	/	见表下概述	见表下概述	见表下概述
天示(上海)企业管理有限公司	中拓(福建)实业有限公司、杭州华速实业有限公司	/	期货纠纷	见表下概述	91,150,000	/	见表下概述	见表下概述	见表下概述

天风证券诉银亿控股有限公司（以下简称“银亿公司”）借款合同纠纷案，天风证券与银亿公司开展股票质押业务，因银亿公司的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于 2019 年 2 月向湖北省高级人民法院提起对银亿公司的民事诉讼，要求其偿还融资本金 130,500,000 元及利息、违约金等。因银亿公司申请破产重组，本案移送至宁波市中级人民法院审理。2019 年 10 月 25 日，宁波市中级人民法院制作（2019）浙 02 民初 424 号民事调解书，内容为：1、银亿公司于 2019 年 12 月 20 日前向天风证券支付融资本金 130,500,000 元；2、银亿公司于 2019 年 12 月 20 日前向天风证券支付以本金 130,500,000 元为基数，自 2018 年 9 月 21 日（含）起至 2019 年 5 月 8 日，按年利率 8.7%计算的利息 7,154,260.27 元；3、银亿公司于 2019 年 12 月 20 日之前向天风证券支付以本金 130,500,000 元为基数，自 2018 年 8 月 22 日（含）起至 2019 年 5 月 8 日，按年利率 4.35%计算的违约金 4,043,712.33 元；4、银亿公司于 2019 年 12 月 20 日前向天风证券支付以本金 130,500,000 元为基数，自 2019 年 5 月 9 日（含）起至实际付清之日止，按年利率 13.05%计算的利息及违约金；5、银亿公司于 2019 年 12 月 20 日前向天风证券支付律师费 150,000 元、财产保全保险费 90,790.54 元；6、如银亿公司未如约履行上述第一项至第五项付款义务，天风证券有权就银亿公司提供质押的银亿股份有限公司 35,450,000 股股票（证券代码 000981）折价、拍卖或变卖所得价款优先受偿；7、案件受理费 798,387.81 元，减半收取 399,193.91 元，财产保全申请费 5,000 元，合计 404,193.91 元，由银亿公司负担，银亿公司应负担的诉讼费 404,193.91 元于 2019 年 11 月 5 日前交至宁波市中级人民法院。银亿公司未履行生效文书义务，天风证券向宁波市中级人民法院申请强制执行，因银亿公司破产重组案已被宁波市中级人民法院受理，破产案号为（2019）浙 02 破申 12 号，天风证券将按破产程序要求积极申请债权。又因银亿公司的破产重组案被法院立案受理，案件进入破产重组程序，天风证券已依法向银亿公司的管理人申报债权。

郭敏诉天风证券劳动仲裁纠纷案，郭敏于 2011 年入职天风证券，2018 年 11 月 30 日天风证券与郭敏解除劳动合同关系，并支付了双倍经济补偿金 342,336 元。后郭敏诉至上海市浦东新区劳动人事争议仲裁委员会，要求天风证券支付经济补偿金、工资差额、年休假差额、加班工资、年终奖等共计 1,686,967 元。上海市浦东新区劳动人事争议仲裁委员会裁决天风证券支付郭敏 2018 年 9 月至 11 月期间工资差额人民币 44,396 元，支付郭敏 2018 年年休假工资差额人民币 15,757.43 元，对郭敏的其他请求事项不予支持。郭敏不服仲裁结果，起诉至上海浦东法院，2019 年 12

月 16 日，上海市浦东新区人民法院作出判决，内容如下：1、天风证券支付郭敏 2018 年未休年休假工资差额 15,757.43 元；2、天风证券支付郭敏 2018 年年年终奖 64,055 元；3、天风证券支付郭敏 2018 年 9 月至 11 月期间工资差额 44,396 元；4、驳回郭敏的其余诉讼请求。郭敏不服上述判决，提出上诉，本案于 2020 年 6 月 10 日二审开庭，暂未二审判决。

天风证券诉龙跃实业集团有限公司借款合同纠纷案，天风证券与龙跃实业集团有限公司（以下简称“龙跃实业”）开展股票质押业务，因龙跃实业质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于 2018 年 9 月向湖北省高级人民法院提起对龙跃实业的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 390,000,000 元及利息、违约金等。2018 年 12 月 26 日，天风证券收到湖北省高级人民法院下达的（2018）鄂民初 75 号民事判决书，判决：1、龙跃实业向天风证券支付融资本金 3.9 亿元及利息（以 3.9 亿元为基数，以年利率 7.5%为标准，自 2018 年 9 月 21 日起计付至付清之日止）；2、龙跃实业向天风证券股份有限公司支付违约金及利息（以 1.9 亿元为基数，以日万分之三为标准，自 2018 年 9 月 11 日起计付至付清之日止；以 2 亿元为基数，以日万分之三为标准，自 2018 年 9 月 8 日计付至付清之日止）；3、天风证券可在融资本金 1.9 亿元及本判决第一、二项确定的相应利息、违约金范围内以龙跃实业提供质押的 2,222,223 股无限售流通股北讯集团股票（证券代码 002359），再融资本金 2 亿元及本判决第一、二项确定的相应利息、违约金范围内以龙跃实业提供质押的 22,232,104 股无限售流通股北讯集团股票（证券代码 002359）折价、拍卖或变卖所得价款优先受偿。2019 年 2 月，上述判决生效后，天风证券向湖北省高级人民法院申请强制执行，湖北省高级人民法院裁定由武汉市中级人民法院强制执行，目前本案尚在执行过程中。2020 年 7 月 7 日，武汉市中级人民法院作出（2020）鄂 01 执恢 71 号之一民事裁定书，裁定终结本案的执行程序，申请执行人天风证券如发现被执行人有可供执行的财产，可再次申请执行。

天风证券二级控股子公司天示（上海）企业管理有限公司（以下简称“天示公司”）诉中拓（福建）实业有限公司（以下简称“中拓公司”）、杭州华速实业有限公司（以下简称“华速公司”）期货纠纷一案，2018 年 6 月，天示公司与中拓公司开展了期货市场场外衍生品交易，华速公司为中拓公司提供连带责任保证担保。业务开展中，中拓公司存在未按照协议约定按时向天示公司提交履约保障品（现金），以及在交易结束后拖欠交易价款的情形，已构成违约。暂计至 2019 年 7 月 5 日，中拓公司累计拖欠款项为人民币 9,115 万元。鉴于此，天示公司根据累计拖欠款项金额分别向法院起诉中拓公司、华速公司，要求中拓公司支付拖欠款项及违约金，华速公司对中拓公司的付款义务承担连带清偿责任，并由中拓公司、华速公司共同承担本案诉讼费、保全费以及保全担保费。2020 年 2 月，上海金融法院开庭审理。2020 年 5 月 20 日，上海天示收到上海金融法院作出的（2019）沪 74 民初 1731 号民事判决书，判决结果如下：1、中拓实业向上海天示偿还本金 90,336,147 元；2、中拓实业向上海天示偿付以本金 90,336,147 元为基数，自 2019 年 8 月 3 日起自实际清偿之日止，以年利率 10.95%计付的罚息；3、中拓实业向上海天示偿付违约金 1,523,456.58 元，及以本金 90,336,147 元为基数，自 2019 年 8 月 3 日起计算至实际清偿之日止，

以年利率 13.05%计付的违约金；4、中拓实业向上海天示偿付律师费 350,000 元；5、华速实业对中拓实业前述四项还款义务承担连带保证责任，华速实业承担连带保证责任后，有权向中拓实业追偿。

(三) 公司本报告期被处罚和公开谴责的情况

适用 不适用

(四) 其他说明

适用 不适用

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

适用 不适用

八、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

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

九、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

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) 其他重大关联交易

适用 不适用

(六) 其他

适用 不适用

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 担保情况

适用 不适用

3 其他重大合同

适用 不适用

十二、 上市公司扶贫工作情况

适用 不适用

1. 精准扶贫规划

√适用 □不适用

在以习近平同志为核心的党中央坚强领导下，自国务院扶贫办、证监会等 7 部委联合下发《关于金融助推脱贫攻坚的实施意见》以来，天风证券深入开展精准扶贫工作。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共与 8 个国家级贫困县开展“一司一县”结对帮扶或签署《金融扶贫备忘录》、帮扶 9 个“三区三州”贫困县、在 49 个贫困县推进扶贫项目，与 29 家国贫县企业开展“一县一企”结对帮扶合作，深入一线推进产业扶贫、智慧扶贫、消费扶贫、公益扶贫相结合的“四位一体”帮扶举措。

2020 年上半年，新冠肺炎疫情对贫困地区脱贫攻坚带来一定压力。公司积极协调资源，联合慈善组织、股东单位、爱心企业帮助贫困地区抗疫。在扶贫实践中，公司逐渐探索出新时代有证券特色的脱贫攻坚“六新”模式：战疫战贫，探索减贫防返贫举措；党建引领，凝聚公益扶贫新力量；一地一策，打造证券扶贫新产品；驻村扶智，引导县域融资新观念；开拓市场，升级现代产业新链条；着眼长效，构建券商扶贫新标准。

总的来说，在战疫战贫方面，公司将持续通过捐资捐物、联合设立公益关怀项目等方式，加大力度帮助贫困地区减轻疫情影响，帮助已摘帽贫困县巩固脱贫成果，为确诊新冠肺炎的贫困人口、受疫情影响较大的贫困学子家庭提供支持；在产业扶贫方面，公司规划持续在贫困地区设立金融扶贫工作站，通过金融专家“一对一”服务的方式为当地企业“建档立卡”，逐一分析，针对性地为企业发展提出建设性帮扶方案，在贫困县开展辅导新三板挂牌、发行债券等系列证券业务，使资本市场更好地服务贫困地区经济社会发展，为政府提供科学的产业发展规划；在智慧扶贫方面，公司通过邀请金融专家、农业专家、扶贫专家赴贫困地区考察指导，为贫困地区发展建言献策，并委派金融工作者到贫困县挂职、派驻金融业务人员阶段性入驻企业等，协助地方政府和企业推进金融扶贫工作，同时在贫困县开展资本市场知识培训和投资者教育活动，帮助贫困地区培养金融人才，加强贫困地区金融知识普及和金融风险教育；在消费扶贫方面，公司规划为贫困地区特色农产品提供品牌塑造协助，帮助特色产品上架消费扶贫平台，积极对接“网红主播”开展“直播带货”活动，通过媒体宣传、消费认购、推荐销售等方式协助拓展贫困地区产品销售渠道；公益扶贫方面，通过参与成立慈善组织，规划开展教育扶贫项目或公益资助项目，帮助“三区三州”深度贫困地区、结对县以及其他民族地区、集中连片特困地区等地贫困学子完成学业，帮助困难群体及时解决生活困难。

针对“已摘帽”国家级贫困县，公司规划在其摘帽三年内继续深入推进结对帮扶各项举措，“脱贫不脱政策、摘帽不摘责任”，帮助巩固脱贫成果，防止返贫。

2. 报告期内精准扶贫概要

√适用 □不适用

2020 年上半年，天风证券以资源整合为发力点，在贫困地区深入推进产业扶贫、智慧扶贫、消费扶贫、公益扶贫“四位一体”的帮扶举措，努力帮助贫困地区减轻新冠肺炎疫情疫情影响，逐渐

形成“战疫战贫，探索减贫防返新举措；党建引领，凝聚公益扶贫新力量；一地一策，打造证券扶贫新产品；驻村扶智，引导县域融资新观念；开拓市场，升级现代产业新链条；着眼长效，构建券商扶贫新标准”的新时代及具有证券特色的脱贫攻坚“六新”模式。

习近平总书记指出，要统筹推进疫情防控和脱贫攻坚。2020年上半年，虽然天风证券总部位于疫情最严重的武汉，但公司仍针对贫困县医疗物资匮乏、扶贫产品销售和产业扶贫困难、贫困户劳动力可能减少等问题，联合慈善组织、股东单位、爱心企业创新推出“战疫+战贫”系列项目。

2020年上半年，天风证券克服疫情影响，深入推进系列帮扶举措。产业扶贫方面，采取“一地一策”方式，为当地政府提供针对性产业发展规划，通过派驻金融专家为贫困县企业“建档立卡”、逐一分析，为企业可持续发展建言献策；智慧扶贫方面，依托“一司一县”金融扶贫工作站加强贫困地区金融知识普及和金融风险教育，为贫困地区普及现代金融理念；消费扶贫方面，通过给贫困地区带来电商、农业专家、先进技术与现代化品牌营销思维，为特色扶贫农产品提供包装设计、品牌塑造、渠道推广等全方位协助；公益扶贫方面，继续帮助“三区三州”深度贫困地区与“一司一县”结对帮扶地区贫困学子完成学业，并为他们提供抗疫支持。

3. 精准扶贫成效

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币
数量及开展情况

指 标	数量及开展情况
一、总体情况	
其中：1. 资金	107.94
二、分项投入	
1. 产业发展脱贫	
其中：1.1 产业扶贫项目类型	<input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫 <input type="checkbox"/> 旅游扶贫 <input checked="" type="checkbox"/> 电商扶贫 <input type="checkbox"/> 资产收益扶贫 <input type="checkbox"/> 科技扶贫 <input checked="" type="checkbox"/> 其他
1.2 产业扶贫项目个数（个）	12
1.3 产业扶贫项目投入金额	41.73
2. 转移就业脱贫	
其中：2.3 帮助建档立卡贫困户实现就业人数（人）	11
4. 教育脱贫	
其中：4.1 资助贫困学生投入金额	8.65
4.2 资助贫困学生人数（人）	1,459
5. 健康扶贫	
其中：5.1 贫困地区医疗卫生资源投入金额	25.34
9. 其他项目	
其中：9.1 项目个数（个）	9
9.2. 投入金额	32.22
9.4. 其他项目说明	含向贫困学子发放的抗疫临时救助金、消费扶贫认购贫困地区特色农产品、“一司一县”金融扶贫工作站运营、结对帮扶地

4. 履行精准扶贫社会责任的阶段性进展情况

√适用 □不适用

天风证券持续助力贫困地区发展，通过“产业扶贫、智慧扶贫、消费扶贫、公益扶贫”等方式，不断创新扶贫模式，探索金融助推贫困地区发展的天风模式。

新冠肺炎疫情发生后，公司心系贫困地区，第一时间将口罩、防护服等物资送往 32 个国家级贫困县防疫一线（包括受疫情影响最严重的湖北地区 12 个贫困县，“三区三州”深度贫困地区凉山州、甘孜州、阿坝州，民族地区新疆、广西、内蒙古、宁夏等重点扶贫地区等），帮助缓解贫困县防疫物资短缺困境。公司还联合慈善组织与受疫情影响的困难家庭实现结对，帮扶湖北省确诊新冠肺炎的建档立卡贫困人口，为他们提供常态化疫情防控下的长效保障。

天风证券坚持深入贫困县，采取“一地一策”方式，助力当地产业发展。目前，公司在三十余个贫困县设有产业扶贫项目，通过有针对性、创新打造的金融扶贫产品，2020 年上半年，公司已帮助湖北省恩施州恩施市融资 9.5 亿元。

公司通过分析扶贫对象在产业链中最薄弱的环节，着力补齐市场营销短板，采用“产业+品牌”的方法，从本地出发，补足短板，打造特色，久久为功，形成竞争力。目前，已为 30 多种特色扶贫农产品提供品牌塑造协助；还推介湖北贫困地区中小企业飞强茶业对接消费扶贫直播平台，帮助缓解湖北贫困县农副产品滞销困境。

公司以转变贫困地区的金融观念为抓手，率先将证券营业部开在了贫困县，作为“一司一县”金融扶贫工作站专门推进金融扶贫工作，积极组织资本市场专项培训与投资者教育活动，助力县域经济发展。

天风证券还参与捐资成立慈善基金会，专业推进公益项目。目前，已联合慈善组织面向“三区三州”深度贫困地区与结对帮扶地区推出系列奖学金、助学金、“梦想计划”圆梦工程、导师结对帮扶等公益助学项目。疫情期间，公司还联合爱心单位为贫困家庭提供临时抗疫补助与应急物资援助。

5. 后续精准扶贫计划

√适用 □不适用

2020 年是打赢脱贫攻坚战的收官年。下一步，公司拟在持续做好“一司一县”结对帮扶工作的基础上，扎实做好常态化防疫形势下各项产业扶贫、智慧扶贫、消费扶贫、公益扶贫相关工作，助力夺取战疫战贫双胜利。

在疫情关怀方面，天风证券拟联合慈善组织为受疫情影响较为严重的贫困县社区困难党员、孤寡老人、失独家庭、孤儿、残障人员，以及建档立卡贫困户、因疫致困、因疫返贫人员等特困人群，贫困县参与疫情防控的一线工作人员及其家属提供持续关怀。在产业扶贫方面，持续推进金融扶贫项目落地，推进扶贫债券发行，组织金融专家阶段性入驻贫困企业，为贫困县企业可持续发展与县域经济发展建言献策；在智慧扶贫方面，组织金融专家赴国家级贫困县举行投资者教

育活动、进行防止非法集资宣讲；在消费扶贫方面，继续为贫困地区对接“网络直播”资源，通过消费认购、推荐消费等方式帮助扶贫产品拓展销路；在公益扶贫方面，推进奖学金与助学金项目，开展“梦想计划”圆梦工程，帮助更多贫困学子完成学业。

用心履行企业社会责任，倾情动员全员力量，天风证券将充分发挥资源整合优势，以最佳的“战斗”状态做好综合金融服务，助力脱贫攻坚，以高度的责任意识、担当意识、专业态度和敬业精神投入工作，经受住疫情考验，与贫困地区一道共同步入小康社会。

十三、 可转换公司债券情况

适用 不适用

十四、 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重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) 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明

适用 不适用

公司及控股子公司不属于武汉市重点排污单位。

公司重视节能环保，认真执行国家《环境保护法》《水污染防治法》《大气污染防治法》《环境噪声污染防治法》《固体废物污染防治法》等环保方面的法律法规。在日常经营管理中，提倡节约能源，尽可能地利用信息技术，进行网上审批、视频与电话会议，营造绿色办公环境。

(四) 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

十五、 其他重大事项的说明

(一) 与上一会计期间相比，会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况、原因及其影响

适用 不适用

财政部 2017 年 7 月发布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》。本公司自 2020 年 1 月 1 日起执行新收入准则。

新收入准则取代了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 14 号—收入》及《企业会计准则第 15 号—建造合同》(统称“原收入准则”)。在原收入准则下，本公司以风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准。新收入准则引入了收入确认计量的“五步法”，并针对特定交易或事项提供了更多的指引，在新收入准则下，本公司以控制权转移作为收入确认时点的判断标准，具体收入确认和计量的会计政策详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 35 收入”的相关内容。

(二) 报告期内发生重大会计差错更正需追溯重述的情况、更正金额、原因及其影响

适用 不适用

(三) 其他

适用 不适用

第六节 普通股股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、股份变动情况表

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例（%）	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例（%）
一、有限售条件股份	2,827,487,342	54.58	/	/	/	/	/	2,827,487,342	42.42
1、国家持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
2、国有法人持股	1,366,012,479	26.37	/	/	/	/	/	1,366,012,479	20.49
3、其他内资持股	1,461,474,863	28.21	/	/	/	/	/	1,461,474,863	21.92
其中：境内非国有法人持股	1,461,474,863	28.21	/	/	/	/	/	1,461,474,863	21.92
境内自然人持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
4、外资持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
其中：境外法人持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
境外自然人持股	/	/	/	/	/	/	/	/	/
二、无限售条件流通股份	2,352,512,658	45.42	+1,485,967,280	/	/	/	+1,485,967,280	3,838,479,938	57.58
1、人民币普通股	2,352,512,658	45.42	+1,485,967,280	/	/	/	+1,485,967,280	3,838,479,938	57.58
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	5,180,000,000	100	+1,485,967,280	/	/	/	+1,485,967,280	6,665,967,280	100

2、股份变动情况说明

√适用 □不适用

经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]39 号文《关于核准天风证券股份有限公司配股的批复》核准，同意公司向原股东配售 1,554,000,000 股新股。报告期内，公司实际向全体股东配售人民币普通股(A 股)1,485,967,280 股，均为无限售条件流通股，配售上市后公司股本总数变更为 6,665,967,280 股。（详见公司公告，公告编号：2020-005 号）

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

适用 不适用

4、 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

(二) 限售股份变动情况

适用 不适用

二、 股东情况

(一) 股东总数:

截止报告期末普通股股东总数(户)	196,625
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	不适用

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

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内增 减	期末持股数 量	比例 (%)	持有有限售 条件股份数 量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
武汉国有资产经营有限公司	190,995,826	827,648,581	12.42	636,652,755	无	0	国有法人
人福医药集团股份公司	156,943,278	680,087,537	10.20	523,144,259	质押	523,144,259	境内非国有法人
湖北省联合发展投资集团有限公司	155,807,917	675,167,641	10.13	519,359,724	质押	259,679,862	国有法人

2020 年半年度报告

宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	63,000,000	273,000,000	4.10	210,000,000	无	0	国有法人
陕西大德投资集团有限责任公司	26,823,028	256,233,121	3.84	229,410,093	无	0	境内非国有法人
中航信托股份有限公司	29,000,000	229,000,000	3.44	200,000,000	无	0	境内非国有法人
武汉高科国有控股集团有限公司	45,050,497	195,218,819	2.93	0	无	0	国有法人
武汉当代科技产业集团股份有限公司	44,498,448	192,826,610	2.89	148,328,162	质押	138,700,000	境内非国有法人
苏州建丰投资中心（有限合伙）	0	184,000,000	2.76	184,000,000	无	0	境内非国有法人
湖北省科技投资集团有限公司	40,113,846	173,826,666	2.61	0	无	0	国有法人

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
武汉高科国有控股集团有限公司	195,218,819	人民币普通股	195,218,819
武汉国有资产经营有限公司	190,995,826	人民币普通股	190,995,826
湖北省科技投资集团有限公司	173,826,666	人民币普通股	173,826,666
人福医药集团股份公司	156,943,278	人民币普通股	156,943,278
湖北省联合发展投资集团有限公司	155,807,917	人民币普通股	155,807,917
上海潞安投资有限公司	97,867,007	人民币普通股	97,867,007
武汉恒健通科技有限责任公司	89,000,000	人民币普通股	89,000,000
武汉市铁源物资有限公司	75,484,423	人民币普通股	75,484,423
上海天需投资合伙企业（有限合伙）	67,600,000	人民币普通股	67,600,000
香港中央结算有限公司	63,115,482	人民币普通股	63,115,482
上述股东关联关系或一致行动的说明	公司股东人福医药集团股份公司和武汉当代科技产业集团股份有限公司因受同一实际控制人控制而存在关联关系及一致行动人关系。除此之外，公司未知上述股东之间存在关联关系或一致行动关系。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用		

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

√适用 □不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	武汉国有资产经营有限公司	636,652,755	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月

2	人福医药集团股份公司	523,144,259	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
3	湖北省联合发展投资集团有限公司	519,359,724	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
4	陕西大德投资集团有限责任公司	229,410,093	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
5	宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	210,000,000	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
6	中航信托股份有限公司	200,000,000	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
7	苏州建丰投资中心（有限合伙）	184,000,000	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
8	武汉当代科技产业集团股份有限公司	148,328,162	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
9	上海天闾投资合伙企业（有限合伙）	101,700,182	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
10	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	49,082,732	2021年10月19日	0	自上市之日起满36个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		公司股东人福医药集团股份公司、武汉当代科技产业集团股份有限公司、上海天闾投资合伙企业（有限合伙）和武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司因受同一实际控制人控制而存在关联关系及一致行动人关系。除此之外，公司未知上述股东之间存在关联关系或一致行动关系。			

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

三、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

第七节 优先股相关情况

适用 不适用

第八节 董事、监事、高级管理人员情况

一、持股变动情况

(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

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
杨洁	董事	选举
秦军	原董事	离任
肖函	首席人力资源官	聘任
	原首席风险官	离任
王勇	首席风险官	聘任
王洪栋	副总裁	聘任
刘翔	原副总裁	离任

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

公司股东湖北省科技投资集团有限公司向公司提出调整派驻于天风证券的董事人员，由杨洁女士接替秦军先生出任公司董事一职。2020年1月15日，公司2020年第一次临时股东大会选举杨洁女士为天风证券股份有限公司第三届董事会董事。

