

# 东兴证券股份有限公司

## 2020 年半年度报告

## 重要提示

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

### 二、未出席董事情况

| 未出席董事职务 | 未出席董事姓名 | 未出席董事的原因说明 | 被委托人姓名 |
|---------|---------|------------|--------|
| 董事      | 张军      | 临时公务       | 谭世豪    |

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人魏庆华、主管会计工作负责人张涛及会计机构负责人（会计主管人员）郝洁声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

### 五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

无

### 六、前瞻性陈述的风险声明

√适用□不适用

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

### 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

### 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况

否

### 九、重大风险提示

公司各项业务与国内宏观经济环境、资本市场走势高度相关，资本市场的剧烈波动及证券行业的监管政策调整，都将对公司经营业绩产生重大影响。

本公司面临的风险主要包括：因未能对法律法规和监管条例及时跟进而造成的法律以及合规风险；持仓金融头寸的市场价格变动而导致损失的市场风险；因客户、证券发行人或交易对手无法履行合约责任而造成经济损失的信用风险；因不充足或不完善的内部流程、人员和系统或外部事件而带来直接或间接损失的操作风险；持有的金融工具不能以合理的价格迅速变现而遭受损失及无法偿还到期债务的流动性风险等。与上一年度所提示的风险因素无重大变化。

针对上述风险，公司从组织架构、制度体系、人员管理、信息技术等方面进行防范，同时优化业务流程，详见本报告“第四节 经营情况讨论与分析”之“三、其他披露事项”之“（二）可能面对的风险”。

## 十、其他

适用 不适用

## 目 录

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| 第一节  | 释义.....             | 5   |
| 第二节  | 公司简介和主要财务指标.....    | 5   |
| 第三节  | 公司业务概要.....         | 11  |
| 第四节  | 经营情况的讨论与分析.....     | 14  |
| 第五节  | 重要事项.....           | 33  |
| 第六节  | 普通股股份变动及股东情况.....   | 45  |
| 第七节  | 优先股相关情况.....        | 47  |
| 第八节  | 董事、监事、高级管理人员情况..... | 47  |
| 第九节  | 公司债券相关情况.....       | 49  |
| 第十节  | 财务报告.....           | 64  |
| 第十一节 | 备查文件目录.....         | 209 |
| 第十二节 | 证券公司信息披露.....       | 209 |

## 第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

| 常用词语释义       |   |                                                      |
|--------------|---|------------------------------------------------------|
| 东兴证券、公司、本公司  | 指 | 东兴证券股份有限公司                                           |
| 中国东方或东方集团    | 指 | 中国东方资产管理股份有限公司                                       |
| 东兴期货         | 指 | 东兴期货有限责任公司                                           |
| 东兴投资         | 指 | 东兴证券投资有限公司                                           |
| 东兴资本         | 指 | 东兴资本投资管理有限公司                                         |
| 东兴香港         | 指 | 东兴证券（香港）金融控股有限公司                                     |
| 东兴基金         | 指 | 东兴基金管理有限公司                                           |
| 大连银行         | 指 | 大连银行股份有限公司                                           |
| 中华联合保险       | 指 | 中华联合保险集团股份有限公司                                       |
| 中国证监会        | 指 | 中国证券监督管理委员会                                          |
| 北京证监局        | 指 | 中国证券监督管理委员会北京监管局                                     |
| 福建证监局        | 指 | 中国证券监督管理委员会福建监管局                                     |
| 财政部          | 指 | 中华人民共和国财政部                                           |
| 中国银保监会       | 指 | 中国银行保险监督管理委员会                                        |
| 上交所          | 指 | 上海证券交易所                                              |
| 深交所          | 指 | 深圳证券交易所                                              |
| 中证登          | 指 | 中国证券登记结算有限责任公司                                       |
| 全国中小企业股份转让系统 | 指 | 全国中小企业股份转让系统有限责任公司                                   |
| 《公司法》        | 指 | 《中华人民共和国公司法》                                         |
| 《证券法》        | 指 | 《中华人民共和国证券法》                                         |
| 万得资讯         | 指 | 上海万得信息技术股份有限公司                                       |
| A 股          | 指 | 本公司普通股股本中每股面值为人民币 1.00 元的内资股，于上海证券交易所上市（股份代码：601198） |
| A 股股东        | 指 | A 股持有人                                               |
| 报告期/报告期末     | 指 | 2020 年度 1-6 月/2020 年 6 月 30 日                        |
| 元、万元、亿元      | 指 | 人民币元、人民币万元、人民币亿元                                     |

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司信息

|           |                                      |
|-----------|--------------------------------------|
| 公司的中文名称   | 东兴证券股份有限公司                           |
| 公司的中文简称   | 东兴证券                                 |
| 公司的外文名称   | DongxingSecuritiesCorporationLimited |
| 公司的外文名称缩写 | DongxingSecuritiesCo.,Ltd.           |
| 公司的法定代表人  | 魏庆华                                  |
| 公司总经理     | 张涛                                   |

注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

|      | 本报告期末             | 上年度末              |
|------|-------------------|-------------------|
| 注册资本 | 2,757,960,657.00  | 2,757,960,657.00  |
| 净资产  | 17,519,773,971.06 | 16,620,218,651.57 |

公司的各单项业务资格情况

√适用□不适用

公司经营范围包括：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；证券投资基金销售；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理；保险兼业代理。

此外，公司及各子公司还具有以下业务资格：

| 序号 | 业务资格                              | 批准机构                | 取得时间     |
|----|-----------------------------------|---------------------|----------|
| 1  | 上市公司股权激励行权融资业务试点                  | 深交所                 | 2020年4月  |
| 2  | 标准债券远期交易                          | 全国银行间同业拆借中心         | 2019年12月 |
| 3  | 信用风险缓释工具一般交易商                     | 中国银行间市场交易商协会        | 2019年11月 |
| 4  | 北京股权交易中心推荐机构会员                    | 北京股权交易中心有限公司        | 2019年8月  |
| 5  | 基差贸易                              | 中国期货业协会             | 2018年7月  |
| 6  | 定价服务业务和合作套保业务                     | 中国期货业协会             | 2017年11月 |
| 7  | 仓单业务                              | 中国期货业协会             | 2017年2月  |
| 8  | 场外期权业务二级交易商                       | 中国证券业协会             | 2018年12月 |
| 9  | 私募基金子公司管理人                        | 中国证券业协会             | 2018年7月  |
| 10 | 香港第4类（就证券提供意见）牌照                  | 香港证券及期货事务监察委员会      | 2017年2月  |
| 11 | 香港第9类（提供资产管理）牌照                   | 香港证券及期货事务监察委员会      | 2017年2月  |
| 12 | 深港通业务交易权限                         | 深交所                 | 2016年11月 |
| 13 | 非金融企业债务融资工具承销业务资格                 | 中国银行间市场交易商协会        | 2016年10月 |
| 14 | 香港放债人牌照                           | 香港东区裁判法院            | 2016年6月  |
| 15 | 受托管理保险资金的资格                       | 原中国保险监督管理委员会        | 2016年3月  |
| 16 | 私募基金业务外包服务机构                      | 中国证券投资基金业协会         | 2015年11月 |
| 17 | 香港第6类（就机构融资提供意见）牌照                | 香港证券及期货事务监察委员会      | 2016年2月  |
| 18 | 香港第1类（证券交易）牌照                     | 香港证券及期货事务监察委员会      | 2016年2月  |
| 19 | 利率互换业务                            | 全国银行间同业拆借中心         | 2015年8月  |
| 20 | 军工涉密业务咨询服务安全保密资格                  | 国家国防科技工业局           | 2015年7月  |
| 21 | 期货公司资产管理业务                        | 中国期货业协会             | 2015年4月  |
| 22 | 期权结算业务资格                          | 中证登                 | 2015年1月  |
| 23 | 上海证券交易所股票期权交易参与者（股票期权经纪、自营业务交易权限） | 上交所                 | 2015年1月  |
| 24 | 公开募集证券投资基金管理业务资格                  | 中国证监会               | 2015年1月  |
| 25 | 柜台市场业务                            | 中国证券业协会             | 2014年12月 |
| 26 | 互联网证券业务                           | 中国证券业协会             | 2014年12月 |
| 27 | 开展客户资金消费支付服务业务                    | 中国证券投资者保护基金有限责任公司   | 2014年11月 |
| 28 | 港股通业务                             | 上交所                 | 2014年10月 |
| 29 | 证券质押登记业务                          | 中证登                 | 2014年8月  |
| 30 | 报价系统参与者                           | 原中证资本市场发展监测中心有限责任公司 | 2014年8月  |
| 31 | 主办券商业务(做市业务)                      | 全国中小企业股份转让系统        | 2014年7月  |
| 32 | 海峡股权交易中心推荐挂牌及代理买卖业务               | 中国证券业协会             | 2014年6月  |
| 33 | 转融券业务                             | 中国证券金融股份有限公司        | 2014年6月  |
| 34 | 保险兼业代理资格                          | 原中国保险监督管理委员会北京监管局   | 2013年11月 |

|    |                   |                      |                            |
|----|-------------------|----------------------|----------------------------|
| 35 | 股票质押式回购业务         | 深交所、上交所              | 2013 年 8 月                 |
| 36 | 私募基金综合托管业务        | 中国证监会                | 2013 年 6 月                 |
| 37 | 主办券商业务(推荐业务、经纪业务) | 全国中小企业股份转让系统         | 2013 年 3 月                 |
| 38 | 约定购回式证券交易资格       | 深交所、上交所              | 2013 年 2 月、<br>2012 年 12 月 |
| 39 | 期货投资咨询业务资格        | 中国证监会上海证监局           | 2013 年 1 月                 |
| 40 | 代销金融产品业务资格        | 中国证监会                | 2013 年 1 月                 |
| 41 | 转融通业务             | 中国证券金融股份有限公司         | 2013 年 1 月                 |
| 42 | 向保险机构投资者提供综合服务    | 原中国保险监督管理委员会         | 2012 年 10 月                |
| 43 | 融资融券业务资格          | 中国证监会                | 2012 年 5 月                 |
| 44 | 同业拆借业务            | 中国人民银行上海总部           | 2011 年 9 月                 |
| 45 | 金融期货经纪            | 中国证监会                | 2010 年 10 月                |
| 46 | 证券资产管理            | 中国证监会                | 2009 年 7 月                 |
| 47 | 证券自营              | 中国证监会                | 2009 年 7 月                 |
| 48 | 证券投资基金销售          | 中国证监会                | 2009 年 7 月                 |
| 49 | 保荐业务资格            | 中国证监会                | 2009 年 1 月                 |
| 50 | 银行间债券交易业务         | 中国外汇交易中心/全国银行间同业拆借中心 | 2008 年 12 月                |
| 51 | 权证业务结算            | 中证登                  | 2008 年 10 月                |
| 52 | 中证登乙类结算参与者        | 中证登                  | 2008 年 8 月                 |
| 53 | 证券承销与保荐           | 中国证监会                | 2008 年 5 月                 |
| 54 | 与证券交易、证券投资有关的财务顾问 | 中国证监会                | 2008 年 5 月                 |
| 55 | 证券投资咨询            | 中国证监会                | 2008 年 5 月                 |
| 56 | 证券经纪              | 中国证监会                | 2008 年 5 月                 |
| 57 | 交易结算资金第三方存管资格     | 中国证监会                | 2007 年 6 月                 |

## 二、联系人和联系方式

|      | 董事会秘书             | 证券事务代表            |
|------|-------------------|-------------------|
| 姓名   | 张锋                | 朵莎                |
| 联系地址 | 北京市西城区金融大街5号B座15层 | 北京市西城区金融大街5号B座15层 |
| 电话   | 010-66555171      | 010-66555171      |
| 传真   | 010-66555397      | 010-66555397      |
| 电子信箱 | dshms@dxzq.net.cn | dshms@dxzq.net.cn |

## 三、基本情况变更简介

|              |                                    |
|--------------|------------------------------------|
| 公司注册地址       | 北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层           |
| 公司注册地址的邮政编码  | 100033                             |
| 公司办公地址       | 北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）B座6、10、12、15、16层 |
| 公司办公地址的邮政编码  | 100033                             |
| 公司网址         | http://www.dxzq.net                |
| 电子信箱         | dshms@dxzq.net.cn                  |
| 经纪业务客户服务热线   | 95309                              |
| 股东联络热线       | 010-66555171                       |
| 报告期内变更情况查询索引 | 不适用                                |

#### 四、信息披露及备置地点变更情况简介

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 公司选定的信息披露报纸名称        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 |
| 登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址 | http://www.sse.com.cn |
| 公司半年度报告备置地点          | 北京市西城区金融大街5号B座15层     |
| 报告期内变更情况查询索引         | 不适用                   |

#### 五、公司股票简况

| 股票种类 | 股票上市交易所 | 股票简称 | 股票代码   | 变更前股票简称 |
|------|---------|------|--------|---------|
| A股   | 上海证券交易所 | 东兴证券 | 601198 | 不适用     |

#### 六、其他有关资料

适用 不适用

#### 七、公司主要会计数据和财务指标

##### (一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

| 主要会计数据                | 本报告期<br>(1-6月)    | 上年同期              | 本报告期比上年<br>同期增减(%)  |
|-----------------------|-------------------|-------------------|---------------------|
| 营业收入                  | 2,525,534,532.10  | 1,887,329,793.75  | 33.82               |
| 归属于母公司股东的净利润          | 786,072,139.81    | 863,774,970.74    | -9.00               |
| 归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 789,429,803.05    | 810,080,509.52    | -2.55               |
| 经营活动产生的现金流量净额         | -1,194,471,907.37 | 9,755,658,076.02  | 不适用                 |
| 其他综合收益                | -116,849,844.09   | 229,731,842.01    | 不适用                 |
| 主要会计数据                | 本报告期末             | 上年度末              | 本报告期末比上年<br>度末增减(%) |
| 资产总额                  | 84,535,923,562.60 | 77,543,564,327.72 | 9.02                |
| 负债总额                  | 63,923,735,761.10 | 57,214,649,468.77 | 11.73               |
| 归属于母公司股东的权益           | 20,574,051,011.79 | 20,292,487,586.31 | 1.39                |
| 所有者权益总额               | 20,612,187,801.50 | 20,328,914,858.95 | 1.39                |

##### (二) 主要财务指标

| 主要财务指标                  | 本报告期<br>(1-6月) | 上年同期  | 本报告期比上年<br>同期增减(%) |
|-------------------------|----------------|-------|--------------------|
| 基本每股收益(元/股)             | 0.285          | 0.313 | -8.95              |
| 稀释每股收益(元/股)             | 不适用            | 不适用   | 不适用                |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)   | 0.286          | 0.294 | -2.72              |
| 加权平均净资产收益率(%)           | 3.82           | 4.36  | 减少0.54个百分点         |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%) | 3.84           | 4.09  | 减少0.25个百分点         |

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用



**(三) 母公司的净资本及风险控制指标**

单位：元 币种：人民币

| 项目                   | 本报告期末             | 上年度末              |
|----------------------|-------------------|-------------------|
| 净资本                  | 17,519,773,971.06 | 16,620,218,651.57 |
| 净资产                  | 20,350,984,844.37 | 20,005,517,279.43 |
| 各项风险资本准备之和           | 7,791,916,685.02  | 7,369,361,339.50  |
| 表内外资产总额              | 64,567,285,161.51 | 58,492,002,420.30 |
| 风险覆盖率(%)             | 224.85            | 225.53            |
| 资本杠杆率(%)             | 24.31             | 26.99             |
| 流动性覆盖率(%)            | 237.37            | 916.77            |
| 净稳定资金率(%)            | 151.08            | 156.65            |
| 净资本/净资产(%)           | 86.09             | 83.08             |
| 净资本/负债(%)            | 41.47             | 44.71             |
| 净资产/负债(%)            | 48.17             | 53.82             |
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本(%)  | 28.73             | 30.76             |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%) | 176.86            | 176.72            |
| 融资(含融券)的金额/净资本(%)    | 100.21            | 101.49            |

注：上表按照《证券公司风险控制指标计算标准规定》计算，母公司各项业务风险控制指标均符合中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》的有关规定。

**八、境内外会计准则下会计数据差异**
 适用  不适用

**九、非经常性损益项目和金额**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 非经常性损益项目                                                   | 金额                   | 附注(如适用)   |
|------------------------------------------------------------|----------------------|-----------|
| 非流动资产处置损益                                                  | 148,566.43           | 主要是固定资产处置 |
| 计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外 | 1,756,120.63         | 主要是政府补助   |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出                                         | -6,261,883.08        | 主要是公益捐赠支出 |
| 所得税影响额                                                     | 999,532.78           |           |
| <b>合计</b>                                                  | <b>-3,357,663.24</b> |           |

**十、其他**
 适用  不适用

按《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式(2017 年修订)》(证监会公告[2017]18 号)的要求编制的主要财务数据和财务报表中同比变动幅度超过 30.00%的重要项目如下：

单位：元 币种：人民币

| 项目   | 2020 年 6 月 30 日   | 2019 年 12 月 31 日  | 增减幅度(%) | 变动原因        |
|------|-------------------|-------------------|---------|-------------|
| 货币资金 | 13,801,061,506.21 | 10,512,431,794.22 | 31.28   | 主要系客户资金增长所致 |

|           |                     |                     |                 |                              |
|-----------|---------------------|---------------------|-----------------|------------------------------|
| 结算备付金     | 4,107,114,666.38    | 3,009,792,422.15    | 36.46           | 主要系客户结算备付金增长所致               |
| 存出保证金     | 1,592,278,379.21    | 850,420,028.46      | 87.23           | 主要系交易保证金增加所致                 |
| 衍生金融资产    | -                   | 7,750,862.27        | -100.00         | 主要系场外期权业务减少所致                |
| 应收款项      | 200,634,098.85      | 415,554,170.15      | -51.72          | 主要系东兴香港收回部分应收客户款项所致          |
| 短期借款      | 2,573,063,147.23    | 1,661,802,273.49    | 54.84           | 主要系融资增加所致                    |
| 应付短期融资款   | 9,883,555,638.27    | 6,593,445,526.71    | 49.90           | 主要系融资增加所致                    |
| 交易性金融负债   | 26,222,233.11       | 40,945,748.36       | -35.96          | 主要系部分收益凭证到期所致                |
| 代理买卖证券款   | 14,450,081,233.62   | 10,702,647,027.52   | 35.01           | 主要系客户资金增长所致                  |
| 应付款项      | 1,757,033,697.18    | 233,131,373.19      | 653.67          | 主要系应付保证金增加所致                 |
| 合同负债      | 11,538,771.73       | 不适用                 | 不适用             | 主要系实施新收入准则所致                 |
| 应交税费      | 186,680,209.15      | 49,129,655.08       | 279.97          | 主要系期末应交个人所得税增加所致             |
| 递延所得税负债   | 13,937,666.99       | 4,175,306.78        | 233.81          | 主要系应税暂时性差异增加所致               |
| 其他负债      | 1,735,296,889.54    | 4,243,620,247.56    | -59.11          | 主要系应付合并结构化主体权益持有者款项减少所致      |
| 其他综合收益    | 140,641,997.57      | 258,346,958.98      | -45.56          | 主要系其他债权投资和其他权益工具公允价值变动所致     |
| <b>项目</b> | <b>2020 年 1-6 月</b> | <b>2019 年 1-6 月</b> | <b>增减幅度 (%)</b> | <b>变动原因</b>                  |
| 利息净收入     | 464,460,594.82      | 289,288,591.37      | 60.55           | 主要系证券经纪业务相关利息收入增加,同时融资成本降低所致 |
| 投资收益      | 637,858,171.07      | 80,461,004.22       | 692.75          | 主要系处置金融工具收益增加所致              |
| 公允价值变动收益  | 136,020,638.56      | 473,855,225.40      | -71.29          | 主要系金融资产公允价值变动所致              |
| 汇兑收益      | 4,532,503.97        | -7,542,431.20       | 不适用             | 主要系汇率变动所致                    |
| 其他收益      | 2,290,887.32        | 1,334,549.71        | 71.66           | 主要系收到与日常活动相关政府补助增加所致         |
| 其他业务收入    | 339,905,801.14      | 3,895,992.66        | 8,624.50        | 主要系子公司执行新收入准则列示变动所致          |
| 信用减值损失    | 40,978,142.51       | -89,413,901.36      | 不适用             | 主要系债权类资产计提信用减值损失增加所致         |
| 其他业务成本    | 345,713,426.11      | 2,204,568.87        | 15,581.68       | 主要系子公司执行新                    |

|               |                   |                   |          |                                |
|---------------|-------------------|-------------------|----------|--------------------------------|
|               |                   |                   |          | 收入准则列示变动所致                     |
| 营业外收入         | 1,663,309.53      | 71,010,006.84     | -97.66   | 主要系非经营性收入减少所致                  |
| 营业外支出         | 8,459,959.30      | 597,929.62        | 1,314.88 | 主要系捐赠支出增加所致                    |
| 所得税费用         | 248,701,050.80    | 172,972,120.67    | 43.78    | 主要系应税收入增加及递延所得税资产转回所致          |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -1,194,471,907.37 | 9,755,658,076.02  | 不适用      | 主要系回购业务资金净流入减少，以及偿付结构化主体资金增加所致 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 2,535,337,011.61  | -4,107,496,885.91 | 不适用      | 主要系购置或处置其他债权投资现金净流入增加所致        |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 2,002,799,650.49  | -539,059,350.71   | 不适用      | 主要系债务融资增加所致                    |

### 第三节 公司业务概要

#### 一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

##### （一）公司主要业务及经营模式

经中国证监会批准，本公司从事的主要业务为：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；证券投资基金销售；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理；保险兼业代理。

全资子公司东兴期货从事的主要业务为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。

全资子公司东兴投资从事的主要业务为：对金融产品的投资、项目投资、股权投资（以上均不含需经许可审批的事项，应当符合法律法规、监管要求）。

全资子公司东兴资本从事的主要业务为：投资管理；投资顾问；股权投资；受托管理股权投资基金；财务顾问服务。

全资子公司东兴香港及其子公司可从事的主要业务为：投资管理；香港证监会核准的第 1 类（证券交易）、第 4 类（就证券提供意见）、第 6 类（就机构融资提供意见）、第 9 类（提供资产管理）及东区裁判法院发出的香港放债人牌照。

全资子公司东兴基金从事的主要业务为：公开募集证券投资基金管理、基金销售和中国证监会许可的其他业务<sup>1</sup>。

<sup>1</sup> 2020 年 2 月，中国证监会下发《关于核准东兴证券股份有限公司设立基金子公司的批复》，批准设立基金公司。3 月 17 日，东兴基金取得工商营业执照。5 月 25 日，东兴证券向东兴基金注资 20,000.00 万元，持有其 100% 的股权。截至报告期末，东兴基金尚未取得《经营证券期货业务许可证》，尚未开展相关业务。

公司及各子公司所开展的主要业务的简要情况及盈利模式情况如下：

| 业务模块   | 主要子业务      | 主要盈利模式               |
|--------|------------|----------------------|
| 财富管理业务 | 证券经纪业务     | 代理买卖证券佣金、手续费         |
|        | 信用业务       | 利息收入                 |
| 自营业务   | 权益类投资业务    | 投资收益                 |
|        | 固定收益类投资业务  |                      |
| 投资银行业务 | 股权融资业务     | 承销费、保荐费              |
|        | 债券融资业务     | 承销费                  |
|        | 财务顾问业务     | 财务顾问费                |
| 资产管理业务 | 证券公司资产管理业务 | 管理费、业绩报酬             |
|        | 公募基金管理业务   | 管理费                  |
| 其他业务   | 海外业务       | -                    |
|        | 期货业务       | 代理买卖期货手续费、基差贸易以及价差收益 |
|        | 另类投资业务     | 投资收益                 |
|        | 私募投资基金管理   | 管理费、业绩报酬             |

## （二）证券行业情况

报告期内，沪深股基累计成交金额946,753.59亿元，同比上升28.25%；沪深300指数上涨1.65%，创业板指数上涨35.60%。报告期末，沪深两市融资融券余额11,637.68亿元，较2019年同期上升27.77%；报告期内，一级市场股票IPO融资额1,392.74亿元，同比增加130.86%；权益类再融资（不含发行股票购买资产类增发和可交换债）4,819.71亿元，同比下降2.45%；上半年债券（不含同业存单）发行总规模18.06万亿元，同比上升34.88%；其中信用债券（扣除国债、政策性银行金融债、地方政府债）发行总金额9.25万亿元，同比增长39.73%。

2020年上半年，据中国证券业协会统计，行业总收入2,134.04亿元，同比上升19.26%；净利润831.47亿元，同比上升24.73%。报告期末，证券行业总资产规模8.03万亿元，较上年末增长10.61%；净资产规模2.09万亿元，较上年末增长3.47%；净资本规模1.67万亿元，较上年末增长3.09%。

## 二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

√适用□不适用

详见本报告“第四节 经营情况的讨论与分析”之“二、报告期主要经营情况”之“（二）财务报表分析”之“5、资产、负债情况分析”。

其中：境外资产 69.43（单位：亿元 币种：人民币），占总资产的比例为 8.21%。

## 三、报告期内核心竞争力分析

√适用□不适用

### （一）集团协同深化发展，打开长期增长空间

公司控股股东中国东方是经国务院批准，由财政部、全国社会保障基金理事会共同发起设立的国有大型非银行金融机构。中国东方注册资本为 682.43 亿元，业务涵盖不良资产、保险、银

行、证券、信托、普惠金融、信用评级和国际业务等，在全国范围内拥有众多分支机构和优质客户资源。2017 年，中国东方成功引入全国社会保障基金理事会、中国电信集团有限公司、国新资本有限公司、上海电气集团股份有限公司等四家投资者，资本实力进一步增强，为做大做强不良资产主业以及东方集团协同发展奠定了坚实基础。2020 年，中国东方全面服务实体经济，重点发展不良资产主业，大力推进市场化债转股业务，深度参与上市公司、实体企业危机救助，履行“保全国有资产、化解金融风险、促进国企改革”的职责。中国东方秉持“稳发展、优动能、防风险、保重点”的原则，稳定主业发展趋势和不良资产业务投放节奏，调整业务结构，持续健全不良资产处置体系，切实贯彻落实国家区域发展战略，对重点机构优先给予资源支持和政策倾斜，打造公司发展特色。

公司依托控股股东的综合金融布局和资源优势，利用中国东方转型升级后的“三重模式”（重组、重整、重构），通过在投行、资管、投资等多项业务领域共同挖掘项目、共享客户资源，共构业务新模式，协同效应显著。

公司作为中国东方旗下唯一的上市金融平台，在中国东方集团内部具有重要的战略地位。未来，公司将从客户、品牌、渠道、产品、信息等方面与中国东方及其下属公司实现资源共享，结合中国东方不良资产主业的优势地位，充分挖掘未来实体经济发展带来的业务机会，打造具有不同需求类型和风险偏好的多层次客户结构，进一步提高公司的客户开发、产品销售和全方位金融服务的竞争力，提高公司金融产品、金融服务的渗透力以及客户的满意度、忠诚度，实现公司各项业务稳健发展。

## （二）深入推进核心业务转型发展，经营业绩稳步增长

公司坚持以“大投行、大资管、大财富”为基本发展战略，以机构客户和高净值客户为中心，深入推进从传统通道业务模式向财富管理与资本中介业务模式的战略转型，收入结构呈多元化发展趋势。2020 年上半年，公司围绕公司发展战略继续加快核心业务的转型与改革，依照国际化、产品化、机构化、专业化、体系化和智能化的变革路径，打造具有公司自身特色的全业务链、全产业链和全生命周期一站式综合服务平台，公司各项核心业务取得突破，经营业绩稳步增长。

大投行业务方面，截至 2020 年 6 月末，公司完成股权项目主承销家数为 11 家，股权主承销项目承销金额 65.81 亿元，公司上半年股票主承销家数及承销金额分列行业第 14 位和第 19 位；债券（公司债、企业债及金融债）主承销家数为 28 家，融资规模 210.44 亿元，较 2019 年同期增长 105.25%，承销收入 10,936.85 万元，较 2019 年同期增长 129.82%。

大资管业务方面，公司坚定不移地推进“品牌财富管理型资管和投资投行型资管”，2020 年上半年，公司不断优化产品结构，持续推进渠道业务的发展和直销客户的储备，2020 年 6 月末公募基金管理非货币资产规模较上年末增长 76.19%，同比增长 413.75%；非货币基金日均管理规模较上年末增长 137.99%，同比增长 442.79%；公募基金管理费收入 1,700.00 万元。

大财富业务方面，公司加快向财富管理转型，公司 2020 年上半年股票基金代理买卖累计成交金额为 1.44 万亿元，市场份额 0.76%。同时，公司积极推进多维度、多层次产品供给体系建



设,丰富分支机构业务抓手。报告期内,公司继续推进 198 综合 APP 功能拓展,支持新三板、创业板客户投资需求,加强理财产品营销,APP 理财客户数同比增长 104.10%,金融产品委托金额同比增长 26.20%。

### （三）合规管理全面加强,风控体系持续完善

公司始终坚持依法合规、稳健经营的理念,依照“健全、合理、制衡、独立”的原则,优化完善“全面、全员、全过程、全覆盖”的风险管理体系,不断完善各项制度流程,为各业务之间建立了有效的风险隔离机制和风险防御机制,能够及时跟进、妥善处理潜在业务风险。2020 年上半年,公司持续完善全面风险管理体系,建立风险控制的动态调整机制,不断优化综合风险管理水平,持续加强各业务条线风险辨识和监控工作,实时关注市场风险事件及敏感信息,成为风险管理者、对冲者、转移者,实现业务一线的风险可控可测,有效帮助和支撑一线业务转型。公司加强业务全面风险排查,充分掌控风险状况;建立奖惩机制,责权利结合,加大考核力度,有奖有罚;加大风险项目清收力度,压缩存量项目规模;进一步完善合规风控体系,成立子公司管理委员会,加强子公司项目管理,确保稳健发展。

### （四）区域资源优势奠定坚实基础

公司已形成全国性的业务布局,并在福建地区具有多年的客户积累和渠道优势。目前公司 45.35%的分支机构分布在福建地区,同时公司经纪业务手续费收入、股基交易量、证券经纪业务利润总额等多项指标持续位于福建证监局辖区(不含厦门)内证券公司前列。福建省是国内经济发达地区之一,民营资本较为活跃,是全国优质中小企业和高净值人群聚集地之一。根据国家统计局数据统计,虽受疫情影响,但福建区域经济状况快速恢复,2020 年上半年福建地区城镇居民人均可支配收入 24,817.00 元,同比增长 1.50%,规模以上工业增加值同比增长 0.10%,其中高技术产业增加值同比增长 1.90%。区域经济的快速发展和高新技术产业的崛起为公司各项业务开展提供了良好机遇。

## 第四节 经营情况的讨论与分析

### 一、经营情况的讨论与分析

2020 年上半年,新型冠状病毒肺炎疫情在全球发酵,加剧宏观经济下行压力,致使市场短期震荡,交易活跃度和风险偏好下降,短期内券商自营业务、经纪业务与两融业务承压,投行业务节奏放缓,但仍有许多亮点。

疫情以来,政府反应及时,除发布减税、降费、补贴等政策之外,加大对市场的流动性支持,平稳市场,提振市场信心;加速国内资本市场改革,监管机构出台相关利好政策。其中,创业板注册制是 2020 年资本市场最大的基础制度改革;多项基础制度充分借鉴科创板的经验,预计将从经纪业务、承销保荐、跟投、两融等方面释放证券行业的利润空间;再融资新规正式落地,新三板落实精选层转板机制,利好投行业务,有望进入大投行时代。此外,各券商业务结构优化,

线上办公效率较高。2020 年上半年，随着国内经济的持续复苏以及系统性风险的缓解，股市行情普涨。公司坚持稳中求进工作总基调，依照国际化、产品化、机构化、专业化、体系化和智能化的变革路径，打造具有公司自身特色的全业务链、全产业链和全生命周期一站式综合服务平台，迎合金融监管政策，积极把握市场机会，加快财富管理转型，全力加强风险防控，实现经营业绩稳步增长。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司总资产 845.36 亿元，较年初增加 69.92 亿元，增幅为 9.02%；净资产 206.12 亿元，较年初增加 2.83 亿元，增幅为 1.39%；净资本为 175.20 亿元，风险覆盖率达到 224.85%，具有较强的抗风险能力。报告期内，公司实现营业收入 25.26 亿元，同比增加 33.82%；实现归属于母公司股东的净利润 7.86 亿元，同比下降 9.00%；每股收益为 0.285 元。

## 二、报告期主要经营情况

### （一）主营业务分析

公司的业务主要分为五个分部：财富管理业务、自营业务、投资银行业务、资产管理业务和其他业务。



| 财富管理业务                                                                                                                       | 自营业务                                                                                                       | 投资银行业务                                                                                                   | 资产管理业务                                                                                                           | 其他业务                                                                                                         |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 证券经纪买卖</li> <li>■ 金融产品代销</li> <li>■ 投资顾问</li> <li>■ 融资融券</li> <li>■ 股票质押</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 权益类投资</li> <li>■ 固定收益投资</li> <li>■ 基金投资</li> <li>■ 衍生品</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 股权业务</li> <li>■ 债券发行</li> <li>■ 并购重组</li> <li>■ 财务顾问</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 单一资产管理</li> <li>■ 集合资产管理</li> <li>■ 专项资产管理</li> <li>■ 公募基金管理</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>■ 海外业务</li> <li>■ 期货业务</li> <li>■ 另类投资业务</li> <li>■ 私募基金管理</li> </ul> |

单位：元 币种：人民币

| 营业收入   | 2020 年上半年      | 占比     | 2019 年上半年      | 占比     | 同比变动    |
|--------|----------------|--------|----------------|--------|---------|
| 财富管理业务 | 824,465,394.22 | 32.65% | 796,930,763.41 | 42.23% | 3.46%   |
| 自营业务   | 705,021,157.60 | 27.92% | 240,856,344.15 | 12.76% | 192.71% |
| 投资银行业务 | 286,273,324.88 | 11.34% | 445,698,128.45 | 23.62% | -35.77% |
| 资产管理业务 | 230,912,392.47 | 9.14%  | 260,105,872.10 | 13.78% | -11.22% |
| 其他业务   | 478,862,262.93 | 18.95% | 143,738,685.64 | 7.61%  | 233.15% |

注：其他业务包括海外业务、期货业务、另类投资业务、私募基金管理业务及其他财务分摊。

财富管理业务收入与上年同期相比有所上升，同比上升 3.46%，在营业收入中的占比下降 9.58 个百分点；自营业务收入与上年同期有所增加，同比上升 192.71%，在营业收入中的占比上升 15.16 个百分点；投资银行业务收入与上年同期有所减少，同比下降 35.77%，在营业收入中的占比下降 12.28 个百分点；资产管理业务收入与上年同期相比有所减少，同比下降 11.22%，在营业收入中的占比下降 4.64 个百分点；其他业务收入与上年同期相比有所增加，同比上升 233.15%，在营业收入中的占比上升 11.34 个百分点。

## 1、财富管理业务

公司的财富管理业务分部主要包括证券经纪业务、信用业务等。2020 年上半年财富管理业务分部实现营业收入 8.24 亿元，占公司营业收入的比例为 32.65%。

### (1) 证券经纪业务

2020 年上半年，沪深两市股票基金日均成交额 8,091.91 亿元，同比增加 29.35%；上证综指比上年末下跌 2.15%，深证成指收盘较上年末上涨 14.97%。在市场表现回暖等因素作用下，证券公司经纪业务收入普遍有所增长，沪深股票市场主要指数上行，两市交投活跃，融资规模显著增长，根据中国证券业协会公布数据，证券行业 2020 年 1-6 月代理买卖证券业务净收入（含席位租赁）为 523.10 亿元，同比增加 17.82%。

根据交易所统计数据，公司 2020 年上半年股票基金代理买卖累计成交金额为 1.44 万亿元，同比增加 16.93%，市场份额 0.76%；累计实现证券经纪业务净收入（含席位租赁）4.17 亿元。根据中国证券业协会统计，公司代理买卖证券业务净收入（含席位收入）排名为 29 位。

单位：元 币种：人民币

| 项目               | 2020 年上半年            | 2019 年上半年            |
|------------------|----------------------|----------------------|
| 股票基金代理买卖交易金额     | 1,443,688,609,412.87 | 1,234,644,539,356.07 |
| 证券经纪业务净收入（含席位租赁） | 416,607,709.81       | 378,502,830.16       |

注 1：上表中的股票包括 A 股、B 股；

注 2：数据来源：股票基金代理买卖交易金额数据来自上海证券交易所、深圳证券交易所统计数据；

注 3：成交金额为双边计算口径。

报告期内，公司积极探索大财富条线准事业部制管理模式，落实相关授权，理顺管理机制。以金融产品销售、机构客户开发为抓手，探索财富管理转型。部均证券代理买卖业务收入排名继续保持行业前 10，金融产品销售取得突破，销售金额同比增长 260.80%。优化分支机构布局，在北京、深圳、江苏、山东、重庆等经济发达地区筹建营业部。2020 年上半年，公司继续推进 198 综合 APP 功能拓展，支持新三板、创业板客户投资需求。全力优化东兴 198APP 的交易稳定性，重点加强 APP 架构设计及压力测试，完善 APP 研发的制度流程。上半年，交易同比增长 56.48%，APP 日活用户同比增长 23.90%，APP 新开户占比 98.30%。持续优化智能投顾体系，推出解套大师、网格交易、策略托管和智能打新等自动化交易产品和服务，增量创收同比增长 50.30%；应对财富管理的新趋势，加快财富管理转型，加强理财产品营销，APP 理财客户数同比增长 104.10%，金融产品委托金额同比增长 26.20%。

未来，公司将顺应市场机构化、客户产品化的大趋势，紧扣财富管理转型战略，继续落实大财富条线准事业部管理模式，理顺管理机制，提升管理效率，强化合规管控，扩大客户基础，优化客户结构，以遍布全国主要经济发达地区的分支机构为触角，以客户为中心，围绕客户资产保值增值需求，整合内外部资源，加大业务协同力度，为广大客户提供多元化的全业务链财富管理服务，推进全辖分支机构各项业务协调发展。2020 年下半年，公司将继续对金融科技进行投入，注重科技赋能，使用科技手段助力业务开展。在资产配置、投资顾问等方向进行积极地探索，包括在 198 综合 APP 中推出面向普通大众客户的智能化投资服务，提升客户体验；进一步升级智



能展业平台，为一线员工展业提供更好的支持等。同时，推进智能投顾建设，加快投顾产品和服务的开发，为客户提供智能化、自动化的财富管理服务。

## （2）信用业务

公司信用业务主要包括融资融券业务和股票质押业务。

2020 年上半年，随着市场行情回暖，融资融券业务规模大幅上升；股票质押业务市场整体呈现规模压缩下行、结构调整的明显趋势。证券市场两融余额在 10,222.82 亿元至 11,637.68 亿元的区间内波动，半年内两融日均余额为 10,795.91 亿元，较 2019 年同期上涨 23.98%，累计融资买入 8.53 万亿元，累计融券卖出 2,469.65 亿元。截至 2020 年 6 月末，市场融出资金余额为 11,637.68 亿元，较 2019 年同期上升 27.77%，两市共有 2,912 家上市公司尚存在股票质押未解押，以 6 月 30 日收盘价统计，质押参考市值为 4.51 万亿元。

2020 年上半年，公司实现信用业务收入 5.69 亿元。截至 2020 年 6 月末，公司融资融券本金余额为 141.42 亿元，较 2019 年同期上升 34.61%，实现融资融券利息收入 4.58 亿元，行业排名第 20 名；自有资金股票质押业务余额为 45.06 亿元，实现股票质押回购业务利息收入 1.11 亿元。截至 2020 年 6 月末，公司两融业务和股票质押式业务（自营）的整体维持担保比例分别为 269.29% 和 268.53%。

| 项目        | 2020 年上半年     |                  | 2019 年上半年     |                  |
|-----------|---------------|------------------|---------------|------------------|
|           | 余额<br>(亿元)    | 利息收入<br>(万元)     | 余额<br>(亿元)    | 利息收入<br>(万元)     |
| 融资融券业务    | 141.42        | 45,798.73        | 105.06        | 32,515.28        |
| 股票质押回购业务  | 45.06         | 11,075.90        | 64.57         | 24,404.10        |
| <b>总计</b> | <b>186.48</b> | <b>56,874.62</b> | <b>169.63</b> | <b>56,919.38</b> |

注 1：截至 2020 年 6 月末，公司自有资金出资的表外股票质押回购业务规模 7.41 亿元，维保比例 151.59%；

注 2：关于股票质押回购业务余额、存续项目的期限结构、三个阶段的账面余额、计提的减值准备金额、担保物金额以及公司不存在股票质押式回购业务重分类等情况，详见“第十节财务报告七、合并财务报表项目注释 11、买入返售金融资产”和“第十节财务报告-七、合并财务报表项目注释-8、应收款项”；关于三阶段划分的具体标准和依据、每个阶段的计提方法和估值技术等，详见“第十节财务报告五、重要会计政策和会计估计-10、金融工具”及“十七、风险管理-2、信用风险”。

未来，公司的信用业务将深化数据挖掘，加强内部有效合作。在风险可控前提下，重点开发机构客户及高净值客户，同时落实收益与风险相匹配原则、严控业务风险、夯实风险管理闭环，控制增量，优化存量，促进业务良性发展。

## 2、自营业务

公司的自营业务分部主要包括权益类投资业务和固定收益类投资业务。2020 年上半年自营业务分部实现营业收入 7.05 亿元，占公司营业收入的比例为 27.92%。

2020 年上半年，受国内外新冠疫情及宏观经济政策变化的影响，国内 A 股市场呈现大幅震荡与结构分化的行情，上证综指较上年末下跌 2.15%；深证成指上涨 14.97%，中小板指数上涨 20.85%，创业板指数上涨 35.60%。

### （1）权益类投资业务

2020 年上半年，公司自营权益类投资业务坚持长期价值投资理念，加大重点行业领域的研究覆盖和上市公司长期基本面变化的跟踪研究，着重长期增长，淡化短期波动，以研究支持并服务投资，不断提升投资的核心竞争力。权益投资团队灵活使用股票、期货、可转债、货币基金、场外基金等投资手段，适时进行多元化资产配置，分散投资，降低投资风险，增强市场风险抵抗能力；同时利用股指期货进行套保，有效控制了投资组合风险。今年上半年，权益投资整体收益率较去年同期显著提升；此外，公司积极探索创新业务模式，自营收入呈现多元化格局，收入渠道进一步拓宽。

### （2）固定收益类投资业务

2020 年初以来，受全球范围内新冠肺炎疫情爆发和国内经济基本面变化的影响，以十年期国债为代表的无风险收益率在 2020 年上半年呈现先下后上的宽幅震荡格局；与此同时，信用债券违约数量和金额仍处历史同期高位，信用债券市场进一步分化。面对复杂多变的市场环境，公司坚持稳中求进的基调，在严控信用风险基础上进一步提升利率债和中高等级信用债的投资比重，并结合固定收益类衍生品开展灵活多样的量化策略交易，取得了较好投资业绩，收益大幅超越市场基准。同时，公司加强客户开拓，销售交易业务平稳进阶，集团协同业务快速发展；继续布局 FICC，积极筹备做市业务，现券交易量持续增长；加大业务创新力度，公司成为全国银行间同业拆借中心批准的利率期权业务首批市场参与机构。

未来，公司自营业务将坚守价值投资，继续优化投研体系，充分利用内外部资源，不断提升团队投资能力和风险管理能力，在日益复杂、多变的市场环境中稳步提高投资业绩。权益类自营投资方面，继续加强二级市场重点行业的跟踪覆盖，优化量化投资策略，进一步形成完善独立、系统的投资框架，引进优秀专业人才，扩充投研和量化投资业务团队。固定收益类投资方面，将继续推动 FICC 布局，加强协同业务创新，坚持稳健的投资策略，关注债券市场的各项变化。

## 3、投资银行业务

公司的投资银行业务分部主要包括股权融资业务、债券融资业务和财务顾问业务。2020 年上半年投资银行业务分部实现营业收入 2.86 亿元，占公司营业收入的比例为 11.34%。

2020 年以来 IPO 审核发行家数及募资规模均同比上升，上半年 IPO 累计募集资金 1,392.74 亿元，同比增加 130.86%，股权再融资规模为 4,819.71 亿元，同比下降 2.45%；信用债券发行规模增长迅速，2020 年上半年公司债及企业债累计发行 1.82 万亿元，同比增加 27.27%，但低等级债券发行明显放缓；随着新三板改革政策落地，市场流动性逐步释放，整体交投开始活跃，交易量、交易金额呈现明显增长趋势。做市指数上涨 21.91%，日均成交额 18,475.10 万元，较去年同期 6,869.69 万元的日均成交额增长 168.94%。

2020 年上半年，在 IPO 审核常态化及科创板加速推进等利好驱动下，证券行业投行业务收入有所增长，证券承销与保荐业务净收入同比上升 49.37%。公司实现投资银行业务净收入 3.08 亿元，根据 wind 统计数据，公司投行承销保荐收入行业排名第 15 位。

截至 2020 年 6 月 30 日，根据 wind 统计数据（上市日），公司完成股权项目主承销家数为 11 家，股权主承销项目承销金额 65.81 亿元，公司上半年股票主承销家数及承销金额分列行业第 14 位和第 19 位；债券（公司债、企业债及金融债）主承销家数为 28 家，融资规模 210.44 亿元，较 2019 年同期增长 105.25%，承销收入 10,936.85 万元，较 2019 年同期增长 129.82%。

2020 年 1-6 月公司担任主承及联席主承销商的股权及债权融资业务承销金额及收入如下：

| 发行类别   | 承销金额（亿元）  |           |         | 承销收入（万元）  |           |         |
|--------|-----------|-----------|---------|-----------|-----------|---------|
|        | 2020 年上半年 | 2019 年上半年 | 同比变动    | 2020 年上半年 | 2019 年上半年 | 同比变动    |
| 首次公开发行 | 11.99     | 27.71     | -56.73% | 10,154.45 | 15,638.75 | -35.07% |
| 再融资发行  | 53.82     | 50.47     | 6.64%   | 3,981.60  | 2,905.66  | 37.03%  |
| 债券     | 210.44    | 102.53    | 105.25% | 10,936.85 | 4,758.85  | 129.82% |

注 1：再融资发行包含公开增发、配股、非公开发行、可转债及优先股；

注 2：债券包含公司担任主承/联席主承销商的公司债、企业债和金融债（含债权融资计划）；

注 3：承销金额来自万得资讯统计，承销金额按照承销商实际配额统计，如果没有公布实际配额，则按照联席主承销商数量做算术平均分配。

未来，公司将立足重点行业和区域，注重优质大中型项目的承揽，提升市场影响力，打造具有东兴证券特色的差异化投行品牌。一方面，继续稳步推进 IPO 业务，不断提升 IPO 项目质量，同时加大再融资等其他投行项目储备和推进力度，推进存量项目的有效落地，统筹兼顾、有所侧重；另一方面，持续加强内部风险管控，坚守质量控制工作底线，紧跟科创板和创业板注册制改革政策，改进完善审核流程，进一步有针对性地完善项目质量控制工作。此外，公司将继续加大产品及业务创新力度，开发蓝海市场，开发优质项目；持续加强与东方集团协同，调动整合中国东方和公司资源，扩大市场覆盖面和加强市场开发深度。公司将全力做好债券销售工作，抓住 REITS、信托压缩非标等机遇，布局新业务和新模式。

#### 4、资产管理业务

公司的资产管理业务分部主要包括证券公司资产管理业务和公募基金管理业务。2020 年上半年资产管理业务分部实现营业收入 2.31 亿元，占公司营业收入的比例为 9.14%。

##### （1）证券公司资产管理业务

在资管新规背景下，资管行业不断适应监管要求，努力“去通道化”提升主动管理能力，以改善资管业务结构。根据中国证券业协会统计，截至 2020 年 6 月末，证券行业受托管理资金本金总额达到 11.83 万亿元，较 2019 年同期下降 12.95%，实现资产管理业务净收入 142.91 亿元，较去年同期增长 12.24%。

报告期内，公司围绕“客户机构化、产品净值化、策略差异化”，继续推进“品牌财富管理型资管业务和投资投行型资管业务”，致力提升资管业务主动投资和风险管控能力。公司积极克服疫情影响，努力推进集合资产管理计划的发行，新产品数量在行业内名列前茅，成功发行支持疫情防控 ABS，持续加大支持实体经济的债券投资力度，差异化的投研策略取得良好业绩回报。受大集合产品整改和疫情影响，2020 年上半年实现资产管理业务净收入 1.47 亿元，同比下降 3.44%；2020 年 6 月末资产管理受托规模为 731.59 亿元，同比下降 38.78%。

| 项目        | 2020 年 6 月 30 日 |                  | 2019 年 6 月 30 日 |                  |
|-----------|-----------------|------------------|-----------------|------------------|
|           | 管理规模 (亿元)       | 净收入 (万元)         | 管理规模 (亿元)       | 净收入 (万元)         |
| 集合资产管理    | 241.65          | 12,523.43        | 277.47          | 7,063.40         |
| 单一资产管理    | 324.66          | 1,498.19         | 560.90          | 7,181.61         |
| 专项资产管理    | 165.28          | 687.50           | 356.58          | 987.53           |
| <b>总计</b> | <b>731.59</b>   | <b>14,709.12</b> | <b>1,194.95</b> | <b>15,232.55</b> |

注：资管业务净收入与资管分部的营业收入存在差异，主要由于资管产品的合并收入计入分部报告

未来，公司资产管理业务将继续坚定不移地强化主动投资管理能力，打造品牌财富管理型及投资投行型资管，积极拓展机构客户和代销渠道，在权益、量化、现金管理、境内外组合策略、FOF、定增、资产证券化、资本市场股债联动等方面打造更为丰富、更具特色的产品集群。

## (2) 公募基金管理业务

2020 年上半年，公司不断优化产品结构，持续推进渠道业务的发展和直销客户的储备，2020 年 6 月末公募基金管理非货币资产规模较上年末增长 76.19%，同比增长 413.75%；非货币基金日均管理规模较上年末增长 137.99%，同比增长 442.79%。在上半年波动加剧的市场环境下，基金非货币资金规模和业绩排名都取得一定提升。未来，公司将利用公募基金公司设立的契机，落实公募业务发展战略和目标定位的实施，以引进和自主培养优秀投研人才为抓手，以投资业绩为导向、以产品创新为突破，结合自身特色推动适合市场需求的公募基金产品，推动规模快速增长。

## 5、其他业务

公司的其他业务分部主要包括期货业务、另类投资业务、私募基金管理业务和海外业务。2020 年上半年其他业务分部中的四家子公司实现的营业收入为 4.79 亿元，占公司营业收入的比例为 18.95%。

### (1) 期货业务

2020 年上半年，期货市场服务实体经济的能力进一步提高，全国期货市场上半年累计成交量 25.22 亿手，同比增长 45.35%，累计成交额 165.47 万亿元，同比增长 28.70%，商品期货交易所场外服务平台上线运行，国内期货对外开放的程度继续加深。公司期货业务主要通过全资子公司东兴期货开展，东兴期货上半年实现日均权益 28.54 亿元，权益峰值达到 35.60 亿元，截至 2020 年 6 月 30 日，管理的资管产品共 5 只，总规模 12.17 亿元。未来，东兴期货将以分类评级进 A 为抓手，大幅增加客户权益为核心指标，重视产业和金融的结合，进一步做强买方业务能力，全面推进场外期权等业务，提升权益报酬率。

### (2) 另类投资业务

根据中国证券业协会于 2016 年 12 月 30 日颁布的《证券公司另类投资子公司管理规范》，公司另类投资业务主要通过全资子公司东兴投资开展。东兴投资已经形成良性发展闭环，业绩“稳定器”和“蓄水池”的作用进一步凸显，截至 2020 年 6 月末，现存续股权投资项目 15 个，投资规模合计 9.13 亿元。2020 年上半年东兴投资积极以创新方式开展股权投资业务，通过灵活的交易结构设计，多维度、多指标和多节点监控等手段在保障项目安全的前提下争取合理收益。未来，



东兴投资将继续发挥业绩“稳定器”和“蓄水池”的作用，兼顾当期收益和中长期布局、投资方向继续聚焦具有技术门槛的新兴产业、在投资阶段重多元化的配置。

### （3）私募基金管理业务

公司的私募基金管理业务主要通过全资子公司东兴资本开展，东兴资本已取得私募基金管理人资格，截至 2020 年 6 月末，共投资 9 个项目。未来，东兴资本将积极适应监管变化，私募基金管理业务将聚焦、深入重点行业，打造完善的业务运作和后台支撑体系，做好“募投管退”一体化管理工作，同时打造特色优势，更好地服务实体经济。

### （4）海外业务

公司以全资子公司东兴香港为平台开展海外业务，2020 年上半年，疫情对全球造成巨大冲击，香港经济也持续下滑。东兴香港在落实疫情防控的同时，积极稳妥地排查风险隐患，有效控制化解风险，截至 2020 年 6 月末，东兴香港在香港中央结算所的港股托管市值为 110.00 亿港元。报告期内，东兴香港投行业务保持良好势头，2020 上半年成功完成独家保荐项目 3 单，联交所审项目 6 单。资管固定收益投资业绩良好，跑赢同期指数。未来，公司将加快国际化布局，依托现有优势寻求业务突破，进一步加强专业化经营，大力推进发展投行、经纪和资管等牌照业务的转型。

## （二）财务报表分析

财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

| 科目            | 本期数               | 上年同期数             | 变动比例 (%) |
|---------------|-------------------|-------------------|----------|
| 营业收入          | 2,525,534,532.10  | 1,887,329,793.75  | 33.82    |
| 营业成本          | 1,483,799,552.91  | 920,542,149.77    | 61.19    |
| 营业利润          | 1,041,734,979.19  | 966,787,643.98    | 7.75     |
| 净利润           | 786,237,278.62    | 864,227,600.53    | -9.02    |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -1,194,471,907.37 | 9,755,658,076.02  | 不适用      |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 2,535,337,011.61  | -4,107,496,885.91 | 不适用      |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 2,002,799,650.49  | -539,059,350.71   | 不适用      |

营业收入变动原因说明：2020 年上半年，公司实现营业收入 25.26 亿元，较上年同期增加 6.38 亿元，同比增长 33.82%，主要变化：手续费及佣金净收入较上年同期减少 1.06 亿元；利息净收入较上年同期增加 1.75 亿元；投资收益及公允价值变动损益较上年同期增加 2.20 亿元；其他业务收入较上年同期增加 3.36 亿元。

营业成本变动原因说明：主要是信用减值损失较上年同期增加 1.30 亿元；其他业务成本较上年同期增加 3.44 亿元；业务及管理费较上年同期增加 0.89 亿元。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是回购业务资金净流入较上年同期减少 78.10 亿元，以及支付其他与经营活动有关的现金较上年同期增加 34.87 亿元。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是购置或处置其他债权投资收到的现金较上年同期增加。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是债务融资收到的现金较上年同期增加。

### 1、收入和成本分析

√适用 □不适用

#### (1) 主营业务分行业、分地区情况

单位：元 币种：人民币

| 主营业务分行业情况 |                  |                  |         |               |               |               |
|-----------|------------------|------------------|---------|---------------|---------------|---------------|
| 分行业       | 营业收入             | 营业成本             | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%)  |
| 财富管理业务    | 824,465,394.22   | 545,033,419.73   | 33.89   | 3.46          | 47.34         | 减少 19.69 个百分点 |
| 自营业务      | 705,021,157.60   | 103,755,514.57   | 85.28   | 192.71        | 8.07          | 增加 25.14 个百分点 |
| 投资银行业务    | 286,273,324.88   | 210,747,782.31   | 26.38   | -35.77        | -1.33         | 减少 25.70 个百分点 |
| 资产管理业务    | 230,912,392.47   | 123,263,849.07   | 46.62   | -11.22        | 23.60         | 减少 15.04 个百分点 |
| 其他业务      | 478,862,262.93   | 500,998,987.23   | -4.62   | 233.15        | 254.55        | 减少 6.31 个百分点  |
| 主营业务分地区情况 |                  |                  |         |               |               |               |
| 分地区       | 营业收入             | 营业成本             | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%)  |
| 福建省内机构    | 419,017,576.02   | 111,211,435.57   | 73.46   | -11.73        | -4.27         | 减少 2.07 个百分点  |
| 福建省外机构    | 275,980,885.53   | 132,379,977.94   | 52.03   | 3.75          | -0.58         | 增加 2.08 个百分点  |
| 小计        | 694,998,461.55   | 243,591,413.51   | 64.95   | -6.17         | -2.30         | 减少 1.39 个百分点  |
| 公司本部及子公司  | 1,830,536,070.55 | 1,240,208,139.40 | 32.25   | 59.65         | 84.77         | 减少 9.21 个百分点  |
| 合计        | 2,525,534,532.10 | 1,483,799,552.91 | 41.25   | 33.82         | 61.19         | 减少 9.98 个百分点  |

单位：元 币种：人民币

| 分行业    | 本期营业收入         | 占总收入比例 | 上期营业收入         | 占总收入比例 | 同比变动 (%) |
|--------|----------------|--------|----------------|--------|----------|
| 财富管理业务 | 824,465,394.22 | 32.65% | 796,930,763.41 | 42.23% | 3.46     |
| 自营业务   | 705,021,157.60 | 27.92% | 240,856,344.15 | 12.76% | 192.71   |
| 投资银行业务 | 286,273,324.88 | 11.34% | 445,698,128.45 | 23.62% | -35.77   |
| 资产管理业务 | 230,912,392.47 | 9.14%  | 260,105,872.10 | 13.78% | -11.22   |
| 其他业务   | 478,862,262.93 | 18.95% | 143,738,685.64 | 7.61%  | 233.15   |

注：其他业务包括海外业务、期货业务、另类投资业务、私募基金管理业务及其他财务分摊。

2020 年上半年，公司财富管理业务分部实现营业收入人民币 8.24 亿元，同比上升 3.46%；自营业务分部实现营业收入人民币 7.05 亿元，同比上升 192.71%；投资银行业务分部实现营业收入人民币 2.86 亿元，同比下降 35.77%；资产管理业务分部实现营业收入人民币 2.31 亿元，同比下降 11.22%；其他业务分部实现营业收入人民币 4.79 亿元，同比上升 233.15%。

