

公司代码：601162

公司简称：天风证券

# 天风证券股份有限公司 2020 年年度报告

## 重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

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

四、公司负责人余磊、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

公司2020年度利润分配预案为：目前公司正在推进非公开发行A股股票。根据中国证监会《证券发行与承销管理办法》规定，上市公司发行证券，存在利润分配方案、公积金转增股本方案尚未提交股东大会表决或者虽经股东大会表决通过但未实施的，应当在方案实施后发行。如果公司实施2020年度利润分配，则在完成利润分配前，公司不能进行非公开发行股票。从股东利益和公司发展等综合因素考虑，公司拟暂不进行2020年度利润分配，也不进行资本公积转增股本。公司计划在本次非公开发行A股股票完成后，尽快按照相关法律法规的要求与《公司章程》规定进行利润分配相关事宜。本预案尚需提交公司股东大会审议。

### 六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

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

### 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

### 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

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

否

## 十、 重大风险提示

报告期内，公司不存在重大风险事项。公司已在本报告中详细描述可能存在的相关风险，敬请查阅第四节“经营情况讨论与分析”中“可能面对的风险（包括落实全面风险管理以及合规风控、信息技术投入情况）”部分的内容。

## 十一、 其他

适用 不适用

## 目录

第一节	释义.....	5
第二节	公司简介和主要财务指标.....	6
第三节	公司业务概要.....	24
第四节	经营情况讨论与分析.....	27
第五节	重要事项.....	44
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	67
第七节	优先股相关情况.....	75
第八节	董事、监事、高级管理人员和员工情况.....	76
第九节	公司治理.....	86
第十节	公司债券相关情况.....	96
第十一节	财务报告.....	109
第十二节	备查文件目录.....	241
第十三节	证券公司信息披露.....	242

## 第一节 释义

### 一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
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
天风有限	指	公司前身，包括成立于 2000 年 3 月 29 日的四川省天风证券经纪有限责任公司，2003 年 8 月更名为四川省天风证券有限责任公司，2004 年 4 月更名为天风证券有限责任公司，2006 年 11 月更名为天风证券经纪有限责任公司，2009 年 9 月更名为天风证券有限责任公司
审计机构/大信	指	大信会计师事务所（特殊普通合伙）
元	指	人民币元，文中另指除外
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
湖北证监局	指	中国证券监督管理委员会湖北监管局
商贸集团	指	武汉商贸集团有限公司（曾用名“武汉国有资产经营有限公司”）
人福医药	指	人福医药集团股份公司（曾用名“武汉人福高科技产业股份有限公司”）
湖北省联发	指	湖北省联合发展投资集团有限公司
陕西大德	指	陕西大德投资集团有限责任公司
宁波信达	指	宁波信达投资合伙企业（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）
武汉高科	指	武汉高科国有控股集团有限公司
当代科技	指	武汉当代科技产业集团股份有限公司
上海天阖	指	上海天阖投资合伙企业（有限合伙）
当代文体	指	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司（曾用名“武汉道博股份有限公司”“武汉当代明诚文化股份有限公司”）
三特索道	指	武汉三特索道集团股份有限公司
宜宾商行	指	宜宾市商业银行股份有限公司
天风天睿	指	天风证券股份有限公司控股子公司，天风天睿投资股份有限公司
天风期货	指	天风证券股份有限公司控股子公司，天风期货有限公司，2015 年 5 月股份制改制后更名为天风期货股份有限公司
天风创新	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风创新投资有限公司
天风国际	指	天风证券股份有限公司全资子公司，天风国际证券集团有限公司（TFInternationalSecuritiesGroupLimited）
《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》
报告期	指	2020 年 1-12 月
报告期末	指	2020 年 12 月 31 日

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、 公司信息

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

公司注册资本和净资产

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00
净资产	9,840,771,799.18	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、经中国银行保险监督管理委员会核准或认可的业务资格：受托管理保险资金业务资格。

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

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

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、收益互换业务。

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

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

## 二、 联系人和联系方式

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

## 三、 基本情况简介

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

## 四、 信息披露及备置地点

公司选定的信息披露媒体名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.sse.com.cn/
公司年度报告备置地点	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼

## 五、 公司股票简况

公司股票简况				
股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	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、公司其他情况

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

√适用 □不适用

公司系由天风有限整体变更设立。天风有限前身为四川省天风证券经纪有限责任公司。2000年3月，中国证监会出具《关于同意四川省天风证券经纪有限责任公司及成都走马街证券营业部开业的批复》（证监机构字〔2000〕55号）。当月，四川省工商行政管理局向四川天风经纪核发了注册号为5100001812199的《企业法人营业执照》，四川天风经纪正式成立。四川天风经纪设立时股东共5家，合计出资7,700万元。

2003年8月，四川天风经纪注册资本由7,700万元增至54,876万元；2006年11月，天风经纪有限注册资本由54,876万元减至18,100万元。

2008年1月，中国证监会出具《关于核准天风证券经纪有限责任公司变更注册地址的批复》（证监许可〔2008〕105号），核准天风经纪有限住所由“成都市锦江区走马街55号友谊广场B座19楼”变更为“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”。2008年2月，天风经纪有限就前述迁址事宜在工商登记机关办理了变更登记。

2009年4月，天风经纪有限注册资本由18,100万元增至31,500万元；2011年2月，天风有限注册资本由31,500万元增至83,700万元。

2011年10月，天风有限召开2011年第三次临时股东会，会议审议并通过了《公司整体变更为股份有限公司的方案》。2012年1月，中国证监会出具《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），核准天风证券有限责任公司变更为股份有限公司，变更后的公司名称为天风证券股份有限公司。2012年2月，天风证券在武汉市工商行政管理局东湖分局就上述事项办理了变更登记并重新领取了《企业法人营业执照》。

2012年6月，天风证券注册资本由83,700万元增至157,000万元；2013年9月，天风证券注册资本由157,000万元增至174,113万元；2014年7月，天风证券注册资本由174,113万元增至234,113万元；2015年6月，天风证券注册资本由234,113万元增至466,200万元。

2018年5月，中国证监会出具《关于核准天风证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》（证监许可〔2018〕885号），核准公司首次公开发行人民币普通股（A股）股票51,800万股。公司于2018年10月在上交所上市，注册资本由466,200万元增至518,000万元。



2020 年 1 月，中国证监会出具《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），核准公司向原股东配售 1,554,000,000 股新股。公司于 2020 年 3 月完成配股发行，配股有效认股数量为 1,485,967,280 股，注册资本由 518,000 万元增至 666,596.73 万元。

## （二）公司组织机构情况

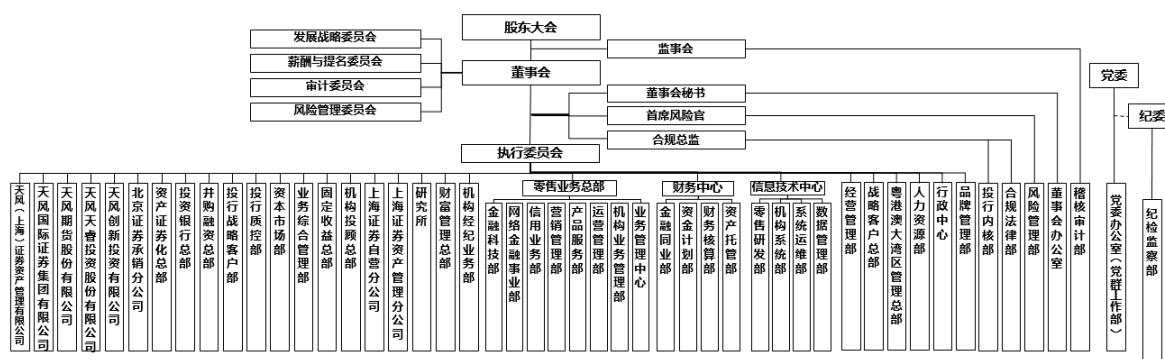
√适用 □不适用

### 1. 公司治理架构

公司遵循《公司法》《证券法》《证券公司监督管理条例》《证券公司治理准则》《证券公司内部控制指引》及《公司章程》等有关规定，构建规范、科学、有效的法人治理结构，并根据公司发展需要不断调整组织架构和运行机制。

公司最高权力机构为股东大会；决策机构为董事会，对股东大会负责；董事会下设风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会、发展战略委员会四个专门委员会，各专门委员会对董事会负责；监督机构为监事会，对股东大会负责。

报告期内，公司组织架构如下：



### 2. 公司主要控股公司情况

#### （1）天风天睿投资股份有限公司

成立时间：2013 年 4 月 22 日

注册资本：154,328.46 万元

持股比例：65.72%

法定代表人：张军

联系电话：027-87618808

注册地址：武汉东湖新技术开发区关东科技工业园华光大道 18 号高科大厦 4 层 01 室

经营范围：管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务（不含国家法律法规、国务院决定限制和禁止的项目不得以任何方式公开募集和发行基金）（不得从事吸收公众存款或变相吸收公众存款，不得从事发放贷款等金融业务）。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

#### （2）天风创新投资有限公司

成立时间：2015 年 12 月 14 日

注册资本：79,473.17 万元

持股比例：100%

法定代表人：丁洁

联系电话：010-59833177

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 4 楼 433 室

经营范围：投资管理。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

（3）天风国际证券集团有限公司

成立时间：2016 年 6 月 6 日

注册资本：486,841,366 港币

持股比例：100%

联系电话：852-38997301

注册地址：香港中环干诺道中 41 号盈置大厦 11 楼 1108 室

经营范围：金融公司的投资和管理

（4）天风期货股份有限公司

成立时间：1996 年 3 月 29 日

注册资本：31,440.00 万元

持股比例：62.94%

法定代表人：张振

联系电话：021-60717137

注册地址：上海市虹口区黄浦路 99 号 502、04、06 室

经营范围：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

（5）天风（上海）证券资产管理有限公司

成立时间：2020 年 8 月 24 日

注册资本：50,000.00 万元

持股比例：100%

法定代表人：许欣

联系电话：021-68815260

注册地址：上海市虹口区东大名路 678 号 5 楼

经营范围：证券资产管理业务（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）

### （三）公司证券营业部的数量和分布情况

√适用 □不适用

截至报告期末，公司共设立证券营业部 106 家，证券营业部的数量及分布情况如下：

序号	区域	营业部名称	地址
1	北京	北京菜市口大街证券营业部	北京市西城区菜市口大街 6 号院 1 号楼 1 层 103
2		北京莲花桥证券营业部	北京市海淀区莲花池东路 39 号 6 层 602
3		北京东三环北路证券营业部	北京市朝阳区东三环北路 17 号八层 806A 室
4		北京诺德樊羊路证券营业部	北京市丰台区诺德中心三期 16 号楼 11 层 1110 和 1111

			室
5	上海	上海兰花路证券营业部	上海市浦东新区兰花路 333 号 20 楼 01 单元
6		上海国宾路证券营业部	上海市杨浦区国宾路 36 号 1109 室
7		上海马当路证券营业部	上海市黄浦区淡水路 277 号 403 室（实际楼层 B503 室）
8		上海龙华中路证券营业部	上海市徐汇区龙华中路 600 号 801 单元
9		上海世纪大道证券营业部	上海市浦东新区世纪大道 210 号 901 房间
10		上海南京西路证券营业部	上海市黄浦区南京西路 288 号创兴金融中心 20 层 03B-04 室
11		上海龙翔路证券营业部	上海市金山区山阳镇龙翔路 950 号、952 号、954 号
12	广东	深圳福华路证券营业部	深圳市福田区现代国际商务大厦 21 楼 2110、2101B 号
13		深圳深南大道华润城营业部	深圳市南山区深南大道 9680 号大冲商务中心 1 栋 1 号楼 1202 房屋
14		深圳国际商会中心证券营业部	深圳市福田区益田路与福华三路东交汇处国际商会中心大厦 29 层 03 号
15		深圳金田路证券营业部	深圳市福田区莲花街道福中社区金田路 4028 号荣超经贸中心 B3903
16		深圳前海证券营业部	深圳市南山区粤海街道高新科技园园路 1002 号 A8 音乐大厦 2207 室
17		深圳益田路证券营业部	深圳市福田区福田街道益田路 4068 号卓越时代广场 1 期 3003
18		深圳福中三路证券营业部	深圳市福田区莲花街道福中三路 1006 号诺德中心 29 楼 A 单元
19		深圳卓越城证券营业部	深圳市福田区梅林街道上梅林卓越城二期 A 座 1710
20		广州黄埔大道西证券营业部	广州市黄埔大道西营业部 888 号国防大厦主楼二层自编 A 区、东裙楼二层自编 B 区
21		广州华夏路证券营业部	广州市天河区华夏路 30 号 2706、2707 房（仅限办公用途）
22		东莞鸿福路证券营业部	东莞市南城区鸿福路 200 号海德广场 B 栋办公楼第 16 层 1603
23		佛山顺德北滘怡欣路证券营业部	佛山市顺德区北滘镇君兰社区居民委员会怡欣路 7 号丰明中心 1 楼 01 号
24		佛山保利东瑞广场证券营业部	佛山市顺德区乐从镇乐从社区居民委员会东平新城文华南路 8 号保利商务中心 5 座 504 至 508
25	湖北	武汉八一路证券营业部	武昌区小洪山特 1 号（八一路）银海华庭 2、3 栋 1-2 层
26		武汉佳园路证券营业部	武汉东湖新技术开发区关东科技工业园华光大道 18 号 12 层 18 号
27		武汉长江日报路证券营业部	武汉市江汉区长江日报路 77 号二楼 201 室
28		武汉欢乐大道证券营业部	洪山区欢乐大道 1 号、3 号东湖 MOMAB 栋 25 层 7-10 号
29		武汉汉口北证券营业部	武汉市黄陂区盘龙城经济开发区汉口北大道 111 号汉口北国际商品交易中心 J 栋 J3 单元 1 层 726、727 室
30		武汉和平大道证券营业部	武汉市青山区 38 街坊八大家花园 45 号楼 5 层 502-504

			室
31		武汉天地证券营业部	武汉市江岸区中山大道 1627 号企业天地 3 号 1001 室
32		武汉徐东大街证券营业部	武昌区武汉轨道交通 8 号线徐家棚站 K9 地块匠心城徐家棚楼层 K9-15F (04) (即 13 层 04 号)
33		钟祥承天大道证券营业部	钟祥市郢中镇承天大道东路 25 号
34		荆门军马场一路证券营业部	湖北省荆门市掇刀区军马场一路 2 号北 112 号 (多辉怡景新城 35 号楼)
35		京山人民大道证券营业部	湖北省京山市新市镇人民大道大龙·联合广场 8-105
36		襄阳长虹南路证券营业部	襄阳市襄城区长虹南路 36 号武商超级生活馆 1 幢 12 层 8 号
37		天门钟惺大道证券营业部	天门市钟惺大道 36 号天下都市港湾 1 号楼
38		宜城步行街证券营业部	湖北省宜城市步行街
39		谷城影院巷证券营业部	湖北省谷城县城关镇西关街影院巷 8 号
40		宜昌夷陵大道证券营业部	宜昌市西陵区夷陵大道 98 号
41		荆州红门路证券营业部	荆州市沙市区红门路益生佳园小区 B 栋 1 层 4 号
42		房县人和路证券营业部	房县城关镇人和路 (寿康永乐超市)
43		十堰江苏路证券营业部	十堰江苏路 8 号 1 幢
44		汉川广场路证券营业部	汉川市仙女山街道办事处广场路世纪新城 C103、C104 号
45		黄石湖滨大道证券营业部	黄石市黄石港区华新路 10 号 10-17 室
46		孝感北京路证券营业部	孝感市北京路东苑小区 1 栋 1 层 104 室
47	辽宁	大连天河路证券营业部	辽宁省大连市甘井子区天河路 81 号
48		大连普兰店学兰路证券营业部	辽宁省大连市普兰店区学兰路北段 39-1 号 4 楼
49		大连中山路证券营业部	辽宁省大连市沙河口区中山路 572 号星海旺座二层
50		大连黄海西路证券营业部	辽宁省大连经济技术开发区正恒园 1-19 号 1-2 层
51	四川	成都市一环路东五段证券营业部	成都市锦江区一环路东五段 8 号天府国际 15 层 03、04 单元
52		成都高华横街证券营业部	成都市武侯区高华横街 33 号三楼 1 号
53		成都白衣上街证券营业部	成都市双流区东升街道白衣上街 177 号 4 栋 1 单元 2 楼 214 号
54		成都槐树店一路证券营业部	成都市成华区鲁能城一期 8 栋 402 号商铺
55		成都聚龙路证券营业部	四川省成都市武侯区聚龙路 1251 号万茂大厦 717 号
56		什邡蓥峰北路证券营业部	什邡市方亭城区强华步行街 5、6 号
57		江油李白大道证券营业部	江油市李白大道东侧宏安中华御景 1 栋 2 楼 1 号
58		新津武阳中路证券营业部	成都市新津县五津镇武阳中路 54 号
59		资阳广场路证券营业部	资阳市雁江区广场路 10 号茂林 28 城三楼
60		宜宾戎州路东段证券营业部	宜宾市翠屏区南岸航天路中段宜都莱茵河畔丽江湾戎州路东段 39-40 幢 1-2 层 14 号附 3 号
61		乐至帅乡大道证券营业部	四川省资阳市乐至县天池镇帅乡大道 255 号 1 幢附 401 号
62		安岳普州大道证券营业部	安岳县岳阳镇普州大道南段 5 号附 13 号 2 楼 202 号
63		眉山湖滨路证券营业部	眉山市东坡区湖滨路东坡湖广场 3 栋 3 层 1-2 号
64		苍溪证券营业部	苍溪县陵江镇滨江路 259 号 (中洋花园)
65		峨眉山滨湖西路证券营业部	峨眉山市滨湖西路 158 号 2-2 号

66	重庆	重庆沧白路证券营业部	重庆市渝中区沧白路 73 号永众国际大厦 12 楼
67		重庆庆云路国金中心证券营业部	重庆市江北区庆云路 1 号重庆国金中心 1 号楼 15-15
68	浙江	杭州教工路证券营业部	浙江省杭州市西湖区教工路 88 号立元大厦 12 层 1201、1203 室
69		杭州西溪首座证券营业部	杭州市西湖区西溪首座 5 号楼 713 室
70		杭州金城路证券营业部	浙江省杭州市萧山区北干街道金城路 546 号
71		杭州环城北路证券营业部	浙江省杭州市下城区环城北路 208 号坤和中心 2007 室
72		绍兴杨绍线证券营业部	浙江省绍兴市柯桥区福全镇杨绍线以南福漓线以东嘉丰大厦 8 层
73		台州市府大道证券营业部	浙江省台州市椒江区市府大道东段 1 号
74		温州瓯江路证券营业部	浙江省温州市鹿城区滨江街道瓯江路锦玉园 2、3 幢 111 室
75		金华解放东路证券营业部	金华市婺城区胜利南街 7 幢
76		江苏	南京庐山路证券营业部
77	苏州工业园区苏州大道证券营业部		苏州工业园区苏州大道东 265 号苏州现代传媒广场 27 楼 D 室
78	江阴环南路证券营业部		江阴市人民东路 137 号
79	徐州沛县红光路证券营业部		沛县汤沐路北红光路东（剑桥府邸）
80	无锡健康路证券营业部		无锡市梁溪区人民中路 139-102 无锡恒隆广场办公楼 1 座 4203 单元
81	安徽	合肥潜山路证券营业部	合肥市蜀山区潜山路 190 号华邦世贸中心超高写字楼 2503-2505
82		合肥创新大道证券营业部	合肥市高新区创新大道 2800 号创新产业园二期 F5 楼 6 层 608-610 室
83	湖南	长沙韶山中路证券营业部	湖南省长沙市雨花区韶山中路 419 号顺天国际金融中心 1428、1429 号
84		长沙劳动东路证券营业部	长沙市雨花区树木岭路 16 号双铁兴苑 1 号综合楼 815、817 号
85		岳阳金鹗中路证券营业部	湖南省岳阳市岳阳楼区金鹗中路 408 号圣鑫城财智公馆 2805 室
86		宁乡新康路证券营业部	长沙市宁乡县玉潭街道通益社区春城北路（春城佳苑）2 栋 108 号
87	山东	潍坊四平路证券营业部	山东省潍坊市奎文区民生东街 1070 号恒易宝莲金融中心宝莲大厦 B301
88		烟台长江路证券营业部	山东省烟台市经济技术开发区长江路 89 号海纳科技金融商业广场 4 号楼 503 室
89		济南花园路证券营业部	济南市历城区花园路 84 号振邦大厦 10 楼
90		临沂广州路证券营业部	山东省临沂市兰山区柳青街道广州路与孝河路交汇处鲁商中心 A5 号楼 501 室
91		菏泽中华路证券营业部	菏泽市凯旋广场（万象广场）第 0006 幢 07 单元 20 层 72011 号房
92		济宁洸河路证券营业部	山东省济宁市任城区洸河路与共青团路交汇处东北角健身广场东片区 7 层东侧

93	福建	福州曙光路证券营业部	福建省福州市台江区曙光路 118 号宇洋中央金座 43 层 03 单元
94		泉州泉秀路证券营业部	泉州市丰泽区泉秀路巴厘印象 1 号楼一、二层
95		泉州丰泽街证券营业部	泉州市丰泽区丰泽街道丰泽街 666 号南益广场 13 楼 1301 室
96	云南	昆明霖雨路证券营业部	云南省昆明市五华区霖雨路 170 号耀龙康城 11 幢 3 单元 102 室商网
97	宁夏	银川黄河东路证券营业部	银川市金凤区黄河东路 788 号亚西大厦-8#营业房
98	广西	南宁东葛路证券营业部	南宁市青秀区东葛路 118 号青秀万达广场西 2 栋 4606、4607、4608、4609 号
99		柳州文昌路证券营业部	柳州市文昌路 20 号乐和大厦地上第 31 层 17、18、19 号
100	江西	南昌绿地中心证券营业部	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 998 号绿地中央广场 C 区 C3 商业楼-401 室
101		九江南海路证券营业部	江西省九江市九江经济技术开发区南海路 7 号柴桑国际中心 1 栋 607 室
102	吉林	长春工农大路证券营业部	吉林省长春市朝阳区工农大路 3488 号
103	新疆	乌鲁木齐卫星路证券营业部	新疆乌鲁木齐经济技术开发区卫星路 473 号卫星大厦四楼 401、402、403、404、405、406 室
104	河南	郑州商务外环路证券营业部	河南自贸试验区郑州片区（郑东）商务外环路 28 号 23 楼房间为 07、11、12 号
105	黑龙江	哈尔滨长江路证券营业部	哈尔滨经开区南岗集中区长江路 209 号中浩华尔街 A 栋 24 层 2 号、3 号
106	陕西	西安科技路证券营业部	西安市科技路 38 号 1 幢 1 单元 11601-3 室

#### （四）其他分支机构数量与分布情况

√适用 □不适用

截至报告期末，公司共设立分公司 20 家，分公司的数量及分布情况如下：

序号	区域	分公司名称	地址	设立时间	负责人	联系电话
1	上海	上海证券资产管理分公司	上海市浦东新区兰花路 333 号 9 楼 01、02、07、08 单元	2011 年 11 月 2 日	付玉	021-50155671
2		上海证券自营分公司	上海市浦东新区兰花路 333 号 10 楼 03、04、05、06 单元	2013 年 6 月 18 日	郭胜北	021-68815388
3		上海分公司	上海市浦东新区潍坊西路 55 号 世贸财富大厦 20 层 02 单元	2018 年 8 月 15 日	陆丽萍	021-68903229
4		上海浦东分公司	中国（上海）自由贸易试验区 浦明路 1500 号 16 楼（名义楼层 19 楼）	2018 年 5 月 24 日	孙凯	021-61063161
5	北京	北京证券承销分公司	北京市西城区佟麟阁路 36 号 1 幢 1201-1230 室	2011 年 11 月 2 日	韩大庆	010-65522557
6	四川	四川分公司	中国（四川）自由贸易试验区 成都高新区天府五街 200 号菁蓉国际广场 3 号楼 B 座 10 层	2012 年 11 月 7 日	徐姝	028-86712441

7	安徽	安徽分公司	合肥市政务区东流路新际商务中心 D 栋 1808、1809、1810 号	2014 年 9 月 3 日	曾文潮	0551-64663198
8	天津	天津分公司	天津和平区西康路 70 号余门的底商 1 层部分及 2 层	2015 年 10 月 22 日	郭顺	022-59061800
9	浙江	浙江分公司	浙江省杭州市西湖区教工路 88 号立元大厦 12 层 1202、1204、1206、1208 室	2016 年 7 月 14 日	陈宁宁	0571-87612722
10		宁波分公司	浙江省宁波市海曙区栎花巷 9 号	2017 年 11 月 16 日	韩养礼	0574-87002960
11	江苏	江苏分公司	南京市建邺区庐山路 168 号南京新地中心二期写字楼 1707、1708、1709	2016 年 10 月 20 日	余琛	025-58700753
12	广西	广西分公司	南宁市青秀区凤翔路 19 号信达大厦十层办公用房	2017 年 1 月 9 日	段广军	0771-5675568
13	江西	江西分公司	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 998 号绿地中央广场 C 区 C3 商业楼-401 室	2017 年 4 月 21 日	熊丹	0791-83902693
14	广东	深圳分公司	深圳市福田区福华四路 16 号平安金融中心 71 楼 03-05 单元	2017 年 5 月 11 日	朱斌	0755-82770100
15	山东	山东分公司	济南市历城区花园路 84 号振邦大厦 10 楼	2017 年 5 月 23 日	段友霞	0531-55680085
16	湖北	襄阳分公司	襄阳市樊城区人民广场南路 12-1 号门面	2017 年 6 月 1 日	叶继华	0710-3084550
17		荆门分公司	湖北省荆门市掇刀区军马场一路 2 号北 112 号	2020 年 7 月 1 日	龙涛	0724-6810646
18	海南	海南分公司	海南省海口市美兰区灵山镇琼山大道 61 号(二)-430	2020 年 7 月 30 日	张雨龙	0898-65857705
19	辽宁	东北分公司	中国(辽宁)自由贸易试验区沈阳片区全运路 109-3 号(109-3 号) 1112、1115、1116、1117 房间	2020 年 9 月 28 日	张煜	024-83777889
20	陕西	陕西分公司	陕西省西安市高新区锦业路 12 号迈科中心 10 层 1001 室	2019 年 5 月 10 日	种亮	029-89285165

## 七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所(境内)	名称	大信会计师事务所(特殊普通合伙)
	办公地址	北京市海淀区知春路 1 号学院国际大厦 1504 室
	签字会计师姓名	张文娟、陈雅婷
报告期内履行持续督导职责的保荐机构	名称	中信证券股份有限公司
	办公地址	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场二期(北座)
	签字的保荐代表	彭源、王安

	人姓名	
	持续督导的期间	2020-12-22 至 2021-12-31

## 八、近三年主要会计数据和财务指标

### (一) 主要会计数据

单位：元币种：人民币

主要会计数据	2020年	2019年		本期比上年同期增减(%)	2018年	
		调整后	调整前		调整后	调整前
营业收入	4,359,629,544.39	3,846,100,730.48	3,846,100,730.48	13.35	3,277,404,101.33	3,277,404,101.33
归属于母公司股东的净利润	454,871,365.71	307,767,555.05	307,767,555.05	47.80	302,851,495.02	302,851,495.02
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	405,315,277.48	258,029,150.21	258,029,150.21	57.08	270,487,733.96	270,487,733.96
经营活动产生的现金流量净额	-3,354,490,668.04	-2,945,165,051.34	-2,945,165,051.34	不适用	1,150,059,000.92	1,150,059,000.92
其他综合收益	-310,478,739.14	-309,945,448.53	-309,945,448.53	不适用	-88,084,310.81	-88,084,310.81
	2020年末	2019年末		本期末比上年同期末增减(%)	2018年末	
		调整后	调整前		调整后	调整前
资产总额	81,405,106,781.45	59,920,334,525.05	59,920,334,525.05	35.86	53,566,065,797.26	53,566,065,797.26
负债总额	59,162,069,868.75	42,413,087,992.68	42,413,087,992.68	39.49	35,075,613,938.77	35,075,613,938.77
归属于母公司股东的权益	17,460,091,857.72	12,123,150,062.81	12,123,150,062.81	44.02	12,321,687,406.03	12,321,687,406.03
所有者权益总额	22,243,036,912.70	17,507,246,532.37	17,507,246,532.37	27.05	18,490,451,858.49	18,490,451,858.49

### (二) 主要财务指标

主要财务指标	2020年	2019年		本期比上年同期增减(%)	2018年	
		调整后	调整前		调整后	调整前
基本每股收益(元/股)	0.07	0.05	0.06	40.00	0.06	0.06
稀释每股收益(元/股)	0.07	0.05	0.06	40.00	0.06	0.06
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.06	0.05	0.05	20.00	0.06	0.06
加权平均净资产收益率(%)	2.79	2.53	2.53	增加0.26个百分点	2.64	2.64
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	2.49	2.12	2.12	增加0.37个百分点	2.36	2.36

注：2020年3月，公司完成配股，根据《企业会计准则第34号—每股收益》和《〈企业会计准则第34号—每股收益〉应用指南》，考虑配股中包含的送股因素，计算每股收益时追溯调整上表中各列报期间发行在外的普通股加权平均数。



报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

### (三) 母公司的净资本及风险控制指标

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	9,840,771,799.18	8,751,580,558.96
净资产	16,816,462,537.05	11,350,179,324.21
各项风险资本准备之和	6,218,702,336.34	7,092,468,702.49
表内外资产总额	63,844,687,060.04	45,503,098,824.47
风险覆盖率(%)	158.24	123.39
资本杠杆率(%)	12.37	15.60
流动性覆盖率(%)	279.37	268.43
净稳定资金率(%)	130.55	146.08
净资本/净资产(%)	58.52	77.11
净资本/负债(%)	21.94	26.74
净资产/负债(%)	37.49	34.68
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	28.32	27.36
自营非权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	262.74	244.50

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

### 九、境内外会计准则下会计数据差异

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

适用 不适用

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

适用 不适用

(三) 境内外会计准则差异的说明：

适用 不适用

### 十、2020 年分季度主要财务数据

单位：元币种：人民币

	第一季度 (1-3 月份)	第二季度 (4-6 月份)	第三季度 (7-9 月份)	第四季度 (10-12 月份)
营业收入	839,058,279.74	1,222,248,733.37	1,370,871,834.70	927,450,696.58
归属于上市公司股东的净利润	80,495,045.99	324,493,419.62	297,141,649.41	-247,258,749.31

归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	83,653,982.62	324,237,881.82	261,045,616.57	-263,622,203.53
经营活动产生的现金流量净额	3,029,928,669.64	-4,010,851,167.60	-6,157,490,104.33	3,783,921,934.25

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

#### 十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位:元币种:人民币

非经常性损益项目	2020 年金额	附注 (如适用)	2019 年金额	2018 年金额
非流动资产处置损益	169,903.88		-137,501.54	-501,532.13
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	86,314,092.06		56,240,129.71	50,013,408.04
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	-20,466,028.70		11,103,084.59	-5,873,117.60
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	-2,324,983.49		-1,765,055.38	-235,332.43
所得税影响额	-14,136,895.52		-15,702,252.54	-11,039,664.82
合计	49,556,088.23		49,738,404.84	32,363,761.06

## 十二、 采用公允价值计量的项目

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目名称	期初余额	期末余额	当期变动	对当期利润的影响金额
交易性金融资产	23,141,487,599.28	27,805,124,322.55	4,663,636,723.27	1,809,574,156.79
其他权益工具投资	3,838,700,733.98	3,279,330,455.93	-559,370,278.05	1,619,230.00
其他债权投资	979,663,520.62	1,468,154,478.25	488,490,957.63	186,577,218.88
衍生金融工具	-274,923.17	-5,389,968.02	-5,115,044.85	-138,826,152.93
交易性金融负债		26,120,694.97	26,120,694.97	-6,988,518.30
合计	27,959,576,930.71	32,573,339,983.68	4,613,763,052.97	1,851,955,934.44

## 十三、 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 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)
货币资金	14,622,925,091.99	8,879,676,149.48	64.68
结算备付金	2,092,593,710.63	1,887,047,540.15	10.89
拆出资金	600,408,750.00	150,102,500.00	300.00
融出资金	5,617,229,266.37	6,068,122,661.53	-7.43
存出保证金	3,234,252,212.13	1,914,546,749.91	68.93
应收款项	1,395,310,400.35	747,858,938.94	86.57
买入返售金融资产	3,624,293,940.73	3,505,744,837.42	3.38
交易性金融资产	27,805,124,322.55	23,141,487,599.28	20.15
其他债权投资	1,468,154,478.25	979,663,520.62	49.86
其他权益工具投资	3,279,330,455.93	3,838,700,733.98	-14.57
长期股权投资	4,520,616,956.01	644,871,981.39	601.01
投资性房地产	150,357,512.25	156,642,036.79	-4.01
固定资产	116,727,952.18	113,148,035.12	3.16
在建工程	562,819,585.16	395,860,677.04	42.18
无形资产	573,323,775.92	584,113,695.22	-1.85
商誉	66,634,466.97	66,634,466.97	
递延所得税资产	294,193,220.00	176,750,717.71	66.45
其他资产	11,380,810,684.03	6,669,361,683.50	70.64
短期借款	630,073,044.46		不适用
应付短期融资款	8,132,246,488.92	4,101,653,977.00	98.27
拆入资金	1,446,215,777.77	150,068,750.00	863.70
交易性金融负债	26,120,694.97		不适用
衍生金融负债	5,389,968.02	274,923.17	1,860.54
卖出回购金融资产款	8,308,264,661.37	10,037,807,023.02	-17.23
代理买卖证券款	11,584,902,888.04	7,512,796,666.15	54.20
应付职工薪酬	338,522,881.20	237,678,307.95	42.43
应交税费	168,357,651.12	68,841,127.56	144.56
应付款项	279,975,921.11	34,316,294.16	715.87
合同负债	51,784,278.10		不适用
长期借款	1,189,306,800.00		不适用
应付债券	24,371,607,466.49	18,020,388,943.79	35.24
递延收益	87,000.00	195,000.00	-55.38
递延所得税负债	287,172,116.59	99,850,963.76	187.60
其他负债	2,342,042,230.59	2,149,216,016.12	8.97
负债合计	59,162,069,868.75	42,413,087,992.68	39.49
实收资本	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00	28.69
资本公积	7,915,543,266.46	4,259,929,865.37	85.81
其他综合收益	-469,026,061.83	-241,330,968.35	不适用
盈余公积	331,425,315.71	292,289,870.75	13.39
一般风险准备	722,474,379.80	619,594,651.18	16.60
未分配利润	2,293,707,677.58	2,012,666,643.86	13.96