公司董事会收到首席风险官肖函女士、副总裁刘翔先生提交的辞职报告，肖函女士因工作需要申请辞去公司首席风险官职务，刘翔先生因个人原因申请辞去公司副总裁职务。2020年4月3日，公司第三届董事会第二十九次会议聘任肖函女士为公司首席人力资源官，聘任王勇先生为公司首席风险官，聘任王洪栋先生为公司副总裁。

三、其他说明

适用 不适用

第九节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

一、公司债券基本情况

单位:亿元 币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率(%)	还本付息方式	交易场所
天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券(第一期)(疫情防控债)	20 天风 01	163423	2020-04-15	2023-04-15	15	2.87	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第三期)	19 天风 03	162279	2019-10-18	2022-10-18	5	4.30	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第二期)	19 天风 02	162113	2019-09-11	2022-09-11	13	4.47	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第一期)	19 天风 01	151401	2019-04-18	2022-04-18	12	4.30	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券(第二期)	18 天风 02	143534	2018-03-27	2023-03-27	8.8	5.80	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券(第一期)	18 天风 01	143497	2018-03-14	2023-03-14	24.2	5.95	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司公开发行 2017 年公司债券(第二期)	17 天风 02	143358	2017-10-25	2022-10-25	5	5.24	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司公开发行 2017 年公司债券(第一期)	17 天风 01	143127	2017-06-26	2022-06-26	15	5.38	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2016 年公司债券(第二期)	16 天风 02	136676	2016-08-31	2021-08-31	13	3.48	本期债券在债券存续期内固定不变,每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2016 年公司债券(第一期)	16 天风 01	136501	2016-06-20	2021-06-20	20	4.18	本期债券在债券存续期内固定不变,每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2020 年非公开发	20 天风 C3	167109	2020-06-23	2023-06-23	18	4.70	本期债券在债券存续期内固定不变,	上海证券

行次级债券(第一期)(品种一)							每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑现一起支付。	交易所
天风证券股份有限公司2020年次级债券(第一期)品种二	20天风C2	166129	2020-02-27	2023-02-27	10.8	4.90	本期债券在债券存续期内固定不变,每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑现一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司2020年次级债券(第一期)品种一	20天风C1	166128	2020-02-27	2023-02-27	6.7	3.90	本期债券在债券存续期内固定不变,每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑现一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司2019年次级债券(第一期)	19天风C1	151841	2019-08-27	2022-08-27	7.5	4.99	本期债券在债券存续期内固定不变,每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑现一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司2018年次级债券(品种一)	18天风C1	150330	2018-04-26	2021-04-26	9	6.00	本次债券每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司2017年次级债券	17天风次	145466	2017-04-11	2022-04-11	10	5.20	本期债券按年付息、到期一次还本。利息每年支付一次,最后一期利息随本金一起支付。	上海证券交易所
天风证券股份有限公司2015年次级债券	15天风次	125762	2015-10-28	2020-10-28	20	5.50	本期债券按年付息、到期一次还本。利息每年支付一次,最后一期利息随本金一起支付。	上海证券交易所

公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

1. 2019年非公开发行公司债券(第一期), 19天风01已于2020年4月20日支付2019年4月18日至2020年4月17日期间的利息。
2. 2018年公司债券(第二期), 18天风02已于2020年3月27日支付2019年3月27日至2020年3月26日期间的利息。
3. 2018年公司债券(第一期), 18天风01已于2020年3月16日支付2019年3月14日至2020年3月13日期间的利息。
4. 2017年公司债券(第一期), 17天风01已于2020年6月29日支付2019年6月26日至2020年6月25日期间的利息。
5. 2016年公司债券(第一期), 16天风01已于2020年6月22日支付2019年6月20日至2020年6月19日期间的利息。
6. 2018年次级债券(品种一), 18天风C1已于2020年4月27日支付2019年4月26日至2020年4月25日期间的利息。
7. 2017年次级债券, 17天风次已于2020年4月13日支付2019年4月11日至2020年4月10日期间的利息。

公司债券其他情况的说明

√适用 □不适用

1. 增发 1 亿美元海外债

公司于 2019 年 7 月 2 日召开第三届董事会第十八次会议并于 2019 年 7 月 22 日召开 2019 年第四次临时股东大会，审议通过了《关于公司直接或间接发行境外债券具体方案的议案》，同意公司或境外全资子公司在中国境外发行不超过（含）6 亿美元相当的境外债券。具体内容详见公司分别于 2019 年 7 月 3 日和 2019 年 7 月 23 日披露的《天风证券股份有限公司第三届董事会第十八次会议决议公告》（2019-060 号）和《天风证券股份有限公司 2019 年第四次临时股东大会决议公告》（2019-065 号）。

公司已于 2019 年 11 月 28 日完成首期 2 亿美元高级信用债券发行，并在 2019 年年度报告中披露相关信息。2020 年 3 月 13 日，公司增发 1 亿美元高级信用债券，票面利率为 4%，于 2020 年 3 月 19 日完成交割。

2. “17 天风 01” 公司债券票面利率调整

公司于 2020 年 5 月 28 日公告“17 天风 01” 公司债券票面利率调整情况，本期债券在存续期内前 3 年（2017 年 6 月 26 日至 2020 年 6 月 25 日）票面年利率为 5.38%，在债券存续期内前 3 年固定不变；在本期债券存续期的第 3 年末，发行人决定下调本期债券票面利率，即在本期债券存续期后 2 年（2020 年 6 月 26 日至 2022 年 6 月 25 日）本期债券票面利率为 2.90%。

二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

债券受托管理人	名称	华英证券有限责任公司
	办公地址	无锡经济开发区金融一街 10 号无锡金融中心 5 层 01-06 单元
	联系人	袁湖、王骆
	联系电话	0510-85200875
	受托管理债券	20 天风 C3
债券受托管理人	名称	南京证券股份有限公司
	办公地址	南京市江东中路 389 号
	联系人	成惠芝
	联系电话	025-83367888
	受托管理债券	20 天风 01
债券受托管理人	名称	海通证券股份有限公司
	办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号天圆祥泰大厦 15 层
	联系人	江艳、郑云桥
	联系电话	010-88027168
	受托管理债券	19 天风 03、19 天风 02、19 天风 01、18 天风 02、18 天风 01、16 天风 02、16 天风 01、18 天风 C1、17 天风次、15 天风次
债券受托管理人	名称	华福证券有限责任公司
	办公地址	湖北省武汉市中北路 108 号兴业大厦 10 楼

	联系人	施屹、黄娇、乐涛、张毕辉
	联系电话	027-87335780
	受托管理债券	17 天风 02、17 天风 01
债券受托管理人	名称	浙商证券股份有限公司
	办公地址	杭州市江干区五星路 201 号浙商大楼
	联系人	徐鹏
	联系电话	0571-87903232
	受托管理债券	19 天风 C1、20 天风 C1、20 天风 C2
资信评级机构	名称	中诚信证券评估有限公司
	办公地址	北京市东城区朝阳门内大街南竹杆胡同 2 号银河 SOHO 6 号楼
	评级债券	19 天风 03、19 天风 02、19 天风 01、19 天风 C1、20 天风 01、20 天风 C1、20 天风 C2、20 天风 C3
资信评级机构	名称	大公国际资信评估有限公司
	办公地址	北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 A 座 29 层
	评级债券	18 天风 02、18 天风 01、16 天风 02、16 天风 01、18 天风 C1、17 天风次、15 天风次、17 天风 02、17 天风 01

其他说明：

适用 不适用

三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

报告期内，本公司公开发行的一期公司债券，发行规模 15 亿元，截至报告期末，已使用 14.98 亿元，全部用于补充营运资金，剩余 0.02 亿元。公开发行的次级债券，发行规模 17.5 亿元，截至报告期末，已使用 17.47 亿元，全部用于补充营运资金，剩余 0.03 亿元。非公开发行的次级债券，发行规模 18 亿元，截至报告期末，已使用 6 亿元，全部用于补充营运资金，剩余 12 亿元。

2019 年，本公司非公开发行的三期公司债券，合计发行规模 30 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金。非公开发行的次级债券，发行规模 7.5 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金。

2018 年，本公司公开发行的两期公司债券，合计发行规模 33 亿元，截至报告期末，扣除承销费后全部用于补充营运资金。非公开发行的次级债券，发行规模 9 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金。

2017 年，本公司公开发行的两期公司债券，合计发行规模 20 亿元，截至报告期末，扣除承销费后全部用于补充营运资金。非公开发行的次级债券，发行规模 10 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金。

2016 年，本公司公开发行的两期公司债券，合计发行规模 33 亿元，截至报告期末，扣除承销费后全部用于补充营运资金。非公开发行的次级债券，发行规模 5.8 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金。

2015 年，本公司公开发行的第一期公司债券，发行规模 12 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金，已于 2018 年 7 月 31 日到期摘牌并兑付本息。非公开发行的次级债券，发行规模 20 亿元，扣除承销费后全部用于补充营运资金。

公司按照《公司债券发行与交易管理办法》的相关要求，设立各期公司债券、次级债券募集资金专项账户，用于债券募集资金的接收、储存、划转及兑息、兑付资金的归集和管理。

截至报告期末，除 2020 公司债券剩余 0.02 亿元，2020 次级债券剩余 12.03 亿元，其他各期债券募集资金已使用完毕，全部用于补充公司营运资金，与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

四、公司债券评级情况

√适用 □不适用

1、2020 年 3 月 6 日，中诚信证券评估有限公司对“天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券（第一期）（疫情防控债）”出具评级报告，信用等级为 AAA（信评委函字【2020】0462D 号）。

2020 年 2 月 14 日，中诚信证券评估有限公司对公司发行的“天风证券股份有限公司 2020 年次级债券（第一期）”出具评级报告，信用等级为 AA+（信评委函字【2020】G087-F2 号）。

2020 年 5 月 21 日，中诚信证券评估有限公司对公司发行的“天风证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券”出具评级报告，信用等级为 AA+（信评委函字【2020】1624D 号）。

2020 年 6 月 28 日，中诚信证券评估有限公司对公司出具主体评级报告，主体评级维持为 AAA，展望稳定（信评委函字【2020】2171M 号）。

2、2020 年 6 月 12 日，大公资信出具了《天风证券股份有限公司主体与相关债项 2019 年度跟踪评级报告》（大公报 SDF【2020】016 号），维持公司主体信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”，维持公司发行的 15 天风债、16 天风 01、16 天风 02、17 天风 01、17 天风 02、18 天风 01、18 天风 02 的债券信用等级为 AAA。

五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

√适用 □不适用

公司发行的所有债券均无担保、抵押或质押等增信机制。

截至本报告期末，公司存续期各期债券的增偿债计划及其他偿债保障措施与募集说明书中“偿债计划及其他保障措施”章节没有重大变化，且各项措施均得到了有效执行。

六、公司债券持有人会议召开情况

□适用 √不适用

七、公司债券受托管理人履职情况

√适用 □不适用

债券代码：163423

债券简称	20 天风 01
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：162279

债券简称	19 天风 03
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：162113

债券简称	19 天风 02
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：151401

债券简称	19 天风 01
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的

	信息披露网站 (http://www.sse.com.cn)。
是否存在利益冲突, 及其风险防范、解决机制	否

债券代码: 143534

债券简称	18 天风 02
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定, 对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪, 并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务, 积极行使了债券受托管理人职责, 维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告, 每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告, 受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站 (http://www.sse.com.cn)。
是否存在利益冲突, 及其风险防范、解决机制	否

债券代码: 143497

债券简称	18 天风 01
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定, 对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪, 并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务, 积极行使了债券受托管理人职责, 维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告, 每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告, 受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站 (http://www.sse.com.cn)。
是否存在利益冲突, 及其风险防范、解决机制	否

债券代码: 143358

债券简称	17 天风 02
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定, 对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪, 并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务, 积极行使了债券受托管理人职责, 维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告, 每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告, 受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站 (http://www.sse.com.cn)。
是否存在利益冲突, 及其风险防范、解决机制	否

债券代码: 143127

债券简称	17 天风 01
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定, 对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪, 并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务, 积极行使了债券受托管理人职责, 维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本

	期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：136676

债券简称	16 天风 02
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：136501

债券简称	16 天风 01
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：167109

债券简称	20 天风 C3
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：166129

债券简称	20 天风 C2
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积

	极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：166128

债券简称	20 天风 C1
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：151841

债券简称	19 天风 C1
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：150330

债券简称	18 天风 C1
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：145466

债券简称	17 天风次
------	--------

受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：125762

债券简称	15 天风次
受托管理人履行职责情况	严格按照《债券受托管理协议》中的约定，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中所约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。受托管理人预计将于发行人年度报告公告后的 2 个月内出具本期债券年度受托管理事务报告，每年六月三十日前向市场公告上一年度受托管理事务报告，受托管理报告详见证监会指定的信息披露网站（ http://www.sse.com.cn ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

八、截至报告期末和上年末（或本报告期和上年同期）下列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	3.45	2.48	39.11	流动资产增加
速动比率	3.02	2.09	44.50	速动资产增加
资产负债率（%）	63.75	66.59	-4.26	
贷款偿还率（%）	100.00	100.00		
	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
EBITDA 利息保障倍数	1.88	1.51	24.50	报告期内利润增加
利息偿付率（%）	100.00	100.00		

九、关于逾期债项的说明

□适用 √不适用

十、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用 □不适用

截至本报告出具之日，各项其他债券和债务融资工具均不存在延迟支付本息的情况。（详情已在第九节公司债券相关情况中的公司债券基本情况披露）

十一、 公司报告期内的银行授信情况

适用 不适用

公司在各大银行等金融机构的资信情况良好，与其一直保持长期合作伙伴关系，获得较高的授信额度，截至报告期末，公司获得主要银行的授信额度为 344.60 亿元，已使用额度为 170.21 亿元，未使用额度为 174.39 亿元。

十二、 公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

适用 不适用

报告期内，公司完全遵从公司债券募集说明书相关约定和承诺，不存在违反的情况。

十三、 公司发生重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用 不适用

第十节 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

2020 年 6 月 30 日

编制单位：天风证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	1	12,415,856,335.91	8,879,676,149.48
其中：客户资金存款		7,212,950,557.60	5,436,071,874.47
结算备付金	2	3,512,661,195.49	1,887,047,540.15
其中：客户备付金		2,516,808,800.31	1,248,239,299.02
贵金属	3		
拆出资金	4	200,040,000.00	150,102,500.00
融出资金	5	5,735,476,576.81	6,068,122,661.53
衍生金融资产	6	65,084.41	
存出保证金	7	2,579,390,915.43	1,914,546,749.91
应收款项	8	1,555,324,762.22	747,858,938.94
应收款项融资	9		
合同资产	10		
买入返售金融资产	11	3,415,092,733.22	3,505,744,837.42
持有待售资产	12		
金融投资：		32,453,941,984.77	27,959,851,853.88
交易性金融资产	13	27,723,728,836.43	23,141,487,599.28
债权投资	14		
其他债权投资	15	933,390,123.43	979,663,520.62
其他权益工具投资	16	3,796,823,024.91	3,838,700,733.98
长期股权投资	17	4,698,572,028.32	644,871,981.39
投资性房地产	18	153,499,774.52	156,642,036.79
固定资产	19	107,741,379.70	113,148,035.12
在建工程	20	479,151,851.80	395,860,677.04
使用权资产	21		
无形资产	22	568,182,697.67	584,113,695.22
商誉	23	67,343,299.74	66,634,466.97
递延所得税资产	24	226,428,661.38	176,750,717.71
其他资产	25	5,914,109,055.81	6,669,361,683.50
资产总计		74,082,878,337.20	59,920,334,525.05
负债：			
短期借款	29		
应付短期融资款	30	3,682,770,493.13	4,101,653,977.00
拆入资金	31	400,081,111.11	150,068,750.00
交易性金融负债	32		
衍生金融负债	6	872,444.00	274,923.17

卖出回购金融资产款	33	8,754,939,653.06	10,037,807,023.02
代理买卖证券款	34	11,046,627,571.97	7,512,796,666.15
代理承销证券款	35		
应付职工薪酬	36	284,955,237.83	237,678,307.95
应交税费	37	156,263,870.19	68,841,127.56
应付款项	38	48,016,517.89	34,316,294.16
合同负债	39	45,201,032.05	
持有待售负债	40		
预计负债	41		
长期借款	42		
应付债券	43	24,054,165,675.02	18,020,388,943.79
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	44		
递延收益	45	195,000.00	195,000.00
递延所得税负债	24	89,390,035.33	99,850,963.76
其他负债	46	2,666,507,090.97	2,149,216,016.12
负债合计		51,229,985,732.55	42,413,087,992.68
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	47	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00
其他权益工具	48		
其中：优先股			
永续债			
资本公积	49	8,100,185,352.18	4,259,929,865.37
减：库存股	50		
其他综合收益	51	-331,685,649.81	-241,330,968.35
盈余公积	52	292,289,870.75	292,289,870.75
一般风险准备	53	628,846,808.64	619,594,651.18
未分配利润	54	2,371,747,250.67	2,012,666,643.86
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		17,727,350,912.43	12,123,150,062.81
少数股东权益		5,125,541,692.22	5,384,096,469.56
所有者权益（或股东权益）合计		22,852,892,604.65	17,507,246,532.37
负债和所有者权益（或股东权益）总计		74,082,878,337.20	59,920,334,525.05

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司资产负债表

2020年6月30日

编制单位：天风证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年6月30日	2019年12月31日
资产：			
货币资金		9,560,636,502.48	7,087,678,848.26
其中：客户资金存款		5,277,191,146.69	3,975,072,020.47
结算备付金		3,895,848,150.35	2,195,561,198.20

其中：客户备付金		2,501,979,382.75	1,244,405,529.24
贵金属			
拆出资金		200,040,000.00	150,102,500.00
融出资金		5,735,476,576.81	6,068,122,661.53
衍生金融资产		65,084.41	
存出保证金		418,992,358.47	284,663,124.79
应收款项		992,965,310.58	730,261,330.94
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产		2,623,572,051.23	3,119,101,139.14
持有待售资产			
金融投资：		25,786,877,585.04	22,063,914,296.90
交易性金融资产		24,491,592,457.26	20,720,477,933.83
债权投资		101,345,947.76	105,116,439.56
其他债权投资		933,390,123.43	979,663,520.62
其他权益工具投资		260,549,056.59	258,656,402.89
长期股权投资	1	7,599,125,699.67	3,328,033,987.00
投资性房地产		16,702,440.06	17,083,290.24
固定资产		72,789,902.55	76,616,522.21
在建工程		109,775,497.71	91,258,949.32
使用权资产			
无形资产		83,775,351.46	90,927,995.09
商誉			
递延所得税资产		109,962,041.24	84,100,480.78
其他资产		5,033,056,144.73	3,656,231,203.49
资产总计		62,239,660,696.79	49,043,657,527.89
负债：			
短期借款			
应付短期融资款		3,682,770,493.13	4,101,653,977.00
拆入资金		400,081,111.11	150,068,750.00
交易性金融负债			
衍生金融负债		872,444.00	274,923.17
卖出回购金融资产款		8,749,936,157.22	9,972,434,386.59
代理买卖证券款		7,705,488,039.36	4,968,008,458.78
代理承销证券款			
应付职工薪酬		270,040,222.13	222,587,143.24
应交税费		179,497,286.28	59,938,479.88
应付款项			
合同负债		18,237,188.56	
持有待售负债			
预计负债			
长期借款			
应付债券		24,028,954,910.54	18,000,551,095.47
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
递延收益			
递延所得税负债		107,586,138.41	104,957,045.41

其他负债		136,192,063.15	113,003,944.14
负债合计		45,279,656,053.89	37,693,478,203.68
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		6,665,967,280.00	5,180,000,000.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		7,295,985,273.63	3,457,303,927.45
减：库存股			
其他综合收益		-150,838,487.57	-151,253,075.11
盈余公积		292,289,870.75	292,289,870.75
一般风险准备		628,846,808.64	619,594,651.18
未分配利润		2,227,753,897.45	1,952,243,949.94
所有者权益（或股东权益）合计		16,960,004,642.90	11,350,179,324.21
负债和所有者权益（或股东权益）总计		62,239,660,696.79	49,043,657,527.89

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

合并利润表

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年半年度	2019 年半年度
一、营业总收入		2,061,307,013.11	1,814,478,415.81
利息净收入	55	-200,239,813.36	-166,738,298.39
其中：利息收入		572,227,576.53	463,266,270.44
利息支出		772,467,389.89	630,004,568.83
手续费及佣金净收入	56	1,357,199,164.46	987,733,640.55
其中：经纪业务手续费净收入		334,011,803.28	314,066,506.38
投资银行业务手续费净收入		522,973,050.00	304,623,619.12
资产管理业务手续费净收入		421,900,555.43	329,427,661.67
投资收益（损失以“-”号填列）	57	830,490,935.06	594,903,767.13
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		75,733,250.95	17,562,265.11
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）	58		
其他收益	59	4,649,322.36	1,241,293.39
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	60	44,284,321.61	158,418,630.22
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-247,537.45	-77,341.06
其他业务收入	61	25,092,925.01	239,000,626.91
资产处置收益（损失以“-”号填列）	62	77,695.42	-3,902.94
二、营业总支出		1,442,455,076.59	1,602,818,360.47
税金及附加	63	16,340,729.91	13,786,797.76
业务及管理费	64	1,314,331,982.16	1,204,007,094.47
信用减值损失	65	107,810,821.25	146,343,201.72
其他资产减值损失	66		8,846,560.21
其他业务成本	67	3,971,543.27	229,834,706.31

三、营业利润（亏损以“-”号填列）		618,851,936.52	211,660,055.34
加：营业外收入	68	2,097,937.38	57,049,894.28
减：营业外支出	69	10,562,268.04	5,181,783.67
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		610,387,605.86	263,528,165.95
减：所得税费用	70	70,145,249.26	45,587,417.02
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		540,242,356.60	217,940,748.93
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		540,242,356.60	217,940,748.93
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）		404,988,465.61	168,189,542.25
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		135,253,890.99	49,751,206.68
六、其他综合收益的税后净额	71	-224,935,008.58	-281,270,960.07
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-87,014,579.12	-169,641,863.33
（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		-67,726,458.11	-159,510,738.99
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		105,835.17	628,371.01
2. 其他债权投资公允价值变动		-1,144,689.00	-12,805,299.13
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		26,600.71	50,375.53
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额		-18,275,867.89	1,995,428.25
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		-137,920,429.46	-111,629,096.74
七、综合收益总额		315,307,348.02	-63,330,211.14
归属母公司所有者的综合收益总额		317,973,886.49	-1,452,321.08
归属于少数股东的综合收益总额		-2,666,538.47	-61,877,890.06
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）		0.068	0.032
（二）稀释每股收益（元/股）		0.068	0.032

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司利润表

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年半年度	2019 年半年度
一、营业总收入		1,658,776,363.87	1,434,032,054.77
利息净收入	2	-258,972,667.10	-194,384,136.42
其中：利息收入		459,229,958.83	398,974,147.00
利息支出		718,202,625.93	593,358,283.42
手续费及佣金净收入	3	1,241,741,245.40	937,780,253.36

其中：经纪业务手续费净收入		325,986,611.81	271,427,094.31
投资银行业务手续费净收入		472,602,287.02	304,623,619.12
资产管理业务手续费净收入		417,807,369.91	336,067,845.92
投资收益（损失以“-”号填列）	4	660,817,662.05	463,406,018.29
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		75,679,656.55	17,774,837.37
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		4,489,851.38	1,098,608.05
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5	10,441,902.65	226,146,362.18
汇兑收益（损失以“-”号填列）		134,494.66	13,545.19
其他业务收入		135,795.15	
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-11,920.32	-28,595.88
二、营业总支出		1,242,104,544.85	1,162,748,727.94
税金及附加		14,789,313.73	11,737,462.81
业务及管理费	6	1,123,814,124.55	1,000,938,245.43
信用减值损失		103,120,256.39	149,692,169.52
其他资产减值损失			
其他业务成本		380,850.18	380,850.18
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		416,671,819.02	271,283,326.83
加：营业外收入		1,870,172.93	56,438,860.95
减：营业外支出		10,506,741.67	4,849,534.61
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		408,035,250.28	322,872,653.17
减：所得税费用		83,276,892.82	85,273,941.68
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		324,758,357.46	237,598,711.49
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		324,758,357.46	237,598,711.49
（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		414,138.73	-136,616,384.43
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		1,426,391.85	-124,489,831.84
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		1,426,391.85	-124,489,831.84
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		-1,012,253.12	-12,126,552.59
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		105,835.17	628,371.01
2. 其他债权投资公允价值变动		-1,144,689.00	-12,805,299.13
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		26,600.71	50,375.53
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		325,172,496.19	100,982,327.06

