

公司代码：600109

公司简称：国金证券



**国金证券股份有限公司**

**2020 年年度报告**

## 重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

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

四、公司负责人冉云、主管会计工作负责人金鹏及会计机构负责人（会计主管人员）李登川声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

### 五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

以截至2020年12月31日公司总股本3,024,359,310股为基数，向全体股东每10股派发现金股利0.70元人民币（含税），共计分配现金股利211,705,151.70元，剩余未分配利润转入下一年度。以上分配预案将提交公司股东大会审议，待股东大会审议通过后执行。

### 六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

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

### 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

### 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况

否

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

否

### 十、重大风险提示

公司主营业务受宏观经济情况、监管政策调整、证券市场波动等影响较大，公司已在本报告中详细披露经营活动中可能存在的风险，敬请查阅“第四节经营情况讨论与分析——三、关于公司未来发展的讨论与分析——（四）可能面对的风险”。

### 十一、其他

适用 不适用

## 目 录

第一节	释义 .....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	公司业务概要 .....	19
第四节	经营情况讨论与分析.....	21
第五节	重要事项 .....	45
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	65
第七节	优先股相关情况.....	70
第八节	董事、监事、高级管理人员和员工情况.....	71
第九节	公司治理 .....	85
第十节	公司债券相关情况.....	96
第十一节	财务报告 .....	102
第十二节	备查文件目录 .....	213
第十三节	证券公司信息披露.....	214

## 第一节 释义

### 一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上交所	指	上海证券交易所
四川证监局	指	中国证券监督管理委员会四川监管局
公司、国金证券	指	国金证券股份有限公司
董事会	指	国金证券股份有限公司董事会
监事会	指	国金证券股份有限公司监事会
公司《章程》	指	《国金证券股份有限公司章程》
非公开发行、增发	指	非公开发行 A 股股票
可转债发行	指	公开发行可转换公司债券
报告期	指	2020 年度
控股股东、涌金集团	指	长沙涌金（集团）有限公司
涌金投资	指	涌金投资控股有限公司
成都建投	指	成都城建投资发展股份有限公司
国金期货	指	公司全资子公司国金期货有限责任公司
国金鼎兴	指	公司全资子公司国金鼎兴投资有限公司
国金创新	指	公司全资子公司国金创新投资有限公司
国金金控	指	公司全资子公司国金金融控股（香港）有限公司
国金道富	指	公司控股子公司国金道富投资服务有限公司
国金基金	指	公司参股公司国金基金管理有限公司
国金涌富	指	公司参股公司国金涌富资产管理有限公司
承销保荐分公司	指	公司上海证券承销保荐分公司
北京场外证券业务分公司	指	公司北京场外证券业务分公司
自营分公司	指	公司上海证券自营分公司
资管分公司	指	公司上海证券资产管理分公司
投资咨询分公司	指	公司上海投资咨询分公司
互联网证券分公司	指	公司上海互联网证券分公司

## 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	国金证券股份有限公司
公司的中文简称	国金证券
公司的外文名称	SINOLINK SECURITIES CO., LTD.
公司的外文名称缩写	SINOLINK SECURITIES
公司的法定代表人	冉云
公司总经理	金鹏

### 公司注册资本和净资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	3,024,359,310.00	3,024,359,310.00
净资产	19,641,319,988.29	18,293,563,610.46

### 公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

截至目前，公司营业执照所载明的经营范围包括：证券业务；证券投资基金托管；证券投资基金销售服务（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）一般项目：证券公司为期货公司提供中间介绍业务（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）；公司经营证券期货业务许可证所载明的经营范围包括：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；融资融券；证券资产管理；证券投资基金代销；代销金融产品；证券投资基金托管。

此外，公司还拥有参与股指期货交易、股指期货套期保值业务；国债期货交易业务；网上证券委托业务；股票质押式回购业务；股票收益互换业务；利率互换交易业务；直接投资业务；全国中小企业股份转让系统主办券商、经纪业务及做市业务；代办系统主办券商业务；中小企业私募债券承销业务；向保险机构投资者提供交易单元服务；约定购回式证券交易业务；全国银行间同业拆借市场同业拆借业务；港股通业务；私募基金综合托管业务试点；证券投资基金托管业务；银行间债券市场尝试做市业务；互联网证券业务试点；柜台市场业务试点；股票期权交易经纪业务、自营业务；转融通业务；开展黄金现货合约自营业务；开展非金融企业债务融资工具承销业务；军工涉密业务咨询服务业务；合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务；上市公司股权激励行权融资业务试点；投资管理人受托管理保险资金资格；场外期权业务二级交易商资格；信用衍生品业务；国债期货做市业务；信用保护合约核心交易商资格、沪深交易所行情信息使用许可、利率期权市场成员资格等其他业务资格。

**二、 联系人和联系方式**

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	周洪刚	叶新豪
联系地址	成都市东城根上街95号	成都市东城根上街95号
电话	028-86690021	028-86690021
传真	028-86695681	028-86695681
电子信箱	tzzgx@gjq.com.cn	tzzgx@gjq.com.cn

**三、 基本情况简介**

公司注册地址	成都市青羊区东城根上街95号
公司注册地址的邮政编码	610015
公司办公地址	成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼
公司办公地址的邮政编码	610015
公司网址	http://www.gjq.com.cn
电子信箱	tzzgx@gjq.com.cn

**四、 信息披露及备置地点**

公司选定的信息披露媒体名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》
登载年度报告的中国证监会指定网站的网址	http://www.sse.com.cn
公司年度报告备置地点	国金证券股份有限公司董事会办公室

**五、 公司股票简况**

公司股票简况				
股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称
A股	上海证券交易所	国金证券	600109	成都建投

**六、 公司其他情况**

(一) 公司历史沿革的情况，主要包括以前年度经历的改制重组、增资扩股等情况

√适用 □不适用

**1. 1990 年成都证券设立**

国金证券为成都城建投资发展股份有限公司（以下简称“原成都建投”）吸收合并国金证券有限责任公司（以下简称“国金有限”）后更名而成。国金有限前身为成都证券，根据中国人民银行《关于成立成都证券公司的批复》（银复[1990]498号）于1990年12月成立，注册资本为1,000万元人民币。

**2. 1997 年更名及增资改制**

1997年11月，根据中国人民银行非银行金融机构司《关于成都证券公司增资改制的批复》（非银证[1997]155号）、中国人民银行成都市分行《关于成都证券公司增资改制的通知》（成人行非

银[1997]6号),公司更名为“成都证券有限责任公司”,注册资本由1,000万元人民币增至2,500万元人民币。

### 3. 2003年更名及增加注册资本

2003年1月,根据中国证监会《关于同意调整成都证券有限责任公司增资扩股方案的批复》(证监机构字[2003]2号),公司更名为“成都证券经纪有限责任公司”,注册资本由2,500万元人民币增至12,800万元人民币。

### 4. 2005年更名及增加注册资本

2005年4月,中国证监会《关于同意成都证券经纪有限责任公司增资扩股并更名的批复》(证监机构字[2005]45号),批准公司更名为“成都证券有限责任公司”,注册资本由12,800万元人民币增至50,000万元人民币,业务范围比照综合类证券公司执行。2005年11月公司更名为“国金证券有限责任公司”。

### 5. 2008年成都建投吸收合并国金证券有限责任公司并更名

2008年1月,中国证监会《关于核准成都建投投资发展股份有限公司以新增股份吸收合并国金证券有限责任公司的批复》(证监许可[2008]113号)核准原成都建投以新增股份换股吸收合并国金证券有限责任公司,并更名为“国金证券股份有限公司”,国金证券股份有限公司继承国金证券有限责任公司(含分支机构)的各项证券业务资格,注册资本变更为500,121,062元。

### 6. 2009年未分配利润转增注册资本

2009年5月,中国证监会《关于核准国金证券股份有限公司变更注册资本的批复》(证监许可[2009]397号)核准公司注册资本变更为1,000,242,124元。

### 7. 2012年非公开发行变更注册资本

2012年11月,中国证券监督管理委员会《关于核准国金证券股份有限公司非公开发行股票的批复》(证监许可[2012]1412号),核准本公司非公开发行不超过3亿股新股。公司向特定对象非公开发行293,829,578股,注册资本变更为1,294,071,702元。

### 8. 2014年资本公积转增股本

经公司第九届董事会第十三次会议和2014年第二次临时股东大会审议通过,以截止到2014年6月30日公司总股本1,294,071,702股为基数,进行资本公积金转增股本,全体股东每10股转增10股,共计转增1,294,071,702股。公司于2014年10月24日完成了本次资本公积转增股本方案的实施,注册资本由1,294,071,702元变更为2,588,143,404元。

### 9. 2014年发行可转换公司债券并完成提前赎回变更注册资本

2014年5月14日,经中国证监会证监许可[2014]425号《关于核准国金证券股份有限公司公开发行可转换公司债券的批复》核准,公司发行了面值总额为人民币25亿元的A股可转债,并于2014年6月3日在上交所上市(可转债代码:110025)。2014年12月11日,公司第九届董事会第十七会议审议通过了《关于提前赎回“国金转债”的议案》,决定行使公司可转债的提前赎回权,对“赎回登记日”(2014年12月29日)登记在册的国金转债全部赎回。截止2014年12月29

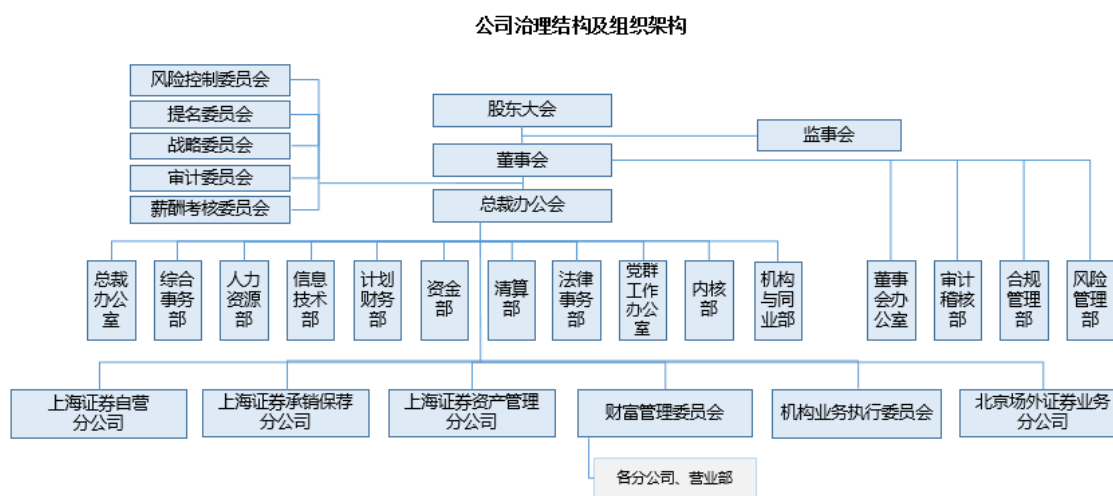
日，共计 2,484,682,000 元“国金转债”（110025）转换成“国金证券”（600109）股票，转股数为 248,715,906 股，公司注册资本变更为 2,836,859,310 股。

**10. 2015 年非公开发行变更注册资本**

2015 年 5 月，经中国证券监督管理委员会《关于核准国金证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2015]775 号）核准，公司非公开发行了 1.875 亿股新股，公司注册资本变更为 3,024,359,310 元。

**(二) 公司组织机构情况**

√适用 □不适用



**(三) 公司证券营业部的数量和分布情况**

√适用 □不适用

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共设立 68 家证券营业部，具体数量及分布如下：

省份	营业部家数	省份	营业部家数	省份	营业部家数
四川	24	北京	2	天津	1
重庆	1	上海	3	浙江	6
湖南	3	云南	1	福建	3
广东	5	江苏	5	陕西	1
辽宁	2	河南	1	湖北	1
安徽	1	山东	2	河北	1
江西	1	广西	1	贵州	1
新疆	1	山西	1		

营业部基本情况如下：

序号	营业部名称	注册地址	咨询电话



1	成都武成大街证券营业部	成都市武成大街 39 号	95310
2	成都东城根街证券营业部	四川省成都市东城根上街 95 号	95310
3	成都双元街证券营业部	成都市双楠小区双元街 99 号	95310
4	都江堰都江堰大道证券营业部	都江堰市都江堰大道 317 号 3 楼 3 号	95310
5	成都青白江青江东路证券营业部	成都市青白江区青江东路 213-215 号 1 单元 2 层	95310
6	成都龙泉驿区龙都南路证券营业部	成都市龙泉驿区龙泉街道龙都南路 3 号二楼	95310
7	成都温江区柳城商业新街证券营业部	成都市温江区柳城商业新街 48 号	95310
8	成都新都区马超西路证券营业部	成都市新都区新都街道马超西路 338 号 5 层	95310
9	邛崃东星大道证券营业部	邛崃市东星大道 80 号巴黎春天 3 层	95310
10	成都大邑县温泉路证券营业部	成都市大邑县晋原镇温泉路 201 号 4 号楼 3 楼 4-3-231 号	95310
11	成都天府大道证券营业部	成都市高新区天府大道中段 177 号 31 栋一单元 3 层 5、6、7 号商铺	95310
12	成都蒲江县杪楞路证券营业部	成都市蒲江县鹤山镇杪楞路中段 5 号	95310
13	上海长宁区长宁路证券营业部	上海市长宁区长宁路 1027 号 901、902 室	95310
14	北京长椿街证券营业部	北京市西城区长椿街 3 号 2-101	95310
15	厦门湖滨南路证券营业部	厦门市思明区湖滨南路 55 号禹洲广场 1002-1005 单元	95310
16	长沙芙蓉中路证券营业部	长沙市天心区芙蓉中路二段 168-1 号摩天一号大厦 2 座 7 楼	95310
17	杭州利一路证券营业部	杭州市萧山区宁围街道利一路 158 号世华帝宝大厦 2 幢 1902 室	95310
18	昆明北京路证券营业部	云南省昆明市北京路与金碧路交叉口西北角知本时代 SMART 城市公寓 2 层 2-A、B 室	95310
19	德阳岷江东路证券营业部	四川省德阳市岷江东路 136 号富丽名城 5 楼	95310
20	攀枝花新源路证券营业部	攀枝花市东区新源路 734 附 11 号	95310
21	南充江东中路证券营业部	四川省南充市高坪区江东中路七段 1 号天来大酒店第 10 幢 9 层 2、4、6、8、10、12 号	95310
22	内江汉安大道证券营业部	内江市东兴区汉安大道西段 925 号	95310

23	广安思源大道证券营业部	四川省广安市广安区思源大道 28 号	95310
24	天津南京路证券营业部	天津市和平区南京路 183 号 世纪都会 21 层 2104 室	95310
25	衡阳蒸阳南路证券营业部	衡阳市雁峰区蒸阳南路 2 号崇业商业广场三区 907、908 室	95310
26	深圳益田路证券营业部	深圳市福田区福田街道福安社区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 T3 座 2402A	95310
27	福州古田路证券营业部	福州市鼓楼区古田路 60 号福晟财富中心 28 层 03,05-07 单元	95310
28	郑州商务外环路证券营业部	河南自贸试验区郑州片区（郑东）CBD 商务外环路 28 号	95310
29	沈阳青年大街证券营业部	辽宁省沈阳市沈河区青年大街 121 号（2907、2908、2909）	95310
30	绵阳临园路证券营业部	四川省绵阳市涪城区临园路西段 23 号（美乐-城市之星）1 栋 1 层 4 号	95310
31	上海浦东新区芳甸路证券营业部	上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 19 楼 1905 室	95310
32	南京江东中路证券营业部	南京市建邺区江东中路 108 号万达广场 C 座 202-204 室	95310
33	重庆聚贤街证券营业部	重庆市江北区江北嘴金融城 3 号 T1 栋 12-4	95310
34	广州华夏路证券营业部	广州市天河区华夏路 16 号富力盈凯 3910 室	95310
35	武汉中北路证券营业部	武昌区水果湖街汉街武汉中央文化旅游区 K3 地块 2 幢 23 层 6 号	95310
36	西安唐延路证券营业部	陕西省西安市高新区唐延路 51 号人寿壹中心 604、605 室	95310
37	上海奉贤区金碧路证券营业部	上海市奉贤区金汇镇金碧路 1950 号 206 室	95310
38	合肥濉溪路证券营业部	合肥市庐阳区濉溪路 310 号翡丽时代广场商业综合楼 B 座 806 室	95310
39	济南经十路证券营业部	济南市槐荫区经十路 22799 号银座中心 1 号楼 3102 室	95310
40	南昌世贸路证券营业部	江西省南昌市红谷滩区世贸路 699 号联泰时代广场 1 幢 151、152 室	95310
41	南宁民族大道证券营业部	南宁市青秀区民族大道 136-2 号南宁华润中心西写	95310

		字楼 1001 室	
42	杭州曙光路证券营业部	浙江省杭州市西湖区曙光路 122 号世贸大厦 A 座 901、903 室	95310
43	石家庄槐安东路证券营业部	河北省石家庄市裕华区槐安东路 158 号鑫科国际广场 C 座 1502、1503 室	95310
44	北京建国门内大街证券营业部	北京市东城区建国门内大街 26 号新闻大厦 620	95310
45	成都高新区交子大道证券营业部	成都市高新区交子大道 233 号中海国际中心 C 座 20 层	95310
46	乐山平江东街证券营业部	四川省乐山市市中区平江东街 17 号 1 幢 1 单元 2 楼	95310
47	成都光华东一路证券营业部	四川省成都市青羊区光华东一路 75 号	95310
48	泸州康城路证券营业部	四川省泸州市江阳区康城路一段 9 号 1 号楼 22 层 2202 号	95310
49	徐州大马路证券营业部	徐州市鼓楼区大马路 99 号启迪之星加速器（徐州）第 77 区 S002 室	95310
50	眉山大雅街证券营业部	四川省眉山市东坡区大雅街 366.368.370 号众和铭座 6 栋 1 层	95310
51	泉州云鹿路证券营业部	福建省泉州市丰泽区云鹿路鲲鹏国际中心 7 层 703、705 单元	95310
52	绍兴解放大道证券营业部	浙江省绍兴市越城区解放大道 701 号越发大厦 1903 室	95310
53	乌鲁木齐红山路证券营业部	新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市天山区红山路 26 号时代广场小区 1 栋 34 层 C 座 C34N、C34O	95310
54	无锡金融一街证券营业部	无锡市滨湖区金融一街 1 号昌兴国际金融大厦 1001、1002、1003 室	95310
55	宜宾蜀南大道证券营业部	四川省宜宾市叙州区蜀南大道西段 14 号新世纪购物广场 10 层 11.12.13 号	95310
56	珠海港昌路证券营业部	珠海市香洲区港昌路 88 号商铺	95310
57	苏州中心广场证券营业部	苏州市工业园区苏州中心广场 58 幢 A 座 11 层 08 号房	95310
58	贵阳毕节路证券营业部	贵州省贵阳市贵阳国家高新技术产业开发区毕节路 58 号联合广场 2 号楼 18 层 3 号	95310

59	佛山融和路证券营业部	佛山市南海区桂城街道融和路 25 号荣耀国际金融中心 1304-1305A 室	95310
60	太原长兴路证券营业部	山西省太原市万柏林区长兴路 1 号 3 幢 10 层 1006-1010 号	95310
61	郴州文化路证券营业部	湖南省郴州市北湖区人民路街道文化路 150 号	95310
62	温州蒋家桥路证券营业部	温州市鹿城区蒋家桥锦园 1 幢 105 室	95310
63	东莞鸿福路证券营业部	广东省东莞市南城街道鸿福路 200 号 4 栋 2 单元 1703 室	95310
64	青岛苗岭路证券营业部	青岛市崂山区苗岭路 36 号 2 号楼 1203、1204	95310
65	大连长江路证券营业部	大连市中山区长江路 280 号大连中心·裕景 5 号楼 ST2 大厦第 34 层 1 单元 02B、03A 号房	95310
66	金华人民广场证券营业部	浙江省金华市婺城区城西街道八一北街 190 号	95310
67	南通工农南路证券营业部	江苏省南通市崇川区工农南路 118 号汇金国际 B 栋 104-106 号	95310
68	宁波中兴路证券营业部	浙江省宁波市鄞州区中兴路 653 号<1-3>	95310

#### (四) 其他分支机构数量与分布情况

√适用 □不适用

分公司名称	设立时间	地址	营运资金	负责人	咨询电话
上海互联网证券分公司	2006年8月	上海市黄浦区西藏中路336号2208、2209室	0.05亿元	李俭	021-61038209
上海证券承销保荐分公司	2010年12月	上海浦东新区芳甸路1088号23层	2亿元	任鹏	021-68826021
上海证券自营分公司	2010年12月	上海市浦东新区芳甸路1088号20层2002	8.5亿元	金鹏	021-61945816
上海证券资产管理分公司	2012年11月	上海市浦东新区芳甸路1088号1101	0.5亿元	马骏	021-61207610
上海投资咨询分公司	2014年4月	上海市浦东新区芳甸路1088号7层01-06单元	1.5亿元	何媛媛	021-60753909
北京场外证券业务分公司	2016年8月	北京市东城区建国门内大街26号新闻大厦17楼	2亿元	丁志卿	010-85142899

深圳分公司	2020年6月	深圳市福田区深南大道4001号时代金融中心7B	0.05亿元	孙协富	0755-83830555
海南分公司	2020年10月	海南省海口市秀英区长滨三路6号鲁能中心C栋1层商铺5、2层商铺11	0.05亿元	印德平	0898-68918312

## 七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所 (境内)	名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)
	办公地址	杭州市江干区钱江路1366号华润大厦B座
	签字会计师姓名	李元良、李青松

## 八、近三年主要会计数据和财务指标

### (一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	2020年	2019年	本期比上年同期增减(%)	2018年
营业收入	6,062,801,499.95	4,349,514,734.00	39.39	3,766,119,304.82
归属于母公司股东的净利润	1,862,640,224.66	1,298,539,701.33	43.44	1,010,492,527.44
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,791,000,384.46	1,249,406,087.02	43.35	932,351,403.36
经营活动产生的现金流量净额	-3,415,491,924.30	-1,874,236,164.66	-	2,597,501,223.75
其他综合收益	31,361,037.73	123,213,097.10	-74.55	-215,323,065.75
	2020年末	2019年末	本期末比上年同期末增减(%)	2018年末
资产总额	67,630,340,286.45	50,151,031,164.73	34.85	46,667,401,967.04
负债总额	45,090,158,556.94	29,362,617,956.88	53.56	27,106,523,520.01
归属于母公司股东的权益	22,465,393,909.07	20,722,610,611.29	8.41	19,489,680,217.07
所有者权益总额	22,540,181,729.51	20,788,413,207.85	8.43	19,560,878,447.03

### (二) 主要财务指标

主要财务指标	2020年	2019年	本期比上年同期增减(%)	2018年
基本每股收益(元/股)	0.616	0.429	43.59	0.334
稀释每股收益(元/股)	0.616	0.429	43.59	0.334
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.592	0.413	43.34	0.308
加权平均净资产收益率(%)	8.63	6.48	增加2.15个百分点	5.28

扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率 (%)	8.30	6.23	增加2.07个百分点	4.87
--------------------------	------	------	------------	------

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

### (三) 母公司的净资本及风险控制指标

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
核心净资本	19,141,319,988.29	17,593,563,610.46
附属净资本	500,000,000.00	700,000,000.00
净资本	19,641,319,988.29	18,293,563,610.46
净资产	22,087,870,950.88	20,406,171,586.66
各项风险准备之和	5,470,560,160.23	4,835,623,989.43
表内外资产总额	51,071,440,413.69	36,868,006,249.28
风险覆盖率 (%)	359.04	378.31
资本杠杆率 (%)	37.48	47.72
流动性覆盖率 (%)	261.09	229.60
净稳定资金率 (%)	149.43	152.54
净资本/净资产 (%)	88.92	89.65
净资本/负债 (%)	71.40	122.39
净资产/负债 (%)	80.29	136.53
自营权益类证券及证券衍生品/净资本 (%)	19.29	22.08
自营非权益类证券及其衍生品/净资本 (%)	108.00	85.59

注：2020 年末净资本、风险资本准备及相关风险控制指标根据中国证监会颁布的《关于修改〈证券公司风险控制指标管理办法〉的决定》（证监会令第 125 号）、《证券公司风险控制指标计算标准规定》（证监会公告[2020]10 号）的要求计算，2019 年末数据亦根据相同口径调整计算。

## 九、境内外会计准则下会计数据差异

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

适用 不适用

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

适用 不适用

(三) 境内外会计准则差异的说明：

适用 不适用

## 十、2020 年分季度主要财务数据

单位：元 币种：人民币

	第一季度 (1-3 月份)	第二季度 (4-6 月份)	第三季度 (7-9 月份)	第四季度 (10-12 月份)
--	------------------	------------------	------------------	--------------------

营业收入	1,391,725,775.44	1,504,501,017.93	1,831,775,046.61	1,334,799,659.97
归属于上市公司股东的净利润	476,137,648.02	525,366,233.08	563,716,499.31	297,419,844.25
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	459,011,400.45	522,850,279.61	561,177,540.08	247,961,164.32
经营活动产生的现金流量净额	1,476,044,137.91	-575,249,265.81	-4,569,687,675.59	253,400,879.19

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

#### 十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

非经常性损益项目	2020 年金额	附注 (如适用)	2019 年金额	2018 年金额
非流动资产处置损益	-974,961.09		-910,724.91	-1,454,585.37
越权审批, 或无正式批准文件, 或偶发性的税收返还、减免				
计入当期损益的政府补助, 但与公司正常经营业务密切相关, 符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	90,522,433.32	财政扶持及奖励款	56,169,017.55	100,391,545.30
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费				
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益				
非货币性资产交换损益				
委托他人投资或管理资产的损益				
因不可抗力因素, 如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备				
债务重组损益				
企业重组费用, 如安置职工的支出、整合费用等				
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益				
同一控制下企业合并产生的				

子公司期初至合并日的当期净损益				
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益				
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益				
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回			1,901,282.78	
对外委托贷款取得的损益				
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益				
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响				
受托经营取得的托管费收入				
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-6,209,278.10		-2,086,344.04	-2,740,641.66
其他符合非经常性损益定义的损益项目	12,656,454.68		11,008,213.26	8,321,688.28
少数股东权益影响额	-356,146.41		-520,943.75	-275,258.14
所得税影响额	-23,998,662.20		-16,426,886.58	-26,101,624.33
合计	71,639,840.20		49,133,614.31	78,141,124.08

## 十二、 采用公允价值计量的项目

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期初余额	期末余额	当期变动	对当期利润的影响金额
交易性金融资产	13,473,513,559.31	18,873,090,456.71	5,399,576,897.40	1,209,749,751.73
衍生金融资产		704,900.00	704,900.00	207,056,311.46
其他债权投资	795,752,348.57	1,019,343,647.45	223,591,298.88	30,578,515.67
其他权益工具投资	2,623,191,791.41	2,689,210,146.85	66,018,355.44	-
交易性金融负债	2,207,439,594.38	1,998,825,621.81	-208,613,972.57	-47,233,215.24
衍生金融负债	55,844,982.00	83,000,181.94	27,155,199.94	23,961,965.63



合计	19,155,742,275.67	24,664,174,954.76	5,508,432,679.09	1,424,113,329.25
----	-------------------	-------------------	------------------	------------------

### 十三、 其他

√适用 □不适用

按《证券公司年度报告内容与格式准则》（2013年修订）（证监会公告[2013]41号）的要求编制的主要财务数据和指标

#### 1. 合并财务报表主要会计数据和财务指标

单位:元 币种:人民币

项 目	2020年 (或2020年1-12月)	2019年 (或2019年1-12月)	增减百分比(%)
资产总额	67,630,340,286.45	50,151,031,164.73	34.85
负债总额	45,090,158,556.94	29,362,617,956.88	53.56
所有者权益总额	22,540,181,729.51	20,788,413,207.85	8.43
营业收入	6,062,801,499.95	4,349,514,734.00	39.39
归属于母公司所有者的净利润	1,862,640,224.66	1,298,539,701.33	43.44
其他综合收益的税后净额	31,361,037.73	123,213,097.10	-74.55
结算备付金	3,177,017,979.84	2,319,895,282.12	36.95
融出资金	14,815,372,516.95	9,178,386,106.25	61.42
存出保证金	1,415,762,304.98	985,053,449.62	43.72
应收款项	90,944,642.04	60,446,787.46	50.45
买入返售金融资产	8,049,753,172.83	5,419,444,483.97	48.53
交易性金融资产	18,873,090,456.71	13,473,513,559.31	40.08
固定资产	107,314,744.71	82,086,210.63	30.73
递延所得税资产	421,029,661.56	308,381,799.47	36.53
应付短期融资款	8,020,043,250.21	3,332,214,079.93	140.68
拆入资金	1,157,635,555.53	200,956,944.44	476.06
卖出回购金融资产款	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31	127.50
应付职工薪酬	2,689,797,674.48	1,848,955,477.50	45.48
应交税费	454,177,948.87	157,387,311.79	188.57
应付债券	6,673,626,986.44	4,155,167,123.38	60.61
手续费及佣金净收入	3,686,611,926.91	2,329,629,723.52	58.25
投资收益	1,339,785,548.97	994,000,895.19	34.79
公允价值变动收益	71,122,752.95	245,401,722.57	-71.02
业务及管理费	3,586,639,701.52	2,661,882,213.14	34.74
信用减值损失	99,601,924.21	-22,010,037.47	-
营业外收入	91,907,319.94	57,522,113.60	59.78
所得税费用	550,695,831.67	407,637,958.36	35.09
经营活动产生的现金流量净额	-3,415,491,924.30	-1,874,236,164.66	-
投资活动产生的现金流量净额	-295,981,937.47	979,760,567.55	-130.21
筹资活动产生的现金流量净额	6,652,764,569.72	2,327,742,624.49	185.80
净资产收益率	8.63	6.48	增加2.15个百分点
每股收益	0.616	0.429	43.59

#### 2. 母公司财务报表主要会计数据和财务指标

单位:元 币种:人民币

项 目	2020 年 (或 2020 年 1-12 月)	2019 年 (或 2019 年 1-12 月)	增减百分比(%)
资产总额	63,475,107,900.88	46,917,954,185.22	35.29
负债总额	41,387,236,950.00	26,511,782,598.56	56.11
所有者权益总额	22,087,870,950.88	20,406,171,586.66	8.24
营业收入	5,695,943,597.83	3,987,926,888.37	42.83
净利润	1,794,163,914.61	1,248,469,602.13	43.71
其他综合收益的税后净额	38,753,415.11	113,409,938.54	-65.83
结算备付金	3,047,539,720.43	2,111,028,705.24	44.36
融出资金	14,527,129,369.69	8,879,808,052.35	63.60
存出保证金	765,754,936.70	364,895,661.81	109.86
买入返售金融资产	4,630,744,627.88	1,993,592,697.78	132.28
交易性金融资产	20,689,501,769.93	15,591,154,083.57	32.70
固定资产	103,258,877.47	77,307,746.18	33.57
递延所得税资产	377,656,546.05	275,931,104.11	36.87
应付短期融资款	8,020,043,250.21	3,332,214,079.93	140.68
拆入资金	1,157,635,555.53	200,956,944.44	476.06
卖出回购金融资产款	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31	127.50
应付职工薪酬	2,630,746,069.98	1,797,322,475.15	46.37
应交税费	441,749,828.67	144,173,665.00	206.40
应付债券	6,673,626,986.44	4,155,167,123.38	60.61
手续费及佣金净收入	3,471,813,388.96	2,158,464,090.46	60.85
投资收益	1,516,807,287.43	1,116,697,859.74	35.83
公允价值变动收益	-17,599,968.83	139,293,776.95	-112.64
业务及管理费	3,350,957,902.91	2,426,718,660.90	38.09
信用减值损失	70,812,901.30	-71,370,007.83	-
营业外收入	85,300,800.92	52,720,213.14	61.80
所得税费用	522,867,248.45	376,454,576.80	38.89
经营活动产生的现金流量净额	-4,066,984,367.87	-2,032,710,690.82	-
投资活动产生的现金流量净额	-294,478,816.01	897,038,395.04	-132.83
筹资活动产生的现金流量净额	6,638,767,097.86	2,332,636,465.44	184.60

### 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

报告期内，本公司结合个人、机构以及企业客户的投融资需求，通过开展证券经纪业务、投资银行业务、资产管理业务、信用交易业务、新三板业务及境外业务等，为其提供多元化、多层次的证券金融服务。同时公司还开展自营投资业务。主要业务如下：

**证券经纪业务：**本公司为个人及机构客户代理买卖股票、基金、债券、衍生金融工具等；向个人及机构客户代销金融产品，并提供财富管理服务、投资研究咨询服务。

**投资银行业务：**本公司为企业客户提供多元化的投资银行服务，包括但不限于股权融资、债权融资、并购重组财务顾问等服务。

**资产管理业务：**本公司作为资产管理人，接受个人及机构客户的委托，对客户资产进行经营运作，为客户提供证券及其他金融产品的投资管理服务。

**信用交易业务：**本公司为个人及机构客户提供包括融资融券、股票质押式回购及约定购回式交易等资本中介服务。

**新三板业务：**本公司为企业客户提供多元化的新三板市场服务，包括但不限于推荐挂牌、做市商服务等。

**证券投资业务：**本公司以自有资金进行权益类证券、固定收益类证券、另类投资及衍生金融工具投资，获取投资收益。

**境外业务：**本公司以香港子公司为基点，稳健拓展境外业务，为个人、机构及企业客户在香港市场提供证券销售及交易、投资银行及资产管理等服务。

2020 年，突如其来的新冠疫情对全球公共卫生带来巨大冲击，外部环境动荡不安，世界经济衰退。得益于国内对疫情的迅速响应、严肃应对、有效控制，中国经济率先迎来复苏，并保持稳步向好态势。在货币政策相对宽松、流动性较为充裕的背景下，国内资本市场交投活跃度显著上升；以新《证券法》、注册制为代表的各项深化改革政策持续落地，也为证券行业业务规模及营收增长提供了强劲动能。

面对宏观经济及资本市场的形势变化，公司秉承“让金融服务更高效、更可靠”的使命，追求“成为举足轻重的金融服务机构”的商业愿景，坚持“客户至上、视人才为公司最重要的资本、以开放心态真诚沟通、团队合作、专业规范、持续优化、追求卓越”的企业核心价值观，不断夯实“差异化增值服务商”的战略定位，坚定落实“以研究咨询为驱动，以经纪业务和投资银行业务为基础，以证券资产管理业务和创新业务为重点突破，以自营和其他业务为重要补充”的业务发展模式，坚持合规风险管理与业务创新发展并重，努力将公司建设成为“治理健全、管理规范、业务精湛、资质齐备、技术领先”的国内证券行业具有一流竞争力和影响力的上市券商。

报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

适用 不适用

截至 2020 年 12 月 31 日,公司交易性金融资产余额 188.73 亿元,比上年年末增加 54.00 亿元,增幅为 40.08%,主要原因为期末债券投资增加;融出资金余额 148.15 亿元,比上年年末增加 56.37 亿元,增幅为 61.42%,主要为融资融券业务规模扩大所致。报告期公司的资产变化情况详见第四节二、(三)资产、负债情况分析。

其中:境外资产 1,448,878,356.77 (单位:元 币种:人民币),占总资产的比例为 2.14%。

## 二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

一是公司治理结构健全,股东支持长远发展。

作为上市券商,公司法人治理结构健全清晰,股东履行职责,支持公司可持续健康发展。公司管理层经验丰富,以公司的长远发展和股东回报为根本目标,决策效率高。

二是公司财务杠杆稳健,资本实力持续夯实。

公司秉持稳健经营理念,财务杠杆及资产负债率一直处于行业较低水平,长期以来保持良好财务状况。通过对政策动向和市场环境的研判,公司在股权、债权融资方面积极开展前瞻性规划,匹配业务发展要求,不断夯实资本实力。

三是公司经营战略明晰,业务发展锐意进取。

公司坚持“让金融服务更高效、更可靠”的使命和“成为举足轻重的金融服务机构”的商业愿景,作为业务范围辐射全国的综合类券商,公司积极推动各重点业务条线转型变更,布局创新业务领域并获取创新业务资质。公司借力互联网证券业务发展迅速扩大零售客户规模,推进财富管理转型精准响应高净值客户需求;通过研究中心化布局及深耕数据研究为机构客户提供高水平创新性的服务支持;以深耕行业、产业细分领域,沉淀上市并购深度经验,以及创新结构融资产品模式,来服务和解决企业客户全周期的融资需求及难题。

四是公司健全合规管理体系,完善风险控制体系。

公司分类监管评级为 A 类 AA 级,建立全面合规管理体系和全面风险管理体系,切实保障公司经营合规,业务风险可控。在合规管理方面,公司高度重视客户适当性管理、投资者权益保护及反洗钱等工作落实,以专业举措守卫业务发展底线;在风险管理方面,公司开展全面风险管理体系建设,加强风险管理系统研发投入,从业务风险计量到操作风险管控,实现对公司业务开展全过程的风险可测、可控、可承受。

五是公司管理机构高效协同,激励机制市场化程度高。

公司采用扁平化组织架构,条块管理清晰、资源配置高效,在决策机制上深化“放、管、服”,适度简政放权确保业务团队市场响应敏捷;在管理机制上重视“横向协同”,围绕客户服务实现跨业务、跨区域的协同增效。同时,公司在激励机制上秉持市场化原则,根据公司经营目标及业务条线特点,结合行业市场环境变化情况,动态调整和优化绩效考核和激励机制,最大程度激发员工的工作动力。此外,公司建立了与企业文化、价值观相匹配的员工素质模型,通过完善的人才发展、培训计划,实现对公司人才的长效培育。

## 第四节 经营情况讨论与分析

### 一、经营情况讨论与分析

2020 年，新型冠状病毒疫情对全球各国公共卫生带来巨大冲击，世界经济衰退；得益于国内对疫情的有效控制，中国经济率先迎来复苏，并保持稳步向好态势；在货币政策相对宽松、流动性较为充裕、改革政策持续落地的背景下，国内资本市场交投活跃度显著上升。2020 年上证综指上涨 13.87%，沪深两市日均股基交易额为 8,478.08 亿元，较上年增长 63.05%；2020 年末沪深两市两融余额 16,189.68 亿元，较上年末增长 58.83%（数据来源：WIND 数据）。

根据证券公司 2020 年度未经审计经营数据显示，证券行业 2020 年度实现营业收入 4,484.79 亿元，同比增长 24.41%；实现净利润 1,575.34 亿元，同比增长 27.98%，127 家证券公司实现盈利（数据来源：中国证券业协会）。

报告期内，公司秉持合规稳健的经营理念，坚守合规底线、强化风险控制，在把握资本市场深化改革机遇推动业务发展与资产规模增长的同时，夯实组织管理能力、增强金融科技建设，通过过程管理、机制激励、协同增效、合作创收等举措，发挥公司各项业务竞争优势，实现公司经营目标。公司积极拓展融资渠道，全年向专业投资者累计公开发行 40 亿元公司债券，发行 10 亿元公募短期公司债；公司业务资质不断完善，取得利率期权市场成员资格。公司证券经纪业务积极推动财富管理转型，借助客户分层分类提升精准营销、持续金融科技投入赋能业务开拓，构建多元化、差异化产品及服务体系，同时报告期内公司获准在浙江省宁波市、浙江省金华市、江苏省徐州市、江苏省南通市、广东省汕头市和河南省洛阳市各设立 1 家证券营业部（C 型）。公司机构业务夯实重点产业链研究实力，创新数据研究产品，匹配客户需求整合资源，协同发展资产托管、行政外包等综合机构服务产品。公司投资银行业务坚持长短结合、股债并举，全年加大科创板及创业板项目开拓，重视债券业务投入，在特色行业领域持续发挥竞争服务能力优势，为客户提供全方位、全周期的融资服务。公司资产管理业务持续转型变革，专注主动管理水平不断提升，在资产证券化结构融资、多资产主动管理产品等方向推动产品创新及项目落地。公司自营业务保持稳健投资策略，高度关注市场波动，严格控制风险优化资产配置，谨慎开展投资及尝试创新投资品种，获取良好投资回报收益。其他业务方面，私募基金业务合规审慎开展基金募集及投资，在疫情影响下加强风控管理确保业务可持续发展，国际业务发挥境内外团队优势，提升企业融资、资产管理服务能力，满足客户跨境投融资需求。公司主体信用等级保持 AAA 级，评级展望为稳定。