归属于母公司所有者权益合计	17,460,091,857.72	12,123,150,062.81	44.02
少数股东权益	4,782,945,054.98	5,384,096,469.56	-11.17
所有者权益合计	22,243,036,912.70	17,507,246,532.37	27.05
负债和所有者权益总计	81,405,106,781.45	59,920,334,525.05	35.86
<b>项目</b>	<b>2020 年年度</b>	<b>2019 年年度</b>	<b>增减幅度 (%)</b>
营业收入	4,359,629,544.39	3,846,100,730.48	13.35
利息净收入	-467,521,218.49	-372,612,411.97	不适用
手续费及佣金净收入	2,756,581,099.86	2,104,060,851.94	31.01
投资收益	1,324,774,189.94	1,220,632,900.51	8.53
其他收益	27,020,042.47	3,308,761.85	716.62
公允价值变动收益	505,224,968.70	323,190,388.00	56.32
汇兑收益	14,115,646.14	-1,148,442.75	不适用
其他业务收入	199,264,911.89	568,619,307.13	-64.96
资产处置收益	169,903.88	49,375.77	244.10
营业支出	3,510,307,559.71	3,447,643,030.33	1.82
税金及附加	33,483,774.78	30,245,719.81	10.71
业务及管理费	2,851,820,961.46	2,405,733,793.91	18.54
信用减值损失	405,791,347.00	483,701,052.27	-16.11
其他资产减值损失	75,371,122.23		不适用
其他业务成本	143,840,354.24	527,962,464.34	-72.76
营业利润	849,321,984.68	398,457,700.15	113.15
营业外收入	67,597,000.37	75,497,821.47	-10.46
营业外支出	28,768,979.48	11,650,246.33	146.94
利润总额	888,150,005.57	462,305,275.29	92.11
所得税费用	200,269,594.59	41,413,622.91	383.58
净利润	687,880,410.98	420,891,652.38	63.43
归属于母公司股东的净利润	454,871,365.71	307,767,555.05	47.80
少数股东损益	233,009,045.27	113,124,097.33	105.98
其他综合收益的税后净额	-310,478,739.14	-309,945,448.53	不适用
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	-215,622,938.75	-242,710,361.08	不适用
综合收益总额	377,401,671.84	110,946,203.85	240.17

## (二) 母公司报表主要项目

项目	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)
货币资金	10,090,785,509.59	7,087,678,848.26	42.37
结算备付金	2,504,785,598.08	2,195,561,198.20	14.08
拆出资金	600,408,750.00	150,102,500.00	300.00
融出资金	5,579,441,537.05	6,068,122,661.53	-8.05
存出保证金	586,304,207.86	284,663,124.79	105.96
应收款项	918,302,873.83	730,261,330.94	25.75

买入返售金融资产	3,313,798,523.37	3,119,101,139.14	6.24
金融投资：	26,207,291,484.12	22,063,914,296.90	18.78
交易性金融资产	25,126,889,082.80	20,720,477,933.83	21.27
债权投资	105,116,439.56	105,116,439.56	
其他债权投资	737,136,193.01	979,663,520.62	-24.76
其他权益工具投资	238,149,768.75	258,656,402.89	-7.93
长期股权投资	7,921,404,635.70	3,328,033,987.00	138.02
投资性房地产	16,321,589.88	17,083,290.24	-4.46
固定资产	81,303,783.18	76,616,522.21	6.12
在建工程	118,371,851.75	91,258,949.32	29.71
无形资产	95,266,955.58	90,927,995.09	4.77
递延所得税资产	175,991,974.73	84,100,480.78	109.26
其他资产	9,800,327,174.05	3,656,231,203.49	168.04
资产总计	68,010,106,448.77	49,043,657,527.89	38.67
短期借款	612,673,200.00		不适用
应付短期融资款	8,132,246,488.92	4,101,653,977.00	98.27
拆入资金	1,446,215,777.77	150,068,750.00	863.70
衍生金融负债	5,071,235.02	274,923.17	1,744.60
卖出回购金融资产款	8,216,523,682.00	9,972,434,386.59	-17.61
代理买卖证券款	6,343,644,072.56	4,968,008,458.78	27.69
应付职工薪酬	246,760,777.21	222,587,143.24	10.86
应交税费	134,084,641.52	59,938,479.88	123.70
合同负债	19,486,098.98		不适用
长期借款	1,189,306,800.00		不适用
应付债券	24,351,406,216.99	18,000,551,095.47	35.28
递延所得税负债	168,485,852.62	104,957,045.41	60.53
其他负债	327,739,068.13	113,003,944.14	190.02
负债合计	51,193,643,911.72	37,693,478,203.68	35.82
实收资本	6,665,967,280.00	5,180,000,000.00	28.69
资本公积	7,111,460,823.71	3,457,303,927.45	105.69
其他综合收益	-175,783,833.99	-151,253,075.11	不适用
盈余公积	331,425,315.71	292,289,870.75	13.39
一般风险准备	716,560,701.48	619,594,651.18	15.65
未分配利润	2,166,832,250.14	1,952,243,949.94	10.99
所有者权益合计	16,816,462,537.05	11,350,179,324.21	48.16
负债和所有者权益总计	68,010,106,448.77	49,043,657,527.89	38.67
<b>项目</b>	<b>2020 年年度</b>	<b>2019 年年度</b>	<b>增减幅度 (%)</b>
营业收入	3,303,183,632.24	2,808,354,180.14	17.62
利息净收入	-638,063,299.32	-437,599,998.47	不适用
手续费及佣金净收入	2,497,901,443.83	2,065,727,735.80	20.92
投资收益	1,151,716,392.48	849,692,354.04	35.55
其他收益	24,449,276.17	3,111,323.42	685.82

公允价值变动收益	241,930,666.59	326,142,320.01	-25.82
汇兑收益	13,758,429.35	161,611.41	8,413.28
其他业务收入	11,478,419.44	1,181,566.32	871.46
资产处置收益	12,303.70	-62,732.39	不适用
营业支出	2,856,186,721.48	2,375,198,618.07	20.25
税金及附加	29,780,186.82	25,622,025.38	16.23
业务及管理费	2,419,855,272.08	2,066,759,558.95	17.08
信用减值损失	330,418,439.99	282,055,333.38	17.15
其他资产减值损失	75,371,122.23		不适用
其他业务成本	761,700.36	761,700.36	-
营业利润	446,996,910.76	433,155,562.07	3.20
营业外收入	51,468,364.54	69,779,876.75	-26.24
营业外支出	25,152,261.47	10,197,614.98	146.65
利润总额	473,313,013.83	492,737,823.84	-3.94
所得税费用	78,067,054.71	103,615,044.39	-24.66
净利润	395,245,959.12	389,122,779.45	1.57
其他综合收益的税后净额	-25,199,609.40	-130,064,662.55	不适用
综合收益总额	370,046,349.72	259,058,116.90	42.84

### 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。公司控股子公司天风天睿开展私募投资基金业务，获得管理费、投资收益等收入。公司通过境外子公司天风国际集团拓展海外业务。

##### （二）行业情况说明

2020年初，突如其来的新冠肺炎疫情肆虐全球，各国经济遭遇重创。在以习近平总书记为核心的党中央坚强领导下，我国率先取得疫情防控战役的胜利，全面复工复产和适度的宏观经济政策，为资本市场注入了强心剂。



得益于有效的疫情防控和适度的宏观经济政策，A股相对于全球市场表现十分突出。2020年，沪深两市累计成交206.8万亿元，日均成交8,511亿元，同比增长63%；上证综指与深证成指分别较上年末上涨13.9%和38.7%。据中国证券业协会统计，2020年证券行业实现营业收入4,484.79亿元，净利润1,575.34亿元，分别同比增长24.41%和27.98%；截至2020年末，证券行业的总资产为8.90万亿元，净资产为2.31万亿元，分别同比增加22.50%和14.10%。

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12月31日，本公司总资产人民币814.05亿元，较上年增加35.86%。其中，金融资产投资合计人民币325.53亿元，较上年增加16.43%，主要系自营业务规模的增加；长期股权投资45.21亿，较上年增加601.01%，主要系权益法核算的长期股权投资增加所致。

其中：境外资产30.32（单位：亿元币种：人民币），占总资产的比例为3.72%。

## 二、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

### 1、适应市场趋势的业务布局

公司坚持综合金融发展方向，打造以全天候财富管理能力、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 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2020年，面对突如其来的新冠肺炎疫情、世界经济深度衰退等多重严重冲击，在党中央坚强领导下，我国疫情防控取得重大战略成果，在全球主要经济体中唯一实现经济正增长，脱贫攻坚战取得全面胜利。公司在抓好疫情防控的同时，稳步推进经营发展，大力提升内部管理，强化落实经营决策，围绕重大经营问题研究部署，在年度分类监管评级中保持A类评级。

#### 1、经纪业务

报告期内，公司经纪业务托管规模、客户数均较上年度有显著增长。截至报告期末，托管资产规模为2,485亿元，同比增长40%；新增客户19.48万户，总客户数达到83.83万户，同比增长30%。实现证券经纪业务营业收入13.70亿元，同比增长19.88%。业务布局方面，新设3家分公司和6家证券营业部；截至报告期末，公司营业部及分公司数量分别为106家和20家。此外，公司深化业务改革，优化分支机构绩效考核和激励机制，搭建统一产品平台，建立筛选评价体系，多举措加强一线员工和骨干员工的培养，财富管理转型取得积极进展。

#### 2、投行业务

报告期内，公司实现投资银行业务收入10.05亿元，同比上升36.74%。股权投资方面，新设投资银行业务委员会，整合原有专业委员会，实现人员、业务、激励、考核、项目的统一综合协调管理。同时，抓住资本市场改革的契机，帮助凌志软件、协创数据完成IPO发行上市，流金岁月完成精选层挂牌，东山精密、宁德时代等8个项目完成再融资发行，居然之家借壳武汉中商项目完成交割及发行上市。债权投行方面，积极拓展债券融资项目来源，加大与持牌金融机构合作，加强与分支机构业务协同，积极推进疫情防控债发行。2020年公司企业债承销189.90亿元，券商中排名第6位，公司债承销747亿元，券商中排名第12位；2020年公司担任管理人发行的企业ABS项目共38单，规模合计366.25亿元，在交易所市场规模排名第11位，单数排名第11位（数据来源：万得资讯）。

#### 3、资产管理业务

2020年，公司以资管子公司设立为契机，加强投研能力和投研团队建设，持续引进市场优秀人才，提升主动管理能力。报告期内，公司资产管理业务实现营业收入8.73亿元，同比增长12.60%。截至报告期末，公司资产管理业务受托客户资金规模为1502.67亿元。

#### 4、自营业务

报告期内，公司自营业务保持稳健投资风格，优化投资业务管理框架，搭建宏观交易体系，提升宏观驱动能力，实现营业收入 19 亿元，同比增长 38.16%。公司不断开拓新的业务细分品种，开展收益互换业务及跨境投资业务，成功获批农发债承销团资格，丰富自营投资品种。

#### 5、研究业务

报告期内，公司研究所发布研究报告近 7,000 篇，其中深度研究报告 1,158 篇，占比接近 17%，达到研究所创立以来最高水平。依托全产业链深度研究优势，搭建金融生态联盟和产业服务联盟，挖掘优质资产，实现价值变现。在年度新财富评选中，天风研究在新财富本土最佳研究团队、最具影响力研究机构、最佳销售服务团队三大奖项评选中全部进入前五名，分析师评选共有 18 个行业入围，12 个行业进入前五，在产业研究大类中，金融、消费、科技大组全部斩获前三名。

#### 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 27 只，管理基金实缴规模 51.47 亿元。报告期内，天风天睿完成设立和备案的基金数量有 4 只，实缴规模 3.45 亿元。

#### 7、期货业务

公司通过子公司天风期货从事期货业务。报告期内，天风期货总成交量 5,216 万手，较上年度增长 91%；总成交额 40,257 亿元，同比增长 21%。2020 年，天风期货在期货分类评级中被评为 BBB 类。

#### 8、海外业务

公司通过子公司天风国际从事海外业务。2020 年 12 月，天风国际成功获批香港证监会附条件<sup>1</sup>的第 6 类牌照（就机构融资提供意见）。2020 年度，天风国际荣获证券时报颁发的“港美股券商 APP 君鼎奖”。

## 二、报告期内主要经营情况

截至报告期末，公司总资产为 814.05 亿元，同比上升 35.86%；归属于母公司股东的权益为 174.6 亿元，同比上升 44.02%。报告期内，公司营业收入为 43.6 亿元，同比上升 13.35%；归属于上市公司股东的净利润 4.55 亿元，同比上升 47.80%。

<sup>1</sup> 附条件第 6 类牌照业务需要受到如下的条件限制：1、持牌人只可向专业投资者提供服务。“专业投资者”的定义在香港《证券及期货条例》及其附属法例的条文内界定；2、持牌人不得持有客户资产。“持有”及“客户资产”的定义已在香港《证券及期货条例》的释义条文内界定；3、就第 6 类受规管活动（就机构融资提供意见）而言，持牌人不得就要求将任何证券在认可证券市场上市的申请以保荐人身份行事。

## (一) 主营业务分析

## 利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位:元币种:人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例(%)
手续费及佣金净收入	2,756,581,099.86	2,104,060,851.94	31.01
利息净收入	-467,521,218.49	-372,612,411.97	不适用
投资收益	1,324,774,189.94	1,220,632,900.51	8.53
其他收益	27,020,042.47	3,308,761.85	716.62
公允价值变动收益	505,224,968.70	323,190,388.00	56.32
汇兑收益	14,115,646.14	-1,148,442.75	不适用
其他业务收入	199,264,911.89	568,619,307.13	-64.96
资产处置收益	169,903.88	49,375.77	244.10
税金及附加	33,483,774.78	30,245,719.81	10.71
业务及管理费	2,851,820,961.46	2,405,733,793.91	18.54
信用减值损失	405,791,347.00	483,701,052.27	-16.11
其他资产减值损失	75,371,122.23		不适用
其他业务成本	143,840,354.24	527,962,464.34	-72.76
营业外收入	67,597,000.37	75,497,821.47	-10.46
营业外支出	28,768,979.48	11,650,246.33	146.94
其他综合收益的税后净额	-310,478,739.14	-309,945,448.53	不适用
经营活动产生的现金流量净额	-3,354,490,668.04	-2,945,165,051.34	不适用
投资活动产生的现金流量净额	-6,405,266,258.71	-566,590,316.01	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	15,717,318,914.59	5,219,076,333.86	201.15
研发支出	14,771,428.64	16,471,411.97	-10.32

## 1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

2020 年度, 本公司实现营业收入人民币 43.6 亿元, 同比上升 13.35%; 营业支出人民币 35.1 亿元, 同比上升 1.82%; 归属于母公司股东的净利润人民币 4.55 亿元, 同比上升 47.80%; 实现每股收益人民币 0.07 元, 同比上升 40.00%, 加权平均净资产收益率 2.79%, 同比增加 0.26 个百分点。

## (1). 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位:元币种:人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率(%)	营业收入比上年增减(%)	营业成本比上年增减(%)	毛利率比上年增减(%)

证券经纪业务	1,370,309,751.80	1,341,275,091.38	2.12	19.88	10.37	增加 8.44 个百分点
证券自营业务	1,900,454,820.35	310,988,949.81	83.64	38.16	74.97	减少 3.44 个百分点
投资银行业务	1,005,138,182.41	413,086,903.73	58.90	36.74	14.66	增加 7.91 个百分点
资产管理业务	872,669,200.52	605,941,171.44	30.56	12.60	29.87	减少 9.24 个百分点
期货经纪业务	112,063,047.45	113,860,980.51	-1.60	44.16	6.10	增加 36.44 个百分点
其他业务	-702,500,040.88	625,037,343.85	不适用	不适用	-40.40	不适用
私募基金业务	255,830,332.80	165,996,190.05	35.11	-10.17	13.32	减少 13.45 个百分点
抵销	-454,335,750.06	-65,879,071.06	不适用	不适用	不适用	不适用
合计	4,359,629,544.39	3,510,307,559.71	19.48	13.35	1.82	增加 9.12 个百分点
主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
湖北省内	54,169,808.67	61,113,860.56	-12.82	15.04	-2.15	增加 19.82 个百分点
湖北省外	2,263,035,666.53	1,201,586,587.10	46.90	11.22	18.88	减少 3.42 个百分点
总部及子公司	2,042,424,069.19	2,247,607,112.05	-10.05	15.77	-5.34	增加 24.53 个百分点

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

适用  不适用

2020 年度，公司证券经纪业务实现营业收入人民币 13.7 亿元，同比上升 19.88%；证券自营业务实现营业收入人民币 19 亿元，同比上升 38.16%；投资银行业务实现营业收入人民币 10.05 亿元，同比上升 36.74%；资产管理业务实现营业收入人民币 8.73 亿元，同比上升 12.6%；期货经纪业务实现营业收入人民币 1.12 亿元，同比上升 44.16%；私募基金业务实现营业收入人民币 2.56 亿元，同比下降 10.17%。

2020 年度，公司湖北省外分支机构实现营业收入人民币 22.63 亿元，同比上升 11.22%；湖北省内分支机构实现营业收入人民币 0.54 亿元，同比增长 15.04%；总部及子公司实现营业收入人民币 20.42 亿元，同比上升 15.77%。

## 2. 费用

适用  不适用

报告期内，本公司的业务及管理费情况具体详见本年度报告“第十一节财务报告七、合并财务报表项目注释 64. 业务及管理费”。

## 3. 研发投入

### 研发投入情况表

适用  不适用

单位：元

本期费用化研发投入	14,771,428.64
本期资本化研发投入	
研发投入合计	14,771,428.64
研发投入总额占营业收入比例 (%)	0.34
公司研发人员的数量	80
研发人员数量占公司总人数的比例 (%)	2.83
研发投入资本化的比重 (%)	-

#### 情况说明

适用 不适用

#### 4. 现金流

适用 不适用

2020 年度，报告期内本公司现金及现金等价物的变动净额为人民币 59.24 亿元，较上年同期增长 42.15 亿元，主要是由于筹资活动现金流量净额增加所致。

从结构上看，2020 年经营活动产生的现金流量净额为人民币-33.54 亿元，2019 年同期为人民币-29.45 亿元，同比减少人民币 4.09 亿元，主要是由于支付其他往来款增加所致。

2020 年投资活动产生的现金流量净额为人民币-64.05 亿元，2019 年同期为人民币-5.67 亿元，同比减少人民币 58.39 亿元，主要是由于投资支付的现金增加。

2020 年筹资活动产生的现金流量净额为人民币 157.17 亿元，2019 年同期为人民币 52.19 亿元，同比增加人民币 104.98 亿元，主要是配股、发行债券、取得借款带来现金流入的同比增加。

#### (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

#### (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

##### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上期期末数	上期期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上期期末变动比例 (%)	情况说明
货币资金	14,622,925,091.99	17.96	8,879,676,149.48	14.82	64.68	主要为货币资金规模增加所致
拆出资金	600,408,750.00	0.74	150,102,500.00	0.25	300.00	拆出资金规模增加
存出保证金	3,234,252,212.13	3.97	1,914,546,749.91	3.20	68.93	交易保证金增加
应收款项	1,395,310,400.35	1.71	747,858,938.94	1.25	86.57	应收账款增加

其他债权投资	1,468,154,478.25	1.80	979,663,520.62	1.63	49.86	其他债权投资规模增加
长期股权投资	4,520,616,956.01	5.55	644,871,981.39	1.08	601.01	主要为投资恒泰证券
在建工程	562,819,585.16	0.69	395,860,677.04	0.66	42.18	在建工程投入增加
递延所得税资产	294,193,220.00	0.36	176,750,717.71	0.29	66.45	其他权益工具投资公允价值变动导致
其他资产	11,380,810,684.03	13.98	6,669,361,683.50	11.13	70.64	其他非流动资产增加
短期借款	630,073,044.46	0.77			不适用	银行借款增加
应付短期融资款	8,132,246,488.92	9.99	4,101,653,977.00	6.85	98.27	短期公司债规模增加
拆入资金	1,446,215,777.77	1.78	150,068,750.00	0.25	863.70	转融通融入资金、银行拆入资金增加
交易性金融负债	26,120,694.97	0.03			不适用	交易性金融负债增加所致
衍生金融负债	5,389,968.02	0.01	274,923.17	0.00	1,860.54	权益衍生工具形成的金融负债增加
代理买卖证券款	11,584,902,888.04	14.23	7,512,796,666.15	12.54	54.20	代理买卖证券款增加
应付职工薪酬	338,522,881.20	0.42	237,678,307.95	0.40	42.43	应付职工短期薪酬增加
应交税费	168,357,651.12	0.21	68,841,127.56	0.11	144.56	应交企业所得税增加
应付款项	279,975,921.11	0.34	34,316,294.16	0.06	715.87	应付清算款项增加
长期借款	1,189,306,800.00	1.46			不适用	银行借款增加
应付债券	24,371,607,466.49	29.94	18,020,388,943.79	30.07	35.24	应付公司债、次级债、收益凭证规模增加
递延所得税负债	287,172,116.59	0.35	99,850,963.76	0.17	187.60	交易性金融资产公允价值与账面成本差异导致
递延收益	87,000.00	0.00	195,000.00	0.00	-55.38	递延收益减少
合同负债	51,784,278.10	0.06			不适用	会计政策变更
资本公积	7,915,543,266.46	9.72	4,259,929,865.37	7.11	85.81	主要为所有者投入资本增加所致
其他综合收益	-469,026,061.83	-0.58	-241,330,968.35	-0.40	不适用	其他权益工具投资公允价值变动

#### 其他说明

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司资产总额为 814.05 亿元，较年初增长 214.85 亿元，增幅 35.86%。扣除代理买卖证券款后，本公司资产总额为 698.2 亿元，较年初增长 174.13 亿元，增幅 33.23%。其中：交易性金融资产 278.05 亿元，占总资产的 34.16%；货币资金 146.23 亿元，占总资产的 17.96%；融出资金 56.17 亿元，占总资产的 6.90%。公司整体资产流动性较强。

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司负债总额为 591.62 亿元，较年初增长 167.49 亿元，增幅 39.49%。扣除代理买卖证券款后，本公司负债总额为 475.77 亿元，较年初增长 126.77 亿元，增



幅 36.32%。其中，应付债券 243.72 亿元，占总负债的 41.19%；代理买卖证券款 115.85 亿元，占总负债的 19.58%；卖出回购金融资产款 83.08 亿元，占总负债的 14.04%

年末扣除代理买卖证券款的资产负债率为 68.14%，较年初的 66.59%略有增长，资产负债结构稳定。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司表内股票质押式回购业务规模 14.88 亿元，平均维持担保比例为 145.76%，表外股票质押式回购业务规模为 66.67 亿元。

信用交易业务情况表

项目	2020 年业务规模 (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	14.88	19.03	-21.81%
融出资金业务	56.79	60.73	-6.49%
合计	71.67	79.77	-10.15%

## 2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

详见本年度报告“第十一节财务报告七、合并财务报表项目注释 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) 行业经营性信息分析

适用 不适用

详见本年度报告“第三节公司业务概要”及本节“一、经营情况讨论及分析”相关内容。

### (五) 投资状况分析

#### 1、对外股权投资总体分析

适用 不适用

报告期末，公司合并报表口径长期股权投资 452,061.70 万元，期初值为 64,487.20 万元，期末较期初增加 387,574.5 万元。

#### (1) 重大的股权投资

适用 不适用

1. 公司收购恒泰证券股份有限公司股权

公司于 2019 年 6 月 17 日、2019 年 7 月 22 日分别召开第三届董事会第十七次会议、2019 年第四次临时股东大会，审议通过了《关于公司收购恒泰证券股份有限公司 29.99%股份的议案》，并与北京庆云洲际科技有限公司、北京汇金嘉业投资有限公司、北京鸿智慧通实业有限公司、济南博杰纳荣信息科技有限公司、中昌恒远控股有限公司、上海怡达科技投资有限责任公司、潍坊科虞科技有限公司、北京华诚宏泰实业有限公司、北京汇富通国际投资有限公司签署了《股权转让协议书》。详见公司披露的《天风证券股份有限公司关于收购恒泰证券股份有限公司 29.99%股权的进展公告》（公告编号：2019-055）、《天风证券股份有限公司第三届董事会第十七次会议决议公告》（公告编号：2019-056）、《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》（公告编号：2019-065）。为顺利推进本次交易的实施，各方于 2020 年 1 月 21 日签订了《股权转让协议书的补充协议（一）》，详见公司披露的《天风证券股份有限公司关于收购恒泰证券股份有限公司 29.99%股权的进展公告》（公告编号：2020-007）。公司已收到中国证监会《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》（证监许可〔2020〕344 号），详见公司披露的《天风证券股份有限公司关于收购恒泰证券股份有限公司部分股权获得中国证监会核准的公告》公告编号：2020-018），并已完成了依法受让恒泰证券股份有限公司 626,552,558 股股份（占股份总数的 24.05%）的过户手续，详见公司披露的《天风证券股份有限公司关于收购恒泰证券股份有限公司部分股权的进展公告》（公告编号：2020-022）、《天风证券股份有限公司关于收购恒泰证券股份有限公司部分股权的进展公告》（公告编号：2020-037）。截至 2020 年 12 月 31 日，公司累计已办理完毕恒泰证券股份有限公司 690,015,375 股股份（占股份总数的 26.49%）的过户手续。公司收购恒泰证券股份有限公司 29.99%股权的方案未发生变化，剩余 3.50% 股权收购将有序完成过户，相关进度见《天风证券股份有限公司关于收购恒泰证券股份有限公司部分股权的进展公告》（公告编号：2020-040）。

## 2. 公司设立资产管理子公司

2020 年 4 月 10 日，公司收到中国证监会《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），核准公司通过设立天风（上海）证券资产管理有限公司从事证券资产管理业务。具体内容详见公司于 2020 年 4 月 11 日披露的《天风证券股份有限公司关于获准设立资产管理子公司的公告》（公告编号：2020-038 号）。

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。

**(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

具体内容详见本年度报告“第二节公司简介和主要财务指标十二、采用公允价值计量的项目”“第十一节财务报告七、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”。

**(六) 重大资产和股权出售**

适用 不适用

**(七) 主要控股参股公司分析**

适用 不适用

1、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 1,345,384 万元，净资产人民币 435,806 万元；2020 年实现营业收入人民币 25,903 万元，利润总额人民币 9,564 万元，净利润人民币 5,488 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 594,735 万元，净资产人民币 38,632 万元；2020 年实现营业收入人民币 30,306 万元，利润总额人民币 1,055 万元，净利润人民币 463 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 93,895 万元，净资产人民币 91,175 万元；2020 年实现营业收入人民币 8,206 万元，利润总额人民币 7,766 万元，净利润人民币 5,875 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 303,213 万元，净资产人民币 38,526 万元；2020 年实现营业收入人民币 22,887 万元，利润总额人民币 6,259 万元，净利润人民币 5,564 万元。

5、天风（上海）证券资产管理有限公司，主营业务：证券资产管理业务，注册资本 50,000 万元，公司持有其 100%的股权。截至报告期末，天风资管总资产人民币 54,313 万元，净资产人民币 51,315 万元；2020 年实现营业收入人民币 3,564 万元，利润总额人民币 1,667 万元，净利润人民币 1,315 万元。

6、宜宾市商业银行股份有限公司，主营业务：吸收公众存款，发放短期、中期和长期贷款，办理国内结算，办理票据承兑和贴现，发行金融债券，代理发行、代理兑付、承销政府债券，买卖政府债券、金融债券，从事同业拆借，从事银行卡业务，提供信用证服务及担保，代理收收付款项及代理保险业务，提供保管箱服务，经银行业监督管理机构批准的其它业务。注册资本人民币 282,254 万元，公司持有其 7.16%的股权。截至报告期末，宜宾商行总资产人民币 5,641,039 万元，净资产人民币 561,617 万元；2020 年实现营业收入人民币 128,555 万元，利润总额人民币 22,024 万元，净利润人民币 16,797 万元。

7、恒泰证券股份有限公司，主营业务：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。注册资本人民币 260,457 万元，公司持有其 26.49%的股权。截至报告期末，恒泰证券总资产人民币 3,359,603 万元，净资产人民币 943,576 万元；2020 年实现营业收入人民币 273,158 万元，利润总额人民币 59,853 万元，净利润人民币 48,235 万元。

#### (八) 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司合并 24 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。

### 三、公司关于公司未来发展的讨论与分析

#### (一) 行业格局和趋势

适用 不适用

2020 年是“十三五”收官之年，也是资本市场建立运行的第三十年。伴随着我国证券市场三十余年的发展，证券行业经历了不断规范和发展壮大的历程，证券公司创新步伐逐步加快、业务范围逐步扩大、盈利能力逐步提升、抗风险能力逐步增强。

##### (一) 资本市场基础制度逐步优化

2020年3月，新《证券法》正式实施，再融资新规、退市新规、新三板转板等政策陆续出台，注册制改革从科创板延伸到创业板，资本市场从增量改革深化到存量改革，为证券行业发展打开了巨大空间。2020年11月3日，《中共中央关于制定国民经济和社会发展第十四个五年规划和二〇三五年远景目标的建议》公布，32字聚焦资本市场：“全面实行股票注册制，建立常态化退市机制，提高直接融资比重，推进金融双向开放”，为资本市场下一步发展指明方向。未来将围绕全面推进注册制、完善资本市场基础制度建设、加速资本市场对外开放、提高上市公司质量等方面推进改革，政策落地速度也将加快。证券公司作为联结资本市场和实体经济的枢纽，将直接受益于资本市场的“提质扩容”，各项业务都将分享资本市场新一轮改革开放的红利。

## （二）稳步推进资本市场深化改革

创新是资本市场发展的动力源泉。证券公司在过去的一年里积极作为，突出主业，做精专业，以客户需求为导向，积极开发多样化、差异化的金融产品，有效满足居民财富管理需求，为实体经济提供更高质量、更有效率的金融服务。尤其是在目前的大数据时代，结合行业数字化转型的需求以及新《证券法》的实施，充分发挥科技的作用，以科技促创新，以创新促发展，增强服务实体经济的能力和效率。证券行业要引进先进理念、经营模式、管理经验，提高行业国际竞争力。同时，更要苦练内功，提升专业水平，努力打造国际一流投资银行。

## （三）券商科技转型加速

证券公司金融科技转型从发展特征来看可以分为三个阶段：第一阶段，科技主要应用于网上登记、交易、结算。越来越多的证券公司开始加速互联网证券业务布局，整合升级线上线下资源，加速网络证券业务创新，证券互联网在证券登记结算中的应用；第二阶段，随着中国互联网用户的快速增加，网上证券交易平台成为了各家券商的标配，新模式将带来便捷、高效的用户体验、股民数量的快速增加；第三阶段，金融科技与人工智能、大数据、区块链、云计算等技术结合推动证券行业真正进入数字化转型，重构了证券行业的金融服务生态。近年来，移动互联、人工智能、大数据、云计算等数字技术的交叉融合应用逐渐成为证券行业提高运营效率、增强盈利能力的有力抓手。

## （二） 公司发展战略

√适用 □不适用

坚持综合金融发展方向，建设全能型大投行，从以产品为中心转向以客户为中心的综合金融服务转型，依托行业顶尖研究所着力打造金融生态圈。同时，全力以赴抓住中国资产管理市场巨

大的结构性变化、战略性机遇，积极发展大类资产配置及投顾业务。打造以全天候资产管理能力、全方位大投行服务能力双轮驱动、两翼齐飞的证券公司。

### (三) 经营计划

√适用 □不适用

1、经纪业务方面，实现分支机构扁平化、标准化和精细化管理，加强总部赋能，继续推进总-分-支管理架构。将流量、销售作为重点，通过互联网手段抓紧做大规模。持续补齐系统短板，打造数字化平台，通过平台串联各方资源。优化产品遴选体系，与公司各类产品打通，启动常态化的产品发行，强化销售管理支持，推动代销规模实现重大突破。大力发展融券业务，扩充公司券源，为业务发展提供新的增长点。

2、投行业务方面，针对新一轮以科技为主的产业升级，抓住市场机遇，拥抱政策，加强挖掘优质投行项目及股权投资项目。实施区域战略，深耕湖北，在北京、上海、广东等产业领先区域加强投行业务展业能力，与当地分支机构协同，对优秀企业进行拜访。整合总部各部门、分支机构、香港子公司的机构销售资源，加强承销能力建设，弥补投行业务承销能力不足的短板。

3、资管业务方面，充实投研人员队伍，打造市场化的投资管理团队，提升主动管理能力。推动丰富资管产品线，夯实固收产品业务优势，增加权益类产品规模占比。深化与现有渠道及客户的合作，申请公募基金管理资格，拓展资产管理业务范围。

4、自营业务方面，加强市场形势研判，以安全性和流动性为前提，提高资源配置的效率。重点投入，全面强化信用风险管理能力，完善责任分担机制，严格控制债券投资信用风险暴露。加强投研能力，积极布局科技、消费、军工、周期、证券等行业优质标的。持续研究与开发投资交易新策略，加大资产、策略投资多元化，进一步拓宽收入来源。

5、研究业务方面，推进社保基金等战略级客户签约，拓展银行理财子公司等增量客户。继续狠抓深度研究，提升天风研究品牌影响力。推动 ToB 端电子产业联盟和电子产业基金落地发行，以及 ToC 端新型投顾项目落地执行，持续挖掘、定价、赋能和变现优质资产，实现价值变现，为公司打造资本性投行进行战略赋能。

6、合规风控方面：充分依托合规管理体系，牢固构建“三道防线”，将合规管理要求落实到业务开展的各个环节，对照监管规定坚守底线。继续优化合规风控组织架构，确保全面风险管理系统建设稳步推进，按照全面风险管理系统整体规划，对项目进度进行细化管理、定期追踪，全力防控风险保障公司稳健运营。

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

√适用 □不适用

##### 1、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 workplaces 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。

此外，公司承担管理职能的业务部门均配备了专职风险管理人员。

#### （2）各类风险应对措施

##### ①市场风险管理

公司根据董事会制定的风险偏好、风险容忍度指标，结合各类投资的风险与收益状况进行资本分配，并根据业务之间的相关性与分散化效应，将公司的整体风险限额划分至各业务部门并制定相应的授权。业务部门是市场风险的承担者，负责一线风险管理工作。投资经理在其授权范围内开展交易并负责相关投资风险管理工作，动态管理其持仓部分暴露的市场风险，主动采取降低敞口或对冲等风险缓释措施控制风险。风险管理部作为独立的风险管理部门，向公司首席风险官负责，运用专业的风险管理工具和管理方法对各投资策略、业务部门/条线和全公司等不同层级的



