

公司代码：601162

公司简称：天风证券

# 天风证券股份有限公司 2023 年半年度报告

## 重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。

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

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

无

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

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

七、是否存在被控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

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

否

十、重大风险提示

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

十一、其他

适用 不适用

## 目录

第一节	释义 .....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	管理层讨论与分析.....	13
第四节	公司治理.....	26
第五节	环境与社会责任.....	28
第六节	重要事项.....	30
第七节	股份变动及股东情况.....	47
第八节	优先股相关情况.....	50
第九节	债券相关情况.....	51
第十节	财务报告.....	56
第十一节	证券公司信息披露.....	184

备查文件目录	载有公司负责人、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。
	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。

## 第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
天风证券/天风/本公司/公司/母公司	指	天风证券股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
宏泰集团	指	湖北宏泰集团有限公司
商贸集团	指	武汉商贸集团有限公司
人福医药	指	人福医药集团股份公司
联发投集团	指	湖北省联合发展投资集团有限公司
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）
三特索道	指	武汉三特索道集团股份有限公司
紫金天风期货	指	紫金天风期货股份有限公司
天风天睿	指	天风天睿投资有限公司（曾用名“天风天睿投资股份有限公司”）
天风创新	指	天风创新投资有限公司
天风国际	指	天风国际证券集团有限公司 (TF International Securities Group Limited)
天风资管	指	天风（上海）证券资产管理有限公司
恒泰证券	指	恒泰证券股份有限公司（恒泰证券部分股票在香港联合交易所有限公司上市，股份代码“01476”，股份简称“恒投证券”）
宜宾商行	指	宜宾市商业银行股份有限公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》	指	《天风证券股份有限公司章程》
报告期	指	2023 年 1-6 月
报告期末	指	2023 年 6 月 30 日
元、万元、亿元	指	人民币元、人民币万元、人民币亿元

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司信息

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

### 注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	8,665,757,464.00	8,665,757,464.00
净资产	15,354,448,280.12	15,273,877,771.43

### 公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

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

序号	业务资格	批准机构	取得时间
1	债券质押式报价回购业务试点	中国证监会	2010年11月
2	同意实施证券经纪人制度	湖北证监局	2012年11月
3	开展集合资产管理电子签名合同试点	湖北证监局	2011年9月
4	开展客户资金第三方存管单客户多存管业务函	湖北证监局	2012年4月
5	参与股指期货业务（自营业务）	湖北证监局	2012年11月
6	参与股指期货业务（资产管理业务）	湖北证监局	2013年3月
7	见证开户业务	湖北证监局	2013年5月
8	参与国债期货业务	湖北证监局	2014年1月
9	自营业务参与利率互换交易	湖北证监局	2014年3月
10	国债期货做市业务	中国证监会	2019年5月
11	受托管理保险资金业务资格	中国保监会	2016年8月
12	约定购回式证券交易权限	深圳证券交易所	2013年1月
13	股票质押式回购交易权限	深圳证券交易所	2013年7月
14	深港通下港股通业务交易权限资格	深圳证券交易所	2016年11月
15	上市公司股权激励行权融资业务	深圳证券交易所	2017年3月
16	股票期权业务交易权限	深圳证券交易所	2019年12月
17	固定收益证券综合电子平台交易商资格	上海证券交易所	2011年9月
18	债券质押式报价回购业务试点	上海证券交易所	2012年6月
19	约定购回式证券交易权限	上海证券交易所	2012年11月
20	债券质押式报价回购交易权限	上海证券交易所	2012年12月
21	股票质押式回购交易权限	上海证券交易所	2013年7月
22	转融通证券出借交易权限	上海证券交易所	2014年7月
23	港股通业务交易权限	上海证券交易所	2014年10月
24	上海证券交易所股票期权交易参与者	上海证券交易所	2015年1月

25	进入全国银行间同业拆借市场	中国人民银行	2012年6月
26	证券公司中小企业私募债券承销业务试点	中国证券业协会	2012年7月
27	互联网证券业务试点	中国证券业协会	2015年3月
28	场外期权业务二级交易商	中国证券业协会	2019年4月
29	收益互换业务	中国证券业协会	2020年4月
30	推荐业务及经纪业务	全国中小企业股份转让系统	2013年3月
31	做市业务资格	全国中小企业股份转让系统	2014年7月
32	银行间债券市场尝试做市业务权限	全国银行间同业拆借中心	2014年7月
33	代理证券质押登记业务资格	中国证券登记结算有限责任公司	2014年9月
34	开展私募基金综合托管业务	中国证券投资者保护基金公司	2015年3月
35	转融通业务	中国证券金融股份有限公司	2013年1月
36	接入中国票据交易系统	上海票据交易所	2019年3月
37	(存托)接入中国票据交易系统	上海票据交易所	2020年8月
38	债券通业务报价资格	中国外汇交易中心	2019年7月
39	国债期货主做市商	中国金融期货交易所	2022年1月
40	非金融企业债务融资工具承销商	中国银行间市场交易商协会	2022年4月
41	机构间私募产品报价与服务系统参与人资格	中证资本市场发展监测中心	2014年8月
42	第1类(证券交易)业务	香港证券及期货事务监察委员会(SFC)	2019年4月
43	第2类(期货合约交易)业务		2019年4月
44	第4类(就证券提供意见)业务		2016年9月
45	第5类(就期货合约提供意见)业务		2016年9月
46	第6类(就机构融资提供意见)业务		2020年12月、 2022年11月
47	第9类(提供资产管理)业务		2016年9月
48	合格境外机构投资者	中国证监会	2021年9月

## 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北路217号天风大厦2号楼25楼	湖北省武汉市武昌区中北路217号天风大厦2号楼25楼
电话	027-87618867	027-87618867
传真	027-87618863	027-87618863
电子信箱	dongban@tfzq.com	dongban@tfzq.com

## 三、基本情况变更简介

公司注册地址	武汉东湖新技术开发区高新大道446号天风证券大厦20层
公司注册地址的历史变更情况	2008年2月,经中国证监会和武汉市工商局批准,公司注册地由四川省成都市变更至湖北省武汉市;2022年4月22日,经武汉市市场监督管理局批准,注册地由湖北省武汉市东湖

	新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼变更为武汉东湖新技术开发区高新大道446号天风证券大厦20层。
公司办公地址	湖北省武汉市武昌区中北路217号天风大厦2号楼
公司办公地址的邮政编码	430000
公司网址	www.tfzq.com
电子信箱	dongban@tfzq.com
报告期内变更情况查询索引	不适用

#### 四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的网站地址	http://www.sse.com.cn/
公司半年度报告备置地点	湖北省武汉市武昌区中北路217号天风大厦2号楼
报告期内变更情况查询索引	不适用

#### 五、公司股票简况

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

#### 六、其他有关资料

适用 不适用

#### 七、公司主要会计数据和财务指标

##### (一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比 上年同期增 减(%)
营业收入	2,160,128,155.26	1,130,265,856.55	91.12
归属于母公司股东的净利润	551,805,663.13	51,673,609.35	967.87
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	460,498,153.97	16,607,664.71	2,672.80
经营活动产生的现金流量净额	8,497,247,498.52	-2,035,917,573.58	不适用
其他综合收益	136,956,848.45	-132,805,997.46	不适用
	本报告期末	上年度末	本报告期末 比上年度末 增减(%)
资产总额	103,254,950,137.72	98,208,310,131.14	5.14
负债总额	78,375,435,351.57	74,359,447,723.25	5.40
归属于母公司股东的权益	23,917,091,453.90	23,119,404,806.73	3.45
所有者权益总额	24,879,514,786.15	23,848,862,407.89	4.32

##### (二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上 年同期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.06	0.01	500.00
稀释每股收益(元/股)	0.06	0.01	500.00

扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.05	0.002	2,400.00
加权平均净资产收益率（%）	2.33	0.21	增加2.12个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	1.95	0.07	增加1.88个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

### (三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	15,354,448,280.12	15,273,877,771.43
净资产	23,270,673,978.29	22,737,509,906.42
各项风险资本准备之和	12,781,551,553.17	12,337,245,668.61
表内外资产总额	86,013,565,950.37	81,528,521,083.98
风险覆盖率(%)	120.13	123.80
资本杠杆率(%)	16.46	16.99
流动性覆盖率(%)	392.95	615.81
净稳定资金率(%)	125.82	125.80
净资本/净资产（%）	65.98	67.17
净资本/负债（%）	25.25	26.90
净资产/负债（%）	38.27	40.04
自营权益类证券及证券衍生品/净资本（%）	8.92	7.77
自营非权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	249.05	228.23

### 八、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

### 九、 非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-1,815,222.29	
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	114,468,686.06	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	9,093,342.04	
减：所得税影响额	30,436,701.45	
少数股东权益影响额（税后）	2,595.20	
合计	91,307,509.16	

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



## 十、其他

√适用 □不适用

## (一)合并财务报表主要项目

项目	2023年6月30日	2022年12月31日	增减幅度 (%)
货币资金	21,053,972,951.01	20,233,335,089.50	4.06
结算备付金	1,694,241,489.27	2,413,937,268.31	-29.81
融出资金	4,554,169,518.12	4,286,800,525.51	6.24
衍生金融资产	88,110,207.35	129,466,897.78	-31.94
存出保证金	557,084,057.02	611,759,826.83	-8.94
应收款项	3,693,523,876.30	3,771,907,295.38	-2.08
买入返售金融资产	3,198,980,203.69	2,590,644,064.44	23.48
持有待售资产		1,388,275,534.30	-100.00
交易性金融资产	38,180,092,595.81	36,742,789,304.50	3.91
债权投资	1,928,949,773.64	2,071,079,051.62	-6.86
其他债权投资	5,415,331,384.21	1,501,182,197.41	260.74
其他权益工具投资	1,582,310,354.73	1,032,425,535.43	53.26
长期股权投资	2,862,293,676.89	3,214,312,807.94	-10.95
投资性房地产	639,464,141.03	614,569,547.83	4.05
固定资产	503,231,260.53	543,211,535.23	-7.36
使用权资产	568,703,045.81	562,587,931.89	1.09
无形资产	318,699,454.85	345,591,107.77	-7.78
商誉	51,424,882.46	51,424,882.46	
递延所得税资产	986,190,851.04	955,203,024.21	3.24
其他资产	15,378,176,413.96	15,147,806,702.80	1.52
资产总计	103,254,950,137.72	98,208,310,131.14	5.14
短期借款	1,319,104,364.45	1,276,014,426.35	3.38
应付短期融资款	6,131,364,091.09	4,460,029,113.94	37.47
拆入资金	4,380,929,440.99	4,605,561,468.90	-4.88
交易性金融负债	1,814,893,319.88	761,480,634.32	138.34
衍生金融负债	80,256,123.42	19,374,920.30	314.23
卖出回购金融资产款	8,649,673,093.35	4,247,355,591.89	103.65
代理买卖证券款	8,439,821,896.99	9,127,671,450.63	-7.54
应付职工薪酬	132,069,646.28	284,671,511.72	-53.61
应交税费	74,878,273.94	78,916,102.41	-5.12
应付款项	6,836,203.11	2,696,802.56	153.49
合同负债	29,765,961.70	74,174,441.85	-59.87
应付债券	44,797,615,279.50	44,551,203,860.26	0.55
租赁负债	593,213,911.94	581,912,076.99	1.94
递延所得税负债	302,893,399.78	173,942,727.03	74.13
其他负债	1,622,120,345.15	4,114,442,594.10	-60.57
负债合计	78,375,435,351.57	74,359,447,723.25	5.40
实收资本(或股本)	8,665,757,464.00	8,665,757,464.00	
资本公积	13,586,512,417.60	13,410,342,195.12	1.31

减：库存股	252,589,862.14	252,589,862.14	
其他综合收益	-789,588,297.13	-860,055,290.15	不适用
盈余公积	327,819,540.82	327,819,540.82	
一般风险准备	882,552,245.47	882,552,245.47	
未分配利润	1,496,627,945.28	945,578,513.61	58.28
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	23,917,091,453.90	23,119,404,806.73	3.45
少数股东权益	962,423,332.25	729,457,601.16	31.94
所有者权益（或股东权益）合计	24,879,514,786.15	23,848,862,407.89	4.32
<b>项目</b>	<b>2023 年半年度</b>	<b>2022 年半年度</b>	<b>增减幅度（%）</b>
营业总收入	2,160,128,155.26	1,130,265,856.55	91.12
利息净收入	-896,405,235.34	-554,246,760.42	不适用
手续费及佣金净收入	1,327,342,042.85	1,617,044,598.27	-17.92
投资收益	1,192,049,878.31	135,353,596.23	780.69
其他收益	13,995,672.17	11,716,114.35	19.46
公允价值变动收益	489,011,729.18	-99,772,667.50	不适用
汇兑收益	9,976,848.21	3,545,452.89	181.40
其他业务收入	25,461,029.09	18,190,781.54	39.97
资产处置收益	-1,303,809.21	-1,565,258.81	不适用
营业总支出	1,386,089,630.57	1,178,998,898.04	17.56
税金及附加	16,363,411.10	26,570,256.74	-38.41
业务及管理费	1,266,015,886.94	1,138,840,541.29	11.17
信用减值损失	91,387,581.83	2,249,576.58	3,962.43
其他业务成本	12,322,750.70	11,338,523.43	8.68
营业利润	774,038,524.69	-48,733,041.49	不适用
营业外收入	111,783,755.97	40,248,297.27	177.74
营业外支出	2,728,813.12	3,633,955.36	-24.91
利润总额	883,093,467.54	-12,118,699.58	不适用
所得税费用	181,100,345.36	-74,406,069.06	不适用
净利润	701,993,122.18	62,287,369.48	1,027.02
归属于母公司股东的净利润	551,805,663.13	51,673,609.35	967.87
少数股东损益	150,187,459.05	10,613,760.13	1,315.03
其他综合收益的税后净额	136,956,848.45	-132,805,997.46	不适用
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额	69,633,575.55	-104,929,306.73	不适用
综合收益总额	838,949,970.63	-70,518,627.98	不适用

## (二) 母公司报表主要项目

项目	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日	增减幅度（%）
货币资金	19,565,318,617.64	18,799,130,049.07	4.08
结算备付金	1,688,840,935.84	2,403,646,581.10	-29.74

融出资金	4,554,169,518.12	4,286,800,525.51	6.24
衍生金融资产	68,387,929.19	128,432,939.54	-46.75
存出保证金	460,669,735.32	434,255,810.17	6.08
应收款项	634,661,571.11	648,068,916.20	-2.07
买入返售金融资产	4,295,916,263.77	4,017,007,551.20	6.94
持有待售资产		1,388,275,534.30	-100.00
交易性金融资产	27,752,907,957.64	28,353,242,820.80	-2.12
债权投资	1,928,949,773.64	2,071,079,051.62	-6.86
其他债权投资	5,415,331,384.21	1,225,705,852.19	341.81
其他权益工具投资	674,604,817.92	166,728,556.90	304.61
长期股权投资	6,765,783,572.54	7,115,626,149.75	-4.92
投资性房地产	289,422,313.59	293,266,213.01	-1.31
固定资产	74,634,491.97	83,065,909.14	-10.15
使用权资产	712,192,226.82	709,131,879.86	0.43
无形资产	121,969,380.14	135,535,487.57	-10.01
递延所得税资产	667,874,234.39	641,225,852.05	4.16
其他资产	15,875,502,592.92	15,088,556,348.09	5.22
资产总计	91,547,137,316.77	87,988,782,028.07	4.04
应付短期融资款	5,806,224,005.48	4,152,745,369.87	39.82
拆入资金	4,380,929,440.99	4,605,561,468.90	-4.88
衍生金融负债	53,614,223.68	14,941,633.00	258.82
卖出回购金融资产款	8,191,436,748.58	3,818,944,695.86	114.49
代理买卖证券款	7,462,222,078.97	8,470,799,019.43	-11.91
应付职工薪酬	97,334,753.66	212,561,638.32	-54.21
应交税费	19,644,286.87	24,925,626.41	-21.19
合同负债	16,003,778.86	15,641,865.04	2.31
应付债券	40,382,986,909.36	40,267,530,040.67	0.29
租赁负债	743,599,754.27	728,588,301.20	2.06
递延所得税负债	165,922,084.66	40,060,378.79	314.18
其他负债	956,545,273.10	2,898,972,084.16	-67.00
负债合计	68,276,463,338.48	65,251,272,121.65	4.64
实收资本（或股本）	8,665,757,464.00	8,665,757,464.00	
资本公积	13,409,766,313.42	13,233,596,090.94	1.33
减：库存股	252,589,862.14	252,589,862.14	
其他综合收益	-226,131,922.67	-262,754,953.19	不适用
盈余公积	327,819,540.82	327,819,540.82	
一般风险准备	710,941,648.73	710,941,648.73	
未分配利润	635,110,796.13	314,739,977.26	101.79
所有者权益（或股东权益）合计	23,270,673,978.29	22,737,509,906.42	2.34
负债和所有者权益（或股东权益）总计	91,547,137,316.77	87,988,782,028.07	4.04
<b>项目</b>	<b>2023 年半年度</b>	<b>2022 年半年度</b>	<b>增减幅度（%）</b>
营业总收入	1,504,620,617.18	237,307,176.51	534.04
利息净收入	-611,087,977.24	-600,054,720.49	不适用
手续费及佣金净收入	935,893,125.16	943,399,452.82	-0.80

投资收益	759,016,677.60	195,706,446.79	287.83
其他收益	13,414,957.27	10,694,731.57	25.44
公允价值变动收益	406,436,135.39	-305,544,689.64	不适用
汇兑收益	-18,476,566.63	-21,709,319.76	不适用
其他业务收入	20,722,860.75	16,380,393.90	26.51
资产处置收益	-1,298,595.12	-1,565,118.68	不适用
营业总支出	1,097,479,053.14	833,432,041.31	31.68
税金及附加	11,046,816.79	13,367,686.51	-17.36
业务及管理费	993,434,940.65	847,001,065.67	17.29
信用减值损失	89,153,396.28	-30,887,969.53	不适用
其他业务成本	3,843,899.42	3,951,258.66	-2.72
营业利润	407,141,564.04	-596,124,864.80	不适用
营业外收入	8,576,754.97	40,007.25	21,338.00
营业外支出	1,605,286.88	2,441,779.09	-34.26
利润总额	414,113,032.13	-598,526,636.64	不适用
所得税费用	92,455,779.74	-147,633,086.11	不适用
净利润	321,657,252.39	-450,893,550.53	不适用
其他综合收益的税后净额	35,259,410.99	-19,201,567.58	不适用
综合收益总额	356,916,663.38	-470,095,118.11	不适用

## 第三节 管理层讨论与分析

### 一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

#### （一）报告期内公司所属行业情况

2023 年上半年，我国经济呈现回升向好态势，国家出台了一系列稳增长的经济政策，维护市场稳定，促进经济发展。资本市场全面深化改革纵深推进，全面注册制正式实施，启动不动产私募投资基金试点，基础设施领域不动产投资信托基金（REITs）常态化发行，30 年期国债期货注册，企业债券发行审核职责划转，债券注册制改革等不断推进，上述改革均将为证券行业的发展注入新的活力。作为当前行业发展的主要着力点，财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务等有望借助改革东风，加快创新发展进程，成为行业发展的主要增长点。

近年来，公司坚持综合金融发展方向，打造以全天候资产管理能力、全方位大投行服务能力双轮驱动、两翼齐飞的证券公司。在从以产品为中心转向以客户为中心的综合金融服务转型过程中，着力增强服务实体经济能力，持续提升合规风控水平，稳步推进各项业务发展，着力推进公司向高质量转型发展。

#### （二）报告期内公司从事的主营业务情况说明

上半年，公司一方面调整发展策略，围绕“瘦身止损、提质增效”战略方针，聚焦主业；一方面继续保持积极努力开展业务的劲头，确保经营稳定发展。

##### 1、经纪业务

报告期末，公司实现经纪业务收入 7.60 亿元，同比增长 2.41%。公司积极优化网点布局，截至报告期末，公司托管客户资产规模 2,175.86 亿元，累计交易额 8,431.86 亿元（不含席位租赁），股基交易市占率万分之 33.81。此外，投教工作佳绩再续，在中国证监会 2022-2023 年度国家级投教基地考核中获“优秀”评级（最高级，共 30 家券商获评此项荣誉）；在上交所举办的全面注册制投资者保护主题活动中荣获“优秀实践案例”（共 15 家券商入选）。

##### 2、投行业务

报告期内，公司实现投资银行业务收入 4.59 亿元。债权投行方面，上半年完成债券承销规模共计 655.10 亿元，其中企业债承销总规模 94.42 亿元，市场排名第 2；私募公司债承销总规模 431.11 亿元，市场排名第 8。（数据来源：Wind）股权投行业务方面，完成中科磁业创业板 IPO 项目，重点推动实施了协创数据与青松建化的定向增发项目。目前在执行和储备项目中，IPO、北交所项目 19 个，再融资项目 9 个，新三板项目 54 个，股权储备项目较往年有所增加。

##### 3、自营业务

报告期内，面对权益市场结构性分化，公司密切关注资本市场变化，强化风险管理，力争把握市场的结构性机会，调整投资品种，稳步推进低风险策略投资，控制投资仓位，同时把握上半年固收市场震荡偏强的投资机遇，积极布局债券投资，上半年自营业务实现营业收入 13.45 亿元，同比大幅增加 787.42%。

#### 4、资产管理业务

公司资产管理业务发展总体平稳，报告期内资管子公司持续优化业务结构，完善投研体系建设，进一步提升主动管理能力。截至报告期末，公司资管业务营业收入 3.38 亿元；公司资产管理业务受托客户资金规模合计 1,082.69 亿元；根据中基协数据统计，上半年公司 ABS 管理月均规模 538.64 亿元，位列行业第 8 位。

#### 5、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 24 只，认缴规模 53.51 亿元，实缴规模 42.30 亿元。此外，报告期内完成了多个项目的平稳退出，2 个投资项目创业板 IPO 上市。

#### 6、海外业务

公司通过子公司天风国际从事海外业务。2022 年天风国际获批了香港证监会颁发的第 6 类牌照（保荐业务牌照），报告期内成功完成港股 IPO 保荐项目、美股承销项目各 1 单，另有多个港美股重点承销项目正在进行。

#### 7、另类投资业务

公司通过子公司天风创新从事另类投资业务。报告期内，天风创新积极应对复杂多变的外部环境，全力盘活存量资产，主动压缩对外投资，调整业务结构，取得积极成效。报告期内完成 3 个项目退出。

## 二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

### （一）清晰的业务布局

公司坚持综合金融发展方向，打造以“全天候资产管理能力、全方位大投行服务能力”双轮驱动、两翼齐飞的证券公司。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资产管理需求。另一方面，持续突出服务实体经济、服务国家双碳战略的功能定位，坚持“服务实体经济、服务中小企业”的经营宗旨，为客户提供股权融资、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，公司还加强对宏观经济的研究，强化研究业务服务国家战略和实体经济的能力。

### （二）极具潜力的区位优势

湖北省是我国中部崛起的重要战略支点，在国家和区域发展中的战略地位持续提升。2021 年 4 月，湖北省印发《金融业发展十四五规划》，明确提出更大力度做强地方法人机构，瞄准“四倍增、一高地”目标，推动资本市场建设，拓宽直接融资渠道。包括：上市后备企业数量倍增，力争完成 1,000 家左右企业的股份制改造，动态保持 2,000 家左右的后备资源梯队；上市公司数量倍增，力争每年新增上市公司 20 家左右，上市公司数量达到 230 家以上；私募股权投资基金规模

倍增，吸引更多国内外头部投资机构落户湖北；直接融资规模倍增，十四五期间全省直接融资总额超过 1 万亿元；打造中部资本市场高地，打造有吸引力和竞争力的区域资本市场，就此方面，公司拥有极具潜力的区位优势。

### （三）卓越的研究能力

公司研究所拥有 210 余名研究人员，研究覆盖近 3,000 家 A 股上市公司、近 700 家海外上市公司，实现 38 个研究领域全覆盖。公司研究所以产业链研究方法为核心，致力于打造国家级产业研究智库，为产业、上市公司、二级市场投资者服务。以对产业资源的整合能力及产业投资机遇和趋势洞悉作为核心竞争力，在资本与实业之间搭建桥梁和纽带，为各级市场主体提供研究咨询、挖掘投资机会等服务。为持续夯实市场竞争优势，公司研究所建立了完善的人才培养机制，通过以老带新帮助内生培养的中生代分析师快速成长，人才梯队实现可持续迭代优化。近年来，公司研究所在市场各大主流评选中稳居行业前列。在 2022 年第二十届“新财富”最佳分析师评选中，公司研究所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，最佳分析师评选共有 19 个行业入围，其中 13 个行业斩获前五名。

### （四）人才队伍成建制

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积聚、培训、再发掘的机制。公司骨干队伍在综合金融领域管理经验丰富、业务能力强，是公司稳定发展的重要因素。与此同时，公司近年来引进和培养了一批年轻的业务骨干，为未来持续保持市场竞争力提供了充裕的人才储备。

## 三、经营情况的讨论与分析

公司及子公司从事的主要业务包括证券经纪业务、投资银行业务、自营业务、研究业务、资产管理业务、私募基金管理业务、另类投资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（或分公司）接受客户委托代理客户买卖证券，是证券公司的一项传统业务。此外，还包括代理销售金融产品、期货中间介绍、代理还本付息、分红派息、证券代保管、鉴证以及代理登记开户等服务。公司通过提供相关服务，获得手续费、佣金等收入。信用交易业务主要是指公司向客户出借资金或出借证券并收取担保物，收取利息等收入。