#### (2) 成本分析表

单位：元 币种：人民币

| 成本分行业情况 |        |      |        |        |          |            |
|---------|--------|------|--------|--------|----------|------------|
| 分行业     | 成本构成项目 | 本期金额 | 本期占总成本 | 上年同期金额 | 上年同期占总成本 | 本期金额较上年同期变 |

|        |      |                | 比例<br>(%) |                | 比例 (%) | 动比例 (%) |
|--------|------|----------------|-----------|----------------|--------|---------|
| 财富管理业务 | 营业支出 | 545,033,419.73 | 36.74     | 369,920,074.65 | 40.19  | 47.34   |
| 自营业务   | 营业支出 | 103,755,514.57 | 6.99      | 96,005,099.73  | 10.43  | 8.07    |
| 投资银行业务 | 营业支出 | 210,747,782.31 | 14.20     | 213,586,333.16 | 23.20  | -1.33   |
| 资产管理业务 | 营业支出 | 123,263,849.07 | 8.31      | 99,725,416.08  | 10.83  | 23.60   |
| 其他业务   | 营业支出 | 500,998,987.23 | 33.76     | 141,305,226.15 | 15.35  | 254.55  |

2020 年上半年，公司财富管理业务分部营业支出人民币 5.45 亿元，同比上升 47.34%；自营业务分部营业支出人民币 1.04 亿元，同比上升 8.07%；投资银行业务分部营业支出人民币 2.11 亿元，同比下降 1.33%；资产管理业务分部营业支出人民币 1.23 亿元，同比上升 23.60%；其他业务分部营业支出人民币 5.01 亿元，同比上升 254.55%。

### (3) 其他

①公司利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

②其他

适用 不适用

## 2、费用

单位：万元 币种：人民币

| 项目     | 本期金额       | 上期金额      | 本期金额较上年同期变动比例 (%) |
|--------|------------|-----------|-------------------|
| 业务及管理费 | 108,158.48 | 99,213.18 | 9.02              |

公司 2020 年上半年业务及管理费为 10.82 亿元，较 2019 年上半年上升 9.02%，业务及管理费上升的主要原因为职工费用、产品销售及广告费上升。

## 3、现金流

单位：万元 币种：人民币

| 项目                   | 本期                 | 上期                 | 同比增减 (%) |
|----------------------|--------------------|--------------------|----------|
| 经营活动现金流入小计           | 741,088.65         | 1,693,324.16       | -56.23   |
| 经营活动现金流出小计           | 860,535.84         | 717,758.35         | 19.89    |
| <b>经营活动产生的现金流量净额</b> | <b>-119,447.19</b> | <b>975,565.81</b>  | 不适用      |
| 投资活动现金流入小计           | 356,489.31         | 148,114.29         | 140.69   |
| 投资活动现金流出小计           | 102,955.61         | 558,863.98         | -81.58   |
| <b>投资活动产生的现金流量净额</b> | <b>253,533.70</b>  | <b>-410,749.69</b> | 不适用      |
| 筹资活动现金流入小计           | 2,381,449.02       | 858,866.20         | 177.28   |
| 筹资活动现金流出小计           | 2,181,169.05       | 912,772.14         | 138.96   |
| <b>筹资活动产生的现金流量净额</b> | <b>200,279.97</b>  | <b>-53,905.94</b>  | 不适用      |
| <b>现金及现金等价物净增加额</b>  | <b>337,914.57</b>  | <b>511,270.48</b>  | -33.91   |

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是回购业务资金净流入较上年同期减少 78.10 亿元，以及支付其他与经营活动有关的现金较上年同期增加 34.87 亿元。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是购置或处置其他债权投资收到的现金较上年同期增加。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：主要是债务融资收到的现金较上年同期增加。

#### 4、非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

#### 5、资产、负债情况分析

适用 不适用

##### (1) 资产及负债状况

单位：元

| 项目名称     | 本期期末数             | 本期期末数占总资产的比例(%) | 上年同期期末数           | 上年同期期末数占总资产的比例(%) | 本期期末金额较上年同期期末变动比例(%) | 情况说明          |
|----------|-------------------|-----------------|-------------------|-------------------|----------------------|---------------|
| 货币资金     | 13,801,061,506.21 | 16.33           | 11,798,259,862.72 | 13.64             | 16.98                |               |
| 结算备付金    | 4,107,114,666.38  | 4.86            | 4,539,870,012.94  | 5.25              | -9.53                |               |
| 融出资金     | 14,515,304,315.35 | 17.17           | 11,038,384,485.47 | 12.76             | 31.50                | 主要系融出资金规模增加   |
| 衍生金融资产   | -                 | -               | 4,173,413.66      | -                 | 不适用                  | 主要系场外期权业务减少   |
| 存出保证金    | 1,592,278,379.21  | 1.88            | 139,250,048.81    | 0.16              | 1,043.47             | 主要系交易保证金增加    |
| 应收款项     | 200,634,098.85    | 0.24            | 205,255,885.28    | 0.24              | -2.25                |               |
| 买入返售金融资产 | 6,185,335,112.92  | 7.32            | 9,976,251,734.47  | 11.53             | -38.00               | 主要系股票质押业务减少所致 |
| 交易性金融资产  | 20,474,641,859.87 | 24.22           | 17,850,448,928.92 | 20.64             | 14.70                |               |
| 债权投资     | 569,460,375.60    | 0.67            | 392,988,898.77    | 0.45              | 44.90                | 主要系债权类投资增加所致  |
| 其他债权投资   | 18,899,354,666.47 | 22.36           | 25,686,848,724.88 | 29.69             | -26.42               |               |
| 其他权益工具投资 | 2,408,626,843.95  | 2.85            | 2,645,109,761.65  | 3.06              | -8.94                |               |
| 长期股权投资   | 239,279,295.43    | 0.28            | 208,183,394.00    | 0.24              | 14.94                |               |
| 投资性房地产   | 27,526,732.51     | 0.03            | 30,085,112.35     | 0.03              | -8.50                |               |
| 固定资产     | 152,820,494.54    | 0.18            | 162,925,541.26    | 0.19              | -6.20                |               |



|           |                   |       |                   |       |          |                         |
|-----------|-------------------|-------|-------------------|-------|----------|-------------------------|
| 无形资产      | 23,671,779.09     | 0.03  | 18,790,774.07     | 0.02  | 25.98    |                         |
| 商誉        | 20,000,000.00     | 0.02  | 20,000,000.00     | 0.02  | -        |                         |
| 递延所得税资产   | 478,716,492.22    | 0.57  | 491,729,112.61    | 0.57  | -2.65    |                         |
| 其他资产      | 840,096,944.00    | 0.99  | 1,294,857,231.03  | 1.51  | -35.12   | 主要系收回部分投资清算款所致          |
| 短期借款      | 2,573,063,147.23  | 3.04  | 2,403,824,735.15  | 2.78  | 7.04     |                         |
| 应付短期融资款   | 9,883,555,638.27  | 11.69 | 4,622,159,537.71  | 5.34  | 113.83   | 主要系融资增加所致               |
| 拆入资金      | 50,933,992.37     | 0.06  | 51,200,951.69     | 0.06  | -0.52    |                         |
| 交易性金融负债   | 26,222,233.11     | 0.03  | 32,846,871.22     | 0.04  | -20.17   |                         |
| 衍生金融负债    | 106,924,431.88    | 0.13  | 83,900,726.68     | 0.10  | 27.44    |                         |
| 卖出回购金融资产款 | 9,450,658,526.15  | 11.18 | 18,996,592,377.88 | 21.96 | -50.25   | 主要系正回购业务减少所致            |
| 代理买卖证券款   | 14,450,081,233.62 | 17.09 | 12,031,250,161.15 | 13.91 | 20.10    |                         |
| 应付职工薪酬    | 1,038,297,936.65  | 1.23  | 1,149,335,554.88  | 1.33  | -9.66    |                         |
| 应交税费      | 186,680,209.15    | 0.22  | 77,127,473.96     | 0.09  | 142.04   | 主要系期末应交个人所得税增加所致        |
| 应付款项      | 1,757,033,697.18  | 2.08  | 93,390,889.93     | 0.11  | 1,781.38 | 主要系应付保证金增加所致            |
| 合同负债      | 11,538,771.73     | 0.01  | 不适用               | 不适用   | 不适用      | 主要系实施新收入准则所致            |
| 应付债券      | 22,639,511,387.23 | 26.78 | 22,302,258,320.84 | 25.78 | 1.51     |                         |
| 递延所得税负债   | 13,937,666.99     | 0.02  | 27,188,194.66     | 0.03  | -48.74   | 主要系应税暂时性差异减少所致          |
| 其他负债      | 1,735,296,889.54  | 2.05  | 4,602,593,395.93  | 5.32  | -62.30   | 主要系应付合并结构化主体权益持有者款项减少所致 |

## 其他说明

## 1) 资产状况

截至 2020 年 6 月 30 日, 公司总资产为 845.36 亿元, 较上年同期期末减少 19.67 亿元, 降幅为 2.27%, 扣除代理买卖证券款后, 公司期末总资产为 700.86 亿元, 较上年同期期末减少 43.86 亿元, 降幅为 5.89%。主要变动情况是: 公司货币资金余额较上年同期期末增加 20.03 亿元, 融

出资金期末余额较上年同期期末增加 34.77 亿元，买入返售金融资产期末余额较上年同期期末减少 37.91 亿，金融投资期末余额较上年同期期末减少 42.23 亿元。

公司资产质量和流动性保持良好。期末公司货币资金和结算备付金占总资产的比率为 21.19%，金融资产占总资产的比率为 50.10%，融出资金占总资产的比率为 17.17%，买入返售金融资产占总资产的比率为 7.32%，长期股权投资占总资产的比率为 0.28%。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司自有资产负债率为 70.59%，较上年同期期末下降 2.51 个百分点。

## 2) 负债状况

截至 2020 年 6 月 30 日，公司负债总额为 639.24 亿元，较上年同期期末减少 25.50 亿元，降幅为 3.84%。其中代理买卖证券款较上年同期期末增加 24.19 亿元。扣除代理买卖证券款后，自有负债总额较上年同期期末减少 49.69 亿元，其中，应付短期融资款期末余额较上年同期期末增加 52.61 亿元，卖出回购金融资产款期末余额较上年同期期末减少 95.46 亿，应付款项期末余额较上年同期期末增加 16.64 亿元，其他负债期末余额较上年同期期末下降 28.67 亿元。

### (2) 截至报告期末主要资产受限情况

√适用 □不适用

| 项目        | 期末账面价值                  | 受限原因                |
|-----------|-------------------------|---------------------|
| 交易性金融资产   | 148,826,222.93          | 回购质押                |
| 交易性金融资产   | 1,072,064,944.00        | 债券回购质押及转融通担保        |
| 交易性金融资产   | 71,416,780.00           | 债券借贷质押              |
| 交易性金融资产   | 48,500,760.40           | 已融出证券               |
| 交易性金融资产   | 227,518,822.93          | 存在限售期               |
| 交易性金融资产   | 140,237,775.85          | 自有资金参与质押集合计划退出受合同限制 |
| 其他债权投资    | 5,196,992,027.50        | 债券回购质押及转融通担保        |
| 其他债权投资    | 1,733,748,245.98        | 回购质押                |
| 其他债权投资    | 1,307,105,280.00        | 债券借贷质押              |
| <b>合计</b> | <b>9,946,410,859.59</b> |                     |

### (3) 其他说明

□适用 √不适用

## (三) 投资状况分析

### 1、 对外股权投资总体分析

√适用 □不适用

报告期内，公司新增对外股权投资 1,800 万元。截至报告期末，公司对外股权投资中，包括公司全资子公司东兴资本对共青城东兴博元投资中心（有限合伙）的投资 5,600 万元，东兴资本对上杭兴源股权投资合伙企业（有限合伙）的投资 1 亿元，东兴资本对贵州益年医疗产业投资中

心（有限合伙）的投资 660 万元，以及东兴资本对绵阳市聚九股权投资中心（有限合伙）的投资 1,800 万元。

**(1) 重大的股权投资**

适用  不适用

**(2) 重大的非股权投资**

适用  不适用

**(3) 以公允价值计量的金融资产**

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目名称      | 期初余额                     | 期末余额                     | 当期变动                   | 对当期利润的影响金额              |
|-----------|--------------------------|--------------------------|------------------------|-------------------------|
| 交易性金融资产   | 17,570,733,770.26        | 20,474,641,859.87        | 2,903,908,089.61       | 580,452,075.98          |
| 其他债权投资    | 22,188,319,748.14        | 18,899,354,666.47        | -3,288,965,081.67      | 692,988,112.18          |
| 其他权益工具投资  | 2,481,585,498.22         | 2,408,626,843.95         | -72,958,654.27         | 2,237,316.85            |
| 衍生金融工具    | -111,912,602.48          | -106,924,431.88          | 4,988,170.60           | 78,352,057.85           |
| 交易性金融负债   | -40,945,748.36           | -26,222,233.11           | 14,723,515.25          | -317,282.02             |
| <b>合计</b> | <b>42,087,780,665.78</b> | <b>41,649,476,705.30</b> | <b>-438,303,960.48</b> | <b>1,353,712,280.84</b> |

**(四) 重大资产和股权出售**

适用  不适用

**(五) 主要控股参股公司分析**

适用  不适用

1、东兴期货有限责任公司：截至 2020 年 6 月 30 日，东兴期货注册资本人民币 51,800.00 万元，东兴证券持有其 100% 的股权，总资产 399,172.19 万元，净资产 66,471.61 万元；2020 年 1-6 月实现营业收入 39,091.46 万元，利润总额 1,226.84 万元，净利润 957.14 万元。

主营业务：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。

2、东兴证券投资有限公司：截至 2020 年 6 月 30 日，东兴投资注册资本人民币 200,000.00 万元，东兴证券持有其 100% 的股权，总资产 120,616.25 万元，净资产 114,182.15 万元；2020 年 1-6 月实现营业收入 10,740.44 万元，利润总额 10,361.63 万元，净利润 1,921.22 万元。

主营业务：对金融产品的投资、项目投资、股权投资（以上均不含需经许可审批的事项，应当符合法律法规、监管要求）。

3、东兴资本投资管理有限公司：截至 2020 年 6 月 30 日，东兴资本注册资本人民币 50,000.00 万元，东兴证券持有其 100% 的股权，总资产 37,105.80 万元，净资产 32,661.35 万元；2020 年 1-6 月实现营业收入 2,832.95 万元，利润总额 1,761.19 万元，净利润 1,284.34 万元。

主营业务：投资管理；投资顾问；股权投资；受托管理股权投资基金；财务顾问服务。

4、东兴证券(香港)金融控股有限公司：截至 2020 年 6 月 30 日，东兴香港注册资本 149,999.94 万元港币，东兴证券持有其 100% 的股权，总资产 694,298.37 万元（折合人民币，下同），净资

产 131,482.13 万元；2020 年 1-6 月实现营业收入-3,530.89 万元，利润总额-9,737.63 万元，净利润-8,090.79 万元。

东兴香港及其子公司主营业务：投资管理；香港证监会核准的第 1 类（证券交易）、第 4 类（就证券提供意见）、第 6 类（就机构融资提供意见）、第 9 类（提供资产管理）及香港东区裁判法院发出的香港放债人牌照。

5、东兴基金管理有限公司：2020 年 2 月，中国证监会下发《关于核准东兴证券股份有限公司设立基金子公司的批复》，批准设立基金公司。3 月 17 日，东兴基金取得工商营业执照。5 月 25 日，东兴证券向东兴基金注资 20,000.00 万元，持有其 100% 的股权。截至报告期末，东兴基金尚未取得《经营证券期货业务许可证》，尚未开展相关业务。截至 2020 年 6 月 30 日，东兴基金总资产 20,048.53 万元，净资产 20,036.40 万元；2020 年 1-6 月实现营业收入 51.03 万元，利润总额 48.53 万元，净利润 36.40 万元。

东兴基金主营业务：公开募集证券投资基金管理、基金销售和中国证监会许可的其他业务。

#### （六）公司控制的结构化主体情况

适用  不适用

截至 2020 年 6 月 30 日，公司合并了 21 家结构化主体，这些主体主要为集合资产管理计划、单一资产管理计划及私募基金。上述结构化主体纳入合并范围的判断因素包括：公司作为管理人或实际控制人，且分别对该等结构化主体持有一定比例的投资，在结构化主体中享有较大可变回报。上述纳入合并范围的结构化主体于 2020 年 6 月 30 日的总资产为人民币 37.32 亿元。

### 三、其他披露事项

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

适用  不适用

#### （二）可能面对的风险

适用  不适用

##### 1、可能面对的风险

公司面临的主要风险类型为市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险、反洗钱风险、声誉风险等。

##### （1）市场风险

公司面临的市场风险是由于持仓金融头寸的市场价格变动而导致损失的风险。持仓金融头寸来自于自营投资、做市业务以及其他投资活动。市场风险类别主要包括权益类及其他以公允价值计量的金融资产价格风险、利率风险、商品价格风险、汇率风险等。目前公司已通过严格的投资研究及审批流程、风险敞口限额机制、止盈止损机制等措施控制市场风险：公司建立了科学严谨的投资研究、授权、决策流程，并严格执行，避免因随意决策、越权决策导致决策失误引发的市

市场风险：公司通过风险敞口管理和敏感性分析、压力测试等一系列的手段对证券市场大幅波动及极端情况下的可能损失进行评估、测算，提前掌握公司面临的市场风险程度、须关注的重点及市场风险可能带来的实际影响，有的放矢地进行管控；日常管控中，公司通过限额管理、逐日盯市、系统/人工管控风控指标、VaR 值管理、业绩归因分析、开发及应用市场风险管理系统等方式进行全流程监控，对于单只券种或投资组合整体可能出现的潜在风险进行风险提示，必要时要求进行止损止盈操作，同时公司还适时使用股指期货、国债期货、期权等衍生金融工具进行市场风险对冲。

## （2）信用风险

信用风险是指因客户、证券发行人或交易对手未履行合约责任而引致损失的风险，主要来自三个方面：一是信用业务（含融资融券和股票质押）；二是债权（包含债券和非标债权）投资的违约风险；三是交易对手违约风险。针对信用业务，公司通过对客户适当性管理、内部信用评级、征信、授信审核标准等环节的严格把控，保证目标客户具有良好的资信；通过对标的证券价格、客户维持担保比例等指标的逐日盯市，及时监控客户和标的证券负面事件，提前发现潜在信用风险；通过客户风险提示、补充质押、强制平仓、司法追索等方式保证公司融出资产的安全。

针对债权投资业务，债券方面，公司建立了内部信用评级机制来控制债券违约和降级风险，根据信用等级进行投资限制并采取分散化投资策略降低因信用风险而带来的损失；非标债权投资方面，公司通过建立严格的尽职调查及投后管理制度，加强对项目的实质调研，控制项目质量，加强投后管理，控制资金的流向及资金的归集、回收，控制项目的违约风险。针对交易对手，通过建立债券交易对手黑白名单联合管控机制、交易对手评级与授信制度，加强交易对手尽职调查和跟踪管理，并设定单一交易对手限额和低等级交易对手累积限额等信用风险限额，最小化因交易对手违约带来的损失；公司对金融衍生品交易对手设定保证金比例和交易规模限制，通过逐日盯市、风险提示、追保等手段来控制交易对手的信用风险。

## （3）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。公司重视并持续加强流动性风险的管理，公司资金实行统一管理和运作，重视资产与负债的期限结构，随时关注其到期日以及到期金额的匹配并进行有效的管理，以保证到期债务的支付；公司建立了流动性风险限额和预警体系，根据公司业务规模、性质、复杂程度、流动性风险偏好和外部市场发展变化情况，设定流动性风险限额并对其执行情况进行监控，及时跟踪市场近期变化情况及公司流动性状况，确保公司在现金流异常时能及时采取应对措施；公司建立了流动性风险报告机制，明确流动性风险报告种类、内容、形式、频率以及报告路径，确保董事会、经理层和其他管理人员及时了解流动性风险水平及其管理状况；公司加强日间流动性管理，通过提前进行现金流测算和融资安排确保具有充足的日间流动性头寸，及时满足正常和压力情景下的日间支付需求；公司积极开展融资渠道管理，确保资金来源的稳定性和可靠性；公司建立优质流动性储备池，保持一定数量的流动性储备资产，监测其变现能力，



确保变现能够在正常的结算期内完成，以弥补现金流缺口，降低流动性风险；公司建立流动性风险应急机制，制定流动性风险应急预案并定期对应急预案进行演练和测试，不断更新和完善应急处理方案，确保公司可以应对紧急情况下的流动性需求。

#### （4）操作风险

操作风险是指由于不充足或不完善的内部流程、人员和系统，或者外部事件而产生直接或间接损失的风险。公司的操作风险分布于公司各部门、各子公司的各个岗位及各条职能线或业务线的整个流程，具有覆盖面广、种类繁多等特点。公司制定下发了操作风险管理制度，通过严格权限管理，实行重要岗位双人、双职、双责等方法，从源头上防范操作风险。同时，公司通过健全的授权机制和岗位职责、高效的制度流程、前中后台的有效牵制、完善的 IT 系统建设、严明的操作纪律和严格的事后监督检查及加大问责力度等手段，多措并举管理操作风险。此外，公司在日常经营中将风险管理和内部控制工作重心前移，充分发挥风险管理部、合规法律部和稽核审计部等内部控制部门及业务部门内部合规风控人员的相关控制职能。公司定期通过内控手册的梳理更新，不断完善操作风险及控制的评估；并结合集团高管驾驶舱、典型操作风险事项专题报告等管理手段，加强损失数据收集与分析，逐步探索搭建并完善公司操作风险识别、评估、监测、控制与报告机制。公司重视创新产品、创新业务存在风险的识别与控制，规范业务操作规程，确保公司总体操作风险可控、可承受。

#### （5）合规风险

合规风险是指因公司经营管理或其工作人员的执业行为违反法律法规、监管准则或自律规则，而被依法追究法律责任、被采取行政处罚、行政监管措施、自律管理或纪律处分等措施，出现财产损失或商业信誉损失的风险。公司制定了完备的合规管理制度，建立了由董事会、合规总监、合规法律部、下属各单位合规管理人员四个层面组成的合规管理组织体系，不断健全合规管理机制，清晰划分了各层级的合规管理职责，全面深入推进合规文化建设，积极培育和提升全体工作人员的合规意识，持续做好合规审查、合规检查、合规报告、合规督导与培训、合规监测、合规有效性评估、合规问责等合规管理工作，切实防范合规风险。

#### （6）洗钱风险

洗钱、恐怖融资和扩散融资风险（以下统称洗钱风险），即法人金融机构在开展业务和经营管理过程中，因未能严格遵循反洗钱法律法规或监管要求，存在反洗钱薄弱环节，而导致机构及业务可能被违法犯罪活动利用所带来严重的声誉风险、法律风险和经营风险的统称。有效的洗钱风险管理，是法人金融机构安全稳健运行的基础。

公司全面贯彻落实人民银行的工作要求，建立健全洗钱风险管理体系，按照风险为本方法，合理配置资源，对洗钱风险进行持续识别、审慎评估、有效控制，控制目标明确、科学、合理、完整。公司洗钱风险管理贯穿决策、执行和监督的全过程，覆盖各项业务活动和管理流程，覆盖所有境内外分支机构及相关附属机构，以及相关部门、岗位和人员；公司积极建设洗钱风险管理文化，促进全体员工树立洗钱风险管理意识、坚持价值准则、恪守职业操守，营造主动管理、合

规经营的良好文化氛围。公司建立内部不同层次的洗钱风险报告机制，反洗钱管理部门及时向董事会和管理层报告洗钱风险情况，包括洗钱风险管理策略、政策、程序、风险评估制度、风险控制措施的制定和执行情况以及洗钱风险事件；境内外分支机构、相关附属机构及时向总部反洗钱管理部门报告洗钱风险情况；各业务部门及时向反洗钱管理部门报告洗钱风险情况，包括风险调整变动情况、风险评估结果等。

### **(7) 声誉风险**

声誉风险是指由证券公司经营管理及其他行为或外部事件导致证券公司股东、员工、客户、第三方合作机构及监管机构等对证券公司的公开负面评价的风险。办公室是公司声誉风险的牵头管理部门，负责建立相关制度和管理流程、机制，防范和识别声誉风险，主动、有效地应对和处置声誉事件，最大程度地减少负面影响。报告期内，公司开展了适当而有效的声誉风险管理，围绕公司战略和重点业务，强化与外部媒体资源的沟通，为公司发展营造良好的媒体环境；加强事前管理和内部宣导，提高声誉风险应对水平；持续完善声誉风险管理相关的制度和流程，加强公司声誉风险管理。报告期内，公司未发生重大声誉风险事件。

## **2、动态风险控制指标监控和补足机制建立情况**

### **(1) 风险控制指标动态监控机制的建立情况**

为了加强风险监控，在风险可测、可控、可承受前提下开展各项业务，公司根据监管部门的要求和自身风险管理的需要，建设了风险控制指标动态监控系统，并搭建了配套的组织体系和内部管理制度。监控系统能够实现风险控制指标的准确计量、动态监控和自动预警，公司根据市场、业务发展、技术、监管环境的变化不断调整和完善系统，使之能够覆盖公司开展的各项业务活动。

### **(2) 净资本补足机制的建立情况**

公司建立了净资本补足机制，根据监管风险控制指标的变化及自身的风险承受能力，对经营范围和各项业务的规模、结构进行动态调整，同时，根据业务发展需要，补充或提高净资本。

风险管理部负责对风险控制指标进行动态监控，一旦发现净资本及与净资本相关的其他风险控制指标突破公司预警值并持续负向变化接近或触及监管预警标准时，公司将采用调整资产结构、借入长期次级债、增资配股等多种渠道及时补足净资本予以应对。

### **(3) 压力测试机制的建立情况**

公司建立了压力测试机制，实施对公司整体风险的“事前评估预判”。公司在制度中明确，开展各项创新业务、扩张业务规模及实施利润分配等经营活动前，进行各类风险控制指标的压力测试，根据分析测试结果提出建议，成为公司管理层决策的重要依据。

报告期内，依据中国证券业协会《证券公司压力测试指引》的要求，从组织保障、制度建设等多方面入手，不断优化综合压力测试机制。报告期内，公司多次实施包括年度压力测试和季度压力测试在内的综合压力测试和专项压力测试。压力测试对象涉及重点风险控制指标和流动性指标，内容全面覆盖自营投资、融资类业务等，以及年度利润分配等重大决策，为保证业务和决策风险的可控、可测、可承受，起到了积极有效的作用。

#### （4）风险控制指标达标情况

报告期内，公司实现盈利，业务经营规范，资产流动性较高。截至报告期末，公司净资本为人民币 175.20 亿元，各类风险控制指标符合相关监管规定，且保有一定的安全边际。

### 3、落实全面风险管理情况

公司始终坚持依法合规、稳健经营的理念，不断依照“健全、合理、制衡、独立”的原则，优化完善“全面、全员、全过程、全覆盖”的风险管理体系，搭建了多层次的风险管理组织架构，建立了覆盖全面的风险管理制度体系，采取有效的风险管控措施，风险把控能力不断增强，整体上较好地控制了经营管理中的各项风险。

#### （1）风险管理组织架构

公司搭建了由董事会与监事会，公司经理层、首席风险官及合规总监，专职风险管理部门，业务经营部门、职能管理部门、分支机构及子公司组成的四个层级的风险管理架构。确保了全面风险管理涵盖公司的所有部门、岗位与人员，渗透到各项业务和工作环节，明确了相关授权的权限范围，确保了各个层级、各项业务、各个部门及各分支机构、各子公司在自身权限范围内开展相关工作。将下属子公司的风险管理纳入到公司全面风险管理体系之中，对子公司实行垂直管理，保障全面风险管理的一致性和有效性。

#### （2）风险管理制度与政策

东兴证券建立了以《全面风险管理制度》为基本制度，以各类专业风险管理办法及业务层面的操作规程和具体风险管理制度等为配套规则的风险管理制度体系，规范各类风险管理工作。同时，公司综合考量发展战略目标、外部市场环境、风险承受能力、股东回报要求等内外部因素，每年制定发布公司风险偏好，明确了对待风险和收益的基本态度及愿意承受的风险总量。在此基础上，结合各项业务在经营中面临的所有实质性风险等实际情况，拟订风险容忍度及其执行方案，并建立关键风险限额指标体系。相关制度与政策得到了有效的贯彻和落实。

#### （3）风险管控措施

公司建立了全面的风险识别和分析体系，采取定性和定量相结合的方式对风险状况开展分析和评价；针对可能影响实现经营目标的内、外部重大风险信息，采用科学合理的计量模型或评估方法进行审慎评估；建立了清晰的风险控制指标体系，有效覆盖各业务类型、各专业风险类型，通过风险管理系统，实现对各类业务风险指标、监管指标的动态监控与预警；制定了与风险偏好相适应的风险应对策略，建立了完善的内外部应对机制，有效管控流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、洗钱风险、声誉风险等各类风险；建立了畅通的风险信息沟通机制，确保相关信息传递与反馈及时、准确、完整。

### （三）其他披露事项

适用 不适用



## 第五节 重要事项

### 一、股东大会情况简介

| 会议届次         | 召开日期       | 决议刊登的指定网站的查询索引        | 决议刊登的披露日期  |
|--------------|------------|-----------------------|------------|
| 2019 年年度股东大会 | 2020-06-03 | http://www.sse.com.cn | 2020-06-04 |

股东大会情况说明

√适用□不适用

公司报告期内共召开一次股东大会，采用现场投票和网络投票相结合的表决方式。

2019 年年度股东大会审议通过了《东兴证券股份有限公司 2019 年度董事会工作报告》、《东兴证券股份有限公司 2019 年度监事会工作报告》、《东兴证券股份有限公司 2019 年年度报告》及摘要、《东兴证券股份有限公司 2019 年度财务决算报告》、《关于东兴证券股份有限公司 2019 年度利润分配的议案》、《关于确定公司 2020 年度证券投资规模的议案》、《关于公司 2019 年关联交易情况及预计 2020 年度日常关联交易的议案》、《关于修订〈东兴证券股份有限公司章程〉的议案》、《关于修订〈东兴证券股份有限公司对外捐赠管理办法〉的议案》、《关于选举公司第五届董事会非独立董事的议案》、《关于选举公司第五届董事会独立董事的议案》及《关于选举公司第五届监事会非职工监事的议案》。相关会议情况详见《东兴证券股份有限公司 2019 年年度股东大会决议公告》（公告编号：2020-034）。

### 二、利润分配或资本公积金转增预案

#### （一）半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

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

### 三、承诺事项履行情况

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

√适用□不适用

| 承诺背景 | 承诺类型 | 承诺方 | 承诺内容 | 承诺时间及期限 | 是否有履行期限 | 是否及时严格履行 | 如未能及时履行应说明未完成履行的 | 如未能及时履行应说明下一步计划 |
|------|------|-----|------|---------|---------|----------|------------------|-----------------|
|      |      |     |      |         |         |          |                  |                 |

|               |        |                 |                          |              |   |   | 具体原因 |   |
|---------------|--------|-----------------|--------------------------|--------------|---|---|------|---|
| 与首次公开发行人相关的承诺 | 其他     | 中国东方            | 虚假披露情形下赔偿投资者损失的承诺        | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 解决同业竞争 | 中国东方            | 避免同业竞争的承诺                | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 解决关联交易 | 中国东方            | 规范并减少关联交易的承诺             | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 其他     | 本公司             | 虚假披露情形下回购股份及赔偿投资者损失的承诺   | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 其他     | 本公司董事、监事及高级管理人员 | 虚假披露情形下回购股份及赔偿投资者损失的承诺   | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
| 与再融资相关的承诺     | 解决同业竞争 | 中国东方            | 避免同业竞争的承诺                | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 解决关联交易 | 中国东方            | 规范并减少关联交易的承诺             | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 其他     | 中国东方            | 不越权干预公司经营管理活动，不侵占公司利益的承诺 | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
|               | 其他     | 本公司董事、高级管理人员    | 对公司填补即期回报措施能够得到切实履行的承诺   | 长期有效         | 否 | 是 | -    | - |
| 其他承诺          | 分红     | 本公司             | 三年（2018年-2020年）分红规划的承诺   | 自股东大会通过之日起三年 | 是 | 是 | -    | - |

#### 四、聘任、解聘会计师事务所情况

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用  不适用

经公司 2020 年第一次临时股东大会审议批准，续聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2020 年度会计师事务所，负责公司 2020 年度财务报告、内部控制等相关审计工作。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用  不适用

公司对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

适用  不适用

公司对上年年度报告中的财务报告被注册会计师出具“非标准审计报告”的说明

适用  不适用

## 五、破产重整相关事项

适用 不适用

## 六、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司未发生达到《上海证券交易所股票上市规则》规定的重大诉讼、仲裁事项。

根据《上海证券交易所股票上市规则》有关规定，公司于2019年2月22日披露《关于累计诉讼的公告》（公告编号：2019-013），对本公司及子公司披露当日近12个月内累计涉及诉讼（仲裁）事项进行了统计，并在公司《2018年年度报告》、《2019年半年度报告》及《2019年年度报告》中披露了累计诉讼案件的进展情况。截至2020年6月30日，累计诉讼案件在《2019年年度报告》基础上进一步的进展情况如下：

### （一）诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

适用 不适用

| 事项概述及类型                         | 查询索引                                    |
|---------------------------------|-----------------------------------------|
| 东兴证券与吕泉源融资融券业务合同纠纷案             | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与汉华易美（天津）图像技术有限公司知识产权纠纷案    | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与倪伟庭融资融券合同纠纷案               | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与沈峰“时空客”证券虚假陈述责任纠纷          | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与费晓红“时空客”证券虚假陈述责任纠纷         | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与周云波“时空客”证券虚假陈述责任纠纷         | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴资本、东兴投资与湖南卓越等辣妹子食品股份转让合同纠纷    | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与弘高中太“弘高创意”股票质押式回购纠纷        | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券定向资管计划与上海融屏等“摩恩电气”股票质押式回购纠纷 | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与虞云新“新光圆成”股票质押式回购纠纷         | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |
| 东兴证券与新疆赢盛通典“康得新”股票质押式回购纠纷       | 2019年年度报告、2019年半年度报告、2019-013、2018年年度报告 |

### （二）临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 报告期内:          |                                |         |            |                                                                                                                                                              |                |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                    |                                     |
|----------------|--------------------------------|---------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|-------------------------------------|
| 起诉(申请)方        | 应诉(被申请)方                       | 承担连带责任方 | 诉讼仲裁类型     | 诉讼(仲裁)基本情况                                                                                                                                                   | 诉讼(仲裁)涉及金额     | 诉讼(仲裁)是否形成预计负债及金额 | 诉讼(仲裁)进展情况                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 诉讼(仲裁)审理结果及影响                                      | 诉讼(仲裁)判决执行情况                        |
| 东兴证券           | 吉林粮食集团收储经销有限公司、吉林粮食集团有限公司、中信华南 |         | 证券虚假陈述责任纠纷 | 原告东兴证券持有的 14 吉粮债《募集说明书》、《非公开转让告知书》存在虚假记载、误导性陈述及重大遗漏，导致所投资 3,000.00 万元 14 吉粮债遭受本金及未获清偿利息的损失。为维护自身权益，原告依法向法院提起侵权之诉，请求法院判令被告吉粮收储赔偿原告全部损失、判令被告吉粮集团、广州证券承担连带赔偿责任。 | 30,000,000.00  |                   | 吉林省长春市中级人民法院于 2019 年 6 月 18 日作出一审判决，判决我司对吉粮收储、吉粮集团分别享有破产债权本金 3,000.00 万元，利息 5,769,982 元，广州证券对上述款项的给付承担连带责任。广州证券向吉林省高级人民法院提出上诉，在二审阶段，我司与中信证券华南股份有限公司（原广州证券，现更名，以下简称中信华南）达成调解意见，吉林高院于 2020 年 3 月 16 日出具民事调解书予以确认。吉粮收储、吉粮集团不同意调解，因此，吉林高院于 2020 年 3 月 16 日作出二审判决，判决内容为：一、维持一审判决第一、三项（即：原告东兴证券对吉粮收储、吉粮集团分别享有破产债权本金 3,000.00 万，利息 5,769,982 元）。二、撤销一审判决第二项（即被告中信华南对上述款项的给付承担连带责任）。本判决为终审判决。 | 东兴证券已与中信华南达成调解，对吉粮收储、吉粮集团享有的破产债权金额较小，未对公司经营产生重大影响。 | 中信华南已根据调解协议履行完毕，对吉粮收储、吉粮集团的破产债权未执行。 |
| 东兴证券（以受托管理人名义代 | 中弘控股股份有限公司                     |         | 债券违约纠纷     | 被告中弘控股股份有限公司作为中弘控股股份有限公司 2016 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）的发行人未能按期履行本金及利息的偿付义务，导致本期债券发                                                                              | 250,000,000.00 |                   | 2019 年 12 月 30 日，北京市高级人民法院下达《民事裁定书》“（2019）京民终 631 号”，裁定驳回东兴证券的上诉，维持原裁定。东兴证券已代表本期债券全体持有人就本期债券违约纠纷向华南国际经济贸易仲裁委员会提交仲裁申请。2020 年 5 月 6 日，仲裁委正式受理，受案号为（2020）深国仲受 1434 号，                                                                                                                                                                                                                    | 被告中弘控股股份有限公司偿还本期债券应付的本金 2.50 亿元及相应利息、逾期            | 未执行                                 |

|                                |  |  |                                                                                                                      |  |  |             |                               |  |
|--------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|-------------|-------------------------------|--|
| 表 16<br>中弘<br>01 债<br>券持<br>人) |  |  | 生实质性违约。东兴证券作为债券的受托管理人代表全体债券持有人向北京市第二中级人民法院起诉请求法院判令被告偿还本期债券应付的本金 2.50 亿元及相应利息、逾期利息，并支付本案诉讼费、律师费。本案件的最终诉讼结果由债券持有人实际承受。 |  |  | 并出具了《仲裁通知》。 | 利息，并支付本案诉讼费、律师费。未对公司经营产生实质影响。 |  |
|--------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|-------------|-------------------------------|--|

**(三) 公司本报告期被处罚和公开谴责的情况**适用 不适用**(四) 其他说明**适用 不适用**七、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况**适用 不适用

报告期内，公司董事、监事、高级管理人员、控股股东不存在被有权机关调查、被司法机关或纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会立案调查或行政处罚、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门给予重大处罚以及被证券交易所公开谴责的情形。

**八、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明**适用 不适用

报告期内，公司及公司控股股东、实际控制人不存在未履行法院生效判决、不存在数额较大债务到期未清偿等不良诚信状况。

**九、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响****(一) 相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的**适用 不适用**(二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况**

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用**十、重大关联交易****(一) 与日常经营相关的关联交易****1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项**适用 不适用

| 类型 | 事项概述 | 查询索引 |
|----|------|------|
|----|------|------|

|          |                                                      |          |
|----------|------------------------------------------------------|----------|
| 向关联方提供劳务 | 向中国东方提供资产管理业务取得收入 1,335.00 万元，提供财务顾问服务取得收入 539.95 万元 | 2020-022 |
|          | 向大连银行股份有限公司提供衍生品服务取得收入 366.63 万元                     |          |
|          | 向上海东兴投资控股发展有限公司提供财务顾问服务取得收入 377.36 万元                |          |

注 1：上表仅列示交易金额超过 300.00 万元的关联交易事项，其他关联交易详见财务附注的相关内容，本节以下表格均同；

注 2：公司通过累计从中国东方借拆入资金 3,000.00 万元，支付利息 28.83 万元；

注 3：为大业信托有限责任公司提供资产管理服务取得收入 271.91 元，支付大业信托有限责任公司信托产品管理费支出 614.03 万元；为海通证券股份有限公司提供证券分销业务服务，累计分销收入 3.75 万元。

## 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用  不适用

## 3、临时公告未披露的事项

适用  不适用

### (二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

#### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用  不适用

| 事项概述                                                                                                                                                           | 查询索引     |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| 与大连银行股份有限公司累计发生现券买卖金额 14,091.71 万元                                                                                                                             | 2020-022 |
| 2016 年 12 月，大业信托有限责任公司委托我司设立东兴鑫智 54 号定向资产管理计划，并投资股票质押式回购项目，我公司于 2020 年 4 月 23 日将该项目债权转让给大业信托有限责任公司，其中债权本金为 773,190,115.00 元。                                   | 2020-022 |
| 2017 年 3 月，中国东方资产管理股份有限公司上海市分公司委托我司设立东兴证券福兴 57 号定向资产管理计划，并通过大连银行股份有限公司上海分行进行委贷放款，我公司于 2020 年 5 月 25 日将该项目债权转让给中国东方资产管理股份有限公司上海市分公司，其中债权本金为 5,160,000,000.00 元。 | 2020-022 |

注：与海通证券股份有限公司累计发生现券买卖金额 90.00 万元，分销买入金额 140.00 万元。

#### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用  不适用

#### 3、临时公告未披露的事项

适用  不适用

#### 4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用  不适用

### (三) 共同对外投资的重大关联交易

#### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用  不适用

| 事项概述                                                                   | 查询索引     |
|------------------------------------------------------------------------|----------|
| 截至 2020 年 6 月 30 日，本公司作为委托人与本公司关联方东方邦信置业有限公司、宁波金融资产管理有限公司共同投资本公司管理的集合资 | 2020-022 |



|                                                                                                                                                                          |          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| 产管理计划总规模 10.49 亿元，其中东方邦信置业有限公司出资本金余额 7.00 亿元；宁波金融资产管理股份有限公司出资本金余额 1.82 亿元，本公司自有资金出资本金余额 1.67 亿元，上半年自有资金实现投资收益 57.19 万元。                                                  |          |
| 截至 2020 年 6 月 30 日，本公司作为委托人与本公司关联方大连银行股份有限公司共同投资本公司管理的集合资产管理计划总规模 7.60 亿元，其中大连银行股份有限公司出资本金余额 6.50 亿元，本公司出资本金余额 1.10 亿元，上半年自有资金实现投资收益为 142.00 万元，收取集合资产管理计划管理费 143.00 万元。 | 2020-022 |

**2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**
 适用  不适用

**3、临时公告未披露的事项**
 适用  不适用

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

| 事项概述                             | 查询索引     |
|----------------------------------|----------|
| 中国东方代理买卖证券款余额 11,496.91 万元       | 2020-022 |
| 应收中国东方款项 3,752.13 万元             | 2020-022 |
| 大连银行股份有限公司代理买卖证券款余额 10,117.20 万元 | 2020-022 |
| 存入大连银行股份有限公司银行存款余额 3,048.83 万元   | 2020-022 |
| 持有大连银行股份有限公司交易性金融资产 5,000.00 万元  | 2020-022 |
| 持有邦信资产管理有限公司交易性金融资产 4,634.81 万元  | 2020-022 |

**2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**
 适用  不适用

**3、临时公告未披露的事项**
 适用  不适用

**（五）其他重大关联交易**
 适用  不适用

**（六）其他**
 适用  不适用

**十一、重大合同及其履行情况**
**1、托管、承包、租赁事项**
 适用  不适用

**2、担保情况**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币



| 公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）               |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
|------------------------------------|-------------|------|------|---------------|-------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|------------|--------|--------|---------|----------|------|
| 担保方                                | 担保方与上市公司的关系 | 被担保方 | 担保金额 | 担保发生日期（协议签署日） | 担保起始日 | 担保到期日                                                                                                                 | 担保类型 | 担保是否已经履行完毕 | 担保是否逾期 | 担保逾期金额 | 是否存在反担保 | 是否为关联方担保 | 关联关系 |
| 报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）            |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）          |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 公司对子公司的担保情况                        |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期内对子公司担保发生额合计                    |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 报告期末对子公司担保余额合计（B）                  |             |      |      |               |       | 2,824,854,662.80                                                                                                      |      |            |        |        |         |          |      |
| 公司担保总额情况（包括对子公司的担保）                |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保总额（A+B）                          |             |      |      |               |       | 2,824,854,662.80                                                                                                      |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保总额占公司净资产的比例（%）                   |             |      |      |               |       | 13.73%                                                                                                                |      |            |        |        |         |          |      |
| 其中：                                |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）           |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D） |             |      |      |               |       | 2,824,854,662.80                                                                                                      |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保总额超过净资产50%部分的金额（E）               |             |      |      |               |       |                                                                                                                       |      |            |        |        |         |          |      |
| 上述三项担保金额合计（C+D+E）                  |             |      |      |               |       | 2,824,854,662.80                                                                                                      |      |            |        |        |         |          |      |
| 未到期担保可能承担连带清偿责任说明                  |             |      |      |               |       | 公司为债券的全部偿付义务提供无条件及不可撤销的保证担保                                                                                           |      |            |        |        |         |          |      |
| 担保情况说明                             |             |      |      |               |       | 详见上海证券交易所网站披露的《东兴证券股份有限公司关于为全资子公司境外发行美元债券提供担保的公告》（公告编号：2019-030）、《东兴证券股份有限公司关于为全资子公司境外发行美元债券提供担保进展的公告》（公告编号：2019-056） |      |            |        |        |         |          |      |

注：公司为全资子公司东兴香港的特殊目的实体东兴启航有限公司（Dongxing Voyage Co., Ltd）境外发行美元债提供的担保在本报告期内的应付利息减已付利息加汇率变动为 41,829,002.28 元。

### 3、其他重大合同

适用  不适用

## 十二、上市公司扶贫工作情况

适用  不适用

### 1、精准扶贫规划

适用  不适用

公司认真贯彻和落实党中央关于精准扶贫的重要指示，把扶贫工作作为崇高的政治责任，践行“扶贫先扶智”的指导思想，注重“输血”，更注重“造血”，在金融扶贫和教育扶贫方面主动作为，以贫困地区实体经济需求为导向，在金融扶贫和教育扶贫方面主动作为，为贫困地区发展贡献力量。

## 2、报告期内精准扶贫概要

√适用 □不适用

2020 年是脱贫攻坚战的收官之年，公司严格落实十九大报告中关于扶贫工作的重要指示，克服新冠疫情给扶贫工作带来的不利影响，积极推进在 4 个定点帮扶贫困县的扶贫工作，重点帮助贫困县开展抗疫防疫工作。

## 3、精准扶贫成效

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

| 指标                    | 数量及开展情况 |
|-----------------------|---------|
| 一、总体情况                |         |
| 其中：1.资金               | 300.00  |
| 二、分项投入                |         |
| 1.健康扶贫                |         |
| 其中：1.1 贫困地区医疗卫生资源投入金额 | 300.00  |

## 4、履行精准扶贫社会责任的阶段性进展情况

√适用 □不适用

自湖北等地发生新型冠状病毒肺炎疫情以来，公司认真贯彻落实党中央、国务院对疫情防控工作的重要决策部署，将疫情防控作为当前工作的重中之重。针对本次新型冠状病毒肺炎疫情，公司分别向位于湖北省周边的对口帮扶的两个贫困县——湖南省邵阳县和重庆市云阳县捐赠资金 200.00 万元和 100.00 万元，用于购买防疫物资，助力疫情防控和复工复产。

## 5、后续精准扶贫计划

√适用 □不适用

2020 年是脱贫攻坚战的收官之年，公司进一步落实十九大报告中关于扶贫工作的重要指示，克服新冠疫情给扶贫工作带来的不利影响，将继续发挥“兴源惠民”教育扶贫品牌优势，做好对贫困地区政府工作人员、教育工作者和医护人员的培训工作，继续做好“金融扶贫+教育扶贫”，充分发挥资本市场在服务国家脱贫攻坚战略中的作用，继续推动结对帮扶事业向纵深发展，向社会展现东兴证券的企业精神和大局意识，不忘初心，凝心聚力打赢脱贫攻坚战。

## 十三、可转换公司债券情况

□适用 √不适用

## 十四、环境信息情况

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

□适用 √不适用

**(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明**

√适用 □不适用

公司及子公司不属于重点排污单位。

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

**(三) 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明**

□适用 √不适用

**(四) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明**

□适用 √不适用

**十五、其他重大事项的说明****(一) 与上一会计期间相比,会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况、原因及其影响**

√适用 □不适用

财政部于2017年度修订了《企业会计准则第14号—收入》(2017年修订)。修订后的准则规定,首次执行该准则应当根据累积影响数,调整期初留存收益及财务报表其他相关项目金额,对可比期间信息不予调整。公司于2020年1月1日起开始执行该准则,对财务报表影响不重大。详见“第十节 财务报告五、44、重要会计政策和会计估计的变更”。

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

□适用 √不适用

**(三) 其他**

√适用 □不适用

**1、撤销江门堤东路证券营业部**

公司第四届董事会第二十二次会议审议通过了《关于撤销江门堤东路营业部的议案》,授权公司经营管理层办理与撤销有关的手续。中国证券监督管理委员会广东监管局已核准同意撤销江门堤东路证券营业部。详见《东兴证券股份有限公司第四届董事会第二十二次会议决议公告》(公告编号:2019-070)和《东兴证券股份有限公司关于获准撤销江门堤东路证券营业部的公告》(公告编号:2020-002)。2020年1月份起公司组织实施了江门堤东路证券营业部的撤销工作;于3月底完成了营业部人员、客户的安置,关闭了经营场所;于5月14日公司收到江门市蓬江区市场监督管理局出具的《核准注销登记通知书》;并于5月25日缴销了《经营证券期货业务许可证》,至此江门堤东路证券营业部的撤销工作已全部完成。

**2、获得中国证监会核准公司设立基金子公司批复**

2020年2月,中国证监会下发《关于核准东兴证券股份有限公司设立基金子公司的批复》(证监许可〔2020〕256号),核准公司设立东兴基金,东兴基金注册地为北京市,注册资本为2亿元

人民币,经营范围为公开募集证券投资基金管理、基金销售和中国证监会许可的其他业务。同时,中国证监会核准公司变更业务范围,减少公开募集证券投资基金管理业务。详见《东兴证券股份有限公司关于获得中国证监会核准公司设立基金子公司批复的公告》(公告编号:2020-007)。

### 3、董监高变动情况

2020年3月27日,公司2020年第二次职工代表大会选举杜彬先生、郝洁女士为公司第五届监事会职工监事,与公司股东大会选举产生的非职工监事共同组成公司第五届监事会。详见《东兴证券股份有限公司关于选举第五届监事会职工代表监事的公告》(公告编号:2020-014)。

2020年4月28日,因工作变动原因,许学礼先生向董事会递交书面辞职报告,辞去公司首席风险官职务;公司第四届董事会第二十五次会议同意聘任赵慧文女士为公司首席风险官,详见《东兴证券股份有限公司关于公司首席风险官发生变动的公告》(公告编号:2020-028)。

2020年6月3日,公司完成董事会和监事会换届。公司2019年年度股东大会选举魏庆华先生、张涛先生、谭世豪先生、张军先生、江月明先生、曾涛先生、董裕平先生、周亮先生为公司第五届董事会非独立董事,选举郑振龙先生、张伟先生、宫肃康先生、孙广亮先生为公司第五届董事会独立董事,选举秦斌先生、张威先生、叶淑玉女士为公司第五届监事会非职工监事。屠旋先生任期届满,不再担任公司董事;罗小平先生任期届满,不再担任公司监事。详见《东兴证券股份有限公司2019年年度股东大会决议公告》(公告编号:2020-034)。

2020年6月3日,公司第五届董事会第一次会议选举魏庆华先生为公司董事长,聘任张涛先生为公司总经理兼财务负责人,聘任谭世豪先生、许学礼先生、银国宏先生、张军先生、刘亮先生、陈海先生为公司副总经理,聘任许学礼先生为公司合规总监,聘任刘亮先生为公司首席信息官,聘任张锋先生为公司董事会秘书,聘任赵慧文女士为公司首席风险官。详见《东兴证券股份有限公司第五届董事会第一次会议决议公告》(公告编号:2020-035)。

2020年6月3日,公司第五届监事会第一次会议选举秦斌先生为公司监事会主席。详见《东兴证券股份有限公司第五届监事会第一次会议决议公告》(公告编号:2020-036)。

### 4、《公司章程》修订情况

2020年4月28日,公司第四届董事会第二十五次会议审议通过了《关于修订<东兴证券股份有限公司章程>的议案》。2020年6月3日,公司2019年年度股东大会审议通过了该议案,授权董事会并同意董事会转授权经营管理层具体办理《公司章程》变更的相关手续。详见《东兴证券股份有限公司关于修订<公司章程>的公告》(公告编号:2020-023)和《东兴证券股份有限公司2019年年度股东大会决议公告》(公告编号:2020-034)。

### 5、计提资产减值准备情况

2020年4月28日,公司第四届董事会第二十五次会议和第四届监事会第十六次会议审议《关于计提资产减值准备的议案》。根据《企业会计准则》和公司会计政策的相关规定,公司对存在减值迹象的资产进行减值测试后,2019年计提各项资产减值准备共计人民币46,653.49万元,已

超过公司最近一个会计年度经审计净利润的 10.00%。详见公司于 2020 年 4 月 30 日发布的《东兴证券股份有限公司关于计提资产减值准备的公告》（公告编号：2020-024）。

#### 6、会计政策变更情况

2020 年 4 月 28 日，公司第四届董事会第二十五次会议和第四届监事会第十六次会议审议通过《关于变更公司会计政策的议案》。本次变更前，公司执行财政部 2006 年发布的《企业会计准则第 14 号——收入》、《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》、《企业会计准则第 12 号——债务重组》。变更后，公司执行财政部 2017 年新发布的新收入准则、2019 年新发布的非货币性资产交换准则以及债务重组准则。详见《东兴证券股份有限公司关于会计政策变更的公告》（公告编号：2020-025）。

#### 7、权益分配实施情况

2020 年 6 月 3 日，公司召开 2019 年年度股东大会，审议通过了《关于东兴证券股份有限公司 2019 年度利润分配议案》，本次利润分配以方案实施前的公司总股本 2,757,960,657 股为基数，每股派发现金红利 0.14 元（含税），共计派发现金红利 386,114,491.98 元（含税）。本次权益分派事项的股权登记日为：2020 年 7 月 22 日，除息日、现金红利发放日：2020 年 7 月 23 日，已实施完毕，详见《东兴证券股份有限公司 2019 年年度权益分派实施公告》（公告编号：2020-041）。

## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、股本变动情况

#### （一）股份变动情况表

##### 1、股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

##### 2、股份变动情况说明

适用 不适用

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

适用 不适用

##### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

#### （二）限售股份变动情况

适用 不适用



**二、股东情况**
**(一) 股东总数:**

|                        |        |
|------------------------|--------|
| 截止报告期末普通股股东总数(户)       | 96,831 |
| 截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户) | 不适用    |

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

单位: 股

| 前十名股东持股情况                             |                   |               |               |                                 |          |            |          |
|---------------------------------------|-------------------|---------------|---------------|---------------------------------|----------|------------|----------|
| 股东名称<br>(全称)                          | 报告期内<br>增减        | 期末持股数量        | 比例<br>(%)     | 持有<br>有限<br>售条<br>件股<br>份数<br>量 | 质押或冻结情况  |            | 股东<br>性质 |
|                                       |                   |               |               |                                 | 股份<br>状态 | 数量         |          |
| 中国东方资产管理股份有限公司                        | -                 | 1,454,600,484 | 52.74         | -                               | 无        | -          | 国有法人     |
| 山东高速股份有限公司                            | -                 | 119,989,367   | 4.35          | -                               | 无        | -          | 国有法人     |
| 中国证券金融股份有限公司                          | -                 | 82,463,160    | 2.99          | -                               | 无        | -          | 国有法人     |
| 福建天宝矿业集团股份有限公司                        | -1,098,200        | 56,380,000    | 2.04          | -                               | 质押       | 23,850,000 | 境内非国有法人  |
| 上海工业投资(集团)有限公司                        | -                 | 48,100,000    | 1.74          | -                               | 无        | -          | 国有法人     |
| 福建新联合投资有限责任公司                         | -                 | 42,530,568    | 1.54          | -                               | 质押       | 42,530,000 | 境内非国有法人  |
| 香港中央结算有限公司                            | 78,623            | 34,041,215    | 1.23          | -                               | 无        | -          | 境外法人     |
| 中国诚通控股集团有限公司                          | -                 | 28,594,222    | 1.04          | -                               | 无        | -          | 国有法人     |
| 中国建设银行股份有限公司-国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 | 4,602,800         | 19,376,249    | 0.70          | -                               | 无        | -          | 未知       |
| 北京金冠达房地产开发有限公司                        | -                 | 15,000,000    | 0.54          | -                               | 质押       | 7,500,000  | 境内非国有法人  |
| 前十名无限售条件股东持股情况                        |                   |               |               |                                 |          |            |          |
| 股东名称                                  | 持有无限售条件流<br>通股的数量 | 股份种类及数量       |               |                                 |          |            |          |
|                                       |                   | 种类            | 数量            |                                 |          |            |          |
| 中国东方资产管理股份有限公司                        | 1,454,600,484     | 人民币普通股        | 1,454,600,484 |                                 |          |            |          |
| 山东高速股份有限公司                            | 119,989,367       | 人民币普通股        | 119,989,367   |                                 |          |            |          |
| 中国证券金融股份有限公司                          | 82,463,160        | 人民币普通股        | 82,463,160    |                                 |          |            |          |
| 福建天宝矿业集团股份有限公司                        | 56,380,000        | 人民币普通股        | 56,380,000    |                                 |          |            |          |
| 上海工业投资(集团)有限公司                        | 48,100,000        | 人民币普通股        | 48,100,000    |                                 |          |            |          |
| 福建新联合投资有限责任公司                         | 42,530,568        | 人民币普通股        | 42,530,568    |                                 |          |            |          |
| 香港中央结算有限公司                            | 34,041,215        | 人民币普通股        | 34,041,215    |                                 |          |            |          |
| 中国诚通控股集团有限公司                          | 28,594,222        | 人民币普通股        | 28,594,222    |                                 |          |            |          |
| 中国建设银行股份有限公司-国泰中证全指                   | 19,376,249        | 人民币普通股        | 19,376,249    |                                 |          |            |          |

|                     |                                                                                                                              |        |            |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------|
| 证券公司交易型开放式指数证券投资基金  |                                                                                                                              |        |            |
| 北京金冠达房地产开发有限公司      | 15,000,000                                                                                                                   | 人民币普通股 | 15,000,000 |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明    | 公司股份均为无限售条件股份。前十名股东中，公司控股股东中国东方与其他前十大股东均不存在关联或一致行动关系；福建天宝矿业集团股份有限公司和北京金冠达房地产开发有限公司之间存在一致行动关系。除此之外，公司未知前述股东之间是否存在关联关系或一致行动关系。 |        |            |
| 表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明 | 不适用                                                                                                                          |        |            |