市场风险状况进行独立监控、测量和管理，并按日、周、月等不同频率生成相应的风险报表和分析评估报告，及时发送给公司经营管理层以及相应业务部门的主要负责人。当发生接近或超过风险限额情况时，风险管理部及时向公司经营管理层以及相应业务部门/条线的主要负责人发送风险提示或预警，并根据公司相关领导/委员会的审批意见，监督业务部门落实应对措施。风险管理部将持续与业务部门/条线人员直接沟通最新市场状况、当前风险暴露和可能出现的极端压力情景等问题。

### ②信用风险管理

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

### ③操作风险管理

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

### ④流动性风险管理

公司对流动性风险的管理采用逐日盯市、动态监控、分层汇总、定期报告，通过流动性监控指标、资产结构、负债结构、资产负债期限匹配结构、现金流量分析、压力测试等方法对流动性风险进行识别与分析。公司流动性风险管理部门每日计算并监控关键风险指标的情况，判断和预测各类风险指标的变化，定期将流动性指标、负债情况向公司经营管理层报告。资金计划部每月报送融资管理业务月度信息简报，对公司存续的主要债务融资工具的品种、规模、原始期限、剩余期限等进行分析，对公司近期资金缺口情况进行汇报，对未来可能发生垫资的风险进行提示。同时，公司流动性风险管理部门跟进公司融资项目进展，包括但不限于公司债、次级债等债务融资工具申请发行额度、交易所审批意见、证监会审核进展、银行授信维护情况等，对金融市场交易量和价格等变动情况进行汇报，评估市场流动性对公司融资能力的影响。此外，在特定业务或

交易开展之前，流动性风险管理部门将充分评估其可能对流动性风险产生的影响，并出具流动性风险评估报告供业务部门和公司执行委员会参考，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、投行内核部是公司在合法、合规方面的主要内部控制职能部门，对公司经营与管理活动的合法、合规进行控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务，保障公司在合法、合规的前提下开展业务经营。合规法律部、投行内核部主要负责合规管理制度、流程的建设与实施；提供日常合规建议与咨询；新业务新产品合规风险审核；合规风险事项调查、督促整改与落实；起草公司法律文书、代理公司诉讼、调解和仲裁等事务；反洗钱管理及反洗钱制度的制定和实施；组织合规培训、推动合规文化建设、培养公司员工合规意识等工作。

#### ⑦洗钱风险管理

公司根据《金融机构反洗钱监督管理办法（试行）》要求，结合自身的反洗钱工作实际特点，从反洗钱机构设置、人员配备、反洗钱制度建设与执行、客户身份识别、客户资料和交易记录保存、客户风险等级划分工作、大额交易和可疑交易报送、反洗钱宣传和培训、反洗钱协查工作、反洗钱监控系统运行、反洗钱检查评估等方面积极开展了工作。公司将进一步加强战略层面布局，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。

### （五）其他

适用 不适用

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

适用 不适用

## 第五节 重要事项

### 一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

#### (一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

适用 不适用

公司重视股东回报，在《公司章程》中明确了公司利润分配政策，《公司章程》利润分配相关条款明确规定了利润分配政策尤其是决策程序和机制以及现金分红相对于股票股利在利润分配方式中的优先顺序、公司现金分红的期间间隔、现金分红的具体条件、发放股票股利的条件等。

公司 2020 年度利润分配预案为：目前公司正在推进非公开发行 A 股股票。根据中国证监会《证券发行与承销管理办法》规定，上市公司发行证券，存在利润分配方案、公积金转增股本方案尚未提交股东大会表决或者虽经股东大会表决通过但未实施的，应当在方案实施后发行。如果公司实施 2020 年度利润分配，则在完成利润分配前，公司不能进行非公开发行股票。从股东利益和公司发展等综合因素考虑，公司暂不进行 2020 年度利润分配，也不进行资本公积转增股本。公司计划在本次非公开发行 A 股股票完成后，尽快按照相关法律法规的要求与《公司章程》规定进行利润分配相关事宜。本预案尚需提交公司股东大会审议。

公司上述利润分配预案制订合规、透明，符合《公司章程》及审议程序的规定，相关决策程序和机制完备，独立董事履职尽责并发表了独立意见，充分保护了中小股东的合法利益。

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

单位：元币种：人民币

分红年度	每 10 股送红股数（股）	每 10 股派息数（元）（含税）	每 10 股转增数（股）	现金分红的数额（含税）	分红年度合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润	占合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润的比率（%）
2020 年	0	0	0	0	454,871,365.71	0
2019 年	0	0.06	0	39,995,803.68	307,767,555.05	13.00
2018 年	0	0.07	0	36,260,000.00	302,851,495.02	11.97

#### (三) 以现金方式回购股份计入现金分红的情况

适用 不适用

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

适用 不适用

报告期内盈利且母公司可供普通股股东分配利润为正，但未提出普通股现金利润分配方案预案的原因	未分配利润的用途和使用计划
目前公司正在推进非公开发行A股股票。根据中国证监会《证券发行与承销管理办法》规定，上市公司发行证券，存在利润分配方案、公积金转增股本方案尚未提交股东大会表决或者虽经股东大会表决通过但未实施的，应当在方案实施后发行。如果公司实施2020年度利润分配，则在完成利润分配前，公司不能进行非公开发行股票。从股东利益和公司发展等综合因素考虑，公司暂不进行2020年度利润分配，也不进行资本公积转增股本。	公司计划在本次非公开发行A股股票完成后，尽快按照相关法律法规的要求与《公司章程》规定进行利润分配相关事宜。

## 二、承诺事项履行情况

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

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	商贸集团、人福医药、湖北省联发、陕西大德、宁波信达、中航信托、苏州建丰、当代科技、上海天闾、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	-	-
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	商贸集团、人福医药、湖北省联发	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	-	-

与首次公开发行相关的承诺	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	-	-
与首次公开发行相关的承诺	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	-	-
与首次公开发行相关的承诺	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	-	-
与首次公开发行相关的承诺	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	-	-
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	商贸集团、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	若未履行相关承诺，本公司将在股东大会及中国证监会指定媒体上进行公开道歉。同时在符合法律、法规及规范性文件规定的情况下 10 个交易日内回购该违规卖出的股票，且自回购完成之日起自动延长持有的全部股份的锁定期 6 个月。在认定未履行	长期有效	否	是	-	-

			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。					
与首次公开发行相关的承诺	解决同业竞争	商贸集团、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	<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。2. 本公司/企业作为天风证券股东期间，不会在中国境内或境外，以任何方式（包括但不限于单独经营、通过合资经营或拥有另一公司或企业的股份及其它权益，或通过他人代本公司/企业经营）直接或间接从事与天风证券（包括其控股子公司，下同）相同或相似的业务。3. 本公司/企业承诺：将采取合法及有效的措施，促使本公司/企业的其他控股、参股子公司不从事与天风证券相同或相似的业务，如果有同时适用于天风证券和本公司/企业其他控股、参股子公司进行商业开发的机会，天风证券在同等条件下享有优先选择权。4. 本公司/企业承诺给予天风证券与本公司/企业其他控股、参股子公司同等待遇，避免损害天风证券及天风证券中小</p>	长期有效	否	是	-	-

			<p>股东的利益。5. 对于天风证券的正常生产、经营活动，本公司/企业保证不利用股东地位损害天风证券及天风证券中小股东的利益。6. 本公司/企业保证上述承诺在本公司/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。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>					
与首次公开发行相关的承诺	解决关联交易	商贸集团、人福医药、湖北省联发、当代科技、上海天阖、当代文体、三特索道	<p>1. 本公司/企业将尽量减少和规范与天风证券及其控股子公司之间发生关联交易；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</p>	长期有效	否	是	-	-



			<p>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；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；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>					
与首次公开发行人相关的承诺	其他	商贸集团、人福医药、湖北省联发、陕西大德、宁波信达、中航信托、苏州建丰	<p>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。</p>	公司上市后三年内	是	是	-	-

与首次公开发行人相关的承诺	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	-	-
与首次公开发行人相关的承诺	其他	全体董事及高级管理人员	公司董事、高级管理人员针对公司填补回报措施能够得到切实履行作出如下承诺： 1. 承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益；2. 承诺对董事和高级管理人员的职务消费行为进行约束；3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动；4. 承诺由董事会或薪酬委员会制定的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 5. 承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。	长期有效	否	是	-	-
与再融资相关的承诺	其他	全体董事、高级管理人员	1、承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益。2、承诺对自身的职务消费行为进行约束。3、承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动。4、承诺由董事会或董事会薪酬与考核委员会制定的薪酬制度与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相	长期有效	否	是	-	-

			<p>挂钩。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。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>					
--	--	--	---	--	--	--	--	--

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

已达到  未达到  不适用

(三) 业绩承诺的完成情况及其对商誉减值测试的影响

适用  不适用

三、报告期内资金被占用情况及清欠进展情况

适用  不适用

四、公司对会计师事务所“非标准意见审计报告”的说明

适用  不适用

五、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明

(一) 公司对会计政策、会计估计变更原因及影响的分析说明

适用  不适用

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》(以下简称“新收入准则”)。

本公司于 2020 年 1 月 1 日起执行新收入准则以及通知，对会计政策相关内容进行调整。

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参见“第十一节财务报告五、35.收入”

本公司根据首次执行新收入准则的累计影响数,调整 2020 年 1 月 1 日的留存收益及财务报表相关项目金额,对可比期间信息不予调整,本公司仅对在首次执行日尚未完成的合同的累计影响数进行调整。

详见本报告“第十一节财务报告五、44.重要会计政策和会计估计的变更”。

## (二) 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明

适用 不适用

## (三) 与前任会计师事务所进行的沟通情况

适用 不适用

## (四) 其他说明

适用 不适用

## 六、聘任、解聘会计师事务所情况

单位:元币种:人民币

	现聘任
境内会计师事务所名称	大信会计师事务所(特殊普通合伙)
境内会计师事务所报酬	1,900,000.00
境内会计师事务所审计年限	13

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	大信会计师事务所(特殊普通合伙)	550,000.00
保荐人	中信证券股份有限公司	-

### 聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

2020 年 4 月 27 日,公司召开第三届董事会第三十次会议,审议并通过了《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 年度财务报告审计机构及内部控制审计机构,该议案经 2019 年年度股东大会审议通过。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

## 七、面临暂停上市风险的情况

### (一) 导致暂停上市的原因

适用 不适用

### (二) 公司拟采取的应对措施

适用 不适用

## 八、面临终止上市的情况和原因

适用 不适用

## 九、破产重整相关事项

适用 不适用

## 十、重大诉讼、仲裁事项

本年度公司有重大诉讼、仲裁事项 本年度公司无重大诉讼、仲裁事项

### (一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

适用 不适用

事项概述及类型	查询索引
王国起与天风证券专利纠纷案	2019年2月21日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007号）
天风证券与银亿控股有限公司借款合同纠纷案	2019年2月21日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007号）
天风证券与龙跃实业集团有限公司借款合同纠纷案	2019年2月21日披露的天风证券股份有限公司《关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告编号：2019-007号）

### (二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

适用 不适用

单位：元币种：人民币

报告期内：									
起诉(申请)方	应诉(被申请)方	承担连带责任方	诉讼仲裁类型	诉讼(仲裁)基本情况	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)是否形成预计负债及金额	诉讼(仲裁)进展情况	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况

天风证券	方锦程、张莉莉	/	合同纠纷	见表下概述	277,395,300	/	见表下概述	见表下概述	见表下概述
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

天风证券诉方锦程、张莉莉、刘可武借款合同纠纷案，天风证券与方锦程开展股票质押业务，因方锦程质押的股票价格持续下跌，经多次催促后其仍不履行补充担保义务和承担违约责任，天风证券于2018年10月向湖北省高级人民法院提起对方锦程、配偶张莉莉、保证人刘可武的民事诉讼，要求偿还融资本金人民币241,941,200.75元及利息、违约金等。为加快诉讼进程，我司于2019年8月2日向法院撤回对刘可武的起诉，2019年11月11日，湖北省高级人民法院作出(2018)鄂民初98号民事判决书，判决：1、方锦程向天风证券支付融资本金241,914,200.75元及利息(2018年3月21日至2018年8月12日欠付利息总额为2,707,636.05元；2018年8月14日之后的利息计算方式为以241,914,200.75元为基数，以年利率百分之十为标准，自2018年8月13日起计付至实际清偿之日止)；2、方锦程向天风证券支付违约金(以241,914,200.75元为基数，以日利率万分之三为标准，自2017年12月13日起计付至2018年9月13日；以241,914,200.75元为基数，以年利率百分之十四为标准，自2018年9月14日起计付至实际清偿之日止)；3、方锦程向天风证券支付律师费20万元，财产保全责任保险费166,437.16元，公告费780元；4、天风证券可在本判决第一、二、三项确定的融资本金、利息、违约金以及相关实现债权费用范围内以方锦程提供质押的31,273,400股方盛制药股票(证券代码603998)折价、拍卖或变卖所得价款优先受偿；5、驳回天风证券其他诉讼请求。2019年12月6日，天风证券收到张莉莉的民事上诉状，上诉请求为：1、请求撤销判决第四项，改判涉案31,273,400股方盛制药股票(证券代码603998)中的二分之一属无效抵押，方锦程仅以涉案31,273,400股方盛制药股票中的二分之一折价、拍卖或变卖所得价款支付本案债务；2、上诉费由天风证券承担。2020年11月，最高院作出二审判决，判决驳回上诉，维持原判。同月，武汉市中级人民法院执行立案，案号为2020鄂01执2281号，目前尚在执行程序中。

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，起诉至上海浦东区法院，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 年未休年假工资差额 15,757.43 元；2、天风证券支付郭敏 2018 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。2020 年 8 月 20 日，上海市第一中级人民法院作出二审判决，驳回郭敏上诉，维持原判。2020 年 8 月，天风证券已按生效判决义务向郭敏履行支付义务，本案已完结。

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，上海金融法院作出一审判决：1、中拓公司向天示公司偿还本金 90,336,147 元；2、中拓公司向天示公司支付以本金为基数，以年利率 10.95%计付的罚息；3、中拓公司向天示公司支付违约金 1,523,456.58 元，及以本金 90,336,147 为基数，以年利率 13.05%计付的违约金；4、中拓公司向天示公司支付律师费 350,000 元；5、杭州华速实业有限公司承担连带保证责任。2020 年 9 月，天示公司向上海金融法院申请强制执行，上海金融法院于 2020 年 12 月以未发现被执行人有可供执行的财产为由终结本次执行程序。2020 年 12 月，天示公司收到杭州华速实业有限公司的破产管理人通知，杭州华速实业有限公司已被杭州市江干区人民法院裁定破产清算审查，天示公司将按破产程序要求积极申请债权。

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

适用 不适用

#### 十二、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

报告期内，公司及公司第一大股东不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

### 十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

#### (一) 相关激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

#### (二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

### 十四、重大关联交易

#### (一) 与日常经营相关的关联交易

##### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

##### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

##### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

#### (二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

##### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

##### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用



3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、 涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(五) 其他

适用 不适用

十五、 重大合同及其履行情况

(一) 托管、承包、租赁事项

1、 托管情况

适用 不适用

2、 承包情况

适用 不适用

## 3、 租赁情况

□适用 √不适用

## (二) 担保情况

√适用 □不适用

单位:亿元币种:人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）													
担保方	担保方与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期（协议签署日）	担保起始日	担保到期日	担保类型	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	是否存在反担保	是否为关联方担保	关联关系
无													
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）							0						
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）							0						
公司及其子公司对子公司的担保情况													
报告期内对子公司担保发生额合计							13.18						
报告期末对子公司担保余额合计（B）							13.18						
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）													
担保总额（A+B）							13.18						
担保总额占公司净资产的比例（%）							7.55						
其中：													
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）							0						
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）							0						
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）							0						
上述三项担保金额合计（C+D+E）							0						
未到期担保可能承担连带清偿责任说明							不适用						
担保情况说明							以上担保为：公司为子公司为天风资管提供最高额度为人民币13.18亿元的净资本担保承诺。						

## (三) 其他重大合同

□适用 √不适用

## 十六、其他重大事项的说明

√适用 □不适用

### (一) 营业网点新设情况

报告期内，公司完成 6 家证券营业部、3 家证券分公司的新设，具体情况如下：

序号	名称	所在地	设立时间	负责人
1	柳州文昌路证券营业部	广西	2020-9-8	覃钢
2	西安科技路证券营业部	陕西	2020-9-16	全瑶斌
3	重庆庆云路国金中心证券营业部	重庆	2020-9-23	高明
4	北京诺德樊羊路证券营业部	北京	2020-10-12	李岩
5	金华解放东路证券营业部	浙江	2020-10-19	邵英
6	上海世纪大道证券营业部	上海	2020-12-7	王振超
7	荆门分公司	湖北	2020-7-1	龙涛
8	海南分公司	海南	2020-7-30	张雨龙
9	东北分公司	辽宁	2020-9-28	张煜

### (二) 营业网点撤销情况

报告期内，公司完成 1 家证券营业部的撤销，具体情况如下：

序号	名称	所在地	撤销时间	负责人
1	深圳平安金融中心证券营业部	深圳	2020-12-8	朱斌

### (三) 营业网点升级情况

报告期内，公司完成 2 家证券营业部升级为分公司，具体情况如下：

序号	名称	所在地	设立时间	负责人	原营业部
1	上海浦东分公司	上海	2018-5-24	孙凯	上海浦明路营业部
2	陕西分公司	陕西	2019-5-10	种亮	西安唐延路营业部

### (四) 营业网点变更情况

报告期内，公司完成 3 家分公司、11 家证券营业部注册地址的变更，具体情况如下：

序号	分公司/营业部原名称	分公司/营业部现名称	变更后地址
1	深圳分公司	深圳分公司	深圳市福田区福田街道福安社区益田路 5033 号平安金融中心 71 层 03-05 单元
2	天津分公司	天津分公司	天津市和平区新兴街西康路 70 号余门
3	西安唐延路营业部	陕西分公司	陕西省西安市高新区锦业路 12 号迈科中心 10 层 1001 室
4	菏泽长江路营业部	菏泽中华路营业部	菏泽市凯旋广场（万象广场）第 0006 幢 07 单元 20 层 72011 号房
5	成都双成三路营业部	成都市槐树店一路营业部	四川省成都市成华区槐树店一路 300 号 8 栋 4 楼 402
6	东莞鸿福路营业部	东莞鸿福路营业部	东莞市南城区鸿福路 200 号海德广场 B 栋办公楼第 16 层 1603
7	上海南京西路营业部	上海南京西路营业部	上海市黄浦区南京西路 288 号创兴金融

			中心 20 层 03B-04 室
8	十堰江苏路营业部	十堰江苏路营业部	十堰江苏路 8 号 1 幢
9	深圳国际商会中心证券营业部	深圳深南大道国际创新中心证券营业部	深圳市福田区益田路与福华三路东交汇处国际商会中心大厦 29 层 03 号
10	大连普兰店体育路营业部	大连普兰店亭兰路营业部	大连市普兰店区亭兰路北段 39-1 号 4 楼
11	宜昌夷陵大道营业部	宜昌隆康路营业部	宜昌市隆康路 10 号二楼（宜昌总工会大楼）
12	江阴环南路营业部	江阴人民东路营业部	江阴市人民东路 137 号
13	深圳福华路营业部	深圳福华路营业部	深圳市福田区现代国际商务大厦 21 楼 2110、2101B 号
14	岳阳金颍中路营业部	岳阳南湖大道营业部	岳阳市南湖大道与东茅岭路交叉口银都大厦 16 楼 D 座

## 十七、积极履行社会责任的工作情况

### （一）上市公司扶贫工作情况

√适用 □不适用

#### 1. 精准扶贫规划

公司积极开展精准扶贫工作，助力打赢脱贫攻坚战。

公司在支持战疫、产业扶贫、智慧扶贫、消费扶贫、公益扶贫、开展扶贫理论研究等方面发力，助力贫困地区发展。

在战疫战贫方面，公司通过捐资捐物、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。

在产业扶贫方面，公司持续在贫困地区设立金融扶贫工作站，针对性的为贫困县企业发展建言献策，并通过发行扶贫债券等方式，服务贫困地区经济社会发展。

在智慧扶贫方面，公司联合专业人员赴贫困地区调研，委派金融专家到贫困县挂职、派驻业务人员阶段性入驻企业，帮助贫困县政府与企业更新融资观念，参与培养县域金融能手，普及金融知识，开展金融风险教育。

在消费扶贫方面，打造品牌农产品，对接“网红主播”开展“直播带货”活动，通过媒体宣传、消费认购、推荐销售等方式拓展销售渠道。

在公益扶贫方面，公司参与成立慈善组织，开展教育扶贫项目、公益救助项目与志愿服务活动，帮助“三区三州”深度贫困地区、结对国家级贫困县以及其他民族地区、集中连片特困地区等地受疫情影响群体、残疾群体、留守儿童、困难老人以及其他困难群体解决生活困难。

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各项帮扶举措，“脱贫不脱政策、摘帽不摘责任”，致力于帮助脱贫县巩固脱贫成果，防止返贫。

此外，公司规划打造美丽乡村，针对湖北省将军山村开展包村帮扶，通过产业开发帮助当地村民致富，助推乡村振兴发展。

## 2. 年度精准扶贫概要

2020年，公司以资源整合为发力点，在扶贫实践中，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。

截至2020年12月31日，公司共与8个国家级贫困县开展“一司一县”结对帮扶工作、帮扶9个“三区三州”贫困县脱贫攻坚，在49个国家级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，助力贫困地区抗击新冠疫情。

### （1）党建引领，凝聚公益扶贫新力量

公司通过参与成立欣鑫慈善基金会，推进党员扶贫志愿服务，为贫困地区不断注入公益扶贫新力量。连续四年在“三区三州”凉山州布拖县等贫困县设立奖学金，帮助贫困学子完成学业，并创新帮扶方式，邀请党员志愿者为学生提供学习、生活、工作、心理健康、职业生涯规划等全方位帮扶。公司还推出“梦想计划”圆梦工程，党员扶贫工作者为贫困学子定制圆梦方案，引导贫困学子树立坚定的理想信念，帮助他们早日实现梦想。

### （2）战疫战贫，探索减贫防返新举措

公司总部位于疫情严重的武汉，但仍结合疫情发展实际，创新推出“战疫+战贫”系列项目，开拓精准扶贫与疫情防控并举的新举措。疫情发生后，公司克服困难，第一时间联合爱心组织将防护与生活用品送往国家级贫困县防疫一线（包括湖北省多个贫困县，“三区三州”深度贫困地区，新疆等民族地区等），缓解贫困县防疫物资短缺困境。截至目前，公司与受疫情影响的困难家庭实现结对，为他们送去包含临时救助金、防护物资、生活用品的“战疫战贫爱心包”；为湖北省确诊新冠肺炎的建档立卡贫困人口投保重疾保险与交通意外险，提供长效保障。公司还通过消费扶贫认购、对接网红主播“直播带货”等方式，帮助受疫情影响严重的湖北贫困县缓解农副产品滞销困境。

### （3）一地一策，打造证券扶贫新产品

公司深入贫困县，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。通过创新设计的金融服务产品，公司“实打实”地帮助贫困县拓展融资渠道，促进产业扶贫高质量落地。

#### (4) 驻村扶智，引导县域融资新观念

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，作为金融扶贫工作站全面推进“金融进村扶贫服务”策略落实。公司委派金融专家在国家级贫困县挂职或阶段性入驻企业，协助当地政府和企业合作开展金融扶贫工作；在利川、房县、苍溪等贫困县开展资本市场专项培训或“少儿财商课”，开展投资者教育与保护活动，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，为贫困地区带来现代金融理念。

#### (5) 开拓市场，升级品牌产业新链条

在消费扶贫方面，公司采用“产业+品牌”的方法，从本地出发，补足短板，打造特色，帮助扶贫对象提升市场竞争力。通过为贫困地区带来电商、农业专家、先进技术与现代化品牌营销思维，公司为凉山猴头菇、房县小花菇、利川红茶等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，协助上架扶贫 832 平台，通过推荐销售、消费认购等方式打开贫困地区特色农产品销售渠道。在利川红茶品牌塑造和产品推广方面，公司免费为结对帮扶的星斗山茶企优化包装设计、融入品牌思维、打造定制产品。通过助推利川红茶产业发展，公司带动当地贫困人口种茶、采茶，过上了好日子。

#### (6) 着眼长效，构建金融扶贫新标准

公司在全国率先开展“证券公司扶贫绩效评估指标体系”研究，形成了由 6 项一级指标、48 项二级指标及深度贫困加成系数组成的专业体系。为证券行业提供标准化扶贫参考，为各级政府扶贫决策和考核提供科学支撑，为巩固金融扶贫成果提供长效解决方案。

在党建引领下，公司从行业属性和专业能力出发，深耕基层、创新不止，找到证券公司造血扶贫的路径，帮助贫困地区跨越与发达地区之间的资本鸿沟、知识鸿沟、市场鸿沟、社会鸿沟。

### 3. 精准扶贫成效

√适用 □不适用

单位：万元币种：人民币

指标	数量及开展情况
一、总体情况	
其中：1. 资金	500.847
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）	19
1.3 产业扶贫项目投入金额	282.338
2. 转移就业脱贫	
2.3 帮助建档立卡贫困户实现就业人数（人）	11
3. 教育脱贫	
其中：3.1 资助贫困学生投入金额	109.106
3.2 资助贫困学生人数（人）	1620
3.3 改善贫困地区教育资源投入金额	10.884
4. 健康扶贫	
其中：4.1 贫困地区医疗卫生资源投入金额	27.339
5. 其他项目	
其中：5.1 项目个数（个）	19
5.2 投入金额	71.181
5.3 其他项目说明	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费用、“一司一县”金融扶贫工作站开展扶贫工作费用、赴贫困地区调研费用、看望贫困户捐赠款、支持贫困县基础设施建设捐赠款、支持贫困县新时代文明实践中心建设、支持贫困县志愿服务项目等。
三、所获奖项（内容、级别）	
全国企业扶贫优秀案例综合 50 佳（国务院扶贫办、中国社科院）	
中国企业 ESG 金责奖·最佳责任进取奖（新浪财经）	
2020 中国企业 ESG 最佳案例奖（财联社）	
“价值共创”抗疫贡献奖（复旦大学管理学院）	

#### 4. 后续精准扶贫计划

当前，全国所有国家级贫困县已脱贫摘帽。2021 年，公司将继续帮助结对脱贫县巩固脱贫成果，在持续做好“一司一县”扶贫工作基础上，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，助推乡村振兴发展。

在疫情关怀方面，公司拟联合慈善组织继续针对受疫情影响较为严重的脱贫县困难党员、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，提供持续关怀。

在产业扶贫方面，公司将持续推进金融扶贫项目落地，推进更多扶贫债券发行，组织金融专家阶段性入驻企业，为脱贫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，公司将继续组织金融专家赴脱贫县举行投资者教育活动、进行防止非法集资宣讲，继续组织“天风证券少儿财商课”特色投教活动。

在消费扶贫方面，公司将继续为脱贫县对接“网红直播”资源，通过消费认购、推荐消费等方式帮助品牌农产品拓展销路。

在公益扶贫方面，持续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。

公司将充分发挥资源整合优势，坚持履行企业社会责任，做好综合金融服务，以高度的责任意识、担当意识助力脱贫县振兴发展。

当前，新冠疫情“外防输入、内防反弹”的压力仍然较大，在常态化疫情防控形势下，公司将坚定不移坚持党的领导，持续担起时代责任，创新牵引、一往无前，奋力助推乡村振兴，在中华民族伟大复兴的征程中贡献天风力量。

## （二）社会责任工作情况

√适用 □不适用

在党建引领下，公司始终坚持将可持续发展理念融入公司的战略规划和业务运营。构建了三大“党建引领责任担当”社会责任行动方向——稳健金融、绿色金融、普惠金融，持续加强与党政机关及监管机构、员工、客户、股东、社区及公众等利益相关方的沟通，发挥金融力量，创造出更大价值。

公司深化党建引领作用，在政治上、思想上、行动上始终同以习近平总书记为核心的党中央保持高度一致，引领并促进公司业务服务国家战略。

稳健金融方面，公司持续完善治理结构，打造规范化、透明化、专业化的公司治理体系。公司坚持合规经营，通过有效的合规管理手段防范违法违规风险，不断提升管理水平。公司建立健全风险管理和内部控制体系，持续提升整体风险防范能力，保障各项业务稳定，健康运转，维护投资者与客户的合法权益。公司全面抓实信息安全管理，保障公司信息资产与客户隐私安全。公



司加强反腐倡廉工作与党风廉政建设，努力提高反腐倡廉工作实效，为公司的改革、发展与稳定提供有力保证。公司持续深入研究并及时跟进市场和客户的需求变化，努力为客户量身定制优质的金融产品，优化客户的财富管理服务体验。公司明确自身责任担当，助力区域经济社会发展，协助政府与企业融资，以专业优势服务实体经济发展。同时，公司注重信息化与数字化建设，加大金融科技投入，将金融科技基因融入公司业务发展与管理流程。新冠疫情期间，公司积极响应党中央号召，助力武汉、湖北、全国复工复产。

绿色金融方面，公司积极助力碳中和行动，将绿色金融融入公司战略规划，捐资设立中央财经大学绿色金融国际研究院，开展绿色研究，全面推动低碳经济相关产学研合作发展。公司全力推进绿色金融产品和项目落地，让绿色金融更好地服务实体经济，助力可持续发展。此外，公司将绿色环保理念潜移默化地融入公司日常业务运营过程中，科学管理排放物，积极节约资源，保护生态环境，建设绿水青山。

普惠金融方面，公司秉承“人是价值创造的根本”的人才理念，依法保障员工在招聘、离职、薪酬福利、晋升发展、工时休假、平等机会、多元化成长等方面的权益，落实各项措施保障员工的生命安全和职业健康。公司倡导“以创业者为本”的企业价值观，将人才发展创造“创业者氛围”。公司重视企业文化建设，致力于打造文化氛围浓厚、员工归属感强烈的幸福企业。公司推动投资者教育与保护工作，帮助社区公众提升投资技能，树立理性投资意识，防范金融诈骗，打击非法集资。公司参与决战决胜脱贫攻坚，助力乡村振兴；参与公益慈善事业与志愿服务活动，树立天风证券的社会责任形象，为建设美好社会贡献力量。

有关公司社会责任履行情况，参见公司于上海证券交易所网站及公司官网披露的《天风证券2020年度环境、社会及公司治理报告》。

### （三）环境信息情况

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

适用 不适用

#### 2. 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

有关公司环境责任履行情况，参见公司于上海证券交易所网站及公司官网披露的《天风证券2020年度环境、社会及公司治理报告》。

3. 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明

适用 不适用

4. 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

(四) 其他说明

适用 不适用

十八、可转换公司债券情况

适用 不适用

## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、普通股股本变动情况

#### (一) 普通股股份变动情况表

##### 1、普通股股份变动情况表

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例(%)	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例(%)
一、有限售条件股份	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、普通股股份总数	5,180,000,000	100.00	1,485,967,280	/	/	/	1,485,967,280	6,665,967,280	100.00

**2、普通股股份变动情况说明**

√适用 □不适用

2020 年 1 月，中国证监会出具《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），核准公司向原股东配售 1,554,000,000 股新股。公司于 2020 年 3 月完成配股发行，最终有效认购数量为 1,485,967,280 股，新增股份于 2020 年 3 月 31 日上市。

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

□适用 √不适用

**4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容**

□适用 √不适用

**(二) 限售股份变动情况**

□适用 √不适用

**二、证券发行与上市情况****(一) 截至报告期内证券发行情况**

√适用 □不适用

单位：股币种：人民币

股票及其衍生证券的种类	发行日期	发行价格（或利率）	发行数量	上市日期	获准上市交易数量	交易终止日期
普通股股票类						
配股	2020 年 3 月 19 日	3.60 元/股	1,485,967,280	2020 年 3 月 31 日	1,485,967,280	不适用
可转换公司债券、分离交易可转债、公司债类						
短期公司债券	2020 年 12 月 8 日	3.80%	10.00 亿	2020 年 12 月 14 日	10.00 亿	2021 年 12 月 7 日
短期公司债券	2020 年 10 月 19 日	3.65%	20.00 亿	2020 年 10 月 26 日	20.00 亿	2021 年 10 月 18 日
公司债券	2020 年 4 月 15 日	2.87%	15.00 亿	2020 年 4 月 21 日	15.00 亿	2023 年 4 月 14 日
次级债券	2020 年 6 月 23 日	4.70%	18.00 亿	2020 年 7 月 2 日	18.00 亿	2023 年 6 月 22 日
次级债券	2020 年 2 月 27 日	4.90%	10.80 亿	2020 年 3 月 5 日	10.80 亿	2025 年 2 月 26 日
次级债券	2020 年 2 月 27 日	3.90%	6.70 亿	2020 年 3 月 5 日	6.70 亿	2023 年 2 月 26 日
短期融资券	2020 年 10 月 20 日	3.40%	20.00 亿	2020 年 10 月 21 日	20.00 亿	2021 年 1 月 18 日
短期融资券	2020 年 7 月 22 日	2.85%	10.00 亿	2020 年 7 月 23 日	10.00 亿	2020 年 10 月 20 日
短期融资券	2020 年 6 月 23 日	2.60%	10.00 亿	2020 年 6 月 24 日	10.00 亿	2020 年 9 月 21 日

短期融资券	2020年3月18日	2.25%	10.00亿	2020年3月19日	10.00亿	2020年6月16日
短期融资券	2020年2月24日	2.60%	10.00亿	2020年2月25日	10.00亿	2020年5月22日
短期融资券	2020年1月13日	2.90%	10.00亿	2020年1月14日	10.00亿	2020年4月10日

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

√适用 □不适用

1. 本公司于2020年3月完成配股发行，本次配售增加股份总数为1,485,967,280股，均为无限售条件流通股，上市流通日为2020年3月31日。

2. 本公司于2020年12月8日公开发行天风证券股份有限公司2020年公开发行短期公司债券(第二期)，简称20天风S2，代码为163850，于2020年12月14日在上交所上市。本期债券为1年，发行规模为10亿元，票面利率为3.80%。