### 二、报告期内主要经营情况

2020 年，公司坚持合规稳健经营的同时积极把握资本市场深化改革机遇，持续推动各项业务经营业绩稳步增长。截至 2020 年 12 月 31 日，公司总资产 676.30 亿元，较上年末增长 34.85%；归属于母公司股东的权益 224.65 亿元，较上年末增长 8.41%。报告期内，公司取得营业收入 60.63 亿元，同比增长 39.39%；归属于母公司股东的净利润 18.63 亿元，同比增长 43.44%。

## (一) 主营业务分析

## 利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位:元 币种:人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	6,062,801,499.95	4,349,514,734.00	39.39
营业成本	3,721,678,050.12	2,697,059,807.33	37.99
管理费用	3,586,639,701.52	2,661,882,213.14	34.74
经营活动产生的现金流量净额	-3,415,491,924.30	-1,874,236,164.66	-
投资活动产生的现金流量净额	-295,981,937.47	979,760,567.55	-130.21
筹资活动产生的现金流量净额	6,652,764,569.72	2,327,742,624.49	185.80
研发支出	75,223,512.66	59,742,379.85	25.91

## 1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

2020 年资本市场景气度提升,整体交易度活跃,公司证券经纪业务、投资银行业务、自营业务、资产管理业务经营业绩较上年同期均实现增长。报告期内,公司实现营业收入 60.63 亿元,同比上升 39.39%,营业成本 37.22 亿元,同比上升 37.99%。

## (1). 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位:元 币种:人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
证券经纪业务	1,820,603,374.97	1,095,238,197.43	39.84	38.72	22.77	增加 7.81 个百分点
投资银行业务	1,665,969,189.13	1,080,204,432.09	35.16	88.67	48.46	增加 17.56 个百分点
证券投资业务	1,175,078,183.59	245,581,911.46	79.10	9.07	46.92	减少 5.39 个百分点
资产管理业务	182,446,672.52	159,900,869.19	12.36	33.43	7.10	增加 21.55 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 (%)
四川省内营业部	551,937,582.62	189,950,826.03	65.58	38.52	24.05	增加 4.01 个百分点
四川省外营业部	756,435,558.37	298,825,220.13	60.50	37.96	28.43	增加 2.93 个百分点

本部、分公司及子公司	4,754,428,358.96	3,232,902,003.96	32.00	39.72	39.88	减少 0.08 个百分点
------------	------------------	------------------	-------	-------	-------	--------------

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

√适用 □不适用

### ①证券经纪业务

2020 年，在加强合规及风险管理的前提下，公司财富管理委员会围绕“加快推进财富管理转型落地”的年度战略目标，在“零售客户线上化，线下高客机构化”的基础上，以“平台+人工”的方式，促成各业务线与产品线、科技线紧密联动，以产品叠加策略为手段，以提升客户粘性为目标，努力提高客户销售服务水平和效率，打造核心竞争力。

在品牌营销及渠道推广上，一方面，持续进行品牌传播，提升客户品牌认知，强化平台互动营销；另一方面，扩大渠道覆盖及合作范围，疫情期间充分运用各类线上渠道、工具、内容开展线上活动，通过与渠道方业务联动，有效提升品牌影响力。

金融科技赋力业务转型升级：依托金融科技的迭代更新，深挖数据潜在价值，充分运用金融科技手段为客户提供全面财富管理服务，打造更稳定、更智能的客户端并贯通员工展业端，实现业务智能化运营，提升客户极致体验及员工服务效能；通过量化平台和大数据分析的技术应用，进一步做深客户-产品-服务的精准匹配，以智能化、精准化、专业化提升平台+人工联动效率。

打造有温度的客户服务体验：坚守以客户为中心的核心价值观，做深“星享金牌服务”体系。在智能服务体系的基础上，重点打造有人有温度的服务体系，为客户匹配专属服务人员，及时解决客户在投资过程中的疑难，满足不同客户的个性化需求。

在零售客户线上化方面，今年线上业务融合更进一步，各业务线围绕平台营销，通过交易、理财、咨询、融资等服务手段的运用，加强业务联动，打磨和提升了员工的服务能力，逐步提升客户粘性，提高整体服务水平和服务效率，降低业务风险。线下高客机构化方面，依托业务线及公司产品线的专家网络支持，为高净值客户提供平台+人工的全方位金融服务，并叠加金融顾问的一对一管家式服务，主要的服务内容除了覆盖基础的股票交易、两融业务、单产品销售及股票单产品咨询，还包含综合财富管理解决方案，为客户提供个性化、差异化服务。

报告期内公司经纪业务股票、基金、债券交易总金额达到 56,013.95 亿元，比上年增加 57.75%，其中股票基金交易总金额 51,216.56 亿元，比上年同期增加 48.08%。另外，公司还向基金公司等机构提供交易单元。2020 年公司证券经纪业务实现营业收入 18.21 亿元，较上年同期增长 38.72%。

### 代理买卖证券情况

证券种类	2020 年交易额（亿元）	市场份额	2019 年交易额（亿元）	市场份额
股票	46,758.04	1.12%	31,285.61	1.22%
基金	4,458.52	1.64%	3,300.81	1.80%
债券	4,797.39	1.19%	920.72	0.55%
合计	56,013.95	1.15%	35,507.14	1.22%

备注：上表所列交易额包含普通经纪业务证券交易额及因融资融券业务产生的证券交易金额，但不包括基金公司等机构租用公司席位实现的交易额。

### 代理销售金融产品情况

单位：万元 币种：人民币

证券种类	销售金额	赎回金额
证券投资基金	41,074,241.97	40,713,027.38
资管计划	1,371,498.26	1,291,169.15
信托产品	272,335.30	273,938.17
合计	42,718,075.53	42,278,134.70
代销收入		20,161.91

### ②投资银行业务

伴随资本市场改革进一步深入，再融资新规正式落地、创业板注册制推出，作为资本市场核心中介，证券公司投资银行业务迎来持续壮大的发展空间。从各主要业务类型看，IPO 审核节奏和发行节奏提速，IPO 的发行数量和募集资金规模较 2019 年大幅上升；由于再融资新规的实施，上市公司再融资规模上升；并购重组市场的交易活跃度下滑，2020 年审核家次及通过率均创新低；2020 年，债券市场发行规模创新高，主要系发债利率水平走低，以及抗疫国债、地方政府债等发行量大幅增加所致。债券市场违约规模仍居高位，由破产重整导致的违约快速增加、国有企业债券违约风险提升、新增违约主体评级中枢加速上移等现象不容忽视，债券市场风险仍需警惕。2020 年，公司持续加强项目管理，强化业务人员的专业技术能力和质量控制意识；继续提升在各个投行业务领域的服务水平，提高项目运作水平，增强承销能力，为客户提供全面的专业服务。

2020 年，股权融资方面，公司分别担任了特宝生物（688278）、公牛集团（603195）、英杰电气（300820）、开普云（688228）、金丹科技（300829）、万泰生物（603392）、吉贝尔（688566）、力鼎光电（605118）、西域旅游（300859）、华丰股份（605100）、奥海科技（002993）、冠盛股份（605088）、欧陆通（300870）、蒙泰高新（300876）、新亚强（603155）、竞业达（003005）、松原股份（300893）、澳弘电子（605058）、仲景食品（300908）、华安鑫创（300928）等 IPO 项目，博世科（300422）增发项目，元力股份（300174）、首华燃气（300483）、回天新材（300041）、奥翔药业（603229）、湘油泵（603319）等非公开发行股票项目的保荐机构（主承销商），合计承销金额为 201.19 亿元。债券融资方面，公司共发行 138 支债券（含可转债），包括 20 嵊州 01、20 嵊州 02、20 兴信 01、20 兴信 02、20 黔交旅投债、G20 仙山、20 余杭 01、20 余杭 02、20 余杭 03、20 般阳 01、20 北控 Y1、20 阿地 01、20 旧改 01、20 即墨 D1、翔港转债、雷迪转债、聚飞转债、上机转债、润达转债、海容转债、祥鑫转债、威唐转债等，合计承销金额为 850.81 亿元。并购重组业务方面，公司担任了楚天科技、人福医药、南卫股份等重大资产重组项目的独立财务顾问。截至 2020 年 12 月末，公司共有注册保荐代表人 216 名，在全部保荐机构中排名第 9 位。

2020 年公司投资银行业务实现营业收入 16.66 亿元，较上年增长 88.67%。



### 证券承销业务情况

项目		2020 年度			2019 年度		
		承销次数	承销金额 (万元)	承销净收入 (万元)	承销次数	承销金额 (万元)	承销净收入 (万元)
主承销	新股发行	20	1,719,489.70	93,896.60	5	287,633.13	20,302.21
	增发新股	6	292,421.93	4,579.87	3	100,236.28	2,075.47
	配股						
	债券	130	8,122,389.62	41,000.56	67	5,260,500.00	37,302.97
	可转换债券	8	385,670.05	4,935.65	2	358,835.00	2,560.05
	其他	4	89,998.39	53.50	3	119,933.65	101.83
	小计	168	10,609,969.69	144,466.18	80	6,127,138.06	62,342.53
副主承销	新股发行						
	增发新股						
	配股						
	债券	2	50,000.00	212.26	3	35,000.00	102.08
	可转换债券						
	其他						
	小计	2	50,000.00	212.26	3	35,000.00	102.08
分销	新股发行	2	1,109.74	994.94	1	972.83	685.61
	增发新股						
	配股						
	债券	237	2,474,700.00	4,971.34	299	3,379,000.00	5,802.74
	可转换债券	1	2,000.00	2.83	1		4.72
	其他						
	小计	240	2,477,809.74	5,969.11	301	3,379,972.83	6,493.07
	总计	410	13,137,779.43	150,647.55	384	9,542,110.89	68,937.68

#### ③证券投资业务

2020 年，公司严格把控自营业务投资风险，在合规的前提下开展各项投资业务。在固定收益类投资方面，2020 年受疫情冲击，海外央行货币政策宽松规模创下历史记录；国内由于疫情控制得力，且外贸增长亮眼，央行保持了相当的定力。另外，随着刚兑打破的范围扩大，2020 年微观主体的信用环境则分化继续加大。全年来看，虽然 10 年国债收益率最后基本收平，但期间各类债券收益率大幅波动，价差剧烈变化。公司在报告期内采取了稳健的投资策略，加大交易灵活度，主动降低信用风险偏好，并适度对冲风险敞口，投资业务平稳发展。在权益类投资方面，公司在报告期内秉持稳健的投资风格，持续优化投研能力，根据市场发展及时调整优化投资策略，把控仓位，实施多元化投资分散风险。在场外业务方面，公司报告期内重点发行保本浮动型收益凭证和指数增强业务，稳健上量并逐步配置多元化结构分散对冲风险。2020 年公司证券投资业务实现营业收入 11.75 亿元，较上年增长 9.07%。

#### ④资产管理业务

国金资管是以主动管理为特色的差异化资产管理服务机构，2020 年，公司以防风险、强管理、稳发展为主线，不断提升投资管理能力和风险控制能力，积极拓展主动管理业务。目前权益类、固定收益类、FOF 类、股票质押式回购、资产证券化等主动管理为特色的业务稳步发展。公司以专业服务满足客户投融资需求，并凭借行业经验深入挖掘客户内在业务驱动逻辑，以专业规范推动业务创新，盘活存量资产。

本报告期内，公司新发行集合计划共计 20 只，单一计划共计 45 只，专项计划共计 16 只。截至 2020 年 12 月底，存续的集合资产管理计划共有 42 只(含处于清算期的产品)，管理规模为 32.79 亿元；存续的单一资产管理计划共有 123 只，管理规模为 712.66 亿元；存续的专项资产管理计划共有 23 只，管理规模为 111.69 亿元。

#### 资产管理业务规模和收入情况

单位：万元 币种：人民币

项目	受托资金		受托资产管理业务收入	
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日	2020 年度	2019 年度
集合资产管理业务	327,882.01	270,374.94	2,680.21	1,853.14
单一资产管理业务	7,126,647.14	8,431,039.38	6,440.96	6,351.89
专向资产管理业务	1,116,857.12	1,623,376.33	1,508.75	862.65
合计	8,571,386.27	10,324,790.65	10,629.92	9,067.68

备注：上述资料和数据为母公司口径。

#### ⑤信用交易业务

2020 年，公司信用交易业务稳步发展。期末信用账户累计开户数为 7.81 万户，较上年末增长 9.99%。报告期末公司的融资融券余额为 145.83 亿元，市场占有率为 8.84%。（数据来源：沪深交易所）。报告期内公司取得融资融券利息收入 78,233.41 万元（注：母公司口径）。

报告期内，约定购回式证券交易期末待购回金额为 0.01 亿元，利息收入 19.33 万元。自有资金直接出资的股票质押式回购交易客户期末待购回客户数为 24 户，待购回金额为 21.43 亿元，利息收入 11,472.55 万元。公司自有资金出资参与支持民营企业发展资产管理计划（纳入合并报表范围），股票质押式回购交易期末待购回金额为 34.83 亿元，利息收入 18,266.69 万元。

报告期末，公司表内股票质押式回购业务规模合计为 56.26 亿元，平均维持担保比率为 322.53%（各在途合同担保总资产之和/各在途合同负债总金额之和）。表外（即自有资金通过参与集合资产管理计划出资且未纳入合并报表范围）股票质押式回购业务规模为 0.15 亿元。

#### ⑥新三板业务

随着股转公司对挂牌准入要求的提高、监管力度的不断加大和市场流动性降低，新三板业务在 2020 年进一步放缓。公司着力在维护原有的新三板企业客户的基础上继续开拓优质新三板挂牌企业和做市企业，为客户提供更全面、更专业的服务。

2020年,公司完成1家企业的推荐挂牌业务,协助6家挂牌企业完成定向增发,合计融资4.85亿元,完成两个新三板收购项目。截至2020年12月31日,公司尚在履行持续督导职责的挂牌企业的家数为69家;公司持续督导的纳入创新层的新三板挂牌企业家数为10家。截至2020年12月31日,公司做市交易已上线项目28个,包括用友金融、宏源药业、恒立数控、民生科技、花嫁丽舍等,其中2020年新增上线项目13个。因挂牌企业拟IPO或内部决策等原因,2020年退出做市的企业共计9家。

### ⑦境外业务

国金金融控股(香港)有限公司为公司的境外金融控股子公司,下设全资子公司国金证券(香港)有限公司(以下简称“国金香港”)和国金财务(香港)有限公司。截至2020年12月31日,国金香港持有香港证监会核发的第1类牌照:证券交易;第2类牌照:期货合约交易;第4类牌照:就证券提供意见;第6类牌照:就机构融资提供意见;第9类牌照:提供资产管理。另外,国金香港于2013年12月获得中国证监会核发的RQFII资格。

目前,国金香港的主要业务包括销售及交易业务(为股票和期货产品提供交易服务);投资银行业务(股票承销和财务顾问)和资产管理业务。

2020年度国金香港代理股票交易量281.51亿港元,代理期货合约交易量14,410张;参与证券承销项目2个,参与财务顾问项目4个。截至2020年12月31日,资产管理业务受托资金13.94亿港元,RQFII业务受托资金2.12亿元人民币。

## (2). 成本分析表

单位:元 币种:人民币

分行业情况						
分行业	成本构成项目	本期金额	本期占总成本比例(%)	上年同期金额	上年同期占总成本比例(%)	本期金额较上年同期变动比例(%)
证券经纪业务	税金及附加、业务管理费、信用减值损失、其他资产减值损失、其他业务成本	1,095,238,197.43	29.43	892,071,699.14	33.08	22.77
投资银行业务	税金及附加、业务管理费、信用减值损失、其他资产减值损失、其他业务成本	1,080,204,432.09	29.02	727,615,595.75	26.98	48.46
证券投资业务	税金及附加、业务管理费、信用减值损失、其他资产减值损失、其他业务成本	245,581,911.46	6.60	167,153,549.76	6.20	46.92
资产管理业务	税金及附加、业务管理费、信用减值损失、其他资产减值损失、其他业务成本	159,900,869.19	4.30	149,294,345.84	5.54	7.10

## 2. 费用

√适用 □不适用

项目	本期数	上年同期数	增减幅度 (%)	主要原因
业务及管理费	3,586,639,701.52	2,661,882,213.14	34.74	报告期公司营业收入增加,相应各项业务成本费用增加。
所得税费用	550,695,831.67	407,637,958.36	35.09	报告期内公司利润总额增加,相应所得税增加。

## 3. 研发投入

### 研发投入情况表

√适用 □不适用

单位: 元

本期费用化研发投入	75,223,512.66
本期资本化研发投入	
研发投入合计	75,223,512.66
研发投入总额占营业收入比例 (%)	1.24
公司研发人员的数量	195
研发人员数量占公司总人数的比例 (%)	5.50
研发投入资本化的比重 (%)	

### 情况说明

□适用 √不适用

## 4. 现金流

√适用 □不适用

报告期内, 公司经营活动产生的现金流量净额为-341,549.19 万元, 比上年同期减少 154,125.58 万元, 主要是由于交易目的而持有的金融资产及融出资金增加导致现金流出。具体构成来看, 经营活动现金流入的主要项目: 收到利息、手续费及佣金的现金流入 611,895.29 万元, 代理买卖证券收到的现金净额 276,511.11 万元, 拆入资金增加的现金流入 95,000.00 万元。经营活动现金流出的主要项目: 融出资金净增加额 559,854.28 万元, 为交易目的而持有的金融资产净增加额 416,669.64 万元, 支付给职工的现金及支付的业务管理费 265,093.51 万元, 支付利息、手续费及佣金的现金流出 81,074.12 万元。

投资活动产生的现金流量净额为-29,598.19 万元, 比上年同期减少 127,574.25 万元, 主要为债权投资收回的现金减少所致。主要构成项目: 收回投资收到的现金 84,009.42 万元, 取得投资收益收到的现金 4,602.31 元, 投资支付的现金 107,341.14 万元, 购建和处置固定资产、无形资产等现金净流出 11,106.63 万元。

筹资活动产生的现金流量净额为 665,276.46 万元, 比上年同期增加 432,502.19 万元, 主要原因为本期发行债券收到的现金增加。主要构成项目: 借款和发行债券收到的现金 2,125,255.93 万元, 偿还债务支付的现金 1,406,864.30 万元, 分配股利或偿付利息产生的现金流出 53,115.17 万元。

公司经营活动产生的现金净流量包含为交易目的而持有的金融资产净增加额、拆借及回购业务资金净增加额、代理买卖证券及融资业务资金净增加额等，该部分现金流入流出与损益无直接对应关系，因此经营活动产生的现金流量净额与净利润存在较大差异。

## (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

## (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上期期末数	上期期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上期期末变动比例 (%)	情况说明
结算备付金	3,177,017,979.84	4.70	2,319,895,282.12	4.63	36.95	
融出资金	14,815,372,516.95	21.91	9,178,386,106.25	18.30	61.42	
存出保证金	1,415,762,304.98	2.09	985,053,449.62	1.96	43.72	
应收款项	90,944,642.04	0.13	60,446,787.46	0.12	50.45	
买入返售金融资产	8,049,753,172.83	11.90	5,419,444,483.97	10.81	48.53	
交易性金融资产	18,873,090,456.71	27.91	13,473,513,559.31	26.87	40.08	
固定资产	107,314,744.71	0.16	82,086,210.63	0.16	30.73	
递延所得税资产	421,029,661.56	0.62	308,381,799.47	0.61	36.53	
应付短期融资款	8,020,043,250.21	11.86	3,332,214,079.93	6.64	140.68	
拆入资金	1,157,635,555.53	1.71	200,956,944.44	0.40	476.06	
卖出回购金融资产款	6,523,824,040.22	9.65	2,867,625,222.31	5.72	127.50	
应付职工薪酬	2,689,797,674.48	3.98	1,848,955,477.50	3.69	45.48	
应交税费	454,177,948.87	0.67	157,387,311.79	0.31	188.57	
应付债券	6,673,626,986.44	9.87	4,155,167,123.38	8.29	60.61	

#### 其他说明

结算备付金：报告期末客户交易结算资金增加。

融出资金：报告期末融资融券融出资金增加。

存出保证金：报告期末交易保证金增加。

应收款项：报告期末应收资产管理费增加。

买入返售金融资产：报告期末债券质押式回购增加。

交易性金融资产：报告期末债券投资增加。

固定资产：报告期末电子设备增加。

递延所得税资产：报告期末可抵扣暂时性差异增加。

应付短期融资款：报告期末短期融资券增加。

拆入资金：报告期末转融通融入资金增加。

卖出回购金融资产款：报告期末债券回购融入资金增加。

应付职工薪酬：报告期末已提未付职工薪酬增加。

应交税费：报告期末已提未付税金增加。

应付债券：报告期末应付公司债券增加。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司总资产 676.30 亿元，比上年末总资产规模增加 34.85%，主要原因为：报告期末交易目的而持有的金融资产增加、融出资金增加。客户交易结算资金为 163.93 亿元，扣除客户交易结算资金后的公司资产总额为 512.38 亿元，公司资产结构优良，流动性强，期末自有现金及现金等价物 31.71 亿元，占资产总额（扣除客户保证金，下同）的比例为 6.19%；交易性金融资产账面价值 188.73 亿元，占资产总额的比例为 36.83%；融资融券融出资金为 148.15 亿元，占资产总额的比例为 28.92%。长期资产占比较小，且构成未发生较大变动。

报告期末公司负债总额 450.90 亿元，扣除客户交易结算资金后负债总额为 286.97 亿元，资产负债率为 56.01%，比 2019 年末增加 12.88 个百分点。公司资产负债率处于合理水平，资产流动性充裕，偿债能力强。

## 2. 截至报告期末主要资产受限情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	100,000.00	保证金冻结
交易性金融资产	7,187,299,891.90	为质押式回购交易设定质押
交易性金融资产	205,134,600.00	为债券借贷交易设定质押
交易性金融资产	61,371,720.00	充抵期货保证金
交易性金融资产	86,007,614.30	已融出证券
其他债权投资	197,174,600.00	为质押式回购交易设定质押
合计	7,737,088,426.20	

详见本财务报表附注七、1，七、8、（2）②，七、10、（2）。

## 3. 其他说明

□适用 √不适用

### （四） 行业经营性信息分析

√适用 □不适用

详见本节“一、经营情况讨论与分析”

**(五) 投资状况分析****1、 对外股权投资总体分析**

√适用 □不适用

报告期末，公司（合并口径）长期股权投资 5.72 亿元，较上年末减少 0.02 亿元，减幅 0.43%，主要为国金鼎兴投资有限公司减少的股权投资，具体内容详见财务报表附注七、合并财务报表项目注释之 12、长期股权投资。

**(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

项目名称	2020 年 12 月 31 日		2020 年 1-12 月	
	初始投资成本/名义金额	公允价值	投资收益及利息收入	公允价值变动金额
（一）交易性金融资产	18,331,999,405.98	18,873,090,456.71	1,211,888,840.62	-2,139,088.89
（二）衍生金融资产	22,955,791,930.00	704,900.00	150,198,478.70	56,857,832.76
（三）其他债权投资	1,009,249,032.16	1,019,343,647.45	31,549,815.56	-2,519,688.38
（四）其他权益工具投资	2,607,455,164.20	2,689,210,146.85		66,018,355.44

**(六) 重大资产和股权出售**

□适用 √不适用

**(七) 主要控股参股公司分析**

√适用 □不适用

**(1) 国金期货有限责任公司**

国金期货有限责任公司（以下简称“国金期货”），注册资本 3 亿元人民币，为公司的全资子公司。国金期货经营范围：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。截至 2020 年 12 月 31 日，国金期货总资产 24.00 亿元，净资产 4.81 亿元。报告期实现营业收入 11,282.47 万元，净利润 2,947.01 万元。

**(2) 国金鼎兴投资有限公司**

国金鼎兴投资有限公司（以下简称“国金鼎兴”），注册资本 10 亿元人民币，为公司的全资子公司。国金鼎兴经营范围：股权投资，实业投资，投资管理，投资咨询，财务咨询（除代理记账）。

截至 2020 年 12 月 31 日，国金鼎兴总资产 16.77 亿元，净资产 11.35 亿元。报告期实现营业收入 4,110.50 万元（证券公司报表口径），净利润-954.09 万元。

### （3）国金创新投资有限公司

国金创新投资有限公司（以下简称“国金创新”），注册资本 8 亿元（实缴 3 亿元）人民币，为公司的全资子公司。国金创新经营范围：金融产品投资，股权投资，实业投资，投资管理，投资咨询。截至 2020 年 12 月 31 日，国金创新总资产 3.78 亿元，净资产 3.69 亿元。报告期实现营业收入 4,441.72 万元（证券公司报表口径），净利润 3,273.35 万元。

### （4）国金道富投资服务有限公司

国金道富投资服务有限公司（以下简称“国金道富”），注册资本 1.1 亿元人民币，本公司持有其 55.00% 股权。国金道富经营范围：接受金融机构委托从事金融信息技术外包，接受金融机构委托从事金融业务流程外包，接受金融机构委托从事金融知识流程外包，实业投资，投资管理，财务咨询，代理记账，企业管理咨询。截至 2020 年 12 月 31 日，国金道富总资产 7.48 亿元，净资产 1.63 亿元，报告期实现营业收入 8,005.74 万元（证券公司报表口径），净利润 2,369.62 万元。

### （5）国金金融控股（香港）有限公司

国金金融控股（香港）有限公司（以下简称“国金金控”），注册资本 3.09 亿元港币，为公司的全资子公司。国金金控为金融控股公司，下设全资子公司国金证券（香港）有限公司（以下简称“国金香港”）和国金财务（香港）有限公司。国金香港经营范围：证券交易、期货合约交易、就证券提供意见、就机构融资提供意见、提供资产管理。截至 2020 年 12 月 31 日，国金金控总资产 14.49 亿元，净资产 2.54 亿元。报告期实现营业收入 7,023.14 万元，净利润 316.91 万元。

### （6）国金基金管理有限公司

国金基金管理有限公司（以下简称“国金基金”），注册资本 3.6 亿元人民币，本公司持有其 49% 的股权。国金基金经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至 2020 年 12 月 31 日，国金基金总资产 3.16 亿元，净资产 2.52 亿元。报告期实现营业收入 16,931.30 万元，净利润 1,037.81 万元。

## （八） 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

本公司对由公司同时作为管理人和投资人的结构化主体，综合评估持有其投资份额而享有的回报以及作为其管理人的管理人报酬是否使本公司所享有的可变回报构成重大影响，并据此判断本公司是否为结构化主体的主要责任人，将满足条件的结构化主体确认为构成控制并纳入合并报表范围。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司合并财务报表范围包括 7 个结构化主体，其总资产为人民币 4,128,510,044.84 元。



## (九) 报告期内营业部、分公司、专业子公司的新设和处置情况

### 1、证券营业部变更

#### (1) 证券营业部新设

2020 年 1 月，根据中国证券监督管理委员会四川监管局《关于核准国金证券股份有限公司设立 2 家分支机构的批复》(川证监机构[2019]28 号)要求，目前，国金证券股份有限公司获准在山东省青岛市、辽宁省大连市各设立的 1 家证券营业部（C 型）已领取了营业执照和《经营证券期货业务许可证》，并正式开业。具体详见公司于 2020 年 1 月 3 日在上海证券交易所网站披露的《关于新设证券营业部开业的公告》。

2020 年 3 月，根据中国证券监督管理委员会四川监管局《关于核准国金证券股份有限公司设立 6 家分支机构的批复》(川证监机构[2020]9 号)要求，公司获准在浙江省宁波市、浙江省金华市、江苏省徐州市、江苏省南通市、广东省汕头市和河南省洛阳市各设立 1 家证券营业部（C 型）。具体详见公司于 2020 年 3 月 4 日在上海证券交易所网站披露的《关于获准新设 6 家分支机构的公告》。

#### (2) 证券营业部撤销

2020 年 10 月，根据《关于取消或调整证券公司部分行政审批项目等事项的公告》(中国证券监督管理委员会公告〔2020〕18 号)的相关要求，撤销成都华润路证券营业部。具体详见公司于 2020 年 10 月 30 日在上海证券交易所网站披露的《关于撤销成都华润路证券营业部的公告》。

2、2017 年 8 月，根据公司第十届董事会第八次会议审议通过的《关于国金证券（香港）有限公司及国金财务（香港）有限公司组织架构调整的议案》，公司拟对香港子公司国金证券（香港）及国金财务（香港）的组织架构进行调整。截至报告期末，公司已在香港设立了国金金融控股（香港）有限公司作为公司在港业务的控股平台公司；报告期内国金金融控股（香港）有限公司以发行股份为对价，从母公司和少数股东处取得国金证券（香港）有限公司和国金财务（香港）有限公司 100.00%的股权，其他组织架构调整事项尚处于正常推进阶段。

3、报告期内，公司子公司国金鼎兴投资有限公司减少合并 1 家子公司，具体内容详见财务报表附注八、合并范围的变更。

## (十) 公司创新业务

### 1、指数业务

公司在获得沪深交易所的指数许可牌照后，于 2020 年间陆续获得东京证券交易所和香港联合交易所的指数许可牌照，成为首家囊括亚洲四大证券交易所指数牌照的中国机构。

在与万得建立的指数业务战略合作基础上，国金指数的编制研发基于“Smart Beta”框架，以“精品化”方式结合市场策略审慎研发。2020 年间，在 Wind 金融终端新增发布策略指数 25 条，已逐步形成覆盖股票策略指数、债券策略指数、海外策略指数、基金财富策略指数等多资产类别的指数线，逐步展现出国金指数团队在全球市场、大盘风格、主题机会和行业轮动上的策略和因子能

力。2020 年末，国金指数团队基于股票市场预期，重点开发了“非抱团风格”的国内首只“GARP 策略”的智能成长系列指数、“新基建-新生活”系列指数、零售休闲主题指数、智慧中国主题指数，为提升国内券商指数业务竞争力继续努力。

## 2、深交所首单短期限滚动发行 ABS

2020 年 12 月，由国金证券发起的交易所市场首单短期限、可滚动发行 ABS“国金-徐工租赁八期资产支持专项计划”在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）成功发行。国金证券在深交所的倾力指导下设计出了此类创新的 ABS 发行方案，通过首发和续发安排实现产品端与底层基础资产的有效衔接，缩短产品久期，本项目的交易结构实现了重要创新，降低了企业融资成本，提升了企业资产证券化产品融资便利性和灵活性，使融资资金能够更加高效地惠及实体经济。

## （十一） 公司融资渠道

### 1、公司融资渠道

从融资方式来看，公司的融资渠道有债权融资和股权融资两种方式。从融资期限来看，公司的短期融资渠道包括通过银行间市场和沪深交易所进行债券回购融入资金、通过银行间市场进行信用拆借、发行证券公司短期融资券、发行短期公司债券、发行收益凭证、债权收益权回购融资等；长期融资渠道包括发行公司债券、可转换公司债券、次级债券、股权融资等方式。

2020 年，公司实施了在交易所公开发行公司债券（含疫情防控债）、在交易所试点公开发行短期公司债券、在银行间市场发行证券公司短期融资券、在银行间市场和交易所开展债券回购、在银行间市场开展信用拆借、在中证机构间报价系统发行收益凭证等债权融资。

### 2、公司融资能力分析

公司具有良好的信用记录和较强的融资能力，主体信用等级经上海新世纪资信评估投资服务有限公司评定为 AAA 级。公司与各大商业银行保持良好的合作关系，获得了多家商业银行的综合授信；作为全国银行间市场成员，公司可以在银行间市场发行短期融资券、开展信用拆借、债券回购等业务。作为上市券商，公司也可以通过股权或债券融资等方式，解决长期发展的资金需求。

## （十二） 公司与境外子公司之间交易情况

报告期内公司向境外子公司国金证券（香港）有限公司支付系统服务费折合人民币 4,238,564.64 元，上述交易在编制合并报表时已作抵销。报告期公司对国金证券（香港）有限公司的担保情况详见第五节 十五、（二）担保情况。

## 三、公司关于公司未来发展的讨论与分析

### （一） 行业格局和趋势

适用 不适用

#### 1、资本市场深化改革，持续并加速推进

“十四五”规划和远景目标提出全面实行股票发行注册制、建立常态化退市机制、提高直接融资比重、推进金融双向开放等。资本市场深化改革的进程将持续并加速推进，证券行业将在注册制全面推行、引入长期资金入市、创新业务产品继续扩容等方面政策逐步落地。伴随着行业改革和资本市场基础制度不断完善，投融资效率将进一步提升，市场交投活跃度和融资规模也将进一步提振，这将为证券行业发展提供历史性机遇和更加广阔的空间。

### 2、资本市场对外开放，挑战与机遇并存

随着国内资本市场进一步开放，与国际成熟市场进一步接轨，未来将有更多的外资控股券商、外商独资券商参与行业竞争。外资投行的全球视野、标准化交易清算系统和综合金融服务能力优势将得以发挥。这将倒逼中资券商加快商业模式转型，摆脱传统的通道盈利模式，建立基于资本实力、风险定价、金融科技等综合竞争能力，同时也将加快中资券商在管理理念、激励机制和业务创新等方面的探索。

### 3、金融行业做大做强，业务转型是关键

传统业务不断地向行业头部券商集中，外资投行也将加入竞争，资本、人才、技术等竞争格局呈现白热化，行业业务转型迫在眉睫。从传统经纪业务向财富业务转型，是满足客户日益增长的投资需求；从通道型投资银行向专业化投资银行的转变，是满足企业资本运作的需求；从通道型资产管理向主动型资产管理的转化，是满足市场价值投资和客户财富管理的需求；从自营模式向交易商模式的转型，是满足市场流动性供给和风险定价方的需求。只有不断地做好业务创新，才能跟上市场和行业发展的步伐，才能为企业客户和个人客户提供一站式综合投融资服务。

### 4、数字化运营成常态，科技与业务深度融合

数字化运营成为行业各项业务发展的常态，通过金融科技优化业务流程，降本增效已深入行业人心，证券行业在 IT 投入的规模逐年增加并不断扩大。未来，证券行业金融科技的发展，将聚焦于科技化运用、数据化运营提升、云计算、大数据平台等领域，并将在管理体制机制、流程设计等方面不断变化，并与业务转型发展深度融合。

## (二) 公司发展战略

√适用 □不适用

公司的总体发展战略：秉承“让金融服务更高效、更可靠”的使命，不断夯实“差异化增值服务商”的战略定位，坚定落实“以研究咨询为驱动，以财富管理业务和投资银行业务为基础，以证券资产管理业务和创新业务为重点突破，以自营和其他业务为重要补充”的业务发展模式，坚持合规风险管理与业务创新发展并重，努力将公司建设成为“治理健全、管理规范、业务精湛、资质齐备、技术领先”的国内证券行业具有一流竞争力和影响力的上市券商，实现“成为举足轻重的金融服务机构”的商业愿景。

## (三) 经营计划

√适用 □不适用

2021 年，公司将通过以下举措推进经营计划落地，努力达成战略目标：

一是财富管理业务方面，公司在坚持零售客户线上化、线下客户机构化的基础上，持续加强金融科技投入，以平台化能力建设与个性化专业服务相结合的方式，通过交易、理财、咨询、融资等服务手段的运用，增强增量获客，促进存量活跃，提升客户粘性。同时，公司将加快推进财富管理转型落地，基于客户分层分类，通过产品叠加策略，实现对差异化金融服务需求的及时满足，助力客户资产规模提升。

二是机构业务方面，公司将坚持研究中心化布局，在科技、医药、消费及新能源等优势研究领域持续深耕，提升对产业链及重点企业的研究实力，同时加大在创新数据研究上的突破，利用更广泛的数据资源、数据网络、数据工具，在行业竞争中形成差异化的研究特色与研究壁垒。公司进一步整合资源，联动研究产品、资产托管、外包服务，为机构客户提供一体化的全面服务。

三是投资银行业务方面，在资本市场改革、注册制推行背景下，公司将把握机遇开拓与增加科创板、创业板优质项目储备，扩大在医疗健康、汽车零部件制造等重点产业内的专业优势与行业影响，并在承销定价、发行销售等重要业务环节加强团队建设、提升综合实力。在股债并举的经营策略下，公司也将继续推进债券业务发展，丰富债券业务资质，审慎严格把控项目风险，提高执业质量。

四是资产管理业务方面，公司积极应对行业竞争，推动资管业务平稳转型，专注主动管理水平提升，创设落地投融资结合的特色化配置型产品，在结构融资业务上关注市场趋势、结合企业需求匹配开发新的产品模式，并积极开展跨业务体系联动，促进协同增效。

五是信用交易业务方面，公司将继续秉持稳健发展、严控风险的风格与节奏开展融资融券、股票质押等业务，加强风险监测与排查，确保整体规模稳中有进。

六是证券投资业务方面，公司将多方位加强投研体系建设，均衡配置各类资产，优化丰富投资策略，从而分散投资风险、实现资产保值增值。同时公司也将在合规、审慎的前提下继续布局指数业务推进产品研发、进一步探索衍生品及场外业务的创新。

七是国际业务方面，公司将以香港子公司为重要平台，充分发挥境内外业务及团队资源，在企业融资、零售经纪、资产管理等方面为客户提供多样化的跨境投融资服务。

八是合规管理方面，公司将认真学习行业监管要求、遵循各项合规管理政策，健全公司合规管理制度体系，继续夯实客户适当性管理、反洗钱、合规检查及培训等工作，加强合规管理信息系统建设，强化合规问责机制，保证对公司各项业务、全体员工的合规管理覆盖，消除合规隐患，倡导及培育良好的合规文化。

九是风险管理方面，公司将针对重点业务风险、流动性风险、信用风险、操作风险等加强监控、管控，持续完善公司金融工具估值、减值及风险计量模型，完善全面风险管理信息系统建设，提升数据治理水平，健全风险限额管理体系，对子公司进一步加强垂直管理，确保子公司业务开展满足公司风险偏好。

公司将依据市场形势变化，在确保流动性安全的基础上，积极拓展融资渠道，运用多种融资工具补充公司营运资金、扩充资本实力、优化资本结构、降低融资成本，保障公司经营及业务发展需求。

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

√适用 □不适用

##### 1、公司经营活动面临的风险

公司经营活动中面临的风险主要有：流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、洗钱和恐怖融资风险、声誉风险等。

##### (1) 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。公司在经营过程中，因受宏观政策、市场变化、经营状况、信用程度等因素的影响，或因公司资产负债结构不匹配而产生流动性风险。另外，由于公司投资银行类业务大额包销、自营业务投资规模过大、长期资产比例过高等因素，会导致公司资金周转不畅、流动性出现困难。

##### (2) 市场风险

市场风险是指公司持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因市场不利变动而发生波动并造成损失的风险。市场风险主要分为价格风险、利率风险和汇率风险等，其中：价格风险是指金融工具的公允价值因指数水平和个别证券市价的变化而发生波动的风险；利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险；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。