注 1：此处列示持股情况摘自本公司截至 2020 年 6 月 30 日的股东名册。

注 2：A 股股东性质为股东在中国结算上海分公司登记的账户性质。

注 3：因公司股票为融资融券标的证券，股东持股数量按照其通过普通证券账户、信用证券账户持有的股票及权益数量合并计算。

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

适用 不适用

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

三、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

报告期内，公司控股股东及实际控制人未发生变更。

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员情况

一、持股变动情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用 不适用

| 姓名  | 担任的职务 | 变动情形 |
|-----|-------|------|
| 许学礼 | 首席风险官 | 离任   |
| 赵慧文 | 首席风险官 | 聘任   |
| 屠旋旋 | 董事    | 离任   |
| 张军  | 董事    | 选举   |
| 罗小平 | 监事    | 离任   |
| 张威  | 监事    | 选举   |

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

1、2020年4月28日，因工作变动，许学礼先生辞去公司首席风险官职务。同日，公司第四届董事会第二十五次会议聘任赵慧文女士为公司首席风险官。

2、2020年6月3日，公司完成董事会和监事会换届。公司2019年年度股东大会选举张军先生为公司非独立董事，选举张威先生为公司非职工监事。屠旋旋先生任职届满不再担任公司董事，罗小平先生任职届满不再担任公司监事。

### 三、其他说明

适用 不适用

报告期内，公司在公司治理、内部控制等方面不存在违反《公司法》、《公司章程》规定的情况。

## 第九节 公司债券相关情况

√适用□不适用

### 一、公司债券基本情况

单位：万元 币种：人民币

| 债券名称                                       | 简称       | 代码     | 发行日        | 到期日        | 债券余额       | 利率 (%) | 还本付息方式                          | 交易场所    |
|--------------------------------------------|----------|--------|------------|------------|------------|--------|---------------------------------|---------|
| 2016 年东兴证券股份有限公司债券                         | 16 东兴债   | 136146 | 2016-01-13 | 2021-01-13 | 23,000.20  | 3.03   | 每年付息一次，到期一次还本，最后一期的利息随本金的兑付一起支付 | 上海证券交易所 |
| 东兴证券股份有限公司面向合格投资者公开发行 2017 年公司债券（品种二）      | 17 东兴 03 | 143136 | 2017-06-15 | 2022-06-15 | 90,000.00  | 4.99   | 每年付息一次，到期一次还本，最后一期的利息随本金的兑付一起支付 | 上海证券交易所 |
| 东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一） | 20 东兴 G1 | 163652 | 2020-6-15  | 2021-6-15  | 240,000.00 | 2.60   | 每年付息一次，到期一次还本，最后一期的利息随本金的兑付一起支付 | 上海证券交易所 |
| 东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一） | 20 东兴 G3 | 175006 | 2020-8-13  | 2021-9-13  | 185,000.00 | 3.00   | 到期一次还本付息                        | 上海证券交易所 |
| 东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二） | 20 东兴 G4 | 175007 | 2020-8-13  | 2023-8-13  | 100,000.00 | 3.57   | 每年付息一次，到期一次还本，最后一期的利息随本金的兑付一起支付 | 上海证券交易所 |



公司债券付息兑付情况

√适用□不适用

报告期内，公开发行公司债券的付息兑付具体情况如下：

| 债券类型               | 债券简称     | 起息日        | 到期日        | 债券规模<br>(人民币万元) | 付息兑付情况    |
|--------------------|----------|------------|------------|-----------------|-----------|
| 人民币公<br>开发行公<br>司债 | 16 东兴债   | 2016/01/13 | 2021/01/13 | 23,000.20       | 已足额按时付息   |
|                    | 17 东兴 03 | 2017/06/15 | 2022/06/15 | 90,000.00       | 已足额按时付息   |
|                    | 17 东兴 02 | 2017/06/15 | 2020/06/15 | 150,000.00      | 已足额按时兑付本息 |

#### 公司债券投资者适当性安排及附权情况

“16 东兴债”面向合格投资者公开发行，为 5 年期固定利率债券，附第 3 年末公司上调票面利率选择权及投资者回售选择权。“16 东兴债”回售申报期为 2018 年 12 月 21 日至 12 月 25 日，根据中证登上海分公司对回售情况的统计，“16 东兴债”回售有效期登记数量为 2,569,998 手，回售金额为 2,569,998,000.00 元。公司对有效登记回售的“16 东兴债”持有人实施回售，回售资金通过偿债专项账户按时划付。截止报告期末，“16 东兴债”剩余规模 230,002,000.00 元。

“17 东兴 02”和“17 东兴 03”是公司面向合格投资者公开发行 2017 年公司债券的两个品种，分别为 3 年期和 5 年期固定利率债券，不附公司、投资者选择权条款及可交换条款等特殊条款。

“20 东兴 G1”是公司 2020 年面向专业投资者公开发行的 1 年期固定利率债券，不附公司、投资者选择权条款及可交换条款等特殊条款。

“20 东兴 G3”和“20 东兴 G4”是公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）的两个品种，分别为 13 个月期和 3 年期固定利率债券，不附公司、投资者选择权条款及可交换条款等特殊条款。

公司债券其他情况的说明

√适用□不适用

报告期内公司存续或发行其他债券和债务融资工具的情况：

#### （一）非公开发行公司债券

单位：万元 币种：人民币

| 债券名称                            | 简称       | 代码     | 发行日        | 到期日        | 债券余额       | 利率(%) | 还本付息方式                          | 交易场所    |
|---------------------------------|----------|--------|------------|------------|------------|-------|---------------------------------|---------|
| 东兴证券股份有限公司非公开发行 2017 年公司债券（第二期） | 17 东兴 F2 | 145185 | 2017-11-09 | 2020-11-09 | 200,000.00 | 5.39  | 每年付息一次，到期一次还本，最后一期的利息随本金的兑付一起支付 | 上海证券交易所 |
| 东兴证券股                           | 18 东     | 150285 | 2018-04-12 | 2021-04-12 | 300,000.00 | 5.37  | 每年付息一次，                         | 上海      |

|                                                         |              |        |            |            |            |      |  |                                                 |                        |
|---------------------------------------------------------|--------------|--------|------------|------------|------------|------|--|-------------------------------------------------|------------------------|
| 份有限公司<br>2018 年非公<br>开发行公司<br>债券（第一<br>期）               | 兴 F1         |        |            |            |            |      |  | 到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付            | 证 券<br>交 易<br>所        |
| 东兴证券股<br>份有限公司<br>2018 年非公<br>开发行公司<br>债券（第二<br>期）（品种二） | 18 东<br>兴 F3 | 150342 | 2018-04-26 | 2021-04-26 | 130,000.00 | 5.10 |  | 每年付息一次，<br>到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付 | 上 海<br>证 券<br>交 易<br>所 |
| 东兴证券股<br>份有限公司<br>2018 年非公<br>开发行公司<br>债券（第三<br>期）      | 18 东<br>兴 F4 | 150592 | 2018-08-06 | 2021-08-06 | 300,000.00 | 4.88 |  | 每年付息一次，<br>到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付 | 上 海<br>证 券<br>交 易<br>所 |
| 东兴证券股<br>份有限公司<br>2019 年非公<br>开发行公司<br>债券（第二<br>期）      | 19 东<br>兴 F2 | 151797 | 2019-07-12 | 2022-7-12  | 300,000.00 | 3.98 |  | 每年付息一次，<br>到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付 | 上 海<br>证 券<br>交 易<br>所 |
| 东兴证券股<br>份有限公司<br>2020 年非公<br>开发行公司<br>债券（第一<br>期）      | 20 东<br>兴 F1 | 166316 | 2020-03-17 | 2023-3-17  | 200,000.00 | 3.20 |  | 每年付息一次，<br>到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付 | 上 海<br>证 券<br>交 易<br>所 |

注：以上债券均不附公司、投资者选择权条款及可交换条款等特殊条款。

## （二）次级债券

单位：亿元 币种：人民币

| 债券名称                                          | 简称       | 代码     | 发行日       | 到期日       | 债券<br>余额 | 利率<br>（%） | 还本付息方式                                          | 交易<br>场所               |
|-----------------------------------------------|----------|--------|-----------|-----------|----------|-----------|-------------------------------------------------|------------------------|
| 东兴证券股<br>份有限公司 2019<br>年度次级债券<br>（第一期）        | 19 东兴 C1 | 151436 | 2019-4-22 | 2022-4-22 | 20.00    | 4.20      | 每年付息一次，<br>到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付 | 上 海<br>证 券<br>交 易<br>所 |
| 东兴证券股<br>份有限公司 2020<br>年度次级债券<br>（第一期）品种<br>一 | 20 东兴 C1 | 166866 | 2020-5-21 | 2023-5-21 | 20.00    | 3.40      | 每年付息一次，<br>到期一次还本，<br>最后一期的利息<br>随本金的兑付一<br>起支付 | 上 海<br>证 券<br>交 易<br>所 |

注：以上债券均不附公司、投资者选择权条款及可交换条款等特殊条款。

## （三）境外债券

单位：万元 币种：美元

| 债券名称 | 简称 | 代码 | 发行日 | 到期日 | 债券余额 | 利率 | 还本 | 交易 |
|------|----|----|-----|-----|------|----|----|----|
|------|----|----|-----|-----|------|----|----|----|

|                                                      |                      |      |           |           |           | (%)  | 付息方式 | 场所   |
|------------------------------------------------------|----------------------|------|-----------|-----------|-----------|------|------|------|
| DONGXINGVOYAGECO.LTD.3.25% GUARANTEEDBONDS2024(5643) | DXVOYAGE B2408(5643) | 5643 | 2019-8-15 | 2024-8-15 | 40,000.00 | 3.25 | 半年一次 | 香港交所 |

2019年8月15日,公司全资子公司东兴香港旗下境外全资特殊目的公司东兴启航有限公司(DongxingVoyageCo.,Ltd)发行4亿美元债券。债券期限5年,债券票息3.25%,到期日为2024年8月15日。本期债券于2020年2月14日足额支付2019年8月15日至2020年2月14日的利息,于2020年8月14日足额支付2020年2月15日至2020年8月14日的利息。

## 二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

报告期内公司聘请的债券受托管理人、资信评级机构均未发生变更。

|                                                                  |      |                         |
|------------------------------------------------------------------|------|-------------------------|
| “18东兴F1”、“18东兴F3”、“18东兴F4”、“19东兴C1”、“20东兴C1”、“20东兴F1”<br>债券受托管理人 | 名称   | 华融证券股份有限公司              |
|                                                                  | 办公地址 | 北京市朝阳区朝阳门北大街18号         |
|                                                                  | 联系人  | 郭广坤                     |
|                                                                  | 联系电话 | 15010770034             |
| “16东兴债”<br>债券受托管理人                                               | 名称   | 新时代证券股份有限公司             |
|                                                                  | 办公地址 | 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层   |
|                                                                  | 联系人  | 李鹏、范斯一                  |
|                                                                  | 联系电话 | 13581581421、18211012109 |
| “17东兴03”、“17东兴F2”<br>债券受托管理人                                     | 名称   | 国金证券股份有限公司              |
|                                                                  | 办公地址 | 上海浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦22楼 |
|                                                                  | 联系人  | 曹现伟、金颖琦                 |
| “19东兴F2”<br>债券受托管理人                                              | 名称   | 首创证券股份有限公司              |
|                                                                  | 办公地址 | 北京市西城区德胜门外大街115号        |
|                                                                  | 联系人  | 邵治铭、杨冰                  |
|                                                                  | 联系电话 | 010-56511750            |
| “20东兴G1”、“20东兴G3”、“20东兴G4”<br>债券受托管理人                            | 名称   | 兴业证券股份有限公司              |
|                                                                  | 办公地址 | 北京市西城区锦什坊街35号601-605室   |
|                                                                  | 联系人  | 宋以祯                     |
|                                                                  | 联系电话 | 010-66290192            |
| “16东兴债”、“17东兴03”、“20东兴G1”、“20东兴G3”、“20东兴G4”<br>资信评级机构            | 名称   | 联合信用评级有限公司              |
|                                                                  | 办公地址 | 北京市朝阳区建国门外大街2号PICC大厦10层 |

其他说明:

适用 不适用

## 三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

公司严格按照募集说明书的约定及内部流程使用募集资金,募集资金的使用及划拨均符合公司募集资金相关制度及公司资金业务相关审批程序。

## （一）公司债券

### 1、“16 东兴债”

截至报告期末，公司发行的“16 东兴债”募集资金已全部使用完毕。公司为“16 东兴债”开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行费用后的资金总额全部用于融资融券、股票质押式回购、资产管理、并购基金等业务，适度扩大固定收益证券投资规模，同时补充公司营运资金；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

### 2、“17 东兴 03”

截至报告期末，公司发行的“17 东兴 03”的募集资金已全部使用完毕。公司为债券开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行费用后的资金总额全部用于补充营运资金，以开展股票质押式回购交易等创新业务，增加固定收益类产品投资、扩大融资融券业务规模以及满足公司日常经营管理的资金需求；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

### 3、“20 东兴 G1”

截至报告期末，公司发行的“20 东兴 G1”的募集资金已全部使用完毕。公司为债券开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行等相关费用后，用于偿还到期负债及补充营运资金；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

### 4、“20 东兴 G3”、“20 东兴 G4”

截至本报告签署日，公司发行的“20 东兴 G3”、“20 东兴 G4”的募集资金已全部使用完毕。公司为债券开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行等相关费用后，全部用于补充营运资金；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

### 5、“17 东兴 F2”

截至报告期末，公司发行的“17 东兴 F2”的募集资金已全部使用完毕。公司为“17 东兴 F2”开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行费用后的资金总额全部用于补充营运资金，以开展股票质押式回购交易等创新业务，增加固定收益类产品投资、扩大融资融券业务规模以及满足公司日常经营管理的资金需求；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### **6、“18 东兴 F1”、“18 东兴 F3”、“18 东兴 F4”**

截至报告期末，公司发行的上述公司债券的募集资金已全部使用完毕。公司为其分别开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行费用后的资金总额全部用于补充营运资金，以开展股票质押式回购交易等创新业务，增加固定收益类产品投资、扩大融资融券业务规模以及满足公司日常经营管理的资金需求；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### **7、“19 东兴 F2”**

截至报告期末，公司发行的“19 东兴 F2”的募集资金已全部使用完毕。公司为其开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行费用后的资金总额全部用于偿还公司到期、赎回的债务融资工具，包括公司债券、次级债券、同业拆借等；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### **8、“20 东兴 F1”**

截至报告期末，公司发行的“20 东兴 F1”的募集资金已全部使用完毕。公司为其开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行费用后的资金总额全部用于偿还“东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券（第一期）”；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。



## （二）次级债券

### 1、“19 东兴 C1”

截至报告期末，公司发行的次级债券“19 东兴 C1”的募集资金已全部使用完毕。公司为“19 东兴 C1”开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金全部用于偿还公司到期债务，包括但不限于归还到期公司债券、同业拆借、收益凭证等债务融资工具；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

### 2、“20 东兴 C1”

截至报告期末，公司发行的次级债券“20 东兴 C1”的募集资金已全部使用完毕。公司为“20 东兴 C1”开立募集资金专项账户，用于募集资金接收、存储及划转，并与受托管理人及开户银行签订三方监管协议，公司严格按照三方监管协议规定及公司资金审批流程运用专户资金。

根据本期债券募集说明书的相关内容，公司将募集资金扣除发行等相关费用后，全部用于偿还公司到期的债务融资工具，包括但不限于归还到期公司债券、同业拆借、收益凭证等债务融资工具；不存在转借他人的情况，也未用于弥补亏损和非生产性支出。

资金实际使用情况与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

## 四、公司债券评级情况

√适用□不适用

联合信用评级有限公司（以下简称“联合评级”）为公司的债券资信评级机构，是联合资信评估有限公司的全资子公司，成立于 2002 年 5 月。2008 年 5 月，联合评级获得中国证券监督管理委员会行政许可，从事证券市场资信评级业务（业务资格许可证编号：ZPJ005，中国证券业协会会员代码 412005）。

联合评级业务范围主要包括主体信用评级、债券评级（公司债、可转债、政府债券、市政公司债、可交换债、私募债、金融债、资产证券化等）、债权投资计划评级、信托产品评级、资管计划评级、信用衍生产品评级、国家主权评级等，以及机构投资者服务、企业社会责任评价、公司治理评价、私募股权基金风险评价、基金评级、信用风险管理咨询等评价和咨询业务。

2020 年 3 月 27 日，联合评级对公司及面向专业投资者公开发行的 2020 年公司债券的信用状况进行了综合评估，并出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券信用评级报告》（联合[2020]566 号），确定公司主体长期信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”；确定公司面向专业投资者公开发行的 2020 年公司债券信用等级为 AAA。

2020 年 6 月 4 日，联合评级对公司主体长期信用及面向专业投资者公开发行的公司债券“20 东兴 G1”进行了评级，并出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司

债券（第一期）信用评级报告》（联合[2020]1145 号），确定公司主体长期信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”；确定公司面向专业投资者公开发行的“20 东兴 G1”信用等级为 AAA。

2020 年 6 月 18 日，联合评级对公司已公开发行的公司债券“16 东兴债”、“17 东兴 03”和“20 东兴 G1”进行了跟踪评级，并出具了《东兴证券股份有限公司公司债券 2020 年跟踪评级报告》（联合[2020]1663 号），维持公司主体长期信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”，维持公司债券“16 东兴债”、“17 东兴 03”和“20 东兴 G1”的债券信用等级为 AAA。以上公司债券评级报告已于 2020 年 6 月 22 日在上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）披露，提请投资者关注。

2020 年 8 月 3 日，联合评级对公司主体长期信用及面向专业投资者公开发行的公司债券“20 东兴 G3”、“20 东兴 G4”进行了评级，并出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）信用评级报告》（联合[2020]2491 号），确定公司主体长期信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”；确定公司面向专业投资者公开发行的“20 东兴 G3”、“20 东兴 G4”的债券信用等级为 AAA。

2020 年 8 月 3 日，联合评级对公司主体长期信用及拟面向专业投资者公开发行的 2020 年次级债券进行了评级，并出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行次级债券信用评级报告》（联合[2020]2016 号），确定公司主体长期信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”；确定公司拟面向专业投资者公开发行的 2020 年次级债券信用等级为 AA+。

以上评级结果与 2019 年 6 月 20 日联合评级出具的“16 东兴债”、“17 东兴 02”和“17 东兴 03”上一次评级报告《东兴证券股份有限公司公司债券 2019 年跟踪评级报告》（联合[2019]1294 号）的评级结果一致，未发生变化，未对投资者适当性产生影响。

公司债券“17 东兴 F2”、“18 东兴 F1”、“18 东兴 F3”、“18 东兴 F4”、“19 东兴 F2”、“20 东兴 F1”，次级债券“19 东兴 C1”、“20 东兴 C1”均未进行评级。

除以上情况，2020 年 5 月 21 日，联合资信评估有限公司（以下简称“联合资信”）出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年主体长期信用评级报告》（联合[2020]1199 号）；2020 年 2 月 19 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第一期短期融资券信用评级报告》（联合[2020]292 号）；2020 年 3 月 6 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第二期短期融资券信用评级报告》（联合[2020]465 号）；2020 年 4 月 7 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第三期短期融资券信用评级报告》（联合[2020]787 号）；2020 年 5 月 21 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第四期短期融资券信用评级报告》（联合[2020]1198 号）；2020 年 6 月 12 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第五期短期融资券信用评级报告》（联合[2020]1304 号）；2020 年 7 月 7 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第六期短期融资券信用评级报告》（联合[2020]2058 号）；2020 年 8 月 10 日，联合资信出具了《东兴证券股份有限公司 2020 年度第七期短期融资券信用评级报告》（联

合[2020]3117号)。以上评级报告中,联合资信确定公司主体长期信用等级为AAA,评级展望为稳定,主体评级与公司债券评级报告中不存在有差异的情况。

除以上情况外,资信评级机构未因公司在中国境内发行其他债券、债务融资工具对公司进行主体评级,因此不存在有差异的情况。

公司主体长期信用等级为AAA,表示公司偿还债务的能力极强,基本不受不利经济环境的影响,违约风险极低。公司债券信用等级AAA的含义同公司主体长期信用等级。

## 五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

√适用□不适用

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均未发生变更,未对债券持有人利益产生影响。

### (一) 增信机制的相关情况

报告期内,公司未到期公司债券均无担保、抵押等增信机制。

### (二) 偿债计划及其他相关情况

公司按时履行各期公司债券年度付息及到期还本付息义务,偿债账户运转规范,与募集说明书的相关承诺保持一致。公司偿债能力良好,偿债资金主要来源于公司日常经营所产生的利润及经营性现金流。2017年、2018年、2019年和2020年上半年,公司合并财务报表营业收入分别为人民币36.33亿元、人民币33.14亿元、人民币39.73亿元和人民币25.26亿元,归属于母公司股东的净利润分别为人民币13.09亿元、人民币10.08亿元、人民币12.21亿元和人民币7.86亿元。良好的盈利能力为公司债券的偿付提供了有力保障。

公司一向保持稳健的财务政策,资产流动性良好,必要时可以通过高流动性资产变现来补充偿债资金。截至2020年6月30日,公司自有资金、买入返售金融资产与交易性金融资产合计达311.63亿元。在公司债券本金或利息兑付时,如果公司出现资金周转困难,可以通过变卖金融资产予以保障。

此外,公司经营稳健,信用记录良好,各项风险监管指标均满足相关要求,外部融资渠道畅通。截至报告期末,公司获得外部授信规模人民币949.70亿元,一旦债券兑付时遇到突发性的资金周转问题,公司将通过各种可行的融资方式予以解决。

同时,本公司主要通过专设的偿付工作小组、专设的偿债专户、加强资产负债管理、提高盈利能力、积极争取股东的支持、制定《债券持有人会议规则》、充分发挥债券受托管理人作用、严格履行信息披露义务等偿债保障措施保障各期债券的按时兑付。报告期,上述偿债保障措施运行良好、有效。

以上偿债计划和其他偿债保障措施的执行情况均与募集说明书的相关承诺保持一致。

### (三) 专项偿债账户情况

目前公司所有存续公司债券和次级债券均设立了专项偿债账户并签订监管协议,用于偿债资金的管理,本息兑付均通过偿债账户按时划付,与募集说明书的相关承诺一致。

## 六、公司债券持有人会议召开情况

适用 不适用

## 七、公司债券受托管理人履职情况

适用 不适用

为充分保障债券持有人的利益,明确公司债存续期间公司、债券持有人和债权代理人之间的权利义务关系,公司分别聘请华融证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、首创证券股份有限公司和兴业证券股份有限公司担任公司存续公司债券和次级债券的受托管理人。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。报告期内,各受托管理人严格按照《债券受托管理协议》约定履行受托管理人职责,为保护债券投资者的利益发挥了积极作用。

| 债券受托管理人    | 受托管理报告出具时间 | 受托管理报告名称                                                                                   | 披露时点       | 披露地址    |
|------------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---------|
| 国金证券股份有限公司 | 2020-01-02 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第一次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-01-02 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-01-08 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第二次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-01-08 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-01-10 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第三次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-01-10 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-01-22 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第四次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-01-22 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-02-18 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第五次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-02-18 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-04-16 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第六次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-04-16 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-05-07 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第七次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-05-07 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-05-13 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第八次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-05-13 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-05-20 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第九次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-05-20 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-06-30 | 东兴证券股份有限公司非公开发行2017年公司债券(第二期)2019年定期受托管理事务报告、东兴证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017年公司债券2019年定期受托管理事务报告 | 2020-06-30 | 上海证券交易所 |
|            | 2020-07-08 | 东兴证券股份有限公司公司债券2020年第十次临时受托管理事务报告                                                           | 2020-07-08 | 上海证券交易所 |



|             |            |                                                                    |                                                                                          |            |
|-------------|------------|--------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
|             | 2020-08-07 | 东兴证券股份有限公司公司债券 2020 年第十一次临时受托管理事务报告                                | 2020-08-07                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-08-17 | 东兴证券股份有限公司公司债券 2020 年第十二次临时受托管理事务报告                                | 2020-08-17                                                                               | 上海证券交易所    |
| 新时代证券股份有限公司 | 2020-01-06 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告、东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券（第一期）受托管理事务临时报告 | 2020-01-06                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-01-07 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告、东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券（第一期）受托管理事务临时报告 | 2020-01-07                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-01-15 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告、东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券（第一期）受托管理事务临时报告 | 2020-01-15                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-02-03 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告、东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券（第一期）受托管理事务临时报告 | 2020-02-03                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-02-18 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告、东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券（第一期）受托管理事务临时报告 | 2020-02-18                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-04-16 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-04-16                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-05-08 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-05-08                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-05-11 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-05-11                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-05-20 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-05-20                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-06-30 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务报告（2019 年度）                                | 2020-06-30                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-07-07 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-07-07                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-08-12 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-08-12                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 2020-08-25 | 2016 年东兴证券股份有限公司债券受托管理事务临时报告                                       | 2020-08-25                                                                               | 上海证券交易所    |
|             | 华融证券股份有限公司 | 2020-01-14                                                         | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司（代资产管理计划）涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告、华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告 | 2020-01-14 |
| 2020-04-17  |            | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司子公司涉及诉讼进展的受托管理事务临时报告                         | 2020-04-17                                                                               | 上海证券交易所    |
| 2020-05-13  |            | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼的受托管理事务临时报告                              | 2020-05-13                                                                               | 上海证券交易所    |
| 2020-05-20  |            | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司（代资产管理计划）涉及诉讼的受托管理事务临时报告                     | 2020-05-20                                                                               | 上海证券交易所    |
| 2020-05-22  |            | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司（代债券持有人）涉及诉讼（仲裁）的受托管理事                       | 2020-05-22                                                                               | 上海证券交易所    |

|            |            |                                                  |                                          |            |
|------------|------------|--------------------------------------------------|------------------------------------------|------------|
|            |            | 务临时报告                                            |                                          |            |
|            | 2020-06-30 | 东兴证券股份有限公司公司债券受托管理事务报告（2019 年度）                  | 2020-06-30                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-07-09 | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司（代资产管理计划）涉及诉讼的受托管理事务临时报告   | 2020-07-09                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-08-13 | 华融证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼的临时受托管理事务报告            | 2020-08-13                               | 上海证券交易所    |
| 首创证券股份有限公司 | 2020-01-06 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司（代资产管理计划）涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告 | 2020-01-06                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-01-09 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-01-09                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-01-10 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司（代资产管理计划）涉及诉讼的临时受托管理事务报告   | 2020-01-10                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-01-22 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-01-22                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-02-19 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-02-19                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-04-16 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-04-16                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-05-08 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-05-08                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-05-13 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-05-13                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-05-22 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-05-22                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-06-30 | 东兴证券股份有限公司公司债券受托管理事务报告（2019 年度）                  | 2020-06-30                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-07-08 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-07-08                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-08-10 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼的临时受托管理事务报告            | 2020-08-10                               | 上海证券交易所    |
|            | 2020-08-19 | 首创证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司涉及诉讼进展的临时受托管理事务报告          | 2020-08-19                               | 上海证券交易所    |
|            | 兴业证券股份有限公司 | 2020-07-09                                       | 兴业证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司公司债券重大事项临时受托管理事务报告 | 2020-07-09 |
| 2020-08-12 |            | 兴业证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司公司债券重大事项临时受托管理事务报告         | 2020-08-12                               | 上海证券交易所    |
| 2020-08-19 |            | 兴业证券股份有限公司关于东兴证券股份有限公司公司债券重大事项临时受托管理事务报告         | 2020-08-19                               | 上海证券交易所    |

注：以上受托管理人在履行职责时与公司均不存在利益冲突的情形。

#### 八、截至报告期末和上年末（或本报告期和上年同期）下列会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 主要指标 | 本报告期末 | 上年度末 | 本报告期末比 | 变动原因 |
|------|-------|------|--------|------|
|------|-------|------|--------|------|



|               |                 |        | 上年度末增减<br>(%)          |      |
|---------------|-----------------|--------|------------------------|------|
| 流动比率          | 1.85            | 2.19   | -15.53                 | -    |
| 速动比率          | 1.85            | 2.19   | -15.53                 | -    |
| 资产负债率 (%)     | 70.59           | 69.59  | 1.44                   | -    |
| 贷款偿还率 (%)     | 不适用             | 不适用    | 不适用                    | -    |
| 主要指标          | 本报告期<br>(1-6 月) | 上年同期   | 本报告期比上<br>年同期增减<br>(%) | 变动原因 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.19            | 2.02   | 8.42                   | -    |
| 利息偿付率 (%)     | 100.00          | 100.00 | 不适用                    | -    |

### 九、关于逾期债项的说明

适用 不适用

### 十、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

适用 不适用

报告期内，公司其他债券和债务融资工具主要包括非公开发行公司债券、次级债券、短期融资券、收益凭证、融出资金债权资产支持专项计划及境外债券等，各项债券和债务融资工具均按时足额付息兑付，未发生逾期违约情况。主要情况如下：

#### （一）利息支付

公司债券存续期内每年支付一次利息，最后一期利息随本金的兑付一起支付。如付息日为法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计利息。债券利息的支付将通过登记机构和有关机构办理。利息支付的具体事项将按照国家有关规定，由公司在交易所网站专区或交易所认可的其他方式发布的兑付公告中加以说明。

“18 东兴 F1”于 2020 年 4 月 13 日（因 2020 年 4 月 12 日为休息日，故顺延至其后第一个工作日）足额支付 2019 年 4 月 12 日至 2020 年 4 月 11 日的利息。

“18 东兴 F3”于 2020 年 4 月 27 日（因 2020 年 4 月 26 日为休息日，故顺延至其后第一个工作日）足额支付 2019 年 4 月 26 日至 2020 年 4 月 25 日的利息。

“19 东兴 F2”于 2020 年 7 月 13 日（因 2020 年 7 月 12 日为休息日，故顺延至其后第一个工作日）足额支付 2019 年 7 月 12 日至 2020 年 7 月 11 日的利息。

“18 东兴 F4”于 2020 年 8 月 6 日足额支付 2019 年 8 月 6 日至 2020 年 8 月 5 日的利息。

报告期内，“17 东兴 F2”、“20 东兴 F1”未到募集说明书约定的付息日，未发生付息。

“19 东兴 C1”于 2020 年 4 月 22 日足额支付 2019 年 4 月 22 日至 2020 年 4 月 21 日的利息。

报告期内，“20 东兴 C1”未到募集说明书约定的付息日，未发生付息兑付。

#### （二）本金兑付

债券到期一次还本。如本金兑付日为法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计利息。债券本金的兑付将通过登记机构和有关机构办理。本金兑付的具体事项将按照国家有关规定，由公司在交易所网站专区或交易所认可的其他方式发布的兑付公告中加以说明。

东兴证券股份有限公司 2017 年度次级债券(第一期)(债券简称 17 东兴 01、债券代码 145410) 于 2020 年 3 月 20 日到期摘牌并兑付本息。

东兴证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第一期)(债券简称 19 东兴 F1、债券代码 151297) 于 2020 年 3 月 20 日到期摘牌并兑付本息。

此外,报告期内公司全资子公司东兴香港旗下境外全资特殊目的公司东兴启航有限公司发行的美元债券已按时、足额支付利息。

报告期内,对于尚在存续期内的短期融资券、收益凭证、融出资金债权资产支持专项计划、证金公司转融资、同业拆借、信用借款等其他债券和债务融资工具,公司均已按时足额付息兑付,未发生逾期违约情况。

#### 十一、公司报告期内的银行授信情况

适用  不适用

公司规范经营,具备较强的盈利能力和偿付能力,并拥有良好的信用记录,与多家银行及其它金融机构保持良好的合作关系并取得其授信。截止报告期末,公司共获得银行授信规模人民币 949.70 亿元,已使用银行授信规模人民币 180.12 亿元,公司可以在授信总额度内开展融资,以支持业务的发展。

母公司未发生银行贷款,不存在偿还银行贷款情况。

公司全资子公司东兴香港于 2017 年 12 月 18 日在香港申请了一笔银团贷款,期限 364 天,贷款额度不超过 4.00 亿美元或等值港元,由瑞士信贷股份有限公司牵头提供贷款。2018 年 12 月 18 日,此笔贷款续期 2 年,到期日为 2020 年 12 月 18 日。截至报告期末,此笔银团贷款已提款金额 2.80 亿美元和 5.43 亿港元,用于东兴香港日常经营。报告期内,该笔银团贷款按时足额付息兑付,无其他展期和减免情况。

#### 十二、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

适用  不适用

报告期内,公司严格执行公司债券募集说明书相关约定和承诺,募集资金使用情况与募集说明书的约定一致;公司严格履行信息披露义务,按时支付债券利息,保障投资者的合法权益。报告期内,公司已发行债券兑付兑息不存在违约情况;公司经营稳定,偿付能力良好,未发现可能导致未来出现不能按期偿付及影响债券投资者利益的情况。

#### 十三、公司发生重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用  不适用

报告期内,公司在上交所网站债券专区于 2020 年 1 月 3 日披露《东兴证券股份有限公司关于公司涉及诉讼进展的公告》,于 2020 年 1 月 9 日披露《东兴证券股份有限公司关于公司(代资产管理

计划) 涉及诉讼的公告》，于2020年1月20日披露《东兴证券股份有限公司关于公司涉及诉讼的进展公告》，于2020年2月13日披露《东兴证券股份有限公司关于公司（代债券持有人）涉及诉讼的进展公告》，于2020年4月13日披露《东兴证券股份有限公司关于子公司涉及诉讼的进展公告》，于2020年4月30日披露《东兴证券股份有限公司涉及诉讼的公告》，于2020年5月8日披露《东兴证券股份有限公司关于公司（代债券持有人）涉及诉讼（仲裁）的进展公告》、于2020年5月18日披露《东兴证券股份有限公司关于公司（代资产管理计划）涉及诉讼的公告》，于2020年7月3日披露《东兴证券股份有限公司关于公司（代资产管理计划）涉及诉讼的公告》，于2020年8月6日披露《东兴证券股份有限公司涉及诉讼的公告》，于2020年8月14日披露《东兴证券股份有限公司涉及诉讼的进展公告》，公告公司涉及仲裁、诉讼及进展的事宜，公告事项对公司业务经营、财务状况及偿债能力无重大影响。

其他事项可参见本报告“第五节 重要事项”中的“六、重大诉讼、仲裁事项”、“七、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况”和“十五、其他重大事项的说明”，以上事项对公司业务经营、财务状况及偿债能力的影响，详见已披露临时公告。

除此之外，报告期内未发生《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，对公司经营情况和偿债能力无影响。

## 第十节 财务报告

### 一、审计报告

适用  不适用

### 二、财务报表

#### 合并资产负债表

2020年6月30日

编制单位：东兴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 附注   | 2020年6月30日               | 2019年12月31日              |
|--------------|------|--------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>   |      |                          |                          |
| 货币资金         | 七、1  | 13,801,061,506.21        | 10,512,431,794.22        |
| 其中：客户资金存款    | 七、1  | 10,363,221,059.46        | 7,818,844,520.63         |
| 结算备付金        | 七、2  | 4,107,114,666.38         | 3,009,792,422.15         |
| 其中：客户备付金     | 七、2  | 3,041,483,306.57         | 2,549,492,963.51         |
| 融出资金         | 七、5  | 14,515,304,315.35        | 12,772,101,251.75        |
| 衍生金融资产       | 七、6  | -                        | 7,750,862.27             |
| 存出保证金        | 七、7  | 1,592,278,379.21         | 850,420,028.46           |
| 应收款项         | 七、8  | 200,634,098.85           | 415,554,170.15           |
| 买入返售金融资产     | 七、11 | 6,185,335,112.92         | 5,183,376,398.01         |
| <b>金融投资：</b> |      | <b>42,352,083,745.89</b> | <b>42,890,727,987.72</b> |

|                                  |      |                          |                          |
|----------------------------------|------|--------------------------|--------------------------|
| 交易性金融资产                          | 七、13 | 20,474,641,859.87        | 17,570,733,770.26        |
| 债权投资                             | 七、14 | 569,460,375.60           | 650,088,971.10           |
| 其他债权投资                           | 七、15 | 18,899,354,666.47        | 22,188,319,748.14        |
| 其他权益工具投资                         | 七、16 | 2,408,626,843.95         | 2,481,585,498.22         |
| 长期股权投资                           | 七、17 | 239,279,295.43           | 221,279,295.43           |
| 投资性房地产                           | 七、18 | 27,526,732.51            | 28,805,922.43            |
| 固定资产                             | 七、19 | 152,820,494.54           | 164,960,276.18           |
| 无形资产                             | 七、22 | 23,671,779.09            | 32,118,127.20            |
| 商誉                               | 七、23 | 20,000,000.00            | 20,000,000.00            |
| 递延所得税资产                          | 七、24 | 478,716,492.22           | 504,345,255.27           |
| 其他资产                             | 七、25 | 840,096,944.00           | 929,900,536.48           |
| <b>资产总计</b>                      |      | <b>84,535,923,562.60</b> | <b>77,543,564,327.72</b> |
| <b>负债：</b>                       |      |                          |                          |
| 短期借款                             | 七、29 | 2,573,063,147.23         | 1,661,802,273.49         |
| 应付短期融资款                          | 七、30 | 9,883,555,638.27         | 6,593,445,526.71         |
| 拆入资金                             | 七、31 | 50,933,992.37            | 51,218,083.59            |
| 交易性金融负债                          | 七、32 | 26,222,233.11            | 40,945,748.36            |
| 衍生金融负债                           | 七、6  | 106,924,431.88           | 119,663,464.75           |
| 卖出回购金融资产款                        | 七、33 | 9,450,658,526.15         | 8,289,171,886.27         |
| 代理买卖证券款                          | 七、34 | 14,450,081,233.62        | 10,702,647,027.52        |
| 应付职工薪酬                           | 七、36 | 1,038,297,936.65         | 1,038,133,702.09         |
| 应交税费                             | 七、37 | 186,680,209.15           | 49,129,655.08            |
| 应付款项                             | 七、38 | 1,757,033,697.18         | 233,131,373.19           |
| 合同负债                             | 七、39 | 11,538,771.73            | 不适用                      |
| 应付债券                             | 七、43 | 22,639,511,387.23        | 24,187,565,173.38        |
| 其中：优先股                           |      | -                        | -                        |
| 永续债                              |      | -                        | -                        |
| 递延所得税负债                          | 七、24 | 13,937,666.99            | 4,175,306.78             |
| 其他负债                             | 七、46 | 1,735,296,889.54         | 4,243,620,247.56         |
| <b>负债合计</b>                      |      | <b>63,923,735,761.10</b> | <b>57,214,649,468.77</b> |
| <b>所有者权益（或股东权益）：</b>             |      |                          |                          |
| 实收资本（或股本）                        | 七、47 | 2,757,960,657.00         | 2,757,960,657.00         |
| 资本公积                             | 七、49 | 9,762,075,296.87         | 9,762,075,296.87         |
| 减：库存股                            | 七、50 | -                        | -                        |
| 其他综合收益                           | 七、51 | 140,641,997.57           | 258,346,958.98           |
| 盈余公积                             | 七、52 | 1,460,690,828.95         | 1,460,690,828.95         |
| 一般风险准备                           | 七、53 | 2,384,753,883.21         | 2,384,753,883.21         |
| 未分配利润                            | 七、54 | 4,067,928,348.19         | 3,668,659,961.30         |
| <b>归属于母公司所有者权益（或<br/>股东权益）合计</b> |      | <b>20,574,051,011.79</b> | <b>20,292,487,586.31</b> |
| <b>少数股东权益</b>                    |      | <b>38,136,789.71</b>     | <b>36,427,272.64</b>     |
| <b>所有者权益（或股东权益）<br/>合计</b>       |      | <b>20,612,187,801.50</b> | <b>20,328,914,858.95</b> |
| <b>负债和所有者权益（或股东<br/>权益）总计</b>    |      | <b>84,535,923,562.60</b> | <b>77,543,564,327.72</b> |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**母公司资产负债表**

2020 年 6 月 30 日

编制单位：东兴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

| 项目                   | 附注   | 2020 年 6 月 30 日          | 2019 年 12 月 31 日         |
|----------------------|------|--------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>           |      |                          |                          |
| 货币资金                 |      | 9,693,306,488.96         | 6,808,205,375.00         |
| 其中：客户资金存款            |      | 8,688,746,983.99         | 6,333,260,167.84         |
| 结算备付金                |      | 3,861,186,336.38         | 3,007,196,047.56         |
| 其中：客户备付金             |      | 2,850,009,042.65         | 2,569,150,379.79         |
| 融出资金                 |      | 14,277,562,129.38        | 12,578,581,361.86        |
| 衍生金融资产               |      | -                        | 7,750,862.27             |
| 存出保证金                |      | 259,622,398.91           | 112,862,831.68           |
| 应收款项                 |      | 208,691,886.89           | 276,931,170.72           |
| 买入返售金融资产             |      | 5,836,149,777.43         | 4,333,856,284.82         |
| <b>金融投资：</b>         |      | <b>35,507,458,843.32</b> | <b>34,653,059,931.17</b> |
| 交易性金融资产              |      | 14,360,997,152.88        | 10,357,859,325.77        |
| 债权投资                 |      | -                        | -                        |
| 其他债权投资               |      | 18,899,354,666.47        | 22,033,200,868.55        |
| 其他权益工具投资             |      | 2,247,107,023.97         | 2,261,999,736.85         |
| 长期股权投资               | 十九、1 | 3,407,416,292.82         | 3,107,416,292.82         |
| 投资性房地产               |      | 27,526,732.51            | 28,805,922.43            |
| 固定资产                 |      | 147,214,770.28           | 158,916,845.56           |
| 无形资产                 |      | 21,091,272.43            | 30,102,681.41            |
| 递延所得税资产              |      | 435,932,365.15           | 420,343,183.11           |
| 其他资产                 |      | 590,988,394.52           | 524,325,896.90           |
| <b>资产总计</b>          |      | <b>74,274,147,688.98</b> | <b>66,048,354,687.31</b> |
| <b>负债：</b>           |      |                          |                          |
| 应付短期融资款              |      | 9,883,555,638.27         | 6,593,445,526.71         |
| 拆入资金                 |      | 50,933,992.37            | 51,218,083.59            |
| 交易性金融负债              |      | 26,222,233.11            | 40,945,748.36            |
| 衍生金融负债               |      | 70,698,153.54            | 2,159,868.79             |
| 卖出回购金融资产款            |      | 9,280,654,261.16         | 7,886,298,911.11         |
| 代理买卖证券款              |      | 11,522,823,756.92        | 8,870,102,246.36         |
| 应付职工薪酬               | 十九、2 | 975,596,303.05           | 964,529,716.93           |
| 应交税费                 |      | 161,799,568.53           | 38,284,635.72            |
| 应付款项                 |      | 1,741,319,206.88         | 186,748,454.66           |
| 合同负债                 |      | 2,131,361.73             | 不适用                      |
| 应付债券                 |      | 19,805,302,916.65        | 21,395,113,394.25        |
| 其中：优先股               |      | -                        | -                        |
| 永续债                  |      | -                        | -                        |
| 其他负债                 |      | 402,125,452.40           | 13,990,821.40            |
| <b>负债合计</b>          |      | <b>53,923,162,844.61</b> | <b>46,042,837,407.88</b> |
| <b>所有者权益（或股东权益）：</b> |      |                          |                          |
| 实收资本（或股本）            |      | 2,757,960,657.00         | 2,757,960,657.00         |
| 资本公积                 |      | 9,761,280,999.29         | 9,761,280,999.29         |
| 减：库存股                |      | -                        | -                        |
| 其他综合收益               |      | 123,526,630.36           | 217,259,202.24           |
| 盈余公积                 |      | 1,460,690,828.95         | 1,460,690,828.95         |

|                          |  |                          |                          |
|--------------------------|--|--------------------------|--------------------------|
| 一般风险准备                   |  | 2,312,343,217.55         | 2,312,343,217.55         |
| 未分配利润                    |  | 3,935,182,511.22         | 3,495,982,374.40         |
| <b>所有者权益(或股东权益)合计</b>    |  | <b>20,350,984,844.37</b> | <b>20,005,517,279.43</b> |
| <b>负债和所有者权益(或股东权益)总计</b> |  | <b>74,274,147,688.98</b> | <b>66,048,354,687.31</b> |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**合并利润表**

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                               | 附注   | 2020 年半年度               | 2019 年半年度               |
|----------------------------------|------|-------------------------|-------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                   |      | <b>2,525,534,532.10</b> | <b>1,887,329,793.75</b> |
| 利息净收入                            | 七、55 | 464,460,594.82          | 289,288,591.37          |
| 其中：利息收入                          |      | 1,394,990,707.59        | 1,365,493,806.37        |
| 利息支出                             |      | 930,530,112.77          | 1,076,205,215.00        |
| 手续费及佣金净收入                        | 七、56 | 940,317,368.79          | 1,046,028,547.71        |
| 其中：经纪业务手续费净收入                    |      | 452,416,246.09          | 395,867,981.05          |
| 投资银行业务手续费净收入                     |      | 329,137,230.13          | 451,141,607.23          |
| 资产管理业务手续费净收入                     |      | 150,151,927.19          | 184,217,796.90          |
| 投资收益（损失以“-”号填列）                  | 七、57 | 637,858,171.07          | 80,461,004.22           |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益               |      | -                       | 40,857,186.90           |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列） |      | -                       | 7,014,767.45            |
| 净敞口套期收益（损失以“-”号填列）               |      | -                       | -                       |
| 其他收益                             |      | 2,290,887.32            | 1,334,549.71            |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）              | 七、60 | 136,020,638.56          | 473,855,225.40          |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列）                  |      | 4,532,503.97            | -7,542,431.20           |
| 其他业务收入                           | 七、61 | 339,905,801.14          | 3,895,992.66            |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列）                |      | 148,566.43              | 8,313.88                |
| <b>二、营业总支出</b>                   |      | <b>1,483,799,552.91</b> | <b>920,542,149.77</b>   |
| 税金及附加                            | 七、63 | 15,523,175.40           | 15,619,670.59           |
| 业务及管理费                           | 七、64 | 1,081,584,808.89        | 992,131,811.67          |
| 信用减值损失                           | 七、65 | 40,978,142.51           | -89,413,901.36          |
| 其他业务成本                           | 七、67 | 345,713,426.11          | 2,204,568.87            |
| <b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>         |      | <b>1,041,734,979.19</b> | <b>966,787,643.98</b>   |
| 加：营业外收入                          | 七、68 | 1,663,309.53            | 71,010,006.84           |
| 减：营业外支出                          | 七、69 | 8,459,959.30            | 597,929.62              |
| <b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>       |      | <b>1,034,938,329.42</b> | <b>1,037,199,721.20</b> |
| 减：所得税费用                          | 七、70 | 248,701,050.80          | 172,972,120.67          |
| <b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>         |      | <b>786,237,278.62</b>   | <b>864,227,600.53</b>   |
| （一）按经营持续性分类                      |      |                         |                         |
| 1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）            |      | 786,237,278.62          | 864,227,600.53          |
| 2.终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）            |      | -                       | -                       |
| （二）按所有权归属分类                      |      |                         |                         |
| 1.归属于母公司股东的净利润（净亏损               |      | 786,072,139.81          | 863,774,970.74          |



|                      |      |                        |                         |
|----------------------|------|------------------------|-------------------------|
| 以“-”号填列)             |      |                        |                         |
| 2.少数股东损益(净亏损以“-”号填列) |      | 165,138.81             | 452,629.79              |
| <b>六、其他综合收益的税后净额</b> | 七、71 | <b>-116,849,844.09</b> | <b>229,731,842.01</b>   |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额 |      | -118,394,222.35        | 230,178,208.85          |
| (一)不能重分类进损益的其他综合收益   |      | -61,028,838.80         | 121,037,736.81          |
| 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   |      | -                      | 98,121,701.57           |
| 3.其他权益工具投资公允价值变动     |      | -61,028,838.80         | 22,916,035.24           |
| 4.企业自身信用风险公允价值变动     |      | -                      | -                       |
| (二)将重分类进损益的其他综合收益    |      | -57,365,383.55         | 109,140,472.04          |
| 1.权益法下可转损益的其他综合收益    |      | -                      | -                       |
| 2.其他债权投资公允价值变动       |      | -75,741,397.56         | 93,186,309.32           |
| 3.金融资产重分类计入其他综合收益的金额 |      | -                      | -                       |
| 4.其他债权投资信用损失准备       |      | -7,465,332.67          | 21,749,236.58           |
| 5.现金流量套期储备           |      | -                      | -                       |
| 6.外币财务报表折算差额         |      | 25,841,346.68          | -5,795,073.86           |
| 7.其他                 |      | -                      | -                       |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额  |      | 1,544,378.26           | -446,366.84             |
| <b>七、综合收益总额</b>      |      | <b>669,387,434.53</b>  | <b>1,093,959,442.54</b> |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额     |      | 667,677,917.46         | 1,093,953,179.59        |
| 归属于少数股东的综合收益总额       |      | 1,709,517.07           | 6,262.95                |
| <b>八、每股收益：</b>       |      |                        |                         |
| (一)基本每股收益(元/股)       |      | 0.285                  | 0.313                   |
| (二)稀释每股收益(元/股)       |      | 不适用                    | 不适用                     |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**母公司利润表**

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                               | 附注   | 2020 年半年度               | 2019 年半年度               |
|----------------------------------|------|-------------------------|-------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                   |      | <b>1,986,885,972.17</b> | <b>1,710,057,940.27</b> |
| 利息净收入                            | 十九、3 | 523,140,759.34          | 410,366,335.96          |
| 其中：利息收入                          |      | 1,271,963,072.87        | 1,238,823,584.07        |
| 利息支出                             |      | 748,822,313.53          | 828,457,248.11          |
| 手续费及佣金净收入                        | 十九、4 | 914,918,815.92          | 1,004,473,861.50        |
| 其中：经纪业务手续费净收入                    |      | 434,761,267.14          | 378,742,841.42          |
| 投资银行业务手续费净收入                     |      | 307,634,068.10          | 435,409,369.39          |
| 资产管理业务手续费净收入                     |      | 163,911,515.30          | 175,520,488.16          |
| 投资收益(损失以“-”号填列)                  | 十九、5 | 469,323,822.29          | -266,987,044.69         |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益               |      | -                       | -                       |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益(损失以“-”号填列) |      | -                       | 7,014,767.45            |
| 净敞口套期收益(损失以“-”号填列)               |      | -                       | -                       |

|                            |      |                         |                         |
|----------------------------|------|-------------------------|-------------------------|
| 其他收益                       |      | 1,743,555.42            | 1,194,549.71            |
| 公允价值变动收益（损失以“－”号填列）        | 十九、6 | 76,942,744.71           | 559,843,560.39          |
| 汇兑收益（损失以“－”号填列）            |      | 134,653.39              | 73,043.47               |
| 其他业务收入                     |      | 533,054.67              | 1,092,720.19            |
| 资产处置收益（损失以“－”号填列）          |      | 148,566.43              | 913.74                  |
| <b>二、营业总支出</b>             |      | <b>979,440,646.89</b>   | <b>801,079,022.30</b>   |
| 税金及附加                      |      | 15,229,895.56           | 15,452,600.93           |
| 业务及管理费                     | 十九、7 | 960,397,774.02          | 869,889,117.06          |
| 信用减值损失                     |      | 2,533,787.39            | -85,541,885.61          |
| 其他业务成本                     |      | 1,279,189.92            | 1,279,189.92            |
| <b>三、营业利润（亏损以“－”号填列）</b>   |      | <b>1,007,445,325.28</b> | <b>908,978,917.97</b>   |
| 加：营业外收入                    |      | 1,507,087.76            | 70,125,414.33           |
| 减：营业外支出                    |      | 8,204,966.35            | 592,813.99              |
| <b>四、利润总额（亏损总额以“－”号填列）</b> |      | <b>1,000,747,446.69</b> | <b>978,511,518.31</b>   |
| 减：所得税费用                    |      | 175,593,222.95          | 140,146,805.23          |
| <b>五、净利润（净亏损以“－”号填列）</b>   |      | <b>825,154,223.74</b>   | <b>838,364,713.08</b>   |
| （一）持续经营净利润（净亏损以“－”号填列）     |      | 825,154,223.74          | 838,364,713.08          |
| （二）终止经营净利润（净亏损以“－”号填列）     |      | -                       | -                       |
| <b>六、其他综合收益的税后净额</b>       |      | <b>-93,572,166.82</b>   | <b>289,049,316.53</b>   |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益         |      | -9,500,034.67           | 174,113,770.63          |
| 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         |      | -                       | 98,121,701.57           |
| 3.其他权益工具投资公允价值变动           |      | -9,500,034.67           | 75,992,069.06           |
| 4.企业自身信用风险公允价值变动           |      | -                       | -                       |
| （二）将重分类进损益的其他综合收益          |      | -84,072,132.15          | 114,935,545.90          |
| 1.权益法下可转损益的其他综合收益          |      | -                       | -                       |
| 2.其他债权投资公允价值变动             |      | -78,656,034.48          | 93,186,309.32           |
| 3.金融资产重分类计入其他综合收益的金额       |      | -                       | -                       |
| 4.其他债权投资信用损失准备             |      | -5,416,097.67           | 21,749,236.58           |
| 5.现金流量套期储备                 |      | -                       | -                       |
| 6.外币财务报表折算差额               |      | -                       | -                       |
| 7.其他                       |      | -                       | -                       |
| <b>七、综合收益总额</b>            |      | <b>731,582,056.92</b>   | <b>1,127,414,029.61</b> |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**合并现金流量表**

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 附注 | 2020年半年度 | 2019年半年度         |
|-----------------------|----|----------|------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b> |    |          |                  |
| 购置或处置交易性金融资产现金净增加额    |    | -        | 1,121,827,679.50 |

|                             |         |                   |                   |
|-----------------------------|---------|-------------------|-------------------|
| 收取利息、手续费及佣金的现金              |         | 2,856,954,359.22  | 2,683,844,822.88  |
| 回购业务资金净增加额                  |         | 80,786,807.97     | 7,891,182,366.98  |
| 代理买卖证券收到的现金净额               |         | 3,747,256,343.79  | 4,595,751,008.68  |
| 收到其他与经营活动有关的现金              | 七、72(1) | 725,888,943.18    | 640,635,677.52    |
| 经营活动现金流入小计                  |         | 7,410,886,454.16  | 16,933,241,555.56 |
| 购置或处置交易性金融资产现金净减少额          |         | 1,127,298,969.26  | -                 |
| 拆入资金净减少额                    |         | -                 | 1,998,097,321.68  |
| 融出资金净增加额                    |         | 1,763,281,896.25  | 3,115,641,251.40  |
| 支付利息、手续费及佣金的现金              |         | 476,218,114.46    | 523,694,334.75    |
| 支付给职工及为职工支付的现金              |         | 811,062,392.67    | 510,032,810.35    |
| 支付的各项税费                     |         | 258,390,432.27    | 348,179,975.88    |
| 支付其他与经营活动有关的现金              | 七、72(2) | 4,169,106,556.62  | 681,937,785.48    |
| 经营活动现金流出小计                  |         | 8,605,358,361.53  | 7,177,583,479.54  |
| 经营活动产生的现金流量净额               |         | -1,194,471,907.37 | 9,755,658,076.02  |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>       |         |                   |                   |
| 收回投资收到的现金                   |         | -                 | 833,543,642.02    |
| 取得投资收益收到的现金                 |         | 257,092,487.35    | 172,775,673.78    |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额   |         | 89,759.40         | 5,935.00          |
| 债权投资现金净增加额                  |         | -                 | 474,817,632.35    |
| 购置或处置其他债权投资和其他权益工具投资的现金净增加额 |         | 3,307,710,838.35  | -                 |
| 投资活动现金流入小计                  |         | 3,564,893,085.10  | 1,481,142,883.15  |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金     |         | 10,366,073.49     | 11,830,333.25     |
| 购置或处置其他债权投资的现金净减少额          |         | -                 | 5,576,809,435.81  |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额         |         | 18,000,000.00     | -                 |
| 支付的其他与投资活动有关的现金             | 七、72(4) | 1,001,190,000.00  | -                 |
| 投资活动现金流出小计                  |         | 1,029,556,073.49  | 5,588,639,769.06  |
| 投资活动产生的现金流量净额               |         | 2,535,337,011.61  | -4,107,496,885.91 |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>       |         |                   |                   |
| 取得借款收到的现金                   |         | 1,209,123,239.72  | 339,583,535.62    |
| 发行债券收到的现金                   |         | 22,605,367,000.00 | 8,249,078,493.61  |
| 筹资活动现金流入小计                  |         | 23,814,490,239.72 | 8,588,662,029.23  |
| 偿还债务支付的现金                   |         | 20,972,106,166.28 | 8,154,168,742.47  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金           |         | 839,584,422.95    | 973,552,637.47    |
| 筹资活动现金流出小计                  |         | 21,811,690,589.23 | 9,127,721,379.94  |
| 筹资活动产生的现金流量净额               |         | 2,002,799,650.49  | -539,059,350.71   |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>   |         | 35,480,938.74     | 3,602,964.72      |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>       |         | 3,379,145,693.47  | 5,112,704,804.12  |
| 加：期初现金及现金等价物余额              | 七、73(4) | 13,148,321,940.60 | 11,210,985,243.54 |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>       | 七、73(4) | 16,527,467,634.07 | 16,323,690,047.66 |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**母公司现金流量表**