3. 本公司于2020年10月19日公开发行天风证券股份有限公司2020年公开发行短期公司债券(第一期)，简称20天风S1，代码为163826，于2020年10月26日在上交所上市。本期债券为1年，发行规模为20亿元，票面利率为3.65%。

4. 本公司于2020年4月15日公开发行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)，简称20天风01，代码为163423，于2020年4月21日在上交所上市。本期债券期限为3年，发行规模为15亿元，票面利率为2.87%。

5. 本公司于2020年6月23日非公开发行天风证券股份有限公司2020年非公开发行次级债券(第一期)(品种一)，简称20天风C3，代码为167109，于2020年7月2日在上交所上市。本期债券期限为3年，发行规模为18亿元，票面利率为4.70%。

6. 本公司于2020年2月27日非公开发行天风证券股份有限公司2020年次级债券(第一期)品种二，简称20天风C2，代码为166129，于2020年3月5日在上交所上市。本期债券期限为5年，发行规模为10.8亿元，票面利率为4.90%。

7. 本公司于2020年2月27日非公开发行天风证券股份有限公司2020年次级债券(第一期)品种一，简称20天风C1，代码为166128，于2020年3月5日在上交所上市。本期债券期限为5年，发行规模为6.70亿元，票面利率为3.90%。

8. 本公司于2020年10月20日发行天风证券股份有限公司2020年度第一期短期融资券，简称20天风CP006，代码为072000252，于10月21日在银行间上市。本期短期融资券期限为91天，发行规模为20亿元，票面利率为3.40%。

9. 本公司于2020年7月20日发行天风证券股份有限公司2020年度第一期短期融资券，简称20天风CP005，代码为072000197，于7月23日在银行间上市。本期短期融资券期限为91天，发行规模为10亿元，票面利率为2.85%。

10. 本公司于 2020 年 6 月 23 日发行天风证券股份有限公司 2020 年度第一期短期融资券，简称 20 天风 CP004，代码为 072000167，于 6 月 24 日在银行间上市。本期短期融资券期限为 91 天，发行规模为 10 亿元，票面利率为 2.60%。

11. 本公司于 2020 年 3 月 18 日发行天风证券股份有限公司 2020 年度第一期短期融资券，简称 20 天风 CP003，代码为 072000071，于 3 月 19 日在银行间上市。本期短期融资券期限为 91 天，发行规模为 10 亿元，票面利率为 2.25%。

12. 本公司于 2020 年 2 月 24 日发行天风证券股份有限公司 2020 年度第一期短期融资券，简称 20 天风 CP002，代码为 072000041，于 2 月 25 日在银行间上市。本期短期融资券期限为 91 天，发行规模为 10 亿元，票面利率为 2.60%。

13. 本公司于 2020 年 1 月 13 日发行天风证券股份有限公司 2020 年度第一期短期融资券，简称 20 天风 CP001，代码为 072000015，于 1 月 14 日在银行间上市。本期短期融资券期限为 91 天，发行规模为 10 亿元，票面利率为 2.90%。

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

√适用 □不适用

1、公司普通股股份总数及股东结构变动详见本报告第六节普通股股份变动及股东情况之“一、（一）普通股股份变动情况”；

2、公司资产和负债结构变动详见本报告第四节经营情况讨论与分析之“二、（三）资产、负债情况分析”。

## (三) 现存的内部职工股情况

□适用 √不适用

## 三、股东和实际控制人情况

### (一) 股东总数

截止报告期末普通股股东总数(户)	215,890
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	204,049
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	不适用
年度报告披露日前上一月末表决权恢复的优先股股东总数(户)	不适用

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

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内增 减	期末持股数 量	比例 (%)	持有有限售 条件股份数 量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
武汉商贸集团有限公司	124,336,187	760,988,942	11.42	636,652,755	无	/	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	29	519,359,753	7.79	519,359,724	质押	259,679,862	国有法人
陕西大德投资集团有限责任公司	19,690,000	249,100,093	3.74	229,410,093	无	/	境内非国有法人
宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	30,498,500	240,498,500	3.61	210,000,000	无	/	国有法人
中航信托股份有限公司	0	200,000,000	3.00	200,000,000	无	/	境内非国有法人
苏州建丰投资中心（有限合伙）	0	184,000,000	2.76	184,000,000	无	/	境内非国有法人
武汉当代科技产业集团股份有限公司	48	148,328,210	2.23	148,328,162	质押	138,700,000	境内非国有法人
武汉高科国有控股集团有限公司	-1,981,693	148,186,629	2.22	0	无	/	国有法人
上海天闾投资合伙企业（有限合伙）	30,510,055	132,210,237	1.98	101,700,182	无	/	境内非国有法人

## 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
人福医药集团股份有限公司	156,943,278	人民币普通股	156,943,278
武汉高科国有控股集团有限公司	148,186,629	人民币普通股	148,186,629
武汉商贸集团有限公司	124,336,187	人民币普通股	124,336,187
上海潞安投资有限公司	87,447,003	人民币普通股	87,447,003
湖北省科技投资集团有限公司	87,432,180	人民币普通股	87,432,180
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	72,602,540	人民币普通股	72,602,540
香港中央结算有限公司	69,022,813	人民币普通股	69,022,813
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
四川华西集团有限公司	52,424,362	人民币普通股	52,424,362
武汉市铁源物资有限公司	50,722,060	人民币普通股	50,722,060
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有限公司、武汉当代科技产业集团股份有限公司和上海天闾投资合伙企业（有限合伙）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	武汉商贸集团有限公司	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	上海天阖投资合伙企业(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、上海天阖投资合伙企业(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

## 四、控股股东及实际控制人情况

### (一) 控股股东情况

#### 1 法人

适用 不适用

#### 2 自然人

适用 不适用

#### 3 公司不存在控股股东情况的特别说明

适用 不适用

公司无任何单一股东或存在一致行动关系的股东持股比例高于 30%。公司亦无任何单一股东或存在一致行动关系的股东能够通过实际支配的公司股份表决权决定公司董事会过半数人员的选任,或决定公司的重大事项。公司无控股股东及实际控制人。

#### 4 报告期内控股股东变更情况索引及日期

适用 不适用

#### 5 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用



**(二) 实际控制人情况****1 法人**

□适用 √不适用

**2 自然人**

□适用 √不适用

**3 公司不存在实际控制人情况的特别说明**

√适用 □不适用

公司无任何单一股东或存在一致行动关系的股东持股比例高于 30%。公司亦无任何单一股东或存在一致行动关系的股东能够通过实际支配的公司股份表决权决定公司董事会过半数人员的选任，或决定公司的重大事项。公司无控股股东及实际控制人。

**4 报告期内实际控制人变更情况索引及日期**

□适用 √不适用

**5 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图**

□适用 √不适用

**6 实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司**

□适用 √不适用

**(三) 控股股东及实际控制人其他情况介绍**

□适用 √不适用

**五、其他持股在百分之十以上的法人股东**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

法人股东名称	单位负责人或法定代表人	成立日期	组织机构代码	注册资本	主要经营业务或管理活动等情况
武汉商贸集团有限公司	王建国	1994年8月12日	17775891-7	4,138,563,980.36	授权范围内的国有资产经营管理及投资；股权投资；物业管理；仓储、物流信息服务；物流实施服务方案咨询；道路货物运输（不含危险货物）；代理进出口、货物进出口、技术进出口（国家禁止或涉及行政审批的货物或技术除外）。（涉及许可经营项目，应取得相关部门许可后方可经营）
人福医药集团股份公司	李杰	1993年3月30日	30001485-0	1,353,704,302	药品研发；生物技术研发；化工产品（化学危险品除外）的研发、销售；技术开发、技术转让及技术服务；货物进出口、技术进出口、代理进出口（不含国家禁止或限制进出口的货物或技术）；对医药产业、医疗机构

					的投资;对医药产业、医疗机构的管理;房地产开发、商品房销售(资质叁级);组织“三来一补”业务。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)
情况说明	无				

## 六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

### 一、持股变动情况及报酬情况

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

√适用 □不适用

单位：股

姓名	职务(注)	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	年初持股数	年末持股数	年度内股份增减变动量	增减变动原因	报告期内从公司获得的税前报酬总额(万元)	是否在公司关联方获取报酬
余磊	董事长	男	42	2012-2-14	2021-4-17	0	0	0	-	280.41	否
张军	董事	男	51	2012-2-14	2021-4-17	0	0	0	-	303.41	否
	副董事长			2019-12-27	2021-4-17						
王琳晶	董事	男	45	2020-11-20	2021-4-17	0	0	0	-	947.52	否
	总裁			2019-12-27	2021-4-17						
张小东	董事	男	69	2012-2-14	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	是
杜越新	董事	男	62	2012-2-14	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	是
丁振国	董事	男	60	2016-4-28	2021-4-17	0	0	0	-	-	是
雷迎春	董事	女	55	2013-1-11	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	是
马全丽	董事	女	43	2019-5-6	2021-4-17	0	0	0	-	-	是
邵博	董事	女	39	2019-5-6	2021-4-17	0	0	0	-	-	是
黄孝武	独立董事	男	53	2015-4-2	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	否
宁立志	独立董事	男	56	2015-4-2	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	否
陈波	独立董事	男	43	2015-4-9	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	否
廖奕	独立董事	男	40	2016-11-7	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	否
袁建国	独立董事	男	58	2019-5-6	2021-4-17	0	0	0	-	6.00	否
吴建钢	监事会主席	男	48	2019-12-27	2021-4-17	0	0	0	-	654.00	否
戚耕耘	监事	男	58	2012-2-14	2021-4-17	0	0	0	-	15.70	否
范晓玲	监事	女	57	2013-12-9	2021-4-17	0	0	0	-	-	否
胡剑	监事	男	43	2019-5-6	2021-4-17	0	0	0	-	-	否

冯琳	常务副总裁	女	49	2019-12-27	2021-4-17	0	0	0	-	576.82	否
翟晨曦	副总裁	女	41	2015-4-3	2021-4-17	0	0	0	-	962.72	否
许欣	副总裁	男	45	2015-5-15	2021-4-17	0	0	0	-	370.41	否
	财务总监			2019-12-27	2021-4-17						
郭胜北	副总裁	男	53	2020-12-4	2021-4-17	0	0	0	-	25.19	否
吕英石	副总裁	男	43	2013-7-4	2021-4-17	0	0	0	-	276.34	否
丁晓文	副总裁	男	47	2018-2-1	2021-4-17	0	0	0	-	500.39	否
赵晓光	副总裁	男	38	2018-5-14	2021-4-17	0	0	0	-	518.64	否
洪琳	合规总监	女	52	2015-11-9	2021-4-17	0	0	0	-	404.68	否
王勇	首席风险官	男	56	2020-4-3	2021-4-17	0	0	0	-	317.67	否
	首席信息官			2020-12-4	2021-4-17						
王洪栋	副总裁	男	43	2020-4-3	2021-4-17	0	0	0	-	392.97	否
诸培宁	董事会秘书	女	34	2017-9-15	2021-4-17	0	0	0	-	291.01	否
肖函	首席人力资源官	女	34	2020-4-3	2021-4-17	0	0	0	-	319.11	否
	原首席风险官			2016-2-4	2020-4-3						
秦军	原董事	男	48	2017-8-15	2020-1-15	0	0	0	-	-	否
杨洁	原董事	女	39	2020-1-15	2020-11-20	0	0	0	-	-	否
刘翔	原副总裁	男	41	2016-6-21	2020-4-3	0	0	0	-	55.86	否
潘思纯	原首席信息官	男	64	2019-12-27	2020-12-4	0	0	0	-	255.12	否
合计	/	/	/	/	/	0	0	0	/	7,515.97	/

注 1：王琳晶先生于 2020 年 11 月出任公司董事，并继续担任公司总裁；

注 2：秦军先生于 2020 年 1 月退任公司董事；

注 3：杨洁女士于 2020 年 11 月退任公司董事；

注 4：王勇先生自 2020 年 4 月出任公司高级管理人员，2020 年从公司获得的税前报酬为其高级管理人员任职期间薪酬；

注 5：王洪栋先生自 2020 年 4 月出任公司高级管理人员，2020 年从公司获得的税前报酬为其高级管理人员任职期间薪酬；

注 6：郭胜北先生自 2020 年 12 月出任公司高级管理人员，2020 年从公司获得的税前报酬为其高级管理人员任职期间薪酬；

注 7：刘翔先生于 2020 年 4 月退任公司高级管理人员，2020 年从公司获得的税前报酬为其高级管理人员任职期间薪酬；

注 8：潘思纯先生于 2020 年 12 月退任公司高级管理人员，2020 年从公司获得的税前报酬为其高级管理人员任职期间薪酬。

姓名	主要工作经历
----	--------

余磊	曾担任人福医药副总经理兼董事会秘书，中证报价南方有限责任公司董事。现任华泰保险集团股份有限公司董事，恒泰证券股份有限公司董事，公司董事长。
张军	曾担任国泰君安证券股份有限公司总裁办经理、资产管理部总经理，华林证券有限责任公司副总裁，公司总裁。现任湖北省证券业协会副会长，公司副董事长。
王琳晶	曾任职于国家发展改革委员会，中国通达电子网络系统公司等，曾任公司副总裁。现任恒泰证券股份有限公司董事，恒泰长财证券有限责任公司董事长，公司董事、总裁。
张小东	曾担任湖南师范大学中文系教师，武汉大学新闻系教师，广州《青年探索》杂志社编辑部主任，武汉市雅达教育投资有限公司董事。现任武汉当代科技产业集团股份有限公司董事、人福医药集团股份有限公司董事、宜昌人福药业有限责任公司董事、武汉人福药业有限责任公司董事、湖北葛店人福药业有限责任公司董事、武汉当代科技投资有限公司董事、武汉明诚金石科技有限公司董事、广州贝龙环保热力设备股份有限公司董事、武汉当代乾源科技有限公司董事，公司董事。
杜越新	曾担任国务院办公厅调研室主任科员、国务院研究室副处长和处长、北京锦江西妮药业有限公司董事长、中国诚信证券评估有限公司总经理、北京储康保健科技有限公司董事长。现任人福医药集团股份有限公司监事长，上海苏珞商务咨询有限公司执行董事、总经理，中诚信投资集团有限公司董事，中国诚信信用管理股份有限公司董事，中国嘉德国际拍卖有限公司董事长，嘉德投资控股有限公司董事长，北京智象信息管理咨询有限公司董事，管理现代化杂志社社长，北京沃德韦尔节能环保科技有限责任公司董事，公司董事。
丁振国	曾担任湖北省财政厅办公室副科长、副主任、主任，湖北省财政厅农业处处长，湖北省财政厅经济建设处处长，湖北联投小池滨江新城投资有限公司董事，长江财产保险股份有限公司董事，湖北省黄麦岭控股集团有限公司董事，湖北省联合发展投资集团有限公司党委委员、总会计师、副总经理、党委委员。现任湖北省联合发展投资集团有限公司董事，湖北省联投控股有限公司董事，公司董事。
雷迎春	曾担任陕西建筑工程总公司子弟一中教师。现任陕西大德投资集团有限责任公司董事长兼总裁，陕西大德置业有限公司董事长兼总经理，中亚能源有限责任公司董事，陕西常春滕投资管理有限公司执行董事兼总经理，陕西大德能源材料有限公司监事，深圳市圣保利国际投资有限公司监事，曼森伯格（深圳）科技发展有限公司监事，铜川枫林物业管理有限公司董事长，公司董事。
马全丽	曾担任武汉国有资产经营有限公司财务部高级主管，武汉东创投资担保有限公司财务部门负责人，武汉国有资产经营有限公司财务部副经理、经理，中百控股集团股份有限公司董事。现任武汉商贸集团有限公司人力资源部经理，公司董事。
邵博	曾担任中国东方航空武汉有限责任公司法律秘书、东方神马集团公司法律事务室经理、武汉商贸集团有限公司战略研究部经理。现任武汉商贸集团有限公司董事会办公室主任、汉口银行股份有限公司董事、中百控股集团股份有限公司董事，公司董事。
黄孝武	曾担任中南财经大学经济学院讲师，中南财经政法大学经济学院副教授。现任中南财经政法大学金融学院教授，湖北随州农村商业银行股份有限公司独立董事，公司独立董事。
宁立志	曾担任武汉大学法学院助教、讲师、副教授。现任武汉大学法学院教授，湖北楚天智能交通股份有限公司独立董事，公司独立董事。
陈波	曾担任上海财经大学副教授。现任华中科技大学经济学教授、自贸区研究中心执行主任（学术职务），公司独立董事。
廖奕	曾担任武汉大学法学院助教、讲师、副教授。现任武汉大学法学院教授，公司独立董事。
袁建国	曾在湖北省财政学校、中南财经大学、湖北财经高等专科学校、武汉工程大学管理学院任教，曾担任明珠电气股份有限公司独立董事、武汉中元华电科技股份有限公司独立董事。现任华中科技大学管理学院会计系副主任，公司独立董事。

吴建钢	曾担任上海亚洲商务投资咨询公司研究发展部职员，人福医药集团股份公司董事会秘书，公司监事、总经理助理、常务副总裁。现任公司监事会主席。
戚耕耘	曾担任电子工业部第十研究所科员、成都联合期货交易所办公室主任，公司董事长助理、董事会办公室主任。现任公司职工监事。
范晓玲	曾担任武汉手表厂会计、副科长、科长、总会计师，武汉市东湖财会咨询服务公司总经理，武汉光谷新技术产业投资有限公司董事长、总经理，历任武汉高科国有控股集团有限公司财务审计部副部长、部长、总会计师、监事。现任武汉高科国有控股集团有限公司董事，公司监事。
胡剑	曾担任江岸区园林局职员，武汉众环会计师事务所项目经理，安永华明会计师事务所审计经理，武汉商贸集团有限公司首席审计师、审计部副经理、法务部副经理、财务部经理。现任武汉商贸集团有限公司审计（法务部）经理，中百控股集团股份有限公司监事，居然之家新零售集团股份有限公司监事，公司监事。
冯琳	曾担任武汉盛源集团股份有限公司会计，大信会计师事务所有限公司副总经理，武汉道博股份有限公司财务总监，公司总裁助理、代行合规总监、财务总监。现任公司常务副总裁。
翟晨曦	曾担任国家开发银行投资业务局副局长、评审三局科长、资金局处长。现任恒泰证券股份有限公司联席总裁，新华基金管理股份有限公司董事长、代任总经理，公司副总裁。
许欣	曾担任中国华融资产管理股份有限公司证券业务部经理、高级副经理、华融证券股份有限公司投资总监、董事会秘书。现任公司副总裁、财务总监。
郭胜北	曾担任摩根斯坦利业务副总裁，德意志银行董事总经理，BroadstreetCapitalGroup 董事总经理，GalleonQuantitativeGroup 董事总经理，GSB 奖台基金创始人、总裁、投资总监，中信证券另类投资业务线行政负责人、权益投资部行政负责人，华菁证券副总经理，现任公司副总裁。
吕英石	曾担任中国成套设备进出口（集团）总公司法律部职员、华泰联合证券有限责任公司并购私募融资总部业务董事。现任恒泰长财证券有限责任公司董事、公司副总裁。
丁晓文	曾担任中国银河证券股份有限公司投资银行总部副总监，瑞银证券有限责任公司投资银行总部主管、保荐业务负责人，瑞士银行亚洲投资银行部董事总经理。现任公司副总裁。
赵晓光	曾担任霍尼韦尔公司助理分析师、东方证券股份有限公司高级研究员、中国国际金融有限公司副总经理、海通证券股份有限公司所长助理、安信证券股份有限公司研究中心总经理。现任公司副总裁。
洪琳	曾任职于广西壮族自治区经济体制改革委员会、中国证券监督管理委员会广西监管局。现任公司合规总监。
王勇	曾担任光大证券股份有限公司首席风险官，现任公司首席风险官、首席信息官。
王洪栋	曾担任招商银行北京分行同业金融部总经理，招商银行总行财富管理部副总经理。现任公司副总裁。
诸培宁	曾担任天天天盈总经理助理、公司董事会办公室副主任。现任公司董事会办公室主任、品牌管理部总经理、证券事务代表、董事会秘书。
肖函	曾担任公司首席风险官、风险管理部总经理。现任公司总裁办公室总经理、首席人力资源官。

其它情况说明

适用 不适用

(二) 董事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

二、现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员的任职情况

(一) 在股东单位任职情况

适用 不适用

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务	任期起始日期	任期终止日期
余磊	武汉当代科技产业集团股份有限公司	董事	2012年2月	2021年4月
张小东	人福医药集团股份公司	董事	1997年1月	/
张小东	武汉当代科技产业集团股份有限公司	董事	1988年7月	/
杜越新	人福医药集团股份公司	监事长	2005年3月	/
丁振国	湖北省联合发展投资集团有限公司	董事	2011年6月	/
雷迎春	陕西大德投资集团有限责任公司	董事长、总裁	2011年12月	/
马全丽	武汉商贸集团有限公司	人力资源部经理	2016年11月	/
邵博	武汉商贸集团有限公司	董事会办公室主任	2019年2月	/
邵博	武汉商贸集团有限公司	战略研究部经理	2019年2月	2020年12月
范晓玲	武汉高科国有控股集团有限公司	董事	2016年6月	/
胡剑	武汉商贸集团有限公司	财务部经理	2020年1月	/
在股东单位任职情况的说明	无			

(二) 在其他单位任职情况

适用 不适用

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务	任期起始日期	任期终止日期
余磊	华泰保险集团股份有限公司	董事	2016年6月	/
余磊	恒泰证券股份有限公司	董事	2019年9月	/
张军	湖北省证券业协会	副会长	2012年9月	/
王琳晶	恒泰证券股份有限公司	董事	2019年12月	/
王琳晶	恒泰长财证券有限责任公司	董事长	2020年11月	/



张小东	武汉人福药业有限责任公司	董事	1997年6月	/
张小东	湖北葛店人福药业有限责任公司	董事	2001年2月	/
张小东	武汉当代科技投资有限公司	董事	2014年10月	/
张小东	武汉明诚金石科技有限公司	董事	2009年11月	/
张小东	武汉当代乾源科技有限公司	董事	2017年4月	/
张小东	宜昌人福药业有限责任公司	董事	2020年12月	/
张小东	湖北人福医药集团有限公司	董事	2021年2月	/
杜越新	中诚信投资集团有限公司	董事	2004年12月	/
杜越新	中国诚信信用管理股份有限公司	董事	2013年10月	/
杜越新	中国嘉德国际拍卖有限公司	董事长	1993年5月	/
杜越新	嘉德投资控股有限公司	董事长	2015年1月	/
杜越新	管理现代化杂志社	社长	1995年7月	/
杜越新	北京沃德韦尔节能环保科技有限责任公司	董事	2000年11月	/
杜越新	北京智象信息管理咨询有限公司	董事	2017年5月	/
杜越新	上海苏珞商务咨询有限公司	执行董事、总经理	2018年7月	/
丁振国	湖北省联投控股有限公司	董事	2013年11月	/
丁振国	长江财产保险股份有限公司	董事	2011年11月	2020年12月
丁振国	中航林业有限公司	董事长	2017年1月	/
丁振国	湖北省黄麦岭控股集团有限公司	执行董事	2017年11月	2020年11月
雷迎春	陕西大德置业有限公司	董事长、总经理	1996年12月	/
雷迎春	中亚能源有限责任公司	董事	2010年10月	/
雷迎春	陕西常春滕投资管理有限公司	执行董事、总经理	2011年3月	/
雷迎春	铜川枫林物业管理有限公司	董事长	2005年12月	/
雷迎春	深圳市圣保利国际投资有限公司	监事	2011年7月	/
雷迎春	陕西大德能源材料有限公司	监事	2015年4月	/
雷迎春	曼森伯格(深圳)科技发展有限公司	监事	2016年5月	/
马全丽	中百控股集团股份有限公司	董事	2017年8月	2020年7月
邵博	汉口银行股份有限公司	董事	2018年12月	/
邵博	中百控股集团股份有限公司	董事	2021年3月	/

黄孝武	湖北随州农村商业银行股份有限公司	独立董事	2020 年 4 月	/
宁立志	湖北楚天智能交通股份有限公司	独立董事	2016 年 10 月	/
袁建国	武汉中元华电科技股份有限公司	独立董事	2014 年 9 月	2020 年 12 月
范晓玲	武汉光谷新技术产业投资有限公司	董事长、总经理	2018 年 4 月	2020 年 7 月
胡剑	中百控股集团股份有限公司	监事	2014 年 12 月	/
胡剑	武汉海尔电器股份有限公司	监事	2017 年 8 月	/
翟晨曦	恒泰证券股份有限公司	联席总裁	2019 年 11 月	/
翟晨曦	新华基金管理股份有限公司	董事长、代任总经理	2020 年 9 月	/
吕英石	恒泰长财证券有限责任公司	董事	2020 年 11 月	/
在其他单位任职情况的说明	丁振国已从中航林业有限公司卸任，相关工商变更尚未完成；胡剑已从武汉海尔电器股份有限公司卸任，相关工商变更尚未完成。			

### 三、董事、监事、高级管理人员报酬情况

√适用 □不适用

董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序	公司董事、监事报酬分别由董事会、监事会制订，报股东大会审议决定；高级管理人员报酬由董事会根据《天风证券股份有限公司高级管理人员考核及薪酬管理暂行办法》审议决定。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	严格按照公司《天风证券股份有限公司高级管理人员考核及薪酬管理暂行办法》执行，与岗位绩效挂钩。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	请参阅本报告本节“持股变动情况及报酬情况”。
报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计	7,515.97 万元

### 四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

√适用 □不适用

姓名	担任的职务	变动情形	变动原因
秦军	原董事	离任	工作原因
杨洁	原董事	离任	工作原因
王琳晶	董事	选举	股东大会选举
肖函	首席人力资源官	聘任	董事会聘任
	原首席风险官	离任	工作原因

王勇	首席风险官	聘任	董事会聘任
	首席信息官	聘任	董事会聘任
王洪栋	副总裁	聘任	董事会聘任
刘翔	原副总裁	离任	工作原因
郭胜北	副总裁	聘任	董事会聘任
潘思纯	原首席信息官	离任	退休原因

### 五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

√适用 □不适用

经核查，报告期内公司董事、监事、高级管理人员不存在重大违法违规行为。

## 六、母公司和主要子公司的员工情况

### (一) 员工情况

母公司在职员工的数量	2,826
主要子公司在职员工的数量	382
在职员工的数量合计	3,208
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	27
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
研究人员	245
投行人员	367
经纪业务人员	1,645
资产管理人员	212
证券投资人员	144
信息技术人员	119
财务人员	112
风控合规/稽核人员	105
行政人员	227
其他人员	32
合计	3,208
教育程度	
教育程度类别	数量(人)
博士研究生	48
硕士研究生	1,227
本科	1,497
大专及以下	436
合计	3,208

### (二) 薪酬政策

√适用 □不适用

公司根据发展战略，按照市场化原则，以保障与激励为薪酬分配的核心，建立兼顾内具公平性和外具竞争力的薪酬体系。公司对各职级、岗位薪酬标准的确定和调整、绩效激励的兑现机制进行了规范，建立了较为完善的激励管理体系。公司员工薪酬包括基本薪酬、津贴、业绩奖励、单项奖励和福利。员工基本薪酬标准根据岗位、职级对应的任职资格要求与个人实际情况确定；业绩奖励水平按照公司整体、业绩单元与员工个人当年业绩完成情况确定。激励的发放根据行业监管对薪酬递延的相关要求执行。

### (三) 培训计划

√适用 □不适用

2021 年公司培训工作将继续以“坚持有价值的成长”为主题，通过线上、线下培训相结合的方式，不断提升培训的深度、广度，为公司员工提供丰富的内、外部通识类、业务类专题培训。在人才培养方面，关注基层业务骨干、校招新员工、新晋及新进经理人等关键人才梯队，差异化

制定培养目标和培养行动，结合轮岗锻炼等手段打造天风自己的干部队伍；在业务类培训方面，聚焦业务痛点，提高业务类培训统筹规划能力，同时开展《战略客户服务人才培养计划》，提升服务战略客户的综合能力；在课程资源建设方面，持续提升在线课程的质量与数量，建设各条线学习地图；在线上学习平台运营方面，通过持续运营提升平台的流量与影响力。

**(四) 劳务外包情况**

适用 不适用

**七、其他**

适用 不适用

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

根据《公司法》《证券法》《证券公司治理准则》等法律、行政法规和规范性文件的规定，公司建立了由股东大会、董事会、监事会和管理层组成的健全的组织机构和公司治理架构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范、相互分离与相互制衡的机制。

根据相关法律、行政法规、规范性文件，公司制订了《公司章程》《股东大会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》《总裁工作细则》《独立董事工作细则》和《董事会秘书工作细则》等规章制度，明确规定了股东大会、董事会、监事会、管理层、独立董事及董事会秘书等的权责范围、决策程序和工作规则，为公司法人治理结构的规范化运行提供了良好的制度保证。

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

□适用 √不适用

### 二、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期
2020 年第一次临时股东大会	2020 年 1 月 15 日	上海证券交易所网站	2020 年 1 月 16 日
2020 年第二次临时股东大会	2020 年 3 月 10 日	上海证券交易所网站	2020 年 3 月 11 日
2020 年第三次临时股东大会	2020 年 5 月 13 日	上海证券交易所网站	2020 年 5 月 14 日
2019 年年度股东大会	2020 年 5 月 29 日	上海证券交易所网站	2020 年 5 月 30 日
2020 年第四次临时股东大会	2020 年 8 月 21 日	上海证券交易所网站	2020 年 8 月 22 日
2020 年第五次临时股东大会	2020 年 10 月 15 日	上海证券交易所网站	2020 年 10 月 16 日
2020 年第六次临时股东大会	2020 年 11 月 20 日	上海证券交易所网站	2020 年 11 月 21 日
2020 年第七次临时股东大会	2020 年 12 月 21 日	上海证券交易所网站	2020 年 12 月 22 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 8 次，其中，年度股东大会 1 次，临时股东大会 7 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規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規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》；

5、2020 年第四次临时股东大会于 2020 年 8 月 21 日召开，审议通过了《关于修订〈天风证券股份有限公司章程〉及相关议事规则部分条款的议案》《关于修订〈天风证券股份有限公司独立董事制度〉部分条款的议案》《关于为资管子公司提供净资本担保承诺的议案》；

6、2020 年第五次临时股东大会于 2020 年 10 月 15 日召开，审议通过了《关于公司符合非公开发行 A 股股票条件的议案》《关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案》《关于公司非公开发行 A 股股票预案的议案》《关于公司非公开发行 A 股股票募集资金使用可行性分析报告的议案》《关于非公开发行 A 股股票摊薄即期回报的风险提示、填补措施及相关主体承诺事项的议案》《关于公司前次募集资金使用情况报告的议案》《关于提请股东大会授权董事会全权办理本次非公开发行 A 股股票相关事宜的议案》《关于董事会在获股东大会批准基础上授权公司经营层办理本次非公开发行 A 股股票相关事宜的议案》；

7、2020 年第六次临时股东大会于 2020 年 11 月 20 日召开，审议通过了《关于公司第三届董事会董事成员调整的议案》；

8、2020 年第七次临时股东大会于 2020 年 12 月 21 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〈天风证券股份有限公司监事会议事规则〉部分条款的议案》。

### 三、董事履行职责情况

#### (一) 董事参加董事会和股东大会的情况

董事姓名	是否独立董事	参加董事会情况						参加股东大会情况
		本年应参加董事会次数	亲自出席次数	以通讯方式参加次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参加会议	出席股东大会的次数
余磊	否	16	14	14	2	0	否	5
张军	否	16	16	14	0	0	否	3
王琳晶	否	1	1	1	0	0	否	0
张小东	否	16	16	14	0	0	否	0
杜越新	否	16	16	14	0	0	否	1
丁振国	否	16	16	14	0	0	否	0
雷迎春	否	16	16	14	0	0	否	1

马全丽	否	16	16	14	0	0	否	0
邵博	否	16	16	14	0	0	否	0
黄孝武	是	16	16	14	0	0	否	0
宁立志	是	16	16	14	0	0	否	0
陈波	是	16	16	14	0	0	否	0
廖奕	是	16	16	14	0	0	否	0
袁建国	是	16	16	14	0	0	否	0
秦军（已离任）	否	1	0	1	1	0	否	0
杨洁（已离任）	否	14	14	12	0	0	否	5

注 1：董事王琳晶先生于 2020 年 11 月 20 日出任公司董事，在其 2020 年任期内，公司共召开了 1 次董事会，其参加了全部会议；

注 2：董事秦军先生于 2020 年 1 月 15 日退任公司董事，在其 2020 年任期内，公司共召开了 1 次董事会，其参加了全部会议；

注 3：董事杨洁女士于 2020 年 11 月 20 日退任公司董事，在其 2020 年任期内，公司共召开了 14 次董事会，其参加了全部会议。

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

年内召开董事会会议次数	16
其中：现场会议次数	0
通讯方式召开会议次数	14
现场结合通讯方式召开会议次数	2

## (二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

适用 不适用

## (三) 其他

适用 不适用

报告期内，公司共召开 16 次董事会议，审议 94 项议案，全部表决通过。会议情况如下表：

序号	会议届次	召开日期	审议议案
1	第三届董事会第二十五次会议	2020 年 1 月 10 日	关于授权两位董事签署配股章程和代表公司办理配股章程香港认可及注册有关事宜的议案
2	第三届董事会第二十六次会议	2020 年 2 月 19 日	董事会关于大集合产品规范整改的议案
3	第三届董事会第二十七次会议	2020 年 2 月 23 日	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 关于提请召开公司 2020 年第二次临时股东大会的议案
4	第三届董事会第二十八次会议	2020 年 3 月 4 日	关于确定公司配股价格的议案
5			关于公司组织架构调整的议案



