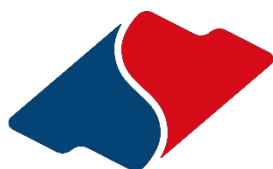


国信证券股份有限公司

2020 年半年度报告



国信证券
GUOSEN SECURITIES

2020 年 8 月

第一节 重要提示、目录和释义

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

公司负责人何如、主管会计工作负责人及会计机构负责人周中国声明：保证本半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本报告经公司第四届董事会第二十九次会议审议通过。公司所有董事均已出席了审议本报告的董事会会议。未有董事、监事、高级管理人员对本报告提出异议。

公司 2020 年半年度财务报告未经审计。

公司半年度不派发现金红利，不送红股，不以公积金转增股本。

本报告中涉及的未来发展计划等前瞻性陈述属于计划性事项，不构成公司对投资者的实质性承诺，敬请投资者注意投资风险。

目录

第一节 重要提示、目录和释义.....	1
第二节 公司简介和主要财务指标.....	4
第三节 公司业务概要.....	7
第四节 经营情况讨论与分析.....	11
第五节 重要事项	30
第六节 股份变动及股东情况.....	44
第七节 优先股相关情况.....	47
第八节 可转换公司债券相关情况.....	48
第九节 董事、监事、高级管理人员情况.....	49
第十节 公司债券相关情况.....	50
第十一节 财务报告	55
第十二节 证券公司信息披露.....	56
第十三节 备查文件目录.....	57

释义

释义项	指	释义内容
国信证券、公司、本公司	指	国信证券股份有限公司
董事会	指	国信证券股份有限公司董事会
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
深圳证监局	指	中国证券监督管理委员会深圳监管局
深交所	指	深圳证券交易所
中证协	指	中国证券业协会
证金公司	指	中国证券金融股份有限公司
深圳市国资委	指	深圳市人民政府国有资产监督管理委员会
深投控	指	深圳市投资控股有限公司
华润信托	指	华润深国投信托有限公司
云南合和	指	云南合和（集团）股份有限公司
一汽投资	指	一汽股权投资（天津）有限公司
北京城建	指	北京城建投资发展股份有限公司
国信弘盛	指	国信弘盛私募基金管理有限公司
国信期货	指	国信期货有限责任公司
国信香港	指	国信证券（香港）金融控股有限公司
国信资本	指	国信资本有限责任公司
鹏华基金	指	鹏华基金管理有限公司
QFII	指	合格境外机构投资者
RQFII	指	人民币合格境外投资者
《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	《国信证券股份有限公司章程》
报告期	指	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
报告期末	指	2020 年 6 月 30 日
元	指	人民币元

2020 年半年度报告中,部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异,这些差异是由于四舍五入造成的。

第二节 公司简介和主要财务指标

一、公司简介

股票简称	国信证券	股票代码	002736
变更后的股票简称	不适用		
股票上市证券交易所	深圳证券交易所		
公司的中文名称	国信证券股份有限公司		
公司的中文简称	国信证券		
公司的外文名称	GUOSEN SECURITIES CO., LTD.		
公司的外文名称缩写	GUOSEN SECURITIES		
公司的法定代表人	何如		

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	谌传立	蔡妮芬
联系地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 25 楼	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 25 楼
电话	0755-82130188	0755-82130188
传真	0755-82133453	0755-82133453
电子信箱	ir@guosen.com.cn	ir@guosen.com.cn

三、其他情况

(一) 公司联系方式

公司注册地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层（邮政编码：518001）
公司办公地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦（邮政编码：518001）
公司网址	http://www.guosen.com.cn
公司电子信箱	ir@guosen.com.cn
公司投资者热线	0755-82130188
公司客服热线	95536

(二) 信息披露及备置地点

公司选定的信息披露媒体的名称	《证券时报》《证券日报》
登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.szse.cn
公司半年度报告备置地点	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 25 楼董事会办公室

(三) 其他有关资料

报告期内，公司注册信息等有关资料未发生变更。

四、主要会计数据和财务指标

(一) 合并报表

单位：万元

项目	2020年1-6月	2019年1-6月	本报告期比上年同期增减
营业收入	803,859.99	653,360.21	23.03%
归属于上市公司股东的净利润	294,553.38	259,782.94	13.38%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	308,296.12	267,973.02	15.05%
其他综合收益	-6,397.64	61,018.83	-110.48%
经营活动产生的现金流量净额	1,105,789.00	2,086,281.18	-47.00%
基本每股收益(元/股)	0.34	0.30	13.33%
稀释每股收益(元/股)	0.34	0.30	13.33%
加权平均净资产收益率	5.41%	5.17%	增加0.24个百分点
项目	2020年6月30日	2019年12月31日	本报告期末比上年度末增减
资产总额	25,519,621.23	22,464,431.22	13.60%
负债总额	20,301,729.86	16,838,906.07	20.56%
归属于上市公司股东的净资产	5,216,051.76	5,620,908.87	-7.20%
总股本	820,000.00	820,000.00	-

截至披露前一交易日的公司总股本(股)	9,612,429,377
用最新股本计算的全面摊薄每股收益(元/股)	0.29

公司于2020年8月完成非公开发行A股股票相关发行及上市工作，本次非公开发行新增股份1,412,429,377股已于2020年8月14日在深圳证券交易所上市。公司将按要求及时办理工商变更登记。

(二) 母公司

单位：万元

项目	2020年1-6月	2019年1-6月	本报告期比上年同期增减
营业收入	758,676.88	609,196.85	24.54%
净利润	321,601.87	266,564.28	20.65%
其他综合收益	-5,206.13	54,755.57	-109.51%
经营活动产生的现金流量净额	908,274.11	2,096,829.83	-56.68%
基本每股收益(元/股)	0.38	0.31	22.58%
稀释每股收益(元/股)	0.38	0.31	22.58%
加权平均净资产收益率	6.07%	5.42%	增加0.65个百分点
项目	2020年6月30日	2019年12月31日	本报告期末比上年度末增减
资产总额	23,998,074.12	20,932,163.20	14.65%
负债总额	18,888,017.27	15,445,489.23	22.29%
所有者权益总额	5,110,056.85	5,486,673.97	-6.86%

五、境内外会计准则下会计数据差异

不适用。公司未按照国际会计准则编制2020年半年度财务报告。

六、非经常性损益项目及金额

单位：万元

项目	2020年1-6月	说明
非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）	-5.46	-
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	2,750.46	收到政府补贴。
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-19,278.21	主要是计提诉讼案件损失。
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回	164.68	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-1,924.88	-
减：所得税影响额	-4,550.68	-
合计	-13,742.74	-

公司属于证券业金融企业，证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司持有交易性金融工具、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有交易性金融工具、衍生金融工具、其他债权投资及其他权益工具投资产生的投资收益，处置交易性金融工具、衍生金融工具、其他债权投资及其他权益工具投资取得的投资收益不作为非经常性损益项目。

七、母公司净资本及有关风险控制指标

单位：万元

项目	2020年6月30日	2019年12月31日	本报告期末比上年末增减	预警标准	监管标准
核心净资本	3,572,596.53	3,505,490.56	1.91%	-	-
附属净资本	-	500,000.00	-100.00%	-	-
净资本	3,572,596.53	4,005,490.56	-10.81%	-	-
净资产	5,110,056.85	5,486,673.97	-6.86%	-	-
各项风险资本准备之和	1,746,385.40	1,504,037.79	16.11%	-	-
表内外资产总额	18,380,405.69	16,537,485.99	11.14%	-	-
风险覆盖率	204.57%	266.32%	下降 61.75 个百分点	≥120%	≥100%
资本杠杆率	19.44%	21.20%	下降 1.76 个百分点	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	159.74%	230.16%	下降 70.42 个百分点	≥120%	≥100%
净稳定资金率	140.74%	127.53%	上升 13.21 个百分点	≥120%	≥100%
净资本/净资产	69.91%	73.00%	下降 3.09 个百分点	≥24%	≥20%
净资本/负债	27.42%	36.77%	下降 9.35 个百分点	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	39.21%	50.37%	下降 11.16 个百分点	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	39.07%	30.30%	上升 8.77 个百分点	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	221.20%	166.00%	上升 55.20 个百分点	≤400%	≤500%

第三节 公司业务概要

一、报告期内公司从事的主要业务

公司向个人、机构客户提供全方位的金融产品和服务，并自营相关金融产品的投资与交易业务，主要业务如下：

经纪及财富管理业务，为个人和机构客户提供证券经纪和期货经纪服务，推广和销售证券及金融产品，提供资产托管、专业化研究和咨询等服务，赚取手续费、佣金及相关收入；提供融资融券、股票质押式回购、约定购回、行权融资等资本中介服务，赚取利息及相关收入。

投资银行业务，为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问、新三板挂牌推荐等金融服务，赚取承销费、保荐费、财务顾问费及相关收入。

投资与交易业务，从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募基金管理及另类投资业务等，赚取投资收益及相关收入。

资产管理业务，根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，集合、单一资产管理业务，资产证券化业务以及基金管理业务等，赚取管理费、业绩报酬及相关收入。

二、主要资产重大变化情况

（一）主要资产重大变化情况

期末余额占公司总资产5%以上的主要资产包括货币资金、融出资金、买入返售金融资产、交易性金融资产、其他债权投资及其他权益工具投资等金融投资。其中，货币资金及结算备付金期末余额为786.56亿元，比上年末增加189.49亿元和31.74%，主要是客户交易资金增加；融出资金期末余额为394.90亿元，比上年末增加17.82亿元和4.72%，主要是融资业务规模增加所致；买入返售金融资产期末余额199.86亿元，比上年末减少37.87亿元和15.93%，主要是股票质押式回购规模减少；金融投资主要包括交易性金融资产、其他债权投资及其他权益工具投资，合计1,026.29亿元，比上年末增加124.16亿元和13.76%，主要是2020年上半年债券投资规模增加。

（二）主要境外资产情况

报告期末，公司境外资产规模为港币16.30亿元（折合人民币13.95亿元），占公司净资产的比重为2.67%。（注：资产规模为对该境外子公司的股权投资规模，境外资产占公司净资产的比重为对该境外子公司的股权投资占公司合并报表归属于母公司股东权益的比例。）

三、核心竞争力分析

公司在长期经营过程中，形成了具有特色的核心竞争力，主要体现在以下几个方面：

（一）突出的市场化能力及综合服务能力

公司具有市场定位准确、客户服务能力强的优势，具备较强的市场敏感性 & 业务前瞻性，善于迅速把握市场机遇。

公司对业务发展区域及客户类型进行了准确定位。经纪及财富管理业务方面，深圳、广州、北京、上海等人均GDP较高、金融业较发达的城市具有庞大的中产阶级群体及优质企业客户，市场化专业服务需求旺盛。经过多年的发展，公司在上述经济发达城市设立的营业部均保持强劲的竞争实力，并持续保持当地领先水平。公司经纪业务经营效率较高，客户交易周转率、户均收入和手续费收入市场份额均排名前列。投资银行业务方面，公司植根实体经济，致力于为细分行业龙头企业、区域龙头企业、科技创新及创新创业企业提供高质量、全方位的投资银行服务；积极响应国家扶持新兴产业发展战略，通过多种方式和手段为战略新兴产业企业和小微创业企业提供便利、多元的金融支持，助推国家战略新兴产业发展和实体经济转型升级。公司多年来为以科技创新型企业为核心的战略新兴产业企业发展提供优质便捷的股权融资服务，充分彰显了在服务科创企业方面的专业实力。

公司持续为客户提供多元化、高品质的金融产品和服务。经纪及财富管理业务方面，公司为客户提供丰富的资讯产品、模拟组合、投资工具、国信TradeStation平台等特色服务产品和工具，并拥有千人规模的专业投资顾问团队。国信TradeStation平台支持证券、融资融券、期货和期权交易，提供完备的策略开发、回测和自动化交易功能，满足多市场、多品种、多周期等交易需求；“鑫财富”产品共享平台在大数据技术手段的支持下，将投顾产品自上而下地进行精准投放，实现各地域分支机构投顾资源的整合与再分配，提升分支机构投顾专业服务质量；公司还运用大数据分析技术不断完善客户分级分类管理，积极支持分支机构营销服务团队转型升级，从而实现精准营销和差异化服务。投资银行业务方面，公司在股票保荐承销、债务融资、并购重组财务顾问以及新三板推荐服务方面建立了全价值链服务模式，持续为客户提供公开及非公开发行融资、并购顾问、做市等全方位金融服务。公司不断丰富债券承销业务类型，形成公司债、企业债、债务融资工具、创新型产品有机结合的业务结构，发行人、投资者两端的核心客户覆盖面不断扩大。机构业务方面，公司能够把握客户核心需求，整合公司优势资源，充分发挥综合服务能力，向社保基金、公募基金、保险、私募等专业机构投资者提供研究咨询、金融产品销售、上市基金流动性服务等一揽子综合服务方案，满足机构客户的各项专业化需求。

（二）规范的公司治理和稳健的经营决策体系

公司建立了科学、稳健的经营决策体系，重大事项决策均采用集体决策机制。公司成立了若干专业委员会，一般由总裁或副总裁担任委员会主任，由业务部门负责人、合规风控等相关人员担任成员。资产负债委员会审议确定公司总体融资规模、投资规模，定期评估各项业务的收益和风险状况以及公司的资产负债状况等；风险控制委员会审批风险管理的制度和规则，审议风险监控分析报告，对重大风险业务做出决

定等；IT规划与治理委员会审定公司信息技术发展规划、资金预算和相关标准，跟踪公司重点信息技术项目的实施等。此外，公司还针对各重要业务线设置了相应的业务管理委员会，如投资银行委员会、资产管理委员会、财富管理委员会等。

（三）严格的内部控制及风险管理

公司坚持风险可控下追求合理收益的风险管理理念，贯彻全面性、有效性、制衡性的基本原则。在长期的业务发展中，公司建立健全了包括组织体系、授权体系、制度体系、防火墙体系、技术防范体系、监控体系、监督与评价体系在内的内部控制体系。公司建立多层次的内部控制机构，内控制度覆盖各项业务的日常运行，对违规行为实行严格问责。严格的内部控制和风险管理为公司合规、稳健经营打下了坚实的基础。

公司对流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等实施精准管理，在风险可测、可控和可承受范围内稳健开展各项业务。公司有效落实各项监管新规，强化合规风控的履职保障；全力推进风险指标并表管理工作，增强全面风险管理的能力与水平；不断提升投资者适当性管理水平，持续完善反洗钱工作机制；深入推进合规风控文化建设，积极开展监管新规讲解及专项培训。

（四）切实有效的考核激励制度

切实有效的考核激励制度是公司保持竞争优势、实现业务转型的有力保障。公司授予业务人员较为充分的业务管理权责，并建立了完善的考核机制，绩效评估透明，员工目标明确，确保管理层和一线人员始终将业务经营作为工作重心。公司针对各主营业务的盈利模式特点，分别设定了相应的考核激励制度并落实到位，确保每个参与价值创造的员工都获得认可和回报，从而充分激发员工的积极主动性及创新能力，为公司实现业务转型升级奠定了坚实的制度基础。

（五）领先的信息技术支撑能力

公司持续加大信息技术投入，加强IT战略规划，大力发展金融科技，以领先的科技能力驱动业务创新，引领公司向数字化转型，实现技术领先战略。公司自主设计和建设了基于“云计算”和“两地三中心”模式的数据中心，具有行业先进性、可扩展性；以ISO20000为标准，大力发展平台化、自动化、智能化、标准化、服务化运维，稳步推行开源产品，加大新型运维团队的培养，持续建设和完善IT运维管理和工具平台体系；拥有行业领先的交易科技平台，极速交易系统在全业务支持、客户数和交易量、系统运行稳定性方面位居行业前列，国信GA1go智能算法引擎算法种类齐全，为高端机构投资者提供交易服务，算法效率大大超过行业平均水平，GTS平台为国内首家全品种、行业领先的量化交易平台；构建一体化线上理财体系，满足用户投资理财需求，建设高端智能财富管理平台，提供全方位的智能财富管理支持工具，疫情期间应用视频直播技术有效连接线上客户，助力公司经纪业务掘金财富管理领域；拥有行业领先的做市平台，进一步强化了多元业务创收能力；智能投顾系列系统促进了投顾专业服务质量的提升；建设国信证券数字投行，促进投行、固收、场外业务信息化管理水平不断提升，各业务条线技术赋能覆盖面更加广泛；公司托管及外包业务系统全面覆盖多元化的交易品种和市场，为公司资产托管与外包业务快速发展提供重要支撑；

建设了行业领先的全业务毫秒级时延异常交易实时风控系统，提升公司交易合规监测水平。公司各类信息系统持续保持高效稳定运行，无重大技术故障事故发生。

第四节 经营情况讨论与分析

一、概述

2020年初以来，新冠肺炎疫情在世界各地爆发，各国大多采取严格社交管控措施以应对疫情蔓延，全球主要经济体均陷入较为严重的衰退。从国内看，上半年我国经济逐步克服疫情带来的不利影响，二季度经济增速由负转正，经济运行呈恢复性增长和稳步复苏态势。展望未来，疫情对世界经济的巨大冲击仍将持续发展演变，外部风险挑战明显增多，国内经济持续恢复仍面临较大压力。

2020年上半年，伴随中国经济的V型回升，风险类资产从二季度开始呈现持续攀升态势，股指、大宗商品等资产价格持续走高。A股市场表现优于全球主要市场，创业板指数以涨幅35.60%位列第一，深成指、沪深300指数、上证指数均位列全球主要指数涨幅前五。市场交投活跃，沪深两市日均交易量8,094亿元，同比增长29.44%。证券行业上半年实现营业收入2,134.04亿元，同比增长19.26%；实现净利润831.47亿元，同比增长24.73%。面对线上业务量激增及行情大幅波动等新的市场情况，公司积极调整应对，迅速升级线上金融服务平台，加强实时监控和预警，确保交易系统稳定运行。同时，公司不断强化合规风控，有效提升国企党建工作质量，切实履行企业社会责任，各项业务稳健开展并取得了较好的经营成果。

随着金融供给侧改革的持续推进，资本市场基础制度和证券行业监管制度不断完善，规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场渐行渐近，驱动证券行业走向变革发展、做大做强。展望2020年下半年，公司将认真落实上级要求部署，深度融入“双区建设”，抢抓历史性战略机遇；积极应对市场变化，提升经营发展质量；加强部门协同配合，有效提升综合服务能力；树牢底线意识，全面提高合规风控水平；持续实施人才工程，开创干部人才工作新局面；牢牢把握业务机会，持续为股东创造价值。

二、主营业务分析

（一）概述

公司通过总部下设机构以及下属分公司、营业部从事证券经纪及财富管理、投资银行、投资与交易、资产管理等业务；通过全资子公司国信弘盛、国信期货、国信资本、国信香港分别开展私募基金、期货、另类投资和境外金融服务等业务。近年来，公司净资产、净资本、营业收入、净利润等主要指标稳居行业前列。2020年上半年，公司实现营业收入80.39亿元，同比上升23.03%；实现归属于上市公司股东的净利润29.46亿元，同比上升13.38%；加权平均净资产收益率为5.41%，同比上升0.24个百分点，保持了行业领先的盈利能力。

（二）主要财务数据变动情况

单位：万元

项目	2020年1-6月	2019年1-6月	增减幅度	变动原因
营业总收入	803,859.99	653,360.21	23.03%	-
营业总支出	422,227.86	308,587.69	36.83%	主要是业务及管理费、信用减值损失增加。
所得税费用	67,302.82	73,328.46	-8.22%	-
经营活动产生的现金流量净额	1,105,789.00	2,086,281.18	-47.00%	主要是本期收到的客户资金减少，自营业务投资规模增加所致。
投资活动产生的现金流量净额	-37,494.95	-7,775.73	不适用	主要是投资所支付的现金增加。
筹资活动产生的现金流量净额	822,697.67	-155,427.49	不适用	主要是发行债券收到的现金增加。
现金及现金等价物净增加额	1,891,926.30	1,922,611.28	-1.60%	-

报告期内，公司利润构成和利润来源未发生重大变动。

（三）主营业务情况分析

1. 按会计科目分类

单位：万元

营业总收入构成项目	2020年1-6月		2019年1-6月		同比增减幅度
	金额	占营业总收入比重	金额	占营业总收入比重	
手续费及佣金净收入	367,266.74	45.69%	303,400.01	46.44%	21.05%
利息净收入	166,185.60	20.67%	79,959.42	12.24%	107.84%
投资收益	236,649.04	29.44%	183,909.72	28.15%	28.68%
公允价值变动收益	9,623.67	1.20%	67,716.98	10.36%	-85.79%
汇兑收益	-129.05	-0.02%	-176.26	-0.03%	不适用
资产处置收益	-5.46	0.00%	-23.17	0.00%	不适用
其他收益	1,736.75	0.22%	481.56	0.07%	260.65%
其他业务收入	22,532.71	2.80%	18,091.95	2.77%	24.55%
合计	803,859.99	100.00%	653,360.21	100.00%	23.03%

相关数据同比发生变动30%以上的原因说明：

（1）利息净收入16.62亿元，同比增加8.62亿元和107.84%，主要是融出资金及买入返售金融资产利息收入增加、应付债券及卖出回购业务利息支出减少所致；

（2）公允价值变动收益0.96亿元，同比减少5.81亿元和85.79%，主要是证券市场波动导致金融资产公允价值减少；

（3）资产处置收益同比增加0.002亿元，主要是固定资产处置损失减少；

（4）其他收益0.17亿元，同比增加0.13亿元和260.65%，主要是代扣代缴个人所得税手续费返还增加。

2. 按业务类型分类

(1) 经纪及财富管理

公司经纪及财富管理业务主要包括：为个人和机构客户提供证券经纪和期货经纪服务，推广和销售证券及金融产品，提供资产托管、专业化研究和咨询等服务；提供融资融券、股票质押式回购、约定购回、行权融资等资本中介服务。报告期内，经纪及财富管理业务实现营业收入45.92亿元，同比上升26.70%。

① 证券类零售业务

市场环境

2020年上半年，尽管受到国内外疫情冲击，在资本市场的各项改革持续深化和流动性宽松促进下，市场交投活跃度延续增长势头，A股市场结构性行情明显。截至6月30日，上证指数下跌2.15%，深证成指上涨14.97%，创业板指数上涨35.60%；上半年A股总成交金额同比增长27.92%。

经营举措及业绩

报告期内，公司不断夯实“以客户为中心”的发展理念，全面提升经纪业务的市场竞争力，全力加速向财富管理转型。一是发力互联网营销展业，加快完善公司互联网业务布局，“金太阳”品牌亮点日益凸显。截至2020年6月末，公司金太阳手机证券用户总数近1,350万、较上年末增长5.5%，微信公众号关注用户176万、较上年末增长11%，线上渠道开户数占比超过36%；二是加快升级投顾服务，全力打造“鑫投顾”财富管理门户，增强投顾线上线下综合服务能力；三是提升交易服务智能化、定制化程度，国信TradeStation业务持续保持快速增长。报告期内，公司代理买卖手续费净收入市场份额为份额5.02%（不含基金分仓），排名行业第三；新增经纪业务客户数量达7.35万户，其中新增高端业务客户占比达33.5%。

② 证券类机构业务

市场环境

2020年上半年，A股市场交投持续活跃，境内外各类机构投资者踊跃入市。截至2020年6月末，公募基金整体规模达到16.90万亿元，同比增长25.62%，其中股票基金和混合型基金规模增长较快；国家进一步便利境外投资者参与我国金融市场，提升了境外机构投资者对A股的关注度，券商在迎来机遇的同时也面临日趋激烈的竞争环境。

经营举措及业绩

2020年上半年，公司机构业务不断夯实财富管理能力，依靠强化产品配置，打造多元化的线上营销模式，公私募产品销量明显增长。通过经纪、机构、研究等业务条线的紧密协同，着重加强线上服务系统布局和线上活动组织力度，多维度满足客户需求。报告期内，公司邀请机构客户接入线上会议600余场，组织分析师路演和上市公司反路演5,000多次，研究业务影响力持续提升。同时，全力推动社保基金、银行及理财子公司等战略客户合作，成功开立公司首只银行理财子公司产品账户，进一步拓宽机构客户群体。积极整合内外部资源，大力开拓海外投行和对冲基金类客户，QFII/RQFII佣金及投资咨询服务收入稳步上升。报告期内，公司机构业务实现交易单元席位佣金收入1.52亿元，同比增长29.12%。

③ 资本中介业务

市场环境

2020年上半年,市场波动加大,但受益于结构化行情,全市场融资融券余额由10,193亿元增长至11,638亿元,较上年末增长14%。股票质押式回购业务随着整体规模的下降,风险进一步释放,但个股风险仍然存在。约定购回和行权融资业务规模较小,对市场影响不大。

经营举措及业绩

2020年上半年,公司通过融资融券开户竞赛、拓宽转融券券源、优化运营管理、提升交易体验等推动融资融券业务做优做强;持续调整完善股票质押式回购业务管理架构、决策流程等,提升风险管控能力;积极推进投资者适当性、交易风险控制、技术系统改造等准备工作,确保创业板试点注册制后相关融资融券及转融通业务顺利开展。同时,公司对受疫情影响严重的上市公司和融资方的风险盯市和违约处置等工作进行差异化管理,制定金融支持防疫相关措施,与客户共克时艰。截至2020年6月末,公司自有资金出资的资本中介业务余额为602.3亿元,排名行业前十。

④ 期货类经纪业务

市场环境

2020年上半年,全球期货和期权市场成交量大幅增长,国内金融市场同样呈现出交投活跃的态势,国内期货市场成交量、成交额均出现明显提升。中国期货业协会公布的最新数据显示,2020年1-6月全国期货市场累计成交量、成交额分别同比增长45.35%和28.70%;期货行业手续费收入74.64亿元,同比增长32.47%。

经营举措及业绩

为应对期货经纪业务手续费率持续下降及新冠疫情给市场造成的冲击,公司在期货经纪业务转型升级、多元化业务拓展方面稳步发展。以单边计算,2020年上半年,子公司国信期货业务成交量3,310.57万手、成交额32,479.70亿元,分别同比增长100.76%和66.63%;实现期货经纪业务手续费净收入0.82亿元,同比增长29.89%。报告期内,国信期货实现营业收入4.78亿元,同比增长47.28%;实现净利润1.22亿元,同比增长76.34%,净利润排名期货行业第六位。

⑤ 资产托管业务

报告期内,公司资产托管及基金服务业务规模4,639.9亿,同比增长6.49%,其中标准产品托管及基金服务业务规模3,856.29亿,同比增长43.09%。公司利用数据分析、绩效分析系统聚焦优质客户,提供定制化资产托管及基金服务;整合公司内部资源,提供综合金融服务方案,满足客户多样化需求。

(2) 投资银行

公司投资银行业务主要是向机构客户提供金融服务,主要包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问和新三板挂牌推荐等业务。报告期内,公司投资银行业务实现营业收入6.37亿元,同比上升27.46%。

① 股票承销保荐业务

市场环境

2020年上半年，新证券法推出，科创板及试点注册制取得阶段性成功，创业板改革有序推进。A股新股发行及审核呈现常态化运作，发行速度和数量显著提升。上半年市场共发行股票项目294个，募集资金3,880亿元，分别同比增长53%和16%。IPO方面，市场发行IPO项目119个，募集资金1,393亿元，分别同比增长83%和125%，上会审核通过率达99%；再融资方面，市场发行再融资项目175个，同比增长38%，募集资金2,488亿元，同比下降9%。可转债仍为上市公司再融资主流方式之一，投资者参与度持续提升。

经营举措及业绩

2020年上半年，公司在做好疫情防控基础上，积极采取各项措施，实时、动态调整工作内容和方式，确保投行业务常态化开展。一是有序推动存量项目的申报、审核及发行上市，切实防范发行风险。报告期内，公司完成股票及可转债承销项目10个，市场份额3.4%。二是以注册制为重点，积极把握创业板改革并试点注册制、科创板市场持续发展等重大市场契机，聚焦粤港澳大湾区，全力做好项目培育及申报。三是高度重视民企纾困工作，支持上市公司及其大股东有效运用各类市场工具，推动以市场化方式缓解民营企业融资困境。截至2020年6月末，公司累计推进纾困项目11个，其中9个通过审核，2个完成交易。公司与深投控等机构共同发起设立总规模为150亿的“深圳投控共赢股权投资基金”已投资7个项目，累计投资金额34.34亿元。公司股票承销保荐业务的具体情况如下：

类别	2020年1-6月		2019年1-6月	
	主承销金额 (亿元)	承销家数	主承销金额 (亿元)	承销家数
首次公开发行	9.67	2	13.34	2
再融资发行	49.93	8	50.11	3.5
合计	59.60	10	63.45	5.5

注：联合主承销家数及金额以1/N计算

② 债券承销业务

市场环境

2020年上半年，债券市场环境错综复杂。年初因疫情袭扰，信用债一级市场沉积大量待发项目，而后伴随央行频繁降准降息、海外疫情恶化、国际油价崩塌以及全球股市暴跌，债市迎来一波爆发行情。国内适时推出多项金融政策，有效保障了债券市场的平稳运行。主要券种的发行利率在纷纷创下低位后有所回升，债券发行量增价跌，发行人融资成本进一步下降。

经营举措及业绩

公司精准把握市场动向，紧抓发行机会，在疫情防控债、优质主体企业债等业务品种创新方面取得突破，进一步扩大了公司在固收业务领域的市场影响力。其中，多支疫情防控债创造了全国记录，发行利率屡创新低。紧抓粤港澳大湾区建设重要机遇，加大业务开拓力度，成功发行全国首单先行示范区绿色公司债券“20深铁02”、市场最大规模纾困债“20安纾01”等。积极开拓境外市场，大力发展美元债业务，成功发行浙江首支普通区县境内主体AA美元债-嵊州投控美元债等。公司债券承销业务的具体情况如下：

类别	2020 年 1-6 月		2019 年 1-6 月	
	主承销金额 (亿元)	承销家数	主承销金额 (亿元)	承销家数
公司债	439.11	51.43	186.57	18.41
债务融资工具	192.99	32.50	100.00	14.00
企业债	27.41	3.84	30.30	3.50
金融债	15.90	4.00	58.30	2.35
资产支持证券	11.10	5.00	87.55	15.50
合计	686.51	96.77	462.72	53.76

注：联合主承销家数、金额以1/N计算

③ 并购重组业务

市场环境

2020年上半年，并购市场交易数量、金额较上年均明显下降，海外并购热度持续下降。中国企业境内并购和出境并购共发生3,818单，同比下降21.63%；交易金额6,444亿元，同比下降46.18%。并购目的仍以横向整合为主，其次是资产调整、多元化战略和战略合作。上半年中国证监会共审核通过了39单并购重组，通过率为78%，同比下降5个百分点。

经营举措及业绩

报告期内，公司继续夯实并购重组业务基础，做好重点客户维护，积极拓展项目储备，妥善处置防范业务风险。2020年上半年，公司完成1单重大资产重组暨配套融资项目的发行上市。

④ 新三板推荐业务

市场环境

2020年上半年，股转公司继续全面深化新三板市场改革，推出精选层制度，有效激发了新三板市场活力。上半年新三板市场融资106.29亿元，环比上升17.43%；二级市场日均成交金额环比提升23.21%，市场各项功能指标回升，积极效应逐渐显现。优质中小企业积极申报精选层，截至2020年6月末，70家企业申报已获受理。

经营举措及业绩

报告期内，公司一方面聚焦存量新三板客户的服务、增值及创新业务的拓展，同时注重防范和化解风险；另一方面积极备战新三板精选层企业公开发行与承销业务，服务新三板深化改革。2020年上半年，公司完成新三板定增融资项目3个，融资金额3,159万元；期末持续督导企业130家。精选层方面，公司承做精选层项目6家，其中贝特瑞已于6月16日通过审核，并于7月9日完成发行，创下了发行规模、战投认购金额、公募基金认购金额、网下询价投资者数量、发行市盈率、做市企业发行价格折扣率等多项市场第一的记录。

⑤ 境外投行业务

报告期内，子公司国信香港以联席国际协调人或联席账簿管理人的角色共完成了11个项目，包括8个美元债发行及3个香港上市项目。2020年上半年，国信香港作为中资美元债（城投类）全球协调人承销排名

大幅跃升至第七位，为公司境外美元债业务打下良好基础。

（3）投资与交易

公司的投资与交易业务主要是从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募基金管理及另类投资业务等。报告期内，公司投资与交易业务共实现营业收入19.87亿元，同比上升6.29%。

① 权益类投资业务

2020年上半年，公司权益投资业务较好地把握住了市场的结构性机会，取得了良好的投资收益率。公司完善了以策略体系为支柱的投资模式，坚持以风险限额为底线，力争实现中低风险的绝对收益。公司形成了以分红投资策略、定增/大宗交易投资策略、价值成长投资策略为主，公私募基金组合投资策略、衍生品套利策略为辅的业务模式，全面捕捉投资交易机会，投资收益更加多元、投资组合更加稳健。

② 固定收益类投资业务

2020年上半年，债券市场走出了先牛后熊的行情，公司积极应对市场变化，以持有债券获取息差为主要投资策略，辅以参与交易性机会增厚资本利得，并积极配置可转债。在合理控制信用资质、保持合理杠杆的前提下，抢抓交易性投资机会，较好地把握了市场节奏和投资机遇。

③ 私募基金业务

今年以来，中国私募基金行业增速显著放缓，疫情防控的“常态化”在一定程度上增加了募资难度。报告期内，子公司国信弘盛完成了1只基金的二期募集；完成5个项目投资，总投资金额1.88亿元；推进7个已上市项目的减持退出，减持金额超过4亿元。2020年上半年，国信弘盛实现营业收入2.37亿元，同比增长50.73%；净利润1.43亿元，同比增长50.99%。

④ 另类投资业务

子公司国信资本主要开展科创板跟投、非上市公司股权投资、股权基金投资、转融通证券出借等投资业务。报告期内，国信资本共完成2只股权类基金投资和1项非上市公司股权投资，累计投资规模2.03亿元；实现营业收入2.33亿元，净利润1.68亿元。

（4）资产管理

公司资产管理业务主要是根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合、单一资产管理业务，资产证券化业务以及基金管理业务等。报告期内，公司资产管理业务实现收入1.95亿元，同比上升25.55%。

市场环境

2020年上半年，新证券法颁布实施，资管新规各项业务配套细则陆续落地，监管规则趋于统一，资产管理行业正向着回归本源、服务实体的方向不断迈进。一方面，疫情冲击、金融市场波动给资产管理业务的营销募资、择时择券、资产配置等造成了较大难度；另一方面，金融风险化解和行业改革等工作有序推进，为资产管理业务打开了空间，资产管理机构迎来新一轮发展提供了历史机遇。

经营举措及业绩

报告期内，公司资产管理业务积极应对宏观经济和行业变化，以主动管理为核心、以产品驱动和渠道拓展为两翼，管理规模实现稳定增长。紧抓市场机遇发行定增、指数、FOF等产品，在严格控制回撤的前提下，大部分产品实现了较好的绝对收益；把握国家科技发展趋势，持续做好科创板产品的投资运营，帮助客户积极参与科创板的投资机遇；积极拓展资产证券化、票据主动管理、员工持股计划等业务，服务类型更加多元，满足实体企业各类融资需求。截至报告期末，公司资产管理净值规模为2,089.80亿元，比上年末增长30.33%，资产管理规模行业排名大幅提升，具体情况如下：

单位：亿元

类型	2020年6月30日	2019年12月31日	较上年末增减
集合资产管理业务	437.76	427.02	2.52%
单一资产管理业务	1,404.01	926.37	51.56%
专项资产管理业务	248.03	250.06	-0.81%
合计	2,089.80	1,603.45	30.33%

(5) 其他业务

公司的其他业务主要是通过重要参股公司鹏华基金从事基金管理业务。鹏华基金立志于“基本面投资专家”，秉承“长期投资、稳利致远”的投资理念，各项业务扎实推进，投研体系不断夯实，管理规模稳健增长。2020年上半年，鹏华基金把握结构性机遇，主动权益投资业绩显著，多只产品业绩名列前茅，在分化加剧的行情中为投资者创造了丰厚的回报，品牌影响力及市场竞争力持续提升。截至报告期末，鹏华基金资产管理规模7,014.31亿元（不含鹏华基金子公司），稳居行业第一梯队。其中，公募基金资产管理规模4,962.79亿元（剔除联接基金），位列行业第十。

三、主营业务构成情况

(一) 主营业务分业务情况

单位：万元

业务类别	营业总收入	营业总支出	营业利润率	营业总收入 同比增减幅度	营业总支出 同比增减幅度	营业利润率 比上年增减
经纪及财富管理	459,220.06	258,316.90	43.75%	26.70%	60.23%	下降 11.77 个百分点
投资银行	63,702.61	46,044.96	27.72%	27.46%	5.06%	上升 15.41 个百分点
投资与交易	198,733.43	38,593.93	80.58%	6.29%	-3.91%	上升 2.06 个百分点
资产管理	19,481.82	8,323.81	57.27%	25.55%	20.63%	上升 1.74 个百分点
其他	62,722.07	70,948.25	不适用	63.11%	25.62%	不适用
合计	803,859.99	422,227.86	47.47%	23.03%	36.83%	下降 5.30 个百分点

报告期内，因公司内部组织结构、管理要求变化相应调整了分部报告的统计口径，主要是将原资本中介业务分部并入经纪及财富管理分部。详见公司2020年半年度财务报表附注“十四、其他重要事项”之“（二）分部信息”。