##### (3) 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。公司信用风险主要来源于以下四个方面：其一，经纪业务代理客户买卖证券等在结算当日客户的资金不足以支付交易所需的情况下，或者客户资金由于其他原因出现缺口，公司代客户进行结算后客户违约的风险；其二，在融资融券业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务等融资类交易业务中，客户未能履行合同约定而带来损失的风险；其三，固定收益类证券投资的违约风险，即所投资固定收益类证券的发行人出现违约，拒绝支付到期本金和利息带来的损失；其四，利率互换、股票收益互换、场外期权、远期交易等场外衍生品交易的对手方违约风险，即交易对手方到期未能按照合同履行相应支付义务的风险。

##### (4) 操作风险

操作风险是指由于不完善或有问题的内部流程、人员及系统或外部事件所造成损失的风险。操作风险事件主要表现为：内部欺诈，外部欺诈，客户、产品和业务活动中违法、不当行为或纠纷，有形资产的损失，经营中断和系统出错和涉及执行、交割以及交易过程的过错。

##### (5) 洗钱和恐怖融资风险

洗钱和恐怖融资风险是指因公司未能建立有效的反洗钱、反恐怖融资内控机制或各业务部门、分支机构及子公司未能认真履行反洗钱、反恐怖融资法定义务，在开展业务的过程中未能有效预防、遏制洗钱和恐怖融资犯罪，出现影响国家金融安全和社会稳定的洗钱和恐怖融资风险案件，从而给公司带来的声誉风险、法律风险、合规风险和经营风险，以及承担其他相应的责任或遭受损失的风险。

#### （6）声誉风险

声誉风险是指公司经营管理及其他行为或外部事件导致公司股东、员工、客户、第三方合作机构、监管机构、媒体及公众等对公司负面评价的风险。

### 2、主要风险因素在报告期内的表现

（1）流动性风险方面：截至 2020 年 12 月 31 日，母公司流动性覆盖率为 261.09%，净稳定资金率为 149.43%，持续符合监管要求。

（2）市场风险方面：截至 2020 年 12 月 31 日，公司涉及的市场风险主要为自营债券及利率衍生工具投资的利率风险和证券投资的价格风险，其中：假设市场利率平均变动 50 个基点，则对净利润及所有者权益的影响为 8,914.22 万元；假设市场价格变动 10%，则股票、股权、基金、衍生工具、资管产品等投资的价值变动对净利润及所有者权益的影响为 44,650.89 万元。公司风险价值（VaR）测算如下：在 95% 概率下，公司 1 天的最大亏损预计不超过 12,900.05 万元，不超过公司报告期末净资产的 0.57%。公司通过分散投资、限额管理、风险对冲等方式管理市场风险，整体市场风险可控。

（3）信用风险方面：截至 2020 年 12 月 31 日，公司的货币资金、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；买入返售金融资产中债券质押式或买断式回购均要求有充足的担保物；应收款主要为预付款项、各项押金等，信用风险较低；融资融券业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务各项在途合同担保品均能较好地保障合同负债；债券投资交易业务主要投资国债、政策性金融债以及外部信用等级在 AA 级及以上的债券，公司整体信用风险可控。公司采用预期信用损失模型对适用的金融工具计提预期信用损失，详见财务报表附注十五、风险管理之 2、信用风险。

（4）操作风险方面：截至 2020 年 12 月 31 日，公司持续健全和完善管理制度、优化业务流程、加强各项业务的实时风险监控工作，未产生重大管理风险和操作风险；加强信息技术系统的建设和管理维护，各系统的安全稳定运行得到保障，未产生重大技术风险。

（5）洗钱和恐怖融资风险方面：截至 2020 年 12 月 31 日，公司高度重视客户身份识别工作，根据反洗钱法律法规要求，在业务开展过程中，认真落实客户尽职调查工作，持续开展客户信息治理，不断提升客户身份识别工作质量，为反洗钱各项后续工作夯实基础；升级反洗钱系统，全面排查可疑交易系统监测指标完整性、有效性，不断优化系统中可疑交易监测功能，提升可疑交易预警准确性；关注高洗钱风险业务并采取措施进行控制，准确评估、识别出高洗钱风险业务以及既有业务中的洗钱和恐怖融资风险点并采取措施进行防范；进一步提高对反洗钱工作的重视度，

反洗钱工作覆盖公司全部业务和产品，防范利用公司业务进行洗钱犯罪活动的风险。报告期内，公司业务面临的洗钱和恐怖融资风险得到有效控制，未发生重大洗钱和恐怖融资风险事件。

(6) 声誉风险方面：截至 2020 年 12 月 31 日，公司总体舆论环境健康，未发生重大声誉风险事件。

报告期内，公司各项业务稳健、资产配置合理、财务状况良好，净资本和流动性等风险控制指标持续符合监管要求。

### 3、公司采取的风险防范对策和措施

#### (1) 持续推进全面风险管理体系建设

根据《证券公司全面风险管理规范》和《证券公司流动性风险管理指引》、《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司风险控制指标动态监控系统指引》等相关要求，公司持续推进全面风险管理体系建设，其中包括：

第一，公司制定并持续完善风险管理制度体系。目前，公司已建立公司层面的《国金证券股份有限公司全面风险管理制度》、《国金证券股份有限公司风险控制指标管理办法》、《国金证券股份有限公司流动性风险管理办法》、《国金证券股份有限公司市场风险管理办法》、《国金证券股份有限公司信用风险管理办法》、《国金证券股份有限公司操作风险管理办法》等风险管理相关制度。同时，公司还在具体业务层面制定了针对金融工具估值与减值、内部信用评级、债券投资交易、投资银行类业务等风险管理工作的制度，基本形成较为完整的全面风险管理制度体系。

第二，公司严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了完整有效的风险管理组织结构体系。公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构；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；经理层是全面风险管理工作的组织机构，并对全面风险管理承担主要责任。公司设专职首席风险官，由其负责全面风险管理工作；公司设立风险管理部履行风险管理职责，在首席风险官领导下推动全面风险管理工作。

第三，公司在总结风险管理系统现状的基础上，规划了系统建设的短、中、长期任务，加大了自主开发系统的力度，持续优化风险数据治理、市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、声誉风险和证券风险预警系统，进一步加强了事前、事中、事后的系统化监测手段。具体包括：完善风险数据治理的范围和数据质量，研究建立统一账户管理系统，以满足公司级同一客户管理的需要；根据新业务开展和业务变化，升级和完善市场风险管理系统；将内部评级、交易对手、统一授信及占用等纳入风险系统集中管理，覆盖融资类业务、自营业务和资产管理等业务；根据公司操作风险管理要求建设完善操作风险管理系统；优化证券风险预警系统，实时提供新闻舆情、财务风险、信用风险、处罚提示、宏观新闻和行业新闻等多方面的预警信息。

第四，公司制定包括风险容忍度和风险限额等在内的风险控制指标体系，并通过压力测试等方法计量风险、评估承受能力、指导资源配置。风险控制指标经公司董事会、经理层或其授权机构审批并逐级分解至各部门、分支机构及子公司，公司对分解后指标的执行情况进行监控和管理；

公司规范金融工具估值的方法、模型和流程，建立各部门、分支机构及子公司与风险管理部门、财务部门的协调机制，确保风险计量基础的科学性；公司选择风险价值、信用敞口、压力测试等方法或模型来计量和评估市场风险、信用风险等可量化的风险类型，同时充分认识到所选方法或模型的局限性，并采用有效手段进行补充。

第五，公司积极推进风险管理文化建设，进一步夯实“人人参与风险管理”的全员风险管理文化，逐步建立公司体系内风险管理专业人员定期交流、互动、沟通的平台和公司风险管理文化宣导和传播的重要窗口。公司风险管理部建立企业微信风险管理资讯专栏，定期更新有代表性的证券公司风险案例及风险管理相关内容，供公司内部员工学习和交流。公司定期筹办风险管理工作会议，致力于为公司营造良好的风险管理文化氛围，加强各部门、分支机构及子公司的风险管理意识，打造独立且有影响力的风险管理品牌。

第六，公司将子公司统一纳入全面风险管理体系，对其风险管理工作实行垂直管理，要求并确保子公司在公司整体风险偏好、风险管理制度及风险管理文化氛围下，建立自身的风险管理组织架构、制度流程、信息技术系统、风控指标体系以及风险管理文化，保障全面风险管理的一致性和有效性。公司明确子公司全面风险管理工作要求，规定子公司风险管理工作负责人的推荐、任免及考核流程，明确重大事项、风险事项报告标准，明确公司开展压力测试应覆盖子公司。为提升风险管理有效性，公司配备专人专岗负责子公司风险管理的日常沟通和报告事宜，持续加强对子公司风险管理工作情况的现场检查 and 定期报告，并提出改进建议，确保其业务开展符合监管及公司内部相关要求。公司持续完善子公司风险管理系统建设，加强对子公司的风险计量工作。

## （2）持续完善风险管理技术和方法，提升风险管理能力

### ①流动性风险管理方面

公司建立了有效的流动性风险管理组织架构；对流动性覆盖率、净稳定资金率等流动性风险计量指标进行计算和监控；建立资金监控的相关内控制度，对货币资金、结算备付金、存出保证金等金融资产，由公司资金部进行管理，清算部协助监控，审慎选择信用级别较高的商业银行存放各项货币资金，有力地保证了货币资金的流动性和安全性，对影响流动性的业务和投资于流动性较低的资产，需公司相关决策机构进行审议；设立证券自营分公司，由经理层授权证券自营分公司在限额内进行证券投资，并根据证券市场行情及公司流动性需求，严格控制自营业务投资范围及规模。公司重视资产和负债到期日的匹配及有效控制匹配差异，以保证到期债务的支付。

### ②市场风险管理方面

公司建立了有效的市场风险管理组织架构，建立了风险限额管理体系，主要包括规模限额、止损限额、风险限额等。董事会确定自营业务风险偏好和风险容忍度；公司经理层确定自营业务的投资规模和风险限额；证券投资决策委员会确定单个项目的规模、止损限额；证券自营部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、止损线等手段进行前端控制；风险管理部通过风险管理系统进行动态监控，及时进行风险提示，督促业务部门进行风险处置等。



针对利率风险，公司积极跟踪国家货币政策动向和市场利率走势，严格控制债券投资规模、久期和杠杆率，合理配置资产，利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具，同时利用国债期货等衍生品对冲部分利率风险敞口。针对价格风险，公司采取多元化和分散的投资策略，对权益类证券持仓进行限额管理和及时调整，并利用股指期货等衍生品对冲部分风险敞口，有效控制市场风险。

### ③信用风险管理方面

公司建立了有效的信用风险管理组织架构，制定了规范的信用风险管理制度，并持续完善信用风险识别、评估、监控、应对及报告机制。

针对经纪业务，公司代理客户的证券交易以全额保证金结算，通过加强客户授信和保证金管理，有效控制了相关的信用风险。

针对融资类业务，公司对融资融券业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务的信用风险控制主要通过事前评估、事中监控和事后报告来实现。事前评估方面，主要是通过建立严格的客户选择标准和标准的客户选择流程、量化的客户信用评级体系、分级授信制度、风险客户名单机制，同时对标的折算率、维持担保比例、集中度及规模进行评估分析；事中监控方面，在逐日盯市的基础上，风险管理部和业务部门对相关风控指标分别进行独立、动态监控，并及时预警；事后报告方面，风险管理部对日终收盘后主要风控指标进行详细分析和压力测试，业务部门视客户风险状况及时提示客户风险，并按照合同约定条款控制信用风险。在确保担保品充足的前提下，公司结合内外部环境变化，不断完善事前评估、事中监控及事后报告的相关要求和标准。

针对固定收益类证券投资及场外衍生品交易，公司重视债券投资交易和交易对手方信用风险的评估和监控，通过选择主要投资国债、高信用等级债券等来控制固定收益类证券投资的信用风险，同时根据《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券投资基金经营机构债券投资交易业务内控指引》等制度要求设置集中度指标以分散投资风险，建立债券投资交易和内部评级相关制度，定期或不定期维护与业务复杂程度相匹配的交易标的、交易对手名单，审慎选择交易标的、交易对手，加强交易监测、报告以确保规范交易等。

### ④操作风险管理方面

公司始终高度重视操作风险管理工作，在加强内部控制的基础上，通过建立一套可操作的管理制度、可执行的风险监控指标、可靠的信息系统、高效的风险应对措施，确保公司操作风险可测、可控和可承受，保障公司稳健经营和各项业务的发展。

2020年，公司围绕“操作风险管理三大工具应用、操作风险信息系统上线升级及使用、培训与宣导工作、流程管理优化”，积极探索操作风险管理落地方案，提高三大工具的使用效率。在风险与控制自我评估方面（RCSA），启动并完成2020年度操作风险与控制自我评估工作，完成公司各业务及管理类流程梳理重检、确认并生成RCSA问卷，同步完成RCSA问卷的线上化过程，组织各部门通过系统完成自评打分工作；在关键风险指标方面（KRI），完成各部门操作风险关键

指标及其阈值重新梳理及系统录入工作，对筛选的 100 余项指标进行填报监控；风险损失数据收集方面（LDC），通过机制建立、Q&A 答疑、不同场合宣贯、风险督导沟通等方式推动风险事件上报。同时，公司操作风险管理系统支持以上三大工具的系统化实现，RCSA、KRI 及 LDC 均通过公司操作风险管理系统进行。

#### ⑤洗钱和恐怖融资风险管理方面

公司为控制和防范洗钱和恐怖融资风险所采取的主要措施有：建立了完善的内控制度，有效指导公司各业务部门、分支机构及子公司开展日常反洗钱工作；建立了业务、产品洗钱风险评估的工作机制，实现各业务部门、分支机构及子公司洗钱风险管理全面覆盖；建立了异常交易行为的主动报送及被动核查的工作机制，对日常工作中发现的以及系统监测出的异常交易行为及时甄别核查并报送；通过深入持续的反洗钱、反恐怖融资培训工作，提高员工的反洗钱工作意识和能力。

2020 年，在人民银行成都分行指导下，公司认真落实各项反洗钱和反恐怖融资工作要求：一是积极召开领导小组会议部署年度反洗钱工作；二是进一步健全反洗钱和反恐怖融资内部控制制度，将反洗钱要求嵌入各业务活动具体操作环节和管理流程；三是不断优化反洗钱系统及相关配套系统，提升反洗钱系统对于客户洗钱风险管理的能力；四是持续做好底层数据治理工作，为客户洗钱风险分析夯实基础；五是强化高风险客户、高风险业务风险管控，进一步加强对反洗钱重点环节的内部控制；六是细化反洗钱绩效考核指标，有效发挥考核对反洗钱工作的促进作用；七是积极配合人民银行反洗钱现场检查，及时整改检查中发现的问题；八是开展反洗钱主题宣传，提高公司员工的反洗钱工作意识。在公司上下的共同努力下，2020 年公司各项反洗钱工作顺利开展，全年未发生洗钱和恐怖融资风险事件，洗钱和恐怖融资风险得到有效控制，较好地履行了反洗钱义务。

#### ⑥声誉风险管理方面

公司持续完善声誉风险管理体系，建立规范的管理制度，包括《国金证券股份有限公司公关宣传管理办法》、《国金证券股份有限公司官方微博、公共微信、QQ 群等媒介平台管理办法》、《国金证券股份有限公司媒体负面报道处理制度》等，主动、有效地识别、评估、控制、监测、应对和报告声誉风险。公司建立了声誉风险预警机制，每日开展舆情监控，对监测信息进行分级分类分析，并制作《声誉风险信息监测日报》向公司经理层报送。如出现负面声誉突发事件，将第一时间向公司管理层报告。如果出现严重的负面声誉突发事件，公司总裁办公室将及时向监管部门报告，并会同公司相关部门制订风险应对策略；由公司新闻发言人针对负面舆情对外发布信息或对事件作出回应，同时相关部门根据应急策略有效应对；负面声誉突发事件平息后，相关部门积极采取公关修复措施，对负面声誉突发事件处理过程进行分析报告，密切关注新问题、新情况，避免舆情出现反复。公司持续加强与媒体的沟通与联系，通过推广正面形象等多种途径客观展示公司形象。

#### 4、公司合规风控、信息技术投入情况

公司根据业务发展需求，投入大量资源建设和优化信息系统，不断提高公司信息化、科技化水平，提升和优化客户体验，确保公司信息系统安全、稳定的运行，保障和支持公司业务正常开展。公司信息技术投入主要包括（按照证券公司信息系统建设投入指标统计口径）：IT 投入固定资产和无形资产的折旧摊销费用、IT 日常运营的费用、机房租赁费用、IT 线路租赁费、IT 信息技术研发费及 IT 人员投入等，2020 年公司信息技术投入总额为 31,381 万元。

公司高度重视合规风控工作，建立了全面、全员、全业务流程的内部控制机制，形成了全覆盖的风险管理体系，以保障公司经营在合法合规的前提下做到风险可控、可承受。公司合规风控投入主要包括（按母公司口径统计）：合规风控相关系统购置和开发支出、合规风控部门日常运营费用以及合规风控人员投入等，2020 年公司合规风控投入总额为 12,436.10 万元。

## （五） 公司风险控制指标说明

适用 不适用

### 1、风控指标敏感性分析和压力测试机制

公司建立了风险控制指标敏感性分析和压力测试机制。按照《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券公司压力测试指引》、《证券公司流动性风险管理指引》和《证券公司全面风险管理规范》的要求，当公司出现可能导致净资本和流动性等风险控制指标发生明显不利变化或接近预警线的情形；确定重大业务规模和开展重大新业务、预期或已经出现重大内部风险状况、预期或已经出现重大外部风险和政策变化事件等情形时，公司需要开展专项或综合压力测试。公司成立压力测试工作领导小组和工作小组，明确了领导小组、工作小组的工作职责。风险管理部及资金部作为压力测试工作的具体执行部门，其他相关部门和分支机构积极配合压力测试工作的开展。近年来，公司不断完善压力测试模块，使公司压力测试工作更加科学、准确、及时，为公司业务发展和决策提供了有力支持。

### 2、净资本补足机制

公司根据中国证券业协会颁布的《证券公司资本补充指引》等相关制度要求，制定了《国金证券股份有限公司 2021-2023 年资本补充规划》。同时，公司建立了净资本及流动性补足机制，当净资本、流动性等各项风险控制指标达到预警标准时，公司将采用调整业务结构、减少投资品种或规模、处置有形或无形资产、发行次级债、募集资本金等方式补充净资本和流动性，保证公司的净资本和流动性等风险控制指标持续符合监管部门的要求。

### 3、报告期内风险控制指标达标情况

截至 2020 年 12 月 31 日，母公司净资本为 19,641,319,988.29 元，各项风险控制指标均持续符合《证券公司管理办法》及《证券公司风险控制指标管理办法》的有关规定，2020 年没有发生触及监管标准的情况；净资本指标与上月相比未发生 20%以上不利变化的情况。

**(六) 公司不合格账户、司法冻结账户、风险处置账户、纯资金账户等账户规范情况**

根据《证券法》的规定和中国证监会的相关要求，公司对所有新开账户、所有合格账户、所有营业部均实行了第三方存管制度。公司持续健全完善账户规范管理长效机制：加强制度落实，完善和优化账户开户相关制度和操作流程；严格进行日常的开户监控；建立健全客户回访制度，及时发现并纠正不规范行为。证券公司应当统一组织回访客户，对新开户客户应当在 1 个月内完成回访，对原有客户的回访比例应当不低于上年末客户总数（不含休眠账户及中止交易账户客户）的 10%，回访内容应当包括但不限于客户身份核实、客户账户变动确认、证券营业部及证券从业人员是否违规代客户操作账户、是否存在全权委托行为等情况。客户回访采用电话、线上电子问卷等多种形式完成，回访结果全面留痕，相关资料应当保存不少于 3 年。公司持续健全完善了立体的、多层次的账户规范长效防控机制。

截至 2020 年 12 月 31 日，在公司开户的客户账户中，共有剩余不合格资金账户 245 户、不合格证券账户 257 户；休眠资金账户 119,403 户、休眠证券账户 206,973 户；司法冻结资金账户 86 户。

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

适用 不适用

## 第五节 重要事项

### 一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

#### (一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

√适用 □不适用

公司一贯重视兼顾未来发展和对股东的合理投资回报，在公司《章程》中明确利润分配政策，要求在不影响公司可持续经营能力及未来长远发展的前提下，应保持利润分配的连续性和稳定性。且为进一步保证全体股东的合法权益，增强利润分配政策的透明度、可操作性，制定并经股东大会审议通过了《公司未来三年股东回报规划（2018-2020年）》，建立了持续、稳定的投资者回报机制，致力于实现投资者和公司利益的“共赢”。

公司严格遵照中国证监会《上市公司监管指引第3号——上市公司现金分红》、上海证券交易所《上市公司现金分红指引》和公司《章程》等法律法规的规定，且与投资者充分沟通，听取投资者特别是中小股东的意见和建议，独立董事对利润分配预案发表独立意见，以增强利润分配方案的决策透明度，保护投资者合法权益。

报告期内，公司完成了以下利润分配方案的实施及预案拟定：

1、根据2019年度股东大会审议通过的《二〇一九年利润分配预案》，公司完成了2019年度利润分配方案的实施工作，以截至2019年12月31日公司总股本3,024,359,310股为基数，向全体股东每10股派发现金股利0.50元人民币（含税），共计分配现金股利151,217,965.50元，剩余未分配利润转入下一年度。

2、根据公司《章程》以及《公司未来三年股东回报规划（2018-2020年）》的要求，并结合公司所处的发展阶段及未来的发展规划，拟定了2020年度利润分配预案：以截至2020年12月31日公司总股本3,024,359,310股为基数，向全体股东每10股派发现金股利0.70元人民币（含税），共计分配现金股利211,705,151.70元，剩余未分配利润转入下一年度。以上分配预案将提交公司股东大会审议，待股东大会审议通过后执行。

公司独立董事对以上利润分配预案发表了独立意见。独立董事认为：公司2020年度利润分配预案符合公司长远利益，符合《公司法》、《证券法》、中国证券监督管理委员会《上市公司监管指引第3号——上市公司现金分红》、上海证券交易所《上市公司现金分红指引》和公司《章程》等相关规定。

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

单位：元 币种：人民币

分红年度	每10股送红股数(股)	每10股派息数(元)(含税)	每10股转增数(股)	现金分红的数额(含税)	分红年度合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润	占合并报表中归属于上市公司普通股股东的净利润的比率(%)
2020年	0	0.7	0	211,705,151.70	1,862,640,224.66	11.37

2019 年	0	0.5	0	151,217,965.50	1,298,539,701.33	11.65
2018 年	0	0.4	0	120,974,372.40	1,010,492,527.44	11.97

注 1：2019 年度利润分配实施情况详见公司公告临 2020-25 号《2019 年年度权益分派实施公告》

注 2：2018 年度利润分配实施情况详见公司公告临 2019-21 号《2018 年年度权益分派实施公告》

(三) 以现金方式回购股份计入现金分红的情况

适用 不适用

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

适用 不适用

二、承诺事项履行情况

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

适用 不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
其他承诺	分红	国金证券股份有限公司	未来三年股东回报规划	2018-2020	是	是	-	-

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

已达到 未达到 不适用

(三) 业绩承诺的完成情况及其对商誉减值测试的影响

适用 不适用

三、报告期内资金被占用情况及清欠进展情况

适用 不适用

四、公司对会计师事务所“非标准意见审计报告”的说明

适用 不适用

五、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明

(一) 公司对会计政策、会计估计变更原因及影响的分析说明

适用 不适用

公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部修订后的《企业会计准则第 14 号——收入》(以下简称“新收入准则”)。按照衔接规定,根据首次执行新收入准则的累积影响数,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。

执行新收入准则调整执行当年年初财务报表相关项目情况,详见财务报表附注五、35、重要会计政策和会计估计的变更。

(二) 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明

适用 不适用

(三) 与前任会计师事务所进行的沟通情况

适用 不适用

(四) 其他说明

适用 不适用

六、聘任、解聘会计师事务所情况

单位:元 币种:人民币

	现聘任
境内会计师事务所名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)
境内会计师事务所报酬	600,000.00
境内会计师事务所审计年限	9 年

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	200,000.00

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

2020 年 5 月 11 日,公司 2019 年度股东大会审议通过了《关于聘任公司二〇二〇年度审计机构的议案》,同意聘任天健会计师事务所(特殊普通合伙)为公司 2020 年度财务审计机构及内部控制审计机构,其中年度财务审计费为人民币陆拾万元,年度内部控制审计费用为人民币贰拾万元,年度审计费合计为人民币捌拾万元整。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

七、面临暂停上市风险的情况

(一) 导致暂停上市的原因

适用 不适用

(二) 公司拟采取的应对措施

适用 不适用

## 八、面临终止上市的情况和原因

适用 不适用

## 九、破产重整相关事项

适用 不适用

## 十、重大诉讼、仲裁事项

本年度公司有重大诉讼、仲裁事项 本年度公司无重大诉讼、仲裁事项

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

适用 不适用

## 十二、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

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

## 十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

### (一) 相关激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

### (二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

## 十四、重大关联交易

### (一) 与日常经营相关的关联交易

报告期内，公司无交易总额高于 3,000 万元且达 2020 年经审计净资产值 5%以上的重大关联交易事项。年度预计日常关联交易事项在报告期内的执行情况详见公司于 2021 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上披露的公司《关于预计公司 2021 年日常关联交易事项的公告》，其他关联交易事项详见财务报表附注之“关联方及关联交易”内容。



1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(五) 其他

适用 不适用

## 十五、重大合同及其履行情况

## (一) 托管、承包、租赁事项

## 1、托管情况

□适用 √不适用

## 2、承包情况

□适用 √不适用

## 3、租赁情况

□适用 √不适用

## (二) 担保情况

√适用 □不适用

单位：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）						不适用							
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）						不适用							
公司及其子公司对子公司的担保情况													
报告期内对子公司担保发生额合计						84,164,000.00							
报告期末对子公司担保余额合计（B）						84,164,000.00							
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）													
担保总额（A+B）						84,164,000.00							
担保总额占公司净资产的比例（%）						0.37							
其中：													
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）						0.00							
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）						84,164,000.00							
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）						0.00							
上述三项担保金额合计（C+D+E）						84,164,000.00							
未到期担保可能承担连带清偿责任说明						不适用							
担保情况说明						2020年3月,公司与中国邮政储蓄银行股份有限公司成都市分行（以下简称“邮储成都分行”）签订《开							

	立跨境保函/备用信用证合同》，约定公司以信用方式向邮储成都分行申请内保外贷业务，为公司下属控股子公司国金香港向招商永隆银行申请金额不超过1亿元港币贷款提供担保。2020年3月24日，邮储成都分行向招商永隆银行开具备用信用证。具体详见公司于2020年3月26日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《关于为国金证券(香港)有限公司提供内保外贷的公告》。
--	---

### （三） 其他重大合同

适用 不适用

### 十六、其他重大事项的说明

适用 不适用

#### 1、向合格投资者公开发行公司债券获批

2020年2月，收到中国证券监督管理委员会《关于核准国金证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2020]191号）核准公司向合格投资者公开发行面值总额不超过人民币80亿元的公司债券。具体详见公司于2020年2月11日于上海证券交易所网站披露的《关于向合格投资者公开发行公司债券获得中国证监会核准的公告》。

#### 2、发行短期融资券获批

2020年1月，公司收到《中国人民银行办公厅关于核定国金证券股份有限公司短期融资券最高待偿还余额的通知》（厅便函[2020]9号）。核定公司待偿还短期融资券最高余额为90亿元。具体详见公司于2020年1月22日于上海证券交易所网站披露的《关于发行短期融资券获得中国人民银行核定通知的公告》。

#### 3、向专业投资者公开发行短期公司债券获批

2020年10月，公司收到中国证券监督管理委员会《关于同意国金证券股份有限公司向专业投资者公开发行短期公司债券注册的批复》（证监许可[2020]2295号），核准公司向专业投资者公开发行面值余额不超过人民币60亿元的短期公司债券。具体详见公司于2020年10月9日于上海证券交易所网站披露的《关于向专业投资者公开发行短期公司债券获得中国证监会同意注册批复的公告》。

#### 4、债券发行事宜

##### （1）非公开发行公司债券利息兑付

2020年4月，公司“18国金01”公司债券已兑付完成并摘牌，兑付本金总额为人民币15亿元，兑付最后一个年度利息总额为人民币8,625万元。具体详见2020年3月26日在上海证券

交易所网站披露的《非公开发行 2018 年公司债券（第一期）2020 年本息兑付和摘牌公告》及 2020 年 4 月 7 日在上海证券交易所网站披露的《关于“18 国金 01”公司债券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 4 月兑付“国金证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券（第二期）”2020 年 4 月 2 日至 2020 年 4 月 1 日期间的利息。具体详见公司于 2020 年 3 月 26 日在上海证券交易所网站披露的《非公开发行 2018 年公司债券（第二期）2020 年付息公告》。

#### （2）公司债券发行

2020 年 2 月，公司完成了司 2020 年公开发行公司债券（面向合格投资者）（第一期）（疫情防控债）发行，品种一发行规模为 15 亿元，票面利率为 3.03%，品种二发行规模为 10 亿元，票面利率为 3.18%。具体详见 2020 年 2 月 27 日在上海证券交易所网站披露的《2020 年公开发行公司债券（面向合格投资者）（第一期）（疫情防控债）发行结果公告》。

2020 年 5 月，公司完成了司 2020 年公开发行公司债券（面向合格投资者）（第二期）（疫情防控债）发行，发行规模为 15 亿元，期限为 367 天，票面利率为 1.99%。具体详见 2020 年 5 月 26 日在上海证券交易所网站披露的《2020 年公开发行公司债券（面向合格投资者）（第二期）（疫情防控债）发行结果公告》。

#### （3）短期公司债发行

2020 年 11 月，公司完成了司 2020 年公开发行短期公司债券（第一期）（面向专业投资者）发行，发行规模为 10 亿元，期限为 315 天，票面利率为 3.34%。具体详见 2020 年 11 月 6 日在上海证券交易所网站披露的《2020 年公开发行短期公司债券（第一期）（面向专业投资者）发行结果公告》。

#### （4）短期融资券发行

2020 年 3 月，公司完成了 2020 年度第一期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 91 天，票面利率为 2.10%。具体详见 2020 年 3 月 24 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第一期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 4 月，公司完成了 2020 年度第二期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 88 天，票面利率为 1.60%。具体详见 2020 年 4 月 21 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第二期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 5 月，公司完成了 2020 年度第三期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 91 天，票面利率为 1.67%。具体详见 2020 年 5 月 19 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第三期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 6 月，公司完成了 2020 年度第四期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 91 天，票面利率为 2.34%。具体详见 2020 年 6 月 19 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第四期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 7 月，公司完成了 2020 年度第五期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 89 天，票面利率为 2.65%。具体详见 2020 年 7 月 14 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第五期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 7 月，公司完成了 2020 年度第六期短期融资券发行，本期债券发行规模为 6 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 91 天，票面利率为 2.70%。具体详见 2020 年 7 月 27 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第六期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 8 月，公司完成了 2020 年度第七期短期融资券发行，本期债券发行规模为 8 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 90 天，票面利率为 2.70%。具体详见 2020 年 8 月 17 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第七期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 9 月，公司完成了 2020 年度第八期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 91 天，票面利率为 2.80%。具体详见 2020 年 9 月 16 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第八期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 10 月，公司完成了 2020 年度第九期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 91 天，票面利率为 3.00%。具体详见 2020 年 10 月 16 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第九期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 11 月，公司完成了 2020 年度第十期短期融资券发行，本期债券发行规模为 15 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 90 天，票面利率为 3.25%。具体详见 2020 年 11 月 12 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第十期短期融资券发行结果公告》。

2020 年 12 月，公司完成了 2020 年度第十一期短期融资券发行，本期债券发行规模为 10 亿元，发行价格为每张人民币 100 元，期限为 88 天，票面利率为 3.10%。具体详见 2020 年 12 月 15 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第十一期短期融资券发行结果公告》。

#### （5）短期融资券利息兑付

公司于 2020 年 6 月兑付“2020 年度第一期短期融资券”本息共计人民币 1,005,235,616.44 元。具体详见公司于 2020 年 6 月 23 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第一期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 7 月兑付“2020 年度第二期短期融资券”本息共计人民币 1,003,857,534.25 元。具体详见公司于 2020 年 7 月 21 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第二期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 8 月兑付“2020 年度第三期短期融资券”本息共计人民币 1,004,163,561.64 元。具体详见公司于 2020 年 8 月 17 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第三期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 9 月兑付“2020 年度第四期短期融资券”本息共计人民币 1,005,833,972.60 元。具体详见公司于 2020 年 9 月 18 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第四期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 10 月兑付“2020 年度第五期短期融资券”本息共计人民币 1,006,461,643.84 元。具体详见公司于 2020 年 10 月 14 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第五期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 10 月兑付“2020 年度第六期短期融资券”本息共计人民币 604,038,904.11 元。具体详见公司于 2020 年 10 月 26 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第六期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 11 月兑付“2020 年度第七期短期融资券”本息共计人民币 805,326,027.40 元。具体详见公司于 2020 年 11 月 13 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第七期短期融资券兑付完成的公告》。

公司于 2020 年 12 月兑付“2020 年度第八期短期融资券”本息共计人民币 1,006,980,821.92 元。具体详见公司于 2020 年 12 月 16 日在上海证券交易所网站披露的《关于 2020 年度第八期短期融资券兑付完成的公告》。

#### 5、为国金证券（香港）有限公司提供内保外贷

（1）公司于 2019 年 4 月召开 2018 年年度股东大会，审议通过了《关于为国金证券（香港）有限公司提供内保外贷的议案》，同意公司为国金香港提供总额不超过 3 亿元人民币（或等额港币）的内保外贷担保，额度内可循环滚动操作，担保期限不超过两年。具体详见公司于 2019 年 4 月 19 日在上海证券交易所网站披露的《2018 年年度股东大会决议公告》。

（2）2020 年 3 月，公司与中国邮政储蓄银行股份有限公司成都市分行签订《开立跨境保函/备用信用证合同》，约定公司以信用方式向邮储成都分行申请内保外贷业务，为公司下属控股子公司国金香港向招商永隆银行申请金额不超过 1 亿元港币贷款提供担保。邮储成都分行向招商永隆银行开具备用信用证。具体详见公司于 2020 年 3 月 26 日于上海证券交易所网站披露的《关于为国金证券（香港）有限公司提供内保外贷的公告》。

#### 6、会计政策变更

2020 年 3 月，公司第十一届董事会第五次会议和公司第九届监事会第四次会议审议通过了《关于会计政策变更的议案》，公司将根据财政部修订印发的《企业会计准则第 14 号-收入》对相关会计政策进行变更。具体详见公司于 2020 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站披露的《关于会计政策变更的公告》。

#### 7、与关联方共同投资

（1）2020 年 3 月，公司第十一届董事会第五次会议审议通过了《关于审议国金创新投资有限公司投资宁波国金涌富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）暨关联交易的议案》。国金创新系本公司全资另类投资子公司，国金涌富系国金创新参股公司，国金创新持有其 43.12%的股权。宁波国金涌富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）普通合伙人为国金涌富，认缴金额 1 万元。国金创新拟以自有资金认缴宁波国金涌富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）有限合伙人份额，认缴金额为不超过 24,900 万元，占本公司最近一期经审计净资产绝对值的 5%以下。按照《上海证券交

易所股票上市规则》的规定，国金涌富属于公司关联方，因此国金创新认缴宁波国金涌富有限合伙份额事宜构成公司与关联方共同投资的关联交易。具体详见公司于 2020 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站披露的《关联交易公告》。

(2) 2020 年 6 月，公司第十一届董事会第七次会议审议通过了《关于审议〈宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合伙）投资宁波锐石企业管理咨询合伙企业（有限合伙）关联交易〉的议案》。国金创新系本公司全资另类投资子公司，国金涌富系国金创新参股公司，国金创新持有其 43.12%的股权，宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合伙）普通合伙人为上海涌铎投资管理有限公司，认缴 1 万元；有限合伙人为涌金投资控股有限公司，认缴 48,300 万元。宁波锐石企业管理咨询合伙企业（有限合伙）普通合伙人为国金涌富，认缴金额 1 万元；国金创新为有限合伙人，认缴金额为 50,000 万元。涌瑞投资拟通过自有资金对宁波锐石进行增资，出资总金额不超过 1 亿元。投资完成后，涌瑞投资将成为宁波锐石的有限合伙人。国金创新以自有资金对宁波锐石的投资总额保持不变，拟出资总金额不超过 5 亿元。本次交易金额合计为 50,000 万元，占本公司最近一期经审计净资产绝对值的 5%以下。按照《上海证券交易所股票上市规则》的规定，涌瑞投资、国金涌富属于公司关联方，因此本次投资构成本公司关联方共同投资的关联交易。具体详见公司于 2020 年 6 月 4 日在上海证券交易所网站披露的《关联交易公告》。

(3) 2020 年 9 月，公司第十一届董事会第十次会议审议通过了《关于审议国金创新投资有限公司投资汽车金融系列有限合伙企业暨关联交易的议案》。国金创新系本公司全资另类投资子公司，国金涌富系国金创新参股公司，国金创新持有其 43.12%的股权。国金创新拟以自有资金投资由国金涌富作为普通合伙人的以汽车金融资产服务业务为投资领域的系列有限合伙企业，预计出资总金额不超过 2 亿元，占本公司最近一期经审计净资产绝对值的 5%以下。按照《上海证券交易所股票上市规则》的规定，国金涌富属于公司关联方，因此国金创新与国金涌富共同投资有限合伙企业，构成公司与关联方共同投资的关联交易。具体详见公司于 2020 年 9 月 12 日在上海证券交易所网站披露的《关联交易公告》。

## 8、2019 年度利润分配

2020 年 5 月，公司 2019 年年度股东大会审议通过了公司《二〇一九年度利润分配预案》：以截至 2019 年 12 月 31 日公司总股本 3,024,359,310 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金股利 0.50 元人民币（含税），共计分配现金股利 151,217,965.50 元，剩余未分配利润转入下一年度。公司于 2020 年 6 月实施完成了 2019 年年度利润分配相关事宜。具体详见公司于 2020 年 5 月 12 日及 2020 年 6 月 2 日在上海证券交易所网站披露的《2019 年年度股东大会决议公告》及《2019 年年度权益分派实施公告》。

## 9、投资者关系管理

### (1) 2019 年度网络业绩说明会

2020 年 4 月，公司通过上海证券交易所“上证 e 互动”网络平台召开了 2019 年度业绩说明会，就公司 2019 年经营情况、现金分红预案、2020 年战略规划等与投资者进行了互动交流。具

体详见公司于 2020 年 4 月 14 日在上海证券交易所网站披露的《关于召开 2019 年度业绩说明会的公告》。

## （2）上市公司投资者集体接待日

2020 年 9 月，为进一步加强与投资者的互动交流工作，公司通过上证所信息网络有限公司提供的网上平台，采取网络远程的方式，参加了由四川省上市公司协会、上证所信息网络有限公司、深圳全景网络有限公司共同举办的“2020 年四川辖区上市公司投资者集体接待日”活动，与投资者就公司治理、发展战略、经营状况和可持续发展等问题进行沟通。具体详见公司于 2020 年 9 月 21 日在上海证券交易所网站披露的《关于参加四川辖区上市公司投资者集体接待日的公告》。