2020 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                          | 附注 | 2020年半年度          | 2019年半年度          |
|-----------------------------|----|-------------------|-------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b>       |    |                   |                   |
| 收取利息、手续费及佣金的现金              |    | 2,532,134,049.87  | 2,506,449,982.48  |
| 回购业务资金净增加额                  |    | -                 | 8,897,721,047.66  |
| 代理买卖证券收到的现金净额               |    | 2,652,543,648.25  | 3,897,384,788.70  |
| 收到其他与经营活动有关的现金              |    | 319,029,426.40    | 364,429,797.18    |
| 经营活动现金流入小计                  |    | 5,503,707,124.52  | 15,665,985,616.02 |
| 购置或处置交易性金融资产现金净减少额          |    | 2,282,480,509.14  | 744,943,333.16    |
| 回购业务资金净减少额                  |    | 145,555,085.38    | -                 |
| 拆入资金净减少额                    |    | -                 | 1,998,097,321.68  |
| 融出资金净增加额                    |    | 1,718,082,139.81  | 3,163,422,754.50  |
| 支付利息、手续费及佣金的现金              |    | 318,467,807.37    | 396,479,986.80    |
| 支付给职工及为职工支付的现金              |    | 728,480,953.35    | 443,408,156.76    |
| 支付的各项税费                     |    | 239,344,587.87    | 310,402,761.90    |
| 支付其他与经营活动有关的现金              |    | 362,125,651.62    | 463,076,229.16    |
| 经营活动现金流出小计                  |    | 5,794,536,734.54  | 7,519,830,543.96  |
| 经营活动产生的现金流量净额               |    | -290,829,610.02   | 8,146,155,072.06  |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>       |    |                   |                   |
| 收回投资收到的现金                   |    | -                 | 833,543,642.02    |
| 取得投资收益收到的现金                 |    | 139,456,389.55    | 99,856,519.28     |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额   |    | 89,759.40         | 5,935.00          |
| 购置或处置其他债权投资和其他权益工具投资的现金净增加额 |    | 3,059,221,533.48  | -                 |
| 投资活动现金流入小计                  |    | 3,198,767,682.43  | 933,406,096.30    |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金     |    | 7,466,842.85      | 11,472,463.01     |
| 购置或处置其他债权投资的现金净减少额          |    | -                 | 5,567,678,719.88  |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额         |    | 300,000,000.00    | -                 |
| 投资活动现金流出小计                  |    | 307,466,842.85    | 5,579,151,182.89  |
| 投资活动产生的现金流量净额               |    | 2,891,300,839.58  | -4,645,745,086.59 |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>       |    |                   |                   |
| 发行债券收到的现金                   |    | 22,605,367,000.00 | 8,249,078,493.61  |
| 筹资活动现金流入小计                  |    | 22,605,367,000.00 | 8,249,078,493.61  |
| 偿还债务支付的现金                   |    | 20,666,535,000.00 | 7,287,587,950.09  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金           |    | 803,363,493.03    | 820,701,099.93    |
| 筹资活动现金流出小计                  |    | 21,469,898,493.03 | 8,108,289,050.02  |
| 筹资活动产生的现金流量净额               |    | 1,135,468,506.97  | 140,789,443.59    |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>   |    |                   |                   |
|                             |    | 1,334,442.30      | 211,489.15        |

|                |  |                   |                   |
|----------------|--|-------------------|-------------------|
| 五、现金及现金等价物净增加额 |  | 3,737,274,178.83  | 3,641,410,918.21  |
| 加：期初现金及现金等价物余额 |  | 9,802,757,700.71  | 8,278,120,966.61  |
| 六、期末现金及现金等价物余额 |  | 13,540,031,879.54 | 11,919,531,884.82 |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**合并所有者权益变动表**

2020 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

| 项目                        | 2020 年半年度        |        |    |   |                  |       |                 |                  |                  |                  |               |                   |
|---------------------------|------------------|--------|----|---|------------------|-------|-----------------|------------------|------------------|------------------|---------------|-------------------|
|                           | 归属于母公司所有者权益      |        |    |   |                  |       |                 |                  |                  |                  | 少数股东权益        | 所有者权益合计           |
|                           | 实收资本(或股本)        | 其他权益工具 |    |   | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            |               |                   |
|                           | 优先股              | 永续债    | 其他 |   |                  |       |                 |                  |                  |                  |               |                   |
| 一、上年期末余额                  | 2,757,960,657.00 | -      | -  | - | 9,762,075,296.87 | -     | 258,346,958.98  | 1,460,690,828.95 | 2,384,753,883.21 | 3,668,659,961.30 | 36,427,272.64 | 20,328,914,858.95 |
| 加：会计政策变更                  | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 前期差错更正                    | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 其他                        | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 二、本年期初余额                  | 2,757,960,657.00 | -      | -  | - | 9,762,075,296.87 | -     | 258,346,958.98  | 1,460,690,828.95 | 2,384,753,883.21 | 3,668,659,961.30 | 36,427,272.64 | 20,328,914,858.95 |
| 三、本期增减变动金额<br>(减少以“-”号填列) | -                | -      | -  | - | -                | -     | -117,704,961.41 | -                | -                | 399,268,386.89   | 1,709,517.07  | 283,272,942.55    |
| (一) 综合收益总额                | -                | -      | -  | - | -                | -     | -118,394,222.35 | -                | -                | 786,072,139.81   | 1,709,517.07  | 669,387,434.53    |
| (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                  | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -386,114,491.98  | -             | -386,114,491.98   |
| 1. 提取盈余公积                 | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 2. 提取一般风险准备               | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 3. 对所有者(或股东)的分配           | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -386,114,491.98  | -             | -386,114,491.98   |
| 4. 其他                     | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| (四) 所有者权益内部               | -                | -      | -  | - | -                | -     | 689,260.94      | -                | -                | -689,260.94      | -             | -                 |



|                    |                  |   |   |   |                  |            |                |                  |                  |                  |               |                   |
|--------------------|------------------|---|---|---|------------------|------------|----------------|------------------|------------------|------------------|---------------|-------------------|
| 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    | -                | - | - | - | -                | 689,260.94 | -              | -                | -689,260.94      | -                | -             | -                 |
| 6. 其他              | -                | - | - | - | -                | -          | -              | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 四、本期期末余额           | 2,757,960,657.00 | - | - | - | 9,762,075,296.87 | -          | 140,641,997.57 | 1,460,690,828.95 | 2,384,753,883.21 | 4,067,928,348.19 | 38,136,789.71 | 20,612,187,801.50 |

| 项目                    | 2019 年半年度        |        |    |   |                  |       |                 |                  |                  |                  |               |                   |
|-----------------------|------------------|--------|----|---|------------------|-------|-----------------|------------------|------------------|------------------|---------------|-------------------|
|                       | 归属于母公司所有者权益      |        |    |   |                  |       |                 |                  |                  |                  | 少数股东权益        | 所有者权益合计           |
|                       | 实收资本(或股本)        | 其他权益工具 |    |   | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            |               |                   |
|                       | 优先股              | 永续债    | 其他 |   |                  |       |                 |                  |                  |                  |               |                   |
| 一、上年期末余额              | 2,757,960,657.00 | -      | -  | - | 9,762,075,296.87 | -     | -422,960,831.29 | 1,276,487,261.62 | 2,114,391,871.68 | 4,152,650,449.20 | 36,306,813.76 | 19,676,911,518.84 |
| 加：会计政策变更              | -                | -      | -  | - | -                | -     | 441,134,626.69  | -                | -                | -690,802,687.55  | -265,632.13   | -249,933,692.99   |
| 前期差错更正                | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 其他                    | -                | -      | -  | - | -                | -     | -               | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 二、本年期初余额              | 2,757,960,657.00 | -      | -  | - | 9,762,075,296.87 | -     | 18,173,795.40   | 1,276,487,261.62 | 2,114,391,871.68 | 3,461,847,761.65 | 36,041,181.63 | 19,426,977,825.85 |
| 三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列) | -                | -      | -  | - | -                | -     | 230,178,208.85  | -                | -                | 372,581,433.56   | 6,262.95      | 602,765,905.36    |
| (一) 综合收益总额            | -                | -      | -  | - | -                | -     | 89,314,810.17   | -                | -                | 863,774,970.74   | 6,262.95      | 953,096,043.86    |
| (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           | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -303,375,672.27  | -             | -303,375,672.27   |
| 1. 提取盈余公积          | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 2. 提取一般风险准备        | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -             | -                 |
| 3. 对所有者(或股东)的分配    | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -303,375,672.27  | -             | -303,375,672.27   |
| 4. 其他              | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -             | -                 |
| (四) 所有者权益内部结转      | -                | - | - | - | -                | - | 140,863,398.68 | -                | -                | -187,817,864.91  | -             | -46,954,466.23    |
| 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              | -                | - | - | - | -                | - | 140,863,398.68 | -                | -                | -187,817,864.91  | -             | -46,954,466.23    |
| 四、本期末余额            | 2,757,960,657.00 | - | - | - | 9,762,075,296.87 | - | 248,352,004.25 | 1,276,487,261.62 | 2,114,391,871.68 | 3,834,429,195.21 | 36,047,444.58 | 20,029,743,731.21 |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

**母公司所有者权益变动表**

2020 年 1—6 月

单位：元币种：人民币

| 项目       | 2020 年半年度        |        |     |    |                  |       |                |                  |                  |                  |                   |
|----------|------------------|--------|-----|----|------------------|-------|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
|          | 实收资本(或股本)        | 其他权益工具 |     |    | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益         | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            | 所有者权益合计           |
|          |                  | 优先股    | 永续债 | 其他 |                  |       |                |                  |                  |                  |                   |
| 一、上年期末余额 | 2,757,960,657.00 | -      | -   | -  | 9,761,280,999.29 | -     | 217,259,202.24 | 1,460,690,828.95 | 2,312,343,217.55 | 3,495,982,374.40 | 20,005,517,279.43 |

|                       |                  |   |   |   |                  |   |                |                  |                  |                  |                   |
|-----------------------|------------------|---|---|---|------------------|---|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 加：会计政策变更              | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| 前期差错更正                | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| 其他                    | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| 二、本年期初余额              | 2,757,960,657.00 | - | - | - | 9,761,280,999.29 | - | 217,259,202.24 | 1,460,690,828.95 | 2,312,343,217.55 | 3,495,982,374.40 | 20,005,517,279.43 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列） | -                | - | - | - | -                | - | -93,732,571.88 | -                | -                | 439,200,136.82   | 345,467,564.94    |
| （一）综合收益总额             | -                | - | - | - | -                | - | -93,572,166.82 | -                | -                | 825,154,223.74   | 731,582,056.92    |
| （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               | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -386,114,491.98  | -386,114,491.98   |
| 1. 提取盈余公积             | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| 2. 提取一般风险准备           | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| 3. 对所有者（或股东）的分配       | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -386,114,491.98  | -386,114,491.98   |
| 4. 其他                 | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| （四）所有者权益内部结转          | -                | - | - | - | -                | - | -160,405.06    | -                | -                | 160,405.06       | -                 |
| 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       | -                | - | - | - | -                | - | -160,405.06    | -                | -                | 160,405.06       | -                 |
| 6. 其他                 | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |

|          |                  |   |   |   |                  |   |                |                  |                  |                  |                   |
|----------|------------------|---|---|---|------------------|---|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 四、本期期末余额 | 2,757,960,657.00 | - | - | - | 9,761,280,999.29 | - | 123,526,630.36 | 1,460,690,828.95 | 2,312,343,217.55 | 3,935,182,511.22 | 20,350,984,844.37 |
|----------|------------------|---|---|---|------------------|---|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|

| 项目                    | 2019 年半年度        |        |     |    |                  |           |                 |                  |                  |                  |                   |
|-----------------------|------------------|--------|-----|----|------------------|-----------|-----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
|                       | 实收资本(或股本)        | 其他权益工具 |     |    | 资本公积             | 减：<br>库存股 | 其他综合收益          | 盈余公积             | 一般风险准备           | 未分配利润            | 所有者权益合计           |
|                       |                  | 优先股    | 永续债 | 其他 |                  |           |                 |                  |                  |                  |                   |
| 一、上年期末余额              | 2,757,960,657.00 | -      | -   | -  | 9,761,280,999.29 | -         | -663,286,593.80 | 1,276,487,261.62 | 2,043,010,668.19 | 4,095,927,499.65 | 19,271,380,491.95 |
| 加：会计政策变更              | -                | -      | -   | -  | -                | -         | 676,322,729.26  | -                | -                | -917,664,957.02  | -241,342,227.76   |
| 前期差错更正                | -                | -      | -   | -  | -                | -         | -               | -                | -                | -                | -                 |
| 其他                    | -                | -      | -   | -  | -                | -         | -               | -                | -                | -                | -                 |
| 二、本年期初余额              | 2,757,960,657.00 | -      | -   | -  | 9,761,280,999.29 | -         | 13,036,135.46   | 1,276,487,261.62 | 2,043,010,668.19 | 3,178,262,542.63 | 19,030,038,264.19 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“一”号填列） | -                | -      | -   | -  | -                | -         | 289,049,316.53  | -                | -                | 347,171,175.90   | 636,220,492.43    |
| （一）综合收益总额             | -                | -      | -   | -  | -                | -         | 148,185,917.85  | -                | -                | 838,364,713.08   | 986,550,630.93    |
| （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               | -                | -      | -   | -  | -                | -         | -               | -                | -                | -303,375,672.27  | -303,375,672.27   |
| 1．提取盈余公积              | -                | -      | -   | -  | -                | -         | -               | -                | -                | -                | -                 |
| 2．提取一般风险准备            | -                | -      | -   | -  | -                | -         | -               | -                | -                | -                | -                 |

|                    |                  |   |   |   |                  |   |                |                  |                  |                  |                   |
|--------------------|------------------|---|---|---|------------------|---|----------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 3. 对所有者（或股东）的分配    | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -303,375,672.27  | -303,375,672.27   |
| 4. 其他              | -                | - | - | - | -                | - | -              | -                | -                | -                | -                 |
| （四）所有者权益内部结转       | -                | - | - | - | -                | - | 140,863,398.68 | -                | -                | -187,817,864.91  | -46,954,466.23    |
| 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              | -                | - | - | - | -                | - | 140,863,398.68 | -                | -                | -187,817,864.91  | -46,954,466.23    |
| 四、本期期末余额           | 2,757,960,657.00 | - | - | - | 9,761,280,999.29 |   | 302,085,451.99 | 1,276,487,261.62 | 2,043,010,668.19 | 3,525,433,718.53 | 19,666,258,756.62 |

法定代表人：魏庆华

主管会计工作负责人：张涛

会计机构负责人：郝洁

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

√适用□不适用

东兴证券股份有限公司经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东兴证券股份有限公司开业的批复》(证监机构字[2008]665号)批准于2008年5月28日成立,注册地为北京,注册资本为人民币15.04亿元。2011年10月27日,中国证监会出具证监许可[2011]1727号《关于核准东兴证券股份有限公司变更注册资本的批复》,核准本公司注册资本由人民币15.04亿元增加至人民币20.04亿元。

2015年2月,经中国证监会证监许可[2015]191号文批准,本公司向社会公众首次公开发行500,000,000股人民币普通股(A股),并于2015年2月26日在上海证券交易所挂牌上市。本公司首次公开发行前总股本为2,004,000,000股,发行上市后总股本为2,504,000,000股。股票发行价格为人民币9.18元/股,募集资金总额人民币4,590,000,000.00元。

2016年10月,经中国证监会证监许可[2016]1352号文批准,本公司非公开发行253,960,657股人民币普通股(A股),并于2016年10月17日在上海证券交易所上市交易。本公司非公开发行前总股本为2,504,000,000股,发行后总股本为2,757,960,657股。非公开发行股票价格为人民币18.81元/股,募集资金总额人民币4,776,999,958.17元。

本公司及子公司的主要经营业务范围包括: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,证券投资基金销售,代销金融产品,公开募集证券投资基金管理,保险兼业代理业务;商品期货经纪,金融期货经纪,期货投资咨询,资产管理;对金融产品的投资,项目投资,股权投资;投资管理,投资顾问,受托管理股权投资基金,财务顾问服务;实业投资,企业管理,财务咨询等。

公司在2020年上半年,关闭了1家证券营业部,于2020年6月30日,共设有69家证券营业部和17家分公司。公司在2020年上半年新设基金子公司,本公司下设子公司的情况参见附注三、2。

本公司的母公司为中国东方资产管理股份有限公司(以下简称“中国东方”)。



**2. 合并财务报表范围**

√适用 □不适用

**(1) 子公司情况**

①通过自行设立方式取得的子公司

| 公司名称         | 注册地        | 法人代表    | 注册资本         | 经营范围                                                                                           | 于2020年6月30日实际出资额 | 实质上构成对子公司净投资的其他项目余额 | 直接持股及表决权比例 2020年6月30日 | 间接持股及表决权比例 2020年6月30日 | 直接持股及表决权比例 2019年12月31日 | 间接持股及表决权比例 2019年12月31日 | 是否合并报表 | 少数股东权益 |    |
|--------------|------------|---------|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|--------|--------|----|
|              |            |         |              |                                                                                                |                  |                     |                       |                       |                        |                        |        | 期末     | 年初 |
| 东兴证券投资有限公司   | 福建省平潭综合实验区 | 张涛      | 人民币 20.00 亿元 | 对金融产品的投资、项目投资、股权投资                                                                             | 人民币 11.50 亿元     | -                   | 100.00%               | -                     | 100.00%                | -                      | 是      | -      | -  |
| 东兴资本投资管理有限公司 | 深圳市        | 王小军 (a) | 人民币 5.00 亿元  | 投资管理；投资顾问；股权投资；受托管理股权投资基金；财务顾问服务                                                               | 人民币 3.00 亿元      | -                   | 100.00%               | -                     | 100.00%                | -                      | 是      | -      | -  |
| 上海伴兴实业发展有限公司 | 上海市        | 银国宏     | 人民币 2.50 亿元  | 实业投资，企业管理，贸易经纪与代理，财务咨询，从事货物及技术的进出口业务，货物运输代理，电子商务（不得从事增值电信业务、金融服务），会务服务，销售金属材料、建筑材料、润滑油、矿产品、石油制 | 人民币 2.50 亿元      | -                   | -                     | 100.00%               | -                      | 100.00%                | 是      | -      | -  |

|                  |     |         |                  |                                                                                                                         |                  |   |         |         |         |         |   |   |   |
|------------------|-----|---------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|---|---------|---------|---------|---------|---|---|---|
|                  |     |         |                  | 品、橡胶制品、食用农产品、玻璃制品、五金交电、日用百货、机械设备、饲料、针纺织品、黄金制品、金银饰品、焦炭、纸制品、木材、木制品、汽车配件，煤炭经营，化工产品批发（除危险化学品、监控化学品、烟花爆竹、民用爆炸物品、易制毒化学品），食品销售 |                  |   |         |         |         |         |   |   |   |
| 上海东策盛资产管理有限公司    | 上海市 | 郭蒙      | 人民币 0.02 亿元      | 资产管理，股权投资管理，投资咨询，投资管理                                                                                                   | 人民币 0.02 亿元      | - | -       | 100.00% | -       | 100.00% | 是 | - | - |
| 东兴基金管理有限公司 (b)   | 北京市 | 银国宏     | 人民币 2.00 亿元      | 公开募集证券投资基金管理、基金销售和中国证监会许可的其他业务                                                                                          | 人民币 2.00 亿元      | - | 100.00% | -       | -       | -       | 是 | - | - |
| 东兴证券(香港)金融控股有限公司 | 香港  | 谭世豪 (c) | 港币 149,999.94 万元 | 投资控股                                                                                                                    | 港币 149,999.94 万元 | - | 100.00% | -       | 100.00% | -       | 是 | - | - |
| 东兴证券(香港)财务有限公司   | 香港  | 兰文      | 港币 500.00 万元     | 放债人牌照                                                                                                                   | 港币 500.00 万元     | - | -       | 100.00% | -       | 100.00% | 是 | - | - |
| 东兴信息服务(深圳)有限公    | 深圳市 | 兰文      | 港币 800.00 万元     | 经济信息咨询、实业项目投资咨                                                                                                          | 港币 800.00 万元     | - | -       | 100.00% | -       | 100.00% | 是 | - | - |

| 司                                        |        |    |             | 询（以上均不含限制项目），市场营销策划 |             |   |   |         |   |         |   |   |   |
|------------------------------------------|--------|----|-------------|---------------------|-------------|---|---|---------|---|---------|---|---|---|
| 东兴证券(香港)资产管理有限公司                         | 香港     | 兰文 | 港币 6.10 亿元  | 就证券提供意见、资产管理        | 港币 6.10 亿元  | - | - | 100.00% | - | 100.00% | 是 | - | - |
| 东兴启航有限公司                                 | 英属处女群岛 | 兰文 | 美元 1.00 元   | 发债                  | 美元 1.00 元   | - | - | 100.00% | - | 100.00% | 是 | - | - |
| Robust Strength Limited                  | 英属处女群岛 | 兰文 | 美元 1.00 元   | 发债                  | 美元 1.00 元   | - | - | 100.00% | - | 100.00% | 是 | - | - |
| 勇庭有限公司                                   | 英属处女群岛 | 兰文 | 美元 1.00 元   | 发债                  | 美元 1.00 元   | - | - | 100.00% | - | 100.00% | 是 | - | - |
| Dongxing AM Segregated Portfolio Company | 开曼群岛   | 兰文 | 美元 100.00 元 | 设立资管基金              | 美元 100.00 元 | - | - | 100.00% | - | 100.00% | 是 | - | - |

- (a) 东兴资本投资管理有限公司法人代表已于 7 月 17 日变更为张锋；  
 (b) 截至报告期末，东兴基金尚未取得《经营证券期货业务许可证》，尚未开展相关业务；  
 (c) 东兴证券（香港）金融控股有限公司法人代表已于 7 月 14 日变更为张涛。

②同一控制下企业合并取得的子公司

| 子公司全称        | 注册地 | 注册资本       | 经营范围                   | 于 2020 年 6 月 30 日实际出资额 | 持股及表决权比例 |        | 是否合并报表 | 少数股东权益          |                  |
|--------------|-----|------------|------------------------|------------------------|----------|--------|--------|-----------------|------------------|
|              |     |            |                        |                        | 期末       | 期初     |        | 2020 年 6 月 30 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
| 东兴证券(香港)有限公司 | 香港  | 港币 7.34 亿元 | 证券交易、就证券提供意见、就机构融资提供意见 | 港币 6.94 亿元             | 94.52%   | 94.52% | 是      | 人民币 38.14 百万元   | 人民币 36.43 百万元    |

③非同一控制下企业合并取得的子公司

| 子公司全称 | 注册地 | 注册资本 | 经营范围 | 于 2020 年 6 月 30 日实际出资额 | 持股及表决权比例 |    | 是否合并报表 | 少数股东权益          |                  |
|-------|-----|------|------|------------------------|----------|----|--------|-----------------|------------------|
|       |     |      |      |                        | 期末       | 期初 |        | 2020 年 6 月 30 日 | 2019 年 12 月 31 日 |

|            |     |             |                           |             |         |         |   |   |   |
|------------|-----|-------------|---------------------------|-------------|---------|---------|---|---|---|
| 东兴期货有限责任公司 | 上海市 | 人民币 5.18 亿元 | 商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理 | 人民币 5.18 亿元 | 100.00% | 100.00% | 是 | - | - |
|------------|-----|-------------|---------------------------|-------------|---------|---------|---|---|---|

**(2) 纳入合并范围的结构化主体**

本期合并范围中包括的结构化主体为：

| 结构化主体名称                                            | 产品类型     |
|----------------------------------------------------|----------|
| 东兴添多利集合资产管理计划                                      | 集合资产管理计划 |
| 东兴添享利集合资产管理计划                                      | 集合资产管理计划 |
| 证券行业支持民营企业发展系列之东兴证券 1 号单一资产管理计划                    | 单一资产管理计划 |
| 证券行业支持民营企业发展系列之东兴证券 2 号 FOF 单一资产管理合同               | 单一资产管理计划 |
| 证券行业支持民营企业发展系列之东兴证券 3 号单一资产管理计划                    | 单一资产管理计划 |
| 证券行业支持民营企业发展系列之东兴证券 6 号单一资产管理合同                    | 单一资产管理计划 |
| 诺安智享 8 号资产管理计划                                     | 单一资产管理计划 |
| 汇添富沪港深灵活配置 7 号资产管理计划                               | 单一资产管理计划 |
| 鑫道复兴 26 号资产管理计划                                    | 单一资产管理计划 |
| 国投瑞银添瑞 4 号稳健增利资产管理计划                               | 单一资产管理计划 |
| 长盛-长兴优选 1 号单一资产管理计划                                | 单一资产管理计划 |
| 民生加银慧选 9 号单一资产管理计划                                 | 单一资产管理计划 |
| 泰达宏利同泰 1 号单一资产管理计划                                 | 单一资产管理计划 |
| 大成基金富益单一资产管理计划                                     | 单一资产管理计划 |
| 华商基金瑞梦全天候 2 号单一资产管理计划                              | 单一资产管理计划 |
| 浦银安盛盛明 1 号单一资产管理计划                                 | 单一资产管理计划 |
| 共青城东兴智铭投资管理合伙企业（有限合伙）                              | 合伙企业     |
| 深圳东兴成长投资管理合伙企业（有限合伙）                               | 合伙企业     |
| 量游鹏鑫一号私募证券投资基金                                     | 私募基金     |
| Dongxing Fixed Income Fund Segregated Portfolio    | 私募基金     |
| Dongxing Selected Equity Fund Segregated Portfolio | 私募基金     |

上述结构化主体纳入合并范围的判断因素包括：本公司作为管理人或实际控制人，且分别对该等结构化主体持有一定比例的投资，在结构化主体中享有较大可变回报。于 2020 年 6 月 30 日，共有 21 个结构化主体因本公司享有的可变回报重大而纳入本公司财务报表的合并范围（2019 年 12 月 31 日：20 个）。上述纳入合并范围的结构化主体于 2020 年 6 月 30 日的总资产为人民币 37.32 亿元（2019 年 12 月 31 日：人民币 69.85 亿元）。纳入合并范围的结构化主体中其他权益持有人持有的权益根据合同条款在其他负债项下列示。

纳入合并范围的结构化主体经营成果如下：

单位：百万元 币种：人民币

| 项目       | 2020 年 6 月 30 日/2020 年 1-6 月 | 2019 年 12 月 31 日/2019 年 1-6 月 |
|----------|------------------------------|-------------------------------|
| 总资产      | 3,732.20                     | 6,984.84                      |
| 营业收入     | 192.45                       | 236.72                        |
| 净利润      | 113.86                       | 216.38                        |
| 最大损失风险敞口 | 2,193.58                     | 2,273.84                      |

(3) 未纳入合并范围的结构化主体情况参见附注十。

(4) 合并范围发生变动的主体

## ①本期新纳入合并范围的结构化主体

本期新纳入合并范围的 2 个结构化主体，期末主要财务数据情况：

单位：百万元 币种：人民币

| 结构化主体名称               | 资产     | 最大损失风险敞口 |
|-----------------------|--------|----------|
| 华商基金瑞梦全天候 2 号单一资产管理计划 | 108.50 | 50.20    |
| 浦银安盛盛明 1 号单一资产管理计划    | 30.34  | 30.34    |

## ②本期不再纳入合并范围的结构化主体

本期不再纳入合并范围的 1 个结构化主体的情况：

| 结构化主体名称             | 产品类型     | 本期内不再纳入合并范围的原因 |
|---------------------|----------|----------------|
| 东兴金选兴盛 35 号集合资产管理计划 | 集合资产管理计划 | 清算             |

## (5) 本期不再纳入合并范围的子公司

本期，本公司未处置子公司且不存在对子公司丧失控制权的情况。



#### 四、财务报表的编制基础

##### 1. 编制基础

本中期财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制。

本中期财务报表根据财政部颁布的《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》和中国证券监督管理委员会颁布的《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式》(2017 年修订)的要求列示和披露有关财务信息,并不包括在年度财务报表中列示的所有信息和披露内容。本中期财务报表应与本公司经审计的 2019 年度财务报表一并阅读。

本公司会计核算以权责发生制为记账基础。除某些金融工具以公允价值计量外,本财务报表以历史成本作为计量基础。资产如果发生减值,则按照相关规定计提相应的减值准备。

在历史成本计量下,资产按照购置时支付的现金或者现金等价物的金额或者所付出的对价的公允价值计量。负债按照因承担现时义务而实际收到的款项或者资产的金额,或者承担现时义务的合同金额,或者按照日常活动中为偿还负债预期需要支付的现金或者现金等价物的金额计量。

公允价值是市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。无论公允价值是可观察到的还是采用估值技术估计的,在本财务报表中计量和/或披露的公允价值均在此基础上予以确定。

对于以交易价格作为初始确认时的公允价值,且在公允价值后续计量中使用了涉及不可观察输入值的估值技术的金融资产,在估值过程中校正该估值技术,以使估值技术确定的初始确认结果与交易价格相等。

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

- 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;
- 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;
- 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 2. 持续经营

√适用□不适用

本公司对自 2020 年 6 月 30 日起 12 个月的持续经营能力进行了评价,未发现对持续经营能力产生重大怀疑的事项和情况。因此,本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

## 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

适用  不适用  
详见以下内容

### 1. 遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本公司于 2020 年 6 月 30 日的合并及公司财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的合并及公司经营成果和现金流量。

### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 3. 营业周期

适用  不适用  
本公司的营业周期均为取得资金并完成回收变现的期间。

### 4. 记账本位币

人民币为本公司及境内子公司经营所处的主要经济环境中的货币，本公司及境内子公司以人民币为记账本位币。本公司之境外子公司根据其经营所处的主要经济环境中的货币确定港币为其记账本位币。本公司编制本财务报表时所采用的货币为人民币。

### 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用  不适用

企业合并，是指将两个或两个以上单独的企业合并形成一个报告主体的交易或事项。企业合并分为同一控制下企业合并和非同一控制下企业合并。

#### （1）同一控制下企业合并

参与合并的企业在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制，且该控制并非暂时性的，为同一控制下的企业合并。同一控制下的企业合并，在合并日取得对其他参与合并企业控制权的一方为合并方，参与合并的其他企业为被合并方。合并日，是指合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

合并方取得的资产和负债均按合并日在被合并方的账面价值计量。合并方取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积（股本溢价）；资本公积（股本溢价）不足以冲减的，调整留存收益。

合并方为进行企业合并发生的各项直接费用，于发生时计入当期损益。

#### （2）非同一控制下企业合并

参与合并的企业在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下的企业合并。非同一控制下的企业合并，在购买日取得对其他参与合并企业控制权的一方为购买方，参与合并的其他企业为被购买方。购买日，是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。

合并成本指购买方为取得被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债和发行的权益性工具的公允价值。购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益。

购买方在合并中所取得的被购买方符合确认条件的可辨认资产、负债及或有负债在购买日以公允价值计量。

合并成本大于合并中取得的被购买方于购买日可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉。合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，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，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。

## 6. 合并财务报表的编制方法

√适用□不适用

### (1) 合并财务报表范围的确定原则

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制是指本公司拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响该回报金额。合并范围包括本公司、全部子公司以及结构化主体。

一旦相关事实和情况的变化导致上述控制定义涉及的相关要素发生了变化，本公司将进行重新评估。

### (2) 合并财务报表编制的方法

从取得子公司的净资产和生产经营决策的实际控制权之日起，本公司开始将其纳入合并范围；从丧失实际控制权之日起停止纳入合并范围。对于处置的子公司，处置日前的经营成果和现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中；当期处置的子公司，不调整合并资产负债表的期初数。非同一控制下企业合并增加的子公司，其购买日后的经营成果及现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中，且不调整合并财务报表的期初数和对比数。同一控制下企业合并增加的子公司及吸收合并下的被合并方，其自合并当期期初至合并日的经营成果和现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中，并且同时调整合并财务报表的对比数。

子公司采用的主要会计政策和会计期间按照本公司统一规定的会计政策和会计期间厘定。

在编制合并财务报表时，子公司与本公司采用的会计政策或会计期间不一致的，按照本公司的会计政策和会计期间对子公司财务报表进行必要的调整。对于非同一控制下企业合并取得的子公司，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其财务报表进行调整。

财务报表合并范围内所有重大往来余额、交易及未实现利润在合并财务报表编制时予以抵销。

子公司的所有者权益及当期净损益中不属于本公司所拥有的部分分别作为少数股东权益及少数股东损益在合并财务报表中股东权益及净利润项下单独列示。子公司当期净损益中属于少数股东权益的份额，在合并利润表中净利润项目下以“少数股东损益”项目列示。少数股东分担的子公司的亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额，仍冲减少数股东权益。

当因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司的控制权时，对于剩余股权，按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司及结构化主体自购买日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益。与原有子公司及结构化主体股权投资相关的其他综合收益，在丧失控制权时一并转为当期投资收益。其后，对该部分剩余股权按照《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》或《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》等相关规定进行后续计量。

本公司通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，需区分处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易是否属于一揽子交易。处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，通常表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：(1)这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；(2)这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；(3)一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；(4)一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。不属于一揽子交易的，对其中的每一项交易视情况分别按照“不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的长期股权投资”和“因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司的控制权”适用的原则进行会计处理。处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易属于一揽子交易的，将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

#### 7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

#### 8. 现金及现金等价物的确定标准

现金是指企业库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指本公司持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

#### 9. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

##### (1) 外币业务

外币交易在初始确认时采用交易发生日的即期汇率折算。

于资产负债表日，外币货币性项目采用该日即期汇率折算为人民币，因该日的即期汇率与初始确认时或者前一资产负债表日即期汇率不同而产生的汇兑差额，除：(1)符合资本化条件的外币专门借款的汇兑差额在资本化期间予以资本化计入相关资产的成本；(2)为了规避外汇风险进行套期的套期工具的汇兑差额按套期会计方法处理；(3)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产货币性项目除摊余成本之外的其他账面余额变动产生的汇兑差额计入其他综合收益外，均计入当期损益。

编制合并财务报表涉及境外经营的，如有实质上构成对境外经营净投资的外币货币性项目，因汇率变动而产生的汇兑差额，列入其他综合收益的“外币报表折算差额”项目；处置境外经营时，计入处置当期损益。

以历史成本计量的外币非货币性项目仍以交易发生日的即期汇率折算的记账本位币金额计量。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，折算后的记账本位币金额与原记账本位币金额的差额，作为公允价值变动（含汇率变动）处理，计入当期损益或确认为其他综合收益。

## (2) 外币财务报表的折算方法

为编制合并财务报表，境外经营的外币财务报表按以下方法折算为人民币报表：资产负债表中的所有资产、负债类项目按资产负债表日的即期汇率折算；股东权益项目按发生时的即期汇率折算；利润表中的所有项目及反映利润分配发生额的项目按与交易发生日即期汇率近似的汇率折算；折算后资产类项目与负债类项目和股东权益类项目合计数的差额确认为其他综合收益并计入股东权益。

外币现金流量以及境外子公司的现金流量，采用与现金流量发生日即期汇率近似的汇率折算，汇率变动对现金及现金等价物的影响额，作为调节项目，在现金流量表中以“汇率变动对现金及现金等价物的影响”单独列示。

上年年末数和上年实际数按照上年财务报表折算后的数额列示。

在处置本公司在境外经营的全部所有者权益或因处置部分股权投资或其他原因丧失了对境外经营控制权时，将资产负债表中股东权益项目下列示的、与该境外经营相关的归属于母公司所有者权益的外币报表折算差额，全部转入处置当期损益。

在处置部分股权投资或其他原因导致持有境外经营权益比例降低但不丧失对境外经营控制权时，与该境外经营处置部分相关的外币报表折算差额将归属于少数股东权益，不转入当期损益。在处置境外经营为联营企业或合营企业的部分股权时，与该境外经营相关的外币报表折算差额，按处置该境外经营的比例转入处置当期损益。

## 10. 金融工具

### 金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

适用  不适用

在本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。



对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关的交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。当本公司按照《企业会计准则第 14 号——收入》（以下简称“收入准则”）初始确认未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收账款时，按照收入准则定义的交易价格进行初始计量。

实际利率法是指计算金融资产或金融负债的摊余成本以及将利息收入或利息费用分摊计入各会计期间的方法。

实际利率，是指将金融资产或金融负债在预计存续期的估计未来现金流量，折现为该金融资产账面余额或该金融负债摊余成本所使用的利率。在确定实际利率时，在考虑金融资产或金融负债所有合同条款（如提前还款、展期、看涨期权或其他类似期权等）的基础上估计预期现金流量，但不考虑预期信用损失。

金融资产或金融负债的摊余成本是以该金融资产或金融负债的初始确认金额扣除已偿还的本金，加上或减去采用实际利率法将该初始确认金额与到期日金额之间的差额进行摊销形成的累计摊销额，再扣除累计计提的损失准备（仅适用于金融资产）。

### **(1) 金融资产的分类与计量**

初始确认后，本公司对不同类别的金融资产，分别以摊余成本、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益或以公允价值计量且其变动计入当期损益进行后续计量。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本公司管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本公司将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本公司管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标的，则该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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括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和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，列示于交易性金融资产。

- 不符合分类为以摊余成本计量的金融资产或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条件的金融资产均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益，除衍生金融资产单独列示外，列示于交易性金融资产。
- 在初始确认时，为消除或显著减少会计错配，本公司可将金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。



初始确认时，本公司可以单项金融资产为基础不可撤销地将非同一控制下的企业合并中确认的或有对价以外的非交易性权益工具指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。此类金融资产作为其他权益工具投资列示。

金融资产满足下列条件之一表明本公司持有该金融资产的目的是交易性的：

- 取得相关金融资产的目的，主要是为了近期出售或回购。
- 相关金融资产在初始确认时属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式。
- 相关金融资产属于衍生工具。但符合财务担保合同定义的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

#### *以摊余成本计量的金融资产*

以摊余成本计量的金融资产采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量，发生减值时或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本公司对分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法确认利息收入。除下列情况外，本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：

- 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，本公司自初始确认起，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。
- 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，本公司在后续期间，按照该金融资产的摊余成本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，本公司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。

#### *以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产*

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相关的减值损失或利得、采用实际利率法计算的利息收入及汇兑损益计入当期损益，除此以外该金融资产的公允价值变动均计入其他综合收益。该金融资产计入各期损益的金额与视同其一直按摊余成本计量而计入各期损益的金额相等。该金融资产终止确认时，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。

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的公允价值变动在其他综合收益中进行确认，该金融资产终止确认时，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。本公司持有该权益工具投资期间，在本公司收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本公司，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。

#### *以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产*

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

## (2) 金融资产减值

本公司对以摊余成本计量的金融工具、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融工具等以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

本公司对由收入准则规范的交易形成且未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收账款按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

对于其他金融工具，除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本公司在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，除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外，作为减值损失或利得计入当期损益。对于分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，本公司在其他综合收益中确认其信用损失准备，并将减值损失或利得计入当期损益，且不减少该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

本公司在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本公司在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

### *信用风险显著增加*

本公司利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，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。

本公司在评估信用风险是否显著增加时会考虑如下因素：

- (1) 同一金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险的外部市场指标是否发生显著变化；
- (2) 金融工具外部信用评级实际或预期是否发生显著变化；
- (3) 预期将导致债务人履行其偿债义务的能力发生显著变化的业务、财务或经济状况的不利变化；
- (4) 债务人经营成果实际或预期是否发生显著变化；
- (5) 债务人所处的监管、经济或技术环境是否发生显著不利变化；
- (6) 作为债务抵押的担保物价值或第三方提供的担保或信用增级质量是否发生显著变化；
- (7) 实际或预期增信措施有效性是否发生重大不利变化；
- (8) 债务人预期表现和还款行为是否发生显著变化。

无论经上述评估后信用风险是否显著增加，当金融工具合同付款已发生逾期超过(含)30日，则表明该金融工具的信用风险已经显著增加。

于资产负债表日，若本公司判断金融工具只具有较低的信用风险，则本公司假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，并且即使较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金义务，则该金融工具被视为具有较低的信用风险。

#### *已发生信用减值的金融资产*

当本公司预期对金融资产未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- (1) 发行方或债务人发生重大财务困难；
- (2) 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- (3) 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- (4) 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- (5) 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；
- (6) 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。

无论上述评估结果如何，若金融工具合同付款已发生逾期超过(含)90日，则本公司推定该金融工具已发生违约。

#### *预期信用损失的确定*

本公司对金融投资、部分应收账款及其他金融资产在单项资产的基础上确定其信用损失，其余应收款项及其他应收款在组合基础上采用减值矩阵确定相关金融工具的信用损失。本公司以共同风险特征为依据，将金融工具分为不同组别。本公司采用的共同信用风险特征包括：金融工具类型、信用风险评级、担保物类型、初始确认日期、剩余合同期限、债务人所处行业、债务人所处地理位置、担保品相对于金融资产的价值等。

本公司按照下列方法确定相关金融工具的预期信用损失：

- 对于金融资产，信用损失应为本公司应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值；
- 对于资产负债表日已发生信用减值但并非购买或源生已发生信用减值的金融资产，信用损失为该金融资产账面余额与按原实际利率折现的估计未来现金流量的现值之间的差额。

本公司计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额；货币时间价值；在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

#### *减记金融资产*

当本公司不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回的，直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。

### (3) 金融资产的转移

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制。

若本公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。本公司按照下列方式对相关负债进行计量：

- 被转移金融资产以摊余成本计量的，相关负债的账面价值等于继续涉入被转移金融资产的账面价值减去本公司保留的权利(如果本公司因金融资产转移保留了相关权利)的摊余成本并加上本公司承担的义务(如果本公司因金融资产转移承担了相关义务)的摊余成本，相关负债不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；
- 被转移金融资产以公允价值计量的，相关负债的账面价值等于继续涉入被转移金融资产的账面价值减去本公司保留的权利(如果本公司因金融资产转移保留了相关权利)的公允价值并加上本公司承担的义务(如果本公司因金融资产转移承担了相关义务)的公允价值，该权利和义务的公允价值应为按独立基础计量时的公允价值。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，针对分类为以摊余成本计量的金融资产与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，将所转移金融资产的账面价值及因转移而收到的对价与原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和的差额计入当期损益。针对被本公司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，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。

金融资产部分转移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，并将终止确认部分收到的对价和原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和与终止确认部分在终止确认日的账面价值之差额计入当期损益。若本公司转移的金融资产是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，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。

金融资产整体转移未满足终止确认条件的，本公司继续确认所转移的金融资产整体，因资产转移而收到的对价在收到时确认为负债。

### (4) 金融负债的分类、确认及计量



本公司根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，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。

金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

#### *以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债*

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。其中，除衍生金融负债单独列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债列示为交易性金融负债。

金融负债满足下列条件之一，表明本公司承担该金融负债的目的是交易性的：

- 承担相关金融负债的目的，主要是为了近期出售或回购。
- 相关金融负债在初始确认时属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式。
- 相关金融负债属于衍生工具。但符合财务担保合同定义的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

本公司将符合下列条件之一的金融负债，在初始确认时可以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：(1)该指定可以消除或明显减少由于该金融负债的计量基础不同所导致的相关利得或损失在确认和计量方面不一致的情况；(2)根据正式书面文件载明的企业风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在本公司内部以此为基础向关键管理人员报告；(3)符合条件的包含嵌入衍生工具的混合工具。

交易性金融负债采用公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融负债相关的股利或利息支出计入当期损益。

对于被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，该负债由本公司自身信用风险变动引起的公允价值变动应当计入其他综合收益，且终止确认该负债时，计入其他综合收益的自身信用风险变动引起的其公允价值累计变动额转入留存收益。其余公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融负债相关的股利或利息支出计入当期损益。若按上述方式对该等金融负债的自身信用风险变动的影响进行处理会造成或扩大损益中的会计错配的，本公司将该金融负债的全部利得或损失（包括企业自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

#### *其他金融负债*

除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外的其他金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，按摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益。

本公司与交易对手方修改或重新议定合同，未导致按摊余成本进行后续计量的金融负债终止确认，但导致合同现金流量发生变化的，本公司重新计算该金融负债的账面价值，并将相关利得

或损失计入当期损益。重新计算的该金融负债的账面价值，本公司根据将重新议定或修改的合同现金流量按金融负债的原实际利率折现的现值确定。对于修改或重新议定合同所产生的所有成本或费用，本公司调整修改后的金融负债的账面价值，并在修改后金融负债的剩余期限内进行摊销。

#### **(5) 金融负债的终止确认**

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。本公司(借入方)与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换现存金融负债，且新金融负债与现存金融负债的合同条款实质上不同的，终止确认原金融负债，并同时确认新金融负债。

金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### **(6) 权益工具**

权益工具是指能证明拥有本公司在扣除所有负债后的资产中的剩余权益的合同。本公司发行(含再融资)、回购、出售或注销权益工具作为权益的变动处理。本公司不确认权益工具的公允价值变动。与权益性交易相关的交易费用从权益中扣减。

本公司对权益工具持有方的分配作为利润分配处理，发放的股票股利不影响股东权益总额。

#### **(7) 衍生工具及嵌入衍生工具**

衍生金融工具，包括股票收益互换、利率互换合同及期权合同等。衍生工具于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量。

对于嵌入衍生工具与主合同构成的混合合同，若主合同属于金融资产的，本公司不从该混合合同中分拆嵌入衍生工具，而将该混合合同作为一个整体适用关于金融资产分类的会计准则规定。

若混合合同包含的主合同不属于金融资产，且同时符合下列条件的，本公司将嵌入衍生工具从混合工具中分拆，作为单独的衍生金融工具处理。

- 嵌入衍生工具与该主合同在经济特征及风险方面不紧密相关。
- 与该嵌入衍生工具具有相同条款的单独工具符合衍生工具的定义。
- 该混合合同不是以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。

嵌入衍生工具从混合合同中分拆的，本公司按照适用的会计准则规定对混合合同的主合同进行会计处理。本公司无法根据嵌入衍生工具的条款和条件对嵌入衍生工具的公允价值进行可靠计量的，该嵌入衍生工具的公允价值根据混合合同公允价值和主合同公允价值之间的差额确定。使用了上述方法后，该嵌入衍生工具在取得日或后续资产负债表日的公允价值仍然无法单独计量的，本公司将该混合合同整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

#### **(8) 金融资产和金融负债的抵销**

当本公司具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的，同时本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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。



**11. 贵金属**适用 不适用**12. 应收款项****应收款项的预期信用损失的确定方法及会计处理方法**适用 不适用

本公司对金融投资、部分应收账款及其他金融资产在单项资产的基础上确定其信用损失，其余应收款项及其他应收款在组合基础上采用减值矩阵确定相关金融工具的信用损失。本公司以共同风险特征为依据，将金融工具分为不同组别。本公司采用的共同信用风险特征包括：金融工具类型、信用风险评级、担保物类型、初始确认日期、剩余合同期限、债务人所处行业、债务人所处地理位置、担保品相对于金融资产的价值等。

本公司按照下列方法确定相关金融工具的预期信用损失：

- 对于金融资产，信用损失应为本公司应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值；
- 对于资产负债表日已发生信用减值但并非购买或源生已发生信用减值的金融资产，信用损失为该金融资产账面余额与按原实际利率折现的估计未来现金流量的现值之间的差额。

本公司计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额；货币时间价值；在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。详见第十节附注五、10 金融工具。

**13. 应收款项融资**适用 不适用**14. 合同资产****(1). 合同资产的确认方法及标准**适用 不适用

合同资产是指已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利，且该权利取决于时间流逝之外的其他因素。本公司拥有的无条件（即，仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项单独列示。

**(2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法**适用 不适用**15. 持有待售资产**适用 不适用

## 16. 债权投资

### 债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用□不适用

本公司对以摊余成本计量的债权投资以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本公司在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用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，在债权投资中确认减值准备。

本公司在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本公司在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本公司按照下列方法确定相关金融工具的预期信用损失：

- 对于金融资产，信用损失应为本公司应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值；
- 对于资产负债表日已发生信用减值但并非购买或源生已发生信用减值的金融资产，信用损失为该金融资产账面余额与按原实际利率折现的估计未来现金流量的现值之间的差额。

本公司计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额；货币时间价值；在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。详见第十节附注五、10 金融工具。

## 17. 其他债权投资

### 其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用□不适用

本公司对以摊余成本计量的其他债权投资以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本公司在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损

失的金额计量其损失准备。信用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，在其他综合收益中确认其信用损失准备，不减少其他债权投资在资产负债表中列示的账面价值。

本公司在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本公司在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本公司按照下列方法确定相关金融工具的预期信用损失：

- 对于金融资产，信用损失应为本公司应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值；
- 对于资产负债表日已发生信用减值但并非购买或源生已发生信用减值的金融资产，信用损失为该金融资产账面余额与按原实际利率折现的估计未来现金流量的现值之间的差额。

本公司计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额；货币时间价值；在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。详见第十节附注五、10 金融工具。

## 18. 长期股权投资

√适用□不适用

### （1）共同控制、重大影响的判断标准

控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。共同控制是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。重大影响是指对被投资方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。在确定能否对被投资单位实施控制或施加重大影响时，已考虑投资方和其他方持有的被投资单位当期可转换公司债券、当期可执行认股权证等潜在表决权因素。

### （2）初始投资成本的确定

对于同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的现金、转让的非现金资产以及所承担债务账面价值之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本，按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份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。

对于非同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，在购买日按照合并成本作为长期股权投资的初始投资成本。

合并方或购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益。

除企业合并形成的长期股权投资外其取得的长期股权投资，按成本进行初始计量。与取得长期股权投资直接相关的费用、税金及其他必要支出也计入投资成本。

### **(3) 后续计量及损益确认方法**

#### **① 成本法核算的长期股权投资**

公司财务报表采用成本法核算对子公司的长期股权投资。子公司是指本公司能够对其实施控制的被投资主体。

采用成本法核算时，长期股权投资按初始投资成本计量，追加或收回投资调整长期股权投资的成本。当期投资收益按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认。

#### **② 权益法核算的长期股权投资**

采用权益法核算时，长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，不调整长期股权投资的初始投资成本；初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资的成本。

采用权益法核算时，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资收益和其他综合收益，同时调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应享有的部分，相应减少长期股权投资的账面价值；对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入资本公积。在确认应享有被投资单位净损益的份额时，以取得投资时被投资单位各项可辨认资产等的公允价值为基础对被投资单位的净利润进行调整后确认。被投资单位采用的会计政策及会计期间与母公司不一致的，按照母公司的会计政策及会计期间对被投资单位的财务报表进行调整，并据以确认投资收益和其他综合收益。对于母公司与联营企业之间发生的交易，投出或出售的资产不构成业务的，未实现内部交易损益按照享有的比例计算归属于母公司的部分予以抵销，在此基础上确认投资损益。但母公司与被投资单位发生的未实现内部交易损失，属于所转让资产减值损失的，不予以抵销。

在确认应分担被投资单位发生的净亏损时，以长期股权投资的账面价值和其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限。此外，如本公司对被投资单位负有承担额外损失的义务，则按预计承担的义务确认预计负债，计入当期投资损失。被投资单位以后期间实现净利润的，本公司在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

#### **③ 处置长期股权投资**

处置长期股权投资时，其账面价值与实际取得价款的差额，计入当期损益。

采用权益法核算的长期股权投资，处置后的剩余股权仍采用权益法核算的，在处置时将原计入股东权益的其他综合收益部分按相应的比例采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。因被投资方除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动而确认的所有者权益，按比例结转转入当期损益。

采用成本法核算的长期股权投资，处置后剩余股权仍采用成本法核算的，其在取得对被投资单位的控制之前因采用权益法核算或金融工具确认和计量准则核算而确认的其他综合收益，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理，并按比例结转当期损益；因采用权益法核算而确认的被投资单位净资产中除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动按比例结转当期损益。

## 19. 投资性房地产

### 如果采用成本计量模式的：

投资性房地产是指为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产。包括已出租的建筑物等。

投资性房地产按成本进行初始计量。与投资性房地产有关的后续支出，如果与该资产有关的经济利益很可能流入且其成本能可靠地计量，则计入投资性房地产成本。其他后续支出，在发生时计入当期损益。

本公司采用成本模式对投资性房地产进行后续计量，并按照与房屋建筑物一致的政策进行折旧。

自用房地产的用途改变为赚取租金或资本增值时，自改变之日起，将固定资产或无形资产转换为投资性房地产，以转换当日的账面价值作为投资性房地产的账面价值。

投资性房地产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

## 20. 固定资产

### (1) 确认条件

√适用□不适用

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。固定资产仅在与有关的经济利益很可能流入本公司，且其成本能够可靠地计量时才予以确认。固定资产按成本进行初始计量。

与固定资产有关的后续支出，如果与该固定资产有关的经济利益很可能流入且其成本能可靠地计量，则计入固定资产成本，并终止确认被替换部分的账面价值。除此以外的其他后续支出，在发生时计入当期损益。

### (2) 折旧方法

√适用□不适用



| 类别      | 折旧方法  | 折旧年限（年） | 残值率 | 年折旧率   |
|---------|-------|---------|-----|--------|
| 房屋及建筑物  | 年限平均法 | 20 年    | 1%  | 4.95%  |
| 交通运输设备  | 年限平均法 | 4 年     | 1%  | 24.75% |
| 电子及通讯设备 | 年限平均法 | 3 年     | 1%  | 33.00% |
| 办公及其他设备 | 年限平均法 | 5 年     | 1%  | 19.80% |

固定资产从达到预定可使用状态的次月起，采用年限平均法在使用寿命内按月计提折旧。预计净残值是指假定固定资产预计使用寿命已满并处于使用寿命终了时的预期状态，本公司目前从该项资产处置中获得的扣除预计处置费用后的金额。

当固定资产处置时或预期通过使用或处置不能产生经济利益时，终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

本公司至少于年度终了对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核，如发生改变则作为会计估计变更处理。

### （3）融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

适用  不适用

#### 21. 在建工程

适用  不适用

#### 22. 借款费用

适用  不适用

借款费用在发生当期确认为费用。

#### 23. 使用权资产

适用  不适用

#### 24. 无形资产

##### （1）计价方法、使用寿命、减值测试

适用  不适用

无形资产包括交易席位和计算机软件使用权。

无形资产按成本进行初始计量。与无形资产有关的支出，如果相关的经济利益很可能流入本公司且其成本能可靠地计量，则计入无形资产成本。除此以外的其他项目的支出，在发生时计入当期损益。

使用寿命有限的无形资产自可供使用时起，对其原值减去预计净残值和已计提的减值准备累计金额在其预计使用寿命内采用直线法分期平均摊销，使用寿命不确定的无形资产不予摊销。

本公司使用寿命有限的无形资产主要包括软件使用权等。软件使用权按取得时的实际成本计价，按直线法在 2 年内进行摊销。



期末对使用寿命有限的无形资产的使用寿命、摊销期限及方法进行复核，与上述估计数有差异的，将调整以上估计数。

## (2) 内部研究开发支出会计政策

适用 不适用

## 25. 长期资产减值

适用 不适用

本公司在每一个资产负债表日检查长期股权投资、采用成本法计量的投资性房地产、固定资产及使用寿命确定的无形资产是否存在可能发生减值的迹象。如果该等资产存在减值迹象，则估计其可收回金额。使用寿命不确定的无形资产和尚未达到可使用状态的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

估计资产的可收回金额以单项资产为基础，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，则以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。可收回金额为资产或者资产组的公允价值减去处置费用后的净额与其预计未来现金流量的现值两者之中的较高者。

如果资产的可收回金额低于其账面价值，按其差额计提资产减值准备，并计入当期损益。

商誉至少在每年年度终了进行减值测试。对商誉进行减值测试时，结合与其相关的资产组或者资产组组合进行。即，自购买日起将商誉的账面价值按照合理的方法分摊到能够从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合，如包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额首先抵减分摊到该资产组或资产组组合的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

## 26. 长期待摊费用

适用 不适用

长期待摊费用为已经发生但应由本期和以后各期负担的分摊期限在一年以上的各项费用。长期待摊费用在预计受益期间分期平均摊销。

## 27. 附回购条件的资产转让

适用 不适用

### (1) 买入返售金融资产

买入返售交易按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关金融产品（包括债券和票据），合同或协议到期日，再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售业务按买入返售相关金融产品时实际支付的款项入账。买入价与返售价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息收入。

本公司对融资类业务形成的资产定期进行减值评估。详见附注七、28 及附注十七、2。

## (2) 卖出回购金融资产款

卖出回购交易按照合同或协议的约定，以一定的价格将相关金融产品（包括债券和票据）出售给交易对手，合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购业务按卖出回购相关金融产品时实际收到的款项入账。卖出的金融产品仍按原分类列于资产负债表的相关项目内，并按照相关的会计政策核算。售价与回购价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息支出。

## 28. 合同负债

### 合同负债的确认方法

适用  不适用

合同负债，是指本公司已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务。本公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中确认为合同负债。履行履约义务的确认条件详见附注五、35。

## 29. 职工薪酬

### (1) 短期薪酬的会计处理方法

适用  不适用

短期薪酬主要包括工资、奖金、津贴和补贴、职工福利费、医疗保险费、生育保险费、工伤保险费、住房公积金、工会经费和职工教育经费、非货币性福利等。本公司在职员工为本公司提供服务的会计期间将实际发生的短期职工薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。其中非货币性福利按公允价值计量。

### (2) 离职后福利的会计处理方法

适用  不适用

离职后福利主要包括设定提存计划。其中设定提存计划主要包括基本养老保险、失业保险以及本公司对符合条件职工实施的企业年金等，相应的应缴存金额于发生时计入相关资产成本或当期损益。

### (3) 辞退福利的会计处理方法

适用  不适用

本公司向职工提供辞退福利的，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：本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；本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。

### (4) 其他长期职工福利的会计处理方法

适用  不适用

## 30. 预计负债

适用  不适用

当与或有事项相关的义务同时符合以下条件时，确认为预计负债：(1)该义务是本公司承担的现时义务；(2)履行该义务很可能导致经济利益流出；(3)该义务的金额能够可靠地计量。在资产负债表日，考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素，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计量。如果货币时间价值影响重大，则以预计未来现金流出折现后的金额确定最佳估计数。如果清偿预计负债所需支出全部或部分预期由第三方补偿的，补偿金额在基本确定能够收到时，作为资产单独确认，且确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

### 31. 租赁负债

适用 不适用

### 32. 股份支付

适用 不适用

### 33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

### 34. 回购本公司股份

适用 不适用

### 35. 收入

#### (1) 收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

本公司在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务控制权时，按照分摊至该项履约义务的交易价格确认收入。履约义务，是指合同中本公司向客户转让可明确区分商品或服务的承诺。交易价格，是指本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，但不包含代第三方收取的款项以及本公司预期将退还给客户的款项。

满足下列条件之一的，属于在某一时间段内履行的履约义务，本公司按照履约进度，在一段时间内确认收入：(1)客户在本公司履约的同时即取得并消耗所带来的经济利益；(2)客户能够控制本公司履约过程中在建的商品；(3)本公司履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本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。否则，本公司在客户取得相关商品或服务控制权的时点确认收入。

本公司根据在向客户转让商品或服务前是否拥有对该商品或服务的控制权，来判断从事交易时本公司的身份是主要责任人还是代理人。本公司在向客户转让商品或者服务前能够控制该商品或服务的，本公司为主要责任人，按照已收或应收对价总额确认收入；否则，本公司为代理人，按照预期有权收取的佣金或手续费的金额确认收入，该金额按照既定的佣金金额或比例等确定。

与本公司取得收入的主要业务类型相关的具体会计政策描述如下：

### (1) 经纪业务收入

本公司从事代理买卖证券及期货经纪业务，在交易完成时点按照成交金额及约定费率确认收入；本公司从事金融产品代销业务，在代销完成时点按照代销规模及约定费率确认收入。

### (2) 投资银行业务收入

本公司从事证券承销业务，在承销合同中约定的履约义务完成时点按照合同或协议约定的金额确认收入；本公司从事证券发行上市保荐业务，在合同开始日对保荐业务合同中包含的各单项履约义务进行识别，并在各单项履约义务完成时点按照合同或协议约定的金额确认收入。