(二) 主营业务分地区情况

1. 营业总收入地区分部情况

单位：万元

地区	2020 年 1-6 月		2019 年 1-6 月		营业总收入 同比增减幅度
	营业网点数量	营业总收入	营业网点数量	营业总收入	
广东	60	127,654.80	60	107,900.40	18.31%
浙江	26	30,767.12	26	25,393.55	21.16%
北京	11	26,939.63	11	21,403.13	25.87%
上海	10	22,760.68	10	19,180.87	18.66%
四川	13	10,932.23	13	9,194.97	18.89%
湖北	6	8,823.03	6	7,703.66	14.53%
福建	8	8,803.53	8	6,995.33	25.85%
江苏	13	8,723.32	13	7,482.14	16.59%
陕西	8	7,114.08	8	5,633.19	26.29%
山东	9	5,710.64	9	4,245.52	34.51%
湖南	6	4,604.29	6	3,707.94	24.17%
辽宁	8	3,634.91	8	3,104.50	17.09%
天津	4	3,361.84	4	2,695.41	24.72%
云南	5	2,624.97	5	2,195.22	19.58%
河南	6	2,311.68	5	1,950.44	18.52%
安徽	4	2,023.97	4	1,618.18	25.08%
山西	5	1,865.85	5	1,546.29	20.67%
重庆	4	1,814.03	4	1,230.38	47.44%
黑龙江	5	1,648.99	5	1,444.73	14.14%
江西	4	1,333.75	4	1,111.05	20.04%
海南	2	1,310.18	2	995.41	31.62%
吉林	3	1,228.86	3	886.80	38.57%
广西	3	810.24	3	603.86	34.18%
河北	2	649.52	2	501.65	29.48%
内蒙古	1	526.68	1	449.86	17.08%
贵州	3	482.76	3	409.32	17.94%
甘肃	1	435.76	1	274.41	58.80%
新疆	2	386.74	2	279.14	38.55%
宁夏	2	369.78	2	290.31	27.37%
公司总部及境内子公司	-	505,910.14	-	404,408.58	25.10%
境外小计	-	8,296.00	-	8,523.96	-2.67%
合计	234	803,859.99	233	653,360.21	23.03%

注：营业网点数量包括证券及期货营业网点。

2. 营业利润地区分部情况

单位：万元

地区	2020 年 1-6 月		2019 年 1-6 月		营业利润 同比增减幅度
	营业网点数量	营业利润	营业网点数量	营业利润	
广东	60	75,323.74	60	64,330.40	17.09%
浙江	26	16,963.20	26	13,578.66	24.93%
北京	11	16,206.12	11	13,380.27	21.12%
上海	10	14,549.40	10	12,410.55	17.23%
四川	13	5,311.78	13	4,546.33	16.84%
湖北	6	5,264.94	6	4,174.61	26.12%
江苏	13	4,193.47	13	3,758.98	11.56%
陕西	8	4,184.74	8	3,152.15	32.76%
福建	8	3,911.71	8	2,616.13	49.52%
湖南	6	2,414.98	6	1,804.49	33.83%
山东	9	2,189.26	9	1,476.58	48.27%
辽宁	8	1,715.65	8	1,115.07	53.86%
云南	5	1,402.79	5	1,196.56	17.24%
天津	4	1,132.12	4	615.83	83.84%
河南	6	1,059.89	5	711.96	48.87%
安徽	4	894.41	4	704.23	27.00%
山西	5	729.76	5	439.69	65.97%
重庆	4	699.77	4	319.93	118.73%
黑龙江	5	665.49	5	528.14	26.01%
海南	2	415.56	2	338.54	22.75%
江西	4	403.77	4	365.95	10.33%
吉林	3	401.29	3	267.11	50.24%
河北	2	212.87	2	82.11	159.26%
宁夏	2	75.82	2	16.01	373.58%
甘肃	1	42.10	1	-61.60	不适用
新疆	2	40.40	2	38.75	4.26%
内蒙古	1	39.89	1	115.76	-65.54%
广西	3	-16.84	3	-110.72	不适用
贵州	3	-209.44	3	-144.23	不适用
公司总部及境内子公司	-	221,718.41	-	212,375.99	4.40%
境外小计	-	-304.89	-	628.30	-148.53%
合计	234	381,632.14	233	344,772.52	10.69%

注：营业网点数量包括证券及期货营业网点。

四、非主营业务分析

不适用。

五、资产及负债状况分析

(一) 资产及负债构成重大变动情况

单位：万元

项目	2020年6月30日		2019年12月31日		占比增减 (百分点)
	金额	占总资产比例	金额	占总资产比例	
货币资金	7,084,727.93	27.76%	5,291,462.98	23.55%	4.21
融出资金	3,948,958.32	15.47%	3,770,804.74	16.79%	-1.32
衍生金融资产	654.47	0.00%	1,893.40	0.01%	-0.01
存出保证金	492,553.32	1.93%	437,471.47	1.95%	-0.02
结算备付金	780,881.65	3.06%	679,294.99	3.02%	0.04
交易性金融资产	7,318,113.93	28.68%	6,251,156.90	27.83%	0.85
其他债权投资	1,892,795.11	7.42%	1,797,259.13	8.00%	-0.58
其他权益工具投资	1,051,986.00	4.12%	972,913.40	4.33%	-0.21
应收账款	74,591.30	0.29%	79,115.76	0.35%	-0.06
投资性房地产	30,453.54	0.12%	29,638.63	0.13%	-0.01
长期股权投资	352,786.65	1.38%	311,057.60	1.38%	0.00
固定资产	108,991.07	0.43%	112,658.37	0.50%	-0.07
合同资产	1,491.47	0.01%	-	-	0.01
买入返售金融资产	1,998,604.38	7.83%	2,377,269.06	10.58%	-2.75
无形资产	65,189.37	0.26%	65,653.87	0.29%	-0.03
在建工程	87,919.37	0.34%	83,226.94	0.37%	-0.03
商誉	1,026.02	0.00%	1,026.02	0.00%	0.00
递延所得税资产	189,710.87	0.74%	164,388.81	0.73%	0.01
其他资产	38,186.45	0.15%	38,139.13	0.17%	-0.02
短期借款	18,840.54	0.07%	29,632.09	0.13%	-0.06
拆入资金	303,839.07	1.19%	535,158.82	2.38%	-1.19
卖出回购金融资产款	4,857,430.96	19.03%	4,182,312.94	18.62%	0.41
应付短期融资款	3,471,452.37	13.60%	1,804,332.28	8.03%	5.57
交易性金融负债	11,515.82	0.05%	28,470.59	0.13%	-0.08
衍生金融负债	19,449.54	0.08%	7,140.90	0.03%	0.05
代理买卖证券款	5,980,309.89	23.43%	4,658,745.75	20.74%	2.69
代理承销证券款	7,700.00	0.03%	-	-	0.03
应付职工薪酬	343,576.26	1.35%	359,770.59	1.60%	-0.25
应交税费	82,664.82	0.32%	87,091.40	0.39%	-0.07
应付款项	632,251.62	2.48%	629,272.21	2.80%	-0.32
合同负债	932.32	0.00%	-	-	0.00
预计负债	40,586.56	0.16%	23,474.99	0.10%	0.06
应付债券	3,721,606.06	14.58%	3,754,933.63	16.72%	-2.14
递延收益	13,150.34	0.05%	13,324.14	0.06%	-0.01
递延所得税负债	34,271.51	0.13%	30,247.12	0.13%	0.00
其他负债	762,152.17	2.99%	694,998.63	3.09%	-0.10

公司2020年6月末总资产2,551.96亿元，同比增加305.52亿元和13.60%；剔除客户资金后的总资产1,953.93亿元，同比增加173.36亿元和9.74%，其中货币资金及结算备付金133.57亿元、融出资金394.90亿元、买入返售金融资产199.86亿元、交易性金融资产731.81亿元、其他债权投资189.28亿元、其他权益工具投资105.20亿元，这六类资产合计占总资产（扣除客户资金）的89.80%，公司资产具有良好的流动性。

公司2020年6月末负债总额2,030.17亿元，同比增加346.28亿元和20.56%；扣除代理买卖证券款后，公司负债1,432.14亿元，其中：公司债335.59亿元，收益凭证208.37亿元，短期借款1.88亿元，短期融资券175.35亿元，其余均为正常的经营性短期负债。公司2020年6月末资产负债率79.55%，剔除客户资金和代理买卖证券款后资产负债率73.30%。

（二）以公允价值计量的资产和负债

单位：万元

项目	期初数	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	本期成本变动	期末数
金融资产						
1. 交易性金融资产（不含衍生金融资产）	6,251,156.90	14,207.03	-	-	1,040,466.11	7,318,113.93
2. 衍生金融资产	1,893.40	-1,238.92	-	-	-	654.47
3. 其他债权投资	1,797,259.13	-	4,291.01	10,216.46	90,945.46	1,892,795.11
4. 其他权益工具投资	972,913.40	-	13,979.23	-	90,241.15	1,051,986.00
合计	9,023,222.83	12,968.11	18,270.24	10,216.46	1,221,652.73	10,263,549.51
金融负债	35,611.49	-3,344.44	-	-	-17,005.38	30,965.36

注：证券自营业务为证券公司的主营业务，交易频繁，因此以本期成本变动来反映公司购买、出售金融资产变动的情况。

报告期内，公司主要资产计量属性未发生重大变化。

（三）截至报告期末的资产权利受限情况

详见公司2020年半年度财务报表附注“五、合并财务报表项目注释”之“（四）其他 1. 所有权或使用权受到限制的资产”。

六、比较式财务报表中变动幅度超过 30%以上项目的情况

单位：万元

项目	2020年6月30日	2019年12月31日	本报告期末比上年度末增减	变动原因
货币资金	7,084,727.93	5,291,462.98	33.89%	市场交投活跃，客户资金增加。
衍生金融资产	654.47	1,893.40	-65.43%	主要是收益互换及收益凭证公允价值变动。
合同资产	1,491.47	-	不适用	主要是新收入准则分类变化的影响。
短期借款	18,840.54	29,632.09	-36.42%	主要是国信香港信用及质押借款减少。

应付短期融资款	3,471,452.37	1,804,332.28	92.40%	主要是短期收益凭证及短期融资券发行规模增加。
拆入资金	303,839.07	535,158.82	-43.22%	转融通融入资金规模减少。
交易性金融负债	11,515.82	28,470.59	-59.55%	主要是债券借贷到期结算。
衍生金融负债	19,449.54	7,140.90	172.37%	主要是股票期权、商品现货远期合同及股指期货公允价值变动。
代理承销证券款	7,700.00	-	不适用	主要是应付代理承销股票款。
合同负债	932.32	-	不适用	主要是新收入准则分类变化的影响。
预计负债	40,586.56	23,474.99	72.89%	主要是计提诉讼案件损失。
其他权益工具	-	500,000.00	-100.00%	赎回永续次级债。
少数股东权益	1,839.61	4,616.28	-60.15%	主要是本期国信弘盛合并利润表的少数股东损益减少。
项目	2020年1-6月	2019年1-6月	同比增减幅度	变动原因
利息净收入	166,185.60	79,959.42	107.84%	主要是融出资金及买入返售金融资产利息收入增加、应付债券及卖出回购业务利息支出减少。
其他收益	1,736.75	481.56	260.65%	主要是代扣代缴个人所得税手续费返还增加。
公允价值变动收益	9,623.67	67,716.98	-85.79%	主要是证券市场波动导致金融资产公允价值减少。
资产处置收益	-5.46	-23.17	不适用	主要是固定资产处置损失减少。
信用减值损失	100,664.68	32,169.63	212.92%	主要是股票质押回购业务信用减值损失增加。
其他资产减值损失	589.38	85.24	591.46%	主要是子公司国信期货计提的存货跌价准备增加。
其他业务成本	21,714.22	16,081.85	35.02%	主要是子公司国信期货大宗商品销售支出增加。
营业外收入	1,636.33	2,472.58	-33.82%	主要是收到的政府补助减少。
营业外支出	21,251.02	13,989.29	51.91%	主要是计提诉讼案件损失增加。
其他综合收益的税后净额	-6,397.64	61,018.83	-110.48%	主要是其他权益工具投资公允价值变动。
经营活动产生的现金流量净额	1,105,789.00	2,086,281.18	-47.00%	主要是本期收到的客户资金减少，自营业务投资规模增加所致。
投资活动产生的现金流量净额	-37,494.95	-7,775.73	不适用	主要是投资所支付的现金增加。
筹资活动产生的现金流量净额	822,697.67	-155,427.49	不适用	主要是发行债券收到的现金增加。

七、投资状况分析

（一）对外股权投资总体分析

报告期内，公司对外股权投资金额共3亿元，主要为子公司国信弘盛出资3亿元对张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）进行增资，增资后持股比例为20%。

（二）报告期内获取的重大的股权投资情况

不适用。

（三）报告期内正在进行的重大的非股权投资情况

单位：万元

项目名称	项目投资方式	是否为固定资产投资	本报告期投入金额	截至报告期末累计实际投入金额	资金来源	项目进度	项目收益情况	披露情况
国信金融大厦	自建	是	5,409.41	85,709.31	自有资金	63.63%	不适用	不适用

（四）以公允价值计量的金融资产

单位：万元

资产类别	初始投资成本	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	报告期内购入金额	报告期内售出金额	报告期累计投资收益	期末金额	资金来源
股票	586,940.98	43,709.02	14,421.48	451,472.62	308,539.82	34,581.34	644,497.94	自有
基金	864,175.17	-3,678.49	2,746.67	465,490.31	420,371.71	17,605.15	866,655.73	自有
债券	7,318,197.61	-44,363.57	4,291.01	262,674,742.15	261,586,811.26	146,832.32	7,449,461.68	自有
信托产品	17,241.00	746.58	-	-	-	753.64	19,834.99	自有
金融衍生工具	-	-4,194.34	-	-	-	1,957.27	-18,795.07	自有
其他	1,249,600.27	17,404.46	-3,188.92	1,264,284.36	1,335,619.31	8,835.36	1,270,928.88	自有
合计	10,036,155.04	9,623.67	18,270.24	264,855,989.44	263,651,342.10	210,565.09	10,232,584.14	-

(五) 金融资产投资
1. 证券投资情况

单位：万元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
债券	132013	17 宝武 EB	147,264.85	公允价值计量	20,133.12	386.77	0.00	127,361.56	-	717.19	148,728.58	交易性金融资产	自有
基金	003474	南方天天利货币 B	117,213.20	公允价值计量	101,912.12	-	-	14,000.00	-	1,301.08	117,213.20	交易性金融资产	自有
债券	190015	19 付息国债 15	72,014.14	公允价值计量	-	-439.42	-	931,256.33	858,358.98	-655.53	71,818.83	交易性金融资产	自有
债券	132018	G 三峡 EB1	65,734.37	公允价值计量	53,700.70	-903.07	-	36,808.17	22,725.10	1,077.58	68,622.22	交易性金融资产	自有
债券	190215	19 国开 15	64,842.58	公允价值计量	10,994.20	53.97	-	4,456,929.47	4,403,539.12	1,612.85	66,605.30	交易性金融资产	自有
债券	150218	15 国开 18	63,969.47	公允价值计量	14,395.12	-1,320.34	-	364,722.05	316,271.55	572.58	64,531.83	交易性金融资产	自有
债券	010107	21 国债 (7)	61,461.63	公允价值计量	63,857.53	-	1,212.56	1,863.43	1,090.69	1,204.80	63,750.64	其他债权投资	自有
债券	122659	12 石油 06	59,294.55	公允价值计量	62,759.98	-	1,542.60	-	-	1,330.09	61,421.95	其他债权投资	自有
债券	145706	17 腾越 01	57,000.00	公允价值计量	58,362.40	-285.63	-	-	-	1,636.44	59,998.85	交易性金融资产	自有
其他	931408	国信金鹏分级 1 号 B	76,841.57	公允价值计量	77,025.99	-15.37	-	-	-	3,082.08	77,010.62	交易性金融资产	自有
期末持有的其他证券投资			9,239,731.54	-	8,560,081.66	16,730.12	15,515.07	258,827,210.59	258,003,379.20	210,356.46	9,463,847.51	-	-
合计			10,025,367.90	-	9,023,222.83	14,207.03	18,270.24	264,760,151.60	263,605,364.63	222,235.62	10,263,549.51	-	-
证券投资审批董事会公告披露日期			不适用										
证券投资审批股东会公告披露日期			不适用										

注：其他证券投资中包含向证金公司划出的投资款，截至报告期末，账面价值为 655,359.08 万元。根据与证金公司签订的协议，公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险、分享投资收益，由证金公司进行统一运作与投资管理。

（六）募集资金使用情况

报告期内，公司无募集资金使用情况。

（七）非募集资金投资的重大项目情况

报告期内，公司无非募集资金投资的重大项目。

八、重大资产和股权出售

（一）出售重大资产情况

报告期内，公司未出售重大资产。

（二）出售重大股权情况

报告期内，公司未出售重大股权。

九、主要控股参股公司分析

（一）主要控股参股公司的情况

报告期内，公司单个子公司的净利润或单个参股公司的投资收益对公司净利润的影响均未达10%，无应当披露的重要控股、参股公司信息。

（二）报告期内取得和处置子公司的情况

公司名称	报告期内取得和处置子公司方式	报告期内对整体生产经营和业绩的影响
国信弘盛能源基金管理（珠海）有限公司	转让	无重大影响

十、公司控制的结构化主体情况

公司合并的结构化主体包括公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。公司通过综合评估公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2020年6月30日，纳入公司财务报表合并范围的结构化主体共27个，合并的结构化主体的总资产为人民币975,661.23万元。公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中的金额为人民币434,231.77万元。

十一、对 2020 年 1-9 月经营业绩的预计

不适用。

十二、公司面临的风险和应对措施

（一）市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司在已构建的四级风险管理架构下，制定了市场风险管理的具体流程，涵盖公司董事会、风险控制委员会、风险管理总部及各业务部门，各组织分工明确，各负其责。

公司根据董事会每年审议通过的整体市场风险限额，综合考虑各业务的风险收益特征和相关性等因素，将风险限额细化至业务策略层级。风险限额主要包括投资规模、损失比例、风险价值（VaR）和压力测试损失等指标。风险管理总部通过市场风险管理系统等专业的风险管理工具和方法对风险限额进行每日监控，当指标达到预警限额时，风险管理总部对触发预警限额部门进行预警提示，并要求其在规定时间内进行反馈，说明触发预警限额原因和后续的调整计划；当指标突破风险限额时，风险管理总部对超限部门进行提示，要求超限部门在规定时间内将指标调整至限额范围内，若因客观原因无法及时调整的，要求超限部门在规定时间内说明超限原因和后续调整计划，并要求超限部门在调整期间不能主动增加风险敞口。风险管理总部会持续监督业务部门风险应对措施落实情况，并与业务部门沟通讨论风险信息 and 可能出现的极端压力情景。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，在已有限额指标的基础上，根据各业务的特点，新增部分既满足业务发展又能有效控制风险暴露程度的限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和VaR限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母限额并进行日常监控。另外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过VaR等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

（二）信用风险

信用风险一般是指因客户、交易对手或证券发行人未履行合约责任而引致公司损失的风险。公司的信

用风险主要集中在以下业务：

- (1) 具有债权性质的债券等交易业务；
- (2) 融资融券业务、约定购回和股票质押式回购等有证券抵押的资本中介业务；
- (3) 场外衍生品业务；
- (4) 经纪业务模式下的债券质押式回购业务；
- (5) 存放银行的活期存款及定期存款；
- (6) 其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司按照《证券公司信用风险管理指引》的要求，已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、信用风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务中存在发行人违约的信用风险。公司建立具有自主知识产权的内部评级体系，采用财务指标与经营指标相结合的方法对发行人、交易对手进行风险评估，通过债券负面清单管理、同一发行人授信管理等措施对债券投资实施前端准入控制；持续监控发行人资信状况；及时调整负面清单债券的持仓；明确违约司法追索程序等措施。

股票质押、融资融券等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 275.28%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 228.72%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 288.64%。

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

经纪业务模式下的债券质押式回购业务公司对中国结算承担交收责任。公司采取投资者适当性管理、风险限额、内部评级、授信管理、集中度管理、系统监控等措施，控制因承担客户回购还款交收责任所带来的信用风险。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

（三）操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则，各部门设置专职或兼职的风险管理岗；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理环节的剩余风险；三是开展关键风险指标监测工作，从公司层面和业务层面两个维度对操作风险进行监控，及时预警并处置风险；四是完善风险事件收集，做好案例分析，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是持续优化公司统一的操作风险管理系统，实现操作风险系统化管理；六是积极宣导风险管理文化，组织公司各部门风险教育培训。

（四）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：（1）动态监测与评估流动性风险指标及限额情况，确保各项指标均持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。（2）持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。（3）加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。（4）开展流动性风险压力测试，分析在不同压力情景下公司的流动性风险承受能力，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施。（5）开展流动性风险应急演练与评估，持续完善应急计划的机制与流程。

报告期内，公司持续完善流动性风险指标及限额体系，适时开展流动性风险压力测试与应急演练，推动流动性风险监管指标新规的系统升级，进一步优化流动性风险管理信息系统，不断完善公司流动性风险管理机制。

第五节 重要事项

一、报告期内召开股东大会的有关情况

(一) 召开股东大会的情况

会议届次	会议类型	投资者参与比例	召开日期	披露日期	披露索引
2020 年第一次临时股东大会	临时股东大会	83.3483%	2020 年 3 月 19 日	2020 年 3 月 20 日	详见深交所网站 (http://www.szse.cn)披露的《2020 年第一次临时股东大会决议公告》
2019 年度股东大会	年度股东大会	83.3465%	2020 年 4 月 10 日	2020 年 4 月 11 日	详见深交所网站 (http://www.szse.cn)披露的《2019 年度股东大会决议公告》
2020 年第二次临时股东大会	临时股东大会	80.0596%	2020 年 5 月 15 日	2020 年 5 月 16 日	详见深交所网站 (http://www.szse.cn)披露的《2020 年第二次临时股东大会决议公告》
2020 年第三次临时股东大会	临时股东大会	83.3568%	2020 年 6 月 15 日	2020 年 6 月 16 日	详见深交所网站 (http://www.szse.cn)披露的《2020 年第三次临时股东大会决议公告》

(二) 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

不适用。

二、本报告期利润分配及资本公积金转增股本预案

公司半年度不派发现金红利，不送红股，不以公积金转增股本。

三、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履行完毕及截至报告期末超期未履行完毕的承诺事项

不存在公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内履行完毕及截至报告期末超期未履行完毕的承诺事项。

四、聘任、解聘会计师事务所情况

经公司2019年度股东大会审议通过，公司续聘天健会计师事务所（特殊普通合伙）为公司2020年度外部审计机构以及2020年度内部控制审计机构。

公司2020年半年度财务报告未经审计。

五、董事会、监事会对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

不适用。

六、董事会对上年度“非标准审计报告”相关情况的说明

不适用。

七、破产重整相关事项

报告期内，公司未发生破产重整相关事项。

八、诉讼事项

（一）重大诉讼仲裁事项

报告期内，公司不存在涉及金额占公司最近一期经审计净资产绝对值10%以上且绝对金额超过1,000万元的重大诉讼、仲裁事项。

（二）其他诉讼仲裁事项

自报告期初至本报告披露日，公司新增或前期已披露并发生新进展的、涉案金额超过人民币1,000万元的与公司经营业务相关的诉讼、仲裁事项，具体如下：

1. 公司与深圳市国信股权投资基金管理有限公司商标侵权及不正当竞争纠纷案

因深圳市国信股权投资基金管理有限公司存在涉嫌侵犯公司字号、商标专用权及不正当竞争等行为，公司向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求深圳市国信股权投资基金管理有限公司赔偿公司经济损失及合理费用合计1,000万元。该案于2018年9月26日立案，经2019年9月3日首次开庭及2020年3月6日第二次开庭审理，法院于2020年4月26日送达一审判决，现案件处于二审审理阶段。

2. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称“华泽钴镍”）部分投资者因证券虚假陈述造成相关投资损失的民事赔偿事宜，分别向成都市中级人民法院（以下简称“成都中院”）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿损失及承担诉讼费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。公司自2018年10月31日起陆续收到相关案件材料，截至目前，涉及公司的诉讼案件合计3,300件，涉案标的额合计10.15亿元，部分案件分别于2019年8月1日、2019年10月10日和2020年8月7日一审开庭审理。成都中院对部分案件作出一审裁判，上述判决书目前尚未生效。四川省高级人民法院于2020年7月7日对部分案件二审开庭审理，目前尚未作出二审裁判。

3. 海口农商行与刚泰集团及公司债券交易纠纷案

刚泰集团公开发行2016年公司债券（第二期）（以下简称“16刚集02”），发行规模为5亿元，期限为3年，附第2年末投资者回售选择权，起息日期为2016年11月3日，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为5亿元。2018年11月3日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。“16刚集02”投资者海口农村商业银行股份有限公司向海南省高级人民法院提起诉讼，要求刚泰集团支付本金、利息、复利及相关费用合计人民币1.07亿元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

4. 公司与刚泰集团债券交易纠纷案

刚泰集团有限公司（以下简称“刚泰集团”）公开发行2016年公司债券（第一期），发行规模为5亿元，期限为3年，附第2年末投资者回售选择权，起息日期为2016年9月26日，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为5亿元。2018年9月26日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。2019年1月25日，公司作为授权代表向深圳国际仲裁院提起仲裁，要求刚泰集团支付债券本金、利息、逾期利息等费用合计人民币5.37亿元。2019年7月17日，本案开庭审理。2019年10月29日，深圳国际仲裁院作出裁决，公司胜诉。2020年1月4日，公司向上海金融法院申请强制执行。2020年5月8日，上海金融法院作出终结本次执行裁定。

5. 公司与苏某、吕某等 21 人基金合同纠纷案

2016年3月，委托人苏某等13人与基金管理人歌斐资产管理有限公司（简称“歌斐资产”）及基金托管人国信证券签订了《歌斐创世优选一号投资基金基金合同》，苏某等13人出资认购了该基金份额。2019年3-4月，苏某等13人向上海国际仲裁中心提起仲裁，认为歌斐资产将基金的基础资产借款债权披露为应收账款债权，以欺诈手段使其在违背真实意思情况下订立合同，请求撤销基金合同，要求歌斐资产返还本金、利息等合计3,366.45万元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前，部分案件已裁决，公司不承担任何责任。

2016年3月，委托人吕某等8人与基金管理人歌斐资产及基金托管人国信证券签订了《歌斐创世优选二号投资基金基金合同》，吕某等8人出资认购了该基金份额。2019年3-4月，吕某等8人向上海国际仲裁中心提起仲裁，认为歌斐资产将基金的基础资产借款债权披露为应收账款债权，以欺诈手段使其在违背真实意思情况下订立合同，请求撤销基金合同，要求歌斐资产返还本金、利息等合计1,542.16万元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前，全部案件已裁决，公司不承担任何责任。

6. 公司与唐某、深圳前海元泉资产管理有限公司基金合同纠纷案

2015年11月22日，委托人唐某与基金管理人北京华建融信资产管理有限公司（以下简称“华建融信”）、基金托管人国信证券签订了《华建1号基础设施建设专项基金合同》，唐某出资认购了该基金份额。2019年4月，唐某在深圳国际仲裁院以华建融信为被申请人提起仲裁。2019年9月，唐某追加公司为仲裁第二被申请人。唐某认为华建融信构成违约，要求华建融信返还本金、利息等合计241.5万元，并要求公司承担连带

赔偿责任。2020年3月4日，公司收到判决书，裁决公司在一定范围内承担连带赔偿责任，公司赔付金额约为78.4万元。2020年6月，公司已履行判决书义务。

2015年12月1日，委托人深圳前海元泉资产管理有限公司（以下简称“前海元泉”）与基金管理人华建融信、基金托管人国信证券签订了《华建1号基础设施建设专项基金合同》，前海元泉出资认购了该基金份额。2018年12月，前海元泉在深圳国际仲裁院以华建融信为被申请人提起仲裁。2019年6月，前海元泉追加公司为仲裁第二被申请人。前海元泉认为华建融信构成违约，要求华建融信返还本金、利息等合计1,380万元，并要求公司承担连带赔偿责任。2020年2月14日，公司收到判决书，裁决公司在一定范围内承担连带赔偿责任，公司赔付金额约为145万元。2020年5月，公司已履行判决书义务。

7. 公司与刘某基金合同纠纷案

2015年1月，委托人刘某与基金管理人正佑金元（北京）投资基金管理有限公司（以下简称“正佑金元”）、基金托管人国信证券签订了《金元1号契约型基金基金合同》，刘某出资认购了该基金份额。2019年6月，刘某向北京市朝阳区人民法院提起诉讼，认为正佑金元未进行合格投资者适当性调查、未在基金业协会登记、未对涉案基金进行备案、未定期进行信息披露和信息公示，已构成违约，要求解除合同及正佑金元返还本金、利息等合计1,758万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件已于2019年11月11日开庭，目前尚未判决。

8. 公司管理的资产管理计划与康得新集团公司债券交易纠纷案

康得新复合材料集团股份有限公司（以下简称“康得新集团”）2018年度第一期超短期融资券“18康得新SCP001”未按期兑付本金及利息。根据委托人的指令及相关法律法规，公司作为资产管理计划管理人，于2019年7月31日向深圳市罗湖区人民法院代两项资产管理计划提起诉讼，要求康得新集团兑付债券本金、利息及违约金等相关费用合计6,247.5万元，案件的最终诉讼结果由委托人承担。2020年5月9日，公司收到胜诉判决。目前案件已进入强制执行程序。

9. 公司与腾邦集团股票质押式回购交易纠纷案

2016年9月29日、2017年8月25日，腾邦集团有限公司（以下简称“腾邦集团”）分别与公司签署《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易，将其所持有的腾邦国际股票（证券代码：300178）5,010万股质押给公司，融资人民币3.17亿元。腾邦集团未能按期偿还本息，其质押的腾邦国际股票已跌破平仓线并被司法冻结，已构成多重违约。2019年8月1日，公司向深圳国际仲裁院提起仲裁，要求腾邦集团偿还未付本金、利息及违约金等合计人民币3.29亿元。2020年5月31日，本案开庭审理。目前尚未收到仲裁裁决。

10. 公司与达仁投资管理集团股份有限公司债券质押式回购交易纠纷案

因达仁投资管理集团股份有限公司管理的达仁通宝3期私募证券投资基金与公司开展的债券质押式回购交易违约，公司于2019年8月向中国国际贸易仲裁委员会华南分会提起仲裁，要求达仁通宝3期私募

证券投资基金偿还本金、利息及违约金等合计1,370万元。2020年3月6日，深圳国际仲裁院向公司送达《关于书面审理的决定》，决定本案将进行书面审理。2020年4月24日，中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会对本案作出裁决，基本支持公司仲裁请求。目前，案件已进入强制执行程序。

11. 公司与余某股票质押式回购交易纠纷案

2017年公司与浙江聚力文化发展股份有限公司（以下简称“聚力文化”）大股东余某开展了3笔股票质押业务，本金余额3.98亿元，截至2019年7月31日利息为4,970万，合计4.47亿。该业务由余某持有的聚力文化约6,643万股股票作质押担保，由聚力控股集团有限公司作连带责任保证担保。因余某及聚力控股集团有限公司未能按时偿还本金及利息，公司于2019年8月向深圳仲裁院递交了仲裁申请材料并立案。案件于2020年6月10日开庭，目前尚未裁决。

12. 公司与吴某等8人基金合同纠纷案

2016年11月，委托人吴某等8人与基金管理人上海东楷创业投资管理有限公司（以下简称“东楷创业”）、基金托管人国信证券签订了《中航神舟电力专项私募基金基金合同》，吴某等8人出资认购了该基金份额。2019年12月，吴某等8人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为东楷创业未披露基金信息、擅自变更投资对象及延期，已经构成根本违约，要求解除合同及东楷创业返还本金、利息等合计1,476.68万元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

13. 公司与刘某等2人基金合同纠纷案

2018年6月，委托人刘某等2人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称“天和盈泰”）、基金托管人国信证券签订了《天和盈泰山一号私募投资基金基金合同》，刘某等2人出资认购了该基金份额。2019年12月，刘某等2人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计2,204万元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

14. 公司与刘某等18人、中南红文化集团股份有限公司证券纠纷案

2016年4月，中南红文化集团股份有限公司（以下简称“中南文化”）实施股权激励计划，分三期向刘某等18名激励对象授予限制性股票。18名激励对象向公司融资，出资认购中南文化向其授予的限制性股票。18名激励对象未按合同约定向公司还款，中南文化未按合同约定回购注销第二、三期限制性股票。公司于2020年1月22日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求刘某等18人和中南文化支付本金、利息及罚息等合计5,517万元。首批案件已于2020年7月10日开庭，目前尚未裁决。

15. 公司与钟某股票质押式回购交易纠纷案

北京金一文化发展股份有限公司（以下简称“金一文化”）董事长钟某，于2016年6月22日以其持有的1,600万股金一文化股票（证券代码：002721）质押给公司，融资人民币1亿元。金一文化股票因价格跌破

平仓线构成违约。公司于2020年1月22日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求钟某偿还本金、利息及违约金等合计10,590万元。案件已于2020年6月29日开庭，因双方无法达成调解协议，仲裁院于7月23日作出生效裁决，支持我方全部仲裁请求。由于钟某在法定履行期内未履行付款义务，公司已于8月6日向北京市第一中级人民法院提出强制执行申请。

16. 公司与藏格投资、四川永鸿股票质押式回购交易纠纷案

2016年7-8月，西藏藏格创业投资集团有限公司（以下简称“藏格投资”）、四川省永鸿实业有限公司（以下简称“四川永鸿”）分别与公司签署《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易。藏格投资、四川永鸿将其所持有的*ST藏格股票（原“藏格控股”，证券代码：000408）合计约27,817万股质押给公司，融资人民币合计22亿元，其中包含向公司作为管理人的资产管理计划融资5.5亿元。因藏格投资、四川永鸿未能按期偿还本息，其质押的*ST藏格股票已跌破平仓线，已构成多重违约。公司于2020年5月向深圳市福田区人民法院申请实现担保物权的特别程序，并于8月18日收到法院作出的支持公司申请的裁定。

17. 公司与张某基金合同纠纷案

2017年2月，委托人张某与基金管理人上海钜澎资产管理有限公司（以下简称“钜澎公司”）、基金托管人国信证券签订了《钜澎大观稳盈优先私募基金2号基金合同》，张某出资认购了该基金份额。2020年2月，张某向上海国际仲裁中心提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期未兑付，是钜澎公司存在虚假宣传、违反投资者适当性、未进行信息披露等违约行为造成的，国信证券对上述行为未尽监督义务，张某要求解除合同及钜澎公司、国信证券返还本金、利息等合计1,602万元。案件已于2020年7月21日开庭，目前尚未裁决。

18. 公司与何某股票质押式回购交易纠纷案

杭州联络互动信息科技股份有限公司实际控制人何某以其持有的2.86亿股联络互动（证券代码：002280）质押给公司，合计融资8.8亿元。因何某未能按期偿还本息，其质押的联络互动股票价格已跌破平仓线，已构成多重违约。公司于2020年6月30日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求何某偿还本金、利息、违约金等合计9.5亿元，并向湖南省汝城县人民法院提出仲裁财产保全申请。目前，何某名下的财产已被采取保全措施，案件尚未开庭。

九、媒体质疑情况

报告期内，公司无媒体普遍质疑事项。

十、处罚及整改情况

1. 2020年6月2日，北京证监局作出《关于对国信证券股份有限公司北京分公司采取出具警示函监管措

施的决定》（[2020]100号）。因公司北京分公司在对投资者进行回访的过程中，未审慎履职了解投资者信息及情况，未向投资者充分揭示风险，存在未全面落实投资者适当性管理义务的情况，北京证监局决定对北京分公司采取出具警示函的行政监管措施。

整改措施：一是进一步梳理公司账户实名制管理相关工作流程，在回访中增加风险揭示和账户实名制管理内容；二是强化投资者适当性管理和账户实名制工作的培训和宣导，进一步规范服务营销工作。

2. 2020年6月11日，上海证监局作出《关于对国信证券有限责任公司上海分公司采取出具警示函措施的决定》（沪证监决[2020]第125号）。因公司上海分公司自2019年11月19日起，未按规定为上海张杨路证券营业部配备专职合规管理人员，上海证监局决定对上海分公司采取出具警示函的行政监管措施。

整改措施：公司已及时完善合规工作机制，按规定配备专职合规管理人员，做好营业网点专职合规管理人员履职保障。

十一、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

报告期内，公司及控股股东、实际控制人不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十二、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

报告期内，公司无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

十三、重大关联交易

报告期内，公司未发生重大关联交易。公司发生的与日常经营相关的主要关联交易情况如下：

（一）与日常经营相关的关联交易

单位：万元

关联交易方	关联交易内容	2020 年预计的关联交易金额	2020 年 1-6 月实际发生的交易金额	占同类交易额的比例
安信证券股份有限公司	自营交易发生额	以实际发生数计算	11,152,222.87	2.11%
	本公司分销买入该公司承销的债券	以实际发生数计算	27,000.00	0.38%
	分销本公司承销的债券	以实际发生数计算	5,000.00	0.07%
国泰君安证券股份有限公司	自营交易发生额	以实际发生数计算	8,589,702.94	1.63%
	分销本公司承销的债券	以实际发生数计算	16,000.00	0.22%
	本公司分销关联方承销的债券	以实际发生数计算	4,000.00	0.06%
	本公司认购该公司承销的债券	以实际发生数计算	41,035.00	0.57%
南方基金管理有限公司	自营交易发生额	以实际发生数计算	1,999,620.10	0.38%
	持有其发行的基金产品	以实际发生数计算	123,565.31	14.26%
	分销本公司承销的债券	以实际发生数计算	34,000.00	0.47%
	认购本公司承销的资产管理计划	以实际发生数计算	3,000.00	0.98%

	代销金融产品收入	以实际发生数计算	1,979.98	8.23%
	持有其发行的基金产品收到的投资收益	以实际发生数计算	1,301.10	0.55%
红塔证券股份有限公司	自营交易发生额	以实际发生数计算	482,945.97	0.09%
	分销本公司承销的债券	以实际发生数计算	51,500.00	0.72%
鹏华基金	持有其发行的基金产品	以实际发生数计算	85,627.02	9.88%
	代销金融产品收入	以实际发生数计算	4,601.96	19.13%
	席位佣金收入	以实际发生数计算	2,066.21	13.59%
	持有其发行的基金产品收到的投资收益	以实际发生数计算	1,502.14	0.63%
华润信托	分销本公司承销的债券	以实际发生数计算	21,000.00	0.29%
	自营交易发生额	以实际发生数计算	18,334.93	0.003%
	持有其发行的信托产品	以实际发生数计算	1,648.89	8.31%
	证券代理买卖交易佣金收入	以实际发生数计算	1,057.48	0.38%
云南红塔银行股份有限公司	自营交易发生额	以实际发生数计算	5,110.01	0.001%
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	基金资产管理服务收入	以实际发生数计算	1,724.43	35.79%
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	基金资产管理服务收入	以实际发生数计算	1,297.14	26.92%
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有限合伙)	基金资产管理服务收入	以实际发生数计算	1,125.89	23.37%