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

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

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

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

公司通过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。

公司通过子公司天风创新开展证券公司另类投资业务。

公司通过境外子公司天风国际集团拓展海外业务。

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

适用 不适用

#### 四、报告期内主要经营情况

##### (一) 主营业务分析

##### 1 财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例（%）
营业收入	2,160,128,155.26	1,130,265,856.55	91.12
营业成本	1,386,089,630.57	1,178,998,898.04	17.56
经营活动产生的现金流量净额	8,497,247,498.52	-2,035,917,573.58	不适用
投资活动产生的现金流量净额	-3,926,306,716.71	364,630,498.20	-1,176.79
筹资活动产生的现金流量净额	432,997,248.94	3,647,507,141.28	-88.13

营业收入变动原因说明：2023 年上半年，本公司实现营业收入 21.60 亿元，同比上涨 91.12%，其中投资收益 11.92 亿元，同比上涨 780.69%，公允价值变动收益 4.89 亿元，较去年同期-1.00 亿元增加 5.89 亿元；

营业成本变动原因说明：主要为业务及管理费及信用减值损失上升；

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要为回购业务现金流入导致；

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要为投资支付的现金增加；

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要为偿还债务支付的现金增加。

##### 2 本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

##### (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

##### (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

##### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期	上年期末数	上年	本期期	情况说明
------	-------	----	-------	----	-----	------



		期末数占总资产的比例 (%)		期末数占总资产的比例 (%)	末金额较上年期末变动比例 (%)	
衍生金融资产	88,110,207.35	0.09	129,466,897.78	0.13	-31.94	衍生金融资产规模减少
持有待售资产			1,388,275,534.30	1.41	-100.00	持有待售资产规模减少
其他债权投资	5,415,331,384.21	5.24	1,501,182,197.41	1.53	260.74	其他债权投资规模增加
其他权益工具投资	1,582,310,354.73	1.53	1,032,425,535.43	1.05	53.26	其他权益工具投资规模增加
应付短期融资款	6,131,364,091.09	5.94	4,460,029,113.94	4.54	37.47	应付短期融资款规模增加
交易性金融负债	1,814,893,319.88	1.76	761,480,634.32	0.78	138.34	交易性金融负债规模增加
衍生金融负债	80,256,123.42	0.08	19,374,920.30	0.02	314.23	衍生金融负债规模增加
卖出回购金融资产款	8,649,673,093.35	8.38	4,247,355,591.89	4.32	103.65	卖出回购金融资产款规模增加
应付职工薪酬	132,069,646.28	0.13	284,671,511.72	0.29	-53.61	应付职工薪酬减少
应付款项	6,836,203.11	0.01	2,696,802.56	0.00	153.49	应付款项增加
合同负债	29,765,961.70	0.03	74,174,441.85	0.08	-59.87	合同负债减少
递延所得税负债	302,893,399.78	0.29	173,942,727.03	0.18	74.13	主要为交易性金融资产公允价值与账面成本差异导致
其他负债	1,622,120,345.15	1.57	4,114,442,594.10	4.19	-60.57	主要为其他流动负债和预收款项减少
未分配利润	1,496,627,945.28	1.45	945,578,513.61	0.96	58.28	本期利润增加
少数股东权益	962,423,332.25	0.93	729,457,601.16	0.74	31.94	本期归属于少数股东的权益增加

#### 其他说明

截至 2023 年 6 月 30 日，本公司资产总额为 1,032.55 亿元，较年初增长 50.47 亿元，增幅 5.14%。扣除代理买卖证券款及代理承销证券款后，本公司资产总额为 948.15 亿元，较年初增长 57.34 亿元，增幅 6.44%。其中：交易性金融资产 381.80 亿元，占总资产的 36.98%；货币资金 210.54 亿元，占总资产的 20.39%；融出资金 45.54 亿元，占总资产的 4.41%。公司整体资产流动性较强。

截至 2023 年 6 月 30 日，本公司负债总额为 783.75 亿元，较年初增长 40.16 亿元，增幅 5.40%。扣除代理买卖证券款及代理承销证券款后，本公司负债总额为 699.36 亿元，较年初增长 47.04 亿元，增幅 7.21%。其中，应付债券 447.98 亿元，占总负债的 57.16%；代理买卖证券款 84.40 亿元，占总负债的 10.77%；卖出回购金融资产款 86.50 亿元，占总负债的 11.04%。

期末扣除代理买卖证券款及代理承销证券款的资产负债率为 73.76%，较年初的 73.23%略有增长，资产负债结构稳定。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司表内股票质押式回购业务规模 1.39 亿元，平均维持担保比例为 312.02%，表外股票质押式回购业务规模为 6 亿元。

项目	本期末业务规模 (亿元)	2022 年业务规模 (亿元)	业务规模变动(同 比)
股票质押式回购业务	1.39	0.40	247.50%
融资融券业务融出资金	45.63	42.96	6.22%
合计	47.02	43.36	8.44%

## 2. 境外资产情况

适用 不适用

### (1) 资产规模

其中：境外资产 124.69（单位：亿元 币种：人民币），占总资产的比例为 12.08%。

### (2) 境外资产占比较高的相关说明

适用 不适用

其他说明

无

## 3. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

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

## 4. 其他说明

适用 不适用

## (四) 投资状况分析

### 1、 对外股权投资总体分析

适用 不适用

报告期末，公司合并报表口径长期股权投资 286,229.37 万元，去年期末值为 321,431.28 万元，较去年期末减少 35,201.91 万元。

**(1).重大的股权投资**

适用 不适用

**(2).重大的非股权投资**

适用 不适用

**(3).以公允价值计量的金融资产**

适用 不适用

具体内容详见本报告“第十节之十二、公允价值的披露及十八、其他重要事项 9、以公允价值计量的资产和负债”。

证券投资情况

适用 不适用

证券投资情况的说明

适用 不适用

自营业务为证券公司的主营业务，交易频繁、交易品种类别较多，公司已按科目披露金融资产投资的投资类别、公允价值变动、投资收益等情况，具体内容详见本年度报告“第十节 财务报告七、合并财务报表项目注释 13、交易性金融资产，15、其他债权投资，16、其他权益工具投资”。

私募基金投资情况

适用 不适用

衍生品投资情况

适用 不适用

具体内容详见本报告“第十节 财务报告七、合并财务报表项目注释 6、衍生金融工具”。

## (五) 重大资产和股权出售

√适用 □不适用

公司于 2022 年 9 月 30 日与北京华融综合投资有限公司（以下简称“北京华融”）签订了《北京华融综合投资有限公司与天风证券股份有限公司关于恒泰证券股份有限公司之股份转让协议》（以下简称“《股份转让协议》”），《股份转让协议》约定向北京华融出售公司持有的恒泰证券的内资股股份中的 249,397,261 股（占恒泰证券总股份数的 9.5754%），本次交易的转让价格合计为人民币 1,800,000,000 元，标的股份的转让价格约为每股人民币 7.22 元，该事项于 2022 年 9 月 30 日经公司第四届董事会第二十六次会议审议通过。上述股权转让于 2023 年 2 月 17 日过户完成。具体内容详见公司分别于 2022 年 10 月 1 日、2023 年 2 月 8 日及 2023 年 2 月 21 日披露的相关公告。

本次股权转让后，截至 2023 年 6 月 30 日，公司对恒泰证券剩余持股比例为 16.92%，期末余额详见本报告“第十节财务报告 七、合并财务报表 注释项目 17、长期股权投资”的相关内容。

## (六) 主要控股参股公司分析

√适用 □不适用

### 1、重要控股子公司经营情况及业绩

(1) 天风天睿投资有限公司，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。天风天睿于 2023 年 5 月 11 日完成公司名称变更，由“天风天睿投资股份有限公司”变更为“天风天睿投资有限公司”，并于 2023 年 6 月 30 日完成工商减资登记，注册资本由 154,328.46 万元变更为 77,214.03 万元，公司持有其 100.00% 股权。截至报告期末，天风天睿总资产人民币 1,559,716 万元，净资产人民币 196,195 万元；2023 年上半年实现营业收入人民币 14,186 万元，利润总额人民币 10,937 万元，净利润人民币 9,658 万元。

(2) 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 53,482 万元，净资产人民币 50,886 万元；2023 年上半年实现营业收入人民币 3,824 万元，利润总额人民币 3,725 万元，净利润人民币 2,768 万元。

(3) 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 103,400 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 1,246,948 万元，净资产人民币 112,215 万元；2023 年上半年实现营业收入人民币 17,948 万元，利润总额人民币 6,570 万元，净利润人民币 6,286 万元。

(4) 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 100,000 万元，公司持有其 100% 的股权。截至报告期末，天风资管总资产人民币 260,860 万元，净资产人民币 196,930 万元；2023 年上半年实现营业收入人民币 30,855 万元，利润总额人民币 25,575 万元，净利润人民币 19,193 万元。

## 2、重要的参股公司经营情况及业绩

(1) 紫金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、期货投资咨询业务，并通过全资子公司深圳天风天成资产管理有限公司开展受托资产管理业务，通过全资子公司紫金天示(上海)企业管理有限公司开展风险管理业务。注册资本人民币 52,440 万元，公司持有其 43.46%的股权。截至报告期末，紫金天风期货合并口径总资产人民币 1,066,044 万元，净资产人民币 66,893 万元；实现营业收入人民币 85,808 万元，利润总额人民币 533 万元，净利润人民币 457 万元。

(2) 恒泰证券股份有限公司，注册资本人民币 260,457 万元。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。截至报告日，公司持有恒泰证券 16.92%股权。截至报告期末，恒泰证券合并总资产人民币 3,163,470 万元，净资产人民币 837,148 万元；上半年实现营业收入人民币 113,332 万元，利润总额人民币 21,106 万元，净利润人民币 15,948 万元。

## 3、报告期内处置子公司及参股公司的情况

### (1) 恒泰证券股权转让情况

2022 年 9 月 30 日，公司与北京华融签订了《北京华融综合投资有限公司与天风证券股份有限公司关于恒泰证券股份有限公司之股份转让协议》，协议约定向北京华融出售公司持有的恒泰证券的内资股股份中的 249,397,261 股（占恒泰证券总股份数的 9.5754%），此次交易的转让价格合计为人民币 1,800,000,000 元，标的股份的转让价格约为每股人民币 7.22 元。公司于 2023 年 2 月 20 日收到中国证券登记结算有限责任公司出具的《过户登记确认书》，恒泰证券股份的过户登记手续已经完成，过户日期为 2023 年 2 月 17 日。

### (2) 转让部分宜宾商行股份

报告期内，根据公司战略安排，转让部分宜宾商行股份，截至报告期末，公司对宜宾商行剩余持股比例约 4.99%。因未派驻董事对其不再具有重大影响，故宜宾商行不再属于公司联营企业。

## (七) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

截至 2023 年 6 月 30 日，本公司合并 14 家结构化主体，主要为资产管理计划。公司对担任结构化主体的管理人或投资顾问，且持有产品份额的结构化主体，综合考虑公司拥有的投资决策权、可变回报的敞口及运用投资决策权影响可变回报等因素后，将公司拥有控制权的结构化主体纳入合并报表范围。

## 五、其他披露事项

### (一) 可能面对的风险

√适用 □不适用

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

#### （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，不能及时向本公司偿还相应债务的风险；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，就业制度和场所安全，客户、产品和业务活动，实物资产损坏，营业中断和信息技术系统瘫痪，执行、交割和流程管理。

#### （4）流动性风险

流动性风险，是指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

洗钱风险是指由于各种方式掩饰、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等引发的风险。

#### （8）廉洁从业风险

廉洁从业风险指公司及公司工作人员在开展证券业务及相关活动中，未严格遵守法律法规、中国证监会的规定和行业自律规则，未遵守社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，未公平

竞争和合规经营，未忠实勤勉，未诚实守信，直接或者间接向他人输送不正当利益或者谋取不正当利益的风险。

## 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) 建立全面的风险管理体系

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，建立了风险管理组织架构的四个层级，覆盖公司业务开展的各个领域。公司风险管理架构体系如下：第一层为董事会及其下设的风险管理委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会以及监事会；第二层为公司总裁办公会及其下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监；第三层为承担风险管理职能的部门，具体包括风险管理部、合规法律部、资金计划部、财务核算部、品牌管理部、纪检监察部；第四层为公司除风险管理职能部门之外的各部门、分支机构、子公司及公司全体成员。各风险管理层级在各自的职责范围内履行风险管理的职责。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，在其授权范围内开展交易并负责投资风险管理工作，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、业务部门和全公司等不同层级的市场风险状况进行独立监控、计量和管理，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，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。此外，风险管理部持续与业务部门/条线人员沟通最新市场状况、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，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。对于涉及信用风险的业务，公司根据业务特点制定准入要求，设置相应的交易对手、

标的证券、或项目层面的准入规则；通过准入管理、内部评级管理、授信管理、压力测试管理、多维度集中度管理、舆情管理和盯市、风险处置等管理措施，对公司涉及信用风险的业务进行事前、事中和事后信用风险管控。

### ③操作风险管理

公司持续强化操作风险管理，建立操作风险管理体系，建立与优化操作制度、指标、系统、流程、报送机制等。通过三大工具展开操作风险管理：定期组织开展操作风险识别与评估的自评工作，通过流程梳理及时发现公司运行中存在的不足和缺陷并补充完善；建立并监控关键风险指标体系，对指标反映的问题及时整改，并根据公司实际及时对指标进行更新；建立操作风险事件上报机制，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，针对已发生的操作风险事项，公司及时分析其产生的原因及造成的影响并进行风险提示或警示，及时对事项进行解决完善。

### 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。公司流动性风险管理部门跟进公司融资项目进展，包括但不限于各类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意见供业务部门和公司总办会参考，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。

#### ⑦洗钱风险管理

公司根据《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》要求，结合自身的反洗钱工作实际特点，从反洗钱机构设置、反洗钱制度建设与执行、客户尽职调查、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、反洗钱名单监控、洗钱和恐怖融资风险评估、反洗钱内部检查和审计、反洗钱协查工作、反洗钱宣传和培训、反洗钱监控系统运行、人员配备、反洗钱保密等方面积极开展了工作。公司持续加强战略层面布局，加大人才队伍建设与科研技术投入，构建更加坚实、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。

#### ⑧廉洁从业风险管理

公司纪检监察部是负责公司及工作人员廉洁从业管理的职能部门，着力推进党风廉政建设、清廉企业建设、廉洁文化建设及监督执纪等工作，对公司员工履行职责、行使权力、廉洁从业以及道德操守情况进行监督检查，调查、处置监督对象违纪违法案件。定期和不定期组织开展廉洁从业检查工作，加强对内控制度执行情况的检查，针对不同时期重点工作任务和突出问题开展专项检查。组织各部门对各岗位的廉洁风险点进行梳理，制定精准的防控措施。制定员工廉洁从业管理扣分标准及廉洁从业的容忍度指标，将员工的廉洁从业情况纳入考核范围。重点关注行业廉洁从业监管政策、监管处罚动态，结合公司实际工作情况常态化开展廉洁从业宣传教育活动，强化职工廉洁从业意识。

## (二) 其他披露事项

适用 不适用

## 第四节 公司治理

### 一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2022 年年度股东大会	2023-05-18	上海证券交易所网站	2023-05-19	详见公司披露的《天风证券股份有限公司 2022 年年度股东大会决议公告》（公告编号：2023-024 号）

### 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

### 股东大会情况说明

适用 不适用

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

上述股东大会的议案全部审议通过，不存在否决议案的情况。

### 二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用 不适用

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

### 三、利润分配或资本公积金转增预案

#### 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

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

### 四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

#### (一) 相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

#### (二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

## 第五节 环境与社会责任

### 一、环境信息情况

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

适用 不适用

#### (二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

##### 1. 因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

##### 2. 参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

公司积极践行企业的环境责任。不断夯实研究能力，为绿色发展建言献策；积极推进绿色业务，以金融力量支持经济社会绿色低碳发展；努力提升能效管理水平，促进自身节能减排、节约资源。公司定期披露履行环境责任有关情况。

##### 3. 未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

#### (三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

#### (四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

适用 不适用

作为金融企业，公司深耕绿色金融，助力实体经济绿色发展，积极履行环境责任。

公司积极开展绿色研究。公司捐资设立的中央财经大学绿色金融国际研究院，开展气候金融，绿色金融和能源金融等前沿研究；公司研究所设立 ESG 研究岗位，围绕 ESG 投资、气候变化、能源转型等前沿议题及企业绿色低碳发展等方面进行研究。

公司积极推进绿色业务。在绿色融资方面，2023 年上半年，公司承销山东方正控股集团、无锡市太湖新城资产等公司的绿色债券及柳州银行绿色金融债券，引导和激励更多社会资本有序投入绿色产业。

#### (五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

适用 不适用

在减少碳排放方面，2023 年上半年，公司推进扎实推进《天风证券“碳达峰 碳中和”行动方案》落地，通过线上集约管理实现资源共享，提升能效管理水平，争做低碳经营的践行者。

在排放物管理方面：公司启用企业用车相关 APP，整合员工出差需求，推进视频会议，减少大气污染物排放；对办公产生的污水全部通过市政生活污水管网进行统一末端处理；设立固废回收箱，定期委托专业单位收集处理有害废弃物；食堂就餐采用小碗菜勤拿少取、减少食物浪费，

倡导员工堂食、减少“打包”就餐对包装产品的资源浪费；推广无纸化办公，在公司内部推行自动化办公系统，对外宣传提倡使用新媒体等。

在资源能源管理方面：公司在天风大厦顶楼设立太阳能发电设备，促进资源的可持续利用；鼓励双面打印，鼓励使用线上资源；在醒目位置张贴“节约用水”“节约用纸”“随手关灯”等标识，积极推行绿色办公；引入电动汽车充电桩，鼓励员工使用新能源汽车；优先使用节能器具，如节水便池、节能灯管、低耗能空调等。

## 二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

√适用 □不适用

2023 年上半年，公司积极响应党中央号召，深入国家级脱贫县房县、秭归县、阳新县等地推进乡村振兴工作，围绕产业帮扶、智力帮扶、公益帮扶、组织振兴等方面，持续帮助脱贫地区发展。

在产业帮扶方面，公司发挥专业特长，为脱贫县政府提供针对性产业发展规划，公司前往阳新县进行乡村振兴工作调研，通过走访当地的茶企、手工皂制作生产基地，提出针对性产业规划方案。

在智力帮扶方面，公司参与房县定点帮扶工作，公司联合武汉大学、华中师范大学在房县开展养老、涉农领域的防范非法集资宣讲，帮助村民和老年人等重点人群提高风险防范意识，助力乡村振兴。

在公益帮扶方面，公司上半年积极推进“橙才计划”乡村振兴公益支教活动，联合高校志愿者赴房县等地推进公益支教课程，助力脱贫县学子完成学业；公司积极参与秭归县“幸福小区”社区志愿服务活动，开展助老帮残等各类社区服务；在灵寿县岔头镇中心小学设立奖助学金，助力当地优秀学子完成学业。

在组织振兴方面，公司多个党支部与台江县老屯乡长滩村党支部、房县窑淮镇窑场村党支部、秭归县九畹溪镇中阳坪村党支部等开展党建共建活动，学习习近平新时代中国特色社会主义思想 and 习近平总书记关于乡村振兴的重要论述精神，交流学习经验，持续深化帮扶协作，巩固拓展帮扶成效。

下一步，公司将在公司党委的领导下，在帮助脱贫县更新融资观念、凝聚公益力量、改善生态环境、提供医疗支持等方面持续发力，推进《天风证券促进实现共同富裕行动计划》落地落细，为乡村振兴发展贡献金融力量。

## 第六节 重要事项

### 一、承诺事项履行情况

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

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	宏泰集团	<p>1.人员独立：保证上市公司的董事、监事及高级管理人员均按照法律、法规规范性文件及公司章程的规定选举、更换、聘任或解聘，不超越董事会和股东大会违法干预上市公司上述人事任免；采取有效措施保证上市公司的总经理、副总经理、财务负责人、董事会秘书等高级管理人员专职在上市公司任职并在上市公司领取薪酬，不在承诺人及承诺人控制的除上市公司及其下属企业以外的其他企业兼任除董事、监事外的其他职务；保证上市公司在劳动、人事管理体系方面独立于承诺人。</p> <p>2.资产完整：保证上市公司具有完整的经营性资产及住所，并独立于承诺人；保证承诺人及承诺人控制的除上市公司及其下属企业以外的其他企业不违规占用上市公司的资金、资产及其他资源。</p> <p>3.机构独立：保证上市公司建立和完善法人治理结构以及独立、完整的组织机构，并规范运作；保证上市公司与承诺人及承诺人控制的除上市公司及其下属企业以外的其他企业之间在办公机构以及生产经营场所等方面完全分开。</p> <p>4.业务独立：保证上市公司拥有独立开展经营活动的资产、人员、资质以及具有独立面向市场自主经营的能力，在经营业务方面能够独立运作；保证除合法行使控股股东的权利外，不干预上市公司的经营业务活动；尽量减少与上市公司的关联交易，确有必要的关联交易，价格按照公平合理及市场化原则确</p>	长期有效	否	是	-	-

		<p>定，确保上市公司及其他股东利益不受到损害，并及时履行信息披露义务。</p> <p>5.财务独立：保证上市公司拥有独立的财务会计部门，建立独立的财务核算体系和财务管理制度；保证上市公司独立在银行开户，不与承诺人及承诺人控制的除上市公司及其下属企业以外的其他企业共用同一个银行账户，保证上市公司独立作出财务决策，承诺人及承诺人控制的除上市公司及其下属企业以外的其他企业不干预上市公司的资金使用；保证上市公司依法独立纳税；保证上市公司的财务人员独立，不在承诺人及承诺人控制的除上市公司及其下属企业以外的其他企业兼职及领取报酬。</p>					
解决关联交易	宏泰集团	<p>1.本公司及本公司控制或影响的企业不会利用上市公司实际控制人地位及重大影响，谋求上市公司及下属子公司在业务合作等方面给予本企业及本企业的关联方优于市场第三方的权利，或谋求与上市公司及下属子公司达成交易的优先权利，损害上市公司及其他股东的合法利益。本公司控制或影响的其他企业将严格避免向上市公司及其下属子公司拆借、占用上市公司及其下属子公司资金或采取由上市公司及其下属子公司代垫款、代偿债务等方式侵占上市公司资金。</p> <p>2.对于本公司及本公司控制或影响的企业与上市公司及其下属子公司之间必需的一切交易行为，均将严格遵守市场原则，本着平等互利、等价有偿的一般原则，公平合理地进行。交易定价有政府定价的，执行政府定价；没有政府定价的，执行市场公允价格；没有政府定价且无可参考市场价格的，按照成本加可比较的合理利润水平确定成本价执行。</p> <p>3.本公司与上市公司及其下属子公司之间的关联交易将严格遵守上市公司章程、关联交易管理制度等规定履行必要的法定程序。在上市公司权力机构审议有关关联交易事项时主动依法履行回避义务。</p> <p>4.本公司保证不通过关联交易取得任何不正当的利益或使上市公司及其下属子公司承担任何不正当的义务。如果因违反上述承诺导致上市公司或其下属子公司损失或利用关联交易侵占上</p>	长期有效	否	是	-	-

			市公司或其下属子公司利益的，上市公司及其下属子公司的损失由本公司承担。 5.上述承诺在本公司及本公司控制或影响的企业构成上市公司的关联方期间持续有效。					
	解决同业竞争	宏泰集团	本次收购完成后，本公司将依法采取必要及可能的措施尽力避免发生与上市公司主营业务产生实质性同业竞争及利益冲突的业务或活动，并按照有关法规，促使本公司控制的企业避免发生与上市公司主营业务产生实质性同业竞争或利益冲突的业务或活动。 本公司将严格遵守有关法律法规、证券监管规则以及上市公司章程等有关规定，不会利用上市公司控股股东的地位谋求不正当利益，进而损害上市公司其他股东尤其是中小股东的权益。	长期有效	否	是	-	-
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	商贸集团、宏泰集团	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 5%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	人福医药、联发投集团	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	已豁免	已豁免	-	-
	股份限售	当代科技	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 3.18%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	上海天阖	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 2.18%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	三特索道	承诺方在所持公司股份的锁定期满后两年内，转让股份数量累计不超过公司首次上市之日总股本的 0.55%等；减持公司股份时提前三个交易日公告。	在股票锁定期满后的两年内	是	是	-	-
	股份限售	商贸集团、人福医药、联发投集团、当代	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	长期有效	否	是	-	-



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

解决关联交易	商贸集团、人福医药、联发投集团、当代科技、上海天阖、三特索道	<p>1.本公司/企业将尽量减少和规范与天风证券及其控股子公司之间发生关联交易；</p> <p>2.不以向天风证券拆借、占用天风证券资金或采取由天风证券代垫款项、代偿债务等任何方式侵占天风证券资金或挪用、侵占天风证券资产或其他资源；不要求天风证券及其控股子公司违法违规提供担保；</p> <p>3.对于与天风证券及其控股子公司之间确有必要进行的关联交易，均将严格遵守公平公允、等价有偿的原则，公平合理地进行；关联交易均以签订书面合同或协议形式明确约定，并严格遵守有关法律法规、规范性文件以及天风证券公司章程、股东大会会议事规则、关联交易实施细则等相关规定，履行各项审批程序和信息披露义务，切实保护天风证券和天风证券其他股东利益；</p> <p>4.不通过关联交易损害天风证券以及天风证券其他股东的合法权益，如因违反上述承诺而损害天风证券及天风证券其他股东合法权益的，本公司/企业自愿赔偿由此对天风证券造成的一切损失；</p> <p>5.本公司/企业将促使并保证本公司的关联方遵守上述承诺，如有违反，本公司/企业自愿承担由此对天风证券造成的一切损失。</p>	长期有效	否	是	-	-
其他	全体董事、高级管理人员	<p>公司董事、高级管理人员针对公司填补回报措施能够得到切实履行作出如下承诺：</p> <p>1.承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益；</p> <p>2.承诺对董事和高级管理人员的职务消费行为进行约束；</p> <p>3.承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动；</p> <p>4.承诺由董事会或薪酬委员会制定的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩；</p> <p>5.承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。</p>	长期有效	否	是	-	-