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

合并现金流量表

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年半年度	2019年半年度
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
向其他金融机构拆入资金净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,659,149,354.19	1,160,583,977.38
拆入资金净增加额		200,074,861.11	-530,000,000.00
回购业务资金净增加额		-1,223,272,225.76	1,333,547,122.97
融出资金净减少额		332,646,084.72	-2,075,098,415.03
代理买卖证券收到的现金净额		3,551,066,341.46	1,263,355,974.94
收到其他与经营活动有关的现金	72(1)	312,980,528.86	1,739,782,659.27
经营活动现金流入小计		4,832,644,944.58	2,892,171,319.53
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,735,056,004.21	-782,705,030.28
拆出资金净增加额			
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		317,768,831.29	298,240,774.73
支付给职工及为职工支付的现金		852,436,763.15	678,220,620.10
支付的各项税费		245,580,832.29	216,552,304.46
支付其他与经营活动有关的现金	72(2)	662,725,011.60	2,992,911,232.29
经营活动现金流出小计		5,813,567,442.54	3,403,219,901.30
经营活动产生的现金流量净额		-980,922,497.96	-511,048,581.77
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		730,000,000.00	3,589,471,306.38
取得投资收益收到的现金		45,964,547.47	111,179,417.60
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			25,000.00
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			-5,409,094.72
收到其他与投资活动有关的现金			2,800.00
投资活动现金流入小计		775,964,547.47	3,695,269,429.26
投资支付的现金		4,360,338,147.98	3,679,885,353.45
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		297,664,984.60	129,769,715.81
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		3,702,525.87	7,239,560.61
投资活动现金流出小计		4,661,705,658.45	3,816,894,629.87
投资活动产生的现金流量净额		-3,885,741,110.98	-121,625,200.61
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		5,324,648,626.18	40,000,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			40,000,000.00
取得借款收到的现金		5,901,800,000.00	4,528,500,000.00
发行债券收到的现金		6,130,086,491.02	1,184,400,000.00

收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		17,356,535,117.20	5,752,900,000.00
偿还债务支付的现金		6,684,662,532.53	2,820,055,302.97
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		676,360,211.14	574,355,061.19
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金		19,598,491.02	21,783,649.90
筹资活动现金流出小计		7,380,621,234.69	3,416,194,014.06
筹资活动产生的现金流量净额		9,975,913,882.51	2,336,705,985.94
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-247,537.45	-882,670.92
五、现金及现金等价物净增加额		5,109,002,736.12	1,703,149,532.64
加：期初现金及现金等价物余额		10,740,413,953.43	9,031,882,923.54
六、期末现金及现金等价物余额		15,849,416,689.55	10,735,032,456.18

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司现金流量表

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年半年度	2019年半年度
一、经营活动产生的现金流量：			
销售商品、提供劳务收到的现金			
向其他金融机构拆入资金净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		1,548,955,365.99	1,168,352,203.80
拆入资金净增加额		200,074,861.11	-530,000,000.00
回购业务资金净增加额		-797,636,238.29	1,352,982,577.06
融出资金净减少额		332,911,184.39	-2,075,098,415.03
代理买卖证券收到的现金净额		2,737,628,046.51	1,328,122,588.68
收到其他与经营活动有关的现金		20,000,000.00	1,051,378,542.14
经营活动现金流入小计		4,041,933,219.71	2,295,737,496.65
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,119,031,702.74	-632,352,999.36
拆出资金净增加额			
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		235,450,015.54	283,778,316.25
支付给职工及为职工支付的现金		739,538,159.04	577,763,544.87
支付的各项税费		240,702,872.56	196,291,937.30
支付其他与经营活动有关的现金		3,287,929,771.93	2,169,582,654.78
经营活动现金流出小计		7,622,652,521.81	2,595,063,453.84
经营活动产生的现金流量净额		-3,580,719,302.10	-299,325,957.19
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		730,000,000.00	2,841,057,753.70
取得投资收益收到的现金			
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		34,622,493.73	

收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		764,622,493.73	2,841,057,753.70
投资支付的现金		3,357,968,604.35	3,368,582,185.66
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		33,094,262.26	63,067,197.73
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		3,391,062,866.61	3,431,649,383.39
投资活动产生的现金流量净额		-2,626,440,372.88	-590,591,629.69
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		5,324,648,626.18	
取得借款收到的现金		5,901,800,000.00	4,258,500,000.00
发行债券收到的现金		6,130,086,491.02	1,184,400,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		17,356,535,117.20	5,442,900,000.00
偿还债务支付的现金		6,387,900,000.00	2,314,650,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		588,050,996.95	541,450,894.52
支付其他与筹资活动有关的现金		9,566,491.02	303,649.90
筹资活动现金流出小计		6,985,517,487.97	2,856,404,544.42
筹资活动产生的现金流量净额		10,371,017,629.23	2,586,495,455.58
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		134,494.66	13,545.19
五、现金及现金等价物净增加额		4,163,992,448.91	1,696,591,413.89
加：期初现金及现金等价物余额		9,264,237,625.72	7,156,190,554.91
六、期末现金及现金等价物余额		13,428,230,074.63	8,852,781,968.80

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

合并所有者权益变动表

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2020 年半年度											
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计	
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	5,180,000,000.00				4,259,929,865.37		-241,330,968.35	292,289,870.75	619,594,651.18	2,012,666,643.86	5,384,096,469.56	17,507,246,532.37
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	5,180,000,000.00				4,259,929,865.37		-241,330,968.35	292,289,870.75	619,594,651.18	2,012,666,643.86	5,384,096,469.56	17,507,246,532.37
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	1,485,967,280.00				3,840,255,486.81		-90,354,681.46		9,252,157.46	359,080,606.81	-258,554,777.34	5,345,646,072.28
（一）综合收益总额							-87,014,579.12			404,988,465.61	-2,666,538.47	315,307,348.02
（二）所有者投入和减少资本	1,485,967,280.00				3,840,255,486.81						-257,623,562.35	5,068,599,204.46
1. 所有者投入的普通股	1,485,967,280.00				3,838,681,346.18							5,324,648,626.18
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他					1,574,140.63						-257,623,562.35	-256,049,421.72
（三）利润分配									9,252,157.46	-49,247,961.14		-39,995,803.68
1. 提取盈余公积												
2. 提取一般风险准									9,252,157.46	-9,252,157.46		

(一) 综合收益总额					-190,675,909.88			168,189,542.25	-111,629,096.74	-134,115,464.37
(二) 所有者投入和减少资本				-214,277,290.44					-271,281,426.79	-485,558,717.23
1. 所有者投入的普通股				-214,277,290.44					40,000,000.00	-174,277,290.44
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									-311,281,426.79	-311,281,426.79
(三) 利润分配							9,751,521.34	-46,011,521.34		-36,260,000.00
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备							9,751,521.34	-9,751,521.34		
3. 对所有者(或股东)的分配								-36,260,000.00		-36,260,000.00
4. 其他										
(四) 所有者权益内部结转					21,034,046.55			-21,034,046.55	-2,345,337.74	-2,345,337.74
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					21,034,046.55			-21,034,046.55	-2,345,337.74	-2,345,337.74
6. 其他										
四、本期期末余额	5,180,000,000.00			4,262,715,932.85	-166,517,710.80	252,907,122.07	531,578,254.42	1,987,991,666.57	5,782,999,245.77	17,831,674,510.88

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

母公司所有者权益变动表

2020 年 1—6 月

单位:元 币种:人民币

项目	2020 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减:库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		-151,253,075.11	292,289,870.75	619,594,651.18	1,952,243,949.94	11,350,179,324.21
加: 会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		-151,253,075.11	292,289,870.75	619,594,651.18	1,952,243,949.94	11,350,179,324.21
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	1,485,967,280.00				3,838,681,346.18		414,587.54		9,252,157.46	275,509,947.51	5,609,825,318.69
(一) 综合收益总额							414,138.73			324,758,357.46	325,172,496.19
(二) 所有者投入和减少资本	1,485,967,280.00				3,838,681,346.18						5,324,648,626.18
1. 所有者投入的普通股	1,485,967,280.00				3,838,681,346.18						5,324,648,626.18
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
(三) 利润分配									9,252,157.46	-49,247,961.14	-39,995,803.68
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备									9,252,157.46	-9,252,157.46	
3. 对所有者(或股东)的分配										-39,995,803.68	-39,995,803.68
4. 其他											
(四) 所有者权益内部结转							448.81			-448.81	
1. 资本公积转增资本(或股本)											

2. 盈余公积转增资本(或股本)										
3. 盈余公积弥补亏损										
4. 设定受益计划变动额结转留存收益										
5. 其他综合收益结转留存收益						448.81			-448.81	
6. 其他										
四、本期期末余额	6,665,967,280.00				7,295,985,273.63	-150,838,487.57	292,289,870.75	628,846,808.64	2,227,753,897.45	16,960,004,642.90

项目	2019 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		39,186,554.76	246,697,420.17	509,407,329.28	1,705,061,209.94	11,137,656,441.60
加：会计政策变更							-60,374,967.32	6,209,701.90	12,419,403.80	43,467,913.30	1,722,051.68
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		-21,188,412.56	252,907,122.07	521,826,733.08	1,748,529,123.24	11,139,378,493.28
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)							-136,616,384.43		9,751,521.34	175,050,312.99	48,185,449.90
(一) 综合收益总额							-153,153,261.59			237,598,711.49	84,445,449.90
(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									9,751,521.34	-46,011,521.34	-36,260,000.00

1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备								9,751,521.34	-9,751,521.34	
3. 对所有者（或股东）的分配									-36,260,000.00	-36,260,000.00
4. 其他										
（四）所有者权益内部结转						16,536,877.16			-16,536,877.16	
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						16,536,877.16			-16,536,877.16	
6. 其他										
四、本期期末余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45	-157,804,796.99	252,907,122.07	531,578,254.42	1,923,579,436.23	11,187,563,943.18

法定代表人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：许欣

三、公司基本情况

1. 公司概况

√适用 □不适用

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

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

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

2020 年 3 月 31 日，经中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券股份有限公司配股的批复》（证监许可（2020）39 号）文件核准，经上海证券交易所同意，公司本次配股共计配售 1,485,967,280 股人民币普通股，发行价格为 3.60 元/股，本次新增股份上市流通日为 2020 年 3 月 31 日，本次配售上市后公司股本总数变更为 6,665,967,280 股。

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

公司地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法人代表：余磊

注册资本：人民币陆拾陆亿陆仟伍佰玖拾陆万柒仟贰佰捌拾元整

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；代销金融产品（凭许可证在核定范围内及期限内经营）；为期货公司提供中间介绍业务。（上述经营范围中国家有专项规定的项目经审批后或凭许可证在核定范围内与期限内经营）。

公司对营业部实行了统一结算、统一风险管理、统一资金调拨、统一财务管理和会计核算。截止 2020 年 6 月 30 日，本公司共设有营业执照的 103 家营业部及 15 家分公司。

2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

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

公司纳入合并报表范围的子公司详见本报告“第十节 财务报告 十、1、在子公司中的权益”。

四、财务报表的编制基础

1. 编制基础

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

2. 持续经营

√适用 □不适用

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

五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

√适用 □不适用

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

1. 遵循企业会计准则的声明

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

2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

3. 营业周期

√适用 □不适用

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

4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

√适用 □不适用

(1) 同一控制下的企业合并

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

(2) 非同一控制下的企业合并

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

6. 合并财务报表的编制方法

√适用 □不适用

(1) 合并财务报表范围

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

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

本公司在评估对结构化主体拥有的权力时，通常考虑下列四方面：

在设立被投资方时的决策及本公司的参与度；

相关合同安排；

仅在特定情况或事项发生时开展的相关活动；

④ 本公司对被投资方做出的承诺。

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

(2) 统一母子公司的会计政策、统一母子公司的资产负债表日及会计期间

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

(3) 合并财务报表抵销事项

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

(4) 合并取得子公司会计处理

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

7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

√适用 □不适用

(1) 合营安排的分类

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

(2) 共同经营的会计处理

共同经营参与方应当确认其与共同经营中利益份额相关的下列项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理：确认单独所持有的资产或负债，以及按其份额确认共同持有的资产或负债；确认出售其享有的共同经营产出份额所产生的收入；按其份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；确认单独所发生的费用，以及按其份额确认共同经营发生的费用。

对共同经营不享有共同控制的参与方，如果享有该共同经营相关资产且承担该共同经营相关负债的，参照共同经营参与方的规定进行会计处理；否则，应当按照相关企业会计准则的规定进行会计处理。

(3) 合营企业的会计处理

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

8. 现金及现金等价物的确定标准

现金等价物是指企业持有的期限短（一般指从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

√适用 □不适用

(1) 外币业务折算

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

(2) 外币财务报表折算

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

10. 金融工具

金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

√适用 □不适用

1) 金融工具的分类及重分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

① 金融资产

本公司将同时符合下列条件的金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产：A. 本公司管理金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；B. 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本公司将同时符合下列条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产：A. 本公司管理金融资产的业务模式既以收取合同现金流量又以出售该金融资产为目标；B. 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

对于非交易性权益工具投资，本公司可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

除分类为以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产之外的金融资产，本公司将其分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能消除或减少会计错配，本公司可以将金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

②金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；以摊余成本计量的金融负债。所有的金融负债不进行重分类。

2) 金融工具的计量

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

①金融资产

A. 以摊余成本计量的金融资产

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

B. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

C. 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

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

D. 指定为公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资

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

②金融负债

A. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的，由企业自身信用风险变动引起的该金融负债公允价值的变动金额，计入其他综合收益，其他公允价值变动计入当期损益。如果对该金融负债的自身信用风险变动的影响计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配的，本公司将该金融负债的全部利得或损失计入当期损益。

B. 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对此类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

3) 本公司对金融工具的公允价值的确认方法

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

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

4) 金融资产和金融负债转移的确认依据和计量方法

①金融资产

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

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

金融资产转移整体满足终止确认条件的，将以下两项金额的差额计入当期损益：A. 被转移金融资产在终止确认日的账面价值；B. 因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产）之和。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，先按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，然后将以下两项金额的差额计入当期损益：A. 终止确认部分在终止确认日的账面价值；B. 终止确认部分收到的对价，与原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产）之和。

针对本公司指定为公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

②金融负债

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

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

5) 预期信用损失的确定方法及会计处理方法

①预期信用损失的确定方法

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

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

A. 较低信用风险的金融工具计量损失准备的方法

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

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

B. 应收款项、租赁应收款计量损失准备的方法

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

C. 其他金融资产计量损失准备的方法

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

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

(a) 可获得有关过去事项、当前状况及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

(b) 宏观经济状况、债务人经营和财务情况、内部实际违约率和预期违约概率、外部信用评级和内部信用评级、逾期情况、外部市场定价等信息；

(c) 金融工具预计存续期内违约风险的相对变化，而非违约风险变动的绝对值。

当出现以下一项或多项可观察信息时，本公司认为相关金融资产已发生信用减值：

(a) 债券发行人、交易对手或债务人发生重大财务困难；

(b) 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；

(c) 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何情况下都不会做出的让步；

(d) 债务人、债券发行人或交易对手很可能破产或进行其他债务重组；

(e) 债券发行人、交易对手或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；

(f) 以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实；

(g) 融资类业务采取强制平仓措施、担保物价值已经不能覆盖融资金额；

(h) 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别；

(i) 债权人由于债务人、债券发行人或交易对手的财务困难作出让步。

② 预期信用损失的会计处理方法

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

11. 贵金属

适用 不适用

12. 应收款项

应收款项的预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节 10、5) 预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

13. 应收款项融资

适用 不适用

14. 合同资产**(1). 合同资产的确认方法及标准**

适用 不适用

本公司将已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示。

(2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节 10、5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

15. 持有待售资产

适用 不适用

本公司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：一是根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；二是出售极可能发生，即企业已经就一项出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。有关规定要求企业相关权力机构或者监管部门批准后方可出售的，应当已经获得批准。

初始计量或在资产负债表日重新计量持有待售的非流动资产或处置组时，其账面价值高于公允价值减去出售费用后的净额的，应当将账面价值减记至公允价值减去出售费用后的净额，减记的金额确认为资产减值损失计入当期损益，同时计提持有待售资产减值准备。

资产负债表中持有待售的非流动资产或持有待售的处置组中的资产列示为划分为持有待售的资产，持有待售的处置组中的负债列示为划分为持有待售的负债。

16. 债权投资**债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法**

适用 不适用

详见本节 10、5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

17. 其他债权投资**其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法**

适用 不适用

详见本节 10、5）预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

18. 长期股权投资

适用 不适用

(1) 初始投资成本确定

对于企业合并取得的长期股权投资，如为同一控制下的企业合并，应当按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额确认为初始成本；非同一控制下的企业合并，应当按购买日确定的合并

成本确认为初始成本；以支付现金取得的长期股权投资，初始投资成本为实际支付的购买价款；以发行权益性证券取得的长期股权投资，初始投资成本为发行权益性证券的公允价值；通过债务重组取得的长期股权投资，其初始投资成本应当按照《企业会计准则第 12 号—债务重组》的有关规定确定；非货币性资产交换取得的长期股权投资，初始投资成本根据准则相关规定确定。

(2) 后续计量及损益确认方法

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

(3) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

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

19. 投资性房地产

(1). 如果采用成本计量模式的

折旧或摊销方法

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

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

20. 固定资产

(1). 确认条件

适用 不适用

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

(2). 折旧方法

√适用 □不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	年限平均法	40	5%	2.38%
运输设备	年限平均法	6	3%	16.17%
电子设备及其他	年限平均法	5	3%	19.40%

(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

√适用 □不适用

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

21. 在建工程

√适用 □不适用

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

22. 借款费用

√适用 □不适用

(1) 借款费用资本化的确认原则

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

(2) 资本化金额计算方法

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

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

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

23. 使用权资产

适用 不适用

24. 无形资产

(1). 计价方法、使用寿命、减值测试

适用 不适用

①无形资产的计价方法

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

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

②使用寿命不确定的判断依据

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

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

(2). 内部研究开发支出会计政策

适用 不适用

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

划分内部研究开发项目的研究阶段和开发阶段的具体标准：为获取新的技术和知识等进行的有计划的调查阶段，应确定为研究阶段，该阶段具有计划性和探索性等特点；在进行商业性生产

或使用前，将研究成果或其他知识应用于某项计划或设计，以生产出新的或具有实质性改进的材料、装置、产品等阶段，应确定为开发阶段，该阶段具有针对性和形成成果的可能性较大等特点。

25. 长期资产减值

√适用 □不适用

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

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

在财务报表中单独列示的商誉，无论是否存在减值迹象，至少每年进行减值测试。减值测试时，商誉的账面价值分摊至预期从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合。测试结果表明包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额先抵减分摊至该资产组或资产组组合的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，以后期间不予转回价值得以恢复的部分。

26. 长期待摊费用

√适用 □不适用

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

27. 附回购条件的资产转让

√适用 □不适用

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

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

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

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

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

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

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

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

28. 合同负债

合同负债的确认方法

√适用 □不适用

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

本公司将同一合同下的合同资产和合同负债以净额列示。

29. 职工薪酬

(1)、短期薪酬的会计处理方法

√适用 □不适用

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

(2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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

(3)、辞退福利的会计处理方法

适用 不适用

企业向职工提供辞退福利时，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：企业不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；企业确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

(4)、其他长期职工福利的会计处理方法

适用 不适用

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

30. 预计负债

适用 不适用

当与或有事项相关的义务是公司承担的现时义务，且履行该义务很可能导致经济利益流出，同时其金额能够可靠地计量时确认该义务为预计负债。本公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量，如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；如涉及多个项目，按照各种可能结果及相关概率计算确定最佳估计数。资产负债表日应当对预计负债账面价值进行复核，有确凿证据表明该账面价值不能真实反映当前最佳估计数，应当按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

31. 租赁负债

适用 不适用

32. 股份支付

适用 不适用

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

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

33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

34. 回购本公司股份

适用 不适用

35. 收入

(1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

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

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

1) 手续费及佣金收入

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

证券承销收入，承销服务已经提供且收取的金额能够可靠地计量时按承销协议约定的金额或比例确认收入。以全额包销方式进行承销业务的，在将证券转售给投资者时，按承销价格确认为证券承销收入，按已承销证券的承购价格结转承销证券的成本；以余额包销或代销方式进行承销业务的，于发行结束后，与发行人结算发行价款时确认收入。

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

2) 利息收入

在相关的收入能够可靠计量，相关的经济利益能够收到时，按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。

买入返售金融资产在当期到期返售的，按返售价格与买入价格的差额确认为当期收入；在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期收入。

3) 投资收益

公司持有交易性金融资产和可供出售金融资产期间取得的红息或现金股利确认为当期收益；处置交易性金融资产时其公允价值与初始入账金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。处置可供出售金融资产时，取得的价款与原值接计入所有者权益的公允价值变动累计额的和与该金融资产账面价值的差额，计入投资收益。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分派的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

4) 其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入。

(2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

适用 不适用

36. 合同成本

适用 不适用

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

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

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

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

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

1. 因转让与该资产相关的商品预期能够取得的剩余对价；
2. 为转让该相关商品估计将要发生的成本。

37. 利润分配

适用 不适用

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

38. 政府补助

(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

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

按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

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

39. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

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

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

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

40. 租赁

(1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

经营租赁的租金支出在租赁期内按照直线法计入相关资产成本或当期损益。

(2)、融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

以租赁资产的公允价值与最低租赁付款额的现值两者中较低者作为租入资产的入账价值，租入资产的入账价值与最低租赁付款额之间的差额作为未确认融资费用，在租赁期内按实际利率法摊销。最低租赁付款额扣除未确认融资费用后的余额作为长期应付款列示。

(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

41. 融资融券业务

适用 不适用

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

融资业务，本公司对于融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，本公司对于融出的证券，不终止确认该证券，但确认相应利息收入。

本公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

42. 资产证券化业务

适用 不适用

43. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

(1) 客户资产管理业务

公司资产管理业务包括定向资产管理业务和集合资产管理业务。

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

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

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

(2) 转融通业务

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

1) 转融资业务

本公司对于融入的资金，确认对出借方的负债，并确认相应利息费用。

2) 转融券业务

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

(3) 分部报告政策

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

经营分部，是指本公司内同时满足下列条件的组成部分：

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

44. 重要会计政策和会计估计的变更

(1)、重要会计政策变更

适用 不适用

会计政策变更的内容和原因	审批程序	备注(受重要影响的报表项目名称和金额)
本公司于2020年1月1日开始执行财政部于2017年修订的《企业会计准则第14号—收入》。会计政策变更的主要内容详见下述“其他说明”。	2020年4月27日，公司第三届董事会第三十次会议、第三届监事会第八次会议审议通过了《关于会计政策变更的议案》。	详见本节44、(3)

其他说明：

财政部2017年7月发布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》。本公司自2020年1月1日起执行新收入准则。

新收入准则取代了财政部于2006年颁布的《企业会计准则第14号—收入》及《企业会计准则第15号—建造合同》(统称“原收入准则”)。在原收入准则下，本公司以风险报酬转移作为收入确认时点的判断标准。新收入准则引入了收入确认计量的“五步法”，并针对特定交易或事项提供了更多的指引，在新收入准则下，本公司以控制权转移作为收入确认时点的判断标准，具体收入确认和计量的会计政策详见本节五、35收入。