## 10、关于控股股东转让股份暨筹划重大事项

2020 年 9 月，公司收到控股股东长沙涌金（集团）有限公司（以下简称“长沙涌金”）的通知，其与国联证券股份有限公司（以下简称“国联证券”）签署了《国联证券股份有限公司与长沙涌金（集团）有限公司关于国金证券股份有限公司之股份转让意向性协议》。长沙涌金拟通过协议转让方式将其持有的约 7.82% 的公司股份转让给国联证券。同日，国金证券与国联证券签署了《国联证券股份有限公司与国金证券股份有限公司之吸收合并意向性协议》，筹划由国联证券向国金证券全体股东发行 A 股股票的方式换股吸收合并国金证券。2020 年 10 月，公司接控股股东终止转让股份的通知，同时经公司审慎研究，公司决定终止筹划本次重大事项。具体内容详见公司于 2020 年 9 月 21 日及 2020 年 10 月 13 日在上海证券交易所网站披露的《关于控股股东转让股份暨筹划重大事项停牌公告》及《关于控股股东终止转让股份暨公司终止筹划重大事项暨公司股票复牌公告》。

## 11、股东权益变动

2020 年 11 月，公司收到 5% 以上股东涌金投资控股有限公司（以下简称“涌金投资”）的通知，自 2020 年 7 月 7 日至 2020 年 11 月 9 日，公司 5% 以上股东涌金投资通过二级市场集中竞价方式共计减持公司股份 33,298,866 股，减持股份数占公司总股本比例的 1.10%。本次权益变动前，涌金投资共计持有公司股份 282,555,604 股，占公司总股本的 9.34%；权益变动后，涌金投资共计持有公司股份 249,256,738 股，占公司总股本的 8.24%。本次权益变动后，公司股东涌金投资及其一致行动人长沙涌金（集团）有限公司合计持有公司股份比例从 27.43% 减少至 26.33%。具体详见公司 2020 年 11 月 11 日在上海证券交易所网站披露的《关于涌金投资控股有限公司及其一致行动人减持达到 1% 的提示性公告》。

## 12、独立董事变更事宜

2020 年 9 月，公司董事会收到独立董事雷家骥先生提交的书面辞职报告。因独立董事连任期限届满原因，雷家骥先生申请辞去公司第十一届董事会独立董事及董事会专门委员会职务。具体详见公司于 2020 年 9 月 20 日在上海证券交易所网站披露的《关于公司独立董事辞职的公告》。

2020 年 9 月，公司 2020 年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举公司第十一届董事会独立董事的议案》，同意选举刘运宏先生为公司第十一届董事会独立董事，任期至本届董事会届满。



具体详见公司于 2020 年 9 月 29 日在上海证券交易所网站披露的《2020 年第一次临时股东大会决议公告》、《关于刘运宏独立董事任职的公告》。

### 13、证券营业部变更

#### (1) 证券营业部新设

2020 年 1 月，根据中国证券监督管理委员会四川监管局《关于核准国金证券股份有限公司设立 2 家分支机构的批复》(川证监机构[2019]28 号)要求，目前，国金证券股份有限公司获准在山东省青岛市、辽宁省大连市各设立的 1 家证券营业部（C 型）已领取了营业执照和《经营证券期货业务许可证》，并正式开业。具体详见公司于 2020 年 1 月 3 日在上海证券交易所网站披露的《关于新设证券营业部开业的公告》。

2020 年 3 月，根据中国证券监督管理委员会四川监管局《关于核准国金证券股份有限公司设立 6 家分支机构的批复》(川证监机构[2020]9 号)要求，公司获准在浙江省宁波市、浙江省金华市、江苏省徐州市、江苏省南通市、广东省汕头市和河南省洛阳市各设立 1 家证券营业部（C 型）。具体详见公司于 2020 年 3 月 4 日在上海证券交易所网站披露的《关于获准新设 6 家分支机构的公告》。

#### (2) 证券营业部撤销

2020 年 10 月，根据《关于取消或调整证券公司部分行政审批项目等事项的公告》(中国证券监督管理委员会公告〔2020〕18 号)的相关要求，撤销成都华润路证券营业部。具体详见公司于 2020 年 10 月 30 日在上海证券交易所网站披露的《关于撤销成都华润路证券营业部的公告》。

### 14、公司主体信用等级

2020 年 11 月，公司收到上海新世纪资信评估投资服务有限公司出具的《国金证券股份有限公司信用评级报告》，公司主体信用等级维持“AAA”，评级展望为“稳定”。具体详见公司于 2020 年 11 月 25 日在上海证券交易所网站披露的《关于公司主体信用等级的公告》。

## 十七、积极履行社会责任的工作情况

### (一) 上市公司扶贫工作情况

适用 不适用

#### 1. 精准扶贫规划

以习总书记精准扶贫思想理论为指导，国金证券股份有限公司（以下简称公司）坚决贯彻、落实中国证监会和中国证券业协会关于脱贫攻坚的战略部署和决策安排，踊跃投身脱贫攻坚，积极承担社会责任。

2020 年是精准扶贫的收官之年。在中国证监会、中国证券业协会和川监局、川证期协的指导下，公司把扶贫作为崇高的政治使命和责任担当，结合自身优势明确了精准扶贫的理念与规划，通过强化机制、增加扶贫多元化方式等系列举措，不断深化精准扶贫工作，得到社会各界的广泛认可。

2020 年在新冠疫情发生后，公司积极履行金融机构的社会责任，落实扶贫协议各项工作内容。2020 年，公司捐资捐物共计约 164.58 万元，四川省成都市青羊区授予“工商优秀扶贫单位”，四川省“发挥金融合力 助推脱贫攻坚”金融精准扶贫劳动竞赛先进集体。近四年，公司投入公益帮扶资金，1278 余万元，帮扶贫困县融资 51.97 亿元，十个结对国家级贫困县已全部脱贫，出色地完成了脱贫攻坚任务。

## 2. 年度精准扶贫概要

截止到 2020 年 12 月 31 日，公司先后与十个国家级贫困县和三个贫困地区建立结对帮扶关系，分别是四川省阿坝藏族羌族自治州九寨沟县、重庆市石柱土家族自治县、四川省宜宾市屏山县、江西省九江市修水县、四川省甘孜藏族自治州色达县、四川省甘孜藏族自治州得荣县、新疆维吾尔自治区克孜勒苏柯尔克孜自治州阿克陶县、新疆维吾尔自治区和田地区皮山县、新疆维吾尔自治区阿克苏地区温宿县和新疆维吾尔自治区喀什地区莎车县，三个贫困地区是新疆阿瓦提县、四川通江县和安徽宿松县。公司“一司一县”定点帮扶内容和成果如下：

序号	帮扶地区	结对时间	帮扶金额	帮扶内容	帮扶成果
1	四川九寨沟县	2016 年	100 万元	1. 产业扶贫援建生态农庄项目； 2. 贫困户帮扶； 3. 金融扶贫、公益扶	已经脱贫
2	重庆石柱县	2017 年	141.5 万元	1. 教育扶贫、公益扶贫； 2. 贫困户帮扶； 3. 金融扶贫和特色产业。	已经脱贫
3	四川屏山县	2017 年	173.55 万元	1. 教育扶贫、公益扶贫； 2. 贫困户帮扶； 3. 金融扶贫和特色产业。	已经脱贫
4	江西修水县	2017 年首次、2018 年补充协议、2019 年补充协议	78 万元	1. 农业帮扶； 2. 贫困户帮扶； 3. 金融扶贫、公益扶贫和特色产业。	已经脱贫
5	四川色达县	2018 年、2019 年补充协议	60 万元	1. 农牧产品项目帮扶； 2. 贫困户帮扶； 3. 金融扶贫、公益扶贫。	已经脱贫
6	四川得荣县	2019 年	42 万元	1. 健康卫生； 2. 文化宣传； 3. 金融扶贫、公益扶贫。	已经脱贫
7	新疆阿克陶县	2019 年	60 万元	1. 基础设施 2. 贫困户帮扶； 3. 金融扶贫、公益扶贫。	已经脱贫
8	新疆阿瓦提县	2019 年	21.6 万元	基础设施	(非国贫县)

9	四川省通江县	2020 年	9.38 万元	教育帮扶	(非国贫县)
10	安徽宿松县	2020 年	10 万元	医疗贫困户帮扶	(非国贫县)
11	新疆皮山县	2020 年、 2021 年 补充协 议	30 万元	1. 教育帮扶; 2. 金融扶贫、公益扶贫。	已经脱贫
12	新疆温宿县	2020 年	25 万元	农牧产品项目帮扶;	已经脱贫
13	新疆莎车县	2020 年	50 万元	农业种植	已经脱贫

### (1) 定点扶贫

#### ◆ 新疆维吾尔自治区克孜勒苏柯尔克孜自治州阿克陶县扶贫工作

2019 年 12 月，公司与新疆阿克陶县签订一司一县精准帮扶协议。阿克陶县是新疆维吾尔自治区 35 个重点贫困县之一，依也勒干村隶属于阿克陶县皮拉勒乡，是深度贫困村。公司捐助 60 万元用于帮助县依也勒干村基础设施建设，修建农贸集市服务区，2020 年上半年已落实第二期项目资金 30 万元。服务区建成后，现代化运作管理体制配套服务功能更齐全，辐射周边屠宰场、彩砖厂等引进企业，物流畅通，交易方便，满足企业及人员的生产、生活需要，同时吸纳 16 名贫困户从事餐饮、销售服务，提升市场服务水平。项目具体包括房屋 8 间 280 平米、地坪 424 平米、红砖铺垫 210 平米和彩钢棚 300 平米。



公司援建农贸市场服务区

2020 年上半年，援建项目竣工，实际建成面积 290 平米，8 间房。预计年租金达到 2.4 万，围绕市场开展商业、餐饮服务。经平整周边土地，目前是县上五家驾校训练场地。

园区的牛羊屠宰点(厂)、沙石料厂、彩砖厂已经建成投产，将来计划逐步建成一个较大市场。

#### ◆ 四川省通江县扶贫工作

2020年8月，公司向四川省通江县教育局捐赠93823元用于通江县高明小学捐赠实施项目，通江县高明小学是一所新建的完全小学（含幼儿园），采用EPC（勘察设计施工）总承包模式招标采购建设。捐赠资金用于购买配套的教室电子白板，学生课桌凳、幼儿床等教育教学设施设备。

◆ 安徽省宿松县扶贫工作

2020年8月，公司向安徽省宿松县捐赠人民币10万元用于开展“爱心救助专项支持计划”，爱心救助旨在帮扶家庭成员患重特大疾病，医疗费用过高，造成基本生活陷入严重困难的家庭。

◆ 新疆维吾尔自治区和田地区皮山县扶贫工作

2020年，公司向皮山县教育局帮扶30万元（叁拾万元整），用于科克铁热克乡第一小学、科克铁热克乡第二小学、科克铁热克乡第三小学体育器材购买项目。

◆ 新疆维吾尔自治区阿克苏地区温宿县扶贫工作

2020年，公司向温宿县帮扶25万元（贰拾伍万元整），用于援建温宿县阿热勒镇提格艾日克村肉牛养殖基地“五合一”防疫点建设项目。

该项目新建肉牛养殖培训实验中心、消毒室、防疫站各一座及相关附属设施，建设总面积138平方米，总投资25万元，现已完工并投入使用。该项目的实施，一是完善肉牛养殖基地防疫措施，改善防疫环境，确保能够第一时间发现疫情，第一时间处置疫情，同时加强对养殖大户宣传培训防疫知识，提高肉牛存活率。二是提高科学养殖技术培训效果，降低养殖成本，缩短养殖周期，改善肉牛养殖技术和养殖环境，增强肉牛育肥效果，预计每头牛每年可增收2000元。三是加强对养殖技术和养殖效益宣传力度，引领更多的农民群众参与肉牛养殖，随着养殖规模的不断扩大、养殖技术的不断成熟，计划在1-2年内采用自繁自育模式，扩大群体规模，实现销售增收。





◆ 新疆维吾尔自治区喀什地区莎车县扶贫工作

2020 年，公司向帮扶单位：莎车县塔孜尔其镇扎滚艾日克（28）村和兰干（29）村合计共落实帮扶项目资金人民币 50 万元（伍拾万元），该资金用于上述两个村成立特色种植养殖、林果加工等合作社的前期启动资金，帮助两个村大力发展特色种植养殖业和林果加工业等产业。

(2) 金融扶贫

公司积极为贫困地区企业发展提供 IPO 辅导和上市保荐、债券融资等金融服务。公司不断为贫困地区企业拓展多元化融资渠道，努力促进贫困地区经济社会可持续发展。

(3) 公益扶贫

2020 年 1 月，公司向上海洋泾社区公益基金会捐助人民币 50000 元（伍万元整）用以帮助社区孤寡老人、伤残军人、烈士家属、重疾重症人员、品学兼优的贫困家庭学子等。

2020 年，在四川省开展以购代捐的消费扶贫工作，采购物资 2 万余元。

2020 年 11 月公司给贵州大方县群丰村撮坝小学，组织了爱心捐赠活动。此次活动共计捐赠衣物 320 余件，重点捐赠对象为贵州大方县群丰村撮坝小学的留守儿童等困难家庭学生。

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	161.38
2.物资折款	3.2
二、分项投入	
1.产业发展脱贫	

其中：1.1 产业扶贫项目类型	<input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫 <input type="checkbox"/> 旅游扶贫 <input type="checkbox"/> 电商扶贫 <input type="checkbox"/> 资产收益扶贫 <input type="checkbox"/> 科技扶贫 <input type="checkbox"/> 其他
1.2 产业扶贫项目个数（个）	3
1.3 产业扶贫项目投入金额	105
2.转移就业脱贫	
2.3 帮助建档立卡贫困户实现就业人数（人）	12
3.易地搬迁脱贫	
4.教育脱贫	
4.3 改善贫困地区教育资源投入金额	39.38
5.健康扶贫	
6.生态保护扶贫	
7.兜底保障	
8.社会扶贫	
8.2 定点扶贫工作投入金额	15
9.其他项目	
其中：9.1 项目个数（个）	2
9.2 投入金额	5.2
9.4 其他项目说明	贵州大方县帮扶项目、成都市青羊区以购代捐帮扶
三、所获奖项（内容、级别）	
四川省成都市青羊区授予“工商优秀扶贫单位”，四川省“发挥金融合力 助推脱贫攻坚”金融精准扶贫劳动竞赛先进集体	

#### 4. 后续精准扶贫计划

公司扶贫工作取得的成绩离不开中国证监会、中国证券业协会和川监局、川证期协的领导和支持。脱贫攻坚的重大胜利为实现第一个百年奋斗目标打下坚实基础，全面建成小康社会胜利在望。脱贫摘帽不是终点，而是新生活、新奋斗的起点，公司秉承着社会责任，不忘初心，牢记使命，将继续通过公益帮扶的绵薄之力帮助更多需要帮助的人，传递正能量，为实现第二个百年奋斗目标、实现中华民族伟大复兴而奋斗。

#### （二）社会责任工作情况

√适用 □不适用

公司秉承“责任、和谐、共赢”的企业核心价值观，持续增强作为社会成员的责任意识，在追求自身经济利益、保护股东权益的同时，充分关注客户、员工等利益相关者权益，重视社会公益等非商业领域贡献，积极支持地区经济社会发展，将短期利益与长期利益结合，将自身成长融入社会建设中，致力于促进环境、经济、社会的可持续发展。

公司关于社会责任的履行情况详见公司于 2021 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 披露的《二〇二〇年度社会责任报告》。

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

□适用 √不适用

**2. 重点排污单位之外的公司的环保情况说明**

□适用 √不适用

**3. 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明**

□适用 √不适用

**4. 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明**

□适用 √不适用

**(四) 其他说明**

√适用 □不适用

**1. 绿色金融**

国金证券发挥专业优势，积极开展绿色金融服务，协助实现节能减排、绿色产业结构升级，有效推动民生事业的可持续发展。2020 年，国金证券作为主承销商参与长兴仙山湖旅游投资开发有限公司 7 亿元绿色项目收益债券销售，募集资金用于建设长兴仙山湖生态智慧型旅游设施系统项目，将促进当地旅游生态的可循环发展。

案例名称	案例介绍
长兴仙山湖旅游投资开发有限公司私募债	国金证券作为主承销商，协助长兴仙山湖旅游投资开发有限公司（简称“仙山湖旅游”）非公开发行绿色项目收益专项公司债券 7 亿元。仙山湖旅游主要负责浙江省长兴县仙山湖景区的开发、策划、运营与管理。本次募集资金投资建设长兴仙山湖生态智慧型旅游设施系统项目，依托湿地生态环境基础，打造仙山湖湿地景区观赏体验的核心吸引点，凸显湿地景区的绿色生态旅游体验，将促进景区新一轮环境生态品质及绿色服务配套设施系统的全面提升、提高湿地景区的整体质量水准。

**2. 绿色债券**

公司自营业务大力支持节能环保事业，将符合国家政策导向的环保类企业纳入投资库。截至 2020 年末，自营投资绿色债券 9,000 万元。根据债券的募集说明书显示，募集资金主要用于佛山市“三旧”改造基础设施之南边污水处理厂及配套管网工程项目、洛阳市涧西污水处理厂扩建工程项目等经认证的十五个绿色项目建设。

**3. 供应链管理**

公司制定有《国金证券股份有限公司招标管理办法》、《国金证券股份有限公司采购管理办法》、《国金证券股份有限公司信息系统基础设施建设、软硬件及技术服务采购管理规范》等制度，规

范公司对基础设施建设、软硬件及技术服务采购等行为，对信息系统选型、测试、采购等管理进行明确规定。

公司针对不同产品、不同金额的采购采取招标、邀标、比价等不同的采购方式，对核心服务器等通过多厂商直销、集中采购等方式降低成本和风险，让采购行为更公开透明和公正。

同时，公司每年定期开展供应商例行考评，并根据考评结果，对不符合公司要求的供应商进行淘汰。2020 年公司上线了供应商管理系统，完善供应商相关信息，实现了对供应商分类规范管理。

#### 4. 绿色经营

##### ◆ 绿色运营

公司倡导绿色经营，节能环保，节约不浪费的运营理念。鼓励员工节约社会与自然资源、保护环境、减少污染、提倡可持续发展、呵护地球环境。公司严格恪守《环境保护法》、《节约能源法》等法律法规，将绿色运营贯穿与经营管理过程中，认真分析运营过程中涉及的人、物等对环境造成的影响，全面合理控制，节能高效办公。采取无纸化办公、节水节电、推广电话视频会议、低碳出行、固废及废水处理等多种措施减少公司运营对环境和自然资源产生的不利影响，2020 年，公司未发生环境方面的违约事件。具体如下：

**节能减排：**公司倡导节水节电，冬夏季空调温度设置上下限，下班后鼓励员工及时关闭办公设备；采用市政用水作为主要来源，对有泄漏之处及时维修以节约水资源。

**无纸化办公：**公司鼓励员工节约用纸，能不打印尽量采用电子版文件进行沟通。倡导双面打印，打印机默认设置为双面打印，节约纸张，节约资源、减少碳排放。

**推广电话、视频会议：**异地会议采取电话，视频会议减少员工商务旅行往来产生的不合理浪费，有效减少了现场会议数量，节约了社会自然资源。2020 年度视频会议超 3,000 次。

**低碳出行：**公司鼓励员工上下班使用公共交通，减少车辆使用以减少废气排放。对公务车辆进行管理，制定了《车辆及驾驶员管理办法》，合理调度，高效节能使用。公司总部自有车辆 12 辆，出行公里数约 40 万公里。均及时跟踪年检，对不符合环保要求的车辆进行更换。

**固废、废水处理：**公司统一收集办公垃圾后由物业进行清运。电子废弃物及对环境有害物质收集后单独处理，废水纳入市政污水管网运送至城镇污水处理厂处理。

#### 十八、可转换公司债券情况

适用 不适用



## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、普通股股本变动情况

#### (一) 普通股股份变动情况表

##### 1、普通股股份变动情况表

报告期内，公司普通股股份总数及股本结构未发生变化。

##### 2、普通股股份变动情况说明

适用 不适用

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

适用 不适用

##### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

#### (二) 限售股份变动情况

适用 不适用

### 二、证券发行与上市情况

#### (一) 截至报告期内证券发行情况

适用 不适用

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

适用 不适用

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

适用 不适用

#### (三) 现存的内部职工股情况

适用 不适用

### 三、股东和实际控制人情况

#### (一) 股东总数

截止报告期末普通股股东总数(户)	188,880
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	185,794

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

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内 增减	期末持 股数量	比例 (%)	持有有 限售条 件股份 数量	质押或冻结情况		股东 性质
					股份 状态	数量	

长沙涌金（集团）有限公司		547,075,232	18.09	0	无	-	境内非国有法人
涌金投资控股有限公司	-33,298,866	249,256,738	8.24	0	无	-	境内非国有法人
山东通汇资本投资集团有限公司		140,582,700	4.65	0	质押	32,562,903	国有法人
中国证券金融股份有限公司		90,428,645	2.99	0	无	-	境内非国有法人
香港中央结算有限公司	9,390,101	63,055,638	2.08	0	无	-	其他
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	28,197,161	53,716,061	1.78	0	无	-	其他
中央汇金资产管理有限责任公司		46,726,900	1.55	0	无	-	国有法人
中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划		30,200,900	1.00	0	无	-	其他
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	14,388,800	24,629,176	0.81	0	无	-	其他
四川产业振兴发展投资基金有限公司		18,750,000	0.62	0	无	-	国有法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
长沙涌金（集团）有限公司	547,075,232	人民币普通股	547,075,232				
涌金投资控股有限公司	249,256,738	人民币普通股	249,256,738				
山东通汇资本投资集团有限公司	140,582,700	人民币普通股	140,582,700				

中国证券金融股份有限公司	90,428,645	人民币普通股	90,428,645
香港中央结算有限公司	63,055,638	人民币普通股	63,055,638
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	53,716,061	人民币普通股	53,716,061
中央汇金资产管理有限责任公司	46,726,900	人民币普通股	46,726,900
中欧基金—农业银行—中欧中证金融资产管理计划	30,200,900	人民币普通股	30,200,900
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	24,629,176	人民币普通股	24,629,176
四川产业振兴发展投资基金有限公司	18,750,000	人民币普通股	18,750,000
上述股东关联关系或一致行动的说明	1. 长沙涌金（集团）有限公司与涌金投资控股有限公司存在关联关系，亦属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。 2. 公司未知其他上述股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。		

备注：公司股东涌金投资控股有限公司权益变动情况，详见公司于 2020 年 11 月 11 日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《关于涌金投资控股有限公司及其一致行动人减持达到 1% 的提示性公告》。

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

#### 四、控股股东及实际控制人情况

##### (一) 控股股东情况

##### 1 法人

适用 不适用

名称	长沙涌金（集团）有限公司
单位负责人或法定代表人	张峥
成立日期	1994 年 6 月 10 日
主要经营业务	房地产开发经营；经济与商务咨询服务（不含金融、证券、期货咨询）；日用百货、五金产品、建材、装饰材料、农产品、化工产品的销售。
报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况	无
其他情况说明	无

2 自然人

适用 不适用

3 公司不存在控股股东情况的特别说明

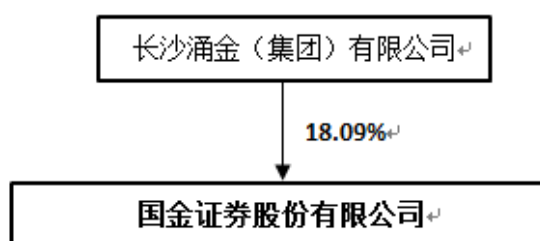
适用 不适用

4 报告期内控股股东变更情况索引及日期

适用 不适用

5 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用



(二) 实际控制人情况

1 法人

适用 不适用

2 自然人

适用 不适用

姓名	陈金霞
国籍	中国
是否取得其他国家或地区居留权	否
主要职业及职务	近 10 年无任职
过去 10 年曾控股的境内外上市公司情况	九芝堂股份有限公司

3 公司不存在实际控制人情况的特别说明

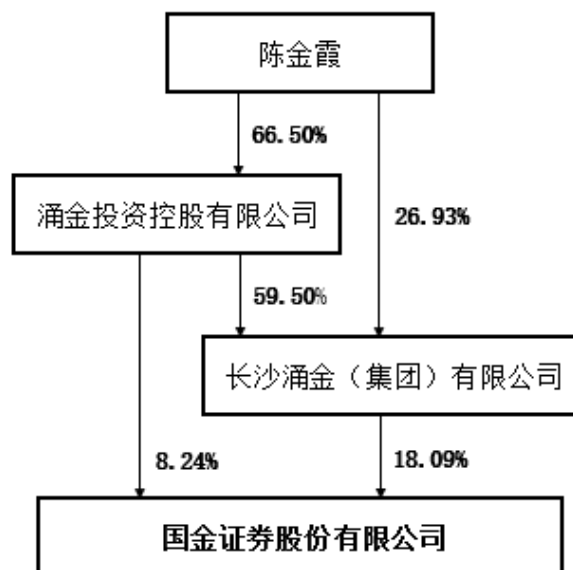
适用 不适用

4 报告期内实际控制人变更情况索引及日期

适用 不适用

5 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用



6 实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司

适用 不适用

(三) 控股股东及实际控制人其他情况介绍

适用 不适用

五、其他持股在百分之十以上的法人股东

适用 不适用

六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

### 一、持股变动情况及报酬情况

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

√适用 □不适用

单位：股

姓名	职务(注)	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	年初持股数	年末持股数	年度内股份增减变动量	增减变动原因	报告期内从公司获得的税前报酬总额（万元）	是否在公司关联方获取报酬
冉云	董事长	男	57	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	793.64	否
杜航	副董事长	男	51	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	247.65	否
金鹏	董事、总经理、财务总监	男	54	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	868.86	否
赵煜	董事	男	52	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	0.00	是
章卫红	董事	女	45	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	0.00	是
郭伟	董事	男	41	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	0.00	否
雷家骥	独立董事	男	66	2019年5月31日	2020年9月28日	0	0	0	/	12.00	否
赵雪媛	独立董事	女	51	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	14.40	否
骆玉鼎	独立董事	男	51	2019年5月31日	2022年5月30日	0	0	0	/	14.40	否
刘运宏	独立董事	男	45	2020年9月	2022年5月	0	0	0	/	2.57	否

				月 28 日	月 30 日						
邹川	监事会主席	男	59	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	269.22	否
顾彦君	监事	男	30	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	0.00	是
蒋伟华	监事	女	47	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	192.24	否
李蒲贤	副总经理、首席信息官	男	53	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	433.74	否
姜文国	副总经理	男	54	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	582.16	否
纪路	副总经理	男	46	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	656.92	否
刘邦兴	副总经理、合规总监	男	46	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	533.10	否
石鸿昕	副总经理	女	53	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	270.71	否
肖振良	副总经理	男	58	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	199.88	否
马骏	副总经理	女	45	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	774.33	否
易浩	首席风险官	男	46	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	418.79	否
周洪刚	董事会秘书	男	46	2019 年 5 月 31 日	2022 年 5 月 30 日	0	0	0	/	419.94	否
合计	/	/	/	/	/	0	0	0	/	6,704.55	/

备注：1、公司高级管理人员的绩效年薪 40%以上采取了延期支付的方式，且延期支付期限不少于 3 年。延期支付薪酬的发放遵循等分原则。

2、报告期内从公司获得税前报酬总额为归属于 2020 年度计提并发放的薪酬。



姓名	主要工作经历
冉云	男，土家族，1964 年出生，EMBA。现任本公司董事长、国金鼎兴投资有限公司董事，国金金融控股（香港）有限公司董事。曾任成都金融市场职员，成都市人民银行计划处职员，成都证券公司发行部经理、总裁助理、副总裁、监事长，国金证券有限责任公司监事长，国金证券股份有限公司监事会主席。
杜航	男，汉族，1970 年出生，管理科学与工程专业博士。现任本公司副董事长。曾任航空信托投资有限责任公司信贷部副经理、证券部负责人，航空证券筹备领导小组成员，中航证券有限公司副总经理、常务副总经理、总经理。
金鹏	男，汉族，1967 年出生，EMBA。现任本公司董事、总经理、财务总监，国金创新投资有限公司董事长，国金期货有限责任公司董事，国金基金管理公司董事，国金证券（香港）有限公司董事，国金金融控股（香港）有限公司董事。曾任涌金期货经纪有限公司总经理助理，上海涌金理财顾问有限公司副总经理，河北财金投资有限公司总经理，涌金实业（集团）有限公司副总裁，国金证券有限责任公司风险控制中心总经理，公司董事、副总经理、监事、监事会主席，国金期货有限责任公司董事长。
赵煜	男，汉族，1969 年出生，大学本科。现任本公司董事、涌金实业（集团）有限公司董事长助理、国金基金管理有限公司董事。曾任上海浦东中软科技发展有限公司董事副总经理，云南国际信托有限公司董事。
章卫红	女，汉族，1976 年出生，硕士，中国注册会计师，中国注册税务师，高级国际财务管理师。现任本公司董事，涌金实业（集团）有限公司财务部总经理，曾任上海融兴网络科技有限公司财务经理，华东理工大学会计系讲师。
郭伟	男，汉族，1980 年出生，管理科学博士。现任本公司董事，山东通汇资本投资集团有限公司党委书记、董事长，通汇诚泰商业保理（天津）有限公司董事长、诚泰融资租赁（上海）有限公司董事。曾任山东省财政厅驻淄博财政检查办事处副主任科员、主任科员，山东省财政厅经济建设处主任科员。
雷家骅	男，汉族，1955 年出生，博士，现任清华大学经管学院教授、博士生导师，清华大学中国企业成长与经济安全研究中心主任，中国技术经济学会创新创业分会理事长，众智博汇（北京）科技孵化器有限公司监事、北京宇信科技集团有限公司独立董事、北京博润创投资本管理有限公司监事、北京众茂博银科技中心（有限合伙）监事、上海圣习医疗科技服务中心监事、上海清朴嘉投资管理合伙企业监事。曾任本公司独立董事。
赵雪媛	女，汉族，1970 年出生，博士，现任本公司独立董事、中央财经大学会计学院教授、硕士生导师，浙江芯能光伏科技股份有限公司独立董事，大同农村商业银行股份有限公司独立董事。
骆玉鼎	男，汉族，1971 年出生，经济学（金融学）博士，现任本公司独立董事、上海市工商管理专业教育指导委员会副主任委员、上海财经大学商学院金融学副教授。曾任上海财经大学金融学院常务副院长、上海财经大学商学院执行院长。
刘运宏	男，汉族，1976 年出生，法学博士、经济学博士后、研究员职称，现任中国人民大学国际并购与投资研究所副所长，前海人寿（上海）研究所所长，光大证券股份有限公司独立董事，上海电气集团股份有限公司独立董事，贵阳银行股份有限公司独立董事，中国人民大学、上海财经大学、华东政法大学等校兼职教授和硕士研究生导师。曾在国泰基金管理有限公司担任法律合规事务主管，在上海证券交易所从事博士后研究工作，在航天证券有限责任公司担任投资银行总部总经理，在华宝证券有限责任公司先后担任投资银行部总经理、总裁

	助理。
邹川	男，汉族，1962 年出生，大学本科学历。现任本公司监事会主席、工会主席。曾任成都大学企业管理系副主任、副教授，成都证券有限责任公司上海茅台路证券营业部总经理、公司总裁助理、公司副总裁，国金证券有限责任公司上海茅台路证券营业部总经理，国金证券股份有限公司经纪业务管理总部经理。
顾彦君	男，汉族，1991 年出生，金融硕士。现任本公司监事，上海纳米创业投资有限公司投资经理，北京鑫星伊顿技术服务股份有限公司董事，深圳英博科技产业培育有限公司董事，深圳英智投资管理有限公司董事，江苏国富氢能技术装备有限公司董事，张家港涌泉投资管理企业(有限合伙)执行事务合伙人委派代表，江苏铨德氢能科技有限公司监事，上海涌澄资产管理有限公司执行董事，上海泓成创业投资合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人委派代表。曾任复星高科技(集团)有限公司地产控股事业部总裁助理及海外资产管理经理。
蒋伟华	女，汉族，1974 年出生，大学本科学历。现任本公司职工代表监事、本公司上海证券自营分公司投资管理部副总经理。曾任中国农业银行广东省信托投资公司上海营业部职员、中山证券有限责任公司上海零陵路营业部职员。
李蒲贤	男，汉族，1968 年出生，经济学博士。现任本公司副总经理、首席信息官，国金期货有限责任公司董事长。曾任成都证券总经理助理、交易总监，成都证券副总经理兼人民南路营业部总经理，国金证券有限责任公司副总经理。
姜文国	男，汉族，1967 年出生，管理科学硕士。现任本公司副总经理，国金证券(香港)有限公司董事。曾任光大证券有限公司资产经营部项目经理，兴业证券股份有限公司投资银行上海总部副总经理、总经理，兴业证券总裁助理，国金证券有限责任公司投资银行部总经理、公司副总经理。
纪路	男，蒙古族，1975 年出生，工商管理硕士，EMBA。现任本公司副总经理，国金基金管理有限公司董事长，国金证券(香港)有限公司董事，国金财务(香港)有限公司董事，国金道富投资服务有限公司董事，上海国金理财财富基金销售有限公司执行董事。中国证券业协会互联网证券专业委员会委员，中国证券业协会证券公司专业评价专家，上交所理事会市场交易管理委员会委员。在 2008 年《证券市场周刊》举办的最佳分析师评选中，获得“金牌领队”特别奖项；在 2010 年《新财富》举办的最佳分析师评选中，被评为“杰出研究领袖”。曾任博时基金管理有限公司研究员，金信证券有限责任公司投资研究中心总经理。
刘邦兴	男，汉族，1975 年出生，法学硕士，EMBA。现任本公司副总经理、合规总监。曾任汕头经济特区对外商业(集团)公司法律顾问，汕头证券股份有限公司法律顾问，涌金集团法律部副总经理，国金证券有限责任公司董事会秘书，本公司董事、董事会秘书。
石鸿昕	女，汉族，1968 年出生，劳动经济学硕士。现任本公司副总经理，国金创新投资有限公司董事、总经理，国金道富投资服务有限公司董事长。曾任本公司人力资源总监，九芝堂股份有限公司人力资源总监，北京涌金财经顾问有限公司人力资源部总经理、总办主任。
肖振良	男，汉族，1963 年出生，经济学硕士。现任本公司副总经理，国金鼎兴投资有限公司董事长、总经理，国金鼎兴资本管理有限公司董事长、总经理，上海佐誉资产管理有限公司董事。曾任国金证券股份有限公司总裁助理，兴业证券股份有限公司投资银行福建总部总经理，中国农业银行股份有限公司干部、厦门市证券监督管理委员会干部。
马骏	女，汉族，1976 年出生，工商管理硕士。现任本公司副总经理、国金证券上海证券资产管理分公司总经理。曾历任亚洲证券有限责任公司债券业务总部高级经理，国盛证券有限责任公司固定收益部副总经理，国金证券股份有限公司固定收益部总经理，国金证券股份有限公司上海证券自营分公司副总经理。
易浩	男，汉族，1975 年出生，法律硕士，EMBA。现任本公司首席风险官。曾任中国建设银行长沙市分行法律顾问，湘财证券有限责任公司

	法律事务总部首席律师、合规管理总部总经理、风险管理总部总经理、稽核管理总部总经理、办公室主任、董秘处主任，本公司合规总监。
周洪刚	男，汉族，1975 年出生，工商管理硕士，EMBA。现任本公司董事会秘书，国金鼎兴投资有限公司董事，国金鼎兴资本管理有限公司董事，国金金融控股（香港）有限公司董事，中国上市公司协会投资者关系委员会委员。曾任湖南省娄底市万宝中学教师，三一重工股份有限公司人力资源部副部长，湖南电广商务拓展有限公司市场总监，九芝堂股份有限公司人力资源部部长、助理销售总监、监事，浙江祥邦科技有限公司副总经理，本公司人力资源部总经理。

其它情况说明

适用 不适用

(二) 董事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

二、现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员的任职情况

(一) 在股东单位任职情况

适用 不适用

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务	任期起始日期	任期终止日期
郭伟	山东通汇资本投资集团有限公司	党委书记、董事长	2019 年 9 月	-
在股东单位任职情况的说明	除此外，公司其他董事、监事及高级管理人员在本公司股东单位没有任职。			

(二) 在其他单位任职情况

适用 不适用

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务	任期起始日期	任期终止日期
冉云	国金鼎兴投资有限公司	董事	2015 年 6 月	-
	国金金融控股（香港）有限公司	董事	2018 年 9 月	-
金鹏	国金创新投资有限公司	董事长	2016 年 10 月	-
	国金期货有限责任公司	董事	2019 年 10 月	2022 年 10 月
	国金基金管理有限公司	董事	2018 年 7 月	2021 年 7 月
	国金证券（香港）有限公司	董事	2019 年 4 月	-
	国金金融控股（香港）有限公司	董事	2018 年 9 月	-

赵煜	涌金实业（集团）有限公司 国金基金管理有限公司 上海涌慧企业管理有限公司 上海涌康企业管理有限公司 上海涌佳农业科技有限公司 上海涌澄资产管理有限公司	董事长助理 董事 执行董事兼总经理 执行董事兼总经理 执行董事 执行董事	2007年9月 2018年7月 2017年4月 2017年4月 2017年9月 2017年10月	- 2021年7月 - - - -
章卫红	涌金实业（集团）有限公司	财务部总经理	2013年11月	-
郭伟	山东通汇资本投资集团有限公司 通汇诚泰商业保理（天津）有限公司 诚泰融资租赁（上海）有限公司 山东高速通达融资租赁有限公司 山东高速青岛产业投资有限公司 先行通数字科技有限公司 通汇资本（香港）有限公司 上海通汇嘉泰商业保理有限公司	党委书记、董事长 董事长 董事 董事长 执行董事 董事长 董事 董事长	2019年9月 2017年9月 2018年11月 2019年12月 2019年10月 2019年12月 2019年12月 2020年12月	- - - - - - - -
雷家骥	清华大学经管学院 北京宇信科技集团有限公司 北京博润创投资本管理有限公司 众智博汇(北京)科技孵化器有限公司 北京众茂博银科技中心（有限合伙） 上海圣习医疗科技服务中心 上海清朴嘉投资管理合伙企业	教授 独立董事 监事 监事 监事 监事 监事	1996年1月 2018年6月 2016年12月 2015年7月 2016年5月 2017年3月 2015年10月	- 2021年6月 - - - - -
赵雪媛	中央财经大学会计学院 大同农村商业银行股份有限公司 浙江芯能光伏科技股份有限公司	教授、副院长 独立董事 独立董事	2007年7月 2019年5月 2018年3月	- - 2021年3月
骆玉鼎	上海财经大学商学院金融学	副教授	2018年1月	-
刘运宏	光大证券股份有限公司	独立董事	2020年12月	2023年12月

	上海电气集团股份有限公司 贵阳银行股份有限公司	独立董事 独立董事	2020 年 11 月 2018 年 2 月	2021 年 9 月 -
顾彦君	上海纳米创业投资有限公司 北京鑫星伊顿技术服务股份有限公司 深圳英博科技产业培育有限公司 江苏国富氢能技术装备有限公司 深圳英智投资管理有限公司 江苏铨德氢能源科技有限公司 上海涌澄资产管理有限公司	投资经理 董事 董事 董事 董事 监事 董事	2017 年 5 月 2016 年 11 月 2017 年 8 月 2017 年 10 月 2017 年 8 月 2018 年 7 月 2020 年 7 月	- - - - - -
李蒲贤	国金期货有限责任公司	董事长	2019 年 10 月	2022 年 10 月
姜文国	国金证券（香港）有限公司	董事	2019 年 4 月	-
纪路	国金基金管理有限公司 国金证券（香港）有限公司 国金财务（香港）有限公司 国金道富投资服务有限公司 上海国金理益财富基金销售有限公司	董事长 董事 董事 董事 董事	2018 年 7 月 2019 年 4 月 2019 年 4 月 2018 年 12 月 2014 年 12 月	2021 年 7 月 - - 2021 年 12 月 -
石鸿昕	国金创新投资有限公司 国金道富投资服务有限公司	董事、总经理 董事长	2016 年 10 月 2018 年 12 月	- 2021 年 12 月
肖振良	国金鼎兴投资有限公司 国金鼎兴资本管理有限公司 上海佐誉资产管理有限公司	董事长、总经理 董事长、总经理 董事	2015 年 6 月 2014 年 1 月 2015 年 11 月	- - -
周洪刚	国金鼎兴投资有限公司 国金鼎兴资本管理有限公司 国金金融控股（香港）有限公司	董事 董事 董事	2016 年 1 月 2016 年 3 月 2018 年 9 月	- - -
在其他单位任职情况的说明	无			