上表所列为报告期内公司发生的主要关联交易，完整的关联交易情况详见公司2020年半年度财务报表附注“十一、关联方及关联交易”。

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

报告期内，公司未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

(三) 共同对外投资的关联交易

报告期内，公司未发生共同对外投资的关联交易。

(四) 关联债权债务往来

报告期内，公司与关联方不存在非经营性债权债务往来。

(五) 其他重大关联交易

报告期内，公司无其他重大关联交易。

十四、控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

报告期内，公司不存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金的情况。

十五、重大合同及其履行情况

（一）托管、承包、租赁事项情况

报告期内，公司不存在重大托管、承包、租赁的情况。

（二）重大担保

1. 担保情况

单位：万港元

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）								
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期（协议签署日）	实际担保金额	担保类型	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
无	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
公司与子公司之间担保情况								
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期（协议签署日）	实际担保金额	担保类型	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
无	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
子公司对子公司的担保情况								
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期（协议签署日）	实际担保金额	担保类型	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
国信证券（香港）经纪有限公司	2020年3月20日	25,000	2015年3月23日、2017年7月10日	3,500	一般保证	自协议签署之日起，至被担保人履行完毕责任为止。	否	否
国信证券（香港）金融产品有限公司	2020年3月20日	20,000	2015年3月23日、2015年6月30日、2017年7月10日、2018年8月2日、2018年7月28日、2019年4月23日	16,500	一般保证	自协议签署之日起，至被担保人履行完毕责任为止。	否	否
报告期内审批对子公司担保额度合计			45,000	报告期内对子公司担保实际发生额合计				-
报告期末已审批的对子公司担保额度合计			45,000	报告期末对子公司实际担保余额合计				20,000
公司担保总额								
报告期内审批担保额度合计			45,000	报告期内担保实际发生额合计				-
报告期末已审批的担保额度合计			45,000	报告期末实际担保余额合计				20,000
实际担保总额占公司净资产的比例				0.35%				
其中：								
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（1）				-				
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（2）				20,000				
担保总额超过净资产50%部分的金额（3）				-				

上述三项担保金额合计（1+2+3）	20,000
对未到期担保，报告期内已发生担保责任或可能承担连带清偿责任的情况说明	不适用
违反规定程序对外提供担保的说明	不适用

公司不存在采用复合方式担保的情况。

2. 违规对外担保情况

报告期内，公司不存在违规对外担保情况。

（三）委托理财

不适用。

（四）其他重大合同

报告期内，公司不存在其他重大合同。

十六、社会责任情况

（一）重大环保问题情况

公司及子公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位。

（二）履行精准扶贫及其他社会责任情况

1. 精准扶贫规划

根据党中央、省委省政府、市委市政府和证券监管机构的部署和要求，秉持“专业协作，多点推进，平衡发展，构建和谐”的社会责任理念，2020年，公司继续按照“精准扶贫”与“多元帮扶”双渠道、共提升的工作思路制定精准扶贫规划，切实做好扶贫开发工作，为确保完成各项目标任务，全面打赢脱贫攻坚战，进一步推动公司与贫困地区产业共建设，促进社会民生和经济同发展作出积极贡献。

2. 半年度履行精准扶贫及其他社会责任情况

党的十九大报告明确指出：“要动员全党全国全社会力量，坚持精准扶贫、精准脱贫。”公司始终以习近平总书记扶贫开发重要战略思想为指导，积极响应党中央号召，牢固树立“四个意识”，强化责任担当，把打赢脱贫攻坚战作为崇高的政治责任，主动承担起国有金融企业与上市公司的双重社会责任。

2020年上半年，公司立足行业特点，发挥行业优势，扎实推进精准扶贫各项工作有序开展。报告期内，公司共开展对口帮扶及其他公益慈善项目14项，支出合计人民币1,938.27万元，其中，驰援疫情支出1,829.87万元，民生帮扶支出90万元，教育帮扶支出1.2万元，其他捐赠支出17.2万元。

（1）积极响应扶贫号召，有效助力贫困县村脱贫

截至2020年6月30日，公司共与新疆麦盖提县、塔什库尔干县、英吉沙县，贵州三都水族自治县、织金县、道真县，云南省龙陵县及内蒙古兴和县共8个国家级贫困县签订了结对帮扶协议；响应深圳市委、市政府号召，结对帮扶广东省级贫困村河源市龙川县山池村。公司结对帮扶的9个贫困县、村中，除新疆英吉沙县以外，均已经政府批准退出贫困县、村序列。

（2）发挥资本市场中介机构职能，创新金融扶贫模式

公司充分利用行业优势及专业能力，为贫困地区企业客户提供IPO、非公开发行等股权融资服务，协助客户发行各类债务融资工具筹集资金，发展特色优势产业；助力地方政府规范举债融资行为，有效促进地方经济发展。截至2020年6月末，公司正在服务的贫困地区拟上市企业IPO项目共7个，服务的贫困县区覆盖江西、西藏、云南、贵州、重庆5个省市自治区；2020年上半年，公司自有资金认购云南、江西、河北等贫困县区较多省份的地方债券共4.17亿元。

（3）持续深耕教育帮扶事业，着力阻断贫困代际传递

公司一贯重视教育帮扶工作，按照“扶贫先扶智”的总体思路，发挥教育帮扶在精准扶贫工作中的基础性、先导性、根本性作用，加强对贫困县、村的教育投入。2020年上半年，公司继续推进员工志愿者支教项目的落地实施，6名优秀员工志愿者赴新疆麦盖提县开展支教活动，有力推动了当地教学水平的提升，在行业内外引起强烈反响。

（4）多元模式开展帮扶，有力保障社会民生

2020年上半年，公司继续从敬老、济困、产业帮扶、医疗设施建设等多方面开展公益慈善活动：公司向结对帮扶的内蒙古兴和县捐赠90万元，用于当地乡镇卫生院医疗设备配置及基层医疗卫生技术人员能力提升培训；广州分公司向乐昌市乐城街道下西村捐赠春节慰问物资5万元，将温暖与爱心传递到困难群众家中；天津分公司向甘肃省平凉市庄浪县、崆峒区和甘南州卓尼县捐款2万元，助力东西部扶贫协作；国信期货向江西省萍乡市捐赠扶贫资金10万元，助力当地贫困地区开展“油茶树种植与加工”“扶贫车间建设”“茶叶种植与加工”“敬老院改造提升”等项目。

（5）多方驰援疫情防控工作，展现国企责任担当

2020年初，新冠肺炎疫情来袭，公司密切关注疫情进展，捐财物、免租金、派出员工支援深圳社区防疫一线，以多种方式全力驰援疫情防控工作。公司积极向湖北武汉捐赠1,200万元，用于定向援助武汉9家抗击新冠肺炎的重点医院及武汉市江岸区慈善会；向深圳市慈善会“深圳市属国资国企驰援湖北专项资金”和深圳市罗湖区慈善会分别捐赠人民币500万元和100万元；向内蒙古兴和县捐赠酒精消毒液、防护服、额温枪等防疫物资折合人民币9.37万元；筹集10万只医用口罩火速驰援新疆麦盖提县，有效缓解当地师生防疫资源不足的难题等。此外，公司积极为疫情防控部署提供专业服务，全力保障防疫关键时期融资人的资金需求。报告期内，公司协助发行多只疫情防控债，涉及企业类型多、受惠区域广、发行规模大、利率屡创新低。

3. 履行精准扶贫及社会责任成效

单位：万元

指标	数量/开展情况
一、总体情况	
其中：1. 资金	1,905.40
2. 物资折款	32.87
3. 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	417
二、分项投入	
1. 转移就业脱贫	
其中：1.1 职业技能培训投入金额（注1）	20.00
2. 教育脱贫	
其中：2.1 资助贫困学生投入金额	1.20
2.2 资助贫困学生人数（人）	2
3. 健康扶贫	
其中：3.1 贫困地区医疗卫生资源投入金额（注2）	70.00
4. 其他项目（注3）	
其中：4.1 项目个数	12
4.2 投入金额	1,847.07

注：1. 职业技能培训投入指的是为内蒙古兴和县提供基层医疗卫生技术人员能力提升培训投入金额；

2. 为贫困地区医疗卫生资源投入是为内蒙古兴和县乡镇卫生院配备医疗设备投入金额；

3. 其他项目主要包括捐赠儿童及老年用品、驰援疫情防控捐赠等。

4. 后续精准扶贫计划

公司将继续认真贯彻落实好党中央关于扶贫开发工作的部署和要求，按照制定的精准扶贫规划，在持续做好公益帮扶工作的同时，重点协助未脱贫县做好脱贫摘帽工作，同时有效防止脱贫地区返贫。作为资本市场的建设者和国民经济发展的参与者、推动者，公司将继续认真落实习近平总书记扶贫开发战略思想，准确把握新形势下脱贫攻坚的新任务、新要求，以资本市场服务产业扶贫为重点，不断完善扶贫机制，做到资金使用精准、项目安排精准、措施到户精准、脱贫成效精准，激发贫困地区自我发展能力，全面助力脱贫攻坚战略。

十七、各单项业务资格的变化情况

序号	资格获取时间	业务资格	批准机构
1	2020年4月8日	债券通报价机构	中国外汇交易中心

十八、其他重大事项的说明

（一）公司非公开发行 A 股股票事项的相关情况

2019年8月28日，公司收到中国证监会出具的《关于核准国信证券股份有限公司非公开发行股票的批

复》（证监许可[2019]1447号），核准公司非公开发行不超过164,000万股新股。

2020年2月14日，中国证监会发布了修订后的《上市公司证券发行管理办法》《创业板上市公司证券发行管理办法》《上市公司非公开发行股票实施细则》。公司根据相关规定调整发行方案并办理申请换发批文等事项，2020年4月22日收到中国证监会出具的《关于核准国信证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2020]471号）。该批复核准公司非公开发行不超过164,000万股新股，自核准发行之日（2020年3月24日）起12个月内有效。

2020年8月，公司完成非公开发行A股股票相关发行及上市工作。公司向深投控、云南合和、华润信托、全国社会保障基金理事会、中国华融资产管理股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、万和证券股份有限公司、厦门国贸资产运营集团有限公司、东海证券股份有限公司10名特定投资者非公开发行A股股票1,412,429,377股，每股发行价格10.62元，募集资金总额人民币14,999,999,983.74元，扣除发行费用人民币218,442,768.95元（不含增值税）后，募集资金净额人民币14,781,557,214.79元。其中：计入股本人民币1,412,429,377.00元，计入资本公积（股本溢价）人民币13,369,127,837.79元。上述新增股份的登记托管及限售手续于2020年8月10日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完成，新股于2020年8月14日上市。

上述事项公告的具体内容详见公司于2019年8月29日、2020年4月25日及2020年8月13日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的相关信息。

（二）发行永续次级债的情况

根据中国证监会出具的《关于国信证券股份有限公司非公开发行永续次级债券有关意见的复函》（机构部函[2020]1372号），中国证监会对公司非公开发行永续次级债券无异议。2020年7月13日，公司非公开发行2020年永续次级债券（第一期）发行结束，实际发行规模50亿元人民币，票面利率4.50%，在债券存续的前5个计息年度内保持不变，若发行人不行使赎回权，自第6个计息年度起，每5年重置一次票面利率。

（三）证券营业网点的变更情况

截至报告期末，公司共设有54家证券分公司，163家证券营业部，分布于全国119个中心城市地区。报告期内，公司证券营业网点的变更情况如下：

序号	变更类型	变更后	变更前
1	迁址	宜昌沿江大道证券营业部 地址：宜昌市伍家岗区沿江大道182号1、11楼	宜昌沿江大道证券营业部 地址：湖北省宜昌市伍家岗区沿江大道189号-1号
2		武汉中北路证券营业部 地址：武汉市武昌区中北路9号长城汇T1号写字楼第9层R3、R5单元	武汉中北路证券营业部 地址：湖北省武汉市武昌区中北路54号宏城金都C座四层
3		南通跃龙路证券营业部 地址：南通市崇川区跃龙路80号瑞富大厦1楼01室和02室	南通跃龙路证券营业部 地址：江苏省南通市崇川区跃龙路100号经典大厦12楼
4	迁址并更名	潮州潮州大道证券营业部 地址：潮州市潮州大道北段恒发花园沿街门市22-29号第三层	潮州枫春路证券营业部 地址：广东省潮州市枫春路枫荫亭新风大厦西侧七层3号办公楼（704-705单元）

5		绵阳临园路证券营业部 地址:绵阳市涪城区临园路中段99号中大财富广场1幢1单元20层、21层	绵阳兴达街证券营业部 地址:绵阳市涪城区兴达街11号
6		嘉兴由拳路证券营业部 地址:浙江省嘉兴市经济技术开发区由拳路203号	嘉兴中山西路证券营业部 地址:嘉兴市中山西路126号
7		深圳科苑南路证券营业部 地址:深圳市南山区粤海街道深大社区深南大道9819号地铁金融科技大厦8F02-04单元	深圳高新南九道证券营业部 地址:深圳市南山区粤海街道高新南九道深圳软件产业基地1A栋A座14F/14M/14N
8		乐山春华路证券营业部 地址:乐山市市中区春华路西段784号2楼	乐山嘉定中路证券营业部 地址:乐山市市中区嘉定中路570号嘉州国际商业中心大厦19楼
9		哈尔滨南极街证券营业部 地址:哈尔滨市道外区荣耀上城F栋1-2层F5、F6号	哈尔滨田地街证券营业部 地址:哈尔滨市道里区田地街副24-6-1号
10	更名	绍兴分公司	绍兴解放大道证券营业部

十九、公司子公司重大事项

(一) 国信弘盛

2020年4月20日,经深圳市市场监督管理局核准,子公司国信弘盛创业投资有限公司更名为“国信弘盛私募基金管理有限公司”,相关工商变更登记手续已完成,并取得了新的营业执照。

(二) 国信期货

报告期内,子公司国信期货新设河南分公司并于2020年5月21日取得《经营证券期货业务许可证》。国信期货河南分公司位于河南自贸试验区郑州片区(郑东)商务外环路30号期货大厦1203。

第六节 股份变动及股东情况

一、股份变动情况

报告期内，公司股份未发生变动，具体如下：

单位：股

项目	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例
一、有限售条件股份	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 国家持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 国有法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 其他内资持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
二、无限售条件股份	8,200,000,000	100.00%	-	-	-	-	-	8,200,000,000	100.00%
1. 人民币普通股	8,200,000,000	100.00%	-	-	-	-	-	8,200,000,000	100.00%
2. 境内上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 境外上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
三、股份总数	8,200,000,000	100.00%	-	-	-	-	-	8,200,000,000	100.00%

二、证券发行与上市情况

报告期内，公司未发行股票及其衍生品。公司发行债券和其他债务融资工具的相关情况详见本报告“第十节 公司债券相关情况”。

公司于2020年8月完成非公开发行A股股票相关发行及上市工作，本次非公开发行新增股份1,412,429,377股已于2020年8月14日在深圳证券交易所上市。详见公司于2020年8月13日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的相关信息。

三、公司股东数量及持股情况

报告期末普通股股东总数	108,880 户		报告期末表决权恢复的优先股股东总数	不适用				
前 10 名普通股股东持股情况								
股东名称	股东性质	持股比例	报告期末持有的普通股数量	报告期内增减变动情况	持有有限售条件的普通股数量	持有无限售条件的普通股数量	质押或冻结情况	
深圳市投资控股有限公司	国有法人	33.53%	2,749,526,814	-	-	2,749,526,814	无	
华润深国投信托有限公司	国有法人	25.15%	2,062,145,110	-	-	2,062,145,110	无	

云南合和(集团)股份有限公司	国有法人	16.77%	1,374,763,407	-	-	1,374,763,407	无
北京城建投资发展股份有限公司	境内非国有法人	4.18%	343,000,000	-	-	343,000,000	无
一汽股权投资(天津)有限公司	国有法人	3.28%	268,571,919	-	-	268,571,919	无
中国证券金融股份有限公司	国有法人	0.92%	75,086,423	-	-	75,086,423	无
香港中央结算有限公司	境外法人	0.63%	51,493,114	-2,271,091	-	51,493,114	无
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	0.60%	49,477,100	-	-	49,477,100	无
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	其他	0.43%	34,878,846	9,375,142	-	34,878,846	无
工银瑞信基金-农业银行-工银瑞信中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
南方基金-农业银行-南方中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
中欧基金-农业银行-中欧中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
博时基金-农业银行-博时中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
大成基金-农业银行-大成中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
嘉实基金-农业银行-嘉实中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
广发基金-农业银行-广发中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
华夏基金-农业银行-华夏中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
银华基金-农业银行-银华中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
易方达基金-农业银行-易方达中证金融资产管理计划	其他	0.34%	27,792,800	-	-	27,792,800	无
战略投资者或一般法人因配售新股成为前10名普通股股东的情况	无。						
上述股东关联关系或一致行动的说明	公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49%的股权。因此,深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外,公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。						
前 10 名无限售条件普通股股东持股情况							
股东名称	报告期末持有无限售条件普通股股份数量	股份种类					
		股份种类	数量				
深圳市投资控股有限公司	2,749,526,814	人民币普通股	2,749,526,814				

华润深国投信托有限公司	2,062,145,110	人民币普通股	2,062,145,110
云南合和(集团)股份有限公司	1,374,763,407	人民币普通股	1,374,763,407
北京城建投资发展股份有限公司	343,000,000	人民币普通股	343,000,000
一汽股权投资(天津)有限公司	268,571,919	人民币普通股	268,571,919
中国证券金融股份有限公司	75,086,423	人民币普通股	75,086,423
香港中央结算有限公司	51,493,114	人民币普通股	51,493,114
中央汇金资产管理有限责任公司	49,477,100	人民币普通股	49,477,100
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	34,878,846	人民币普通股	34,878,846
工银瑞信基金—农业银行—工银瑞信中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
南方基金—农业银行—南方中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
博时基金—农业银行—博时中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
大成基金—农业银行—大成中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
嘉实基金—农业银行—嘉实中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
广发基金—农业银行—广发中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
华夏基金—农业银行—华夏中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
银华基金—农业银行—银华中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
易方达基金—农业银行—易方达中证金融资产管理计划	27,792,800	人民币普通股	27,792,800
前 10 名无限售条件普通股股东之间,以及前 10 名无限售条件普通股股东和前 10 名普通股股东之间关联关系或一致行动的说明	公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49%的股权。因此,深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外,公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。		
前 10 名普通股股东参与融资融券业务股东情况说明	公司前 10 名普通股股东未参与融资融券业务。		

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

四、控股股东或实际控制人变更情况

报告期内,公司控股股东及实际控制人均未发生变更。

第七节 优先股相关情况

公司未发行优先股。

第八节 可转换公司债券相关情况

公司未发行可转换公司债券。

第九节 董事、监事、高级管理人员情况

一、董事、监事和高级管理人员持股变动

公司董事、监事和高级管理人员未持有公司股份。

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

姓名	担任的职务	类型	日期	原因
邓舸	总裁	聘任	2020年5月14日	经公司第四届董事会第二十六次会议审议通过，聘任邓舸先生担任公司总裁。
	董事	选举	2020年6月15日	经公司2020年第三次临时股东大会审议通过，选举邓舸先生为公司第四届董事会董事。
岳克胜	原总裁	离任	2020年5月14日	年龄原因。
李新建	原董事	离任	2020年5月20日	个人原因。

第十节 公司债券相关情况

一、公司债券基本信息

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	到期日	债券余额 (亿元)	利率	还本付息方式
国信证券股份有限公司 2017 年面向合格投资者公 开发行公司债券（第一期）	17 国信 01	112516	2017 年 4 月 14 日	2020 年 4 月 14 日	50	4.39%	已按时兑付本 金及利息。
国信证券股份有限公司 2017 年面向合格投资者公 开发行公司债券（第二期）	17 国信 02	112544	2017 年 7 月 13 日	2020 年 7 月 13 日	60	4.58%	已按时兑付本 金及利息。
国信证券股份有限公司 2017 年面向合格投资者公 开发行公司债券（第三期）	17 国信 03	112595	2017 年 10 月 18 日	2020 年 10 月 18 日	30	4.80%	采用单利按年 计息，不计复 利。每年付息一 次，最后一期利 息随本金的兑 付一起支付。
国信证券股份有限公司 2018 年面向合格投资者公 开发行公司债券（第一期）	18 国信 03	112740	2018 年 8 月 8 日	2021 年 8 月 8 日	37	3.97%	采用单利按年 计息，不计复 利。每年付息一 次，最后一期利 息随本金的兑 付一起支付。
公司债券上市或转让的交易场所	深圳证券交易所						
投资者适当性安排	本期债券面向拥有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的合格 A 股证券 账户的合格投资者（法律、法规禁止购买者除外）公开发行。						
截至本报告披露日，公司债券的付息兑 付情况	2020 年 4 月 14 日，兑付 17 国信 01 债券本金及利息； 2020 年 7 月 13 日，兑付 17 国信 02 债券本金及利息； 2020 年 8 月 10 日，兑付 18 国信 03 债券利息。						
公司债券附发行人或投资者选择权条 款、可交换条款等特殊条款的，报告期 内相关条款的执行情况	不适用。						

二、债券受托管理人和资信评级机构信息

债券受托管理人：							
名称	广发证券股份 有限公司	办公地址	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 43 楼	联系人	祝磊、王丽欣	联系人电话	020-66338681 020-66338681
报告期内对公司债券进行跟踪评级的资信评级机构：							
名称	中诚信国际信用评级有限责任公司			办公地址	上海市黄浦区西藏南路 760 号安基大厦 24 楼		
报告期内公司聘请的债券受托管理人、 资信评级机构发生变更的，变更的原因、 履行的程序、对投资者利益的影响等	不适用。						

三、公司债券募集资金使用情况

(一) 公开发行的公司债券募集资金使用情况

公司债券募集资金使用情况及履行的程序	公司债券的募集资金扣除发行费用后,已全部用于补充公司营运资金和偿还到期债务。
期末余额(万元)	135.90
募集资金专项账户运作情况	上述公司债券发行时,公司依照募集说明书的相关约定,指定专项账户归集募集资金;至报告期末,募集资金已依照募集说明书中的资金运用计划,全部用于补充公司运营资金和偿还到期债务。
募集资金使用是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致	募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

(二) 非公开发行的公司债券募集资金使用情况

截至报告期末,公司未到期的非公开发行的公司债券(含证券公司短期公司债券和次级债券)共计人民币200亿元,其中以前年度发行的债券为人民币120亿元,均按照募集说明书的募集资金约定用途使用,期末余额1.68亿元。

四、公司债券信息评级情况

根据中诚信国际信用评级有限责任公司2017年6月15日出具的《国信证券股份有限公司2017年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)跟踪评级报告(2017)》、2017年7月3日出具的《国信证券股份有限公司2017年面向合格投资者公开发行公司债券(第二期)信用评级报告》、2017年9月11日出具的《国信证券股份有限公司2017年面向合格投资者公开发行公司债券(第三期)信用评级报告》、2018年7月23日出具的《国信证券股份有限公司2018年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)信用评级报告》,国信证券股份有限公司2017年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期、第二期、第三期)、国信证券股份有限公司2018年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)信用等级为AAA,公司主体信用等级为AAA,评级展望为稳定。

根据中诚信国际信用评级有限责任公司2020年5月19日出具的国信证券股份有限公司2017年、2018年面向合格投资者公开发行公司债券跟踪评级报告(2020),维持公司主体信用等级为AAA,评级展望为稳定;维持“17国信02”“17国信03”和“18国信03”的信用等级为AAA。

五、公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施

报告期内,公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。

17国信01、17国信02、17国信03、18国信03不设担保等增信机制。公司债券的偿债资金将主要来源于公司日常经营所产生的收入及利润。2017年度、2018年度和2019年度,公司合并财务报表营业收入分别为119.24亿元、100.31亿元和140.93亿元,实现归属于母公司的净利润分别为45.75亿元、34.23亿元和49.10亿元。良好的收入规模和盈利积累,是公司按期偿本付息的有力保障。

公司经营稳健，信用记录良好，各项风险监管指标均满足相关要求，外部融资渠道畅通。截至报告期末，公司获得的外部授信规模超过人民币1,900亿元，一旦债券兑付时突发资金周转困难，公司可使用多种融资方式予以化解。同时，为了充分、有效地维护债券持有人的利益，公司形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施，包括制定《债券持有人会议规则》、设立专门的偿付工作小组、制定并严格执行资金管理计划、充分发挥债券受托管理人的作用和严格履行信息披露义务等。

六、报告期内债券持有人会议的召开情况

报告期内，未召开债券持有人会议。

七、报告期内债券受托管理人履行职责的情况

广发证券股份有限公司作为公司面向合格投资者公开发行2017年公司债券（第一期、第二期、第三期）及公开发行2018年公司债券（第一期）的受托管理人，对公司履行募集说明书及协议约定义务的情况进行持续跟踪和监督，持续关注公司的资信状况、内外部增信机制及偿债保障措施的实施情况，对公司专项账户募集资金的接收、存储、划转与本息偿付进行监督。截至本报告出具日，受托管理人除同时担任本期债券的主承销商和受托管理人之外，不存在其他可能影响其尽职履责的利益冲突情形。

广发证券股份有限公司2020年5月27日出具的《2019年公司债券受托管理事务报告》已在深交所网站（<http://www.szse.cn>）披露，提请投资者关注。

八、截至报告期末和上年末（或报告期和上年相同期间）公司的主要会计数据和财务指标

项目	本报告期末	上年末	本报告期末比上年末增减
流动比率	171.71%	195.63%	下降 23.92 个百分点
资产负债率	73.30%	68.41%	上升 4.89 个百分点
速动比率	171.71%	195.63%	下降 23.92 个百分点
项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
EBITDA 利息保障倍数	3.14	2.57	22.18%
贷款偿还率	100.00%	100.00%	-
利息偿付率	100.00%	100.00%	-

九、公司逾期未偿还债项

公司不存在逾期未偿还债项。截至报告期末的资产权利受限情况，详见公司2020年半年度财务报表附注“五、合并财务报表项目注释”之“（四）其他 1. 所有权或使用权受到限制的资产”。

十、报告期内对其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

1. 短期融资券

债券简称	起息日	到期日	发行规模（亿元）	利率	付息兑付情况
19国信证券CP009	2019年10月30日	2020年1月22日	30	3.00%	已按时兑付本金及利息
19国信证券CP010	2019年11月13日	2020年2月11日	25	3.10%	已按时兑付本金及利息
19国信证券CP011	2019年11月27日	2020年2月25日	25	3.07%	已按时兑付本金及利息
19国信证券CP012	2019年12月11日	2020年3月10日	30	3.05%	已按时兑付本金及利息
19国信证券CP013	2019年12月23日	2020年3月20日	30	3.03%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP001	2020年1月22日	2020年4月21日	40	2.80%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP002	2020年2月19日	2020年5月19日	40	2.52%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP003	2020年3月9日	2020年6月5日	30	2.28%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP004	2020年3月23日	2020年6月19日	30	2.03%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP005	2020年4月14日	2020年7月14日	30	1.50%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP006	2020年4月23日	2020年7月22日	35	1.38%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP007	2020年5月15日	2020年8月13日	40	1.55%	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP008	2020年6月9日	2020年9月4日	40	2.20%	未到付息日
20国信证券CP009	2020年6月15日	2020年9月11日	30	2.25%	未到付息日

2. 证券公司次级债券

债券简称	起息日	到期日	发行规模（亿元）	利率	付息兑付情况
18国信C1	2018年5月23日	2020年5月23日	11	5.29%	已按时兑付本金及利息

3. 非公开发行公司债券

债券简称	起息日	到期日	发行规模（亿元）	利率	付息兑付情况
18国信01	2018年1月17日	2020年1月17日	23	5.55%	已按时兑付本金及利息
18国信04	2018年11月19日	2021年11月19日	30	4.15%	未到付息日
19国信01	2019年3月11日	2022年3月11日	15	4.05%	已按时兑付利息
19国信02	2019年4月8日	2022年4月8日	35	4.00%	已按时兑付利息
19国信03	2019年7月4日	2022年7月4日	40	4.00%	已按时兑付利息
20国信01	2020年1月13日	2023年1月13日	30	3.60%	未到付息日
20国信02	2020年3月2日	2023年3月2日	50	3.17%	未到付息日

4. 永续次级债券

债券简称	起息日	期限	发行规模（亿元）	利率	付息兑付情况
15国信Y1	2015年6月25日	5+N	50	5.80%	已行使赎回选择权，并于2020年6月29日全额兑付本金及最后一期利息。

5. 收益凭证

报告期内，公司累计发行232期收益凭证，募集资金181.88亿元，均按时兑付本金及利息。收益凭证期

末存量规模为207.8亿元。

十一、报告期内获得的银行授信情况、使用情况以及偿还银行贷款的情况

公司规范经营，信誉良好，具备较强的盈利能力和偿付能力，具有良好的信用记录，与各大商业银行保持良好的合作关系。报告期内，公司获得多家商业银行的授信额度，能够满足公司日常运营和业务开展的资金需求。

报告期末，公司无未清偿银行贷款。公司系银行间市场成员，报告期内按时偿付信用拆借本息，报告期末银行拆入资金余额为0。

十二、报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

报告期内，公司对募集说明书相关约定或承诺的执行情况良好，不存在违反约定或承诺的情况。

十三、报告期内发生的重大事项

报告期内，公司未发生《公司债券发行与交易管理办法》第四十五条列示的重大事项。

十四、公司债券是否存在保证人

公司债券不存在保证人。

第十一节 财务报告

一、审计报告

公司2020年半年度财务报告未经审计。

二、财务报表

公司2020年半年度财务报表及附注附后。

第十二节 证券公司信息披露

一、公司重大行政许可事项的相关情况

序号	批复日期	批复文件	文号
1	2020 年 2 月 20 日	深圳证监局关于核准国信证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复	深证局许可字[2020]7 号
2	2020 年 3 月 24 日	中国证监会关于核准国信证券股份有限公司非公开发行股票的批复	证监许可[2020]471 号

二、监管部门对公司的分类结果

根据中国证监会《证券公司分类监管规定》，公司近三年分类评价情况为：

	2019 年	2018 年	2017 年
分类评价	AA	A	A

第十三节 备查文件目录

- (一) 载有公司法定代表人签名的半年度报告文本。
- (二) 载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名盖章的财务报告文本。
- (三) 报告期内中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。
- (四) 其他有关资料。

国信证券股份有限公司

法定代表人:



董事会批准报送日期：2020年8月24日

目 录

一、 审阅报告	第 1 页
二、 财务报表	第 2—11 页
(一) 合并资产负债表.....	第 2 页
(二) 母公司资产负债表.....	第 3 页
(三) 合并利润表.....	第 4 页
(四) 母公司利润表.....	第 5 页
(五) 合并现金流量表.....	第 6 页
(六) 母公司现金流量表.....	第 7 页
(七) 合并所有者权益变动表.....	第 8—9 页
(八) 母公司所有者权益变动表.....	第 10—11 页
三、 财务报表附注	第 12—130 页

审 阅 报 告

天健审〔2020〕7-782号

国信证券股份有限公司全体股东：

我们审阅了后附的国信证券股份有限公司（以下简称国信证券公司）2020年1-6月财务报表，包括2020年6月30日的合并及母公司资产负债表，2020年1-6月的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表，以及财务报表附注。这些财务报表的编制是国信证券公司管理层的责任，我们的责任是在实施审阅工作的基础上对这些财务报表出具审阅报告。

我们按照《中国注册会计师审阅准则第2101号——财务报表审阅》的规定执行了审阅业务。该准则要求我们计划和实施审阅工作，以对财务报表是否不存在重大错报获取有限保证。审阅主要限于询问国信证券公司有关人员和核对财务数据实施分析程序，提供的保证程度低于审计。我们没有实施审计，因而不发表审计意见。

根据我们的审阅，我们没有注意到任何事项使我们相信国信证券公司2020年1-6月财务报表没有按照企业会计准则的规定编制，未能在所有重大方面公允反映国信证券公司合并及母公司的财务状况、经营成果和现金流量。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）



中国注册会计师：



谢军

中国注册会计师：



黄燕

二〇二〇年八月二十四日

合并资产负债表

2020年6月30日

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

资产	注释号	期末数	上年年末数	负债和所有者权益	注释号	期末数	上年年末数
资产：				负债：			
货币资金	1	70,847,279,340.82	52,914,629,831.41	短期借款	20	188,405,429.61	296,320,895.36
其中：客户资金存款		59,085,054,376.56	46,342,426,655.52	应付短期融资款	21	34,714,523,712.64	18,043,322,824.10
结算备付金	2	6,808,816,537.43	6,792,949,934.99	拆入资金	22	3,038,390,654.37	5,351,588,175.87
其中：客户备付金		6,214,300,409.11	4,964,700,968.10	交易性金融负债	23	115,158,245.39	284,705,904.51
贵金属				衍生金融负债	4	194,495,393.19	71,408,981.24
拆出资金				卖出回购金融资产款	24	48,574,309,563.54	41,823,129,380.47
融出资金	3	39,489,583,162.88	37,708,047,436.61	代理买卖证券款	25	59,803,098,941.34	46,587,457,461.00
衍生金融资产	4	6,544,712.43	18,933,954.93	代理承销证券款		77,000,000.00	
存出保证金	5	4,925,533,185.04	4,374,714,699.62	应付职工薪酬	26	3,435,762,593.37	3,597,705,854.74
应收款项	6	745,912,974.58	791,157,610.45	应交税费	27	826,648,236.36	870,913,978.92
应收款项融资				应付款项	28	6,322,516,246.95	6,292,722,141.64
合同资产		14,914,731.25		合同负债		9,323,180.38	
买入返售金融资产	7	19,986,043,816.71	23,772,690,648.61	持有待售负债			
持有待售资产				预计负债	29	405,865,604.38	234,749,894.60
金融投资：				递延收益	30	131,503,448.58	133,241,379.60
交易性金融资产	8	73,181,139,296.79	62,511,569,002.17	应付债券	31	37,216,060,580.06	37,549,336,296.56
债权投资				其中：优先股			
其他债权投资	9	18,927,951,117.10	17,972,591,320.77	永续债			
其他权益工具投资	10	10,519,859,955.17	9,729,134,025.69	递延所得税负债	17	342,715,117.72	302,471,179.42
长期股权投资	11	3,527,866,530.16	3,110,575,968.49	其他负债	32	7,621,521,674.35	6,949,986,304.46
投资性房地产	12	304,535,353.53	296,386,293.49	负债合计		203,017,298,622.23	168,389,060,652.49
固定资产	13	1,089,910,723.14	1,126,583,684.09	所有者权益：			
在建工程	14	879,193,744.10	832,269,353.63	股本	33	8,200,000,000.00	8,200,000,000.00
无形资产	15	651,893,731.74	656,538,746.78	其他权益工具	34		5,000,000,000.00
其中：交易席位费		29,752,745.38	29,752,745.38	其中：优先股			
商誉	16	10,260,249.61	10,260,249.61	永续债			5,000,000,000.00
递延所得税资产	17	1,897,108,676.73	1,643,888,119.65	资本公积	35	6,769,104,587.01	6,769,233,170.81
其他资产	18	381,864,487.12	381,391,313.67	减：库存股			
				其他综合收益	36	292,723,243.49	326,029,483.28
				盈余公积	37	4,212,265,617.55	4,212,265,617.55
				一般风险准备	38	11,680,791,089.71	11,674,053,491.33
				未分配利润	39	21,005,633,013.65	20,027,506,956.75
				归属于母公司所有者权益合计		52,160,517,551.41	56,209,088,719.72
				少数股东权益		18,396,121.69	46,162,822.45
				所有者权益合计		52,178,913,673.10	56,255,251,542.17
资产总计		255,196,212,295.33	224,644,312,194.66	负债和所有者权益总计		255,196,212,295.33	224,644,312,194.66

法定代表人：



主管会计工作的负责人：

第 2 页



会计机构负责人：



母公司资产负债表

2020年6月30日

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

资产	注释号	期末数	上年年末数	负债和所有者权益	注释号	期末数	上年年末数
资产：				负债：			
货币资金		62,967,445,927.68	46,139,584,825.73	短期借款			
其中：客户资金存款		52,825,727,590.43	47,142,472,325.15	应付短期融资款		34,714,523,712.64	18,043,322,824.10
结算备付金		7,312,571,852.00	6,162,499,325.33	拆入资金		3,038,390,654.37	5,351,588,175.87
其中：客户备付金		5,482,991,396.37	4,243,819,443.86	交易性金融负债			151,366,011.48
贵金属				衍生金融负债		156,876,390.13	71,049,811.24
拆出资金				卖出回购金融资产款		47,802,440,680.64	41,823,129,380.47
融出资金		39,145,404,279.87	37,458,966,464.38	代理买卖证券款		58,450,639,817.94	45,531,853,496.89
衍生金融资产		4,334,837.43	18,588,249.93	代理承销证券款		117,000,000.00	
存出保证金		2,356,435,722.20	1,883,695,320.01	应付职工薪酬	2	3,335,546,937.65	3,503,043,239.32
应收款项		488,178,310.36	518,260,175.60	应交税费		769,492,580.21	801,209,174.67
应收款项融资				应付款项		2,362,944,480.93	828,438,785.15
合同资产		14,914,731.25		合同负债			
买入返售金融资产		19,629,041,178.24	22,752,120,227.26	持有待售负债			
持有待售资产				预计负债		405,865,604.38	234,749,894.60
金融投资：				递延收益		131,503,448.58	133,241,379.60
交易性金融资产		61,423,524,482.37	49,987,132,321.40	应付债券		37,216,060,580.06	37,549,336,296.56
债权投资				其中：优先股			
其他债权投资		18,927,951,117.10	17,972,591,320.77	永续债			
其他权益工具投资		13,295,633,317.20	12,459,173,058.52	递延所得税负债		103,417,983.01	155,631,916.17
长期股权投资	1	9,558,934,298.90	9,369,302,592.72	其他负债		275,469,842.59	276,931,962.39
投资性房地产		306,446,353.54	311,999,190.17	负债合计		188,880,172,713.13	154,454,892,348.51
固定资产		1,052,129,560.19	1,075,365,250.83	所有者权益：			
在建工程		879,193,744.10	832,269,353.63	股本		8,200,000,000.00	8,200,000,000.00
无形资产		610,233,712.63	644,945,805.27	其他权益工具			5,000,000,000.00
其中：交易席位费		29,752,745.38	29,752,745.38	其中：优先股			
商誉				永续债			5,000,000,000.00
递延所得税资产		1,656,223,457.74	1,430,147,429.93	资本公积		6,768,722,390.89	6,768,850,974.69
其他资产		322,144,340.93	304,991,107.38	减：库存股			
				其他综合收益		-161,377,515.79	-131,432,181.79
				盈余公积		4,212,265,617.55	4,212,265,617.55
				一般风险准备		11,680,791,089.71	11,674,053,491.33
				未分配利润		20,400,166,928.24	19,143,001,768.57
				所有者权益合计		51,100,568,510.60	54,866,739,670.35
资产总计		239,980,741,223.73	209,321,632,018.86	负债和所有者权益总计		239,980,741,223.73	209,321,632,018.86