(2)、重要会计估计变更

适用 不适用

(3)、2020年起首次执行新收入准则、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	2019年12月31日	2020年1月1日	调整数
资产：			
货币资金	8,879,676,149.48	8,879,676,149.48	
其中：客户资金存款	5,436,071,874.47	5,436,071,874.47	
结算备付金	1,887,047,540.15	1,887,047,540.15	
其中：客户备付金	1,248,239,299.02	1,248,239,299.02	
贵金属			
拆出资金	150,102,500.00	150,102,500.00	
融出资金	6,068,122,661.53	6,068,122,661.53	
衍生金融资产			
存出保证金	1,914,546,749.91	1,914,546,749.91	
应收款项	747,858,938.94	747,858,938.94	
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	3,505,744,837.42	3,505,744,837.42	
持有待售资产			
金融投资：			
交易性金融资产	23,141,487,599.28	23,141,487,599.28	
债权投资			
其他债权投资	979,663,520.62	979,663,520.62	
其他权益工具投资	3,838,700,733.98	3,838,700,733.98	
长期股权投资	644,871,981.39	644,871,981.39	
投资性房地产	156,642,036.79	156,642,036.79	
固定资产	113,148,035.12	113,148,035.12	
在建工程	395,860,677.04	395,860,677.04	
使用权资产			
无形资产	584,113,695.22	584,113,695.22	
商誉	66,634,466.97	66,634,466.97	
递延所得税资产	176,750,717.71	176,750,717.71	
其他资产	6,669,361,683.50	6,669,361,683.50	
资产总计	59,920,334,525.05	59,920,334,525.05	
负债：			
短期借款			
应付短期融资款	4,101,653,977.00	4,101,653,977.00	
拆入资金	150,068,750.00	150,068,750.00	
交易性金融负债			
衍生金融负债	274,923.17	274,923.17	
卖出回购金融资产款	10,037,807,023.02	10,037,807,023.02	
代理买卖证券款	7,512,796,666.15	7,512,796,666.15	
代理承销证券款			
应付职工薪酬	237,678,307.95	237,678,307.95	
应交税费	68,841,127.56	68,841,127.56	
应付款项	34,316,294.16	34,316,294.16	
合同负债		46,203,382.84	46,203,382.84
持有待售负债			
预计负债			
长期借款			
应付债券	18,020,388,943.79	18,020,388,943.79	

其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
递延收益	195,000.00	195,000.00	
递延所得税负债	99,850,963.76	99,850,963.76	
其他负债	2,149,216,016.12	2,103,012,633.28	-46,203,382.84
负债合计	42,413,087,992.68	42,413,087,992.68	
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	5,180,000,000.00	5,180,000,000.00	
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	4,259,929,865.37	4,259,929,865.37	
减：库存股			
其他综合收益	-241,330,968.35	-241,330,968.35	
盈余公积	292,289,870.75	292,289,870.75	
一般风险准备	619,594,651.18	619,594,651.18	
未分配利润	2,012,666,643.86	2,012,666,643.86	
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	12,123,150,062.81	12,123,150,062.81	
少数股东权益	5,384,096,469.56	5,384,096,469.56	
所有者权益（或股东权益）合计	17,507,246,532.37	17,507,246,532.37	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	59,920,334,525.05	59,920,334,525.05	

各项目调整情况的说明：

√适用 □不适用

本公司于 2020 年 1 月 1 日开始执行财政部于 2017 年修订的《企业会计准则第 14 号—收入》准则，2020 年半年度报告已按照新收入准则的要求对 2020 年年初数进行衔接调整。

母公司资产负债表

单位：元 币种：人民币

项目	2019 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	调整数
资产：			
货币资金	7,087,678,848.26	7,087,678,848.26	
其中：客户资金存款	3,975,072,020.47	3,975,072,020.47	
结算备付金	2,195,561,198.20	2,195,561,198.20	
其中：客户备付金	1,244,405,529.24	1,244,405,529.24	
贵金属			
拆出资金	150,102,500.00	150,102,500.00	
融出资金	6,068,122,661.53	6,068,122,661.53	
衍生金融资产			
存出保证金	284,663,124.79	284,663,124.79	
应收款项	730,261,330.94	730,261,330.94	
应收款项融资			

合同资产			
买入返售金融资产	3,119,101,139.14	3,119,101,139.14	
持有待售资产			
金融投资：			
交易性金融资产	20,720,477,933.83	20,720,477,933.83	
债权投资	105,116,439.56	105,116,439.56	
其他债权投资	979,663,520.62	979,663,520.62	
其他权益工具投资	258,656,402.89	258,656,402.89	
长期股权投资	3,328,033,987.00	3,328,033,987.00	
投资性房地产	17,083,290.24	17,083,290.24	
固定资产	76,616,522.21	76,616,522.21	
在建工程	91,258,949.32	91,258,949.32	
使用权资产			
无形资产	90,927,995.09	90,927,995.09	
商誉			
递延所得税资产	84,100,480.78	84,100,480.78	
其他资产	3,656,231,203.49	3,656,231,203.49	
资产总计	49,043,657,527.89	49,043,657,527.89	
负债：			
短期借款			
应付短期融资款	4,101,653,977.00	4,101,653,977.00	
拆入资金	150,068,750.00	150,068,750.00	
交易性金融负债			
衍生金融负债	274,923.17	274,923.17	
卖出回购金融资产款	9,972,434,386.59	9,972,434,386.59	
代理买卖证券款	4,968,008,458.78	4,968,008,458.78	
代理承销证券款			
应付职工薪酬	222,587,143.24	222,587,143.24	
应交税费	59,938,479.88	59,938,479.88	
应付款项			
合同负债		16,948,466.01	16,948,466.01
持有待售负债			
预计负债			
长期借款			
应付债券	18,000,551,095.47	18,000,551,095.47	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债			
递延收益			
递延所得税负债	104,957,045.41	104,957,045.41	
其他负债	113,003,944.14	96,055,478.13	-16,948,466.01
负债合计	37,693,478,203.68	37,693,478,203.68	
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	5,180,000,000.00	5,180,000,000.00	
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	3,457,303,927.45	3,457,303,927.45	

减：库存股			
其他综合收益	-151,253,075.11	-151,253,075.11	
盈余公积	292,289,870.75	292,289,870.75	
一般风险准备	619,594,651.18	619,594,651.18	
未分配利润	1,952,243,949.94	1,952,243,949.94	
所有者权益（或股东权益）合计	11,350,179,324.21	11,350,179,324.21	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	49,043,657,527.89	49,043,657,527.89	

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

本公司于 2020 年 1 月 1 日开始执行财政部于 2017 年修订的《企业会计准则第 14 号—收入》准则，2020 年半年度报告已按照新收入准则的要求对 2020 年年初数进行衔接调整。

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

适用 不适用

45. 其他

适用 不适用

六、税项

1. 主要税种及税率

主要税种及税率情况

适用 不适用

税种	计税依据	税率
增值税	应税收入	9%、6%、5%、3%、1%
城市维护建设税	应纳流转税额	7%、5%、1%
企业所得税	应税收入	25%、16.5%
教育费附加	应纳流转税额	3%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

适用 不适用

纳税主体名称	所得税税率（%）
TF International Securities Group Limited	16.5
TFI Securities Limited	16.5
TF International Holdings Limited	16.5
TFI Asset Management Limited	16.5
TFI Securities and Futures Limited	16.5
除上述以外的其他纳税主体	25

2. 税收优惠

适用 不适用

3. 其他

适用 不适用

七、合并财务报表项目注释

1、货币资金

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	442,896.30	/	/	297,387.56
人民币	/	/	442,896.30	/	/	297,387.56
美元						
港元						
银行存款：	/	/	12,390,598,976.03	/	/	8,870,876,816.17
其中：自有资金	/	/	5,177,648,418.43	/	/	3,434,804,941.70
人民币	/	/	4,807,935,973.45	/	/	1,941,995,206.62
美元	1,075,077.85	7.0795	7,611,013.62	198,179,087.51	6.9762	1,382,536,950.28
港元	396,415,124.55	0.9134	362,101,431.36	123,102,530.53	0.8958	110,272,784.80
客户资金	/	/	7,212,950,557.60	/	/	5,436,071,874.47
人民币	/	/	6,791,185,103.13	/	/	5,287,848,446.75
美元	149,675.85	7.0795	1,059,630.18	233,457.86	6.9762	1,628,648.75
港元	460,573,025.37	0.9134	420,705,824.29	163,650,426.42	0.8958	146,594,778.97
其他货币资金：	/	/	9,103,698.21	/	/	1,194,630.29
人民币	/	/	9,103,698.21	/	/	1,194,630.29
美元						
港元						
应收利息			15,710,765.37			7,307,315.46
合计	/	/	12,415,856,335.91	/	/	8,879,676,149.48

其中，融资融券业务：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有信用资金	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
客户信用资金	/	/	787,385,044.23	/	/	708,439,845.93
人民币	/	/	787,385,044.23	/	/	708,439,845.93
美元						
港元						
合计	/	/	787,385,044.23	/	/	708,439,845.93

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

√适用 □不适用

截至2020年6月30日，受限制的货币资金为人民币28,254,578.20元，为风险准备专户存款。

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：	/	/	995,836,046.64	/	/	638,737,073.86
人民币	/	/	975,529,937.40	/	/	637,074,241.80
美元	0.02	7.0795	0.11	0.02	6.9762	0.14
港元	22,230,369.95	0.9134	20,306,109.13	1,856,294.98	0.8958	1,662,831.92
公司信用备付金：	/	/	16,348.54	/	/	71,167.27
人民币	/	/	16,348.54	/	/	71,167.27
美元						
港元						
客户普通备付金：	/	/	2,340,890,074.01	/	/	846,356,033.22
人民币	/	/	2,319,777,087.68	/	/	838,576,735.83
美元	193,805.53	7.0795	1,372,046.24	279,098.71	6.9762	1,947,048.42
港元	21,611,644.00	0.9134	19,740,940.09	6,510,805.07	0.8958	5,832,248.97
客户信用备付金：	/	/	175,918,726.30	/	/	401,883,265.80
人民币	/	/	175,918,726.30	/	/	401,883,265.80
美元						
港元						
合计	/	/	3,512,661,195.49	/	/	1,887,047,540.15

结算备付金的说明：

无

3、 贵金属

□适用 √不适用

4、 拆出资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
拆放银行		
拆放非银行金融机构	200,040,000.00	150,102,500.00
合计	200,040,000.00	150,102,500.00

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的拆出资金余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

拆出资金的说明：

无

5、融出资金

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	5,740,348,091.09	6,073,259,275.48
其中：个人	2,612,955,144.92	3,139,431,927.45
机构	3,127,392,946.17	2,933,827,348.03
减：减值准备	4,871,514.28	5,136,613.95
账面价值小计	5,735,476,576.81	6,068,122,661.53
境外		
其中：个人		
机构		
减：减值准备		
账面价值小计		
账面价值合计	5,735,476,576.81	6,068,122,661.53

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	865,816,486.22	859,206,726.32
债券	707,816,057.92	500,255,453.64
股票	17,116,585,722.14	17,267,977,403.74
基金	82,018,846.27	65,262,057.34
合计	18,772,237,112.55	18,692,701,641.04

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

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

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

融出资金的说明：

适用 不适用

6、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具 (按类别列示)												
—利率互换			19,728,222,000.00						21,759,369,850.00			
—国债期货			14,605,000,000.00						14,700,000,000.00			
—国债期货			5,123,222,000.00						7,059,369,850.00			
货币衍生工具 (按类别列示)												
权益衍生工具 (按类别列示)	419,481,800.00			357,438,140.00		872,444.00	267,625,260.00			485,092,500.00		274,923.17
—股指期货 (注)	419,481,800.00			79,609,160.00			267,625,260.00			303,576,620.00		
—期权				277,828,980.00		872,444.00			181,515,880.00			274,923.17
信用衍生工具 (按类别列示)												
其他衍生工具 (按类别列示)				210,930,624.88	65,084.41					50,098,870.00		
—商品期货				194,725,265.00						50,098,870.00		
—收益互换				16,205,359.88	65,084.41							
合计	419,481,800.00			20,296,590,764.88	65,084.41	872,444.00	267,625,260.00			22,294,561,220.00		274,923.17

已抵销的衍生金融工具：

适用 不适用

衍生金融工具的说明：

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

7、存出保证金

适用 不适用

单位：元

项目	期末账面余额			期初账面余额		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
交易保证金	/	/	2,553,798,108.42	/	/	1,900,904,986.50
其中：人民币	/	/	2,543,870,704.36	/	/	1,894,017,024.12
美元	276,497.13	7.0795	1,957,461.43	270,000.00	6.9762	1,883,574.00
港元	8,725,195.56	0.9134	7,969,942.63	5,586,626.60	0.8958	5,004,388.38
信用保证金	/	/	25,592,807.01	/	/	13,641,763.41
其中：人民币	/	/	25,592,807.01	/	/	13,641,763.41
美元						
港元						
履约保证金	/	/		/	/	
其中：人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
合计	/	/	2,579,390,915.43	/	/	1,914,546,749.91

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	611,785,187.32	53,586,650.11
应收资产管理费	833,972,616.96	687,650,991.28
应收手续费及佣金	179,846,748.05	48,060,955.97
应收票据		
应收租金收入	8,615,124.00	4,878,858.31
其他	2,196,728.24	1,793,295.09
合计	1,636,416,404.57	795,970,750.76
减：坏账准备(按简化模型计提)	81,091,642.35	48,111,811.82
减：坏账准备(按一般模型计提)		
应收款项账面价值	1,555,324,762.22	747,858,938.94

(2) 按账龄分析

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额		期初余额	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	1,247,396,645.45	76.23	580,756,454.89	72.96
1-2年	278,134,855.51	17.00	212,895,375.63	26.75
2-3年	110,884,903.61	6.77	2,318,920.24	0.29
3年以上				
合计	1,636,416,404.57	100.00	795,970,750.76	100.00

(3) 按计提坏账列示

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例(%)	金额	坏账准备计提比例(%)	金额	占账面余额合计比例(%)	金额	坏账准备计提比例(%)
单项计提坏账准备：								
单项计小计								
组合计提坏账准备：								
1年以内	1,247,396,645.45	76.23	30,962,473.46	2.48	580,756,454.89	72.96	26,358,490.22	4.54
1-2年	278,134,855.51	17.00	27,952,188.17	10.05	212,895,375.63	26.75	21,289,537.55	10.00

2-3年	110,884,903.61	6.77	22,176,980.72	20.00	2,318,920.24	0.29	463,784.05	20.00
组合小计	1,636,416,404.57	100.00	81,091,642.35	4.96	795,970,750.76	100.00	48,111,811.82	6.04
合计	1,636,416,404.57	100.00	81,091,642.35	4.96	795,970,750.76	100.00	48,111,811.82	6.04

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

9、应收款项融资

适用 不适用

10、合同资产

(1). 合同资产情况

适用 不适用

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

适用 不适用

(3). 本期合同资产计提减值准备情况

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

11、买入返售金融资产

(1) 按业务类别

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	1,825,583,641.66	1,903,327,005.54
债券质押式回购	1,726,983,550.24	876,184,173.63
债券买断式回购		793,041,020.10
其他		
减：减值准备	137,474,458.68	66,807,361.85
账面价值合计	3,415,092,733.22	3,505,744,837.42

(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	1,825,583,641.66	1,903,327,005.54
债券	1,726,983,550.24	1,669,225,193.73
基金		
其他		
减：减值准备	137,474,458.68	66,807,361.85

买入返售金融资产账面价值	3,415,092,733.22	3,505,744,837.42
--------------	------------------	------------------

(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	5,113,876,771.60	4,571,646,049.44
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物		798,549,290.00
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		798,549,290.00

(4) 约定购回、股票质押式回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	1,308,502,467.88	1,085,842,222.11
一个月至三个月内	64,362,084.04	233,227,167.89
三个月至一年内	452,719,089.74	584,257,615.54
一年以上		
合计	1,825,583,641.66	1,903,327,005.54

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

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

股票质押式回购按减值阶段列示：

项 目	期末余额			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
账面余额	206,223,940.92	876,673,781.93	742,685,918.81	1,825,583,641.66
减值准备	49,849.14	1,992,150.44	135,432,459.10	137,474,458.68
账面价值	206,174,091.78	874,681,631.49	607,253,459.71	1,688,109,182.98
担保物价值	422,270,417.04	2,017,045,079.05	668,619,819.26	3,107,935,315.35

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

买入返售金融资产的说明：

□适用 √不适用

12、持有待售资产

□适用 √不适用

13、交易性金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末余额						
类别	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计
债券	15,595,080,707.65		15,595,080,707.65	15,370,141,812.46		15,370,141,812.46
公募基金	1,543,100,018.65		1,543,100,018.65	1,520,030,685.16		1,520,030,685.16
股票/股权	4,569,256,416.94		4,569,256,416.94	4,284,366,855.76		4,284,366,855.76
银行理财产品						
券商资管产品	1,285,926,750.48		1,285,926,750.48	1,255,871,069.84		1,255,871,069.84
信托计划	930,558,150.35		930,558,150.35	897,855,525.00		897,855,525.00
其他	3,799,806,792.36		3,799,806,792.36	3,275,545,028.68		3,275,545,028.68
合计	27,723,728,836.43		27,723,728,836.43	26,603,810,976.90		26,603,810,976.90
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	12,981,852,521.05		12,981,852,521.05	12,743,135,753.58		12,743,135,753.58
公募基金	508,475,429.38		508,475,429.38	503,473,580.88		503,473,580.88
股票/股权	4,613,276,578.20		4,613,276,578.20	4,374,558,739.74		4,374,558,739.74
银行理财产品						
券商资管产品	1,829,821,280.32		1,829,821,280.32	1,806,424,549.34		1,806,424,549.34
信托计划	934,243,715.21		934,243,715.21	887,742,635.17		887,742,635.17
其他	2,273,818,075.12		2,273,818,075.12	1,835,109,450.82		1,835,109,450.82
合计	23,141,487,599.28		23,141,487,599.28	22,150,444,709.53		22,150,444,709.53

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的描述性说明

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

14、 债权投资

适用 不适用

15、 其他债权投资

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债										
地方债										
金融债										
企业债	888,000,000.00	50,832,020.80	-5,441,897.37	933,390,123.43	1,832,540.62	954,000,000.00	29,579,165.99	-3,915,645.37	979,663,520.62	1,797,072.98
其他										
合计	888,000,000.00	50,832,020.80	-5,441,897.37	933,390,123.43	1,832,540.62	954,000,000.00	29,579,165.99	-3,915,645.37	979,663,520.62	1,797,072.98

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

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

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他说明：

无

16、其他权益工具投资

(1). 按项目披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
非交易性权益工具	4,415,246,388.13	3,796,823,024.91	4,230,000.00	4,295,601,900.51	3,838,700,733.98	6,356,005.06	战略投资
合计	4,415,246,388.13	3,796,823,024.91	4,230,000.00	4,295,601,900.51	3,838,700,733.98	6,356,005.06	/

(2). 本期终止确认的其他权益工具

√适用 □不适用

由于上述权益工具并非为交易目的而持有，本公司将其指定为其他权益工具投资。由于公司战略调整，本公司对部分其他权益工具进行处置，相应的损益金额 3,340,102.34 元从其他综合收益重分类为留存收益。

其他说明：

□适用 √不适用

17、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	减值准备 期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		

一、合营企业										
小计										
二、联营企业										
湖北三环资本管理有限公司	20,460,579.91			-16,001.37					20,444,578.54	
武汉帮创科技有限公司	2,400,700.54			-2,400.00					2,398,300.54	
宜宾市商业银行股份有限公司	622,010,700.94			25,080,452.74	2,238,285.64				649,329,439.32	
恒泰证券股份有限公司		3,977,932,956.58		50,599,203.81	-2,132,450.47				4,026,399,709.92	
小计	644,871,981.39	3,977,932,956.58		75,661,255.18	105,835.17				4,698,572,028.32	
合计	644,871,981.39	3,977,932,956.58		75,661,255.18	105,835.17				4,698,572,028.32	

其他说明

无

18、投资性房地产

投资性房地产计量模式

(1). 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	土地使用权	在建工程	合计
一、账面原值				
1. 期初余额	194,007,810.53			194,007,810.53
2. 本期增加金额				
(1) 外购				
(2) 存货\固定资产\在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	194,007,810.53			194,007,810.53
二、累计折旧和累计摊销				
1. 期初余额	37,365,773.74			37,365,773.74
2. 本期增加金额	3,142,262.27			3,142,262.27
(1) 计提或摊销	3,142,262.27			3,142,262.27
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	40,508,036.01			40,508,036.01
三、减值准备				
1. 期初余额				
2. 本期增加金额				
(1) 计提				
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	153,499,774.52			153,499,774.52
2. 期初账面价值	156,642,036.79			156,642,036.79

(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	电子设备	运输工具	合计
一、账面原值：				
1. 期初余额	92,605,472.99	164,553,691.01	17,810,125.58	274,969,289.58

2. 本期增加金额		7,934,957.12		7,934,957.12
(1) 购置		7,934,957.12		7,934,957.12
(2) 在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额		3,572,963.58	603,340.17	4,176,303.75
(1) 处置或报废		3,572,963.58	603,340.17	4,176,303.75
4. 期末余额	92,605,472.99	168,915,684.55	17,206,785.41	278,727,942.95
二、累计折旧				
1. 期初余额	21,865,691.32	124,432,408.34	14,964,289.91	161,262,389.57
2. 本期增加金额	1,878,845.67	10,670,615.76	734,008.70	13,283,470.13
(1) 计提	1,878,845.67	10,670,615.76	734,008.70	13,283,470.13
3. 本期减少金额	380,850.18	3,180,309.14	557,002.02	4,118,161.34
(1) 处置或报废	380,850.18	3,180,309.14	557,002.02	4,118,161.34
4. 期末余额	23,363,686.81	131,922,714.96	15,141,296.59	170,427,698.36
三、减值准备				
1. 期初余额		558,864.89		558,864.89
2. 本期增加金额				
(1) 计提				
3. 本期减少金额				
(1) 处置或报废				
4. 期末余额		558,864.89		558,864.89
四、账面价值				
1. 期末账面价值	69,241,786.18	36,434,104.70	2,065,488.82	107,741,379.70
2. 期初账面价值	70,739,781.67	39,562,417.78	2,845,835.67	113,148,035.12

(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

单位：元 币种：人民币

项目	账面原值	累计折旧	减值准备	账面价值
电子设备	2,111,103.04	2,055,842.99		55,260.05
合计	2,111,103.04	2,055,842.99		55,260.05

(4). 通过经营租赁租出的固定资产

□适用 √不适用

(5). 未办妥产权证书的固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书的原因
房屋建筑物	605,189.40	正在办理中
合计	605,189.40	

其他说明：

□适用 √不适用

20、在建工程

(1). 在建工程情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
天风证券光谷一路项目	109,775,497.71		109,775,497.71	91,258,949.32		91,258,949.32
天风证券中北路F地块	369,376,354.09		369,376,354.09	304,601,727.72		304,601,727.72
合计	479,151,851.80		479,151,851.80	395,860,677.04		395,860,677.04

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期初余额	本期增加金额	期末余额
天风证券光谷一路项目	91,258,949.32	18,516,548.39	109,775,497.71
天风证券中北路F地块	304,601,727.72	64,774,626.37	369,376,354.09
合计	395,860,677.04	83,291,174.76	479,151,851.80

(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

22、无形资产

(1). 无形资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	交易席位费	软件使用权	土地使用权	特许经营权	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	2,845,780.00	225,246,116.53	525,027,788.00	20,800,000.03	773,919,684.56
2. 本期增加金额	17,660.00	7,238,848.24			7,256,508.24
(1) 购置	17,660.00	7,238,848.24			7,256,508.24
(2) 内部研发					
(3) 企业合并增加					
3. 本期减少金额	913,440.00	629,518.12			1,542,958.12
(1) 处置	913,440.00	629,518.12			1,542,958.12
4. 期末余额	1,950,000.00	231,855,446.65	525,027,788.00	20,800,000.03	779,633,234.68
二、累计摊销					

1. 期初余额		146,603,555.73	43,202,433.61		189,805,989.34
2. 本期增加金额		15,732,454.48	10,697,759.13		26,430,213.61
(1) 计提		15,732,454.48	10,697,759.13		26,430,213.61
3. 本期减少金额		629,967.21	4,155,698.73		4,785,665.94
(1) 处置		629,967.21	4,155,698.73		4,785,665.94
4. 期末余额		161,706,043.00	49,744,494.01		211,450,537.01
三、减值准备					
1. 期初余额					
2. 本期增加金额					
(1) 计提					
3. 本期减少金额					
(1) 处置					
4. 期末余额					
四、账面价值					
1. 期末账面价值	1,950,000.00	70,149,403.65	475,283,293.99	20,800,000.03	568,182,697.67
2. 期初账面价值	2,845,780.00	78,642,560.80	481,825,354.39	20,800,000.03	584,113,695.22