### (3) 资产管理业务收入

本公司接受客户委托负责经营管理受托资产，由于在本公司履约的同时委托客户即取得并消耗本公司履约所带来的经济利益，因此本公司在履约义务履行期间内根据受托管理资产规模及约定费率确认收入；本公司提供资产管理业务根据受托资产业绩状况可能收取额外的业绩报酬，本公司在业绩评价周期期末，在与业绩报酬相关的不确定性消除、已确认累计收入金额很可能不会发生重大转回时，按照合同或协议约定的计算方法确认为当期收入。

## (2) 同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

适用 不适用

## 36. 合同成本

适用 不适用

## 37. 利润分配

适用 不适用

母公司根据《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》（证监机构字[2007]320 号）的规定按税后利润的 10%提取交易风险准备金，用于弥补证券交易损失。

根据《中华人民共和国证券法》、《金融企业财务规则》(财政部令第 42 号)和《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》(证监机构字[2007]320 号)的规定，本公司按照当期净利润的 10%提取一般风险准备。根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(证监会[2017]12 号公告)，按基金管理费收入的 20%提取一般风险准备。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日颁布《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》(证监会[2018]39 号公告)，按大集合管理费收入的 10%提取一般风险准备。

本公司子公司东兴证券投资有限公司根据公司章程的规定提取法定交易风险准备。

本公司子公司东兴期货有限责任公司根据《金融企业财务规则》(财政部令第 42 号)以及公司章程，按照经股东会批准的比例提取一般风险准备。

## 38. 政府补助

### (1) 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

政府补助是指本公司从政府无偿取得货币性资产和非货币性资产。政府补助在能够满足政府补助所附条件且能够收到时予以确认。

与资产相关的政府补助，是指本公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助。与资产相关的政府补助，确认为递延收益，在相关资产的使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入当期损益。

## (2) 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用□不适用

与收益相关的政府补助，是指除与资产相关的政府补助之外的政府补助。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和损失的，确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益；用于补偿已经发生的相关成本费用和损失的，直接计入当期损益。本公司将难以区分性质的政府补助整体归类为与收益相关的政府补助。

与本公司日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益。与本公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收入。

## 39. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用□不适用

### (1) 当期所得税

资产负债表日，对于当期和以前期间形成的当期所得税负债（或资产），以按照税法规定计算的预期应交纳（或返还）的所得税金额计量。

### (2) 递延所得税资产及递延所得税负债

对于某些资产、负债项目的账面价值与其计税基础之间的差额，以及未作为资产和负债确认但按照税法规定可以确定其计税基础的项目的账面价值与计税基础之间的差额产生的暂时性差异，采用资产负债表债务法确认递延所得税资产及递延所得税负债。

一般情况下所有暂时性差异均确认相关的递延所得税。但对于可抵扣暂时性差异，本公司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，确认相关的递延所得税资产。此外，与商誉的初始确认相关的，以及与既不是企业合并、发生时也不影响会计利润和应纳税所得额（或可抵扣亏损）的交易中产生的资产或负债的初始确认有关的暂时性差异，不予确认有关的递延所得税资产或负债。

对于能够结转以后年度的可抵扣亏损及税款抵减，以很可能获得用来抵扣可抵扣亏损和税款抵减的未来应纳税所得额为限，确认相应的递延所得税资产。

本公司确认与子公司及联营企业投资相关的应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债，除非本公司能够控制暂时性差异转回的时间，而且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。对于与子公司及联营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，只有当暂时性差异在可预见的未来很可能



转回，且未来很可能获得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额时，本公司才确认递延所得税资产。

资产负债表日，对于递延所得税资产和递延所得税负债，根据税法规定，按照预期收回相关资产或清偿相关负债期间的适用税率计量。

除与直接计入其他综合收益或股东权益的交易和事项相关的当期所得税和递延所得税计入其他综合收益或股东权益，以及企业合并产生的递延所得税调整商誉的账面价值外，其余当期所得税和递延所得税费用或收益计入当期损益。

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

### **(3) 所得税的抵销**

当拥有以净额结算的法定权利，且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行，本公司当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列报。

当拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利，且递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债时，本公司递延所得税资产及递延所得税负债以抵销后的净额列报。

## **40. 租赁**

### **(1) 经营租赁的会计处理方法**

适用  不适用

融资租赁为实质上转移了与资产所有权有关的全部风险和报酬的租赁，其所有权最终可能转移，也可能不转移。融资租赁以外的其他租赁为经营租赁。

#### **(1) 本公司作为承租人记录经营租赁业务**

经营租赁的租金支出在租赁期内的各个期间按照直线法计入相关资产成本或当期损益。初始直接费用计入当期损益。或有租金于实际发生时计入当期损益。

#### **(2) 本公司作为出租人记录经营租赁业务**

经营租赁的租金收入在租赁期内的各个期间按直线法确认为当期损益。对金额较大的初始直接费用于发生时予以资本化，在整个租赁期间内按照与确认租金收入相同的基础分期计入当期损益；其他金额较小的初始直接费用于发生时计入当期损益。或有租金于实际发生时计入当期损益。

### **(2) 融资租赁的会计处理方法**

适用  不适用



**(3) 新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法**

适用 不适用

**41. 融资融券业务**

适用 不适用

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

本公司对于融出的资金，确认应收债权；本公司对于融出的证券，不终止确认该证券；对于融出的资金和证券，确认相应收入。

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。

本公司对融资类业务形成的资产定期进行减值评估。详见附注七、28 以及附注十七、2。

**42. 资产证券化业务**

适用 不适用

**43. 其他重要的会计政策和会计估计**

适用 不适用

**转融通业务**

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

对于转融资业务，本公司对融入的资金，确认对出借方的负债，并确认相应利息费用。

对于转融券业务，本公司对于融入的证券，由于其主要风险或收益不由本公司享有或承担，不确认该证券，但确认相应支出。

**客户交易结算资金**

本公司收到的客户交易结算资金存放于存管银行的专门账户，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。本公司在收到代理客户买卖证券款时确认为一项资产和一项负债。

本公司接受客户委托通过证券交易所代理买卖证券，与客户清算时如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额，按清算日买卖证券成交价的差额，加代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费减少客户交易结算资金；如买入证券成交总额小于卖出证券成交总额，按清算日买卖证券成交价的差额，减代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费增加客户交易结算资金。

**资产管理业务**

资产管理业务是指本公司接受委托负责经营管理受托资产的业务，包括单一资产管理业务、集合资产管理业务和专项资产管理业务。

本公司受托经营资产管理业务，以托管客户或集合计划为主体，独立建账，独立核算。定期与托管人的会计核算和估值结果进行复核，于根据合同约定满足收入确认的条件时，按合同规定的收益分成方式和比例计算受托投资管理手续费及佣金收入。

#### 代理发行证券业务

对于以全额包销方式进行代理发行证券的业务，本公司在收到代发行人发售的证券时，按承购价同时确认为一项资产和一项负债。发行期结束后，如有未售出的证券，按承销价格转为本公司的金融资产。

对于以余额包销方式进行代理发行证券的业务，承销期结束后，如有未售出的证券，按约定的承销价格转为本公司的金融资产。

对于以代销方式进行代理发行证券的业务，承销期结束后，如有未售出的证券，将未售出证券退还委托单位。

#### 44. 重要会计政策和会计估计的变更

##### (1) 重要会计政策变更

适用  不适用

| 会计政策变更的内容和原因                                                            | 审批程序                                  | 备注(受重要影响的报表项目名称和金额) |
|-------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------|
| 财政部于 2017 年度修订了《企业会计准则第 14 号—收入》（2017 年修订），本公司于 2020 年 1 月 1 日起开始执行该准则。 | 2020 年 4 月 28 日经本公司第四届董事会第二十五次会议审议通过。 | 本准则执行对本公司报表未产生重大影响。 |

其他说明：

财政部于 2017 年度修订了《企业会计准则第 14 号—收入》（2017 年修订）。修订后的准则规定，首次执行该准则应当根据累积影响数，调整期初留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整。公司于 2020 年 1 月 1 日起开始执行该准则，对财务报表影响不重大。

##### (2) 重要会计估计变更

适用  不适用

##### (3) 2020 年起首次执行新收入准则、新租赁准则调整首次执行当年年初财务报表相关情况

适用  不适用

本公司自 2020 年 1 月 1 日起首次执行新收入准则，新收入准则的首次执行对公司年初留存收益及财务报表无重大影响，对可比期间信息不予调整。

新租赁准则本报告期间不适用。

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

适用  不适用

本公司自 2020 年 1 月 1 日起首次执行新收入准则，新收入准则的首次执行对公司年初留存收益及财务报表无重大影响，对可比期间信息不予调整。

新租赁准则本报告期间不适用。

#### 45. 其他

√适用□不适用

本公司在运用附注五所述的会计政策过程中，由于经营活动内在的不确定性，本公司需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些判断、估计和假设是基于本公司管理层过去的历史经验，并在考虑其他相关因素的基础上作出的。实际的结果可能与本公司的估计存在差异。

本公司对前述判断、估计和假设在持续经营的基础上进行定期复核，会计估计的变更仅影响变更当期的，其影响数在变更当期予以确认；既影响变更当期又影响未来期间的，其影响数在变更当期和未来期间予以确认。

资产负债表日，本公司在运用会计政策过程中所作出的重要判断以及会计估计中涉及如下关键假设和不确定因素，很可能产生重大影响：

##### （1）对结构化主体的合并

在确定是否合并结构化主体时，本公司主要考虑对这些主体(包括信托计划、资产管理计划及基金等)是否具有控制权。在评估时，本公司考虑结构化主体的设立目的、本公司作为管理人对于结构化主体拥有的实质性权力，并结合与结构化主体约定的收益率、管理费率、业绩报酬条款以及持有份额等因素评价本公司享有的全部可变回报，以评估本公司是否控制结构化主体。如果本公司对结构化主体拥有实质性权力，面临的可变回报的风险重大并且本公司对于结构化主体的权力将影响本公司取得的可变回报时，本公司合并该等结构化主体。

##### （2）金融资产的分类

在确定金融资产的分类时，本公司主要考虑金融资产的业务模式和合同现金流量特征。本公司判断管理金融资产的业务模式时主要考虑评价和向关键管理人员报告金融资产业绩的方式、影响金融资产业绩的风险及其管理方式以及相关业务管理人员获得报酬的方式；评估合同现金流量特征与基本借贷安排是否一致时，本公司主要考虑本金金额在金融资产存续期内是否发生变动，利息是否包括对货币时间价值、与特定期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。

##### （3）预期信用损失的计量

###### *对信用风险是否显著增加的判断*

本公司根据金融工具初始确认后信用风险的变化使用三阶段减值模型对金融工具的预期信用损失进行计量。本公司对处于第一阶段的金融工具按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，对处于第二阶段和第三阶段的金融工具按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。在评估金融工具的信用风险是否显著增加时，本公司充分考虑反映金融工具的信用风险是否发生显著变化的各种合理且依据的信息，包括前瞻性信息。当触发一个或多个定量和定性指标时，本公司认为金融工具的信用风险已发生显著增加。

本公司在评估信用风险是否显著增加时考虑的因素的详细信息已于附注十七、风险管理之 2 信用风险披露。

#### 建立具有类似信用风险特征的资产组

在组合基础上对预期信用损失进行评估时，本公司以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组别。同时，本公司通过对同一组别内金融工具是否仍具有共同风险特征进行持续评估，以确保信用风险特征发生变化时对金融工具资产组合进行重新划分。金融资产在信用风险显著增加的情况下将由按照 12 个月内预期信用损失转移至按照整个存续期内的预期信用损失确认损失准备，同时信用风险的变化也可能导致同一预期信用损失计量方式下损失准备金额的变化。

#### 使用的模型和假设

本公司根据会计准则的要求在预期信用损失计量中运用的判断还涉及根据金融资产类型选择适当的模型和假设，包括与关键信用风险因素相关的假设。本公司对金融资产的预期信用损失计量使用考虑了前瞻性影响的违约概率、违约损失率和违约风险敞口等关键参数。详细信息已于附注十七、风险管理之 2 信用风险披露。

## 六、税项

### 1. 主要税种及税率

主要税种及税率情况

√ 适用 □ 不适用

| 税种            | 计税依据                     | 税率          |
|---------------|--------------------------|-------------|
| 增值税           | 增值税应税收入                  | 6%或 3%      |
| 城市维护建设税       | 按实际缴纳的流转税额的 7%或 5%计缴     | 7%或 5%      |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 按实际缴纳的流转税额的 3%或 2%或 1%计缴 | 3%或 2%或 1%  |
| 企业所得税         | 应纳税所得额                   | 25%或 16.50% |

#### 所得税

本公司及境内子公司的企业所得税税率为 25%(2019 年度：25%)。

本公司之子公司东兴香港及其香港子公司的所得税按照香港特别行政区所得税率计算缴纳。

#### 增值税

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36 号)的规定，本公司及境内子公司自 2016 年 5 月 1 日起对全部应税业务缴纳增值税，本公司及子公司为增值税一般纳税人，按照相关税收规定，适用增值税率为 6%。

根据财政部和国家税务总局《关于明确金融、房地产开发、教育辅助等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)、《关于资管产品增值税有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)以及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

**城市维护建设税及教育费附加**

城市维护建设税按照实际缴纳流转税额的 7%或 5%计缴。教育费附加及地方教育费附加按照实际缴纳流转税额的 3%和 2%或 1%计缴。

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

适用 不适用

| 纳税主体名称                  | 所得税税率 (%) |
|-------------------------|-----------|
| 母公司及设立于中国大陆的子公司         | 25%       |
| 母公司之子公司东兴证券(香港)金融控股有限公司 | 16.50%    |

**2. 税收优惠**

适用 不适用

**3. 其他**

适用 不适用

**七、合并财务报表项目注释**
**1、货币资金**

适用 不适用

单位：元

| 项目        | 期末             |        |                          | 期初             |        |                          |
|-----------|----------------|--------|--------------------------|----------------|--------|--------------------------|
|           | 外币金额           | 折算率    | 折人民币金额                   | 外币金额           | 折算率    | 折人民币金额                   |
| 现金：       | /              | /      | 7,079.10                 | /              | /      | 6,825.69                 |
| 人民币       | /              | /      | 7,079.10                 | /              | /      | 6,825.69                 |
| 银行存款：     | /              | /      | 13,801,054,427.11        | /              | /      | 10,512,424,968.53        |
| 其中：自有资金   | /              | /      | 3,437,833,367.65         | /              | /      | 2,693,580,447.90         |
| 人民币       | /              | /      | 1,243,847,819.71         | /              | /      | 757,876,780.67           |
| 港元        | 457,624,479.16 | 0.9134 | 417,994,199.26           | 685,853,104.41 | 0.8958 | 614,387,210.93           |
| 美元        | 250,863,952.07 | 7.0795 | 1,775,991,348.68         | 189,403,465.54 | 6.9762 | 1,321,316,456.30         |
| 客户资金      | /              | /      | 10,363,221,059.46        | /              | /      | 7,818,844,520.63         |
| 人民币       | /              | /      | 10,182,618,194.11        | /              | /      | 7,621,355,457.29         |
| 港元        | 107,246,312.45 | 0.9134 | 97,958,781.79            | 142,177,706.38 | 0.8958 | 127,362,789.38           |
| 美元        | 11,673,166.75  | 7.0795 | 82,640,184.01            | 10,051,656.52  | 6.9762 | 70,122,366.21            |
| 欧元        | 500.00         | 7.7991 | 3,899.55                 | 500.00         | 7.8155 | 3,907.75                 |
| <b>合计</b> | /              | /      | <b>13,801,061,506.21</b> | /              | /      | <b>10,512,431,794.22</b> |

其中，融资融券业务：

适用 不适用

单位：元

| 项目     | 期末   |     |              | 期初   |     |               |
|--------|------|-----|--------------|------|-----|---------------|
|        | 外币金额 | 折算率 | 折人民币金额       | 外币金额 | 折算率 | 折人民币金额        |
| 自有信用资金 | /    | /   | 1,008,290.62 | /    | /   | 13,948,159.79 |
| 人民币    | /    | /   | 1,008,290.62 | /    | /   | 13,948,159.79 |

|           |          |          |                         |          |          |                         |
|-----------|----------|----------|-------------------------|----------|----------|-------------------------|
| 客户信用资金    | /        | /        | 2,024,263,874.06        | /        | /        | 1,264,743,527.25        |
| 人民币       | /        | /        | 2,024,263,874.06        | /        | /        | 1,264,743,527.25        |
| <b>合计</b> | <b>/</b> | <b>/</b> | <b>2,025,272,164.68</b> | <b>/</b> | <b>/</b> | <b>1,278,691,687.04</b> |

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

适用 不适用

货币资金的说明：

适用 不适用

于 2020 年 6 月 30 日和 2019 年 12 月 31 日，本公司货币资金不存在抵押、质押、冻结等对变现有限制或存在潜在回收风险的情况。

## 2、 结算备付金

适用 不适用

单位：元

| 项目        | 期末            |          |                         | 期初           |          |                         |
|-----------|---------------|----------|-------------------------|--------------|----------|-------------------------|
|           | 外币金额          | 折算率      | 折人民币金额                  | 外币金额         | 折算率      | 折人民币金额                  |
| 公司自有备付金：  | /             | /        | 1,065,631,359.81        | /            | /        | 460,299,458.64          |
| 人民币       | /             | /        | 1,065,631,359.81        | /            | /        | 460,299,458.64          |
| 客户普通备付金：  | /             | /        | 2,314,445,144.69        | /            | /        | 2,008,932,578.22        |
| 人民币       | /             | /        | 2,285,232,943.38        | /            | /        | 1,992,087,433.63        |
| 港元        | 11,349,280.85 | 0.9134   | 10,366,433.13           | 8,745,430.97 | 0.8958   | 7,834,157.06            |
| 美元        | 2,662,019.66  | 7.0795   | 18,845,768.18           | 1,291,675.63 | 6.9762   | 9,010,987.53            |
| 客户信用备付金：  | /             | /        | 727,038,161.88          | /            | /        | 540,560,385.29          |
| 人民币       | /             | /        | 727,038,161.88          | /            | /        | 540,560,385.29          |
| <b>合计</b> | <b>/</b>      | <b>/</b> | <b>4,107,114,666.38</b> | <b>/</b>     | <b>/</b> | <b>3,009,792,422.15</b> |

## 3、 贵金属

适用 不适用

## 4、 拆出资金

适用 不适用

## 5、 融出资金

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目    | 期末账面余额            | 期初账面余额            |
|-------|-------------------|-------------------|
| 境内    | 14,377,970,299.14 | 12,659,888,159.33 |
| 其中：个人 | 12,990,935,373.21 | 11,920,856,897.00 |
| 机构    | 1,387,034,925.93  | 739,031,262.33    |



|               |                          |                          |
|---------------|--------------------------|--------------------------|
| 减：减值准备        | 100,408,169.76           | 81,306,797.47            |
| 账面价值小计        | 14,277,562,129.38        | 12,578,581,361.86        |
| 境外            | 252,018,474.55           | 206,818,718.11           |
| 其中：个人         | 34,826,018.09            | 12,722,880.37            |
| 机构            | 217,192,456.46           | 194,095,837.74           |
| 减：减值准备        | 14,276,288.58            | 13,298,828.22            |
| 账面价值小计        | 237,742,185.97           | 193,519,889.89           |
| <b>账面价值合计</b> | <b>14,515,304,315.35</b> | <b>12,772,101,251.75</b> |

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 担保物类别     | 期末公允价值                   | 期初公允价值                   |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 资金        | 2,772,529,392.26         | 1,814,087,400.83         |
| 债券        | 128,818,187.67           | 120,931,434.51           |
| 股票        | 31,408,853,760.13        | 34,182,727,000.86        |
| 基金        | 10,727,865,088.57        | 333,065,928.06           |
| <b>合计</b> | <b>45,038,066,428.63</b> | <b>36,450,811,764.26</b> |

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

融出资金的说明：

√适用 □不适用

按放款日的账龄分析：

单位：元 币种：人民币

| 账龄        | 2020年6月30日               |               |                       |             | 2019年12月31日              |               |                      |             |
|-----------|--------------------------|---------------|-----------------------|-------------|--------------------------|---------------|----------------------|-------------|
|           | 账面余额                     |               | 减值准备                  |             | 账面余额                     |               | 减值准备                 |             |
|           | 金额                       | 比例 (%)        | 金额                    | 比例 (%)      | 金额                       | 比例 (%)        | 金额                   | 比例 (%)      |
| 3个月以内     | 6,678,499,899.80         | 45.65         | 46,773,153.15         | 0.70        | 5,434,674,885.47         | 42.24         | 35,109,844.48        | 0.65        |
| 3-6个月     | 3,050,902,671.54         | 20.85         | 17,992,378.93         | 0.59        | 2,583,222,970.72         | 20.08         | 19,379,362.01        | 0.75        |
| 6个月以上     | 4,900,586,202.35         | 33.50         | 49,918,926.26         | 1.02        | 4,848,809,021.25         | 37.68         | 40,116,419.20        | 0.83        |
| <b>合计</b> | <b>14,629,988,773.69</b> | <b>100.00</b> | <b>114,684,458.34</b> | <b>0.78</b> | <b>12,866,706,877.44</b> | <b>100.00</b> | <b>94,605,625.69</b> | <b>0.74</b> |

融出证券

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末公允价值 | 期初公允价值 |
|----|--------|--------|
|----|--------|--------|

|                    |                      |                      |
|--------------------|----------------------|----------------------|
| 以自有证券作为融出证券的       | -                    | -                    |
| --交易性金融资产(a)       | 48,500,760.40        | 13,957,816.40        |
| 小计                 | 48,500,760.40        | 13,957,816.40        |
| 以转融通融入证券作为融出证券的(b) | 37,338,759.04        | 24,886,881.46        |
| <b>合计</b>          | <b>85,839,519.44</b> | <b>38,844,697.86</b> |

(a)本公司以自有证券作为融出证券的，为本公司记录为交易性金融资产，这些资产并没有因为融出而终止确认。

(b)本公司向中国证券金融股份有限公司转融通融入证券未纳入本公司资产负债表核算，于2020年6月30日转融通融入证券按照融入当日证券公允价值计算的总金额为人民币99,941,888.00元(2019年12月31日：人民币43,149,200.00元)。

(c)经强制平仓后仍无法全额收回融出证券的形成融出证券违约，于2020年6月30日及2019年12月31日，本公司融出证券违约金额为零。

(d)账龄在6个月以上的融出资金系展期的合约。

(e)于2020年6月30日，融出资金业务强制平仓合约终止后客户尚未归还款项金额为人民币16,220,664.75元(2019年12月31日：人民币16,004,777.74元)。

(f)于2020年6月30日，本公司无将上述融资融券业务中的收益权进行资产证券化的项目，原有项目已到期。2019年12月31日，本公司将上述融资融券业务中的收益权进行资产证券化的金额为人民币1,036,410,233.86元。

**6、衍生金融工具**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 类别        | 期末       |          |          |                          |          |                        | 期初       |          |          |                         |                     |                        |
|-----------|----------|----------|----------|--------------------------|----------|------------------------|----------|----------|----------|-------------------------|---------------------|------------------------|
|           | 套期工具     |          |          | 非套期工具                    |          |                        | 套期工具     |          |          | 非套期工具                   |                     |                        |
|           | 名义金额     | 公允价值     |          | 名义金额                     | 公允价值     |                        | 名义金额     | 公允价值     |          | 名义金额                    | 公允价值                |                        |
| 资产        |          | 负债       | 资产       |                          | 负债       | 资产                     |          | 负债       | 资产       |                         | 负债                  |                        |
| 权益衍生工具    |          |          |          |                          |          |                        |          |          |          |                         |                     |                        |
| —股票收益互换   | -        | -        | -        | 549,302,219.08           | -        | -20,773,960.50         | -        | -        | -        | 1,685,397.50            | 1,146.13            | -                      |
| —股票期权     | -        | -        | -        | 405,037,310.00           | -        | -30,783,414.99         | -        | -        | -        | 95,143,080.00           | 7,749,716.14        | -                      |
| —商品期权     | -        | -        | -        | 38,809,447,857.46        | -        | -18,429,277.92         | -        | -        | -        | 358,540,861.78          | -                   | -2,155,537.25          |
| —其他       | -        | -        | -        | 223,817,840.23           | -        | -36,937,778.47         | -        | -        | -        | 490,076,286.90          | -                   | -117,507,927.50        |
| 其他衍生工具    |          |          |          |                          |          |                        |          |          |          |                         |                     |                        |
| 利率互换      | -        | -        | -        | 280,000,000.00           | -        | -                      | -        | -        | -        | -                       | -                   | -                      |
| 商品期货      | -        | -        | -        | 827,681,200.00           | -        | -                      | -        | -        | -        | 164,303,845.00          | -                   | -                      |
| 股指期货      | -        | -        | -        | 1,113,589,740.00         | -        | -                      | -        | -        | -        | 85,703,220.00           | -                   | -                      |
| <b>合计</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>42,208,876,166.77</b> | <b>-</b> | <b>-106,924,431.88</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>1,195,452,691.18</b> | <b>7,750,862.27</b> | <b>-119,663,464.75</b> |

已抵销的衍生金融工具：

适用 不适用

衍生金融工具的说明：

在当日无负债结算制度下，本公司于 2020 年 6 月 30 日及 2019 年 12 月 31 日所有的利率互换及期货合约产生的持仓损益均已结算并包含在结算备付金中。因此，衍生金融资产和衍生金融负债项下的利率互换和期货投资按抵销相关暂收暂付款后的净额列示，金额为零。

## 7、存出保证金

适用 不适用

单位：元

| 项目     | 期末账面余额     |        |                         | 期初账面余额     |        |                       |
|--------|------------|--------|-------------------------|------------|--------|-----------------------|
|        | 外币金额       | 折算率    | 折人民币金额                  | 外币金额       | 折算率    | 折人民币金额                |
| 交易保证金  | /          | /      | 1,561,689,460.50        | /          | /      | 833,571,303.02        |
| 其中：人民币 | /          | /      | 1,559,321,295.50        | /          | /      | 831,239,829.02        |
| 港元     | 500,000.00 | 0.9134 | 456,700.00              | 500,000.00 | 0.8958 | 447,900.00            |
| 美元     | 270,000.00 | 7.0795 | 1,911,465.00            | 270,000.00 | 6.9762 | 1,883,574.00          |
| 信用保证金  | /          | /      | 30,588,918.71           | /          | /      | 16,848,725.44         |
| 其中：人民币 | /          | /      | 30,588,918.71           | /          | /      | 16,848,725.44         |
| 合计     | /          | /      | <b>1,592,278,379.21</b> | /          | /      | <b>850,420,028.46</b> |

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的存出保证金余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

## 8、应收款项

(1) 按明细列示

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末余额                  | 期初余额                  |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 应收业务收入款   | 194,032,262.94        | 199,080,883.89        |
| 应收融资融券客户款 | 16,220,664.75         | 16,004,777.74         |
| 借款保证金     | -                     | 35,811,445.85         |
| 其他        | 14,552,033.07         | 190,521,456.98        |
| 合计        | <b>224,804,960.76</b> | <b>441,418,564.46</b> |
| 减：坏账准备    | 24,170,861.91         | 25,864,394.31         |
| 应收款项账面价值  | <b>200,634,098.85</b> | <b>415,554,170.15</b> |

按账龄分析

单位：元 币种：人民币

| 账龄 | 期末余额 |      | 期初余额 |      |
|----|------|------|------|------|
|    | 账面余额 | 坏账准备 | 账面余额 | 坏账准备 |

|           | 金额                    | 比例 (%)        | 金额                   | 比例 (%)       | 金额                    | 比例 (%)        | 金额                   | 比例 (%)      |
|-----------|-----------------------|---------------|----------------------|--------------|-----------------------|---------------|----------------------|-------------|
| 1 年以内     | 142,054,565.54        | 63.19         | 1,938,596.10         | 1.36         | 351,659,907.44        | 79.66         | 2,450,382.39         | 0.70        |
| 1-2 年     | 68,599,712.00         | 30.52         | 9,309,077.10         | 13.57        | 71,854,184.76         | 16.28         | 11,284,680.66        | 15.70       |
| 2-3 年     | 2,277,328.35          | 1.01          | 1,762,849.31         | 77.41        | 7,457,148.33          | 1.69          | 1,682,007.33         | 22.56       |
| 3 年以上     | 11,873,354.87         | 5.28          | 11,160,339.40        | 93.99        | 10,447,323.93         | 2.37          | 10,447,323.93        | 100.00      |
| <b>合计</b> | <b>224,804,960.76</b> | <b>100.00</b> | <b>24,170,861.91</b> | <b>10.75</b> | <b>441,418,564.46</b> | <b>100.00</b> | <b>25,864,394.31</b> | <b>5.86</b> |

**(2) 按计提坏账列示**

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 账龄           | 期末余额                  |               |                      |               | 期初余额                  |               |                      |               |
|--------------|-----------------------|---------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|----------------------|---------------|
|              | 账面余额                  |               | 坏账准备                 |               | 账面余额                  |               | 坏账准备                 |               |
|              | 金额                    | 占账面余额合计比例 (%) | 金额                   | 坏账准备计提比例 (%)  | 金额                    | 占账面余额合计比例 (%) | 金额                   | 坏账准备计提比例 (%)  |
| 单项计提坏账准备:    |                       |               |                      |               |                       |               |                      |               |
| 按单项计提坏账      | 16,900,925.05         | 7.52          | 16,900,925.05        | 100.00        | 17,390,728.70         | 3.94          | 17,390,728.70        | 100.00        |
| <b>单项计小计</b> | <b>16,900,925.05</b>  | <b>7.52</b>   | <b>16,900,925.05</b> | <b>100.00</b> | <b>17,390,728.70</b>  | <b>3.94</b>   | <b>17,390,728.70</b> | <b>100.00</b> |
| 组合计提坏账准备:    |                       |               |                      |               |                       |               |                      |               |
| 按账龄组合计提坏账    | 207,904,035.71        | 92.48         | 7,269,936.86         | 3.50          | 424,027,835.76        | 96.06         | 8,473,665.61         | 2.00          |
| <b>组合小计</b>  | <b>207,904,035.71</b> | <b>92.48</b>  | <b>7,269,936.86</b>  | <b>3.50</b>   | <b>424,027,835.76</b> | <b>96.06</b>  | <b>8,473,665.61</b>  | <b>2.00</b>   |
| <b>合计</b>    | <b>224,804,960.76</b> | <b>100.00</b> | <b>24,170,861.91</b> | <b>10.75</b>  | <b>441,418,564.46</b> | <b>100.00</b> | <b>25,864,394.31</b> | <b>5.86</b>   |

**(3) 期末应收款项中前五名欠款单位**

单位：元 币种：人民币

| 项目                | 期末余额                  | 欠款性质     | 账龄    | 比例%          |
|-------------------|-----------------------|----------|-------|--------------|
| 东兴福兴 59 号定向资产管理合同 | 36,986,301.00         | 资产管理业务收入 | 1 年以内 | 16.45        |
| 滁州惠科光电科技有限公司      | 32,249,572.50         | 债券承销收入   | 1-2 年 | 14.35        |
| 东兴添多利集合资产管理计划     | 22,050,000.00         | 应收清算款    | 1 年以内 | 9.81         |
| 北京市海淀区国有资本经营管理中心  | 9,000,000.00          | 债券承销收入   | 1-2 年 | 4.00         |
| 东兴证券 1 号单一资产管理合同  | 8,084,465.45          | 资产管理业务收入 | 1 年以内 | 3.60         |
| <b>前五名欠款金额合计</b>  | <b>108,370,338.95</b> |          |       | <b>48.21</b> |

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

√ 适用 □ 不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明：

□ 适用 √ 不适用

应收款项其他说明：

(1) 上述应收款项中应收关联方款项请参见第十节附注十三、关联方及关联交易。

(2) 上述应收款项中不存在由买入返售金融资产重分类至本科目的情况。

**9、 应收款项融资**
 适用  不适用

**10、 合同资产**
**(1) 合同资产情况**
 适用  不适用

**(2) 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因**
 适用  不适用

**(3) 本期合同资产计提减值准备情况**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**11、 买入返售金融资产**
**(1) 按业务类别**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 期末账面余额                  | 期初账面余额                  |
|---------------|-------------------------|-------------------------|
| 股票质押式回购       | 4,561,083,538.92        | 5,431,134,140.29        |
| 债券质押式回购       | 2,074,265,286.95        | 671,206,578.40          |
| 债券买断式回购       | 549,522,986.58          | -                       |
| 减：减值准备        | 999,536,699.53          | 918,964,320.68          |
| <b>账面价值合计</b> | <b>6,185,335,112.92</b> | <b>5,183,376,398.01</b> |

**(2) 按金融资产种类**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                  | 期末账面余额                  | 期初账面余额                  |
|---------------------|-------------------------|-------------------------|
| 股票                  | 4,561,083,538.92        | 5,431,134,140.29        |
| 债券                  | 2,623,788,273.53        | 671,206,578.40          |
| 减：减值准备              | 999,536,699.53          | 918,964,320.68          |
| <b>买入返售金融资产账面价值</b> | <b>6,185,335,112.92</b> | <b>5,183,376,398.01</b> |

**(3) 担保物金额**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                 | 期末账面余额            | 期初账面余额            |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| 担保物                | 18,076,592,624.09 | 15,058,405,660.30 |
| 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 | -                 | -                 |



**(4) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 期限        | 期末账面余额                  | 期初账面余额                  |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 一个月内      | 5,293,371,228.99        | 2,627,750,676.40        |
| 一个月至三个月内  | 804,946,120.64          | 108,896,027.45          |
| 三个月至一年内   | 741,561,860.00          | 2,792,551,761.52        |
| 一年以上      | 344,992,602.82          | 573,142,253.32          |
| <b>合计</b> | <b>7,184,871,812.45</b> | <b>6,102,340,718.69</b> |

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

√适用 □不适用

买入返售金融资产使用预期信用损失模型计提减值, 市场波动及业务情况变化导致资产减值余额变动。

买入返售金融资产的说明：

√适用 □不适用

(1) 截止 2020 年 6 月 30 日, 本公司在买入返售业务中收取的担保物无对外出售或再次对外抵押的情况。

(2) 截止 2020 年 6 月 30 日, 股票质押式回购减值准备明细情况如下：

单位：元 币种：人民币

| 风险阶段划分    | 账面余额                    | 减值准备                  | 担保物市值                    |
|-----------|-------------------------|-----------------------|--------------------------|
| 阶段一       | 1,895,642,140.56        | 6,491,314.33          | 9,690,465,125.01         |
| 阶段二       | 630,804,400.39          | 42,482,802.20         | 4,173,661,582.41         |
| 阶段三       | 2,034,636,997.97        | 950,562,583.00        | 1,350,099,255.77         |
| <b>合计</b> | <b>4,561,083,538.92</b> | <b>999,536,699.53</b> | <b>15,214,225,963.19</b> |

单位：元 币种：人民币

| 项目                      | 未来 12 个月预期信用损失      | 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值) | 合计                    |
|-------------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>2020 年 1 月 1 日余额</b> | <b>9,404,360.83</b> | <b>85,707,265.52</b>  | <b>823,852,694.33</b> | <b>918,964,320.68</b> |
| 2020 年 1 月 1 日余额在三阶段的转移 | -                   | -                     | -                     | -                     |
| -转入第一阶段                 | -                   | -                     | -                     | -                     |
| -转入第二阶段                 | -474,109.88         | 474,109.88            | -                     | -                     |
| -转入第三阶段                 | -                   | -26,870,976.11        | 26,870,976.11         | -                     |

|                     |                     |                      |                       |                       |
|---------------------|---------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|
| -本期计提               | 192,560.43          | 9,008,955.48         | 99,838,912.56         | 109,040,428.47        |
| -本期转回               | 2,631,497.05        | 25,836,552.57        | -                     | 28,468,049.62         |
| <b>2020年6月30日余额</b> | <b>6,491,314.33</b> | <b>42,482,802.20</b> | <b>950,562,583.00</b> | <b>999,536,699.53</b> |

(3)于2020年6月30日,股票质押式回购业务已逾期利息原值为人民币50,320,352.85元,相应减值准备为人民币50,320,352.85元,请参见第十节附注七、25其他资产。

(4)于2020年6月30日,本公司不存在股票质押式回购业务重分类至其他科目的情况。

## 12、持有待售资产

适用 不适用

**13、交易性金融资产**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 期末余额      |                           |                           |                          |                           |                           |                          |
|-----------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|--------------------------|
| 类别        | 公允价值                      |                           |                          | 初始成本                      |                           |                          |
|           | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计                   | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 初始成本合计                   |
| 债券        | 3,280,657,214.08          | -                         | 3,280,657,214.08         | 3,177,623,910.37          | -                         | 3,177,623,910.37         |
| 股票        | 3,985,341,690.17          | -                         | 3,985,341,690.17         | 3,454,406,412.85          | -                         | 3,454,406,412.85         |
| 基金        | 8,121,524,998.88          | -                         | 8,121,524,998.88         | 8,179,842,291.61          | -                         | 8,179,842,291.61         |
| 券商资管产品    | 1,978,413,393.53          | -                         | 1,978,413,393.53         | 2,409,316,481.67          | -                         | 2,409,316,481.67         |
| 其他        | 3,108,704,563.21          | -                         | 3,108,704,563.21         | 3,087,247,204.70          | -                         | 3,087,247,204.70         |
| <b>合计</b> | <b>20,474,641,859.87</b>  | <b>-</b>                  | <b>20,474,641,859.87</b> | <b>20,308,436,301.20</b>  | <b>-</b>                  | <b>20,308,436,301.20</b> |
| 期初余额      |                           |                           |                          |                           |                           |                          |
| 类别        | 公允价值                      |                           |                          | 初始成本                      |                           |                          |
|           | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计                   | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 初始成本合计                   |
| 债券        | 5,810,281,403.91          | -                         | 5,810,281,403.91         | 5,751,558,223.92          | -                         | 5,751,558,223.92         |
| 股票        | 5,162,168,286.79          | -                         | 5,162,168,286.79         | 4,742,660,489.89          | -                         | 4,742,660,489.89         |
| 基金        | 3,350,517,820.45          | -                         | 3,350,517,820.45         | 3,306,507,026.98          | -                         | 3,306,507,026.98         |
| 券商资管产品    | 1,557,312,952.29          | -                         | 1,557,312,952.29         | 1,949,478,672.90          | -                         | 1,949,478,672.90         |
| 其他        | 1,690,453,306.82          | -                         | 1,690,453,306.82         | 1,726,634,642.29          | -                         | 1,726,634,642.29         |
| <b>合计</b> | <b>17,570,733,770.26</b>  | <b>-</b>                  | <b>17,570,733,770.26</b> | <b>17,476,839,055.98</b>  | <b>-</b>                  | <b>17,476,839,055.98</b> |

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的描述性说明

□适用 √不适用

其他说明：

√适用□不适用

- 1、 交易性金融资产用于核算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、 于 2020 年 6 月 30 日，本公司交易性金融资产包括融出证券人民币 48,500,760.40 元，详细信息参见附注七、75。
- 3、 于 2020 年 6 月 30 日，本公司交易性金融资产中无持有本公司 5%(含 5%)以上表决权股份的股东作为发行人发行的金融资产。
4. 本公司将部分交易性金融资产作为卖出回购金融资产交易的质押品，详细信息参见附注七、75。
5. 本公司作为管理人以自有资金投资部分资产管理集合计划时承诺自有资金参与份额在计划存续期内不退出。截至 2020 年 6 月 30 日止，本公司持有的上述退出受到限制的集合计划的账面价值总计人民币 140,237,775.85 元(2019 年 12 月 31 日：人民币 179,378,436.25 元)，详见附注七、75。
6. 存在限售期限的交易性金融资产  
截至 2020 年 6 月 30 日止，交易性金融资产存在限售期限证券的公允价值为人民币 227,518,822.93 元。

币种：人民币 单位：元

| 证券代码      | 证券名称 | 公允价值           | 限售解禁日      |
|-----------|------|----------------|------------|
| 601077.SH | 渝农商行 | 238,402.48     | 2020-10-29 |
| 688388.SH | 嘉元科技 | 102,167,782.03 | 2021-7-22  |
| 688058.SH | 宝兰德  | 56,265,645.30  | 2021-11-1  |
| 688555.SH | 泽达易盛 | 68,846,993.12  | 2022-6-23  |

#### 14、 债权投资

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末余额                  |                      |                     |                       | 期初余额                  |                      |                     |                       |
|-----------|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|
|           | 初始成本                  | 利息                   | 减值准备                | 账面价值                  | 初始成本                  | 利息                   | 减值准备                | 账面价值                  |
| 金融债       | 557,174,000.00        | 13,661,703.75        | 1,375,328.15        | 569,460,375.60        | 636,018,000.00        | 16,443,574.44        | 2,372,603.34        | 650,088,971.10        |
| <b>合计</b> | <b>557,174,000.00</b> | <b>13,661,703.75</b> | <b>1,375,328.15</b> | <b>569,460,375.60</b> | <b>636,018,000.00</b> | <b>16,443,574.44</b> | <b>2,372,603.34</b> | <b>650,088,971.10</b> |

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用□不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的债权投资余额显著变动的情况说明：

□适用√不适用

其他说明：

债权投资主要反映期末本公司以摊余成本计量的债权投资的期末账面价值。

### 15、其他债权投资

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末余额                     |                       |                       |                          |                      | 期初余额                     |                       |                       |                          |                       |
|-----------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|----------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|
|           | 初始成本                     | 利息                    | 公允价值变动                | 账面价值                     | 累计减值准备               | 初始成本                     | 利息                    | 公允价值变动                | 账面价值                     | 累计减值准备                |
| 国债        | -                        | -                     | -                     | -                        | -                    | 280,000,000.00           | 1,447,786.30          | 2,080,120.00          | 283,527,906.30           | -                     |
| 地方债       | 2,380,000,000.00         | 85,168,189.04         | 3,627,740.00          | 2,468,795,929.04         | 583,240.94           | 3,980,000,000.00         | 75,949,476.71         | 31,057,820.00         | 4,087,007,296.71         | 8,598,430.87          |
| 金融债       | 881,001,000.00           | 13,044,145.68         | 4,736,201.98          | 898,781,347.66           | 2,335,320.77         | 1,231,001,000.00         | 27,691,845.80         | 19,190,066.62         | 1,277,882,912.42         | 3,133,842.81          |
| 企业债       | 12,334,411,600.00        | 414,120,899.55        | 133,710,449.40        | 12,882,242,948.95        | 82,355,209.87        | 13,539,460,785.20        | 394,462,570.90        | 210,595,306.48        | 14,144,518,662.58        | 82,447,716.02         |
| 其他        | 2,639,153,000.00         | 25,297,128.92         | -14,915,688.10        | 2,649,534,440.82         | 7,538,051.09         | 2,346,500,000.00         | 39,483,863.83         | 9,399,106.30          | 2,395,382,970.13         | 8,307,470.14          |
| <b>合计</b> | <b>18,234,565,600.00</b> | <b>537,630,363.19</b> | <b>127,158,703.28</b> | <b>18,899,354,666.47</b> | <b>92,811,822.67</b> | <b>21,376,961,785.20</b> | <b>539,035,543.54</b> | <b>272,322,419.40</b> | <b>22,188,319,748.14</b> | <b>102,487,459.84</b> |

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用□不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：

□适用√不适用

其他说明：

- 1、其他债权投资主要反映期末本公司分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资的期末账面价值。
- 2、截至 2020 年 6 月 30 日，其他债权投资中用于债券回购质押及转融通担保证券的金额总计为人民币 5,196,992,027.50 元，用于回购质押的金额为人民币 1,733,748,245.98 元，用于债券借贷质押的金额为人民币 1,307,105,280.00 元，详见附注七、75。
- 3、截至 2020 年 6 月 30 日，本公司其他债权投资余额中无持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东作为发行人发行的金融资产。



## 16、其他权益工具投资

### (1) 按项目披露

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 本期                      |                         |                     |
|------------|-------------------------|-------------------------|---------------------|
|            | 初始成本                    | 本期末公允价值                 | 本期确认的股利收入           |
| 非交易性权益工具投资 | 803,327,963.21          | 559,544,330.60          | 2,237,316.85        |
| 证金投资       | 1,858,080,000.00        | 1,849,082,513.35        | -                   |
| <b>合计</b>  | <b>2,661,407,963.21</b> | <b>2,408,626,843.95</b> | <b>2,237,316.85</b> |

### (2) 本期终止确认的其他权益工具

√适用□不适用

由于特定资产不再满足本公司投资目标，本公司处置部分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投资工具，处置金融资产人民币 3,088,458.87 元，持有期间产生的累计损失从其他综合收益转入留存收益。

其他说明：

√适用□不适用

证金投资为本公司与其他若干家证券公司投资于证金公司统一运作的专户。根据相关合约，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。本公司出于非交易性目的对该项投资进行管理。

**17、长期股权投资**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位                      | 期初余额                  | 本期增减变动               |      |                     |                      |            |                     |            |    | 期末余额                  | 减值准备<br>期末余额 |
|----------------------------|-----------------------|----------------------|------|---------------------|----------------------|------------|---------------------|------------|----|-----------------------|--------------|
|                            |                       | 追加投资                 | 减少投资 | 权益法下<br>确认的投<br>资损益 | 其他<br>综合<br>收益<br>调整 | 其他权<br>益变动 | 宣告发放<br>现金股利<br>或利润 | 计提减值<br>准备 | 其他 |                       |              |
| 二、联营企业                     |                       |                      |      |                     |                      |            |                     |            |    |                       |              |
| 共青城博元投资<br>中心(有限合伙)        | 63,809,392.41         | -                    | -    | -                   | -                    | -          | -                   | -          | -  | 63,809,392.41         | -            |
| 上杭兴源股权投<br>资合伙企业(有限<br>合伙) | 150,869,903.02        | -                    | -    | -                   | -                    | -          | -                   | -          | -  | 150,869,903.02        | -            |
| 贵州益年医疗产<br>业投资中心(有限<br>合伙) | 6,600,000.00          | -                    | -    | -                   | -                    | -          | -                   | -          | -  | 6,600,000.00          | -            |
| 绵阳市聚九股权<br>投资中心(有限合<br>伙)  | -                     | 18,000,000.00        | -    | -                   | -                    | -          | -                   | -          | -  | 18,000,000.00         | -            |
| 小计                         | 221,279,295.43        | 18,000,000.00        | -    | -                   | -                    | -          | -                   | -          | -  | 239,279,295.43        | -            |
| <b>合计</b>                  | <b>221,279,295.43</b> | <b>18,000,000.00</b> | -    | -                   | -                    | -          | -                   | -          | -  | <b>239,279,295.43</b> | -            |

## 18、投资性房地产

投资性房地产计量模式

### (1) 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 房屋、建筑物        | 合计            |
|-------------|---------------|---------------|
| 一、账面原值      |               |               |
| 1.期初余额      | 51,519,824.04 | 51,519,824.04 |
| 2.本期增加金额    | -             | -             |
| 3.本期减少金额    | -             | -             |
| 4.期末余额      | 51,519,824.04 | 51,519,824.04 |
| 二、累计折旧和累计摊销 |               |               |
| 1.期初余额      | 22,713,901.61 | 22,713,901.61 |
| 2.本期增加金额    | 1,279,189.92  | 1,279,189.92  |
| (1) 计提或摊销   | 1,279,189.92  | 1,279,189.92  |
| 3.本期减少金额    | -             | -             |
| 4.期末余额      | 23,993,091.53 | 23,993,091.53 |
| 三、减值准备      |               |               |
| 1.期初余额      | -             | -             |
| 2.本期增加金额    | -             | -             |
| 3.本期减少金额    | -             | -             |
| 4.期末余额      | -             | -             |
| 四、账面价值      |               |               |
| 1.期末账面价值    | 27,526,732.51 | 27,526,732.51 |
| 2.期初账面价值    | 28,805,922.43 | 28,805,922.43 |

### (2) 未办妥产权证书的投资性房地产情况：

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

## 19、固定资产

### (1) 固定资产情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 房屋及建筑物         | 交通运输设备        | 电子及通讯设备        | 办公及其他设备       | 合计             |
|------------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------|
| 一、账面原值：    |                |               |                |               |                |
| 1.期初余额     | 231,876,890.92 | 29,760,064.33 | 247,527,038.01 | 21,945,390.23 | 531,109,383.49 |
| 2.本期增加金额   | -              | 1,306,920.15  | 6,070,716.85   | 608,661.39    | 7,986,298.39   |
| (1) 购置     | -              | 1,293,787.12  | 5,913,510.16   | 583,991.64    | 7,791,288.92   |
| (2) 外币报表折算 | -              | 13,133.03     | 157,206.69     | 24,669.75     | 195,009.47     |
| 3.本期减少金额   | -              | 1,858,379.78  | 754,766.19     | 142,820.92    | 2,755,966.89   |
| (1) 处置或报废  | -              | 1,858,379.78  | 754,766.19     | 142,820.92    | 2,755,966.89   |
| 4.期末余额     | 231,876,890.92 | 29,208,604.70 | 252,842,988.67 | 22,411,230.70 | 536,339,714.99 |

|            |                |               |                |               |                |
|------------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------|
| 二、累计折旧     |                |               |                |               |                |
| 1.期初余额     | 118,091,283.41 | 22,445,353.59 | 209,707,244.42 | 15,905,225.89 | 366,149,107.31 |
| 2.本期增加金额   | 5,740,148.10   | 1,191,314.47  | 11,071,983.13  | 1,269,368.03  | 19,272,813.73  |
| (1) 计提     | 5,740,148.10   | 1,178,702.98  | 10,940,633.79  | 1,248,668.93  | 19,108,153.80  |
| (2) 外币报表折算 | -              | 12,611.49     | 131,349.34     | 20,699.10     | 164,659.93     |
| 3.本期减少金额   | -              | 1,247,839.55  | 654,861.04     | -             | 1,902,700.59   |
| (1) 处置或报废  | -              | 1,247,839.55  | 654,861.04     | -             | 1,902,700.59   |
| 4.期末余额     | 123,831,431.51 | 22,388,828.51 | 220,124,366.51 | 17,174,593.92 | 383,519,220.45 |
| 三、减值准备     |                |               |                |               |                |
| 1.期初余额     | -              | -             | -              | -             | -              |
| 2.本期增加金额   | -              | -             | -              | -             | -              |
| (1) 计提     | -              | -             | -              | -             | -              |
| 3.本期减少金额   | -              | -             | -              | -             | -              |
| (1) 处置或报废  | -              | -             | -              | -             | -              |
| 4.期末余额     | -              | -             | -              | -             | -              |
| 四、账面价值     |                |               |                |               |                |
| 1.期末账面价值   | 108,045,459.41 | 6,819,776.19  | 32,718,622.16  | 5,236,636.78  | 152,820,494.54 |
| 2.期初账面价值   | 113,785,607.51 | 7,314,710.74  | 37,819,793.59  | 6,040,164.34  | 164,960,276.18 |

(2) 暂时闲置的固定资产情况

适用  不适用

(3) 通过融资租赁租入的固定资产情况

适用  不适用

(4) 通过经营租赁租出的固定资产

适用  不适用

(5) 未办妥产权证书的固定资产情况

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 账面价值          | 未办妥产权证书的原因             |
|------------------------|---------------|------------------------|
| 莆田市荔城区镇海街道梅园东路38弄5号楼2号 | 14,706,908.50 | 目前办理土地使用权证的手续尚在进行中，详见注 |

其他说明：

适用  不适用

注：根据福建省福州市中级人民法院出具的（2008）榕民破字第2-50号《民事裁定书》，裁定将上述房产过户给买受人东兴证券莆田梅园东路证券营业部。截至目前，该房屋已过户至本公司莆田梅园东路证券营业部名下，办理土地使用权证的手续尚在进行中。

## 20、在建工程

(1) 在建工程情况

适用  不适用

**(2) 重要在建工程项目本期变动情况**
 适用  不适用

**(3) 本期计提在建工程减值准备情况**
 适用  不适用

其他说明

 适用  不适用

**21、使用权资产**
 适用  不适用

**22、无形资产**
**(1) 无形资产情况**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 交易席位          | 软件             | 合计             |
|------------|---------------|----------------|----------------|
| 一、账面原值     |               |                |                |
| 1.期初余额     | 20,342,690.00 | 179,329,869.07 | 199,672,559.07 |
| 2.本期增加金额   | 9,680.00      | 3,388,021.33   | 3,397,701.33   |
| (1) 购置     | -             | 3,110,848.23   | 3,110,848.23   |
| (2) 外币报表折算 | 9,680.00      | 277,173.10     | 286,853.10     |
| 3.本期减少金额   | -             | -              | -              |
| (1) 处置     | -             | -              | -              |
| 4.期末余额     | 20,352,370.00 | 182,717,890.40 | 203,070,260.40 |
| 二、累计摊销     |               |                |                |
| 1.期初余额     | 19,850,000.00 | 147,704,431.87 | 167,554,431.87 |
| 2.本期增加金额   | -             | 11,844,049.44  | 11,844,049.44  |
| (1) 计提     | -             | 11,844,049.44  | 11,844,049.44  |
| (2) 外币报表折算 | -             | -              | -              |
| 3.本期减少金额   | -             | -              | -              |
| (1) 处置     | -             | -              | -              |
| 4.期末余额     | 19,850,000.00 | 159,548,481.31 | 179,398,481.31 |
| 三、减值准备     |               | -              | -              |
| 1.期初余额     | -             | -              | -              |
| 2.本期增加金额   | -             | -              | -              |
| (1) 计提     | -             | -              | -              |
| (2) 外币报表折算 | -             | -              | -              |
| 3.本期减少金额   | -             | -              | -              |
| (1) 处置     | -             | -              | -              |
| 4.期末余额     | -             | -              | -              |
| 四、账面价值     |               |                | -              |

|          |            |               |               |
|----------|------------|---------------|---------------|
| 1.期末账面价值 | 502,370.00 | 23,169,409.09 | 23,671,779.09 |
| 2.期初账面价值 | 492,690.00 | 31,625,437.20 | 32,118,127.20 |

(2) 未办妥产权证书的土地使用权情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

23、商誉

(1) 商誉账面原值

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位名称或形成商誉的事项 | 期初余额                 | 本期增加     | 本期减少     | 期末余额                 |
|-----------------|----------------------|----------|----------|----------------------|
|                 |                      | 企业合并形成的  | 处置       |                      |
| 东兴期货有限责任公司      | 20,000,000.00        | -        | -        | 20,000,000.00        |
| <b>合计</b>       | <b>20,000,000.00</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>20,000,000.00</b> |

(2) 商誉减值准备

适用 不适用

(3) 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息

适用 不适用

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

适用 不适用

(5) 商誉减值测试的影响

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

于 2020 年 6 月 30 日，本公司商誉是因收购东兴期货有限责任公司产生的，原值及净值均为人民币 20,000,000.00 元。

24、递延所得税资产/递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 期末余额             |                | 期初余额             |                |
|--------------|------------------|----------------|------------------|----------------|
|              | 可抵扣暂时性差异         | 递延所得税资产        | 可抵扣暂时性差异         | 递延所得税资产        |
| 未支付的工资余额     | 1,025,766,086.53 | 256,441,521.63 | 1,019,595,612.08 | 254,898,903.02 |
| 金融企业购买营业用房补助 | 1,631,919.00     | 407,979.75     | 1,631,919.00     | 407,979.75     |



|               |                         |                       |                         |                       |
|---------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
| 资产减值准备        | 630,817,071.91          | 157,234,237.22        | 622,298,451.40          | 154,999,468.50        |
| 可抵扣亏损         | 160,006,321.85          | 27,295,919.63         | 253,782,786.98          | 63,168,069.07         |
| 预提费用          | -                       | -                     | 192,045.44              | 48,011.36             |
| 其他            | 1,662,242.56            | 415,560.64            | 10,096,229.15           | 1,807,016.73          |
| 其他权益投资公允价值变动  | 252,781,119.26          | 50,818,987.09         | 192,555,706.86          | 39,863,043.87         |
| 交易性金融资产公允价值变动 | 259,416,764.12          | 64,854,191.03         | 336,239,011.36          | 84,059,752.84         |
| <b>合计</b>     | <b>2,332,081,525.23</b> | <b>557,468,396.99</b> | <b>2,436,391,762.27</b> | <b>599,252,245.14</b> |

**(2) 未经抵销的递延所得税负债**

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目             | 期末余额                  |                      | 期初余额                  |                      |
|----------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
|                | 应纳税暂时性差异              | 递延所得税负债              | 应纳税暂时性差异              | 递延所得税负债              |
| 交易性金融资产公允价值变动  | 230,311,861.70        | 50,208,619.59        | 167,453,151.95        | 29,842,173.67        |
| 其他权益工具投资公允价值变动 | 154,461,116.70        | 38,615,279.19        | 259,335,829.44        | 64,833,957.36        |
| 固定资产折旧年限差异     | 15,462,691.92         | 3,865,672.98         | 17,624,662.48         | 4,406,165.62         |
| <b>合计</b>      | <b>400,235,670.32</b> | <b>92,689,571.76</b> | <b>444,413,643.87</b> | <b>99,082,296.65</b> |

**(3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债**

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 递延所得税资产和负债期末互抵金额 | 抵销后递延所得税资产或负债期末余额 | 递延所得税资产和负债期初互抵金额 | 抵销后递延所得税资产或负债期初余额 |
|---------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|
| 递延所得税资产 | 78,751,904.77    | 478,716,492.22    | 94,906,989.87    | 504,345,255.27    |
| 递延所得税负债 | 78,751,904.77    | 13,937,666.99     | 94,906,989.87    | 4,175,306.78      |

**(4) 未确认递延所得税资产明细**

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目               | 期末余额                  | 期初余额                  |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| 信用减值损失(a)        | 87,551,018.10         | 77,297,732.78         |
| 交易性金融资产公允价值变动(b) | -2,414,702.91         | -34,957,698.25        |
| 可抵扣亏损(c)         | 130,186,572.31        | 71,686,572.31         |
| 其他债权投资公允价值变动(c)  | -                     | 480,915.10            |
| <b>合计</b>        | <b>215,322,887.50</b> | <b>114,507,521.94</b> |

**(5) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

(a)系本公司纳入合并范围内的结构化产品计提的资产减值准备，因财政部和国家税务总局并未出台针对客户资产管理业务所得税纳税问题的具体规定，因此暂时未针对该等减值准备确认递延所得税资产。