**三、董事、监事、高级管理人员报酬情况**

√适用 □不适用

董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序	公司严格按照相关法律、法规、规范性文件的要求，对公司董事、监事、高级管理人员的薪酬方案进行决策。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	公司独立董事报酬标准参考同行业上市公司的平均水平确定；公司内部董事、监事和高级管理人员的报酬由公司薪酬体系决定，与工作岗位和绩效考核结果挂钩；公司外部董事、监事不在公司领取报酬。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	报告期内按照公司《薪酬管理制度》的相关规定支付了董事、监事、高级管理人员报酬。
报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计	公司董事、监事和高级管理人员报酬组成包含归属 2020 年计提并发放的薪酬和 2019 年度及以前年度递延发放的薪酬两部分。截止报告期末，公司董事、监事和高级管理人员 2020 年计提并发放的薪酬合计为 6,704.55 万元。报告期，上述人员归属 2019 年度及以前年度递延发放的薪酬金额分别为：冉云：576.45 万元；杜航：96.94 万元；金鹏：590.90 万元；邹川：90.67 万元；李蒲贤：177.34 万元；姜文国：371.34 万元；纪路：342.67 万元；刘邦兴：218.00 万元；石鸿昕：70.99 万元；肖振良：92.30 万元；周洪刚：179.00 万元；易浩：202.75 万元；马骏：833.43 万元。

**四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况**

√适用 □不适用

姓名	担任的职务	变动情形	变动原因
雷家骥	独立董事	离任	独立董事连任期限届满
刘运宏	独立董事	选举	经公司 2020 年第一次临时股东大会决议，公司选举刘运宏先生为公司第十一届董事会独立董事，任期至本届董事会届满

备注：2020 年 9 月 11 日，公司董事会收到独立董事雷家骥先生提交的书面辞职报告。因独立董事连任期限届满原因，雷家骥先生申请辞去公司第十一届董事会独立董事及董事会专门委员会职务。根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》和公司《章程》等有关规定，雷

家骥先生在公司新任独立董事任职前将继续履职。具体详见公司于 2020 年 9 月 12 日在上海证券交易所网站（[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn)）披露的《关于公司独立董事辞职的公告》。

2020 年 9 月 28 日，公司 2020 年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举公司第十一届董事会独立董事的议案》，同意选举刘运宏先生为公司第十一届董事会独立董事，任期至本届董事会届满。具体详见公司于 2020 年 9 月 29 日在上海证券交易所网站（[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn)）披露的《国金证券股份有限公司 2020 年第一次临时股东大会决议公告》。

#### 五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

适用 不适用

## 六、母公司和主要子公司的员工情况

### (一) 员工情况

母公司在职员工的数量	3,198
主要子公司在职员工的数量	347
在职员工的数量合计	3,545
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	0
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
经纪业务人员	1,871
机构与研究业务人员	130
自营业务人员	67
投行业务人员	634
资管业务人员	93
财务人员	79
管理及其他业务人员	324
公司全资子公司国金期货有限责任公司	138
公司全资子公司国金鼎兴投资有限公司	57
公司全资子公司国金创新投资有限公司	3
公司全资子公司国金金融控股(香港)有限公司	47
公司控股子公司国金道富投资服务有限公司	102
合计	3,545
教育程度	
教育程度类别	数量(人)
研究生及以上	1,205
本科	2,065
大专	225
大专以下	50
合计	3,545

备注：公司全资子公司国金金融控股(香港)有限公司员工情况包含其子公司国金证券(香港)有限公司、国金财务(香港)有限公司员工情况。

### (二) 薪酬政策

√适用 □不适用

公司的薪酬政策遵循：

1. 市场化原则：以证券行业市场薪酬水平以及公司业绩为基础，不同职能的薪酬待遇根据市场化原则设计。
2. 公平性原则：根据职位职责和价值贡献程度确定职级，按职级确定员工的基本薪酬水平，保证薪酬对内的公平性。
3. 差异化原则：根据员工能力以及绩效水平进行薪酬差异化，拉开绩效差异。
4. 透明与保密兼顾原则：公司薪酬制度、机制和规则完全公开透明，但具体薪酬数据实行保密薪资制。



5. 分序列管理原则：是指公司按照业务性质的不同，将公司薪酬分为不同的序列进行管理，包括职能管理序列、业务序列（研究、财富委、投资银行、投资管理、资产管理等）。各序列的薪酬结构基本相同，但具体规定以及薪酬水平各不相同，序列之间不做横向比较。

6. 动态管理原则：根据公司战略变化、业绩发展、行业发展状况等因素，调整公司整体薪酬体系。公司整体薪酬调整幅度参照证券行业平均薪酬调整幅度；员工薪酬调整幅度按员工个人能力发展以及绩效水平进行差异化区分。

### (三) 培训计划

√适用 □不适用

人才，是国金证券最重要的资本，是业务发展的重要驱动力。公司以“业务支撑、组织赋能、人才培养、文化推动”为目标，建立了完善的人才发展体系，致力于塑造学习型组织氛围、提升员工能力与业绩、助力员工职业发展。

#### 1、人才培养与发展



2020 年，全年共组织培训 1,538 场（含内部培训和外部学习），员工培训覆盖率 100%，参训 44,351 人次，198,810 总学时，人均 62 学时，培训投入 304 万元。

2020 年度公司各类型员工培训统计

类别		参训人次	覆盖人员比例	总学时（小时）	人均学时（小时）
按性别	男性	21,987	100%	98,949	58
	女性	22,364	100%	99,860	67
按员工类型	员工及基层管理者	41,994	100%	187,573	64
	中高层管理者	2,357	100%	11,236	44
合计		44,351	100%	198,810	62

### 1) 落地多层次人才发展项目

面向各级管理者、在岗员工及新入职员工，提供管理培训、专业培训、通用培训、文化培训、从业资格培训等。

- 管理者发展：开展朝阳计划、启航计划、雏鹰计划等项目，融合线上课程、高管经验分享、专业管理能力培训、人才发展测评、案例研讨等方式，帮助各级管理者明确职责目标与定位，开拓视野格局，提升管理能力。
- 在岗员工发展：围绕岗位学习发展地图，组织业务前沿、专业技能、合规风控、个人成长等系列国金公开课，开展业务骨干潜才发展明计划、专业岗位序列专项培训、反洗钱与职业道德等多场专项培训，提升员工岗位胜任能力，支撑组织持续发展，增强员工合规风控意识与职业道德。
- 新员工发展：开展扬帆计划、管培生培养项目、岗位带教机制、新人学习闯关等培养项目，帮助新进员工快速理解融入公司与团队，传授岗位必备技能，建立正确的职业发展规划。



### 2) 构建多元化人才培养方式

2020 年，新冠疫情对培训工作带来巨大挑战，公司克服困难化危为机，努力丰富学习资源、创新智能化学习模式，发起“协同办公、成长在线”系列学习项目，为员工打造线上线下混合式、多元化人才培养方式，最广泛地覆盖员工。

- **内部培训组织：**

在新冠疫情影响下，公司不断创新学习方式，实现面授培训线上化，学习形式多样化。通过直播、面授或直播面授相结合的混合式培训，有效突破地域限制，帮助员工高效学习成长，促进公司知识分享与业务交流。全年共组织实施 1,417 场内部培训，40,042 人次参加。公司通过内部开发和外部引进的方式，在国金乐享 E-Learning 平台新增上线 980 门课程(其中自主开发 333 门)，提供员工随时随地长期学习。



● 外部学习支持：

公司鼓励员工参加于岗位和职业发展相关的外部培训，提升员工专业水平和视野。委派员工参加中国证券业协会、中国基金业协会、四川省上市公司协会、上海证券交易所等外部专业机构组织的各类培训课程，2020 年共计 4,309 人次参加外部学习。为提升员工金融服务的专业性，公司积极支持员工参加与岗位相关的专业资格认证及后续教育培训，帮助员工申请或维持证券、基金、期货、会计等从业资格，2020 年共支持 4,192 人次参加专业资格认证及后续教育培训。其中，为推动公司财富业务转型进程，帮助 146 位员工获得金融理财师（AFP）资格。此外，公司积极引入上海证券交易所浦江学院、资本市场学院、数字中欧等多家外部机构提供的 E-Learning 平台课程，面向全员开放选修。

2020 年度公司各类型培训统计

课程组织方	培训方式	学习人次	学时	场次
内部	E-Learning 平台学习	5,871	53,432	335
	面授培训	6,279	12,780	437
	直播及直播面授混合式培训	27,892	47,487	645
外部	E-Learning 平台学习	4,226	84,232	76
	面授培训	27	488	23
	直播及直播面授混合式培训	56	390	22

2、员工职业发展

围绕投行类、投资类、财富管理类、行业研究类、合规风控类关键岗位的胜任要求和员工职业发展规划，公司陆续组织开发了相关岗位的学习地图，帮助员工明确职业发展目标与路径，匹配学习资源，明晰学习方式。

公司同时通过每年组织的人才盘点，积极发掘有能力有潜力有意愿的优秀人才。基于人才盘点的结果，跟进高潜人才的发展与保留，通过培养、晋升、轮岗、薪酬激励等多种方式保留高潜人才。针对后备干部梯队，实施专项领导力发展项目“朝阳计划”；针对新任干部，实施专项领导力发展项目“启航计划”等。

**(四) 劳务外包情况**

√适用 □不适用

劳务外包的工时总数	78,764 小时
劳务外包支付的报酬总额	1,275.14 万元

**七、公司委托经纪人从事客户招揽、客户服务情况**

√适用 □不适用

公司于 2013 年 5 月 24 日取得开展证券经纪人的业务资格（川证监机构[2013]34 号批文）。截止 2020 年 12 月 31 日，公司在职证券经纪人共 124 人，均具备证券执业资格，并与公司签订委托代理合同。对经纪人的培训和管理上，公司建立了统一管理机制，按照协会要求定期对经纪人实施年检和后续培训，规范经纪人的展业行为，同时，公司建立了对经纪人发展客户的回访制度，本年度公司未发生与证券经纪人有关的客户投诉和纠纷。

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

根据《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《上市公司治理准则》等法律、法规、规范性文件的要求，公司规范运作，不断完善法人治理结构，制定了以公司《章程》为核心，包括《股东大会议事规则》、《董事会议事规则》、《监事会议事规则》、《独立董事制度》在内的较为完备的公司治理制度，并根据发展情况及监管规范持续修订。建立了科学严谨的组织构架，形成权力机构、决策机构、监督机构与经理层之间权责分明、有效制衡的公司治理体系，确保使各层级在各自的职责、权限范围内，各司其职，各负其责，推动公司平稳健康发展。

#### （一）股东与股东大会

股东大会是公司最高权力机构，公司严格履行《上市公司治理准则》、公司《股东大会议事规则》等法律法规的规定，确保股东大会的召集、召开、提案、表决等程序合法合规，聘请律师出席并出具法律见证意见。公司股东作为公司的所有者，不存在不正当干涉公司经营治理的情形。所有股东，特别是中小股东享有平等地位，为充分听取中小股东的意见和诉求，在涉及其利益的股东大会议案表决时，对中小投资者采取单独计票等，通过各种方式增强公司决策的透明度，保护投资者，尤其是中小股东的合法权益。

公司在报告期内召开了 2 次股东大会，圆满完成各项议程，召集、召开、提案、表决等程序符合法律、法规、规范性文件的要求，充分保障了股东依法行使权利，尊重中小股东合法权益。

#### （二）董事与董事会

公司依据相关法律法规及公司《章程》的规定制定了《董事会议事规则》，对董事会的召集、召开、提案、表决、决议等事项作出明确规定，确保规范运作。公司董事会共有 9 名董事，其中独立董事 3 名。董事会下设审计委员会、风险控制委员会、战略委员会、提名委员会和薪酬考核委员会，其中，审计委员会、薪酬考核委员会、提名委员会的召集人由独立董事担任，各委员会分工明确，权责分明，有效运作，切实保证了董事会决策的客观性和公正性。

报告期内，公司召开了 8 次董事会会议，5 个专业委员会共计召开 11 次专业委员会会议，公司董事会、各专门委员会的决策程序和议事规则科学、透明，充分履行了法律法规赋予董事的决策和管理职责。公司独立董事勤勉尽责，对相关议案发表独立意见，充分发挥了独立董事的独立作用。

#### （三）监事与监事会

公司监事会有 3 名监事，其中由股东大会选举产生两名，由职工代表大会选举产生 1 名。监事会作为公司的监督机构，对公司财务、合规管理、风险管理、高级管理人员履职规范等方面履行监督职责，对公司定期报告、风险控制指标报告、内部控制自我评价报告等进行了充分审议。公司依据相关法律法规及公司《章程》的规定制定了《监事会议事规则》，全体监事能够按照相关规定履行职责，依法出席监事会会议，列席董事会会议，并向股东大会汇报工作。

公司在报告期内召开了 4 次监事会会议，圆满完成各项议题，切实维护了全体股东尤其是中小股东的合法权益。

#### （四）经营管理层

公司经营管理层负责公司日常经营管理工作，公司高级管理人员的选聘程序符合《公司法》、公司《章程》、公司《提名委员会工作细则》等规章制度的规定。管理层能够按照公司《章程》赋予的权利和义务履职。截止报告期末，公司有高级管理人员 10 名，其中，总裁 1 名，副总裁 7 名，其中总裁兼任财务总监，1 名副总裁兼任合规总监，1 名副总裁兼任首席信息官，首席风险官 1 名，董事会秘书 1 名。公司经营管理层按照董事会授权，执行董事会决议事项，依法、合规、勤勉、诚信，对公司的日常经营实施有效管理，努力实现公司效益和社会效益的最大化，并定期向董事会和监事会汇报公司经营情况。

#### （五）内幕信息知情人管理

根据中国证监会《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，公司制定了《内幕信息知情人管理制度》、《外部信息使用人制度》等规定并严格执行。报告期内，公司做好了内幕信息管理工作，能够真实、准确和完整地记录内幕信息在筹划、编制、传递等各个阶段的内幕信息知情人名单及重大事项进程备忘录，认真做好相关信息披露工作。经自查，本年度公司不存在内幕信息知情人在影响公司股价的重大敏感信息披露前利用内幕信息买卖公司股份的情况，不存在涉嫌内幕交易被监管部门采取监管措施及行政处罚的情形。

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

## 二、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期
2019 年年度股东大会	2020 年 5 月 11 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2020 年 5 月 12 日
2020 年第一次临时股东大会	2020 年 9 月 28 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2020 年 9 月 29 日

股东大会情况说明

适用 不适用

#### 1、2019 年年度股东大会

公司于 2020 年 5 月 11 日在成都市东城根上街 95 号成证大厦 16 楼会议室召开了 2019 年年度股东大会，审议通过了《二〇一九年度董事会工作报告》、《二〇一九年度监事会工作报告》、《二〇一九年度报告全文及摘要》、《二〇一九年度财务决算报告》、《二〇一九年利润分配预案》、《关于聘请公司二〇一九年度审计机构的议案》、《关于预计公司二〇二〇年日常关联交易事项的议案》、《关于二〇一九年度董事薪酬情况的专项说明》、《关于二〇一九年度监事薪酬情况的专项说明》、《关于修订公司<章程>的议案》。

#### 2、2020 年第一次临时股东大会

公司于 2020 年 9 月 28 日在成都市东城根上街 95 号成证大厦 16 楼会议室召开了 2020 年第一次临时股东大会，审议通过了《关于选举公司第十一届董事会独立董事的议案》。

以上会议决议公告可在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）查询。

### 三、董事履行职责情况

#### (一) 董事参加董事会和股东大会的情况

董事姓名	是否独立董事	参加董事会情况						参加股东大会情况
		本年应参加董事会次数	亲自出席次数	以通讯方式参加次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参加会议	出席股东大会的次数
冉云	否	8	8	0	0	0	否	2
杜航	否	8	8	0	0	0	否	2
金鹏	否	8	8	0	0	0	否	2
赵煜	否	8	8	0	0	0	否	2
章卫红	否	8	8	0	0	0	否	2
郭伟	否	8	8	0	0	0	否	2
雷家骊	是	6	6	0	0	0	否	2
赵雪媛	是	8	8	0	0	0	否	2
骆玉鼎	是	8	8	0	0	0	否	2
刘运宏	是	2	2	0	0	0	否	0

备注：2020 年 9 月 11 日，公司董事会收到独立董事雷家骊先生提交的书面辞职报告。因独立董事连任期限届满原因，雷家骊先生申请辞去公司第十一届董事会独立董事及董事会专门委员会职务。根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》和公司《章程》等有关规定，雷家骊先生在公司新任独立董事任职前将继续履职。具体详见公司于 2020 年 9 月 12 日在上海证券交易所网站（[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn)）披露的《关于公司独立董事辞职的公告》。

2020 年 9 月 28 日，公司 2020 年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举公司第十一届董事会独立董事的议案》，同意选举刘运宏先生为公司第十一届董事会独立董事，任期至本届董事会届满。具体详见公司于 2020 年 9 月 29 日在上海证券交易所网站（[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn)）披露的《国金证券股份有限公司 2020 年第一次临时股东大会决议公告》。

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

年内召开董事会会议次数	8
其中：现场会议次数	8
通讯方式召开会议次数	0
现场结合通讯方式召开会议次数	8

#### (二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

适用 不适用

报告期内，公司独立董事对 2020 年度履职情况进行了总结，详见于 2021 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站 www. sse. com. cn 披露的公司《二〇二〇年度独立董事述职报告》。

### (三) 董事会会议情况

√适用 □不适用

报告期内，公司召开了 8 次董事会会议，董事会对会议审议的所有事项未提出异议，会议情况如下：

1、第十一届董事会第五次会议于 2020 年 3 月 31 日在现场召开，会议审议通过了《二〇一九年度董事会工作报告》、《二〇一九年度独立董事述职报告工作报告》、《二〇一九年度财务决算报告》、《二〇一九年度报告全文及摘要》、《二〇一九年利润分配预案》、《关于聘请公司二〇一九年度审计机构的议案》、《关于会计政策变更的议案》、《二〇一九年度内部控制评价报告》、《二〇一九年度合规工作报告》、《二〇一九年度反洗钱工作报告》、《二〇一九年度风险控制指标情况报告》、《二〇一九年度全面风险管理工作报告》、《二〇一九年年度风险偏好执行情况报告》、《国金证券股份有限公司风险偏好陈述书（2020）》、《关于修订〈国金证券股份有限公司风险控制指标管理办法〉的议案》、《二〇一九年度社会责任报告》、《董事会审计委员会二〇一九年度履职情况报告》、《二〇一九年度合规负责人考核报告》、《关于二〇一九年度董事薪酬情况的专项说明》、《关于二〇一九年度高级管理人员绩效考核和薪酬情况的专项说明》、《关于修订〈国金证券股份有限公司绩效管理制度〉的议案》、《国金证券股份有限公司 2019 年度信息技术及治理工作报告》、《国金证券股份有限公司 IT 发展规划报告（2020 年-2022 年）》、《国金证券股份有限公司信息技术工作管理目标》、《关于公司开展结售汇业务的议案》、《关于审议国金创新投资有限公司投资宁波国金涌富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）暨关联交易的议案》、《关于预计公司二〇二〇年度日常关联交易事项的议案》、《关于修订〈国金证券股份有限公司章程〉的议案》、《关于召开二〇一九年度股东大会的议案》。

2、第十一届董事会第六次会议于 2020 年 4 月 28 日在现场召开，会议审议通过了《二〇二〇年第一季度报告全文及正文》。

3、第十一届董事会第七次会议于 2020 年 6 月 3 日在现场召开，会议审议通过了《关于审议〈宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合伙）投资宁波锐石企业管理咨询合伙企业（有限合伙）暨关联交易〉的议案》。

4、第十一届董事会第八次会议于 2020 年 8 月 14 日在现场召开，会议审议通过了《关于资管新规过渡期资管产品整改计划的议案》、《关于修订公司〈洗钱风险管理策略〉的议案》、《关于修订公司〈洗钱和恐怖融资风险管理制度〉的议案》。

5、第十一届董事会第九次会议于 2020 年 8 月 26 日在现场召开，会议审议通过了《二〇二〇年半年度报告及摘要》、《二〇二〇年上半年风险控制指标情况报告》、《关于推选公司第十一届董事会独立董事候选人的议案》。



6、第十一届董事会第十次会议于 2020 年 9 月 11 日在现场召开，会议审议通过了《关于审议国金创新投资有限公司投资汽车金融系列有限合伙企业暨关联交易的议案》、《关于修订〈国金证券股份有限公司融资融券业务管理制度〉的议案》、《关于召开二〇二〇年第一次临时股东大会的议案》。

7、第十一届董事会第十二次会议于 2020 年 12 月 15 日在现场召开，会议审议通过了《关于修订公司〈章程〉的议案》、《关于召开二〇二一年第一次临时股东大会的议案》。

8、第十一届董事会第十二次会议于 2020 年 12 月 15 日在现场召开，会议审议通过了《关于修订公司〈章程〉的议案》、《关于召开二〇二一年第一次临时股东大会的议案》。

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

√适用 □不适用

##### （一）董事会专门委员会构成

本公司董事会下设审计委员会、风险控制委员会、战略委员会、薪酬考核委员会、提名委员会。报告期内，各委员会成员构成如下：

董事会届次	董事会专门委员会	委员名单	召集人
第十一届董事会	审计委员会	赵雪媛、刘运宏、章卫红	赵雪媛
	风险控制委员会	冉云、赵雪媛、骆玉鼎	冉云
	战略委员会	冉云、杜航、郭伟	冉云
	薪酬与考核委员会	骆玉鼎、赵雪媛、金鹏	骆玉鼎
	提名委员会	刘运宏、骆玉鼎、赵煜	刘运宏

备注：2020 年 9 月 11 日，公司董事会收到独立董事雷家骥先生提交的书面辞职报告。因独立董事连任期限届满原因，雷家骥先生申请辞去公司第十一届董事会独立董事及董事会专门委员会职务。根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》和公司《章程》等有关规定，雷家骥先生在公司新任独立董事任职前将继续履职。具体详见公司于 2020 年 9 月 12 日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《关于公司独立董事辞职的公告》。

2020 年 9 月 28 日，公司 2020 年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举公司第十一届董事会独立董事的议案》，同意选举刘运宏先生为公司第十一届董事会独立董事，任期至本届董事会届满。具体详见公司于 2020 年 9 月 29 日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《国金证券股份有限公司 2020 年第一次临时股东大会决议公告》。

2020 年 10 月 29 日，公司第十一届董事会第十一次会议审议通过了《关于调整公司第十一届董事会专门委员会成员的议案》，同意选举刘运宏先生为公司第十一届董事会提名委员会及第十一届董事会审计委员会委员，并担任第十一届董事会提名委员会召集人，负责主持提名委员会工作。具体详见公司于 2020 年 10 月 30 日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《第十一届董事会第十一次会议决议公告》。

## （二）董事会专门委员会职责及召开会议情况

### 1、第十一届董事会专门委员会职责及召开会议情况

#### （1）董事会审计委员会

董事会审计委员会在 2020 年勤勉尽责，积极履行专门委员会的职责，召开了 6 次会议。

①第十一届董事会审计委员会二〇二〇年第一次审议并通过了《二〇一九年度财务决算报告》、《二〇一九年度报告全文及摘要》、《二〇一九年度利润分配预案》、《二〇一九年度内部控制评价报告》、《关于聘任公司二〇二〇年度审计机构的议案》、《关于预计公司二〇二〇年度日常关联交易事项的议案》、《董事会审计委员会二〇一九年度履职情况报告》、《审计委员会关于会计师事务所从事二〇一九年度公司审计工作的总结报告》、《二〇一九年度内部审计工作报告》、《二〇二〇年度内部审计工作计划》、《关于修订公司<章程>的议案》、《关于会计政策变更的议案》、《关于国金创新投资有限公司投资宁波国金涌富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）暨关联交易的议案》。

②第十一届董事会审计委员会二〇二〇年第二次会议审议并通过了《二〇二〇年第一季度报告全文及正文》。

③第十一届董事会审计委员会二〇二〇年第三次会议审议并通过了《关于宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合伙）投资宁波锐石企业管理咨询合伙企业（有限合伙）暨关联交易的议案》。

④第十一届董事会审计委员会二〇二〇年第四次会议审议并通过了《二〇二〇年半年度报告及摘要》、《二〇一九年度反洗钱工作专项稽核报告》。

⑤第十一届董事会审计委员会二〇二〇年第五次会议审议并通过了《关于国金创新投资有限公司投资汽车金融系列有限合伙企业暨关联交易的议案》。

⑥第十一届董事会审计委员会二〇二〇年第六次会议审议并通过了《二〇二〇年第三季度报告全文及正文》。

#### （2）董事会风险控制委员会

董事会风险控制委员会在 2020 年勤勉尽责，积极履行专门委员会的职责，召开了 2 次会议。

①第十一届董事会风险控制委员会二〇二〇年第一次会议审议并通过了《二〇一九年度内部控制评价报告》、《二〇一九年度合规工作报告》、《二〇一九年度反洗钱工作报告》、《二〇一九年年度风险控制指标情况报告》、《二〇一九年度全面风险管理工作报告》、《二〇一九年年度风险偏好执行情况报告》、《国金证券股份有限公司风险偏好陈述书（2020）》、《关于修订<国金证券股份有限公司风险控制指标管理办法>的议案》。

②第十一届董事会风险控制委员会二〇二〇年第二次会议审议并通过了《关于修订公司<洗钱风险管理策略>的议案》、《关于修订公司<洗钱和恐怖融资风险管理制度>的议案》。

#### （3）董事会战略委员会

董事会战略委员会在 2020 年勤勉尽责，积极履行专门委员会的职责，召开了 2 次会议。

①第十一届董事会战略委员会二〇二〇年第一次会议审议并通过了《国金证券股份有限公司 2019 年度信息技术及治理工作报告》、《国金证券股份有限公司 IT 发展规划报告（2020 年-2022 年）》、《国金证券股份有限公司信息技术工作管理目标》、《关于公司开展结售汇业务的议案》。

②第十一届董事会战略委员会二〇二〇年第二次会议审议并通过了《关于公司<2021-2023 年资本补充规划>的议案》。

#### （4）董事会薪酬考核委员会

董事会薪酬考核委员会在 2020 年勤勉尽责，积极履行专门委员会的职责，召开了 1 次会议。

第十一届董事会薪酬考核委员会二〇二〇年第一次会议审议并通过了《关于董事、监事、高级管理人员年度绩效考核与薪酬情况的汇报》、《关于 2019 年度董事薪酬情况的专项说明》、《关于 2019 年度高级管理人员绩效考核和薪酬情况的专项说明》、《关于审议公司<二〇一九年度合规负责人考核报告>的议案》、《关于修订<国金证券股份有限公司绩效管理制度>的议案》。

#### （5）董事会提名委员会

董事会提名委员会在 2020 年勤勉尽责，积极履行专门委员会的职责，召开了 1 次会议。

第十一届董事会提名委员会二〇二〇年第一次会议审议并通过了《关于推选公司第十一届董事会独立董事候选人的议案》。

## 五、监事会发现公司存在风险的说明

√适用 □不适用

2020 年，监事会严格按照《公司法》、公司《章程》、公司《监事会议事规则》等相关规定，勤勉尽责，积极维护股东合法权益。报告期内，监事会共召开会议 4 次，对公司经营情况、财务状况、董事会和管理层履职情况等进行了监督，全体监事对报告期内审议的事项均无异议。

2020 年度，公司监事出席监事会会议情况如下：

监事会届次	监事姓名	职务	本年应参加监事会次数	亲自出席监事会次数	委托出席监事会次数	缺席监事会次数
第九届监事会	邹川	监事会主席	4	4	0	0
	顾彦君	监事	4	4	0	0
	蒋伟华	职工监事	4	4	0	0

1、第九届监事会第四次会议于 2020 年 3 月 31 日在现场召开，会议审议通过了《二〇一九年监事会工作报告》、《二〇一九年度财务决算报告》、《二〇一九年度报告全文及摘要》、《二〇一九年度利润分配预案》、《关于聘任公司二〇二〇年度审计机构的议案》、《关于会计政策变更的议案》、《二〇一九年度内部控制评价报告》、《二〇一九年度合规工作报告》、《二〇一九年度反洗钱工作报告》、《二〇一九年度风险控制指标情况报告》、《二〇一九年度全面风险管理工作报告》、《二〇一九年风险偏好执行情况报告》、《国金证券股份有限公司风险偏好陈述书（2020）》、《关于修订<国金证券股份有限公司风险控制指标管理办法>的议案》、《关于二〇一九年度监事薪酬情况的专项说明》、《关于预计公司二〇二〇年日常关联交易事项的议案》。

2、第九届监事会第五次会议于 2020 年 4 月 28 日在现场召开，会议审议通过了《二〇二〇年第一季度报告全文及正文》。

3、第九届监事会第六次会议于 2020 年 8 月 26 日在现场召开，会议审议通过了《二〇二〇年半年度报告及摘要》、《二〇二〇年上半年风险控制指标情况报告》。

4、第九届监事会第七次会议于 2020 年 10 月 29 日在现场召开，会议审议通过了《二〇二〇年第三季度报告全文及正文》。

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

适用 不适用

存在同业竞争的，公司相应的解决措施、工作进度及后续工作计划

适用 不适用

## 七、报告期内对高级管理人员的考评机制，以及激励机制的建立、实施情况

适用 不适用

根据《国金证券高级管理人员薪酬与绩效管理制度》的有关规定，公司董事会薪酬与考核委员会是公司高管人员薪酬与绩效的管理机构。每个会计年度结束后，公司会对高级管理人员进行年度绩效考核及相应的薪酬激励。

## 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

公司内部控制自我评价报告的具体内容详见 2021 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站上披露的《国金证券股份有限公司 2020 年度内部控制评价报告》。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

## 九、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司财务报告相关内部控制进行了审计，并于 2021 年 4 月 2 日在上海证券交易所网站上披露了《国金证券股份有限公司 2020 年度内部控制审计报告》。

是否披露内部控制审计报告：是

内部控制审计报告意见类型：标准的无保留意见

## 十、其他

适用 不适用

### （一）公司合规管理体系建设情况

#### 1、合规人员配置情况

公司合规管理组织架构由合规总监、合规管理部和下属各单位的合规风控人员组成。合规管理组织架构较为科学完善，合规人员配置符合外部规范性文件要求以及公司实际业务发展需要。

(1) 公司已设置符合要求的合规负责人。合规负责人即公司合规总监，具有胜任合规管理工作需要的专业知识和技能，具备监管要求的任职条件。

(2) 公司已设置符合要求的合规管理部门。合规管理部已配备足够的、具备与履行合规管理职责相适应的专业知识和技能的合规管理人员。

(3) 已在业务部门、分支机构设置专兼合规管理人员

公司在承销保荐分公司、北京场外证券业务分公司、自营分公司、资管分公司、投资咨询分公司、互联网证券分公司、15 人及以上的营业部都已设置专职合规风控岗，在股票销售交易部、资产托管部等业务部门以及 15 人以下的营业部设置有兼职合规风控岗。公司专、兼合规风控岗设置情况符合监管规定。

(4) 在公司另类投资子公司（国金创新）、私募基金管理子公司（国金鼎兴）等子公司层面，公司已选派人员作为上述子公司高级管理人员负责合规管理工作，并由合规总监考核和管理。

## 2、制度建设情况

公司根据业务发展的实际情况，梳理经营管理活动中的风险点，持续开展从制度到业务流程的修订、梳理和完善工作，并把合规管理的要求嵌入到了公司规章制度和业务流程之中，为各项业务开展提供了有力的制度保障。2020 年经合规总监与合规管理部审查通过后新制定公司规章制度 66 项、修订 375 项、废止 8 项。

## 3、合规咨询与合规审查

合规管理部积极支持公司各项业务合规稳健发展，在为相关业务开展提供合规咨询意见及出具合规审查意见等方面均持续给予了积极的支持。合规咨询方面：对于公司下属各单位及其工作人员在经营管理和执业过程中遇到的法律、法规和准则适用与理解的问题，合规管理部积极响应，进行合规分析与论证，出具尽可能准确、客观和完整的合规咨询意见。合规审查方面：公司通过 EBOSS 办公自动化系统将合规审查要求贯穿于公司各项业务决策、执行、监督、反馈等各个环节，与业务实现了“无缝对接”，公司相关业务流程均设置了合规风控岗或合规督导或合规总监的审查节点，实现了合规管理的全覆盖。公司各级合规管理人员对每一个流程均认真审查，并根据相关的法律法规和公司的制度规定，对各项业务决策提供合规意见与建议。

## 4、合规检查

公司 2020 年修订完善了合规检查制度，并进一步优化了合规检查流程，根据检查工作计划安排，共开展各类合规检查 25 项，包括公司部分营业部的常规检查、部分子公司的专项检查、IB 介绍业务运行情况的专项检查、反洗钱管理专项检查等。

公司 2020 年配合完成了十次外部监管现场检查，对于每一项检查，合规管理部及相关部门均全力以赴，认真落实各项检查要求，保障检查工作顺利完成，各项检查未出现重大问题。

## 5、合规监测

公司持续开展员工证券账户及交易情况监测、上网行为管理监测、执业行为监测、证券从业资格监测等合规监测工作。通过上述合规监测工作，公司及时了解员工证券从业资格情况和日常

执业行为，防范违法违规行为的发生。为保障合规监测工作的便利性和准确性，公司已要求全体员工补全个人联络信息，包含员工所有名下手机号码，持续完善合规监测机制。2020 年，公司合规管理部制作了《关于证券从业人员证券投资方面的违规行为及注意事项》，在公司内部对全体员工进行了合规宣导，切实提高员工的合规意识水平。

#### 6、合规培训和合规宣传

公司持续加大合规宣传和培训的力度，注重合规管理人员专业素质的培养，提供各类外部培训机会，要求合规管理部全体员工通过不断学习，提升自己的专业能力和职业素养，并要求参训员工对全体部门员工实行转培训。

公司合规培训涵盖合规培训内容资源体系的建设、合规培训的组织与实施。2020 年度，合规管理部组织或参与培训 28 场，涵盖了新员工入职培训、反洗钱培训、专项培训及业务条线培训等方面。同时，合规管理部制作了“金规指”、合规监察月报、合规内参三份内部刊物，针对不同的宣传对象进行了内容和侧重点上各有不同的合规宣导和培训。通过各种形式的合规培训，公司将全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础的理念进行了大力宣传。

#### 7、合规性专项考核情况

为客观评价各部门及员工的合规管理成效，确保公司各项合规管理制度的贯彻执行，公司 2020 年对《国金证券股份有限公司合规与风险管理考核办法》进行了修订，并据此开展了 2020 年度的合规考核工作，考核对象涵盖公司高管、公司各部门及其负责人、部门合规风控岗、部门内控联系人及全体员工。通过规范的开展合规考核工作，公司客观评价了下属各单位的合规管理成效以及员工的合规表现，合规考核结果在年度综合绩效考核中得到了体现和应用，使得公司各项合规管理制度的贯彻执行得到了有效的促进。

#### 8、合规问责

根据公司《国金证券股份有限公司合规问责管理办法》，合规管理部对公司各部门及员工出现的违规违纪行为进行了警示或问责，2020 年共出具合规提醒函 15 份，合规警示函 23 份，合规惩戒函 10 份，合规问责决定 3 份，并要求相关责任人员及时整改，有关问责结果纳入了年度合规考核范围，对全体员工起到了警示作用。

#### 9、子公司合规管理

公司充分重视各类子公司的合规管理工作，已将各层级子公司纳入公司统一的合规管理体系，通过明确子公司向母公司报告的合规管理事项，对子公司的合规管理制度进行审查，对子公司经营管理行为的合规性进行监督和检查，选派人员作为高级管理人员负责私募子公司和另类子公司的合规工作并对其进行合规考核以及定期召开子公司合规管理联席会议等方式，宣传和贯彻公司的合规文化，确保子公司合规管理工作符合监管要求和公司内部管理的需求。

#### 10、信息隔离墙管理

公司根据监管要求和信息隔离墙管理相关制度，在人员隔离、业务隔离、物理隔离、信息技术隔离、资金和账户隔离等方面严格执行相关要求，信息隔离墙两侧的业务部门及其工作人员之

间对敏感信息进行交流的，要求履行跨墙审批程序；设置了观察名单和限制名单，对敏感信息、墙上人员、跨墙人员等关键对象进行重点管理；持续加强内幕信息及知情人登记、员工证券投资行为管理和监控、证券研究报告的合规审核和信息隔离墙监测等工作，严格防范内幕交易和利益冲突。2020 年，公司隔离墙 4.0 系统顺利上线，通过增加功能模块调整有关流程进一步优化了隔离逻辑和跨墙回墙流程，提高了信息隔离有关工作的质量和效率。

#### 11、反洗钱工作

为避免因反洗钱履职不到位可能给公司带来的监管风险，公司按照监管要求开展了多项反洗钱重点工作，包括：组织公司各业务部门开展反洗钱相关制度的修订工作；持续完善反洗钱信息系统，提升洗钱风险防控能力；不定期组织召开公司反洗钱工作专题会议，向公司领导汇报反洗钱工作存在的问题，向业务部门提出工作建议；针对公司 2019 年度反洗钱分类评级结果，合规总监牵头组织对评级中的扣分点逐条进行核实，对发现的薄弱点及时督促整改，并撰写专项汇报材料向人民银行成都分行进行反馈；根据业务发展实际情况，对反洗钱领导小组成员进行了调整，调整情况已及时向人民银行成都分行反洗钱处进行了报备；细化反洗钱绩效考核指标，提高反洗钱绩效考核工作质量；在全公司范围内以讲座、外部专家培训、知识测试、知识竞赛等方式，开展反洗钱的宣传培训工作；配合人民银行成都分行对公司反洗钱工作开展现场检查等。

#### （二）公司内部稽核检查情况

报告期间，公司审计稽核部门根据监管政策要求和公司制度规定，合理安排审计计划，全年共完成各类审计项目 71 项，其中常规审计 24 项，离任审计 26 项，专项审计 9 项，工程审计 12 项，涉及 6 个分（子）公司、39 家证券营业部、1 个公司业务部门和 3 个职能部门。报告期间，审计稽核部门严格按照内部审计执业规范流程，做好各项审计活动的计划、实施和报告：对证券营业部的审计涉及被审计单位的客户适当性管理、财务管理、信息系统管理，同时包括产品营销管理、反洗钱工作及经营的合法合规等方面；对公司总部职能和业务部门的审计，涉及被审计单位的制度执行和内部控制情况、业务开展合规情况以及预算管理、绩效管理等方面。

报告期间，公司审计稽核部门根据监管部门要求，组织人员先后完成了《公司 2019 年度反洗钱工作专项审计》、《公司 2019 年度金融产品销售专项审计》、《公司 2020 年全面风险管理专项审计》、《公司 2020 年信息技术管理专项审计》等专项审计。

报告期间，公司审计稽核部门针对审计中发现的问题，在 2020 年实施了《2019 年度审计发现问题整改落实情况检查》，通过现场、非现场等方式，对被审计单位整改情况进行检查，持续关注后续落实情况，积极促进了公司治理的完善和内部控制机制的健全。