本期末通过公司内部研发形成的无形资产占无形资产余额的比例 0%

(2). 未办妥产权证书的土地使用权情况

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

23、商誉

(1). 商誉账面原值

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加		本期减少		期末余额
		企业合并形成的	外币报表折算	处置		
天风期货股份有限公司	15,209,584.51					15,209,584.51
武汉光谷创投私募基金管理有限公司（原名：光谷创投基金管理有限公司）	45,237.49					45,237.49
TFI Asset Management Limited	14,831,718.58		708,832.77			15,540,551.35
企巢天风（武汉）创业投资中心（有限合伙）	593,327.62					593,327.62
TFI Securities and Futures Limited	35,954,598.77					35,954,598.77
合计	66,634,466.97		708,832.77			67,343,299.74

(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

TFI Asset Management Limited 商誉本期增加额为外币报表折算差异造成。本公司对因非同一控制下企业合并形成的商誉账面价值按照预计未来现金流量现值计算其可收回金额，天风期货股份有限公司、TFI Asset Management Limited 及 TFI Securities and Futures Limited 的可收回金额基于管理层的经营计划和调整后的折现率 11.65%至 12.51%计算，在预测期之后的现金流按照稳定的增长率和终值推算。本公司根据上述假设分析各资产组的可收回金额，可回收金额并没有导致确认减值损失，本公司商誉在本报告期末未发生减值。

(5). 商誉减值测试的影响

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

24、递延所得税资产/递延所得税负债

(1). 未经抵销的递延所得税资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	443,515,737.92	110,878,934.49	336,996,186.98	84,249,046.76
内部交易未实现利润				
可抵扣亏损	31,074,359.68	7,768,589.92	32,856,736.33	8,214,184.08
公允价值变动	431,124,547.95	107,781,136.97	337,149,947.46	84,287,486.87
合计	905,714,645.55	226,428,661.38	707,002,870.77	176,750,717.71

(2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
非同一控制企业合并资产评估增值				
公允价值变动	357,560,141.33	89,390,035.33	399,403,855.02	99,850,963.76
合计	357,560,141.33	89,390,035.33	399,403,855.02	99,850,963.76

(3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

适用 不适用

(4). 未确认递延所得税资产明细

适用 不适用

(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

25、其他资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
应收利息	583,966.20	1,752,560.80
应收股利		2,432,210.56
其他应收款	309,988,782.95	539,542,395.19
抵债资产		
代理兑付债券		
合同取得成本		
合同履约成本		
应收退货成本		
长期待摊费用	38,565,755.29	47,211,143.26
应收结算担保金	10,057,563.40	10,000,000.00
预付账款	67,585,533.18	60,549,963.77
其他流动资产	1,172,243,615.43	1,290,493,867.19
其他非流动资产	4,315,083,839.36	4,717,379,542.73
合计	5,914,109,055.81	6,669,361,683.50

其他应收款按款项性质列示：

适用 不适用

1. 其他应收款

(1) 按明细列示

款项性质	期末余额	期初余额
其他应收款余额	446,256,353.75	675,464,074.55
减：减值准备	136,267,570.80	135,921,679.36
其他应收款净值	309,988,782.95	539,542,395.19

(2) 按类别明细列示

类别	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	97,503,670.74	21.85	97,503,670.74	100.00
按组合计提坏账准备	348,752,683.01	78.15	38,763,900.06	

其中：应收往来款组合	322,576,437.45	72.28	38,678,845.74	11.99
应收押金组合	26,176,245.56	5.87	85,054.32	0.32
特定款项组合				
合 计	446,256,353.75	100.00	136,267,570.80	

类 别	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	97,503,424.03	14.44	97,503,424.03	100.00
按组合计提坏账准备	577,960,650.52	85.56	38,418,255.33	
其中：应收往来款组合	255,447,127.02	37.82	37,418,616.40	14.65
应收押金组合	21,691,574.09	3.21	97,173.08	0.45
特定款项组合	300,821,949.41	44.53	902,465.85	0.30
合 计	675,464,074.55	100.00	135,921,679.36	

1) 截止期末，单项计提坏账准备的其他应收款

债务人名称	账面余额	坏账金额	账龄	计提比例 (%)	计提理由
中拓（福建）实业有限公司	86,216,147.40	86,216,147.40	1 年以内	100	确定无法收回
上海集翔新能源科技有限公司	4,800,000.00	4,800,000.00	1 年以内	100	确定无法收回
广东天铁冷轧薄板加工有限公司	2,450,000.00	2,450,000.00	1 年以内	100	确定无法收回
成都联贸实业有限公司	3,774,679.75	3,774,679.75	5 年以上	100	账龄较长，难以收回
其他	262,843.59	262,843.59	1 年以内； 1-2 年；3 年以上	100	确定无法收回
合 计	97,503,670.74	97,503,670.74			

2) 按组合计提坏账准备的其他应收款

账 龄	期末余额			期初余额		
	账面余额	占账面余额合计比例 (%)	坏账准备	账面余额	占账面余额合计比例 (%)	坏账准备
1 年以内	180,673,680.03	51.81	5,446,867.39	408,645,026.10	70.70	5,297,260.27
1-2 年	72,166,072.61	20.69	7,494,601.04	72,513,280.92	12.55	7,071,515.72
2-3 年	57,999,713.12	16.63	10,937,291.55	59,168,203.24	10.24	11,166,026.72
3 年以上	37,913,217.25	10.87	14,885,140.08	37,634,140.26	6.51	14,883,452.62
合 计	348,752,683.01	100.00	38,763,900.06	577,960,650.52	100.00	38,418,255.33

2. 长期待摊费用

类 别	期初余额	本期增加额	本期摊销额	其他减少额	期末余额
装修改造费	45,409,039.87	1,984,189.18	11,272,074.57		36,121,154.48
软件服务费	1,263,599.37	90,566.04	265,384.78		1,088,780.63
其他	538,504.02	828,946.80	11,630.64		1,355,820.18
合 计	47,211,143.26	2,903,702.02	11,549,089.99		38,565,755.29

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他资产的说明：

无

26、 融券业务情况

适用 不适用

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
		计提	其他增加	转回	转/核销	
拆出资金减值准备						
融出资金减值准备	5,136,613.95	-265,099.67				4,871,514.28
存出保证金减值准备						
应收款项坏账准备	48,111,811.82	32,979,830.53				81,091,642.35
合同资产减值准备						
买入返售金融资产减值准备	66,807,361.85	70,667,096.83				137,474,458.68
债权投资减值准备						
其他债权投资减值准备	1,797,072.98	170,056.82			134,589.18	1,832,540.62
其他应收款坏账准备	135,921,679.36	-1,472,345.81	1,818,237.25			136,267,570.80
其他金融资产减值准备	133,163,632.12	5,731,282.55				138,894,914.67
金融工具及其他项目信用减值准备小计	390,938,172.08	107,810,821.25	1,818,237.25		134,589.18	500,432,641.40
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	558,864.89					558,864.89
在建工程减值准备						
无形资产减值准备						
商誉减值准备						
其他资产减值准备小计	558,864.89					558,864.89
合计	391,497,036.97	107,810,821.25	1,818,237.25		134,589.18	500,991,506.29

资产减值准备的说明：

无

28、 金融工具及其他项目预期信用损失准备表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

金融工具类别	期末余额			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未)	整个存续期预期信用损失(已发生)	

		发生信用减值)	信用减值)	
拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	4,871,514.28			4,871,514.28
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备 (简化模型)	/	81,091,642.35		81,091,642.35
应收款项坏账准备 (一般模型)				
合同资产减值准备 (简化模型)	/			
合同资产减值准备 (一般模型)				
买入返售金融资产减值准备	49,849.14	1,992,150.44	135,432,459.10	137,474,458.68
债权投资减值准备				
其他债权投资减值准备	1,832,540.62			1,832,540.62
其他应收款坏账准备		38,763,900.06	97,503,670.74	136,267,570.80
其他金融资产减值准备	20,769,050.57	78,995,153.71	39,130,710.39	138,894,914.67
合计	27,522,954.61	200,842,846.56	272,066,840.23	500,432,641.40
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
拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	5,136,613.95			5,136,613.95
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备 (简化模型)	/	48,111,811.82		48,111,811.82
应收款项坏账准备 (一般模型)				
合同资产减值准备 (简化模型)	/			
合同资产减值准备 (一般模型)				
买入返售金融资产减值准备	318,160.88	81,196.11	66,408,004.86	66,807,361.85
债权投资减值准备				
其他债权投资减值准备	1,797,072.98			1,797,072.98
其他应收款坏账准备		38,418,255.33	97,503,424.03	135,921,679.36
其他金融资产减值准备	19,107,422.89	74,925,498.84	39,130,710.39	133,163,632.12
合计	26,359,270.70	161,536,762.10	203,042,139.28	390,938,172.08

29、短期借款

(1). 短期借款分类

适用 不适用

(2). 已逾期未偿还的短期借款情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

30、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率(%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
收益凭证(注)				3,974,100,000.00	3.30-5.00	2,091,499,182.47	1,959,346,111.53	1,368,643,106.88	2,682,202,187.12
19 天风证券 CP004 短期融资券	100	2019-10-16	91 天	1,000,000,000.00	3.03	1,006,392,054.81	1,141,551.75	1,007,533,606.56	
19 天风证券 CP005 短期融资券	100	2019-11-20	91 天	1,000,000,000.00	3.27	1,003,762,739.72	4,367,588.15	1,008,130,327.87	
20 天风证券 CP001 短期融资券	100	2020-01-13	91 天	1,000,000,000.00	2.90		1,007,210,382.51	1,007,210,382.51	
20 天风证券 CP002 短期融资券	100	2020-02-24	91 天	1,000,000,000.00	2.60		1,006,464,480.87	1,006,464,480.87	
20 天风证券 CP003 短期融资券	100	2020-03-18	91 天	1,000,000,000.00	2.25		1,005,609,589.04	1,005,609,589.04	
20 天风证券 CP004 短期融资券	100	2020-06-23	91 天	1,000,000,000.00	2.60		1,000,568,306.01		1,000,568,306.01
合计	/		/	9,974,100,000.00		4,101,653,977.00	5,984,708,009.86	6,403,591,493.73	3,682,770,493.13

应付短期融资款的说明：

本公司 2020 年 6 月 30 日尚未到期的期限小于一年的收益凭证共计 36 笔，未到期产品的票面利率均在 3.30%-5.00%之间

31、拆入资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
银行拆入资金	400,081,111.11	150,068,750.00
合计	400,081,111.11	150,068,750.00

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
交易所质押式回购	1,521,613,841.16	1,509,594,690.93
银行间质押式卖出回购	7,233,325,811.90	8,528,212,332.09
合计	8,754,939,653.06	10,037,807,023.02

(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	8,754,939,653.06	10,037,807,023.02
合计	8,754,939,653.06	10,037,807,023.02

(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	9,795,172,687.50	10,728,609,019.77
合计	9,795,172,687.50	10,728,609,019.77

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

□适用 √不适用

卖出回购金融资产款的说明：

□适用 √不适用

34、代理买卖证券款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
普通经纪业务		
其中：个人	8,387,285,759.51	5,344,259,632.98
机构	1,682,887,649.75	1,311,991,131.88
小计	10,070,173,409.26	6,656,250,764.86
信用业务		
其中：个人	959,830,044.64	854,220,970.21
机构	16,624,118.07	2,324,931.08
小计	976,454,162.71	856,545,901.29
合计	11,046,627,571.97	7,512,796,666.15

代理买卖证券款的说明：

无

35、代理承销证券款

□适用 √不适用

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	236,910,653.95	789,980,001.27	742,096,064.33	284,794,590.89
二、离职后福利-设定提存计划	165,693.82	8,070,150.72	8,075,197.60	160,646.94
三、辞退福利	601,960.18	799,249.05	1,401,209.23	
合计	237,678,307.95	798,849,401.04	751,572,471.16	284,955,237.83

(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	235,526,277.58	745,319,177.86	697,443,731.00	283,401,724.44
二、职工福利费		8,932,112.94	8,932,112.94	
三、社会保险费	8,257.10	12,855,916.66	12,861,470.93	2,702.83
其中：医疗保险费	8,062.65	11,683,462.22	11,689,039.06	2,485.81
工伤保险费	29.38	95,891.31	95,891.31	29.38
生育保险费	165.07	1,076,563.13	1,076,540.56	187.64
四、住房公积金	114,103.18	22,261,039.67	22,246,995.32	128,147.53
五、工会经费和职工教育经费	1,262,016.09	611,754.14	611,754.14	1,262,016.09
合计	236,910,653.95	789,980,001.27	742,096,064.33	284,794,590.89

(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	159,637.26	7,797,898.32	7,802,829.56	154,706.02
2、失业保险费	6,056.56	272,252.40	272,368.04	5,940.92
合计	165,693.82	8,070,150.72	8,075,197.60	160,646.94

其他说明：

□适用 √不适用

37、应交税费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税	25,338,752.96	33,725,361.67
企业所得税	105,625,579.52	11,073,515.90
个人所得税	17,624,732.19	15,401,681.15
城市维护建设税	1,996,758.59	2,274,580.39
教育费附加及地方教育费附加	1,343,597.71	1,571,514.47
其他	4,334,449.22	4,794,473.98
合计	156,263,870.19	68,841,127.56

其他说明：

无

38、应付款项

(1). 应付款项列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付清算款项	15,334,189.06	10,136,303.79

期货风险准备金	21,779,776.72	20,896,503.30
应付手续费及佣金	4,520,086.99	3,283,487.07
应付赎回款	6,382,465.12	
合计	48,016,517.89	34,316,294.16

(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
预收款项	45,201,032.05	46,203,382.84
合计	45,201,032.05	46,203,382.84

(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
16 天风 01	100	2016. 6. 20	3+2 年	2,000,000,000.00	3.37、4.18	2,033,493,527.59	45,394,087.43	83,600,000.00	1,995,287,615.02
16 天风 02	100	2016. 8. 31	5 年	1,300,000,000.00	3.48	1,312,678,783.31	23,412,126.12		1,336,090,909.43
17 天风 01	100	2017. 6. 26	3+2 年	1,500,000,000.00	5.38、2.9	1,536,976,097.21	681,550.26	80,700,000.00	1,456,957,647.47
17 天风 02	100	2017. 10. 25	3+2 年	500,000,000.00	5.24	503,120,746.81	13,382,245.44		516,502,992.25
18 天风 01	100	2018. 3. 14	3+2 年	2,420,000,000.00	5.95	2,526,094,678.87	73,143,972.86	143,990,000.00	2,455,248,651.73
18 天风 02	100	2018. 3. 27	3+2 年	880,000,000.00	5.80	915,658,543.57	25,936,373.57	51,040,000.00	890,554,917.14
19 天风 01	100	2019. 4. 18	3 年	1,200,000,000.00	4.30	1,232,750,121.25	26,535,194.20	51,600,000.00	1,207,685,315.45
19 天风 02	100	2019. 9. 11	3 年	1,300,000,000.00	4.47	1,313,327,493.02	29,836,069.20		1,343,163,562.22
19 天风 03	100	2019. 10. 18	3 年	500,000,000.00	4.30	502,594,967.92	11,050,915.98		513,645,883.90
20 天风 01	100	2020. 4. 15	3 年	1,500,000,000.00	2.87		1,505,133,092.91		1,505,133,092.91
15 天风次	100	2015. 10. 28	5 年	2,000,000,000.00	5.50	2,017,143,381.60	56,466,862.62		2,073,610,244.22
17 天风次	100	2017. 4. 11	5 年	1,000,000,000.00	5.20	1,034,744,893.65	26,566,896.84	52,000,000.00	1,009,311,790.49
18 天风 C1	100	2018. 4. 26	3 年	900,000,000.00	6.00	936,750,000.00	27,000,000.00	54,000,000.00	909,750,000.00
19 天风 C1	100	2019. 8. 27	3 年	750,000,000.00	4.99	760,999,898.68	19,048,848.66		780,048,747.34
20 天风 C1	100	2020. 2. 27	3 年	670,000,000.00	3.90		678,277,386.43		678,277,386.43
20 天风 C2	100	2020. 2. 27	5 年	1,080,000,000.00	4.90		1,096,999,802.72		1,096,999,802.72
20 天风 C3	100	2020. 6. 23	3 年	1,800,000,000.00	4.70		1,797,664,705.30		1,797,664,705.30
TIANFS 4.3 12/09/22	100 美元	2019. 12. 09	3 年	200,000,000.00 美元	4.30	1,394,055,810.31	51,556,114.07	30,441,850.00	1,415,170,074.38
TIANFS 4.3 12/09/22	100 美元	2019. 12. 09	3 年	100,000,000.00 美元	4.30		719,516,507.25	6,764,855.56	712,751,651.69
天庚 4 号		2020. 6. 22	547 天	360,000,000.00	3.50		360,310,684.93		360,310,684.93
合计						18,020,388,943.79	6,587,913,436.79	554,136,705.56	24,054,165,675.02

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：

无

44、租赁负债

□适用 √不适用

45、递延收益

√适用 □不适用

单位：元 币种人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因
第十批“3551 光谷人才计划”科技（金融）服务人才资助资金	195,000.00			195,000.00	
合计	195,000.00			195,000.00	/

涉及政府补助的项目：

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

46、其他负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付账款	84,791,313.79	63,097,759.90
应付利息	10,490,665.64	5,953,942.78
其他应付款	491,029,876.94	249,941,421.53
其他流动负债	711,127,132.47	431,564,128.14
其他非流动负债	1,369,038,046.15	1,352,142,010.25
长期应付款	30,055.98	313,370.68
合计	2,666,507,090.97	2,103,012,633.28

其他应付款按款项性质列示：

□适用 √不适用

其他负债的说明：

无

47、股本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期初余额	本次变动增减（+、-）					小计	期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他			
股份总数	5,180,000,000.00	1,485,967,280.00					1,485,967,280.00	6,665,967,280.00

其他说明：

无

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

□适用 √不适用

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

□适用 √不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

49、资本公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	4,251,282,642.47	3,840,255,486.81		8,091,538,129.28
其他资本公积	8,647,222.90			8,647,222.90
合计	4,259,929,865.37	3,840,255,486.81		8,100,185,352.18

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期资本溢价增加系由公司收购子公司少数股权以及公司配股、外币报表折算差异所致。

50、库存股

□适用 √不适用

51、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期发生金额						税后归属于少数股东	期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司		
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-242,741,490.86	-228,014,970.70	-22,999,589.16		5,075,425.82	-210,090,807.36	-71,066,560.45	-139,024,246.91	-313,808,051.31
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益									
其他权益工具投资公允价值变动	-242,741,490.86	-228,014,970.70	-22,999,589.16		5,075,425.82	-210,090,807.36	-71,066,560.45	-139,024,246.91	-313,808,051.31
企业自身信用风险公允价值变动									
二、将重分类进损益的其他综合收益	1,410,522.51	-15,959,050.84	552,745.48	2,776,324.69		-19,288,121.01	-19,288,121.01		-17,877,598.50
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-5,815,222.35	105,835.17				105,835.17	105,835.17		-5,709,387.18
其他债权投资公允价值变动	-2,936,734.03	2,040,925.07	510,231.27	2,675,382.80		-1,144,689.00	-1,144,689.00		-4,081,423.03
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用减值准备	1,347,804.75	170,056.81	42,514.21	100,941.89		26,600.71	26,600.71		1,374,405.46
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	8,814,674.14	-18,275,867.89				-18,275,867.89	-18,275,867.89		-9,461,193.75
其他综合收益合计	-241,330,968.35	-243,974,021.54	-22,446,843.68	2,776,324.69	5,075,425.82	-229,378,928.37	-90,354,681.46	-139,024,246.91	-331,685,649.81

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

2020 年半年度报告

		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
一、不能重分类进损益的其他综合收益	3,492,218.23	-336,015,830.64	-41,496,610.62		-23,379,384.29	-271,139,835.73	-159,510,738.99	-111,629,096.74	-156,018,520.76
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	3,492,218.23	-336,015,830.64	-41,496,610.62		-23,379,384.29	-271,139,835.73	-159,510,738.99	-111,629,096.74	-156,018,520.76
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	-368,065.70	-7,785,597.59	-4,251,641.21	6,597,167.96		-10,131,124.34	-10,131,124.34		-10,499,190.04
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-6,685,016.42	628,371.01				628,371.01	628,371.01		-6,056,645.41
其他债权投资公允价值变动	1,294,087.50	-10,476,564.22	-4,268,433.05	6,597,167.96		-12,805,299.13	-12,805,299.13		-11,511,211.63
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用减值准备	1,515,915.15	67,167.37	16,791.84			50,375.53	50,375.53		1,566,290.68
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	3,506,948.07	1,995,428.25				1,995,428.25	1,995,428.25		5,502,376.32
其他综合收益合计	3,124,152.53	-343,801,428.23	-45,748,251.83	6,597,167.96	-23,379,384.29	-281,270,960.07	-169,641,863.33	-111,629,096.74	-166,517,710.80

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	292,289,870.75			292,289,870.75
任意盈余公积				
储备基金				
企业发展基金				
其他				
合计	292,289,870.75			292,289,870.75

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

53、 一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	319,298,535.96	9,252,157.46			328,550,693.42
交易风险准备	300,296,115.22		10		300,296,115.22
合计	619,594,651.18	9,252,157.46			628,846,808.64

一般风险准备的说明

注 1: 根据《证券法》和公司章程的规定，公司按弥补亏损后税后利润的 10%提取风险准备金。

注 2: 根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(中国证监会公告(2018)39号)的规定，本公司按大集合资产管理业务管理费收入计提不低于 10%一般风险准备金。

54、 未分配利润

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上年度
调整前上期末未分配利润	2,012,666,643.86	1,894,287,197.69
调整期初未分配利润合计数(调增+, 调减-)		4,888,979.84
调整后期初未分配利润	2,012,666,643.86	1,899,176,177.53
加: 本期归属于母公司所有者的净利润	404,988,465.61	307,767,555.05
减: 提取法定盈余公积		38,912,277.95
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备	9,252,157.46	57,914,698.69
应付普通股股利	39,995,803.68	36,260,000.00
转作股本的普通股股利		
提取交易风险准备		38,912,277.95
其他综合收益结转留存收益	-3,340,102.34	22,277,834.13

期末未分配利润	2,371,747,250.67	2,012,666,643.86
---------	------------------	------------------

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	572,227,576.53	463,266,270.44
其中：货币资金及结算备付金利息收入	124,650,073.99	108,989,979.32
拆出资金利息收入	1,386,666.64	5,108,037.53
融出资金利息收入	210,888,704.49	120,658,057.20
买入返售金融资产利息收入	155,225,620.61	168,402,596.04
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	46,370,121.28	102,415,099.04
债权投资利息收入	43,559,898.84	27,604,814.83
其他债权投资利息收入	28,896,230.68	32,502,785.52
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	7,620,381.28	
利息支出	772,467,389.89	630,004,568.83
其中：短期借款利息支出		
应付短期融资款利息支出	83,218,694.79	24,500,771.78
拆入资金利息支出	6,815,173.50	1,444,444.45
其中：转融通利息支出		
卖出回购金融资产款利息支出	98,692,890.93	174,465,175.47
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	17,802,023.92	18,625,461.74
长期借款利息支出		
应付债券利息支出	504,425,279.39	385,989,309.13
其中：次级债券利息支出	162,121,935.30	123,145,359.28
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	61,513,327.36	24,979,406.26
利息净收入	-200,239,813.36	-166,738,298.39

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	334,011,803.28	300,995,134.94
证券经纪业务收入	467,719,132.25	354,740,331.63
其中：代理买卖证券业务	261,305,238.54	190,978,042.04
交易单元席位租赁	197,924,524.97	158,720,520.87
代销金融产品业务	8,489,368.74	5,041,768.72
证券经纪业务支出	133,707,328.97	53,745,196.69
其中：代理买卖证券业务	133,707,328.97	53,745,196.69
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	20,193,115.06	13,071,371.44
期货经纪业务收入	60,621,790.75	42,498,275.06
期货经纪业务支出	40,428,675.69	29,426,903.62
3. 投资银行业务净收入	522,973,050.00	304,623,619.12
投资银行业务收入	522,973,050.00	304,623,619.12
其中：证券承销业务	432,288,822.64	198,516,816.82
证券保荐业务	8,018,867.91	4,905,660.40
财务顾问业务	82,665,359.45	101,201,141.90
投资银行业务支出		
其中：证券承销业务		
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4. 资产管理业务净收入	421,900,555.43	329,427,661.67
资产管理业务收入	421,900,555.43	329,427,661.67
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入	11,793,282.21	
基金管理业务收入	11,793,282.21	
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	32,943,244.35	25,008,456.23
投资咨询业务收入	32,943,244.35	25,008,456.23
投资咨询业务支出		
7. 其他手续费及佣金净收入	13,384,114.13	14,607,397.15
其他手续费及佣金收入	13,384,114.13	14,607,397.15
其他手续费及佣金支出		
合计	1,357,199,164.46	987,733,640.55
其中：手续费及佣金收入	1,531,335,169.12	1,070,905,740.86
手续费及佣金支出	174,136,004.66	83,172,100.31