(b)系本公司纳入合并范围内的结构化产品持有的该等金融资产的公允价值变动，因财政部和国家税务总局并未出台针对客户资产管理业务所得税纳税问题的具体规定，因此暂时未针对该等公允价值变动确认递延所得税资产。

(c)由于未来能否获得足够的应纳税所得额具有不确定性，本公司之子公司未将该暂时性差异确认为递延所得税资产。

**25、其他资产**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 期末账面价值                | 期初账面价值                |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 委托贷款       | 361,876,760.36        | 357,804,646.13        |
| 其他应收款      | 317,335,485.59        | 438,910,062.68        |
| 预付款项       | 65,301,649.02         | 83,022,755.88         |
| 预缴企业所得税    | 56,385,237.39         | -                     |
| 应收利息       | 50,320,352.85         | 46,945,614.69         |
| 存货         | 26,623,259.70         | 31,807,974.58         |
| 长期待摊费用     | 17,687,697.61         | 26,360,691.36         |
| 待抵扣增值税进项税额 | 16,986,154.33         | 68,210,359.21         |
| 应收退税款      | 3,406,612.25          | -                     |
| 应收股利       | 290,837.42            | 262,158.70            |
| 减：坏账准备     | -76,117,102.52        | -123,423,726.75       |
| <b>合计</b>  | <b>840,096,944.00</b> | <b>929,900,536.48</b> |

(1) 其他应收款按款项性质列示：

 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 款项性质      | 期末账面余额                | 期初账面余额                |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 备用金       | 35,975,830.20         | 6,909,212.66          |
| 押金        | 29,035,070.56         | 27,234,206.43         |
| 应收违约债券款   | 11,695,264.37         | 33,157,253.57         |
| 待赎回基金款    | 16,904,036.29         | -                     |
| 应收清算款     | 183,129,534.12        | 341,829,454.37        |
| 其他        | 40,595,750.05         | 29,779,935.65         |
| 减：坏账准备    | -25,796,749.67        | -75,400,407.18        |
| <b>合计</b> | <b>291,538,735.92</b> | <b>363,509,655.50</b> |

(2) 其他应收款按账龄分析

单位：元 币种：人民币

| 账龄        | 期末余额                  |               |                      |             | 期初余额                  |               |                      |              |
|-----------|-----------------------|---------------|----------------------|-------------|-----------------------|---------------|----------------------|--------------|
|           | 账面余额                  |               | 坏账准备                 |             | 账面余额                  |               | 坏账准备                 |              |
|           | 金额                    | 比例 (%)        | 金额                   | 比例 (%)      | 金额                    | 比例 (%)        | 金额                   | 比例 (%)       |
| 1 年以内     | 259,619,018.14        | 81.82         | 4,293,659.62         | 1.65        | 37,090,685.09         | 8.45          | 513,525.87           | 1.38         |
| 1-2 年     | 21,608,850.87         | 6.81          | 2,134,365.57         | 9.88        | 349,610,690.34        | 79.65         | 34,859,044.17        | 9.97         |
| 2-3 年     | 23,082,247.69         | 7.27          | 13,268,508.24        | 57.48       | 40,991,031.58         | 9.34          | 34,789,127.07        | 84.87        |
| 3 年以上     | 13,025,368.89         | 4.10          | 6,100,216.24         | 46.83       | 11,217,655.67         | 2.56          | 5,238,710.07         | 46.70        |
| <b>合计</b> | <b>317,335,485.59</b> | <b>100.00</b> | <b>25,796,749.67</b> | <b>8.13</b> | <b>438,910,062.68</b> | <b>100.00</b> | <b>75,400,407.18</b> | <b>17.18</b> |

## (3) 其他应收款中前五名欠款单位

单位：元 币种：人民币

| 名称             | 金额                    | 欠款性质  | 账龄    | 占比 (%)       |
|----------------|-----------------------|-------|-------|--------------|
| 银河德睿资本管理有限公司   | 130,000,000.00        | 应收清算款 | 1 年以内 | 40.96        |
| 中国国际金融股份有限公司   | 29,162,000.00         | 应收清算款 | 1 年以内 | 9.19         |
| 中信中证资本管理有限公司   | 14,886,500.00         | 应收清算款 | 1 年以内 | 4.69         |
| 吉林粮食集团收储经销有限公司 | 11,695,264.37         | 违约债券  | 2-3 年 | 3.69         |
| 北京国华京都置业有限公司   | 3,924,978.00          | 房屋押金  | 3 年以上 | 1.24         |
| <b>合计</b>      | <b>189,668,742.37</b> |       |       | <b>59.77</b> |

## (4) 上述其他应收款中无应收持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东的款项。

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

 适用  不适用

详见第十节附注五、10 金融工具。

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

 适用  不适用

本期其他资产余额变动主要是因为部分资产收回，减值准备转回所致。

其他资产的说明：

(1) 上述委托贷款为母公司之香港子公司东兴香港发放的委托贷款。

(2) 应收利息

单位：元 币种：人民币

| 项目       | 2020 年 6 月 30 日 |               |      |
|----------|-----------------|---------------|------|
|          | 账面原值            | 减值准备          | 账面价值 |
| 买入返售金融资产 | 50,320,352.85   | 50,320,352.85 | -    |

**26、 融券业务情况**
 适用  不适用

融券业务违约情况：

 适用  不适用

融券业务的说明：

详见第十节附注七、5 融出资金。

**27、资产减值准备变动表**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 期初余额                    | 本期增加                  | 本期减少                   |          | 期末余额                    |
|--------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|----------|-------------------------|
|              |                         |                       | 转回                     | 转/核销     |                         |
| 融出资金减值准备     | 94,605,625.69           | 20,078,832.65         | -                      | -        | 114,684,458.34          |
| 买入返售金融资产减值准备 | 918,964,320.68          | 136,385,514.46        | -55,813,135.61         | -        | 999,536,699.53          |
| 债权投资减值准备     | 2,372,603.34            | 1,099,706.77          | -2,096,981.96          | -        | 1,375,328.15            |
| 其他债权投资减值准备   | 102,487,459.84          | 10,421,528.04         | -20,097,165.21         | -        | 92,811,822.67           |
| 应收款项坏账准备     | 25,864,394.31           | 252,228.97            | -1,945,761.37          | -        | 24,170,861.91           |
| 其他金融资产减值准备   | 123,423,726.75          | 8,405,192.43          | -55,711,816.66         | -        | 76,117,102.52           |
| <b>合计</b>    | <b>1,267,718,130.61</b> | <b>176,643,003.32</b> | <b>-135,664,860.81</b> | <b>-</b> | <b>1,308,696,273.12</b> |

**28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 金融工具类别       | 期末余额                  |                       |                         |                         |
|--------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
|              | 未来 12 个月预期信用损失        | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)  | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)    | 合计                      |
| 融出资金减值准备     | 73,235,229.86         | 27,535,268.65         | 13,913,959.83           | 114,684,458.34          |
| 应收款项坏账准备     | 11,360.33             | 7,258,576.53          | 16,900,925.05           | 24,170,861.91           |
| 买入返售金融资产减值准备 | 6,491,314.33          | 42,482,802.20         | 950,562,583.00          | 999,536,699.53          |
| 债权投资减值准备     | 1,375,328.15          | -                     | -                       | 1,375,328.15            |
| 其他债权投资减值准备   | 91,652,855.63         | 1,158,967.04          | -                       | 92,811,822.67           |
| 其他金融资产减值准备   | 179,879.15            | 13,855,765.21         | 62,081,458.16           | 76,117,102.52           |
| <b>合计</b>    | <b>172,945,967.45</b> | <b>92,291,379.63</b>  | <b>1,043,458,926.04</b> | <b>1,308,696,273.12</b> |
| 金融工具类别       | 期初余额                  |                       |                         |                         |
|              | 未来 12 个月预期信用损失        | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)  | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)    | 合计                      |
| 融出资金减值准备     | 57,032,482.17         | 26,324,061.16         | 11,249,082.36           | 94,605,625.69           |
| 应收款项坏账准备     | 11,233.39             | 8,462,432.22          | 17,390,728.70           | 25,864,394.31           |
| 买入返售金融资产减值准备 | 9,404,360.83          | 85,707,265.52         | 823,852,694.33          | 918,964,320.68          |
| 债权投资减值准备     | 2,372,603.34          | -                     | -                       | 2,372,603.34            |
| 其他债权投资减值准备   | 102,019,926.20        | 467,533.64            | -                       | 102,487,459.84          |
| 其他金融资产减值准备   | 170,717.10            | 44,148,056.53         | 79,104,953.12           | 123,423,726.75          |
| <b>合计</b>    | <b>171,011,323.03</b> | <b>165,109,349.07</b> | <b>931,597,458.51</b>   | <b>1,267,718,130.61</b> |

**29、短期借款****(1) 短期借款分类**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目   | 期末余额                    | 期初余额                    |
|------|-------------------------|-------------------------|
| 信用借款 | 2,573,063,147.23        | 1,661,802,273.49        |
| 合计   | <b>2,573,063,147.23</b> | <b>1,661,802,273.49</b> |

短期借款分类的说明：

截止 2020 年 6 月 30 日，短期借款折合人民币 2,573,063,147.23 元，系本公司之子公司东兴香港的银团及银行短期信用借款，其中银团信用借款到期日为 2020 年 12 月 18 日，借款本金为美元和港币，借款利率分别为 Libor 美元+2.20%和 Hibor 港币+2.20%(2020 年 6 月 30 日：折合人民币 2,480,833,681.84 元；2019 年 12 月 31 日：折合人民币 1,661,802,273.49 元)；银行信用借款到期日为 2020 年 10 月 2 日，借款本金为港币，借款利率 Hibor 港币+1.80%(2020 年 6 月 30 日：折合人民币 92,229,465.39 元；2019 年无余额)。

**(2) 已逾期未偿还的短期借款情况**

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

**30、应付短期融资款**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 债券名称          | 发行金额                     | 起息日期       | 到期日期      | 票面利率 (%) | 期初余额                    | 本期增加                     | 本期减少                    | 期末余额                    |
|---------------|--------------------------|------------|-----------|----------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 公司债           |                          |            |           |          |                         |                          |                         |                         |
| 19 东兴 F1      | 4,000,000,000.00         | 2019/3/20  | 2020/3/20 | 3.54%    | 4,111,340,273.97        | 30,259,726.03            | 4,141,600,000.00        | -                       |
| 20 东兴 G1      | 2,400,000,000.00         | 2020/6/15  | 2021/6/15 | 2.60%    |                         | 2,402,735,342.47         | -                       | 2,402,735,342.47        |
| <b>小计</b>     | <b>6,400,000,000.00</b>  | /          | /         | /        | <b>4,111,340,273.97</b> | <b>2,432,995,068.50</b>  | <b>4,141,600,000.00</b> | <b>2,402,735,342.47</b> |
| 短期融资券         |                          |            |           |          |                         |                          |                         |                         |
| 19 东兴证券 CP002 | 2,000,000,000.00         | 2019/11/21 | 2020/2/19 | 3.12%    | 2,007,009,315.07        | 8,376,986.30             | 2,015,386,301.37        | -                       |
| 20 东兴证券 CP001 | 3,000,000,000.00         | 2020/2/27  | 2020/5/27 | 2.45%    | -                       | 3,018,073,770.49         | 3,018,073,770.49        | -                       |
| 20 东兴证券 CP002 | 3,000,000,000.00         | 2020/3/19  | 2020/6/17 | 2.08%    | -                       | 3,015,386,301.37         | 3,015,386,301.37        | -                       |
| 20 东兴证券 CP003 | 3,000,000,000.00         | 2020/4/16  | 2020/7/15 | 1.59%    | -                       | 3,009,932,054.79         | -                       | 3,009,932,054.79        |
| 20 东兴证券 CP004 | 2,000,000,000.00         | 2020/5/29  | 2020/8/27 | 1.75%    | -                       | 2,003,164,383.56         | -                       | 2,003,164,383.56        |
| 20 东兴证券 CP005 | 2,000,000,000.00         | 2020/6/19  | 2020/9/17 | 2.24%    | -                       | 2,001,472,876.71         | -                       | 2,001,472,876.71        |
| <b>小计</b>     | <b>15,000,000,000.00</b> | /          | /         | /        | <b>2,007,009,315.07</b> | <b>13,056,406,373.22</b> | <b>8,048,846,373.23</b> | <b>7,014,569,315.06</b> |
| 收益凭证          |                          |            |           |          |                         |                          |                         |                         |
| 金鹏 147 号      | 20,150,000.00            | 2019/8/8   | 2020/2/10 | 3.40%    | 20,424,040.00           | 76,956.44                | 20,500,996.44           | -                       |
| 金鹏 151 号      | 80,666,000.00            | 2019/8/22  | 2020/2/24 | 3.40%    | 81,657,860.30           | 413,275.12               | 82,071,135.42           | -                       |
| 金鹏 160 号      | 150,000.00               | 2019/10/17 | 2020/1/13 | 2.90%    | 150,905.75              | 154.93                   | 151,060.68              | -                       |
| 金鹏 162 号      | 50,000.00                | 2019/10/31 | 2020/2/3  | 2.90%    | 50,246.30               | 135.07                   | 50,381.37               | -                       |
| 金鹏 164 号      | 75,000,000.00            | 2019/11/18 | 2020/8/17 | 3.30%    | 75,298,356.16           | 1,234,109.59             | -                       | 76,532,465.75           |
| 金鹏 165 号      | 50,000,000.00            | 2019/11/18 | 2020/5/18 | 3.10%    | 50,186,849.32           | 590,273.97               | 50,777,123.29           | -                       |



|          |                |            |            |       |                |               |               |                |
|----------|----------------|------------|------------|-------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 金鹏 166 号 | 60,050,000.00  | 2019/11/18 | 2020/2/17  | 3.00% | 60,267,167.12  | 236,909.59    | 60,504,076.71 | -              |
| 金鹏 167 号 | 40,000,000.00  | 2019/11/18 | 2020/1/7   | 2.90% | 40,139,835.62  | 22,246.57     | 40,162,082.19 | -              |
| 金鹏 169 号 | 110,000,000.00 | 2019/11/18 | 2020/11/9  | 3.60% | 110,477,369.86 | 1,974,575.35  | -             | 112,451,945.21 |
| 金鹏 170 号 | 300,000.00     | 2019/11/28 | 2020/1/6   | 2.70% | 300,754.52     | 133.15        | 300,887.67    | -              |
| 金鹏 173 号 | 2,156,000.00   | 2019/12/12 | 2020/1/13  | 2.90% | 2,159,425.97   | 2,226.88      | 2,161,652.85  | -              |
| 金鹏 174 号 | 8,041,000.00   | 2019/12/13 | 2020/2/27  | 3.10% | 8,053,975.75   | 39,610.19     | 8,093,585.94  | -              |
| 金鹏 175 号 | 20,788,000.00  | 2019/12/26 | 2020/1/20  | 2.90% | 20,797,909.90  | 33,032.98     | 20,830,942.88 | -              |
| 金鹏 176 号 | 3,750,000.00   | 2020/1/9   | 2020/2/10  | 2.90% | -              | 3,759,832.19  | 3,759,832.19  | -              |
| 金鹏 177 号 | 1,575,000.00   | 2020/1/9   | 2020/4/6   | 3.00% | -              | 1,586,521.23  | 1,586,521.23  | -              |
| 金鹏 178 号 | 50,000.00      | 2020/1/14  | 2020/10/12 | 3.30% | -              | 50,763.97     | -             | 50,763.97      |
| 金鹏 179 号 | 20,050,000.00  | 2020/1/17  | 2020/10/12 | 3.30% | -              | 20,350,914.79 | -             | 20,350,914.79  |
| 金鹏 180 号 | 20,150,000.00  | 2020/1/23  | 2020/4/20  | 3.00% | -              | 20,297,398.63 | 20,297,398.63 | -              |
| 金鹏 181 号 | 21,960,000.00  | 2020/2/7   | 2020/2/11  | 3.00% | -              | 21,969,024.66 | 21,969,024.66 | -              |
| 金鹏 182 号 | 5,500,000.00   | 2020/2/7   | 2020/2/18  | 3.00% | -              | 5,505,424.66  | 5,505,424.66  | -              |
| 金鹏 183 号 | 4,544,000.00   | 2020/2/7   | 2020/3/10  | 3.10% | -              | 4,556,735.65  | 4,556,735.65  | -              |
| 金鹏 184 号 | 3,281,000.00   | 2020/2/7   | 2020/5/5   | 3.30% | -              | 3,307,400.81  | 3,307,400.81  | -              |
| 金鹏 185 号 | 10,657,000.00  | 2020/2/12  | 2020/2/16  | 3.00% | -              | 10,661,379.59 | 10,661,379.59 | -              |
| 金鹏 186 号 | 5,346,000.00   | 2020/2/12  | 2020/2/23  | 3.00% | -              | 5,351,272.77  | 5,351,272.77  | -              |
| 金鹏 187 号 | 2,247,000.00   | 2020/2/12  | 2020/3/15  | 3.10% | -              | 2,253,297.76  | 2,253,297.76  | -              |
| 金鹏 188 号 | 728,000.00     | 2020/2/12  | 2020/5/10  | 3.30% | -              | 733,857.91    | 733,857.91    | -              |
| 金鹏 189 号 | 29,326,000.00  | 2020/2/14  | 2020/2/18  | 3.00% | -              | 29,338,051.78 | 29,338,051.78 | -              |
| 金鹏 190 号 | 4,603,000.00   | 2020/2/14  | 2020/2/25  | 3.00% | -              | 4,607,539.95  | 4,607,539.95  | -              |
| 金鹏 191 号 | 14,463,000.00  | 2020/2/19  | 2020/2/23  | 3.00% | -              | 14,468,943.70 | 14,468,943.70 | -              |
| 金鹏 192 号 | 2,328,000.00   | 2020/2/19  | 2020/3/1   | 3.00% | -              | 2,330,296.11  | 2,330,296.11  | -              |
| 金鹏 193 号 | 7,991,000.00   | 2020/2/19  | 2020/3/22  | 3.10% | -              | 8,013,396.69  | 8,013,396.69  | -              |
| 金鹏 194 号 | 20,827,000.00  | 2020/2/19  | 2020/5/17  | 3.30% | -              | 20,994,586.02 | 20,994,586.02 | -              |
| 金鹏 195 号 | 27,777,000.00  | 2020/2/21  | 2020/2/25  | 3.00% | -              | 27,788,415.21 | 27,788,415.21 | -              |
| 金鹏 196 号 | 8,497,000.00   | 2020/2/21  | 2020/3/3   | 3.00% | -              | 8,505,380.60  | 8,505,380.60  | -              |
| 金鹏 197 号 | 10,556,000.00  | 2020/2/26  | 2020/3/1   | 3.00% | -              | 10,560,338.08 | 10,560,338.08 | -              |
| 金鹏 198 号 | 6,985,000.00   | 2020/2/26  | 2020/3/8   | 3.00% | -              | 6,991,889.32  | 6,991,889.32  | -              |
| 金鹏 199 号 | 9,256,000.00   | 2020/2/26  | 2020/3/29  | 3.10% | -              | 9,281,942.16  | 9,281,942.16  | -              |

|          |               |           |           |       |   |               |               |            |
|----------|---------------|-----------|-----------|-------|---|---------------|---------------|------------|
| 金鹏 200 号 | 4,926,000.00  | 2020/2/26 | 2020/5/24 | 3.30% | - | 4,965,637.43  | 4,965,637.43  | -          |
| 金鹏 201 号 | 23,128,000.00 | 2020/2/28 | 2020/3/3  | 3.00% | - | 23,137,504.66 | 23,137,504.66 | -          |
| 金鹏 202 号 | 3,156,000.00  | 2020/2/28 | 2020/3/10 | 3.00% | - | 3,159,112.77  | 3,159,112.77  | -          |
| 金鹏 203 号 | 6,557,000.00  | 2020/3/4  | 2020/3/8  | 3.00% | - | 6,559,694.66  | 6,559,694.66  | -          |
| 金鹏 204 号 | 2,142,000.00  | 2020/3/4  | 2020/3/15 | 3.00% | - | 2,144,112.66  | 2,144,112.66  | -          |
| 金鹏 205 号 | 11,856,000.00 | 2020/3/4  | 2020/3/29 | 3.10% | - | 11,882,180.65 | 11,882,180.65 | -          |
| 金鹏 206 号 | 391,000.00    | 2020/3/4  | 2020/5/31 | 3.30% | - | 394,146.21    | 394,146.21    | -          |
| 金鹏 207 号 | 23,383,000.00 | 2020/3/6  | 2020/3/10 | 3.00% | - | 23,392,609.45 | 23,392,609.45 | -          |
| 金鹏 208 号 | 5,242,000.00  | 2020/3/6  | 2020/3/17 | 3.00% | - | 5,247,170.19  | 5,247,170.19  | -          |
| 金鹏 209 号 | 11,590,000.00 | 2020/3/11 | 2020/3/15 | 3.00% | - | 11,594,763.01 | 11,594,763.01 | -          |
| 金鹏 210 号 | 4,750,000.00  | 2020/3/11 | 2020/3/22 | 3.00% | - | 4,754,684.93  | 4,754,684.93  | -          |
| 金鹏 211 号 | 10,181,000.00 | 2020/3/11 | 2020/4/12 | 3.10% | - | 10,209,534.69 | 10,209,534.69 | -          |
| 金鹏 212 号 | 105,000.00    | 2020/3/11 | 2020/6/7  | 3.30% | - | 105,844.89    | 105,844.89    | -          |
| 金鹏 213 号 | 27,962,000.00 | 2020/3/13 | 2020/3/17 | 3.00% | - | 27,973,491.23 | 27,973,491.23 | -          |
| 金鹏 214 号 | 4,357,000.00  | 2020/3/13 | 2020/3/24 | 3.00% | - | 4,361,297.32  | 4,361,297.32  | -          |
| 金鹏 215 号 | 21,568,000.00 | 2020/3/18 | 2020/3/22 | 3.00% | - | 21,576,863.56 | 21,576,863.56 | -          |
| 金鹏 216 号 | 11,766,000.00 | 2020/3/18 | 2020/3/29 | 3.00% | - | 11,777,604.82 | 11,777,604.82 | -          |
| 金鹏 217 号 | 1,700,000.00  | 2020/3/18 | 2020/4/19 | 3.10% | - | 1,704,764.66  | 1,704,764.66  | -          |
| 金鹏 218 号 | 1,199,000.00  | 2020/3/18 | 2020/6/14 | 3.30% | - | 1,208,647.84  | 1,208,647.84  | -          |
| 金鹏 219 号 | 26,899,000.00 | 2020/3/20 | 2020/3/24 | 3.00% | - | 26,910,054.38 | 26,910,054.38 | -          |
| 金鹏 220 号 | 7,831,000.00  | 2020/3/20 | 2020/3/31 | 3.00% | - | 7,838,723.73  | 7,838,723.73  | -          |
| 金鹏 221 号 | 19,074,000.00 | 2020/3/25 | 2020/3/29 | 3.00% | - | 19,081,838.63 | 19,081,838.63 | -          |
| 金鹏 222 号 | 15,195,000.00 | 2020/3/25 | 2020/4/26 | 3.10% | - | 15,237,587.63 | 15,237,587.63 | -          |
| 金鹏 223 号 | 836,000.00    | 2020/3/25 | 2020/6/21 | 3.30% | - | 842,726.94    | 842,726.94    | -          |
| 金鹏 224 号 | 710,000.00    | 2020/3/25 | 2020/9/20 | 3.50% | - | 716,672.05    | -             | 716,672.05 |
| 金鹏 225 号 | 22,328,000.00 | 2020/3/27 | 2020/3/31 | 3.00% | - | 22,337,175.89 | 22,337,175.89 | -          |
| 金鹏 226 号 | 4,222,000.00  | 2020/3/27 | 2020/4/7  | 3.00% | - | 4,226,164.16  | 4,226,164.16  | -          |
| 金鹏 227 号 | 17,607,000.00 | 2020/4/1  | 2020/4/12 | 3.00% | - | 17,624,365.81 | 17,624,365.81 | -          |
| 金鹏 228 号 | 33,944,000.00 | 2020/4/1  | 2020/6/28 | 3.30% | - | 34,217,132.95 | 34,217,132.95 | -          |
| 金鹏 229 号 | 350,000.00    | 2020/4/1  | 2020/9/27 | 3.50% | - | 353,054.11    | -             | 353,054.11 |
| 金鹏 230 号 | 23,169,000.00 | 2020/4/3  | 2020/4/7  | 3.00% | - | 23,178,521.51 | 23,178,521.51 | -          |

|          |                  |           |            |       |   |                  |                  |               |
|----------|------------------|-----------|------------|-------|---|------------------|------------------|---------------|
| 金鹏 231 号 | 18,501,000.00    | 2020/4/3  | 2020/4/14  | 3.00% | - | 18,519,247.56    | 18,519,247.56    | -             |
| 金鹏 232 号 | 20,539,000.00    | 2020/4/8  | 2020/4/12  | 3.00% | - | 20,547,440.68    | 20,547,440.68    | -             |
| 金鹏 233 号 | 5,166,000.00     | 2020/4/8  | 2020/4/19  | 3.00% | - | 5,171,095.23     | 5,171,095.23     | -             |
| 金鹏 234 号 | 2,253,000.00     | 2020/4/8  | 2020/5/10  | 3.10% | - | 2,259,314.57     | 2,259,314.57     | -             |
| 金鹏 235 号 | 1,057,000.00     | 2020/4/8  | 2020/7/5   | 3.30% | - | 1,065,027.41     | -                | 1,065,027.41  |
| 金鹏 236 号 | 21,856,000.00    | 2020/4/10 | 2020/4/14  | 3.00% | - | 21,864,981.92    | 21,864,981.92    | -             |
| 金鹏 237 号 | 13,615,000.00    | 2020/4/10 | 2020/4/21  | 3.00% | - | 13,628,428.49    | 13,628,428.49    | -             |
| 金鹏 238 号 | 22,415,000.00    | 2020/4/15 | 2020/4/19  | 3.00% | - | 22,424,211.64    | 22,424,211.64    | -             |
| 金鹏 239 号 | 7,714,000.00     | 2020/4/15 | 2020/4/26  | 3.00% | - | 7,721,608.33     | 7,721,608.33     | -             |
| 金鹏 240 号 | 6,004,000.00     | 2020/4/15 | 2020/5/17  | 3.10% | - | 6,020,827.65     | 6,020,827.65     | -             |
| 金鹏 241 号 | 5,769,000.00     | 2020/4/15 | 2020/7/12  | 3.30% | - | 5,809,161.72     | -                | 5,809,161.72  |
| 金鹏 242 号 | 22,845,000.00    | 2020/4/17 | 2020/4/21  | 3.00% | - | 22,854,388.26    | 22,854,388.26    | -             |
| 金鹏 243 号 | 19,292,000.00    | 2020/4/17 | 2020/4/28  | 3.00% | - | 19,311,027.73    | 19,311,027.73    | -             |
| 金鹏 244 号 | 32,749,000.00    | 2020/4/22 | 2020/4/26  | 3.00% | - | 32,762,458.49    | 32,762,458.49    | -             |
| 金鹏 245 号 | 8,865,000.00     | 2020/4/22 | 2020/5/24  | 3.10% | - | 8,889,846.29     | 8,889,846.29     | -             |
| 金鹏 246 号 | 1,812,000.00     | 2020/4/22 | 2020/7/19  | 3.30% | - | 1,823,467.73     | -                | 1,823,467.73  |
| 金鹏 247 号 | 23,715,000.00    | 2020/4/24 | 2020/4/28  | 3.00% | - | 23,724,745.89    | 23,724,745.89    | -             |
| 金鹏 248 号 | 26,414,000.00    | 2020/4/24 | 2020/5/5   | 3.00% | - | 26,440,052.16    | 26,440,052.16    | -             |
| 金鹏 249 号 | 48,506,000.00    | 2020/4/29 | 2020/5/10  | 3.00% | - | 48,553,841.53    | 48,553,841.53    | -             |
| 金鹏 250 号 | 28,768,000.00    | 2020/4/29 | 2020/5/31  | 3.10% | - | 28,848,629.22    | 28,848,629.22    | -             |
| 金鹏 251 号 | 2,217,000.00     | 2020/4/29 | 2020/7/26  | 3.30% | - | 2,229,627.79     | -                | 2,229,627.79  |
| 金鹏 252 号 | 20,700,000.00    | 2020/4/23 | 2020/10/25 | 3.50% | - | 20,836,960.27    | -                | 20,836,960.27 |
| 金鹏 253 号 | 49,981,000.00    | 2020/5/8  | 2020/5/12  | 3.00% | - | 50,001,540.14    | 50,001,540.14    | -             |
| 金鹏 254 号 | 49,970,000.00    | 2020/5/8  | 2020/5/19  | 3.00% | - | 50,019,285.48    | 50,019,285.48    | -             |
| 金鹏 255 号 | 50,000,000.00    | 2020/5/13 | 2020/5/17  | 3.00% | - | 50,020,547.95    | 50,020,547.95    | -             |
| 金鹏 256 号 | 50,000,000.00    | 2020/5/13 | 2020/5/24  | 3.00% | - | 50,049,315.07    | 50,049,315.07    | -             |
| 金鹏 257 号 | 16,609,000.00    | 2020/5/13 | 2020/6/14  | 3.10% | - | 16,655,550.70    | 16,655,550.70    | -             |
| 金鹏 258 号 | 5,367,000.00     | 2020/5/13 | 2020/8/9   | 3.30% | - | 5,390,776.55     | -                | 5,390,776.55  |
| 金鹏 259 号 | 50,000,000.00    | 2020/5/15 | 2020/5/19  | 3.00% | - | 50,020,547.95    | 50,020,547.95    | -             |
| 金鹏 260 号 | 45,214,000.00    | 2020/5/15 | 2020/5/26  | 3.00% | - | 45,258,594.63    | 45,258,594.63    | -             |
| 金鹏 261 号 | 1,000,000,000.00 | 2020/5/15 | 2020/5/27  | 1.62% | - | 1,000,576,986.30 | 1,000,576,986.30 | -             |

|          |               |           |            |       |   |               |               |               |
|----------|---------------|-----------|------------|-------|---|---------------|---------------|---------------|
| 金鹏 262 号 | 37,546,000.00 | 2020/5/20 | 2020/5/24  | 3.00% | - | 37,561,429.86 | 37,561,429.86 | -             |
| 金鹏 263 号 | 12,973,000.00 | 2020/5/20 | 2020/5/31  | 3.00% | - | 12,985,795.29 | 12,985,795.29 | -             |
| 金鹏 264 号 | 6,130,000.00  | 2020/5/20 | 2020/6/21  | 3.10% | - | 6,147,180.79  | 6,147,180.79  | -             |
| 金鹏 265 号 | 1,010,000.00  | 2020/5/20 | 2020/8/16  | 3.30% | - | 1,013,835.23  | -             | 1,013,835.23  |
| 金鹏 266 号 | 46,625,000.00 | 2020/5/22 | 2020/5/26  | 3.00% | - | 46,644,160.96 | 46,644,160.96 | -             |
| 金鹏 267 号 | 32,368,000.00 | 2020/5/22 | 2020/6/2   | 3.00% | - | 32,399,924.60 | 32,399,924.60 | -             |
| 金鹏 268 号 | 49,838,000.00 | 2020/5/27 | 2020/5/31  | 3.00% | - | 49,858,481.37 | 49,858,481.37 | -             |
| 金鹏 269 号 | 29,844,000.00 | 2020/5/27 | 2020/6/7   | 3.00% | - | 29,873,435.18 | 29,873,435.18 | -             |
| 金鹏 270 号 | 9,424,000.00  | 2020/5/27 | 2020/6/28  | 3.10% | - | 9,450,413.02  | 9,450,413.02  | -             |
| 金鹏 271 号 | 1,744,000.00  | 2020/5/27 | 2020/8/23  | 3.30% | - | 1,749,518.68  | -             | 1,749,518.68  |
| 金鹏 272 号 | 42,083,000.00 | 2020/5/29 | 2020/6/2   | 3.00% | - | 42,100,294.38 | 42,100,294.38 | -             |
| 金鹏 273 号 | 27,838,000.00 | 2020/5/29 | 2020/6/9   | 3.00% | - | 27,865,456.66 | 27,865,456.66 | -             |
| 金鹏 274 号 | 20,000,000.00 | 2020/5/20 | 2020/11/22 | 3.30% | - | 20,075,945.21 | -             | 20,075,945.21 |
| 金鹏 275 号 | 60,000,000.00 | 2020/5/22 | 2020/8/16  | 2.70% | - | 60,177,534.24 | -             | 60,177,534.24 |
| 金鹏 276 号 | 49,970,000.00 | 2020/6/3  | 2020/6/7   | 3.00% | - | 49,990,535.62 | 49,990,535.62 | -             |
| 金鹏 277 号 | 28,027,000.00 | 2020/6/3  | 2020/6/14  | 3.00% | - | 28,054,643.07 | 28,054,643.07 | -             |
| 金鹏 278 号 | 20,330,000.00 | 2020/6/3  | 2020/7/5   | 3.10% | - | 20,378,346.41 | -             | 20,378,346.41 |
| 金鹏 279 号 | 3,082,000.00  | 2020/6/3  | 2020/8/30  | 3.30% | - | 3,089,802.10  | -             | 3,089,802.10  |
| 金鹏 280 号 | 41,187,000.00 | 2020/6/5  | 2020/6/9   | 3.00% | - | 41,203,926.16 | 41,203,926.16 | -             |
| 金鹏 281 号 | 43,634,000.00 | 2020/6/5  | 2020/6/16  | 3.00% | - | 43,677,036.27 | 43,677,036.27 | -             |
| 金鹏 282 号 | 46,882,000.00 | 2020/6/10 | 2020/6/14  | 3.00% | - | 46,901,266.58 | 46,901,266.58 | -             |
| 金鹏 283 号 | 36,530,000.00 | 2020/6/10 | 2020/6/21  | 3.00% | - | 36,566,029.59 | 36,566,029.59 | -             |
| 金鹏 284 号 | 4,344,000.00  | 2020/6/10 | 2020/7/12  | 3.10% | - | 4,351,747.79  | -             | 4,351,747.79  |
| 金鹏 285 号 | 1,870,000.00  | 2020/6/10 | 2020/9/6   | 3.30% | - | 1,873,550.44  | -             | 1,873,550.44  |
| 金鹏 286 号 | 50,000,000.00 | 2020/6/12 | 2020/6/16  | 3.00% | - | 50,020,547.95 | 50,020,547.95 | -             |
| 金鹏 287 号 | 4,874,000.00  | 2020/6/12 | 2020/7/12  | 3.10% | - | 4,881,865.17  | -             | 4,881,865.17  |
| 金鹏 288 号 | 44,177,000.00 | 2020/6/17 | 2020/6/21  | 2.90% | - | 44,194,549.77 | 44,194,549.77 | -             |
| 金鹏 289 号 | 25,940,000.00 | 2020/6/17 | 2020/6/28  | 2.90% | - | 25,964,731.84 | 25,964,731.84 | -             |
| 金鹏 290 号 | 8,877,000.00  | 2020/6/17 | 2020/7/19  | 3.00% | - | 8,887,214.63  | -             | 8,887,214.63  |
| 金鹏 291 号 | 2,201,000.00  | 2020/6/17 | 2020/9/13  | 3.20% | - | 2,203,701.50  | -             | 2,203,701.50  |
| 金鹏 292 号 | 49,998,000.00 | 2020/6/19 | 2020/6/30  | 2.90% | - | 49,998,000.00 | -             | 49,998,000.00 |

|          |                          |            |           |       |                         |                          |                          |                         |
|----------|--------------------------|------------|-----------|-------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-------------------------|
| 金鹏 293 号 | 47,366,000.00            | 2020/6/24  | 2020/6/28 | 2.90% | -                       | 47,384,816.63            | 47,384,816.63            | -                       |
| 金鹏 294 号 | 14,750,000.00            | 2020/6/24  | 2020/7/5  | 2.90% | -                       | 14,758,203.42            | -                        | 14,758,203.42           |
| 金鹏 295 号 | 3,313,000.00             | 2020/6/24  | 2020/7/26 | 3.00% | -                       | 3,314,906.11             | -                        | 3,314,906.11            |
| 金鹏 296 号 | 8,858,000.00             | 2020/6/24  | 2020/9/20 | 3.20% | -                       | 8,863,436.14             | -                        | 8,863,436.14            |
| 新客 6 号   | 800,000.00               | 2019/10/9  | 2020/1/7  | 4.50% | 808,284.93              | 690.41                   | 808,975.34               | -                       |
| 新客 7 号   | 700,000.00               | 2019/10/23 | 2020/1/21 | 4.50% | 706,041.10              | 1,812.32                 | 707,853.42               | -                       |
| 新客 8 号   | 1,300,000.00             | 2019/11/6  | 2020/2/4  | 4.50% | 1,308,975.34            | 5,609.59                 | 1,314,584.93             | -                       |
| 新客 9 号   | 700,000.00               | 2019/11/20 | 2020/2/18 | 4.50% | 703,624.66              | 4,228.76                 | 707,853.42               | -                       |
| 新客 10 号  | 900,000.00               | 2019/12/4  | 2020/3/3  | 4.50% | 903,106.85              | 6,990.41                 | 910,097.26               | -                       |
| 新客 11 号  | 700,000.00               | 2019/12/18 | 2020/3/17 | 4.50% | 701,208.22              | 6,645.20                 | 707,853.42               | -                       |
| 新客 12 号  | 1,900,000.00             | 2020/1/8   | 2020/4/7  | 4.50% | -                       | 1,921,316.44             | 1,921,316.44             | -                       |
| 新客 13 号  | 1,950,000.00             | 2020/1/22  | 2020/4/21 | 4.50% | -                       | 1,971,877.40             | 1,971,877.40             | -                       |
| 新客 14 号  | 700,000.00               | 2020/2/5   | 2020/5/5  | 4.50% | -                       | 707,853.42               | 707,853.42               | -                       |
| 新客 15 号  | 1,250,000.00             | 2020/2/19  | 2020/5/19 | 4.50% | -                       | 1,264,023.97             | 1,264,023.97             | -                       |
| 新客 16 号  | 1,900,000.00             | 2020/3/4   | 2020/6/2  | 4.50% | -                       | 1,921,316.44             | 1,921,316.44             | -                       |
| 新客 17 号  | 1,050,000.00             | 2020/3/18  | 2020/6/16 | 4.50% | -                       | 1,061,780.14             | 1,061,780.14             | -                       |
| 新客 18 号  | 1,550,000.00             | 2020/4/1   | 2020/6/30 | 4.50% | -                       | 1,567,389.73             | 1,567,389.73             | -                       |
| 新客 19 号  | 2,100,000.00             | 2020/4/15  | 2020/7/14 | 4.50% | -                       | 2,119,935.62             | -                        | 2,119,935.62            |
| 新客 20 号  | 2,900,000.00             | 2020/4/29  | 2020/7/28 | 4.50% | -                       | 2,922,524.66             | -                        | 2,922,524.66            |
| 新客 21 号  | 2,350,000.00             | 2020/5/13  | 2020/8/11 | 4.50% | -                       | 2,364,196.58             | -                        | 2,364,196.58            |
| 新客 22 号  | 2,150,000.00             | 2020/5/27  | 2020/8/25 | 4.50% | -                       | 2,159,277.40             | -                        | 2,159,277.40            |
| 新客 23 号  | 2,100,000.00             | 2020/6/10  | 2020/9/8  | 4.50% | -                       | 2,105,436.99             | -                        | 2,105,436.99            |
| 新客 24 号  | 1,350,000.00             | 2020/6/24  | 2020/9/22 | 4.50% | -                       | 1,351,165.07             | -                        | 1,351,165.07            |
| 小计       | <b>3,677,818,000.00</b>  | /          | /         | /     | <b>475,095,937.67</b>   | <b>3,213,827,796.03</b>  | <b>3,222,672,752.96</b>  | <b>466,250,980.74</b>   |
| 合计       | <b>25,077,818,000.00</b> | /          | /         | /     | <b>6,593,445,526.71</b> | <b>18,703,229,237.75</b> | <b>15,413,119,126.19</b> | <b>9,883,555,638.27</b> |

**31、拆入资金**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末账面余额               | 期初账面余额               |
|-----------|----------------------|----------------------|
| 转融通融入资金   | 50,933,992.37        | 51,218,083.59        |
| <b>合计</b> | <b>50,933,992.37</b> | <b>51,218,083.59</b> |

转融通融入资金：

 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 剩余期限      | 期末                   |       | 期初                   |       |
|-----------|----------------------|-------|----------------------|-------|
|           | 余额                   | 利率区间  | 余额                   | 利率区间  |
| 1 个月以内    | 50,933,992.37        | 3.25% | 51,218,083.59        | 4.30% |
| 1 至 3 个月  | -                    | -     | -                    | -     |
| 3 至 12 个月 | -                    | -     | -                    | -     |
| 1 年以上     | -                    | -     | -                    | -     |
| <b>合计</b> | <b>50,933,992.37</b> | /     | <b>51,218,083.59</b> | /     |

**32、交易性金融负债**

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 类别        | 期末公允价值                    |                           |                      | 期初公允价值                    |                           |                      |
|-----------|---------------------------|---------------------------|----------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------|
|           | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 合计                   | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 合计                   |
| 收益凭证      | 26,222,233.11             | -                         | 26,222,233.11        | 40,945,748.36             | -                         | 40,945,748.36        |
| <b>合计</b> | <b>26,222,233.11</b>      | <b>-</b>                  | <b>26,222,233.11</b> | <b>40,945,748.36</b>      | <b>-</b>                  | <b>40,945,748.36</b> |

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的描述性说明：

 适用  不适用

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

 适用  不适用

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

 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

收益凭证为本公司发行的融资工具，其对投资者的回报与股票指数的表现相关。



**33、卖出回购金融资产款**
**(1) 按业务类别**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末账面余额                  | 期初账面余额                  |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 买断式卖出回购   | 480,418,432.11          | 499,955,979.74          |
| 质押式卖出回购   | 8,970,240,094.04        | 7,789,215,906.53        |
| <b>合计</b> | <b>9,450,658,526.15</b> | <b>8,289,171,886.27</b> |

**(2) 按金融资产种类**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末账面余额                  | 期初账面余额                  |
|-----------|-------------------------|-------------------------|
| 股票        | -                       | -                       |
| 债券        | 9,450,658,526.15        | 8,289,171,886.27        |
| 其他        | -                       | -                       |
| <b>合计</b> | <b>9,450,658,526.15</b> | <b>8,289,171,886.27</b> |

**(3) 担保物金额**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末账面余额                   | 期初账面余额                  |
|-----------|--------------------------|-------------------------|
| 股票        | -                        | -                       |
| 债券        | 10,405,360,194.01        | 8,644,763,435.16        |
| 其他        | -                        | -                       |
| <b>合计</b> | <b>10,405,360,194.01</b> | <b>8,644,763,435.16</b> |

**(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类**
 适用  不适用

卖出回购金融资产款的说明：

 适用  不适用

本公司为卖出回购业务而设定质押的证券类别及账面价值，详见附注七、75 所有权或使用权受到限制的资产。

**34、代理买卖证券款**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目     | 期末账面余额            | 期初账面余额           |
|--------|-------------------|------------------|
| 普通经纪业务 |                   |                  |
| 其中：个人  | 9,312,066,069.73  | 7,591,003,424.76 |
| 机构     | 2,286,825,114.87  | 1,297,342,040.26 |
| 小计     | 11,598,891,184.60 | 8,888,345,465.02 |
| 信用业务   |                   |                  |

|       |                          |                          |
|-------|--------------------------|--------------------------|
| 其中：个人 | 2,632,996,188.44         | 1,745,959,511.72         |
| 机构    | 218,193,860.58           | 68,342,050.78            |
| 小计    | 2,851,190,049.02         | 1,814,301,562.50         |
| 合计    | <b>14,450,081,233.62</b> | <b>10,702,647,027.52</b> |

### 35、代理承销证券款

适用 不适用

### 36、应付职工薪酬

#### (1) 应付职工薪酬列示

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 期初余额                    | 本期增加                  | 本期减少                  | 期末余额                    |
|-------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 1,036,752,052.01        | 707,907,804.26        | 709,237,017.49        | 1,035,422,838.78        |
| 职工福利费       | -                       | 16,830,751.83         | 16,830,751.83         | -                       |
| 社会保险费       | 432,238.86              | 16,353,279.52         | 16,469,593.35         | 315,925.03              |
| 其中：基本医疗保险费  | 375,109.74              | 15,071,114.37         | 15,173,557.15         | 272,666.96              |
| 工伤保险费       | 16,798.11               | 118,380.02            | 120,972.26            | 14,205.87               |
| 生育保险费       | 40,331.01               | 1,163,785.13          | 1,175,063.94          | 29,052.20               |
| 住房公积金       | 37,998.15               | 31,441,394.17         | 31,447,412.29         | 31,980.03               |
| 设定提存计划      | 713,804.37              | 33,372,311.47         | 33,503,839.49         | 582,276.35              |
| 其中：养老保险费    | 625,243.90              | 10,121,570.97         | 10,255,087.51         | 491,727.36              |
| 失业保险费       | 77,143.80               | 419,358.82            | 427,404.96            | 69,097.66               |
| 企业年金        | 11,416.67               | 22,831,381.68         | 22,821,347.02         | 21,451.33               |
| 工会经费和职工教育经费 | 46,680.23               | 3,890,071.64          | 2,142,743.88          | 1,794,007.99            |
| 辞退福利        | -                       | 756,929.12            | 756,929.12            | -                       |
| 企业补充医疗保险    | 13,468.04               | 44,512.01             | 44,512.01             | 13,468.04               |
| 其他          | 137,460.43              | 629,573.21            | 629,593.21            | 137,440.43              |
| 合计          | <b>1,038,133,702.09</b> | <b>811,226,627.23</b> | <b>811,062,392.67</b> | <b>1,038,297,936.65</b> |

#### (2) 短期薪酬列示

适用 不适用

#### (3) 设定提存计划列示

适用 不适用

公司设定提存计划列示数据详见第十节附注七、36（1）应付职工薪酬列示。

按照中国有关法规，母公司及子公司的职工参加了由当地劳动和社会保障部门组织实施的社会基本养老保险和失业保险，母公司及子公司以当地规定的社会基本养老保险和失业保险的缴纳基数和比例，向当地社会基本养老保险和失业保险经办机构缴纳保险费。

除了以上基本养老保险和失业保险计划外，母公司为符合条件的职工设立了企业年金计划，按上年职工工资总额的一定比例提取年金计划供款。

其他说明：

适用 不适用

**37、 应交税费**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 期末余额                  | 期初余额                 |
|---------------|-----------------------|----------------------|
| 增值税           | 33,866,838.87         | 23,083,495.89        |
| 企业所得税         | 60,517,684.78         | 5,589,090.11         |
| 城市维护建设税       | 2,375,406.96          | 2,922,459.08         |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 2,010,452.18          | 2,187,439.68         |
| 代扣代缴税费        | 87,561,633.31         | 15,040,069.29        |
| 其他            | 348,193.05            | 307,101.03           |
| <b>合计</b>     | <b>186,680,209.15</b> | <b>49,129,655.08</b> |

**38、 应付款项**
**(1) 应付款项列示**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 期末余额                    | 期初余额                  |
|-------------|-------------------------|-----------------------|
| 应付保证金       | 1,457,744,623.34        | 100,795,843.06        |
| 应付投资者保护基金   | 9,820,687.90            | 8,397,545.72          |
| 应付产品销售费用    | 24,213,147.49           | 32,583,369.66         |
| 应付交易所交易单元费  | 11,613,947.02           | 10,782,131.08         |
| 应付三方存管业务手续费 | 15,136,155.72           | 5,012,472.72          |
| 应付经纪人佣金     | 2,627,620.45            | 5,670,854.31          |
| 应付证券清算款     | 178,087,856.94          | 41,100,000.00         |
| 其他          | 57,789,658.32           | 28,789,156.64         |
| <b>合计</b>   | <b>1,757,033,697.18</b> | <b>233,131,373.19</b> |

**(2) 应付票据**
 适用  不适用

其他说明：

 适用  不适用

**39、 合同负债**
**(1) 合同负债情况**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末余额                 | 期初余额       |
|-----------|----------------------|------------|
| 手续费及佣金预收款 | 2,131,361.73         |            |
| 销售货物预收款   | 9,407,410.00         |            |
| <b>合计</b> | <b>11,538,771.73</b> | <b>不适用</b> |

**(2) 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 变动金额 | 变动原因 |
|----|------|------|
|    |      |      |

|           |                      |         |
|-----------|----------------------|---------|
| 手续费及佣金预收款 | 2,131,361.73         | 执行新收入准则 |
| 销售货物预收款   | 9,407,410.00         | 执行新收入准则 |
| <b>合计</b> | <b>11,538,771.73</b> | /       |

其他说明：

适用  不适用

2020年1月1日施行新收入准则，合同负债主要涉及本公司投行业务预收款及销售货物收取的预收款。预收款在合同签订时收取，合同的相关收入在本公司履行履约义务后确认。

#### 40、持有待售负债

适用  不适用

#### 41、预计负债

适用  不适用

#### 42、长期借款

##### (1) 长期借款分类

适用  不适用

其他说明，包括利率区间：

适用  不适用

**43、应付债券**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 债券类型      | 面值        | 起息日期       | 到期日期      | 发行金额                 | 票面利率 (%) | 期初余额                     | 本期增加                    | 本期减少                    | 期末余额                     |
|-----------|-----------|------------|-----------|----------------------|----------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|
| 次级债       |           |            |           |                      |          |                          |                         |                         |                          |
| 17 东兴 01  | 100       | 2017/3/20  | 2020/3/20 | 3,000,000,000.00     | 5.00%    | 3,117,945,205.48         | 32,054,794.52           | 3,150,000,000.00        | -                        |
| 19 东兴 C1  | 100       | 2019/4/22  | 2022/4/22 | 2,000,000,000.00     | 4.20%    | 2,051,379,322.83         | 43,227,121.56           | 84,000,000.00           | 2,010,606,444.39         |
| 20 东兴 C1  | 100       | 2020/5/21  | 2023/5/21 | 2,000,000,000.00     | 3.40%    | -                        | 2,008,162,465.17        | 9,433,962.26            | 1,998,728,502.91         |
| <b>小计</b> | /         | /          | /         | /                    | /        | <b>5,169,324,528.31</b>  | <b>2,083,444,381.25</b> | <b>3,243,433,962.26</b> | <b>4,009,334,947.30</b>  |
| 公司债       |           |            |           |                      |          |                          |                         |                         |                          |
| 16 东兴债    | 100       | 2016/1/13  | 2021/1/13 | 2,800,000,000.00     | 3.03%    | 236,741,940.80           | 3,474,983.64            | 6,969,060.6             | 233,247,863.84           |
| 17 东兴 02  | 100       | 2017/6/15  | 2020/6/15 | 1,500,000,000.00     | 4.80%    | 1,537,879,727.74         | 34,120,272.26           | 1,572,000,000.00        | -                        |
| 17 东兴 03  | 100       | 2017/6/15  | 2022/6/15 | 900,000,000.00       | 4.99%    | 921,325,200.31           | 22,949,683.64           | 44,910,000.00           | 899,364,883.95           |
| 17 东兴 F2  | 100       | 2017/11/9  | 2020/11/9 | 2,000,000,000.00     | 5.39%    | 2,015,370,131.82         | 53,922,140.09           | -                       | 2,069,292,271.91         |
| 18 东兴 F1  | 100       | 2018/4/12  | 2021/4/12 | 3,000,000,000.00     | 5.37%    | 3,112,983,907.99         | 81,311,094.54           | 161,108,055.00          | 3,033,186,947.53         |
| 18 东兴 F3  | 100       | 2018/4/26  | 2021/4/26 | 1,300,000,000.00     | 5.10%    | 1,343,877,940.04         | 33,494,056.79           | 66,303,315.00           | 1,311,068,681.83         |
| 18 东兴 F4  | 100       | 2018/8/6   | 2021/8/6  | 3,000,000,000.00     | 4.88%    | 3,051,893,638.32         | 75,357,942.62           | -                       | 3,127,251,580.94         |
| 19 东兴 F2  | 100       | 2019/7/12  | 2022/7/12 | 3,000,000,000.00     | 3.98%    | 3,051,875,347.64         | 60,479,834.57           | -                       | 3,112,355,182.21         |
| 东兴 1 优    | 100       | 2018/10/30 | 2020/4/30 | 950,000,000.00       | 4.50%    | 953,841,031.28           | 17,591,918.72           | 971,432,950.00          | -                        |
| 20 东兴 F1  | 100       | 2020/3/17  | 2023/3/17 | 2,000,000,000.00     | 3.20%    | -                        | 2,019,634,519.4         | 9,433,962.26            | 2,010,200,557.14         |
| 境外美元债     | 美元<br>100 | 2019/8/15  | 2024/8/15 | 美元<br>400,000,000.00 | 3.25%    | 2,792,451,779.13         | 110,611,634.77          | 68,854,943.32           | 2,834,208,470.58         |
| <b>小计</b> | /         | /          | /         | /                    | /        | <b>19,018,240,645.07</b> | <b>2,512,948,081.04</b> | <b>2,901,012,286.18</b> | <b>18,630,176,439.93</b> |
| <b>合计</b> | /         | /          | /         | /                    | /        | <b>24,187,565,173.38</b> | <b>4,596,392,462.29</b> | <b>6,144,446,248.44</b> | <b>22,639,511,387.23</b> |

**44、 租赁负债**
 适用  不适用

**45、 递延收益**
 适用  不适用

**46、 其他负债**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 期末账面余额                  | 期初账面余额                  |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 其他应付款                 | 21,875,531.13           | 109,259,107.78          |
| 应付股利                  | 386,114,491.98          | -                       |
| 递延收益                  | 1,631,919.00            | 1,631,919.00            |
| 期货风险准备金               | 13,183,808.28           | 14,024,826.43           |
| 应付纳入合并结构化主体其他权益持有人之款项 | 1,312,491,139.15        | 4,118,704,394.35        |
| <b>合计</b>             | <b>1,735,296,889.54</b> | <b>4,243,620,247.56</b> |

其他应付款按款项性质列示：

 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末余额                 | 期初余额                  |
|-----------|----------------------|-----------------------|
| 代扣五险一金    | 1,905,285.73         | 32,804,864.84         |
| 标准仓单质押业务  | -                    | 10,476,000.00         |
| 应付期权费     | -                    | 5,150,639.22          |
| 应付外部单位往来款 | -                    | 37,375,616.84         |
| 其他        | 19,970,245.40        | 23,451,986.88         |
| <b>合计</b> | <b>21,875,531.13</b> | <b>109,259,107.78</b> |

其他负债的说明：

(1) 于 2020 年 06 月 30 日，应付纳入合并结构化主体其他权益持有人之款项，详见附注三、2 纳入合并范围的结构化主体。

(2) 于 2020 年 06 月 30 日，其他应付款中无应付持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东单位款项。

(3) 2020 年 06 月 03 日，经股东大会批准，母公司作如下现金分红：以总股本 2,757,960,657 股为基数，向全体 A 股股东每 10 股派发现金红利人民币 1.40 元（含税），分配现金红利人民币 386,114,491.98 元，占 2019 年度合并报表归属于母公司所有者净利润的 31.63%。

**47、 股本**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 期初余额 | 本次变动增减（+、-） |    |       |    |    | 期末余额 |
|------|-------------|----|-------|----|----|------|
|      | 发行新股        | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 |      |
|      |             |    |       |    |    |      |



|      |                  |   |   |   |   |   |                  |
|------|------------------|---|---|---|---|---|------------------|
| 股份总数 | 2,757,960,657.00 | - | - | - | - | - | 2,757,960,657.00 |
|------|------------------|---|---|---|---|---|------------------|

#### 48、其他权益工具

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

适用  不适用

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

适用  不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

适用  不适用

其他说明：

适用  不适用

#### 49、资本公积

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 期初余额                    | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额                    |
|------------|-------------------------|------|------|-------------------------|
| 资本溢价（股本溢价） | 9,761,280,999.29        | -    | -    | 9,761,280,999.29        |
| 其他资本公积     | 794,297.58              | -    | -    | 794,297.58              |
| <b>合计</b>  | <b>9,762,075,296.87</b> | -    | -    | <b>9,762,075,296.87</b> |

#### 50、库存股

适用  不适用

**51、其他综合收益**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                | 期初余额                  | 本期发生金额                |                       |                      |                      |                        |                        | 税后归属于母公司            | 税后归属于少数股东             | 期末余额 |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|------------------------|------------------------|---------------------|-----------------------|------|
|                   |                       | 本期所得税前发生额             | 减：所得税费用               | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益   | 减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益 | 合计                     |                        |                     |                       |      |
| 一、不能重分类进损益的其他综合收益 | -139,908,394.84       | -74,286,718.27        | -13,257,879.47        | -                    | -689,260.94          | -60,339,577.86         | -60,339,577.86         | -                   | -200,247,972.70       |      |
| 其他权益工具投资公允价值变动    | -139,908,394.84       | -74,286,718.27        | -13,257,879.47        | -                    | -689,260.94          | -60,339,577.86         | -60,339,577.86         | -                   | -200,247,972.70       |      |
| 二、将重分类进损益的其他综合收益  | 398,255,353.82        | 37,233,303.84         | 2,759,894.49          | 91,838,792.90        | -                    | -57,365,383.55         | -57,365,383.55         | 1,544,378.26        | 340,889,970.27        |      |
| 其他债权投资公允价值变动      | 191,587,235.14        | 3,424,602.78          | 559,451.13            | 78,606,549.21        | -                    | -75,741,397.56         | -75,741,397.56         | -                   | 115,845,837.58        |      |
| 其他债权投资信用减值准备      | 77,074,199.62         | 7,967,354.38          | 2,200,443.36          | 13,232,243.69        | -                    | -7,465,332.67          | -7,465,332.67          | -                   | 69,608,866.95         |      |
| 外币财务报表折算差额        | 129,593,919.06        | 25,841,346.68         | -                     | -                    | -                    | 25,841,346.68          | 25,841,346.68          | 1,544,378.26        | 155,435,265.74        |      |
| <b>其他综合收益合计</b>   | <b>258,346,958.98</b> | <b>-37,053,414.43</b> | <b>-10,497,984.98</b> | <b>91,838,792.90</b> | <b>-689,260.94</b>   | <b>-117,704,961.41</b> | <b>-117,704,961.41</b> | <b>1,544,378.26</b> | <b>140,641,997.57</b> |      |