报告期内实施的各项审计活动中，未发现被审计单位有重大违法、违规行为；未发现被审计单位超范围经营及私自账外经营；未发现被审计单位挪用客户保证金及其他资产、非法融入融出资金；未发现被审计单位接受客户全权委托现象；未发现重大信息安全事故、重大突发事件及未了结客户纠纷。

## 第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、公司债券基本情况

单位: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
国金证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券 (第二期)	18 国金 02	150234	2018/4/2	2021/4/2	1,500,000,000	5.85	按年付息到期还本	上海证券交易所
国金证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券 (第一期)	19 国金 C1	151742	2019/6/24	2022/6/24	1,000,000,000	4.60	按年付息到期还本	上海证券交易所
国金证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券 (面向合格投资者) (第一期) (疫情防控债)	20 国金 01	163186	2020/2/26	2022/2/26	1,500,000,000	3.03	按年付息到期还本	上海证券交易所
国金证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券 (面向合格投资者) (第一期) (疫情防控债)	20 国金 02	163187	2020/2/26	2023/2/26	1,000,000,000	3.18	按年付息到期还本	上海证券交易所
国金证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券 (面向专业投资者) (第二期)	20 国金 03	163565	2020/5/25	2021/5/27	1,500,000,000	1.99	到期一次还本付息	上海证券交易所
国金证券股份有限公司 2020 年公开发行短期公司债券 (第一期) (面向专业投资者)	20 国金 S1	163841	2020/11/05	2021/9/16	1,000,000,000	3.34	到期一次还本付息	上海证券交易所



## 公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

公司于 2020 年 4 月 2 日按时足额兑付了“18 国金 01”、“18 国金 02”两期债券自 2019 年 4 月 2 日至 2020 年 4 月 1 日期间的利息共计人民币 17,400 万元(含税),并兑付了“18 国金 01”到期本金 15 亿元;

公司于 2020 年 6 月 24 日按时足额兑付了“19 国金 C1”债券自 2019 年 6 月 24 日至 2020 年 6 月 23 日期间的利息共计人民币 4,600 万元(含税)。

截至报告期末,本公司已发行尚在存续期内的公司债券票面余额为 75.00 亿元,详见上表。

## 公司债券其他情况的说明

□适用 √不适用

## 二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

债券受托管理人	名称	华金证券股份有限公司
	办公地址	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层
	联系人	刘大余
	联系电话	021-20655592
债券受托管理人	名称	川财证券有限责任公司
	办公地址	中国(四川)自由贸易试验区成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼
	联系人	汪洋
	联系电话	028-86583081
债券受托管理人	名称	东吴证券股份有限公司
	办公地址	苏州工业园区星阳街 5 号
	联系人	胡俊华
	联系电话	0512-62936320
资信评级机构	名称	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
	办公地址	上海市汉口路 398 号华盛大厦 14F

## 其他说明:

√适用 □不适用

“18 国金 01”、“18 国金 02”两期债券受托管理人为华金证券股份有限公司(以下简称“华金证券”);“19 国金 C1”债券受托管理人为川财证券有限责任公司(以下简称“川财证券”);“20 国金 01”、“20 国金 02”、“20 国金 03”和“20 国金 S1”三期债券受托管理人为东吴证券股份有限公司(以下简称“东吴证券”)、资信评级机构为上海新世纪资信评估投资服务有限公司。

## 三、公司债券募集资金使用情况

√适用 □不适用

1、公司非公开发行 2018 年公司债券(第二期)募集资金已按照募集说明书约定用途用于补充公司营运资金。报告期末,募集资金专项账户余额为 0.00 元。专项账户按照公司与华金证券、中国工商银行签订的《三方监管协议》约定接受监管,每次划拨均履行了相应的审批程序。

2、公司非公开发行 2019 年次级债券（第一期）募集资金已按照募集说明书约定用途用于偿还到期债务。报告期末，募集资金专项账户余额为 14,899.58 元。专项账户按照公司与川财证券、中国邮政储蓄银行签订的《三方监管协议》约定接受监管，每次划拨均履行了相应的审批程序。

3、公司 2020 年公开发行公司债券（面向合格投资者）（第一期）（疫情防控债）募集资金已按照募集说明书约定用途将不低于 10%比例用于支持疫情防护防控支出，其余部分用于偿还到期债务和补充公司流动资金。报告期末，募集资金专项账户余额为 1,154,500.44 元。专项账户按照公司与东吴证券、中国工商银行签订的《三方监管协议》约定接受监管，每次划拨均履行了相应的审批程序。

4、公司 2020 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第二期）募集资金已按照募集说明书约定用途用于补充公司流动资金。报告期末，募集资金专项账户余额为 14,600.53 元。专项账户按照公司与东吴证券、中国工商银行签订的《三方监管协议》约定接受监管，每次划拨均履行了相应的审批程序。

5、公司 2020 年公开发行短期公司债券（第一期）（面向专业投资者）募集资金已按照募集说明书约定用途补充公司流动资金。报告期末，募集资金专户账户余额为 49,971.59 元。专项账户按照公司与东吴证券、中信银行签订的《三方监管协议》约定接受监管，每次划拨均履行了相应的审批程序。

#### 四、公司债券评级情况

√适用 □不适用

2019 年 11 月 22 日，上海新世纪资信评估投资服务有限公司对本公司发行的公司债券“20 国金 01”、“20 国金 02”进行了信用评级，并出具了《国金证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券（面向合格投资者）（第一期）（疫情防控债）信用评级报告》（编号：[新世纪债评（2019）011466]），“20 国金 01”、“20 国金 02”债项信用等级为 AAA，公司主体信用等级为 AAA，评级展望稳定。

2020 年 5 月 14 日，上海新世纪资信评估投资服务有限公司对本公司发行的公司债券“20 国金 03”进行了信用评级，并出具了《国金证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第二期）信用评级报告》（编号：[新世纪债评（2020）010713]），“20 国金 03”债项信用等级为 AAA，公司主体信用等级为 AAA，评级展望稳定。

2020 年 6 月 1 日，上海新世纪资信评估投资服务有限公司对本公司已发行的公司债券“20 国金 01”、“20 国金 02”的信用状况进行了跟踪评级，并出具了《国金证券股份有限公司及其发行的 20 国金 01 和 20 国金 02 跟踪评级报告》（编号：[新世纪跟踪（2020）100131]），维持公司债券“20 国金 01”、“20 国金 02”的信用等级为 AAA，维持本公司主体信用等级为 AAA，评级展望稳定。

2020 年 11 月 23 日，上海新世纪资信评估投资服务有限公司对本公司主体信用进行年度评级，并出具《国金证券股份有限公司信用评级报告》（编号：[新世纪企评（2020）020464]），评级结果维持本公司主体信用等级 AAA，评级展望稳定。

## 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，公司债券的偿债计划、保障措施及具体安排的执行情况与债券募集说明书中的相关承诺保持一致。

## 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

1、华金证券作为公司非公开发行公司债券“18 国金 01”和“18 国金 02”的债券受托管理人，报告期内，依据相关规定，积极履行受托管理人职责，维护了债券持有人的合法权益。

2、川财证券作为公司非公开发行次级债券“19 国金 C1”的债券受托管理人，报告期内，依据相关规定，积极履行受托管理人职责，维护了债券持有人的合法权益。

3、东吴证券作为公司公开发行公司债券“20 国金 01”、“20 国金 02”、“20 国金 03”和“20 国金 S1”的债券受托管理人，报告期内，依据相关规定，积极履行受托管理人职责，维护了债券持有人的合法权益。

## 八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

主要指标	2020 年	2019 年	本期比上年同期 增减 (%)	变动原因
息税折旧摊销 前利润	3,168,320,776.26	2,316,591,778.94	36.77	经营业绩较上年增加所致
流动比率	2.11	2.78	-24.10	短期融资券、公司债券等债务融资工具增加所致
速动比率	2.11	2.78	-24.10	短期融资券、公司债券等债务融资工具增加所致
资产负债率 (%)	56.01	43.13	增加 12.88 个百分点	
EBITDA 全部 债务比	0.13	0.18	-27.78	
利息保障倍数	4.68	4.16	12.50	
现金利息保障 倍数	-8.99	-6.02	-	

EBITDA 利息保障倍数	4.82	4.29	12.35	
贷款偿还率 (%)	100.00	100.00		
利息偿付率 (%)	100.00	100.00		

备注：上述表格中会计数据和财务指标计算口径均不含代理买卖证券款、代理承销证券款等客户交易结算资金。

### 九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用 □不适用

报告期内，公司在银行间市场累计发行了 11 期短期融资券，票面金额共计 109 亿元，到期兑付了 8 期短期融资券，票面金额小计 74 亿元。截至本报告期末，公司短期融资券待偿余额为 35 亿元。详见下表：

债券简称	发行规模 (万元)	债券余额 (万元)	票面利率 (%)	起息日	到期日	债券状态
20 国金证券 CP001	100,000	-	2.10	2020-3-23	2020-6-22	已兑付
20 国金证券 CP002	100,000	-	1.60	2020-4-20	2020-7-17	已兑付
20 国金证券 CP003	100,000	-	1.67	2020-5-15	2020-8-14	已兑付
20 国金证券 CP004	100,000	-	2.34	2020-6-18	2020-9-17	已兑付
20 国金证券 CP005	100,000	-	2.65	2020-7-13	2020-10-10	已兑付
20 国金证券 CP006	60,000	-	2.70	2020-7-24	2020-10-23	已兑付
20 国金证券 CP007	80,000	-	2.70	2020-8-14	2020-11-12	已兑付
20 国金证券 CP008	100,000	-	2.80	2020-9-15	2020-12-15	已兑付
20 国金证券 CP009	100,000	100,000	3.00	2020-10-15	2021-1-14	存续中
20 国金证券 CP010	150,000	150,000	3.25	2020-11-11	2021-2-9	存续中
20 国金证券 CP011	100,000	100,000	3.10	2020-12-14	2021-3-12	存续中

报告期内，公司在机构间私募产品报价与服务系统累计发行了面值 554,934 万元收益凭证、兑付了面值 535,596 万元收益凭证。截至本报告期末，公司处于存续期的收益凭证面额共计 349,926 万元。

### 十、公司报告期内的银行授信情况

√适用 □不适用

报告期内，公司加强了授信管理工作。截至 2020 年 12 月 31 日，公司获得主要合作银行给予的授信总额度合计超 470 亿元，有效满足了公司各项业务的发展需求。

**十一、 公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况**

适用 不适用

报告期内，公司严格执行公司债券募集说明书相关约定或承诺，募集资金投向与募集说明书的约定一致；严格履行信息披露责任，按期兑付债券利息，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，盈利情况良好，未发现可能导致未来出现不能按期偿付情况的风险。

报告期内，公司不存在与主要客户发生业务往来时违约、不存在违反募集说明书相关约定或承诺等情况。

**十二、 公司发生的重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响**

适用 不适用

## 第十一节 财务报告

### 一、审计报告

√适用 □不适用

## 审 计 报 告

天健审〔2021〕11-31 号

国金证券股份有限公司全体股东：

### 一、 审计意见

我们审计了国金证券股份有限公司（以下简称国金证券）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2020 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表，以及相关财务报表附注。

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

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金证券，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 关键审计事项

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

#### （一）金融工具公允价值的估值

##### 1. 事项描述

相关信息披露详见财务报表附注三 8(4)及附注八。

截至 2020 年 12 月 31 日，国金证券以公允价值计量的金融资产和金融负债分别为人民币 225.82 亿元和 20.82 亿元。

国金证券对金融工具的估值以市场数据和估值模型相结合为基础。公允价值计量通常需要大量的输入值，部分输入值来源于能够从活跃市场可靠获取的数据。除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外，当输入值是相关资产或负债直接或间接可观察的输入值或不可观察输入值时，即部分金融工具公允价值属于第二层次和第三层次的情况下，国金证券管理层（以下简称管理层）需要对输入值的确定作出重大判断。

由于金融工具公允价值的估值涉及金额重大且估值过程较为复杂，在确定估值方法或估值模型以及估值模型使用的输入值时涉及管理层的重大判断，我们将其确定为关键审计事项。

## 2. 审计应对

我们对金融工具公允价值的估值事项执行的审计程序包括：

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

(2) 通过将国金证券采用的公允价值与公开可获取的市场数据进行比较，评价国金证券对所有在活跃市场交易的金融工具的估值；

(3) 就公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具，通过合理的审计抽样方法选取样本，获取样本与估值相关的基础信息并识别与金融工具估值相关的条件，评价管理层采用的估值方法、估值模型和输入值的适当性；在此基础上进行独立估值，并将我们的估值结果与国金证券的估值结果进行比较。具体程序包括：将国金证券使用的估值方法、估值模型与市场通常使用方法、模型进行对比评价，测试估值过程中使用的输入值，应用估值方法、估值模型重新测算金融工具公允价值；

(4) 评价在财务报表中的相关披露是否按照企业会计准则的要求反映了金融工具的估值风险。

## (二) 适用预期信用损失法的金融资产减值

### 1. 事项描述

相关信息披露详见财务报表附注三 8(5)及附注五 19、20。

截至 2020 年 12 月 31 日，国金证券适用预期信用损失法的金融资产账面余额为人民币 450.57 亿元，累计计提的信用减值准备为人民币 2.46 亿元，账面价值为人民币 448.18 亿元。

国金证券以预期信用损失为基础，对债券投资、开展融资类业务形成的资产，以及货币市场拆出、借出的资金或证券、应收款项等进行减值测试并确认损失准备。如果信用风险自初始确认后未显著增加，国金证券按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后已显著增加但未发生信用减值，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；如果已经发生信用损失，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。在评估预期信用损失时，国金证券还需考虑所有合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。

由于适用预期信用损失法的金融资产减值涉及金额重大，且其减值测试的过程，包括对减值阶段的划分、减值参数及假设的设定以及未来现金流量的估计等涉及管理层的重大判断，我们将其确定为关键审计事项。

## 2. 审计应对

我们对适用预期信用损失法的金融资产减值事项执行的审计程序包括：

(1) 了解与适用预期信用损失法的金融资产减值相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

(2) 评估管理层划分减值阶段的标准合理性，包括信用风险自初始确认后显著增加的划分标准以及已经发生信用损失的划分标准；

(3) 评估管理层计算减值损失时使用的减值参数及假设的合理性，包括违约概率、违约损失率、违约风险暴露和前瞻性调整系数等；

(4) 针对需要估计未来现金流量的减值项目，通过合理的审计抽样方法选取样本，对样本在各期间的现金流量以及折现率的合理性进行评估；

(5) 通过合理的审计抽样方法选取样本，对样本的减值测试结果进行检查，包括将样本的减值阶段划分结果与划分标准进行对比；根据评估后的减值参数、未来现金流量等重新对样本进行减值测试，并将结果与国金证券的减值结果进行对比。

(6) 评价在财务报表中的相关披露是否按照企业会计准则的要求反映了上述金融资产的信用风险。

## 四、其他信息



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

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

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

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

## **五、管理层和治理层对财务报表的责任**

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

在编制财务报表时，管理层负责评估国金证券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

国金证券治理层（以下简称治理层）负责监督国金证券的财务报告过程。

## **六、注册会计师对财务报表审计的责任**

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

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

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

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

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

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

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

天健会计师事务所（特殊普通合伙）

中国·杭州

中国注册会计师：李元良  
（项目合伙人）

中国注册会计师：李青松

二〇二一年三月三十一日

## 二、财务报表

## 合并资产负债表

2020 年 12 月 31 日

编制单位：国金证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	1	15,965,993,258.22	13,906,547,252.59
其中：客户资金存款		13,180,315,379.63	11,461,246,776.27
结算备付金	2	3,177,017,979.84	2,319,895,282.12
其中：客户备付金		2,792,059,159.09	1,958,106,632.77
拆出资金			
融出资金	3	14,815,372,516.95	9,178,386,106.25
衍生金融资产	4	704,900.00	
存出保证金	5	1,415,762,304.98	985,053,449.62
应收款项	6	90,944,642.04	60,446,787.46
合同资产			
买入返售金融资产	7	8,049,753,172.83	5,419,444,483.97
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	8	18,873,090,456.71	13,473,513,559.31
债权投资	9	169,918,187.76	152,973,211.90
其他债权投资	10	1,019,343,647.45	795,752,348.57
其他权益工具投资	11	2,689,210,146.85	2,623,191,791.41
长期股权投资	12	572,432,856.47	574,930,694.74
投资性房地产			
固定资产	13	107,314,744.71	82,086,210.63
在建工程			
无形资产	14	70,374,584.53	65,204,766.14
商誉	15	43,971,702.51	46,051,960.45
递延所得税资产	16	421,029,661.56	308,381,799.47
其他资产	17	148,105,523.04	159,171,460.10
资产总计		67,630,340,286.45	50,151,031,164.73
<b>负债：</b>			
短期借款	21	252,520,360.23	246,534,740.68
应付短期融资款	22	8,020,043,250.21	3,332,214,079.93
拆入资金	23	1,157,635,555.53	200,956,944.44
交易性金融负债	24	1,998,825,621.81	2,207,439,594.38
衍生金融负债	4	83,000,181.94	55,844,982.00
卖出回购金融资产款	25	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31
代理买卖证券款	26	16,392,827,620.76	13,595,885,739.85
代理承销证券款			
应付职工薪酬	27	2,689,797,674.48	1,848,955,477.50
应交税费	28	454,177,948.87	157,387,311.79
应付款项	29	629,811,282.05	512,896,608.91
合同负债	30	6,428,633.64	
持有待售负债			
预计负债			

长期借款			
应付债券	31	6,673,626,986.44	4,155,167,123.38
其中：优先股			
永续债			
递延所得税负债	16	108,178,854.11	85,852,022.55
其他负债	32	99,460,546.65	95,858,109.16
负债合计		45,090,158,556.94	29,362,617,956.88
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	33	3,024,359,310.00	3,024,359,310.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	34	7,852,125,555.43	7,852,125,554.68
减：库存股			
其他综合收益	35	80,796,688.36	49,435,650.49
盈余公积	36	1,298,126,504.21	1,118,710,112.75
一般风险准备	37	2,576,909,949.82	2,218,059,862.39
未分配利润	38	7,633,075,901.25	6,459,920,120.98
归属于母公司所有者权益（或 股东权益）合计		22,465,393,909.07	20,722,610,611.29
少数股东权益		74,787,820.44	65,802,596.56
所有者权益（或股东权益） 合计		22,540,181,729.51	20,788,413,207.85
负债和所有者权益（或股东 权益）总计		67,630,340,286.45	50,151,031,164.73

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

### 母公司资产负债表

2020 年 12 月 31 日

编制单位：国金证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金		13,079,239,832.08	11,735,704,452.46
其中：客户资金存款		11,111,889,248.69	9,938,148,183.50
结算备付金		3,047,539,720.43	2,111,028,705.24
其中：客户备付金		2,662,581,597.14	1,749,241,110.84
拆出资金			
融出资金		14,527,129,369.69	8,879,808,052.35
衍生金融资产		704,900.00	
存出保证金		765,754,936.70	364,895,661.81
应收款项		77,313,688.92	42,402,130.86
合同资产			
买入返售金融资产		4,630,744,627.88	1,993,592,697.78
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			

交易性金融资产		20,689,501,769.93	15,591,154,083.57
债权投资		153,112,631.73	152,973,211.90
其他债权投资		1,019,343,647.45	795,752,348.57
其他权益工具投资		2,412,303,104.51	2,358,574,749.57
长期股权投资	1	2,085,704,125.64	2,080,618,749.08
投资性房地产			
固定资产		103,258,877.47	77,307,746.18
在建工程			
无形资产		61,237,899.34	56,738,160.50
递延所得税资产		377,656,546.05	275,931,104.11
其他资产		444,562,223.06	401,472,331.24
资产总计		63,475,107,900.88	46,917,954,185.22
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款		8,020,043,250.21	3,332,214,079.93
拆入资金		1,157,635,555.53	200,956,944.44
交易性金融负债		1,841,113,753.68	2,087,339,976.52
衍生金融负债		83,000,181.94	55,844,982.00
卖出回购金融资产款		6,523,824,040.22	2,867,625,222.31
代理买卖证券款		13,877,727,112.51	11,565,207,020.89
代理承销证券款			
应付职工薪酬	2	2,630,746,069.98	1,797,322,475.15
应交税费		441,749,828.67	144,173,665.00
应付款项		30,999,599.77	205,007,867.21
合同负债		5,306,771.55	
持有待售负债			
预计负债			
长期借款			
应付债券		6,673,626,986.44	4,155,167,123.38
其中：优先股			
永续债			
递延所得税负债		40,384,009.48	42,834,220.05
其他负债		61,079,790.02	58,089,021.68
负债合计		41,387,236,950.00	26,511,782,598.56
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		3,024,359,310.00	3,024,359,310.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		7,847,200,595.69	7,847,200,595.69
减：库存股			
其他综合收益		81,041,744.65	42,288,329.54
盈余公积		1,298,126,504.21	1,118,710,112.75
一般风险准备		2,576,909,949.82	2,218,059,862.39
未分配利润		7,260,232,846.51	6,155,553,376.29
所有者权益（或股东权益）合计		22,087,870,950.88	20,406,171,586.66
负债和所有者权益（或股东权益）总计		63,475,107,900.88	46,917,954,185.22

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

## 合并利润表

2020 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年度	2019 年度
一、营业总收入		6,062,801,499.95	4,349,514,734.00
利息净收入	39	945,153,612.36	770,797,631.77
其中：利息收入		1,660,208,049.13	1,352,680,715.66
利息支出		715,054,436.77	581,883,083.89
手续费及佣金净收入	40	3,686,611,926.91	2,329,629,723.52
其中：经纪业务手续费净收入		1,651,299,263.32	1,140,360,748.84
投资银行业务手续费净收入		1,666,180,012.93	901,273,881.41
资产管理业务手续费净收入		113,701,706.91	96,265,359.51
投资收益（损失以“-”号填列）	41	1,339,785,548.97	994,000,895.19
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		15,070,695.81	-2,291,326.02
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	42	12,656,454.68	11,008,213.26
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	43	71,122,752.95	245,401,722.57
汇兑收益（损失以“-”号填列）		4,378,312.94	-1,286,862.65
其他业务收入	44	3,018,941.11	37,372.29
资产处置收益（损失以“-”号填列）	45	73,950.03	-73,961.95
二、营业总支出		3,721,678,050.12	2,697,059,807.33
税金及附加	46	35,436,424.39	21,668,700.57
业务及管理费	47	3,586,639,701.52	2,661,882,213.14
信用减值损失	48	99,601,924.21	-22,010,037.47
其他资产减值损失	49		35,518,931.09
其他业务成本			
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		2,341,123,449.83	1,652,454,926.67
加：营业外收入	50	91,907,319.94	57,522,113.60
减：营业外支出	51	8,643,075.84	4,276,203.05
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,424,387,693.93	1,705,700,837.22
减：所得税费用	52	550,695,831.67	407,637,958.36
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,873,691,862.26	1,298,062,878.86
（一）按经营持续性分类			
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,873,691,862.26	1,298,062,878.86
2.终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
（二）按所有权归属分类			
1.归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列）		1,862,640,224.66	1,298,539,701.33
2.少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		11,051,637.60	-476,822.47
六、其他综合收益的税后净额	35	31,361,037.73	123,213,097.10

归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		31,361,037.87	123,213,097.05
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益		49,513,766.58	87,881,058.28
1.重新计量设定受益计划变动额			
2.权益法下不能转损益的其他综合收益			
3.其他权益工具投资公允价值变动		49,513,766.58	87,881,058.28
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		-18,152,728.71	35,332,038.77
1.权益法下可转损益的其他综合收益			-144,969.80
2.其他债权投资公允价值变动		-1,889,766.28	25,747,201.46
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		346,915.19	3,427,091.97
5.现金流量套期储备			
6.外币财务报表折算差额		-16,609,877.62	6,302,715.14
7.其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		-0.14	0.05
七、综合收益总额		1,905,052,899.99	1,421,275,975.96
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,894,001,262.53	1,421,752,798.38
归属于少数股东的综合收益总额		11,051,637.46	-476,822.42
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益(元/股)	58	0.616	0.429
(二) 稀释每股收益(元/股)	58	0.616	0.429

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

### 母公司利润表

2020 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年度	2019 年度
一、营业总收入		5,695,943,597.83	3,987,926,888.37
利息净收入	3	711,092,392.30	562,383,887.78
其中：利息收入		1,418,899,976.41	1,130,073,524.46
利息支出		707,807,584.11	567,689,636.68
手续费及佣金净收入	4	3,471,813,388.96	2,158,464,090.46
其中：经纪业务手续费净收入		1,556,521,084.45	1,081,267,316.80
投资银行业务手续费净收入		1,657,323,435.68	877,226,744.18
资产管理业务手续费净收入		106,299,220.41	90,676,816.21
投资收益（损失以“-”号填列）	5	1,516,807,287.43	1,116,697,859.74
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		5,085,283.87	446,188.06
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		12,171,950.74	10,900,789.34
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6	-17,599,968.83	139,293,776.95
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,201,526.08	250,346.30

其他业务收入		2,859,843.10	11,987.98
资产处置收益（损失以“-”号填列）		230.21	-75,850.18
二、营业总支出		3,455,695,108.49	2,411,526,416.19
税金及附加		33,924,304.28	20,658,832.03
业务及管理费	7	3,350,957,902.91	2,426,718,660.90
信用减值损失		70,812,901.30	-71,370,007.83
其他资产减值损失			35,518,931.09
其他业务成本			
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		2,240,248,489.34	1,576,400,472.18
加：营业外收入		85,300,800.92	52,720,213.14
减：营业外支出		8,518,127.20	4,196,506.39
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,317,031,163.06	1,624,924,178.93
减：所得税费用		522,867,248.45	376,454,576.80
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,794,163,914.61	1,248,469,602.13
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,794,163,914.61	1,248,469,602.13
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
六、其他综合收益的税后净额		38,753,415.11	113,409,938.54
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		40,296,266.20	84,013,354.45
1.重新计量设定受益计划变动额			
2.权益法下不能转损益的其他综合收益			
3.其他权益工具投资公允价值变动		40,296,266.20	84,013,354.45
4.企业自身信用风险公允价值变动			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		-1,542,851.09	29,396,584.09
1.权益法下可转损益的其他综合收益			222,290.65
2.其他债权投资公允价值变动		-1,889,766.28	25,747,201.47
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		346,915.19	3,427,091.97
5.现金流量套期储备			
6.外币财务报表折算差额			
7.其他			
七、综合收益总额		1,832,917,329.72	1,361,879,540.67

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

## 合并现金流量表

2020年1—12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年度	2019年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			1,436,402,085.58
收取利息、手续费及佣金的现金		6,118,952,854.28	4,158,176,589.29
拆入资金净增加额		950,000,000.00	
回购业务资金净增加额		938,956,682.16	418,949,004.89



融出资金净减少额			
代理买卖证券收到的现金净额		2,765,111,143.75	1,896,158,334.19
收到其他与经营活动有关的现金	53	728,933,864.84	1,036,301,056.04
经营活动现金流入小计		11,501,954,545.03	8,945,987,069.99
为交易目的而持有的金融资产净增加额		4,166,696,425.62	
支付利息、手续费及佣金的现金		810,741,227.87	602,126,127.43
拆入资金净减少额			3,950,000,000.00
融出资金净增加额		5,598,542,778.94	2,863,648,722.96
支付给职工及为职工支付的现金		1,997,597,772.46	1,666,656,397.08
支付的各项税费		713,914,119.78	594,654,869.77
支付其他与经营活动有关的现金	53	1,629,954,144.66	1,143,137,117.41
经营活动现金流出小计		14,917,446,469.33	10,820,223,234.65
经营活动产生的现金流量净额		-3,415,491,924.30	-1,874,236,164.66
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		840,094,237.11	1,621,048,599.06
取得投资收益收到的现金		46,023,143.25	250,678,225.78
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		313,218.53	611,929.34
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		2,378,311.94	
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		888,808,910.83	1,872,338,754.18
投资支付的现金		1,073,411,392.69	800,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		111,379,455.61	92,574,045.19
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金	53		4,141.44
投资活动现金流出小计		1,184,790,848.30	892,578,186.63
投资活动产生的现金流量净额		-295,981,937.47	979,760,567.55
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		261,949,300.00	314,478,650.00
发行债券收到的现金		20,990,610,000.00	6,912,010,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		21,252,559,300.00	7,226,488,650.00
偿还债务支付的现金		14,068,643,000.00	4,466,557,850.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		531,151,730.28	432,188,175.51
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润			
支付其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流出小计		14,599,794,730.28	4,898,746,025.51
筹资活动产生的现金流量净额		6,652,764,569.72	2,327,742,624.49
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的</b>		-23,804,034.64	9,878,575.35

影响			
五、现金及现金等价物净增加额		2,917,486,673.31	1,443,145,602.73
加：期初现金及现金等价物余额		16,204,633,971.65	14,761,488,368.92
六、期末现金及现金等价物余额		19,122,120,644.96	16,204,633,971.65

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

## 母公司现金流量表

2020 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年度	2019年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
收取利息、手续费及佣金的现金		5,625,050,111.61	3,767,663,158.08
拆入资金净增加额		950,000,000.00	
回购业务资金净增加额		960,725,782.16	3,320,458,404.89
融出资金净减少额			
代理买卖证券收到的现金净额		2,311,982,516.89	1,832,623,869.95
收到其他与经营活动有关的现金		394,039,751.34	820,376,661.40
经营活动现金流入小计		10,241,798,162.00	9,741,122,094.32
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,759,101,471.64	1,458,925,417.57
支付利息、手续费及佣金的现金		810,563,203.35	596,237,321.17
拆入资金净减少额			3,950,000,000.00
融出资金净增加额		5,608,353,474.89	2,882,652,228.86
支付给职工及为职工支付的现金		1,864,673,392.00	1,512,514,346.87
支付的各项税费		686,682,093.15	569,847,131.05
支付其他与经营活动有关的现金		1,579,408,894.84	803,656,339.62
经营活动现金流出小计		14,308,782,529.87	11,773,832,785.14
经营活动产生的现金流量净额		-4,066,984,367.87	-2,032,710,690.82
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		833,653,793.16	1,539,716,115.16
取得投资收益收到的现金		33,666,651.52	244,954,716.44
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		205,440.53	605,799.34
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		867,525,885.21	1,785,276,630.94
投资支付的现金		1,055,200,192.69	800,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		106,804,508.53	88,238,235.90
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		1,162,004,701.22	888,238,235.90
投资活动产生的现金流量净额		-294,478,816.01	897,038,395.04
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		20,990,610,000.00	6,912,010,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			

筹资活动现金流入小计		20,990,610,000.00	6,912,010,000.00
偿还债务支付的现金		13,827,760,000.00	4,155,490,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		524,082,902.14	423,883,534.56
支付其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流出小计		14,351,842,902.14	4,579,373,534.56
筹资活动产生的现金流量净额		6,638,767,097.86	2,332,636,465.44
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-1,201,526.08	250,346.30
五、现金及现金等价物净增加额		2,276,102,387.90	1,197,214,515.96
加：期初现金及现金等价物余额		13,837,752,577.14	12,640,538,061.18
六、期末现金及现金等价物余额		16,113,854,965.04	13,837,752,577.14

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

合并所有者权益变动表  
2020 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

项目	2020 年度											
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
	优先股	永续债	其他									
一、上年年末余额	3,024,359,310.00				7,852,125,554.68		49,435,650.49	1,118,710,112.75	2,218,059,862.39	6,459,920,120.98	65,802,596.56	20,788,413,207.85
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年初余额	3,024,359,310.00				7,852,125,554.68		49,435,650.49	1,118,710,112.75	2,218,059,862.39	6,459,920,120.98	65,802,596.56	20,788,413,207.85
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）					0.75		31,361,037.87	179,416,391.46	358,850,087.43	1,173,155,780.27	8,985,223.88	1,751,768,521.66
（一）综合收益总额							31,361,037.87			1,862,640,224.66	11,051,637.46	1,905,052,899.99
（二）所有者投入和减少资本					0.75						-2,066,413.58	-2,066,412.83
1. 所有者投入的普通股											-2,066,412.79	-2,066,412.79
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					0.75						-0.79	-0.04
（三）利润分配								179,416,391.46	358,850,087.43	-689,484,444.39		-151,217,965.50
1. 提取盈余公积								179,416,391.46		-179,416,391.46		
2. 提取一般风险准备									358,850,087.43	-358,850,087.43		
3. 对所有者（或股东）的分配										-151,217,965.50		-151,217,965.50
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
四、本年年末余额	3,024,359,310.00				7,852,125,555.43		80,796,688.36	1,298,126,504.21	2,576,909,949.82	7,633,075,901.25	74,787,820.44	22,540,181,729.51

项目	2019 年度											
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计	
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
	优先股	永续债	其他									
一、上年年末余额	3,024,359,310.00				7,852,125,554.68		1,154,112.98	997,268,949.77	1,975,177,536.43	5,639,594,753.21	71,198,229.96	19,560,878,447.03
加：会计政策变更							-74,931,559.54	-3,405,797.23	-6,811,594.46	17,300,919.47	-16,350.19	-67,864,381.95
前期差错更正												
其他												
二、本年年初余额	3,024,359,310.00				7,852,125,554.68		-73,777,446.56	993,863,152.54	1,968,365,941.97	5,656,895,672.68	71,181,879.77	19,493,014,065.08
三、本年增减变动金额（减少以“一”号填列）							123,213,097.05	124,846,960.21	249,693,920.42	803,024,448.30	-5,379,283.21	1,295,399,142.77
（一）综合收益总额							123,213,097.05			1,298,539,701.33	-476,822.42	1,421,275,975.96
（二）所有者投入和减少资本											-4,902,460.79	-4,902,460.79
1. 所有者投入的普通股											-4,902,460.79	-4,902,460.79
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								124,846,960.21	249,693,920.42	-495,515,253.03		-120,974,372.40
1. 提取盈余公积								124,846,960.21		-124,846,960.21		
2. 提取一般风险准备									249,693,920.42	-249,693,920.42		
3. 对所有者（或股东）的分配										-120,974,372.40		-120,974,372.40
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												
1. 资本公积转增资本（或股本）												
2. 盈余公积转增资本（或股本）												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益												
6. 其他												
四、本年年末余额	3,024,359,310.00				7,852,125,554.68		49,435,650.49	1,118,710,112.75	2,218,059,862.39	6,459,920,120.98	65,802,596.56	20,788,413,207.85

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

## 母公司所有者权益变动表

2020 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

项目	2020 年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减:库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年年末余额	3,024,359,310.00				7,847,200,595.69		42,288,329.54	1,118,710,112.75	2,218,059,862.39	6,155,553,376.29	20,406,171,586.66
加: 会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年年年初余额	3,024,359,310.00				7,847,200,595.69		42,288,329.54	1,118,710,112.75	2,218,059,862.39	6,155,553,376.29	20,406,171,586.66
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)							38,753,415.11	179,416,391.46	358,850,087.43	1,104,679,470.22	1,681,699,364.22
(一)综合收益总额							38,753,415.11			1,794,163,914.61	1,832,917,329.72
(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								179,416,391.46	358,850,087.43	-689,484,444.39	-151,217,965.50
1.提取盈余公积								179,416,391.46		-179,416,391.46	
2.提取一般风险准备									358,850,087.43	-358,850,087.43	
3.对所有者(或股东)的分配										-151,217,965.50	-151,217,965.50
4.其他											
(四)所有者权益内部结转											
1.资本公积转增资本(或股本)											
2.盈余公积转增资本(或股本)											
3.盈余公积弥补亏损											
4.设定受益计划变动额结转留存收益											
5.其他综合收益结转留存收益											
6.其他											
四、本年年末余额	3,024,359,310.00				7,847,200,595.69		81,041,744.65	1,298,126,504.21	2,576,909,949.82	7,260,232,846.51	22,087,870,950.88

项目	2019 年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年年末余额	3,024,359,310.00				7,847,200,595.69		-73,487,184.68	997,268,949.77	1,975,177,536.43	5,426,439,607.76	19,196,958,814.97
加：会计政策变更							2,365,575.68	-3,405,797.23	-6,811,594.46	-23,840,580.57	-31,692,396.58
前期差错更正											
其他											
二、本年初余额	3,024,359,310.00				7,847,200,595.69		-71,121,609.00	993,863,152.54	1,968,365,941.97	5,402,599,027.19	19,165,266,418.39
三、本年增减变动金额（减少以“-”号填列）							113,409,938.54	124,846,960.21	249,693,920.42	752,954,349.10	1,240,905,168.27
（一）综合收益总额							113,409,938.54			1,248,469,602.13	1,361,879,540.67
（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								124,846,960.21	249,693,920.42	-495,515,253.03	-120,974,372.40
1. 提取盈余公积								124,846,960.21		-124,846,960.21	
2. 提取一般风险准备									249,693,920.42	-249,693,920.42	
3. 对所有者（或股东）的分配										-120,974,372.40	-120,974,372.40
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
四、本年年末余额	3,024,359,310.00				7,847,200,595.69		42,288,329.54	1,118,710,112.75	2,218,059,862.39	6,155,553,376.29	20,406,171,586.66

法定代表人：冉云

主管会计工作负责人：金鹏

会计机构负责人：李登川

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

适用 不适用

国金证券股份有限公司(以下简称公司或本公司)为成都城建投资发展股份有限公司(以下简称原成都建投)吸收合并国金证券有限责任公司(以下简称原国金证券)后更名而成。

原成都建投系于 2002 年 12 月 24 日经成都市工商行政管理局批准由成都百货(集团)股份有限公司更名而成的股份有限公司。公司前身成都百货(集团)股份有限公司于 1997 年 8 月 7 日在上海证券交易所上市, 股票代码 600109。原国金证券前身为成立于 1990 年的成都证券公司, 经过历年的更名及增资, 于 2005 年 11 月更名为“国金证券有限责任公司”, 注册资本人民币 500,000,000.00 元。

2007 年 1 月 24 日, 中国证券监督管理委员会以证监公司字(2007)12 号文核准原成都建投与长沙九芝堂(集团)有限公司(以下简称九芝堂集团)、湖南涌金投资(控股)有限公司(以下简称湖南涌金)和四川舒卡特种纤维股份有限公司(以下简称舒卡股份)进行重大资产置换, 并发行不超过 7,500 万股的人民币普通股购买其合计持有的原国金证券 51.76%的股权; 以证监公司字(2007)13 号文批复同意九芝堂集团、湖南涌金公告原成都建投收购报告书并豁免要约收购义务; 以证监机构字(2007)23 号文核准原成都建投分别受让九芝堂集团、湖南涌金和舒卡股份持有的原国金证券 51.76%股权。至此, 原成都建投成为原国金证券的控股股东。

2008 年 1 月 22 日, 中国证券监督管理委员会以证监许可(2008)113 号文核准原成都建投向原国金证券除原成都建投以外的股东发行 216,131,588 股股份换股吸收合并原国金证券。在完成相关吸收合并工作后, 原国金证券依法注销。公司由原成都建投更名为国金证券股份有限公司, 并依法继承原国金证券(含分支机构)的各项证券业务资格。

截至 2020 年 12 月 31 日, 公司注册资本 3,024,359,310.00 元, 股份总数 3,024,359,310 股(每股面值 1 元)。

公司注册地: 成都市青羊区东城根上街 95 号。

总部地址: 成都市青羊区东城根上街 95 号。

法定代表人: 冉云。

公司经营范围: 许可项目: 证券业务; 证券投资基金托管; 证券投资基金销售服务(依法须经批准的项目, 经相关部门批准后方可开展经营活动, 具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准)。一般项目: 证券公司为期货公司提供中间介绍业务(除依法须经批准的项目外, 凭营业执照依法自主开展经营活动)。