(2) 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	3,773,584.92	6,603,773.59
并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	78,891,774.53	94,597,368.31

(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	1,073,669,725.40	6,931,830.21	761,792,168.41	3,900,097.18
银行理财产品				
信托	533,495,000.00	1,557,538.53	644,410,000.00	434,124.37
资产管理产品			300,000,000.00	707,547.17
合计	1,607,164,725.40	8,489,368.74	1,706,202,168.41	5,041,768.72

(4) 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	149	70	83
期末客户数量	107,974	196	861
其中：个人客户	107,889	127	
机构客户	85	69	861
期初受托资金	60,294,350,252.50	34,057,167,382.86	61,985,791,063.20
其中：自有资金投入	884,957,923.66		834,500,000.00
个人客户	45,155,238,698.48	221,951,888.37	
机构客户	14,254,153,630.36	33,835,215,494.49	61,151,291,063.20
期末受托资金	58,926,589,732.66	29,807,323,701.36	55,917,684,550.00
其中：自有资金投入	754,741,605.69		599,276,350.00
个人客户	45,471,477,093.77	192,886,575.20	
机构客户	12,700,371,033.20	29,614,437,126.16	55,318,408,200.00
期末主要受托资产初始成本	64,924,652,537.21	30,807,480,135.76	60,380,142,749.34
其中：股票	1,095,369,409.77	321,924,183.49	
国债	1,501,045,993.33	203,875,780.00	
其他债券	46,067,793,922.83	9,757,619,119.05	
基金	606,973,218.45	147,915,316.81	597,329,909.53
信托	5,199,273,870.77	799,569,493.00	
资产支持证券	2,105,003,008.16	462,742,338.45	59,371,242,370.25
协议或定期存款			100,000,000.00
委贷		1,508,636,980.95	
期货保证金	17,244,577.70	1,028,601.00	
买入返售金融资产	5,953,412,071.50	1,962,582,799.15	
卖出回购金融资产款	-3,655,180,700.00	-3,323,376,195.51	
收益权		6,485,703,815.03	
债权类资产		1,629,663,899.71	
期货资管计划	97,985,884.03	1,243,240,891.50	
股票质押式回购	4,557,700,941.86	5,748,534,946.97	
其他	1,378,030,338.81	3,857,818,166.16	311,570,469.56
当期资产管理业务净收入	245,513,064.49	17,642,949.39	158,744,541.55

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	75,733,250.95	17,562,265.11
处置长期股权投资产生的投资收益		692,096.78
金融工具投资收益	754,757,684.11	576,649,405.24
其中：持有期间取得的收益	425,560,617.93	498,954,354.30
— 交易性金融工具	421,330,617.93	497,587,954.30
— 其他权益工具投资	4,230,000.00	1,366,400.00
— 衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	329,197,066.18	77,695,050.94
— 交易性金融工具	379,410,313.76	162,775,125.15
— 其他债权投资	3,321,614.42	-11,329.11
— 债权投资		
— 衍生金融工具	-53,534,862.00	-85,068,745.10
其他		
合计	830,490,935.06	594,903,767.13

(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	423,769,815.43	497,952,472.38
	处置取得收益	383,712,765.96	163,552,445.90
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	-2,439,197.50	-364,518.08
	处置取得收益	-4,302,452.20	-777,320.75
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		

投资收益的说明：

无

58、净敞口套期收益

适用 不适用

59、其他收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
个税手续费返还	3,939,136.64	1,241,293.39
其他	710,185.72	
合计	4,649,322.36	1,241,293.39

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	44,573,062.16	160,662,387.56
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	-288,740.55	-2,243,757.34
其他		
合计	44,284,321.61	158,418,630.22

其他说明：

无

61、其他业务收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
出租收入	3,741,853.94	4,397,298.63
现货销售收入		224,120,567.37
其他	21,351,071.07	10,482,760.91
合计	25,092,925.01	239,000,626.91

其他业务收入说明：

无

62、资产处置收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
固定资产处置利得	89,615.74	34,335.06
固定资产处置损失	-11,920.32	-38,238.00
合计	77,695.42	-3,902.94

其他说明：

□适用 √不适用

63、税金及附加

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准
消费税			
营业税			
城市维护建设税	8,174,445.03	6,613,718.15	
教育费附加			
教育费附加及地方教育费附加	5,677,214.41	4,050,761.99	
资源税			
房产税	750,814.03	939,852.71	
土地使用税	136,632.03	84,932.03	
车船使用税	10,160.00	2,220.00	
印花税	1,513,897.72	782,310.88	
其他	77,566.69	1,313,002.00	
合计	16,340,729.91	13,786,797.76	/

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	799,093,737.43	623,176,252.05
租赁费	60,688,599.28	71,973,738.92
折旧费	13,268,117.43	13,867,719.34
无形资产摊销	19,968,769.60	14,804,336.69
长期待摊费用摊销	11,549,089.99	18,360,002.64
差旅费	23,861,608.04	43,851,473.63
业务招待费	34,589,213.94	53,594,503.00
投资者保护基金	8,229,119.51	13,700,225.84
电子设备运转费	32,629,030.51	24,094,837.63
安全防范费	150,534.13	164,405.26
基金管理费及托管费	7,125,409.30	2,672,873.12
资产管理计划销售费用	186,607,184.56	166,206,584.81
其他	116,571,568.44	157,540,141.54
合计	1,314,331,982.16	1,204,007,094.47

其他说明：

无

65、信用减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
融出资金减值损失	-265,099.67	1,779,695.28
应收款项及其他应收款信用减值损失	31,507,484.72	11,782,347.90
买入返售金融资产减值损失	70,667,096.83	132,674,231.59
其他债权投资减值损失	170,056.82	67,167.37
债权投资减值损失		39,759.58
其他资产减值损失	5,731,282.55	
合计	107,810,821.25	146,343,201.72

其他说明：
无

66、其他资产减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
其他资产		8,846,560.21
合计		8,846,560.21

其他说明：
无

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
投资性房地产折旧	3,142,262.27	3,138,735.41
物业服务成本	400,168.79	416,190.67
装修业务成本	429,112.21	1,461,431.85
现货		224,818,348.38
合计	3,971,543.27	229,834,706.31

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			
其中：固定资产处置利得			
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	317,398.02	45,311,337.01	317,398.02
其他	1,780,539.36	11,738,557.27	1,780,539.36

合计	2,097,937.38	57,049,894.28	2,097,937.38
----	--------------	---------------	--------------

计入当期损益的政府补助

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额	与资产相关/与收益相关
上海市浦东新区促进金融业发展财政扶持资金		38,208,000.00	与收益相关
失业保险稳岗补贴	317,398.02	2,704.00	与收益相关
深圳市人民政府金融发展服务办公室房租补贴		99,700.92	与收益相关
深圳市财政委员会落户奖励		2,000,000.00	与收益相关
上市奖励金		5,000,000.00	与收益相关
济宁市任城区公共就业服务局企业吸纳高校毕业生就业补助		932.09	与收益相关

其他说明：

□适用 √不适用

69、营业外支出

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	176,606.11	10,843.09	176,606.11
其中：固定资产处置损失	176,606.11	10,843.09	176,606.11
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	9,944,050.00	4,236,000.00	9,944,050.00
其他	441,611.93	934,940.58	441,611.93
合计	10,562,268.04	5,181,783.67	10,562,268.04

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	106,911,985.72	63,534,607.75

递延所得税费用	-36,766,736.46	-17,947,190.73
合计	70,145,249.26	45,587,417.02

(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	610,387,605.86
按法定/适用税率计算的所得税费用	152,596,901.47
子公司适用不同税率的影响	-1,681,092.88
调整以前期间所得税的影响	
非应税收入的影响	-4,597,081.37
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	5,739,379.64
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	
权益法核算的投资收益	-18,933,312.74
其他	-62,979,544.86
所得税费用	70,145,249.26

其他说明:

□适用 √不适用

71、其他综合收益

√适用 □不适用

详见本节七、合并财务报表项目注释 51、其他综合收益。

72、现金流量表项目

(1). 收到的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额	上期发生额
收财政补贴收入	317,398.02	45,311,337.01
收到的其他往来款	305,903,130.84	1,402,875,257.37
销售现货收到的现金	6,760,000.00	291,596,064.89
合计	312,980,528.86	1,739,782,659.27

收到的其他与经营活动有关的现金说明:

无

(2). 支付的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期发生额	上期发生额
现金支付的业务及管理费用	470,452,267.71	488,537,313.78
支付的投资者保护基金	8,229,119.51	11,240,196.68
捐赠支出	9,944,050.00	5,118,747.78

支付其他往来款	39,770,340.70	2,175,053,903.46
支付的存出保证金	134,329,233.68	19,246,435.96
购买现货支付的现金		293,714,634.63
合计	662,725,011.60	2,992,911,232.29

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	540,242,356.60	217,940,748.93
加：资产减值准备		8,846,560.21
信用减值损失	107,810,821.25	146,343,201.72
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	16,410,379.70	17,022,957.78
使用权资产摊销		
无形资产摊销	26,427,682.11	14,806,336.69
长期待摊费用摊销	11,549,089.99	18,360,002.64
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）	77,695.42	10,843.09
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	175,290.97	3,902.94
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-44,284,321.61	-158,418,630.22
利息支出	563,908,277.94	583,728,455.80
投资损失（收益以“-”号填列）	-83,284,865.37	23,718,473.81
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的减少（增加以“-”号填列）	-4,582,241,237.15	938,764,397.27
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-49,677,943.67	-61,677,064.56
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	-10,460,928.43	43,729,873.83

存货的减少（增加以“-”号填列）		
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-934,145,280.63	-4,792,517,923.98
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	3,456,570,484.92	2,488,289,282.28
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-980,922,497.96	-511,048,581.77
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	15,849,416,689.55	10,735,032,456.18
减：现金的期初余额	10,740,413,953.43	9,031,882,923.54
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	5,109,002,736.12	1,703,149,532.64

(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	15,849,416,689.55	10,740,413,953.43
其中：库存现金	442,896.30	297,387.56
可随时用于支付的银行存款	12,327,208,899.55	8,851,874,395.43
可随时用于支付的其他货币资金	9,103,698.21	1,194,630.29
结算备付金	3,512,661,195.49	1,887,047,540.15
存放同业款项		
拆放同业款项		
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	15,849,416,689.55	10,740,413,953.43
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

其他说明：

□适用 √不适用

74、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

□适用 √不适用

75、所有权或使用权受到限制的资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	28,254,578.20	风险准备专户存款
存出保证金	2,500,000.00	转融通担保物
交易性金融资产	9,015,911,673.69	卖出回购担保物、转融通证券出借
其他债权投资	683,959,957.37	卖出回购担保物
固定资产	26,544,106.10	其他非流动负债担保物
投资性房地产	136,797,334.46	其他非流动负债担保物
在建工程	369,376,354.09	其他非流动负债担保物
无形资产	468,271,156.11	其他非流动负债担保物
合计	10,731,615,160.02	/

其他说明：

无

76、外币货币性项目

(1). 外币货币性项目：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	1,224,753.70	7.0795	8,670,643.82
港币	856,988,149.92	0.91344	782,807,255.66
结算备付金			
美元	193,805.55	7.07950	1,372,046.39
港币	43,842,013.95	0.91344	40,047,049.22
存出保证金			
其中：美元	276,497.13	7.07950	1,957,461.43
港币	8,725,195.56	0.91344	7,969,942.63
交易性金融资产			
美元	188,237,925.59	7.0795	1,332,630,394.25
港币	52,917,135.44	0.91344	48,336,628.19
其他资产			
其中：美元	31,364,021.09	7.0795	222,041,587.31
港币	37,264,240.29	0.91344	34,038,647.65
代理买卖证券款			
其中：美元	486,688.77	7.07950	3,445,513.15
港币	333,985,964.26	0.91344	305,076,139.19
其他负债			

其中：美元	6,559,311.37	7.0795	46,436,644.86
港币	47,187,816.23	0.91344	43,103,238.85

其他说明：

无

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

适用 不适用

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

77、套期

适用 不适用

78、政府补助

1. 政府补助基本情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
失业保险稳岗补贴	317,398.02	营业外收入	317,398.02

2. 政府补助退回情况

适用 不适用

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

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

适用 不适用

5、其他原因的合并范围变动

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

适用 不适用

6、其他

适用 不适用

十、在其他主体中的权益

1、在子公司中的权益

(1) 企业集团的构成

√适用 □不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
天风期货股份有限公司	上海市	上海市	商品期货、金融期货经纪、期货投资咨询	62.94		设立
天风天睿投资股份有限公司	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询	65.724		设立
天风创新投资有限公司	上海市	上海市	投资管理	100		设立
深圳天风天成资产管理有限公司	广东深圳	广东深圳	受托资产管理、投资管理		100	设立
武汉光谷创投私募基金管理有限公司(原名:武汉光谷创投基金管理有限公司)	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资及投资咨询		55	非同一控制下企业合并
武汉天阔投资管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		100	设立
天风天睿置业(武汉)有限公司	湖北武汉	湖北武汉	物业管理、装饰装修工程;		100	设立
天示(上海)企业管理有限公司	上海市	上海市	金融贸易		100	设立
武汉达昇创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资			结构化主体
武汉泰德鑫创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	投资管理及咨询			结构化主体
武汉惠人生物创业投资基金中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务			结构化主体
武汉光谷之星生物产业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
天风汇盈壹号(武汉)创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务;			结构化主体
汇智易德咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资及投资管理			结构化主体
天风瑞祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
汇盈通祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
汇盈昇达(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天风汇城(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
上海天适新股权投资中心(有限合伙)	上海市	上海市	股权投资、投资咨询			结构化主体
企巢天风(武汉)创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务			非同一控制下企业合并
TFI International Securities Group Limited	中国香港	中国香港	金融公司的投资和管理	100		非同一控制下企业合并
TFI Securities Limited	中国香港	中国香港	行政管理、人事管理		100	非同一控制下企业合并
TFI International Holdings Limited	中国香港	中国香港	基金投资及运营管理		100	非同一控制下企业合并
TFI Asset Management Limited	中国香港	中国香港	资产管理业务及投资咨询业务	100		非同一控制下企业合并
TFI Asset Management (Cayman) Ltd.	开曼	开曼	投资基金业务		100	设立
TFI Securities and Futures Limited	中国香港	中国香港	证券经纪业务、期货经纪业务		100	非同一控制下企业合并
睿颂天勤咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动、债权收益权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体

睿泽天航咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天融鼎信(武汉)股权投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天风汇博(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天融鼎宸(武汉)股权投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
荆门臻慈天善股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北荆门	湖北荆门	股权投资、投资管理			结构化主体
睿海天泽咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿嘉恒通咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿嘉恒信咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿正天诚咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿海天源咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿泓天祺咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿坤津祥咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
若干证券公司及资产管理公司资产管理计划	上海市	上海市	证券投资			结构化主体

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明:

无

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

无

对于纳入合并范围的重要的结构化主体,控制的依据:

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

确定公司是代理人还是委托人的依据:

无

其他说明:

无

(2). 重要的非全资子公司

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	少数股东持股比例 (%)	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
天风期货股份有限公司	37.06	4,924,941.00		146,378,740.65
天风天睿投资股份有限公司	34.276	-5,942,666.45		1,104,506,301.26

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明:

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

(3). 重要非全资子公司的主要财务信息

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	期末余额		期初余额	
	资产合计	负债合计	资产合计	负债合计
天风期货股份有限公司	4,152,844,646.74	3,756,866,913.38	3,387,703,423.16	2,995,014,791.33
天风天睿投资股份有限公司	9,683,164,290.32	5,152,312,366.43	8,116,166,916.63	3,435,651,106.67

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
天风期货股份有限公司	80,281,559.92	13,289,101.53	13,289,101.53	241,647,466.37	247,587,290.59	-50,385,486.94	-50,385,486.94	-119,033,596.67
天风天睿投资股份有限公司	99,927,644.33	31,224,480.48	-65,265,371.60	98,939,972.13	62,992,566.89	-3,310,981.27	-149,960,985.16	-593,929,072.49

其他说明：
无

(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制:

适用 不适用

(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持:

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

适用 不适用

(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

2020年4月,公司以17,889,537.00港币的价格购买TFI Securities and Futures Limited 22.46%股权,完成后持股比例为100%。

(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

单位:元 币种:港元

	TFI Securities and Futures Limited
购买成本/处置对价	
—现金	17,889,537.00
—非现金资产的公允价值	
购买成本/处置对价合计	17,889,537.00
减:按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	19,620,092.62
差额	-1,730,555.62
其中:调整资本公积	1,730,555.62
调整盈余公积	
调整未分配利润	

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的会计处理方法
				直接	间接	
宜宾市商业银行股份有限公司	四川宜宾	四川宜宾	商业银行	14.57		权益法

恒泰证券 股份有限 公司	内蒙古呼和 浩特	内蒙古呼和 浩特	证券公司	26.49		权益法
--------------------	-------------	-------------	------	-------	--	-----

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

(2). 重要合营企业的主要财务信息

适用 不适用

(3). 重要联营企业的主要财务信息

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
	宜宾市商业银行股份有限公司	宜宾市商业银行股份有限公司
资产合计	45,043,155,510.30	45,842,481,952.22
负债合计	40,708,458,502.16	41,836,925,682.79
少数股东权益	261,060,449.99	253,314,449.14
归属于母公司股东权益	4,073,636,558.15	3,752,241,820.29
按持股比例计算的净资产份额	605,725,589.70	546,696,269.10
调整事项	75,314,431.84	75,314,431.84
--商誉	75,314,431.84	75,314,431.84
对联营企业权益投资的账面价值	649,329,439.32	622,010,700.94
营业收入	605,820,316.97	556,806,527.25
净利润	179,402,461.24	111,943,623.26
其他综合收益	8,784,569.82	4,312,772.90
综合收益总额	194,764,751.22	116,256,396.16
本年度收到的来自联营企业的股利		

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
	恒泰证券股份有限公司	恒泰证券股份有限公司
资产合计	31,079,939,616.57	
负债合计	21,972,782,798.75	
少数股东权益	403,297,366.42	
归属于母公司股东权益	8,703,859,451.40	
按持股比例计算的净资产份额	2,305,871,146.06	
调整事项	1,720,528,563.86	
--商誉	1,720,528,563.86	
对联营企业权益投资的账面价值	4,026,399,709.92	
营业收入	1,028,056,978.49	
净利润	145,960,412.40	
其他综合收益	-8,015,572.95	
综合收益总额	137,944,839.45	
本年度收到的来自联营企业的股利		

其他说明：

无

(4). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
合营企业：		
投资账面价值合计		
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润		
--其他综合收益		
--综合收益总额		
联营企业：		
投资账面价值合计	22,842,878.08	22,861,280.45
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	-274,689.42	-212,572.26
--其他综合收益		
--综合收益总额	-274,689.42	-212,572.26

其他说明：

无

(5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明：

适用 不适用

(6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损

适用 不适用

(7). 与合营企业投资相关的未确认承诺

适用 不适用

(8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

适用 不适用

4、重要的共同经营

适用 不适用

5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

适用 不适用

本公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本公司发起设立的投资基金和资产管理计划，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

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

项 目	2020 年 6 月 30 日		2019 年 12 月 31 日	
	账面价值	最大损失敞口	账面价值	最大损失敞口
集合资产管理计划	709,728,121.32	706,996,988.46	933,543,393.14	926,113,549.34

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

6、其他

适用 不适用

十一、与金融工具相关的风险

适用 不适用

详见本报告第十节 财务报告 十七、风险管理

十二、公允价值的披露

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
一、持续的公允价值计量				
（一）交易性金融资产	3,197,093,829.56	19,247,952,495.16	5,278,747,596.12	27,723,793,920.84
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	3,197,093,829.56	19,247,952,495.16	5,278,747,596.12	27,723,793,920.84
（1）债务工具投资	166,205,007.17	15,017,409,740.54	359,814,520.54	15,543,429,268.25
（2）权益工具投资	3,030,888,822.39	4,230,477,670.21	4,918,933,075.58	12,180,299,568.18
（3）衍生金融资产		65,084.41		65,084.41
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		933,390,123.43		933,390,123.43
（三）其他权益工具投资	20,805,273.14	22,311,232.67	3,753,706,519.10	3,796,823,024.91
（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	3,217,899,102.70	20,203,653,851.26	9,032,454,115.22	32,454,007,069.18
(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		872,444.00		872,444.00
其中：发行的交易性债券				
衍生金融负债		872,444.00		872,444.00
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	-	872,444.00	-	872,444.00
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

适用 不适用

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

适用 不适用

本公司持续第二层次公允价值计量项目估值通常基于底层投资(投资组合中公开交易的权益工具)的公允价值计算得出,所有重大输入值均为市场中直接或间接可观察的输入值。债券投资的公允价值是采用第三方估值机构估值系统的报价,第三方估值机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。股指期货合约、商品期货合约及利率互换合约的公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日,采用类似衍生金融工具的市场利率将未来现金流折现,以验证报价的合理性。

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

适用 不适用

5、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析

适用 不适用

6、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

√适用 □不适用

报告期内，本公司持有部分全国中小企业股份转让系统挂牌的股票摘牌，或前十二个月累计换手率较低，层级由第二层次调整为第三层次；本公司持有的部分未上市股权在报告期在交易所上市，层级由第三层次调整为第二层次。

7、本期内发生的估值技术变更及变更原因

□适用 √不适用

8、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

√适用 □不适用

本公司认为，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。

9、其他

□适用 √不适用

十三、关联方及关联交易**1、本企业的母公司情况**

□适用 √不适用

2、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

√适用 □不适用

详见本报告第十节 财务报告 十、在其他主体中的权益 1、在子公司中的权益。

3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

√适用 □不适用

详见本报告第十节 财务报告 十、在其他主体中的权益 3、在合营企业或联营企业中的权益。

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

√适用 □不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
湖北三环资本管理有限公司	联营企业

其他说明：

□适用 √不适用

4、其他关联方情况

√适用 □不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
武汉国有资产经营有限公司	持股 5%以上股东
人福医药集团股份公司	持股 5%以上股东
湖北省融资担保集团有限责任公司（原名：湖北省担保集团有限责任公司）	持股 5%以上股东(湖北省联合发展投资集团有限公司)之子公司
武汉当代科技产业集团股份有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司（原名：武汉当代明诚文化股份有限公司）	间接持股 5%以上自然人控制的企业
武汉三特索道集团股份有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业
武汉天盈投资集团有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北天乾资产管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉当代天信财富投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
长瑞当代资本管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北宏泰天睿股权投资基金管理有限公司（原名：湖北省宏泰天睿股权投资基金管理有限公司）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
当代国际集团有限公司（DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉光谷新技术产业投资有限公司	公司监事担任该公司董事
武汉当代瑞通投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉长瑞恒兴投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
杭州财悦科技有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
天风睿金(武汉)投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉睿通致和投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉光谷融资租赁有限公司	持股 5%以上股东之子公司
正隆保险经纪股份有限公司（原名：正隆（北京）保险经纪股份有限公司）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉晟道创业投资基金管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
崇阳三特隼水河旅游开发有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北人福医药集团有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉当代科技投资有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
江诚融和信息技术（武汉）有限公司（原名：当代金融信息技术（武汉）有限公司）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北鼎壹荟农贸易有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉天盈博贵企业管理中心（有限合伙）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司

其他说明：

□适用 √不适用

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
江诚融和信息技术（武汉）有限公司	业务及管理费—电子设备运转费		646,419.93

江诚融和信息技术（武汉）有限公司	业务及管理费-信息使用费		203,653.85
崇阳三特隼水河旅游开发有限公司	业务及管理费-会议费		92,452.83
杭州财悦科技有限公司	业务及管理费-咨询费	5,094,339.60	5,060,377.20
崇阳三特隼水河旅游开发有限公司	业务及管理费-差旅费	41,913.21	
武汉当代科技产业集团股份有限公司	利息支出-存款利息支出	234.44	458.3
武汉国有资产经营有限公司	利息支出-存款利息支出	10,627.45	12,175.88
武汉光谷新技术产业投资有限公司	利息支出-存款利息支出	123.68	157.32
当代国际集团有限公司（DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED）	利息支出-其他流动负债/其他非流动负债利息支出	201,286.11	2,312,421.31
湖北鼎壹荟农贸易有限公司	业务及管理费-招待费	592,430.00	
正隆保险经纪股份有限公司	业务及管理费-聘请中介机构费	2,184,466.05	