法定代表人：



主管会计工作的负责人：

第 3 页



会计机构负责人：



天健会计师事务所(特殊普通合伙)
审核之章

合并利润表

2020年1-6月

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、营业总收入		8,038,599,945.76	6,533,602,124.36
手续费及佣金净收入	1	3,672,667,409.38	3,034,000,101.39
其中：经纪业务手续费净收入		2,772,770,191.18	2,275,764,335.65
投资银行业务手续费净收入		595,994,564.93	489,166,032.89
资产管理业务手续费净收入		130,165,134.95	111,799,568.22
利息净收入	2	1,661,855,951.87	799,594,191.38
其中：利息收入		3,505,949,941.89	3,077,465,183.77
利息支出		1,844,093,990.02	2,277,870,992.39
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	3	2,366,490,369.24	1,839,097,181.80
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		260,839,500.68	180,958,687.21
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			
净敞口套期收益			
其他收益	4	17,367,535.56	4,815,585.32
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5	96,236,669.03	677,169,849.62
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,290,498.41	-1,762,624.72
其他业务收入	6	225,327,094.99	180,919,516.62
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-54,585.90	-231,677.05
二、营业总支出		4,222,278,593.13	3,085,876,898.47
税金及附加	7	60,464,813.46	51,522,657.89
业务及管理费	8	2,932,130,928.87	2,550,987,060.63
信用减值损失	9	1,006,646,836.56	321,696,264.42
其他资产减值损失	10	5,893,797.90	852,368.56
其他业务成本	11	217,142,216.34	160,818,546.97
三、营业利润（亏损总额以“-”号填列）		3,816,321,352.63	3,447,725,225.89
加：营业外收入	12	16,363,311.27	24,725,823.94
减：营业外支出	13	212,510,173.36	139,892,912.46
四、利润总额（净亏损以“-”号填列）		3,620,174,520.54	3,332,558,137.37
减：所得税费用	14	673,028,186.29	733,284,626.01
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,947,146,334.25	2,599,273,511.36
（一）按经营持续性分类：			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		2,947,146,334.25	2,599,273,511.36
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. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”号填列）		2,945,533,795.86	2,597,829,436.15
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		1,612,538.39	1,444,075.21
六、其他综合收益的税后净额		-63,976,380.37	610,188,316.80
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额	15	-63,976,380.37	610,188,316.80
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-114,434,338.20	604,700,460.75
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		-114,434,338.20	604,700,460.75
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		50,457,957.83	5,487,886.05
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		11,922,584.71	8,000,050.27
2. 其他债权投资公允价值变动		-39,119,762.14	-988,072.88
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用减值准备		69,939,262.24	-3,118,698.18
5. 现金流量套期储备（现金流量套期损益的有效部分）			
6. 外币财务报表折算差额		7,715,873.02	1,594,606.84
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		2,883,169,953.88	3,209,461,858.16
归属于母公司所有者的综合收益总额		2,881,557,415.49	3,208,017,782.95
归属于少数股东的综合收益总额		1,612,538.39	1,444,075.21
八、每股收益：			
（一）基本每股收益		0.34	0.30
（二）稀释每股收益		0.34	0.30

法定代表人

主管会计工作的负责人

会计机构负责人

何如

第 4 页 共 130 页

中国周

中国周

天健会计师事务所(特殊普通合伙)
审核之章

母 公 司 利 润 表

2020年1-6月

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	注释号	本期数	上年同期数
一、营业总收入		7,586,768,769.62	6,091,968,547.05
手续费及佣金净收入	1	3,493,374,379.35	2,919,607,637.00
其中：经纪业务手续费净收入		2,656,626,928.95	2,188,455,480.57
投资银行业务手续费净收入		582,934,063.92	478,931,206.12
资产管理业务手续费净收入		125,856,585.43	109,455,518.91
利息净收入	2	1,543,303,721.71	845,111,836.80
其中：利息收入		3,303,952,273.00	2,972,935,556.33
利息支出		1,760,648,551.29	2,127,823,719.53
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	3	2,713,416,220.59	1,646,352,368.07
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		201,870,661.07	116,238,650.81
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			
净敞口套期收益			
其他收益		16,862,393.41	4,700,787.64
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4	-196,964,576.84	655,648,356.57
汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,769,237.06	177,354.91
其他业务收入		15,061,980.24	20,601,883.11
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-54,585.90	-231,677.05
二、营业总支出		3,645,357,653.11	2,594,528,660.39
税金及附加		58,161,910.92	49,286,845.54
业务及管理费	5	2,680,565,927.88	2,357,183,029.14
信用减值损失		901,076,977.68	185,954,622.70
其他资产减值损失			
其他业务成本		5,552,836.63	2,104,163.01
三、营业利润（亏损总额以“-”号填列）		3,941,411,116.51	3,497,439,886.66
加：营业外收入		6,334,051.05	16,637,934.29
减：营业外支出		208,335,801.04	139,680,189.55
四、利润总额（净亏损以“-”号填列）		3,739,409,366.52	3,374,397,631.40
减：所得税费用		523,390,686.11	708,754,823.65
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,216,018,680.41	2,665,642,807.75
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		3,216,018,680.41	2,665,642,807.75
（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		-52,061,256.36	547,555,666.24
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-71,770,385.37	537,536,231.85
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动		-71,770,385.37	537,536,231.85
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		19,709,129.01	10,019,434.39
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-11,110,371.09	14,126,205.45
2. 其他债权投资公允价值变动		-39,119,762.14	-988,072.88
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用减值准备		69,939,262.24	-3,118,698.18
5. 现金流量套期储备（现金流量套期损益的有效部分）			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		3,163,957,424.05	3,213,198,473.99

法定代表人：

主管会计工作的负责人：

会计机构负责人：



第 5 页 共 130 页




天晟会计师事务所(特殊普通合伙)
审核之章

合并现金流量表

2020年1-6月

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			
其他权益工具投资净减少额			
其他债权投资净减少额			1,968,391,857.63
收取利息、手续费及佣金的现金		7,810,887,416.39	6,812,587,816.26
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		10,209,903,981.00	10,126,292,007.43
代理承销证券收到的现金净额		77,000,000.00	
代理买卖证券收到的现金净额		13,153,602,553.90	17,509,643,056.75
收到其他与经营活动有关的现金	1	1,982,023,379.52	2,121,081,673.36
经营活动现金流入小计		33,233,417,330.81	38,537,996,411.43
为交易目的而持有的金融资产净增加额		8,503,027,553.47	1,179,058,389.51
其他债权投资净增加额		579,075,373.37	
其他权益工具投资净增加额		903,086,344.94	220,932,521.21
融出资金净增加额		1,867,248,043.05	4,775,072,447.47
拆入资金净减少额		2,300,000,000.00	3,000,000,000.00
代理买卖证券支付的现金净额			
支付利息、手续费及佣金的现金		1,333,839,072.56	1,387,682,407.66
支付给职工以及为职工支付的现金		2,497,558,584.95	2,084,941,406.28
支付的各项税费		1,170,870,590.55	1,420,055,481.61
支付其他与经营活动有关的现金	2	3,020,821,774.97	3,607,441,980.52
经营活动现金流出小计		22,175,527,337.86	17,675,184,634.26
经营活动产生的现金流量净额	3	11,057,889,992.95	20,862,811,777.17
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		155,342,939.92	98,066,086.26
取得投资收益收到的现金		1,000,000.00	15,855,098.40
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		834,069.21	1,601,694.08
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		157,177,009.13	115,522,878.74
投资支付的现金		301,000,000.00	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		211,879,468.98	193,280,215.39
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		19,247,067.16	
投资活动现金流出小计		532,126,536.14	193,280,215.39
投资活动产生的现金流量净额		-374,949,527.01	-77,757,336.65
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		2,118,110,164.19	299,850,150.00
发行债券收到的现金		57,687,968,000.00	34,225,798,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		59,806,078,164.19	34,525,648,150.00
偿还债务支付的现金		43,662,860,487.19	33,519,123,150.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,882,073,454.09	2,550,999,859.59
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		14,647.25	3,352,770.74
支付其他与筹资活动有关的现金		5,034,167,479.26	9,800,000.00
筹资活动现金流出小计		51,579,101,420.54	36,079,923,009.59
筹资活动产生的现金流量净额		8,226,976,743.65	-1,554,274,859.59
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
		9,345,791.17	-4,666,778.69
五、现金及现金等价物净增加额			
加：期初现金及现金等价物余额	3	18,919,263,000.76	19,226,112,802.24
加：期初现金及现金等价物余额	3	59,588,272,168.73	41,784,495,854.53
六、期末现金及现金等价物余额			
	3	78,507,535,169.49	61,010,608,656.77

法定代表人：

主管会计工作的负责人：

会计机构负责人：



第 6 页 共 130 页



母公司现金流量表

2020年1-6月

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			
其他权益工具投资净减少额			
其他债权投资净减少额			1,968,391,857.63
收取利息、手续费及佣金的现金		7,489,827,370.72	6,541,407,926.58
拆入资金净增加额			
回购业务资金净增加额		8,811,958,991.55	10,802,739,232.75
代理承销证券收到的现金净额		117,000,000.00	60,000,000.00
代理买卖证券收到的现金净额		12,930,766,212.23	17,666,061,547.99
收到其他与经营活动有关的现金		1,066,204,458.47	856,960,935.51
经营活动现金流入小计		30,415,757,032.97	37,895,561,500.46
为交易目的而持有的金融资产净增加额		9,911,977,022.89	1,825,458,963.46
其他债权投资净增加额		579,075,373.37	
其他权益工具投资净增加额		903,086,344.94	220,932,521.21
拆入资金净减少额		2,300,000,000.00	3,000,000,000.00
融出资金净增加额		1,789,093,513.32	4,749,069,782.51
代理买卖证券支付的现金净额			
支付利息、手续费及佣金的现金		1,281,798,301.79	1,349,362,301.86
支付给职工以及为职工支付的现金		2,355,256,673.83	1,943,391,631.62
支付的各项税费		1,066,293,345.31	1,319,576,498.94
支付其他与经营活动有关的现金		1,146,435,340.48	2,519,471,474.98
经营活动现金流出小计		21,333,015,915.93	16,927,263,174.58
经营活动产生的现金流量净额		9,082,741,117.04	20,968,298,325.88
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		61,150,941.25	38,600,800.00
取得投资收益收到的现金		731,000,000.00	165,855,098.40
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		830,857.75	1,533,241.83
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		792,981,799.00	205,989,140.23
投资支付的现金		50,000,000.00	329,934,587.75
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		201,359,866.35	182,339,618.94
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		251,359,866.35	512,274,206.69
投资活动产生的现金流量净额		541,621,932.65	-306,285,066.46
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		57,687,968,000.00	34,225,798,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		57,687,968,000.00	34,225,798,000.00
偿还债务支付的现金		41,430,611,000.00	32,867,767,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,882,058,806.84	2,535,771,501.86
支付其他与筹资活动有关的现金		5,030,188,679.26	
筹资活动现金流出小计		49,342,858,486.10	35,403,538,501.86
筹资活动产生的现金流量净额		8,345,109,513.90	-1,177,740,501.86
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
		1,773,137.06	177,354.91
五、现金及现金等价物净增加额			
		17,971,245,700.65	19,484,450,112.47
加：期初现金及现金等价物余额		52,217,966,267.18	34,972,764,789.79
六、期末现金及现金等价物余额			
		70,189,211,967.83	54,457,214,902.26

法定代表人：



主管会计工作的负责人：

第 7 页 共 30 页



会计机构负责人：



天健会计师事务所(特殊普通合伙)
审核之章

合并所有者权益变动表

2020年1-6月

单位：人民币元

项 目	归属亨尼公司所有者权益										未分配利润	少数股东权益	所有者权益合计
	股本		资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	其他权益工具		其他			
	股本	其他											
一、上年年末余额	8,200,000.00	5,000,000.00	6,769,233.17		326,029.83	4,212,265.61	11,074,053.49			20,027,506.95	46,182,822.45	56,255,351,512.17	
加：会计政策变更													
前期差错更正													
同一控制下企业合并													
其他													
二、本年年初余额	8,200,000.00	5,000,000.00	6,769,233.17		326,029.83	4,212,265.61	11,074,053.49			20,027,506.95	46,182,822.45	56,255,351,512.17	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）		-5,000,000.00	-128,583.80		-33,396,239.79		6,737,698.38			978,126,056.30	-27,766,700.76	-1,076,337,869.07	
（一）综合收益总额					-33,396,239.79		6,737,698.38			2,945,633,795.86	1,612,538.30	2,883,160,933.88	
（二）所有者投入和减少资本		-5,000,000.00									-28,478,800.00	-5,028,478,800.00	
1. 所有者投入的普通股													
2. 其他权益工具持有者投入资本		-5,000,000.00											
3. 股份支付计入所有者权益的金额													
4. 其他													
（三）利润分配													
1. 提取盈余公积							6,737,698.38			-1,026,737,598.38	-900,439.15	-1,930,000,439.15	
2. 提取一般风险准备							6,737,698.38			-8,737,598.38			
3. 对所有者（或股东）的分配										-1,640,000,000.00	-900,439.15	-1,640,900,439.15	
4. 其他										-290,000,000.00		-290,000,000.00	
（四）所有者权益内部结转						30,670,140.58				-30,670,140.58			
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						30,670,140.58				-30,670,140.58			
6. 其他													
（五）其他													
四、本期期末余额	8,200,000.00		6,640,649.37		292,723,243.49	4,212,265,617.55	11,860,791,085.71			21,009,633,013.65	18,396,121.69	52,178,913,673.10	

编制单位：国信证券股份有限公

期数

归属亨尼公司所有者权益

未分配利润

少数股东权益

所有者权益合计

股本

其他

资本公积

减：库存股

其他综合收益

盈余公积

一般风险准备

其他权益工具

其他

未分配利润

少数股东权益

所有者权益合计

股本

其他

资本公积

减：库存股

其他综合收益

盈余公积

一般风险准备

其他权益工具

其他

未分配利润

少数股东权益

所有者权益合计

股本

其他

资本公积

减：库存股

其他综合收益

盈余公积

一般风险准备

其他权益工具

其他

未分配利润

少数股东权益

所有者权益合计

股本

其他

资本公积

减：库存股

其他综合收益

盈余公积

一般风险准备

其他权益工具

其他

未分配利润

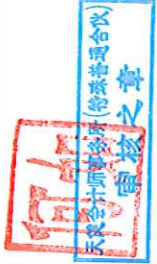
少数股东权益

所有者权益合计

法定代表人：

会计机构负责人：

第 8 页 共 130 页



合并所有者权益变动表

2020年1-6月

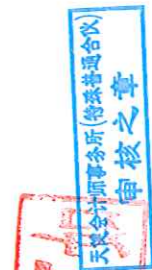
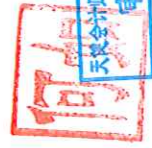
单位：人民币元

项 目	上年同期数										少数股东权益	所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益											
	股本	其他权益工具	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	库存股	其他	少数股东权益		
一、上年年末余额	8,200,000,000.00	5,150,958,904.11	6,772,425,317.32	-212,115,365.80	4,212,265,617.55	10,668,165,480.15	17,672,629,746.29				62,176,508.82	52,529,506,182.41
加：会计政策变更			-3,509,689.95	-489,049,817.09			-4,141,141.93					-496,720,628.97
前期差错更正												
同一控制下企业合并												
其他												
二、本年初余额	8,200,000,000.00	5,150,958,904.11	6,768,915,677.37	-701,105,202.89	4,212,265,617.55	10,668,165,480.15	17,668,488,598.36				62,176,508.82	52,929,786,553.47
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）		-160,958,904.11	318,232.47	887,049,241.68		28,555,558.70	1,204,122,162.65				-11,706,695.53	1,957,387,028.86
（一）综合收益总额				610,188,346.80			2,397,829,436.15				1,444,075.21	3,209,461,858.16
（二）所有者投入和减少资本											-9,800,000.00	-9,800,000.00
1. 所有者投入的普通股											-9,800,000.00	-9,800,000.00
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												
（三）利润分配												
1. 提取盈余公积		-160,958,904.11				28,555,558.70	-1,151,596,852.59				-3,352,770.74	-1,277,352,770.74
2. 提取一般风险准备						28,555,558.70	-28,555,558.70					
3. 对所有者（或股东）的分配							-984,000,000.00				-3,352,770.74	-987,352,770.74
4. 其他		-150,958,904.11					-139,041,095.89					-290,000,000.00
（四）所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
（五）其他												
四、本期末余额	8,200,000,000.00	5,000,000,000.00	6,769,233,870.84	185,884,038.79	4,212,265,617.55	10,696,721,038.85	18,872,600,761.01				50,467,813.29	53,887,173,147.33

法定代表人：

主管会计工作的负责人

会计机构负责人：



母公司所有者权益变动表

2020年1-6月

单位：人民币元

项 目	本期数							所有者权益合计	
	股本		资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备		
	股本	其他							
一、上年年末余额	8,200,000,000.00		6,768,850,974.69		-131,432,181.79	4,212,265,617.55	11,674,053,491.33	19,143,001,768.57	54,866,739,670.35
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年初余额	8,200,000,000.00		6,768,850,974.69		-131,432,181.79	4,212,265,617.55	11,674,053,491.33	19,143,001,768.57	54,866,739,670.35
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)			-128,583.80		-29,945,334.00		6,737,598.38	1,257,165,159.67	-3,766,171,158.75
(一) 综合收益总额					-52,061,256.36		3,216,018,680.41		3,163,957,424.05
(二) 所有者投入和减少资本									-5,000,000,000.00
1. 所有者投入的普通股									
2. 其他权益工具持有者投入资本					-5,000,000,000.00				-5,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额									
4. 其他									
(三) 利润分配							6,737,598.38	-1,936,737,598.38	-1,930,000,000.00
1. 提取盈余公积									
2. 提取一般风险准备							6,737,598.38	-6,737,598.38	
3. 对所有者(或股东)的分配								-1,610,000,000.00	-1,610,000,000.00
4. 其他								-290,000,000.00	-290,000,000.00
(四) 所有者权益内部结转					22,115,922.36			-22,115,922.36	
1. 资本公积转增资本(或股本)									
2. 盈余公积转增资本(或股本)									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 设定受益计划变动额结转留存收益									
5. 其他综合收益结转留存收益					22,115,922.36			-22,115,922.36	
6. 其他									
(五) 其他									-128,583.80
四、本期期末余额	8,200,000,000.00		6,768,722,390.89		-161,377,515.79	4,212,265,617.55	11,680,791,089.71	20,400,166,928.24	51,100,568,510.60

法定代表人：

主管会计工作的负责人：

会计机构负责人：



第 10 页



母公司所有者权益变动表

2020年1-6月

单位：人民币元

项 目	上 年 同 期 数										
	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
	股本	其他权益工具	其他	其他权益工具							
一、上年年末余额	8,200,000,000.00		5,150,958,904.11		6,768,913,647.37		-214,982,188.63	4,212,265,617.55	10,688,165,480.15	16,733,587,096.19	51,518,910,556.74
加：会计政策变更							-696,193,077.64			112,219,285.51	-583,973,792.13
前期差错更正											
其他											
二、本年年初余额	8,200,000,000.00		5,150,958,904.11		6,768,913,647.37		-911,175,265.27	4,212,265,617.55	10,688,165,480.15	16,845,806,381.70	50,934,936,764.61
三、本年期增减变动金额(减少以“-”号填列)			-150,958,904.11		-61,672.68		825,995,843.16		28,555,556.70	1,270,366,252.21	1,973,891,075.28
(一) 综合收益总额					547,555,686.24					2,665,642,807.75	3,213,198,473.99
(二) 所有者投入和减少资本											
1. 所有者投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
(三) 利润分配			-150,958,904.11						28,555,556.70	-1,151,596,652.59	-1,274,000,000.00
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备									28,555,556.70	-28,555,556.70	
3. 对所有者(或股东)的分配										-984,000,000.00	-984,000,000.00
4. 其他			-150,958,904.11							-139,011,095.89	-290,000,000.00
(四) 所有者权益内部结转							278,440,176.92			-278,440,176.92	
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							278,440,176.92			-278,440,176.92	
6. 其他											
(五) 其他					-61,672.68					34,760,273.97	34,698,601.29
四、本年年末余额	8,200,000,000.00		5,000,000,000.00		6,768,850,974.69		-85,179,423.11	4,212,265,617.55	10,686,721,036.85	18,116,172,633.91	52,908,830,839.89

法定代表人： _____ 主管会计工作的负责人： _____ 会计机构负责人： _____



国信证券股份有限公司

财务报表附注

2020年1-6月

金额单位：人民币元

一、公司基本情况

国信证券股份有限公司（以下简称公司或本公司）系经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准，由国信证券有限责任公司整体改制设立，于2008年3月25日在深圳市工商行政管理局登记注册，总部位于广东省深圳市。公司现持有统一社会信用代码为914403001922784445的营业执照，注册资本为人民币9,612,429,377.00元，股本总数9,612,429,377股（每股面值1元）。其中，有限售条件的流通股份1,412,429,377股；无限售条件的流通股份8,200,000,000股。公司股票分别于2014年12月29日和2020年8月14日在深圳证券交易所上市交易。

本公司主要经营范围：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；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；金融产品代销等。

本公司的母公司为深圳市投资控股有限公司（以下简称深圳投控公司）。

截至2020年6月30日，公司拥有16家子公司（含全资子公司），54家分公司，163家证券营业部；拥有员工10,745人，其中关键高级管理人员11人。

本财务报表业经公司2020年8月24日第四届第二十九次董事会批准对外报出。

本公司将国信弘盛私募基金管理有限公司（以下简称国信弘盛公司）、国信期货有限责任公司（以下简称国信期货公司）、国信证券（香港）金融控股有限公司（以下简称国信香港公司）、国信资本有限责任公司等16家子公司纳入本期合并财务报表范围，情况详见本财务报表附注七和八之说明。

二、财务报表的编制基础

（一）编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

（二）持续经营能力评价

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

三、重要会计政策及会计估计

重要提示：本公司根据实际生产经营特点针对金融工具减值、收入确认、买回返售及卖出回购金融资产、融资融券业务的核算、转融通业务等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

（一）遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了企业的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

（二）会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表所载财务信息的会计期间为 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

（三）记账本位币

采用人民币为记账本位币。

境外子公司根据其经营所处的主要经济环境的货币确定为其记账本位币。

（四）非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日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，确认为商誉；如果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，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，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，其差额计入当期损益。

（五）合并财务报表的编制方法

母公司将其控制的所有子公司纳入合并财务报表的合并范围。合并财务报表以母公司及其子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，由母公司按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》编制。

（六）合营安排分类及共同经营会计处理方法

1. 合营安排分为共同经营和合营企业。
2. 当公司为共同经营的合营方时，确认与共同经营中利益份额相关的下列项目：
 - （1）确认单独所持有的资产，以及按持有份额确认共同持有的资产；
 - （2）确认单独所承担的负债，以及按持有份额确认共同承担的负债；
 - （3）确认出售公司享有的共同经营产出份额所产生的收入；
 - （4）按公司持有份额确认共同经营因出售资产所产生的收入；
 - （5）确认单独所发生的费用，以及按公司持有份额确认共同经营发生的费用。

（七）现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、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。

（八）外币业务和外币报表折算

1. 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，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，不改变其人民币金额；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，差额计入当期损益或其他综合收益。

2. 外币财务报表折算

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，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

（九）客户交易结算资金

公司收到的客户交易结算资金存放在存管银行的专门账户上，与自有资金分开管理，为代理客户证券交易而进行资金清算与交收的款项存入交易所指定的清算代理机构，在结算备付金中核算。公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为资产及负债，公司代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时，按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等

相关费用确认为手续费支出，按规定向客户收取的手续费，在与客户办理买卖证券款项清算时确认为手续费收入。

（十）金融工具

1. 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下四类：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；(2) 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；(3) 不属于上述(1)或(2)的财务担保合同，以及不属于上述(1)并以低于市场利率贷款的贷款承诺；(4) 以摊余成本计量的金融负债。

2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

(1) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，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。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照交易价格进行初始计量。

(2) 金融资产的后续计量方法

1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

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

3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损

益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

(3) 金融负债的后续计量方法

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失(包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动)计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。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

按照《企业会计准则第23号——金融资产转移》相关规定进行计量。

3) 不属于上述1)或2)的财务担保合同，以及不属于上述1)并以低于市场利率贷款的贷款承诺

在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：①按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；②初始确认金额扣除按照相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

4) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

(4) 金融资产和金融负债的终止确认

1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：(1) 未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；(2) 保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：(1) 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；(2) 因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为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）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：(1) 终止确认部分的账面价值；(2) 终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资）之和。

4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

(1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

(2) 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

(3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由

可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

5. 金融工具减值

(1) 金融工具减值计量和会计处理

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、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、合同资产、租赁应收款、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以外的贷款承诺、不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债或不属于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的财务担保合同进行减值处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指公司按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于公司购买或源生的已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，公司在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。

对于由《企业会计准则第14号——收入》规范的交易形成，且不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，公司按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，公司按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

公司利用可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

于资产负债表日，若公司判断金融工具只具有较低的信用风险，则假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

公司判断金融工具是否已违约，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。如果金融工具逾期超过30天，则公司将其界定为违约。

公司判断金融工具已发生信用减值的依据，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，公司将该金融资产界定为已发生信用减值：

- 1) 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 2) 债务人发生重大财务困难；
- 3) 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- 4) 债务人很可能破产或存在其他财务重组等事项；
- 5) 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；
- 6) 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 7) 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别。

公司以单项金融工具或金融工具组合为基础评估预期信用风险和计量预期信用损失。当以金融工具组合为基础时，公司以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组合。

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，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，公司在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

(2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
融出资金——融资融券业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、预期信用损失率和前瞻性信息计算预期信用损失。
买入返售金融资产——约定购回、行权融资和小微通	业务性质	
融出资金——孖展业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。
融出资金——限制性股票融资业务	业务性质	
买入返售金融资产——股票质押回购业务	业务性质	
其他债权投资——国债、政策性金融债、央票	风险特征	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他债权投资——信用债以及地方政府债	风险特征	

项 目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
其他应收款——应收往来款组合	款项性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。
其他应收——应收押金保证金组合	款项性质	

(3) 按组合计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
应收款项——账龄组合	应收款账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
应收款项——特殊款项组合	款项性质	
合同资产——账龄组合	合同资产账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
合同资产——特殊款项组合	款项性质	

6. 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，公司以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：(1) 公司具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；(2) 公司计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，公司不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

(十一) 证券承销业务

公司证券承销的方式包括余额包销和代销。在余额包销方式下，对发行期结束后未售出的证券按约定的发行价格转为交易性金融资产等。

公司将发行项目立项之前的相关费用计入当期损益。所有已确认不能成功发行的项目费用记入当期损益。

(十二) 买入返售与卖出回购款项

买入返售交易是指按照合同或协议以一定的价格向交易对手买入相关资产(包括债券及票据)，合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售按买入返售相关资产时实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”项目列示。

卖出回购交易是指按照合同或协议以一定的价格将相关的资产(包括债券和票据)出售给交易对手，到合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购按卖出回

购相关资产时实际收到的款项入账，在资产负债表“卖出回购金融资产款”项目列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内，并按照相关的会计政策核算。

买入返售及卖出回购的利息收支，在返售或回购期间内以实际利率确认。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收支。

（十三）客户资产管理

公司客户资产管理业务分为定向资产管理业务、集合资产管理业务、专项资产管理业务。

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。对集合资产管理业务产品的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表内反映。

（十四）融资融券业务

融资融券业务，是指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。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，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理。公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，融出的证券按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》有关规定，不终止确认该证券，并确认相应利息收入。

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。

公司根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

（十五）转融通业务

公司通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由公司享有或承担，不将其计入资产负债表。

（十六）长期股权投资

1. 共同控制、重要影响的判断

按照相关约定对某项安排存在共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，认定为共同控制。对被投资单位的财务和经营政策有参与决

策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定，认定为重大影响。

2. 投资成本的确定

(1) 同一控制下的企业合并形成的，合并方以支付现金、转让非现金资产、承担债务或发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为其初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价的账面价值或发行股份的面值总额之间的差额调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

公司通过多次交易分步实现同一控制下企业合并形成的长期股权投资，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，在合并日，根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额确定初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积；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形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

公司通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

1) 在个别财务报表中，按照原持有的股权投资的账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

2) 在合并财务报表中，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益等的，与其相关的其他综合收益等转为购买日所属当期收益。但由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

(3) 除企业合并形成以外的：以支付现金取得的，按照实际支付的购买价款作为其初始投资成本；以发行权益性证券取得的，按照发行权益性证券的公允价值作为其初始投资成本；以债务重组方式取得的，按《企业会计准则第 12 号——债务重组》确定其初始投资成本；以非货币性资产交换取得的，按《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》确定其初始

投资成本。

3. 后续计量及损益确认方法

对被投资单位实施控制的长期股权投资采用成本法核算；对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。

(十七) 投资性房地产

1. 投资性房地产包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权和已出租的建筑物。

2. 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，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。房屋、建筑物预计可使用年限及残值率分别为：

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	5	1.9- 3.17

(十八) 固定资产

1. 固定资产确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

2. 各类固定资产的折旧方法

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	5	1.9- 3.17
交通工具	年限平均法	10	5	9.5
电子设备	年限平均法	3-5	5	19-31.67
办公设备及其他	年限平均法	5	5	19

(十九) 在建工程

1. 在建工程同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量则予以确认。在建工程按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的实际成本计量。

2. 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

（二十）借款费用

1. 借款费用资本化的确认原则

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，在发生时确认为费用，计入当期损益。

2. 借款费用资本化期间

(1) 当借款费用同时满足下列条件时，开始资本化：1) 资产支出已经发生；2) 借款费用已经发生；3) 为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

(2) 若符合资本化条件的资产在购建或者生产过程中发生非正常中断，并且中断时间连续超过 3 个月，暂停借款费用的资本化；中断期间发生的借款费用确认为当期费用，直至资产的购建或者生产活动重新开始。

(3) 当所购建或者生产符合资本化条件的资产达到预定可使用或可销售状态时，借款费用停止资本化。

3. 借款费用资本化金额

为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入专门借款的，以专门借款当期实际发生的利息费用（包括按照实际利率法确定的折价或溢价的摊销），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，确定应予资本化的利息金额；为购建或者生产符合资本化条件的资产占用了一般借款的，根据累计资产支出超过专门借款的资产支出加权平均数乘以占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。

（二十一）无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、计算机软件及交易席位费等，按成本进行初始计量。

2. 使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销，无法可靠确定预期实现方式的，采用直线法摊销。具体年限如下：

(1) 计算机软件按 5 年摊销；

(2) 土地使用权，按照房地产证上的土地使用年限摊销；

本公司将交易席位费视为使用寿命不确定的无形资产。使用寿命不确定的无形资产不摊

销，公司在每个会计期间均对该无形资产的使用寿命进行复核。对使用寿命不确定的无形资产，使用寿命不确定的判断依据是：是否在不确定的期间内为企业产生现金流量。

（二十二）部分长期资产减值

对长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程和使用寿命有限的无形资产等长期资产，在资产负债表日有迹象表明发生减值的，估计其可收回金额。对因企业合并所形成的商誉和使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年都进行减值测试。商誉结合与其相关的资产组或者资产组组合进行减值测试。

若上述长期资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额确认资产减值准备并计入当期损益。

（二十三）长期待摊费用

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

（二十四）职工薪酬

1. 职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

2. 短期薪酬的会计处理方法

在职工为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，并计入当期损益或相关资产成本。

3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

(1) 在职工为公司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。

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

1) 根据预期累计福利单位法，采用无偏且相互一致的精算假设对有关人口统计变量和财务变量等作出估计，计量设定受益计划所产生的义务，并确定相关义务的所属期间。同时，对设定受益计划所产生的义务予以折现，以确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本；

2) 设定受益计划存在资产的，将设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。设定受益计划存在盈余的，以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产；

3) 期末, 将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分, 其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本, 重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益, 并且在后续会计期间不允许转回至损益, 但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

4. 辞退福利的会计处理方法

向职工提供的辞退福利, 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: (1) 公司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; (2) 公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

5. 其他长期职工福利的会计处理方法

向职工提供的其他长期福利, 符合设定提存计划条件的, 按照设定提存计划的有关规定进行会计处理; 除此之外的其他长期福利, 按照设定受益计划的有关规定进行会计处理, 为简化相关会计处理, 将其产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动等组成项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

(二十五) 预计负债

1. 因对外提供担保、诉讼事项、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务, 履行该义务很可能导致经济利益流出公司, 且该义务的金额能够可靠的计量时, 公司将该项义务确认为预计负债。

2. 公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量, 并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

(二十六) 优先股、永续债等其他金融工具

根据金融工具相关准则、《金融负债与权益工具的区分及相关会计处理规定》(财会〔2014〕13号)和《永续债相关会计处理的规定》(财会〔2019〕2号), 对发行的永续债, 公司依据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式, 结合金融资产、金融负债和权益工具的定义, 在初始确认时将该等金融工具或其组成部分分类为金融资产、金融负债或权益工具。

在资产负债表日, 对于归类为权益工具的金融工具, 其利息支出或股利分配作为公司的利润分配, 其回购、注销等作为权益的变动处理; 对于归类为金融负债的金融工具, 其利息

支出或股利分配按照借款费用进行处理，其回购或赎回产生的利得或损失等计入当期损益。

（二十七）收入

1. 收入确认原则

于合同开始日，公司对合同进行评估，识别合同所包含的各单项履约义务，并确定各单项履约义务是在某一时段内履行，还是在某一时点履行。

满足下列条件之一时，属于在某一时段内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：(1) 客户在公司履约的同时即取得并消耗公司履约所带来的经济利益；(2) 客户能够控制公司履约过程中在建商品或服务；(3) 公司履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，公司在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。对于在某一时点履行的履约义务，在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品控制权时，公司考虑下列迹象：(1) 公司就该商品享有现时收款权利，即客户就该商品负有现时付款义务；(2) 公司已将该商品的法定所有权转移给客户，即客户已拥有该商品的法定所有权；(3) 公司已将该商品实物转移给客户，即客户已实物占有该商品；(4) 公司已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户，即客户已取得该商品所有权上的主要风险和报酬；(5) 客户已接受该商品；(6) 其他表明客户已取得商品控制权的迹象。

2. 收入计量原则

(1) 公司按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。交易价格是公司因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项以及预期将退还给客户的款项。

(2) 合同中存在可变对价的，公司按照期望值或最可能发生金额确定可变对价的最佳估计数，但包含可变对价的交易价格，不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。

(3) 合同中存在重大融资成分的，公司按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，公司预计客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

(4) 合同中包含两项或多项履约义务的，公司于合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务。

3. 收入确认的具体方法

(1) 手续费及佣金收入

与交易相关的经济利益能够流入公司，相关的收入能够可靠计量且满足下列各项经营活动的特定收入确认标准时，确认相关的手续费及佣金收入。

1) 经纪业务收入

代理买卖证券手续费收入、期货经纪业务手续费收入在交易日确认收入。

2) 投资银行业务收入

证券承销业务收入，按承销方式分别确认收入：① 采用全额包销方式的，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认收入；② 采用余额包销、代销方式的，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认。

保荐业务和财务顾问业务按照提供劳务收入的确认条件，在保荐服务和财务顾问服务完成且取得收款证据时确认为收入。

3) 资产管理和基金管理业务收入

受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入，在资产管理合同或基金到期或者定期与委托单位结算收益或损失时，按合同规定收益分成方式和比例计算的应该享有的收益或承担的损失，确认为当期损益。

4) 投资咨询业务收入

投资咨询业务收入按照提供劳务收入的确认条件，在投资咨询服务完成且取得收款证据时确认为收入。

(2) 利息收入

对于所有以摊余成本计量的金融工具及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产中计息的金融工具，利息收入以实际利率计量。实际利率是指按金融工具的预计存续期间将其预计未来现金流入或流出折现至该金融资产账面余额或金融负债摊余成本的利率。实际利率的计算需要考虑金融工具的合同条款(例如提前还款权)并且包括所有归属于实际利率组成部分的费用和所有交易成本，但不包括预期信用损失。

公司根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入并列报为“利息收入”，但下列情况除外：1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，自初始确认起，按照该

金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入；2) 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产的摊余成本(即，账面余额扣除预期信用损失准备之后的净额)和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，并且这一改善在客观上可与应用上述规定之后发生的某一事件相联系，转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

(3) 让渡资产使用权的收入

公司在同时满足相关的经济利益很可能流入、收入金额能够可靠计量时，确认让渡资产使用权的收入。

(二十八) 合同成本

与合同成本有关的资产包括合同取得成本和合同履约成本。

公司为取得合同发生的增量成本预期能够收回的，作为合同取得成本确认为一项资产。

公司为履行合同发生的成本，不适用存货、固定资产或无形资产等相关准则的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)、明确由客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。