	第三届董事会第二十九次会议	2020 年 4 月 3 日	关于变更公司首席风险官的议案 关于聘任公司首席人力资源官的议案 关于聘任公司副总裁的议案
6	第三届董事会第三十次会议	2020 年 4 月 27 日	2019 年度董事会工作报告 2019 年年度报告 2019 年度独立董事工作报告 2019 年度董事会审计委员会履职情况报告 2019 年度经营工作报告 2019 年度环境、社会及公司治理报告 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 关于会计政策变更的议案 关于计提资产减值准备的议案 内部控制审计报告 信息系统建设投入指标报表专项审计报告 关于发行境内债务融资工具一般性授权的议案 关于向中国建设银行股份有限公司成都铁道支行申请增加公司国内金融机构人民币结算账户透支额度的议案 2019 年度内部控制评价报告 2019 年度反洗钱工作专项审计报告 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 2019 年度风险管理工作报告 2019 年度风险控制指标监控报告 关于审议《公司 2020 年一级指标限额表》的议案 关于预计公司 2020 年自营投资额度的议案 公司 2019 年度合规报告 关于修订《公司反洗钱工作内部控制基本规定》的议案 关于修订《公司洗钱风险自评估实施办法》的议案 关于修订《公司章程》部分条款的议案 公司合规负责人 2019 年度考核报告 关于审议公司高级管理人员 2019 年度报酬总额的议案 关于审议公司董事 2019 年度报酬总额的议案 2020 年第一季度报告 关于提请召开公司 2020 年第三次临时股东大会的议案 关于提请召开公司 2019 年度股东大会的议案
7	第三届董事会第三十一次会议	2020 年 5 月 21 日	关于非公开发行次级债券的议案 关于提请董事会授权公司经营管理层在有关法律法规规定及股东大会授权范围内全权办理本次非公开发行次级债券相关事宜的议案 关于公司组织架构调整的议案
8	第三届董事会第三十二次会议	2020 年 6 月 1 日	关于修订《天风证券股份有限公司高级管理人员考核及薪酬管理暂行办法》部分条款的议案 关于制定《天风证券股份有限公司投资者关系管理制度》的议案 关于制定《天风证券股份有限公司董事、监事、高级管理人员持有公司股份及其变动专项管理制度》的议案 关于向招商银行申请贷款的议案

			关于公开发行短期公司债的议案 关于提请董事会授权公司经营管理层在有关法律法规规定及股东大会授权范围内全权办理本次公开发行短期公司债的议案
9	第三届董事会第三十三次会议	2020年8月4日	关于修订《天风证券股份有限公司章程》及相关议事规则部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司独立董事制度》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司董事会秘书工作细则》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司董事会审计委员会议事规则》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司董事会风险管理委员会议事规则》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司董事会发展战略委员会议事规则》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司董事会薪酬与提名委员会议事规则》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司内幕信息知情人登记管理和保密制度》部分条款的议案 关于修订《天风证券股份有限公司合规管理有效性评估办法》部分条款的议案 关于为资管子公司提供净资本担保承诺的议案 关于提请召开公司2020年第四次临时股东大会的议案
10	第三届董事会第三十四次会议	2020年8月18日	关于落实资管新规过渡期延长的资管计划整改方案报告 关于公司组织架构调整的议案
11	第三届董事会第三十五次会议	2020年8月28日	2020年半年度报告 关于计提资产减值准备的议案 关于增补公司执行委员会委员的议案
12	第三届董事会第三十六次会议	2020年9月11日	2020年半年度募集资金存放与使用情况专项报告 关于公司组织架构调整的议案
13	第三届董事会第三十七次会议	2020年9月26日	关于公司符合非公开发行A股股票条件的议案 关于公司非公开发行A股股票方案的议案 关于公司非公开发行A股股票预案的议案 关于公司非公开发行A股股票募集资金使用可行性分析报告的议案 关于非公开发行A股股票摊薄即期回报的风险提示、填补措施及相关主体承诺事项的议案 关于公司前次募集资金使用情况报告的议案 关于提请股东大会授权董事会全权办理本次非公开发行A股股票相关事宜的议案 关于董事会获股东大会批准基础上授权公司经营层办理本次非公开发行A股股票相关事宜的议案 关于召开公司2020年第五次临时股东大会的议案
14	第三届董事会第三十八次会议	2020年10月30日	2020年第三季度报告 2020年上半年风险管理工作报告 2020年上半年风险控制指标监控报告
15	第三届董事会第三十九次会议	2020年11月4日	关于公司第三届董事会董事成员调整的议案 关于公司第三届董事会风险管理委员会委员调整的议案

			关于召开公司 2020 年第六次临时股东大会的议案
16	第三届董事会第四十次会议	2020 年 12 月 4 日	关于变更公司首席信息官的议案
			关于聘任公司副总裁的议案
			关于公司组织架构调整的议案
			关于向中国建设银行股份有限公司成都铁道支行申请给予公司国内金融机构人民币结算账户透支额度的议案
			关于修订《公司章程》部分条款的议案
			关于召开公司 2020 年第七次临时股东大会的议案

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

√适用 □不适用

公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会、发展战略委员会 4 个专门委员会，制定并于报告期内修订了《董事会专门委员会议事规则》，进一步明确其权责范围和工作程序。

##### (1) 风险管理委员会

风险管理委员会由 3 名董事组成，现任成员包括董事长余磊先生、独立董事宁立志先生和董事王琳晶先生，其中余磊先生任召集人。

风险管理委员会的主要职责是：①对公司的风险控制情况进行评估；②对公司风险状况进行评估；③提出完善公司风险管理和内部控制的建议；④董事会授权的其他职责。

报告期内，风险管理委员会共召开 2 次会议，审议通过 9 项议案。详情见下：

序号	会议届次	召开日期	审议议案
1	第三届风险管理委员会第四次会议	2020 年 4 月 27 日	内部控制审计报告
			2019 年度内部控制评价报告
			2019 年度反洗钱工作专项审计报告
			2019 年度风险管理工作报告
			公司 2019 年风险控制指标监控报告
			关于审议《公司 2020 年一级指标限额表》的议案
			2019 年度合规报告
2	第三届风险管理委员会第五次会议	2020 年 10 月 30 日	公司 2020 年上半年风险管理工作报告
			公司 2020 年上半年风险控制指标监控报告

##### (2) 审计委员会

审计委员会由 3 名董事组成，现任成员包括独立董事袁建国先生、独立董事黄孝武先生和董事马全丽女士，其中袁建国先生任召集人。

审计委员会的主要职责是：①监督及评估外部审计机构工作；②指导内部审计工作；③审阅公司财务报告并对其发表意见；④评估内部控制的有效性；⑤协调管理层、内部审计部门及相关部门与外部审计机构的沟通；⑥履行公司关联交易控制和日常管理的职责；⑦公司董事会授权的其他事宜及相关法律法规中涉及的其他事项。

报告期内，审计委员会共召开 3 次会议，审议通过 15 项议案。详情见下：

	会议届次	召开日期	审议议案
1	第三届审计委员会第七次会议	2020年4月27日	2019年年度报告
			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
			关于会计政策变更的议案
			关于计提资产减值准备的议案
			内部控制审计报告
			信息系统建设投入指标报表专项审计报告
			2019年度内部控制评价报告
			2019年度反洗钱工作专项审计报告
			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
2	第三届审计委员会第八次会议	2020年8月18日	2020年半年度报告
			关于计提资产减值准备的议案
3	第三届审计委员会第九次会议	2020年10月23日	2020年第三季度报告

## (3) 薪酬与提名委员会

薪酬与提名委员会由3名董事组成，现任成员包括董事长余磊先生、独立董事宁立志先生和独立董事黄孝武先生，其中黄孝武先生任召集人。

薪酬与提名委员会的主要职责是：①研究董事和高级管理人员的选择标准和程序，并提出建议；②广泛搜寻合格的董事和高级管理人员的人选；③对董事候选人和高级管理人员候选人进行审查并提出建议；④研究董事与高级管理人员考核的标准，进行考核并提出建议；⑤研究董事、高级管理人员的薪酬政策与方案并提出建议；⑥董事会授权的其他职责。

报告期内，薪酬与提名委员会共召开5次会议，审议通过10项议案。详情见下：

序号	会议届次	召开日期	审议议案
1	第三届薪酬与提名委员会第六次会议	2020年4月3日	关于变更公司首席风险官的议案
			关于聘任公司首席人力资源官的议案
			关于聘任公司副总裁的议案
2	第三届薪酬与提名委员会第七次会议	2020年4月27日	公司合规负责人2019年度考核报告
			关于审议公司高级管理人员2019年度报酬总额的议案 关于审议公司董事2019年度报酬总额的议案
3	第三届薪酬与提名委员会第八次会议	2020年6月1日	关于修订《天风证券股份有限公司高级管理人员考核及薪酬管理暂行办法》部分条款的议案
4	第三届薪酬与提名委员会第九次会议	2020年11月4日	关于公司第三届董事会董事成员调整的议案
5	第三届薪酬与提名委员会第十次会议	2020年12月4日	关于变更公司首席信息官的议案
			关于聘任公司副总裁的议案

## (4) 发展战略委员会

发展战略委员会由 4 名董事组成，现任成员包括董事长余磊先生、独立董事陈波先生、独立董事黄孝武先生和独立董事宁立志先生，其中余磊先生任召集人。

发展战略委员会的主要职责是：①了解并掌握公司经营的全面情况；②了解、分析、掌握国际国内行业现状；③了解并掌握国家相关政策；④研究公司近期、中期、长期发展战略或相关问题；⑤对公司长远发展战略、重大投资、改革等重大决策提供咨询建议；⑥审议通过发展战略专项研究报告；⑦定期或不定期出具日常研究报告；⑧董事会赋予的其他职责。

报告期内，各专门委员会委员认真履行职责，依法合规地开展工作，有效发挥各自专业领域特长，对讨论决策的重大事项提出了专业化的合理性意见和建议，促进了董事会各专门委员会科学决策和规范运作。报告期内，未有委员就所审议事项提出异议。

## 五、监事会发现公司存在风险的说明

√适用 □不适用

报告期内，公司监事会一直严格按照有关法律、法规、公司章程及监事会议事规则的规定规范运作，严格执行监事会制度，对相关事项进行检查监督，监事会对报告期内的监督事项无异议。

报告期内共召开 7 次监事会，审议通过 34 项议案。详情见下：

序号	会议届次	召开日期	审议议案
1	第三届监事会第八次会议	2020 年 4 月 27 日	2019 年度监事会工作报告
			2019 年年度报告
			2019 年度环境、社会及公司治理报告
			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
			关于会计政策变更的议案
			关于计提资产减值准备的议案
			内部控制审计报告
			信息系统建设投入指标报表专项审计报告
			2019 年度内部控制评价报告
			2019 年度反洗钱工作专项审计报告
			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
			2019 年度风险管理工作报告
			2019 年度风险控制指标监控报告
			关于审议《公司 2020 年一级指标限额表》的议案
2	第三届监事会第九次会议	2020 年 8 月 4 日	2019 年度合规报告
			关于审议公司高级管理人员 2019 年度报酬总额的议案
3	第三届监事会第十次会议	2020 年 8 月 28 日	关于审议公司监事 2019 年度报酬总额的议案
			2020 年第一季度报告
4	第三届监事会第十一次会议	2020 年 9 月 11 日	2020 年半年度募集资金存放与使用情况专项报告

5	第三届监事会第十二次会议	2020年9月26日	关于公司符合非公开发行A股股票条件的议案
			关于公司非公开发行A股股票方案的议案
			关于公司非公开发行A股股票预案的议案
			关于公司非公开发行A股股票募集资金使用可行性分析报告的议案
			关于非公开发行A股股票摊薄即期回报的风险提示、填补措施及相关主体承诺事项的议案
			关于公司前次募集资金使用情况报告的议案
6	第三届监事会第十三次会议	2020年10月30日	2020年第三季度报告
			2020年上半年风险管理工作报告
			2020年上半年风险控制指标监控报告
7	第三届监事会第十四次会议	2020年12月4日	关于修订《天风证券股份有限公司监事会议事规则》部分条款的议案

报告期内，公司监事参加监事会议情况如下表：

	职务	本年应参加监事会次数	亲自出席次数	以通讯方式出席现场会议次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参加会议	出席会议方式
吴建钢	监事会主席	7	7	7	0	0	否	通讯/现场
戚耕耘	职工监事	7	7	7	0	0	否	通讯/现场
范晓玲	监事	7	7	7	0	0	否	通讯/现场
胡剑	监事	7	7	7	0	0	否	通讯/现场

年内召开监事会会议次数	7
其中：现场会议次数	0
通讯方式召开会议次数	7
现场结合通讯方式召开会议次数	1

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

适用 不适用

存在同业竞争的，公司相应的解决措施、工作进度及后续工作计划

适用 不适用

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

适用 不适用

公司董事会制定了《高级管理人员考核及薪酬管理办法》，该办法依据市场薪酬水平及行业考核激励方式，确保高级管理人员的薪酬激励与权责匹配。考核与激励水平不仅与所分管业务的整体业绩表现相关，还与公司整体业绩的完成情况及风险合规管理情况挂钩，能够充分调动高级管理人员的积极性，并且强化风险合规管理意识。董事会每年依据该办法，对高级管理人员实施考核评价，核定薪酬及当年的激励标准，并按照监管递延要求发放。

#### 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

公司内部控制自我评价报告的具体内容详见 2021 年 4 月 28 日在上海证券交易所网站上披露的《天风证券股份有限公司 2020 年度内部控制评价报告》。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

#### 九、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

公司聘请大信会计师事务所（特殊普通合伙）作为内部控制审计机构。大信会计师事务所（特殊普通合伙）出具了《天风证券股份有限公司内部控制审计报告》。

公司在披露本报告的同时披露《天风证券股份有限公司内部控制审计报告》及《天风证券股份有限公司 2020 年度内部控制评价报告》，其不存在意见不一致的情形。

是否披露内部控制审计报告：是

内部控制审计报告意见类型：标准的无保留意见

#### 十、其他

适用 不适用

## 第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、公司债券基本情况

单位: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 2020 年公开发行短期公司债券 (第二期)	20 天风 S2	163850	2020 年 12 月 8 日	2021 年 12 月 8 日	10.00	3.80	到期一次还本付息	上海证券交易所
天风证券股份有限公司 2020 年公开发行短期公司债券 (第一期)	20 天风 S1	163826	2020 年 10 月 19 日	2021 年 10 月 19 日	20.00	3.65	到期一次还本付息	上海证券交易所
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 年 4 月 15 日	2023 年 4 月 15 日	15.00	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 年 10 月 18 日	2022 年 10 月 18 日	5.00	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 年 9 月 11 日	2022 年 9 月 11 日	13.00	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 年 4 月 18 日	2022 年 4 月 18 日	12.00	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 年 3 月 27 日	2023 年 3 月 27 日	8.80	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 年 3 月 14 日	2023 年 3 月 14 日	24.20	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 年 10 月 25 日	2022 年 10 月 25 日	5.00	4.00	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 年 6 月 26 日	2022 年 6 月 26 日	15.00	2.90	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 年 8 月 31 日	2021 年 8 月 31 日	13.00	3.48	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 年 6 月 20 日	2021 年 6 月 20 日	20.00	4.18	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 年非公开发行次级债券（第一期）（品种一）	20 天风 C3	167109	2020 年 6 月 23 日	2023 年 6 月 23 日	18.00	4.70	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所
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 年 2 月 27 日	2023 年 2 月 27 日	10.80	4.90	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 年次级债券（第一期）品种一	20 天风 C1	166128	2020 年 2 月 27 日	2023 年 2 月 27 日	6.70	3.90	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 年次级债券（第一期）	19 天风 C1	151841	2019 年 8 月 27 日	2022 年 8 月 27 日	7.50	4.99	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 2018 年次级债券（品种一）	18 天风 C1	150330	2018 年 4 月 26 日	2021 年 4 月 26 日	9.00	6.00	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 年 4 月 11 日	2022 年 4 月 11 日	10.00	5.20	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所
-----------------------	--------	--------	-----------------	-----------------	-------	------	--------------------------------	---------

#### 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（第三期），19 天风 03 已于 2020 年 10 月 19 日支付 2019 年 10 月 18 日至 2020 年 10 月 18 日期间的利息。
- 2、2019 年非公开发行公司债券（第二期），19 天风 02 已于 2020 年 9 月 11 日支付 2019 年 9 月 11 日至 2020 年 9 月 10 日期间的利息。
- 3、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。
- 4、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。
- 5、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。
- 6、2017 年公司债券（第二期），17 天风 02 已于 2020 年 10 月 26 日支付 2019 年 10 月 25 日至 2020 年 10 月 25 日期间的利息。
- 7、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。
- 8、2016 年公司债券（第二期），16 天风 02 已于 2020 年 8 月 31 日支付 2019 年 8 月 31 日至 2020 年 8 月 30 日期间的利息。
- 9、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。
- 10、2019 年次级债券（第一期），19 天风 C1 已于 2020 年 8 月 27 日支付 2019 年 8 月 27 日至 2020 年 8 月 26 日期间的利息。
- 11、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。
- 12、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

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%。

## 3、“17天风02”公司债券票面利率调整

本期债券在存续期内前3年（2017年10月25日至2020年10月24日）票面年利率为5.24%，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10月25日至2022年10月24日）本期债券票面利率为4.00%。

## 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	中信建投证券股份有限责任公司
	办公地址	北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座2层
	联系人	邬浩、赵英伦、朱丰弢、李路辉
	联系电话	010-68451084
	受托管理债券	20天风S1
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	20 天风 S2、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
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
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 SOHO6 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、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，本公司公开发行的公司债券，发行规模 15 亿元，截至报告期末，扣除承销费后全部用于补充营运资金。公开发行的两期次级债券，发行规模 17.50 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 18 亿元，截至报告期末，扣除承销费后全部用于补充营运资金。公开发行的两期短期公司债券，合计发行规模 30 亿元，截止报告期末，已经使用 21.37 元，其中 9.36 亿元用于偿还到期债务，剩余 12.02 亿元用于补充营运资金。

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 0.12 亿元，截至报告期末，已经使用 29.8688 亿元，全部用于补充营运资金，剩余 0.0112 亿元。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，截止报告期末，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，截止报告期末，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，截止报告期末，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 短期公司债券剩余 8.63 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 18 日，中诚信证券评估有限公司出具了《天风证券股份有限公司公开发行公司债券跟踪评级报告（2020）》（信评委函字【2020】跟踪 0849 号），维持公司主体信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”，维持“20 天风 01”信用等级为 AAA。

2020 年 6 月 18 日，中诚信证券评估有限公司出具了《天风证券股份有限公司非公开发行公司债券、次级债券跟踪评级报告（2020）》（信评委函字【2020】跟踪 0848 号），维持公司主体信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”，维持“19 天风 01”、“19 天风 02”、“19 天风 03”的信用等级为 AAA，维持“19 天风 C1”、“20 天风 C1”、“20 天风 C2”的信用等级为 AA+。

2020 年 11 月 12 日，中诚信证券评估有限公司出具了《天风证券股份有限公司 2020 年度跟踪评级报告》（信评委函字【2020】跟踪 3756 号），维持公司主体信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”。

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：163850

债券简称	20 天风 S2
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

债券代码：163826

债券简称	20 天风 S1
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
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（ <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> ）。
是否存在利益冲突，及其风险防范、解决机制	否

## 八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

主要指标	2020 年	2019 年	本期比上年同期增减 (%)	变动原因
息税折旧摊销前利润	2,616,664,791.38	1,837,590,241.20	42.40	报告期内利润增加
流动比率	2.45	2.48	-1.21	
速动比率	2.16	2.09	3.35	
资产负债率 (%)	68.14	66.59	2.33	
EBITDA 全部债务比	5.93%	5.69%	4.22	
利息保障倍数	1.55	1.36	13.97	
现金利息保障倍数	-1.97	-2.28	不适用	
EBITDA 利息保障倍数	1.61	1.43	12.59	
贷款偿还率 (%)	100.00	100.00		

利息偿付率 (%)	100.00	100.00		
-----------	--------	--------	--	--

#### 九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

适用 不适用

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。（详情已在第十节公司债券相关情况中的公司债券基本情况披露）

#### 十、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 402.60 亿元，已使用额度为 164.71 亿元，未使用额度为 237.89 亿元。

#### 十一、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

适用 不适用

报告期内，公司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。

#### 十二、公司发生的重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用 不适用

## 第十一节 财务报告

### 一、审计报告

√适用 □不适用

大信审字[2021]第 2-00560 号

### 天风证券股份有限公司全体股东：

#### 一、 审计意见

我们审计了天风证券股份有限公司（以下简称“贵公司”）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2020 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东权益变动表，以及财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了贵公司 2020 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况以及 2020 年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

#### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于贵公司，并履行了职业道德方面的其他责任。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

#### 三、 关键审计事项

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

##### （一）结构化主体并表

###### 1、 事项描述

截至 2020 年 12 月 31 日，贵公司纳入合并资产负债表的结构化主体的总资产为 94.54 亿元。结构化主体通常是为实现具体而明确的目的设计并成立的，并在确定的范围内开展业务活动。贵公司可能通过发起设立、持有投资或保留权益份额等方式在结构化主体中享有权益。这些结构化主体主要包括合伙企业、资产管理计划等。根据贵公司的会计政策，合并财务报表的合并范围应当以控制为基础予以确定。贵公司管理层（以下简称“管理层”）根据控制的三要素对是

否控制结构化主体进行判断。在确定是否应合并结构化主体时，管理层需要考虑的因素并非完全可量化的，需要进行综合考虑。由于在确定是否应将结构化主体纳入合并范围时需要涉及重大的管理层判断，且合并结构化主体可能对合并资产负债表产生重大影响，因此，我们将结构化主体的合并识别为关键审计事项。

## 2、审计应对

与结构化主体的合并相关的主要审计程序包括：

- (1) 询问管理层和检查与管理层对结构化主体是否合并作出的判断过程相关的文档；
- (2) 检查相关合同、内部设立文件以及向投资者披露的信息，以了解结构化主体的设立目的和贵公司对结构化主体的参与程度，并评价管理层关于贵公司对结构化主体是否拥有权力的判断；
- (3) 检查结构化主体对风险和报酬的结构设计，包括在结构化主体中对任何资本或回报的担保、佣金的支付以及收益的分配等，以评价管理层就贵公司因参与结构化主体的相关活动而拥有的对该主体的风险敞口、权力及对可变回报的影响所作的判断；
- (4) 检查管理层对结构化主体的分析，包括贵公司对享有结构化主体的经济利益的比重及可变动性的计算，以评价管理层关于贵公司影响其来自结构化主体可变回报的能力所作的判断，就管理层对贵公司承担或享有的可变回报的结果进行了重新计算；
- (5) 评价管理层就是否应合并结构化主体所作的判断；
- (6) 评价财务报表中针对结构化主体的相关披露是否符合企业会计准则的要求。

## (二) 融出资金和买入返售金融资产减值

### 1、事项描述

如财务报表附注五（三）、五（七）所述，于 2020 年 12 月 31 日，贵公司在合并财务报表中列报的融出资金账面价值为人民币 56.17 亿元，买入返售金融资产账面价值为人民币 36.24 亿元。根据贵公司的会计政策，贵公司采用单项认定和组合计提相结合的方式对上述融出资金和买入返售金融资产计提减值准备。采用单项认定计提减值准备时，贵公司需考虑单个客户的抵押物价值、可回收金额等因素；采用组合方式计提减值准备时，则需依据其风险特征按照余额的一定比例分别计提减值准备。上述资产减值准备的计提涉及管理层的判断和估计，且结果对财务报表影响重大，因此我们将该类资产的减值计提确认为关键审计事项。

## 2、审计应对

与融出资金和买入返售金融资产减值准备计提相关的主要审计程序包括：

(1) 测试针对融出资金和买入返售金融资产的减值准备建立的相关内部控制是否合理，是否得到有效执行；

(2) 了解管理层使用的预期信用损失模型，评估预期信用损失模型及所用的关键假设、参数的适当性，包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露、抵押品、前瞻性调整因子等；

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

(4) 结合市场惯例和历史损失经验，评估管理层减值模型计算结果的合理性；

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

### (三) 金融工具公允价值的评估

#### 1、事项描述

如财务报表附注九所述，截至 2020 年 12 月 31 日，贵公司公允价值属于第二层次的金融资产账面价值计人民币 177.05 亿元、属于第三层次的金融资产账面价值计人民币 110.13 亿元，该等金融资产账面价值合计人民币 287.18 亿元。贵公司金融工具的估值是以市场数据和估值模型相结合为基础，其中估值模型通常需要大量的输入值。输入值的确定会使用管理层估计，这当中会涉及重大的管理层判断和估计。由于部分金融工具公允价值的评估较为复杂，且该等金融工具对财务报表的影响重大，我们将金融工具公允价值的评估识别为关键审计事项。

#### 2、审计应对

我们对金融工具公允价值的评估事项执行的主要审计程序包括：

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

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

(3) 评价贵公司用于公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具的估值模型，同时，基于相关市场数据，我们也对管理层在计量第二层次和第三层次的金融工具的公允价值时所采用的不可观察输入值及可观察输入值的合理性和适当性进行了抽样评估，检查估值结果是否正确；

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

#### 四、其他信息

贵公司管理层对其他信息负责。其他信息包括贵公司 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

#### 五、管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时，管理层负责评估贵公司的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理层计划清算贵公司、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督贵公司的财务报告过程。

#### 六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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

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

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。



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

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

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

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

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

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

大信会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师：张文娟

（项目合伙人）

中国 · 北京

中国注册会计师：陈雅婷

二〇二一年四月二十七日

## 二、公司基本情况

### 1. 公司概况

√适用 □不适用

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

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

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

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

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

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

公司对营业部实行了统一结算、统一风险管理、统一资金调拨、统一财务管理和会计核算。截止 2020 年 12 月 31 日，本公司共设有营业执照的 106 家营业部及 20 家分公司。

### 2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

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

本公司纳入合并报表范围的子公司详见本报告“第十一节财务报告十、1、在子公司中的权益”。

### 三、财务报表

#### 合并资产负债表

2020 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	1	14,622,925,091.99	8,879,676,149.48
其中：客户资金存款		8,914,812,690.27	5,436,071,874.47
结算备付金	2	2,092,593,710.63	1,887,047,540.15
其中：客户备付金		1,180,195,256.20	1,248,239,299.02
贵金属	3		
拆出资金	4	600,408,750.00	150,102,500.00
融出资金	5	5,617,229,266.37	6,068,122,661.53
衍生金融资产	6		
存出保证金	7	3,234,252,212.13	1,914,546,749.91
应收款项	8	1,395,310,400.35	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	3,624,293,940.73	3,505,744,837.42
持有待售资产	12		
<b>金融投资：</b>		32,552,609,256.73	27,959,851,853.88
交易性金融资产	13	27,805,124,322.55	23,141,487,599.28
债权投资	14		
其他债权投资	15	1,468,154,478.25	979,663,520.62
其他权益工具投资	16	3,279,330,455.93	3,838,700,733.98
长期股权投资	17	4,520,616,956.01	644,871,981.39
投资性房地产	18	150,357,512.25	156,642,036.79
固定资产	19	116,727,952.18	113,148,035.12
在建工程	20	562,819,585.16	395,860,677.04
使用权资产	21		
无形资产	22	573,323,775.92	584,113,695.22
商誉	23	66,634,466.97	66,634,466.97
递延所得税资产	24	294,193,220.00	176,750,717.71
其他资产	25	11,380,810,684.03	6,669,361,683.50
资产总计		81,405,106,781.45	59,920,334,525.05
<b>负债：</b>			
短期借款	29	630,073,044.46	
应付短期融资款	30	8,132,246,488.92	4,101,653,977.00
拆入资金	31	1,446,215,777.77	150,068,750.00
交易性金融负债	32	26,120,694.97	
衍生金融负债	6	5,389,968.02	274,923.17

卖出回购金融资产款	33	8,308,264,661.37	10,037,807,023.02
代理买卖证券款	34	11,584,902,888.04	7,512,796,666.15
代理承销证券款	35		
应付职工薪酬	36	338,522,881.20	237,678,307.95
应交税费	37	168,357,651.12	68,841,127.56
应付款项	38	279,975,921.11	34,316,294.16
合同负债	39	51,784,278.10	
持有待售负债	40		
预计负债	41		
长期借款	42	1,189,306,800.00	
应付债券	43	24,371,607,466.49	18,020,388,943.79
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	44		
递延收益	45	87,000.00	195,000.00
递延所得税负债	24	287,172,116.59	99,850,963.76
其他负债	46	2,342,042,230.59	2,149,216,016.12
负债合计		59,162,069,868.75	42,413,087,992.68
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
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	7,915,543,266.46	4,259,929,865.37
减：库存股	50		
其他综合收益	51	-469,026,061.83	-241,330,968.35
盈余公积	52	331,425,315.71	292,289,870.75
一般风险准备	53	722,474,379.80	619,594,651.18
未分配利润	54	2,293,707,677.58	2,012,666,643.86
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		17,460,091,857.72	12,123,150,062.81
少数股东权益		4,782,945,054.98	5,384,096,469.56
所有者权益（或股东权益）合计		22,243,036,912.70	17,507,246,532.37
负债和所有者权益（或股东权益）总计		81,405,106,781.45	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12月31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 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金		10,090,785,509.59	7,087,678,848.26
其中：客户资金存款		5,501,192,472.76	3,975,072,020.47
结算备付金		2,504,785,598.08	2,195,561,198.20
其中：客户备付金		1,180,195,256.20	1,244,405,529.24
贵金属			
拆出资金		600,408,750.00	150,102,500.00
融出资金		5,579,441,537.05	6,068,122,661.53
衍生金融资产			
存出保证金		586,304,207.86	284,663,124.79
应收款项		918,302,873.83	730,261,330.94
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产		3,313,798,523.37	3,119,101,139.14
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>		26,207,291,484.12	22,063,914,296.90
交易性金融资产		25,126,889,082.80	20,720,477,933.83
债权投资		105,116,439.56	105,116,439.56
其他债权投资		737,136,193.01	979,663,520.62
其他权益工具投资		238,149,768.75	258,656,402.89
长期股权投资	1	7,921,404,635.70	3,328,033,987.00
投资性房地产		16,321,589.88	17,083,290.24
固定资产		81,303,783.18	76,616,522.21
在建工程		118,371,851.75	91,258,949.32
使用权资产			
无形资产		95,266,955.58	90,927,995.09
商誉			
递延所得税资产		175,991,974.73	84,100,480.78
其他资产		9,800,327,174.05	3,656,231,203.49
资产总计		68,010,106,448.77	49,043,657,527.89
<b>负债：</b>			
短期借款		612,673,200.00	
应付短期融资款		8,132,246,488.92	4,101,653,977.00
拆入资金		1,446,215,777.77	150,068,750.00
交易性金融负债			
衍生金融负债		5,071,235.02	274,923.17
卖出回购金融资产款		8,216,523,682.00	9,972,434,386.59
代理买卖证券款		6,343,644,072.56	4,968,008,458.78
代理承销证券款			
应付职工薪酬	2	246,760,777.21	222,587,143.24
应交税费		134,084,641.52	59,938,479.88
应付款项			
合同负债		19,486,098.98	
持有待售负债			
预计负债			
长期借款		1,189,306,800.00	
应付债券		24,351,406,216.99	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		168,485,852.62	104,957,045.41
其他负债		327,739,068.13	113,003,944.14
负债合计		51,193,643,911.72	37,693,478,203.68
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
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		7,111,460,823.71	3,457,303,927.45
减：库存股			
其他综合收益		-175,783,833.99	-151,253,075.11
盈余公积		331,425,315.71	292,289,870.75
一般风险准备		716,560,701.48	619,594,651.18
未分配利润		2,166,832,250.14	1,952,243,949.94
所有者权益（或股东权益）合计		16,816,462,537.05	11,350,179,324.21
负债和所有者权益（或股东权益）总计		68,010,106,448.77	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—12 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020 年度	2019 年度
一、营业总收入		4,359,629,544.39	3,846,100,730.48
利息净收入	55	-467,521,218.49	-372,612,411.97
其中：利息收入		1,201,680,437.16	947,136,730.64
利息支出		1,669,201,655.65	1,319,749,142.61
手续费及佣金净收入	56	2,756,581,099.86	2,104,060,851.94
其中：经纪业务手续费净收入		788,881,274.62	577,167,543.28
投资银行业务手续费净收入		1,024,508,520.64	743,894,162.90
资产管理业务手续费净收入		836,722,806.10	666,861,144.68
投资收益（损失以“-”号填列）	57	1,324,774,189.94	1,220,632,900.51
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		161,471,393.14	19,763,682.93
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）			36,830,173.22
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）	58		
其他收益	59	27,020,042.47	3,308,761.85

公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	60	505,224,968.70	323,190,388.00
汇兑收益（损失以“-”号填列）		14,115,646.14	-1,148,442.75
其他业务收入	61	199,264,911.89	568,619,307.13
资产处置收益（损失以“-”号填列）	62	169,903.88	49,375.77
二、营业总支出		3,510,307,559.71	3,447,643,030.33
税金及附加	63	33,483,774.78	30,245,719.81
业务及管理费	64	2,851,820,961.46	2,405,733,793.91
信用减值损失	65	405,791,347.00	483,701,052.27
其他资产减值损失	66	75,371,122.23	
其他业务成本	67	143,840,354.24	527,962,464.34
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		849,321,984.68	398,457,700.15
加：营业外收入	68	67,597,000.37	75,497,821.47
减：营业外支出	69	28,768,979.48	11,650,246.33
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		888,150,005.57	462,305,275.29
减：所得税费用	70	200,269,594.59	41,413,622.91
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		687,880,410.98	420,891,652.38
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		687,880,410.98	420,891,652.38
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）		454,871,365.71	307,767,555.05
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		233,009,045.27	113,124,097.33
六、其他综合收益的税后净额	71	-310,478,739.14	-309,945,448.53
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-215,622,938.75	-242,710,361.08
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-168,335,949.79	-244,821,553.12
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		-168,335,949.79	-244,821,553.12
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		-47,286,988.96	2,111,192.04
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-5,763,802.95	869,794.07
2. 其他债权投资公允价值变动		-4,439,276.28	-4,230,821.53
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		569,203.59	164,493.43
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额		-37,653,113.32	5,307,726.07

7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		-94,855,800.39	-67,235,087.45
七、综合收益总额		377,401,671.84	110,946,203.85
归属于母公司所有者的综合收益总额		239,248,426.96	65,057,193.97
归属于少数股东的综合收益总额		138,153,244.88	45,889,009.88
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)		0.07	0.05
（二）稀释每股收益(元/股)		0.07	0.05