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
湖北天乾资产管理有限公司	财务顾问收入		283,018.87
湖北天乾资产管理有限公司	证券承销收入	14,150,943.40	
湖北人福医药集团有限公司	资产管理收入	754,716.98	
人福医药集团股份公司	证券承销收入	2,146,226.42	3,396,226.42
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	证券承销收入	5,660,377.36	
杭州财悦科技有限公司	投资咨询收入	1,047,169.80	1,047,169.81
当代国际集团有限公司（DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED）	资产管理费收入	523,000.96	439,659.63
湖北三环资本管理有限公司	其他业务收入-其他	89,393.65	91,500.64
湖北宏泰天睿股权投资基金管理有限公司	其他业务收入-其他服务收入	95,757.08	98,014.04
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券经纪收入	14.15	248.25
天风睿金（武汉）投资基金管理有限公司	代销金融产品业务		1,798,896.24
武汉光谷融资租赁有限公司	证券承销收入		2,830,188.68
武汉天盈投资集团有限公司	证券承销收入	5,660,377.36	32,110.09
武汉晟道创业投资基金管理有限公司	投资咨询收入		2,046,833.02
人福医药集团股份公司	资产管理费收入		377,358.49
武汉三特索道集团股份有限公司	资产管理费收入	58,455.71	34,716.92
武汉当代瑞通投资管理有限公司	利息收入	920,028.67	864,367.34
武汉光谷融资租赁有限公司	受托资产收入	69,336.61	
武汉国有资产经营有限公司	证券承销收入	2,122,641.51	
武汉当代科技投资有限公司	证券承销收入	7,075,471.70	

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

□适用 √不适用

(2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表：

□适用 √不适用

关联托管/承包情况说明：

□适用 √不适用

本公司委托管理/出包情况表:

适用 不适用

关联管理/出包情况说明:

适用 不适用

(3). 关联租赁情况

本公司作为出租方:

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	出租办公用房	1,602,407.70	1,602,407.70
武汉当代天信财富投资管理有限公司	出租办公用房	674,529.54	674,514.54
武汉长瑞恒兴投资基金管理有限公司	出租办公用房	195,446.57	197,025.46
武汉睿通致和投资管理有限公司	出租办公用房	72,389.40	72,389.40
正隆保险经纪股份有限公司	出租办公用房	48,838.78	
杭州财悦科技有限公司	出租办公用房		345.10

本公司作为承租方:

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

出租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁费	上期确认的租赁费
湖北省融资担保集团有限责任公司	租赁办公用房	1,491,040.29	2,164,072.71
宜宾市商业银行股份有限公司	租赁办公用房	91,800.00	86,400.00

关联租赁情况说明

适用 不适用

(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

单位: 元 币种: 人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
武汉天盈博贵企业管理中心(有限合伙)	公司 2019 年向关联方武汉天盈博贵企业管理中心(有限合伙)出让了持有的太平睿盈混合型证券投资基金 3,200.00 万份额, 转		31,000,000.00

	让对价为 3,100.00 万元整。2019 年 3 月 29 日, 武汉天盈博贵企业管理中心(有限合伙) 向公司全额支付了上述转让对价。		
--	---	--	--

(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	4,302.58	2,598.30

(8). 其他关联交易

√适用 □不适用

关联方通过表外业务进行投融资

截至报告期末, 关联方合计通过公司设立的定向资产管理计划实现投资、融资已全部清算完毕。此类定向资产管理计划的管理费率水平为 0.3%, 本年度公司通过此类业务合计收取的管理费金额为 0.26 万元。

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
应收款项	武汉天盈投资集团有限公司	149,664.07	24,682.81	149,664.07	24,682.81
应收款项	湖北宏泰天睿股权投资基金管理有限公司	947,078.33	56,564.17	845,575.82	51,489.04
应收款项	湖北三环资本管理有限公司	158,263.36	7,913.17	63,506.10	3,175.31
应收款项	武汉长瑞恒兴投资基金管理有限公司	553,286.34	27,664.32	188,084.95	9,404.25
应收款项	长瑞当代资本管理有限公司			158,028.01	7,901.40
应收款项	杭州财悦科技有限公司	1,110,000.00	55,500.00		
应收款项	武汉睿通致和投资管理有限公司	114,013.35	5,700.67	38,004.45	1,900.22
应收款项	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	6,169,269.70	364,547.76	4,486,741.60	280,421.35
应收款项	武汉三特索道集团股份有限公司	1,225,500.00	122,550.00	1,225,500.00	61,275.00
应收款项	武汉当代天信财富投资管理有限公司	1,062,368.28	53,118.41	354,112.26	17,705.64
预付款项	宜宾市商业银行股份有限公司	38,250.00		130,050.00	
预付款项	杭州财悦科技有限公司	566,037.49		5,660,377.09	
其他应收款	长瑞当代资本管理有限公司	86,303.74	5,495.71	86,303.74	5,495.71

其他应收款	武汉当代瑞通投资管理有限公司	35,474,393.36	6,663,267.57	34,499,162.58	6,614,506.03
其他非流动资产	江诚融和信息技术（武汉）有限公司			124,150.95	

(2). 应付项目

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
代理买卖证券款	武汉国有资产经营有限公司	17,270,920.79	8,820,677.72
代理买卖证券款	武汉光谷新技术产业投资有限公司	3,513.95	3,390.27
代理买卖证券款	武汉当代科技产业集团股份有限公司	17,383.34	4,662,085.67
其他应付款	武汉睿通致和投资管理有限公司		173,572.36
其他应付款	当代国际集团有限公司 (DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED)	375,755.42	368,490.75
其他流动负债	当代国际集团有限公司 (DANGDAI INTERNATIONAL GROUP CO., LIMITED)		59,326,159.63

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

1) 天风证券诉龙跃实业集团有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人龙跃实业集团有限公司（以下简称“龙跃实业”）开展股票质押业务，因龙跃实业质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于 2018 年 9 月向湖北省高级人民法院提起对龙跃实业的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 390,000,000.00 元及利息、违约金等。湖北省高级人民法院于 2018 年 12 月 26 日作出（2018）鄂民初 75 号民事判决书，判决龙跃实业向天风证券支付融资本金人民币 390,000,000.00 元及利息、违约金等。2019 年 2 月，上述判决生效后，天风证券向湖北省高级人民法院申请强制执行，湖北省高级人民法院裁定由武汉市中级人民法院强制执行。2020 年 7 月 7 日，武汉市中级人民法院作出（2020）鄂 01 执恢 71 号之一民事裁定书，裁定终结本案的执行程序，申请执行人天风证券如发现被执行人有可供执行的财产，可再次申请执行。

2) 公司诉方锦程股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人方锦程开展股票质押业务，因方锦程质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于 2018 年 10 月向湖北省高级人民法院提起对方锦程及配偶张莉莉、担保人刘可武的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 241,914,200.75 元及利息、违约金等。湖北省高级人民法院于 2018 年 10 月 23 日受理了本案，于 2018 年 11 月对方锦程、张莉莉采取了诉讼保全措施。为加快诉讼进程，天风证券撤回对刘可武的起诉，湖北省高院于 2019 年 8 月 6 日作出（2018）鄂民初 98 裁定书同意该撤回申请，并定于本案 2019 年 8 月 29 日开庭审理。2019 年 11 月 11 日，湖北省高级人民法院作出一审判决，判决方锦程向天风证券支付融资本金人民币 241,914,200.75 元及利息、违约金等。2019 年 11 月 26 日，张莉莉提起上诉，要求改判涉案 31,273,400 股方盛制药股票（证券代码 603998）中的二分之一属无效抵押，方锦程仅以涉案 31,273,400 股方盛制药股票中的二分之一折价、拍卖或变卖所得价款支付本案债务。尚未收到二审法院传票，截止报告日，二审受理法院尚未就本案作出判决。

3) 天风证券诉宁波银亿控股有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人宁波银亿控股有限公司（以下简称“宁波银亿”）开展股票质押业务，因宁波银亿质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于 2019 年 2 月向湖北省高级人民法院提起对宁波银亿的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 130,500,000.00 元及利息、违约金等。湖北省高级人民法院于 2019 年 2 月受理了本案，因审理过程中宁波银亿申请破产重组，本案移送至宁波市中级人民法院审理。2019 年 10 月 25 日，宁波市中级人民法院作出（2019）浙 02 民初 424 号民事调解书，确认宁波银亿应于 2019 年 12 月 20 日前向天风证券偿还融资本金 130,500,000.00 元及利息、违约金等。因宁波银亿未按期履行生效调解书义务，天风证券向宁波市中级人民法院申请强制执行，又因宁波银亿的破产重组案被法院立案受理，案件进入破产重组程序，天风证券已依法向宁波银亿的管理人申报债权。

4) 天风证券诉长城影视文化企业集团有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人长城影视文化企业集团有限公司（以下简称“长城公司”）开展股票质押业务，因长城公司质押的股票被司法冻结，经多次催促后其仍不履行回购义务，构成违约。天风证券于 2019 年 2 月向东湖新技术开发区人民法院提起对长城公司的民事诉讼，要求其偿还融资本金人民币 11,220,588.23 元及利息、违约金等。东湖新技术开发区人民法院于 2019 年 2 月 20 日受理了本案，2019 年 3 月 28 日，东湖新技术开发区人民法院通知长城公司对本案提出管辖权异议。武汉东湖新技术开发区人民法院于 2019 年 4 月出具（2019）鄂 0192 民初 1580 号《民事裁定书》，裁定被告长城文化对本案的管辖权提出的异议成立，本案移送至湖北省武汉市武昌区人民法院处理。

2019 年 4 月，长城公司向武汉市中级人民法院提交《管辖异议上诉状》，请求依法撤销武汉东湖新技术开发区人民法院出具的（2019）鄂 0192 民初 1580 号《民事裁定书》，将案件移送至浙江省杭州市西湖区人民法院管辖。2019 年 6 月，湖北省武汉市中级人民法院作出《民事裁定书》，裁定驳回上诉，维持原裁定。2019 年 8 月 7 日，武汉市武昌区人民法院已立案，案号为（2019）鄂 0106 民初 15156 号，本案于 2019 年 11 月 14 日开庭审理。2020 年 4 月 16 日，天风证券收到民事判决书，判决长城公司向天风证券偿还融资本金 11,220,588.23 元及相应利息、违约金等。2020 年 5 月，天风证券收到长城公司上诉状，长城公司请求改判为长城公司支付天风证券自 2019 年 1 月 9 日起自融资本金偿还之日止的违约金（以 11,220,588.23 元为计算基数，按 2020 年 1 月 20 日贷款市场报价利率 1 年期 LPR 年利率 4.15%上浮 30%的标准计算）。本案于 2020 年 8 月 18 日二审开庭，截止报告日，二审受理法院尚未就本案作出判决。

5) 天风证券诉国广环球资产管理有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人国广环球资产管理有限公司（以下简称“国广环球”）开展股票质押业务，因国广环球质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于 2019 年 3 月向武汉市中级人民法院提起对国广环球的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 61,020,000.00 元及利息、违约金等。武汉市中级人民法院于 2019 年 3 月受理了本案，并于 2019 年 12 月作出一审判决，判决国广环球向天风证券支付融资本金人民币 61,020,000.00 元及利息、违约金等。判决生效后，天风证券向武汉市中级人民法院提起强制执行程序，执行案号为（2020）鄂 01 执 317 号，案件目前尚在执行过程中。

6) 天风证券诉曹永德、刘娜、郴州市三曦矿业有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人曹永德开展股票质押业务，因质押股票被 ST，构成提前购回或补充质押的情形，经多次催促后其仍不履行回购义务，天风证券于 2019 年 11 月向武汉市中级人民法院提起对曹永德、配偶刘娜、担保方郴州市三曦矿业有限公司的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 37,345,701.41 元及利息、违约金等。武汉市中级人民法院于 2019 年 11 月受理了本案，本案采取公告送达方式，定于 2020 年 9 月 8 日公告开庭审理，截止报告日，一审受理法院尚未就本案作出判决。

7) 天风证券诉张平西、曹叶玉、郴州市三曦矿业有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人张平西开展股票质押业务，因质押股票被 ST，构成提前购回或补充质押的情形，经多次催促后其仍不履行回购义务，天风证券于 2019 年 11 月向武汉市中级人民法院提起对张平西、配偶曹叶玉、担保方郴州市三曦矿业有限公司的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 30,797,796.48 元及利息、违约金等。武汉市中级人民法院于 2019 年 11 月受理了本案，本案采取公告送达方式，定于 2020 年 9 月 8 日公告开庭审理，截止报告日，一审受理法院尚未就本案作出判决。

8) 天风证券诉发行人郴州市金贵银业股份有限公司债券纠纷案

郴州市金贵银业股份有限公司作为发行人于 2014 年 11 月公开发行了“14 金贵债”，发行规模为人民币 7 亿元，期限为 5 年，起息日为 2014 年 11 月 3 日，兑付日为 2019 年 11 月 3 日，本期债券发行时无担保。2019 年 10 月 16 日，金贵银业公司公告其控股股东曹永贵及其配偶许丽为本次债券本息的兑付提供连带责任保证担保。天风证券持有的“14 金贵债”票面金额合计人民币 40,800,000.00 元。2019 年 11 月，金贵银业公司发布公告，称因资金周转困难，不能按期全额兑付“14 金贵债”全体债券持有人的本金及利息。金贵银业公司未能按约定履行兑付本期债券的义务，已构成实质违约。天风证券于 2019 年 11 月向武汉市中级人民法院提起诉讼，要求金贵银业公司支付本金 40,800,000.00 元及利息、逾期利息。2019 年 12 月，武汉市中级人民法院受理了本案，并于 2020 年 8 月 5 日开庭审理，截止报告日，一审受理法院尚未就本案作出判决。

9) 天风证券诉担保人曹永贵、许丽债券纠纷案

郴州市金贵银业股份有限公司作为发行人于 2014 年 11 月公开发行了“14 金贵债”，发行规模为人民币 7 亿元，期限为 5 年，起息日为 2014 年 11 月 3 日，兑付日为 2019 年 11 月 3 日，本期债券发行时无担保。2019 年 10 月 16 日，金贵银业公司公告其控股股东曹永贵及其配偶许丽为本次债券本息的兑付提供连带责任保证担保。天风证券持有的“14 金贵债”票面金额合计人民币 40,800,000.00 元。2019 年 11 月，金贵银业公司发布公告，称因资金周转困难，不能按期全额兑付“14 金贵债”全体债券持有人的本金及利息。金贵银业公司未能按约定履行兑付本期债券的义务，已构成实质违约。天风证券于 2019 年 11 月向保证人曹永贵、许丽提起仲裁，要求曹永贵、许丽支付本金 40,800,000.00 元及利息、逾期利息。2019 年 12 月，上海仲裁委员会受理了本案，并于 2020 年 8 月 11 日开庭，截止报告日，上海仲裁委员会尚未就本案作出裁决。

10) 公司控股子公司天风天睿投资股份有限公司诉林西县盛亿矿业有限责任公司、郝万金借款合同纠纷

2016 年 10 月，林西县盛亿矿业有限责任公司（以下简称“盛亿矿业”）因经营周转需要，向天风天睿投资股份有限公司（以下简称“天风天睿”）申请借款，借款金额 3000 万元，借款期限 12 个月。2018 年 9 月，郝万金作为担保人签订《补充协议》，就盛亿矿业的借款自愿提供连带责任保证。天风天睿于 2016 年 12 月向盛亿矿业借款 3000 万元整。借款到期后，盛亿矿业未按期还款，经天风天睿多次催要，仍拒不履行还款义务。天风天睿于 2019 年 4 月向武汉市中级人民

法院申请诉前财产保全，申请冻结盛亿矿业及郝万金银行存款 4500 万元或查封、扣押其他等值财产。2019 年 4 月，武汉市中级人民法院立案诉前保全，案号为（2019）鄂 01 财保 247 号。2019 年 6 月，天风天睿对林西县盛亿矿业有限责任公司、郝万金提起民事诉讼，要求盛亿矿业立即偿还借款本金 3000 万元及利息，郝万金承担连带清偿责任。因盛亿矿业提起管辖权异议，经武汉市中级人民法院驳回管辖异议申请后，盛亿矿业向湖北省高级人民法院提起管辖权异议上诉，湖北省高级人民法院维持原裁定，驳回盛亿矿业的管辖异议上诉申请，本案于 2020 年 7 月 16 日开庭审理。截止报告日，本案尚未作出判决。

11) 中铁十九局诉天风天睿投资股份有限公司、东方紫悦（武汉）母婴健康管理有限公司撤销之诉纠纷案

因（2018）鄂 01 民终 5018 号民事判决书认定武汉地铁集团及中铁十九局集团有限公司的行为造成了天风天睿的财产损害，中铁十九局集团有限公司（以下简称“中铁十九局”）诉至武汉市中级人民法院，要求依法撤销（2018）鄂 01 民终 5018 号民事判决书。武汉市中级人民法院于 2019 年 8 月 28 日开庭审理，2019 年 12 月，武汉市中级人民法院作出判决，驳回中铁十九局的诉讼请求。中铁十九局不服该判决，提出上诉，暂未收到二审开庭通知。截止报告日，二审法院尚未判决。

12) 公司控股子公司天风天睿投资股份有限公司诉武汉地铁集团有限公司、中铁十九局集团有限公司、第三人东方紫悦（武汉）母婴健康管理有限公司侵权纠纷

天风天睿将位于江岸区香港路康怡花园案涉房屋租赁给第三人东方紫悦（武汉）母婴健康管理有限公司使用。在租赁期间，因轨道交通六号线地下施工，造成天风天睿房屋地面沉降、墙体严重开裂。地铁集团提出 2016 年 9 月施工完成后才能维修，经鉴定机构鉴定，天风天睿房屋为 C 级危险房屋，应立即进行修复处理。至 2017 年 10 月，双方未就房屋维修、赔偿事宜达成一致，为避免房屋损坏造成损失不断扩大，由第三人对房屋进行修复，费用为 2,530,000.00 元。经武汉市江岸区人民法院生效判决确认，因地铁施工导致天风天睿房屋自 2015 年 7 月开始处于不适租状态。由于地铁集团的侵权行为导致房屋受损不适租，天风天睿向武汉市江岸区人民法院提起诉讼，要求地铁集团、中铁十九局赔偿房屋受损的修缮费用 2,530,000.00 元及利息，自 2015 年 10 月至 2017 年 9 月期间的租金损失 4,647,349.00 元，利息和违约金损失、为实现债权而支出的费用等。武汉市江岸区人民法院于 2019 年 4 月受理了本案，于 2019 年 5 月开庭审理。2019 年 6 月，武汉市江岸区人民法院作出（2019）鄂 0102 民初 5339 号裁定书，因本案诉争房屋与中铁十九局与天风天睿、第三人撤销之诉纠纷案相关，裁定本案中止诉讼。截至报告日，本案尚未作出判决。

13) 公司控股子公司天风期货股份有限公司之子公司天示（上海）企业管理有限公司诉中拓（福建）实业有限公司、杭州华速实业有限公司合同纠纷案件

2018 年 6 月，天示（上海）企业管理有限公司（以下简称“上海天示”）与中拓（福建）实业有限公司（以下简称“中拓实业”）签订一系列业务协议，并与中拓实业进行期货市场场外衍生品交易；上海天示与杭州华速实业有限公司（以下简称“华速实业”）另签订了《协议书》，

约定华速实业为中拓实业的付款义务提供连带责任保证担保。2019年7月，中拓实业拖欠支付交易价款，已构成违约，导致上海天示权利受损。上海天示于2019年7月向上海金融法院提起诉讼，请求法院：判令被告中拓实业向原告支付拖欠的款项人民币9,115万元；判令被告中拓实业向原告支付违约金（自2019年7月5日起计算至实际清偿之日止，以所拖欠款项人民币9,115万元的余额为计算基数，按照日万分之五利率计算）；判令华速实业对中拓实业的上述付款义务承担连带清偿责任；判令本案诉讼费、保全费以及保全担保费由两被告承担。上海金融法院于2019年7月受理了本案，案号为（2019）沪74民初1731号，并于2020年2月20日开庭审理。2020年5月20日，上海金融法院作出判决，中拓实业向天风证券偿还拖欠款项90,336,147元及相应违约金等，华速实业对中拓实业的上述付款义务承担连带清偿责任。

14) 公司控股子公司天风天睿投资股份有限公司管理的天风汇城（武汉）投资中心（有限合伙）与戴金华、镇江亿致投资管理有限公司股权回购纠纷

公司控股子公司天风天睿投资股份有限公司管理的天风汇城（武汉）投资中心（有限合伙）（以下简称“天风汇城”）于2017年4月投资2184万元购买84万股海龙核科股票，并约定发生规定情形时，天风汇城有权要求镇江亿致投资管理有限公司回购天风汇城持有的全部84万股股票。因2017年7月，全国中小企业股份转让系统要求对部分合同条款进行修改，戴金华自愿加入承担回购义务。因江苏海龙核科技股份有限公司未达业绩承诺要求，触发了回购条款，天风汇城向戴金华、镇江亿致投资管理有限公司要求履行回购义务，但对方一直未履行。天风汇城于2019年12月对戴金华、镇江亿致投资管理有限公司提起民事诉讼，要求其履行股权回购义务，支付回购款26,353,998.90元并承担相应违约金。2019年12月，镇江市京口区人民法院受理了本案。2020年7月，法院通知本案延期开庭，开庭时间暂未确定，截止报告日，本案尚未作出判决。

15) 天风天睿投资股份有限公司诉钟凯股权回购纠纷案

2016年12月，天风天睿向四川天诺创世企业管理有限公司（以下简称“四川天诺”）投资人民币4000万元，并约定发生规定情形时，天风天睿有权要求钟凯履行回购义务。天风天睿于2020年1月向钟凯、四川天诺发出回购通知书，要求钟凯按照合同约定履行回购天风天睿持有的四川天诺的全部股份，并按约定支付股权转让价款4,691.4722万元，但钟凯一直未履行回购义务。天风天睿于2020年1月17日向武汉仲裁委立案并申请保全，要求钟凯向天风天睿支付4,691.4722万元股权回购款并承担违约金，配合办理工商变更登记手续。截止报告日，本案尚未作出裁决。

16) 天风证券诉张锡聪股权转让纠纷案

2019年10月，天风证券与张锡聪签订了《股票转让协议书》，约定张锡聪受让天风证券持有的绿网天下（福建）网络科技股份有限公司2,714,496股股票，转让价款共计人民币7,790,603.52元。张锡聪应于2019年11月30日前完成全部股份的受让工作。协议签订后，张锡聪未按约定履行，已构成违约。天风证券于2020年5月向武汉东湖新技术开发区人民法院提起诉讼，要求张锡聪支付7,790,603.52元股权转让款并承担违约金。截止报告日，本案尚未作出裁决。

17) 天风证券诉许军、黄稚喻、郴州市三曦矿业有限公司股票质押合同纠纷案

天风证券与融资人许军开展股票质押业务，因质押股票被 ST，构成提前购回或补充质押的情形，经多次催促后其仍不履行回购义务，天风证券于 2020 年 5 月向武汉市武昌区人民法院提起对许军、黄稚喻、郴州市三曦矿业有限公司的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币 16,530,207.58 元及利息、违约金等。武汉市武昌区人民法院于 2020 年 6 月受理了本案，法院定于 2020 年 9 月 23 日开庭，截止报告日，一审受理法院尚未就本案作出判决。

18) 呼和浩特经济技术开发区投资开发集团有限公司诉天风证券互易纠纷案

2016 年 8 月，我司与呼和浩特经济技术开发区投资开发集团有限公司（以下简称呼经开集团）签订债权融资合作协议，约定我司为呼经开集团 2016-2018 年度非公开定向债务融资工具提供专业的服务，呼经开集团向我司支付牵头服务费。2016 年 11 月，呼经开集团向我司申请减免牵头服务费，将合作协议中约定的牵头服务费调整为按 75%收取，且不高于 7500 万元。我司附条件的同意了呼经开集团的申请。上述协议签订后，我司按约定履行了相关义务，呼经开集团于 2016 年 12 月 5 日成功发行 10 亿债务融资工具。2016 年 12 月 7 日，呼经开集团一次性全额向我司支付了 7500 万元牵头服务费。2020 年 6 月，我司收到武汉市中级人民法院送达的传票，呼经开集团对我司提起诉讼，要求：1、返回牵头服务费 2,849.8356 万元；2、要求我司支付逾期返回牵头服务费的利息 96,181.95 元（以牵头服务费 2,849.8356 万元为基数，按年利率 4.05%，自 2020 年 2 月 28 日起算）；3、诉讼费由我司承担。本案于 2020 年 7 月 30 日开庭审理，截止报告日，一审法院尚未就本案作出判决。