公司对于与合同成本有关的资产采用与该资产相关的商品或服务收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。

如果与合同成本有关的资产的账面价值高于因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本，公司对超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失。以前期间减值的因素之后发生变化，使得转让该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本高于该资产账面价值的，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下该资产在转回日的账面价值。

(二十九) 政府补助

1. 政府补助在同时满足下列条件时予以确认：(1) 公司能够满足政府补助所附的条件；(2) 公司能够收到政府补助。政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府

补助为非货币性资产的,按照公允价值计量;公允价值不能可靠取得的,按照名义金额计量。

2. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

政府文件规定用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。政府文件不明确的,以取得该补助必须具备的基本条件为基础进行判断,以购建或以其他方式形成长期资产为基本条件的作为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助,冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关的政府补助确认为递延收益的,在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助,直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的,将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

3. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助,难以区分与资产相关或与收益相关的,整体归类为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助,用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的,确认为递延收益,在确认相关成本费用或损失的期间,计入当期损益或冲减相关成本;用于补偿已发生的相关成本费用或损失的,直接计入当期损益或冲减相关成本。

4. 与公司日常经营活动相关的政府补助,按照经济业务实质,计入其他收益或冲减相关成本费用。与公司日常活动无关的政府补助,计入营业外收支。

(三十) 递延所得税资产、递延所得税负债

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,该计税基础与其账面数之间的差额),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. 确认递延所得税资产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。

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

4. 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益,但不包括下列情况产生的所得税:(1) 企业合并;(2) 直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

(三十一) 租赁

经营租赁的会计处理方法

公司为承租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金计入相关资产成本或确认为当期损益，发生的初始直接费用，直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

公司为出租人时，在租赁期内各个期间按照直线法将租金确认为当期损益，发生的初始直接费用，除金额较大的予以资本化并分期计入损益外，均直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

(三十二) 一般风险准备金和交易风险准备金

公司按当年实现净利润的 10% 分别计提一般风险准备金和交易风险准备金。根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，每月按照不低于公募基金托管费收入的 2.5% 提取一般风险准备金；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，每月按照不低于大集合资产管理业务管理费收入的 10% 计提一般风险准备金。

(三十三) 分部报告

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

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

(三十四) 重要会计政策说明

企业会计准则变化引起的会计政策变更

1. 公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部修订后的《企业会计准则第 14 号——收入》(以下简称新收入准则)。根据相关新旧准则衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日执行新准则的累积影响数追溯调整本报告期期初留存收益及财务报表其他相关项目金额。

执行新收入准则对公司 2020 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

项 目	资产负债表		
	2019 年 12 月 31 日	新收入准则调整影响	2020 年 1 月 1 日
应收账款	791,157,610.45	-15,914,731.25	775,242,879.20

项 目	资产负债表		
	2019 年 12 月 31 日	新收入准则调整影响	2020 年 1 月 1 日
合同资产		15,914,731.25	15,914,731.25
合同负债		2,064,024.90	2,064,024.90
其他负债	6,949,986,304.46	-2,064,024.90	6,947,922,279.56

2. 公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部于 2019 年度颁布的《企业会计准则解释第 13 号》，该项会计政策变更采用未来适用法处理。

四、税项

(一) 主要税种及税率

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	销售货物或提供应税劳务	3%、6%、9%和 13%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加	应缴流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%、20%、16.5%

不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

纳税主体名称	所得税税率
国信证券（香港）金融控股有限公司（以下简称国信香港公司）	16.5%
国信证券（香港）经纪有限公司	16.5%
国信证券（香港）融资有限公司	16.5%
国信证券（香港）资产管理有限公司	16.5%
国信（香港）金融产品有限公司	16.5%
深圳市国信运通基金管理有限公司	20%
国信咨询服务（深圳）有限公司（以下简称国信咨询公司）	20%
国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司	20%
除上述以外的其他纳税主体	25%

(二) 税收优惠

1. 增值税税收优惠

根据《财政部 国家税务总局关于将铁路运输和邮政业纳入营业税改征增值税试点的通知》（财税[2013]106号）、《国家税务总局关于重新发布〈营业税改征增值税跨境应税服务增值税免税管理办法（试行）〉的公告》（国家税务总局公告2014年第49号），国信咨询公司从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免税优惠政策，国信咨询公司于2014年完成跨境应税服务增值税优惠税收备案登记，自2014年11月1日起至2017年8月31日止享受增值税减免税优惠政策，国信咨询公司于优惠期限到期前申请应税服务增值税优惠备案并完成备案登记，从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免税优惠政策延长至2022年3月31日。

2. 企业所得税税收优惠

根据财政部、国家税务总局《关于小型微利企业所得税优惠政策的通知》（财税[2015]34号），国信咨询公司、国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司、深圳市国信运通基金管理有限公司的年应纳税所得额不超过100万元的部分，减按25%计入应纳税所得额，按20%的税率缴纳企业所得税；对年应纳税所得额超过100万元到不超过300万元的部分，减按50%计入应纳税所得额，按20%的税率缴纳企业所得税。

（三）其他说明

根据国家税务总局公告2012年第57号国家税务总局关于印发《跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法》的公告，本公司先汇总公司本部和下属营业部应纳税所得额，其中50%应纳税所得额在本部预缴，50%应纳税所得额按经营收入、职工工资薪酬费用和资产总额三因素计算各所属营业部应分摊所得税额的比例。本公司所属证券营业部按分摊的当期应纳税所得额和各自适用税率计缴企业所得税。

五、合并财务报表项目注释

说明：本财务报表附注的期初数指财务报表上年年末数按新收入准则调整后的2020年1月1日的数据。期末数指2020年6月30日财务报表数，本期指2020年1-6月，上年同期指2019年1-6月。母公司同。

（一）合并资产负债表项目注释

1. 货币资金

（1）类别明细

项 目	期末数	期初数
-----	-----	-----

项 目	期末数	期初数
库存现金	333,078.21	307,330.94
银行存款	70,808,695,692.98	52,866,444,546.65
其中：客户资金存款	59,085,054,376.56	46,352,426,655.52
自有资金存款	11,723,641,316.42	6,514,017,891.13
其他货币资金	38,250,538.63	47,877,953.82
合 计	70,847,279,309.82	52,914,629,831.41
其中：存放在境外的款项总额	1,486,334,390.79	1,256,932,779.63

(2) 币种明细

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
库存现金：						
人民币			199,807.60			196,528.35
美元	7,714.00	7.0795	54,611.26	7,714.00	6.9762	53,814.40
港元	86,117.09	0.9134	78,659.35	63,617.09	0.8958	56,988.19
小 计			333,078.21			307,330.94
银行存款：						
其中：客户资金存款						
人民币			57,216,566,476.50			44,669,245,693.18
美元	66,321,593.33	7.0795	469,523,720.00	61,356,198.89	6.9762	428,033,114.75
港元	1,531,600,810.20	0.9134	1,398,964,180.06	1,401,147,407.40	0.8958	1,255,147,847.59
小 计			59,085,054,376.56			46,352,426,655.52
自有资金存款						
人民币			11,420,684,155.88			6,209,338,137.56
美元	31,569,789.08	7.0795	223,498,321.79	28,430,327.62	6.9762	198,335,651.53
港元	83,978,986.70	0.9134	76,706,406.45	115,168,087.13	0.8958	103,167,572.45
欧元	345,739.42	7.9610	2,752,431.52	406,439.61	7.8155	3,176,528.77
英镑	0.09	8.7144	0.78	0.09	9.1501	0.82
小 计			11,723,641,316.42			6,514,017,891.13
银行存款小计			70,808,695,692.98			52,866,444,546.65

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
其他货币资金：						
人民币			38,250,538.63			47,877,953.82
合 计			70,847,279,309.82			52,914,629,831.41

(3) 融资融券业务信用资金明细情况

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
客户信用资金：						
人民币			4,804,113,013.72			3,689,858,311.98
美元	14,909,370.69	7.0795	105,550,889.80	7,237,556.75	6.9762	50,490,643.40
港元	417,873,767.69	0.9134	381,685,899.41	286,358,871.73	0.8958	256,520,277.30
小 计			5,291,349,802.93			3,996,869,232.68
自有信用资金：						
人民币			9,794.87			13,000.00
总 计			5,291,359,597.80			3,996,882,232.68

(4) 其他说明

2020年6月30日，本公司使用受限的货币资金为人民币58,774,310.41元（期初本公司使用受限的货币资金为人民币57,670,219.90元）。

2. 结算备付金

(1) 按类别列示

项 目	期末数	期初数
客户备付金	6,214,300,409.11	4,964,700,968.10
公司备付金	1,594,516,128.32	1,828,248,966.89
合 计	7,808,816,537.43	6,792,949,934.99

(2) 按币种列示

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
公司自有备付金：						
人民币			1,594,516,128.32			1,828,248,966.89
公司备付金总计			1,594,516,128.32			1,828,248,966.89
客户普通备付金：						
人民币			5,009,652,940.10			4,231,712,245.04
美元	8,772,283.86	7.0795	62,103,383.59	2,385,131.42	6.9762	16,639,153.81
港币	82,625,981.39	0.9134	75,470,571.40	23,733,092.61	0.8958	21,260,104.36
小 计			5,147,226,895.09			4,269,611,503.21
客户信用备付金：						
人民币			1,067,073,514.02			695,089,464.89
客户备付金总计			6,214,300,409.11			4,964,700,968.10
合 计			7,808,816,537.43			6,792,949,934.99

3. 融出资金

(1) 按客户类别

项 目	期末数	期初数
境内		
其中：个人	35,356,728,226.22	34,735,554,341.73
机构	3,905,890,613.79	2,826,573,730.52
减：减值准备	117,214,560.14	103,161,607.87
账面价值小计	39,145,404,279.87	37,458,966,464.38
境外		
其中：个人	336,687,723.91	248,721,517.65
机构	7,728,723.82	781,555.25
减：减值准备	237,564.72	422,100.67
账面价值小计	344,178,883.01	249,080,972.23
合 计	39,489,583,162.88	37,708,047,436.61

(2) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
股票	128,771,160,980.17	112,756,943,710.83
资金	6,097,010,340.30	4,564,752,350.45
基金	2,342,035,406.16	1,949,573,849.94
债券	159,878,184.63	86,754,719.09
合 计	137,370,084,911.26	119,358,024,630.31

注：担保物包含融出资金、融出证券、孖展融资及限制性股票融资的担保物

4. 衍生金融资产、衍生金融负债

(1) 明细情况

项 目	期末数			期初数		
	非套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具						
利率互换	14,720,000,000.00		20,816,691.03	7,250,000,000.00		9,739,739.71
权益衍生工具						
收益互换	2,947,481,756.00	4,334,837.43		3,112,000,000.00	9,382,773.03	
收益凭证	20,779,682,000.00		1,434,233.10	7,622,325,000.00	9,205,476.90	
股指期货	2,761,306,408.55			2,207,234,819.42		
股票期权	1,394,420,000.00		98,313,106.00	1,191,632,691.00		52,113,271.53
股指期权	154,980,000.00		36,312,360.00	62,310,000.00		9,196,800.00
小 计	28,037,870,164.55	4,334,837.43	136,059,699.10	14,195,502,510.42	18,588,249.93	61,310,071.53
其他衍生工具						
场外期权	15,585,000.00		160,537.24	11,144,000.00		359,170.00
商品期货	589,499,330.00			66,271,460.00		
商品期权	68,133,550.00	2,209,875.00	175,280.00	11,289,250.00	345,705.00	
远期合同	537,340,000.00		37,283,185.82			
小 计	1,210,557,880.00	2,209,875.00	37,619,003.06	88,704,710.00	345,705.00	359,170.00
合 计	43,968,428,044.55	6,544,712.43	194,495,393.19	21,534,207,220.42	18,933,954.93	71,408,981.24

(2) 股指期货合约和商品期货合约

在当日无负债结算制度下, 结算备付金已包括本公司于 2020 年 6 月 30 日所持有的股指期货合约和商品期货合约产生的持仓损益, 衍生金融负债项下的股指期货合约和商品期货合约与相关的股指期货暂收暂付款和商品期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额列示, 2020 年 6 月 30 日抵销后的净额为人民币零元, 公允价值变动损失为人民币 22, 309, 663. 49 元(期初本公司股指期货合约和商品期货合约公允价值变动损失为人民币 10, 109, 705. 00 元)。

5. 存出保证金

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
交易保证金:						
人民币			3, 593, 233, 245. 87			3, 244, 454, 199. 77
美元	270, 000. 00	7. 0795	1, 911, 465. 00	270, 000. 00	6. 9762	1, 883, 574. 00
港币	11, 070, 732. 23	0. 9134	10, 112, 006. 82	10, 363, 394. 28	0. 8958	9, 283, 528. 60
小 计			3, 605, 256, 717. 69			3, 255, 621, 302. 37
信用保证金:						
人民币			1, 320, 276, 467. 35			1, 119, 093, 397. 25
合 计			4, 925, 533, 185. 04			4, 374, 714, 699. 62

6. 应收款项

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数[注]
应收逾期融资款	716, 052, 518. 38	703, 623, 274. 55
应收手续费及佣金	461, 434, 913. 67	373, 061, 820. 96
应收代垫款项	200, 923, 335. 86	200, 900, 583. 40
应收违约债券	182, 268, 574. 32	183, 915, 327. 13
应收清算款项	104, 895, 848. 17	37, 352, 186. 15
应收利率互换款项	100, 621, 000. 90	47, 417, 007. 90

项 目	期末数	期初数[注]
应收融资融券客户款	59,752,013.93	53,887,238.90
应收期货交易款	30,393,992.99	56,517,363.62
应收申购款	7,784,000.00	43,074,000.00
收益互换预付金		100,000,000.00
其他	78,761,961.49	81,667,363.72
减：坏账准备（按简化模型计提）	1,196,975,185.13	1,106,173,287.13
合 计	745,912,974.58	775,242,879.20

[注]期初数与上期期末余额(2019年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十四)1之说明

(2) 类别明细情况

种 类	期末数			
	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(%)
单项计提坏账准备				
—应收逾期融资款	716,052,518.38	36.86	716,052,518.38	100.00
—应收违约债券	182,268,574.32	9.38	182,268,574.32	100.00
—应收代垫款项	200,923,335.86	10.34	182,417,221.31	90.79
—应收融资融券款	59,752,013.93	3.08	59,752,013.93	100.00
—其他	43,697,609.00	2.25	43,697,609.00	100.00
小 计	1,202,694,051.49	61.90	1,184,187,936.94	98.46
组合计提坏账准备				
账龄组合	318,956,397.35	16.42	12,787,248.19	4.01
特定款项组合	421,237,710.87	21.68		
小 计	740,194,108.22	38.10	12,787,248.19	1.73
合 计	1,942,888,159.71	100.00	1,196,975,185.13	61.61

(续上表)

种类	期初数			
	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(%)
单项计提坏账准备				
—应收逾期融资款	703,623,274.55	37.40	703,623,274.55	100.00
—应收违约债券	183,915,327.13	9.78	183,915,327.13	100.00
—应收代垫款项	200,336,793.40	10.65	113,972,570.18	56.89
—应收融资融券款	53,887,238.90	2.86	53,887,238.90	100.00
—其他	43,316,256.93	2.30	43,316,256.93	100.00
小计	1,185,078,890.91	62.99	1,098,714,667.69	92.71
组合计提坏账准备		-		
账龄组合	291,737,708.40	15.51	7,458,619.44	2.56
特定款项组合	404,599,567.02	21.51		
小计	696,337,275.42	37.01	7,458,619.44	1.07
合计	1,881,416,166.33	100.00	1,106,173,287.13	58.79

(3) 坏账准备的计提情况——按账龄组合计提坏账准备的应收账款

账龄	期末数		坏账准备	期初数		坏账准备
	账面金额	比例(%)		账面金额	比例(%)	
1年以内	211,271,783.40	66.24	1,980,389.91	221,494,795.52	75.92	1,179,268.09
1至2年	64,726,320.01	20.29	3,236,316.00	47,752,400.88	16.37	3,054,835.87
2至3年	26,928,992.64	8.44	2,692,899.26	14,324,537.74	4.91	1,802,739.53
3年以上	16,029,301.30	5.03	4,877,643.02	8,165,974.26	2.80	1,421,775.95
合计	318,956,397.35	100.00	12,787,248.19	291,737,708.40	100.00	7,458,619.44

(4) 应收款项金额前五名情况

项目	款项性质	期末余额[注3]	账龄	占应收款项总额的比例(%)
客户A	[注1]	228,677,636.98	3年以上	11.77
客户B	[注2]	192,013,485.01	1-2年	9.88
客户C	[注1]	164,632,623.92	3年以上	8.47

项 目	款项性质	期末余额[注 3]	账龄	占应收款项总额的比例(%)
客户 D	[注 1]	163,845,864.41	3 年以上	8.43
客户 E	[注 1]	108,213,482.15	3 年以上	5.57
合 计		857,383,092.47		44.13

[注 1]系国信香港公司开展的融资业务逾期本金及利息

[注 2]系为其垫付的和解款

[注 3]期末余额前五名应收账款相应计提的坏账准备期末余额汇总金额为人民币 839,493,224.27 元

(5) 应收款项坏账准备变动情况

详见本财务报表附注五(一)19 之说明。

(6) 报告期应收款项中应收持本公司 5% (含 5%) 以上有表决权股份的股东单位的款项及关联方的款项

详见本财务报表附注十一(三)之说明。

7. 买入返售金融资产

(1) 明细情况——按业务类别

项 目	期末数	期初数
股票质押式回购	20,813,475,331.50	24,549,336,637.43
交易所质押式逆回购	1,048,359,274.00	286,704,447.54
银行间质押式逆回购	498,843,730.41	500,034,246.58
行权融资	236,294,279.51	230,702,348.20
约定购回式回购	51,777,384.87	57,403,005.73
减：减值准备	2,662,706,183.58	1,851,490,036.87
合 计	19,986,043,816.71	23,772,690,648.61

(2) 明细情况——按金融资产种类

项 目	期末数	期初数
股票	20,865,252,716.37	24,606,739,643.16
债券	1,547,203,004.41	786,738,694.12
其他	236,294,279.51	230,702,348.20

项 目	期末数	期初数
减：减值准备	2,662,706,183.58	1,851,490,036.87
合 计	19,986,043,816.71	23,772,690,648.61

(3) 约定购回融出资金

剩余期限	期末数	期初数
1 个月内	7,430,893.53	4,834,384.52
1 个月至 3 个月内	6,911,926.75	11,302,879.67
3 个月至 1 年内	37,434,564.59	41,265,741.54
小 计	51,777,384.87	57,403,005.73

(4) 股票质押回购融出资金

剩余期限	期末数	期初数
1 个月内	8,762,735,934.21	6,832,420,928.63
1 个月至 3 个月内	5,886,216,764.35	3,517,226,188.93
3 个月至 1 年内	5,894,838,314.80	14,199,689,519.87
1 年以上	269,684,318.14	
小 计	20,813,475,331.50	24,549,336,637.43

(5) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
担保物	73,937,924,017.99	74,347,799,516.88
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物		
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		

注：上述担保物不包括交易所质押式逆回购交易取得的担保物的公允价值

8. 交易性金融资产

(1) 明细情况

项 目	期末数					
	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	公允价值小计	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	初始成本小计
债券	55,566,665,652.94		55,566,665,652.94	54,707,148,196.23		54,707,148,196.23
公募基金	8,465,369,693.59		8,465,369,693.59	8,468,030,896.70		8,468,030,896.70
股票	2,679,897,822.35		2,679,897,822.35	2,248,542,958.26		2,248,542,958.26
银行理财产品	1,574,361,768.22		1,574,361,768.22	1,565,420,000.00		1,565,420,000.00
券商理财产品	1,197,976,108.88		1,197,976,108.88	1,182,191,479.75		1,182,191,479.75
信托计划	198,349,884.88		198,349,884.88	172,410,000.00		172,410,000.00
私募基金及专户	2,386,177,859.28		2,386,177,859.28	2,169,311,874.67		2,169,311,874.67
其他股权投资	1,015,423,088.72		1,015,423,088.72	1,005,865,938.36		1,005,865,938.36
其他	96,917,417.93		96,917,417.93	95,604,788.27		95,604,788.27
合 计	73,181,139,296.79		73,181,139,296.79	71,614,526,132.24		71,614,526,132.24

(续上表)

项 目	期初数					
	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	公允价值小计	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	初始成本小计
债券	45,927,969,880.61		45,927,969,880.61	44,737,293,880.16		44,737,293,880.16
公募基金	7,964,655,175.34		7,964,655,175.34	7,930,531,434.34		7,930,531,434.34
股票	1,804,724,575.81		1,804,724,575.81	1,807,939,886.32		1,807,939,886.32
银行理财产品	2,792,029,645.82		2,792,029,645.82	2,769,050,000.00		2,769,050,000.00
券商理财产品	995,895,252.81		995,895,252.81	991,679,770.65		991,679,770.65
信托计划	280,884,035.43		280,884,035.43	262,410,000.00		262,410,000.00

项 目	期初数					
	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	公允价值小计	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	初始成本小计
私募基金及专户	1,845,908,322.02		1,845,908,322.02	1,785,880,810.13		1,785,880,810.13
其他股权投资	801,937,879.53		801,937,879.53	827,514,978.61		827,514,978.61
其他	97,564,234.80		97,564,234.80	97,564,234.80		97,564,234.80
合 计	62,511,569,002.17		62,511,569,002.17	61,209,864,995.01		61,209,864,995.01

(2) 其他说明

1) 2020年6月30日, 本公司为回购交易设定质押或过户的债券的公允价值计人民币34,793,001,701.47元, 为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币3,832,556,947.00元。

2) 2020年6月30日, 本公司持有的限售股的公允价值计人民币1,258,759,692.87元。

3) 本公司作为管理人以自有资金参与的集合资产管理计划截至2020年6月30日的公允价值计人民币1,003,046,157.82元, 其中人民币854,929,573.43元为B份额, 一旦集合计划全部收益不足以支付份额A收益且C份额持有人本金不足以支付份额A收益, 本公司将以持有的B份额为限弥补份额A持有人的约定收益及本金; 其中人民币10,009,973.90元为劣后级份额, 一旦集合计划出现亏损, 本公司将以持有的份额为限对集合计划的亏损进行弥补; 其中人民币138,106,610.49元为本公司持有的普通份额。同时, 本公司持有的B份额及劣后级份额退出受到合同约定的限制。

9. 其他债权投资

(1) 明细情况

项 目	期末数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	1,294,010,272.77	17,349,863.10	13,691,381.73	1,325,051,517.60	
地方债	8,917,362,893.33	209,452,483.82	87,638,748.83	9,214,454,125.98	14,233,112.87

项 目	期末数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
金融债	2,166,701,303.73	47,817,345.65	15,989,034.81	2,230,507,684.19	
企业债	3,706,052,379.32	65,827,138.15	-92,500,595.27	3,679,378,922.20	127,277,686.40
中期票据	2,079,342,198.81	61,535,176.07	13,074,881.19	2,153,952,256.07	3,965,529.80
次级债	30,014,609.00	392,671.23	273,031.00	30,680,311.23	50,506.53
非公开定向债务融资工具	281,344,284.81	7,838,409.83	4,743,605.19	293,926,299.83	670,390.29
合计	18,474,827,941.77	410,213,087.85	42,910,087.48	18,927,951,117.10	146,197,225.89

(续上表)

项 目	期初数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	1,471,134,346.24	20,318,246.37	11,872,852.39	1,503,325,445.00	
地方债	6,636,684,438.05	114,159,077.40	43,599,029.52	6,794,442,544.97	10,621,908.76
金融债	1,675,151,501.02	31,436,814.26	20,340,739.39	1,726,929,054.67	
企业债	3,942,819,487.41	75,220,879.02	-1,670,406.93	4,016,369,959.50	35,030,035.58
中期票据	3,236,654,060.96	64,657,261.88	15,488,869.04	3,316,800,191.88	6,049,184.71
次级债	30,018,632.86	1,080,780.82	360,447.14	31,459,860.82	182,812.47
同业存单	291,229,403.31		168,696.69	291,398,100.00	469,638.00
非公开定向债务融资工具	281,681,456.90	5,275,163.93	4,909,543.10	291,866,163.93	591,296.72
合计	17,565,373,326.75	312,148,223.68	95,069,770.34	17,972,591,320.77	52,944,876.24

(2) 其他说明

2020年6月30日，本公司为回购交易设定质押的债券的公允价值计人民币15,544,328,278.90元，为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币415,797,268.00元。

10. 其他权益工具投资

(1) 明细情况

项 目	期末数		
	初始成本	公允价值	本期确认的股利收入
非交易性权益工具	10,380,067,687.21	10,519,859,955.17	40,492,864.98

(续上表)

项 目	期初数		
	初始成本	公允价值	本期确认的股利收入
非交易性权益工具	9,477,656,160.93	9,729,134,025.69	614,203,987.94

(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的原因

本公司将部分权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资,主要包括以融出证券为目的持有的证券投资以及策略投资持有的证券投资以及中国证券金融股份有限公司(以下简称证金公司)的专户投资等。

上述其他权益工具投资包含本公司与其他证券公司投资于证金公司的专户投资,根据与证金公司签订的协议,本公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险、分享投资收益,由证金公司进行统一运作与投资管理,2020年6月30日证金公司专户投资成本计人民币6,585,480,000.00元,公允价值计人民币6,553,590,755.00元。

上述其他权益工具投资包含本公司以融出证券为目的持有的证券投资,2020年6月30日该部分非交易性权益工具成本计人民币760,812,096.19元,公允价值计人民币898,326,167.61元。

上述其他权益工具投资包含本公司策略投资持有的证券投资,2020年6月30日该部分非交易性权益工具成本计人民币3,033,775,591.02元,公允价值计人民币3,067,943,032.56元。

(3) 本期终止确认的其他权益工具投资

1) 明细情况

项 目	终止确认时公允价值	本期股利收入	终止确认时从其他综合收益转入留存收益的累计利得和损失
非交易性权益工具	1,196,951,794.06		-40,893,520.78

2) 处置权益工具投资的原因

其他权益工具投资处置的原因主要系本公司根据融券客户的需求调整融券证券持仓和投资策略调整所致。

(4) 其他说明

2020年6月30日，本公司持有的限售股的公允价值计人民币253,043,368.26元。

11. 长期股权投资

(1) 分类情况

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	减值	账面价值	账面余额	减值	账面价值
对联营企业投资	3,030,603,516.11		3,030,603,516.11	2,933,263,568.36		2,933,263,568.36
对合营企业投资	497,263,014.05		497,263,014.05	177,312,400.13		177,312,400.13
合 计	3,527,866,530.16		3,527,866,530.16	3,110,575,968.49		3,110,575,968.49

(2) 明细情况

被投资单位名称	期初数	本期增减变动							期末数	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		
联营企业:										
鹏华基金管理有限公司（鹏华基金 公司）	1,302,060,774.76			201,932,128.16	-14,009,334.57					1,489,983,568.35
前海股交投资控股（深圳）有限公 司	203,856,376.08			-842,404.60	2,898,963.48	-128,583.80				205,784,351.16
青岛蓝海股权交易中心有限责任公 司	27,205,295.46			780,937.51			1,000,000.00			26,986,232.97
北京航天科工军民融合科技成果转化 创业投资基金（有限合伙）	378,348,812.63		15,069,468.38	20,291,498.41						383,570,842.66
常州高新投创业投资有限公司	96,208,822.57			911,703.98	23,032,955.80					120,153,482.35
深圳市前海弘泰基金管理有限公司	9,306,184.30			-60,274.18						9,245,910.12
深圳市前海清控弘泰投资发展有限 公司	4,508,979.35			-31.40						4,508,947.95
深圳市国信弘盛股权投资基金（有 限合伙）	455,823,996.60		137,376,530.07	14,394,346.46						332,841,812.99
深圳市国信众创股权投资基金（有 限合伙）	39,524,100.98			365,129.04						39,889,230.02
南京华文弘盛文化产业创业投资基 金合伙企业（有限合伙）	50,926,781.11		2,896,941.47	160,436.04						48,190,275.68

被投资单位名称	期初数	本期增减变动								期末数	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		
深圳弘盛道格体育投资合伙企业 (有限合伙)	40,558,644.39			-417,492.80						40,141,151.59	
深圳市中亚亿百投资企业(有限合 伙)	14,648,009.92			4.51						14,648,014.43	
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有 限合伙)	246,659,361.98			329,965.74						246,989,327.72	
厦门弘盛联发智能技术产业股权投 资基金合伙企业(有限合伙)	59,364,606.29			3,475,004.76						62,839,611.05	
深圳市五色检测技术服务有限公司	2,926,325.78			-147,806.36						2,778,519.42	
华润宝塔股权投资(延安)有限公司	1,336,496.16			-284,258.51						1,052,237.65	
华润(延安)新产业经济投资合伙 企业(有限合伙)		1,000,000.00								1,000,000.00	
小 计	2,933,263,568.36	1,000,000.00	155,342,939.92	240,888,886.76	11,922,584.71	-128,583.80	1,000,000.00			3,030,603,516.11	
合营企业:											
深圳市国信大族壹号机器人产业投 资基金(有限合伙)	26,906,489.17			7,923,055.39						34,829,544.56	
深圳市国信蓝思基金管理有限公司	7,215,245.01			200,496.27						7,415,741.28	
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙 企业(有限合伙)	7,566,161.64			6,850,302.98						14,416,464.62	

被投资单位名称	期初数	本期增减变动							期末数	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
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	102,708,834.73	300,000,000.00		5,306,705.53						408,015,540.26	
珠海国信运通股权投资基金(有限合伙)	32,915,669.58			-329,946.25						32,585,723.33	
小 计	177,312,400.13	300,000,000.00		19,950,613.92						497,263,014.05	
合 计	3,110,575,968.49	301,000,000.00	155,342,939.92	260,839,500.68	11,922,584.71	-128,583.80	1,000,000.00			3,527,866,530.16	

12. 投资性房地产

项 目	房屋及建筑物	合 计
账面原值		
期初数	335,254,930.30	335,254,930.30
本期增加金额	24,002,871.71	24,002,871.71
1) 外购		
2) 固定资产转入	24,002,871.71	24,002,871.71
本期减少金额		
1) 处置		
2) 其他转出		
期末数	359,257,802.01	359,257,802.01
累计折旧和累计摊销		
期初数	38,868,636.81	38,868,636.81
本期增加金额	15,853,811.67	15,853,811.67
1) 计提或摊销	5,512,224.55	5,512,224.55
2) 固定资产转入	10,341,587.12	10,341,587.12
本期减少金额		
1) 处置		
2) 其他转出		
期末数	54,722,448.48	54,722,448.48
账面价值		
期末账面价值	304,535,353.53	304,535,353.53
期初账面价值	296,386,293.49	296,386,293.49

13. 固定资产

(1) 账面价值

项 目	期末数	期初数
固定资产原价	2,095,604,708.10	2,083,785,546.65
减：累计折旧	1,005,693,984.96	957,201,862.56

项 目	期末数	期初数
固定资产减值准备		
加：固定资产清理		
固定资产合计	1,089,910,723.14	1,126,583,684.09

(2) 固定资产增减变动表

项 目	房屋及建筑物	交通工具	电子设备	办公设备及其他	合 计
账面原值					
期初数	1,224,491,675.40	85,991,459.53	746,905,390.47	26,397,021.25	2,083,785,546.65
本期增加金额	22,123,380.27	1,434,429.88	24,310,833.76	189,099.05	48,057,742.96
1) 购置		1,411,989.13	22,066,613.87	178,440.76	23,657,043.76
2) 在建工程转入	22,123,380.27		1,640,707.96		23,764,088.23
3) 外币报表折算差额		22,440.75	603,511.93	10,658.29	636,610.97
本期减少金额	24,002,871.71	1,257,229.53	9,688,246.56	1,290,233.71	36,238,581.51
1) 处置或报废		1,257,229.53	9,635,026.56	1,180,777.71	12,073,033.80
2) 转入投资性房地产	24,002,871.71				24,002,871.71
3) 其他			53,220.00	109,456.00	162,676.00
期末数	1,222,612,183.96	86,168,659.88	761,527,977.67	25,295,886.59	2,095,604,708.10
累计折旧					
期初数	365,068,545.79	59,607,311.81	514,261,997.74	18,264,007.22	957,201,862.56
本期增加金额	14,383,178.28	2,917,573.08	51,768,770.39	1,254,138.74	70,323,660.49
1) 计提	14,383,178.28	2,901,863.47	51,373,010.94	1,244,126.24	69,902,178.93
2) 外币报表折算差额		15,709.61	395,759.45	10,012.50	421,481.56
本期减少金额	10,341,587.12	1,194,368.05	9,056,475.93	1,239,106.99	21,831,538.09
1) 处置或报废		1,194,368.05	9,005,916.93	1,135,123.79	11,335,408.77
2) 转入投资性房地产	10,341,587.12				10,341,587.12
3) 其他			50,559.00	103,983.20	154,542.20
期末数	369,110,136.95	61,330,516.84	556,974,292.20	18,279,038.97	1,005,693,984.96
减值准备					

项 目	房屋及建筑物	交通工具	电子设备	办公设备及其他	合 计
期初数					
本期增加金额					
本期减少金额					
期末数					
账面价值					
期末账面价值	853,502,047.01	24,838,143.04	204,553,685.47	7,016,847.62	1,089,910,723.14
期初账面价值	859,423,129.61	26,384,147.72	232,643,392.73	8,133,014.03	1,126,583,684.09

(3) 未办妥产权证书的固定资产的情况

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
深圳市福田区红树福苑小区 20 套人才房	5,038,906.51	人才安居住房为有限产权，仅有购房合同，不予办理房产证
深圳市南山区松坪村三期 4 套人才房	1,078,669.47	
深圳市罗湖区莲馨家园 6 套人才房	4,289,514.02	
深圳市福田区信托花园 8 栋 202 房	482,061.38	因历史原因未办理房产证
绵阳中大财富广场 20-22 层商品房	21,902,148.69	因开发商涉及诉讼，尚未开庭
小 计	32,791,300.07	

14. 在建工程

(1) 明细情况

工程名称	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
国信金融大厦项目（深圳）	857,093,078.23		857,093,078.23	802,998,947.98		802,998,947.98
国信金融大厦装修项目	14,589,520.75		14,589,520.75			
分支机构装修项目	4,030,749.52		4,030,749.52			
总部东莞机房建设	2,942,357.52		2,942,357.52	1,833,321.15		1,833,321.15
国信证券大厦项目（义乌）	538,038.08		538,038.08	538,038.08		538,038.08
国信证券大厦项目（义乌）装修项目				8,030,074.52		8,030,074.52
绵阳中大财富广场				18,868,971.90		18,868,971.90

工程名称	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
合计	879,193,744.10		879,193,744.10	832,269,353.63		832,269,353.63

(2) 重要在建工程项目本期变动情况

工程名称	预算数 (万元)	期初数	本期增加	转入固定 资产	其他减少	期末数
国信金融大厦 项目(深圳)	134,690	802,998,947.98	54,094,130.25			857,093,078.23
小计	134,690	802,998,947.98	54,094,130.25			857,093,078.23

(续上表)

工程名称	工程累计投入 占预算比例(%)	工程 进度(%)	利息资本 化累计金额	本期利息 资本化金额	本期利息资本 化率(%)	资金来源
国信金融大厦 项目(深圳)	63.63	63.63				自有资金
小计	63.63	63.63				

15. 无形资产

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合计
账面原值					
期初数	591,433,100.00	424,425,593.25	66,577,562.50	9,152,694.20	1,091,588,949.95
本期增加金额	6,694,857.00	23,351,237.76		2,503.64	30,048,598.40
(1) 购置	6,694,857.00	23,351,237.76		2,503.64	30,048,598.40
本期减少金额					
(1) 处置					
期末数	598,127,957.00	447,776,831.01	66,577,562.50	9,155,197.84	1,121,637,548.35
累计摊销					
期初数	138,156,106.75	257,699,436.50	36,824,817.12	2,366,356.69	435,046,717.06
本期增加金额	5,967,803.75	28,601,696.93		124,112.76	34,693,613.44
(1) 计提	5,967,803.75	28,495,897.86		124,112.93	34,587,814.54
(2) 外币报表折算差额		105,799.07		-0.17	105,798.90
本期减少金额					

项 目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合 计
(1) 处置					
期末数	144,123,910.50	286,301,133.43	36,824,817.12	2,490,469.45	469,740,330.50
减值准备					
期初数		3,486.11			3,486.11
本期增加金额					
本期减少金额					
期末数		3,486.11			3,486.11
账面价值					
期末账面价值	454,004,046.50	161,472,211.47	29,752,745.38	6,664,728.39	651,893,731.74
期初账面价值	453,276,993.25	166,722,670.64	29,752,745.38	6,786,337.51	656,538,746.78

16. 商誉

(1) 商誉账面原值

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初数	本期企业合并形成	本期减少		期末数
			处置	其他	
收购证券营业部	22,135,974.26				22,135,974.26
收购子公司	10,260,249.61				10,260,249.61
其中：国信期货公司	10,260,249.61				10,260,249.61
合 计	32,396,223.87				32,396,223.87

(2) 商誉减值准备

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初数	本期增加		本期减少		期末数
		计提	其他	处置	其他	
收购证券营业部	22,135,974.26					22,135,974.26
小 计	22,135,974.26					22,135,974.26

(3) 商誉减值测试过程

1) 收购证券营业部

本公司收购民安证券有限责任公司（以下简称民安证券）17家营业部计提的商誉减值。本公司于2006年1月收购民安证券17家营业部，收购对价与民安证券17家营业部净资产账面价值的差额12,501,991.26元计入商誉。其余9,633,983.00元系本公司历年收购其他