与再融资相关的承诺	其他	宏泰集团	<p>关于本次认购资金来源，宏泰集团已出具《关于资金来源的承诺函》，承诺：</p> <p>1.本公司系依据中华人民共和国法律依法设立并有效存续的有限责任公司，符合法律、法规及规范性文件规定的认购上市公司向特定对象发行股票的条件；</p> <p>2.本公司用于认购天风证券本次发行股票的资金系本公司合法自有资金或通过合法方式自筹的资金，资金来源合法、合规，并拥有完全的、有效的处分权；不存在对外募集、代持、结构化安排或直接、间接使用发行人及其关联方资金的情形；不存在接受发行人、主要股东直接或通过其利益相关方提供财务资助、补偿、承诺收益或其他协议安排的情形。</p> <p>3.本次认购的股份不存在接受他人委托代为认购、代他人出资受托持股、信托持股及其他代持情形。</p> <p>4.本公司承诺不存在以下情形： （1）法律法规规定禁止持股；（2）本次发行的中介机构或其负责人、高级管理人员、经办人员等违规持股；（3）不当利益输送。</p>	长期有效	否	是	-	-
	解决同业竞争	宏泰集团	<p>1.本公司确认，截止本承诺出具之日，本公司及本公司直接、间接控制的公司、企业不存在与天风证券及其子公司从事相同、相似业务的情况，不存在构成重大不利影响的同业竞争的业务和经营。</p> <p>2.本公司作为天风证券控股股东期间，本公司及本公司直接或间接控制的其他企业将不会从事任何与天风证券的业务、经营构成竞争或可能构成竞争的业务，本公司所参股的企业，如从事与天风证券构成直接或间接竞争的经营业务或活动的，本公司将避免成为该等企业的控股股东或获得该等企业的实际控制权。</p> <p>3.本公司承诺给予天风证券与本公司其他控股、参股子公司同等待遇，避免损害天风证券及天风证券中小股东的利益。</p> <p>4.对于天风证券的正常生产、经营活动，本公司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。</p>	长期有效	否	是	-	-

			<p>5. 本公司保证上述承诺在本公司作为天风证券控股股东期间持续有效，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），如本公司因违反本承诺的内容而从中受益，本公司同意将所得收益返还给天风证券。</p> <p>6. 本公司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支付的分红款，本公司持有的天风证券股份不得转让，直至本公司依法遵守有关承诺或依法执行有关约束措施。</p>					
解决关联交易	宏泰集团	<p>1、本公司及本公司控制或影响的企业不会利用上市公司实际控制人地位及重大影响，谋求上市公司及下属子公司在业务合作等方面给予本企业及本企业的关联方优于市场第三方的权利，或谋求与上市公司及下属子公司达成交易的优先权利，损害上市公司及其他股东的合法利益。本公司控制或影响的其他企业将严格避免向上市公司及其下属子公司拆借、占用上市公司及其下属子公司资金或采取由上市公司及其下属子公司代垫款、代偿债务等方式侵占上市公司资金；不要求天风证券及其控股子公司违法违规提供担保。</p> <p>2、对于本公司及本公司控制或影响的企业与上市公司及其下属子公司之间必需的一切交易行为，均将严格遵守市场原则，本着平等互利、等价有偿的一般原则，公平合理地进行。交易定价有政府定价的，执行政府定价；没有政府定价的，执行市场公允价格；没有政府定价且无可参考市场价格的，按照成本加可比较的合理利润水平确定成本价执行。</p> <p>3、本公司与上市公司及其下属子公司之间的关联交易将严格遵守上市公司章程、关联交易管理制度等规定履行必要的法定程序。在上市公司权力机构审议有关关联交易事项时主动依法履行回避义务。</p> <p>4、本公司保证不通过关联交易取得任何不正当的利益或使上市公司及其下属子公司承担任何不正当的义务。如果因违反上述承诺导致上市公司或其下属子公司损失或利用关联交易侵占</p>	长期有效	否	是	-	-	

		上市公司或其下属子公司利益的，上市公司及其下属子公司的损失由本公司承担。 5、上述承诺在本公司及本公司控制或影响的企业构成上市公司的关联方期间持续有效。						
其他	全体董事、高级管理人员	为维护公司和全体股东的合法权益，保障公司填补被摊薄即期回报措施能够得到切实履行，根据《关于首发及再融资、重大资产重组摊薄即期回报有关事项的指导意见》（证监会公告[2015]31号）等相关规定，公司全体董事、高级管理人员承诺如下： 1.本人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.本人承诺对自身的职务消费行为进行约束。 3.本人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.本人承诺由董事会或董事会薪酬与提名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.如公司未来实施股权激励计划，本人承诺拟公布的公司股权激励计划的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩。 若违反上述承诺给公司或者股东造成损失的，本人将依法承担相应责任。自本承诺出具日至公司本次发行股票完成前，若国家及证券监管部门作出关于上市公司填补被摊薄即期回报措施的其他新的监管规定的，且本承诺不能满足国家及证券监管部门的该等规定时，本人承诺届时将按照国家及证券监管部门的最新规定出具补充承诺。 作为填补回报措施相关责任主体之一，本人若违反本承诺或拒不履行本承诺，本人同意国家或证券监管机构按照其制定或发布的有关规定、规则，对本人作出相关处罚或采取相关监管措施。	长期有效	否	是	-	-	
其他	宏泰集团	公司控股股东湖北宏泰集团有限公司为保证公司填补回报措施能够得到切实履行，作出如下承诺： 1、不越权干预天风证券经营管理活动，不侵占天风证券利益。	长期有效	否	是	-	-	

			<p>2、自本承诺出具日至本次向特定对象发行 A 股股票实施完毕前，若中国证监会作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定，且上述承诺不能满足中国证监会该等规定时，本公司承诺届时将按照中国证监会的最新规定出具补充承诺。</p> <p>3、本公司承诺切实履行上市公司制定的有关填补回报措施以及本公司对此作出的任何有关填补回报措施的承诺，若本公司违反该等承诺并给上市公司或者投资者造成损失的，本公司愿意依法承担对上市公司或者投资者的补偿责任。</p>					
其他	公司及其全体董事、监事、高级管理人员，宏泰集团	<p>公司及其全体董事、监事、高级管理人员，控股股东均已知悉《承诺人廉洁自律规范须知》相关要求，保证严格遵守法律法规、中国证监会的规定和上海证券交易所的业务规则，诚实守信、忠实勤勉、廉洁自律，不以任何方式影响和干扰审核工作，并郑重作出以下承诺：</p> <p>(一)遵守发行上市审核有关沟通、接待接触、回避等相关规定，不私下与审核人员、监管人员以及上海证券交易所上市审核委员会(以下简称上市委)委员等进行可能影响公正执行公务的接触；认为可能存在利益冲突的关系或者情形时，及时按相关规定和流程提出回避申请。</p> <p>(二)不组织、指使或者参与以下列方式向审核人员、监管人员、上海证券交易所上市委委员或者其他利益关系人输送不正当利益：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1.以各种名义赠送或者提供资金、礼品、房产、汽车、有价证券、股权等财物，或者为上述行为提供代持等便利；</li> <li>2.提供旅游、宴请、娱乐健身、工作安排等利益，或者提供就业、就医入学、承担差旅费等便利；</li> <li>3.安排显著偏离公允价格的结构化、高收益、保本理财产品等交易；</li> <li>4.直接或者间接提供内幕信息、未公开信息、商业秘密和客户信息，明示或者暗示从事相关交易活动；</li> <li>5.其他输送不正当利益的情形。</li> </ol> <p>(三)不组织、指使或者参与打探审核未公开信息，不请托说情、干扰审核工作。</p>	审核期间	是	是	-	-	

			<p>(四)遵守法律法规、中国证监会、上海证券交易所有关保密的规定，不泄露审核过程中知悉的内幕信息、未公开信息、商业秘密和国家秘密，不利用上述信息直接或者间接为本人或者其他谋取不正当利益。</p> <p>如违反上述承诺,承诺人自愿接受上海证券交易所依据其业务规则采取的终止审核、一定期限内不接受申请文件、公开认定不适合担任相关职务等措施。承诺人相关行为违反法律法规的，将承担相应法律责任。</p>					
--	--	--	--	--	--	--	--	--

注 1：人福医药为推进“归核聚焦”工作，持续优化资产负债结构，于 2022 年 3 月 31 日与宏泰集团签署了《人福医药集团股份公司与湖北宏泰集团有限公司关于天风证券股份有限公司 7.85% 股份之附条件生效的股份转让协议》，人福医药将以协议转让的方式向宏泰集团转让其持有的公司股份 680,087,537 股（占公司总股本的 7.85%）。2022 年 9 月 26 日，公司收到宏泰集团、人福医药转来的《中国证券登记结算有限责任公司过户登记确认书》，本次主要股东变更的股份过户已经完成，相关信息请查阅公司 2022 年 9 月 28 日于上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）发布的《天风证券股份有限公司关于变更主要股东完成股份过户的公告》（公告编号：2022-083）。宏泰集团已作出承诺，将承接人福医药申请豁免的自愿性股份限售承诺直至原承诺到期。

注 2：湖北省委省政府部署由省属金融控股平台宏泰集团战略入股公司，其已完成受让人福医药集团股份公司所持天风证券 7.85% 股权，拟继续按照省委省政府部署，启动受让联发投集团所持公司股权工作。2022 年 9 月 30 日，联发投集团与湖北联投集团有限公司、宏泰集团签署了《湖北省联合发展投资集团有限公司与湖北联投集团有限公司、湖北宏泰集团有限公司关于天风证券股份有限公司 5.99% 股份之附条件生效的股份转让协议》，宏泰集团将受让联发投集团持有的公司股份 519,359,753 股（占公司总股本的 5.99%）。2023 年 2 月 15 日，公司收到宏泰集团、联发投集团转来的《中国证券登记结算有限责任公司过户登记确认书》，本次权益变动的股份过户已经完成，相关信息请查阅公司 2023 年 2 月 17 日于上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）发布的《天风证券股份有限公司关于变更控股股东完成股份过户的公告》（公告编号：2023-006）。宏泰集团已作出承诺，将承接联发投集团申请豁免的自愿性股份限售承诺直至原承诺到期。

注 3：2023 年 4 月 27 日，公司第四届董事会第三十二次会议审议通过向特定对象发行 A 股股票相关议案。本次向特定对象发行 A 股股票的发行对象为公司控股股东宏泰集团。本次发行股票的定价基准日为公司本次发行股票的董事会决议公告日（即 2023 年 4 月 28 日）。本次发行股票的发行价格为定价基准日前 20 个交易日股票交易均价的 80%（定价基准日前 20 个交易日公司股票交易均价=定价基准日前 20 个交易日股票交易总额/定价基准日

前 20 个交易日股票交易总量)与发行前公司最近一期末经审计的归属于母公司股东的每股净资产值的较高者。本次向特定对象发行 A 股股票数量不超过 1,498,127,340 股(含本数),未超过本次发行前总股本的 30%(即 2,599,727,239 股)。本次向特定对象发行股票方案于 2023 年 5 月 18 日经公司股东大会审议通过,尚需取得上海证券交易所核准通过、中国证券监督管理委员会注册后方可实施。

## 二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

## 三、违规担保情况

适用 不适用



#### 四、半年报审计情况

适用 不适用

#### 五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

适用 不适用

#### 六、破产重整相关事项

适用 不适用

#### 七、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司未发生上海证券交易所《股票上市规则》中规定的涉案金额超过人民币 1,000 万元且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的重大诉讼、仲裁事项。已在上一年年度报告中披露的重大诉讼、仲裁事项的进展情况如下：

##### (一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

适用 不适用

##### (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

##### (三) 公司本报告期被处罚和公开谴责的情况

适用 不适用

##### (四) 其他说明

适用 不适用

公司与长安国际信托股份有限公司（以下简称“长安信托”）合同纠纷案

因《差额补足合同》涉及合同纠纷，长安信托以公司为被告，分别在西安市中级人民法院向公司提起 3 项诉讼，公司收到西安市中级人民法院的开庭通知。因该项合同纠纷，长安信托向法院申请冻结公司的资金，目前因该冻结导致公司资金使用受限金额为 11.98 亿元。因涉及合同纠纷，公司亦向武汉市中级人民法院提起诉讼，以长安信托为被告提起 3 项诉讼，要求解除合同。2023 年 5 月，西安市中级人民法院和武汉市中级人民法院分别就上述 6 项诉讼作出一审判决，西安市中级人民法院部分支持了长安信托的诉讼请求，武汉市中级人民法院判决确认《差额补足函》不生效，驳回其他诉讼请求。而后 6 项诉讼均提上诉，进入二审程序。湖北省高院于 2023 年 8 月对 3 项诉讼作出终审判决，判决驳回上诉，维持原判。陕西省高院的 3 项诉讼尚未出具二审判决。

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

适用 不适用

九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

十、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

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

适用 不适用

**2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**

适用 不适用

**3、 临时公告未披露的事项**

适用 不适用

**(五) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务**

适用 不适用

**(六) 其他重大关联交易**

适用 不适用

2023 年 4 月 27 日公司第四届董事会第三十二次会议审议通过了《关于公司 2023 年度向特定对象发行 A 股股票方案的议案》《关于公司 2023 年度向特定对象发行 A 股股票预案的议案》《关于公司 2023 年度向特定对象发行 A 股股票涉及关联交易的议案》等与本次非公开发行相关的议案。具体内容详见公司于 2023 年 4 月 28 日披露的相关公告。

**(七) 其他**

适用 不适用

公司严格按照上海证券交易所《股票上市规则》《上市公司自律监管指引第 5 号——交易与关联交易》及公司内部有关规章制度开展关联交易。公司关联交易遵循公平、公开、公允的原则，关联交易协议的签订遵循平等、自愿、等价、有偿的原则，按照市场价格进行。

报告期内，公司日常关联交易按照公司 2022 年度股东大会审议通过的《关于确认 2022 年度日常关联交易及预计 2023 年度日常关联交易的议案》执行，具体披露情况详见本报告第十节财务报告附注中的“关联方及关联交易”内容（依据企业会计准则编制）。

**十一、 重大合同及其履行情况****1 托管、承包、租赁事项**

适用 不适用

## 2 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）															
担保方	担保方与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期（协议签署日）	担保起始日	担保到期日	担保类型	主债务情况	担保物（如有）	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	反担保情况	是否为关联方担保	关联关系
无															
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）							0								
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）							0								
公司对子公司的担保情况															
报告期内对子公司担保发生额合计							0								
报告期末对子公司担保余额合计（B）							36.66								
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）															
担保总额（A+B）							36.66								
担保总额占公司净资产的比例（%）							15.33								
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）							23.48								
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）							23.48								
未到期担保可能承担连带清偿责任说明															
担保情况说明							1、截至报告期末，公司的担保事项为：公司对全资控股子公司天风资管净资产担保最高额度为13.18亿元人民币，实际担保金额8.18亿元人民币；公司为全资子公司天风天睿非公开发行公司债券提供的担保总额不超过15亿元人民币，目前天风天睿已发行公司								

债5亿元人民币，实际担保金额为5亿元人民币；公司及天风国际对天风国际全资控股子公司TFI OVERSEAS INVESTMENT LIMITED发行美元债券提供的担保金额为2.9亿美元（折合人民币20.06亿元）；天风国际对其全资控股子公司天风国际证券与期货提供的担保总额为1.75亿港元及2亿人民币（折合人民币3.42亿元）。

2、上述担保中被担保对象为资产负债率超过70%的是公司全资子公司天风国际证券与期货公司与TFI OVERSEAS INVESTMENT LIMITED。

3 其他重大合同

适用 不适用

十二、其他重大事项的说明

适用 不适用

## 第七节 股份变动及股东情况

### 一、股本变动情况

#### (一) 股份变动情况表

##### 1、股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

##### 2、股份变动情况说明

适用 不适用

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

适用 不适用

##### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

#### (二) 限售股份变动情况

适用 不适用

### 二、股东情况

#### (一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数(户)	193,286
截至报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	不适用

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

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内增减	期末持股数量	比例 (%)	持有有 限售条 件股 份 数 量	质押、标记或冻结情 况		股东 性质
					股 份 状 态	数 量	
湖北宏泰集团有限公司	519,359,753	1,199,447,290	13.84	0	无	0	国有法人
武汉商贸集团有限公司	0	760,988,942	8.78	0	无	0	国有法人
宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	0	206,600,000	2.38	0	无	0	境内非国有法人
武汉金融控股（集团）有限公司	0	195,599,022	2.26	0	无	0	国有法人
广东恒健国际投资有限公司	0	195,599,022	2.26	0	无	0	境内非国有法人
陕西大德投资集团有限责任公司	-10,850,000	180,250,077	2.08	0	无	0	境内非国有法人
中国建设银行股份有限公司-国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	25,987,950	147,977,585	1.71	0	无	0	境内非国有法人

西安港资本管理有限公司	100,000	147,412,100	1.70	0	无	0	境内非国有法人
上海天闾投资合伙企业（有限合伙）	0	132,210,237	1.53	0	质押	130,000,000	境内非国有法人
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	6,771,230	112,889,110	1.30	0	无	0	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
湖北宏泰集团有限公司	1,199,447,290	人民币普通股	1,199,447,290
武汉商贸集团有限公司	760,988,942	人民币普通股	760,988,942
宁波信达天赢投资合伙企业（有限合伙）	206,600,000	人民币普通股	206,600,000
武汉金融控股（集团）有限公司	195,599,022	人民币普通股	195,599,022
广东恒健国际投资有限公司	195,599,022	人民币普通股	195,599,022
陕西大德投资集团有限责任公司	180,250,077	人民币普通股	180,250,077
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	147,977,585	人民币普通股	147,977,585
西安港资本管理有限公司	147,412,100	人民币普通股	147,412,100
上海天闾投资合伙企业（有限合伙）	132,210,237	人民币普通股	132,210,237
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	112,889,110	人民币普通股	112,889,110
前十名股东中回购专户情况说明	不适用		
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	不适用		
上述股东关联关系或一致行动的说明	公司股东湖北宏泰集团有限公司与武汉商贸集团有限公司于 2022 年 10 月 19 日签署了《一致行动协议》，构成一致行动关系。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

### (三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

## 三、董事、监事和高级管理人员情况

### (一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

### (二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用



## (三) 其他说明

□适用 √不适用

## 四、控股股东或实际控制人变更情况

√适用 □不适用

新控股股东名称	湖北宏泰集团有限公司
新实际控制人名称	湖北省财政厅
变更日期	2023 年 2 月 15 日
信息披露网站查询索引及日期	公司于 2023 年 2 月 17 日在上海证券交易所网站 (www.sse.com.cn) 披露了《天风证券股份有限公司关于变更控股股东完成股份过户的公告》(公告编号: 2023-006 号)。

注: 2022 年 9 月 26 日, 宏泰集团完成受让人福医药持有公司 7.85% 股权的过户工作, 宏泰集团成为公司主要股东。详见 2022-083 号公告。2022 年 10 月 19 日, 宏泰集团与武汉商贸集团签署《一致行动协议》。详见 2022-094 号公告。2022 年 12 月 28 日, 公司收到中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券股份有限公司变更主要股东的批复》(证监许可〔2022〕3232 号), 核准宏泰集团成为公司控股股东。详见 2022-105 号公告。2023 年 2 月 15 日, 宏泰集团完成受让联发投集团持有公司 5.99% 股权的过户工作, 宏泰集团直接持有公司 1,199,447,290 股股份 (占公司股份总数 13.84%), 与其一致行动人武汉商贸合计持有公司 1,960,436,232 股股份 (占公司股份总数 22.62%); 宏泰集团成为公司的控股股东。详见 2023-006 号公告。

## 第八节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第九节 债券相关情况

### 一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

√适用 □不适用

#### (一) 企业债券

□适用 √不适用

#### (二) 公司债券

√适用 □不适用

#### 1. 公司债券基本情况

单位：万元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
天风证券股份有限公司2020年次级债券(第一期)品种二	20天风C2	166129.SH	2020-02-25	2020-02-27	2025-02-27	108,000	4.90	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向合格投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第一期)	21天风01	175645.SH	2021-01-18	2021-01-19	2024-01-19	70,000	4.18	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司2021年面向专	21天风C1	188809.SH	2021-09-29	2021-09-30	2024-09-30	400,000	5.40	每年付息一次,到期一	上海证券交易所	面向专业投资	竞价、报价、询价	否

业投资者公开发行次级债券（第一期）								次还本	所	者发行	和协议交易方式	
天风证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）	21 天风 05	185176.SH	2021-12-24	2021-12-27	2024-12-27	250,000	4.30	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）	22 天风 01	185322.SH	2022-01-21	2022-01-24	2025-01-24	180,000	4.06	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）	22 天风 02	185419.SH	2022-02-25	2022-02-28	2025-02-28	70,000	4.08	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券（第一期）	22 天风 03	194511.SH	2022-05-05	2022-05-06	2025-05-06	430,000	4.50	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券（第二期）	22 天风 04	194859.SH	2022-07-07	2022-07-08	2025-07-08	270,000	4.80	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者非公开发行公司债券（第三期）	22 天风 05	182713.SH	2022-11-18	2022-11-21	2025-11-21	180,000	5.00	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发	23 天风 01	250695.SH	2023-04-10	2023-04-11	2026-04-11	160,000	5.18	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交	否

行公司债券（第一期）品种一											易方式	
天风证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券（第一期）品种二	23 天风 02	250696.SH	2023-04-10	2023-04-11	2026-04-11	440,000	4.75	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券（第二期）品种一	23 天风 03	250832.SH	2023-04-17	2023-04-18	2026-04-18	300,000	5.08	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者非公开发行公司债券（第二期）品种二	23 天风 04	250833.SH	2023-04-17	2023-04-18	2026-04-18	40,000	4.17	每年付息一次,到期一次还本	上海证券交易所	面向专业投资者发行	竞价、报价、询价和协议交易方式	否
天风证券 N2024	天风证券 4%N2024	5052.HK	2022-03-15	2022-03-15	2024-03-15	34,000	4.00	每半年付息一次,到期一次还本	-	-	-	否

注：天风证券 N2024 债券币种为美元。  
 公司对债券终止上市交易风险的应对措施  
适用 不适用

逾期未偿还债券

适用 不适用

关于逾期债项的说明

适用 不适用

## 2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

## 3. 信用评级结果调整情况

适用 不适用

其他说明

无

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

适用 不适用

其他说明

无

## 5. 公司债券其他情况的说明

适用 不适用

### (三) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

### (四) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

适用 不适用

### (五) 主要会计数据和财务指标

适用 不适用

单位：元币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比 上年度末增减 (%)	变动原因
流动比率	2.86	3.92	-27.04	流动负债规模增加
速动比率	2.66	3.65	-27.12	流动负债规模增加
资产负债率(%)	73.76	73.23	0.72	
	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上 年同期增减(%)	变动原因
扣除非经常性损益后净利润	460,498,153.97	16,607,664.71	2,672.80	报告期利润上升
EBITDA 全部债务比	0.04	0.02	100.00	报告期利润上升
利息保障倍数	1.64	0.99	65.66	报告期利润上升
现金利息保障倍数	8.37	-1.09	不适用	经营活动产生的现金流量净额增加导致
EBITDA 利息保障倍数	1.74	1.10	58.18	报告期利润上升
贷款偿还率(%)	100.00	100.00	0.00	
利息偿付率(%)	100.00	100.00	0.00	

二、可转换公司债券情况

适用 不适用

## 第十节 财务报告

### 一、审计报告

□适用 √不适用

### 二、财务报表

#### 合并资产负债表

2023 年 6 月 30 日

编制单位：天风证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	1	21,053,972,951.01	20,233,335,089.50
其中：客户资金存款		7,316,352,193.55	7,925,740,530.96
结算备付金	2	1,694,241,489.27	2,413,937,268.31
其中：客户备付金		1,056,420,084.37	1,543,894,946.72
贵金属	3		
拆出资金	4		
融出资金	5	4,554,169,518.12	4,286,800,525.51
衍生金融资产	6	88,110,207.35	129,466,897.78
存出保证金	7	557,084,057.02	611,759,826.83
应收款项	8	3,693,523,876.30	3,771,907,295.38
应收款项融资	9		
合同资产	10		
买入返售金融资产	11	3,198,980,203.69	2,590,644,064.44
持有待售资产	12		1,388,275,534.30
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	13	38,180,092,595.81	36,742,789,304.50
债权投资	14	1,928,949,773.64	2,071,079,051.62
其他债权投资	15	5,415,331,384.21	1,501,182,197.41
其他权益工具投资	16	1,582,310,354.73	1,032,425,535.43
长期股权投资	17	2,862,293,676.89	3,214,312,807.94
投资性房地产	18	639,464,141.03	614,569,547.83
固定资产	19	503,231,260.53	543,211,535.23
在建工程	20		
使用权资产	21	568,703,045.81	562,587,931.89
无形资产	22	318,699,454.85	345,591,107.77
商誉	23	51,424,882.46	51,424,882.46
递延所得税资产	24	986,190,851.04	955,203,024.21
其他资产	25	15,378,176,413.96	15,147,806,702.80
资产总计		103,254,950,137.72	98,208,310,131.14
<b>负债：</b>			
短期借款	29	1,319,104,364.45	1,276,014,426.35
应付短期融资款	30	6,131,364,091.09	4,460,029,113.94
拆入资金	31	4,380,929,440.99	4,605,561,468.90
交易性金融负债	32	1,814,893,319.88	761,480,634.32
衍生金融负债	6	80,256,123.42	19,374,920.30