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

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—12 月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020 年度	2019 年度
一、营业总收入		3,303,183,632.24	2,808,354,180.14
利息净收入	3	-638,063,299.32	-437,599,998.47
其中：利息收入		906,926,147.17	801,294,203.95
利息支出		1,544,989,446.49	1,238,894,202.42
手续费及佣金净收入	4	2,497,901,443.83	2,065,727,735.80
其中：经纪业务手续费净收入		717,079,525.07	543,621,324.21
投资银行业务手续费净收入		918,710,612.50	738,479,535.53
资产管理业务手续费净收入		784,823,519.06	677,260,512.89
投资收益（损失以“-”号填列）	5	1,151,716,392.48	849,692,354.04
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		163,723,802.85	20,362,739.44
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）			36,830,173.22
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		24,449,276.17	3,111,323.42
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6	241,930,666.59	326,142,320.01
汇兑收益（损失以“-”号填列）		13,758,429.35	161,611.41
其他业务收入		11,478,419.44	1,181,566.32
资产处置收益（损失以“-”号填列）		12,303.70	-62,732.39
二、营业总支出		2,856,186,721.48	2,375,198,618.07
税金及附加		29,780,186.82	25,622,025.38
业务及管理费	7	2,419,855,272.08	2,066,759,558.95
信用减值损失		330,418,439.99	282,055,333.38
其他资产减值损失		75,371,122.23	
其他业务成本		761,700.36	761,700.36



三、营业利润（亏损以“-”号填列）		446,996,910.76	433,155,562.07
加：营业外收入		51,468,364.54	69,779,876.75
减：营业外支出		25,152,261.47	10,197,614.98
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		473,313,013.83	492,737,823.84
减：所得税费用		78,067,054.71	103,615,044.39
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		395,245,959.12	389,122,779.45
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		395,245,959.12	389,122,779.45
（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		-25,199,609.40	-130,064,662.55
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-14,294,683.11	-126,868,128.52
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		-14,294,683.11	-126,868,128.52
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		-10,904,926.29	-3,196,534.03
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-5,763,802.95	869,794.07
2. 其他债权投资公允价值变动		-4,439,276.28	-4,230,821.53
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		-701,847.06	164,493.43
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		370,046,349.72	259,058,116.90
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)			
（二）稀释每股收益(元/股)			

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—12月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020年度	2019年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
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		4,030,039,100.25	3,132,560,802.70

拆入资金净增加额		848,220,098.36	
回购业务资金净增加额			-94,023,994.39
融出资金净减少额		391,717,454.75	
代理买卖证券收到的现金净额		2,707,956,715.70	984,914,894.85
收到其他与经营活动有关的现金	72(1)	2,194,920,851.81	1,460,891,181.54
经营活动现金流入小计		10,172,854,220.87	5,484,342,884.70
为交易目的而持有的金融资产净增加额		2,834,015,349.27	-697,375,924.81
拆出资金净增加额			
返售业务资金净增加额			
回购业务资金净减少额		1,811,078,608.87	
融出资金净增加额			3,663,597,279.14
支付利息、手续费及佣金的现金		688,959,777.60	604,258,346.54
支付给职工及为职工支付的现金		1,643,643,762.51	1,250,779,101.34
支付的各项税费		432,300,414.86	358,296,525.30
支付其他与经营活动有关的现金	72(2)	6,117,346,975.80	3,249,952,608.53
经营活动现金流出小计		13,527,344,888.91	8,429,507,936.04
经营活动产生的现金流量净额		-3,354,490,668.04	-2,945,165,051.34
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		2,405,445,182.39	2,757,960,461.23
取得投资收益收到的现金		113,534,251.95	162,645,877.96
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		234,934.54	23,147,293.90
收到其他与投资活动有关的现金		494,820,887.95	407,956,348.90
投资活动现金流入小计		3,014,035,256.83	3,351,709,981.99
投资支付的现金		5,302,072,548.62	2,819,186,697.23
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		175,468,389.21	167,844,084.93
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		3,941,760,577.71	931,269,515.84
投资活动现金流出小计		9,419,301,515.54	3,918,300,298.00
投资活动产生的现金流量净额		-6,405,266,258.71	-566,590,316.01
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		6,028,466,044.19	1,166,540,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		703,817,418.01	1,166,540,000.00
取得借款收到的现金		13,242,664,499.49	9,108,500,000.00
发行债券收到的现金		11,577,520,000.00	5,146,100,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		30,848,650,543.68	15,421,140,000.00
偿还债务支付的现金		12,558,950,000.00	7,162,700,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,148,373,145.05	895,233,905.86
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		3,524,958.91	21,180,206.71

支付其他与筹资活动有关的现金		1,424,008,484.04	2,144,129,760.28
筹资活动现金流出小计		15,131,331,629.09	10,202,063,666.14
筹资活动产生的现金流量净额		15,717,318,914.59	5,219,076,333.86
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-33,871,866.97	1,210,063.38
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		5,923,690,120.87	1,708,531,029.89
加：期初现金及现金等价物余额		10,740,413,953.43	9,031,882,923.54
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		16,664,104,074.30	10,740,413,953.43

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—12月

单位：元币种：人民币

项目	附注	2020年度	2019年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
销售商品、提供劳务收到的现金			
向其他金融机构拆入资金净增加额			
收取利息、手续费及佣金的现金		3,690,300,046.42	2,882,287,467.16
拆入资金净增加额		848,220,098.36	
回购业务资金净增加额			971,530,029.34
融出资金净减少额		431,652,932.00	
代理买卖证券收到的现金净额		1,375,635,613.78	1,236,744,052.32
收到其他与经营活动有关的现金		155,931,106.37	176,381,225.50
经营活动现金流入小计		6,501,739,796.93	5,266,942,774.32
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,039,223,478.16	1,250,803,120.43
拆出资金净增加额			
回购业务资金净减少额		1,846,410,362.71	
融出资金净增加额			3,663,597,279.14
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		597,774,276.11	545,391,505.23
支付给职工及为职工支付的现金		1,455,603,245.57	1,066,066,449.28
支付的各项税费		413,964,434.91	342,361,318.27
支付其他与经营活动有关的现金		9,269,392,475.64	1,891,750,277.75
经营活动现金流出小计		16,622,368,273.10	8,759,969,950.10
经营活动产生的现金流量净额		-10,120,628,476.17	-
			3,493,027,175.78
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		1,052,333,117.14	1,546,550,401.47
取得投资收益收到的现金		64,809,147.21	120,599,000.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金			11,801.18
投资活动现金流入小计		1,117,142,264.35	1,667,161,202.65
投资支付的现金		4,015,968,604.35	2,208,582,192.00

购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		62,205,224.96	93,959,616.09
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		4,078,173,829.31	2,302,541,808.09
投资活动产生的现金流量净额		-2,961,031,564.96	-635,380,605.44
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		5,324,648,626.18	
取得借款收到的现金		13,125,080,000.00	9,108,500,000.00
发行债券收到的现金		11,577,520,000.00	5,146,100,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		30,027,248,626.18	14,254,600,000.00
偿还债务支付的现金		12,558,950,000.00	7,162,700,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,090,928,602.81	823,060,629.27
支付其他与筹资活动有关的现金		16,607,749.25	32,546,130.11
筹资活动现金流出小计		13,666,486,352.06	8,018,306,759.38
筹资活动产生的现金流量净额		16,360,762,274.12	6,236,293,240.62
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		13,758,429.35	161,611.41
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		3,292,860,662.34	2,108,047,070.81
加：期初现金及现金等价物余额		9,264,237,625.72	7,156,190,554.91
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		12,557,098,288.06	9,264,237,625.72

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—12 月

单位:元币种:人民币

项目	2020 年度											
	归属于母公司所有者权益								少数股东权益	所有者权益合计		
	实收资本(或股本)	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、上年年末余额	5,180,000,000.00				4,259,929,865.37		- 241,330,968.35	292,289,870.75	619,594,651.18	2,012,666,643.86	5,384,096,469.56	17,507,246,532.37
加：会计政策变更								-389,150.95	-778,301.90	-2,724,056.61		-3,891,509.46
前期差错更正												
其他												
二、本年年初余额	5,180,000,000.00				4,259,929,865.37		- 241,330,968.35	291,900,719.80	618,816,349.28	2,009,942,587.25	5,384,096,469.56	17,503,355,022.91
三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列)	1,485,967,280.00				3,655,613,401.09		- 227,695,093.48	39,524,595.91	103,658,030.52	283,765,090.33	-601,151,414.58	4,739,681,889.79
(一) 综合收益总额							- 215,622,938.75			454,871,365.71	138,153,244.88	377,401,671.84
(二) 所有者投入和减少资本	1,485,967,280.00				3,655,613,401.09						-735,779,700.55	4,405,800,980.54
1. 所有者投入的普通股	1,485,967,280.00				3,838,681,346.18						703,817,418.01	6,028,466,044.19
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					-183,067,945.09						-1,439,597,118.56	-1,622,665,063.65
(三) 利润分配								39,524,595.91	103,658,030.52	-183,178,430.11	-3,524,958.91	-43,520,762.59
1. 提取盈余公积								39,524,595.91		-39,524,595.91		
2. 提取一般风险准备									103,658,030.52	-103,658,030.52		
3. 对所有者(或股东)的分配										-39,995,803.68	-3,524,958.91	-43,520,762.59
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转							-12,072,154.73			12,072,154.73		

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						-12,072,154.73			12,072,154.73		
6. 其他											
四、本年年末余额	6,665,967,280.00				7,915,543,266.46	- 469,026,061.83	331,425,315.71	722,474,379.80	2,293,707,677.58	4,782,945,054.98	22,243,036,912.70

项目	2019 年度											
	归属于母公司所有者权益								少数股东权益	所有者权益合计		
	实收资本(或股本)	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、上年年末余额	5,180,000,000.00				4,476,993,223.29		14,302,235.60	246,697,420.17	509,407,329.28	1,894,287,197.69	6,168,764,452.46	18,490,451,858.49
加：会计政策变更							-12,922,842.87	6,680,172.63	13,360,345.26	4,888,979.84	17,216,532.55	29,223,187.41
前期差错更正												
其他												
二、本年初余额	5,180,000,000.00				4,476,993,223.29		1,379,392.73	253,377,592.80	522,767,674.54	1,899,176,177.53	6,185,980,985.01	18,519,675,045.90
三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列)					-217,063,357.92		-242,710,361.08	38,912,277.95	96,826,976.64	113,490,466.33	-801,884,515.45	-1,012,428,513.53
(一) 综合收益总额							-242,710,361.08			307,767,555.05	45,889,009.88	110,946,203.85
(二) 所有者投入和减少资本					-217,063,357.92						-791,142,490.80	-1,008,205,848.72
1. 所有者投入的普通股											1,166,540,000.00	1,166,540,000.00
2. 其他权益工具持有者投入资本												
3. 股份支付计入所有者权益的金额												
4. 其他					-217,063,357.92						-1,957,682,490.80	-2,174,745,848.72
(三) 利润分配								38,912,277.95	96,826,976.64	-171,999,254.59	-21,180,206.71	-57,440,206.71
1. 提取盈余公积								38,912,277.95		-38,912,277.95		
2. 提取一般风险准备									96,826,976.64	-96,826,976.64		
3. 对所有者(或股东)的分配										-36,260,000.00	-21,180,206.71	-57,440,206.71
4. 其他												
(四) 所有者权益内部结转										-22,277,834.13	-35,450,827.82	-57,728,661.95
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									-22,277,834.13	-35,450,827.82	-57,728,661.95
6. 其他											
四、本年年末余额	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	

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—12 月

单位:元币种:人民币

项目	2020 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、上年年末余额	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								-389,150.95	-778,301.90	-2,724,056.61	-3,891,509.46
前期差错更正											
其他											
二、本年初余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		-151,253,075.11	291,900,719.80	618,816,349.28	1,949,519,893.33	11,346,287,814.75
三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列)	1,485,967,280.00				3,654,156,896.26		-24,530,758.88	39,524,595.91	97,744,352.20	217,312,356.81	5,470,174,722.30
(一)综合收益总额							-25,199,609.40			395,245,959.12	370,046,349.72
(二)所有者投入和减少资本	1,485,967,280.00				3,654,156,896.26						5,140,124,176.26
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					-184,524,449.92						-184,524,449.92
(三)利润分配								39,524,595.91	97,744,352.20	-177,264,751.79	-39,995,803.68
1.提取盈余公积								39,524,595.91		-39,524,595.91	
2.提取一般风险准备									97,744,352.20	-97,744,352.20	
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							668,850.52			-668,850.52	
1.资本公积转增资本(或股本)											
2.盈余公积转增资本(或股本)											
3.盈余公积弥补亏损											
4.设定受益计划变动额结转留存收益											

5. 其他综合收益结转留存收益					668,850.52				-668,850.52	
6. 其他										
四、本年年末余额	6,665,967,280.00			7,111,460,823.71	-175,783,833.99	331,425,315.71	716,560,701.48	2,166,832,250.14	16,816,462,537.05	

2020 年年度报告

项目	2019 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、上年年末余额	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	6,680,172.63	13,360,345.26	46,761,208.38	6,426,758.95
前期差错更正											
其他											
二、本年初余额	5,180,000,000.00				3,457,303,927.45		-21,188,412.56	253,377,592.80	522,767,674.54	1,751,822,418.32	11,144,083,200.55
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）							-130,064,662.55	38,912,277.95	96,826,976.64	200,421,531.62	206,096,123.66
（一）综合收益总额							-130,064,662.55			389,122,779.45	259,058,116.90
（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								38,912,277.95	96,826,976.64	-171,999,254.59	-36,260,000.00
1. 提取盈余公积								38,912,277.95		-38,912,277.95	
2. 提取一般风险准备									96,826,976.64	-96,826,976.64	
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										-16,701,993.24	-16,701,993.24
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										-16,701,993.24	-16,701,993.24
6. 其他											
四、本年年末余额	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

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

## 四、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

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

### 2. 持续经营

适用 不适用

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

## 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

适用 不适用

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

### 1. 遵循企业会计准则的声明

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

### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 3. 营业周期

适用 不适用

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

### 4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

### 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用 不适用

#### (1) 同一控制下的企业合并

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

## (2) 非同一控制下的企业合并

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

## 6. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

### (1) 合并财务报表范围

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

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

本公司在评估对结构化主体拥有的权力时，通常考虑下列四方面：

在设立被投资方时的决策及本公司的参与度；

相关合同安排；

仅在特定情况或事项发生时开展的相关活动；

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

## 8. 现金及现金等价物的确定标准

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

## 9. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

### (1) 外币业务折算

本公司对发生的外币交易，采用与交易发生日折合本位币入账。资产负债表日外币货币性项目按资产负债表日即期汇率折算，因该日的即期汇率与初始确认时或者前一资产负债表日即期汇

率不同而产生的汇兑差额，除符合资本化条件的外币专门借款的汇兑差额在资本化期间予以资本化计入相关资产的成本外，均计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其记账本位币金额。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，折算后的记账本位币金额与原记账本位币金额的差额，作为公允价值变动(含汇率变动)处理，计入当期损益或确认为其他综合收益。

## (2) 外币财务报表折算

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

## 10. 金融工具

### (1). 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

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

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

**15. 持有待售资产**

□适用 √不适用

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

√适用 □不适用

详见本节 10、5) 预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

**17. 其他债权投资****(1). 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

本公司固定资产主要分为：房屋建筑物、电子设备、运输设备等；折旧方法采用年限平均法。根据各类固定资产的性质和使用情况，确定固定资产的使用寿命和预计净残值。并在年度终了，对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核，如与原先估计数存在差异的，进行相应的调整。除已提足折旧仍继续使用的固定资产和单独计价入账的土地之外，本公司对所有固定资产计提折旧。

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

### (1). 合同负债的确认方法

适用 不适用

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

## 29. 职工薪酬

### (1)、短期薪酬的会计处理方法

适用 不适用

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

### (2)、离职后福利的会计处理方法

适用 不适用

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

### (3)、辞退福利的会计处理方法

适用 不适用

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

### (4)、其他长期职工福利的会计处理方法

适用 不适用

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

## 30. 预计负债

适用 不适用

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

## 31. 租赁负债

适用 不适用

## 32. 股份支付

适用 不适用

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

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

## 33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

### 34. 回购本公司股份

适用 不适用

### 35. 收入

#### (1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

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

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

##### 1) 手续费及佣金收入

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

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

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

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

##### 2) 利息收入

根据相关本金及实际利率按权责发生制原则确认。

##### 3) 其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入。

#### (2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

适用 不适用

### 36. 合同成本

适用 不适用

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

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

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

(2) 该成本增加了本公司未来用于履行履约义务的资源；

(3) 该成本预期能够收回。

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

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

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

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

(1) 因转让与该资产相关的商品预期能够取得的剩余对价；

(2) 为转让该相关商品估计将要发生的成本。

以前期间减值的因素之后发生变化，使得前述两项差额高于该资产账面价值的，应当转回原已计提的资产减值准备，并计入当期损益，但转回后的资产账面价值不超过假定不计提减值准备情况该资产在转回日的账面价值。

### 37. 利润分配

适用 不适用

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

### 38. 政府补助

#### (1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

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

按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

## (2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

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

## 39. 递延所得税资产/递延所得税负债

适用 不适用

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

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

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

## 40. 租赁

### (1)、经营租赁的会计处理方法

适用 不适用

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》(以下简称“新收入准则”)。本公司于 2020 年 1 月 1 日起执行新收入准则以及通知，对会计政策相关内容进行调整。

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。

本公司根据首次执行新收入准则的累计影响数，调整 2020 年 1 月 1 日的留存收益及财务报表相关项目金额，对可比期间信息不予调整，本公司仅对在首次执行日尚未完成的合同的累计影响数进行调整。

##### (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
----	------------------	----------------	-----

<b>资产：</b>			
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			
<b>金融投资：</b>	27,959,851,853.88	27,959,851,853.88	
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	
<b>负债：</b>			
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	67,232,637.00	-1,608,490.56
应付款项	34,316,294.16	34,316,294.16	
合同负债		60,946,048.17	60,946,048.17
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	2,093,769,967.97	-55,446,048.15
负债合计	42,413,087,992.68	42,416,979,502.14	3,891,509.46
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
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	291,900,719.80	-389,150.95
一般风险准备	619,594,651.18	618,816,349.28	-778,301.90
未分配利润	2,012,666,643.86	2,009,942,587.25	-2,724,056.61
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	12,123,150,062.81	12,119,258,553.35	-3,891,509.46
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	17,503,355,022.91	-3,891,509.46
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
<b>资产：</b>			
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			
<b>金融投资：</b>	22,063,914,296.90	22,063,914,296.90	
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	
<b>负债：</b>			
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	58,329,989.32	-1,608,490.56
应付款项			
合同负债		21,191,490.66	21,191,490.66
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	97,312,453.50	-15,691,490.64
负债合计	37,693,478,203.68	37,697,369,713.14	3,891,509.46
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
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	291,900,719.80	-389,150.95
一般风险准备	619,594,651.18	618,816,349.28	-778,301.90
未分配利润	1,952,243,949.94	1,949,519,893.33	-2,724,056.61
所有者权益（或股东权益）合计	11,350,179,324.21	11,346,287,814.75	-3,891,509.46
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	13%、9%、6%、5%、3%、1%
城市维护建设税	应纳流转税额	7%、5%、1%
企业所得税	应纳税所得额	25%、16.5%
教育费附加	应纳流转税额	3%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

适用 不适用

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

#### 2. 税收优惠

适用 不适用

#### 3. 其他

适用 不适用

## 七、合并财务报表项目注释

## 1、货币资金

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：	/	/	222,832.79	/	/	297,387.56
人民币	/	/	222,832.79	/	/	297,387.56
银行存款：	/	/	14,609,760,350.49	/	/	8,870,876,816.17
其中：自有资金	/	/	5,694,947,660.22	/	/	3,434,804,941.70
人民币	/	/	5,314,667,412.10	/	/	1,941,995,206.62
美元	13,052,507.48	6.5249	85,166,285.30	198,179,087.51	6.9762	1,382,536,950.28
港元	350,148,552.34	0.8416	294,699,027.59	123,102,530.53	0.8958	110,272,784.80
欧元	53,151.06	8.0250	414,935.23			
客户资金	/	/	8,914,812,690.27	/	/	5,436,071,874.47
人民币	/	/	8,494,070,628.91	/	/	5,287,848,446.75
美元	52,990,344.51	6.5249	345,756,607.33	233,457.86	6.9762	1,628,648.75
港元	88,743,445.01	0.8416	74,690,033.06	163,650,426.42	0.8958	146,594,778.97
欧元	37,841.90	8.0250	295,420.97			
其他货币资金：	/	/		/	/	1,194,630.29
人民币	/	/		/	/	1,194,630.29
应收利息：	/	/	12,941,908.71	/	/	7,307,315.46
人民币	/	/	12,941,446.78	/	/	7,307,315.46
港元	548.84	0.8416	461.93			
合计	/	/	14,622,925,091.99	/	/	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	/	/	605,144,742.56	/	/	708,439,845.93
人民币	/	/	605,144,742.56	/	/	708,439,845.93
美元						
港元						
合计	/	/	605,144,742.56	/	/	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 12 月 31 日，受限制的货币资金为人民币 38,472,819.61 元，为风险准备金专户存款及司法冻结。

货币资金的说明：

适用 不适用

## 2、结算备付金

适用 不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
公司自有备付金：	/	/	912,363,553.45	/	/	638,737,073.86
人民币	/	/	912,363,527.14	/	/	637,074,241.80
美元	0.02	6.5249	0.13	0.02	6.9762	0.14
港元	31.10	0.8416	26.18	1,856,294.98	0.8958	1,662,831.92
公司信用备付金：	/	/	34,900.98	/	/	71,167.27
人民币	/	/	34,900.98	/	/	71,167.27
美元						
港元						
客户普通备付金：	/	/	739,625,510.67	/	/	846,356,033.22
人民币	/	/	736,466,195.41	/	/	838,576,735.83
美元	131,660.26	6.5249	859,070.01	279,098.71	6.9762	1,947,048.42
港元	2,733,051.24	0.8416	2,300,245.25	6,510,805.07	0.8958	5,832,248.97
客户信用备付金：	/	/	440,569,745.53	/	/	401,883,265.80
人民币	/	/	440,569,745.53	/	/	401,883,265.80
美元						
港元						
合计	/	/	2,092,593,710.63	/	/	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	600,408,750.00	150,102,500.00
合计	600,408,750.00	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	5,641,606,343.48	6,073,259,275.48
其中：个人	3,071,428,727.72	3,139,431,927.45
机构	2,570,177,615.76	2,933,827,348.03
减：减值准备	62,164,806.43	5,136,613.95
账面价值小计	5,579,441,537.05	6,068,122,661.53
境外	37,819,041.65	
其中：个人	8,630,966.45	
机构	29,188,075.20	
减：减值准备	31,312.33	
账面价值小计	37,787,729.32	
账面价值合计	5,617,229,266.37	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	654,579,195.11	859,206,726.32
债券	58,676,301.57	500,255,453.64
股票	19,195,272,721.85	17,267,977,403.74
基金	81,139,457.28	65,262,057.34
合计	19,989,667,675.81	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			18,748,730,700.00						21,759,369,850.00			
—利率互换			14,025,000,000.00						14,700,000,000.00			
—国债期货			4,723,730,700.00						7,059,369,850.00			
权益衍生工具	512,489,040.00		675,354,300.00		3,403,432.00	267,625,260.00			485,092,500.00		274,923.17	
—股指期货（注）	512,489,040.00		345,439,260.00			267,625,260.00			303,576,620.00			
—期权			329,915,040.00		3,403,432.00				181,515,880.00		274,923.17	
其他衍生工具			265,519,196.91		1,986,536.02				50,098,870.00			
—商品期货			177,255,925.00						50,098,870.00			
—收益互换			88,263,271.91		1,986,536.02							
合计	512,489,040.00		19,689,604,196.91		5,389,968.02	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	/	/	3,092,904,533.35	/	/	1,900,904,986.50
其中：人民币	/	/	3,036,506,108.06	/	/	1,894,017,024.12
美元	279,993.46	6.5249	1,826,929.33	270,000.00	6.9762	1,883,574.00
港元	64,839,475.26	0.8416	54,571,495.96	5,586,626.60	0.8958	5,004,388.38
信用保证金	/	/	141,347,678.78	/	/	13,641,763.41
其中：人民币	/	/	141,347,678.78	/	/	13,641,763.41
美元						
港元						
履约保证金	/	/		/	/	
其中：人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
合计	/	/	3,234,252,212.13	/	/	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	500,056,722.98	53,586,650.11
应收资产管理费	819,619,469.64	687,650,991.28
应收手续费及佣金	149,949,818.56	48,060,955.97
应收票据		
应收租金收入	2,150,927.05	4,878,858.31
其他	1,966,417.20	1,793,295.09
合计	1,473,743,355.43	795,970,750.76
减：坏账准备(按简化模型计提)	78,432,955.08	48,111,811.82
减：坏账准备(按一般模型计提)		
应收款项账面价值	1,395,310,400.35	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	1,149,552,714.55	78.00	580,756,454.89	72.96
1-2 年	232,538,384.79	15.78	212,895,375.63	26.75
2-3 年	91,224,155.79	6.19	2,318,920.24	0.29
3 年以上	428,100.30	0.03		
合计	1,473,743,355.43	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	1,149,552,714.55	78.00	38,490,590.17	3.35	580,756,454.89	72.96	26,358,490.22	4.54
1-2年	232,538,384.79	15.78	21,483,290.89	9.24	212,895,375.63	26.75	21,289,537.55	10.00
2-3年	91,224,155.79	6.19	18,245,023.87	20.00	2,318,920.24	0.29	463,784.05	20.00
3年以上	428,100.30	0.03	214,050.15	50.00				
组合小计	1,473,743,355.43	100.00	78,432,955.08	5.32	795,970,750.76	100.00	48,111,811.82	6.04
合计	1,473,743,355.43	100.00	78,432,955.08	5.32	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

## (4) 应收票据

□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	1,488,437,061.92	1,903,327,005.54
债券质押式回购	2,206,300,396.86	876,184,173.63
债券买断式回购	92,577,474.41	793,041,020.10
其他		
减：减值准备	163,020,992.46	66,807,361.85
账面价值合计	3,624,293,940.73	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	1,488,437,061.92	1,903,327,005.54
债券	2,298,877,871.27	1,669,225,193.73
基金		
其他		
减：减值准备	163,020,992.46	66,807,361.85
买入返售金融资产账面价值	3,624,293,940.73	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	4,571,027,057.44	4,571,646,049.44
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	93,130,590.00	798,549,290.00
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	93,130,590.00	798,549,290.00

## (4) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	1,231,512,117.30	1,085,842,222.11

一个月至三个月内		233,227,167.89
三个月至一年内	256,924,944.62	584,257,615.54
一年以上		
合计	1,488,437,061.92	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	506,327,389.14		982,109,672.78	1,488,437,061.92
减值准备	166,928.52		162,854,063.94	163,020,992.46
账面价值	506,160,460.62		819,255,608.84	1,325,416,069.46
担保物价值	1,150,447,706.41		1,019,035,259.51	2,169,482,965.92

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

买入返售金融资产的说明：

适用 不适用

## 12、持有待售资产

适用 不适用

## 13、交易性金融资产

适用 不适用

单位：元币种：人民币

类别	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	13,315,469,600.68		13,315,469,600.68	13,090,220,195.55		13,090,220,195.55
公募基金	1,693,427,329.58		1,693,427,329.58	1,621,213,763.07		1,621,213,763.07
股票/股权	4,957,787,670.39		4,957,787,670.39	4,428,129,015.16		4,428,129,015.16
银行理财	137,945,339.87		137,945,339.87	137,800,000.00		137,800,000.00

产品						
券商资管产品	1,743,133,031.49		1,743,133,031.49	1,711,685,410.94		1,711,685,410.94
信托计划	729,821,115.93		729,821,115.93	677,155,525.00		677,155,525.00
其他	5,227,540,234.61		5,227,540,234.61	4,576,899,050.85		4,576,899,050.85
合计	27,805,124,322.55		27,805,124,322.55	26,243,102,960.57		26,243,102,960.57
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	1,453,052,285.70	24,936,872.97	-9,834,680.42	1,468,154,478.25	2,090,430.46	954,000,000.00	29,579,165.99	-3,915,645.37	979,663,520.62	1,797,072.98
其他										
合计	1,453,052,285.70	24,936,872.97	-9,834,680.42	1,468,154,478.25	2,090,430.46	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	4,123,691,837.73	3,279,330,455.93	1,619,230.00	4,295,601,900.51	3,838,700,733.98	6,356,005.06	战略投资
合计	4,123,691,837.73	3,279,330,455.93	1,619,230.00	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 12,072,154.73 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		
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			288,131.01					20,748,710.92	
武汉帮创科技有限公司	2,400,700.54			-2,400,700.54						
宜宾市商业银行股份有限公司	622,010,700.94			22,913,127.43	-1,569,542.68	-184,524,449.92		75,371,122.23	383,458,713.54	75,371,122.23
恒泰证券股份有限公司		3,977,932,956.58		140,810,675.42	-4,194,260.27				4,114,549,371.73	
新疆新旅资本管理有限公司		2,000,000.00		-139,840.18					1,860,159.82	
小计	644,871,981.39	3,979,932,956.58		161,471,393.14	-5,763,802.95	-184,524,449.92		75,371,122.23	4,520,616,956.01	75,371,122.23
合计	644,871,981.39	3,979,932,956.58		161,471,393.14	-5,763,802.95	-184,524,449.92		75,371,122.23	4,520,616,956.01	75,371,122.23

其他说明：

无

## 18、投资性房地产

投资性房地产计量模式

## (1). 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元币种：人民币

项目	房屋、建筑物	土地使用权	在建工程	合计
一、账面原值				
1. 期初余额	194,007,810.53			194,007,810.53
2. 本期增加金额				
(1) 外购				
(2) 存货\固定资产\在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	194,007,810.53			194,007,810.53
二、累计折旧和累计摊销				
1. 期初余额	37,365,773.74			37,365,773.74
2. 本期增加金额	6,284,524.54			6,284,524.54
(1) 计提或摊销	6,284,524.54			6,284,524.54
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	43,650,298.28			43,650,298.28
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	150,357,512.25			150,357,512.25
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	运输工具	电子设备	合计
----	--------	------	------	----



一、账面原值：				
1. 期初余额	92,605,472.99	17,810,125.58	164,553,691.01	274,969,289.58
2. 本期增加金额		2,327,392.52	29,956,198.77	32,283,591.29
(1) 购置		2,327,392.52	29,956,198.77	32,283,591.29
(2) 在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额	6,129,991.45	3,645,087.80	34,249,111.81	44,024,191.06
(1) 处置或报废	6,129,991.45	3,645,087.80	34,249,111.81	44,024,191.06
4. 期末余额	86,475,481.54	16,492,430.30	160,260,777.97	263,228,689.81
二、累计折旧				
1. 期初余额	21,865,691.32	14,964,289.91	124,432,408.34	161,262,389.57
2. 本期增加金额	2,995,990.96	1,919,651.00	21,325,126.13	26,240,768.09
(1) 计提	2,995,990.96	1,919,651.00	21,325,126.13	26,240,768.09
3. 本期减少金额	5,950,541.15	3,292,911.30	32,317,832.47	41,561,284.92
(1) 处置或报废	5,950,541.15	3,292,911.30	32,317,832.47	41,561,284.92
4. 期末余额	18,911,141.13	13,591,029.61	113,439,702.00	145,941,872.74
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	67,564,340.41	2,901,400.69	46,262,211.08	116,727,952.18
2. 期初账面价值	70,739,781.67	2,845,835.67	39,562,417.78	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

## (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	593,632.38	正在办理中

其他说明：

□适用 √不适用

## 20、在建工程

## (1). 在建工程情况

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
天风证券光谷一路项目	118,371,851.75		118,371,851.75	91,258,949.32		91,258,949.32
天风证券中北路 F 地块	444,447,733.41		444,447,733.41	304,601,727.72		304,601,727.72
合计	562,819,585.16		562,819,585.16	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	本期转入固定资产金额	本期其他减少金额	期末余额
天风证券光谷一路项目	91,258,949.32	27,112,902.43			118,371,851.75
天风证券中北路 F 地块	304,601,727.72	139,846,005.69			444,447,733.41
合计	395,860,677.04	166,958,908.12			562,819,585.16

## (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		36,662,861.54			36,662,861.54
(1) 购置		36,662,861.54			36,662,861.54
(2) 内部研发					
(3) 企业合并增加					
3. 本期减少金额		668,246.38			668,246.38
(1) 处置		668,246.38			668,246.38
4. 期末余额	2,845,780.00	261,240,731.69	525,027,788.00	20,800,000.03	809,914,299.72
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		34,112,209.52	13,084,120.80		47,196,330.32
(1) 计提		34,112,209.52	13,084,120.80		47,196,330.32

3. 本期减少金额		411,795.86			411,795.86
(1) 处置		411,795.86			411,795.86
4. 期末余额		180,303,969.39	56,286,554.41		236,590,523.80
三、减值准备					
1. 期初余额					
2. 本期增加金额					
(1) 计提					
3. 本期减少金额					
(1) 处置					
4. 期末余额					
四、账面价值					
1. 期末账面价值	2,845,780.00	80,936,762.30	468,741,233.59	20,800,000.03	573,323,775.92
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		处置		
天风期货股份有限公司	15,209,584.51					15,209,584.51
武汉光谷创投私募基金管理有限公司 (原名：光谷创投基金管理有限公司)	45,237.49					45,237.49
TFI Asset Management Limited	14,831,718.58					14,831,718.58
企巢天风(武汉)创业投资中心(有限合伙)	593,327.62					593,327.62
TFI Securities and Futures Limited	35,954,598.77					35,954,598.77
合计	66,634,466.97					66,634,466.97

### (2). 商誉减值准备

适用  不适用

### (3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息

适用  不适用

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

适用  不适用

注：本公司年底对因非同一控制下企业合并形成的商誉账面价值进行减值测试。天风期货股份有限公司、TFI Asset Management Limited 及 TFI Securities and Futures Limited 按照市

场法并参考可比交易案例的市净率指标，考虑相关影响因素后，对含有商誉资产组的公允价值进行评估。经减值测试，截止 2020 年 12 月 31 日，商誉不存在减值。

**(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	746,842,055.81	186,710,513.96	336,996,186.98	84,249,046.76
内部交易未实现利润				
可抵扣亏损	26,643,642.94	6,660,910.74	32,856,736.33	8,214,184.08
公允价值变动	403,287,181.15	100,821,795.30	337,149,947.46	84,287,486.87
合计	1,176,772,879.90	294,193,220.00	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				
可供出售金融资产公允价值变动				
公允价值变动	1,148,688,466.34	287,172,116.59	399,403,855.02	99,850,963.76
合计	1,148,688,466.34	287,172,116.59	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	986,805.84	1,752,560.80
应收股利		2,432,210.56
其他应收款	611,540,154.75	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	37,099,356.28	47,211,143.26
应收结算担保金	14,002,685.81	10,000,000.00
预付账款	113,704,551.12	60,549,963.77
其他流动资产	2,694,660,668.15	1,290,493,867.19
其他非流动资产	7,908,816,462.08	4,717,379,542.73
合计	11,380,810,684.03	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) 按类别明细列示