证券营业部形成的商誉。

2008年本公司对上述商誉余额进行减值测试，计提商誉减值准备 22,135,974.26 元。

2) 收购国信期货公司

本公司于 2007 年 8 月收购国信期货公司，收购对价与国信期货公司净资产账面价值的差额 10,260,249.61 计入商誉。

目前国内商品期货市场呈现出快速发展的趋势，市场的影响力越来越大，上市品种越来越丰富，相关的资金正不断地进入期货市场，套期保值的能力被越来越多的投资者所接受。在未来较长的时间内，商品期货的发展依然延续。随着期货新品种的不断推出，期货市场的发展空间巨大。国信期货公司业已取得商品期货及金融期货的业务资格，预计国信期货公司的可收回金额高于其账面价值，本公司由此判断该商誉不存在减值迹象。

17. 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

项 目	期末数		期初数	
	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
计提未付的应付职工薪酬	3,113,757,469.58	778,347,771.71	3,292,350,203.91	822,995,955.28
资产减值准备	3,207,775,151.59	801,943,787.93	2,303,208,672.98	575,802,168.29
金融工具公允价值变动	728,172,905.84	182,043,226.40	623,495,071.69	155,873,767.86
预计负债	405,865,604.38	101,466,401.10	217,949,894.60	54,487,473.65
递延收益	131,503,448.58	32,875,862.22	133,241,379.60	33,310,344.96
其他	1,726,509.48	431,627.37	5,673,638.44	1,418,409.61
合 计	7,588,801,089.45	1,897,108,676.73	6,575,918,861.22	1,643,888,119.65

(2) 未经抵销的递延所得税负债

项 目	期末数		期初数	
	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
金融工具公允价值变动	1,045,136,653.07	261,229,374.09	858,261,430.69	214,523,937.61
合营/联营企业损益变动	325,942,974.52	81,485,743.63	351,828,407.46	87,947,241.81

项 目	期末数		期初数	
	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
合 计	1,371,079,627.59	342,715,117.72	1,210,089,838.15	302,471,179.42

(3) 未确认递延所得税资产明细

项 目	期末数	期初数
可抵扣暂时性差异	859,634,739.20	914,676,441.51
可抵扣亏损	557,371,279.79	528,733,147.23
小 计	1,417,006,018.99	1,443,409,588.74

(4) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

未确认递延所得税资产的可抵扣亏损系本公司之子公司国信香港公司尚在可补亏年度内的亏损额，预计该公司短期难以补亏，故未确认递延所得税资产，且该亏损额无抵扣时间限制。

18. 其他资产

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
长期待摊费用	111,982,190.55	113,854,353.37
其他应收款	110,095,138.65	88,614,152.95
预付款项	70,104,425.55	89,775,104.27
待认证进项税	61,208,131.95	43,876,768.96
预缴税金	18,934,023.67	18,005,386.89
应收股利	8,129,155.32	5,629,192.19
期货会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00
待抵扣进项税	11,421.43	172,517.72
大宗商品		20,063,837.32
合 计	381,864,487.12	381,391,313.67

(2) 其他应收款

1) 类别明细情况

种 类	期末数
-----	-----

	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	7,300,000.00	5.97	7,300,000.00	100.00	
按组合计提坏账准备	114,954,159.16	94.03	4,859,020.51	4.23	110,095,138.65
其中：应收往来款组合	28,649,199.15	23.44	4,859,020.51	16.96	23,790,178.64
应收押金保证金组合	86,304,960.01	70.59			86,304,960.01
合 计	122,254,159.16	100.00	12,159,020.51	9.95	110,095,138.65

2) 期末单项计提坏账准备的其他应收款

其他应收款内容	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
中国华兴集团公司	7,300,000.00	7,300,000.00	100.00	处于关停状态

3) 按组合计提坏账准备的其他应收款

种 类	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	9,078,404.90	31.69	128,030.42	1.41
1至2年	776,717.55	2.71	37,740.85	4.86
2至3年	1,765,503.87	6.16	176,548.14	10.00
3年以上	17,028,572.83	59.44	4,516,701.10	26.52
合 计	28,649,199.15	100.00	4,859,020.51	16.96

(3) 长期待摊费用

项 目	期初数	本期增加	本期摊销	其他减少	期末数	其他减少的原因
办公家私	12,899,037.11	2,655,326.39	2,480,860.49		13,073,503.01	
装修费及其他	100,955,316.26	19,791,078.27	21,837,706.99		98,908,687.54	
合 计	113,854,353.37	22,446,404.66	24,318,567.48		111,982,190.55	

19. 资产减值准备明细

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期减少		外币报表折算差 额	期末数
			转回	转销/核销		
融出资金减值准备	103,583,708.54	14,052,952.27	188,239.20		3,703.25	117,452,124.86
应收款项坏账准备	1,106,173,287.13	79,779,932.77	1,646,752.81		12,668,718.04	1,196,975,185.13
买入返售金融资产减值准备	1,851,490,036.87	811,216,146.71				2,662,706,183.58
其他债权投资减值准备	52,944,876.24	129,695,981.07	27,531,361.04	8,912,270.38		146,197,225.89
其他应收款坏账准备	10,890,843.72	1,268,176.79				12,159,020.51
金融工具及其他项目信用减值准备小计	3,125,082,752.50	1,036,013,189.61	29,366,353.05	8,912,270.38	12,672,421.29	4,135,489,739.97
商誉减值准备	22,135,974.26					22,135,974.26
大宗商品跌价准备	141,107.50	5,893,797.90		6,034,905.40		
无形资产减值准备	3,486.11					3,486.11
其他资产减值准备小计	22,280,567.87	5,893,797.90		6,034,905.40		22,139,460.37
合 计	3,147,363,320.37	1,041,906,987.51	29,366,353.05	14,947,175.78	12,672,421.29	4,157,629,200.34

(2) 金融工具及其他项目预期信用损失准备

项 目	期末数			小 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）	
买入返售金融资产减值准备	20,895,123.76	24,582,485.74	2,617,228,574.08	2,662,706,183.58
应收款项坏账准备（简化模型）		12,787,248.19	1,184,187,936.94	1,196,975,185.13
融出资金减值准备	73,421,896.92	384,399.96	43,645,827.98	117,452,124.86
其他债权投资减值准备	28,490,017.83	81,472,364.37	36,234,843.69	146,197,225.89
其他应收款减值准备（一般模型）	4,859,020.51		7,300,000.00	12,159,020.51
合 计	127,666,059.02	119,226,498.26	3,888,597,182.69	4,135,489,739.97

20. 短期借款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
信用借款	156,003,429.61	206,320,895.36
抵押借款	32,402,000.00	90,000,000.00
合 计	188,405,429.61	296,320,895.36

(2) 抵押借款抵押物信息

抵押借款系本公司之子公司国信香港公司的短期借款余额，为抵押借款而设定抵押的资产为孖展业务客户向国信香港公司提供的担保物，期末价值为人民币 239,185,454.39 元。

21. 应付短期融资款

项目	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率	期初数	本期增加	本期减少	期末数
19 国信 CP009	3,000,000,000.00	2019-10-30	84 天	3,000,000,000.00	3.00%	3,015,491,803.28	5,163,934.42	3,020,655,737.70	
19 国信 CP010	2,500,000,000.00	2019-11-13	90 天	2,500,000,000.00	3.10%	2,510,375,683.06	8,681,693.99	2,519,057,377.05	
19 国信 CP011	2,500,000,000.00	2019-11-27	90 天	2,500,000,000.00	3.07%	2,507,339,480.87	11,533,469.95	2,518,872,950.82	
19 国信 CP012	3,000,000,000.00	2019-12-11	90 天	3,000,000,000.00	3.05%	3,005,250,000.00	17,250,000.00	3,022,500,000.00	
19 国信 CP013	3,000,000,000.00	2019-12-23	88 天	3,000,000,000.00	3.03%	3,002,235,245.90	19,620,491.80	3,021,855,737.70	
20 国信 CP001	4,000,000,000.00	2020-1-22	90 天	4,000,000,000.00	2.80%		4,027,540,983.61	4,027,540,983.61	
20 国信 CP002	4,000,000,000.00	2020-2-19	90 天	4,000,000,000.00	2.52%		4,024,786,885.25	4,024,786,885.25	
20 国信 CP003	3,000,000,000.00	2020-3-9	88 天	3,000,000,000.00	2.28%		3,016,490,958.90	3,016,490,958.90	
20 国信 CP004	3,000,000,000.00	2020-3-23	88 天	3,000,000,000.00	2.03%		3,014,682,739.73	3,014,682,739.73	
20 国信 CP005	3,000,000,000.00	2020-4-14	91 天	3,000,000,000.00	1.50%		3,009,616,438.36		3,009,616,438.36
20 国信 CP006	3,500,000,000.00	2020-4-23	90 天	3,500,000,000.00	1.38%		3,509,130,684.93		3,509,130,684.93
20 国信 CP007	4,000,000,000.00	2020-5-15	90 天	4,000,000,000.00	1.55%		4,007,983,561.64		4,007,983,561.64
20 国信 CP008	4,000,000,000.00	2020-6-9	87 天	4,000,000,000.00	2.20%		4,005,304,109.59		4,005,304,109.59
20 国信 CP009	3,000,000,000.00	2020-6-15	88 天	3,000,000,000.00	2.25%		3,002,958,904.11		3,002,958,904.11
收益凭证[注]	22,059,507,000.00			22,059,507,000.00		4,002,630,610.99	18,178,219,402.10	5,001,319,999.08	17,179,530,014.01
合计	67,559,507,000.00			67,559,507,000.00		18,043,322,824.10	49,858,964,258.38	33,187,763,369.84	34,714,523,712.64

[注]本公司 2020 年 1-6 月共发行 232 期收益凭证，其中一年期以下 149 期，一年期以上 83 期；一年期以下收益凭证未到期产品共 165 期，固定收益率为 1.9%至 3.6%；一年期以上收益凭证未到期产品共 158 期，固定收益率为 2.90%至 10%

22. 拆入资金

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
银行拆入资金		300,024,166.67
转融通拆入资金	3,038,390,654.37	5,051,564,009.20
合 计	3,038,390,654.37	5,351,588,175.87

(2) 转融通拆入资金

剩余期限	期末数		期初数	
	金额	利率区间	金额	利率区间
1个月以内			1,019,397,342.53	4.30%
1至3个月	3,038,390,654.37	3.50%	2,024,402,777.78	3.50%
3至12个月			2,007,763,888.89	3.25%
合 计	3,038,390,654.37		5,051,564,009.20	

23. 交易性金融负债

项 目	期末数		
	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
第三方在结构化主体中享有的权益	68,871,816.13		68,871,816.13
融入证券	46,286,429.26		46,286,429.26
合 计	115,158,245.39		115,158,245.39

(续上表)

项 目	期初数		
	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
债券借贷	151,366,011.48		151,366,011.48
第三方在结构化主体中享有的权益	69,548,044.53		69,548,044.53
结构性票据	63,791,848.50		63,791,848.50
合 计	284,705,904.51		284,705,904.51

24. 卖出回购金融资产款

(1) 明细情况——按业务类型

项 目	期末数	期初数
质押式卖出回购	42,928,886,078.60	36,305,454,067.64
质押式报价回购	5,605,285,515.81	5,413,327,187.49
买断式卖出回购	40,137,969.13	104,348,125.34
合 计	48,574,309,563.54	41,823,129,380.47

(2) 明细情况——按金融资产种类

项 目	期末数	期初数
债券	48,574,309,563.54	41,823,129,380.47
合 计	48,574,309,563.54	41,823,129,380.47

(3) 质押式报价回购融入资金按剩余期限分类列示

剩余期限	期末数		期初数	
	金额	利率区间	金额	利率区间
1个月以内	5,515,113,754.13	1.45%-6.08%	5,313,806,961.49	2%-6.08%
1至3个月	54,499,427.39	1.9%-6.08%	57,205,668.90	2.4%-6.08%
3至12个月	35,672,334.29	2%-2.8%	42,314,557.10	2%-6.08%
合 计	5,605,285,515.81		5,413,327,187.49	

(4) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
债券	57,311,872,469.37	47,217,166,620.50
合 计	57,311,872,469.37	47,217,166,620.50

25. 代理买卖证券款

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
普通经纪业务		
其中：个人	46,370,950,126.49	37,025,381,135.61
机构	7,039,487,481.46	4,854,739,369.81

项 目	期末数	期初数
小 计	53,410,437,607.95	41,880,120,505.42
信用业务		
其中：个人	5,621,180,987.29	4,494,540,145.98
机构	771,480,346.10	212,796,809.60
小 计	6,392,661,333.39	4,707,336,955.58
合 计	59,803,098,941.34	46,587,457,461.00

(2) 分币种列示

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
人民币			57,757,785,529.51			44,818,698,804.57
美元	76,484,394.23	7.0795	541,471,268.93	65,713,635.05	6.9762	458,431,461.00
港币	1,646,422,315.31	0.9134	1,503,842,142.90	1,462,745,250.56	0.8958	1,310,327,195.43
合 计			59,803,098,941.34			46,587,457,461.00

26. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	3,593,794,130.50	2,170,771,572.81	2,330,623,357.26	3,433,942,346.05
离职后福利—设定提存计划	3,911,724.24	89,877,630.53	91,969,107.45	1,820,247.32
合 计	3,597,705,854.74	2,260,649,203.34	2,422,592,464.71	3,435,762,593.37

(2) 短期薪酬明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	3,314,518,956.70	1,938,791,503.61	2,110,946,567.07	3,142,363,893.24
职工福利费		39,210,563.01	39,210,563.01	
社会保险费	678,057.13	43,050,556.64	43,295,582.35	433,031.42
其中：医疗保险费	580,663.49	38,729,433.72	38,943,083.80	367,013.41
工伤保险费	40,339.79	429,169.24	435,166.72	34,342.31
生育保险费	57,053.85	3,891,953.68	3,917,331.83	31,675.70

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
住房公积金	190,533.63	94,610,283.35	94,557,535.35	243,281.63
工会经费和职工教育经费	278,405,983.04	39,437,537.27	26,941,980.55	290,901,539.76
其他短期薪酬	600.00	15,671,128.93	15,671,128.93	600.00
小 计	3,593,794,130.50	2,170,771,572.81	2,330,623,357.26	3,433,942,346.05

(3) 设定提存计划明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	1,776,422.63	49,351,595.22	49,394,198.17	1,733,819.68
失业保险费	30,648.87	-2,947,393.24	-2,937,295.81	20,551.44
补充养老保险(企业年金)	2,104,652.74	43,473,428.55	45,512,205.09	65,876.20
小 计	3,911,724.24	89,877,630.53	91,969,107.45	1,820,247.32

27. 应交税费

项 目	期末数	期初数
企业所得税	588,724,586.78	413,020,333.64
代扣代缴税金	150,495,175.25	378,477,000.18
其中：代扣代缴个人所得税	41,757,275.41	65,369,883.15
增值税	76,629,417.31	68,882,428.41
城市维护建设税	5,464,811.14	4,629,581.25
教育费附加及地方教育费附加	3,899,319.08	3,279,436.99
房产税	640,516.20	1,665,713.18
其他	794,410.60	959,485.27
合 计	826,648,236.36	870,913,978.92

28. 应付款项

项 目	期末数	期初数
应付资管计划 A 份额净值	3,694,408,806.55	5,195,997,434.50
待交付清算款	1,684,515,395.52	674,007,730.54
股票质押回购项目法院执行款	540,000,000.00	

项 目	期末数	期初数
应付资管产品认购款	133,838,341.13	178,476,300.54
应付赎回款	99,442,940.41	43,314,019.58
应付投资者保护基金	38,007,399.52	30,820,560.24
应付投行手续费支出	29,203,347.50	26,536,052.05
应付资管产品增值税及附加	28,445,564.23	35,532,378.61
应付外单位往来款	16,331,734.81	41,654,823.37
应付银行三方存管费	11,125,694.11	9,897,113.90
应付股票借贷保证金	8,616,055.08	31,170,043.77
银行中间业务费	6,806,816.20	6,806,816.20
其他	31,774,151.89	18,508,868.34
合 计	6,322,516,246.95	6,292,722,141.64

29. 预计负债

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
行政罚款[注 1]	16,800,000.00		16,800,000.00	
未决诉讼[注 2]	217,949,894.60	187,915,709.78		405,865,604.38
合 计	234,749,894.60	187,915,709.78	16,800,000.00	405,865,604.38

[注 1]根据本公司与深圳市国土资源和房产管理局签订的《深圳市土地使用权出让合同书》、《补充协议》以及《深圳市建设用地开工竣工管理办法（试行）》的相关规定，截至 2019 年 12 月 31 日，国信金融大厦（深圳）项目已逾期 2 年以上，需按照土地出让金的 20%支付违约金计人民币 16,800,000.00 元，该违约金已于 2020 年 1-6 月支付

[注 2]本公司对多起涉诉案件进行审慎判断，并根据相关裁决书，计提了预计负债 405,865,604.38 元

30. 递延收益

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
购地补偿款[注]	133,241,379.60		1,737,931.02	131,503,448.58
合 计	133,241,379.60		1,737,931.02	131,503,448.58

[注]系本公司 2010 年度收到的深圳市人民政府的金融发展专项资金。根据深圳市人民

政府发布的《深圳市人民政府关于印发深圳市支持金融业发展若干规定的通知》及《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》，本公司于 2010 年度收到深圳市人民政府金融发展专项资金计人民币 168,000,000.00 元，截至 2020 年 6 月 30 日，本公司按照剩余土地使用年限摊销累计结转计人民币 36,496,551.42 元。根据《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》的相关规定，本公司取得该项金融发展专项资金的前提是承诺 10 年内不迁离深圳

31. 应付债券

类型	债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率	期初数	本期增加	本期减少	期末余额
公司债	17 国信 01	5,000,000,000.00	2017-4-14	3 年	5,000,000,000.00	4.39%	5,156,686,276.77	62,813,723.23	5,219,500,000.00	
公司债	17 国信 02	6,000,000,000.00	2017-7-13	3 年	6,000,000,000.00	4.58%	6,128,727,763.95	137,062,399.98		6,265,790,163.93
公司债	17 国信 03	3,000,000,000.00	2017-10-18	3 年	3,000,000,000.00	4.80%	3,029,181,654.54	71,824,252.06		3,101,005,906.60
次级债	18 国信 C1	1,100,000,000.00	2018-5-23	2 年	1,100,000,000.00	5.29%	1,135,454,562.84	22,735,437.16	1,158,190,000.00	
公司债	18 国信 01	2,300,000,000.00	2018-1-17	2 年	2,300,000,000.00	5.55%	2,421,984,572.29	5,665,427.71	2,427,650,000.00	
公司债	18 国信 03	3,700,000,000.00	2018-8-8	3 年	3,700,000,000.00	3.97%	3,757,921,292.94	73,208,791.82		3,831,130,084.76
公司债	18 国信 04	3,000,000,000.00	2018-11-19	3 年	3,000,000,000.00	4.15%	3,014,194,659.21	62,027,760.66		3,076,222,419.87
公司债	19 国信 01	1,500,000,000.00	2019-3-11	3 年	1,500,000,000.00	4.05%	1,548,875,644.35	30,318,910.60	60,750,000.00	1,518,444,554.95
公司债	19 国信 02	3,500,000,000.00	2019-4-8	3 年	3,500,000,000.00	4.00%	3,601,894,557.46	69,843,095.47	140,000,000.00	3,531,737,652.93
公司债	19 国信 03	4,000,000,000.00	2019-7-4	3 年	4,000,000,000.00	4.00%	4,078,339,519.54	79,720,074.22		4,158,059,593.76
公司债	20 国信 01	3,000,000,000.00	2020-1-13	3 年	3,000,000,000.00	3.60%		3,052,050,726.89	11,320,754.72	3,040,729,972.17
公司债	20 国信 02	5,000,000,000.00	2020-3-2	3 年	5,000,000,000.00	3.17%		5,054,640,271.66	18,867,924.53	5,035,772,347.13
收益凭证	[注]	3,750,786,000.00		3 年	3,750,786,000.00		3,676,075,792.67	162,561,954.31	181,469,863.02	3,657,167,883.96
合计		44,850,786,000.00			44,850,786,000.00		37,549,336,296.56	8,884,472,825.77	9,217,748,542.27	37,216,060,580.06

[注]详见本财务报表附注五(一)21 应付短期融资款[注]之说明,期末未到期一年期以上的收益凭证共 158 期,固定收益率为 2.90%至 10%

32. 其他负债

项 目	期末数	期初数[注 1]
应付货币保证金[注 2]	6, 271, 845, 493. 78	5, 565, 047, 036. 49
应付质押保证金[注 2]	975, 921, 544. 00	1, 006, 015, 440. 00
其他应付款	258, 132, 104. 58	285, 660, 174. 09
期货风险准备金	86, 779, 320. 69	82, 618, 310. 60
应付利息	17, 903, 413. 65	3, 470, 065. 09
代理兑付债券款	323, 800. 00	323, 800. 00
其他	10, 615, 997. 65	4, 787, 453. 29
合 计	7, 621, 521, 674. 35	6, 947, 922, 279. 56

[注 1]期初数与上期期末余额（2019 年 12 月 31 日）差异详见本财务报表附注三（三十四）1 之说明

[注 2]系本公司之子公司国信期货公司应付个人及法人的客户保证金

33. 股本

项 目	期初数	本期增减变动（减少以“—”表示）					期末数
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	8, 200, 000, 000. 00						8, 200, 000, 000. 00

34. 其他权益工具

(1) 期末发行在外的永续债基本情况

2015 年 4 月 15 日，本公司第三届董事会第十三次会议决议通过，同意本公司发行永续次级债的余额规模上限不超过 200 亿元，由本公司根据业务发展需要分期发行，本决议的有效期为自股东大会审议通过之日起三十六个月内有效；中国证监会于 2015 年 6 月 15 日出具《关于国信证券股份有限公司试点发行永续次级债券的无异议函》（机构部函[2015]1809 号），对本公司试点发行永续次级债券无异议。

2015 年 6 月 25 日，本公司完成了 2015 年第一期永续次级债券发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 5.80%。无到期日，第 5 个和其后每个付息日，本公司有权按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回本息。本年债券采用浮动

利率形式，单利按年计息，前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起，每 5 年重置一次票面利率。如果本公司不行使赎回权，则从第 6 个计息年度开始票面利率调整为当期基准利率加上基本利差再加上 300 个基点（1 个基点为 0.01%）。

除非发生强制付息事件，本年永续次级债的每个付息日，发行人可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；强制付息事件：付息日前 12 个月，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红，（2）减少注册资本。

2020 年 5 月 13 日，公司公告决定不行使发行人续期选择权，并对登记在册的 2015 年第一期永续次级债券全部赎回，并在 2020 年 6 月 29 日（2020 年 6 月 25 日为法定节假日，顺延至其后的第 1 个交易日）完成全额兑付。

本公司 2020 年 1-6 月支付永续次级债利息计人民币 290,000,000.00 元。

（2）期末发行在外的永续债变动情况

项 目	期初数		本期增加		本期减少		期末数	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
2015 年第一期永续次级债券		5,000,000,000.00				5,000,000,000.00		
合 计		5,000,000,000.00				5,000,000,000.00		

35. 资本公积

（1）明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
股本溢价	6,682,414,105.09			6,682,414,105.09
其他资本公积	86,819,065.72		128,583.80	86,690,481.92
合 计	6,769,233,170.81		128,583.80	6,769,104,587.01

（2）其他说明

其他资本公积本期变动主要是联营企业资本公积变动所致。

36. 其他综合收益

项 目	期初数	本期发生额				减：其他综合收益 结转留存收益	期末数
		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	税后归属于母公 司		
不能重分类进损益的其他 综合收益	188,608,398.54	-152,579,117.58	-38,144,779.38		-114,434,338.20	-30,670,140.58	104,844,200.92
其中：其他权益工具投资公 允价值变动	188,608,398.54	-152,579,117.58	-38,144,779.38		-114,434,338.20	-30,670,140.58	104,844,200.92
以后将重分类进损益的其 他综合收益	137,421,084.74	89,280,561.48	10,273,166.69	28,549,436.96	50,457,957.83		187,879,042.57
其中：权益法下在被投资单 位以后将重分类进损益的 其他综合收益中享有的份 额	22,909,502.58	11,922,584.71			11,922,584.71		34,832,087.29
其他债权投资公允价值变 动	71,302,327.75	-30,422,185.97	-13,039,920.72	21,737,496.89	-39,119,762.14		32,182,565.61
其他债权投资信用减值准 备	39,708,657.15	100,064,289.72	23,313,087.41	6,811,940.07	69,939,262.24		109,647,919.39
外币财务报表折算差额	3,500,597.26	7,715,873.02			7,715,873.02		11,216,470.28
合 计	326,029,483.28	-63,298,556.10	-27,871,612.69	28,549,436.96	-63,976,380.37	-30,670,140.58	292,723,243.49

37. 盈余公积

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	4,212,265,617.55			4,212,265,617.55
合 计	4,212,265,617.55			4,212,265,617.55

38. 一般风险准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
一般风险准备	5,933,554,502.89	6,737,598.38		5,940,292,101.27
交易风险准备	5,740,498,988.44			5,740,498,988.44
合 计	11,674,053,491.33	6,737,598.38		11,680,791,089.71

39. 未分配利润

项 目	本期数	上年同期数
调整前上期末未分配利润	20,027,506,956.75	17,672,629,740.29
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		-4,161,141.93
调整后期初未分配利润	20,027,506,956.75	17,668,468,598.36
加：本期归属于母公司所有者的净利润	2,945,533,795.86	2,597,829,436.15
减：提取法定盈余公积		
提取一般风险准备	6,737,598.38	28,555,556.70
应付普通股股利	1,640,000,000.00	984,000,000.00
永续次级债券利息支出	290,000,000.00	104,280,821.92
其他综合收益结转留存收益	30,670,140.58	276,860,894.88
期末未分配利润	21,005,633,013.65	18,872,600,761.01

(二) 合并利润表项目注释

1. 手续费及佣金净收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
证券经纪业务净收入	2,688,942,153.85	2,210,616,836.85

项 目	本期数	上年同期数
证券经纪业务收入	3,172,328,813.96	2,608,515,524.01
代理买卖证券业务	2,779,653,129.05	2,408,156,120.74
交易单元席位租赁	152,070,566.06	117,776,415.08
代销金融产品业务	240,605,118.85	82,582,988.19
证券经纪业务支出	483,386,660.11	397,898,687.16
代理买卖证券业务	483,386,660.11	397,898,687.16
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
期货经纪业务净收入	83,828,037.33	65,147,498.80
期货经纪业务收入	84,518,022.23	65,836,214.78
期货经纪业务支出	689,984.90	688,715.98
投资银行业务净收入	595,994,564.93	489,166,032.89
投资银行业务收入	609,646,901.09	506,792,974.28
证券承销业务	552,922,365.64	422,789,891.11
证券保荐业务	32,045,046.95	24,465,936.65
财务顾问业务	24,679,488.50	59,537,146.52
投资银行业务支出	13,652,336.16	17,626,941.39
证券承销业务	13,652,336.16	17,626,941.39
证券保荐业务		
财务顾问业务		
资产管理业务净收入	130,165,134.95	111,799,568.22
资产管理业务收入	136,233,796.81	116,753,937.22
资产管理业务支出	6,068,661.86	4,954,369.00
基金管理业务净收入	42,031,639.69	12,289,157.18
基金管理业务收入	48,171,477.53	24,843,297.93
基金管理业务支出	6,139,837.84	12,554,140.75
投资咨询业务净收入	21,982,272.96	19,814,410.40
投资咨询业务收入	21,982,272.96	19,814,410.40

项 目	本期数	上年同期数
投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	109,723,605.67	125,166,597.05
其他手续费及佣金收入	110,352,437.93	125,166,597.05
其他手续费及佣金支出	628,832.26	
合 计	3,672,667,409.38	3,034,000,101.39
其中：手续费及佣金收入总计	4,183,233,722.51	3,467,722,955.67
手续费及佣金支出总计	510,566,313.13	433,722,854.28

(2) 财务顾问业务净收入

项 目	本期数	上年同期数
并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司	8,888,679.25	30,651,886.78
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	15,790,809.25	28,885,259.74
小 计	24,679,488.50	59,537,146.52

(3) 代理销售金融产品收入

项 目	本期数	上年同期数
基金	201,352,310.77	67,714,036.36
其他金融产品	39,252,808.08	14,868,951.83
小 计	240,605,118.85	82,582,988.19

代理销售金融产品的销售总额

项 目	本期数	上年同期数
基金	28,994,190,596.19	8,858,236,950.36
其他金融产品	3,557,139,811.26	3,149,051,555.83
小 计	32,551,330,407.45	12,007,288,506.19

(4) 资产管理业务开展及收入明细情况

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	83	138	38
期末客户数量	94,100	124	397

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
其中：个人客户	93,880	29	12
机构客户	220	95	385
期初受托资金	30,807,617,662.13	95,467,923,677.46	24,400,800,319.67
其中：自有资金投入	3,959,340,116.65		
个人客户	19,396,569,568.86	4,964,922,103.86	92,160,439.09
机构客户	7,451,707,976.62	90,503,001,573.60	24,308,639,880.58
期末受托资金	34,133,183,399.78	143,329,127,138.71	24,757,298,330.84
其中：自有资金投入	4,128,023,544.08		
个人客户	20,264,284,569.48	4,936,473,684.44	85,884,282.09
机构客户	9,740,875,286.22	138,392,653,454.27	24,671,414,048.75
期末主要受托资产初始成本	31,837,561,672.23	142,669,530,215.59	24,548,889,249.64
其中：股票	5,471,908,690.34	11,467,148,075.34	102,158,600.25
国债	215,782,049.35		
其他债券	23,423,381,489.61	2,689,649,210.36	10,297,302.52
基金	2,044,374,257.01	5,876,817.62	11,486,500.05
其他	682,115,185.92	128,506,856,112.27	24,424,946,846.82
本期资产管理业务净收入	89,561,072.42	40,062,248.27	541,814.26

2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	3,505,949,941.89	3,077,465,183.77
货币资金及结算备付金利息收入	698,290,855.94	592,507,751.65
融资融券利息收入	1,446,052,877.48	1,286,536,932.09
买入返售金融资产利息收入	1,026,712,516.33	924,682,101.06
其中：约定购回利息收入	1,786,101.90	4,366,940.81
股票质押回购利息收入	1,016,381,081.08	910,110,929.86
其他债权投资利息收入	324,953,806.44	270,649,832.23
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	9,939,885.70	3,088,566.74

项 目	本期数	上年同期数
利息支出	1,844,093,990.02	2,277,870,992.39
短期借款利息支出	4,830,846.93	11,251,242.58
应付短期融资券利息支出	270,474,862.16	328,613,650.58
拆入资金利息支出	94,950,365.20	45,209,986.61
其中：转融通利息支出	91,194,771.87	19,445,539.41
卖出回购金融资产利息支出	484,818,630.47	702,387,130.60
其中：报价回购利息支出	52,786,711.54	60,981,343.91
代理买卖证券款利息支出	88,219,418.82	74,746,574.38
应付债券利息支出	792,300,825.75	990,738,032.81
其中：次级债券利息支出	22,735,437.16	187,788,739.73
份额 A 持有人利息支出	75,532,033.81	110,710,104.88
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	32,967,006.88	14,214,269.95
利息净收入	1,661,855,951.87	799,594,191.38

3. 投资收益

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	260,839,500.68	180,958,687.21
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	2,189,949,939.25	1,707,617,445.60
其中：持有期间取得的收益	1,550,318,446.30	1,593,873,227.33
— 交易性金融工具	1,509,825,581.32	1,447,942,365.66
— 其他权益工具投资	40,492,864.98	145,930,861.67
— 衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	639,631,492.95	113,744,218.27
— 交易性金融工具	516,568,481.30	-9,544,141.75
— 其他债权投资	103,490,299.38	31,554,726.91
— 衍生金融工具	19,572,712.27	91,733,633.11

项 目	本期数	上年同期数
其他	-84,299,070.69	-49,478,951.01
合 计	2,366,490,369.24	1,839,097,181.80

(2) 按权益法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增 减变动的的原因
联营企业:			
鹏华基金公司	201,932,128.16	118,458,380.21	被投资单位净 利润变化
前海股交投资控股(深圳)有限公司	-842,404.60	-2,312,974.86	被投资单位净 利润变化
常州高新投创业投资有限公司	911,703.98	3,371,978.61	被投资单位净 利润变化
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金(有限合伙)	20,291,498.41	16,493,114.57	被投资单位净 利润变化
深圳市前海弘泰基金管理有限公司	-60,274.18	33,123.27	被投资单位净 利润变化
深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司	-31.40	6.83	被投资单位净 利润变化
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	14,394,346.46	81,972,037.11	被投资单位净 利润变化
浙江金融资产交易中心股份有限公司		-37,154,169.85	被投资单位净 利润变化
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	780,937.51	93,245.46	被投资单位净 利润变化
深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙)	365,129.04	-586,920.14	被投资单位净 利润变化
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	160,436.04	-468,834.74	被投资单位净 利润变化
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有限合伙)	329,965.74	3,197,740.25	被投资单位净 利润变化
深圳弘盛道格体育投资合伙企业(有限合伙)	-417,492.80	-415,852.53	被投资单位净 利润变化
深圳市中亚亿百投资企业(有限合伙)	4.51	-117.52	被投资单位净 利润变化
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	3,475,004.76	491,501.57	被投资单位净 利润变化
华润宝塔股权投资(延安)有限公司	-284,258.51	-160,214.88	被投资单位净 利润变化
深圳市五色检测技术服务有限公司	-147,806.36	-46,418.40	被投资单位净 利润变化

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
小 计	240,888,886.76	182,965,624.96	
合营企业:			
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金	7,923,055.39	-2,158,403.14	被投资单位净利润变化
深圳市国信蓝思基金管理有限公司	200,496.27	93,568.02	被投资单位净利润变化
深圳市国信锦源天仪股权投资企业(有限合伙)		-5,921.26	被投资单位净利润变化
珠海国信运通股权投资基金(有限合伙)	-329,946.25	-313,234.02	被投资单位净利润变化
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业(有限合伙)	6,850,302.98	9,313.95	被投资单位净利润变化
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	5,306,705.53	367,738.70	被投资单位净利润变化
小 计	19,950,613.92	-2,006,937.75	
合 计	260,839,500.68	180,958,687.21	

(3) 交易性金融工具投资收益

交易性金融工具		本期数	上年同期数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	1,509,825,581.32	1,447,942,365.66
	处置期间收益	510,776,186.09	-19,505,595.11
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置期间收益	5,792,295.21	9,961,453.36
合 计		2,026,394,062.62	1,438,398,223.91

4. 其他收益

项 目	本期数		上年同期数	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	发生额	计入当期非经常性损益的金额
与资产相关的政府补助[注]	1,737,931.02	1,737,931.02	1,737,931.02	1,737,931.02
与收益相关的政府补助[注]	439,769.12	439,769.12	174,692.34	174,692.34
代扣个人所得税手续费返还	15,189,835.42		2,902,961.96	
合 计	17,367,535.56	2,177,700.14	4,815,585.32	1,912,623.36

[注]本期计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注五(四)2之说明

5. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
交易性金融资产	142,070,305.41	865,231,708.85
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	-3,890,275.91	-8,620,331.84
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	-41,943,360.47	-179,441,527.39
合 计	96,236,669.03	677,169,849.62

6. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品销售收入	208,698,481.38	156,974,549.14
房租收入	12,791,392.86	14,223,907.90
其他	3,837,220.75	9,721,059.58
合 计	225,327,094.99	180,919,516.62

7. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	30,894,317.77	23,987,394.49
教育费附加及地方教育费附加	22,068,240.85	16,921,820.11
房产税	6,664,079.84	8,846,395.07
印花税	288,867.81	1,219,129.16
土地使用税	269,127.24	269,127.25
车船税	90,127.12	76,848.27
其他	190,052.83	201,943.54
合 计	60,464,813.46	51,522,657.89

8. 业务及管理费

项 目	本期数	上年同期数
职工费用	2,258,870,103.25	1,889,949,997.21
租赁费	108,768,285.64	96,452,329.75
通讯费	107,074,101.77	93,933,623.62
折旧费	69,900,804.09	75,759,086.28
电子设备运转费	46,906,340.80	38,646,312.78
交易所席位年费	40,660,382.14	38,259,472.90
投资者保护基金支出	36,118,761.63	28,925,416.15
无形资产摊销	34,587,814.54	28,153,276.67
差旅费	29,138,964.74	55,808,436.60
业务宣传费	25,668,164.57	20,291,816.23
其他	174,437,205.70	184,807,292.44
合 计	2,932,130,928.87	2,550,987,060.63

9. 信用减值损失

项 目	本期数	上年同期数
买入返售金融资产坏账准备	811,216,146.71	126,498,105.87
其他债权投资减值损失	102,164,620.03	4,342,015.06
应收款项坏账损失	78,133,179.96	161,207,320.60
融出资金坏账准备	13,864,713.07	19,083,685.08
其他应收款减值损失	1,268,176.79	10,565,137.81
合 计	1,006,646,836.56	321,696,264.42

10. 其他资产减值损失

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品跌价准备	5,893,797.90	852,368.56
合 计	5,893,797.90	852,368.56

11. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品销售成本	207,468,981.70	155,897,603.92
投资性房地产折旧	5,512,224.55	1,778,682.30
其他	4,161,010.09	3,142,260.75
合 计	217,142,216.34	160,818,546.97

12. 营业外收入

项 目	本期数		上年同期数	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	发生额	计入当期非经常性损益的金额
政府补助[注]	15,884,143.46	15,884,143.46	22,416,893.79	22,416,893.79
违约赔偿收入	413,557.98	413,557.98	2,283,808.39	2,283,808.39
非流动资产毁损报废利得	15,824.62	15,824.62		
其他	49,815.21	49,815.21	25,121.76	25,121.76
合 计	16,363,341.27	16,363,341.27	24,725,823.94	24,725,823.94

[注]本期计入营业外收入的政府补助情况详见本财务报表附注五(四)2之说明

13. 营业外支出

项 目	本期数		上年同期数	
	发生额	计入当期非经常性损益的金额	发生额	计入当期非经常性损益的金额
非常损失[注]	192,583,918.34	192,583,918.34	136,251,311.79	136,251,311.79
对外捐赠	19,383,170.00	19,383,170.00	369,710.22	369,710.22
罚款支出	15,445.99	15,445.99	200,200.00	200,200.00
其他	527,639.03	527,639.03	3,071,690.45	3,071,690.45
合 计	212,510,173.36	212,510,173.36	139,892,912.46	139,892,912.46