19) 天风证券诉沈阳华益新汽车销售有限公司债券纠纷案

2020 年，我公司与沈阳华益新汽车销售有限公司（以下简称沈阳华益公司）签署《债券买卖协议》，约定沈阳华益公司在 2020 年 4 月 6 日或之前自我公司处购买华晨汽车集团控股有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第一期）（166202.SH，以下简称“20 华晨 01”），并按照 6.5% 持有期收益率向我公司支付自缴款日至交割日期间的收益，其中交割面值为 30,000 万元。2020 年 3 月 6 日，我公司、沈阳华益公司与华晨汽车集团控股有限公司签署《担保合同》，约定华晨控股对沈阳华益公司在前述《债券买卖协议》项下的债务提供全额无条件不可撤销连带责任保证担保。同日，我公司与沈阳市汽车工业资产经营有限公司签署《质押合同》，约定为确保《债券买卖协议》的履行及我公司债券买卖的实现，沈阳汽车以其持有的金杯汽车股份有限公司（以下简称“金杯汽车”，证券代码 600609.SH）14,200 万股的股份向我公司提供股权质押担保。因沈阳华益公司未按约定履行回购义务，已构成违约，我司向武汉市中级人民法院对沈阳华益公司提起诉前保全，裁定冻结沈阳汽车持有的金杯汽车 14200 万股的股份。2020 年 8 月 17 日，武汉市中级人民法院立案受理。

(2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

√适用 □不适用

除上述事项外，截至资产负债表日止，本公司无重大需披露的或有事项。

3、其他

□适用 √不适用

十六、资产负债表日后事项**1、重要的非调整事项**

□适用 √不适用

2、利润分配情况

□适用 √不适用

3、销售退回

□适用 √不适用

4、其他资产负债表日后事项说明

√适用 □不适用

(1) 发行短期融资券

2020年7月22日，本公司完成2020年第五期短期融资券（简称“20天风证券CP005”）的发行，发行总额10亿元，债券期限91天，票面利率2.85%。

(2) 发行短期公司债券获得证监许可

本公司根据第三届董事会第三十二次会议决议以及2020年7月31日收到中国证券监督管理委员会《关于同意天风证券股份有限公司向专业投资者公开发行短期公司债券注册的批复》（证监许可〔2020〕1641号），获准向专业投资者公开发行面额不超过30亿元的短期公司债券。

(3) 发行金融债券的意见书

本公司根据第三届董事会第二十七次会议决议、2020年第二次临时股东大会决议，2020年7月23日收到中国证券监督管理委员会《关于天风证券股份有限公司发行金融债券的监管意见书》（机构部函〔2020〕1906号），对公司关于发行金融债券的请示无异议。

(4) 为设立的资管子公司提供净资本担保承诺的公告

2020年4月10日，本公司收到中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2020〕517号），设立资管子公司得到核准。2020年8月24日，天风（上海）证券资产管理有限公司工商登记手续已办理完成并领取了营业执照。

本公司根据第三届董事会第三十三次会议决议、2020年第四次临时股东大会决议同意公司为拟设立的全资资产管理子公司天风（上海）证券资产管理有限公司（以下简称“天风资管”）出具担保承诺函，提供最高额度为人民币13.18亿元的净资本担保承诺。

十七、 风险管理

1、 风险管理政策及组织架构

(1). 风险管理政策

√适用 □不适用

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

(2). 风险治理组织架构

√适用 □不适用

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

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

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

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

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

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

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

2) 第二层级为公司执行委员会及其下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监。

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

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

公司执行委员会下设其他专业委员在公司执行委员会的要求下，负责各条线专项发展和研究，根据公司风险管理政策，制定各条线专项质量控制标准。公司其他专业委员会向公司执行委员会汇报。

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

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

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

风险管理部为全面风险管理部门，在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。

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

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

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

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

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

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

②结算存管部负责公司客户资金的管理和监控，确保客户资金的安全性。

③人力资源部负责员工从业资格和员工合同管理工作合法合规。

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

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

公司确定风险管理的四道防线。公司各部门、分支机构、子公司及全体员工对其职责范围内的风险管理事项进行检查与督导，贯彻执行公司各项风险管理制度，通过部门及岗位的相互制衡实施风险控制措施，形成公司风险管理第一道风险防线；公司风险管理部、合规法律部、资金计划部、财务核算部、品牌管理部作为公司风险管理部门具体负责公司市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、声誉风险、合规及法律风险的识别、监测、检查和报告，确保公司风险得到有效控制与管理，构成公司风险管理第二道防线；公司稽核审计部通过系统、规范的方法，审查和评价业务活动、内部控制和风险管理的适当性和有效性，以促进完善治理，形成公司风险管理第三道防线；公司执行委员会及其下设的合规与风险管理委员会、其他专业委员会、首席风险官、公司合规总监制定并执行风险管理政策，对公司的整体风险状况进行评估与监督，以确保与公司经营活动相关联的各种风险控制在合理的范围内，形成公司风险管理第四道防线。

2、信用风险

√适用 □不适用

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

截至2020年6月30日，公司融资融券业务平均维持担保比例为283.17%，自有资金参与股票质押式回购业务平均履约保障比例为154.45%，客户违约风险有所降低；公司开展银行间债券回购业务选择信用等级高、资本实力雄厚、履约能力强的交易对手开展交易，并监控交易对手信用风险敞口；公司开展债券交易选择高信用等级且具有较强偿付能力融资人发行的高等级债券，公司投资产品的信用风险低。在信用风险管理方面，公司坚持业务发展的安全性、流动性与效益性的有效统一，公司坚持在有效控制交易对手违约损失的前提下，运用审慎、可测、可控、可承受的风险管理方式，确保公司资产组合所面临的信用风险不会对公司持续经营产生重大影响。

报告期末，公司不考虑任何担保物及其他信用增级措施的最大信用风险敞口如下：

单位：元人民币

项 目	2020年6月30日	2019年12月31日
货币资金	12,415,856,335.91	8,879,676,149.48
结算备付金	3,512,661,195.49	1,887,047,540.15
拆出资金	200,040,000.00	150,102,500.00
融出资金	5,735,476,576.81	6,068,122,661.53
交易性金融资产	27,723,728,836.43	23,141,487,599.28
衍生金融资产	65,084.41	

买入返售金融资产	3,415,092,733.22	3,505,744,837.42
应收款项	1,555,324,762.22	747,858,938.94
应收利息		
存出保证金	2,579,390,915.43	1,914,546,749.91
其他债权投资	933,390,123.43	979,663,520.62
其他权益工具投资	3,796,823,024.91	3,838,700,733.98
最大信用风险敞口	61,867,849,588.26	51,112,951,231.31

3、流动风险

√适用 □不适用

流动性风险，是指证券公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的其他资金需求的风险。公司建立了流动性管理指标体系，对关键指标进行监控，一旦指标预警，及时进行调整。同时，公司建立最低备付金额度制度，在资金计划中预留以备意外支出的最低备付金金额。公司积极开展资金缺口管理，通过测算资金流量缺口，有效管理支付风险。公司持续拓展融资渠道和方式的多元化，避免由于融资渠道过于集中或融资方式过于单一而导致的筹资困难

4、市场风险

√适用 □不适用

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

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

风险管理部作为独立的风险管理部门，向公司首席风险官负责，使用风险管理工具和方法对各投资策略、业务部门/条线和全公司等不同层级的市场风险状况进行独立监控、测量和管理，并按日、周、月等不同频率生成相应的风险报告和分析评估报告，报送公司合规与风险管理委员会、

执行委员会以及相应业务部门/条线的主要负责人。当发生接近或超过风险限额情况时，风险管理部及时向业务部门/条线的主要负责人发布预警和提示，并督促业务部门落实应对措施。

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

1、风险价值（VAR（1Day, 95%））

风险来源	单日 95%VAR（单位：元人民币）	
	2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
权益类市场风险	101,435,193.83	199,481,558.95
利率类市场风险	62,240,843.26	16,359,638.72
商品类市场风险	762,480.77	277,979.59
分散化效益	-53,027,752.28	-10,998,543.01
合 计	111,410,765.58	205,120,634.25

2、利率敏感性分析

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

情景	利率敏感性（单位：元人民币）	
	2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
上升 25 个基点	-37,570,000	-39,770,320
下降 25 个基点	37,570,000	39,770,320

十八、 其他重要事项

1、 前期会计差错更正

(1). 追溯重述法

适用 不适用

(2). 未来适用法

适用 不适用

2、 债务重组

适用 不适用

3、 资产置换

(1). 非货币性资产交换

适用 不适用

(2). 其他资产置换

适用 不适用

4、 年金计划

适用 不适用

5、 终止经营

适用 不适用

6、 分部信息

(1). 报告分部的确定依据与会计政策

适用 不适用

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

(2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	期货经纪业务	其他业务	私募基金业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	668,181,047.78	771,644,430.67	499,781,327.02	455,597,970.74	45,621,868.94	-317,209,408.60	98,565,749.30	160,875,972.74	2,061,307,013.11
手续费及佣金净收入	346,340,114.37	17,762,511.85	449,392,148.81	436,688,999.08	20,391,812.03	79,395,756.29	33,763,911.04	26,536,089.01	1,357,199,164.46
投资收益	4,545,199.70	700,479,237.81	361,881.67	-1,829,236.54	3,043,571.16	83,229,133.03	35,774,087.44	-4,887,060.79	830,490,935.06
其他收入	317,295,733.71	53,402,681.01	50,027,296.54	20,738,208.20	22,186,485.75	-479,834,297.92	29,027,750.82	139,226,944.52	-126,383,086.41
二、营业支出	706,510,185.07	126,657,515.55	126,721,668.05	330,164,726.70	41,832,487.46	88,799,386.66	51,390,384.61	29,621,277.51	1,442,455,076.59
三、营业利润	-38,329,137.29	644,986,915.12	373,059,658.97	125,433,244.04	3,789,381.48	-406,008,795.26	47,175,364.69	131,254,695.23	618,851,936.52
四、资产总额	33,053,584,112.62	36,925,615,958.38	1,072,119,818.57	1,138,478,935.48	4,224,368,679.18	4,528,036,908.83	11,277,503,901.09	18,136,829,976.95	74,082,878,337.20
五、负债总额	36,082,646,600.90	9,272,102,666.94	19,521,301.38	42,322,554.09	3,731,128,426.76	4,146,048,964.75	4,778,021,989.94	6,841,806,772.21	51,229,985,732.55
六、补充信息									
信用减值损失	71,725,309.42	84,633.82	-712,270.86	32,139,951.51	62,534.80	2,127,698.26	4,374,074.45	1,991,110.15	107,810,821.25

(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

8、 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用 不适用

9、 以公允价值计量的资产和负债

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末金额
金融资产					
1、交易性金融资产(不含衍生金融资产)	23,141,487,599.28	44,573,062.16			27,723,728,836.43
2、衍生金融资产	-274,923.17	-288,740.55			-807,359.59
3、其他债权投资	979,663,520.62		-4,081,423.03	170,056.82	933,390,123.43
4、其他权益工具投资	3,838,700,733.98		-313,808,051.31		3,796,823,024.91
金融资产小计	27,959,576,930.71	44,284,321.61	-317,889,474.34	170,056.82	32,453,134,625.18
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	27,959,576,930.71	44,284,321.61	-317,889,474.34	170,056.82	32,453,134,625.18
金融负债					

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

期末账面价值						
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	12,415,856,335.91					

结算备付金	3,512,661,195.49				
拆出资金	200,040,000.00				
融出资金	5,735,476,576.81				
衍生金融资产				65,084.41	
买入返售金融资产	3,415,092,733.22				
应收款项	1,555,324,762.22				
存出保证金	2,579,390,915.43				
交易性金融资产				27,723,728,836.43	
债权投资					
其他债权投资		933,390,123.43			
其他权益工具投资			3,796,823,024.91		
其他资产	320,630,312.55				
合计	29,734,472,831.63	933,390,123.43	3,796,823,024.91	27,723,793,920.84	

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	8,879,676,149.48					
结算备付金	1,887,047,540.15					
拆出资金	150,102,500.00					
融出资金	6,068,122,661.53					
衍生金融资产						
买入返售金融资产	3,505,744,837.42					
应收款项	747,858,938.94					
存出保证金	1,914,546,749.91					
交易性金融资产				23,141,487,599.28		
债权投资						
其他债权投资		979,663,520.62				
其他权益工具投资			3,838,700,733.98			
其他资产	551,294,955.99					
合计	23,704,394,333.42	979,663,520.62	3,838,700,733.98	23,141,487,599.28		

(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

金融负债项目	期末账面价值		
	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	
		分类为以公允价值	按照《金融工具确认

		计量且其变动计入当期损益的金融负债	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	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
应付短期融资款	3,682,770,493.13			
拆入资金	400,081,111.11			
衍生金融负债		872,444.00		
卖出回购金融资产款	8,754,939,653.06			
代理买卖证券款	11,046,627,571.97			
应付款项	48,016,517.89			
应付债券	24,054,165,675.02			
其他负债	586,311,856.37			
合计	48,572,912,878.55	872,444.00		
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
应付短期融资款	4,101,653,977.00			
拆入资金	150,068,750.00			
衍生金融负债		274,923.17		
卖出回购金融资产款	10,037,807,023.02			
代理买卖证券款	7,512,796,666.15			
应付款项	34,316,294.16			
应付债券	18,020,388,943.79			
其他负债	308,085,374.21			
合计	40,165,117,028.33	274,923.17		

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	272,972,798.49	5,485,306.68			1,380,967,022.44
2、衍生金融资产					
3、贷款和应收款					
4、其他债权投资					
5、其他权益工具投资					
金融资产小计	272,972,798.49	5,485,306.68			1,380,967,022.44
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		
一、合营企业										
二、联营企业										
宜宾市商业银行股份有限公司	622,010,700.94			25,080,452.74	2,238,285.64					649,329,439.32
恒泰证券股份有限公司		3,977,932,956.58		50,599,203.81	-2,132,450.47					4,026,399,709.92
小计	622,010,700.94	3,977,932,956.58		75,679,656.55	105,835.17					4,675,729,149.24
三、对子公司投资										
天风天睿投资股份有限公司	1,398,047,668.16									1,398,047,668.16
天风期货股份有限公司	268,537,000.00									268,537,000.00
TFI Asset Management Limited	18,983,167.90									18,983,167.90
天风创新投资有限公司	767,955,450.00	38,000,000.00								805,955,450.00
TFI Securities Group Limited	252,500,000.00	179,373,264.37								431,873,264.37
小计	2,706,023,286.06	217,373,264.37								2,923,396,550.43
合计	3,328,033,987.00	4,195,306,220.95		75,679,656.55	105,835.17					7,599,125,699.67

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	222,544,560.49	681,008,602.16	633,559,027.47	269,994,135.18
二、离职后福利-设定提存计划	42,582.75	6,730,508.72	6,727,004.52	46,086.95
三、辞退福利		763,789.57	763,789.57	
四、一年内到期的其他福利				
合计	222,587,143.24	688,502,900.45	641,049,821.56	270,040,222.13

(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	221,183,006.53	641,535,984.62	594,094,900.02	268,624,091.13
二、职工福利费	0.00	8,139,884.60	8,139,884.60	0.00
三、社会保险费	8,257.10	11,107,659.95	11,113,214.21	2,702.84
其中：医疗保险费	8,062.65	10,014,280.51	10,019,857.34	2,485.82
工伤保险费	29.38	83,842.55	83,842.55	29.38
生育保险费	165.07	1,009,536.89	1,009,514.32	187.64
四、住房公积金	114,103.18	19,621,825.70	19,607,781.35	128,147.53
五、工会经费和职工教育经费	1,239,193.68	603,247.29	603,247.29	1,239,193.68
合计	222,544,560.49	681,008,602.16	633,559,027.47	269,994,135.18

(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	36,526.19	6,482,137.37	6,478,517.53	40,146.03
2、失业保险费	6,056.56	248,371.35	248,486.99	5,940.92
合计	42,582.75	6,730,508.72	6,727,004.52	46,086.95

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	459,229,958.83	398,974,147.00
其中：货币资金及结算备付金利息收入	93,350,725.59	78,455,217.58
拆出资金利息收入	1,386,666.64	4,917,583.32
融出资金利息收入	210,887,456.29	120,658,057.20
买入返售金融资产利息收入	62,004,457.42	122,212,876.79
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	45,749,136.90	102,415,099.04
债权投资利息收入	3,518,403.97	30,843,062.66
其他债权投资利息收入	28,896,230.68	29,287,814.67
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	59,186,018.24	12,599,534.78
利息支出	718,202,625.93	593,358,283.42
其中：短期借款利息支出		
应付短期融资款利息支出	83,218,694.79	24,500,771.78
拆入资金利息支出	6,815,173.50	1,444,444.45
其中：转融通利息支出		
卖出回购金融资产利息支出	98,339,299.59	171,954,966.33
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	12,457,386.86	9,556,168.40
长期借款利息支出		
应付债券利息支出	504,832,302.16	385,778,788.75
其中：次级债券利息支出	158,392,427.10	122,934,838.90
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	12,539,769.03	123,143.71
利息净收入	-258,972,667.10	-194,384,136.42

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	325,986,611.81	271,427,094.31
证券经纪业务收入	459,693,940.78	354,741,196.24
其中：代理买卖证券业务	253,280,047.07	190,978,042.04
交易单元席位租赁	197,924,524.97	158,721,385.48
代销金融产品业务	8,489,368.74	5,041,768.72
证券经纪业务支出	133,707,328.97	83,314,101.93
其中：代理买卖证券业务	133,707,328.97	83,314,101.93
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	472,602,287.02	304,623,619.12
投资银行业务收入	472,602,287.02	304,623,619.12
其中：证券承销业务	396,631,266.91	198,516,816.82
证券保荐业务	8,018,867.91	4,905,660.40
财务顾问业务	67,952,152.20	101,201,141.90
投资银行业务支出		
其中：证券承销业务		
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4. 资产管理业务净收入	417,807,369.91	336,067,845.92
资产管理业务收入	417,807,369.91	336,067,845.92
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	21,938,454.19	21,524,418.83
投资咨询业务收入	21,938,454.19	21,524,418.83
投资咨询业务支出		
7. 其他手续费及佣金净收入	3,406,522.47	4,137,275.18
其他手续费及佣金收入	3,406,522.47	4,137,275.18
其他手续费及佣金支出		
合计	1,241,741,245.40	937,780,253.36
其中：手续费及佣金收入	1,375,448,574.37	1,021,094,355.29
手续费及佣金支出	133,707,328.97	83,314,101.93

(2). 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	3,773,584.92	6,603,773.59
并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	64,178,567.28	94,597,368.31

(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	1,073,669,725.40	6,931,830.21	761,792,168.41	3,900,097.18
银行理财产品				
信托	533,495,000.00	1,557,538.53	644,410,000.00	434,124.37
资产管理产品			300,000,000.00	707,547.17
合计	1,607,164,725.40	8,489,368.74	1,706,202,168.41	5,041,768.72

(4). 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	133	55	83
期末客户数量	107,831	55	861
其中：个人客户	107,767	1	0
机构客户	64	54	861
期初受托资金	57,938,326,781.91	31,701,680,169.33	61,985,791,063.20
其中：自有资金投入	862,307,344.58		834,500,000.00
个人客户	44,892,863,751.30	99,742,500.00	
机构客户	12,183,155,686.03	31,601,937,669.33	61,151,291,063.20
期末受托资金	57,152,572,574.53	27,096,763,568.54	55,917,684,550.00
其中：自有资金投入	700,460,504.43		599,276,350.00
个人客户	45,199,041,387.03	49,742,500.00	
机构客户	11,253,070,683.07	27,047,021,068.54	55,318,408,200.00
期末主要受托资产初始成本	59,376,992,017.75	27,982,896,835.25	60,380,142,749.34
其中：股票	137,641,436.82	154,076,566.94	
国债	1,501,045,993.33	203,875,780.00	
其他债券	41,697,696,724.50	8,029,490,347.28	
基金	605,819,453.14	86,866,126.37	597,329,909.53
信托	5,199,273,870.77	799,569,493.00	
资产支持证券	2,105,003,008.16	402,922,642.63	59,371,242,370.25
协议或定期存款			100,000,000.00
委贷		1,508,636,980.95	
期货保证金	15,574,350.50	1,028,601.00	
买入返售金融资产	5,754,275,554.46	1,225,814,200.00	
卖出回购金融资产款	-3,655,180,700.00	-3,052,053,830.00	
收益权		6,485,703,815.03	
债权类资产		1,629,663,899.71	
期货资管计划	97,985,884.03	1,243,240,891.50	
股票质押式回购	4,557,700,941.86	5,748,534,946.97	
其他	1,360,155,500.18	3,515,526,373.87	311,570,469.56
当期资产管理业务净收入	377,258,877.35	17,087,274.04	23,461,218.52

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	75,679,656.55	17,774,837.37
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	585,138,005.50	445,631,180.92

其中：持有期间取得的收益	352,370,259.02	349,357,331.99
— 交易性金融工具	352,370,259.02	349,357,331.99
— 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	232,767,746.48	96,273,848.93
— 交易性金融工具	282,371,200.77	142,154,635.99
— 其他债权投资	3,321,614.42	-11,329.11
— 债权投资		
— 衍生金融工具	-52,925,068.71	-45,869,457.95
其他		
合计	660,817,662.05	463,406,018.29

(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	354,809,456.52	349,721,850.07
	处置取得收益	286,673,652.97	142,931,956.74
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	-2,439,197.50	-364,518.08
	处置取得收益	-4,302,452.20	-777,320.75
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益		

投资收益的说明：

无

6、公允价值变动收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	10,599,711.20	239,932,248.90
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债		
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	-157,808.55	-13,785,886.72
其他		
合计	10,441,902.65	226,146,362.18

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	675,477,913.64	521,690,528.54
租赁费	54,356,934.39	60,202,411.47
折旧费	10,473,672.29	11,614,601.51
无形资产摊销	14,256,702.79	13,405,576.82
长期待摊费用摊销	10,161,564.16	16,159,606.47
差旅费	22,367,071.84	39,710,075.24
业务招待费	32,366,516.23	50,296,828.77
投资者保护基金	8,229,119.51	13,635,199.90
电子设备运转费	13,503,879.24	17,381,877.12
安全防范费	150,534.13	164,405.26
其他	95,863,031.77	90,470,549.52
资产管理计划销售费用	186,607,184.56	166,206,584.81
合计	1,123,814,124.55	1,000,938,245.43

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	-97,595.55	
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）	317,398.02	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		

企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-3,957,115.35	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
所得税影响额	-126,237.73	
少数股东权益影响额	960,151.78	
合计	-2,903,398.83	

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	2.71	0.068	0.068
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	2.73	0.069	0.069

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

第十一节 备查文件目录

备查文件目录	载有公司法定代表人、主管会计工作的公司负责人、会计机构负责人签名并盖章的会计报表。
	载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。
	报告期内在中国证监会指定报刊上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

董事长：余磊

董事会批准报送日期：2020 年 8 月 28 日

修订信息

适用 不适用

第十二节 证券公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

时间	许可单位	文号	行政许可文件名称
2020 年 1 月 7 日	中国证监会	证监许可[2020]39 号	关于核准天风证券股份有限公司配股的批复
2020 年 2 月 27 日	中国证监会	证监许可[2020]344 号	关于核准恒泰证券股份有限公司变更持有 5%以上股权的股东的批复
2020 年 3 月 24 日	中国证监会	证监许可[2020]469 号	关于同意天风证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复
2020 年 3 月 27 日	中国证监会	证监许可[2020]517 号	关于核准天风证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复
2020 年 6 月 12 日	上海证券交易所	上证函[2020]1187 号	关于对天风证券股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

- 1、公司 2018 年分类评价结果为 A 类 A 级；
- 2、公司 2019 年分类评价结果为 A 类 AA 级；
- 3、公司 2020 年分类评价结果为 A 类 A 级。