款项性质	期末余额	期初余额
应收往来款组合	872,554,848.92	352,950,551.05
应收押金组合	29,306,656.43	21,691,574.09
特定款项组合		300,821,949.41
减：坏账准备	290,321,350.60	135,921,679.36
合计	611,540,154.75	539,542,395.19

#### 2) 其他应收款项账龄分析

账龄	期末余额		期初余额	
	账面余额	比例 (%)	账面余额	比例 (%)
1 年以内	641,687,617.08	71.15	502,111,173.50	74.34
1 至 2 年	144,801,736.56	16.06	72,652,770.50	10.76
2 至 3 年	55,548,372.36	6.16	59,168,203.24	8.76
3 年以上	59,823,779.35	6.63	41,531,927.31	6.14
合计	901,861,505.35	100.00	675,464,074.55	100.00

### (2) 长期待摊费用

项目	期初余额	本年增加	本年摊销	其他减少	期末余额
装修改造费	45,409,039.87	12,108,948.17	22,058,526.90		35,459,461.14
软件服务费	1,263,599.37	1,716,223.86	1,917,539.24		1,062,283.99
其他	538,504.02	205,005.85	165,898.72		577,611.15

合计	47,211,143.26	14,030,177.88	24,141,964.86		37,099,356.28
----	---------------	---------------	---------------	--	---------------

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

## 26、融券业务情况

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	36,222,990.79	
—交易性金融资产		
—转融通融入证券	36,222,990.79	
转融通融入证券总额	63,398,994.00	

融券业务违约情况：

适用 不适用

融券业务的说明：

无

## 27、资产减值准备变动表

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	外币报表折算	本期减少		期末余额
				转回	转/核销	
拆出资金减值准备						
融出资金减值准备	5,136,613.95	57,059,504.81				62,196,118.76
存出保证金减值准备						
应收款项坏账准备	48,111,811.82	30,385,749.13	-64,605.87			78,432,955.08
合同资产减值准备						
买入返售金融资产减值准备	66,807,361.85	96,213,630.61				163,020,992.46
债权投资减值准备						
其他债权投资减值准备	1,797,072.98	469,843.77	-41,897.11		134,589.18	2,090,430.46
其他应收款坏账准备	135,921,679.36	154,638,530.23	-35,092.83		203,766.16	290,321,350.60
其他金融资产减值准备	133,163,632.12	67,024,088.45				200,187,720.57
金融工具及其他项目信用减值准备小计	390,938,172.08	405,791,347.00	-141,595.81		338,355.34	796,249,567.93
长期股权投资减值准备		75,371,122.23				75,371,122.23
投资性房地产减值准备						
固定资产减值准备	558,864.89					558,864.89
在建工程减值准备						
无形资产减值准备						
商誉减值准备						
其他资产减值准备小计	558,864.89	75,371,122.23				75,929,987.12

合计	391,497,036.97	481,162,469.23	-141,595.81	338,355.34	872,179,555.05
----	----------------	----------------	-------------	------------	----------------

资产减值准备的说明：  
无

## 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

金融工具类别	期末余额			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	411,598.49	8,587.95	61,775,932.32	62,196,118.76
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备（简化模型）	/	78,432,955.08		78,432,955.08
应收款项坏账准备（一般模型）				
合同资产减值准备（简化模型）	/			
合同资产减值准备（一般模型）				
买入返售金融资产减值准备	166,928.52		162,854,063.94	163,020,992.46
债权投资减值准备				
其他债权投资减值准备	2,090,430.46			2,090,430.46
其他应收款坏账准备		49,965,268.49	240,356,082.11	290,321,350.60
其他金融资产减值准备	23,522,463.25	69,639,666.31	107,025,591.01	200,187,720.57
合计	26,191,420.72	198,046,477.83	572,011,669.38	796,249,567.93
金融工具类别	期初余额			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	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

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
信用借款	17,399,844.46	

质押借款	612,673,200.00	
合计	630,073,044.46	

短期借款分类的说明：

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

**(2). 已逾期未偿还的短期借款情况**

适用 不适用

其他说明

适用 不适用



## 30、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率(%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
收益凭证(注)				6,397,380,000.00	3.30-5.00	2,091,499,182.47	4,433,584,355.40	3,423,427,668.24	3,101,655,869.63
19 天风证券 CP004 短期融资券	1,000,000,000.00	2019/10/16	91 天	1,000,000,000.00	3.03	1,006,392,054.81		1,006,392,054.81	
19 天风证券 CP005 短期融资券	1,000,000,000.00	2019/11/20	91 天	1,000,000,000.00	3.27	1,003,762,739.72		1,003,762,739.72	
20 天风证券 CP001 短期融资券	1,000,000,000.00	2020/1/13	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	1,000,000,000.00	2020/2/24	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	1,000,000,000.00	2020/3/18	91 天	1,000,000,000.00	2.25		1,005,609,589.03	1,005,609,589.03	
20 天风证券 CP004 短期融资券	1,000,000,000.00	2020/6/23	91 天	1,000,000,000.00	2.60		1,006,482,191.77	1,006,482,191.77	
20 天风证券 CP005 短期融资券	1,000,000,000.00	2020/7/22	91 天	1,000,000,000.00	2.85		1,007,105,479.45	1,007,105,479.45	
20 天风证券 CP006 短期融资券	2,000,000,000.00	2020/10/20	91 天	2,000,000,000.00	3.40		2,013,562,841.52		2,013,562,841.52
20 天风 S1 短期公司债	2,000,000,000.00	2020/10/19	365 天	2,000,000,000.00	3.65		2,012,166,666.66		2,012,166,666.66
20 天风 S2 短期公司债	1,000,000,000.00	2020/12/8	365 天	1,000,000,000.00	3.80		1,004,861,111.11		1,004,861,111.11
合计	/	/	/	18,397,380,000.00	/	4,101,653,977.00	14,497,047,098.32	10,466,454,586.40	8,132,246,488.92

应付短期融资款的说明：

注：本公司 2020 年 12 月 31 日尚未到期的期限小于一年的收益凭证共计 37 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	940,312,999.99	150,068,750.00
转融通融入资金	505,902,777.78	
合计	1,446,215,777.77	150,068,750.00

转融通融入资金：

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

剩余期限	期末		期初	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1 个月以内	505,902,777.78	2.50%		
合计	505,902,777.78	/		/

拆入资金的说明：

无

**32、交易性金融负债****(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
债券	26,120,694.97		26,120,694.97			
合计	26,120,694.97		26,120,694.97			

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的描述性说明：

□适用 √不适用

**(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入其他综合收益**

□适用 √不适用

**(3) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入当期损益**

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**33、卖出回购金融资产款****(1) 按业务类别**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
交易所质押式回购	1,703,058,829.67	1,509,594,690.93
银行间质押式卖出回购	6,605,205,831.70	8,528,212,332.09
银行间买断式卖出回购		
合计	8,308,264,661.37	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	8,308,264,661.37	10,037,807,023.02
合计	8,308,264,661.37	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	10,069,107,678.40	10,728,609,019.77
合计	10,069,107,678.40	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	8,752,009,679.47	5,344,259,632.98
机构	2,178,521,558.79	1,311,991,131.88
小计	10,930,531,238.26	6,656,250,764.86
信用业务		
其中：个人	640,070,506.51	854,220,970.21
机构	14,301,143.27	2,324,931.08
小计	654,371,649.78	856,545,901.29
合计	11,584,902,888.04	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	1,743,011,349.94	1,641,812,416.03	338,109,587.86
二、离职后福利-设定提存计划	165,693.82	9,542,353.18	9,540,381.77	167,665.23
三、辞退福利	601,960.18	1,750,546.46	2,106,878.53	245,628.11
四、一年内到期的其他福利				
合计	237,678,307.95	1,754,304,249.58	1,653,459,676.33	338,522,881.20

**(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	1,642,387,189.75	1,541,160,026.88	336,753,440.45
二、职工福利费		16,454,250.09	16,454,250.09	
三、社会保险费	8,257.10	34,225,456.30	34,229,014.18	4,699.22
其中：医疗保险费	8,062.65	31,688,046.69	31,691,681.96	4,427.38
工伤保险费	29.38	107,243.63	107,243.81	29.20
生育保险费	165.07	2,430,165.98	2,430,088.41	242.64
四、住房公积金	114,103.18	46,268,641.91	46,270,151.86	112,593.23
五、工会经费和职工教育经费	1,262,016.09	3,675,811.89	3,698,973.02	1,238,854.96
合计	236,910,653.95	1,743,011,349.94	1,641,812,416.03	338,109,587.86

**(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	9,225,688.31	9,223,638.11	161,687.46
2、失业保险费	6,056.56	316,664.87	316,743.66	5,977.77
合计	165,693.82	9,542,353.18	9,540,381.77	167,665.23

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	59,194,434.96	33,414,040.91
企业所得税	65,895,814.89	9,776,346.10
个人所得税	35,285,979.33	15,401,681.15
城市维护建设税	2,181,772.25	2,274,580.39
教育费附加及地方教育费附加	1,466,249.97	1,571,514.47
其他	4,333,399.72	4,794,473.98
合计	168,357,651.12	67,232,637.00

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	236,889,711.25	10,136,303.79
期货风险准备金	23,718,501.58	20,896,503.30
应付手续费及佣金	19,367,708.28	3,283,487.07
合计	279,975,921.11	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
预收账款	51,784,278.10	60,946,048.17
合计	51,784,278.10	60,946,048.17

**(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因**

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**40、持有待售负债**

□适用 √不适用

**41、预计负债**适用 不适用**42、长期借款****(1). 长期借款分类**适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款	1,189,306,800.00	
合计	1,189,306,800.00	

长期借款分类的说明：

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

其他说明，包括利率区间：

无

## 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	100.00	2016.6.20	3+2 年	2,000,000,000.00	3.37、4.18	2,033,493,527.59	90,942,022.39	83,600,000.00	2,040,835,549.98
16 天风 02	100.00	2016.8.31	5 年	1,300,000,000.00	3.48	1,312,678,783.31	46,744,517.68	45,240,000.00	1,314,183,300.99
17 天风 01	100.00	2017.6.26	3+2 年	1,500,000,000.00	5.38、2.9	1,536,976,097.21	62,775,700.32	80,700,000.00	1,519,051,797.53
17 天风 02	100.00	2017.10.25	3+2 年	500,000,000.00	5.24	503,120,746.81	25,682,855.72	26,200,000.00	502,603,602.53
18 天风 01	100.00	2018.3.14	3+2 年	2,420,000,000.00	5.95	2,526,094,678.87	146,315,236.00	143,990,000.00	2,528,419,914.87
18 天风 02	100.00	2018.3.27	3+2 年	880,000,000.00	5.80	915,658,543.57	51,884,165.97	51,040,000.00	916,502,709.54
19 天风 01	100.00	2019.4.18	3 年	1,200,000,000.00	4.30	1,232,750,121.25	53,089,437.22	51,600,000.00	1,234,239,558.47
19 天风 02	100.00	2019.9.11	3 年	1,300,000,000.00	4.47	1,313,327,493.02	59,694,131.14	58,110,000.00	1,314,911,624.16
19 天风 03	100.00	2019.10.18	3 年	500,000,000.00	4.30	502,594,967.92	22,107,246.89	21,500,000.00	503,202,214.81
20 天风 01	100.00	2020.4.15	3 年	1,500,000,000.00	2.87		1,527,345,035.91		1,527,345,035.91
15 天风次	100.00	2015.10.28	5 年	2,000,000,000.00	5.50	2,017,143,381.60	90,444,444.30	2,107,587,825.90	
17 天风次	100.00	2017.4.11	5 年	1,000,000,000.00	5.20	1,034,744,893.65	53,150,191.72	52,000,000.00	1,035,895,085.37
18 天风 C1	100.00	2018.4.26	3 年	900,000,000.00	6.00	936,750,000.00	54,000,000.00	54,000,000.00	936,750,000.00
19 天风 C1	100.00	2019.8.27	3 年	750,000,000.00	4.99	760,999,898.68	38,109,500.71	37,425,000.00	761,684,399.39
20 天风 C1	100.00	2020.2.27	3 年	670,000,000.00	3.90		713,587,294.08		713,587,294.08
20 天风 C2	100.00	2020.2.27	5 年	1,080,000,000.00	4.90		1,123,578,509.48		1,123,578,509.48
20 天风 C3	100.00	2020.7.2	3 年	1,800,000,000.00	4.70		1,818,524,775.89		1,818,524,775.89
天庚 4 号	100.00	2020.6.22	547 天	360,000,000.00	3.50		366,662,465.75	6,282,739.72	360,379,726.03
天庚 5 号	100.00	2020.7.17	546 天	300,000,000.00	4.35		306,006,575.34		306,006,575.34
天庚 6 号	100.00	2020.7.30	545 天	300,000,000.00	4.25		305,414,383.56		305,414,383.56
天庚 7 号	100.00	2020.9.4	728 天	330,000,000.00	4.80		335,164,273.97		335,164,273.97
天庚 8 号	100.00	2020.9.29	488 天	130,000,000.00	4.80		131,607,013.70		131,607,013.70
天庚 9 号	100.00	2020.9.29	489 天	170,000,000.00	4.80		172,101,479.45		172,101,479.45
天庚 10 号	100.00	2020.11.12	729 天	1,000,000,000.00	4.90		1,006,712,328.77		1,006,712,328.77

TIANFS4.312 /09/22	100 美元	2019.12.09	3 年	200,000,000.00 美元	4.30	1,394,055,810.31	-31,359,160.83	56,114,140.00	1,306,582,509.48
TIANFS4.312 /09/22	100 美元	2019.12.09	3 年	100,000,000.00 美元	4.30		667,802,071.59	11,478,268.40	656,323,803.19
合计						18,020,388,943.79	9,238,086,496.72	2,886,867,974.02	24,371,607,466.49

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	42,000.00	150,000.00	87,000.00	
合计	195,000.00	42,000.00	150,000.00	87,000.00	/

涉及政府补助的项目：

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**46、其他负债**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付账款	79,488,174.75	63,097,759.90
应付利息	2,904,776.35	5,953,942.78
其他应付款	451,873,778.72	239,033,671.53
其他流动负债	690,040,812.88	433,229,212.83
其他非流动负债	1,117,734,687.89	1,352,142,010.25
长期应付款		313,370.68
合计	2,342,042,230.59	2,093,769,967.97

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：

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

#### 48、其他权益工具

(1) 其他金融工具划分至其他权益工具的情况（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	3,840,137,851.01		8,091,420,493.48
其他资本公积	8,647,222.90		184,524,449.92	-175,877,227.02
合计	4,259,929,865.37	3,840,137,851.01	184,524,449.92	7,915,543,266.46

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

1. 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所致。
2. 本期其他资本公积减少系长期股权投资的联营企业被动稀释股权影响。

#### 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	-276,223,844.84	-18,685,518.12		17,725,578.19	-275,263,904.91	-180,408,104.52	-94,855,800.39	-423,149,595.38
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益									
其他权益工具投资公允价值变动	-242,741,490.86	-276,223,844.84	-18,685,518.12		17,725,578.19	-275,263,904.91	-180,408,104.52	-94,855,800.39	-423,149,595.38
企业自身信用风险公允价值变动									
二、将重分类进损益的其他综合收益	1,410,522.51	-49,221,000.75	-1,768,783.78	-165,228.01		-47,286,988.96	-47,286,988.96		-45,876,466.45
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-5,815,222.35	-5,763,802.95				-5,763,802.95	-5,763,802.95		-11,579,025.30
其他债权投资公允价值变动	-2,936,734.03	-6,182,141.71	-1,545,535.44	-197,329.99		-4,439,276.28	-4,439,276.28		-7,376,010.31
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	1,347,804.75	378,057.23	-223,248.34	32,101.98		569,203.59	569,203.59		1,917,008.34
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	8,814,674.14	-37,653,113.32				-37,653,113.32	-37,653,113.32		-28,838,439.18
其他综合收益合计	-241,330,968.35	-325,444,845.59	-20,454,301.90	-165,228.01	17,725,578.19	-322,550,893.87	-227,695,093.48	-94,855,800.39	-469,026,061.83

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

## 2020 年年度报告

		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	2,080,062.26	-394,324,560.48	-77,004,671.75		-5,263,248.16	-312,056,640.57	-244,821,553.12	-67,235,087.45	-242,741,490.86
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	2,080,062.26	-394,324,560.48	-77,004,671.75		-5,263,248.16	-312,056,640.57	-244,821,553.12	-67,235,087.45	-242,741,490.86
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	-700,669.53	755,749.34	-1,355,442.70			2,111,192.04	2,111,192.04		1,410,522.51
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-6,685,016.42	869,794.07				869,794.07	869,794.07		-5,815,222.35
其他债权投资公允价值变动	1,294,087.50	-5,641,095.37	-1,410,273.84			-4,230,821.53	-4,230,821.53		-2,936,734.03
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	1,183,311.32	219,324.57	54,831.14			164,493.43	164,493.43		1,347,804.75
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	3,506,948.07	5,307,726.07				5,307,726.07	5,307,726.07		8,814,674.14
其他综合收益合计	1,379,392.73	-393,568,811.14	-78,360,114.45		-5,263,248.16	-309,945,448.53	-242,710,361.08	-67,235,087.45	-241,330,968.35

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	291,900,719.80	39,524,595.91		331,425,315.71
合计	291,900,719.80	39,524,595.91		331,425,315.71

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

根据《公司法》和公司章程的规定，公司按弥补亏损后税后利润的10%提取法定盈余公积金。

**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	318,909,385.01	64,133,434.61	10%		383,042,819.62
交易风险准备	299,906,964.27	39,524,595.91			339,431,560.18
合计	618,816,349.28	103,658,030.52			722,474,379.80

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	上期
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-）	-2,724,056.61	4,888,979.84
调整后期初未分配利润	2,009,942,587.25	1,899,176,177.53
加：本期归属于母公司所有者的净利润	454,871,365.71	307,767,555.05
减：提取法定盈余公积	39,524,595.91	38,912,277.95
提取一般风险准备	64,133,434.61	57,914,698.69
应付普通股股利	39,995,803.68	36,260,000.00
提取交易风险准备	39,524,595.91	38,912,277.95
其他综合收益结转留存收益	-12,072,154.73	22,277,834.13
期末未分配利润	2,293,707,677.58	2,012,666,643.86

调整期初未分配利润明细：

1、由于会计政策变更，影响期初未分配利润-2,724,056.61元。

**55、利息净收入**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	1,201,680,437.16	947,136,730.64
其中：货币资金及结算备付金利息收入	286,390,177.34	225,392,753.45
拆出资金利息收入	11,557,361.07	5,867,027.76
融出资金利息收入	346,875,288.61	304,195,028.72
买入返售金融资产利息收入	323,765,049.41	291,795,746.37
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	81,799,598.69	137,982,837.57
债权投资利息收入		49,187,009.99
其他债权投资利息收入	183,725,448.23	58,298,983.90
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	49,367,112.50	12,400,180.45
利息支出	1,669,201,655.65	1,319,749,142.61
其中：短期借款利息支出	12,336,538.30	
应付短期融资款利息支出	160,448,460.47	120,962,434.91
拆入资金利息支出	27,055,267.21	4,806,219.46
其中：转融通利息支出	5,902,777.78	
卖出回购金融资产款利息支出	206,599,305.32	318,508,570.08
代理买卖证券款利息支出	44,550,457.65	36,864,155.80
长期借款利息支出	10,546,800.00	
应付债券利息支出	1,082,612,532.64	756,833,230.82
其中：次级债券利息支出	350,599,343.08	246,780,180.14
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	125,052,294.06	81,774,531.54
利息净收入	-467,521,218.49	-372,612,411.97

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	732,748,088.01	544,910,906.04
证券经纪业务收入	1,035,219,382.00	658,693,451.51
其中：代理买卖证券业务	570,462,096.02	372,633,920.25
交易单元席位租赁	444,195,424.91	277,974,345.95
代销金融产品业务	20,561,861.07	8,085,185.31
证券经纪业务支出	302,471,293.99	113,782,545.47
其中：代理买卖证券业务	302,471,293.99	113,782,545.47
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	56,133,186.61	32,256,637.24
期货经纪业务收入	135,843,341.67	93,841,925.85
期货经纪业务支出	79,710,155.06	61,585,288.61
3.投资银行业务净收入	1,024,508,520.64	743,894,162.90

投资银行业务收入	1,042,703,069.83	743,894,162.90
其中：证券承销业务	840,319,843.87	540,459,057.27
证券保荐业务	25,471,698.13	9,905,660.40
财务顾问业务	176,911,527.83	193,529,445.23
投资银行业务支出	18,194,549.19	
其中：证券承销业务	17,999,737.38	
证券保荐业务		
财务顾问业务	194,811.81	
4.资产管理业务净收入	836,722,806.10	666,861,144.68
资产管理业务收入	836,722,806.10	666,861,144.68
资产管理业务支出		
5.基金管理业务净收入	18,017,284.43	16,840,596.03
基金管理业务收入	18,017,284.43	16,840,596.03
基金管理业务支出		
6.投资咨询业务净收入	77,412,692.22	90,048,956.32
投资咨询业务收入	77,412,692.22	90,048,956.32
投资咨询业务支出		
7.其他手续费及佣金净收入	11,038,521.85	9,248,448.73
其他手续费及佣金收入	11,176,133.87	9,248,448.73
其他手续费及佣金支出	137,612.02	
合计	2,756,581,099.86	2,104,060,851.94
其中：手续费及佣金收入	3,157,094,710.12	2,279,428,686.02
手续费及佣金支出	400,513,610.26	175,367,834.08

## (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	4,433,962.28	21,754,716.99
其他财务顾问业务净收入	172,282,753.74	171,774,728.24

## (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	3,183,252,741.25	14,591,286.09	1,249,652,890.06	6,924,953.05
信托	380,500,000.00	5,970,574.98	697,010,000.00	1,160,232.26
合计	3,563,752,741.25	20,561,861.07	1,946,662,890.06	8,085,185.31

## (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	153	63	84
期末客户数量	90,970	211	888
其中：个人客户	90,783	148	
机构客户	187	63	888
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	56,567,416,425.19	27,744,382,488.62	65,955,632,720.00
其中：自有资金投入	141,290,515.59		429,284,150.00
个人客户	41,051,550,858.92	395,121,780.87	
机构客户	15,374,575,050.68	27,349,260,707.75	65,526,348,570.00
期末主要受托资产初始成本	52,012,993,723.71	27,759,324,558.30	72,279,368,814.86
其中：股票	969,874,508.34	2,123,566,792.00	
国债	367,545,266.67	106,080,769.39	
其他债券	41,931,835,214.46	7,380,538,189.74	
基金	756,901,821.75	1,009,931,167.43	220,843,451.07
资产支持证券	1,247,329,409.46	229,040,650.00	69,585,548,395.01
信托	4,700,884,312.86	1,353,939,493.00	
协议或定期存款			120,000,000.00
委贷		1,433,636,980.95	
基金专户理财	488,100,000.00	129,334,535.12	
期货保证金	11,232,365.60	1,047,264.00	
买入返售金融资产	3,545,156,539.42	2,152,653,312.63	
卖出回购金融资产款	-7,249,233,008.90	-1,497,582,802.00	
收益权		1,791,675,219.57	
债权类资产		6,479,637,832.57	
期货资管计划	97,985,884.03	892,673,566.17	
股票质押式回购	4,044,200,941.86	3,411,792,446.97	
其他	1,101,180,468.16	761,359,140.76	2,352,976,968.78
当期资产管理业务净收入	720,763,401.41	46,869,492.03	69,089,912.66

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	161,471,393.14	19,763,682.93
处置长期股权投资产生的投资收益		9,094,724.49
金融工具投资收益	1,163,302,796.80	1,191,774,493.09
其中：持有期间取得的收益	789,705,306.73	771,593,353.36
—交易性金融工具	788,086,076.73	765,237,348.30
—其他权益工具投资	1,619,230.00	6,356,005.06
处置金融工具取得的收益	373,597,490.07	420,181,139.73



—交易性金融工具	503,210,446.51	445,846,197.98
—其他债权投资	3,321,614.42	
—债权投资		36,830,173.22
—衍生金融工具	-132,934,570.86	-62,495,231.47
合计	1,324,774,189.94	1,220,632,900.51

**(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	791,001,781.84	765,237,348.30
	处置取得收益	507,283,259.70	446,994,696.18
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	-2,915,705.11	
	处置取得收益	-4,072,813.19	-1,148,498.20

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
政府补助	21,310,200.93	1,457,444.25
其他	5,709,841.54	1,851,317.60
合计	27,020,042.47	3,308,761.85

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	511,289,115.25	394,689,099.14
交易性金融负债	-172,564.48	
衍生金融工具	-5,891,582.07	-71,498,711.14
合计	505,224,968.70	323,190,388.00

公允价值变动收益的说明：

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	9,695,550.21	10,953,312.74
现货交易收入	135,391,593.14	519,938,975.40
其他	54,177,768.54	37,727,018.99
合计	199,264,911.89	568,619,307.13

其他业务收入说明：  
无

**62、资产处置收益**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
非流动资产处置收益	169,903.88	49,375.77
合计	169,903.88	49,375.77

其他说明：  
无

**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
城市维护建设税	16,083,440.38	13,186,150.53
教育费附加及地方教育附加	11,063,692.31	8,544,456.00
印花税	1,870,683.12	995,302.76
其他	4,465,958.97	7,519,810.52
合计	33,483,774.78	30,245,719.81

税金及附加的说明：  
无

**64、业务及管理费**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	1,753,803,873.37	1,279,124,829.25
租赁费	152,956,526.06	141,135,737.69
折旧费	25,836,836.89	27,697,004.91
无形资产摊销	34,123,715.09	28,516,169.90
长期待摊费用摊销	22,297,411.00	29,902,279.75
差旅费	58,751,154.03	90,916,835.99
业务招待费	86,019,734.60	104,976,810.06
投资者保护基金	16,132,938.63	12,566,960.27
电子设备运转费	93,681,991.54	82,036,729.93
咨询费、顾问费、中介机构服务费	136,638,421.30	98,641,799.34
业务宣传费	41,410,817.77	21,850,680.76
佣金支出	23,214,631.03	98,694,506.91
基金管理费及托管费	21,588,572.54	11,740,755.97

资产管理计划销售费用	266,162,035.44	246,212,861.94
其他	119,202,302.17	131,719,831.24
合计	2,851,820,961.46	2,405,733,793.91

业务及管理费的说明：  
无

#### 65、信用减值损失

适用 不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
融出资金减值损失	57,059,504.81	3,072,590.39
应收款项及其他应收款信用减值损失	185,024,279.36	132,227,180.91
买入返售金融资产减值损失	96,213,630.61	239,819,548.74
其他债权投资减值损失	469,843.77	219,324.57
债权投资减值损失		168,087.58
其他资产减值损失	67,024,088.45	108,194,320.08
合计	405,791,347.00	483,701,052.27

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
长期股权投资减值准备	75,371,122.23	
合计	75,371,122.23	

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
现货交易成本	135,234,955.80	519,385,851.54
投资性房地产摊销	6,284,524.54	6,284,524.54
其他	2,320,873.90	2,292,088.26
合计	143,840,354.24	527,962,464.34

其他业务成本说明：  
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	617.18		617.18
其中：固定资产处置利得	617.18		617.18
政府补助	59,294,049.59	56,240,129.71	59,294,049.59
其他	8,302,333.60	19,257,691.76	8,302,333.60
合计	67,597,000.37	75,497,821.47	67,597,000.37

计入当期损益的政府补助

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额	与资产相关/与收益相关
财政扶持资金	58,509,900.00	44,081,000.00	与收益相关
鼓励企业上市政府奖励		5,000,000.00	与收益相关
其他	784,149.59	7,159,129.71	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	1,133,505.01	186,877.31	1,133,505.01
其中：固定资产处置损失	1,081,197.32	186,877.31	1,081,197.32
无形资产处置损失	52,307.69		52,307.69
对外捐赠	20,551,628.00	9,325,900.00	20,551,628.00
其他	7,083,846.47	2,137,469.02	7,083,846.47
合计	28,768,979.48	11,650,246.33	28,768,979.48

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	116,596,349.21	33,507,876.24
递延所得税费用	83,673,245.38	7,905,746.67
合计	200,269,594.59	41,413,622.91

### (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	888,150,005.57
按法定/适用税率计算的所得税费用	222,037,501.39
子公司适用不同税率的影响	-5,320,004.30
调整以前期间所得税的影响	-4,528,484.77
非应税收入的影响	-71,845,703.06
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	53,123,397.85
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-2,261,212.40
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	9,064,099.88
所得税费用	200,269,594.59

其他说明：

适用 不适用

## 71、其他综合收益

适用 不适用

详见附注 51

## 72、现金流量表项目

### (1). 收到的其他与经营活动有关的现金

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
收财政补贴收入	86,314,092.06	56,240,129.71
收到的存出保证金		5,717,157.04
收到的其他往来款	1,948,854,259.75	835,680,039.65
销售现货收到的现金	159,752,500.00	563,253,855.14
合计	2,194,920,851.81	1,460,891,181.54

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	1,042,208,468.96	1,045,553,151.47
支付的投资者保护基金	15,388,487.93	18,343,528.14
捐赠支出	20,551,628.00	9,325,900.00
支付其他往来款	4,729,073,102.46	1,575,012,197.00
支付的存出保证金	155,178,841.37	44,936,425.42
购买现货支付的现金	154,946,447.08	556,781,406.50
合计	6,117,346,975.80	3,249,952,608.53

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
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>		
净利润	687,880,410.98	420,891,652.38
加：资产减值准备	75,371,122.23	
信用减值损失	405,791,347.00	483,701,052.27
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	32,525,292.63	33,981,529.45
无形资产摊销	47,196,330.32	28,516,169.90
长期待摊费用摊销	24,141,964.86	29,902,279.75
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)	-169,903.88	-49,375.77
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	1,133,505.01	186,877.31
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-505,224,968.70	-538,032,378.03
财务费用(收益以“-”号填列)	1,206,953,740.43	882,879,006.42
投资损失(收益以“-”号填列)	-336,781,600.31	-577,311,425.36
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	-103,881,856.47	-54,812,167.16
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	187,321,152.83	62,717,913.83
处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额	-5,120,316,344.20	-768,806,717.71
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-3,080,953,352.18	-540,470,470.51
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	3,124,522,491.41	-2,408,458,998.11
经营活动产生的现金流量净额	-3,354,490,668.04	-2,945,165,051.34
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b>		
债务转为资本		

一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况:</b>		
现金的期末余额	16,664,104,074.30	10,740,413,953.43
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	5,923,690,120.87	1,708,531,029.89

## (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	16,664,104,074.30	10,740,413,953.43
其中: 库存现金	222,832.79	297,387.56
可随时用于支付的银行存款	14,571,287,530.88	8,851,874,395.43
可随时用于支付的其他货币资金		1,194,630.29
存放同业款项	2,092,593,710.63	1,887,047,540.15
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	16,664,104,074.30	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	38,472,819.61	风险准备金专户存款/司法冻结
固定资产	26,036,728.63	其他非流动负债担保物

无形资产	461,812,243.59	其他非流动负债担保物
存出保证金	120,091,138.65	转融通担保物
交易性金融资产	8,788,284,975.12	卖出回购担保物、转融通证券出借
买入返售金融资产	92,428,070.13	卖出回购担保物
其他债权投资	393,324,360.00	卖出回购担保物
投资性房地产	134,035,922.37	其他非流动负债担保物
在建工程	444,447,733.41	其他非流动负债担保物
交易性金融资产	1,487,200,354.95	其他非流动负债担保物
合计	11,986,134,346.46	/

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	66,042,851.99	6.5249	430,922,892.63
欧元	90,992.96	8.0250	710,356.20
港币	438,891,997.35	0.8416	369,389,060.65
结算备付金			
其中：美元	131,660.28	6.5249	859,070.14
港币	2,733,082.34	0.8416	2,300,271.43
存出保证金			
其中：美元	279,993.46	6.5249	1,826,929.33
港币	64,839,475.26	0.8416	54,571,495.96
融出资金			
其中：港币	44,897,734.56	0.8416	37,787,729.32
其他资产			
其中：美元	51,211,750.99	6.5249	334,151,554.03
港币	23,815,143.06	0.8416	20,043,777.01
代理买卖证券款			
其中：美元	446,492.56	6.5249	2,913,319.28
港币	522,477,377.10	0.8416	439,737,859.63
其他负债			
其中：美元	342,170.07	6.5249	2,232,625.49
港币	59,318,901.51	0.8416	49,925,160.27

其他说明：

无

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

√适用 □不适用



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

## 77、套期

适用 不适用

## 78、政府补助

### 1. 政府补助基本情况

适用 不适用

单位：元币种：人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
财政扶持资金	71,081,900.00	营业外收入/其他收益	71,081,900.00
其他	1,026,934.13	营业外收入/其他收益	1,026,934.13
稳岗补贴	8,495,416.39	其他收益	8,495,416.39

### 2. 政府补助退回情况

适用 不适用

其他说明：

无

## 79、其他

适用 不适用

## 八、资产证券化业务的会计处理

适用 不适用

## 九、合并范围的变更

### 1、非同一控制下企业合并

适用 不适用

### 2、同一控制下企业合并

适用 不适用

### 3、反向购买

适用 不适用

#### 4、 处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

#### 5、 其他原因的合并范围变动

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

适用 不适用

##### 1、 报告期合并范围增加情况

2020 年新成立天风（上海）证券资产管理有限公司，因此合并范围增加。

##### 2、 报告期合并范围减少情况

由公司控股子公司天风天睿投资股份有限公司作为管理人的睿颂天勤咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）本期注销，本公司本年度合并范围由此减少。