截至 2020 年 12 月 31 日, 公司经批准设立分公司 8 家、证券营业部 68 家; 拥有员工 3545 人, 期末在职董事、监事和高级管理人员 21 人。

本财务报表经本公司董事会于 2021 年 3 月 31 日决议批准报出。



## 2. 合并财务报表范围

适用 不适用

公司合并财务报表范围包括直接或间接控制的子公司和结构化主体。具体情况详见本财务报表附注八、合并范围的变更和九、在其他主体中的权益。

## 四、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

### 2. 持续经营

适用 不适用

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

## 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

以下披露内容已涵盖了本公司根据实际业务经营特点制定的具体会计政策和会计估计。详见本财务报表附注“五、27.收入”、“五、34.其他重要的会计政策和会计估计”。

### 1. 遵循企业会计准则的声明

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

### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 3. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

境外子公司以其经营所处的主要经济环境中的货币为记账本位币，编制财务报表时折算为人民币。

### 4. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用 不适用

#### (1) 同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。公司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份额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；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

#### (2) 非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确

认为商誉；如果合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益。

## 5. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，所有子公司(包括本公司所控制的单独主体)均纳入合并财务报表。公司合并财务报表按照《企业会计准则第33号—合并财务报表》及相关规定的要求编制，母公司与子公司、子公司相互之间发生的内部交易于合并时抵销。

子公司所有者权益中不属于母公司的份额作为少数股东权益，在合并资产负债表中股东权益项目下以“少数股东权益”项目列示。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。

在报告期内，若因同一控制下企业合并增加子公司的，则调整合并资产负债表的期初数；将子公司合并当期期初至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；将子公司合并当期期初至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表，同时对比较报表的相关项目进行调整，视同合并后的报告主体在以前期间一直存在。

在报告期内，若因非同一控制下企业合并增加子公司的，则不调整合并资产负债表期初数；将子公司自购买日至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司自购买日至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表。通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方的股权，公司按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益。购买日之前持有的被购买方的股权涉及其他综合收益的，与其相关的其他综合收益转为购买日所属当期投资收益。

## 6. 现金及现金等价物的确定标准

在编制现金流量表时，将公司库存现金以及可以随时用于支付的存款确认为现金。将同时具备期限短、流动性强、易于转换为已知现金、价值变动风险很小四个条件的投资，确定为现金等价物。

## 7. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

### (1) 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，计入当期损益；以历史成本计量的外币非货币性项目仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其人民币金额；以公允价

值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，差额计入当期损益或其他综合收益。

## (2) 外币财务报表折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

## 8. 金融工具

### (1). 金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

适用 不适用

#### (1) 金融资产和金融负债的分类

公司根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产于初始确认时划分为以下三类：①以摊余成本计量的金融资产；②以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；③以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

除下列各项外，公司将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债：①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；②金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；③不属于上述①或②情形的财务担保合同，以及不属于上述①情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

#### (2) 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

##### ① 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第 14 号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

##### ② 金融资产的后续计量方法

###### A. 以摊余成本计量的金融资产

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

###### B. 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

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

得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

C. 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

D. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

③ 金融负债的后续计量方法

A. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

采用公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配；终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。

B. 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债，按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》相关规定进行计量。

C. 不属于上述 A.或 B.的财务担保合同，以及不属于上述 A.并以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

D. 以摊余成本计量的金融负债

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

④ 金融资产和金融负债的终止确认

A. 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：收取金融资产现金流量的合同权利已终止；金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

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

(3) 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报

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

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

#### (4) 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

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

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。

在证券交易所上市流通的股票，估值日有交易的，按估值日收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的，参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素，调整最近交易日的收盘价确定公允价值。首次发行未上市的股票，在未上市期间按发行价格估值；送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价或最近交易日的收盘价确定公允价值。通过公开、非公开等方式取得且有明确限售期的股票，在限售期内，以证券交易所上市交易的同一股票的公允价值为基础，引入流动性折扣进行估值。流动性折扣依据第三方估值机构提供的数据，或看跌期权法以及其他合理的估值方法分析确定。长期停牌股票根据停牌原因、停牌时间及停牌公司公告等信息，采用市场法、收益法、成本法等估值技术，结合流动性折扣等因素评估公允价值。

非证券交易所交易的股票（如：在全国中小企业股份转让系统、区域性股权市场挂牌交易的股票等），交易量及交易频率足以持续提供定价信息的，按估值日收盘价估值；交易量或交易频率不足以反映公允价值的情况下，综合考虑交易活跃程度、转让方式等，采用市场法、收益法、成本法等估值技术，结合流动性折扣等因素评估公允价值。

在全国银行间市场交易的固定收益品种，主要依据第三方估值机构提供的价格数据确定公允价值。证券交易所交易的含有转股权的债券（如：可转换债券、可交换债券等），对净价部分以交易所收盘价为基础确定公允价值。

非证券交易所上市的资产管理产品，估值日资产管理人提供单位净值的，按资产管理人提供的估值日单位净值估值；估值日资产管理人未提供单位净值，且从最近净值提供日到估值日整体市场环境及投资标的未发生重大变化的，参考最近可获取的单位净值确定公允价值；若有充足证据表明最近可获取的单位净值不能真实反映公允价值的，采用估值技术确定公允价值。

非上市公司股权，综合考虑被评估企业实际情况、市场交易情况及其他可获得的信息，采用市场法、收益法、成本法等估值技术，结合流动性折扣等因素评估公允价值。

#### (5) 金融工具减值

公司以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资、合同资产、租赁应收款、分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的贷款承诺、不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债或不属于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债的财务担保合同进行减值处理并确认损失准备。

计入上述分类的金融工具包括但不限于债券投资、开展融资类业务（含融资融券、约定购回、股票质押回购等）形成的资产，以及货币市场拆出（借出）资金或证券（含定期存款）、应收款项等。

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

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

对于不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。在评估信用风险是否显著增加时，考虑以下事项，包括但不限于：①可获得有关过去事项、当前状况及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；②宏观经济状况、债务人经营和财务情况、内部实际违约率和预期违约概率、外部信用评级和内部信用评级、逾期情况、外部市场定价等信息；③金融工具预计存续期内违约风险的相对变化，而非违约风险变动的绝对值。

公司基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行调整：①第一阶段：在资产负债表日信用风险较低的金融工具，或初始确认后信用风

险未显著增加的金融工具，公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）预期信用损失的金额计量其损失准备；②第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，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；③第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，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。

公司根据金融资产的特点，针对具有相同风险特征的金融资产界定存在发生信用减值证据的情形。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：①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；⑦其他表明金融资产已发生信用减值的情形。

预期信用损失主要计量方法包括违约概率/违约损失率法、损失率法等。违约概率/违约损失率方法是指通过估计单笔资产或资产组合的违约风险暴露(EAD)、违约概率(PD)、违约损失率(LGD)等参数计量预期信用损失的方法。损失率方法是指在不估计违约概率和违约损失率等情况下，直接估计损失率计量预期信用损失的方法。公司通过对宏观经济因素、行业政策和行业环境等因素的判断，确定前瞻性调整系数，并对预期信用损失的计量结果进行调整。

金融工具信用减值三阶段划分的具体标准、减值的具体计量方法和参数等，详见本财务报表附注十五、风险管理之 2、信用风险。

公司在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资，公司在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

#### (6) 金融资产和金融负债的抵销

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

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

## 9. 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

参见本财务报表附注“五、8. 金融工具”。

## 10. 合同资产

### (1). 合同资产的确认方法及标准

适用 不适用

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列示合同资产或合同负债。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。

### (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

参见本财务报表附注“五、8. 金融工具”。

## 11. 持有待售资产

适用 不适用

公司将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：(1) 根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；(2) 出售极可能发生，即公司已经就出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。

公司专为转售而取得的非流动资产或处置组，在取得日满足“预计出售将在一年内完成”的规定条件，且短期（通常为 3 个月）内很可能满足持有待售类别的其他划分条件的，在取得日将其划分为持有待售类别。

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

对于取得日划分为持有待售类别的非流动资产或处置组，在初始计量时比较假定其不划分为持有待售类别情况下的初始计量金额和公允价值减去出售费用后的净额，以两者孰低计量。除企业合并中取得的非流动资产或处置组外，由非流动资产或处置组以公允价值减去出售费用后的净额作为初始计量金额而产生的差额，计入当期损益。

## 12. 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

参见本财务报表附注“五、8. 金融工具”。

## 13. 其他债权投资

### (1). 其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

参见本财务报表附注“五、8. 金融工具”。

## 14. 长期股权投资

适用 不适用

(1) 共同控制、重要影响的判断



按照相关约定对某项安排存在共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策，认定为共同控制。对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定，认定为重大影响。

## (2) 投资成本的确定

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

②非同一控制下的企业合并形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

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

## (3) 后续计量及损益确认方法

公司对被投资单位能够实施控制的长期股权投资采用成本法核算，按照初始投资成本计价，追加或收回投资时调整长期股权投资的成本。被投资单位宣告分派的现金股利或利润，确认为当期投资收益。

对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。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；长期股权投资的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。取得长期股权投资后，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所有者权益。

## (4) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的处理方法

### ①个别财务报表

对处置的股权，其账面价值与实际取得价款之间的差额，计入当期损益。对于剩余股权，对被投资单位仍具有重大影响或者与其他方一起实施共同控制的，转为权益法核算；不能再对被投资单位实施控制、共同控制或重大影响的，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的相关规定进行核算。

### ②合并财务报表

**A.通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且不属于“一揽子交易”的**

在丧失控制权之前，处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整资本公积（资本溢价），资本溢价不足冲减的，冲减留存收益。

丧失对原子公司控制权时，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自购买日或合并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，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益等，应当在丧失控制权时转为当期投资收益。

**B. 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且属于“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。

**15. 投资性房地产**

**(1). 如果采用成本计量模式的：**

折旧或摊销方法

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

公司对投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。

**16. 固定资产**

**(1). 确认条件**

适用 不适用

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

**(2). 折旧方法**

固定资产折旧采用年限平均法分类计提，根据固定资产类别、预计使用寿命和预计净残值率确定折旧率。

适用 不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	年限平均法	30	3%	3.23%
电子设备	年限平均法	3	3%	32.33%
运输工具	年限平均法	4-6	3%	24.25%-16.17%
办公及其他设备	年限平均法	5	3%	19.40%

**17. 借款费用**√适用  不适用

借款费用，包括借款利息、折价或者溢价的摊销、辅助费用以及因外币借款而发生的汇兑差额等。

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

**18. 无形资产****(1). 计价方法、使用寿命、减值测试**√适用  不适用

无形资产是指本公司拥有或者控制的没有实物形态的可辨认非货币性资产，包括交易席位费、特许经营权、软件以及期货会员资格投资等，按成本进行初始计量。

使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内采用直线法摊销，并在年度终了，对无形资产的使用寿命和摊销方法进行复核，如与原先估计数存在差异的，进行相应的调整。使用寿命有限的无形资产摊销方法如下：

项 目	摊销年限(年)	摊销方法
计算机软件	2-5	直线法

使用寿命不确定的无形资产不予摊销，本公司在每个会计期间对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。

**(2). 内部研究开发支出会计政策** 适用  不适用**19. 长期资产减值**√适用  不适用

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

可收回金额的计量结果表明,该等长期资产的可收回金额低于其账面价值的,将资产的账面价值减记至可收回金额,减记的金额确认为资产减值损失,计入当期损益,同时计提相应的资产减值准备。

**20. 长期待摊费用**√适用  不适用

本公司长期待摊费用是指已经支出，但受益期限在一年以上(不含一年)的各项费用，包括经营租入固定资产改良支出等，采用直线法，按租赁期和 5 年孰短来确定摊销期限。

## 21. 商誉

商誉为非同一控制下企业合并成本超过应享有的被投资单位或被购买方可辨认净资产于取得日或购买日的公允价值份额的差额。

在财务报表中单独列示的商誉至少在每年年终进行减值测试。减值测试时，商誉的账面价值依据相关的资产组或者资产组组合能够从企业合并的协同效应中受益的情况分摊至受益的资产组或资产组组合。

## 22. 附回购条件的资产转让

适用 不适用

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资产，合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售业务按实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”列示。

卖出回购交易按照合同或协议，以一定的价格将相关的资产出售给交易对手，到合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购业务按实际收到的款项入账，在资产负债表“卖出回购金融资产款”列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内。

买入返售及卖出回购业务的买卖差价分别按实际利率法在返售或回购期间内确认为利息收入和利息支出。买入返售金融资产中，涉及向客户融出资金的，以预期信用损失为基础计提减值准备，详见本财务报表附注“五、8.金融工具”。

## 23. 合同负债

### (1). 合同负债的确认方法

适用 不适用

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作为合同负债列示。公司在向客户转让商品或者服务之前，如果客户已经支付了合同对价或公司已经取得了无条件收取合同对价权利的，公司应当在客户实际支付款项与到期应支付款项孰早时点，按照该已收或应收的金额确认合同负债，待向客户转让商品或者提供服务时，结转相关合同负债并确认收入。

## 24. 职工薪酬

职工薪酬，是指公司为获得职工提供的服务或解除劳动关系而给予的各种形式的报酬或补偿。职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

### (1)、短期薪酬的会计处理方法

适用 不适用

在职工为公司提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或

相关资产成本。

## (2)、离职后福利的会计处理方法

适用 不适用

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

① 在职工为公司提供服务的会计期间，根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

② 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

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

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

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

## (3)、辞退福利的会计处理方法

适用 不适用

向职工提供的辞退福利，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：① 公司不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；② 公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

## (4)、其他长期职工福利的会计处理方法

适用 不适用

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

## 25. 预计负债

适用 不适用

(1) 预计负债的确认标准：与或有事项相关的义务同时满足下列条件时，公司确认为预计负债：该义务是公司承担的现时义务；履行该义务很可能导致经济利益流出公司；该义务的金额能够可靠地计量。(2) 预计负债的计量：公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

## 26. 股份支付

适用 不适用

股份支付是为了获取职工和其他方提供服务而授予权益工具或者承担以权益工具为基础确定的负债的交易，分为以权益结算的股份支付和以现金结算的股份支付。

以权益结算的股份支付换取职工提供服务的，以授予职工权益工具的公允价值计量。授予后立即可行权的换取职工服务的以权益结算的股份支付，在授予日按照权益工具的公允价值计入相关成本或费用，相应调整资本公积。完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的换取职工服务的以权益结算的股份支付，在等待期内的每个资产负债表日，以对可行权权益工具数量的最佳估计为基础，按权益工具授予日的公允价值，将当期取得的服务计入相关成本或费用，相应调整资本公积。换取其他方服务的权益结算的股份支付，如果其他方服务的公允价值能够可靠计量的，按照其他方服务在取得日的公允价值计量；如果其他方服务的公允价值不能可靠计量，但权益工具的公允价值能够可靠计量的，按照权益工具在服务取得日的公允价值计量，计入相关成本或费用，相应增加所有者权益。

授予后立即可行权的换取职工服务的以现金结算的股份支付，在授予日按公司承担负债的公允价值计入相关成本或费用，相应增加负债。完成等待期内的服务或达到规定业绩条件才可行权的换取职工服务的以现金结算的股份支付，在等待期内的每个资产负债表日，以对可行权情况的最佳估计为基础，按公司承担负债的公允价值，将当期取得的服务计入相关成本或费用和相应的负债。

## 27. 收入

### (1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

#### (1) 收入确认原则

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

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

对于在某一时段内履行的履约义务，公司在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不

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

## （2）收入计量原则

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

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

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

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

## （3）公司具体主要收入

手续费及佣金收入：代理客户买卖证券手续费收入，在代理买卖证券交易日确认收入。金融产品代销业务在代销完成时按照代销规模及约定费率确认收入。承销业务手续费收入，在承销业务提供的相关服务完成时确认收入。保荐业务收入和财务顾问业务收入在履行了合同中的履约义务、提供相关服务后确认收入。受托资产管理手续费及佣金收入按合同规定收取的管理费收入以及其他应由本公司享有的收入，按权责发生制原则确认。

利息收入：根据相关本金及实际利率按权责发生制原则确认。

其他业务收入：以合同到期结算时或提供服务时确认为收入。

## 28. 利润分配

适用 不适用

公司当年实现的税后利润，在弥补以前年度亏损后，按 10%提取法定公积金、按 10%提取一般风险准备金、按 10%提取交易风险准备金后，再按股东大会批准方案进行分配。

## 29. 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

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划分为与资产相关的政府补助。

与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关的政府补助确认为递延收益的，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

### (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

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。

对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助，难以区分与资产相关或与收益相关的，整体归类为与收益相关的政府补助。

与收益相关的政府补助，用于补偿公司以后期间的相关成本费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益或冲减相关成本；用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的，直接计入当期损益或冲减相关成本。

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

## 30. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

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

(2) 确认递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异、可抵扣亏损和税款抵减的应纳税所得额为限。在无法明确估计可抵扣暂时性差异预期转回期间可能取得的应纳税所得额时，不确认与可抵扣暂时性差异相关的递延所得税资产。

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

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



### 31. 租赁

#### (1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

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

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

#### (2)、融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

公司为承租人时，在租赁期开始日，公司以租赁开始日租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值中两者较低者作为租入资产的入账价值，将最低租赁付款额作为长期应付款的入账价值，其差额为未确认融资费用，发生的初始直接费用，计入租赁资产价值。在租赁期各个期间，采用实际利率法计算确认当期的融资费用。

公司为出租人时，在租赁期开始日，公司以租赁开始日最低租赁收款额与初始直接费用之和作为应收融资租赁款的入账价值，同时记录未担保余值；将最低租赁收款额、初始直接费用及未担保余值之和与其现值之和的差额确认为未实现融资收益。在租赁期各个期间，采用实际利率法计算确认当期的融资收入。

### 32. 融资融券业务

√适用 □不适用

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

公司对融出的资金，确认应收债权，在资产负债表中列示为融出资金，并确认相应利息收入；对融出的证券，不终止确认该证券，确认相应利息收入。

### 33. 套期会计

套期分为公允价值套期、现金流量套期和境外经营净投资套期。

运用套期会计的条件：(1)套期关系仅由符合条件的套期工具和被套期项目组成。(2)在套期开始时，公司正式指定了套期工具和被套期项目，并准备了关于套期关系和公司从事套期的风险管理策略和风险管理目标的书面文件。该文件至少载明了套期工具、被套期项目、被套期风险的性质以及套期有效性评估方法(包括套期无效部分产生的原因分析以及套期比率确定方法)等内容。

(3)套期关系符合套期有效性要求。

套期同时满足下列条件时，公司认定套期关系符合套期有效性要求：(1) 被套期项目和套期工具之间存在经济关系；(2) 被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影

响不占主导地位；(3) 套期关系的套期比率等于公司实际套期的被套期项目数量与对其进行套期的套期工具实际数量之比，但不反映被套期项目和套期工具相对权重的失衡。

公司在套期开始日及以后期间持续地对套期关系是否符合套期有效性要求进行评估。套期关系由于套期比率的原因而不再符合套期有效性要求，但指定该套期关系的风险管理目标没有改变的，公司进行套期关系再平衡。

发生下列情形之一的，终止运用套期会计：(1)因风险管理目标发生变化，导致套期关系不再满足风险管理目标。(2)套期工具已到期、被出售、合同终止或已行使。(3)被套期项目与套期工具之间不再存在经济关系，或者被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影响开始占主导地位。(4)套期关系不再满足运用套期会计方法的其他条件。

### 34. 其他重要的会计政策和会计估计

√适用 □不适用

#### (1) 每日无负债结算的衍生工具

本公司持有的衍生工具包括股指期货、国债期货等。因股指期货、国债期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的股指期货、国债期货暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

#### (2) 分部报告

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

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

当存在相似经济特征的两个或多个经营分部，同时满足下列条件的，可以合并为一个经营分部：①各单项产品或劳务的性质相同或相似；②生产过程的性质相同或相似；③产品或劳务的客户类型相同或相似；④销售产品或提供劳务的方式相同或相似；⑤生产产品或提供劳务受法律、行政法规的影响相同或相似。

本公司以经营分部为基础确定报告分部，分部会计政策与合并财务报表会计政策一致。分部间转移价格参照市场价格确定，与各分部共同使用的资产、相关的费用按照收入比例在不同的分部之间分配。

#### (3) 客户资产管理业务

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为核算主体，单独建账、独立核算。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

本公司对由公司(含公司子公司)作为管理人的资产管理计划，综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些集合资产管理计划的可变回报，或承担的风险敞口等因素，将符合条件的资产管

理计划纳入合并报表范围。除此以外，资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表内反映，资产管理业务开展情况及收入在财务报表附注中列示。

(4) 转融通业务

公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由公司享有或承担，公司不将其计入资产负债表的金融资产项目，只在表外登记备查。

(5) 终止经营的确认标准

满足下列条件之一的、已经被处置或划分为持有待售类别且能够单独区分的组成部分确认为终止经营：

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

35. 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)
公司自 2020 年 1 月 1 日起执行财政部修订后的《企业会计准则第 14 号——收入》(以下简称“新收入准则”)。	本次变更经第十一届董事会第五次会议审议通过	按照衔接规定，根据首次执行新收入准则的累积影响数，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。

(2)、重要会计估计变更

适用 不适用

本报告期无会计估计变更。

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

适用 不适用

合并资产负债表

单位:元 币种:人民币

项目	2019 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	调整数
应付款项	512,896,608.91	505,767,453.18	-7,129,155.73
合同负债		7,129,155.73	7,129,155.73

母公司资产负债表

单位:元 币种:人民币

项目	2019 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	调整数
应付款项	205,007,867.21	199,998,533.18	-5,009,334.03

合同负债		5,009,334.03	5,009,334.03
------	--	--------------	--------------

## 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	以应税销售额为基础计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	6%，3%
城市维护建设税	按实际缴纳的增值税计缴	7%，1%
教育费附加	按实际缴纳的增值税计缴	3%
企业所得税	按应纳税所得额计缴	25%，16.5%

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（%）
本公司及注册在境内的子公司	25
注册在香港的子公司	16.5

注：根据香港利得税两级制，符合要求的实体，其利润不超过 200 万港元部分按 8.25% 征税，超过 200 万港元的部分按 16.5% 征税。

### 2. 其他

适用 不适用

公司企业所得税的缴纳按照《跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法》（国家税务总局公告 2012 年第 57 号）的规定执行。

## 七、合并财务报表项目注释

说明：本财务报表附注的期初余额指 2020 年 1 月 1 日余额，期末余额指 2020 年 12 月 31 日余额，本期金额指 2020 年 1 月 1 日—2020 年 12 月 31 日发生额，上期金额指 2019 年 1 月 1 日—2019 年 12 月 31 日发生额，金额单位若未特别注明者均为人民币元。母公司同。期初余额与上期末余额（2019 年 12 月 31 日）差异详见本财务报表附注五、35、(3)之说明。

### 1、货币资金

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	9,138.61	/	/	10,324.67
人民币	/	/	1,898.65	/	/	2,262.65
港元	8,602.20	0.84164	7,239.96	9,000.00	0.89578	8,062.02
银行存款：	/	/	15,965,984,119.61	/	/	13,906,536,927.92
其中：自有资	/	/	2,785,668,739.98	/	/	2,445,290,151.65

金						
人民币	/	/	2,645,046,783.38	/	/	2,317,103,541.19
美元	3,052,676.70	6.5249	19,918,410.20	2,995,251.31	6.9762	20,895,472.19
港元	143,413,189.44	0.84164	120,702,276.76	119,773,982.76	0.89578	107,291,138.27
新加坡币	257.30	4.9345	1,269.64		/	
客户资金	/	/	13,180,315,379.63	/	/	11,461,246,776.27
人民币	/	/	12,310,778,174.17	/	/	11,034,388,986.01
美元	7,314,357.57	6.5249	47,725,451.68	6,207,128.49	6.9762	43,302,169.77
港元	976,353,450.23	0.84164	821,738,117.84	428,180,602.92	0.89578	383,555,620.49
新加坡币	14,922.57	4.9345	73,635.94		/	
合计	/	/	15,965,993,258.22	/	/	13,906,547,252.59

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	/	/	352,943,701.93	/	/	248,592,774.02
人民币	/	/	352,943,701.93	/	/	248,592,774.02
客户信用资金	/	/	1,642,415,257.39	/	/	1,221,337,103.46
人民币	/	/	1,362,718,675.18	/	/	1,016,913,926.58
港元	332,323,300.00	0.84164	279,696,582.21	228,206,900.00	0.89578	204,423,176.88
合计	/	/	1,995,358,959.32	/	/	1,469,929,877.48

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

适用 不适用

截至 2020 年 12 月 31 日，货币资金受限金额为人民币 100,000.00 元。

## 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：	/	/	384,958,820.75	/	/	361,788,649.35
人民币	/	/	384,958,820.75	/	/	361,788,649.35
客户普通备付金：	/	/	2,352,261,988.36	/	/	1,759,071,648.93
人民币	/	/	2,338,776,884.63	/	/	1,727,578,613.78
美元	988,338.07	6.5249	6,448,807.08	808,230.19	6.9762	5,638,375.45
港元	8,360,221.29	0.84164	7,036,296.65	28,862,733.81	0.89578	25,854,659.70
客户信用备付金：	/	/	439,797,170.73	/	/	199,034,983.84
人民币	/	/	439,797,170.73	/	/	199,034,983.84
合计	/	/	3,177,017,979.84	/	/	2,319,895,282.12

## 3、融出资金

适用 不适用

(1) 按类别列示：

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	14,543,737,799.89	8,889,385,919.62
其中：个人	14,022,972,521.19	8,665,638,363.44
机构	520,765,278.70	223,747,556.18
减：减值准备	16,608,430.20	9,577,867.27
账面价值小计	14,527,129,369.69	8,879,808,052.35
境外	301,577,839.01	312,298,418.13
其中：个人	157,900,379.84	204,757,821.96
机构	143,677,459.17	107,540,596.17
减：减值准备	13,334,691.75	13,720,364.23
账面价值小计	288,243,147.26	298,578,053.90
账面价值合计	14,815,372,516.95	9,178,386,106.25

截至 2020 年 12 月 31 日，上述融出资金中因收益权转让受限金额为 0.00 元。

(2) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：  
√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	1,796,764,935.76	1,206,181,482.90
债券	118,013,376.83	24,803,955.45
股票	46,934,330,850.72	30,358,693,242.38
基金	1,522,398,439.67	443,190,689.72
其他	13,214,151.84	114,967.37
合计	50,384,721,754.82	32,032,984,337.82

融出资金的说明：

√适用 □不适用

截至 2020 年 12 月 31 日，公司融出资金不存在逾期。

#### 4、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	
利率衍生工具			22,690,949,350.00	0.00				16,183,688,500.00	0.00	
国债期货 [注]			10,390,949,350.00	0.00				6,053,688,500.00	0.00	
利率互换 [注]			12,300,000,000.00	0.00				10,130,000,000.00	0.00	

权益衍生工具				611,764,180.00	0.00	69,487,181.94				1,409,944,080.00	0.00	22,738,982.00
股指期货 [注]				234,842,580.00	0.00					328,232,440.00	0.00	
权益互换				65,250,000.00		67,295,000.24						
场内期权				246,421,600.00		1,824,880.00				1,081,711,640.00		22,738,982.00
场外期权				65,250,000.00		367,301.70						
信用衍生工具				30,000,000.00	704,900.00							
信用保护 合约				30,000,000.00	704,900.00							
其他衍生工具				1,463,591,000.00		13,513,000.00				1,307,723,000.00	0.00	33,106,000.00
黄金期货 [注]										231,277,060.00	0.00	
黄金现货 延期[注]										83,630,940.00	0.00	
黄金 远期				1,463,591,000.00		13,513,000.00				992,815,000.00		33,106,000.00
合计				24,796,304,530.00	704,900.00	83,000,181.94				18,901,355,580.00	0.00	55,844,982.00

衍生金融工具的说明：

注：在当日无负债结算制度下，衍生金融资产项下的期货、利率互换、现货延期投资与相关的衍生品暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币 0.00 元。抵销前衍生金融工具浮盈与衍生品暂收款金额均为人民币 51,712,069.41 元。

5、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	/	/	1,289,018,536.66	/	/	911,603,146.14
其中：人民币	/	/	1,280,318,888.98	/	/	901,571,467.80
美元	270,000.00	6.5249	1,761,723.00	270,000.00	6.9762	1,883,574.00
港元	8,243,340.00	0.84164	6,937,924.68	9,096,099.87	0.89578	8,148,104.34
信用保证金	/	/	26,162,561.74	/	/	11,634,869.73
其中：人民币	/	/	26,162,561.74	/	/	11,634,869.73
履约保证金	/	/	100,581,206.58	/	/	61,815,433.75
其中：人民币	/	/	100,581,206.58	/	/	61,815,433.75
合计	/	/	1,415,762,304.98	/	/	985,053,449.62

## 6、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
应收资产管理费	61,833,950.79	31,751,165.75
应收手续费及佣金	33,586,543.33	29,980,788.41
其他		247,841.15
合计	95,420,494.12	61,979,795.31
减：坏账准备(按简化模型计提)	4,475,852.08	1,533,007.85
应收款项账面价值	90,944,642.04	60,446,787.46

截至 2020 年 12 月 31 日，公司无股票质押式回购业务融出资金重分类至应收款项情况。

### (2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额		期初余额	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	78,439,999.94	82.20	53,460,766.88	86.26
1-2 年	12,772,294.18	13.39	4,040,128.43	6.52
2-3 年			4,478,900.00	7.22
3 年以上	4,208,200.00	4.41		
合计	95,420,494.12	100.00	61,979,795.31	100.00

### (3) 按计提坏账列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备：								
单项计提								
单项计小计								
组合计提坏账准备：								
按信用风险特征组合计提	95,420,494.12	100.00	4,475,852.08	4.69	61,979,795.31	100.00	1,533,007.85	2.47
组合小计	95,420,494.12	100.00	4,475,852.08	4.69	61,979,795.31	100.00	1,533,007.85	2.47



合计	95,420,494.12	100.00	4,475,852.08	4.69	61,979,795.31	100.00	1,533,007.85	2.47
----	---------------	--------	--------------	------	---------------	--------	--------------	------

## 7、买入返售金融资产

### (1) 按业务类别

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券	1,208,603.04	11,148,278.47
股票质押式回购	5,639,708,734.17	5,143,390,372.53
债券质押式回购	2,580,420,000.00	372,060,000.00
减：减值准备	171,584,164.38	107,154,167.03
账面价值合计	8,049,753,172.83	5,419,444,483.97

### (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	5,640,917,337.21	5,154,538,651.00
债券	2,580,420,000.00	372,060,000.00
减：减值准备	171,584,164.38	107,154,167.03
买入返售金融资产账面价值	8,049,753,172.83	5,419,444,483.97

### (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	20,729,123,788.83	14,922,070,964.02
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	93,337,286.96	969,512,526.36
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	673,368,835.05	374,412,745.00
一个月至三个月内	145,549,456.03	745,354,067.71
三个月至一年内	2,201,737,501.65	2,564,412,622.47
一年以上	2,620,261,544.48	1,470,359,215.82
合计	5,640,917,337.21	5,154,538,651.00

买入返售金融资产的说明：

√适用 □不适用

### (5) 股票质押式回购明细情况：

股票质押式回购剩余期限

项 目	期末余额	期初余额
一个月以内	673,368,835.05	374,412,745.00
一个月至三个月内	145,484,498.23	735,177,272.10
三个月至一年内	2,200,593,856.41	2,563,441,139.61
一年以上	2,620,261,544.48	1,470,359,215.82
合 计	5,639,708,734.17	5,143,390,372.53

股票质押式回购信用风险敞口

期末余额	阶段 1 未来 12 个月 预期信用损失	阶段 2 整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	合 计
账面余额	3,889,613,176.51	1,667,986,250.36	82,109,307.30	5,639,708,734.17
减值准备	51,061,652.90	84,422,294.02	36,084,351.29	171,568,298.21
担保物金额	11,562,378,838.07	6,486,821,491.00	95,500,344.56	18,144,700,673.63
期初余额	阶段 1 未来 12 个月 预期信用损失	阶段 2 整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	合 计
账面余额	5,017,007,867.19		126,382,505.34	5,143,390,372.53
减值准备	68,036,696.28		38,966,273.63	107,002,969.91
担保物金额	14,336,877,667.53		163,446,329.29	14,500,323,996.82

截至 2020 年 12 月 31 日，公司股票质押式回购业务融出资金在买入返售金融资产科目核算，不存在重分类的情况。

## 8、交易性金融资产

√适用 □不适用

(1) 按类别列示：

单位：元 币种：人民币

类别	期末余额					
	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	11,336,614,425.52		11,336,614,425.52	11,143,784,764.73		11,143,784,764.73
公募基金	472,428,731.52		472,428,731.52	440,573,379.74		440,573,379.74
股票	1,497,670,001.87		1,497,670,001.87	1,398,853,125.84		1,398,853,125.84
银行理财产品	92,511,615.40		92,511,615.40	92,500,000.00		92,500,000.00
券商资管产品	122,308,851.37		122,308,851.37	117,759,824.13		117,759,824.13
信托	11,000,000.00		11,000,000.00	11,000,000.00		11,000,000.00

计划						
其他	5,340,556,831.03		5,340,556,831.03	5,127,528,311.54		5,127,528,311.54
合计	18,873,090,456.71		18,873,090,456.71	18,331,999,405.98		18,331,999,405.98
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	8,100,000,212.84		8,100,000,212.84	7,827,603,229.65		7,827,603,229.65
公募 基金	926,331,059.92		926,331,059.92	904,974,030.73		904,974,030.73
股票	1,052,614,717.02		1,052,614,717.02	994,681,064.14		994,681,064.14
银行 理财 产品	152,298,909.91		152,298,909.91	148,899,000.00		148,899,000.00
券商 资管 产品	29,716,922.03		29,716,922.03	26,795,416.47		26,795,416.47
信托 计划	296,736,319.55		296,736,319.55	292,616,388.32		292,616,388.32
其他	2,915,815,418.04		2,915,815,418.04	2,755,981,177.92		2,755,981,177.92
合计	13,473,513,559.31		13,473,513,559.31	12,951,550,307.23		12,951,550,307.23

其他说明：

适用 不适用

(2) 存在限售期限及有承诺条件的交易性金融资产：

① 存在限售期限的交易性金融资产：

项 目	期末余额	限售期限（注）
金丹科技限售股	3,621,490.78	2021年4月22日
美畅股份限售股	42,725.58	2021年2月24日
南大环境限售股	14,271.63	2021年2月24日
盛德鑫泰限售股	8,288.69	2021年3月1日
万胜智能限售股	8,960.68	2021年3月10日
狄耐克限售股	10,397.61	2021年5月12日
华业香料限售股	5,696.99	2021年3月16日
爱克股份限售股	7,279.64	2021年3月16日
翔丰华限售股	11,126.96	2021年3月17日
品渥食品限售股	14,195.20	2021年3月24日
铜牛信息限售股	11,207.63	2021年3月24日
爱美客限售股	300,936.51	2021年3月29日
熊猫乳品限售股	9,177.28	2021年4月16日
国安达限售股	10,153.32	2021年4月29日
康平科技限售股	10,031.44	2021年5月18日
瑞丰新材限售股	12,699.65	2021年5月27日
特发服务限售股	4,479.50	2021年6月21日
南山智尚限售股	6,199.56	2021年6月22日

中伟股份限售股	26,645.70	2021年6月23日
天秦装备限售股	5,609.80	2021年6月25日
法本信息限售股	7,798.75	2021年6月30日
江天化学限售股	1,339.00	2021年7月7日
金龙鱼限售股	1,037,244.02	2021年4月15日
龙竹科技限售股	10,604,360.00	2021年1月27日
祥生医疗限售股	35,756,640.00	2021年12月2日
特宝生物限售股	67,635,877.50	2022年1月16日
开普云限售股	29,167,171.10	2022年3月26日
吉贝尔限售股	44,292,634.11	2022年5月17日
合计	192,644,638.63	

注：限售期限为根据交易所关于上市公司股东及董监高减持股份实施细则的规定，能减持所持有的所有该次非公开发行股份的期限。

② 有承诺条件的交易性金融资产：

项目	限售条件或变现方面的其他重大限制	期末余额
债券	为质押式回购交易设定质押	4,532,116,973.10
债券	为债券借贷交易设定质押	205,134,600.00
债券	充抵期货保证金	61,371,720.00
永续债	为质押式回购交易设定质押	2,655,182,918.80
基金	已融出证券	86,007,614.30
合计		7,539,813,826.20

## 9、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
公司债	166,703,071.07	3,431,319.34	216,202.65	169,918,187.76	149,728,545.95	3,436,345.15	191,679.20	152,973,211.90
合计	166,703,071.07	3,431,319.34	216,202.65	169,918,187.76	149,728,545.95	3,436,345.15	191,679.20	152,973,211.90

其他说明：

截至 2020 年 12 月 31 日，公司无有承诺条件的债权投资。

10、其他债权投资

√适用 □不适用

(1) 按类别列示：

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	196,387,185.75	643,176.79	129,514.25	197,159,876.79		261,357,380.59	871,602.43	1,470,639.41	263,699,622.43	
企业债	652,694,285.73	17,396,259.73	-5,665,665.73	664,424,879.73	843,004.04	395,599,984.65	11,725,771.88	-9,436,904.65	397,888,851.88	602,438.88
公司债	6,985,300.00		-5,333,996.04	1,651,303.96	5,663,623.03	6,985,200.00		-2,477,147.51	4,508,052.49	5,383,319.01
其他	153,182,260.68	2,930,116.97	-4,790.68	156,107,586.97	120,866.16	124,572,897.07	2,994,761.77	2,088,162.93	129,655,821.77	179,181.74
合计	1,009,249,032.16	20,969,553.49	-10,874,938.20	1,019,343,647.45	6,627,493.23	788,515,462.31	15,592,136.08	-8,355,249.82	795,752,348.57	6,164,939.63

其他说明：

(2) 有承诺条件的其他债权投资：

项目	限售条件或变现方面的其他重大限制	期末余额
债券	为质押式回购交易设定质押	197,174,600.00
合计		197,174,600.00

## 11、其他权益工具投资

### (1). 按项目披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
专户投资	2,300,000,000.00	2,412,303,104.51		2,300,000,000.00	2,358,574,749.57	150,997,214.80	非交易性权益工具投资
股权投资	307,455,164.20	276,907,042.34		307,455,164.20	264,617,041.84		非交易性权益工具投资
合计	2,607,455,164.20	2,689,210,146.85		2,607,455,164.20	2,623,191,791.41	150,997,214.80	/

### (2). 本期终止确认的其他权益工具

□适用 √不适用

## 12、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备		
一、合营企业										
小计										
二、联营企业										
国金基金管理有限公司	118,595,070.98			5,085,283.87						123,680,354.85
上海国金鼎兴一期股权投资基金中心（有限合伙）[注]				11,128,090.13			-11,128,090.13			
宁波鼎智金通股权投资中心（有限合伙）	447,728,021.37		-6,440,443.95	-1,295.41						441,286,282.01
国金涌富资产管理有限公司	8,607,602.39			-1,141,382.78						7,466,219.61
小计	574,930,694.74		-6,440,443.95	15,070,695.81			-11,128,090.13			572,432,856.47
合计	574,930,694.74		-6,440,443.95	15,070,695.81			-11,128,090.13			572,432,856.47

其他说明：

注：公司投资本金已收回，截至 2020 年 12 月 31 日该基金尚处于清算期。

## 13、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	办公及其他设备	运输工具	电子设备	合计
----	--------	---------	------	------	----