卖出回购金融资产款	33	8,649,673,093.35	4,247,355,591.89
代理买卖证券款	34	8,439,821,896.99	9,127,671,450.63
代理承销证券款	35		
应付职工薪酬	36	132,069,646.28	284,671,511.72
应交税费	37	74,878,273.94	78,916,102.41
应付款项	38	6,836,203.11	2,696,802.56
合同负债	39	29,765,961.70	74,174,441.85
持有待售负债	40		
预计负债	41		
长期借款	42		
应付债券	43	44,797,615,279.50	44,551,203,860.26
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	44	593,213,911.94	581,912,076.99
递延收益	45		
递延所得税负债	24	302,893,399.78	173,942,727.03
其他负债	46	1,622,120,345.15	4,114,442,594.10
负债合计		78,375,435,351.57	74,359,447,723.25
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	47	8,665,757,464.00	8,665,757,464.00
其他权益工具	48		
其中：优先股			
永续债			
资本公积	49	13,586,512,417.60	13,410,342,195.12
减：库存股	50	252,589,862.14	252,589,862.14
其他综合收益	51	-789,588,297.13	-860,055,290.15
盈余公积	52	327,819,540.82	327,819,540.82
一般风险准备	53	882,552,245.47	882,552,245.47
未分配利润	54	1,496,627,945.28	945,578,513.61
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		23,917,091,453.90	23,119,404,806.73
少数股东权益		962,423,332.25	729,457,601.16
所有者权益（或股东权益）合计		24,879,514,786.15	23,848,862,407.89
负债和所有者权益（或股东权益）总计		103,254,950,137.72	98,208,310,131.14

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

### 母公司资产负债表

2023 年 6 月 30 日

编制单位：天风证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金		19,565,318,617.64	18,799,130,049.07
其中：客户资金存款		6,717,373,726.92	7,367,433,059.26

结算备付金		1,688,840,935.84	2,403,646,581.10
其中：客户备付金		1,056,420,084.37	1,543,894,946.72
贵金属			
拆出资金			
融出资金		4,554,169,518.12	4,286,800,525.51
衍生金融资产		68,387,929.19	128,432,939.54
存出保证金		460,669,735.32	434,255,810.17
应收款项		634,661,571.11	648,068,916.20
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产		4,295,916,263.77	4,017,007,551.20
持有待售资产			1,388,275,534.30
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产		27,752,907,957.64	28,353,242,820.80
债权投资		1,928,949,773.64	2,071,079,051.62
其他债权投资		5,415,331,384.21	1,225,705,852.19
其他权益工具投资		674,604,817.92	166,728,556.90
长期股权投资	1	6,765,783,572.54	7,115,626,149.75
投资性房地产		289,422,313.59	293,266,213.01
固定资产		74,634,491.97	83,065,909.14
在建工程			
使用权资产		712,192,226.82	709,131,879.86
无形资产		121,969,380.14	135,535,487.57
商誉			
递延所得税资产		667,874,234.39	641,225,852.05
其他资产		15,875,502,592.92	15,088,556,348.09
资产总计		91,547,137,316.77	87,988,782,028.07
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款		5,806,224,005.48	4,152,745,369.87
拆入资金		4,380,929,440.99	4,605,561,468.90
交易性金融负债			
衍生金融负债		53,614,223.68	14,941,633.00
卖出回购金融资产款		8,191,436,748.58	3,818,944,695.86
代理买卖证券款		7,462,222,078.97	8,470,799,019.43
代理承销证券款			
应付职工薪酬	2	97,334,753.66	212,561,638.32
应交税费		19,644,286.87	24,925,626.41
应付款项			
合同负债		16,003,778.86	15,641,865.04
持有待售负债			
预计负债			
长期借款			
应付债券		40,382,986,909.36	40,267,530,040.67
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		743,599,754.27	728,588,301.20
递延收益			

递延所得税负债		165,922,084.66	40,060,378.79
其他负债		956,545,273.10	2,898,972,084.16
负债合计		68,276,463,338.48	65,251,272,121.65
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		8,665,757,464.00	8,665,757,464.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		13,409,766,313.42	13,233,596,090.94
减：库存股		252,589,862.14	252,589,862.14
其他综合收益		-226,131,922.67	-262,754,953.19
盈余公积		327,819,540.82	327,819,540.82
一般风险准备		710,941,648.73	710,941,648.73
未分配利润		635,110,796.13	314,739,977.26
所有者权益（或股东权益）合计		23,270,673,978.29	22,737,509,906.42
负债和所有者权益（或股东权益）总计		91,547,137,316.77	87,988,782,028.07

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

## 合并利润表

2023 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2023 年半年度	2022 年半年度
一、营业总收入		2,160,128,155.26	1,130,265,856.55
利息净收入	55	-896,405,235.34	-554,246,760.42
其中：利息收入		498,555,261.18	595,157,324.94
利息支出		1,394,960,496.52	1,149,404,085.36
手续费及佣金净收入	56	1,327,342,042.85	1,617,044,598.27
其中：经纪业务手续费净收入		515,662,440.83	484,939,495.98
投资银行业务手续费净收入		436,208,799.59	562,318,975.38
资产管理业务手续费净收入		316,802,708.97	510,038,933.09
投资收益（损失以“-”号填列）	57	1,192,049,878.31	135,353,596.23
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		44,023,795.43	-81,691,615.73
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）		90,895.67	15,706,132.30
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）	58		
其他收益	59	13,995,672.17	11,716,114.35
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	60	489,011,729.18	-99,772,667.50
汇兑收益（损失以“-”号填列）		9,976,848.21	3,545,452.89
其他业务收入	61	25,461,029.09	18,190,781.54
资产处置收益（损失以“-”号填列）	62	-1,303,809.21	-1,565,258.81
二、营业总支出		1,386,089,630.57	1,178,998,898.04
税金及附加	63	16,363,411.10	26,570,256.74
业务及管理费	64	1,266,015,886.94	1,138,840,541.29
信用减值损失	65	91,387,581.83	2,249,576.58
其他资产减值损失	66		

其他业务成本	67	12,322,750.70	11,338,523.43
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		774,038,524.69	-48,733,041.49
加：营业外收入	68	111,783,755.97	40,248,297.27
减：营业外支出	69	2,728,813.12	3,633,955.36
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		883,093,467.54	-12,118,699.58
减：所得税费用	70	181,100,345.36	-74,406,069.06
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		701,993,122.18	62,287,369.48
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		701,993,122.18	62,287,369.48
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）		551,805,663.13	51,673,609.35
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		150,187,459.05	10,613,760.13
六、其他综合收益的税后净额	71	136,956,848.45	-132,805,997.46
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		69,633,575.55	-104,929,306.73
（一）不能重分类进损益的其他综合收益			
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动		-7,741,383.07	-115,420,501.93
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
（二）将重分类进损益的其他综合收益			
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		15,671,374.95	-859,535.14
2. 其他债权投资公允价值变动		27,064,896.64	-24,753,560.32
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		975,477.01	63,916.83
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额		33,663,210.02	36,040,373.83
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		67,323,272.90	-27,876,690.73
七、综合收益总额		838,949,970.63	-70,518,627.98
归属于母公司所有者的综合收益总额		621,439,238.68	-53,255,697.38
归属于少数股东的综合收益总额		217,510,731.95	-17,262,930.60
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）		0.06	0.01
（二）稀释每股收益（元/股）		0.06	0.01

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

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

### 母公司利润表

2023 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2023年半年度	2022年半年度
一、营业总收入		1,504,620,617.18	237,307,176.51
利息净收入	3	-611,087,977.24	-600,054,720.49
其中：利息收入		568,087,254.79	564,876,626.62
利息支出		1,179,175,232.03	1,164,931,347.11
手续费及佣金净收入	4	935,893,125.16	943,399,452.82
其中：经纪业务手续费净收入		487,620,809.07	466,953,303.29
投资银行业务手续费净收入		408,524,303.51	429,698,533.99
资产管理业务手续费净收入			
投资收益（损失以“-”号填列）	5	759,016,677.60	195,706,446.79
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		45,200,349.27	-78,877,221.40
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）		90,895.67	15,706,132.30
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		13,414,957.27	10,694,731.57
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6	406,436,135.39	-305,544,689.64
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-18,476,566.63	-21,709,319.76
其他业务收入		20,722,860.75	16,380,393.90
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-1,298,595.12	-1,565,118.68
二、营业总支出		1,097,479,053.14	833,432,041.31
税金及附加		11,046,816.79	13,367,686.51
业务及管理费	7	993,434,940.65	847,001,065.67
信用减值损失		89,153,396.28	-30,887,969.53
其他资产减值损失			
其他业务成本		3,843,899.42	3,951,258.66
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		407,141,564.04	-596,124,864.80
加：营业外收入		8,576,754.97	40,007.25
减：营业外支出		1,605,286.88	2,441,779.09
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		414,113,032.13	-598,526,636.64
减：所得税费用		92,455,779.74	-147,633,086.11
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		321,657,252.39	-450,893,550.53
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		321,657,252.39	-450,893,550.53
（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		35,259,410.99	-19,201,567.58
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-8,452,337.61	6,347,611.05
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		-8,452,337.61	6,347,611.05
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		43,711,748.60	-25,549,178.63
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		15,671,374.95	-859,535.14
2. 其他债权投资公允价值变动		27,064,896.64	-24,753,560.32
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		975,477.01	63,916.83
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		356,916,663.38	-470,095,118.11
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)			
（二）稀释每股收益(元/股)			

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

## 合并现金流量表

2023 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2023年半年度	2022年半年度
<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		1,699,116,561.96	2,209,086,011.15
为交易目的而持有的金融资产净减少额		1,481,222,206.49	
拆入资金净增加额			
拆出资金净减少额			1,000,000,000.00
回购业务资金净增加额		4,175,737,553.31	
融出资金净减少额			423,510,090.34
代理买卖证券收到的现金净额			1,164,619,040.85
收到其他与经营活动有关的现金	72(1)	5,371,471,584.29	1,622,330,158.97
经营活动现金流入小计		12,727,547,906.05	6,419,545,301.31
为交易目的而持有的金融资产净增加额			1,069,313,768.11
拆出资金净增加额			
返售业务资金净增加额			
拆入资金净减少额		224,100,000.00	620,900,000.00
回购业务资金净减少额			3,273,623,548.14
融出资金净增加额		264,622,769.42	
代理买卖证券支付的现金净额		709,615,849.11	
支付利息、手续费及佣金的现金		295,233,247.35	342,928,815.14
支付给职工及为职工支付的现金		922,073,115.29	1,130,176,336.61
支付的各项税费		224,972,454.13	360,406,000.12
支付其他与经营活动有关的现金	72(2)	1,589,682,972.23	1,658,114,406.77
经营活动现金流出小计		4,230,300,407.53	8,455,462,874.89
经营活动产生的现金流量净额		8,497,247,498.52	-2,035,917,573.58
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		5,802,379,503.36	2,939,411,889.22
取得投资收益收到的现金		176,938,857.48	137,624,686.12
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			
收到其他与投资活动有关的现金		4,500,000.00	584,748,000.00
投资活动现金流入小计		5,983,818,360.84	3,661,784,575.34

投资支付的现金		9,829,584,065.81	2,753,488,271.68
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		79,191,011.74	113,385,805.46
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		1,350,000.00	430,280,000.00
投资活动现金流出小计		9,910,125,077.55	3,297,154,077.14
投资活动产生的现金流量净额		-3,926,306,716.71	364,630,498.20
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		45,000,000.00	90,000,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		45,000,000.00	90,000,000.00
取得借款收到的现金		2,953,708,231.88	1,078,952,904.86
发行债券收到的现金		11,826,304,000.00	12,997,464,804.51
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		14,825,012,231.88	14,166,417,709.37
偿还债务支付的现金		13,068,492,015.86	9,184,634,074.74
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,163,603,939.42	970,592,358.23
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金		159,919,027.66	363,684,135.12
筹资活动现金流出小计		14,392,014,982.94	10,518,910,568.09
筹资活动产生的现金流量净额		432,997,248.94	3,647,507,141.28
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		32,902,310.67	312,711.03
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		5,036,840,341.42	1,976,532,776.93
加：期初现金及现金等价物余额		16,456,724,342.40	20,952,643,792.97
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		21,493,564,683.82	22,929,176,569.90

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

## 母公司现金流量表

2023 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2023年半年度	2022年半年度
<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		1,701,132,604.47	1,735,465,374.56
拆入资金净增加额			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		1,417,076,476.34	1,585,143,525.04
拆出资金净减少额			1,000,000,000.00
回购业务资金净增加额		4,137,881,191.60	
融出资金净减少额			423,510,090.34
代理买卖证券收到的现金净额			642,902,119.04
收到其他与经营活动有关的现金		4,985,445,127.83	683,144,061.47
经营活动现金流入小计		12,241,535,400.24	6,070,165,170.45
为交易目的而持有的金融资产净增加额			

拆出资金净增加额			
融出资金净增加额		264,622,769.42	
代理买卖证券支付的现金净额		1,008,576,940.46	
返售业务资金净增加额			
拆入资金净减少额		224,100,000.00	620,900,000.00
回购业务资金净减少额			7,127,052,353.74
支付利息、手续费及佣金的现金		266,068,107.87	306,307,243.25
支付给职工及为职工支付的现金		791,939,385.74	927,001,206.53
支付的各项税费		125,838,657.62	137,225,013.87
支付其他与经营活动有关的现金		1,341,979,920.03	1,758,599,297.34
经营活动现金流出小计		4,023,125,781.14	10,877,085,114.73
经营活动产生的现金流量净额		8,218,409,619.10	-4,806,919,944.28
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		5,189,970,027.60	3,326,782,888.74
取得投资收益收到的现金		126,546,034.19	167,272,870.53
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			
投资活动现金流入小计		5,316,516,061.79	3,494,055,759.27
投资支付的现金		9,146,984,065.81	1,159,388,271.68
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		26,853,644.09	26,379,281.10
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		9,173,837,709.90	1,185,767,552.78
投资活动产生的现金流量净额		-3,857,321,648.11	2,308,288,206.49
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金		1,567,300,000.00	319,300,000.00
发行债券收到的现金		11,826,304,000.00	12,132,840,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		13,393,604,000.00	12,452,140,000.00
偿还债务支付的现金		11,704,166,000.00	7,923,000,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		941,525,330.72	970,592,358.23
支付其他与筹资活动有关的现金		103,267,980.38	183,835,976.77
筹资活动现金流出小计		12,748,959,311.10	9,077,428,335.00
筹资活动产生的现金流量净额		644,644,688.90	3,374,711,665.00
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-18,476,566.63	-21,709,319.76
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		4,987,256,093.26	854,370,607.45
加：期初现金及现金等价物余额		15,067,573,546.42	19,463,105,107.90
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		20,054,829,639.68	20,317,475,715.35

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友



## 合并所有者权益变动表

2023 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2023 年半年度											
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计	
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	8,665,757,464.00				13,410,342,195.12	252,589,862.14	-860,055,290.15	327,819,540.82	882,552,245.47	945,578,513.61	729,457,601.16	23,848,862,407.89
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	8,665,757,464.00				13,410,342,195.12	252,589,862.14	-860,055,290.15	327,819,540.82	882,552,245.47	945,578,513.61	729,457,601.16	23,848,862,407.89
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）					176,170,222.48		70,466,993.02			551,049,431.67	232,965,731.09	1,030,652,378.26
（一）综合收益总额							69,633,575.55			551,805,663.13	217,510,731.95	838,949,970.63
（二）所有者投入和减少资本										77,186.01	15,454,999.14	15,532,185.15
1. 所有者投入的普通股											34,704,000.00	34,704,000.00
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										77,186.01	-19,249,000.86	-19,171,814.85
（三）利润分配												
1. 提取盈余公积												

2. 提取一般风险准备												
3. 对所有者（或股东）的分配												
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转						833,417.47			-833,417.47			
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						833,417.47			-833,417.47			
6. 其他												
（五）其他					176,170,222.48						176,170,222.48	
四、本期期末余额	8,665,757,464.00				13,586,512,417.60	252,589,862.14	-789,588,297.13	327,819,540.82	882,552,245.47	1,496,627,945.28	962,423,332.25	24,879,514,786.15

项目	2022 年半年度											
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计	
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	8,665,757,464.00				13,410,342,195.12	141,070,721.42	-563,104,779.73	327,819,540.82	809,424,547.32	2,612,903,191.33	700,626,309.32	25,822,697,746.76
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	8,665,757,464.00				13,410,342,195.12	141,070,721.42	-563,104,779.73	327,819,540.82	809,424,547.32	2,612,903,191.33	700,626,309.32	25,822,697,746.76

2023 年半年度报告

三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)					111,519,140.72	-70,186,358.77		1,265,530.33	-35,809,525.24	82,271,817.85	-133,977,676.55
(一) 综合收益总额						-104,929,306.73			51,673,609.35	-17,262,930.60	-70,518,627.98
(二) 所有者投入和减少资本					111,519,140.72				113,166.54	99,534,748.45	-11,871,225.73
1. 所有者投入的普通股					111,519,140.72					90,000,000.00	-21,519,140.72
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									113,166.54	9,534,748.45	9,647,914.99
(三) 利润分配								1,265,530.33	-52,853,353.17		-51,587,822.84
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备								1,265,530.33	-1,265,530.33		
3. 对所有者(或股东)的分配									-51,587,822.84		-51,587,822.84
4. 其他											
(四) 所有者权益内部结转						34,742,947.96			-34,742,947.96		
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						34,742,947.96			-34,742,947.96		
6. 其他											
四、本期期末余额	8,665,757,464.00			13,410,342,195.12	252,589,862.14	-633,291,138.50	327,819,540.82	810,690,077.65	2,577,093,666.09	782,898,127.17	25,688,720,070.21

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

## 母公司所有者权益变动表

2023 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2023 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	8,665,757,464.00				13,233,596,090.94	252,589,862.14	-262,754,953.19	327,819,540.82	710,941,648.73	314,739,977.26	22,737,509,906.42
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	8,665,757,464.00				13,233,596,090.94	252,589,862.14	-262,754,953.19	327,819,540.82	710,941,648.73	314,739,977.26	22,737,509,906.42
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）					176,170,222.48		36,623,030.52			320,370,818.87	533,164,071.87
（一）综合收益总额							35,259,410.99			321,657,252.39	356,916,663.38
（二）所有者投入和减少资本										77,186.01	77,186.01
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										77,186.01	77,186.01
（三）利润分配											
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备											
3. 对所有者（或股东）的分配											
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转							1,363,619.53			-1,363,619.53	
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							1,363,619.53			-1,363,619.53	
6. 其他											
（五）其他					176,170,222.48						176,170,222.48
四、本期期末余额	8,665,757,464.00				13,409,766,313.42	252,589,862.14	-226,131,922.67	327,819,540.82	710,941,648.73	635,110,796.13	23,270,673,978.29

项目	2022 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	8,665,757,464.00				13,233,596,090.94	141,070,721.42	-247,792,809.76	327,819,540.82	710,941,648.73	2,024,865,529.64	24,574,116,742.95
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	8,665,757,464.00				13,233,596,090.94	141,070,721.42	-247,792,809.76	327,819,540.82	710,941,648.73	2,024,865,529.64	24,574,116,742.95
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）						111,519,140.72	-17,202,292.10			-504,367,482.31	-633,088,915.13
（一）综合收益总额							-19,201,567.58			-450,893,550.53	-470,095,118.11
（二）所有者投入和减少资本						111,519,140.72				113,166.54	-111,405,974.18
1. 所有者投入的普通股						111,519,140.72					-111,519,140.72
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										113,166.54	113,166.54

(三) 利润分配										-51,587,822.84	-51,587,822.84
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备											
3. 对所有者（或股东）的分配										-51,587,822.84	-51,587,822.84
4. 其他											
(四) 所有者权益内部结转						1,999,275.48				-1,999,275.48	
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						1,999,275.48				-1,999,275.48	
6. 其他											
四、本期期末余额	8,665,757,464.00				13,233,596,090.94	252,589,862.14	-264,995,101.86	327,819,540.82	710,941,648.73	1,520,498,047.33	23,941,027,827.82

公司负责人：余磊

主管会计工作负责人：王琳晶

会计机构负责人：李正友

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

√适用 □不适用

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

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。

2021 年 3 月经中国证券监督管理委员会[2021]962 号文《关于核准天风证券股份有限公司非公开发行股票批复》核准，公司于 2021 年 4 月 29 日发行人民币普通股 1,999,790,184 股，变更后的注册资本为人民币 8,665,757,464.00 元。

公司地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区高新大道 446 号天风证券大厦 20 层

法人代表：余磊

注册资本：人民币捌拾陆亿陆仟伍佰柒拾伍万柒仟肆佰陆拾肆元整

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

公司对分支机构（营业部、分公司）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 2023 年 6 月 30 日，本公司设有营业执照的分支机构共有 85 家营业部及 29 家分公司。

#### 2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

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

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

## 四、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

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

### 2. 持续经营

√适用 不适用

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

## 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

√适用 不适用

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

### 1. 遵循企业会计准则的声明

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

### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 3. 营业周期

√适用 不适用

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

### 4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

### 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

√适用 不适用

#### (1) 同一控制下的企业合并

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



## (2) 非同一控制下的企业合并

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

## 6. 合并财务报表的编制方法

√适用 □不适用

### (1) 合并财务报表范围

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

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

本公司在评估对结构化主体拥有的权力时，通常考虑下列四方面：

在设立被投资方时的决策及本公司的参与度；

相关合同安排；

仅在特定情况或事项发生时开展的相关活动；

本公司对被投资方做出的承诺。

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

### (2) 统一母子公司的会计政策、统一母子公司的资产负债表日及会计期间

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

### (3) 合并财务报表抵销事项

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

### (4) 合并取得子公司会计处理

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

## 7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

√适用 □不适用

### (1) 合营安排的分类

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

### (2) 共同经营的会计处理

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

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

### (3) 合营企业的会计处理

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

## 8. 现金及现金等价物的确定标准

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

## 9. 外币业务和外币报表折算

√适用 □不适用

### (1) 外币业务折算

本公司对发生的外币交易，采用与交易发生日折合本位币入账。资产负债表日外币货币性项目按资产负债表日即期汇率折算，因该日的即期汇率与初始确认时或者前一资产负债表日即期汇率不同而产生的汇兑差额，除符合资本化条件的外币专门借款的汇兑差额在资本化期间予以资本

化计入相关资产的成本外，均计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其记账本位币金额。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，折算后的记账本位币金额与原记账本位币金额的差额，作为公允价值变动(含汇率变动)处理，计入当期损益或确认为其他综合收益。

## (2) 外币财务报表折算

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

## 10. 金融工具

### 金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

√适用 □不适用

#### 1) 金融工具的分类及重分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

#### ① 金融资产

本公司将同时符合下列条件的金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产：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、租赁应收款，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

公司将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：一是根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；二是出售极可能发生，即本公司已经就一项出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。有关规定要求本公司相关权力机构或者监管部门批准后方可出售的，应当已经获得批准。

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

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

终止经营是满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已被本公司处置或被本公司划归为持有待售类别：

1. 该组成部分代表一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区；
2. 该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区进行处置的一项相关联计划的一部分；
3. 该组成部分是专为转售而取得的子公司。

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

详见本节 10、5) 预期信用损失的确定方法及会计处理方法。

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

详见本节 10、5) 预期信用损失的确定方法及会计处理方法。



## 18. 长期股权投资

√适用 □不适用

### (1) 初始投资成本确定

对于企业合并取得的长期股权投资，如为同一控制下的企业合并，应当按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额确认为初始成本；非同一控制下的企业合并，应当按购买日确定的合并成本确认为初始成本；以支付现金取得的长期股权投资，初始投资成本为实际支付的购买价款；以发行权益性证券取得的长期股权投资，初始投资成本为发行权益性证券的公允价值；通过债务重组取得的长期股权投资，其初始投资成本应当按照《企业会计准则第 12 号—债务重组》的有关规定确定；非货币性资产交换取得的长期股权投资，初始投资成本根据准则相关规定确定。

### (2) 后续计量及损益确认方法

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

### (3) 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

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

## 19. 投资性房地产

### (1). 如果采用成本计量模式的

#### 折旧或摊销方法

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

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

## 20. 固定资产

### (1). 确认条件

√适用 □不适用

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

### (2). 折旧方法

√适用 □不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	年限平均法	30-50	3%-5%	1.90%-2.32%
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	2-15	0-3%	6.47%-50.00%

### (3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

√适用 □不适用

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

## 21. 在建工程

√适用 □不适用

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

## 22. 借款费用

√适用 □不适用

### (1) 借款费用资本化的确认原则

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

### (2) 资本化金额计算方法

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

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

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

### 23. 使用权资产

适用  不适用

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

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

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

### 24. 无形资产

#### (1). 计价方法、使用寿命、减值测试

适用  不适用

##### ①无形资产的计价方法

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

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

## ②使用寿命不确定的判断依据

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

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

## (2). 内部研究开发支出会计政策

√适用 □不适用

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

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

## 25. 长期资产减值

√适用 □不适用

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

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

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

上述资产减值损失一经确认，以后期间不予转回价值得以恢复的部分。

## 26. 长期待摊费用

√适用 □不适用

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

## 27. 附回购条件的资产转让

√适用 □不适用

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

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

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

对于客户未逾期并按时付息且履约保障比高于追保线（含）的股票质押式回购业务，划分为“阶段一”；

对于合约维持担保比低于追保线（不含）但高于平仓线（含）、发生逾期且逾期天数在 30 个自然日（含）以内及其他被认定信用风险显著增加的情形的股票质押式回购业务，划分为“阶段二”；