**52、 盈余公积**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期初余额                    | 本期增加     | 本期减少     | 期末余额                    |
|-----------|-------------------------|----------|----------|-------------------------|
| 法定盈余公积    | 1,105,458,940.88        | -        | -        | 1,105,458,940.88        |
| 任意盈余公积    | 355,231,888.07          | -        | -        | 355,231,888.07          |
| <b>合计</b> | <b>1,460,690,828.95</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>1,460,690,828.95</b> |

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

根据《中华人民共和国公司法》及本公司章程的规定，法定盈余公积金按照本公司当期净利润的10%提取，当法定盈余公积累计额达到本公司注册资本的50%以上时，可不再提取。

**53、 一般风险准备**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期初余额                    | 本期计提     | 本期减少     | 期末余额                    |
|-----------|-------------------------|----------|----------|-------------------------|
| 一般风险准备金   | 1,219,955,756.87        | -        | -        | 1,219,955,756.87        |
| 交易风险准备金   | 1,164,798,126.34        | -        | -        | 1,164,798,126.34        |
| <b>合计</b> | <b>2,384,753,883.21</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>2,384,753,883.21</b> |

**54、 未分配利润**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 本期                      | 上年度                     |
|-----------------------|-------------------------|-------------------------|
| 调整前上期末未分配利润           | 3,668,659,961.30        | 4,152,650,449.20        |
| 调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-） | -                       | -805,884,697.46         |
| 调整后期初未分配利润            | 3,668,659,961.30        | 3,346,765,751.74        |
| 加：本期归属于母公司所有者的净利润     | 786,072,139.81          | 1,220,698,859.37        |
| 减：提取法定盈余公积            | -                       | 122,802,378.22          |
| 提取任意盈余公积              | -                       | 61,401,189.11           |
| 提取一般风险准备              | -                       | 147,559,633.31          |
| 提取交易风险准备金             | -                       | 122,802,378.22          |
| 应付普通股股利               | 386,114,491.98          | 303,375,672.27          |
| 其他                    | 689,260.94              | 140,863,398.68          |
| <b>期末未分配利润</b>        | <b>4,067,928,348.19</b> | <b>3,668,659,961.30</b> |

**55、 利息净收入**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 本期发生额            | 上期发生额            |
|---------------|------------------|------------------|
| 利息收入          | 1,394,990,707.59 | 1,365,493,806.37 |
| 其中：存放金融同业利息收入 | 160,854,472.62   | 148,447,039.36   |

|                        |                       |                       |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 其中：自有资金存款利息收入          | 38,738,410.82         | 47,124,236.59         |
| 客户资金存款利息收入             | 122,116,061.80        | 101,322,802.77        |
| 拆出资金利息收入               | -                     | -                     |
| 融出资金利息收入               | 469,623,449.67        | 349,375,720.38        |
| 买入返售金融资产利息收入           | 146,836,869.41        | 273,241,586.07        |
| 其中：约定购回利息收入            | -                     | -                     |
| 股权质押回购利息收入             | 127,718,208.46        | 265,301,305.89        |
| 债权投资利息收入               | 37,802,822.04         | 34,275,335.84         |
| 其他债权投资利息收入             | 579,833,471.21        | 558,749,312.00        |
| 其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入 | 39,622.64             | 1,404,812.72          |
| 利息支出                   | 930,530,112.77        | 1,076,205,215.00      |
| 其中：短期借款利息支出            | 53,340,712.55         | 74,890,067.45         |
| 应付短期融资款利息支出            | 97,772,814.05         | 67,686,703.94         |
| 拆入资金利息支出               | 21,044,529.52         | 49,706,091.55         |
| 其中：转融通利息支出             | 1,590,248.99          | 5,361,997.20          |
| 卖出回购金融资产款利息支出          | 123,656,459.78        | 204,783,259.31        |
| 其中：报价回购利息支出            | -                     | -                     |
| 代理买卖证券款利息支出            | 26,171,070.06         | 21,444,819.71         |
| 长期借款利息支出               | -                     | 12,398,419.50         |
| 应付债券利息支出               | 535,639,109.83        | 525,166,816.92        |
| 其中：次级债券利息支出            | 83,444,381.25         | 127,783,923.92        |
| 结构化主体其他持有人利息支出         | 69,997,764.06         | 117,558,246.20        |
| 其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出 | 2,907,652.92          | 2,570,790.42          |
| <b>利息净收入</b>           | <b>464,460,594.82</b> | <b>289,288,591.37</b> |

## 56、手续费及佣金净收入

### (1) 手续费及佣金净收入情况

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目              | 本期发生额                   | 上期发生额                   |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>手续费及佣金收入</b> | <b>1,080,055,981.73</b> | <b>1,166,435,271.82</b> |
| 证券经纪业务收入        | 573,591,202.87          | 498,000,085.03          |
| 其中：代理买卖证券业务     | 497,016,113.60          | 446,615,674.13          |
| 交易单元席位租赁        | 58,478,988.81           | 51,144,399.64           |
| 代销金融产品业务        | 18,096,100.46           | 240,011.26              |
| 期货经纪业务收入        | 13,457,524.09           | 13,827,746.04           |
| 投资银行业务收入        | 334,243,362.20          | 455,458,494.02          |
| 其中：证券承销业务       | 265,822,912.99          | 264,617,062.51          |
| 证券保荐业务          | 21,770,840.85           | 40,867,096.94           |
| 财务顾问业务          | 46,649,608.36           | 149,974,334.57          |
| 资产管理业务收入        | 150,151,927.19          | 184,217,796.90          |
| 投资咨询业务收入        | 7,601,307.99            | 13,777,129.21           |
| 其他手续费及佣金收入      | 1,010,657.39            | 1,154,020.62            |
| <b>手续费及佣金支出</b> | <b>139,738,612.94</b>   | <b>120,406,724.11</b>   |
| 证券经纪业务支出        | 134,632,480.87          | 115,959,850.02          |
| 其中：代理买卖证券业务     | 134,632,480.87          | 115,959,850.02          |

|             |                       |                         |
|-------------|-----------------------|-------------------------|
| 期货经纪业务支出    | -                     | -                       |
| 投资银行业务支出    | 5,106,132.07          | 4,316,886.79            |
| 其中：证券承销业务   | 5,106,132.07          | 4,316,886.79            |
| 资产管理业务支出    | -                     | -                       |
| 投资咨询业务支出    | -                     | -                       |
| 其他手续费及佣金支出  | -                     | 129,987.30              |
| <b>合计</b>   | <b>940,317,368.79</b> | <b>1,046,028,547.71</b> |
| 其中：手续费及佣金收入 | 1,080,055,981.73      | 1,166,435,271.82        |
| 手续费及佣金支出    | 139,738,612.94        | 120,406,724.11          |

## (2) 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 本期发生额                | 上期发生额                 |
|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| 并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司 | 10,386,792.45        | 3,954,716.98          |
| 并购重组财务顾问业务净收入--其他     | -                    | 1,622,641.51          |
| 融资类财务顾问业务净收入          | 9,103,773.58         | 4,330,188.68          |
| 其他财务顾问业务净收入           | 27,159,042.33        | 140,066,787.40        |
| <b>合计</b>             | <b>46,649,608.36</b> | <b>149,974,334.57</b> |

## (3) 代理销售金融产品业务

□适用 √不适用

## (4) 资产管理业务

□适用 √不适用

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

## 57、投资收益

### (1) 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目              | 本期发生额                 | 上期发生额                |
|-----------------|-----------------------|----------------------|
| 权益法核算的长期股权投资收益  | -                     | 40,857,186.90        |
| 处置长期股权投资产生的投资收益 | -                     | -                    |
| 金融工具投资收益        | 637,858,171.07        | 39,603,817.32        |
| 其中：持有期间取得的收益    | 344,201,767.31        | 731,191,418.47       |
| —交易性金融工具        | 341,964,450.46        | 728,541,971.38       |
| —其他权益工具投资       | 2,237,316.85          | 2,649,447.09         |
| —衍生金融工具         | -                     | -                    |
| 处置金融工具取得的收益     | 293,656,403.76        | -691,587,601.15      |
| —交易性金融工具        | 166,176,781.13        | -648,679,877.09      |
| —其他债权投资         | 113,154,640.97        | 7,014,767.45         |
| —衍生金融工具         | 14,951,106.45         | -53,087,270.40       |
| —交易性金融负债        | -626,124.79           | 3,164,778.89         |
| <b>合计</b>       | <b>637,858,171.07</b> | <b>80,461,004.22</b> |

**(2) 交易性金融工具投资收益明细表**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 交易性金融工具                   |        | 本期发生额          | 上期发生额           |
|---------------------------|--------|----------------|-----------------|
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 持有期间收益 | 341,964,450.46 | 728,541,971.38  |
|                           | 处置取得收益 | 166,176,781.13 | -648,679,877.09 |
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 持有期间收益 | -              | -               |
|                           | 处置取得收益 | -626,124.79    | 3,164,778.89    |

**58、净敞口套期收益**
 适用  不适用

**59、其他收益**
 适用  不适用

**60、公允价值变动收益**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                           | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 交易性金融资产                      | 72,310,844.39         | 526,338,088.99        |
| 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                      | 308,842.77            | -2,761,370.46         |
| 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                       | 63,400,951.40         | -49,721,493.13        |
| <b>合计</b>                    | <b>136,020,638.56</b> | <b>473,855,225.40</b> |

**61、其他业务收入**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 类别        | 本期发生额                 | 上期发生额               |
|-----------|-----------------------|---------------------|
| 租赁收入      | 465,554.67            | 1,084,418.29        |
| 其他收入      | 339,440,246.47        | 2,811,574.37        |
| <b>合计</b> | <b>339,905,801.14</b> | <b>3,895,992.66</b> |

**62、资产处置收益**
 适用  不适用



**63、税金及附加**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 本期发生额                | 上期发生额                | 计缴标准                  |
|---------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| 城市维护建设税       | 8,104,209.08         | 7,817,439.94         | 按实际缴纳的流转税额的7%或5%计缴    |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 5,809,492.79         | 5,588,923.34         | 按实际缴纳的流转税额的3%或2%或1%计缴 |
| 房产税           | 1,096,123.98         | 1,776,911.91         | 按税法有关规定缴纳             |
| 其他            | 513,349.55           | 436,395.40           | 按税法有关规定缴纳             |
| <b>合计</b>     | <b>15,523,175.40</b> | <b>15,619,670.59</b> | /                     |

**64、业务及管理费**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 本期发生额                   | 上期发生额                 |
|-----------|-------------------------|-----------------------|
| 职工费用      | 811,226,627.23          | 676,844,914.64        |
| 租赁费       | 74,469,577.37           | 78,064,864.09         |
| 折旧摊销费     | 38,496,642.77           | 41,948,096.39         |
| 产品销售及广告费  | 32,700,404.00           | 22,874,482.89         |
| 邮电通讯费     | 18,872,573.87           | 21,560,157.65         |
| 业务宣传及招待费  | 12,723,150.01           | 17,675,805.49         |
| 投资者保护基金   | 9,476,998.22            | 16,200,291.94         |
| 差旅费       | 8,514,804.61            | 13,729,434.45         |
| 其他        | 75,104,030.81           | 103,233,764.13        |
| <b>合计</b> | <b>1,081,584,808.89</b> | <b>992,131,811.67</b> |

**65、信用减值损失**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目             | 本期发生额                | 上期发生额                 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 应收款项信用减值损失     | -1,693,532.40        | 557,588.68            |
| 融出资金信用减值损失     | 20,078,832.65        | 8,993,104.09          |
| 买入返售金融资产信用减值损失 | 80,572,378.85        | -124,197,098.64       |
| 债权投资信用减值损失     | -997,275.19          | -2,412,867.81         |
| 其他债权投资信用减值损失   | -9,675,637.17        | 28,998,982.10         |
| 其他金融资产信用减值损失   | -47,306,624.23       | -1,353,609.78         |
| <b>合计</b>      | <b>40,978,142.51</b> | <b>-89,413,901.36</b> |

**66、其他资产减值损失**

□适用√不适用

**67、其他业务成本**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 类别 | 本期发生额 | 上期发生额 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|           |                       |                     |
|-----------|-----------------------|---------------------|
| 租赁成本      | 1,279,189.92          | 1,279,189.92        |
| 其他成本      | 344,434,236.19        | 925,378.95          |
| <b>合计</b> | <b>345,713,426.11</b> | <b>2,204,568.87</b> |

**68、营业外收入**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 本期发生额               | 上期发生额                | 计入当期非经常性损益的金额       |
|-----------|---------------------|----------------------|---------------------|
| 政府补助      | 1,229,495.48        | 4,501,341.51         | 1,229,495.48        |
| 其他        | 433,814.05          | 66,508,665.33        | 433,814.05          |
| <b>合计</b> | <b>1,663,309.53</b> | <b>71,010,006.84</b> | <b>1,663,309.53</b> |

计入当期损益的政府补助

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 补助项目                                         | 本期发生金额     | 上期发生金额       | 与资产相关/与收益相关 |
|----------------------------------------------|------------|--------------|-------------|
| 上海分公司收到区政府发放重点贡献企业奖励                         | 60,000.00  | -            | 与收益相关       |
| 稳岗补贴                                         | 406,450.48 | -            | 与收益相关       |
| 永安牺和路证券营业部减免房产及土地使用税                         | 17,700.00  | -            | 与收益相关       |
| 烟台营业部收烟台芝罘区金融工作办公室 2017 年新设机构一次性开办费补助        | 500,000.00 | -            | 与收益相关       |
| 东兴香港收到政府发放的一次性防疫抗疫基金现金资助                     | 45,345.00  | -            | 与收益相关       |
| 东兴证券石狮濠江路证券营业部收扶持证券市场发展专项奖励                  | -          | 187,547.17   | 与收益相关       |
| 东兴证券股份有限公司济南分公司济南金融补助资金                      | -          | 106,700.00   | 与收益相关       |
| 东兴证券石狮濠江路证券营业部收扶持证券市场发展专项奖励                  | -          | 25,094.34    | 与收益相关       |
| 东兴证券收到北京市西城区发展和改革委员会-2017 年度重点企业经济社会发展综合贡献奖励 | -          | 1,000,000.00 | 与收益相关       |
| 东兴证券上海虹口区广灵二路证券营业部收到财政补贴                     | 120,000.00 | 80,000.00    | 与收益相关       |
| 东兴证券股份有限公司广州分公司收到财政局划来金融中心建设资金               | -          | 2,000,000.00 | 与收益相关       |
| 东兴证券股份有限公司广州分公司收到天河区高级人才奖励资金                 | -          | 312,000.00   | 与收益相关       |
| 东兴证券上海肇嘉浜路证券营                                | 80,000.00  | 20,000.00    | 与收益相关       |

|                    |                     |                     |       |
|--------------------|---------------------|---------------------|-------|
| 业部收到财政扶持           |                     |                     |       |
| 东兴期货收到上海市虹口区财政绩效奖励 | -                   | 770,000.00          | 与收益相关 |
| <b>合计</b>          | <b>1,229,495.48</b> | <b>4,501,341.51</b> |       |

其他说明：

适用  不适用

#### 69、营业外支出

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 本期发生额               | 上期发生额             | 计入当期非经常性损益的金额       |
|-----------|---------------------|-------------------|---------------------|
| 对外捐赠      | 8,100,000.00        | 124,771.50        | 8,100,000.00        |
| 违约赔偿支出    | 207,254.05          | 73,050.00         | 207,254.05          |
| 其他        | 152,705.25          | 400,108.12        | 152,705.25          |
| <b>合计</b> | <b>8,459,959.30</b> | <b>597,929.62</b> | <b>8,459,959.30</b> |

#### 70、所得税费用

##### (1) 所得税费用表

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 当期所得税费用   | 162,243,299.67        | 31,308,670.38         |
| 递延所得税费用   | 86,457,751.13         | 141,663,450.29        |
| <b>合计</b> | <b>248,701,050.80</b> | <b>172,972,120.67</b> |

##### (2) 会计利润与所得税费用调整过程

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                             | 本期发生额                 |
|--------------------------------|-----------------------|
| 利润总额                           | 1,034,938,329.42      |
| 按法定/适用税率计算的所得税费用               | 258,734,582.34        |
| 非应税收入的影响                       | -80,489,446.22        |
| 子公司适用不同税率的影响                   | 10,994,270.28         |
| 调整以前期间所得税的影响                   | 961,644.41            |
| 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 | 58,499,999.99         |
| <b>所得税费用</b>                   | <b>248,701,050.80</b> |

其他说明：

适用  不适用

#### 71、其他综合收益

适用  不适用

详见第十节附注七、51 其他综合收益。

**72、现金流量表项目**
**(1) 收到的其他与经营活动有关的现金**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 往来款的净减少额   | 382,028,945.19        | 38,735,635.43         |
| 存出保证金的净减少额 | -                     | 584,940,383.73        |
| 营业外收入      | 1,663,309.53          | 15,875,240.07         |
| 其他收益       | 2,290,887.32          | -                     |
| 其他业务收入     | 339,905,801.14        | 1,084,418.29          |
| <b>合计</b>  | <b>725,888,943.18</b> | <b>640,635,677.52</b> |

**(2) 支付的其他与经营活动有关的现金**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                 | 本期发生额                   | 上期发生额                 |
|--------------------|-------------------------|-----------------------|
| 纳入合并范围的结构化主体资金投放净额 | 2,842,734,027.16        | 236,277,130.14        |
| 以现金支付的营业费用         | 231,619,983.22          | 445,062,725.72        |
| 其他业务支出             | 344,434,236.19          | -                     |
| 营业外支出              | 8,459,959.30            | 597,929.62            |
| 存出保证金的净增加额         | 741,858,350.75          | -                     |
| <b>合计</b>          | <b>4,169,106,556.62</b> | <b>681,937,785.48</b> |

**(3) 收到的其他与投资活动有关的现金**
 适用  不适用

**(4) 支付的其他与投资活动有关的现金**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 本期发生额                   | 上期发生额    |
|--------------|-------------------------|----------|
| 期限超过三个月的银行存款 | 1,001,190,000.00        | -        |
| <b>合计</b>    | <b>1,001,190,000.00</b> | <b>-</b> |

**(5) 收到的其他与筹资活动有关的现金**
 适用  不适用

**(6) 支付的其他与筹资活动有关的现金**
 适用  不适用

**73、现金流量表补充资料**
**(1) 现金流量表补充资料**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 补充资料                             | 本期金额                     | 上期金额                    |
|----------------------------------|--------------------------|-------------------------|
| <b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>       |                          |                         |
| 净利润                              | 786,237,278.62           | 864,227,600.53          |
| 加：信用减值损失/资产减值准备                  | 40,978,142.51            | -89,413,901.36          |
| 固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧          | 19,108,153.80            | 23,730,629.24           |
| 无形资产摊销                           | 11,844,049.44            | 10,428,256.45           |
| 长期待摊费用摊销                         | 7,544,439.53             | 7,789,210.70            |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列） | -89,759.40               | -8,313.88               |
| 公允价值变动损失（收益以“-”号填列）              | -136,020,638.56          | -473,855,225.40         |
| 非经营性利息净支出                        | 632,263,345.50           | 680,142,007.81          |
| 汇兑损失                             | -4,532,503.97            | 7,542,431.20            |
| 投资损失（收益以“-”号填列）                  | -226,369,408.59          | -27,373,733.82          |
| 递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）             | 25,628,763.05            | 144,509,603.15          |
| 递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）             | 9,762,360.21             | -2,846,152.86           |
| 经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）            | -5,990,164,038.31        | -2,068,272,389.39       |
| 经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）            | 3,629,337,908.80         | 10,679,058,053.65       |
| <b>经营活动产生的现金流量净额</b>             | <b>-1,194,471,907.37</b> | <b>9,755,658,076.02</b> |

**(2) 本期支付的取得子公司的现金净额**

□适用 √不适用

**(3) 本期收到的处置子公司的现金净额**

□适用 √不适用

**(4) 现金和现金等价物的构成**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 期末余额                     | 期初余额                     |
|-----------------------|--------------------------|--------------------------|
| 一、现金                  | 12,422,161,486.79        | 10,140,849,521.63        |
| 其中：库存现金               | 7,079.10                 | 6,825.69                 |
| 可随时用于支付的银行存款          | 12,422,154,407.69        | 10,140,842,695.94        |
| 二、现金等价物               | 4,105,306,147.28         | 3,007,472,418.97         |
| 结算备付金                 | 4,105,306,147.28         | 3,007,472,418.97         |
| <b>三、期末现金及现金等价物余额</b> | <b>16,527,467,634.07</b> | <b>13,148,321,940.60</b> |

其他说明：

√适用□不适用

现金及现金等价物不包含母公司和子公司持有的原始期限超过三个月的银行存款。

#### 74、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

□适用√不适用

#### 75、所有权或使用权受到限制的资产

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末账面价值                  | 受限原因                |
|-----------|-------------------------|---------------------|
| 交易性金融资产   | 148,826,222.93          | 回购质押                |
| 交易性金融资产   | 1,072,064,944.00        | 债券回购质押及转融通担保        |
| 交易性金融资产   | 71,416,780.00           | 债券借贷质押              |
| 交易性金融资产   | 48,500,760.40           | 已融出证券               |
| 交易性金融资产   | 227,518,822.93          | 存在限售期               |
| 交易性金融资产   | 140,237,775.85          | 自有资金参与质押集合计划退出受合同限制 |
| 其他债权投资    | 5,196,992,027.50        | 债券回购质押及转融通担保        |
| 其他债权投资    | 1,733,748,245.98        | 回购质押                |
| 其他债权投资    | 1,307,105,280.00        | 债券借贷质押              |
| <b>合计</b> | <b>9,946,410,859.59</b> | /                   |

#### 76、外币货币性项目

(1). 外币货币性项目：

√适用□不适用

单位：元

| 项目    | 期末外币余额         | 折算汇率   | 期末折算人民币余额        |
|-------|----------------|--------|------------------|
| 货币资金  |                |        |                  |
| 其中：美元 | 262,537,118.82 | 7.0795 | 1,858,631,532.69 |
| 港币    | 564,870,791.61 | 0.9134 | 515,952,981.05   |
| 欧元    | 500.00         | 7.7991 | 3,899.55         |
| 结算备付金 |                |        |                  |
| 其中：美元 | 2,662,019.66   | 7.0795 | 18,845,768.18    |
| 港币    | 11,349,280.85  | 0.9134 | 10,366,433.13    |
| 存出保证金 |                |        |                  |
| 其中：美元 | 270,000.00     | 7.0795 | 1,911,465.00     |
| 港币    | 500,000.00     | 0.9134 | 456,700.00       |
| 应付债券  |                |        |                  |
| 其中：美元 | 400,340,203.49 | 7.0795 | 2,834,208,470.58 |
| 短期借款  |                |        |                  |
| 其中：美元 | 280,304,507.01 | 7.0795 | 1,984,415,757.38 |
| 港币    | 644,457,400.76 | 0.9134 | 588,647,389.85   |

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

√适用 □不适用

东兴香港主要经营地为香港特别行政区, 因主要业务发生在香港, 记账本位币为港币。

## 77、套期

□适用 √不适用

## 78、政府补助

### (1) 政府补助基本情况

√适用 □不适用

详见第十节财务报告附注七、68 营业外收入计入当期损益的政府补助。

### (2) 政府补助退回情况

□适用 √不适用

## 79、其他

□适用 √不适用

## 80、金融资产转移

### (1) 回购协议

回购协议指本公司在卖出一项金融资产的同时, 与交易对手约定在未来指定日期以固定价格回购该资产(或与其实质上相同的金融资产)的交易。由于回购价格是固定的, 本公司仍然承担与卖出资产相关的所有权上几乎所有的风险和报酬。卖出的金融资产(在卖出回购期内本公司无法使用)未在财务报表中予以终止确认, 而是被视为相关担保借款的担保物, 因为本公司保留了该等金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬。此外, 本公司就所收到的对价确认一项金融负债。在此类交易中, 交易对手对本公司的追索权均不限于被转让的金融资产。已转移金融资产作为卖出回购金融资产交易的质押品。

### (2) 融出证券

本公司与客户签订协议, 客户以资金或者证券作为质押后, 公司向客户借出证券供其卖出, 同时要求客户在约定的期限内, 买入相同数量和品种的证券归还券商并支付相应的融券费用。在某些情况下, 若相关证券价值上升或下降, 本公司需要向客户归还部分抵押物或者要求客户补足抵押物。由于本公司仍保留有关证券的全部风险, 因此并未于资产负债表终止确认该等证券。

### (3) 融资融券收益权资产证券化

本公司以融资融券收益权为底层资产开展资产证券化业务。对于该等资产证券化业务, 本公司保留了相关信贷资产的风险和报酬, 故未对该部分证券化的信贷资产进行终止确认资产。

### (4) 下表列示了并未终止确认的已转移金融资产及相关负债的账面价值:

单位: 元 币种: 人民币

| 2020年6月30日 |         |        |      |    |
|------------|---------|--------|------|----|
| 项目         | 交易性金融资产 | 其他债权投资 | 融出资金 | 合计 |
|            |         |        |      |    |



|           |                         |                          |          |                       |
|-----------|-------------------------|--------------------------|----------|-----------------------|
| 转移资产的账面值  | 1,340,808,707.33        | 8,237,845,553.48         | -        | 9,578,654,260.81      |
| 相关负债的账面值  | 169,998,578.50          | 9,279,992,567.26         | -        | 9,449,991,145.76      |
| <b>合计</b> | <b>1,170,810,128.83</b> | <b>-1,042,147,013.78</b> | <b>-</b> | <b>128,663,115.05</b> |

单位：元 币种：人民币

| 2019 年 12 月 31 日 |                       |                       |                      |                         |
|------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-------------------------|
| 项目               | 交易性金融资产               | 其他债权投资                | 融出资金                 | 合计                      |
| 转移资产的账面值         | 932,702,439.72        | 8,630,373,152.13      | 1,036,410,233.86     | 10,599,485,825.71       |
| 相关负债的账面值         | 402,872,975.16        | 7,886,298,911.11      | 953,841,031.28       | 9,243,012,917.55        |
| <b>合计</b>        | <b>529,829,464.56</b> | <b>744,074,241.02</b> | <b>82,569,202.58</b> | <b>1,356,472,908.16</b> |

#### 八、资产证券化业务的会计处理

 适用  不适用

#### 九、合并范围的变更

##### 1、非同一控制下企业合并

 适用  不适用

##### 2、同一控制下企业合并

 适用  不适用

##### 3、反向购买

 适用  不适用

#### 4、 处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

适用 不适用

#### 5、 其他原因的合并范围变动

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

适用 不适用

详见第十节附注三、2 合并财务报表范围。

#### 6、 其他

适用 不适用

**十、在其他主体中的权益**
**1、在子公司中的权益**
**(1) 企业公司的构成**

√适用□不适用

| 子公司名称                   | 主要经营地      | 注册地        | 业务性质                               | 持股比例(%) |        | 取得方式         |
|-------------------------|------------|------------|------------------------------------|---------|--------|--------------|
|                         |            |            |                                    | 直接      | 间接     |              |
| 东兴期货有限责任公司              | 上海市        | 上海市        | 金融业                                | 100.00  |        | 非同一控制下企业合并取得 |
| 东兴证券投资有限公司              | 福建省平潭综合实验区 | 福建福州市平潭县   | 投资                                 | 100.00  |        | 通过设立或投资取得    |
| 东兴资本投资管理有限公司            | 北京市        | 深圳市前海深港合作区 | 投资管理                               | 100.00  |        | 通过设立或投资取得    |
| 深圳东兴成长投资管理合伙企业(有限合伙)[1] | 北京市        | 深圳市        | 投资管理                               |         | 99.99  | 通过设立或投资取得    |
| 共青城东兴智铭投资管理合伙企业(有限合伙)   | 上海市        | 江西共青城      | 基金管理平台                             |         | 55.00  | 通过设立或投资取得    |
| 上海伴兴实业发展有限公司            | 上海市        | 上海市        | 投资管理                               |         | 100.00 | 通过设立或投资取得    |
| 上海东策盛资产管理有限公司           | 上海市        | 上海市浦东新区    | 投资管理                               |         | 100.00 | 通过设立或投资取得    |
| 东兴基金管理有限公司[2]           | 北京市        | 北京市        | 公开募集基金管理、销售                        | 100.00  |        | 通过设立或投资取得    |
| 东兴证券(香港)金融控股有限公司        | 香港特别行政区    | 香港特别行政区    | 投资管理                               | 100.00  |        | 通过设立或投资取得    |
| 东兴证券(香港)有限公司            | 香港特别行政区    | 香港特别行政区    | 证券交易、就证券提供意见、就机构融资提供意见             |         | 94.52  | 同一控制下企业合并取得  |
| 东兴证券(香港)财务有限公司          | 香港特别行政区    | 香港特别行政区    | 放债人牌照                              |         | 100.00 | 通过设立或投资取得    |
| 东兴信息服务(深圳)有限公司          | 深圳市前海      | 深圳市前海      | 经济信息咨询、实业项目投资咨询(以上均不含限制项目), 市场营销策划 |         | 100.00 | 通过设立或投资取得    |

|                                             |         |             |                |  |        |           |
|---------------------------------------------|---------|-------------|----------------|--|--------|-----------|
| 东兴证券(香港)资产管理<br>有限公司                        | 香港特别行政区 | 香港特别行政区     | 就证券提供意见、提供资产管理 |  | 100.00 | 通过设立或投资取得 |
| 东兴启航有限公司                                    | 香港特别行政区 | 英属处女群岛(BVI) | 东兴香港投资项目       |  | 100.00 | 通过设立或投资取得 |
| Robust Strength Limited                     | 香港特别行政区 | 英属处女群岛(BVI) | 东兴香港投资项目       |  | 100.00 | 通过设立或投资取得 |
| 勇庭有限公司                                      | 香港特别行政区 | 英属处女群岛(BVI) | 东兴香港投资项目       |  | 100.00 | 通过设立或投资取得 |
| Dongxing AM Segregated<br>Portfolio Company | 香港特别行政区 | 开曼群岛        | 东兴香港投资项目       |  | 100.00 | 通过设立或投资取得 |

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：

(a) 本公司拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响该回报金额。

(b) 公司对“子公司名称”的持股比例为实缴出资比例。

<sup>1</sup> 以实际出资额计算持股比例，工商登记尚未变更；

<sup>2</sup> 截至报告期末，东兴基金尚未取得《经营证券期货业务许可证》，尚未开展相关业务。

**(2) 重要的非全资子公司**
 适用  不适用

**(3) 重要非全资子公司的主要财务信息**
 适用  不适用

**(4) 使用企业公司资产和清偿企业公司债务的重大限制:**
 适用  不适用

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

其他说明:

 适用  不适用

**2、 在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易**
 适用  不适用

**3、 在合营企业或联营企业中的权益**
 适用  不适用

**(1) 重要的合营企业或联营企业**
 适用  不适用

单位: 元 币种: 人民币

| 合营企业或联营企业名称        | 主要经营地 | 注册地    | 业务性质 | 持股比例(%) |        | 对合营企业或联营企业投资的会计处理方法 |
|--------------------|-------|--------|------|---------|--------|---------------------|
|                    |       |        |      | 直接      | 间接     |                     |
| 共青城博元投资中心(有限合伙)    | 上海    | 江西省九江市 | 股权投资 | -       | 21.14% | 长期股权投资权益法           |
| 上杭兴源股权投资合伙企业(有限合伙) | 上海    | 福建省龙岩市 | 股权投资 | -       | 9.70%  | 长期股权投资权益法           |
| 贵州益年医疗产业投资中心(有限合伙) | 上海    | 贵州省贵阳市 | 股权投资 | -       | 20.00% | 长期股权投资权益法           |
| 绵阳市聚九股权投资中心(有限合伙)  | 上海    | 四川省绵阳市 | 股权投资 | -       | 18.75% | 长期股权投资权益法           |

本公司对“合营企业或联营企业名称”的持股比例为实缴出资比例。

**(2) 重要合营企业的主要财务信息**
 适用  不适用

**(3) 重要联营企业的主要财务信息**

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

|                      | 期末余额/本期发生额            |                         |                      |                      | 期初余额/上期发生额            |                         |                      |
|----------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|
|                      | 共青城博元投资中心(有限合伙)       | 上杭兴源股权投资合伙企业(有限合伙)      | 贵州益年医疗产业投资中心(有限合伙)   | 绵阳市聚九股权投资中心(有限合伙)    | 共青城博元投资中心(有限合伙)       | 上杭兴源股权投资合伙企业(有限合伙)      | 贵州益年医疗产业投资中心(有限合伙)   |
| 流动资产                 | 284,867,997.06        | 1,538,197,280.20        | 32,772,710.99        | 96,000,000.00        | 284,863,359.00        | 1,538,222,183.91        | 33,009,663.33        |
| 非流动资产                | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| <b>资产合计</b>          | <b>284,867,997.06</b> | <b>1,538,197,280.20</b> | <b>32,772,710.99</b> | <b>96,000,000.00</b> | <b>284,863,359.00</b> | <b>1,538,222,183.91</b> | <b>33,009,663.33</b> |
| 流动负债                 | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| 非流动负债                | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| <b>负债合计</b>          | <b>-</b>              | <b>-</b>                | <b>-</b>             | <b>-</b>             | <b>-</b>              | <b>-</b>                | <b>-</b>             |
| 少数股东权益               | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| 归属于母公司股东权益           | 284,867,997.06        | 1,538,197,280.20        | 32,772,710.99        | 96,000,000.00        | 284,863,359.00        | 1,538,222,183.91        | 33,009,663.33        |
| 按持股比例计算的净资产份额        | 60,221,094.58         | 149,205,136.18          | 6,554,542.20         | 18,000,000.00        | 60,989,245.17         | 150,782,687.11          | 6,601,932.67         |
| 调整事项                 | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| --商誉                 | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| --内部交易未实现利润          | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| --其他                 | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| 对联营企业权益投资的账面价值       | 63,809,392.41         | 150,869,903.02          | 6,600,000.00         | 18,000,000.00        | 63,809,392.41         | 150,869,903.02          | 6,600,000.00         |
| 存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值 | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| 营业收入                 | 17,961.06             | 3,766.56                | 54,792.70            | -                    | 57,607,759.44         | 414,112,228.51          | -                    |
| 净利润                  | 4,638.06              | -10,747,172.84          | -255,107.30          | -                    | 57,607,542.44         | 403,406,818.79          | -                    |
| 终止经营的净利润             | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| 其他综合收益               | -                     | -                       | -                    | -                    | -                     | -                       | -                    |
| <b>综合收益总额</b>        | <b>4,638.06</b>       | <b>-10,747,172.84</b>   | <b>-255,107.30</b>   | <b>-</b>             | <b>57,607,542.44</b>  | <b>403,406,818.79</b>   | <b>-</b>             |

|                 |   |   |   |   |   |   |   |
|-----------------|---|---|---|---|---|---|---|
| 本年度收到的来自联营企业的股利 | - | - | - | - | - | - | - |
|-----------------|---|---|---|---|---|---|---|



(4) 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

适用 不适用

(5) 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明:

适用 不适用

(6) 合营企业或联营企业发生的超额亏损

适用 不适用

(7) 与合营企业投资相关的未确认承诺

适用 不适用

(8) 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

适用 不适用

4、重要的共同经营

适用 不适用

5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明:

适用 不适用

(1) 本公司发起设立的未纳入合并财务报表的结构化主体的权益

本公司发起的该类结构化主体主要包括资产管理计划、单一资产管理计划和专项资产管理计划、公募基金、私募基金、合伙企业，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本公司对该类结构化主体不具有控制，因此未合并该类结构化主体。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。

截至 2020 年 06 月 30 日本公司发起设立但未纳入合并财务报表的结构化主体中，本公司享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

单位：元 币种：人民币

| 2020 年 6 月 30 日 |                   |                  |                |                  |
|-----------------|-------------------|------------------|----------------|------------------|
| 项目              | 发起规模              | 交易性金融资产          | 长期股权投资         | 最大损失敞口           |
| 集合资产管理计划        | 23,083,139,525.52 | 1,216,970,006.52 | -              | 1,216,970,006.52 |
| 单一资产管理计划        | 32,157,122,155.32 | 30,000,000.00    | -              | 30,000,000.00    |
| 专项资产管理计划        | 16,528,249,860.00 | 124,800,000.00   | -              | 124,800,000.00   |
| 基金              | 8,253,260,395.57  | 1,434,759,559.76 | -              | 1,434,759,559.76 |
| 合伙企业            | 1,409,880,626.41  | -                | 239,279,295.43 | 239,279,295.43   |

|    |                          |                         |                       |                         |
|----|--------------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|
| 合计 | <b>81,431,652,562.82</b> | <b>2,806,529,566.28</b> | <b>239,279,295.43</b> | <b>3,045,808,861.71</b> |
|----|--------------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|

(2) 本公司持有投资的其他未纳入合并财务报表的结构化主体的权益

本公司亦通过投资在部分由关联方或第三方独立机构发起的该类结构化主体中持有权益。

本公司在关联方或第三方独立机构发起设立但未纳入合并财务报表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项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 交易性金融资产                 | 长期股权投资   | 最大损失敞口                  |
|-----------|-------------------------|----------|-------------------------|
| 集合资产管理计划  | 606,643,387.01          | -        | 606,643,387.01          |
| 基金        | 6,686,765,439.12        | -        | 6,686,765,439.12        |
| 理财产品      | 519,208,750.32          | -        | 519,208,750.32          |
| <b>合计</b> | <b>7,812,617,576.45</b> | <b>-</b> | <b>7,812,617,576.45</b> |

除上表列示两种情况外，本公司未有向纳入合并范围或未纳入合并范围结构化主体提供财务支持或其他支持。

## 6、其他

适用 不适用

## 十一、与金融工具相关的风险

适用 不适用

详见附注十七、风险管理。

## 十二、公允价值的披露

### 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 期末公允价值                   |                          |                         |                          |
|-----------------------|--------------------------|--------------------------|-------------------------|--------------------------|
|                       | 第一层次公允价值计量               | 第二层次公允价值计量               | 第三层次公允价值计量              | 合计                       |
| <b>一、持续的公允价值计量</b>    |                          |                          |                         |                          |
| （一）交易性金融资产            |                          |                          |                         |                          |
| -股票                   | 2,567,171,642.86         | -                        | 1,418,170,047.31        | 3,985,341,690.17         |
| -债券                   | 1,970,561,904.56         | 1,310,095,309.52         | -                       | 3,280,657,214.08         |
| -基金                   | 539,171,373.09           | 7,255,019,206.05         | 327,334,419.74          | 8,121,524,998.88         |
| -资管计划                 | -                        | 1,978,413,393.53         | -                       | 1,978,413,393.53         |
| -其他                   | 33,475,389.34            | 2,617,870,176.36         | 457,358,997.51          | 3,108,704,563.21         |
| （二）其他债权投资             |                          |                          |                         |                          |
| -债券                   | 7,835,572,758.51         | 11,063,781,907.96        | -                       | 18,899,354,666.47        |
| （三）其他权益工具投资           |                          |                          |                         |                          |
| -股票                   | 236,245,910.30           | 191,658,741.21           | 131,639,679.09          | 559,544,330.60           |
| -证金投资                 | -                        | -                        | 1,849,082,513.35        | 1,849,082,513.35         |
| <b>持续以公允价值计量的资产总额</b> | <b>13,182,198,978.66</b> | <b>24,416,838,734.63</b> | <b>4,183,585,657.00</b> | <b>41,782,623,370.29</b> |
| （六）交易性金融负债            | -                        | -26,222,233.11           | -                       | -26,222,233.11           |
| （七）衍生金融负债             | -9,571,450.00            | -57,711,738.97           | -39,641,242.91          | -106,924,431.88          |
| <b>持续以公允价值计量的负债总额</b> | <b>-9,571,450.00</b>     | <b>-83,933,972.08</b>    | <b>-39,641,242.91</b>   | <b>-133,146,664.99</b>   |

### 2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

√适用□不适用

对于存在活跃市场的交易性金融资产及负债、其他债权投资、其他权益工具投资，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。

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

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 2020年6月30日公允价值           | 2019年12月31日公允价值          | 估值技术                                                | 输入值 |
|-------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------------------------------------|-----|
| 债务工具        | 12,373,877,217.48        | 18,732,455,115.43        | 中债估值。未来现金流基于合约金额及票面利率估算，并按反映交易对手信用风险的利率折现。          | 不适用 |
| 股票          | 191,658,741.21           | 378,257,353.10           | 市价调整法。公允价值按最近成交价决定。                                 | 不适用 |
| 基金          | 7,255,019,206.05         | 3,201,443,390.15         | 市价组合法。按所投标的金融资产的市值及相关费用决定。                          | 不适用 |
| 资产管理计划      | 1,978,413,393.53         | 1,557,312,952.29         | 市价组合法。按所投标的金融资产的市值及相关费用决定。                          | 不适用 |
| 股票收益互换      | -20,773,960.50           | 1,146.13                 | 公允价值按中国证券交易所报价计算的相关权益证券回报与本公司和交易对手互换协议所协定固定收入的差额决定。 | 不适用 |
| 收益凭证及其他衍生工具 | -63,160,011.58           | -158,453,675.87          | 市价调整法。公允价值按市场报价计算后调整决定。                             | 不适用 |
| 其他          | 2,617,870,176.36         | 901,860,656.29           | 市价组合法。按所投标的金融资产的市值及相关费用决定。                          | 不适用 |
| <b>合计</b>   | <b>24,332,904,762.55</b> | <b>24,612,876,937.52</b> |                                                     |     |

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

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 金融资产 | 2020年6月30日公允价值   | 2019年12月31日公允价值  | 估值技术                      | 输入值     |
|------|------------------|------------------|---------------------------|---------|
| 股票   | 1,549,809,726.40 | 1,468,784,192.13 | 公允价值按可比公司法确定，并给予一定的流动性折扣。 | 流动性折扣   |
| 期权   | -                | 7,749,716.14     | 公允价值按照期权估值模型进行价值核算。       | 隐含波动率   |
| 私募基金 | 327,334,419.74   | 408,552,454.78   | 根据所投资的资产净值，并参照第三方对相关投     | 参照第三方对相 |

|           |                         |                         |                                                            |          |
|-----------|-------------------------|-------------------------|------------------------------------------------------------|----------|
|           |                         |                         | 资组合的估值。                                                    | 关投资组合的估值 |
| 非上市股权     | 457,358,997.51          | 380,040,195.75          | 非上市股权的公允价值按可比公司法确定,并给<br>予一定的流动性折扣,并按反映投资标的信用风<br>险的折现率折现。 | 流动性折扣    |
| 其他        | 1,849,082,513.35        | 1,905,400,248.13        | 折现现金流,未来现金流基于合同约定估算。                                       | 折现率      |
| 金融负债      |                         |                         |                                                            |          |
| 期权        | -39,641,242.91          | -2,155,537.24           | 公允价值按照期权估值模型进行价值核算。                                        | 隐含波动率    |
| <b>合计</b> | <b>4,143,944,414.09</b> | <b>4,168,371,269.69</b> |                                                            |          |

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

适用 不适用

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

适用 不适用

2020 年上半年与 2019 年本公司上述以公允价值计量的项目各层次之间本年没有发生重大第一层次和第二层次之间的转换，也没有发生重大第二层次和第三层次之间的转换，2020 年上半年无由第三层次转入第一层次的以公允价值计量的金融资产（2019 年：无）。

单位：元 币种：人民币

| 本公司                                   | 交易性金融资产                 | 其他权益工具                  | 衍生金融工具                |
|---------------------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------------|
| <b>2020 年 1 月 1 日</b>                 | <b>2,124,470,288.85</b> | <b>2,038,306,801.94</b> | <b>5,594,178.90</b>   |
| 计入其他综合收益(负数)                          | -                       | -57,584,609.50          |                       |
| 计入损益                                  | 13,059,488.44           | -                       | -17,389,615.87        |
| 买入（正数）                                | 70,102,864.59           | -                       | -22,251,627.04        |
| 卖出（负数）                                | -163,441,007.15         | -                       | -5,594,178.90         |
| 转出第三层级（负数）                            | -                       | -                       | -                     |
| 转入第三层级（正数）                            | 158,671,829.83          | -                       | -                     |
| <b>2020 年 6 月 30 日</b>                | <b>2,202,863,464.56</b> | <b>1,980,722,192.44</b> | <b>-39,641,242.91</b> |
| 于 2020 年 6 月 30 日持有资产/负<br>债的总收益/(损失) | -                       | -                       | -                     |

|           |               |                |               |
|-----------|---------------|----------------|---------------|
| -计入损益     | 80,031,647.33 | -              | -4,344,587.08 |
| -计入其他综合收益 | -             | -57,584,609.50 | -             |

**7、 本期内发生的估值技术变更及变更原因**
 适用  不适用

**8、 不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况**
 适用  不适用

本公司管理层认为，除以下项目外，本公司财务报表中按摊余成本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。

2020年6月30日

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 账面价值              | 公允价值              | 差异              | 公允价值计量层次 |
|---------------|-------------------|-------------------|-----------------|----------|
| 应付债券-公司债      | 18,630,176,439.93 | 18,846,466,450.58 | -216,290,010.65 | 第二层次     |
| 应付债券-次级债      | 4,009,334,947.30  | 4,021,756,000.00  | -12,421,052.70  | 第二层次     |
| 应付短期融资款-公司债   | 2,402,735,342.47  | 2,399,577,600.00  | 3,157,742.47    | 第二层次     |
| 应付短期融资款-短期融资券 | 7,014,569,315.06  | 7,010,628,000.00  | 3,941,315.06    | 第二层次     |

2019年12月31日

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 账面价值              | 公允价值              | 差异              | 公允价值计量层次 |
|---------------|-------------------|-------------------|-----------------|----------|
| 应付债券-公司债      | 19,018,240,645.07 | 19,252,092,523.53 | -233,851,878.46 | 第二层次     |
| 应付债券-次级债      | 5,169,324,528.31  | 5,209,677,000.00  | -40,352,471.69  | 第二层次     |
| 应付短期融资款-公司债   | 4,111,340,273.97  | 4,110,792,000.00  | 548,273.97      | 第二层次     |
| 应付短期融资款-短期融资券 | 2,007,009,315.07  | 2,007,370,000.00  | -360,684.93     | 第二层次     |

## 9、其他

适用 不适用

## 十三、关联方及关联交易

### 1、本企业的母公司情况

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 母公司名称          | 注册地 | 业务性质 | 注册资本   | 母公司对本企业的持股比例 (%) | 母公司对本企业的表决权比例 (%) |
|----------------|-----|------|--------|------------------|-------------------|
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 北京市 | 资产管理 | 682.43 | 52.74            | 52.74             |

本企业的母公司情况的说明：

中国东方资产管理股份有限公司前身为中国东方资产管理公司。公司控股股东中国东方是经国务院批准，由财政部、全国社会保障基金理事会共同发起设立的国有大型非银行金融机构。经国务院批准，中国东方资产管理公司于 2016 年 9 月完成整体改制，并由财政部、全国社会保障基金理事会共同发起设立中国东方资产管理股份有限公司，注册资本为人民币 553.63 亿元。2017 年通过引入战略投资者，中国东方资产管理股份有限公司注册资本增加至人民币 682.43 亿元。

本企业最终控制方是财政部。

### 2、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

适用 不适用

本企业子公司的情况详见第十节附注十、1 在子公司中的权益。

### 3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

适用 不适用

本企业重要的合营或联营企业详见第十节附注十、3 在合营企业或联营企业中的权益。

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

适用 不适用

### 4、其他关联方情况

适用 不适用

| 其他关联方名称            | 其他关联方与本企业关系 |
|--------------------|-------------|
| 邦信资产管理有限公司         | 同受母公司最终控制   |
| 北京东富金泓投资管理中心（有限合伙） | 同受母公司最终控制   |
| 北京东银融泰投资管理有限公司     | 同受母公司最终控制   |



|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 大连银行股份有限公司               | 同受母公司最终控制 |
| 东方邦信置业有限公司               | 同受母公司最终控制 |
| 东方邦信资本管理有限公司             | 同受母公司最终控制 |
| 东富（北京）投资管理有限公司           | 同受母公司最终控制 |
| 共青城博元投资中心(有限合伙)          | 同受母公司最终控制 |
| 贵州益年医疗产业投资中心（有限合伙）       | 同受母公司最终控制 |
| 杭州东方邦信赤和股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 同受母公司最终控制 |
| 上海东兴投资控股发展有限公司           | 同受母公司最终控制 |
| 上海丰垠餐饮管理有限公司             | 同受母公司最终控制 |
| 上海瑞丰国际大厦置业有限公司           | 同受母公司最终控制 |
| 上杭兴源股权投资合伙企业（有限合伙）       | 同受母公司最终控制 |
| 石河子东兴博大股权投资合伙企业(有限合伙)    | 同受母公司最终控制 |
| 中国东方资产管理（国际）控股有限公司       | 同受母公司最终控制 |
| 中华联合财产保险股份有限公司           | 同受母公司最终控制 |
| 中华联合人寿保险股份有限公司           | 同受母公司最终控制 |
| 中华联合保险集团股份有限公司           | 同受母公司最终控制 |
| 厦门国际银行股份有限公司             | 其他        |
| 绵阳市聚九股权投资中心（有限合伙）        | 其他        |

其他说明：

适用 不适用

## 5、关联交易情况

### （1）购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 关联方            | 关联交易内容   | 本期发生额        | 上期发生额      |
|----------------|----------|--------------|------------|
| 中华联合财产保险股份有限公司 | 车辆及财产保险  | 1,110,041.04 | 140,846.86 |
| 中华联合财产保险股份有限公司 | 补充医疗保险   | -            | 868,251.97 |
| 中华联合人寿保险股份有限公司 | 补充医疗保险   | 49,765.00    | 127,558.96 |
| 大连银行股份有限公司     | 手续费支出    | 2,233.20     | 1,609.00   |
| 大连银行股份有限公司     | 代销金融产品支出 | 178,874.72   | 11,348.94  |
| 上海瑞丰国际大厦置业有限公司 | 业务及管理费   | 309,087.11   | -          |
| 上海丰垠餐饮管理有限公司   | 业务及管理费   | 138,823.27   | -          |

出售商品/提供劳务情况表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 关联方            | 关联交易内容 | 本期发生额         | 上期发生额         |
|----------------|--------|---------------|---------------|
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 资产管理业务 | 13,349,962.57 | 25,886,565.80 |
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 财务顾问服务 | 5,399,528.30  | 3,039,622.64  |
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 代理买卖证券 | 319,732.12    | 388.76        |
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 证券承销业务 | 2,702,166.41  | 5,139,858.49  |
| 大连银行股份有限公司     | 资产管理业务 | 2,320,963.44  | 4,123,028.75  |
| 大连银行股份有限公司     | 代理买卖证券 | 455,366.49    | 46,628.92     |
| 大连银行股份有限公司     | 财务顾问服务 | 94,339.62     | 1,028,301.89  |
| 大连银行股份有限公司     | 衍生品业务  | 3,666,332.46  | 1,506,639.64  |

|                          |        |              |            |
|--------------------------|--------|--------------|------------|
| 北京东银融泰投资管理有限公司           | 资产管理业务 | -            | 180,178.48 |
| 中国东方资产管理（国际）控股有限公司       | 证券承销业务 | -            | 215,589.95 |
| 东富（北京）投资管理有限公司           | 资产管理业务 | 457,500.00   | 450,000.00 |
| 东方邦信资本管理有限公司             | 财务顾问业务 | -            | 566,037.74 |
| 邦信资产管理有限公司               | 财务顾问业务 | 1,415,094.34 | -          |
| 上海东兴投资控股发展有限公司           | 财务顾问业务 | 3,773,584.91 | -          |
| 北京东富金泓投资管理中心（有限合伙）       | 代理买卖证券 | -            | 211,522.29 |
| 杭州东方邦信赤和股权投资基金合伙企业（有限合伙） | 代理买卖证券 | -            | 16,405.18  |
| 中华联合财产保险股份有限公司           | 代理买卖证券 | 291,011.87   | -          |
| 中华联合财产保险股份有限公司           | 资产管理业务 | 17,277.72    | -          |
| 中华联合保险集团股份有限公司           | 代理买卖证券 | 61,523.03    | -          |
| 中华联合人寿保险股份有限公司           | 代理买卖证券 | 141,200.75   | -          |
| 中华联合人寿保险股份有限公司           | 证券承销业务 | 2,650,943.40 | -          |

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

适用  不适用

### （2）关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表：

适用  不适用

关联托管/承包情况说明：

适用  不适用

本公司委托管理/出包情况表：

适用  不适用

关联管理/出包情况说明：

适用  不适用

### （3）关联租赁情况

本公司作为出租方：

适用  不适用

本公司作为承租方：

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 出租方名称          | 租赁资产种类 | 本期确认的租赁费     | 上期确认的租赁费     |
|----------------|--------|--------------|--------------|
| 中国东方资产管理股份有限公司 | 房屋使用权  | 291,428.58   | 803,500.01   |
| 中华联合财产保险股份有限公司 | 房屋使用权  | 530,587.14   | 528,175.38   |
| 上海瑞丰国际大厦置业有限公司 | 房屋使用权  | 2,875,146.38 | 3,025,853.75 |

关联租赁情况说明

适用  不适用

### （4）关联担保情况

本公司作为担保方

适用  不适用

单位：亿元 币种：美元

| 被担保方 | 担保金额 | 担保起始日 | 担保到期日 | 担保是否已经履行完毕 |
|------|------|-------|-------|------------|
|------|------|-------|-------|------------|

|          |   |           |           |   |
|----------|---|-----------|-----------|---|
| 东兴启航有限公司 | 4 | 2019-8-16 | 2024-8-15 | 否 |
|----------|---|-----------|-----------|---|

本公司作为被担保方

适用 不适用

关联担保情况说明

适用 不适用

2019年8月15日,本公司全资子公司东兴香港旗下境外全资特殊目的公司东兴启航有限公司(Dongxing Voyage Co.,Ltd)于境外完成了总额为4亿美元固定利率高级无抵押债券的发行、债券期限5年,债券票息3.25%,本公司为本期债券全部偿付义务提供保证担保。

(5) 关联方资金拆借

适用 不适用

(6) 关联方资产转让、债务重组情况

适用 不适用

(7) 关键管理人员报酬

适用 不适用

单位:万元 币种:人民币

| 项目       | 本期发生额    | 上期发生额  |
|----------|----------|--------|
| 关键管理人员报酬 | 1,977.88 | 456.28 |

(8) 其他关联交易

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

| 关联方                   | 关联交易内容  | 本期发生额          | 上期发生额          |
|-----------------------|---------|----------------|----------------|
| 中国东方资产管理股份有限公司        | 利息支出    | 288,259.96     | 779,456.97     |
| 大连银行股份有限公司            | 利息收入    | 461,877.36     | 97,285.87      |
| 大连银行股份有限公司            | 银行存款    | 30,488,292.74  | 31,801,492.67  |
| 大连银行股份有限公司            | 交易性金融负债 | -              | 1,713,498.77   |
| 大连银行股份有限公司            | 交易性金融资产 | 50,000,000.00  | -              |
| 中国东方资产管理(国际)控股有限公司    | 利息支出    | -              | 12,030,670.06  |
| 厦门国际银行股份有限公司          | 利息支出    | -              | 22,264.67      |
| 邦信资产管理有限公司            | 交易性金融资产 | 46,348,110.00  | -              |
| 中国东方资产管理(国际)控股有限公司    | 担保费支出   | -              | 6,136,941.86   |
| 石河子东兴博大股权投资合伙企业(有限合伙) | 交易性金融资产 | 41,394,736.84  | 80,000,000.00  |
| 共青城博元投资中心(有限合伙)       | 长期股权投资  | 63,809,392.41  | 56,000,000.00  |
| 上杭兴源股权投资合伙企业(有限合伙)    | 长期股权投资  | 150,869,903.02 | 152,183,394.00 |
| 贵州益年医疗产业投资中心(有限合伙)    | 长期股权投资  | 6,600,000.00   | -              |
| 绵阳市聚九股权投资中心(有限合伙)     | 长期股权投资  | 18,000,000.00  | -              |

6、 关联方应收应付款项

(1) 应收项目

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

| 项目名称  | 关联方            | 期末余额          | 期初余额          |
|-------|----------------|---------------|---------------|
| 其他应收款 | 上海瑞丰国际大厦置业有限公司 | 2,015,678.73  | 2,015,678.73  |
| 应收款项  | 中国东方资产管理股份有限公司 | 37,521,301.00 | 37,646,301.00 |

|       |                |            |            |
|-------|----------------|------------|------------|
| 其他应收款 | 中国东方资产管理股份有限公司 | 52,500.00  | 1,500.00   |
| 其他应收款 | 中华联合财产保险股份有限公司 | 183,612.00 | 183,612.00 |
| 预付款项  | 中华联合人寿保险股份有限公司 | 176,908.00 | -          |

## (2) 应付项目

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目名称    | 关联方            | 期末账面余额         | 期初账面余额       |
|---------|----------------|----------------|--------------|
| 代理买卖证券款 | 中国东方资产管理股份有限公司 | 114,969,133.47 | 471,463.36   |
| 代理买卖证券款 | 邦信资产管理有限公司     | 2,061.43       | 8,340.43     |
| 代理买卖证券款 | 东方邦信置业有限公司     | 4,107.46       | -            |
| 代理买卖证券款 | 东方邦信资本管理有限公司   | -              | 1,625.90     |
| 代理买卖证券款 | 大连银行股份有限公司     | 101,171,961.00 | 2,928,323.61 |
| 交易性金融负债 | 大连银行股份有限公司     | 349,906.16     | -            |

## 7、 关联方承诺

□ 适用 √ 不适用

## 8、 其他

√ 适用 □ 不适用

### 2020 年上半年关联方共同投资情况

(1) 截至 2020 年 6 月 30 日，本公司作为委托人与本公司关联方东方邦信置业有限公司、宁波金融资产管理有限公司共同投资本公司管理的集合资产管理计划总规模 10.49 亿元，其中东方邦信置业有限公司出资本金余额 7.00 亿元；宁波金融资产管理有限公司出资本金余额 1.82 亿元，本公司自有资金出资本金余额 1.67 亿元，上半年自有资金实现投资收益 57.19 万元。

(2) 截至 2020 年 6 月 30 日，本公司作为委托人与本公司关联方大连银行股份有限公司共同投资本公司管理的集合资产管理计划总规模 7.60 亿元，其中大连银行股份有限公司出资本金余额 6.50 亿元，本公司出资本金余额 1.10 亿元，上半年自有资金实现投资收益为 142.00 万元，收取集合资产管理计划管理费 143.00 万元。