#### 6、 其他

适用 不适用

## 十、在其他主体中的权益

## 1、在子公司中的权益

## (1). 企业集团的构成

√适用 □不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
天风期货股份有限公司	上海市	上海市	商品期货、金融期货经纪、期货投资咨询	62.94		设立
天风天睿投资股份有限公司	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务	65.724		设立
天风创新投资有限公司	上海市	上海市	投资管理	100		设立
天风(上海)证券资产管理有限公司	上海市	上海市	证券资产管理业务	100		设立
深圳天风天成资产管理有限公司	广东深圳	广东深圳	受托资产管理、投资管理		100	设立
武汉光谷创投基金管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资及投资咨询		55	非同一控制下企业合并
武汉天阔投资管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		100	设立
天风天睿物业管理(武汉)有限公司(曾用名:天风天睿置业(武汉)有限公司)	湖北武汉	湖北武汉	物业管理;装饰装修工程		100	设立
天示(上海)企业管理有限公司	上海市	上海市	金融贸易		100	设立
武汉达昇创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资			结构化主体
武汉泰德鑫创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务			结构化主体
武汉惠人生物创业投资基金中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
天风汇盈壹号(武汉)创业投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
武汉光谷之星生物产业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	创业投资业务及创业投资咨询业务			结构化主体
汇智易德咸宁股权投资合伙企业(有限合伙)	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
天风瑞祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
汇盈通祺(武汉)投资中心(有限合伙)	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
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
TFInternationalSecuritiesGroupLimited	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
TFISecuritiesLimited	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
TFICapitalLimited（原名：TFISecuritiesHoldingsLimited）	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
TFIAssetManagementLimited	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
TFIAssetManagement(Cayman)Ltd.	开曼	开曼	投资基金业务		100	设立
TFISecuritiesandFuturesLimited	中国香港	中国香港	证券经纪业务、期货经纪业务		100	非同一控制下企业合并
睿海天泽咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿嘉恒通咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿嘉恒信咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿正天诚咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿海天源咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
睿泽天航咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天融鼎信（武汉）股权投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天风汇博（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天融鼎宸（武汉）股权投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
荆门臻慈天善股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北荆门	湖北荆门	股权投资、投资管理			结构化主体
睿泓天祺咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
睿坤津祥咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）	湖北咸宁	湖北咸宁	股权投资、投资管理			结构化主体
若干证券公司及资产管理公司资产管理计划	上海市	上海市	证券投资			结构化主体

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

本公司发行及管理的纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司发行的资产管理计划及特定客户资产管理计划。本公司作为资产管理计划管理人考虑对该等结构化主体是否存在控制，并

基于本公司作为资产管理人的决策范围、资产管理计划持有人的权力、提供管理服务而获得的报酬和面临的可变动收益风险敞口等因素来判断本公司作为资产管理计划管理人是主要责任人还是代理人。经评估后，本公司承担主要责任人的资产管理计划纳入合并范围。

确定公司是代理人还是委托人的依据：

1、存在单独一方拥有实质性权利可以无条件罢免决策者的，该为代理人；

2、除 1 以外的情况下，综合考虑决策者对被投资方的抉择权范围，其他方享有的实质性权利、决策者的薪酬水平、抉择者因持有被投资方中其他权益所承担可变回报的风险等相关因素进行判断。

其他说明：

无

## (2). 重要的非全资子公司

适用 不适用

单位：元币种：人民币

子公司名称	少数股东持股比例	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
天风期货股份有限公司	37.06%	1,716,153.28		143,170,915.10
天风天睿投资股份有限公司	34.276%	1,651,004.63		1,068,484,282.77

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	5,947,354,178.51	5,561,032,227.34	3,387,703,423.16	2,995,014,791.33
天风天睿投资股份有限公司	13,453,841,225.80	9,095,778,404.44	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	303,058,053.50	4,630,746.62	4,630,746.62	1,550,915,317.81	598,917,864.98	-147,493,711.12	-147,493,711.12	-329,650,366.15
天风天睿投资股份有限公司	259,033,743.00	54,883,169.79	-188,092,866.90	3,552,524,336.69	288,395,820.28	74,321,577.62	-110,866,934.43	479,497,719.99

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

	TFISecuritiesandFutures Limited
购买成本/处置对价	17,889,537.00
—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(注)	四川宜宾	四川宜宾	商业银行	7.16		权益法
恒泰证券股份有限公司	内蒙古呼和浩特	内蒙古呼和浩特	证券公司	26.49		权益法

在合营企业或联营企业的持股比例不同于表决权比例的说明：  
无

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

### (2). 重要合营企业的主要财务信息

适用 不适用

### (3). 重要联营企业的主要财务信息

适用 不适用

单位：元币种：人民币

	期末余额/本期发生额		期初余额/上期发生额	
	宜宾市商业银行股份有限公司	恒泰证券股份有限公司	宜宾市商业银行股份有限公司	恒泰证券股份有限公司
资产合计	56,410,388,114.64	33,596,030,823.86	45,842,481,952.22	
负债合计	50,794,222,134.31	24,160,265,859.56	41,836,925,682.79	
少数股东权益	260,597,355.52	404,532,030.30	253,314,449.14	
归属于母公司股东权益	5,355,568,624.81	9,031,232,934.00	3,752,241,820.29	
按持股比例计算的净资产份额	383,458,713.54	2,392,373,604.22	546,696,269.10	
调整事项		1,722,175,767.51	75,314,431.84	
—商誉		1,722,175,767.51	75,314,431.84	
对联营企业权益投资的账面价值	383,458,713.54	4,114,549,371.73	622,010,700.94	
营业收入	1,285,549,792.79	2,731,583,692.14	1,164,864,315.13	
净利润	167,972,128.98	482,352,700.66	151,722,133.68	
其他综合收益	6,092,555.92	-15,799,714.73	5,969,760.25	
综合收益总额	174,064,684.90	466,552,985.93	157,691,893.93	
本年度收到的来自联营企业的股利			2,404,648.63	

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	22,608,870.74	22,861,280.45
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	-2,252,409.71	-599,056.51
--其他综合收益		
--综合收益总额	-2,252,409.71	-599,056.51

其他说明：

无

## (5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明

□适用 √不适用

## (6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损

□适用 √不适用

## (7). 与合营企业投资相关的未确认承诺

□适用 √不适用

## (8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

□适用 √不适用

## 4、重要的共同经营

□适用 √不适用

## 5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

√适用 □不适用

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

有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

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

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

详见本报告第十一节财务报告十七、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
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
（一）交易性金融资产	3,828,235,349.37	16,612,809,819.54	7,364,079,153.64	27,805,124,322.55
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	3,828,235,349.37	16,612,809,819.54	7,364,079,153.64	27,805,124,322.55
（1）债务工具投资	596,960,313.47	13,092,216,091.92	537,115,782.97	14,226,292,188.36
（2）权益工具投资	3,231,275,035.90	3,520,593,727.62	6,826,963,370.67	13,578,832,134.19
（3）衍生金融资产				
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		737,136,193.01	731,018,285.24	1,468,154,478.25
（三）其他权益工具投资	6,135,000.00	355,421,554.10	2,917,773,901.83	3,279,330,455.93
（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				
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	3,834,370,349.37	17,705,367,566.65	11,012,871,340.71	32,552,609,256.73
(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	26,120,694.97	5,389,968.02		31,510,662.99
其中：发行的交易性债券	26,120,694.97			26,120,694.97
衍生金融负债		5,389,968.02		5,389,968.02
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				
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	26,120,694.97	5,389,968.02	-	31,510,662.99
<b>二、非持续的公允价值计量</b>				
(一) 持有待售资产				
<b>非持续以公允价值计量的资产总额</b>				
<b>非持续以公允价值计量的负债总额</b>				

## 2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

√适用 □不适用

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

√适用 □不适用

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

折现，以验证报价的合理性。

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

适用 不适用

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

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

适用 不适用

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

适用 不适用

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

#### 7、本期内发生的估值技术变更及变更原因

适用 不适用

#### 8、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

适用 不适用

于 2020 年 12 月 31 日，本公司管理层认为除应付债券外，其他金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司所持有应付债券账面价值为人民币 24,371,607,466.49 元，公允价值为人民币 24,335,772,843.49 元。

**9、其他**

□适用 √不适用

**十三、关联方及关联交易****1、本企业的母公司情况**

□适用 √不适用

**2、本企业的子公司情况**

本企业子公司的情况详见附注

√适用 □不适用

详见本报告第十一节财务报告十、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

详见本报告第十一节财务报告十、在其他主体中的权益 3、在合营企业或联营企业中的权益。

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

√适用 □不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
湖北三环资本管理有限公司	联营企业

其他说明

□适用 √不适用

**4、其他关联方情况**

√适用 □不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
武汉商贸集团有限公司（曾用名：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
湖北省联合发展投资集团有限公司	持股 5%以上股东
湖北省融资担保集团有限责任公司（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 (DANGDAIINTERNATIONALGROUPCO., 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
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
武汉睿通致和投资管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉光谷融资租赁有限公司	第一大股东武汉商贸集团有限公司之子公司
正隆保险经纪股份有限公司（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
湖北天禾农业金融服务有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉汉为体育场馆管理有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
克什克腾旗三特旅业开发有限公司热水分公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
恒泰长财证券有限责任公司	重要联营企业之全资子公司
武汉当代科技投资有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北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
湖北人福药房连锁有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
湖北人福医药集团有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
武汉高科国有控股集团有限公司	公司监事担任该公司董事
天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	间接持股 5%以上自然人控制的企业之结构化主体
崇阳三特文旅开发有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司
双刃剑（上海）体育文化传播有限公司	间接持股 5%以上自然人控制的企业之子公司

其他说明：

无

## 5、关联交易情况

### (1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

适用 不适用

单位：元币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
杭州财悦科技有限公司	业务及管理费-咨询费	16,981,131.79	10,188,679.07
双刃剑（上海）体育文化传播有限公司	业务及管理费-业务宣传费	14,150,943.40	
正隆保险经纪股份有限公司	业务及管理费-咨询费	3,121,966.05	1,792,452.78
湖北鼎壹荟农贸易有限公司	业务及管理费-招待费	824,904.00	
恒泰长财证券有限责任公司	业务及管理费-咨询费	466,981.13	
恒泰长财证券有限责任公司	手续费及佣金支出-证券承销	283,018.87	
恒泰证券股份有限公司	业务及管理费-资产管理计划销售费用	159,934.49	

崇阳三特文旅开发有限公司	业务及管理费-会议费	69,778.00	
崇阳三特隽水河旅游开发有限公司	业务及管理费-会议费		92,452.83
崇阳三特隽水河旅游开发有限公司	业务及管理费-差旅费	55,650.82	12,362.26
湖北人福药房连锁有限公司	业务及管理费-劳动保护费/劳保用品	35,000.00	
湖北天禾农业金融服务有限公司	购买商品		20,655.77
武汉汉为体育场馆管理有限公司	业务及管理费-职工福利费		119,703.00
武汉汉为体育场馆管理有限公司	业务及管理费-职工教育经费		1,188.68
克什克腾旗三特旅业开发有限公司热水分公司	业务及管理费-会议费		94,558.69
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	587.63	8,369.48
武汉商贸集团有限公司	利息支出-存款利息支出	32,378.19	19,289.85
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	191.69	182.84
当代国际集团有限公司 (DANGDAIINTERNATIONALGROUPCO.,LIMITED)	利息支出-其他流动负债/ 其他非流动负债利息支出		4,754,808.04
武汉高科国有控股集团有限公司	利息支出-存款利息支出	14,679.79	
武汉当代瑞通投资管理有限公司	利息支出-存款利息支出	4,034.49	
武汉天盈投资集团有限公司	利息支出-存款利息支出	2,916.67	
湖北省联合发展投资集团有限公司	利息支出-存款利息支出	26,575.20	
武汉当代天信财富投资管理有限公司	利息支出-存款利息支出	76.46	
天风睿源(武汉)股权投资中心(有限合伙)	利息支出-存款利息支出	1,232.26	

## 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		660,377.36
湖北天乾资产管理有限公司	证券承销收入	14,150,943.40	
湖北天乾资产管理有限公司	其他业务收入-其他	241,651.38	
湖北人福医药集团有限公司	资产管理费收入	1,509,433.96	1,132,075.47
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	9,433,962.27	18,867,924.53
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券承销收入	1,273,584.91	14,150,943.40
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券经纪收入	305.79	140,378.17
杭州财悦科技有限公司	投资咨询收入	2,094,339.60	2,094,339.61
当代国际集团有限公司 (DANGDAIINTERNATIONALGROUPCO.,LIMITED)	资产管理费收入	1,688,773.74	1,107,988.90
当代国际集团有限公司 (DANGDAIINTERNATIONALGROUPCO.,LIMITED)	证券承销收入	12,201,965.49	
湖北三环资本管理有限公司	其他业务收入-其他	181,179.64	181,898.82
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	194,076.81	194,847.15
天风睿金(武汉)投资基金管理有限公司	代销金融产品业务		2,450,745.29
武汉光谷融资租赁有限公司	证券承销收入	3,665,094.34	2,830,188.68

武汉光谷融资租赁有限公司	受托资产收入	98,181.46	149,903.85
武汉天盈投资集团有限公司	证券承销收入	9,433,962.27	
武汉天盈投资集团有限公司	其他业务收入-其他		32,110.09
武汉天盈投资集团有限公司	证券经纪收入	1,886.77	
武汉晟道创业投资基金管理有限公司	投资咨询收入	188,679.24	2,046,833.02
武汉三特索道集团股份有限公司	资产管理费收入	111,535.06	134,749.66
武汉三特索道集团股份有限公司	证券承销收入	4,504,245.28	
武汉当代瑞通投资管理有限公司	利息收入	1,667,484.37	1,794,506.22
武汉当代瑞通投资管理有限公司	证券经纪收入	39,383.02	
天风睿金（武汉）投资基金管理有限公司	财务顾问收入		4,056,528.30
武汉商贸集团有限公司	证券承销收入	2,122,641.51	
武汉当代科技投资有限公司	证券承销收入	14,150,943.41	
恒泰长财证券有限责任公司	财务顾问收入	849,056.60	
恒泰证券股份有限公司	投资咨询收入	4,037,735.85	
恒泰证券股份有限公司	证券承销收入	5,094,760.38	
武汉高科国有控股集团有限公司	证券经纪收入	85,446.15	
湖北省联合发展投资集团有限公司	证券经纪收入	350,217.91	
武汉当代天信财富投资管理有限公司	证券经纪收入	1,399.81	
武汉商贸集团有限公司	证券经纪收入	114,243.90	

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	3,204,815.40	3,204,815.40
武汉当代天信财富投资管理有限公司	出租办公用房	1,349,074.08	1,349,044.08
武汉长瑞恒兴投资基金管理有限公司	出租办公用房	298,068.83	175,495.67
武汉睿通致和投资管理有限公司	出租办公用房	144,778.80	144,778.80
杭州财悦科技有限公司	出租办公用房		345.10
长瑞当代资本管理有限公司	出租办公用房	97,871.90	219,199.22



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	2,982,080.56	3,655,112.99
宜宾市商业银行股份有限公司	租赁办公用房	174,150.00	175,950.00

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

#### (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	7,515.98	4,622.69

#### (8). 其他关联交易

适用 不适用

##### ①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大致为 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。

##### ②人福医药集团股份公司发行股份购买资产并募集配套资金之承销

人福医药集团股份公司以发行股份的方式向自然人李杰、陈小清、徐华斌购买其合计持有的宜昌人福药业有限责任公司 13% 股权，并向人福医药控股股东武汉当代科技产业集团股份有限公司募集配套资金。天风证券作为上述交易的联席主承销商，承销费用总额为 1900 万元。本次募集配套资金的新增股份已于 2021 年 2 月 4 日办理完毕股份登记手续。

##### (3) 其他关联交易

天风证券2020年购买恒泰证券股份有限公司管理的恒泰盈沃致远1号集合资产管理计划，截止2020年12月31日其公允价值为3,971.55万元，成本为3,800.00万元。天风证券担任恒泰盈沃致远1号集合资产管理计划的投资顾问，本期确认财务顾问收入302,174.78元。

## 6、关联方应收应付款项

### (1). 应收项目

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收账款	湖北三环资本管理有限公司	255,556.49	15,953.13	63,506.10	3,175.31
应收账款	湖北宏泰天睿股权投资基金管理有限公司	728,580.95	62,572.02	845,575.82	51,489.04
应收账款	武汉当代天信财富投资管理有限公司	1,416,512.04	70,825.60	354,112.26	17,705.64
应收账款	武汉长瑞恒兴投资基金管理有限公司	315,952.97	16,212.28	188,084.95	9,404.25
应收账款	长瑞当代资本管理有限公司	115,056.58	5,903.82	158,028.01	7,901.40
应收账款	武汉三特索道集团股份有限公司			1,225,500.00	61,275.00
应收账款	武汉天盈投资集团有限公司	149,664.07	60,832.04	149,664.07	24,682.81
应收账款	武汉睿通致和投资管理有限公司	173,572.31	9,756.34	38,004.45	1,900.22
应收账款	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	560,842.70	28,042.14	4,486,741.60	280,421.35
应收账款	湖北天乾资产管理有限公司	13,170.00	658.50		
预付款项	宜宾市商业银行股份有限公司	107,100.00		130,050.00	
预付款项	杭州财悦科技有限公司			5,660,377.09	
预付款项	正隆保险经纪股份有限公司	1,312,500.00			
其他应收款	长瑞当代资本管理有限公司			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			34,499,162.58	6,614,506.03

### (2). 应付项目

适用 不适用

单位：元币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
代理买卖证券款	武汉商贸集团有限公司	7,824.49	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		3,390.27
代理买卖证券款	武汉当代科技产业集团股份有限公司	350,852.42	4,662,085.67
代理买卖证券款	武汉高科国有控股集团有限公司	16,407.86	
代理买卖证券款	武汉当代瑞通投资管理有限公司	883.77	
代理买卖证券款	武汉天盈投资集团有限公司	17,246.63	
代理买卖证券款	武汉当代天信财富投资管理有限公司	687.85	
代理买卖证券款	天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	348,977.10	
其他应付款	武汉睿通致和投资管理有限公司	173,572.36	173,572.36

其他应付款	当代国际集团有限公司 (DANGDAIINTERNATIONALGROUPCO., LIMITED)		368,490.75
其他流动负债	当代国际集团有限公司 (DANGDAIINTERNATIONALGROUPCO., 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

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

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

**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未决诉讼、仲裁

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

2019年10月28日，天山生物就股权转让一案向昌吉市人民法院提起诉讼，法院于2019年10月28日立案审理。天山生物请求判令撤销与各被告之间的股权转让行为暨撤销原告与33名被告（包含武汉泰德鑫创业投资中心（有限合伙））于2017年9月7日就各被告向原告转让大象广告股份有限公司之发行股份及现金购买资产协议。请求判令被告武汉泰德鑫创业投资中心（有限合伙）向原告返还天山生物股份6,088,524股，由原告将该股份注销；如果其无法足额向原告返还上述股份，则应将交付不足部分的股份数折算现金补偿金支付给原告。目前该案件正处于一审过程中。

(2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

除上述事项外，截至资产负债表日止，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) 非公开发行股票

2021年3月，公司取得中国证券监督管理委员会出具的《关于核准天风证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可〔2021〕962号），核准公司非公开发行不超过1,999,790,184股新股。截至报告日，公司实际已非公开发行A股股票1,999,790,184股，每股发行价格为人民币4.09元。

#### (2) 发行公司债券、短期融资券

1) 2021年1月15日，本公司面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第一期)（简称“21天风01”），发行总额7亿元，债券期限3年，票面利率4.18%。

2) 2021 年 3 月 10 日, 本公司面向专业投资者公开发行 2021 年公司债券 (第二期) (品种一) (简称“21 天风 02”), 发行总额 8 亿元, 债券期限 3 年, 票面利率 4.50%。

3) 2021 年 3 月 24 日发行 2021 年度第一期短期融资券 (简称“21 天风证券 CP001”), 发行总额 10 亿元, 短期融资券期限 91 天, 票面利率 3.00%。

### (3) 公司分红

根据 2021 年 4 月 27 日第三届董事会第四十四次会议审议通过的公司 2020 年度利润分配预案, 公司 2020 年度拟不转增、不分配。以上分配预案尚需提交公司 2020 年度股东大会审议。

## 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安全、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 12 月 31 日，公司融资融券业务平均维持担保比例为 304.19%，自有资金参与股票质押式回购业务平均履约保障比例为 131.17%，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条件下，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：

项 目	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
货币资金	14,622,925,091.99	8,879,676,149.48
结算备付金	2,092,593,710.63	1,887,047,540.15
拆出资金	600,408,750.00	150,102,500.00
融出资金	5,617,229,266.37	6,068,122,661.53
交易性金融资产	27,805,124,322.55	23,141,487,599.28
衍生金融资产		
买入返售金融资产	3,624,293,940.73	3,505,744,837.42
应收款项	1,395,310,400.35	747,858,938.94
应收利息		
存出保证金	3,234,252,212.13	1,914,546,749.91
债权投资		
其他债权投资	1,468,154,478.25	979,663,520.62
其他权益工具投资	3,279,330,455.93	3,838,700,733.98
最大信用风险敞口	63,739,622,628.93	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	
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
权益类市场风险	66,738,184.19	199,481,558.95
利率类市场风险	37,548,474.43	16,359,638.72
商品类市场风险	1,005,844.94	277,979.59
分散化效益	-39,126,033.81	-10,998,543.01
合 计	66,166,469.75	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	
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
上升 25 个基点	-50,130,000.00	-39,770,320.00
下降 25 个基点	50,130,000.00	39,770,320.00

## 十八、 其他重要事项

### 1、 前期会计差错更正

#### (1). 追溯重述法

适用 不适用

#### (2). 未来适用法

适用 不适用

**2、 债务重组**

适用 不适用

**3、 资产置换**

**(1). 非货币性资产交换**

适用 不适用

**(2). 其他资产置换**

适用 不适用

**4、 年金计划**

适用 不适用

**5、 终止经营**

适用 不适用

**6、 分部信息**

**(1). 报告分部的确定依据与会计政策**

适用 不适用

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

## (2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	证券经纪业务	证券自营业务	投资银行业务	资产管理业务	期货经纪业务	其他业务	私募基金业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	1,370,309,751.80	1,900,454,820.35	1,005,138,182.41	872,669,200.52	112,063,047.45	-702,500,040.88	255,830,332.80	454,335,750.06	4,359,629,544.39
手续费及佣金净收入	824,478,760.75	34,407,977.27	1,002,244,246.45	828,345,299.37	56,623,927.70	2,741,395.11	57,010,349.09	49,270,855.88	2,756,581,099.86
投资收益		1,228,281,719.83		3,586,227.54	11,953,734.80	164,648,148.88	54,104,079.46	137,799,720.57	1,324,774,189.94
其他收入	545,830,991.05	637,765,123.25	2,893,935.96	40,737,673.61	43,485,384.95	-869,889,584.87	144,715,904.25	267,265,173.61	278,274,254.59
二、营业支出	1,341,275,091.38	310,988,949.81	413,086,903.73	605,941,171.44	113,860,980.51	625,037,343.85	165,996,190.05	65,879,071.06	3,510,307,559.71
三、营业利润	29,034,660.42	1,589,465,870.54	592,051,278.68	266,728,029.08	-1,797,933.06	-1,327,537,384.73	89,834,142.75	388,456,679.00	849,321,984.68
四、资产总额	14,113,773,381.11	42,794,413,226.59	1,189,663,351.02	1,602,557,907.79	5,959,525,614.81	48,987,940,505.98	9,957,542,434.42	43,200,309,640.27	81,405,106,781.45
五、负债总额	6,958,760,302.98	11,395,587,859.17	1,064,611,856.20	89,552,004.57	5,525,784,528.82	38,603,318,488.68	5,585,726,826.42	10,061,271,998.09	59,162,069,868.75
六、补充信息									
3、信用减值损失	298,645,241.28	-675,896.42	-614,683.55	33,568,091.20	-58,630.27	-3,910,901.43	79,475,875.69	637,749.50	405,791,347.00

(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	511,289,115.25			27,805,124,322.55
2、衍生金融资产					
3、其他债权投资	979,663,520.62		-5,459,001.97	469,843.77	1,468,154,478.25
4、其他权益工具投资	3,838,700,733.98		-423,149,595.38		3,279,330,455.93
金融资产小计	27,959,851,853.88	511,289,115.25	-428,608,597.35	469,843.77	32,552,609,256.73
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	27,959,851,853.88	511,289,115.25	-428,608,597.35	469,843.77	32,552,609,256.73
金融负债					
1、交易性金融负债		-172,564.48			26,120,694.97
2、衍生金融负债	274,923.17	-5,891,582.07			5,389,968.02
金融负债小计	274,923.17	-6,064,146.55			31,510,662.99

## 10、 金融工具项目计量基础分类表

(1). 金融资产计量基础分类表

适用 不适用

单位：元币种：人民币

金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	14,622,925,091.99					

结算备付金	2,092,593,710.63					
拆出资金	600,408,750.00					
融出资金	5,617,229,266.37					
买入返售金融资产	3,624,293,940.73					
应收款项	1,395,310,400.35					
存出保证金	3,234,252,212.13					
交易性金融资产					27,805,124,322.55	
债权投资	-					
其他债权投资		1,468,154,478.25				
其他权益工具投资			3,279,330,455.93			
其他资产	626,529,646.4					
合计	31,813,543,018.60	1,468,154,478.25	3,279,330,455.93		27,805,124,322.55	
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

期末账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动

			变动计入当期损益的金融负债	计入当期损益的金融负债
短期借款	630,073,044.46			
应付短期融资款	8,132,246,488.92			
拆入资金	1,446,215,777.77			
交易性金融负债		26,120,694.97		
衍生金融负债		5,389,968.02		
卖出回购金融资产款	8,308,264,661.37			
代理买卖证券款	11,584,902,888.04			
应付款项	279,975,921.11			
长期借款	1,189,306,800.00			
应付债券	24,371,607,466.49			
其他负债	534,266,729.82			
合计	47,714,540,244.60	31,510,662.99		
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	10,240,124.03			442,676,780.22
2、衍生金融资产					
3、贷款和应收款					465,391,631.89
4、其他债权投资				1,229,153.54	731,018,285.24
5、其他权益工具投资					
金融资产小计	272,972,798.49	10,240,124.03		1,229,153.54	1,639,086,697.35
金融负债					
1、交易性金融负债		-172,564.48			26,120,694.97
金融负债小计		-172,564.48			26,120,694.97

## 12、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

□适用 √不适用

13、其他

适用 不适用



## 十九、 母公司财务报表主要项目注释

## 1、 长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	减值准备期末余额	
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备			其他
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
宜宾市商业银行股份有限公司	622,010,700.94			22,913,127.43	-1,569,542.68	-184,524,449.92		75,371,122.23		383,458,713.54	75,371,122.23
恒泰证券股份有限公司		3,977,932,956.58		140,810,675.42	-4,194,260.27					4,114,549,371.73	
小计	622,010,700.94	3,977,932,956.58		163,723,802.85	-5,763,802.95	-184,524,449.92		75,371,122.23		4,498,008,085.27	75,371,122.23
三、对子公司投资											
天风天睿投资股份有限公司	1,398,047,668.16									1,398,047,668.16	
天风期货股份有限公司	268,537,000.00									268,537,000.00	
TFI Asset Management Limited	18,983,167.90									18,983,167.90	
天风创新投资有限公司	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	
天风（上海）证券资产管理有限公司		500,000,000.00								500,000,000.00	
小计	2,706,023,286.06	717,373,264.37								3,423,396,550.43	
合计	3,328,033,987.00	4,695,306,220.95		163,723,802.85	-5,763,802.95	-184,524,449.92		75,371,122.23		7,921,404,635.70	75,371,122.23

其他说明：

无

**2、 应付职工薪酬****(1). 应付职工薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	222,544,560.49	1,470,793,988.83	1,446,624,007.28	246,714,542.04
二、离职后福利-设定提存计划	42,582.75	7,566,231.84	7,562,579.42	46,235.17
三、辞退福利		1,416,658.87	1,416,658.87	
四、一年内到期的其他福利				
合计	222,587,143.24	1,479,776,879.54	1,455,603,245.57	246,760,777.21

**(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	1,381,357,593.23	1,357,182,205.13	245,358,394.63
二、职工福利费		14,723,903.06	14,723,903.06	
三、社会保险费	8,257.10	30,333,616.53	30,337,174.41	4,699.22
其中：医疗保险费	8,062.65	27,952,733.33	27,956,368.60	4,427.38
工伤保险费	29.38	95,103.75	95,103.93	29.20
生育保险费	165.07	2,285,779.45	2,285,701.88	242.64
四、住房公积金	114,103.18	40,738,523.67	40,740,033.62	112,593.23
五、工会经费和职工教育经费	1,239,193.68	3,640,352.34	3,640,691.06	1,238,854.96
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	222,544,560.49	1,470,793,988.83	1,446,624,007.28	246,714,542.04

**(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	7,286,698.39	7,282,967.18	40,257.40
2、失业保险费	6,056.56	279,533.45	279,612.24	5,977.77
3、企业年金缴费				
合计	42,582.75	7,566,231.84	7,562,579.42	46,235.17

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	906,926,147.17	801,294,203.95

其中：货币资金及结算备付金利息收入	215,752,649.97	162,792,027.15
拆出资金利息收入	11,557,361.07	5,867,027.76
融出资金利息收入	346,875,288.61	304,195,028.72
买入返售金融资产利息收入	116,570,821.97	182,325,466.79
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	81,799,598.69	137,982,837.57
债权投资利息收入	7,075,471.73	55,022,423.36
其他债权投资利息收入	52,007,412.43	58,298,983.90
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	157,087,141.39	32,793,246.27
利息支出	1,544,989,446.49	1,238,894,202.42
其中：短期借款利息支出	5,433,200.00	
应付短期融资款利息支出	160,448,460.47	120,962,434.91
拆入资金利息支出	27,055,267.21	4,806,219.46
其中：转融通利息支出	5,902,777.78	
卖出回购金融资产利息支出	203,082,250.37	315,015,835.37
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	26,877,629.29	19,456,802.54
长期借款利息支出	10,546,800.00	
应付债券利息支出	1,091,086,305.28	756,773,094.08
其中：次级债券利息支出	350,174,814.81	246,355,651.82
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	20,459,533.87	21,879,816.06
利息净收入	-638,063,299.32	-437,599,998.47

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	717,079,525.07	543,621,324.21
证券经纪业务收入	1,016,108,410.83	656,930,184.76
其中：代理买卖证券业务	550,858,417.30	370,870,653.50
交易单元席位租赁	444,195,424.91	277,974,345.95
代销金融产品业务	21,054,568.62	8,085,185.31
证券经纪业务支出	299,028,885.76	113,308,860.55
其中：代理买卖证券业务	299,028,885.76	113,308,860.55
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	918,710,612.50	738,479,535.53
投资银行业务收入	919,465,329.49	738,479,535.53
其中：证券承销业务	769,142,530.17	539,647,656.28

证券保荐业务	25,471,698.13	9,905,660.40
财务顾问业务	124,851,101.19	188,926,218.85
投资银行业务支出	754,716.99	
其中：证券承销业务	754,716.99	
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4.资产管理业务净收入	784,823,519.06	677,260,512.89
资产管理业务收入	784,823,519.06	677,260,512.89
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	64,381,920.74	84,873,766.42
投资咨询业务收入	64,381,920.74	84,873,766.42
投资咨询业务支出		
7.其他手续费及佣金净收入	12,905,866.46	21,492,596.75
其他手续费及佣金收入	13,043,478.48	21,492,596.75
其他手续费及佣金支出	137,612.02	
合计	2,497,901,443.83	2,065,727,735.80
其中：手续费及佣金收入	2,797,822,658.60	2,179,036,596.35
手续费及佣金支出	299,921,214.77	113,308,860.55

## (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	4,433,962.28	21,754,716.99
其他财务顾问业务净收入	120,417,138.91	167,171,501.86

## (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	3,183,252,741.25	15,083,993.64	1,249,652,890.06	6,924,953.05
信托	380,500,000.00	5,970,574.98	697,010,000.00	1,160,232.26
合计	3,563,752,741.25	21,054,568.62	1,946,662,890.06	8,085,185.31

## (4). 资产管理业务

□适用 √不适用

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

**5、 投资收益****(1). 投资收益情况**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	163,723,802.85	20,362,739.44
金融工具投资收益	987,992,589.63	829,329,614.60
其中：持有期间取得的收益	773,490,777.71	623,035,878.69
—交易性金融工具	773,490,777.71	623,035,878.69
处置金融工具取得的收益	214,501,811.92	206,293,735.91
—交易性金融工具	344,414,586.39	249,554,914.07
—其他债权投资	3,321,614.42	
—债权投资		36,830,173.22
—衍生金融工具	-133,234,388.89	-80,091,351.38
合计	1,151,716,392.48	849,692,354.04

**(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	776,406,482.82	623,035,878.69
	处置取得收益	348,571,442.97	250,703,412.27
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	-2,915,705.11	
	处置取得收益	-4,156,856.58	-1,148,498.20

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	247,925,157.27	341,915,723.88
衍生金融工具	-5,994,490.68	-15,773,403.87
合计	241,930,666.59	326,142,320.01

公允价值变动收益的说明：

无

**7、 业务及管理费**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	1,454,274,304.04	1,053,579,235.11
租赁费	137,841,208.63	122,210,730.53
折旧费	20,422,340.63	23,077,568.43

无形资产摊销	30,967,626.93	25,594,761.09
长期待摊费用摊销	19,181,581.16	29,238,256.55
差旅费	54,037,652.65	82,771,341.94
业务招待费	79,888,238.75	98,768,470.66
投资者保护基金	16,132,938.63	12,566,960.27
电子设备运转费	56,361,934.81	49,664,981.53
安全防范费	326,903.15	241,143.40
其他	550,420,542.70	569,046,109.44
合计	2,419,855,272.08	2,066,759,558.95

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	169,903.88	
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）	86,314,092.06	
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	-20,466,028.70	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
所得税影响额	-14,136,895.52	
少数股东权益影响额	-2,324,983.49	
合计	49,556,088.23	

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	2.79	0.07	0.07

扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	2.49	0.06	0.06
-------------------------	------	------	------

### 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



## 第十二节 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。
备查文件目录	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。
备查文件目录	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：2021 年 4 月 27 日

### 修订信息

适用 不适用

## 第十三节 证券公司信息披露

### 一、公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

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
2020年7月23日	中国证监会	机构部函[2020]1906号	关于天风证券股份有限公司发行金融债券的监管意见书
2020年7月31日	中国证监会	证监许可[2020]1641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短期公司债券注册的批复
2020年8月19日	中国证券金融公司	中证金函[2020]145号	关于申请参与创业板转融券业务的复函
2020年8月31日	上海票据交易所	序号: 202008010	关于天风证券股份有限公司(存托)接入中国票据交易系统的通知
2020年10月27日	中国证监会	机构部函[2020]2850号	关于天风证券为天风资管提供净资本担保承诺事项的复函
2020年12月18日	中国证监会	机构部函[2020]3395号	关于天风证券股份有限公司非公开发行A股股票的监管意见书

### 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。