对于维持担保比例低于平仓线（不含）、逾期天数大于 30 个自然日（不含）及其他被认为实质性违约的股票质押式回购业务，划分为“阶段三”。

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

对于阶段一和阶段二的上述金融资产，本公司的违约概率及违约损失率根据公司历史违约信息，对违约概率进行估计并设定，结合前瞻性调整因素，确认预期信用损失。对于阶段三已发生信用减值的上述金融资产，由于已经发生违约，因此违约概率设置为 1，违约损失率通过综合考

虑担保品的价值、可变现能力及处置周期，融资人的信用状况及还款能力等进行估计，并结合前瞻性调整因素，计提相应的减值准备。

## 28. 合同负债

### 合同负债的确认方法

√适用 □不适用

本公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品或提供服务的义务列示为合同负债。本公司将同一合同下的合同资产和合同负债以净额列示。

## 29. 职工薪酬

### (1)、短期薪酬的会计处理方法

√适用 □不适用

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

### (2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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

### (3)、辞退福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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

### (4)、其他长期职工福利的会计处理方法

√适用 □不适用

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

### 30. 预计负债

√适用 □不适用

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

### 31. 租赁负债

√适用 □不适用

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

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

未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

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

### 32. 股份支付

√适用 □不适用

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

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

### 33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

### 34. 回购本公司股份

适用 不适用

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。

### 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

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

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

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

(2) 该成本增加了本公司未来用于履行履约义务的资源；

(3) 该成本预期能够收回。

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

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

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

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

(1) 因转让与该资产相关的商品预期能够取得的剩余对价；

(2) 为转让该相关商品估计将要发生的成本。

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

### 37. 利润分配

√适用 □不适用

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

### 38. 政府补助

#### (1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

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

按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

#### (2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

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

### 39. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

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

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

(3) 对与子公司及联营企业投资相关的应纳税暂时性差异，确认递延所得税负债，除非本公司能够控制暂时性差异转回的时间且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。对与子公司

及联营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，当该暂时性差异在可预见的未来很可能转回且未来很可能获得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额时，确认递延所得税资产。

#### 40. 租赁

##### (1)、经营租赁的会计处理方法

适用 不适用

##### (2)、融资租赁的会计处理方法

适用 不适用

##### (3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

###### 1) 承租人

①使用权资产的会计政策详见本附注五、23。

②租赁负债的会计政策详见本附注五、31。

③短期租赁和低价值资产租赁。

在租赁期开始日，本公司对除短期租赁和低价值资产租赁以外的租赁确认使用权资产和租赁负债，并在租赁期内分别确认折旧费用和利息费用。

本公司在租赁期内各个期间采用直线法，将短期租赁和低价值资产租赁的租赁付款额计入当期费用。

###### 2) 出租人

###### ①经营租赁会计处理

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

###### ②融资租赁会计处理

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

#### 41. 融资融券业务

适用 不适用

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

融资业务，本公司对于融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，本公司对于融出的证券，不终止确认该证券，但确认相应利息收入。

本公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

#### 42. 资产证券化业务

适用 不适用

#### 43. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

##### (1) 客户资产管理业务

公司资产管理业务包括定向资产管理业务和集合资产管理业务。

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

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

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

##### (2) 转融通业务

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

## (2)、重要会计估计变更

□适用 √不适用

## (3)、2023 年起首次执行新会计准则或准则解释等涉及调整首次执行当年年初的财务报表

□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%
教育费附加	应纳流转税额	3%
企业所得税	应纳税所得额	25%、16.5%、8.25%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

√适用 □不适用

纳税主体名称	所得税税率(%)
TF International Securities Group Limited	16.5
TFI Securities Limited	16.5
TFI Capital Limited	16.5
TFI Asset Management Limited	8.25、16.5
TFI Securities and Futures Limited	16.5
除上述以外的其他纳税主体	25

## 2. 税收优惠

□适用 √不适用

## 3. 其他

□适用 √不适用

## 七、合并财务报表项目注释

## 1. 货币资金

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	23,019.34	/	/	44,281.46
人民币	/	/	23,019.34	/	/	44,281.46
美元						
港元						
银行存款：	/	/	21,053,938,418.73	/	/	20,228,420,436.61
其中：自有资金	/	/	13,737,586,225.18	/	/	12,302,679,905.65
人民币	/	/	13,533,011,979.53	/	/	12,109,397,671.16
美元	16,739,944.39	7.2258	120,959,981.09	14,067,288.94	6.9646	97,995,895.21
港元	90,570,745.69	0.9220	83,504,416.11	106,546,931.87	0.8933	95,175,177.83
欧元	13,945.25	7.8771	109,848.45	14,979.27	7.4229	111,161.45
其中：客户资金	/	/	7,316,352,193.55	/	/	7,925,740,530.96
人民币	/	/	6,787,518,830.09	/	/	7,420,983,486.34
美元	68,906,875.13	7.2258	497,909,627.47	60,820,030.93	6.9646	423,609,875.04
港元	33,218,814.31	0.9220	30,627,082.43	90,504,054.63	0.8933	80,844,556.87
欧元	37,660.15	7.8771	296,653.56	40,770.96	7.4229	302,612.71
其他货币资金：	/	/	5,813.31	/	/	4,845,282.43
人民币	/	/	5,813.31	/	/	4,845,282.43
美元						
港元						
应收利息：			5,699.63			25,089.00
人民币			5,699.63			25,089.00
港元						
合计	/	/	21,053,972,951.01	/	/	20,233,335,089.50

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	/	/	1,247,753,129.25	/	/	1,341,995,362.46
人民币	/	/	1,247,753,129.25	/	/	1,341,995,362.46
美元						
港元						
合计	/	/	1,247,753,129.25	/	/	1,341,995,362.46

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 2023 年 6 月 30 日，受限制的货币资金为人民币 1,254,649,756.46 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：	/	/	637,112,215.60	/	/	869,333,172.11
人民币	/	/	637,112,186.79	/	/	869,333,144.19
美元	0.02	7.2258	0.14	0.02	6.9646	0.14
港元	31.10	0.9220	28.67	31.10	0.8933	27.78
公司信用备付金：	/	/	709,189.30	/	/	709,149.48
人民币	/	/	709,189.30	/	/	709,149.48
美元						
港元						
客户普通备付金：	/	/	964,044,672.02	/	/	1,379,437,499.27
人民币	/	/	960,565,041.11	/	/	1,375,460,704.46
美元	101,558.25	7.2258	733,839.62	184,612.67	6.9646	1,285,753.44
港元	2,978,146.25	0.9220	2,745,791.29	3,012,573.32	0.8933	2,691,041.37
客户信用备付金：	/	/	92,375,412.35	/	/	164,457,447.45
人民币	/	/	92,375,412.35	/	/	164,457,447.45
美元						
港元						
合计	/	/	1,694,241,489.27	/	/	2,413,937,268.31

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

## 5、 融出资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	4,557,084,010.49	4,289,870,782.67
其中：个人	3,197,713,782.60	2,976,217,007.17
机构	1,359,370,227.89	1,313,653,775.50
减：减值准备	2,914,492.37	3,070,257.16
账面价值小计	4,554,169,518.12	4,286,800,525.51
境外	6,370,229.84	6,171,864.05

其中：个人	6,370,229.84	6,171,864.05
机构		
减：减值准备	6,370,229.84	6,171,864.05
账面价值小计		
账面价值合计	4,554,169,518.12	4,286,800,525.51

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	1,020,935,311.07	1,052,216,340.64
债券	34,461,964.76	32,634,150.96
股票	15,056,548,700.03	14,549,073,064.79
基金	227,025,127.99	219,833,014.69
合计	16,338,971,103.85	15,853,756,571.08

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用  不适用

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

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

适用  不适用

融出资金的说明：

适用  不适用



## 6、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具 (按类别列示)	745,702,560.00		3,173,134.20	9,448,073,700.00						12,295,240,000.00		
—利率互换				8,895,000,000.00						12,195,000,000.00		
—国债期货	745,702,560.00		3,173,134.20	553,073,700.00						100,240,000.00		
货币衍生工具 (按类别列示)	3,029,817,681.90	18,441,195.62	22,910,293.41									
—货币期货	1,982,076,681.90		22,910,293.41									
—外汇远期	1,047,741,000.00	18,441,195.62										
权益衍生工具 (按类别列示)	1,372,285,067.10		558,472.13	1,638,899,393.02	62,789,470.54	14,190,249.55				1,573,490,142.24	103,978,925.01	9,343,725.38
—股指期货	1,372,285,067.10		558,472.13	303,783,120.00						455,575,360.00		
—期权				1,335,116,273.02	62,789,470.54	14,190,249.55				1,117,914,782.24	103,978,925.01	9,343,725.38
信用衍生工具 (按类别列示)												
其他衍生工具 (按类别列示)	144,516,000.00	1,281,082.54		560,219,856.46	5,598,458.65	39,423,974.13	1,733,932,975.64	1,033,958.24	4,433,287.30	691,003,813.06	24,454,014.53	5,597,907.62
—商品期货				5,052,645.00			1,594,641,811.46		4,433,287.30	2,014,470.00		
—收益互换	144,516,000.00	1,281,082.54		555,167,211.46	5,598,458.65	39,423,974.13	139,291,164.18	1,033,958.24		688,989,343.06	24,454,014.53	5,597,907.62
合计	5,292,321,309.00	19,722,278.16	26,641,899.74	11,647,192,949.48	68,387,929.19	53,614,223.68	1,733,932,975.64	1,033,958.24	4,433,287.30	14,559,733,955.30	128,432,939.54	14,941,633.00

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：在每日无负债结算制度下，非套期衍生金融工具项下的期货合约和在上海清算所集中清算的利率互换合约按抵销后的净额列示，为人民币零元。

## 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	/	/	527,554,025.77	/	/	578,579,049.58
其中：人民币	/	/	435,431,962.85	/	/	438,759,705.43
美元	9,439,101.12	7.2258	68,205,367.29	18,238,865.24	6.9646	127,025,649.91
港元	25,940,579.65	0.9220	23,916,695.63	14,322,314.91	0.8933	12,793,694.24
信用保证金	/	/	29,530,031.25	/	/	33,180,777.25
其中：人民币	/	/	29,530,031.25	/	/	33,180,777.25
美元						
港元						
履约保证金	/	/		/	/	
其中：人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
合计	/	/	557,084,057.02	/	/	611,759,826.83

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	2,105,557,343.20	2,328,271,086.83
应收资产管理费	1,666,841,882.92	1,494,175,073.82
应收手续费及佣金	232,301,208.41	250,491,577.73
应收票据		
应收租金收入	10,726,488.27	7,516,266.93
其他	2,397,807.55	7,935,737.25
合计	4,017,824,730.35	4,088,389,742.56
减：坏账准备(按简化模型计提)	324,300,854.05	316,482,447.18
减：坏账准备(按一般模型计提)		
应收款项账面价值	3,693,523,876.30	3,771,907,295.38

## (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	3,053,858,971.30	76.00	3,082,966,391.82	75.41
1-2 年	347,032,986.75	8.64	412,478,251.43	10.09
2-3 年	343,809,688.81	8.56	344,387,153.72	8.42
3 年以上	273,123,083.49	6.80	248,557,945.59	6.08
合计	4,017,824,730.35	100.00	4,088,389,742.56	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	3,053,858,971.30	76.00	68,392,094.97	2.24	3,082,966,391.82	75.41	54,586,104.06	1.77
1-2年	347,032,986.75	8.64	42,423,700.93	12.22	412,478,251.43	10.09	48,420,676.95	11.74
2-3年	343,809,688.81	8.56	71,436,243.07	20.78	344,387,153.72	8.42	71,556,355.75	20.78
3年以上	273,123,083.49	6.80	142,048,815.08	52.01	248,557,945.59	6.08	141,919,310.42	57.10
组合小计	4,017,824,730.35	100.00	324,300,854.05	8.07	4,088,389,742.56	100.00	316,482,447.18	7.74
合计	4,017,824,730.35	100.00	324,300,854.05	8.07	4,088,389,742.56	100.00	316,482,447.18	7.74

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明:

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明:

□适用 √不适用

## 9、 应收款项融资

□适用 √不适用

## 10、 合同资产

## (1). 合同资产情况

□适用 √不适用

## (2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

□适用 √不适用

## (3). 本期合同资产计提减值准备情况

□适用 √不适用

其他说明:

□适用 √不适用

## 11、 买入返售金融资产

## (1) 按业务类别

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	139,321,329.41	40,222,538.05
债券质押式回购	2,237,407,550.02	2,118,657,931.82
债券买断式回购	769,497,235.13	381,547,189.82
其他	104,471,489.96	101,218,299.57
减：减值准备	51,717,400.83	51,001,894.82
账面价值合计	3,198,980,203.69	2,590,644,064.44

## (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	243,792,819.37	141,440,837.62
债券	3,006,904,785.15	2,500,205,121.64
基金		
其他		
减：减值准备	51,717,400.83	51,001,894.82
买入返售金融资产账面价值	3,198,980,203.69	2,590,644,064.44

## (3) 担保物金额

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
担保物	3,438,036,339.76	2,613,839,775.49
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	877,276,502.20	586,004,139.50
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		36,173,107.11

## (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		
一个月至三个月内		
三个月至一年内	139,321,329.41	40,222,538.05
一年以上		
合计	139,321,329.41	40,222,538.05

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	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失	

	期信用损失	(未发生信用减值)	(已发生信用减值)	
账面余额	139,321,329.41			139,321,329.41
减值准备	89,089.11			89,089.11
账面价值	139,232,240.30			139,232,240.30
担保物价值	434,712,293.00			434,712,293.00

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

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

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

适用  不适用

买入返售金融资产的说明：

适用  不适用

## 12、持有待售资产

适用  不适用

## 13、交易性金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末余额						
类别	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计
债券	16,726,776,687.52		16,726,776,687.52	16,741,396,454.22		16,741,396,454.22
公募基金	1,212,575,978.63		1,212,575,978.63	1,223,230,350.03		1,223,230,350.03
股票/股权	4,924,191,516.61		4,924,191,516.61	3,839,526,992.09		3,839,526,992.09
银行理财产品	224,702,387.23		224,702,387.23	224,500,000.00		224,500,000.00
券商资管产品	13,611,227,249.77		13,611,227,249.77	13,016,848,108.51		13,016,848,108.51
信托计划	642,070,333.09		642,070,333.09	552,171,393.63		552,171,393.63
其他	838,548,442.96		838,548,442.96	799,035,778.76		799,035,778.76
合计	38,180,092,595.81		38,180,092,595.81	36,396,709,077.24		36,396,709,077.24
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	15,500,043,154.26		15,500,043,154.26	15,871,848,332.76		15,871,848,332.76
公募基金	2,983,407,681.11		2,983,407,681.11	2,988,919,197.47		2,988,919,197.47
股票/股权	4,530,549,634.18		4,530,549,634.18	3,721,753,486.54		3,721,753,486.54
银行理财产品						
券商资管产品	12,655,281,027.55		12,655,281,027.55	12,374,052,524.51		12,374,052,524.51

信托计划	646,618,439.39		646,618,439.39	573,365,276.28		573,365,276.28
其他	426,889,368.01		426,889,368.01	415,479,801.97		415,479,801.97
合计	36,742,789,304.50		36,742,789,304.50	35,945,418,619.53		35,945,418,619.53

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

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额				期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
国债								
地方债								
金融债								
企业债	63,000,000.00	3,390,303.06	9,321.73	66,380,981.33	63,000,000.00	4,037,827.54	48,198.82	66,989,628.72
其他	1,823,879,494.31	41,858,885.66	3,169,587.66	1,862,568,792.31	1,949,856,056.81	57,140,973.47	2,907,607.38	2,004,089,422.90
合计	1,886,879,494.31	45,249,188.72	3,178,909.39	1,928,949,773.64	2,012,856,056.81	61,178,801.01	2,955,806.20	2,071,079,051.62

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

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

对本期发生损失准备变动的债权投资余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他说明：

无



## 15、其他债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	60,000,000.00	2,250,937.27	325,174.86	62,576,112.13						
地方债	1,160,000,000.00	38,612,202.29	1,149,856.87	1,199,762,059.16	16,124.06					
金融债	1,290,000,000.00	16,145,881.91	1,259,191.50	1,307,405,073.41						
企业债	1,274,000,000.00	19,620,564.47	10,523,037.98	1,304,143,602.45	933,617.50	160,000,000.00	3,796,735.06	-6,432,997.52	157,363,737.54	129,597.92
公司债	100,000,000.00	12,221,369.86	-78,168,900.00	34,052,469.86	270,872.94	100,000,000.00	8,849,315.07	-78,168,900.00	30,680,415.07	213,011.88
其他	1,521,000,000.00	25,938,335.01	-39,546,267.81	1,507,392,067.20	696,338.55	1,348,109,192.74	12,604,237.52	-47,575,385.46	1,313,138,044.80	273,707.24
合计	5,405,000,000.00	114,789,290.81	-104,457,906.60	5,415,331,384.21	1,916,953.05	1,608,109,192.74	25,250,287.65	-132,177,282.98	1,501,182,197.41	616,317.04

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、合并财务报表项目注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表。

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

其他说明：

无

## 16、其他权益工具投资

## (1). 按项目披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
非交易性权益工具	2,870,297,829.78	1,582,310,354.73	20,431,546.86	2,374,401,032.33	1,032,425,535.43	5,083,768.11	战略投资
合计	2,870,297,829.78	1,582,310,354.73	20,431,546.86	2,374,401,032.33	1,032,425,535.43	5,083,768.11	/

**(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-833,417.47 元从其他综合收益重分类为留存收益。

其他说明：

□适用 √不适用

## 17、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
湖北三环资本管理有限公司	19,790,091.61			-271,512.95						19,518,578.66	
宜宾市商业银行股份有限公司（注2）	388,855,864.00		-14,937,248.86	10,628,463.80	5,103,041.76	2,589,621.05			-392,239,741.75		
恒泰证券股份有限公司	2,452,338,842.43			32,683,168.37	4,441,401.32					2,489,463,412.12	
新疆新旅资本管理有限公司	1,641,885.36			-82,670.26						1,559,215.10	
浙江寻常问道网络信息科技有限公司	3,778,372.00			-822,370.63						2,956,001.37	
广州恒天大数据研究有限公司	1,000,000.00		-1,000,000.00								
紫金天风期货股份有限公司	346,907,752.54			1,888,717.10						348,796,469.64	
武汉帮创科技有限公司（注1）											
小计	3,214,312,807.94		-15,937,248.86	44,023,795.43	9,544,443.08	2,589,621.05			-392,239,741.75	2,862,293,676.89	
合计	3,214,312,807.94		-15,937,248.86	44,023,795.43	9,544,443.08	2,589,621.05			-392,239,741.75	2,862,293,676.89	

## 其他说明

注 1：武汉帮创科技有限公司不具备持续经营能力，本公司根据会计准则规定，对其净投资的长期权益减记至零。

注 2：报告期内，根据公司战略安排，转让部分宜宾商行股份，截至报告期末，公司对宜宾商行剩余持股比例约 4.99%。因未派驻董事对其不再具有重大影响，故宜宾商行不再属于公司联营企业，剩余股权转让入其他权益工具投资核算。

## 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	641,318,564.75	60,845,271.97		702,163,836.72
2. 本期增加金额	25,899,569.50	12,215,139.93		38,114,709.43
(1) 外购				
(2) 固定资产/无形资产转入	25,899,569.50	12,215,139.93		38,114,709.43
(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	667,218,134.25	73,060,411.90		740,278,546.15
二、累计折旧和累计摊销				
1. 期初余额	79,312,139.42	8,282,149.47		87,594,288.89
2. 本期增加金额	10,398,062.18	2,822,054.05		13,220,116.23
(1) 计提或摊销	8,978,093.78	822,203.86		9,800,297.64
(2) 固定资产/无形资产转入	1,419,968.40	1,999,850.19		3,419,818.59
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额	89,710,201.60	11,104,203.52		100,814,405.12
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	577,507,932.65	61,956,208.38		639,464,141.03
2. 期初账面价值	562,006,425.33	52,563,122.50		614,569,547.83

## (2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
房屋建筑物	525,940.62	正在办理中

其他说明

□适用 √不适用

## 19、固定资产

## (1). 固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	电子设备	运输工具	合计
一、账面原值：				
1. 期初余额	531,607,072.74	144,213,054.39	14,037,950.20	689,858,077.33
2. 本期增加金额		5,730,313.26	3,029,702.35	8,760,015.61
(1) 购置		5,730,313.26	3,029,702.35	8,760,015.61
(2) 在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额	25,899,569.50	7,183,769.59	2,919,533.56	36,002,872.65
(1) 处置或报废		7,183,769.59	2,919,533.56	10,103,303.15
(2) 转入投资性房地产	25,899,569.50			25,899,569.50
4. 期末余额	505,707,503.24	142,759,598.06	14,148,118.99	662,615,220.29
二、累计折旧				
1. 期初余额	39,864,257.25	92,345,459.97	13,883,725.55	146,093,442.77
2. 本期增加金额	7,224,485.43	13,168,640.08	384,893.69	20,778,019.20
(1) 计提	7,224,485.43	13,168,640.08	384,893.69	20,778,019.20
3. 本期减少金额	1,419,968.40	3,913,260.10	2,707,373.04	8,040,601.54
(1) 处置或报废		3,913,260.10	2,707,373.04	6,620,633.14
(2) 转入投资性房地产	1,419,968.40			1,419,968.40
4. 期末余额	45,668,774.28	101,600,839.95	11,561,246.20	158,830,860.43
三、减值准备				
1. 期初余额		553,099.33		553,099.33
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		553,099.33		553,099.33
四、账面价值				
1. 期末账面价值	460,038,728.96	40,605,658.78	2,586,872.79	503,231,260.53
2. 期初账面价值	491,742,815.49	51,314,495.09	154,224.65	543,211,535.23

## (2). 暂时闲置的固定资产情况

□适用 √不适用

## (3). 通过融资租赁租入的固定资产情况

□适用 √不适用

## (4). 通过经营租赁租出的固定资产

□适用 √不适用

## (5). 未办妥产权证书的固定资产情况

□适用 √不适用

其他说明：

适用 不适用**20、在建工程****(1). 在建工程情况**适用 不适用**(2). 重要在建工程项目本期变动情况**适用 不适用**(3). 本期计提在建工程减值准备情况**适用 不适用

其他说明

适用 不适用**21、使用权资产**适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	机器设备	其他	合计
一、账面原值				
1. 期初余额	750,480,675.83	399,707.52	871,953.50	751,752,336.85
2. 本期增加金额	92,055,510.29			92,055,510.29
(1) 新增租赁	92,055,510.29			92,055,510.29
3. 本期减少金额	46,874,575.76			46,874,575.76
(1) 终止租赁	46,874,575.76			46,874,575.76
4. 期末余额	795,661,610.36	399,707.52	871,953.50	796,933,271.38
二、累计折旧				
1. 期初余额	188,537,870.70	155,441.86	471,092.40	189,164,404.96
2. 本期增加金额	75,593,436.33	66,617.92	208,811.93	75,868,866.18
(1) 计提	75,593,436.33	66,617.92	208,811.93	75,868,866.18
3. 本期减少金额	36,803,045.57			36,803,045.57
(1) 终止租赁	36,803,045.57			36,803,045.57
4. 期末余额	227,328,261.46	222,059.78	679,904.33	228,230,225.57
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) 终止租赁				
4. 期末余额				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	568,333,348.90	177,647.74	192,049.17	568,703,045.81
2. 期初账面价值	561,942,805.13	244,265.66	400,861.10	562,587,931.89

其他说明：

无

## 22、无形资产

## (1). 无形资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	交易席位费	软件使用权	土地使用权	特许经营权	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	2,845,780.00	338,648,837.69	244,478,779.62	20,800,000.03	606,773,397.34
2. 本期增加金额		5,031,613.37			5,031,613.37
(1) 购置		5,031,613.37			5,031,613.37
(2) 内部研发					
(3) 企业合并增加					
3. 本期减少金额		1,956,201.42	12,215,139.93		14,171,341.35
(1) 处置		1,956,201.42			1,956,201.42
(2) 转入投资性房地产			12,215,139.93		12,215,139.93
4. 期末余额	2,845,780.00	341,724,249.64	232,263,639.69	20,800,000.03	597,633,669.36
二、累计摊销					
1. 期初余额		222,982,480.18	38,199,809.39		261,182,289.57
2. 本期增加金额		18,713,425.15	2,994,551.40		21,707,976.55
(1) 计提		18,713,425.15	2,994,551.40		21,707,976.55
3. 本期减少金额		1,956,201.42	1,999,850.19		3,956,051.61
(1) 处置		1,956,201.42			1,956,201.42
(2) 转入投资性房地产			1,999,850.19		1,999,850.19
4. 期末余额		239,739,703.91	39,194,510.60		278,934,214.51
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	101,984,545.73	193,069,129.09	20,800,000.03	318,699,454.85
2. 期初账面价值	2,845,780.00	115,666,357.51	206,278,970.23	20,800,000.03	345,591,107.77

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		
武汉光谷创投私募基金管理有限公司	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	51,424,882.46					51,424,882.46