### 2020 年上半年其他关联交易

(1) 本公司作为管理人、本公司关联方中国东方资产管理股份有限公司作为原始权益人曾于 2018 年发行“如日 2018 年第一期资产支持专项计划”、“如日 2018 年第二期资产支持专项计划”，曾于 2019 年发行“如日 2019 年第一期资产支持专项计划”，于 2020 年 3 月发行“如日 2020 年第一期资产支持专项计划（疫情防控 abs）”。截至 2020 年 6 月 30 日，“如日 2018 年第一期资产支持专项计划”存续规模 26.90 亿元，中国东方资产管理股份有限公司持有全部次级共计 5.78 亿元；“如日 2018 年第二期资产支持专项计划”存续规模 29.52 亿元，中国东方资产管理股份有限公司持有全部次级共计 1.33 亿元；“如日 2019 年第一期资产支持专项计划”存续规模 33.42 亿元，中国东方资产管理股份有限公司持有全部次级共计 3.00 亿元；“如日 2020 年第一期资产支持专项

计划（疫情防控 abs）”存续规模 50.51 亿元，中国东方资产管理股份有限公司持有全部次级共计 1.01 亿元。

（2）本公司作为管理人、本公司关联方中国东方资产管理股份有限公司作为原始权益人曾于 2019 年发行“煦日 2019 年第二期资产支持专项计划”（已于 2020 年 1 月 10 日结束）、“煦日 2019 年第三期资产支持专项计划”。截至 2020 年 6 月 30 日，“煦日 2019 年第三期资产支持专项计划”存续规模 11.57 亿元，中国东方资产管理股份有限公司持有优先级及次级共计约 0.58 亿元，该专项计划已于 2020 年 7 月 14 日结束。

（3）2016 年 12 月，大业信托有限责任公司委托我司设立东兴鑫智 54 号定向资产管理计划，并投资股票质押式回购项目，我公司于 2020 年 4 月 23 日将该项目债权转让给大业信托有限责任公司，其中债权本金为 7.73 亿元。

（4）2017 年 3 月，中国东方资产管理股份有限公司上海市分公司委托我司设立东兴证券福兴 57 号定向资产管理计划，并通过大连银行股份有限公司上海分行进行委贷放款，我公司于 2020 年 5 月 25 日将该项目债权转让给中国东方资产管理股份有限公司上海市分公司，其中债权本金为 51.60 亿元。

#### 十四、股份支付

##### 1、 股份支付总体情况

适用 不适用

##### 2、 以权益结算的股份支付情况

适用 不适用

##### 3、 以现金结算的股份支付情况

适用 不适用

##### 4、 股份支付的修改、终止情况

适用 不适用

##### 5、 其他

适用 不适用

#### 十五、承诺及或有事项

##### 1、 重要承诺事项

适用 不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

###### （1）资本承诺

于 2020 年 6 月 30 日和 2019 年 12 月 31 日，本公司及母公司无重大对外已签署的资本性支出合约。

## (2) 经营租赁承诺

至资产负债表日止，对外签订的不可撤销的经营租赁合同情况如下：

单位：元 币种：人民币

| 项目               | 本公司                   |                       |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
|                  | 2020年6月30日            | 2019年12月31日           |
| 不可撤销经营租赁的最低租赁付款额 |                       |                       |
| 资产负债表日后第1年       | 157,064,634.56        | 152,171,476.91        |
| 资产负债表日后第2年       | 107,135,015.35        | 112,155,271.31        |
| 资产负债表日后第3年       | 63,368,754.72         | 59,780,811.77         |
| 资产负债表日后第3年以上     | 10,491,393.89         | 42,200,942.42         |
| 合计               | <b>338,059,798.52</b> | <b>366,308,502.41</b> |

## 2、或有事项

## (1) 资产负债表日存在的重要或有事项

适用 不适用

## (2) 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

## 3、其他

适用 不适用

## 十六、资产负债表日后事项

## 1、重要的非调整事项

适用 不适用

本公司于2020年7月24日发行东兴证券股份有限公司2020年度第六期短期融资券，于2020年7月27日在银行间市场上市，发行规模为人民币20亿元，期限为90天，票面利率2.64%。

本公司于2020年8月19日发行东兴证券股份有限公司2020年度第七期短期融资券，于2020年8月20日在银行间市场上市，发行规模为人民币15亿元，期限为90天，票面利率2.64%。

本公司于2020年8月13日发行东兴证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期），于2020年8月19日在上海证券交易所上市。本期债券分为两个品种，品种一的期限为13个月，发行规模为人民币18.5亿元，票面利率3.00%；品种二的期限为3年，发行规模为人民币10亿元，票面利率3.57%。

## 2、利润分配情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 拟分配的利润或股利       | 386,114,491.98 |
| 经审议批准宣告发放的利润或股利 | 386,114,491.98 |

2020年4月28日，经本公司第四届董事会第二十五次会议决议批准，本公司拟作如下现金分红：以总股本2,757,960,657股为基数，向全体A股股东每10股派发现金红利人民币1.40元



(含税)，拟分配现金红利为人民币 386,114,491.98 元，占 2019 年度合并报表归属于母公司所有者净利润的 31.63%。本次分配后剩余可供分配利润结转至下一年度。以上分配方案已于 2020 年 6 月经股东大会审议通过。

公司 2019 年度 A 股现金红利已于 2020 年 7 月 23 日派发完毕。

### 3、 销售退回

适用 不适用

### 4、 其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

## 十七、 风险管理

### 1、 风险管理政策及组织架构

#### (1) 风险管理政策

适用 不适用

本公司成立以来严格按照《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司内部控制指引》等相关法律、法规规章要求，明确了董事会、经理层及各个部门的风险管理职责，建立了全面风险管理组织体系和多防线内部控制机制。本公司通过建立全面风险管理体系，不断优化风险管理的治理架构、风险管理策略、风险监控指标、风险评估流程、风险应对措施、风险报告制度，培育风险文化，使风险识别、监测、评估和控制机制能够有效运行，将风险管理贯穿事前、事中和事后，确保公司风险可测、可控、可承受。本公司根据业务发展特点，尤其对创新业务进行了严格的风险把控，着重在事前和事中进行风险管理，并针对创新业务不断修改、完善相关风险监控指标与风险评估流程，确保公司的风险识别、监测、评估和控制机制在创新业务方面同样有效运行。

#### (2) 风险治理组织架构

适用 不适用

本公司建立了董事会与监事会，公司经理层、首席风险官与合规总监，专职风险管理部门，业务经营部门、职能管理部门、分支机构及子公司四个层次的风险管理架构。

董事会是公司风险管理的最高机构，承担全面风险管理的最终责任，审议批准公司全面风险管理的基本制度；负责审批公司总体风险管理战略与重大政策；确定公司可以承受的总体风险水平；审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇，建立与首席风险官的直接沟通机制；监督和评价风险管理的全面性及有效性。董事会通过其下设的风险控制委员会和审计委员会行使风险管理职能。

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



经理层是公司风险管理的执行与管理机构，对全面风险管理承担主要责任，主要职责包括：执行董事会制定的风险管理政策；组织建立健全有效的风险管理制度和机制；组织实施各类风险的识别、评估与管理。

首席风险官负责公司全面风险管理工作，履职范围涵盖公司经营运作的所有环节。负责拟定公司风险管理的基本制度，制定相关的工作流程；督导公司各部门建立健全相关的业务制度以及相应的风险管理规则，检查、评估各部门风险管理措施与流程的具体落实情况与效果并要求改正或完善；建议董事会及经理层根据市场情况以及公司业务发展制定、修改、撤销有关公司相关业务的风险偏好、风险容忍度与风险限额；对公司重大决策和主要业务活动进行风险评估；为公司高级管理人员、各部门和分支机构提供风险管理咨询、组织相关培训；向公司董事会、风险控制委员会、监管部门报告公司风险管理状况。

合规总监全面负责本公司合规管理工作，对董事会负责，主要职责包括：组织拟定合规管理的基本制度和其他合规管理制度，督导下属各单位实施；法律法规和准则发生变动的，及时建议董事会或高级管理人员并督导有关部门，评估其对合规管理的影响，修改、完善有关制度和业务流程；对公司内部规章制度、重大决策、新产品和新业务方案等进行合规审查并签署合规审查意见；对公司及其工作人员经营管理和执业行为的合规性进行监督检查；协助董事会和高级管理人员建立和执行信息隔离墙、利益冲突管理和反洗钱制度；按照公司规定，为高级管理人员、下属各单位提供合规咨询、组织合规培训；发现公司存在违法违规行为或合规风险隐患的，依照公司章程规定及时向董事会、经营管理主要负责人报告，提出处理意见，并督促整改；配合证券监管机构对公司的检查和调查，跟踪和评估监管意见和监管要求的落实情况。

本公司设立风险管理部、合规法律部和稽核审计部三个专职风险管理部门。风险管理部在首席风险官领导下推动公司全面风险管理工作，负责规划并贯彻执行公司风险管理战略；建设并完善风险管理体系；审核公司经营活动的经营风险，为业务决策提供风险管理建议；进行风险识别、评估、监测、报告和处置；指导、督促、协助和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。

合规法律部主要负责确定本公司合规管理目标，建设并完善合规管理体系；为各项业务提供合规咨询，对各类新业务进行合规审核，培育本公司合规文化；组织实施本公司信息隔离墙和反洗钱制度，对员工执业行为进行管理；负责本公司法律事务管理，审查本公司各类合同，提供法律咨询和指导。稽核审计部主要对公司财务收支、经济活动、内部控制、风险管理实施独立、客观的监督、评价和建议；负责为本公司审计委员会提供资料，为其审计决策提供支持和服务；根据情况定期或不定期，有计划地对公司总部部门、分支机构、子公司进行审计。

风险管理部、合规法律部和稽核审计部三个专职风险管理部门相互独立，通过建立信息共享、配合处理和协同互助的工作机制，从事前、事中和事后三个阶段防范化解风险，构建了立体、完整的全面风险管理体系。风险管理部、合规法律部和稽核审计部三个专职风险管理部门与各业务部门、分支机构及其内部的合规及风险控制岗位建立了固定的信息沟通渠道，并与各业务部门、分支机构保持顺畅的沟通、协调机制，通过出具合规提示函、风险提示函、风险报告等对各业务

部门、分支机构的业务开展进行风险防范和监督。业务经营部门及职能管理部门负责对各自业务风险进行一线监控和管理。

本公司将子公司的风险管理纳入统一体系，对其风险管理工作实行垂直管理，各子公司参考本公司上述风险管理政策和风险管理组织架构建立与各自公司业务发展相匹配的风险管理政策和架构。

## 2、信用风险

√适用□不适用

信用风险指由于交易对手不能履行合约而导致损失的风险。本公司的信用风险主要来自以下方面：一是证券买卖的代理业务，若公司未提前要求客户依法缴足交易保证金，在结算当日客户的资金不足以支付交易所需的情况下，或客户资金由于其他原因出现缺口，本公司有责任代客户进行结算而造成损失；二是银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和应收款项等金融资产以及债券投资，其信用风险主要为交易对手违约和标的证券发行人主体违约风险，最大的风险敞口等于这些资产的账面金额；三是融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务的信用风险，主要为客户未能及时足额偿还负债本息而违约的风险。

为控制经纪业务产生的信用风险，本公司代理客户进行的证券交易均以全额保证金结算，从而避免了代理业务相关的结算风险。

本公司的银行存款、结算备付金和存出保证金均存放于信用良好的商业银行、中国证券登记结算有限责任公司和相关交易所；买入返售金融资产均为质押式、买断式回购；应收款主要为应收业务收入款及各项押金等，信用风险较低，且根据减值测试情况对应收款项已充分计提了减值准备，将该类金融资产的信用风险降低至较低水平。本公司通过选择投资国债、中央银行票据、信用评级高的债券等来控制固定收益类证券投资的信用风险，注重发行主体的资质分析，且通过分散化投资以分散信用风险，截止 2020 年 06 月 30 日，本公司持有的国债、中央银行票据和金融债券占比为 4.57%，AA-级(含)以上的信用债券占比为 94.35%。

本公司对融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务的信用风险控制主要是通过适当性管理、征授信管理、客户黑名单和灰名单管理、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式实现。

### 预期信用损失

自 2019 年 1 月 1 日起，对于以摊余成本计量的金融资产(包括融出资金、买入返售金融资产和债权投资等)和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益计量的金融资产(包括其他债权投资)，其预期信用损失的计量中使用了模型和假设。这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况和客户的信用行为(例如，客户违约的可能性及相应损失)。

对纳入预期信用损失计量的金融资产，本公司运用自金融资产初始确认之后信用质量发生“三阶段”变化的减值模型分别计量预期信用损失，具体包括：

(1) 自初始确认后信用风险未发生显著增加的金融工具，分为“第一阶段”，且本公司对其信用风险进行持续监控。

(2) 如果识别出自初始确认后信用风险发生显著增加，但并未将其视为已发生信用减值的工具，则本公司将其转移至“第二阶段”。

本公司在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本公司在进行金融资产损失准备阶段划分时，充分考虑了反映金融工具的信用风险是否发生显著变化的各种合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。当触发以下一个或多个定量和定性指标时，本公司认为金融工具的信用风险已发生显著增加：

- 针对融资类业务，公司充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券所属板块、流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况、担保证券所属上市公司经营情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的预警线和平仓线。如果本金或利息在合同付款日后逾期超过(含)30日。如果融资融券类业务的客户信用状态为预警，维持担保比例不低于 130%且小于 150%。如果股票质押式回购业务于报告日前 5 个交易日履约保障比例均在不低于 100%且小于 130%。

- 针对债券投资业务，如果债券在合同付款日后逾期超过(含)30日，债券发行人或债券的最新评级较初始确认时点债券发行人或债券的评级下调超过 2 级，且债券发行人或债券的最新评级在投资级以下。

如果金融资产的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。截至 2020 年 06 月 30 日，本公司未将任何金融工具视为具有较低信用风险而不再比较资产负债表日的信用风险与初始确认时相比是否显著增加。

(3) 对于已发生信用减值的金融工具，则划分为“第三阶段”。

根据新金融工具准则判断金融工具是否发生信用减值时，本公司所采用的界定标准，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，本公司将该金融资产界定为已发生信用减值：

- 债务人在合同付款日后逾期超过(含)90 天仍未付款；
- 融资类金融资产业务采取强制平仓措施、担保物价值已经不能覆盖融资金额；
- 融资融券类业务的客户信用状态为预平仓，且维持担保比例小于 130%；
- 股票质押式回购业务于报告日前 5 个交易日履约保障比例均小于 100%；
- 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别；
- 债务人发生重大财务困难；
- 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- 债务人很可能破产或其他财务重组等。

金融资产发生信用减值时，有可能是多个事件的共同作用所致，未必是可单独识别的事件所致。

第一阶段金融工具按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，第二阶段和第三阶段金融工具按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

对于第一阶段和第二阶段的债券投资类金融资产，管理层运用包含违约概率、违约损失率及违约风险敞口等关键参数的风险参数模型法评估损失准备。对于第三阶段已发生信用减值的上述金融资产，通过预估未来与该金融资产相关的现金流，计量损失准备。上述第一阶段、第二阶段以及第三阶段金融资产的减值评估，管理层均考虑了前瞻性因素。

对于第一阶段和第二阶段的融资类金融产品(包括融出资金、买入返售金融资产中的股票质押式回购)，管理层运用包含损失率比率及违约风险敞口的损失率模型评估损失准备。对于第三阶段已发生信用减值的上述金融资产，通过预估未来与该金融资产相关的现金流，计量损失准备。上述第一阶段、第二阶段以及第三阶段金融资产的减值评估，管理层均考虑了前瞻性因素。

本公司根据会计准则的要求在预期信用损失计量中使用了判断、假设和估计，包括：

- 判断信用风险显著增加的标准；
- 选择计量预期信用损失的适当模型和假设；
- 针对不同类型的产品，在计量预期信用损失时确定需要使用的前瞻性信息和权重。

#### 预期信用损失计量的参数、假设及估计技术

根据信用风险是否显著增加以及是否发生信用减值，本公司对不同的金融资产分别以 12 个月或整个存续期的预期信用损失计量减值准备。在计量预期信用损失时，本公司考虑了前瞻性信息的影响。

对融出资金、债权投资、其他债权投资等金融资产，预期信用损失为考虑了前瞻性影响的违约概率、违约损失率、违约风险敞口三者乘积作为未来现金流折现至当期的结果：

- 违约概率是指借款人在未来 12 个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。违约是指未按合同约定偿付债务，或其他违反债务合同且对正常偿还债务产生重大影响的行为。本公司计算违约概率考虑的主要因素有债券投资业务经评估后的信用评级信息等；

- 违约损失率是指本公司对违约风险敞口发生损失程度作出的预期。本公司主要考虑担保物变现的价值、债券发行人或交易对手的类型等；

- 违约风险敞口是指在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本公司应被偿付的金额。

对股票质押式回购类买入返售金融资产，预期信用损失为违约风险敞口及考虑前瞻性影响的损失率比率二者乘积折现后的结果：

- 违约风险敞口是指在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本公司应被偿付的金额；



- 损失率比率是指本公司对违约风险敞口发生损失金额作出的预期。本公司使用基于公开市场数据测算的历史损失率并评估其适当性。

#### 前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。

对于债券投资，本公司通过进行历史数据分析，识别出影响信用风险及预期信用损失的关键经济指标，主要包括国内生产总值和进口额。本公司通过进行回归分析确定这些经济指标历史上与违约概率、违约敞口和违约损失率之间的关系，并通过预测未来经济指标确定预期的违约概率、违约敞口和违约损失率。对于融资类业务，本公司基于对产品特性进行分析，识别出与融资类业务风险相关的经济指标(上证指数的波动率)。通过构建这些经济指标与业务风险特征之间的关系，对融资类业务的预期损失进行前瞻性的调整。

除了提供基本经济情景外，本公司的管理层专家小组也提供了其他可能的情景及情景权重。针对每一个主要产品类型分析、设定不同的情景，以确保考虑到指标非线性发展特征。本公司在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及其特征。

本公司认为，在 2020 年 6 月 30 日及 2019 年 12 月 31 日，对于本公司的债券以及融资类资产组合，应当考虑应用 3 种不同情景来恰当反映关键经济指标发展的非线性特征。本公司结合统计分析及专家判断来确定情景权重，也同时考虑了各情景所代表的可能结果的范围，目前本公司采用的基准情景权重超过非基准情景权重之和。

本公司以加权的 12 个月预期信用损失(第一阶段)或加权的整个存续期预期信用损失(第二阶段及第三阶段)计量相关的损失准备。上述加权的信用损失是由各情景下预期信用损失乘以相应情景的权重计算得出。

对于融资类业务，基于敞口特征和信用管理方法的不同，管理层认为经济变量导致前瞻性信息变动对于合并财务报表的影响不重大。

与其他经济预测类似，对预计经济指标和发生可能性的估计具有高度的固有不确定性，因此实际结果可能同预测存在重大差异。本公司认为这些预测体现了公司对可能结果的最佳估计。

#### 担保物及其他信用增级措施

本公司采用一系列政策和信用增级措施来降低信用风险敞口至可接受水平。其中，最为普遍的方法是提供抵押物或担保。本公司根据交易对手的信用风险评估决定所需的担保物金额及类型。对于融出资金和买入返售协议下的担保物主要为股票和债券等。本公司管理层会定期检查担保物的市场价值，根据相关协议要求追加担保物，并在进行损失准备的充足性审查时监视担保物的市场价值变化。

在不考虑担保物或其他信用增级措施的情况下，于资产负债表日最大信用风险敞口是指金融资产扣除减值准备后的账面价值。本公司最大信用风险敞口金额列示如下：

单位：元 币种：人民币

|  | 2020 年 6 月 30 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|--|-----------------|------------------|
|--|-----------------|------------------|

|                   |                          |                          |
|-------------------|--------------------------|--------------------------|
| 银行存款              | 13,801,054,427.11        | 10,512,424,968.53        |
| 结算备付金             | 4,107,114,666.38         | 3,009,792,422.15         |
| 融出资金              | 14,515,304,315.35        | 12,772,101,251.75        |
| 衍生金融资产            | -                        | 7,750,862.27             |
| 买入返售金融资产          | 6,185,335,112.92         | 5,183,376,398.01         |
| 应收款项              | 200,634,098.85           | 415,554,170.15           |
| 存出保证金             | 1,592,278,379.21         | 850,420,028.46           |
| 金融投资              | 22,749,472,256.15        | 28,648,690,123.15        |
| 其中：交易性金融资产        | 3,280,657,214.08         | 5,810,281,403.91         |
| 债权投资              | 569,460,375.60           | 650,088,971.10           |
| 其他债权投资            | 18,899,354,666.47        | 22,188,319,748.14        |
| 其他金融资产            | 653,415,496.28           | 720,498,755.45           |
| <b>表内信用风险敞口小计</b> | <b>63,804,608,752.25</b> | <b>62,120,608,979.92</b> |

本公司纳入预期信用损失减值评估范围的金融工具的信用风险敞口按损失所处阶段划分如下：

(1) 融出资金

单位：元 币种：人民币

|                   | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 合计             |
|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|----------------|
| 2020 年 1 月 1 日余额  | 57,032,482.17  | 26,324,061.16        | 11,249,082.36        | 94,605,625.69  |
| -本期计提             | 16,202,747.69  | 1,211,207.49         | 2,664,877.47         | 20,078,832.65  |
| -本期转回             | -              | -                    | -                    | -              |
| 2020 年 6 月 30 日余额 | 73,235,229.86  | 27,535,268.65        | 13,913,959.83        | 114,684,458.34 |

(2) 买入返售金融资产

单位：元 币种：人民币

|                   | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 合计             |
|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|----------------|
| 2020 年 1 月 1 日余额  | 9,404,360.83   | 85,707,265.52        | 823,852,694.33       | 918,964,320.68 |
| -本期计提             | 192,560.43     | 9,483,065.36         | 126,709,888.67       | 136,385,514.46 |
| -本期转回             | 3,105,606.93   | 52,707,528.68        | -                    | 55,813,135.61  |
| 2020 年 6 月 30 日余额 | 6,491,314.33   | 42,482,802.20        | 950,562,583.00       | 999,536,699.53 |

(3) 应收款项

单位：元 币种：人民币

|                   | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 合计            |
|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|---------------|
| 2020 年 1 月 1 日余额  | 11,233.39      | 8,462,432.22         | 17,390,728.70        | 25,864,394.31 |
| -本期计提             | 126.94         | 244,763.58           | 7,338.45             | 252,228.97    |
| -本期转回             | -              | 1,448,619.27         | 497,142.10           | 1,945,761.37  |
| 2020 年 6 月 30 日余额 | 11,360.33      | 7,258,576.53         | 16,900,925.05        | 24,170,861.91 |

## (4) 债权投资

单位：元 币种：人民币

|                   | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 合计           |
|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|--------------|
| 2020 年 1 月 1 日余额  | 2,372,603.34   | -                    | -                    | 2,372,603.34 |
| -本期计提             | 1,099,706.77   | -                    | -                    | 1,099,706.77 |
| -本期转回             | 2,096,981.96   | -                    | -                    | 2,096,981.96 |
| 2020 年 6 月 30 日余额 | 1,375,328.15   | -                    | -                    | 1,375,328.15 |

## (5) 其他债权投资

单位：元 币种：人民币

|                   | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 合计             |
|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|----------------|
| 2020 年 1 月 1 日余额  | 102,019,926.20 | 467,533.64           | -                    | 102,487,459.84 |
| -本期计提             | 9,262,561.00   | 1,158,967.04         | -                    | 10,421,528.04  |
| -本期转回             | 19,629,631.57  | 467,533.64           | -                    | 20,097,165.21  |
| 2020 年 6 月 30 日余额 | 91,652,855.63  | 1,158,967.04         | -                    | 92,811,822.67  |

## (6) 其他金融资产

单位：元 币种：人民币

|                   | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值） | 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值） | 合计             |
|-------------------|----------------|----------------------|----------------------|----------------|
| 2020 年 1 月 1 日余额  | 170,717.10     | 44,148,056.53        | 79,104,953.12        | 123,423,726.75 |
| -本期计提             | 9,162.05       | 3,957,536.14         | 4,438,494.24         | 8,405,192.43   |
| -本期转回             | -              | 34,249,827.46        | 21,461,989.20        | 55,711,816.66  |
| 2020 年 6 月 30 日余额 | 179,879.15     | 13,855,765.21        | 62,081,458.16        | 76,117,102.52  |

### 3、流动风险

√适用 □不适用

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

本公司重视并持续加强流动性风险的管理，公司资金实行统一管理和运作，重视资产与负债的期限结构，随时关注其到期日以及到期金额的匹配并进行有效的管理，以保证到期债务的支付；公司建立了流动性风险限额和预警体系，根据公司业务规模、性质、复杂程度、流动性风险偏好和外部市场发展变化情况，设定流动性风险限额并对其执行情况进行监控，及时跟踪市场近期变化情况以及公司流动性状况，确保公司在现金流异常时能及时采取应对措施；公司建立了流动性风险报告机制，明确流动性风险报告种类、内容、形式、频率以及报告路径，确保董事会、经理层



和其他管理人员及时了解流动性风险水平及其管理状况；公司加强日间流动性管理，通过提前进行现金流测算和融资安排确保具有充足的日间流动性头寸，及时满足正常和压力情景下的日间支付需求；公司积极开展融资渠道管理，确保资金来源的稳定性和可靠性；公司建立优质流动性储备池，保持一定数量的流动性储备资产，监测其变现能力，确保变现能够在正常的结算期内完成，以弥补现金流缺口，降低流动性风险；公司建立流动性风险应急机制，制定流动性风险应急预案并定期对应急预案进行演练和测试，不断更新和完善应急处理方案，确保公司可以应对紧急情况下的流动性需求。

#### 4、市场风险

√适用□不适用

本公司涉及的市场风险指由于市场价格、利率或汇率的变动等对本公司资产价值所产生的影响，包括利率风险、汇率风险和其他价格风险。

##### (1)利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率风险主要影响生息资产和负债。本公司的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债券投资和其他固定收益类投资。本公司利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具，采用敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，当利率发生合理、可能的变动时，将对利润总额和不考虑企业所得税影响的其他综合收益产生的影响。本公司通过对配置投资组合进行久期管理等来管理组合的利率风险，定期开展压力测试以测算各种压力情景下各项风控指标变化的情况。证券经纪业务客户资金存款和代理买卖证券款币种与期限相互匹配，本公司经纪业务的利率敏感性资产和负债的币种与期限结构基本匹配，利率风险可控。

##### 敏感性分析

本公司利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具，衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，对本公司利润总额和不考虑企业所得税影响的其他综合收益的影响如下：

单位：千元 币种：人民币

| 项目              | 2020 年 1-6 月 |            |
|-----------------|--------------|------------|
|                 | 对利润总额的影响     | 对其他综合收益的影响 |
| 市场利率平行上升 100 基点 | 1,997        | -188,994   |
| 市场利率平行下降 100 基点 | -1,997       | 188,994    |

单位：千元 币种：人民币

| 项目              | 2019 年 1-6 月 |            |
|-----------------|--------------|------------|
|                 | 对利润总额的影响     | 对其他综合收益的影响 |
| 市场利率平行上升 100 基点 | 4,658        | -256,868   |
| 市场利率平行下降 100 基点 | -4,658       | 256,868    |

对利润总额的影响是指假设利率于未来1年中间发生一定变动对1年内净生息头寸利息收入及期末持有交易性金融资产及负债等其他金融工具所产生的重估后公允价值变动的的影响。

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

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

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

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

### (2) 汇率风险

汇率风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本公司的外汇风险主要与本公司的营运相关(以不同于本公司功能货币的外币结算及付款)。

本公司所持有的外币资产及负债相对于总资产及负债占比较小，并无重大外汇风险。以本公司的收益结构衡量，大部分交易以人民币结算，外币交易占比对于本公司不算重大。本公司认为，鉴于本公司的外币资产、负债及收入占总资产、负债及收入的比例很小，本公司业务的外汇风险不重大。

### (3) 其他价格风险

价格风险是指因市场价格变动(利率风险或汇率风险引起的变动除外)而引起的金融工具未来现金流量或公允价值变动的风险，不论该变动是由于个别金融工具或其发行人的特定因素引起的，还是由某些影响整个交易市场中的所有类似金融工具的因素引起的。本公司的价格风险主要来自自营投资、做市等业务持仓。为有效管理风险，本公司主要采取以下措施：一是通过构建证券投资组合，运用金融衍生工具，进行有效的风险对冲；二是统一管理持仓的风险敞口，通过业务部门内部风控岗和风险管理部两道防线，实施独立的风险监控、分析、报告，及时发现和处置风险；三是实施风险许可证管理，控制风险敞口规模、集中度、损失限额等指标，并不定期调整以应对不断变化的市场风险、业务状况或风险承受能力；四是结合情景分析、压力测试等方法对组合的相对风险和绝对风险进行评估。

### 敏感性分析

如果权益工具的市价上升或下降 10%，假设交易性金融资产和其他权益工具投资其他变量不变，基于资产负债表日的上述资产对本公司利润总额和不考虑企业所得税影响的其他综合收益的影响如下：

单位：千元 币种：人民币

| 项目       | 2020 年 1-6 月 |            |
|----------|--------------|------------|
|          | 对利润总额的影响     | 对其他综合收益的影响 |
| 市价上升 10% | 276,972      | 240,863    |
| 市价下降 10% | -276,972     | -240,863   |

单位：千元 币种：人民币

| 项目       | 2019 年 1-6 月 |            |
|----------|--------------|------------|
|          | 对利润总额的影响     | 对其他综合收益的影响 |
| 市价上升 10% | 224,806      | 264,511    |
| 市价下降 10% | -224,806     | -264,511   |

## 十八、其他重要事项

### 1、前期会计差错更正

#### (1) 追溯重述法

 适用  不适用

#### (2) 未来适用法

 适用  不适用

### 2、债务重组

 适用  不适用

### 3、资产置换

#### (1) 非货币性资产交换

 适用  不适用

#### (2) 其他资产置换

 适用  不适用

### 4、年金计划

 适用  不适用

本公司建立了企业年金计划，2020 年上半年缴费总额不高于上年度职工工资总额的 8.00%。

### 5、终止经营

 适用  不适用

### 6、分部信息

#### (1) 报告分部的确定依据与会计政策

 适用  不适用

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础，结合经营分部规模，确定报告分部并披露分部信息。经营分部，是指本公司内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入并发生费用；
- (2) 本公司管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源及评价其业绩；

(3) 本公司能够取得该组成部分的财务状况和经营成果和现金流量等有关财务信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本公司的经营业务根据业务的性质以及所提供的产品和劳务分开组织和管理。本公司的每个经营分部是一个业务部门或子公司，提供面临不同于其他经营分部的风险并取得不同于其他经营分部的报酬的产品和服务。以下是对经营分部详细信息的概括：

- a) 财富管理业务主要包括证券经纪业务、信用业务等；
- b) 自营投资业务主要包括以自有资金从事权益类投资业务、固定收益类投资业务等；
- c) 投资银行业务主要包括股权融资业务、债券融资业务和财务顾问业务等；
- d) 资产管理业务主要包括证券公司资产管理业务和公募基金管理业务等；
- e) 其他业务主要包括期货业务、另类投资业务、私募基金管理业务和海外业务等；

分部会计政策与编制合并财务报表时采用的会计政策一致。分部间转移交易以实际交易价格为基础计算。分部收入和分部费用按各分部的实际收入和费用确定。

分部利润/(亏损)指分摊所得税费用前各分部所赚得的利润/所产生的亏损，该指标提交管理层供其分配资源及评估业绩。

分部资产/负债分配予各分部。分部间的抵销主要为自有资金在分部间往来调整的抵销。分部业绩不包括所得税费用，而分部资产及负债分别包括预缴税金和应交税费。

分部收入均源于中国内地及香港，非流动资产所在地均在中国内地及香港。

本公司业务并不向特定客户开展，不存在单一客户占本公司营业收入 10% 或 10% 以上的情形。

**(2) 报告分部的财务信息**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目               | 财富管理业务            | 自营投资              | 投资银行           | 资产管理             | 其他业务              | 分部间抵销            | 合计                |
|------------------|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|
| <b>2020年1-6月</b> |                   |                   |                |                  |                   |                  |                   |
| (1) 营业收入         | 824,465,394.22    | 705,021,157.60    | 286,273,324.88 | 230,912,392.47   | 478,862,262.93    | -                | 2,525,534,532.10  |
| 其中：手续费及佣金净收入     | 449,252,410.44    | 10,618,869.94     | 281,076,494.03 | 144,611,996.08   | 54,757,598.30     | -                | 940,317,368.79    |
| 投资收益             | 91,827,026.05     | 304,558,188.00    | 5,202,711.00   | 169,217,760.98   | 67,052,485.04     | -                | 637,858,171.07    |
| 其他收入（含公允价值变动）    | 283,385,957.73    | 389,844,099.66    | -5,880.15      | -82,917,364.59   | 357,052,179.59    | -                | 947,358,992.24    |
| (2) 营业支出         | 545,033,419.73    | 103,755,514.57    | 210,747,782.31 | 123,263,849.07   | 500,998,987.23    | -                | 1,483,799,552.91  |
| (3) 营业利润         | 279,431,974.49    | 601,265,643.03    | 75,525,542.57  | 107,648,543.40   | -22,136,724.30    | -                | 1,041,734,979.19  |
| (4) 利润总额         | 280,816,887.80    | 601,265,643.03    | 75,542,523.70  | 107,695,278.69   | -30,382,003.80    | -                | 1,034,938,329.42  |
| (5) 资产总额         | 24,920,559,920.37 | 37,419,992,430.63 | 20,590,893.60  | 2,945,011,632.54 | 24,544,076,554.95 | 5,314,307,869.49 | 84,535,923,562.60 |
| (6) 负债总额         | 22,515,308,335.35 | 26,746,452,521.10 | 2,131,361.73   | 1,274,108,993.67 | 13,720,979,088.13 | 335,244,538.88   | 63,923,735,761.10 |
| (7) 折旧和摊销费用      | 16,829,813.68     | 625,789.25        | 217,102.09     | 1,186,003.23     | 19,637,934.52     | -                | 38,496,642.77     |
| (8) 信用减值损失/（转回）  | 104,217,099.49    | -28,683,452.75    | -              | -                | -34,555,504.23    | -                | 40,978,142.51     |
| <b>2019年1-6月</b> |                   |                   |                |                  |                   |                  |                   |
| (1) 营业收入         | 796,930,763.41    | 240,856,344.15    | 445,698,128.45 | 260,105,872.10   | 143,738,685.64    | -                | 1,887,329,793.75  |
| 其中：手续费及佣金净收入     | 402,054,757.58    | 12,628,581.57     | 435,409,369.39 | 146,897,486.94   | 49,038,352.23     | -                | 1,046,028,547.71  |
| 投资收益             | -3,232,047.66     | -354,834,036.13   | 12,634,894.26  | 207,317,229.52   | 218,574,964.23    | -                | 80,461,004.22     |
| 其他收入（含公允价值变动）    | 398,108,053.49    | 583,061,798.71    | -2,346,135.20  | -94,108,844.36   | -123,874,630.82   | -                | 760,840,241.82    |
| (2) 营业支出         | 369,920,074.65    | 96,005,099.73     | 213,586,333.16 | 99,725,416.08    | 141,305,226.15    | -                | 920,542,149.77    |
| (3) 营业利润         | 427,010,688.76    | 144,851,244.42    | 232,111,795.29 | 160,380,456.02   | 2,433,459.49      | -                | 966,787,643.98    |
| (4) 利润总额         | 427,285,891.87    | 144,851,244.42    | 232,165,795.29 | 170,028,736.06   | 62,868,053.56     | -                | 1,037,199,721.20  |
| (5) 资产总额         | 24,120,550,971.47 | 37,854,494,365.77 | 21,777,386.85  | 8,493,945,275.74 | 19,303,766,011.99 | 3,291,121,088.93 | 86,503,412,922.89 |
| (6) 负债总额         | 17,962,946,186.38 | 28,467,030,756.20 | -              | 4,509,553,503.70 | 15,837,843,541.51 | 303,704,796.11   | 66,473,669,191.68 |
| (7) 折旧和摊销费用      | 14,671,964.84     | 791,452.72        | 445,852.79     | 1,448,467.27     | 24,590,358.77     | -                | 41,948,096.39     |
| (8) 资产减值损失       | -114,825,867.71   | 28,998,982.10     | 285,000.00     | -                | -3,872,015.75     | -                | -89,413,901.36    |

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

适用 不适用

(4) 其他说明

适用 不适用

7、 租赁

适用 不适用

8、 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用 不适用

**9、以公允价值计量的资产和负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                  | 期初金额                     | 本期公允价值变动损益            | 计入权益的累计公允价值变动          | 本期计提的减值              | 期末金额                     |
|---------------------|--------------------------|-----------------------|------------------------|----------------------|--------------------------|
| 金融资产                |                          |                       |                        |                      |                          |
| 1、交易性金融资产(不含衍生金融资产) | 17,570,733,770.26        | 72,310,844.39         |                        |                      | 20,474,641,859.87        |
| 2、衍生金融资产            | 7,750,862.27             | 97,844,599.66         |                        |                      | -                        |
| 3、其他债权投资            | 22,188,319,748.14        | -                     | 127,158,703.28         | -9,675,637.17        | 18,899,354,666.47        |
| 4、其他权益工具投资          | 2,481,585,498.22         | -                     | -252,781,119.26        |                      | 2,408,626,843.95         |
| 金融资产小计              | 42,248,389,878.89        | 170,155,444.05        | -125,622,415.98        | -9,675,637.17        | 41,782,623,370.29        |
| 投资性房地产              | -                        | -                     |                        |                      | -                        |
| 生产性生物资产             | -                        | -                     |                        |                      | -                        |
| 其他                  | -                        | -                     |                        |                      | -                        |
| <b>上述合计</b>         | <b>42,248,389,878.89</b> | <b>170,155,444.05</b> | <b>-125,622,415.98</b> | <b>-9,675,637.17</b> | <b>41,782,623,370.29</b> |
| 金融负债                | 160,609,213.11           | -34,134,805.49        |                        |                      | 133,146,664.99           |



**10、金融工具项目计量基础分类表**
**(1) 金融资产计量基础分类表**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 期末账面价值    |                          |                             |                                   |                           |
|-----------|--------------------------|-----------------------------|-----------------------------------|---------------------------|
| 金融资产项目    | 以摊余成本计量的金融资产             | 分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资 | 以公允价值计量且其变动计入当期损益         |
|           |                          |                             |                                   | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |
| 货币资金      | 13,801,061,506.21        | -                           | -                                 | -                         |
| 结算备付金     | 4,107,114,666.38         | -                           | -                                 | -                         |
| 融出资金      | 14,515,304,315.35        | -                           | -                                 | -                         |
| 交易性金融资产   | -                        | -                           | -                                 | 20,474,641,859.87         |
| 买入返售金融资产  | 6,185,335,112.92         | -                           | -                                 | -                         |
| 应收款项      | 200,634,098.85           | -                           | -                                 | -                         |
| 存出保证金     | 1,592,278,379.21         | -                           | -                                 | -                         |
| 其他权益工具投资  | -                        | -                           | 2,408,626,843.95                  | -                         |
| 其他债权投资    | -                        | 18,899,354,666.47           | -                                 | -                         |
| 债权投资      | 569,460,375.60           | -                           | -                                 | -                         |
| 其他资产      | 840,096,944.00           | -                           | -                                 | -                         |
| <b>合计</b> | <b>41,811,285,398.52</b> | <b>18,899,354,666.47</b>    | <b>2,408,626,843.95</b>           | <b>20,474,641,859.87</b>  |
| 期初账面价值    |                          |                             |                                   |                           |
| 金融资产项目    | 以摊余成本计量的金融资产             | 分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产 | 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资 | 以公允价值计量且其变动计入当期损益         |
|           |                          |                             |                                   | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |
| 货币资金      | 10,512,431,794.22        | -                           | -                                 | -                         |
| 结算备付金     | 3,009,792,422.15         | -                           | -                                 | -                         |
| 融出资金      | 12,772,101,251.75        | -                           | -                                 | -                         |
| 交易性金融资产   | -                        | -                           | -                                 | 17,570,733,770.26         |
| 衍生金融资产    | -                        | -                           | -                                 | 7,750,862.27              |
| 买入返售金融资产  | 5,183,376,398.01         | -                           | -                                 | -                         |
| 应收款项      | 415,554,170.15           | -                           | -                                 | -                         |
| 存出保证金     | 850,420,028.46           | -                           | -                                 | -                         |
| 其他权益工具投资  | -                        | -                           | 2,481,585,498.22                  | -                         |
| 其他债权投资    | -                        | 22,188,319,748.14           | -                                 | -                         |
| 债权投资      | 650,088,971.10           | -                           | -                                 | -                         |
| 其他资产      | 929,900,536.48           | -                           | -                                 | -                         |
| <b>合计</b> | <b>34,323,665,572.32</b> | <b>22,188,319,748.14</b>    | <b>2,481,585,498.22</b>           | <b>17,578,484,632.53</b>  |

**(2) 金融负债计量基础分类表**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 期末账面价值 |
|--------|
|--------|

| 金融负债项目        | 以摊余成本计量的金融负债             | 以公允价值计量且其变动计入当期损益         |
|---------------|--------------------------|---------------------------|
|               |                          | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 |
| 短期借款          | 2,573,063,147.23         | -                         |
| 应付短期融资款       | 9,883,555,638.27         | -                         |
| 拆入资金          | 50,933,992.37            | -                         |
| 交易性金融负债       | -                        | 26,222,233.11             |
| 衍生金融负债        | -                        | 106,924,431.88            |
| 卖出回购金融资产款     | 9,450,658,526.15         | -                         |
| 代理买卖证券款       | 14,450,081,233.62        | -                         |
| 代理承销证券款       | -                        | -                         |
| 应付款项          | 1,757,033,697.18         | -                         |
| 合同负债          | 11,538,771.73            | -                         |
| 应付债券          | 22,639,511,387.23        | -                         |
| 其他负债          | 1,735,296,889.54         | -                         |
| <b>合计</b>     | <b>62,551,673,283.32</b> | <b>133,146,664.99</b>     |
| <b>期初账面价值</b> |                          |                           |
| 金融负债项目        | 以摊余成本计量的金融负债             | 以公允价值计量且其变动计入当期损益         |
|               |                          | 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 |
| 短期借款          | 1,661,802,273.49         | -                         |
| 应付短期融资款       | 6,593,445,526.71         | -                         |
| 拆入资金          | 51,218,083.59            | -                         |
| 交易性金融负债       | -                        | 40,945,748.36             |
| 衍生金融负债        | -                        | 119,663,464.75            |
| 卖出回购金融资产款     | 8,289,171,886.27         | -                         |
| 代理买卖证券款       | 10,702,647,027.52        | -                         |
| 代理承销证券款       | -                        | -                         |
| 应付款项          | 233,131,373.19           | -                         |
| 应付债券          | 24,187,565,173.38        | -                         |
| 其他负债          | 4,243,620,247.56         | -                         |
| <b>合计</b>     | <b>55,962,601,591.71</b> | <b>160,609,213.11</b>     |

### 11、外币金融资产和金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期初金额             | 本期公允价值变动损益      | 计入权益的累计公允价值变动 | 本期计提的减值   | 期末金额             |
|-----------|------------------|-----------------|---------------|-----------|------------------|
| 金融资产      |                  |                 |               |           |                  |
| 1、交易性金融资产 | 2,309,792,413.00 | -171,112,331.29 | -             | -         | 3,226,864,352.21 |
| 2、衍生金融资产  | -                | -               | -             | -         | -                |
| 3、贷款和应收款  | 223,479,242.37   | -               | -             | 29,003.51 | 11,559,006.00    |

|               |                         |                        |                        |                      |                         |
|---------------|-------------------------|------------------------|------------------------|----------------------|-------------------------|
| 4、其他债权投资      | 155,118,879.59          | -                      | 2,914,636.94           | -2,454,173.62        | -                       |
| 5、其他权益工具投资    | 206,319,191.37          | -                      | -145,603,443.71        | -                    | 147,357,959.98          |
| 6、债权投资        | 650,088,971.10          | -                      | -                      | -997,275.19          | 569,460,375.60          |
| <b>金融资产小计</b> | <b>3,544,798,697.43</b> | <b>-171,112,331.29</b> | <b>-142,688,806.77</b> | <b>-3,422,445.30</b> | <b>3,955,241,693.79</b> |
| 金融负债          | 117,507,927.51          | 82,289,067.49          | -                      | -                    | 36,937,778.47           |

**12、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项**
 适用  不适用

**13、其他**
 适用  不适用

## 十九、母公司财务报表主要项目注释

## 1、长期股权投资

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位            | 期初余额                    | 本期增减变动                |      |        | 期末余额                    | 减值准备期末余额 |
|------------------|-------------------------|-----------------------|------|--------|-------------------------|----------|
|                  |                         | 追加投资                  | 减少投资 | 计提减值准备 |                         |          |
| 东兴期货有限责任公司       | 538,306,355.56          | -                     | -    | -      | 538,306,355.56          | -        |
| 东兴证券投资有限公司       | 1,100,000,000.00        | 50,000,000.00         | -    | -      | 1,150,000,000.00        | -        |
| 东兴资本投资管理有限公司     | 250,000,000.00          | 50,000,000.00         | -    | -      | 300,000,000.00          | -        |
| 东兴证券(香港)金融控股有限公司 | 1,219,109,937.26        | -                     | -    | -      | 1,219,109,937.26        | -        |
| 东兴基金管理有限公司       | -                       | 200,000,000.00        | -    | -      | 200,000,000.00          | -        |
| <b>合计</b>        | <b>3,107,416,292.82</b> | <b>300,000,000.00</b> | -    | -      | <b>3,407,416,292.82</b> | -        |

## 2、应付职工薪酬

### (1) 应付职工薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 期初余额                  | 本期增加                  | 本期减少                  | 期末余额                  |
|-------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 963,280,993.44        | 645,215,694.24        | 635,642,555.91        | 972,854,131.77        |
| 职工福利费       | -                     | 12,530,602.82         | 12,530,602.82         | -                     |
| 社会保险费       | 432,238.86            | 15,196,524.93         | 15,312,838.76         | 315,925.03            |
| 其中：基本医疗保险费  | 375,109.74            | 14,012,319.37         | 14,114,762.15         | 272,666.96            |
| 工伤保险费       | 16,798.11             | 108,636.13            | 111,228.37            | 14,205.87             |
| 生育保险费       | 40,331.01             | 1,075,569.43          | 1,086,848.24          | 29,052.20             |
| 住房公积金       | 35,855.03             | 29,454,892.96         | 29,460,911.08         | 29,836.91             |
| 设定提存计划      | 713,804.37            | 32,105,278.82         | 32,236,806.84         | 582,276.35            |
| 其中：养老保险费    | 625,243.90            | 9,299,163.25          | 9,432,679.79          | 491,727.36            |
| 失业保险费       | 77,143.80             | 388,806.89            | 396,853.03            | 69,097.66             |
| 企业年金        | 11,416.67             | 22,417,308.68         | 22,407,274.02         | 21,451.33             |
| 工会经费和职工教育经费 | 46,680.23             | 3,744,704.13          | 1,997,376.37          | 1,794,007.99          |
| 辞退福利        | -                     | 756,929.12            | 756,929.12            | -                     |
| 企业补充医疗保险    | 13,468.04             | -5,252.99             | -5,252.99             | 13,468.04             |
| 其他          | 6,676.96              | 548,165.44            | 548,185.44            | 6,656.96              |
| <b>合计</b>   | <b>964,529,716.93</b> | <b>739,547,539.47</b> | <b>728,480,953.35</b> | <b>975,596,303.05</b> |

### (2) 短期薪酬列示

□适用 √不适用

### (3) 设定提存计划列示

√适用 □不适用

母公司设定提存计划列示数据详见第十节附注十九、2（1）应付职工薪酬列示。

按照中国有关法规，母公司的职工参加了由当地劳动和社会保障部门组织实施的社会基本养老保险和失业保险，母公司以当地规定的社会基本养老保险和失业保险的缴纳基数和比例，向当地社会基本养老保险和失业保险经办机构缴纳保险费。

除了以上基本养老保险和失业保险计划外，母公司为符合条件的职工设立了企业年金计划，按上年职工工资总额的一定比例提取年金计划供款。

其他说明：

□适用 √不适用

## 3、利息净收入

□适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 本期发生额                   | 上期发生额                   |
|---------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>利息收入</b>   | <b>1,271,963,072.87</b> | <b>1,238,823,584.07</b> |
| 其中：存放金融同业利息收入 | 119,468,491.08          | 102,940,157.32          |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 19,310,444.16           | 20,091,331.92           |

|                        |                       |                       |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 客户资金存款利息收入             | 100,158,046.92        | 82,848,825.40         |
| 融出资金利息收入               | 457,987,259.65        | 325,152,841.76        |
| 买入返售金融资产利息收入           | 117,231,981.64        | 251,981,272.99        |
| 其中：约定购回利息收入            | -                     | -                     |
| 股权质押回购利息收入             | 110,758,921.15        | 244,040,992.81        |
| 其他债权投资利息收入             | 577,275,340.50        | 558,749,312.00        |
| 其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入 | -                     | -                     |
| <b>利息支出</b>            | <b>748,822,313.53</b> | <b>828,457,248.11</b> |
| 其中：短期借款利息支出            | -                     | -                     |
| 应付短期融资款利息支出            | 97,772,814.05         | 67,686,703.94         |
| 拆入资金利息支出               | 21,044,529.52         | 49,706,091.55         |
| 其中：转融通利息支出             | 1,590,248.99          | 5,361,997.20          |
| 卖出回购金融资产利息支出           | 121,057,044.47        | 198,769,208.31        |
| 其中：报价回购利息支出            | -                     | -                     |
| 代理买卖证券款利息支出            | 20,114,035.11         | 17,905,586.84         |
| 应付债券利息支出               | 485,926,237.46        | 491,818,867.05        |
| 其中：次级债券利息支出            | 83,444,381.25         | 127,783,923.92        |
| 其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出 | 2,907,652.92          | 2,570,790.42          |
| <b>利息净收入</b>           | <b>523,140,759.34</b> | <b>410,366,335.96</b> |

#### 4、 手续费及佣金净收入

##### (1) 手续费及佣金净收入情况

√ 适用 □ 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目              | 本期发生额                   | 上期发生额                   |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>手续费及佣金收入</b> | <b>1,054,082,861.08</b> | <b>1,124,783,587.61</b> |
| 证券经纪业务收入        | 568,819,180.23          | 494,605,693.44          |
| 其中：代理买卖证券业务     | 492,186,634.09          | 443,221,282.54          |
| 交易单元席位租赁        | 58,478,988.81           | 51,144,399.64           |
| 代销金融产品业务        | 18,153,557.33           | 240,011.26              |
| 投资银行业务收入        | 312,740,200.17          | 439,726,256.18          |
| 其中：证券承销业务       | 258,723,798.68          | 263,314,142.44          |
| 证券保荐业务          | 10,783,293.90           | 28,999,695.74           |
| 财务顾问业务          | 43,233,107.59           | 147,412,418.00          |
| 资产管理业务收入        | 163,911,515.30          | 175,520,488.16          |
| 投资咨询业务收入        | 7,601,307.99            | 13,777,129.21           |
| 其他手续费及佣金收入      | 1,010,657.39            | 1,154,020.62            |
| <b>手续费及佣金支出</b> | <b>139,164,045.16</b>   | <b>120,309,726.11</b>   |
| 证券经纪业务支出        | 134,057,913.09          | 115,862,852.02          |
| 其中：代理买卖证券业务     | 134,057,913.09          | 115,862,852.02          |
| 投资银行业务支出        | 5,106,132.07            | 4,316,886.79            |
| 其中：证券承销业务       | 5,106,132.07            | 4,316,886.79            |
| 资产管理业务支出        | -                       | -                       |
| 投资咨询业务支出        | -                       | -                       |
| 其他手续费及佣金支出      | -                       | 129,987.30              |
| <b>合计</b>       | <b>914,918,815.92</b>   | <b>1,004,473,861.50</b> |

|             |                  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
| 其中：手续费及佣金收入 | 1,054,082,861.08 | 1,124,783,587.61 |
| 手续费及佣金支出    | 139,164,045.16   | 120,309,726.11   |

**(2) 财务顾问业务净收入**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 本期发生额                | 上期发生额                 |
|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| 并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司 | 10,386,792.45        | 3,954,716.98          |
| 并购重组财务顾问业务净收入--其他     | -                    | 1,622,641.51          |
| 融资类财务顾问业务净收入          | 9,103,773.58         | 4,330,188.68          |
| 其他财务顾问业务净收入           | 23,742,541.56        | 137,504,870.83        |
| <b>合计</b>             | <b>43,233,107.59</b> | <b>147,412,418.00</b> |

**(3) 代理销售金融产品业务**
 适用  不适用

**(4) 资产管理业务**
 适用  不适用

手续费及佣金净收入的说明：

 适用  不适用

**5、投资收益**
**(1) 投资收益情况**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 本期发生额                 | 上期发生额                  |
|--------------|-----------------------|------------------------|
| 金融工具投资收益     | 469,323,822.29        | -266,987,044.69        |
| 其中：持有期间取得的收益 | 310,824,575.10        | 381,814,854.91         |
| —交易性金融工具     | 308,587,258.25        | 379,165,407.82         |
| —其他权益工具投资    | 2,237,316.85          | 2,649,447.09           |
| —衍生金融工具      | -                     | -                      |
| 处置金融工具取得的收益  | 158,499,247.19        | -648,801,899.60        |
| —交易性金融工具     | 22,508,739.85         | -604,687,870.94        |
| —其他债权投资      | 129,325,314.80        | 7,014,767.45           |
| —衍生金融工具      | 7,291,317.33          | -54,293,575.00         |
| —交易性金融负债     | -626,124.79           | 3,164,778.89           |
| <b>合计</b>    | <b>469,323,822.29</b> | <b>-266,987,044.69</b> |

**(2) 交易性金融工具投资收益明细表**
 适用  不适用

单位：元 币种：人民币

| 交易性金融工具                   |        | 本期发生额          | 上期发生额           |
|---------------------------|--------|----------------|-----------------|
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 持有期间收益 | 308,587,258.25 | 379,165,407.82  |
|                           | 处置取得收益 | 22,508,739.85  | -604,687,870.94 |



|                           |        |             |              |
|---------------------------|--------|-------------|--------------|
| 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | 持有期间收益 | -           | -            |
|                           | 处置取得收益 | -626,124.79 | 3,164,778.89 |

## 6、公允价值变动收益

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                           | 本期发生额                | 上期发生额                 |
|------------------------------|----------------------|-----------------------|
| 交易性金融资产                      | 95,638,427.32        | 619,963,089.49        |
| 其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 95,638,427.32        | -                     |
| 交易性金融负债                      | 308,842.77           | 1,206,456.86          |
| 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 | 308,842.77           | -                     |
| 衍生金融工具                       | -19,004,525.38       | -61,325,985.96        |
| <b>合计</b>                    | <b>76,942,744.71</b> | <b>559,843,560.39</b> |

## 7、业务及管理费

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 本期发生额                 | 上期发生额                 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 职工费用      | 739,547,539.47        | 609,099,499.35        |
| 租赁费       | 60,035,279.85         | 64,846,018.03         |
| 折旧摊销费     | 35,407,294.26         | 38,380,848.77         |
| 产品销售及广告费  | 32,523,263.35         | 21,546,790.03         |
| 邮电通讯费     | 17,841,783.63         | 20,573,572.29         |
| 业务宣传及招待费  | 11,717,257.93         | 16,332,672.71         |
| 投资者保护基金   | 9,372,103.64          | 16,132,622.09         |
| 差旅费       | 7,740,626.61          | 12,339,909.67         |
| 其他        | 46,212,625.28         | 70,637,184.12         |
| <b>合计</b> | <b>960,397,774.02</b> | <b>869,889,117.06</b> |

## 8、其他

□适用√不适用

## 二十、补充资料

### 1、当期非经常性损益明细表

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                                            | 金额            | 说明        |
|-----------------------------------------------|---------------|-----------|
| 非流动资产处置损益                                     | 148,566.43    | 主要是固定资产处置 |
| 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） | 1,756,120.63  | 主要是政府补助   |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出                            | -6,261,883.08 | 主要是公益捐赠支出 |
| 所得税影响额                                        | 999,532.78    | -         |

|    |               |   |
|----|---------------|---|
| 合计 | -3,357,663.24 | - |
|----|---------------|---|

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

适用  不适用

由于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融工具、以摊余成本计量的金融工具属于本公司正常自营证券业务，故本公司将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号—非经常性损益》中列举的有关非经常性损益项目，包括持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融工具和以摊余成本计量的金融工具取得的投资收益、公允价值变动损益以及处置上述金融工具取得的投资收益等，界定为经常性损益的项目。

## 2、 净资产收益率及每股收益

适用  不适用

| 报告期利润                   | 加权平均净资产收益率 (%) | 每股收益   |        |
|-------------------------|----------------|--------|--------|
|                         |                | 基本每股收益 | 稀释每股收益 |
| 归属于公司普通股股东的净利润          | 3.82           | 0.285  | 不适用    |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 3.84           | 0.286  | 不适用    |

## 3、 境内外会计准则下会计数据差异

适用  不适用

## 4、 其他

适用  不适用

## 第十一节 备查文件目录

|        |                                       |
|--------|---------------------------------------|
| 备查文件目录 | 载有法定代表人签名的半年度报告文本                     |
|        | 载有法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报告原文 |
|        | 报告期内在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  |
|        | 其他相关文件                                |

董事长：魏庆华

董事会批准报送日期：2020 年 8 月 27 日

### 修订信息

适用  不适用

## 第十二节 证券信息披露

### 一、 公司重大行政许可事项的相关情况

适用  不适用

| 序号 | 发文单位  | 文件名称                         | 文号             | 发文日期       |
|----|-------|------------------------------|----------------|------------|
| 1  | 中国证监会 | 关于核准设立东兴基金管理有限公司的批复          | 证监许可〔2020〕256号 | 2020-02-10 |
| 2  | 深圳交易所 | 关于同意东兴证券开展上市公司股权激励行权融资业务试点的函 | 深证函〔2020〕266号  | 2020-04-10 |

### 二、 监管部门对公司的分类结果

适用  不适用

2020 年，公司分类监管评级为 A 类 A；2019 年，公司分类监管评级为 A 类 A；2018 年，公司分类监管评级为 A 类 A。