[注]其中计人民币 187,915,709.78 元详见本财务报表附注五(一)29[注 2]之说明

14. 所得税费用

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	868,969,110.25	617,608,497.46
递延所得税费用	-195,940,923.96	115,676,128.55
合 计	673,028,186.29	733,284,626.01

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

项 目	本期数	上年同期数
利润总额	3,620,174,520.54	3,332,558,137.37
按母公司税率计算的所得税费用	905,043,630.14	833,139,534.34
子公司适用不同税率的影响	-26,355.13	-898,299.24
调整以前期间所得税的影响	-239,866.34	-8,939,707.63
非应税收入的影响	-174,728,488.04	-111,942,322.96
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	15,899,451.64	16,938,290.53
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-3,879,307.35	3,970,051.52
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	3,962,937.57	1,518,432.07
其他	-73,003,816.20	-501,352.62
所得税费用	673,028,186.29	733,284,626.01

15. 其他综合收益的税后净额

其他综合收益的税后净额详见本财务报表附注五(一)36之说明。

(三) 合并现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
清算交收资金净增加额	938,818,310.96	
应付货币保证金净增加额	706,798,457.29	1,435,137,954.01
大宗商品销售收到的现金	255,504,016.10	178,590,026.60

项 目	本期数	上年同期数
收到政府补助	25,807,844.11	28,700,953.45
租赁收入	18,640,562.53	20,085,118.05
代扣代缴手续费收入	15,142,802.15	2,902,961.96
收回受限资金		409,240,000.00
代扣代缴税费收到现金净增加额		22,557,616.48
其他	21,311,386.38	23,867,042.81
合 计	1,982,023,379.52	2,121,081,673.36

2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
资产管理计划优先级参与人款项净减少额	1,410,428,880.30	23,426,756.71
存出保证金净增加额	551,185,267.81	452,235,659.35
现金支付的业务及管理费	488,392,731.76	512,053,033.42
购买大宗商品支付的现金	233,780,899.13	286,282,860.21
代扣代缴税费支付的现金净额	212,489,316.42	
应付质押保证金净减少额	30,093,896.00	41,905,168.00
捐赠支出	18,783,170.00	369,710.22
罚款支出	16,815,445.99	
清算交收资金净减少额		2,023,048,574.84
支付代垫款项		189,929,547.64
股票借贷业务支付净额		30,752,583.87
其他	58,852,167.56	47,438,086.26
合 计	3,020,821,774.97	3,607,441,980.52

3. 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

补充资料	本期数	上年同期数
1) 将净利润调节为经营活动现金流量:		

补充资料	本期数	上年同期数
净利润	2,947,146,334.25	2,599,273,511.36
加：资产减值准备	997,593,458.68	322,548,632.98
固定资产及投资性房地产折旧	75,413,028.64	77,537,768.58
无形资产摊销	34,587,814.54	28,153,276.67
长期待摊费用摊销	24,318,567.48	21,965,118.99
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（减：收益）	54,585.90	231,677.05
公允价值变动损失（减：收益）	-96,236,669.03	-677,169,849.62
利息支出	1,067,606,534.84	1,330,602,925.97
汇兑损失（减：收益）	1,290,498.41	1,762,624.72
投资损失（减：收益）	-260,839,500.68	-189,458,966.46
递延所得税资产减少（减：增加）	-225,299,157.90	10,496,225.96
递延所得税负债增加（减：减少）	53,283,859.02	104,140,336.55
交易性金融资产减少（减：增加）	-10,523,411,206.71	-2,574,745,338.89
交易性金融负债增加（减：减少）	-171,252,172.94	84,539,407.56
其他权益工具投资减少（减：增加）	-902,411,526.28	6,082,473.69
其他债权投资减少（减：增加）	-1,007,519,479.19	1,666,187,298.49
衍生金融负债增加（减：减少）	62,109,779.24	-6,023,709.63
买入返售金融资产减少（减：增加）	2,975,430,685.19	4,880,295,061.30
卖出回购金融资产增加（减：减少）	6,751,180,183.07	5,298,678,182.50
融出资金减少（减：增加）	-1,795,404,142.59	-4,695,008,119.07
代理买卖证券款增加（减：减少）	13,215,641,480.34	17,509,643,056.75
代理承销证券款增加（减：减少）	77,000,000.00	
经营性应收项目的减少（减：增加）	-586,769,300.10	-1,373,145,981.94
经营性应付项目的增加（减：减少）	-1,655,623,661.23	-3,563,773,836.34
经营活动产生的现金流量净额	11,057,889,992.95	20,862,811,777.17
2) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
债务转为资本		

补充资料	本期数	上年同期数
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3) 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	78,507,535,169.49	61,010,608,656.77
减：现金的期初余额	59,588,272,168.73	41,784,495,854.53
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	18,919,263,000.76	19,226,112,802.24

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	期末数	期初数
1) 现金	78,507,535,169.49	59,588,272,168.73
其中：库存现金	333,078.21	307,330.94
可随时用于支付的银行存款	70,664,460,284.18	52,756,614,405.25
可随时用于支付的其他货币资金	38,094,565.63	41,353,736.42
可随时用于支付的结算备付金	7,804,647,241.47	6,789,996,696.12
2) 现金等价物		
3) 期末现金及现金等价物余额	78,507,535,169.49	59,588,272,168.73

(四) 其他

1. 所有权或使用权受到限制的资产

项 目	期末账面价值	受限原因
货币资金	58,774,310.41	风险准备金、股票申购款
交易性金融资产	34,793,001,701.47	为回购业务设定质押或过户
交易性金融资产	3,832,556,947.00	为债券借贷业务设定质押
交易性金融资产	1,258,759,692.87	限售股
交易性金融资产	864,939,547.33	持有的份额退出受到合同约定的限制
交易性金融资产	253,492,643.16	融出证券
其他债权投资	15,544,328,278.90	为回购业务设定质押或过户

项 目	期末账面价值	受限原因
其他债权投资	415,797,268.00	为债券借贷业务设定质押
其他权益工具投资	721,852,071.84	融出证券
其他权益工具投资	253,043,368.26	限售股
合 计	57,996,545,829.24	

2. 政府补助

(1) 明细情况

1) 与资产相关的政府补助

总额法

项 目	期初递延收益	本期新增补助	本期摊销	期末递延收益	本期摊销列报项目	说明
购地补贴	133,241,379.60		1,737,931.02	131,503,448.58	其他收益	[注]

[注]购地补贴详见本财务报表附注五(一)30之说明

2) 与收益相关，且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

项 目	金额	列报项目	说明
财政扶持资金	5,560,000.00	营业外收入	[注]
金融机构补贴	10,000,000.00	营业外收入	沪府发〔2009〕40号
生育津贴	4,749,857.65	业务及管理费	
稳岗补贴	4,734,073.88	业务及管理费	
其他与经营活动相关的政府补助	439,769.12	其他收益	
其他与经营活动无关的政府补助	324,143.46	营业外收入	
小 计	25,807,844.11		

[注]主要是上海北京东路证券营业部收到上海市黄浦区拨付的重点企业产业发展资金

(2) 本期计入当期损益的政府补助金额为 27,545,775.13 元。

3. 金融工具计量基础

(1) 金融资产计量基础分类表

项 目	期末数			
	以摊余成本计量的金融资产	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
		分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	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
货币资金	70,847,279,309.82			
结算备付金	7,808,816,537.43			
融出资金	39,489,583,162.88			
衍生金融资产				6,544,712.43
存出保证金	4,925,533,185.04			
应收款项	745,912,974.58			
合同资产	14,914,731.25			
买入返售金融资产	19,986,043,816.71			
交易性金融资产				73,181,139,296.79
其他债权投资		18,927,951,117.10		
其他权益工具投资			10,519,859,955.17	
其他资产	268,482,296.57			
合 计	144,086,566,014.28	18,927,951,117.10	10,519,859,955.17	73,187,684,009.22

(2) 金融负债计量基础分类表

项 目	期末数			
	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	188,405,429.61			
应付短期融资款	34,714,523,712.64			
拆入资金	3,038,390,654.37			

项 目	期末数			
	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
交易性金融负债		115,158,245.39		
衍生金融负债		194,495,393.19		
卖出回购金融资产款	48,574,309,563.54			
代理买卖证券款	59,803,098,941.34			
代理承销证券款	77,000,000.00			
应付款项	6,322,516,246.95			
合同负债	9,323,180.38			
应付债券	37,216,060,580.06			
其他负债	7,534,742,353.66			
合 计	197,478,370,662.55	309,653,638.58		

4. 融资融券业务

(1) 融券业务明细情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	1,580,754,065.57	769,530,587.14
其中：其他权益工具投资	721,852,071.84	695,668,708.30
交易性金融资产	253,492,643.16	
转融通融入证券	605,409,350.57	73,861,878.84
转融通融入证券总额	1,583,274,565.45	441,932,604.00

(2) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
股票	126,241,916,147.06	110,360,567,602.75
资金	6,043,920,749.04	4,491,866,916.00

项 目	期末公允价值	期初公允价值
基金	2,335,552,322.25	1,947,587,751.59
债券	159,878,184.63	86,754,719.09
合 计	134,781,267,402.98	116,886,776,989.43

六、母公司财务报表项目注释

(一) 母公司资产负债表项目注释

1. 长期股权投资

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
对子公司投资	7,836,180,146.42	7,836,180,146.42
对联营、合营企业投资	1,722,754,152.48	1,533,122,446.30
减：长期股权投资减值准备		
合 计	9,558,934,298.90	9,369,302,592.72

(2) 对子公司投资

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	期末数	减值准备 期末数
国信期货公司	1,890,915,346.42			1,890,915,346.42	
国信弘盛公司	3,050,000,000.00			3,050,000,000.00	
国信香港公司	1,395,264,800.00			1,395,264,800.00	
国信资本公司	1,500,000,000.00			1,500,000,000.00	
小 计	7,836,180,146.42			7,836,180,146.42	

(3) 对联营企业投资

项 目	期末数	期初数
鹏华基金公司	1,489,983,568.35	1,302,060,774.76
前海股交投资控股（深圳）有限公司	205,784,351.16	203,856,376.08
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	26,986,232.97	27,205,295.46
小 计	1,722,754,152.48	1,533,122,446.30

2. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	3,501,684,993.15	2,024,216,167.10	2,191,853,298.69	3,334,047,861.56
离职后福利—设定提存计划	1,358,246.17	87,339,181.78	87,198,351.86	1,499,076.09
合计	3,503,043,239.32	2,111,555,348.88	2,279,051,650.55	3,335,546,937.65

(2) 短期薪酬明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	3,229,344,821.75	1,803,926,367.19	1,982,648,380.71	3,050,622,808.23
职工福利费		37,217,533.59	37,217,533.59	
社会保险费	551,554.35	41,225,082.89	41,426,145.01	350,492.23
其中：医疗保险费	467,833.59	37,097,073.97	37,272,048.81	292,858.75
工伤保险费	38,267.45	417,324.69	421,318.13	34,274.01
生育保险费	45,453.31	3,710,684.23	3,732,778.07	23,359.47
住房公积金	62,868.23	90,142,319.39	90,091,178.39	114,009.23
工会经费和职工教育经费	271,725,148.82	37,471,400.28	26,236,597.23	282,959,951.87
其他	600.00	14,233,463.76	14,233,463.76	600.00
小计	3,501,684,993.15	2,024,216,167.10	2,191,853,298.69	3,334,047,861.56

(3) 设定提存计划明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	1,260,261.90	48,598,229.22	48,445,907.42	1,412,583.70
失业保险费	24,494.24	-2,871,369.36	-2,867,491.31	20,616.19
企业年金缴费	73,490.03	41,612,321.92	41,619,935.75	65,876.20
小计	1,358,246.17	87,339,181.78	87,198,351.86	1,499,076.09

(二) 母公司利润表项目注释

1. 手续费及佣金净收入

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
证券经纪业务净收入	2,656,626,928.95	2,188,455,480.57
证券经纪业务收入	3,137,799,179.64	2,585,292,726.99
代理买卖证券业务	2,745,123,494.73	2,385,342,100.62
交易单元席位租赁	152,070,566.06	117,776,415.08
代销金融产品业务	240,605,118.85	82,174,211.29
证券经纪业务支出	481,172,250.69	396,837,246.42
代理买卖证券业务	481,172,250.69	396,837,246.42
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
投资银行业务净收入	582,934,063.92	478,931,206.12
投资银行业务收入	596,586,400.08	496,558,147.51
证券承销业务	542,339,103.87	420,785,151.94
证券保荐业务	30,066,037.71	16,235,849.05
财务顾问业务	24,181,258.50	59,537,146.52
投资银行业务支出	13,652,336.16	17,626,941.39
证券承销业务	13,652,336.16	17,626,941.39
证券保荐业务		
财务顾问业务		
资产管理业务净收入	125,856,585.43	109,455,518.91
资产管理业务收入	158,167,997.37	143,111,049.30
资产管理业务支出	32,311,411.94	33,655,530.39
投资咨询业务净收入	17,540,582.10	17,579,565.34
投资咨询业务收入	17,540,582.10	17,579,565.34
投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	110,416,218.95	125,185,866.06
其他手续费及佣金收入	110,416,218.95	125,185,866.06
其他手续费及佣金支出		
合 计	3,493,374,379.35	2,919,607,637.00

项 目	本期数	上年同期数
其中：手续费及佣金收入总计	4,020,510,378.14	3,367,727,355.20
手续费及佣金支出总计	527,135,998.79	448,119,718.20

(2) 财务顾问业务净收入

项 目	本期数	上年同期数
并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司	8,888,679.25	30,651,886.78
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	15,292,579.25	28,885,259.74
小 计	24,181,258.50	59,537,146.52

(3) 资产管理业务开展及收入明细情况

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	81	138	25
期末客户数量	94,074	124	384
其中：个人客户	93,856	29	
机构客户	218	95	384
期初受托资金	30,771,814,240.63	95,442,584,591.31	24,299,429,159.81
其中：自有资金投入	3,955,340,116.65		
个人客户	19,375,678,013.51	4,964,922,103.86	
机构客户	7,440,796,110.47	90,477,662,487.45	24,299,429,159.81
期末受托资金	34,093,652,770.40	143,329,127,138.71	24,663,839,000.00
其中：自有资金投入	4,128,023,544.08		
个人客户	20,230,753,940.10	4,936,473,684.44	
机构客户	9,734,875,286.22	138,392,653,454.27	24,663,839,000.00
期末主要受托资产初始成本	31,803,864,559.85	142,669,530,215.59	24,436,433,346.87
其中：股票	5,471,908,690.34	11,467,148,075.34	
国债	215,782,049.35		
其他债券	23,423,381,489.61	2,689,649,210.36	
基金	2,043,188,031.34	5,876,817.62	11,486,500.05
其他	649,604,299.21	128,506,856,112.27	24,424,946,846.82

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
本期资产管理业务净收入	95,105,313.53	30,555,045.49	196,226.41

2. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	3,303,952,273.00	2,972,935,556.33
货币资金及结算备付金利息收入	597,245,479.23	501,815,398.83
拆出资金利息收入		
融资融券利息收入	1,426,128,385.48	1,275,137,816.20
买入返售金融资产利息收入	945,684,716.15	923,252,096.12
其中：约定购回利息收入	1,786,101.90	4,366,940.81
股票质押回购利息收入	935,731,390.77	910,110,929.86
债权投资利息收入		
其他债权投资利息收入	324,953,806.44	270,649,832.23
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	9,939,885.70	2,080,412.95
利息支出	1,760,648,551.29	2,127,823,719.53
短期借款利息支出	39,970.22	224,450.45
应付短期融资券利息支出	270,474,862.16	328,613,650.58
拆入资金利息支出	94,950,365.20	45,209,986.61
其中：转融通利息支出	91,194,771.87	19,445,539.41
卖出回购金融资产利息支出	481,819,024.65	674,259,228.81
其中：报价回购利息支出	52,786,711.54	60,981,343.91
代理买卖证券款利息支出	88,219,418.82	74,746,574.38
应付债券利息支出	792,300,825.75	990,738,032.81
其中：次级债券利息支出	22,735,437.16	187,788,739.73
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	32,844,084.49	14,031,795.89
利息净收入	1,543,303,721.71	845,111,836.80

3. 投资收益

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
成本法核算的长期股权投资收益	730,000,000.00	150,000,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	201,870,661.07	116,238,650.81
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	1,865,844,630.21	1,429,592,668.27
其中：持有期间取得的收益	1,342,883,535.77	1,362,866,419.57
一交易性金融工具	1,302,390,670.79	1,216,935,557.90
一其他权益工具投资	40,492,864.98	145,930,861.67
处置金融工具取得的收益	522,961,094.44	66,726,248.70
一交易性金融工具	427,430,501.52	-56,392,474.62
一其他债权投资	103,490,299.38	31,554,726.91
一衍生金融工具	-7,959,706.46	91,563,996.41
其他	-84,299,070.69	-49,478,951.01
合 计	2,713,416,220.59	1,646,352,368.07

(2) 按权益法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
鹏华基金公司	201,932,128.16	118,458,380.21	被投资单位净利润变化
前海股交投资控股（深圳）有限公司	-842,404.60	-2,312,974.86	被投资单位净利润变化
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	780,937.51	93,245.46	被投资单位净利润变化
小 计	201,870,661.07	116,238,650.81	

(3) 交易性金融工具投资收益

交易性金融工具		本期数	上年同期数
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	1,302,390,670.79	1,216,935,557.90
	处置期间收益	441,327,571.52	-56,526,244.62
分类为以公允价值计量且其变	持有期间收益		

交易性金融工具		本期数	上年同期数
动计入当期损益的金融负债	处置期间收益	-13,897,070.00	133,770.00
小 计		1,729,821,172.31	1,160,543,083.28

4. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
交易性金融资产	-156,696,049.82	831,286,849.10
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	543,160.00	-27,080.00
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	-40,811,687.02	-175,611,412.53
合 计	-196,964,576.84	655,648,356.57

5. 业务及管理费

项 目	本期数	上年同期数
职工薪酬	2,109,776,248.79	1,775,367,793.03
通讯费	101,701,868.12	89,280,993.46
租赁费	78,331,150.83	73,731,382.08
折旧费	64,619,572.58	71,388,471.86
差旅费	27,911,113.76	52,239,804.93
电子设备运转费	38,630,894.84	32,218,963.65
交易所席位年费	38,551,956.47	37,218,531.02
投资者保护基金支出	35,755,220.92	28,735,700.69
业务宣传费	25,385,225.17	19,992,562.07
无形资产摊销	32,474,312.85	26,398,247.37
其他	127,428,363.55	150,610,578.98
合 计	2,680,565,927.88	2,357,183,029.14

七、合并范围的变更

(一) 合并范围减少

公司名称	股权处置方式	股权处置时点	处置日净资产	期初至处置日净利润
国信弘盛能源基金管理(珠海)有限公司	转让	2020-5-20	51,807,738.56	-213,787.49

(二) 纳入合并范围的结构化主体变动情况

本公司纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。本公司综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使本公司面临可变回报的影响重大,并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。本公司2020年度新增6个结构化主体纳入合并报表范围,9个结构化主体清算不再纳入合并报表范围。

八、在其他主体中的权益

(一) 在子公司中的权益

1. 子公司的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例/表决权比例(%)		取得方式
				直接	间接	
国信弘盛公司	深圳	深圳	股权投资基金管理	100.00		自行设立
国信香港公司	香港	香港	金融控股公司	100.00		自行设立
国信资本有限责任公司	深圳	深圳	科创板跟投;创业投资	100.00		自行设立
国信期货公司	上海	上海	期货经纪、期货投资咨询、资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
国信证券(香港)经纪有限公司[注1]	香港	香港	证券及期货经纪业务		100.00	自行设立
国信证券(香港)融资有限公司[注1]	香港	香港	投资银行		100.00	自行设立
国信证券(香港)资产管理有限公司[注1]	香港	香港	资产管理		100.00	自行设立
国信咨询公司[注1]	深圳	深圳	提供咨询和支持服务		100.00	自行设立

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例/表决权比例(%)	取得方式
深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司[注 3]	深圳	深圳	股权投资基金管理	100.00	自行设立
国信（香港）金融产品有限公司[注 1]	香港	香港	金融产品	100.00	自行设立
国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司[注 2]	深圳	深圳	股权投资；受托管理股权投资；	100.00	自行设立
国信金阳资本管理有限公司[注 4]	上海	上海	现货和期货交易	100.00	自行设立
深圳市国信大族机器人产业投资基金管理有限公司[注 3]	深圳	深圳	受托管理股权投资基金	51.00	自行设立
深圳市国信众创基金管理有限公司[注 3]	深圳	深圳	受托管理股权投资基金	51.00	自行设立
深圳市国信运通基金管理有限公司[注 3]	深圳	深圳	受托管理股权投资基金	51.00	自行设立
华文弘盛基金管理（珠海）有限公司[注 3]	深圳	珠海	受托管理股权投资基金	51.00	自行设立

[注 1]国信香港公司的下设子公司

[注 2]国信证券（香港）资产管理有限公司的下设子公司

[注 3]国信弘盛公司的下设子公司

[注 4]国信期货公司的下设子公司

2. 对于纳入合并范围的重要的结构化主体控制的依据

本公司在评估控制时，需考虑：1) 投资方对被投资方的权利；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利影响其回报的金额。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需要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持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。对于本公司担任资产管理方的资产管理计划，本公司会持续评估因管理该资产管理计划而获得的薪酬水平和面临的可变回报风险程度是否表明本公司为该资产管理计划的主要责任人。如本公司为该资产管理计划的主要责任人，应将上述资产管理计划纳入合并范围。

本公司合并的结构化主体包括本公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和本公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。本公司通过综合评估本公司因持有的份额而享

有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2020年6月30日，纳入本公司财务报表合并范围的结构化主体共27个，合并的结构化主体的总资产为人民币9,756,612,312.32元。本公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中的金额为人民币4,342,317,722.08元。

(二) 在合营企业或联营企业中的权益

1. 重要的合营企业或联营企业

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	
鹏华基金公司	深圳	深圳	基金管理	50.00		权益法
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	深圳	深圳	私募股权投资		28.58	权益法
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金(有限合伙)	北京	北京	私募股权投资		25.00	权益法

2. 重要联营企业的主要财务信息

项 目	期末数/本期数			期初数/上年同期数		
	鹏华基金公司	深圳市国信弘盛股权投资 基金（有限合伙）	北京航天科工军民融合 科技成果转化创业投资 基金（有限合伙）	鹏华基金公司	深圳市国信弘盛股权投资 基金（有限合伙）	北京航天科工军民融合 科技成果转化创业投资 基金（有限合伙）
资产	4,680,598,160.83	1,229,404,617.70	1,554,402,698.89	4,224,829,548.69	1,624,343,728.11	1,513,395,250.51
负债	1,597,954,063.89	66,607,146.75	1,319,328.26	1,521,873,703.00	31,467,100.91	
少数股东权益	102,676,960.23			98,834,296.17		
归属于母公司所有者权益	2,979,967,136.71	1,162,797,470.95	1,553,083,370.63	2,604,121,549.52	1,592,876,627.20	1,513,395,250.51
按持股比例计算的净资产份额	1,489,983,568.35	332,284,158.65	388,270,842.66	1,302,060,774.76	455,244,140.05	378,348,812.63
调整事项		557,654.34	-4,700,000.00		579,856.55	
对联营企业权益投资的账面价值	1,489,983,568.35	332,841,812.99	383,570,842.66	1,302,060,774.76	455,823,996.60	378,348,812.63
营业总收入	1,382,277,178.25	69,106,797.60	-39,156,704.08	1,021,066,708.03	322,028,306.83	
净利润	379,688,251.25	67,630,980.31	-43,186,682.72	247,722,009.45	321,216,646.00	7,505,313.13
终止经营的净利润						
其他综合收益				37,869,441.72		
综合收益总额	379,688,251.25	67,630,980.31	-43,186,682.72	285,591,451.17	321,216,646.00	7,505,313.13
本期收到的来自联营企业的股利				15,000,000.00		

3. 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

项 目	期末数/本期数	期初数/上年同期数
合营企业		
投资账面价值合计	497,263,014.05	177,312,400.13
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	19,950,613.92	-2,006,937.75
其他综合收益		
综合收益总额	19,950,613.92	-2,006,937.75
联营企业		
投资账面价值合计	824,207,292.11	797,029,984.37
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	4,270,913.73	-33,957,906.93
其他综合收益	25,931,919.28	-1,907,290.99
综合收益总额	30,202,833.01	-35,865,197.92

(三) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本公司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资产管理计划、第三方机构发起设立的资产管理计划。

1. 在本公司发起设立的资产管理计划和投资基金中的权益

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

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

项 目	财务报表 列报项目	账面价值		最大损失敞口	
		期末数	期初数	期末数	期初数
券商资管产品	交易性金融资产	1,003,046,157.82	895,205,221.70	1,003,046,157.82	895,205,221.70

本期本公司从由本公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的资产管理计划及投资基

金中获取的管理费及业绩报酬为人民币 184,405,274.34 元。

2. 在第三方机构发起设立的资产管理计划中享有的权益

本公司直接持有的第三方机构发起设立的结构化主体，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括证券公司资产管理计划、基金专户产品和信托产品。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。

期末本公司通过直接持有第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失敞口列示如下：

项 目	财务报表 列报项目	账面价值		最大损失敞口	
		期末数	期初数	期末数	期初数
基金	交易性金融资产	8,465,369,693.59	7,964,655,175.34	8,465,369,693.59	7,964,655,175.34
银行理财产品	交易性金融资产	1,574,361,768.22	2,792,029,645.82	1,574,361,768.22	2,792,029,645.82
券商理财产品	交易性金融资产	194,929,951.06	100,690,031.11	194,929,951.06	100,690,031.11
信托计划	交易性金融资产	198,349,884.88	280,884,035.43	198,349,884.88	280,884,035.43
私募基金及专户	交易性金融资产	2,386,177,859.28	1,845,908,322.02	2,386,177,859.28	1,845,908,322.02
基金	其他权益工具投资	201,187,574.25	269,747,336.33	201,187,574.25	269,747,336.33

九、与金融工具相关的风险

本公司的主要金融工具包括现金、银行存款、结算备付金、交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资、买入返售金融资产、应收款项、融出资金、融出证券、交易性金融负债、卖出回购金融资产、拆入资金、融入证券、应付利息、应付款项等。各项金融工具的详细情况说明详见各项目附注。与这些金融工具有关的风险，以及本公司为降低这些风险所采取的风险管理政策如下所述。本公司管理层对这些风险敞口进行管理和监控以确保将上述风险控制在限定的范围之内。

本公司以全面风险管理和并表管理试点为抓手，按照风险类型对所有业务进行风险评估、计量、监测、检查和报告，实现风险管理全覆盖；建立风险偏好和风险限额体系，形成覆盖“风险总量-业务类型-业务部门或子公司-投资策略”的多层次、多维度限额管理体系；健

全公司经营及风险情况报表体系，编制全面反映集团公司整体风险及业务状况的日报表；建立健全全面风险管理信息系统，建设独立的风险数据库，实现风险数据的 T+1 日采集，确保本公司各条业务线在风险可测、可控和可承受的范围内稳健开展。

（一）风险管理政策及组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

1. 董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

2. 经营层、风险控制委员会及首席风险官

经营层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程，公司风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策，公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作。

3. 独立的风险管理机构

公司风险管理总部、合规管理总部与监察稽核总部作为独立的风险管理机构，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。

风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行考评。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，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。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对各业务领域、部门和主要岗位的内部控制制度执行情况履行管理、检查、反馈和督导等职责。

公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。

4. 业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门的负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理制度，并指定相关人员从事

风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

（二）信用风险

信用风险一般是指因客户、交易对手或证券发行人未履行合约责任而引致公司损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

1. 具有债权性质的债券等交易业务；
2. 融资融券业务、约定购回和股票质押式回购等有证券抵押的资本中介业务；
3. 场外衍生品业务；
4. 经纪业务模式下的债券质押式回购业务；
5. 存放银行的活期存款及定期存款；
6. 其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司按照《证券公司信用风险管理指引》的要求，已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、信用风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务中存在发行人违约的信用风险。公司建立具有自主知识产权的内部评级体系，采用财务指标与经营指标相结合的方法对发行人、交易对手进行风险评估，通过债券负面清单管理、同一发行人授信管理等措施对债券投资实施前端准入控制；持续监控发行人资信状况；及时调整负面清单债券的持仓；明确违约司法追索程序等措施。

股票质押、融资融券等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 275.28%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 228.72%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 288.64%。

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

经纪业务模式下的债券质押式回购业务公司对中国结算承担交收责任。公司采取投资者适当性管理、风险限额、内部评级、授信管理、集中度管理、系统监控等措施，控制因承担客户回购还款交收责任所带来的信用风险。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

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

项 目	期末数	期初数
货币资金	70,847,279,309.82	52,914,629,831.41
结算备付金	7,808,816,537.43	6,792,949,934.99
存出保证金	4,925,533,185.04	4,374,714,699.62
融出资金	39,489,583,162.88	37,708,047,436.61
衍生金融资产	6,544,712.43	18,933,954.93
交易性金融资产[注 1]	56,058,356,682.10	45,927,969,880.61
其他债权投资	18,927,951,117.10	17,972,591,320.77
其他权益工具投资[注 2]	721,852,071.84	695,668,708.30
买入返售金融资产	19,986,043,816.71	23,772,690,648.61
应收款项	745,912,974.58	791,157,610.45
合同资产	14,914,731.25	
其他资产	188,328,719.52	184,018,449.41
合 计	219,721,117,020.70	191,153,372,475.71

[注 1]交易性金融资产为债券投资、为融出证券业务下融出给客户的证券以及向证金公司借出的证券

[注 2]其他权益工具投资为融出证券业务下融出给客户的证券

(三) 操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所

造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则，各部门设置专职或兼职的风险管理岗；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理环节的剩余风险；三是开展关键风险指标监测工作，从公司层面和业务层面两个维度对操作风险进行监控，及时预警并处置风险；四是完善风险事件收集，做好案例分析，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是持续优化公司统一的操作风险管理系统，实现操作风险系统化管理；六是积极宣导风险管理文化，组织公司各部门风险教育培训。

（四）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

1. 动态监测与评估流动性风险指标及限额情况，确保各项指标均持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。
2. 持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。
3. 加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。
4. 开展流动性风险压力测试，分析在不同压力情景下公司的流动性风险承受能力，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施。
5. 开展流动性风险应急演练与评估，持续完善应急计划的机制与流程。

报告期内，公司持续完善流动性风险指标及限额体系，适时开展流动性风险压力测试与应急演练，推动流动性风险监管指标新规的系统升级，进一步优化流动性风险管理信息系统，不断完善公司流动性风险管理机制。

2020年6月30日，本公司各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

项 目	即期	小于3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	合 计
短期借款		188,618,342.26				188,618,342.26
应付短期融资款		25,214,387,087.47	9,660,624,368.28			34,875,011,455.75
拆入资金		3,049,291,666.67				3,049,291,666.67
交易性金融负债				95,168,728.94	19,989,516.45	115,158,245.39
衍生金融负债	36,312,360.00	41,331,108.81	116,851,924.38			194,495,393.19
应付款项	1,698,594,730.78	3,763,070,781.58	817,583,090.14	43,267,644.45		6,322,516,246.95
卖出回购金融资产款		48,551,035,644.87	36,099,979.68			48,587,135,624.55
代理买卖证券款	59,803,098,941.34					59,803,098,941.34
代理承销证券款		77,000,000.00				77,000,000.00
应付债券		8,448,718,176.99	5,594,957,333.24	25,025,191,473.83		39,068,866,984.06
其他金融负债	7,247,767,037.78					7,247,767,037.78
合 计	68,785,773,069.90	89,333,452,808.65	16,226,116,695.72	25,163,627,847.22	19,989,516.45	199,528,959,937.94

(五) 市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司在已构建的四级风险管理架构下，制定了市场风险管理的具体流程，涵盖公司董事会、风险控制委员会、风险管理总部及各业务部门，各组织分工明确，各负其责。

公司根据董事会每年审议通过的整体市场风险限额，综合考虑各业务的风险收益特征和相关性等因素，将风险限额细化至业务策略层级。风险限额主要包括投资规模、损失比例、

风险价值（VaR）和压力测试损失等指标。风险管理总部通过市场风险管理系统等专业的风险管理工具和方法对风险限额进行每日监控，当指标达到预警限额时，风险管理总部对触发预警限额部门进行预警提示，并要求其在规定时间内进行反馈，说明触发预警限额原因和后续的调整计划；当指标突破风险限额时，风险管理总部对超限部门进行提示，要求超限部门在规定时间内将指标调整至限额范围内，若因客观原因无法及时调整的，要求超限部门在规定时间内说明超限原因和后续调整计划，并要求超限部门在调整期间不能主动增加风险敞口。风险管理总部会持续监督业务部门风险应对措施落实情况，并与业务部门沟通讨论风险信息 and 可能出现的极端压力情景。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，在已有限额指标的基础上，根据各业务的特点，新增部分既满足业务发展又能有效控制风险暴露程度的限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和 VaR 限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母限额并进行日常监控。另外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过 VaR 等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR 值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR 模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

本公司和本公司以期末为基期 VaR 值分析概况如下：

-国信集团 VaR 值为 31,155 万元；

-国信证券 VaR 值为 29,976 万元。

价格敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，股票、基金、可转换债券、衍生品等资产类型的价格增加或减少对集团和公司综合收益的影响。假设以 2020 年 6 月 30 日为基期，在其他变量固定的情况下市场权益类及商品价格发生变动，且不考虑管理层为市场价格变化而可能采取的风险管理活动，价格敏感性分析如下：

金额单位：人民币万元

价格变动对综合收益影响	母公司层面	合并层面
股票、基金、商品价格上浮 10%	51,185	53,896
股票、基金、商品价格下跌 10%	-44,968	-47,536

注：VaR 值计算与敏感性分析时不包含 2015 年因公司响应市场维稳号召通过互换方式委托证金公司产生的权益类投资，因无法有效获得该投资的持仓数据或逐日净值序列。

下表汇总了本公司涉及的市场风险敞口：

项 目	期末数	期初数
股票	6,444,979,448.27	4,510,916,986.12
公募基金	8,666,557,267.84	8,234,402,511.67
债券	74,494,616,770.04	63,900,561,201.38
券商理财产品	1,197,976,108.88	995,895,252.81
银行理财产品	1,574,361,768.22	2,792,029,645.82
信托计划	198,349,884.88	280,884,035.43
其他股权投资	1,015,423,088.72	801,937,879.53
其他	9,036,686,032.21	8,696,666,835.87
合 计	102,628,950,369.06	90,213,294,348.63

利率敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，市场整体利率平行变动对集团和公司综合收益的影响。假设以 2020 年 6 月 30 日为基期，在其他变量固定的情况下市场整体利率发生平行变动，且不考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动，利率敏感性分析如下：

金额单位：人民币万元

收益率曲线变动对综合收益影响	母公司层面	合并层面
上升 100 个基点	-173,287	-173,370
下降 100 个基点	192,282	192,371

下表汇总了本公司涉及利率风险的金融资产或金融负债：

1. 期末数

项 目	1 个月以内	1 至 3 个月	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	非生息	合计
金融资产							
货币资金	67,483,243,002.70	2,378,419,302.13	900,000,000.00			85,617,004.99	70,847,279,309.82
结算备付金	7,798,837,566.20					9,978,971.23	7,808,816,537.43
融出资金	344,178,883.01	38,350,527,238.85	133,929,464.50			660,947,576.52	39,489,583,162.88
交易性金融资产	939,039,241.34	1,983,993,290.46	12,849,397,714.35	32,131,830,187.76	7,023,292,865.96	18,253,585,996.92	73,181,139,296.79
衍生金融资产		179,687.50	4,155,149.93			2,209,875.00	6,544,712.43
买入返售金融资产	1,547,159,274.00	267,637,252.29	17,858,192,382.28			313,054,908.14	19,986,043,816.71
存出保证金	4,919,076,142.41					6,457,042.63	4,925,533,185.04
其他权益工具投资			721,852,071.84			9,798,007,883.33	10,519,859,955.17
其他债权投资	227,580,179.40	841,792,890.34	1,255,406,523.81	13,806,911,358.20	2,386,047,077.50	410,213,087.85	18,927,951,117.10
小 计	83,259,114,289.06	43,822,549,661.57	33,722,933,306.71	45,938,741,545.96	9,409,339,943.46	29,540,072,346.61	245,692,751,093.37
金融负债							
短期借款	187,680,000.00					725,429.61	188,405,429.61
应付短期融资款	9,538,128,000.00	15,564,976,000.00	9,525,792,000.00			85,627,712.64	34,714,523,712.64
拆入资金		3,000,000,000.00				38,390,654.37	3,038,390,654.37
交易性金融负债						115,158,245.39	115,158,245.39
衍生金融负债	18,078,775.00	21,699,361.00	61,096,476.54	13,983,166.83		79,637,613.82	194,495,393.19
应付款项	1,634,183,249.00	1,296,576,735.00	746,263,256.00			2,645,493,006.95	6,322,516,246.95

项 目	1 个月以内	1 至 3 个月	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	非生息	合计
卖出回购金融资产款	48,461,417,625.53	54,476,000.00	35,657,000.00			22,758,938.01	48,574,309,563.54
代理买卖证券款	59,797,394,483.83					5,704,457.51	59,803,098,941.34
应付债券	6,000,000,000.00	2,008,605,000.00	4,642,131,000.00	23,700,050,000.00		865,274,580.06	37,216,060,580.06
其他金融负债	7,247,767,037.78						7,247,767,037.78
小 计	132,884,649,171.14	21,946,333,096.00	15,010,939,732.54	23,714,033,166.83		3,858,770,638.36	197,414,725,804.87
净头寸	-49,625,534,882.08	21,876,216,565.57	18,711,993,574.17	22,224,708,379.13	9,409,339,943.46	25,681,301,708.25	48,278,025,288.50