**(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

本公司对因非同一控制下企业合并形成的商誉账面价值进行减值测试。TFI Asset Management Limited 及 TFI Securities and Futures Limited 按照市场法并参考可比交易案例的市净率指标，考虑相关影响因素后，对含有商誉资产组的公允价值进行评估。于 2023 年 6 月 30 日，管理层未注意到商誉存在明显减值迹象。

**(5). 商誉减值测试的影响**

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**24、递延所得税资产/递延所得税负债****(1). 未经抵销的递延所得税资产**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	1,340,417,703.01	335,104,425.75	1,251,958,544.22	312,989,636.06



内部交易未实现利润				
可抵扣亏损	1,293,471,045.24	323,367,761.31	1,344,042,475.48	336,010,618.87
其他债权投资公允价值变动	104,457,906.60	26,114,476.65	140,544,435.46	35,136,108.87
其他权益工具投资公允价值变动	934,420,787.74	233,605,196.94	910,469,929.95	227,617,482.49
衍生金融工具	198,496,590.69	49,624,147.67	101,485,902.60	25,371,475.65
交易性金融资产公允价值变动	73,499,370.87	18,374,842.72	72,310,809.06	18,077,702.27
纳税调整				
合计	3,944,763,404.15	986,190,851.04	3,820,812,096.77	955,203,024.21

## (2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
非同一控制企业合并资产评估增值				
其他债权投资公允价值变动				
其他权益工具投资公允价值变动				
交易性金融资产公允价值变动	1,071,047,133.83	267,761,783.47	571,391,114.24	142,847,778.56
衍生金融工具	140,526,465.25	35,131,616.31	124,379,793.87	31,094,948.47
合计	1,211,573,599.08	302,893,399.78	695,770,908.11	173,942,727.03

## (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	170.83	
应收股利	11,805.32	603,792.78
其他应收款	681,449,972.92	547,960,462.68
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	129,908,353.78	124,150,394.51
预付账款	37,019,201.44	42,972,090.29
其他流动资产	5,671,164,724.06	5,626,927,614.45
其他非流动资产	8,858,622,185.61	8,805,192,348.09
合计	15,378,176,413.96	15,147,806,702.80

其他应收款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

款项性质	期末账面余额	期初账面余额
应收往来款组合	969,335,218.97	851,198,679.78
应收押金组合	44,835,887.64	34,657,803.72
减：坏账准备	332,721,133.69	337,896,020.82
合计	681,449,972.92	547,960,462.68

## (1) 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	483,797,498.65	47.71	318,038,455.43	35.91
1 至 2 年	227,411,437.61	22.42	245,201,257.18	27.68
2 至 3 年	223,250,703.40	22.01	224,331,865.88	25.32
3 年以上	79,711,466.95	7.86	98,284,905.01	11.09
合计	1,014,171,106.61	100.00	885,856,483.50	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	123,716,159.11	16,314,797.14	10,480,482.44		129,550,473.81
其他	434,235.40		76,355.43		357,879.97
合计	124,150,394.51	16,314,797.14	10,556,837.87		129,908,353.78

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

其他资产的说明：

无

**26、 融券业务情况**

√适用 □不适用

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		
—交易性金融资产		
—转融通融入证券		
转融通融入证券总额	55,050.00	

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	9,242,121.21	-155,764.79	198,365.79			9,284,722.21
存出保证金减值准备						
应收款项坏账准备	316,482,447.18	7,818,406.87				324,300,854.05
合同资产减值准备						
买入返售金融资产减值准备	51,001,894.82	204,527.58	510,978.43			51,717,400.83
债权投资减值准备	2,955,806.20	352,323.76			129,220.57	3,178,909.39
其他债权投资减值准备	616,317.04	2,234,999.40			934,363.39	1,916,953.05
其他应收款坏账准备	337,896,020.82	-5,174,887.13				332,721,133.69
其他金融资产减值准备	725,906,991.59	86,107,976.14				812,014,967.73
金融工具及其他项目信用减值准备小计	1,444,101,598.86	91,387,581.83	709,344.22		1,063,583.96	1,535,134,940.95
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	553,099.33					553,099.33
在建工程减值准备						
无形资产减值准备						
商誉减值准备						
其他资产减值准备小计	75,924,221.56				75,371,122.23	553,099.33
合计	1,520,025,820.42	91,387,581.83	709,344.22		76,434,706.19	1,535,688,040.28

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			
	未来 12 个月预期信	整个存续期预期信用损	整个存续期预期信用损	合计

	用损失	失(未发生信用减值)	失(已发生信用减值)	
拆出资金减值准备				
融出资金减值准备	2,913,196.78	1,295.59	6,370,229.84	9,284,722.21
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备(简化模型)	/	324,300,854.05		324,300,854.05
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	14,229,707.95	12,747,670.55	24,740,022.33	51,717,400.83
债权投资减值准备	358,032.67	2,820,876.72		3,178,909.39
其他债权投资减值准备	150,691.76	1,766,261.29		1,916,953.05
其他应收款坏账准备		102,878,091.72	229,843,041.97	332,721,133.69
其他金融资产减值准备	15,670,553.17	369,333,245.71	427,011,168.85	812,014,967.73
合计	33,322,182.33	813,848,295.63	687,964,462.99	1,535,134,940.95
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	9,218,553.26	23,567.95		9,242,121.21
存出保证金减值准备				
应收款项坏账准备(简化模型)	/	316,482,447.18		316,482,447.18
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	13,657,244.05	12,604,628.44	24,740,022.33	51,001,894.82
债权投资减值准备	18,443.69	2,937,362.51		2,955,806.20
其他债权投资减值准备	18,183.87	598,133.17		616,317.04
其他应收款坏账准备		107,917,025.36	229,978,995.46	337,896,020.82
其他金融资产减值准备	17,459,364.06	384,277,555.40	324,170,072.13	725,906,991.59
合计	40,371,788.93	824,840,720.01	578,889,089.92	1,444,101,598.86

## 29、短期借款

### (1). 短期借款分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款		
抵押借款		
信用借款	1,319,104,364.45	1,276,014,426.35
合计	1,319,104,364.45	1,276,014,426.35

短期借款分类的说明：

无

### (2). 已逾期未偿还的短期借款情况

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

## 30、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
收益凭证	597,300,000.00	2023/3/24-2023/5/11		597,300,000.00	3.5-4.2		602,176,608.24		602,176,608.24
22 天风证券 CP001 短期融资券	3,000,000,000.00	2022/10/28	361 天	3,000,000,000.00	3.70	3,019,767,123.29	55,043,835.59		3,074,810,958.88
22 天风证券 CP002 短期融资券	1,130,000,000.00	2022/12/6	360 天	1,130,000,000.00	3.70	1,132,978,246.58	20,733,178.08		1,153,711,424.66
23 天风证券 CP001 短期融资券	970,000,000.00	2023/4/26	359 天	970,000,000.00	3.15		975,525,013.70		975,525,013.70
TFI Overseas Investment Limited Series 2023-001	3,000,000.00 美元	2023/1/27	364 天	20,310,600.00	6.70		22,403,578.02		22,403,578.02
TFI Overseas Investment Limited Series 2023-002	5,000,000.00 港币	2023/1/19	364 天	4,324,350.00	6.00		4,748,291.47		4,748,291.47
TFI Overseas Investment Limited Series 2023-003	6,100,000.00 美元	2023/2/2	181 天	40,949,300.00	6.37		45,240,655.00		45,240,655.00
TFI Overseas Investment Limited Series 2023-004	2,000,000.00 港币	2023/2/16	336 天	1,746,300.00	6.00		1,890,096.79		1,890,096.79
TFI Overseas Investment Limited Series 2023-009	10,000,000.00 美元	2023/5/11	61 天	69,101,000.00	5.80		72,956,479.69		72,956,479.69
TFI Overseas Investment	5,000,000.00 美元	2022/1/28	361 天	31,873,000.00	4.60	36,300,051.23	118,384.61	36,418,435.84	

Limited Series 2022-01									
TFI Overseas Investment Limited Series 2022-03	3,000,000.00 美元	2022/11/1	92 天	21,624,300.00	5.15	21,073,012.00	97,875.17	21,170,887.17	
TFI Overseas Investment Limited Series 2022-04	5,000,000.00 美元	2022/11/1	182 天	36,040,500.00	5.80	35,172,068.51	700,409.29	35,872,477.80	
TFI Overseas Investment Limited Series 2022-06	6,300,000.00 美元	2022/12/6	182 天	43,939,980.00	5.80	44,106,936.21	10,011,853.91	54,118,790.12	
TFI Overseas Investment Limited Series 2022-08	24,500,000.00 美元	2022/12/19	364 天	170,877,700.00	7.40	170,631,676.12	12,394,279.43	5,124,970.91	177,900,984.64
合计	/	/	/	6,138,087,030.00	/	4,460,029,113.94	1,824,040,538.99	152,705,561.84	6,131,364,091.09

应付短期融资款的说明：

注：本公司 2023 年 6 月 30 日尚未到期的期限小于一年的收益凭证共计 15 笔，未到期产品的票面利率均在 3.5%-4.2%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	4,180,891,663.21	4,605,561,468.90
转融通融入资金		
非银行金融机构拆入资金	200,037,777.78	
合计	4,380,929,440.99	4,605,561,468.90

转融通融入资金：

□适用 √不适用

拆入资金的说明：

无

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

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
债券	1,559,620,238.25		1,559,620,238.25	468,092,499.59		468,092,499.59
股票	121,701,360.00		121,701,360.00	117,911,640.00		117,911,640.00
第三方在结构化主体中享有的权益及其他		133,571,721.63	133,571,721.63		175,476,494.73	175,476,494.73
合计	1,681,321,598.25	133,571,721.63	1,814,893,319.88	586,004,139.59	175,476,494.73	761,480,634.32

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
买断式卖出回购	458,236,344.77	428,410,896.03
质押式卖出回购	8,191,436,748.58	3,818,944,695.86
质押式报价回购		
合计	8,649,673,093.35	4,247,355,591.89

## (2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票		
债券	8,649,673,093.35	4,247,355,591.89
其他		
合计	8,649,673,093.35	4,247,355,591.89

## (3) 担保物金额

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票		
债券	9,652,157,468.81	5,693,700,280.15
其他		
合计	9,652,157,468.81	5,693,700,280.15

## (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	6,235,916,726.38	6,826,619,274.92
机构	1,183,117,679.87	1,249,055,156.70
小计	7,419,034,406.25	8,075,674,431.62
信用业务		
其中：个人	968,173,135.76	993,875,798.46
机构	52,614,354.98	58,121,220.55
小计	1,020,787,490.74	1,051,997,019.01
合计	8,439,821,896.99	9,127,671,450.63



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	284,469,745.44	716,411,143.94	869,031,154.61	131,849,734.77
二、离职后福利-设定提存计划	201,766.28	47,020,202.92	47,002,057.69	219,911.51
三、辞退福利		6,135,823.86	6,135,823.86	
四、一年内到期的其他福利				
合计	284,671,511.72	769,567,170.72	922,169,036.16	132,069,646.28

#### (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	283,804,966.24	646,679,658.02	799,244,125.85	131,240,498.41
二、职工福利费		7,078,937.59	7,078,937.59	
三、社会保险费	468.95	26,610,053.52	26,608,967.10	1,555.37
其中：医疗保险费	0.17	24,503,117.74	24,501,990.22	1,127.69
工伤保险费	262.60	489,727.43	489,838.53	151.50
生育保险费	206.18	1,617,208.35	1,617,138.35	276.18
四、住房公积金	84,314.87	34,863,674.71	34,863,674.71	84,314.87
五、工会经费和职工教育经费	579,995.38	1,178,820.10	1,235,449.36	523,366.12
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	284,469,745.44	716,411,143.94	869,031,154.61	131,849,734.77

#### (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	197,809.09	45,532,027.22	45,513,881.99	215,954.32
2、失业保险费	3,957.19	1,488,175.70	1,488,175.70	3,957.19
3、企业年金缴费				
合计	201,766.28	47,020,202.92	47,002,057.69	219,911.51

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	9,928,096.35	8,116,081.89
消费税		
营业税		
企业所得税	49,098,740.57	45,415,372.46
个人所得税	12,927,540.51	16,539,394.25
城市维护建设税	1,484,847.71	1,503,720.05
教育费附加及地方教育费附加	1,069,527.73	1,051,667.75
其他	369,521.07	6,289,866.01
合计	74,878,273.94	78,916,102.41

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
应付票据		
应付手续费及佣金	6,836,203.11	2,696,802.56
合计	6,836,203.11	2,696,802.56

**(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	29,765,961.70	74,174,441.85
合计	29,765,961.70	74,174,441.85

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

40、 持有待售负债

适用 不适用

41、 预计负债

适用 不适用

42、 长期借款

(1). 长期借款分类

适用 不适用

其他说明，包括利率区间:

适用 不适用

## 43、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
20 天风 C1	100	2020/2/27	3 年	670,000,000.00	3.90	692,021,554.99	4,108,443.51	696,129,998.50	
20 天风 C2	100	2020/2/27	5 年	1,080,000,000.00	4.90	1,124,085,282.46	26,595,131.54	52,920,000.00	1,097,760,414.00
20 天风 C3	100	2020/6/23	3 年	1,800,000,000.00	4.70	1,843,472,057.91	41,127,942.09	1,884,600,000.00	
21 天风 C1	100	2021/9/30	3 年	4,000,000,000.00	5.40	4,051,203,670.32	108,942,510.54		4,160,146,180.86
18 天风 01	100	2018/3/14	3+2 年	2,420,000,000.00	5.95、 4.00	2,148,879,272.14	18,480,727.86	2,167,360,000.00	
18 天风 02	100	2018/3/27	3+2 年	880,000,000.00	5.80、 4.10	611,377,758.04	6,424,511.96	617,802,270.00	
20 天风 01	100	2020/4/15	3 年	1,500,000,000.00	2.87	1,530,192,507.04	12,857,492.96	1,543,050,000.00	
21 天风 01	100	2021/1/19	3 年	700,000,000.00	4.18	727,075,745.69	14,972,714.18	29,260,000.00	712,788,459.87
21 天风 02	100	2021/3/12	2 年	800,000,000.00	4.50	828,671,654.98	7,328,345.02	836,000,000.00	
21 天风 04	100	2021/6/28	2 年	2,000,000,000.00	4.12	2,040,466,065.28	41,933,934.72	2,082,400,000.00	
21 天风 05	100	2021/12/27	3 年	2,500,000,000.00	4.30	2,494,005,251.44	55,517,748.66		2,549,523,000.10
22 天风 01 长期公司债	100	2022/1/24	3 年	1,800,000,000.00	4.06	1,866,626,843.46	36,962,157.84	73,080,000.00	1,830,509,001.30
22 天风 02 长期公司债	100	2022/2/28	3 年	700,000,000.00	4.08	723,314,171.73	14,442,931.26	28,560,000.00	709,197,102.99
22 天风 03 长期公司债	100	2022/5/6	3 年	4,300,000,000.00	4.50	4,425,991,249.90	96,815,544.36	193,500,000.00	4,329,306,794.26
22 天风 04 长期公司债	100	2022/7/8	3 年	2,700,000,000.00	4.80	2,762,064,180.05	64,840,470.90		2,826,904,650.95
22 天风 05 长期公司债	100	2022/11/21	3 年	1,800,000,000.00	5.00	1,809,836,173.55	45,026,931.90		1,854,863,105.45
23 天风 01	100	2023/4/11	2+1 年	1,600,000,000.00	5.18		1,618,217,315.76		1,618,217,315.76
23 天风 02	100	2023/4/11	1+1+1 年	4,400,000,000.00	4.75		4,445,963,602.30		4,445,963,602.30
23 天风 03	100	2023/4/18	2+1 年	3,000,000,000.00	5.08		3,030,523,492.89		3,030,523,492.89
23 天风 04	100	2023/4/18	1+1+1 年	400,000,000.00	4.17		403,337,527.59		403,337,527.59
22 天睿 01	100	2022/6/13	3+2 年	500,000,000.00	6.50	503,897,175.84	18,896,858.40	32,500,000.00	490,294,034.24

2023 年半年度报告

长期收益凭证 (注)	100	2021/3/30- 2023/5/26		10,202,800,000.00	4.2-5.43	8,197,206,214.38	2,424,461,252.47	2,290,478,100.00	8,331,189,366.85
22 天风海外 2024-03-15	100 美元	2022/3/15	2 年	340,000,000.00 美元	4.00	2,391,040,387.31	236,460,717.54	144,744,210.66	2,482,756,894.19
GuaranteedNotes	100 美元	2022/4/6	3 年	50,000,000.00 美元	4.00	351,431,402.86	20,024,542.72	6,922,233.20	364,533,712.38
天风国际证券 N20240605	100 美元	2022/12/5	1.5 年	240,000,000.00 美元	6.50	1,679,658,598.35	117,904,808.42	54,739,315.69	1,742,824,091.08
天风国际证券 N20230606	100 美元	2022/12/9	2.5 年	250,000,000.00 美元	6.75	1,748,686,642.54	127,506,628.53	59,216,738.63	1,816,976,532.44
合计						44,551,203,860.26	13,039,674,285.92	12,793,262,866.68	44,797,615,279.50

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：

注：本公司 2023 年 6 月 30 日尚未到期的长期收益凭证共计 84 笔，未到期产品的票面利率均在 4.20%-5.43%之间。

**44、租赁负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一年以内到期的租赁负债	134,836,569.03	126,999,246.45
一年以上的非流动租赁负债	458,377,342.91	454,912,830.54
合计	593,213,911.94	581,912,076.99

其他说明：

无

**45、递延收益**

□适用 √不适用

**46、其他负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付利息	83,076.92	175,411.59
应付股利		
其他应付款	1,438,432,033.38	1,511,158,291.70
代理兑付债券款		
预提费用		
应付账款	177,027,993.13	293,878,929.24
其他流动负债	6,577,241.72	509,229,961.57
预收款项		1,800,000,000.00
合计	1,622,120,345.15	4,114,442,594.10

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（+、-）					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	8,665,757,464.00						8,665,757,464.00

其他说明：

无

**48、其他权益工具**

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

适用 不适用

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

适用 不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

**49、资本公积**

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	13,577,865,194.70			13,577,865,194.70
其他资本公积	-167,522,999.58	176,170,222.48		8,647,222.90
合计	13,410,342,195.12	176,170,222.48		13,586,512,417.60

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

其他资本公积本期变动系权益法下联营企业其他权益变动及转让部分联营企业股权所致。

**50、库存股**

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
库存股	252,589,862.14			252,589,862.14
合计	252,589,862.14			252,589,862.14

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

## 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	-770,942,414.60	53,594,175.37	-5,987,714.46		-393,846.48	59,975,736.31	-6,907,965.60	66,883,701.91	-777,850,380.20
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	-770,942,414.60	53,594,175.37	-5,987,714.46		-393,846.48	59,975,736.31	-6,907,965.60	66,883,701.91	-777,850,380.20
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	-89,112,875.55	133,374,055.10	9,346,791.22	46,652,305.26		77,374,958.62	77,374,958.62		-11,737,916.93
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-18,472,422.90	15,671,374.95				15,671,374.95	15,671,374.95		-2,801,047.95
其他债权投资公允价值变动	-105,408,326.59	81,804,470.73	9,021,632.22	45,717,941.87		27,064,896.64	27,064,896.64		-78,343,429.95



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	504,134.89	2,234,999.40	325,159.00	934,363.39		975,477.01	975,477.01		1,479,611.90
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	34,263,739.05	33,663,210.02				33,663,210.02	33,663,210.02		67,926,949.07
其他综合收益合计	-860,055,290.15	186,968,230.47	3,359,076.76	46,652,305.26	-393,846.48	137,350,694.93	70,466,993.02	66,883,701.91	-789,588,297.13

项目	期初余额	上期发生金额						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	-427,236,098.34	-69,199,564.72	8,610,282.98		30,744,397.00	-108,554,244.70	-80,677,553.97	-27,876,690.73	-507,913,652.31
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益									

其他权益工具投资公允价值变动	-427,236,098.34	-69,199,564.72	8,610,282.98		30,744,397.00	-108,554,244.70	-80,677,553.97	-27,876,690.73	-507,913,652.31
企业自身信用风险公允价值变动									
二、将重分类进损益的其他综合收益	-135,868,681.39	2,261,314.04	-8,229,881.16			10,491,195.20	10,491,195.20		-125,377,486.19
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-9,973,422.14	-859,535.14				-859,535.14	-859,535.14		-10,832,957.28
其他债权投资公允价值变动	-107,473,610.92	-33,004,747.09	-8,251,186.77			-24,753,560.32	-24,753,560.32		-132,227,171.24
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	9,601,546.39	85,222.44	21,305.61			63,916.83	63,916.83		9,665,463.22
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	-28,023,194.72	36,040,373.83				36,040,373.83	36,040,373.83		8,017,179.11
其他综合收益合计	-563,104,779.73	-66,938,250.68	380,401.82		30,744,397.00	-98,063,049.50	-70,186,358.77	-27,876,690.73	-633,291,138.50

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	327,819,540.82			327,819,540.82
任意盈余公积				
储备基金				
企业发展基金				
其他				
合计	327,819,540.82			327,819,540.82

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

无

**53、 一般风险准备**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	470,304,753.00				470,304,753.00
交易风险准备	412,247,492.47				412,247,492.47
合计	882,552,245.47				882,552,245.47

一般风险准备的说明

无

**54、 未分配利润**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上年度
调整前上期末未分配利润	945,578,513.61	2,612,903,191.33
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	945,578,513.61	2,612,903,191.33
加：本期归属于母公司所有者的净利润	551,805,663.13	-1,508,969,578.78
减：提取法定盈余公积		
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备		37,196,614.24
应付普通股股利		35,931,083.91
转作股本的普通股股利		51,587,822.84
提取交易风险准备		
其他综合收益结转留存收益	833,417.47	33,639,577.95
其他	-77,186.01	
期末未分配利润	1,496,627,945.28	945,578,513.61

调整期初未分配利润明细:

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

## 55、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	498,555,261.18	595,157,324.94
其中：货币资金及结算备付金利息收入	156,224,467.96	166,912,621.31
拆出资金利息收入		14,390,541.54
融出资金利息收入	139,937,547.57	130,037,869.53
买入返售金融资产利息收入	41,508,948.24	45,495,436.93
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	2,466,878.22	6,123,514.49
债权投资利息收入	37,396,033.65	39,613,648.28
其他债权投资利息收入	72,950,836.97	70,656,789.76
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	50,537,426.79	128,050,417.59
利息支出	1,394,960,496.52	1,149,404,085.36
其中：短期借款利息支出	25,454,330.48	7,365,738.48
应付短期融资款利息支出	105,379,295.62	104,421,415.18
拆入资金利息支出	50,079,984.27	37,069,453.52
其中：转融通利息支出		
卖出回购金融资产款利息支出	81,239,529.19	100,869,953.78
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	10,912,322.70	18,440,279.24
长期借款利息支出		27,438,100.00
应付债券利息支出	1,074,668,315.69	856,964,499.68
其中：次级债券利息支出	180,774,027.68	225,594,814.97
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	47,226,718.57	-3,165,354.52
利息净收入	-896,405,235.34	-554,246,760.42

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	515,662,440.83	484,939,495.98
证券经纪业务收入	645,794,222.40	632,737,232.32
其中：代理买卖证券业务	284,218,458.50	308,243,457.96
交易单元席位租赁	347,628,698.85	312,404,109.58
代销金融产品业务	13,947,065.05	12,089,664.78
证券经纪业务支出	130,131,781.57	147,797,736.34
其中：代理买卖证券业务	130,131,781.57	147,797,736.34
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	436,208,799.59	562,318,975.38
投资银行业务收入	436,766,361.86	563,770,390.47
其中：证券承销业务	371,345,031.27	493,547,301.66
证券保荐业务	10,522,099.24	14,150,943.40
财务顾问业务	54,899,231.35	56,072,145.41
投资银行业务支出	557,562.27	1,451,415.09
其中：证券承销业务	557,562.27	1,451,415.09
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4. 资产管理业务净收入	316,802,708.97	510,038,933.09
资产管理业务收入	316,802,708.97	510,038,933.09
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入	4,286,152.59	8,432,501.74
基金管理业务收入	4,286,152.59	8,432,501.74
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	50,536,599.45	44,744,352.71
投资咨询业务收入	50,536,599.45	44,744,352.71
投资咨询业务支出		
7. 其他手续费及佣金净收入	3,845,341.42	6,570,339.37
其他手续费及佣金收入	3,845,341.42	6,570,339.37
其他手续费及佣金支出		
合计	1,327,342,042.85	1,617,044,598.27
其中：手续费及佣金收入	1,458,031,386.69	1,766,293,749.70
手续费及佣金支出	130,689,343.84	149,249,151.43

## (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		1,886,792.45

并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	54,899,231.35	54,185,352.96

**(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	2,714,297,368.00	13,404,258.57	2,069,506,203.77	11,367,919.38
银行理财产品				
信托	5,654,500.00	542,806.48	128,705,300.00	721,745.40
合计	2,719,951,868.00	13,947,065.05	2,198,211,503.77	12,089,664.78

**(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	205	36	75
期末客户数量	21,908	164	1,022
其中：个人客户	21,618	126	
机构客户	290	38	1,022
期初受托资金	33,760,301,569.94	21,119,561,791.89	53,611,625,710.00
其中：自有资金投入	1,434,240,429.33	1,894,686,320.02	646,000,000.00
个人客户	20,370,019,327.15	666,560,855.95	
机构客户	11,956,041,813.46	18,558,314,615.92	52,965,625,710.00
期末受托资金	28,790,492,478.67	21,800,648,269.77	57,677,380,630.00
其中：自有资金投入	1,590,254,734.53	1,955,582,179.33	470,000,000.00
个人客户	16,791,582,361.15	687,984,347.36	
机构客户	10,408,655,382.99	19,157,081,743.08	57,207,380,630.00
期末主要受托资产初始成本	32,915,443,463.11	22,174,360,015.37	58,735,076,270.65
其中：股票	165,267,638.55	307,425,331.69	
国债	179,870,374.76		
其他债券	18,012,062,251.56	3,652,181,649.49	
基金	960,966,129.04	424,591,311.91	
资产支持证券	294,342,785.98	67,409,510.01	56,618,209,089.88
信托		143,939,493.00	
协议或定期存款			
委贷		300,000,000.00	
基金专户理财			
期货保证金	12,013,926.24	203,195.00	
买入返售金融资产	1,913,246,812.12	2,352,374,696.88	
卖出回购金融资产款	-2,150,518,371.37	-374,815,712.15	
收益权		9,713,015,465.39	
债权类资产		2,488,952,327.99	
期货资管计划	92,921,136.77		
股票质押式回购		950,000,000.00	
其他	13,435,270,779.46	2,149,082,746.16	2,116,867,180.77
当期资产管理业务净收入	259,448,981.21	41,725,462.97	15,628,264.79

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	44,023,795.43	-81,691,615.73
处置长期股权投资产生的投资收益	363,041,908.23	
金融工具投资收益	784,984,174.65	217,045,211.96
其中：持有期间取得的收益	568,061,873.75	396,748,324.04
— 交易性金融工具	547,630,326.89	395,416,999.24
— 其他权益工具投资	20,431,546.86	1,331,324.80
— 衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	216,922,300.90	-179,703,112.08
— 交易性金融工具	157,579,029.42	-183,868,220.10
— 其他债权投资	42,851,480.97	-1,399,130.92
— 债权投资	90,895.67	15,706,132.30
— 衍生金融工具	16,400,894.84	-10,141,893.36
其他		
债务重组收益		
合计	1,192,049,878.31	135,353,596.23

### (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	547,630,326.89	397,084,365.15
	处置取得收益	153,946,499.44	-182,899,486.96
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		-1,667,365.91
	处置取得收益	3,632,529.98	-968,733.14
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益		

投资收益的说明：

无

#### 58、净敞口套期收益

适用 不适用

#### 59、其他收益

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
个税手续费返还	10,174,753.75	6,467,673.89
政府补助	2,875,686.06	4,865,965.15
其他	945,232.36	382,475.31
合计	13,995,672.17	11,716,114.35

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	591,754,397.24	-140,145,787.75
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债	-18,210,476.02	14,215,666.07
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	-84,532,192.04	26,157,454.18
其他		
合计	489,011,729.18	-99,772,667.50

其他说明：

无

#### 61、其他业务收入

适用 不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
出租收入	16,485,043.75	12,417,840.25
其他	8,975,985.34	5,772,941.29
合计	25,461,029.09	18,190,781.54

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	-131,246.98	-13,359.51
使用权资产清理收益	-1,172,562.23	-1,551,899.30
合计	-1,303,809.21	-1,565,258.81

其他说明：

□适用 √不适用

**63、税金及附加**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准
城市维护建设税	6,516,206.65	8,349,838.04	7%、5%、1%
教育费附加及地方教育附加	4,656,276.28	5,939,846.74	3%、2%
房产税	4,343,514.51	10,193,069.84	12%、1.2%
土地使用税	101,794.81	134,552.45	按规定缴纳
车船使用税	15,230.00	12,560.00	按规定缴纳
印花税	725,375.07	1,934,862.74	按规定缴纳
其他	5,013.78	5,526.93	按规定缴纳
合计	16,363,411.10	26,570,256.74	/

其他说明：

无

**64、业务及管理费**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	768,564,844.98	615,117,325.77
租赁费	24,268,786.22	19,489,177.82
折旧费	96,646,885.38	87,830,237.73
无形资产摊销	21,707,976.55	17,446,014.01
长期待摊费用摊销	10,331,791.91	10,744,921.80
差旅费	32,929,928.25	22,998,708.04
业务招待费	41,036,543.93	40,666,954.98
投资者保护基金	12,959,793.91	6,131,658.57
电子设备运转费	37,450,614.23	39,736,351.30
安全防范费	188,486.41	195,598.67
基金管理费及托管费	4,665,057.56	11,233,497.88
资产管理计划销售费用	72,747,742.06	104,033,817.75
其他	142,517,435.55	163,216,276.97
合计	1,266,015,886.94	1,138,840,541.29

其他说明：

无

**65、信用减值损失**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
融出资金减值损失	-155,764.79	-238,139.98
应收款项及其他应收款信用减值损失	2,643,519.74	5,287,131.95
买入返售金融资产减值损失	204,527.58	4,201,490.67
其他债权投资减值损失	2,234,999.40	145,718.82
债权投资减值损失	352,323.76	3,084,573.13
其他资产减值损失	86,107,976.14	-10,231,198.01
合计	91,387,581.83	2,249,576.58

其他说明：

无

**66、其他资产减值损失**

□适用 √不适用

**67、其他业务成本**

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
投资性房地产摊销	9,800,297.64	10,010,171.79
其他	2,522,453.06	1,328,351.64
合计	12,322,750.70	11,338,523.43

其他说明：

无

**68、营业外收入**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得合计			
其中：固定资产处置利得			
无形资产处置利得			
债务重组利得			
非货币性资产交换利得			
接受捐赠			
政府补助	111,593,000.00	40,130,000.00	111,593,000.00

其他	190,755.97	118,297.27	190,755.97
合计	111,783,755.97	40,248,297.27	111,783,755.97

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	111,593,000.00	40,130,000.00	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	511,413.08	359,032.83	511,413.08
其中：固定资产处置损失	280,658.36	359,032.83	280,658.36
无形资产处置损失			
债务重组损失			
非货币性资产交换损失			
对外捐赠	891,321.00	2,693,687.16	891,321.00
其他	1,326,079.04	581,235.37	1,326,079.04
合计	2,728,813.12	3,633,955.36	2,728,813.12

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	86,496,576.21	24,798,919.83
递延所得税费用	94,603,769.15	-99,204,988.89
合计	181,100,345.36	-74,406,069.06

## (2) 会计利润与所得税费用调整过程

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	883,093,467.54
按法定/适用税率计算的所得税费用	220,773,366.89
子公司适用不同税率的影响	-5,584,387.86
调整以前期间所得税的影响	429,394.54
非应税收入的影响	-27,134,905.80
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	7,459,961.51
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	29,737,727.13
其他	-44,580,811.05
所得税费用	181,100,345.36

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	114,468,686.06	45,012,533.13
收到的存出保证金	81,089,697.04	508,177,330.42
收到的其他往来款	5,175,913,201.19	1,069,140,295.42
合计	5,371,471,584.29	1,622,330,158.97

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	287,153,335.99	363,189,419.00
支付的投资者保护基金	7,409,555.89	18,448,397.08
捐赠支出	891,321.00	2,693,687.16
支付其他往来款	1,267,814,832.12	1,226,974,743.11

支付的存出保证金	26,413,927.23	46,808,160.42
合计	1,589,682,972.23	1,658,114,406.77

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	701,993,122.18	62,287,369.48
加：资产减值准备		
信用减值损失	91,387,581.83	2,249,576.58
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	30,578,316.84	29,912,857.30
使用权资产摊销	75,868,866.18	67,927,552.22
无形资产摊销	21,707,976.55	17,446,014.01
长期待摊费用摊销	10,556,837.87	10,451,744.93
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）	1,303,809.21	1,565,258.81
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	280,658.36	359,032.83
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-489,011,729.18	99,772,667.50
财务费用（收益以“-”号填列）	887,513,298.76	968,165,015.59
投资损失（收益以“-”号填列）	-600,353,197.50	-208,427,511.04
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-34,021,744.59	-111,600,065.02
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	128,950,672.75	-69,125,496.33
存货的减少（增加以“-”号填列）		

处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净增加额	1,481,222,206.49	-1,094,364,779.68
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	4,057,936,450.57	-502,679,822.23
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	2,131,334,372.20	-1,309,856,988.53
其他		
经营活动产生的现金流量净额	8,497,247,498.52	-2,035,917,573.58
<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	21,493,564,683.82	22,929,176,569.90
减：现金的期初余额	16,456,724,342.40	20,952,643,792.97
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	5,036,840,341.42	1,976,532,776.93

## (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	21,493,564,683.82	16,456,724,342.40
其中：库存现金	23,019.34	44,281.46
可随时用于支付的银行存款	19,799,294,361.90	14,037,897,510.20
可随时用于支付的其他货币资金	5,813.31	4,845,282.43
可随时用于支付的结算备付金	1,694,241,489.27	2,413,937,268.31
存放同业款项		
拆放同业款项		
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	21,493,564,683.82	16,456,724,342.40
其中：母公司或集团内子公司使用受限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	1,254,649,756.46	风险准备金专户存款/司法冻结
存出保证金	13,633,161.84	转融通担保物
交易性金融资产	8,146,209,116.33	司法冻结/卖出回购担保物
债权投资	1,108,959,974.26	卖出回购担保物
其他债权投资	3,297,500,076.69	卖出回购担保物
合计	13,820,952,085.58	/

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	85,646,819.52	7.2258	618,869,608.56
欧元	51,605.40	7.8771	406,502.01
港币	123,789,560.00	0.9220	114,131,498.54
结算备付金	-	-	-
其中：美元	101,558.27	7.2258	733,839.76
港币	2,978,177.35	0.9220	2,745,819.96
存出保证金	-	-	-
其中：美元	9,439,101.12	7.2258	68,205,367.29
港币	25,940,579.65	0.9220	23,916,695.63
交易性金融资产	-	-	-
其中：美元	1,141,284,634.78	7.2258	8,246,694,513.99
港币	132,359,136.17	0.9220	122,032,476.36
应收账款	-	-	-
其中：美元	164,013,246.58	7.2258	1,185,126,917.14
欧元	172,784.55	7.8771	1,361,041.18
港币	1,037,456,165.04	0.9220	956,513,835.04
其他资产	-	-	-
其中：美元	11,253,652.00	7.2258	81,316,638.62
港币	1,589,858.00	0.9220	1,465,849.08
短期借款	-	-	-
其中：港币	1,430,729,912.20	0.9220	1,319,104,364.45
代理买卖证券款	-	-	-

其中：美元	86,735,587.99	7.2258	626,734,011.70
欧元	22,736.30	7.8771	179,096.11
港币	2,294,212.22	0.9220	2,115,263.67
应付短期融资款	-	-	-
其中：美元	44,078,399.26	7.2258	318,501,697.35
港币	7,199,987.26	0.9220	6,638,388.26
应付债券	-	-	-
其中：美元	886,696,453.00	7.2258	6,407,091,230.09
其他负债	-	-	-
其中：美元	470,836.00	7.2258	3,402,166.77
港币	1,144,727.74	0.9220	1,055,438.98

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	114,395,000.00	营业外收入/其他收益	114,395,000.00
其他	73,686.06	其他收益	73,686.06

(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

由全资子公司天风创新投资有限公司作为管理人的汇智易德咸宁股权投资合伙企业（有限合伙）本期末已完成工商注销，本期合并范围由此减少。

### 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	
天风天睿投资有限公司	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	100		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
武汉光谷创投私募基金管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	对高新技术企业的投资及投资咨询		55	非同一控制下企业合并
武汉天阔投资管理有限公司	湖北武汉	湖北武汉	项目投资、投资咨询等		100	设立
天风天睿物业管理（武汉）有限公司	湖北武汉	湖北武汉	物业管理；图文设计制作		100	设立
企巢天风（武汉）创业投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	管理或受托管理股权类投资并从事相关咨询服务业务			非同一控制下企业合并

TF International Securities Group Limited	中国香港	中国香港	金融公司的投资和管理	100		非同一控制下企业合并
TFI Securities Limited	中国香港	中国香港	行政管理、人事管理		100	非同一控制下企业合并
TFI Capital Limited	中国香港	中国香港	基金投资及运营管理		100	非同一控制下企业合并
TFI Asset Management Limited	中国香港	中国香港	资产管理业务及投资咨询业务		100	非同一控制下企业合并
TFI Asset Management (Cayman) Ltd.	开曼	开曼	投资基金业务		100	设立
TFI Securities and Futures Limited	中国香港	中国香港	证券经纪业务、期货经纪业务		100	非同一控制下企业合并
TFI Overseas Investment Limited	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛			100	设立
天云信息服务（深圳）有限公司	广东深圳	广东深圳	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务		100	设立
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
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
天风瑞祺（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
汇盈通祺（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
天风汇城（武汉）投资中心（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	从事非证券类股权投资活动及相关的咨询服务业务			结构化主体
上海天适新股权投资中心（有限合伙）	上海市	上海市	股权投资、投资咨询			结构化主体

天睿中创股权投资基金（武汉）合伙企业（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	股权投资、投资咨询			结构化主体
睿云天吉股权投资基金（武汉）合伙企业（有限合伙）	湖北武汉	湖北武汉	股权投资、投资咨询			结构化主体
若干证券公司及资产管理公司资产管理计划	上海市	上海市	证券投资			结构化主体

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：

无

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

无

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

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

确定公司是代理人还是委托人的依据：

无

其他说明：

无

**(2). 重要的非全资子公司**

适用 不适用

**(3). 重要非全资子公司的主要财务信息**

适用 不适用

**(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制：**

适用 不适用

**(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持：**

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

## 2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

□适用 √不适用

## 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	
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	16.92		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恒泰证券股份有限公司派驻董事。

## (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
	恒泰证券股份有限公司	恒泰证券股份有限公司
资产合计	31,634,696,735.29	31,021,247,666.61
负债合计	23,263,212,144.05	22,835,492,781.11
少数股东权益	154,908,885.67	188,629,142.87
归属于母公司股东权益	8,216,575,705.57	7,997,125,742.63
按持股比例计算的净资产份额	1,389,806,400.55	1,352,681,830.86
调整事项	1,099,657,011.57	1,099,657,011.57
—商誉	1,099,657,011.57	1,099,657,011.57
对联营企业权益投资的账面价值	2,489,463,412.12	2,452,338,842.43
营业收入	1,133,320,792.83	574,562,992.65
净利润	159,475,789.24	-373,696,883.38
其他综合收益	26,253,916.50	-24,473,619.52
综合收益总额	185,729,705.74	-398,170,502.90
本年度收到的来自联营企业的股利		

其他说明：

无

## (4). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	372,830,264.77	761,973,965.51
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	11,340,627.06	12,470,379.74
--其他综合收益	5,103,041.76	5,623,526.67
--综合收益总额	16,443,668.82	18,093,906.41

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	2,378,364,646.56	2,378,364,646.56	2,100,622,336.78	2,100,622,336.78
----------	------------------	------------------	------------------	------------------

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

## 6、其他

适用 不适用

## 十一、与金融工具相关的风险

适用 不适用

详见本报告第十节财务报告十七、风险管理

## 十二、公允价值的披露

### 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值 计量	第二层次公允价值 计量	第三层次公允价值 计量	合计
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
(一) 交易性金融资产	1,471,103,245.06	32,195,286,030.40	4,601,813,527.70	38,268,202,803.16
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	1,471,103,245.06	32,195,286,030.40	4,601,813,527.70	38,268,202,803.16
(1) 债务工具投资	233,621,710.48	16,345,653,424.54	638,747,367.84	17,218,022,502.86
(2) 权益工具投资	1,237,481,534.58	15,849,632,605.86	3,874,955,952.51	20,962,070,092.95
(3) 衍生金融资产			88,110,207.35	88,110,207.35
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		5,415,331,384.21		5,415,331,384.21
(三) 其他权益工具投资		111,527,480.57	1,470,782,874.16	1,582,310,354.73
(四) 投资性房地产				

1. 出租用的土地使用权				
2. 出租的建筑物				
3. 持有并准备增值后转让的土地使用权				
(五) 生物资产				
1. 消耗性生物资产				
2. 生产性生物资产				
持续以公允价值计量的资产总额	1,471,103,245.06	37,722,144,895.18	6,072,596,401.86	45,265,844,542.10
(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	121,701,360.00	1,559,620,238.25	80,256,123.42	1,761,577,721.67
其中：发行的交易性债券		1,559,620,238.25		1,559,620,238.25
衍生金融负债			80,256,123.42	80,256,123.42
其他	121,701,360.00			121,701,360.00
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			133,571,721.63	133,571,721.63
持续以公允价值计量的负债总额	121,701,360.00	1,559,620,238.25	213,827,845.05	1,895,149,443.3
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

## 2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

√适用 □不适用

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

√适用 □不适用

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

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

√适用 □不适用

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

#### 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

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。

#### 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2023年6月30日,本公司管理层认为除应付债券外,其他金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。



截至 2023 年 6 月 30 日，本公司所持有应付债券账面价值为人民币 44,797,615,279.5 元，公允价值为人民币 45,224,830,796.88 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

单位：万元 币种：人民币

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例 (%)	母公司对本企业的表决权比例 (%)
湖北宏泰集团有限公司	湖北武汉	投资	800,000	13.84	22.62

本企业的母公司情况的说明：

2022 年 9 月 30 日，公司股东湖北省联合发展投资集团有限公司（以下简称“联发投集团”）与湖北联投集团有限公司（以下简称“联投集团”）、湖北宏泰集团有限公司（以下简称“宏泰集团”）签署了《湖北省联合发展投资集团有限公司与湖北联投集团有限公司、湖北宏泰集团有限公司关于天风证券股份有限公司 5.99%股份之附条件生效的股份转让协议》（以下简称“《股份转让协议》”），宏泰集团受让联发投集团持有的公司股份 519,359,753 股（占公司总股本的 5.99%）。2022 年 10 月 19 日，公司股东宏泰集团与武汉商贸集团有限公司（以下简称“武汉商贸”）签署了《一致行动协议》，协议约定在未来公司经营管理过程中，根据有关法律法规、证监会规定和公司章程约定需要由公司股东、董事行使相关权利时，武汉商贸将与宏泰集团采取一致行动，作出相同的意思表示，双方意见不一致时，以宏泰集团意见为准，以巩固宏泰集团在本公司的控股股东地位。上述股份转让及一致行动事项完成后，宏泰集团及其一致行动人将合计持有公司 22.62%的股权，宏泰集团成为公司控股股东，宏泰集团的实际控制人湖北省财政厅成为公司实际控制人。2022 年 12 月 28 日，公司收到中国证券监督管理委员会《关于核准天风证券股份有限公司变更主要股东的批复》（证监许可〔2022〕3232 号），核准宏泰集团成为公司控股股东。

本企业最终控制方是湖北省财政厅

其他说明：

无

### 2、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

适用 不适用

详见本报告第十节财务报告十、在其他主体中的权益 1、在子公司中的权益。

### 3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

√适用 □不适用

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

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

√适用 □不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
紫金天风期货股份有限公司	联营企业
恒泰证券股份有限公司	联营企业
宜宾市商业银行股份有限公司	原联营企业

其他说明：

□适用 √不适用

### 4、其他关联方情况

√适用 □不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
武汉商贸集团有限公司	持有公司 5%以上股份的股东
武汉商贸集团有限公司之子公司	持有公司 5%以上股份的股东之子公司
湖北省联合发展投资集团有限公司	原持有公司 5%以上股份的股东
湖北省联合发展投资集团有限公司之子公司	原持有公司 5%以上股份的股东之子公司
武汉当代科技产业集团股份有限公司	原直接和间接持股合计 5%以上股份的股东
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	原直接和间接持股合计 5%以上股份的股东之子公司
人福医药集团股份公司	原持有公司 5%以上股份的股东
人福医药集团股份公司之子公司	原持有公司 5%以上股份的股东之子公司
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	原间接持股 5%以上自然人控制的公司
天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	原间接持股 5%以上自然人控制的公司
武汉当代瑞通投资管理有限公司	原间接持股 5%以上自然人控制的公司
武汉新星汉宜化工有限公司	原间接持股 5%以上自然人控制的公司
武汉睿通致和投资管理有限公司	原间接持股 5%以上自然人控制的公司
武汉喆信投资管理有限公司	原间接持股 5%以上自然人控制的公司
陕西大德投资集团有限责任公司	公司董事担任该公司董事
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
汉口银行股份有限公司	公司董事担任该公司董事
新华基金管理股份有限公司	联营企业之子公司
紫金天示（上海）企业管理有限公司	联营企业之子公司
深圳天风天成资产管理有限公司	联营企业之子公司
恒泰盈沃资产管理有限公司	联营企业之子公司
恒泰长财证券有限责任公司	联营企业之子公司

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	获批的交易额度（如适用）	是否超过交易额度（如适用）	上期发生额
恒泰证券股份有限公司	业务及管理费	1,008,552.33			282,691.44
武汉当代科技产业集团股份有限公司	利息支出	158.61			1,072.64
武汉商贸集团有限公司	利息支出	1,361.71			101,902.07
湖北省联合发展投资集团有限公司	利息支出	0.54			1,355.46
天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	利息支出	5.79			2,521.76
武汉当代瑞通投资管理有限公司	利息支出	7.28			10.16
武汉高科国有控股集团有限公司	利息支出				1,453.95
恒泰长财证券有限责任公司	手续费及佣金支出				1,451,415.09
新华基金管理股份有限公司	业务及管理费	38,303.78			1,886,792.45
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	业务及管理费	21,786.00			1.22
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	利息支出	1,283.22			
湖北省联合发展投资集团有限公司之子公司	利息支出	4,410.22			
陕西大德投资集团有限责任公司	利息支出	522.86			
武汉喆信投资管理有限公司	利息支出	6.25			
紫金天风期货股份有限公司	利息支出	229.55			
武汉商贸集团有限公司之子公司	利息支出	12.17			
紫金天风期货股份有限公司	投资收益-交易费用	94,313.07			

出售商品/提供劳务情况表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
武汉当代科技产业集团股份有限公司	财务顾问收入		3,773,584.91
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	其他业务收入	21,262.49	27,974.00
武汉当代科技产业集团股份有限公司	证券经纪收入		7,391.53
天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	证券经纪收入		9,957.80
武汉商贸集团有限公司	证券经纪收入		23,286.18
湖北省联合发展投资集团有限公司	投资咨询收入		136,792.45

恒泰证券股份有限公司	投资咨询收入	1,191,860.83	2,473,207.55
武汉睿通致和投资管理有限公司	其他业务收入	573.11	852.00
紫金天风期货股份有限公司	其他业务收入	1,273,584.91	2,103,499.81
紫金天风期货股份有限公司	投资咨询收入	471,698.11	
紫金天风期货股份有限公司	利息收入	1,754,329.30	3,508,658.56
湖北省联合发展投资集团有限公司之子公司	财务顾问收入	245,283.02	
湖北宏泰集团有限公司	财务顾问收入	1,415,094.34	
恒泰长财证券有限责任公司	证券承销收入	3,134,198.11	
新华基金管理股份有限公司	代销金融商品收入	982,210.49	
武汉商贸集团有限公司之子公司	财务顾问收入	75,471.70	
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	证券经纪收入	23,547.17	
陕西大德投资集团有限责任公司	证券经纪收入	6,574.00	
湖北省联合发展投资集团有限公司之子公司	证券经纪收入	1,543.47	
恒泰证券股份有限公司	利息收入	0.71	
汉口银行股份有限公司	证券承销收入	20,754.72	

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

适用 不适用

### (2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表：

适用 不适用

关联托管/承包情况说明：

适用 不适用

本公司委托管理/出包情况表：

适用 不适用

关联管理/出包情况说明：

适用 不适用

### (3). 关联租赁情况

本公司作为出租方：

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	出租办公用房		1,602,407.70
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	出租办公用房	1,408,711.27	1,664,562.46
武汉喆信投资管理有限公司	出租办公用房		738,913.73
紫金天风期货股份有限公司	出租办公用房	1,205,749.98	1,177,899.78
紫金天示（上海）企业管理有限公司	出租办公用房	85,311.66	83,341.14
武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	出租停车位	63,375.24	80,348.61

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	简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用（如适用）		未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额（如适用）		支付的租金		承担的租赁负债利息支出		增加的使用权资产	
		本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额
宜宾市商业银行股份有限公司	租赁办公用房							4,824.67	8,528.90		

关联租赁情况说明

√适用 □不适用

于 2023 年 6 月 30 日，本公司持有关联方的使用权资产金额为人民币 660,619.69 元。

**(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	2,321.07	3,152.68

**(8). 其他关联交易**适用 不适用

本公司持有关联方管理并发行的资产管理产品：

关联方名称	产品名称	2023年6月30日持有份额	2022年末持有份额
恒泰盈沃资产管理有 限公司	恒泰盈沃致远 1 号集 合资产管理计划	6,180,647.94	21,139,429.38
深圳天风天成资产管 理有限公司	天成立心二号	57,916,460.69	57,916,460.69

**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
存出保证金	紫金天风期货股份有 限公司	212,391,171.05		171,628,145.95	
结算备付金	紫金天风期货股份有 限公司	351,087,891.57		276,574,737.44	
应收账款	紫金天风期货股份有 限公司	3,745,138.49	187,256.92	1,113,059.03	55,652.95
应收账款	紫金天示（上海）企 业管理有限公司	207,722.92	10,386.15	114,733.24	5,736.66

应收账款	武汉当代明诚文化体育集团股份有限公司	5,608,427.00	532,800.57	5,608,427.00	532,800.57
应收账款	武汉喆信投资管理有限公司	934,549.80	46,727.49	1,387,307.65	69,365.38
应收账款	武汉睿通致和投资管理有限公司	224,244.86	35,981.27	224,244.86	35,981.27
应收账款	武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	1,204,115.70	60,205.78	413,084.65	20,654.23
债权投资	紫金天风期货股份有限公司	50,667,809.43		52,558,220.39	
结算备付金	恒泰证券股份有限公司	559.49			