2. 期初数

项 目	1 个月以内	1 至 3 个月	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	非生息	合计
金融资产							
货币资金	48,729,429,293.52	218,256,968.05	3,907,952,100.00			58,991,469.84	52,914,629,831.41
结算备付金	6,774,423,785.38					18,526,149.61	6,792,949,934.99
融出资金	249,080,972.23	36,493,892,792.95	223,160,070.57			741,913,600.86	37,708,047,436.61
交易性金融资产	367,910,083.14	780,731,309.20	7,247,376,092.88	32,643,936,358.28	4,160,234,148.74	17,311,381,009.93	62,511,569,002.17
衍生金融资产		188,250.00	18,399,999.93			345,705.00	18,933,954.93
买入返售金融资产	786,700,019.97	269,794,114.11	22,339,730,224.87			376,466,289.66	23,772,690,648.61
存出保证金	4,368,844,479.94					5,870,219.68	4,374,714,699.62
其他权益工具投资			695,668,708.30			9,033,465,317.39	9,729,134,025.69
其他债权投资	130,060,070.00		1,997,843,998.47	12,674,735,839.79	2,857,803,188.83	312,148,223.68	17,972,591,320.77
小 计	61,406,448,704.18	37,762,863,434.31	36,430,131,195.02	45,318,672,198.07	7,018,037,337.57	27,859,107,985.65	215,795,260,854.80

项 目	1 个月以内	1 至 3 个月	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	非生息	合计
金融负债							
短期借款	296,034,000.00					286,895.36	296,320,895.36
应付短期融资款	3,041,054,000.00	12,067,135,000.00	2,855,522,000.00			79,611,824.10	18,043,322,824.10
拆入资金	1,300,000,000.00	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00			51,588,175.87	5,351,588,175.87
交易性金融负债	149,532,200.00		63,791,848.50			71,381,856.01	284,705,904.51
衍生金融负债	4,250,493.24	19,728,080.18	28,579,448.24	6,966,416.74	732,590.10	11,151,952.74	71,408,981.24
应付款项	2,783,590,631.75	1,732,225,307.00	657,737,190.00			1,119,169,012.89	6,292,722,141.64
卖出回购金融资产款	41,695,517,827.72	56,848,000.00	42,223,000.00			28,540,552.75	41,823,129,380.47
代理买卖证券款	46,582,715,635.86					4,741,825.14	46,587,457,461.00
应付债券	2,300,000,000.00		17,758,614,000.00	16,700,000,000.00		790,722,296.56	37,549,336,296.56
其他金融负债	6,571,062,476.49						6,571,062,476.49
小 计	104,723,757,265.06	15,875,936,387.18	23,406,467,486.74	16,706,966,416.74	732,590.10	2,157,194,391.42	162,871,054,537.24
净头寸	-43,317,308,560.88	21,886,927,047.13	13,023,663,708.28	28,611,705,781.33	7,017,304,747.47	25,701,913,594.23	52,924,206,317.56

十、公允价值的披露

(一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

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
持续的公允价值计量				
1. 交易性金融资产	2,219,196,194.71	66,839,351,132.48	4,122,591,969.60	73,181,139,296.79
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	2,219,196,194.71	66,839,351,132.48	4,122,591,969.60	73,181,139,296.79
债务工具投资	132,282,301.02	55,434,383,351.92		55,566,665,652.94
权益工具投资	2,086,913,893.69	11,404,967,780.56	4,122,591,969.60	17,614,473,643.85
2. 衍生金融资产		6,544,712.43		6,544,712.43
3. 其他债权投资		18,927,951,117.10		18,927,951,117.10
4. 其他权益工具投资	3,713,225,831.91	6,553,590,755.00	253,043,368.26	10,519,859,955.17
持续以公允价值计量的资产总额	5,932,422,026.62	92,327,437,717.01	4,375,635,337.86	102,635,495,081.49
5. 交易性金融负债	46,286,429.26	68,871,816.13		115,158,245.39
6. 衍生金融负债	98,313,106.00	96,182,287.19		194,495,393.19
持续以公允价值计量的负债总额	144,599,535.26	165,054,103.32		309,653,638.58

(二) 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

对于存在活跃市场的金融资产或金融负债，本公司采用活跃市场中的报价确定其公允价值。

(三) 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

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。不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。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。场外期权、收益互换、收

益凭证的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

(四) 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

项 目	2020年6月30日 公允价值	估值技术	重大不可观 察输入值	对公允价值的 影响
流通受限的上市公司股票	1,511,803,061.13	市值折扣法	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
非活跃市场的股票/非上市公司股权	1,188,394,487.46	市值折扣法/协议转让价格	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
理财产品、私募债等	1,675,437,789.27	现金流量折现法	风险调整折现率	风险调整折现率越高，公允价值越低
合 计	4,375,635,337.86			

(五) 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

项 目	期初余额	转入第三层次	转出第三层次	当年利得或损失总额	
				计入损益	计入其他综合收益
交易性金融资产	6,103,231,394.23	29,196,066.80	1,154,566,047.88	275,042,411.81	
其他权益工具投资	10,565,300.26		10,565,300.26		27,141,995.96
合 计	6,113,796,694.49	29,196,066.80	1,165,131,348.14	275,042,411.81	27,141,995.96

(续上表)

项 目	购买、发行、出售和结算				期末余额	对于在报告期末持有的资产，计入损益的当期未实现利得或损失的变动
	购买	发行	出售	结 算		
交易性金融资产	5,746,629,525.03		6,876,941,380.39		4,122,591,969.60	205,314,015.61
其他权益工具投资	225,901,372.30				253,043,368.26	
合 计	5,972,530,897.33		6,876,941,380.39		4,375,635,337.86	205,314,015.61

(六) 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

2020年1-6月，本公司公允价值计量的项目由第三层次转出主要是限售股解禁所致。

(七) 本期发生的估值技术变更及变更原因

2020年1-6月，本公司公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

(八) 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

本公司管理层认为，于2020年6月30日除应付短期融资款、应付债券外，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。截至2020年6月30日，本公司所持有的应付短期融资款账面价值为人民币34,714,523,712.64元，公允价值为人民币34,705,103,514.01元；本公司所持有的应付债券账面价值为人民币37,216,060,580.06元，公允价值为人民币37,396,100,083.96元。

十一、关联方及关联交易

(一) 关联方情况

1. 本公司的母公司情况

(1) 本公司的母公司

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本 (万元)	母公司对本 公司的持股 比例(%)	母公司对本 公司的表决 权比例(%)
深圳投控公司	深圳	通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理	2,764,900.00	33.53	33.53

(2) 本公司最终控制方是深圳市人民政府国有资产监督管理委员会。

2. 本公司的子公司情况详见本财务报表附注八(一)之说明。

3. 本公司的合营和联营企业情况

本公司重要的合营或联营企业详见本财务报表附注八(二)之说明。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：

合营或联营企业名称	与本公司关系
鹏华基金公司	本公司之联营企业
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有限合伙)	本公司之联营企业
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	本公司之联营企业
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	本公司之联营企业
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	本公司之联营企业

合营或联营企业名称	与本公司关系
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	本公司之联营企业
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	本公司之合营企业

4. 本公司的其他关联方情况

其他关联方名称	与本公司关系
华润深国投信托有限公司（以下简称华润深国投公司）	持有本公司 5%以上股份的法人
深圳市荔园酒店有限公司	受同一方控制
深圳市投控物业管理有限公司	受同一方控制
深圳市建筑设计研究总院有限公司	受同一方控制
深圳市信息管线有限公司	受同一方控制
深圳市城市建设开发（集团）有限公司	受同一方控制
深圳市国际招标有限公司	受同一方控制
国泰君安证券股份有限公司	深圳投控公司董事及公司监事担任该公司董事
深圳市特发集团有限公司	深圳投控公司监事过去 12 个月曾在该公司担任高级管理人员
深圳市人才安居集团有限公司	深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事
南方基金管理股份有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
深圳市资本运营集团有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
深圳市燃气集团股份有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
深圳联合产权交易所股份有限公司	深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事
中国平安保险（集团）股份有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
北京城建投资发展股份有限公司	公司监事担任该公司董事
云南红塔银行股份有限公司	公司董事担任该公司董事
安信证券股份有限公司	公司董事担任该公司董事

其他关联方名称	与本公司关系
红塔证券股份有限公司	公司董事担任该公司董事
云南白药集团股份有限公司	公司董事担任该公司董事

(二) 关联交易情况

1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

(1) 佣金收入

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
华润深国投公司	证券代理买卖交易佣金	10,574,801.17	14,321,653.55
云南白药集团股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	75,410.99	
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	证券代理买卖交易佣金	55,605.90	17,617.11
关联自然人	证券代理买卖交易佣金	16,105.17	55,310.98
深圳投控公司	证券代理买卖交易佣金	12,123.09	1,955.29
北京城建投资发展股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	82.48	470.42
深圳市特发集团有限公司	证券代理买卖交易佣金		9,488.34
鹏华基金公司	席位佣金收入	20,662,066.29	10,632,842.85
南方基金管理股份有限公司	席位佣金收入	4,805,542.86	5,083,965.46
华润深国投公司	期货交易佣金	1,465.38	3,332.05
合 计		36,203,203.33	30,126,636.05

(2) 提供顾问服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
华润深国投公司	投资顾问收入	2,205,754.97	
深圳投控公司	财务顾问收入	707,547.17	1,933,962.26
深圳市燃气集团股份有限公司	财务顾问收入	143,396.23	268,867.92
深圳市资本运营集团有限公司	财务顾问收入		188,679.25
深圳市城市建设开发(集团)有限公司	财务顾问收入		47,169.81
合 计		3,056,698.37	2,438,679.24

(3) 提供金融产品代销服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鹏华基金公司	代销金融产品收入	46,019,585.34	22,118,099.26
南方基金管理股份有限公司	代销金融产品收入	19,799,839.09	1,883,367.74
华润深国投公司	代销金融产品收入	57,212.30	421,809.04
合 计		65,876,636.73	24,423,276.04

(4) 提供资产管理服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	17,244,346.97	
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	12,971,375.04	
国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙）	基金管理收入	11,258,892.36	17,732,333.95
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	2,814,723.11	2,731,661.87
深圳投控公司	资产管理收入	2,348,992.91	1,237,240.75
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	1,876,482.08	1,871,284.57
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	1,411,217.33	1,915,223.53
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	594,440.64	592,794.14
北京城建投资发展股份有限公司	资产管理收入	468,341.57	938,000.48
合 计		50,988,812.01	27,018,539.29

(5) 提供承销保荐服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市人才安居集团有限公司	债券承销收入	2,688,679.25	
深圳市特发集团有限公司	债券承销收入	754,716.98	
安信证券股份有限公司	债券分销收入	11,792.45	
合 计		3,455,188.68	

(6) 收取利息

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
关联自然人	融出资金利息	6,847.30	4,545.73
合 计		6,847.30	4,545.73

(7) 接受其他劳务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市荔园酒店	会议费、住宿费	31,736.00	53,252.15
深圳市建筑设计研究总院有限公司	设计费	977,358.49	
深圳市建筑科学研究院股份有限公司	设计费		87,735.85
深圳市国际招标有限公司	招标代理费	1,658,532.11	
安信证券股份有限公司	债券分销支出	9,433.96	
国泰君安证券股份有限公司	债券分销支出	104,716.98	
合 计		2,781,777.54	140,988.00

(8) 卖出回购交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
南方基金管理股份有限公司	卖出回购利息支出	639,186.59	1,200,310.14
云南红塔银行股份有限公司	卖出回购利息支出		66,595.90
安信证券股份有限公司	卖出回购利息支出	7,698.90	112,962.33
国泰君安证券股份有限公司	卖出回购利息支出		102,575.34
中国平安保险(集团)股份有限公司	卖出回购利息支出		52,656.16
华润深国投公司	卖出回购利息支出	41,079.45	
合 计		687,964.94	1,535,099.87

2. 关联租赁情况-公司承租情况

出租方名称	租赁资产种类	本期确认的 租赁费	上年同期确认的 租赁费
华润深国投公司	房屋租赁	5,418,057.85	4,965,561.56
深圳投控公司	房屋租赁	3,198,888.58	3,198,888.60
深圳市信息管线有限公司	通信管道租赁	857,097.96	857,097.96
深圳市投控物业管理有限公司	物业管理费等	709,057.01	720,612.83
合 计		10,183,101.40	9,742,160.95

3. 关键管理人员报酬

单位：万元

项 目	本期数	上年同期数
关键管理人员报酬	1,638.82	1,455.00
合 计	1,638.82	1,455.00

4. 其他关联交易

(1) 自营交易

单位：万元

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
安信证券股份有限公司	自营交易	11,152,222.87	182,326.95
国泰君安证券股份有限公司	自营交易	8,589,702.94	3,480,930.12
南方基金管理股份有限公司	自营交易	1,999,620.10	593,839.73
红塔证券股份有限公司	自营交易	482,945.97	
华润深国投公司	自营交易	18,334.93	15,263.02
云南红塔银行股份有限公司	自营交易	5,110.01	
合计		22,247,936.82	4,272,359.82

(2) 债券销售、分销业务

单位：万元

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	本公司认购关联方承销的债券规模	41,035.00	35,062.50
国泰君安证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	16,000.00	4,000.00
国泰君安证券股份有限公司	本公司分销关联方承销的债券规模	4,000.00	
南方基金管理股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	34,000.00	60,500.00
南方基金管理股份有限公司	认购本公司承销的资产管理计划规模	3,000.00	
华润深国投公司	分销本公司承销的债券规模	21,000.00	
安信证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	5,000.00	
红塔证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	51,500.00	
安信证券股份有限公司	其主承我司分销买入	27,000.00	
安信证券股份有限公司	本公司申购关联方承销的债券规模		24.50
合计		202,535.00	99,587.00

(3) 持有关联方发行的产品或债券

关联方	期末数/本期数			期初数/上年同期数		
	份额/数量	市值	投资收益	份额/数量	市值	投资收益
南方基金管理股份有限公司	1,212,222,012.24	1,235,653,069.93	13,011,045.36	1,022,060,714.16	1,021,259,236.76	6,774,930.48

关联方	期末数/本期数			期初数/上年同期数		
	份额/数量	市值	投资收益	份额/数量	市值	投资收益
鹏华基金公司	841,570,225.08	856,270,170.50	15,021,434.07	1,107,852,791.18	1,372,916,727.17	13,723,481.77
华润深国投公司	15,410,000.00	16,488,940.83		15,410,000.00	15,756,725.00	-6,289,821.12
合计	2,069,202,237.32	2,108,412,181.26	28,032,479.43	2,145,323,505.34	2,409,932,688.93	14,208,591.13

(三) 关联方应收应付款项

1. 应收关联方款项

项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	鹏华基金公司	7,942,392.34		6,564,829.99	
应收款项	厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	2,983,606.56		5,920,219.18	
应收款项	珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	4,139,048.52		3,526,774.66	
应收款项	南方基金管理股份有限公司	2,515,637.05		2,483,979.59	
应收款项	华润深国投公司	1,674,407.62		1,556,854.09	
应收款项	深圳投控公司	7,490,655.22		5,000,722.74	
应收款项	深圳市投控物业管理有限公司	226,299.42		226,299.42	
其他应收款	深圳联合产权交易所股份有限公司	220,000.00		220,000.00	
应收款项	国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙）	11,934,426.23			
应收款项	南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	1,989,071.04			
应收款项	深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	1,495,890.41			
小计		42,611,434.41		25,499,679.67	
融出资金	关联自然人	171,912.63		87,880.76	
小计		171,912.63		87,880.76	

2. 应付关联方款项

项目名称	关联方	期末数	期初数
卖出回购金融资产	南方基金管理股份有限公司	546,424,760.16	65,983,879.45
合计		546,424,760.16	65,983,879.45

十二、承诺及或有事项

(一) 重要承诺事项

1. 已签订的正在或准备履行的大额发包合同

项目	期末数	期初数
大额发包合同	276,620,925.04	362,071,416.26
合计	276,620,925.04	362,071,416.26

2. 已签订的正在或准备履行的租赁合同及财务影响

剩余租赁期	期末数
1年以内(含1年)	166,669,500.22
1年以上2年以内(含2年)	120,698,830.16
2年以上3年以内(含3年)	93,617,890.69
3年以上	77,654,631.36
合计	458,640,852.43

(二) 或有事项

未决诉讼仲裁形成的或有负债及其财务影响

截至目前，本公司作为被告涉诉金额较大的未决诉讼、未决仲裁如下：

1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称华泽钴镍）部分投资者因证券虚假陈述造成相关投资损失的民事赔偿事宜，分别向成都市中级人民法院（以下简称成都中院）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿损失及承担诉讼费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。公司自2018年10月31日起陆续收到相关案件材料，截至目前，涉及公司的诉讼案件合计3,300件，涉案标的额合计10.15亿元，部分案件分别于2019年8月1日、2019年10月10日和2020年8月7日一审开庭审理。成都中院对部分案件作出一审裁判，上述判决书目前尚未生效。四川省高级人民法院于2020年7月7日对部分案件二审开庭审理，目前尚未作出二审裁判。

2. 海口农商行与刚泰集团及公司债券交易纠纷案

刚泰集团有限公司（以下简称刚泰集团）公开发行2016年公司债券（第二期）（以下简称16刚集02），发行规模为5亿元，期限为3年，附第2年末投资者回售选择权，起息日

期为 2016 年 11 月 3 日，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为 5 亿元。2018 年 11 月 3 日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。16 刚集 02 投资者海口农村商业银行股份有限公司向海南省高级人民法院提起诉讼，要求刚泰集团支付本金、利息、复利及相关费用合计人民币 1.07 亿元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

3. 公司与苏某等 13 人基金合同纠纷案

2016 年 3 月，苏某等 13 人作为委托人与基金管理人歌斐资产管理有限公司（简称歌斐资产）及基金托管人本公司签订了《歌斐创世优选一号投资基金基金合同》，苏某等 13 人出资认购了该基金份额。2019 年 3-4 月，苏某等 13 人分别向上海国际仲裁中心提起仲裁，认为歌斐资产将基金的基础资产借款债权披露为应收账款债权，以欺诈手段使其在违背真实意思情况下订立合同，请求撤销基金合同，要求歌斐资产退还本金及利息等合计 3,366.45 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。截止目前，部分案件已裁决，公司不承担任何责任。

4. 公司与吴某等 8 人基金合同纠纷案

2016 年 11 月，吴某等 8 人作为委托人与基金管理人上海东楷创业投资管理有限公司（以下简称东楷创业）及基金托管人本公司签订了《中航神舟电力专项私募基金基金合同》，吴某等 8 人认购了该基金份额。2019 年 12 月，吴某等 8 人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为东楷创业未披露基金信息、擅自变更投资对象及延期，已经构成根本违约，公司未尽到托管人监督职责，因此要求解除合同并返还本金及利息等合计 1,476.68 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

5. 公司与刘某基金合同纠纷案

2015 年 1 月，刘某作为委托人与基金管理人正佑金元（北京）投资基金管理有限公司（以下简称正佑金元）及基金托管人本公司签订了《金元 1 号契约型基金基金合同》，刘某出资认购了该基金份额。2019 年 6 月，刘某向北京市朝阳区人民法院提起诉讼，认为正佑金元未进行合格投资者适当性调查、未在基金业协会登记、涉案基金未备案、未定期进行信息披露和信息公示，公司未尽到托管人监督职责，因此要求解除合同并返还本金及利息等合计 1,758 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件已于 2019 年 11 月 11 日开庭，目前尚未判决。

6. 公司与刘某等 2 人基金合同纠纷案

2018 年 6 月，委托人刘某等 2 人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下

简称天和盈泰)及基金托管人本公司签订了《天和盈泰山一号私募投资基金基金合同》，刘某等2人出资认购了该基金份额。2019年12月，刘某等2人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计2,204万元，并要求公司承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

7. 公司与张某基金合同纠纷案

2017年2月，委托人张某与基金管理人上海钜澎资产管理有限公司(以下简称钜澎公司)、基金托管人本公司签订了《钜澎大观稳盈优先私募基金2号基金合同》，张某出资认购了该基金份额。2020年2月，张某向上海国际仲裁中心提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期未兑付，是钜澎公司存在虚假宣传、违反投资者适当性、未进行信息披露等违约行为造成的，本公司对上述行为未尽监督义务，张某要求解除合同及钜澎公司、本公司返还本金、利息等合计1,602万元。案件已于2020年7月21日开庭，目前尚未裁决。

十三、资产负债表日后事项

其他资产负债表日后事项说明

1. 2020年7月13日，国信证券股份有限公司2017年面向合格投资者公开发行公司债券(第二期)兑付本息合计人民币6,274,800,000.00元。

2. 2020年7月13日，国信证券股份有限公司2020年度第十期短期融资券发行结束，债券简称：20国信证券CP010，实际发行规模30亿元人民币，票面利率2.60%，期限为89天。

3. 2020年7月13日，国信证券股份有限公司非公开发行2020年永续次级债券(第一期)发行结束，实际发行规模50亿元人民币，票面利率4.50%，在债券存续的前5个计息年度内保持不变，若发行人不行使赎回权，自第6个计息年度起，每5年重置一次票面利率。

4. 2020年7月14日，国信证券股份有限公司2020年度第五期短期融资券兑付本息合计人民币3,011,219,178.08元。

5. 2020年7月22日，国信证券股份有限公司2020年度第六期短期融资券兑付本息合计人民币3,511,909,589.04元。

6. 2020年7月，本公司向深圳投控公司、云南合和(集团)股份有限公司、华润深国投

公司等 10 个特定对象非公开发行人民币普通股（A 股）股票 1,412,429,377 股，增加注册资本人民币 1,412,429,377.00 元，变更后的注册资本为人民币 9,612,429,377.00 元，募集资金总额 14,999,999,983.74 元，减除发行费用人民币 218,442,768.95 元（不含增值税）后，募集资金净额为 14,781,557,214.79 元。其中，计入股本人民币 1,412,429,377.00 元，计入资本公积（股本溢价）13,369,127,837.79 元。上述新增股份的登记托管及限售手续于 2020 年 8 月 10 日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完成，新股于 2020 年 8 月 14 日上市。

7. 2020 年 8 月 13 日，国信证券股份有限公司 2020 年度第七期短期融资券兑付本息合计人民币 4,015,287,671.23 元。

十四、其他重要事项

（一）年金计划

本公司依据相关政策建立了企业年金计划，按照参与企业年金职工当年度工资总额及规定的计提比例确定企业年金缴费总额，并为符合年金方案条件的员工缴纳企业年金。

本公司企业年金计划于 2012 年 12 月正式成立。该年金计划受托管理人和账户管理人为泰康养老保险股份有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司，投资管理人为泰康资产管理有限责任公司。

根据本公司与泰康养老保险股份有限公司签订的《企业年金计划受托管理合同》，在合同存续期内，受托人根据法律法规规定制定企业年金基金投资政策。

（二）分部信息

1. 本公司确定报告分部考虑的因素

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业务分部，本期对业务分部进行了调整，现划分为 5 个业务分部：经纪及财富管理业务分部；投资银行业务分部；投资与交易业务分部；资产管理业务分部；其他分部。每个业务分部为单独的业务分部，提供不同的劳务。本公司的管理层定期审阅这些分部的经营成果，以决定向其配置资源。本公司各个业务分部提供的主要服务分别如下：

(1) 经纪及财富管理业务分部，主要包括：向个人及机构投资者提供证券经纪、期货经纪、代销金融产品、资产托管、投资咨询、融资融券及其他资本中介等服务。

(2) 投资银行业务分部，主要包括：为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并

购重组、新三板推荐等金融服务。

(3) 投资与交易业务分部，主要包括：从事权益类、固定收益类、另类投资类、衍生类产品及其他金融产品的交易和做市业务。

(4) 资产管理业务分部，主要包括：根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合资产管理业务、单一资产管理业务、专项资产管理业务以及基金管理业务等。

(5) 其他分部，主要包括：以上分部业务之外的其他业务以及公司总部运营。

2. 各报告分部利润（亏损）、资产及负债信息

(1) 2020年1-6月

项 目	经纪及财富管理	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
1) 营业收入	4,592,200,638.80	637,026,147.69	1,987,334,258.57	194,818,152.26	627,220,748.44	8,038,599,945.76
手续费及佣金净收入	2,862,284,616.48	637,054,648.48		196,087,626.40	-22,759,481.98	3,672,667,409.38
投资收益（损失）			2,159,667,520.58		206,822,848.66	2,366,490,369.24
其他收入	1,729,916,022.32	-28,500.79	-172,333,262.01	-1,269,474.14	443,157,381.76	1,999,442,167.14
2) 营业支出	2,583,169,017.76	460,449,619.23	385,939,316.05	83,238,121.24	709,482,518.85	4,222,278,593.13
业务及管理费	1,711,576,569.99	455,956,861.37	203,919,599.12	82,081,548.24	478,596,350.15	2,932,130,928.87
3) 营业利润	2,009,031,621.04	176,576,528.46	1,601,394,942.52	111,580,031.02	-82,261,770.41	3,816,321,352.63
4) 利润总额	2,017,764,808.02	176,679,861.81	1,601,498,275.87	111,580,031.02	-287,348,456.18	3,620,174,520.54
5) 资产总额	133,152,932,232.59	915,153,375.06	110,511,210,379.60	667,723,864.31	9,949,192,443.77	255,196,212,295.33
递延所得税资产	710,063,502.80		297,467,858.21	546,393.04	889,030,922.68	1,897,108,676.73
6) 负债总额	127,944,658,717.99	730,801,590.04	54,154,092,387.15	114,038,372.44	20,073,707,554.61	203,017,298,622.23
递延所得税负债			342,296,935.15	418,182.57		342,715,117.72
7) 补充信息						
① 折旧与摊销费用	44,236,928.29	18,321,221.87	3,274,176.04	1,625,506.86	66,861,577.60	134,319,410.66
② 资本性支出	39,187,069.58	3,330,490.05	954,212.40	708,482.12	102,852,884.56	147,033,138.71
③ 信用减值损失	836,128,842.32		168,992,222.24		1,525,772.00	1,006,646,836.56
④ 其他资产减值损失					5,893,797.90	5,893,797.90

(2) 2019年1-6月

项 目	经纪及财富管理	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
1) 营业收入	3,624,411,815.60	499,771,960.43	1,869,705,672.04	155,177,156.44	384,535,519.85	6,533,602,124.36
手续费及佣金净收入	2,408,761,670.32	499,796,175.74		152,891,430.42	-27,449,175.09	3,034,000,101.39
投资收益(损失)			1,722,890,429.59		116,206,752.21	1,839,097,181.80
其他收入	1,215,650,145.28	-24,215.31	146,815,242.45	2,285,726.02	295,777,942.73	1,660,504,841.17
2) 营业支出	1,612,182,947.06	438,269,385.97	401,632,887.72	69,002,127.08	564,789,550.64	3,085,876,898.47
业务及管理费	1,435,311,107.61	434,744,544.26	223,951,565.25	68,049,870.79	388,929,972.72	2,550,987,060.63
3) 营业利润	2,012,228,868.54	61,502,574.46	1,468,072,784.32	86,175,029.36	-180,254,030.79	3,447,725,225.89
4) 利润总额	2,031,104,098.82	62,301,594.32	1,468,072,784.31	86,175,029.36	-315,095,369.44	3,332,558,137.37
5) 资产总额	124,074,113,872.23	893,880,283.94	104,587,022,093.82	697,747,342.24	3,690,375,176.46	233,943,138,768.69
递延所得税资产	375,128,541.45		156,393,372.87	3,200,080.24	815,342,218.51	1,350,064,213.07
6) 负债总额	118,150,868,118.67	713,094,681.79	54,026,435,024.57	97,247,081.53	7,051,362,878.62	180,039,007,785.18
递延所得税负债			180,150,895.02	147,054.66		180,297,949.68
7) 补充信息						
① 折旧与摊销费用	37,268,817.29	18,330,302.37	2,748,750.89	966,077.74	68,342,215.95	127,656,164.24
② 资本性支出	29,077,984.97	4,967,522.45	903,290.67	630,005.05	132,393,209.06	167,972,012.20
③ 信用减值损失	148,181,264.85		169,583,433.01		3,931,566.56	321,696,264.42
④ 其他资产减值损失					852,368.56	852,368.56

注：2019年1-6月数据已按照本年的分部口径进行披露

(三) 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

1. 出具告慰函

2011年2月22日，本公司就国信香港公司向 STANDARD CHARTERED BANK (HONGKONG) LIMITED (渣打银行(香港)有限公司)及 STANDARD CHARTERED BANK 出具告慰函，本公司确认知晓 STANDARD CHARTERED BANK、其各分行及/或附属公司与关联公司 (STANDARD CHARTERED BANK (HONGKONG) LIMITED 渣打银行(香港)有限公司) 现时提供予本公司之一个或多个子公司的一切融资以及进行的金融衍生产品交易，以及银行未来可能向公司提供融资或是金融衍生产品交易。鉴于银行提供和/或继续提供前述融资、给予子公司任何信贷或其他融资、或进行和/或继续进行金融衍生产品交易或其他交易，本公司向银行保证，不允许子公司在完全清偿其对银行之负债、或履行其对银行之义务之前，进行清算(无论自愿清算或强制清算)或与其债权人达成任何债务重组协议或安排。本公司确认，本告慰函将适用于银行今后可能向子公司提供之全新的或额外新增的任何融资或金融衍生产品交易。本告慰函并不构成对本公司具有法律约束力的义务或责任。

本公司于2015年9月29日就国信香港公司融资事项向大新银行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会大新银行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对大新银行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对大新银行应尽义务的行动，将对影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会大新银行；本公司和国信香港公司将向大新银行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供大新银行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对大新银行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于2019年1月就国信证券(香港)经纪有限公司的融资事项向民生银行香港分行出具安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港100%股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港按照银行的要求及时履行并偿付相关债务。安慰函将一直维持有效，直至国信香港在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日(以较后发生者为准)失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于2019年5月就国信香港公司的融资事项向南洋商业银行有限公司出具了承诺函，主要内容为国信证券继续直接或间接地拥有及持有国信香港的全部股份，并且维持对国信香港的最终管理控制权；就合理认为会影响国信香港持续性经营的情况实时通知银行，并督促国信香港履行还款责任。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于2019年8月就国信香港公司的融资事项向上海银行(香港)出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港100%股本权益及控制权，将督促国信香港业务

运作正常，将促使并监督国信香港按照银行的要求及时履行并偿付相关债务。安慰函将一直维持有效，直至国信香港在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

2019年11月12日就国信香港公司融资事项向永丰银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会永丰银行香港分行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对永丰银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对永丰银行香港分行应尽义务的行动，对将影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会永丰银行香港分行；本公司和国信香港公司将向永丰银行香港分行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供永丰银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对永丰银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

2020年5月21日国信香港公司融资事项向中国信托商业银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会中国信托商业银行香港分行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对中国信托商业银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对中国信托商业银行香港分行应尽义务的行动，对将影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会中国信托商业银行香港分行；本公司和国信香港公司将向中国信托商业银行香港分行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供中国信托商业银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对中国信托商业银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

2. 国信香港公司为全资子公司提供担保

截至2020年6月30日，国信香港公司为其全资子公司的常规业务提供的担保金额计港币20,000万元。

3. 债券借贷

本公司借入债券的类别及公允价值具体如下：

债券类别	期末公允价值	期初公允价值
国债	3,889,845,930.00	4,180,351,569.00
地方政府债	3,084,696,559.00	2,117,658,397.00
金融债		149,532,200.00
合计	6,974,542,489.00	6,447,542,166.00

注：本公司通过借入方式取得的债券全部为卖出回购业务而设定质押

十五、其他补充资料

(一) 非经常性损益

项 目	金 额	说 明
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-54,585.90	
计入当期损益的政府补助（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）	27,504,613.75	
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-192,782,139.41	
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回	1,646,752.81	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-19,248,836.14	
小 计	-182,934,194.89	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	-45,506,801.08	
少数股东权益影响额(税后)		
归属于母公司所有者的非经常性损益净额	-137,427,393.81	

(二) 净资产收益率及每股收益

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益(元/股)	
		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	5.41	0.34	0.34
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	5.67	0.36	0.36





会计师事务所 执业证书

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）

首席合伙人：胡少先

主任会计师：

经营场所：浙江省杭州市西溪路128号6楼

组织形式：特殊普通合伙

执业证书编号：33000001

批准执业文号：浙财会（2011）25号

批准执业日期：1988年11月21日设立，2011年6月28日转制



证书序号：0007666

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批，准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的，应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止或执业许可注销的，应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



发证机关：

2019年12月25日

中华人民共和国财政部制

仅为国信证券股份有限公司2020年1-6月审阅报告之目的而提供文件的复印件，仅用于说明天健会计师事务所（特殊普通合伙）具有执业资质未经本所书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方传
送或披露。



证书序号：000390

会计师事务所 证券、期货相关业务许可证

经财政部、中国证券监督管理委员会审查，批准
天健会计师事务所（特殊普通合伙） 执行证券、期货相关业务。

首席合伙人：胡少先



证书号：44

发证时间：二〇二〇年十一月八日

证书有效期至：二〇二一年十一月八日



仅为国信证券股份有限公司2020年1-6月审阅报告之目的而提供文件的复印件，仅用于说明天健会计师事务所（特殊普通合伙）具有证券期货相关业务执业资质未经本所书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方传送给披露。



营业执照

(副本)

统一社会信用代码
913300005793421213 (1/3)

扫描二维码
登录国家企业信用信息公示系统
了解更多登记、备案、许可、监管信息



名称 天健会计师事务所(特殊普通合伙)
 成立日期 2011年07月18日
 类型 特殊普通合伙企业
 合伙期限 2011年07月18日至长期
 执行事务合伙人 胡少先
 主要经营场所 浙江省杭州市西湖区西溪路128号6楼

经营范围
 审计企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具相关报告；基本建设年度决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；信息系统审计；法律、法规规定展的其他业务。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)

登记机关

2020

年08

月13

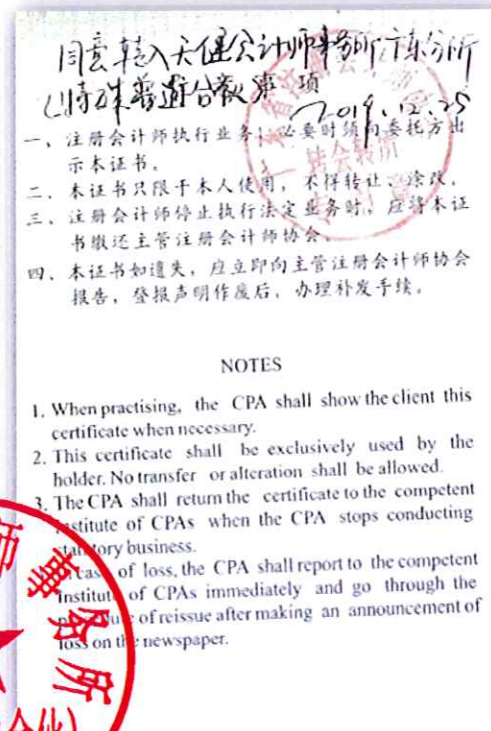
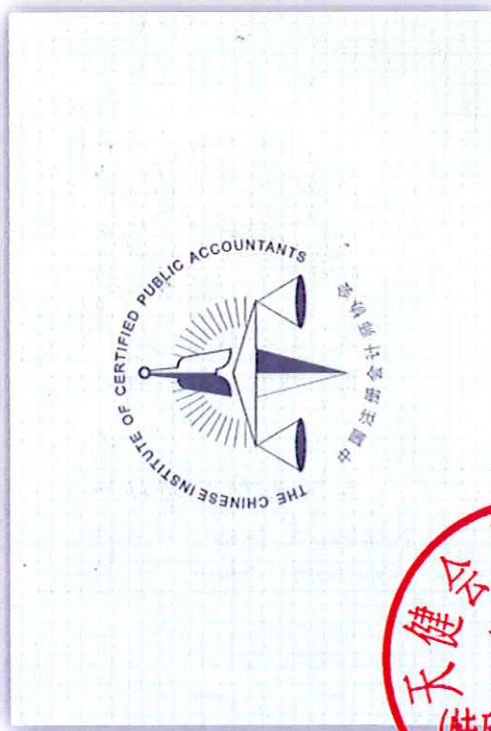


国家企业信用信息公示系统网址：<http://www.gsxt.gov.cn>

(特殊普通合伙) 每年1月1日至6月30日通过
注册会计师事务所 提供财务报告

国家市场监督管理总局监制

仅为国信证券股份有限公司2020年1-6月审阅报告之目的而提供文件的复印件，仅用于说明天健会计师事务所(特殊普通合伙)合法经营未经本所书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方
 传送或披露。



仅为国信证券股份有限公司2020年1-6月审阅报告后附之目的而提供文件的复印件，仅用于说明谢军是中国注册会计师，未经谢军本人书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方传送或披露。

姓名 黄燕
Full name
性别 女
Sex
出生日期 1989-10-02
Date of birth
工作单位 瑞华会计师事务所(特殊普通
Working unit (普通合伙) 深圳分所
身份证号码
Identity card No. 659424468946622927



年度检验登记
Annual Renewal Registration



一年,
or after

黄燕
110101301656
深圳市注册会计师协会

年 月 日
/y /m /d

5

证书编号:
No. of Certificate 110101301656

批准注册协会:
Authorized Institute of CPAs 深圳市注册会计师协会


发证日期:
Date of Issuance 2019 年 03 月 03 日

4

注册会计师工作单位变更事项登记
Registration of the Change of Working Unit by a CPA

同意调出
Agree the holder to be transferred from


瑞华会计师事务所(特殊普通合伙) 事务所
深圳分所 CPAs



转出协会盖章
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs
2019 年 12 月 31 日
/y /m /d

同意调入
Agree the holder to be transferred to

天健会计师事务所 事务所
转会转入 广东分所 CPAs



转入协会盖章
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs
2019 年 12 月 27 日
/y /m /d

仅为国信证券股份有限公司2020年1-6月审阅报告之目的而提供文件的复印件，仅用于说黄燕是中国注册会计师，未经黄燕本人书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方传送或披露。