## (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	陕西大德投资集团有限责任公司	1,603.43	9,576.81
代理买卖证券款	武汉商贸集团有限公司	3,530,496.82	55,781.72
代理买卖证券款	武汉当代科技产业集团股份有限公司	125,611.09	250,904.96
代理买卖证券款	人福医药集团股份公司	100.41	100.29
代理买卖证券款	武汉喆信投资管理有限公司	4,954.35	4,948.10
代理买卖证券款	湖北省联合发展投资集团有限公司	425.05	424.51
代理买卖证券款	武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	2,094.37	1,555.05
代理买卖证券款	武汉当代瑞通投资管理有限公司	5,763.66	5,756.38
代理买卖证券款	天风睿源（武汉）股权投资中心（有限合伙）	4,583.77	4,577.98
代理买卖证券款	武汉新星汉宜化工有限公司	514.94	514.28
代理买卖证券款	武汉商贸集团有限公司之子公司	9,639.30	9,627.13
代理买卖证券款	湖北省联合发展投资集团有限公司之子公司	3,261,252.62	10,024.21
代理买卖证券款	人福医药集团股份公司之子公司	2,135.44	2,132.73
其他应付款	紫金天风期货股份有限公司	641,955.36	641,955.36
其他应付款	紫金天示（上海）企业管理有限公司	45,420.93	45,420.93
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	武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	688,250.96	688,250.96
应付账款	恒泰长财证券有限责任公司		1,538,500.00
合同负债	武汉当代科技产业集团股份有限公司之子公司	495,084.57	

**7、 关联方承诺**

适用 不适用

**8、 其他**

适用 不适用

**十四、 股份支付****1、 股份支付总体情况**

适用 不适用

**2、 以权益结算的股份支付情况**

适用 不适用

**3、 以现金结算的股份支付情况**

适用 不适用

**4、 股份支付的修改、终止情况**

适用 不适用

**5、 其他**

适用 不适用

**十五、 承诺及或有事项****1、 重要承诺事项**

适用 不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

1) 天风证券股份有限公司于 2020 年 8 月 4 日召开第三届董事会第三十三次会议, 同意为设立的全资资产管理子公司天风(上海)证券资产管理有限公司出具担保承诺函, 提供最高额度为人民币 13.18 亿元的净资本担保承诺,截至 2023 年 6 月 30 日, 上述担保余额为 8.18 亿元。

2) 公司于 2021 年 7 月 30 日召开第四届董事会第五次会议,审议通过公司控股子公司天风天睿发行总额不超过人民币 3 亿元、期限不超过 5 年的非公开发行创新创业(或科技创新)公司债券和总额不超过人民币 12 亿元、期限不超过 5 年的非公开发行公司债券, 同意由公司对以上债券提供全额无条件不可撤销的连带责任保证担保, 截至 2023 年 6 月 30 日, 上述担保余额为 5 亿元。

3) 公司于 2021 年 9 月 22 日、2021 年 10 月 11 日分别召开第四届董事会第八次会议、2021 年第四次临时股东大会, 审议并通过了《关于天风国际在境外市场发行债券或票据的议案》, 同意公司及/或天风国际担保或维好天风国际或其附属公司发行不超过 6 亿美元的境外债券。截至



2023 年 6 月 30 日，公司及天风国际对天风国际控股子公司发行金额 0.5 亿美元、期限 3 年的美元债券以及发行金额 2.4 亿美元、期限 1.5 年的美元债券提供担保。

4)公司于 2022 年 3 月 2 日、2022 年 3 月 18 日分别召开第四届董事会第十五次会议、2022 年第一次临时股东大会，审议通过了《关于天风国际证券集团为其全资子公司提供担保的议案》，同意公司境外全资子公司天风国际为其下属子公司天风国际证券与期货提供不超过 6 亿港元或其他等值外币的担保。截至 2023 年 6 月 30 日，天风国际对其控股子公司提供 1.75 亿港元及 2 亿人民币担保。

## 2、或有事项

### (1). 资产负债表日存在的重要或有事项

√适用 □不适用

1)新疆天山畜牧生物工程股份有限公司诉控股子公司武汉光谷创投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。

2022 年 12 月 7 日，公司收到昌吉州中院出具的《民事判决书》[(2021)新 23 民初 23 号]，判决如下：撤销原告新疆天山畜牧生物工程股份有限公司与各被告之间于 2017 年 9 月 7 日签订的《新疆天山畜牧生物工程股份有限公司与陈德宏等关于大象广告股份有限公司之发行股份及支付现金购买资产协议》。本次判决为一审判决，而后公司申请上诉，进入二审程序，已于 2023 年 8 月 8 日开庭，暂未出具二审判决，后续结果尚存在不确定性。

2)长安国际信托股份有限公司（以下简称“长安信托”）诉天风证券股份有限公司合同纠纷案

因《差额补足合同》涉及合同纠纷，长安信托以公司为被告，分别在西安市中级人民法院向公司提起 3 项诉讼，公司收到西安市中级人民法院的开庭通知。因该项合同纠纷，长安信托向法院申请冻结公司的资金，目前因该冻结导致公司资金使用受限金额为 1,197,510,000.00 元。因涉及合同纠纷，公司亦向武汉市中级人民法院提起诉讼，以长安信托为被告提起 3 项诉讼，要求解除合同。2023 年 5 月，西安市中级人民法院和武汉市中级人民法院分别就上述 6 项诉讼作出一审判决，西安市中级人民法院部分支持了长安信托的诉讼请求，武汉市中级人民法院判决确认《差额补足函》不生效，驳回其他诉讼请求。而后 6 项诉讼均提上诉，进入二审程序。湖北省高院于 2023 年 8 月对 3 项诉讼作出终审判决，判决驳回上诉，维持原判。陕西省高院的 3 项诉讼尚未出具二审判决。

(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

截止报告日，公司发行设立“天风-安鑫资产支持专项计划”，发行总额 8.64 亿，期限 18 年，优先级票面利率 4.20%，详见《天风证券股份有限公司关于发行天风-安鑫资产支持专项计划资产支持证券的结果公告》（公告编号：2023-033 号）。

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三道防线，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；公司总裁办公会及其

下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监；风险管理部门，包括风险管理部、合规法律部、纪检监察部、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) 第二层级为公司总裁办公会及其下设的合规与风险管理委员会、公司其他专业委员会、首席风险官、合规总监。

公司总裁办公会为公司日常风险管理工作的决策机构，负责对公司的整体风险状况进行评估及管控，确保公司经营活动相关联的各种风险控制再董事会授权范围内，包括审议或授权下设的合规与风险管理委员会审议风险管理制度，并适时调整；建立健全公司全面风险管理的组织架构，明确全面管理职能部门、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；制定公司风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等及具体执行方案，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；建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；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。

公司总裁办公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。

公司总裁办公会下设其他专业委员在公司总裁办公会的要求下，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总裁办公会汇报。

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、纪检监察部、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。

合规法律部为合规、法律风险的管理部门，负责公司合规体系建设，对公司经营与管理活动的合法、合规进行控制，负责指导、检查和督导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。

纪检监察部为公司廉洁从业风险管理部门，负责对公司及所有员工的廉洁从业情况进行监督、检查。

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。

证券公司对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三道防线。公司业务各部门、分支机构、子公司承担第一道风险管理职责，负责识别和控制业务拓展和执行过程中所涉及的风险；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承担风险管理第二道防线，负责设定风险管理政策和框架，独立评估、监控和汇报风险管理情况，确保第一道防线能有效承担风险管理责任，同时对其进行平行控制；内外部稽核审计部门或机构为第三道风险管理防线，负责独立审计监察与监督，并向公司最高领导层汇报，确保风险管理机制有效运行。

## 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、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 2023 年 6 月 30 日，公司融资融券业务平均维持担保比例为 244.36%，自有资金参与股票质押式回购业务平均履约保障比例为 312.02%，客户违约风险有所降低；公司开展债券逆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：

单位：元人民币

项 目	2023年6月30日	2022年12月31日
货币资金	21,053,972,951.01	20,233,335,089.50
结算备付金	1,694,241,489.27	2,413,937,268.31

拆出资金	-	-
融出资金	4,554,169,518.12	4,286,800,525.51
交易性金融资产	16,726,776,687.52	15,500,043,154.26
衍生金融资产	88,110,207.35	129,466,897.78
买入返售金融资产	3,198,980,203.69	2,590,644,064.44
应收款项	3,693,523,876.30	3,771,907,295.38
存出保证金	557,084,057.02	611,759,826.83
债权投资	1,928,949,773.64	2,071,079,051.62
其他债权投资	5,415,331,384.21	1,501,182,197.41
其他资产	15,378,176,413.96	15,147,806,702.80
最大信用风险敞口	74,289,316,562.09	68,257,962,073.84

### 3、流动风险

√适用 □不适用

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

### 4、市场风险

√适用 □不适用

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

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

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

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

#### 1、风险价值（VAR（1Day, 95%））

风险来源	单日 95%VAR（单位：元人民币）	
	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
权益类市场风险	17,637,530.39	33,461,264.12
利率类市场风险	13,471,102.29	8,206,049.96
商品类市场风险	75,765.19	121,422.23
分散化效益	-10,454,249.18	-15,689,912.64
合 计	20,730,148.68	26,098,823.66

#### 2、利率敏感性分析

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

情景	利率敏感性（单位：元人民币）	
	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
上升 25 个基点	-101,017,016	-30,986,770
下降 25 个基点	101,017,016	30,986,770

### 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	其他业务	私募基金业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	759,963,020.35	1,345,412,192.16	458,938,936.90	338,477,167.93	-487,177,927.06	126,823,343.72	382,308,578.74	2,160,128,155.26
手续费及佣金净收入	541,682,081.91	-12,036,196.39	457,773,664.44	333,267,809.31	5,382,012.19	4,380,492.21	3,107,820.82	1,327,342,042.85
投资收益		744,814,369.83		19,312,314.39	424,765,724.27	5,318,874.45	2,161,404.63	1,192,049,878.31
其他收入	218,280,938.44	612,634,018.72	1,165,272.46	-14,102,955.77	-917,325,663.52	117,123,977.06	377,039,353.29	-359,263,765.90
二、营业支出	564,201,118.94	233,029,868.36	208,756,362.36	164,549,676.63	238,664,004.38	10,450,456.72	33,561,856.82	1,386,089,630.57
三、营业利润	195,761,901.41	1,112,382,323.80	250,182,574.54	173,927,491.30	-725,841,931.44	116,372,887.00	348,746,721.92	774,038,524.69
四、资产总额	10,045,883,373.02	44,450,275,785.32	5,215,461,343.86	2,808,930,280.44	69,870,046,023.03	9,246,860,299.48	38,382,506,967.43	103,254,950,137.72
五、负债总额	7,545,753,385.58	23,455,537,476.58	5,291,511,180.60	649,556,398.42	54,135,227,710.02	7,167,467,099.16	19,869,617,898.79	78,375,435,351.57
六、补充信息								
七、信用减值损失	-254,443.07	87,196,504.38		11,297,843.65	2,766,500.70	-11,346,079.81	-1,727,255.98	91,387,581.83

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

□适用 √不适用

## (4). 其他说明

□适用 √不适用

## 7、 租赁

√适用 □不适用

项目	2023 年半年度
租赁负债利息费用	15,268,696.14
计入当期损益的采用简化处理的短期租赁费用	4,092,386.03
计入当期损益的采用简化处理的低价值资产租赁费用（短期租赁除外）	172,600.54
与租赁相关的总现金流出	98,866,268.36

## 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）	36,742,789,304.50	591,754,397.24			38,180,092,595.81
2、衍生金融资产	129,466,897.78	-84,532,192.04			88,110,207.35
3、其他债权投资	1,501,182,197.41		-76,863,818.05	2,234,999.40	5,415,331,384.21
4、其他权益工具投资	1,032,425,535.43		-777,850,380.20		1,582,310,354.73
金融资产小计	39,405,863,935.12	507,222,205.20	-854,714,198.25	2,234,999.40	45,265,844,542.10
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	39,405,863,935.12	507,222,205.20	-854,714,198.25	2,234,999.40	45,265,844,542.10
金融负债	780,855,554.62	-18,210,476.02			1,895,149,443.30

## 10、金融工具项目计量基础分类表

## (1). 金融资产计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值	
金融资产项目	以公允价值计量且其变动计入当期损益

	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	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	21,053,972,951.01					
结算备付金	1,694,241,489.27					
融出资金	4,554,169,518.12					
衍生金融资产				88,110,207.35		
买入返售金融资产	3,198,980,203.69					
应收款项	3,693,523,876.30					
存出保证金	557,084,057.02					
交易性金融资产				38,180,092,595.81		
债权投资	1,928,949,773.64					
其他债权投资		5,415,331,384.21				
其他权益工具投资			1,582,310,354.73			
其他资产	15,378,176,413.96					
合计	52,059,098,283.01	5,415,331,384.21	1,582,310,354.73	38,268,202,803.16		
期初账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的 金融资产	分类为以公允价值 计量且其变动计入 其他综合收益的金 融资产	指定为以公允价值 计量且其变动计入 其他综合收益的非 交易性权益工具投 资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计 量且其变动计入当期 损益的金融资产	按照《金融 工具确认和 计量》准则 指定为以公 允价值计量 且其变动计 入当期损益 的金融资产	按照《套期 会计》准则 指定为以公 允价值计量 且其变动计 入当期损益 的金融资产

货币资金	20,233,335,089.50				
结算备付金	2,413,937,268.31				
融出资金	4,286,800,525.51				
衍生金融资产				129,466,897.78	
买入返售金融资产	2,590,644,064.44				
应收款项	3,771,907,295.38				
存出保证金	611,759,826.83				
交易性金融资产				36,742,789,304.50	
债权投资	2,071,079,051.62				
其他债权投资		1,501,182,197.41			
其他权益工具投资			1,032,425,535.43		
其他资产	547,960,462.68				
合计	36,527,423,584.27	1,501,182,197.41	1,032,425,535.43	36,872,256,202.28	

## (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变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	1,319,104,364.45			
应付短期融资款	6,131,364,091.09			
拆入资金	4,380,929,440.99			
交易性金融负债		1,681,321,598.25	133,571,721.63	
衍生金融负债		80,256,123.42		
卖出回购金融资产款	8,649,673,093.35			

代理买卖证券款	8,439,821,896.99			
应付款项	6,836,203.11			
应付债券	44,797,615,279.50			
租赁负债	593,213,911.94			
其他负债	1,622,120,345.15			
合计	75,940,678,626.57	1,761,577,721.67	133,571,721.63	
期初账面价值				
以公允价值计量且其变动计入当期损益				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	1,276,014,426.35			
应付短期融资款	4,460,029,113.94			
拆入资金	4,605,561,468.90			
交易性金融负债		586,004,139.59	175,476,494.73	
衍生金融负债		19,374,920.30		
卖出回购金融资产款	4,247,355,591.89			
代理买卖证券款	9,127,671,450.63			
应付款项	2,696,802.56			
应付债券	44,551,203,860.26			
租赁负债	581,912,076.99			
其他负债	1,805,212,632.53			
合计	70,657,657,424.05	605,379,059.89	175,476,494.73	

## 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	6,545,934,321.18	10,380,889.46			8,368,726,990.35
2、衍生金融资产					
3、贷款和应收款	2,338,648,058.75				2,143,001,793.36
4、其他债权投资	275,476,345.22				
5、其他权益工具投资					
金融资产小计	9,160,058,725.15	10,380,889.46	0.00	0.00	10,511,728,783.71
金融负债	586,004,139.59	-18,210,476.01			1,681,321,598.25

## 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

2023年4月27日，公司第四届董事会第三十二次会议审议通过向特定对象发行A股股票相关议案。本次向特定对象发行A股股票的发行对象为公司控股股东宏泰集团。本次发行股票的定价基准日为公司本次发行股票的董事会决议公告日（即2023年4月28日）。本次发行股票的发行价格为定价基准日前20个交易日股票交易均价的80%（定价基准日前20个交易日公司股票交易均价=定价基准日前20个交易日股票交易总额/定价基准日前20个交易日股票交易总量）与发行前公司最近一期末经审计的归属于母公司股东的每股净资产值的较高者。本次向特定对象发行A股股票数量不超过1,498,127,340股（含本数），未超过本次发行前总股本的30%（即2,599,727,239股）。

本次向特定对象发行股票方案于2023年5月18日经公司股东大会审议通过，尚需取得上海证券交易所核准通过、中国证券监督管理委员会注册后方可实施。

## 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

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
对子公司投资	3,918,650,982.41		3,918,650,982.41	3,918,650,982.41		3,918,650,982.41
对联营、合营企业投资	2,847,132,590.13		2,847,132,590.13	3,272,346,289.57	75,371,122.23	3,196,975,167.34
合计	6,765,783,572.54		6,765,783,572.54	7,190,997,271.98	75,371,122.23	7,115,626,149.75

## (1) 对子公司投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减值准备	减值准备期末余额
天风天睿投资有限公司（曾用名：天风天睿投资股份有限公司）	1,514,258,591.16			1,514,258,591.16		
天风创新投资有限公司	505,466,167.49			505,466,167.49		
TFI Securities Group Limited	898,926,223.76			898,926,223.76		
天风（上海）证券资产管理有限公司	1,000,000,000.00			1,000,000,000.00		
合计	3,918,650,982.41			3,918,650,982.41		

## (2) 对联营、合营企业投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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										

2023 年半年度报告

小计											
二、联营企业											
宜宾市商业银行股份有限公司（注1）	388,855,864.00		-14,937,248.86	10,628,463.80	5,103,041.76	2,589,621.05			-392,239,741.75		
恒泰证券股份有限公司	2,452,338,842.43			32,683,168.37	4,441,401.32					2,489,463,412.12	
紫金天风期货股份有限公司	355,780,460.91			1,888,717.10						357,669,178.01	
小计	3,196,975,167.34		-14,937,248.86	45,200,349.27	9,544,443.08	2,589,621.05			-392,239,741.75	2,847,132,590.13	
合计	3,196,975,167.34		-14,937,248.86	45,200,349.27	9,544,443.08	2,589,621.05			-392,239,741.75	2,847,132,590.13	

其他说明：

√适用 □不适用

注 1：报告期内，根据公司战略安排，转让部分宜宾商行股份，截至报告期末，公司对宜宾商行剩余持股比例约 4.99%。因未派驻董事对其不再具有重大影响，故宜宾商行不再属于公司联营企业，剩余股权转入其他权益工具投资核算。



## 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	212,548,014.80	624,020,493.58	739,247,378.24	97,321,130.14
二、离职后福利-设定提存计划	13,623.52	40,247,621.19	40,247,621.19	13,623.52
三、辞退福利		4,835,413.23	4,835,413.23	
四、一年内到期的其他福利				
合计	212,561,638.32	669,103,528.00	784,330,412.66	97,334,753.66

## (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	211,883,235.60	563,355,843.22	678,527,185.04	96,711,893.78
二、职工福利费		5,795,852.22	5,795,852.22	
三、社会保险费	468.95	23,099,835.19	23,098,748.77	1,555.37
其中：医疗保险费	0.17	21,242,300.47	21,241,172.95	1,127.69
工伤保险费	262.60	429,926.79	430,037.89	151.50
生育保险费	206.18	1,427,607.93	1,427,537.93	276.18
四、住房公积金	84,314.87	30,613,283.25	30,613,283.25	84,314.87
五、工会经费和职工教育经费	579,995.38	1,155,679.70	1,212,308.96	523,366.12
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	212,548,014.80	624,020,493.58	739,247,378.24	97,321,130.14

## (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	9,666.33	38,943,498.61	38,943,498.61	9,666.33
2、失业保险费	3,957.19	1,304,122.58	1,304,122.58	3,957.19
3、企业年金缴费				
合计	13,623.52	40,247,621.19	40,247,621.19	13,623.52

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	568,087,254.79	564,876,626.62
其中：货币资金及结算备付金利息收入	152,212,909.64	163,541,573.87
拆出资金利息收入		14,390,541.54
融出资金利息收入	139,937,547.57	129,709,664.43
买入返售金融资产利息收入	64,522,812.22	73,316,492.22
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	2,466,878.22	6,123,514.49
债权投资利息收入	37,396,033.65	39,613,648.28
其他债权投资利息收入	72,950,836.97	21,722,188.12
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	101,067,114.74	122,582,518.16
利息支出	1,179,175,232.03	1,164,931,347.11
其中：短期借款利息支出		8,300.00
应付短期融资款利息支出	86,178,635.61	104,421,415.18
拆入资金利息支出	50,079,984.27	37,069,453.52
其中：转融通利息支出		
卖出回购金融资产利息支出	75,656,150.08	99,289,563.86
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	10,938,066.61	18,492,274.01
长期借款利息支出		27,438,100.00
应付债券利息支出	935,890,160.15	856,370,380.75
其中：次级债券利息支出	180,774,027.68	225,594,814.97
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	20,432,235.31	21,841,859.79
利息净收入	-611,087,977.24	-600,054,720.49

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	487,620,809.07	466,953,303.29
证券经纪业务收入	613,426,989.94	614,751,039.63
其中：代理买卖证券业务	248,743,405.22	289,020,891.85
交易单元席位租赁	347,628,698.85	312,404,109.58
代销金融产品业务	17,054,885.87	13,326,038.20
证券经纪业务支出	125,806,180.87	147,797,736.34
其中：代理买卖证券业务	125,806,180.87	147,797,736.34
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	408,524,303.51	429,698,533.99
投资银行业务收入	409,081,865.78	431,149,949.08

其中：证券承销业务	346,399,615.56	373,029,414.68
证券保荐业务	7,783,018.87	14,150,943.40
财务顾问业务	54,899,231.35	43,969,591.00
投资银行业务支出	557,562.27	1,451,415.09
其中：证券承销业务	557,562.27	1,451,415.09
证券保荐业务		
财务顾问业务		
4. 资产管理业务净收入		
资产管理业务收入		
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入		
基金管理业务收入		
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	35,949,840.97	40,290,483.72
投资咨询业务收入	35,949,840.97	40,290,483.72
投资咨询业务支出		
7. 其他手续费及佣金净收入	3,798,171.61	6,457,131.82
其他手续费及佣金收入	3,798,171.61	6,457,131.82
其他手续费及佣金支出		
合计	935,893,125.16	943,399,452.82
其中：手续费及佣金收入	1,062,256,868.30	1,092,648,604.25
手续费及佣金支出	126,363,743.14	149,249,151.43

## (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		1,886,792.45
并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	54,899,231.35	42,082,798.55

## (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	2,714,297,368.00	13,404,258.57	2,069,506,203.77	11,367,919.38
银行理财产品				
信托	5,654,500.00	542,806.48	128,705,300.00	721,745.40
其他	682,186,859.00	3,107,820.82	797,131,885.00	1,236,373.42
合计	3,402,138,727.00	17,054,885.87	2,995,343,388.77	13,326,038.20

## (4). 资产管理业务

□适用 √不适用

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

## 5、投资收益

## (1). 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益		86,000,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	45,200,349.27	-78,877,221.40
处置长期股权投资产生的投资收益	363,044,491.82	
金融工具投资收益	350,771,836.51	188,583,668.19
其中：持有期间取得的收益	239,788,930.71	371,162,744.92
—交易性金融工具	239,697,434.11	371,162,744.92
—其他权益工具投资	91,496.60	
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	110,982,905.80	-182,579,076.73
—交易性金融工具	63,732,837.16	-185,826,385.80
—其他债权投资	42,851,480.97	-1,399,130.92
—债权投资	90,895.67	15,706,132.30
—衍生金融工具	4,307,692.00	-11,059,692.31
其他		
债务重组收益		
合计	759,016,677.60	195,706,446.79

## (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	239,697,434.11	372,830,110.83
	处置取得收益	63,732,837.16	-184,857,652.66
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		-1,667,365.91
	处置取得收益		-968,733.14
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益		

投资收益的说明：

无

## 6、公允价值变动收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	487,300,152.10	-330,280,491.91
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债		
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	-80,864,016.71	24,735,802.27
其他		
合计	406,436,135.39	-305,544,689.64

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	669,103,528.00	510,666,766.46
租赁费	25,088,548.04	18,436,840.24
折旧费	91,693,203.51	83,465,241.24
无形资产摊销	17,889,608.71	13,668,987.89
长期待摊费用摊销	9,872,547.67	10,482,253.14
差旅费	29,475,367.02	20,159,828.19
业务招待费	37,526,681.27	36,428,670.47
投资者保护基金	10,814,137.42	1,819,758.66
电子设备运转费	36,628,078.27	38,636,978.98
安全防范费	882,578.05	195,598.67
其他	64,460,662.69	113,040,141.73
合计	993,434,940.65	847,001,065.67

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	-1,815,222.29	
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	114,468,686.06	

定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外		
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	9,093,342.04	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
减：所得税影响额	30,436,701.45	
少数股东权益影响额（税后）	2,595.20	
合计	91,307,509.16	

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	2.33	0.06	0.06
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	1.95	0.05	0.05

**3、境内外会计准则下会计数据差异**适用 不适用**4、其他**适用 不适用

董事长：余磊

董事会批准报送日期：2023 年 8 月 30 日

**修订信息**适用 不适用

## 第十一节 证券公司信息披露

### 一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

时间	许可单位	文号	行政许可文件名称
2023 年 3 月 24 日	上海证券交易所	上证函[2023]840 号	关于对天风证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函

### 二、 监管部门对公司的分类结果

□适用 √不适用