一、账面原值：					
1.期初余额	6,624,282.82	29,584,420.29	24,450,418.77	246,021,372.95	306,680,494.83
2.本期增加金额		1,909,637.12	1,092,710.82	62,734,978.72	65,737,326.66
(1) 购置		2,164,511.65	1,157,289.33	62,989,457.71	66,311,258.69
(2) 在建工程转入					
(3) 企业合并增加					
(4) 外币报表折算差额		-254,874.53	-64,578.51	-254,478.99	-573,932.03
3.本期减少金额		1,542,887.33	1,748,431.87	29,205,239.51	32,496,558.71
(1) 处置或报废		1,487,014.33	1,748,431.87	29,205,239.51	32,440,685.71
(2) 其他减少		55,873.00			55,873.00
4.期末余额	6,624,282.82	29,951,170.08	23,794,697.72	279,551,112.16	339,921,262.78
二、累计折旧					
1.期初余额	4,659,519.62	21,463,157.78	18,828,235.68	179,643,371.12	224,594,284.20
2.本期增加金额	268,258.44	2,868,518.32	1,968,873.60	34,404,553.87	39,510,204.23
(1) 计提	268,258.44	3,114,156.37	2,017,559.91	34,665,792.29	40,065,767.01
(2) 外币报表折算差额		-245,638.05	-48,686.31	-261,238.42	-555,562.78
3.本期减少金额		1,482,024.13	1,695,978.91	28,319,967.32	31,497,970.36
(1) 处置或报废		1,430,928.66	1,695,978.91	28,319,967.32	31,446,874.89
(2) 其他减少		51,095.47			51,095.47
4.期末余额	4,927,778.06	22,849,651.97	19,101,130.37	185,727,957.67	232,606,518.07
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	1,696,504.76	7,101,518.11	4,693,567.35	93,823,154.49	107,314,744.71
2.期初账面价值	1,964,763.20	8,121,262.51	5,622,183.09	66,378,001.83	82,086,210.63

其他说明：

适用 不适用

截至 2020 年 12 月 31 日，公司无暂时闲置的固定资产，无通过融资租赁租入的固定资产，无通过经营租赁租出的固定资产，无未办妥产权证书的固定资产。

#### 14、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	计算机软件	交易席位费	期货会员资格 [注]	其他	合计
一、账面原值					
1.期初余额	178,420,170.18	14,507,291.61	1,847,890.00	7,745,397.50	202,520,749.29
2.本期增加金额	38,266,565.01		-27,070.00		38,239,495.01
(1)购置	38,266,565.01				38,266,565.01
(2)内部研发					
(3)企业合并增加					
(4) 外币报表折算差额			-27,070.00		-27,070.00
3.本期减少金额	15,659,709.96	40,098.99			15,699,808.95
(1)处置	15,659,709.96	40,098.99			15,699,808.95
4.期末余额	201,027,025.23	14,467,192.62	1,820,820.00	7,745,397.50	225,060,435.35
二、累计摊销					

1.期初余额	116,029,713.10	14,507,291.61		6,778,978.44	137,315,983.15
2.本期增加金额	32,699,946.27			369,079.56	33,069,025.83
(1) 计提	32,699,946.27			369,079.56	33,069,025.83
3.本期减少金额	15,659,059.17	40,098.99			15,699,158.16
(1)处置	15,659,059.17	40,098.99			15,699,158.16
4.期末余额	133,070,600.20	14,467,192.62		7,148,058.00	154,685,850.82
三、减值准备					
1.期初余额					
2.本期增加金额					
(1) 计提					
3.本期减少金额					
(1)处置					
4.期末余额					
四、账面价值					
1.期末账面价值	67,956,425.03		1,820,820.00	597,339.50	70,374,584.53
2.期初账面价值	62,390,457.08		1,847,890.00	966,419.06	65,204,766.14

其他说明：

适用 不适用

注：期货会员资格投资系公司子公司国金期货有限责任公司和国金证券（香港）有限公司向期货交易所缴纳的会员资格费，由于期货会员资格的使用寿命不确定，未对其进行摊销。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司无通过内部研发形成的无形资产，无未办妥产权证书的土地使用权，无用于抵押或担保的无形资产。

## 15、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	其他	处置	其他	
国金期货有限责任公司	11,632,798.02					11,632,798.02
国金证券（香港）有限公司	100,295,450.68		-6,061,751.44			94,233,699.24
国金财务（香港）有限公司	405.46					405.46
合计	111,928,654.16		-6,061,751.44			105,866,902.72

### (2). 商誉减值准备

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
		计提	其他	处置	其他	
国金证券（香港）有限公司	65,876,288.25		-3,981,493.50			61,894,794.75
国金财务（香港）有限公司	405.46					405.46
合计	65,876,693.71		-3,981,493.50			61,895,200.21



**(3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息**

√适用 □不适用

公司将国金期货有限责任公司经纪业务、国金证券（香港）有限公司分别确认为单个资产组。

本年末商誉所在资产组与购买日、以前年度商誉减值测试时所确认的资产组组合一致。

公司 2007 年通过非同一控制下企业合并方式获得国金期货有限责任公司 95.50% 股权，合并成本超过国金期货有限责任公司可辨认净资产公允价值的差额 11,632,798.02 元确认为商誉。公司 2015 年通过非同一控制下企业合并的方式获得粤海证券有限公司（后更名为国金证券（香港）有限公司）99.9999967% 股权，合并成本超过粤海证券有限公司可辨认净资产公允价值的差额港币 111,964,378.17 元确认为商誉，该商誉按 2019 年 12 月 31 日期末汇率折算人民币为 100,295,450.68 元，按 2020 年 12 月 31 日期末汇率折算人民币为 94,233,699.24 元。

**(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

商誉的可收回金额按照资产组的预计未来现金流量的现值计算。未来现金流量基于 2021 年至 2025 年的财务预算确定，超过 5 年的现金流量以 2025 年的预算数零增长永续计算。折现率主要根据加权平均资金成本、权益资本成本作适当调整后确定。其他假设涉及基于过往表现及管理层对市场发展预期的预算收入及各项业务费率等。

公司对包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，比较这些相关资产组或者资产组组合的账面价值（包括所分摊的商誉的账面价值部分）与其可收回金额，如相关资产组或者资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认商誉的减值损失。

**(5). 商誉减值测试的影响**

√适用 □不适用

**① 国金期货有限责任公司：**

公司聘请开元资产评估有限公司对包含商誉的资产组的可回收金额进行评估，评估机构出具了评估报告（开元评报字[2021]084 号）。根据测算，本期期末包含商誉的资产组的可收回金额高于账面价值，商誉并未发生减值。

**② 国金证券（香港）有限公司：**

公司聘请开元资产评估有限公司对包含商誉的资产组的可回收金额进行评估，评估机构出具了评估报告（开元评报字[2021]062 号）。根据测算，本期期末包含商誉的资产组的可收回金额高于账面价值，商誉并未发生减值。

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

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产/信用减值准备	221,590,207.56	55,397,551.96	131,827,412.69	32,956,853.28
交易性金融工具公允价值变动	28,159,013.84	7,039,753.47	8,784,592.50	2,196,148.13
衍生金融工具公允价值变动			45,929,228.38	11,482,307.10
其他债权投资公允价值变动	10,874,938.20	2,718,734.55	8,355,249.82	2,088,812.46
其他权益工具投资公允价值变动	30,548,121.86	7,637,030.47	42,838,122.36	10,709,530.59
已计提未发放的职工薪酬等	1,372,384,054.76	343,096,013.68	992,624,330.73	248,156,082.67
可抵扣亏损	175,032.58	43,758.15		
期货风险准备金差异	1,637,996.88	409,499.22	1,637,996.88	409,499.22
其他	18,958,412.82	4,687,320.06	1,752,848.39	382,566.02
合计	1,684,327,778.50	421,029,661.56	1,233,749,781.75	308,381,799.47

(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
交易性金融工具公允价值变动	277,494,690.05	69,373,672.53	269,402,302.78	67,350,575.71
衍生金融工具公允价值变动	34,890,570.01	8,722,642.50		
其他权益工具投资公允价值变动	112,303,104.51	28,075,776.13	58,574,749.57	14,643,687.39
其他	8,027,051.77	2,006,762.95	15,431,037.82	3,857,759.45
合计	432,715,416.34	108,178,854.11	343,408,090.17	85,852,022.55

(3). 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
可抵扣暂时性差异	17,570,135.72	15,220,640.82
可抵扣亏损	55,977,855.01	59,572,923.11
合计	73,547,990.73	74,793,563.93

(4). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

年份	期末金额	期初金额	备注
2020 年		414,564.98	

2021 年	17,965.09	1,422,153.04	
2022 年	0.63	1,002,584.41	
2023 年		2,794,110.69	
2024 年	15,099,323.44	24,130,538.21	
2025 年	15,587,068.62		
其他	25,273,497.23	29,808,971.78	
合计	55,977,855.01	59,572,923.11	/

其他说明：

适用 不适用

注：根据《香港法例》第 112 章《税务条例》第 19 条规定，对亏损的相关处理为：纳税人在香港经营而产生的亏损，准予其在以后连续的各纳税年度抵销，无抵销年限。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司无以抵销后净额列示的递延所得税资产和负债。

### 17、其他资产

适用 不适用

(1) 按类别列示：

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
应收股利	5,485,050.00	5,485,050.00
其他应收款	103,624,004.29	103,443,858.12
应收融资融券客户款	0.00	0.00
长期待摊费用	22,982,928.44	28,570,697.52
应收结算担保金	10,062,323.89	10,063,929.43
发放贷款		9,048,486.80
其他	5,951,216.42	2,559,438.23
合计	148,105,523.04	159,171,460.10

(2) 其他应收款：

①按明细列示：

项目	期末余额	年初余额
其他应收款余额	135,910,316.51	114,064,021.39
减：坏账准备	32,286,312.22	10,620,163.27
其他应收款净值	103,624,004.29	103,443,858.12

②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
企业往来款	45,595,835.78	28,068,213.66
员工借备用金	58,122.81	267,677.71
押金及保证金	28,415,835.39	23,187,720.33
其他	61,840,522.53	62,540,409.69
合计	135,910,316.51	114,064,021.39

③按账龄分析：

账 龄	期末余额		期初余额	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1 年以内	68,969,733.21	50.75	54,941,131.47	48.16
1-2 年	15,782,242.76	11.61	24,875,051.73	21.81
2-3 年	19,857,759.47	14.61	29,392,559.23	25.77
3-4 年	29,137,949.10	21.44	2,725,580.61	2.39
4 年以上	2,162,631.97	1.59	2,129,698.35	1.87
合 计	135,910,316.51	100.00	114,064,021.39	100.00

④按计提坏账列示:

种 类	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备:				
单项计提	25,032,933.62	18.42	18,809,914.90	75.14
单项小计	25,032,933.62	18.42	18,809,914.90	75.14
组合计提坏账准备:				
按信用风险特征组合计提	110,877,382.89	81.58	13,476,397.32	12.15
组合小计	110,877,382.89	81.58	13,476,397.32	12.15
合 计	135,910,316.51	100.00	32,286,312.22	23.76
种 类	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备:				
单项计提	27,765,735.41	24.34	4,184,195.34	15.07
单项小计	27,765,735.41	24.34	4,184,195.34	15.07
组合计提坏账准备:				
按信用风险特征组合计提	86,298,285.98	75.66	6,435,967.93	7.46
组合小计	86,298,285.98	75.66	6,435,967.93	7.46
合 计	114,064,021.39	100.00	10,620,163.27	9.31

⑤期末其他应收款情况:

单位名称	金额	坏账准备	年限	占其他应收款总额比例 (%)	性质或内容

恒生电子股份有限公司	26,019,570.02	1,748,530.46	1 年以内, 1-2 年, 2-3 年	23.42	购软件预付款
深圳市中恒汇志投资有限公司	25,000,000.00	18,809,914.90	3-4 年	5.97	应收资管产品本金补偿
上海东上海联合置业有限公司	7,726,138.00	2,105,982.64	1 年以内, 1-2 年, 2-3 年	5.42	房租及押金
西藏聚富投资管理有限公司	7,339,098.74	653,827.27	1 年以内, 1-2 年	6.45	应收减资款等
宁波同兴嘉华股权投资管理中心(有限合伙)	5,000,000.00	1,500,000.00	2-3 年	3.38	应收股权转让款
其他	64,825,509.75	7,468,056.95		55.36	
合计	135,910,316.51	32,286,312.22		100.00	

## ⑥ 应收关联方款项:

本期末其他应收款中无持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东单位欠款情况。

其他资产的说明:

## (3) 应收融资融券客户款:

项 目	期末余额			期初余额		
	账面余额	坏账准备	净值	账面余额	坏账准备	净值
应收融资融券客户款	654,690.00	654,690.00	0.00	4,133,866.83	4,133,866.83	0.00

## (4) 长期待摊费用:

项 目	期初余额	本期增加	本期摊销	本期其他减少	期末余额
经营租入固定资产改良支出	28,570,697.52	7,607,014.74	12,852,737.37	342,046.45	22,982,928.44
合计	28,570,697.52	7,607,014.74	12,852,737.37	342,046.45	22,982,928.44

## (5) 应收结算担保金:

交易所名称	期末余额	期初余额
中国金融期货交易所	10,062,323.89	10,063,929.43
合计	10,062,323.89	10,063,929.43

## (6) 发放贷款:

项 目	期末余额	期初余额
发放贷款余额		9,165,424.63
减: 坏账准备		116,937.83
发放贷款净值		9,048,486.80

## 18、融券业务情况

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	180,660,766.40	63,528,201.02
—交易性金融资产	86,007,614.30	54,338,477.40
—转融通融入证券	94,653,152.10	9,189,723.62
转融通融入证券总额	152,001,256.00	10,262,000.00

融券业务的说明:

截至 2020 年 12 月 31 日, 公司融券业务无违约情况。

### 19、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			外币报表折算 差额	期末余额
			转回	转/核销	其他		
融出资金 减值准备	23,298,231.50	7,551,002.29				-906,111.84	29,943,121.95
应收款项 坏账准备	1,533,007.85	3,900,963.61	927,819.38			-30,300.00	4,475,852.08
买入返售 金融资产 减值准备	107,154,167.03	66,205,374.04	135,330.95	1,640,045.74			171,584,164.38
债权投资 减值准备	191,679.20	29,659.10	2,720.52			-2,415.13	216,202.65
其他债权 投资减值 准备	6,164,939.63	971,299.89		508,746.29			6,627,493.23
其他应收 款坏账准 备	10,620,163.27	21,688,836.02	4,665.57	2,000.00	16,021.50		32,286,312.22
其他信用 减值准备	4,250,804.66	1,046,881.55	721,555.87	3,922,371.78		931.44	654,690.00
金融工具 及其他项 目信用减 值准备小 计	153,212,993.14	101,394,016.50	1,792,092.29	6,073,163.81	16,021.50	-937,895.53	245,787,836.51
商誉减值 准备	65,876,693.71					-3,981,493.50	61,895,200.21
其他资产 减值准备 小计	65,876,693.71					-3,981,493.50	61,895,200.21
合计	219,089,686.85	101,394,016.50	1,792,092.29	6,073,163.81	16,021.50	-4,919,389.03	307,683,036.72

### 20、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	16,821,357.92	302,579.92	12,819,184.11	29,943,121.95

应收款项坏账准备（简化模型）	/	267,652.08	4,208,200.00	4,475,852.08
买入返售金融资产减值准备	51,077,519.07	84,422,294.02	36,084,351.29	171,584,164.38
债权投资减值准备	161,771.54	54,431.11		216,202.65
其他债权投资减值准备	963,870.20		5,663,623.03	6,627,493.23
其他应收款坏账准备		2,219,576.34	30,066,735.88	32,286,312.22
其他信用减值准备			654,690.00	654,690.00
合计	69,024,518.73	87,266,533.47	89,496,784.31	245,787,836.51
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	9,725,575.73	168,721.71	13,403,934.06	23,298,231.50
应收款项坏账准备（简化模型）	/	189,337.85	1,343,670.00	1,533,007.85
买入返售金融资产减值准备	68,187,893.40		38,966,273.63	107,154,167.03
债权投资减值准备	191,679.20			191,679.20
其他债权投资减值准备	781,620.62		5,383,319.01	6,164,939.63
其他应收款坏账准备		2,987,101.81	7,633,061.46	10,620,163.27
其他信用减值准备	116,937.83		4,133,866.83	4,250,804.66
合计	79,003,706.78	3,345,161.37	70,864,124.99	153,212,993.14

## 21、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	25,277,560.23	26,921,812.03
质押借款[注1]	143,078,800.00	183,781,728.65
保证借款[注2]	84,164,000.00	35,831,200.00
合计	252,520,360.23	246,534,740.68

短期借款分类的说明：

注 1：该款项系子公司国金证券（香港）有限公司在客户同意下，以其给予客户的融资款而取得的质押品（持有的上市公司股份）作为质押物借入。

注 2：该款项系子公司国金证券（香港）有限公司在本公司的担保下向银行取得的短期借款。截至 2020 年 12 月 31 日，公司无已逾期未偿还的短期借款。

### (2). 已逾期未偿还的短期借款情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

## 22、应付短期融资款

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率（%）	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
短期收益凭证	1.00	2019/1/8 至 2020/12/30	12 天至 365 天	8,384,390,000.00	3.00-6.66	3,332,214,079.93	5,206,598,284.45	5,038,736,374.44	3,500,075,989.94

短期融资券	100.00	2020/3/23 至 2020/12/14	88 天至 91 天	10,900,000,000.00	1.60-3.25		10,956,649,452.06	7,441,898,082.20	3,514,751,369.86
短期公司债券	100.00	2020/11/5	315 天	1,000,000,000.00	3.34		1,005,215,890.41		1,005,215,890.41
合计	/	/	/	20,284,390,000.00	/	3,332,214,079.93	17,168,463,626.92	12,480,634,456.64	8,020,043,250.21

### 23、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	1,157,635,555.53	200,956,944.44
合计	1,157,635,555.53	200,956,944.44

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	606,624,444.42	2.50%-2.80%		
1 至 3 个月	551,011,111.11	2.80%		
3 至 12 个月			200,956,944.44	3.25%
合计	1,157,635,555.53		200,956,944.44	

### 24、交易性金融负债

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
债券	48,019,584.00		48,019,584.00	279,656,448.00		279,656,448.00
结构化主体		157,711,868.13	157,711,868.13		120,099,617.86	120,099,617.86
其他	1,443,000,000.00	350,094,169.68	1,793,094,169.68	954,240,000.00	853,443,528.52	1,807,683,528.52
合计	1,491,019,584.00	507,806,037.81	1,998,825,621.81	1,233,896,448.00	973,543,146.38	2,207,439,594.38

### 25、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	193,808,219.18	
质押式卖出回购	6,330,015,821.04	2,867,625,222.31
合计	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31

(2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31
合计	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31



(3) 担保物金额

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	7,541,683,491.90	3,540,682,475.95
合计	7,541,683,491.90	3,540,682,475.95

(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

26、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	9,584,843,755.75	7,911,791,493.35
机构	3,085,298,235.61	2,663,256,627.31
应付期货保证金	1,646,072,990.84	1,610,629,777.25
小计	14,316,214,982.20	12,185,677,897.91
信用业务		
其中：个人	1,747,636,363.11	1,209,370,252.92
机构	328,976,275.45	200,837,589.02
小计	2,076,612,638.56	1,410,207,841.94
合计	16,392,827,620.76	13,595,885,739.85

27、应付职工薪酬

(1). 应付职工薪酬列示

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,848,321,241.25	2,836,785,858.95	1,996,079,844.73	2,689,027,255.47
二、离职后福利-设定提存计划	539,823.75	7,658,929.73	8,138,579.47	60,174.01
三、辞退福利	94,412.50	2,870,065.35	2,254,232.85	710,245.00
合计	1,848,955,477.50	2,847,314,854.03	2,006,472,657.05	2,689,797,674.48

(2). 短期薪酬列示

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,818,860,232.03	2,674,360,382.05	1,850,939,687.15	2,642,280,926.93
二、职工福利费	6,300.00	1,758,995.13	1,763,420.13	1,875.00
三、社会保险费	324,064.59	51,866,397.72	51,770,322.58	420,139.73
其中：医疗保险费	290,671.72	47,737,028.16	47,626,216.73	401,483.15
工伤保险费	4,745.27	82,828.83	87,166.40	407.70
生育保险费	28,647.60	4,046,540.73	4,056,939.45	18,248.88
四、住房公积金	290,276.00	53,946,016.49	53,921,497.20	314,795.29

五、工会经费和职工教育经费	28,840,368.63	54,193,276.88	37,024,126.99	46,009,518.52
六、其他		660,790.68	660,790.68	
合计	1,848,321,241.25	2,836,785,858.95	1,996,079,844.73	2,689,027,255.47

**(3). 设定提存计划列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	519,068.99	7,401,939.18	7,862,795.09	58,213.08
2、失业保险费	20,754.76	256,990.55	275,784.38	1,960.93
合计	539,823.75	7,658,929.73	8,138,579.47	60,174.01

其他说明：

□适用 √不适用

**28、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	21,166,528.94	16,520,126.85
企业所得税	389,129,410.10	121,500,635.21
个人所得税	22,345,634.04	12,775,664.69
城市维护建设税	1,574,352.05	1,520,575.64
教育费附加及地方教育费附加	1,273,047.33	1,161,283.67
其他	18,688,976.41	3,909,025.73
合计	454,177,948.87	157,387,311.79

**29、应付款项****(1). 应付款项列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付清算款项	608,649,671.06	477,798,979.30
应付手续费及佣金	8,603,823.59	12,783,318.37
应付资管产品费用	7,579,435.23	28,580.33
其他	4,978,352.17	15,156,575.18
合计	629,811,282.05	505,767,453.18

**30、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	6,428,633.64	7,129,155.73
合计	6,428,633.64	7,129,155.73

**(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

### 31、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
公司债券 18 国金 01	100.00	2018/4/2	2 年	1,500,000,000.00	5.75	1,564,986,986.34	21,267,123.25	1,586,254,109.59	
公司债券 18 国金 02	100.00	2018/4/2	3 年	1,500,000,000.00	5.85	1,566,108,904.14	87,509,589.04	87,745,890.41	1,565,872,602.77
公司债券 20 国金 01	100.00	2020/2/26	2 年	1,500,000,000.00	3.03		1,538,601,369.89		1,538,601,369.89
公司债券 20 国金 02	100.00	2020/2/26	3 年	1,000,000,000.00	3.18		1,027,008,219.19		1,027,008,219.19
公司债券 20 国金 03	100.00	2020/5/25	1 年	1,500,000,000.00	1.99		1,518,073,561.65		1,518,073,561.65
次级债券 19 国金 C1	100.00	2019/6/24	3 年	1,000,000,000.00	4.60	1,024,071,232.90	46,000,000.04	46,000,000.00	1,024,071,232.94
合计				8,000,000,000.00		4,155,167,123.38	4,238,459,863.06	1,720,000,000.00	6,673,626,986.44

### 32、其他负债

√适用 □不适用

(1) 按类别列示：

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付股利	1,770,399.20	1,760,879.20
其他应付款	71,583,754.25	69,220,025.70
期货风险准备金	25,776,527.36	24,858,544.05
其他	329,865.84	18,660.21
合计	99,460,546.65	95,858,109.16

(2) 其他应付款：

其他应付款按款项性质列示：

√适用 □不适用

① 按明细列示：

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付证券投资者保护基金	15,795,297.11	13,080,444.06
应付期货投资者保障基金	279,895.54	250,853.88
应付社保及公积金	274,355.15	2,447,634.75
其他	55,234,206.45	53,441,093.01
合计	71,583,754.25	69,220,025.70

② 应付关联方款项：

本期末其他应付款中无应付持有本公司 5%以上（含 5%）表决权股份的股东单位的款项。

(3) 应付股利：

单位名称	期末余额	年初余额
部分法人股东	481,050.00	481,050.00
成都市财政局	1,210,000.00	1,210,000.00
无限售条件的流通股股东	79,349.20	69,829.20
合计	1,770,399.20	1,760,879.20

**33、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	3,024,359,310						3,024,359,310

其他说明：

截至 2020 年 12 月 31 日，公司股份全部为无限售条件的人民币普通股。

**34、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）[注]	7,835,907,645.66	0.79	0.04	7,835,907,646.41
其他资本公积	16,217,909.02			16,217,909.02
合计	7,852,125,554.68	0.79	0.04	7,852,125,555.43

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

注：资本溢价（股本溢价）本期增加系公司子公司国金金融控股（香港）有限公司以发行股份为对价，从母公司和少数股东处取得国金证券（香港）有限公司和国金财务（香港）有限公司 100%的股权所致；本期减少系母公司购买公司子公司国金金融控股（香港）有限公司的少数股权所致。

### 35、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						期末余额	
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司		税后归属于少数股东
一、不能重分类进损益的其他综合收益	11,802,470.41	66,018,355.44	16,504,588.86			49,513,766.58	49,513,766.58		61,316,236.99
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益									
其他权益工具投资公允价值变动	11,802,470.41	66,018,355.44	16,504,588.86			49,513,766.58	49,513,766.58		61,316,236.99
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	37,633,180.08	-13,805,463.38	701,103.60	3,646,161.87		-18,152,728.85	-18,152,728.71	-0.14	19,480,451.37
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	77,138.97								77,138.97
其他债权投资公允价值变动	-6,266,437.37	1,745,783.63	436,445.91	3,199,104.00		-1,889,766.28	-1,889,766.28		-8,156,203.65
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	4,623,704.73	1,058,630.75	264,657.69	447,057.87		346,915.19	346,915.19		4,970,619.92
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	39,198,773.75	-16,609,877.76				-16,609,877.76	-16,609,877.62	-0.14	22,588,896.13
其他综合收益合计	49,435,650.49	52,212,892.06	17,205,692.46	3,646,161.87		31,361,037.73	31,361,037.87	-0.14	80,796,688.36

项目	期初余额	上期发生金额						期末余额	
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司		税后归属于少数股东
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-76,078,587.87	117,174,744.37	29,293,686.09			87,881,058.28	87,881,058.28		11,802,470.41
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益									
其他权益工具投资公允价值变动	-76,078,587.87	117,174,744.37	29,293,686.09			87,881,058.28	87,881,058.28		11,802,470.41
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	2,301,141.31	9,928,102.10	942,589.18	-26,346,525.90		35,332,038.82	35,332,038.77	0.05	37,633,180.08
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	222,108.77	-144,969.80				-144,969.80	-144,969.80		77,138.97
其他债权投资公允价值变动	-32,013,638.83	-1,977,847.10	-494,461.77	-27,230,586.79		25,747,201.46	25,747,201.46		-6,266,437.37
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	1,196,612.76	5,748,203.81	1,437,050.95	884,060.89		3,427,091.97	3,427,091.97		4,623,704.73
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	32,896,058.61	6,302,715.19				6,302,715.19	6,302,715.14	0.05	39,198,773.75
其他综合收益合计	-73,777,446.56	127,102,846.47	30,236,275.27	-26,346,525.90		123,213,097.10	123,213,097.05	0.05	49,435,650.49

**36、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	1,118,710,112.75	179,416,391.46		1,298,126,504.21
合计	1,118,710,112.75	179,416,391.46		1,298,126,504.21

**37、一般风险准备**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	1,120,088,743.33	179,433,695.97			1,299,522,439.30
交易风险准备	1,097,971,119.06	179,416,391.46			1,277,387,510.52
合计	2,218,059,862.39	358,850,087.43			2,576,909,949.82

一般风险准备的说明：

注：公司每年末按税后利润的 10% 计提一般风险准备金，按税后利润的 10% 计提交易风险准备金；根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，每月按照不低于公募基金托管费收入的 2.5% 提取一般风险准备金。

**38、未分配利润**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	6,459,920,120.98	5,639,594,753.21
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		17,300,919.47
调整后期初未分配利润	6,459,920,120.98	5,656,895,672.68
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,862,640,224.66	1,298,539,701.33
减：提取法定盈余公积	179,416,391.46	124,846,960.21
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备	358,850,087.43	249,693,920.42
应付普通股股利	151,217,965.50	120,974,372.40
转作股本的普通股股利		
期末未分配利润	7,633,075,901.25	6,459,920,120.98

**39、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	1,660,208,049.13	1,352,680,715.66
其中：货币资金及结算备付金利息收入	513,759,897.01	412,895,042.16
融出资金利息收入	802,787,752.82	534,341,042.50
买入返售金融资产利息收入	304,562,045.47	344,408,041.01
其中：约定购回利息收入	193,299.35	1,178,040.90
股权质押回购利息收入	297,392,354.58	338,283,565.72

债权投资利息收入	8,619,631.91	16,618,941.78
其他债权投资利息收入	29,486,125.52	41,998,055.74
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	992,596.40	2,419,592.47
利息支出	715,054,436.77	581,883,083.89
其中：短期借款利息支出	6,102,618.27	8,304,640.95
应付短期融资款利息支出	177,853,626.92	84,566,736.60
拆入资金利息支出	58,836,849.98	59,298,530.38
其中：转融通利息支出	23,703,194.44	956,944.44
卖出回购金融资产款利息支出	154,127,012.96	146,639,702.16
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	57,108,884.65	41,774,869.79
应付债券利息支出	238,459,863.06	223,004,911.92
其中：次级债券利息支出	46,000,000.04	24,071,232.90
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	22,565,580.93	18,293,692.09
利息净收入	945,153,612.36	770,797,631.77

#### 40、手续费及佣金净收入

##### (1) 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	1,579,561,997.73	1,094,858,240.97
证券经纪业务收入	2,055,156,129.54	1,405,358,799.55
其中：代理买卖证券业务	1,624,922,740.14	1,141,414,238.07
交易单元席位租赁	228,614,245.57	152,723,258.05
代销金融产品业务	201,619,143.83	111,221,303.43
证券经纪业务支出	475,594,131.81	310,500,558.58
其中：代理买卖证券业务	475,594,131.81	310,500,558.58
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
2. 期货经纪业务净收入	71,737,265.59	45,502,507.87
期货经纪业务收入	157,654,145.10	131,262,839.85
期货经纪业务支出	85,916,879.51	85,760,331.98
3. 投资银行业务净收入	1,666,180,012.93	901,273,881.41
投资银行业务收入	1,695,349,871.85	928,874,062.52
其中：证券承销业务	1,534,631,783.08	724,889,966.96
证券保荐业务	88,560,584.91	59,799,906.88
财务顾问业务	72,157,503.86	144,184,188.68
投资银行业务支出	29,169,858.92	27,600,181.11
其中：证券承销业务	27,939,268.61	27,054,919.61
证券保荐业务		
财务顾问业务	1,230,590.31	545,261.50
4. 资产管理业务净收入	113,701,706.91	96,265,359.51
资产管理业务收入	127,796,478.50	101,772,610.79
资产管理业务支出	14,094,771.59	5,507,251.28
5. 基金管理业务净收入	43,941,303.21	34,354,278.99

基金管理业务收入	43,941,303.21	34,354,278.99
基金管理业务支出		
6.投资咨询业务净收入	94,289,144.85	81,584,191.63
投资咨询业务收入	94,289,144.85	81,584,191.63
投资咨询业务支出		
7.其他手续费及佣金净收入	117,200,495.69	75,791,263.14
其他手续费及佣金收入	117,200,495.69	75,791,263.14
其他手续费及佣金支出		
合计	3,686,611,926.91	2,329,629,723.52
其中：手续费及佣金收入	4,291,387,568.74	2,758,998,046.47
手续费及佣金支出	604,775,641.83	429,368,322.95

## (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	13,933,962.26	103,955,660.39
并购重组财务顾问业务净收入--其他	1,620,754.73	2,147,735.85
其他财务顾问业务净收入	55,372,196.56	37,535,530.94

## (3) 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	410,742,419,741.22	193,389,460.54	326,047,628,917.66	91,288,923.85
信托	2,723,353,000.00	4,624,374.64	2,454,390,000.00	16,904,509.91
其他	13,714,982,572.09	3,605,308.65	13,430,266,281.28	3,027,869.67
合计	427,180,755,313.31	201,619,143.83	341,932,285,198.94	111,221,303.43

## (4) 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	48	123	28
期末客户数量	2,720	123	261
其中：个人客户	2,682	15	4
机构客户	38	108	257
期初受托资金	3,243,021,212.97	84,310,393,796.02	16,730,549,361.42
其中：自有资金投入	51,866,299.21	3,443,850,729.85	22,475,000.00
个人客户	1,944,249,709.44	60,000,100.38	9,753,009.92
机构客户	1,246,905,204.32	80,806,542,965.79	16,698,321,351.50
期末受托资金	4,254,747,262.15	71,266,471,440.26	11,554,692,483.30
其中：自有资金投入	43,339,838.83	3,464,638,639.20	16,000,000.00
个人客户	3,411,862,243.22	602,840,383.59	87,065,250.14
机构客户	799,545,180.10	67,198,992,417.47	11,451,627,233.16
期末主要受托资产初始成本	3,726,640,913.65	73,541,787,637.36	11,541,974,948.35
其中：股票	980,521,745.72	8,070,608,747.72	13,579,765.71



国债	71,749,665.06		
其他债券	2,604,816,560.85	3,769,640,853.10	294,574,000.00
基金	108,819,852.79	12,672,660.20	65,249,982.64
其他[注1]	-39,266,910.77	61,688,865,376.34	11,168,571,200.00
当期资产管理业务净收入	31,392,231.98	64,409,659.13	17,899,815.80

注 1：产品正回购交易融入资金期末余额在该项扣减。

#### 41、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	15,070,695.81	-2,291,326.02
处置长期股权投资产生的投资收益	239,102.49	1,346,730.79
金融工具投资收益	1,324,475,750.67	994,945,490.42
其中：持有期间取得的收益	727,427,984.80	831,394,292.69
— 交易性金融工具	727,427,984.80	680,397,077.89
— 其他权益工具投资		150,997,214.80
处置金融工具取得的收益	597,047,765.87	163,551,197.73
— 交易性金融工具	444,785,597.13	178,231,966.22
— 其他债权投资	2,063,690.04	-9,512,670.89
— 衍生金融工具	150,198,478.70	-5,168,097.60
合计	1,339,785,548.97	994,000,895.19

公司本期不存在投资收益汇回的重大限制。

##### (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	727,427,984.80	680,397,077.89
	处置取得收益	484,460,855.82	177,845,092.18
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益	-8,833,321.65	9,992,751.42
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益	-30,841,937.04	-9,605,877.38

#### 42、其他收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
手续费返还收入	12,638,092.87	10,966,498.76
进项税加计扣除收益	18,361.81	41,714.50
合计	12,656,454.68	11,008,213.26

**43、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	-2,139,088.89	252,551,842.07
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债	-7,557,956.55	26,511,694.11
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	15,539,351.77	-14,570,563.00
衍生金融工具	80,819,798.39	-33,661,813.61
合计	71,122,752.95	245,401,722.57

**44、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
融资业务其他收入	2,859,843.10	11,987.98
其他	159,098.01	25,384.31
合计	3,018,941.11	37,372.29

**45、资产处置收益**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
非流动资产处置利得	73,950.03	-73,961.95
合计	73,950.03	-73,961.95

**46、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	19,911,520.66	12,508,432.17	详见本财务报表附注税项之说明
教育费附加	8,962,579.96	5,676,131.52	详见本财务报表附注税项之说明
房产税	55,643.98	55,643.98	详见本财务报表附注税项之说明
土地使用税	4,578.60	4,578.60	详见本财务报表附注税项之说明
车船使用税	42,920.00	43,070.00	详见本财务报表附注税项之说明
印花税	455,854.76	141,464.50	详见本财务报表附注税项之说明
其他	6,003,326.43	3,239,379.80	详见本财务报表附注税项之说明
合计	35,436,424.39	21,668,700.57	/

**47、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	2,847,314,854.03	2,003,002,834.29
咨询费	97,799,996.99	80,704,997.99
租赁费	92,733,317.52	92,339,964.89

电子设备运转费	83,161,768.27	58,460,018.67
交易所会员年费	53,018,470.39	45,284,962.54
差旅费	48,871,749.57	66,709,089.16
折旧费	40,065,767.01	31,169,619.50
业务招待费	39,412,897.21	36,930,784.87
无形资产摊销	33,069,025.83	27,181,881.88
投资者保护基金	27,134,895.58	19,052,815.15
长期待摊费用摊销	12,852,737.37	12,431,226.24
其他	211,204,221.75	188,614,017.96
合计	3,586,639,701.52	2,661,882,213.14

#### 48、信用减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
融出资金减值	7,551,002.29	2,944,390.07
买入返售金融资产减值	66,070,043.09	-32,883,262.14
坏账损失	25,100,509.63	2,207,100.40
债权投资减值	26,938.58	10,496.15
其他债权投资减值	971,299.89	5,942,087.35
其他信用减值	-117,869.27	-230,849.30
合计	99,601,924.21	-22,010,037.47

#### 49、其他资产减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
商誉减值		35,518,931.09
合计		35,518,931.09

#### 50、营业外收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得合计	174,310.71	161,299.10	174,310.71
其中：固定资产处置利得	174,310.71	161,299.10	174,310.71
接受捐赠		100,000.00	
政府补助	90,522,433.32	56,169,017.55	90,522,433.32
其他	1,210,575.91	1,091,796.95	1,210,575.91
合计	91,907,319.94	57,522,113.60	91,907,319.94

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
公司收到的财政扶持及奖励款	84,954,687.59	52,373,326.03	与收益相关

子公司收到的财政扶持及奖励款	5,567,745.73	3,795,691.52	与收益相关
合 计	90,522,433.32	56,169,017.55	

## 51、营业外支出

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	1,223,221.83	998,062.06	1,223,221.83
其中：固定资产处置损失	1,223,221.83	998,062.06	1,223,221.83
对外捐赠	3,649,933.00	2,346,259.00	3,649,933.00
其他	3,769,921.01	931,881.99	3,769,921.01
合 计	8,643,075.84	4,276,203.05	8,643,075.84

## 52、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	657,211,458.79	304,776,822.31
递延所得税费用	-106,515,627.12	102,861,136.05
合 计	550,695,831.67	407,637,958.36

### (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	2,424,387,693.93
按法定/适用税率计算的所得税费用	606,096,923.49
子公司适用不同税率的影响	-434,373.48
调整以前期间所得税的影响	-5,604,816.88
非应税收入的影响	-57,523,530.39
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	5,111,690.35
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-485,523.44
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	4,013,974.20
其他	-478,512.18
所得税费用	550,695,831.67

## 53、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
应付款项净增加额	293,045,242.50	206,007,222.51
衍生金融工具投资收到的现金净额	257,468,577.03	
收到的政府补助款	90,522,433.32	56,169,017.55

交易性金融负债增加收到的现金	47,200,000.00	703,047,720.91
其他	40,697,611.99	71,077,095.07
合计	728,933,864.84	1,036,301,056.04

## (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
支付的其他业务及管理费	653,337,317.28	588,096,651.23
存出保证金净增加额	400,859,274.89	179,818,682.20
交易性金融负债减少支付的现金	303,047,187.81	296,374,982.51
应付款项净减少额	169,001,413.63	
应收款项净增加额	35,573,106.41	
其他	68,135,844.64	78,846,801.47
合计	1,629,954,144.66	1,143,137,117.41

## (3). 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
因对子公司减资支付的现金净额		4,141.44
合计		4,141.44

## 54、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	1,873,691,862.26	1,298,062,878.86
加：资产减值准备		
信用减值损失	99,601,924.21	-22,010,037.47
其他资产减值损失		35,518,931.09
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	40,065,767.01	31,169,619.50
无形资产摊销	33,069,025.83	27,181,881.88
长期待摊费用摊销	12,852,737.37	12,431,226.24
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）	-73,950.03	73,961.95
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	1,048,911.12	836,762.96
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-14,879,820.19	-233,144,614.08
利息支出（收入以“-”号填列）	384,310,350.82	257,259,291.95
汇兑损失（收益以“-”号填列）	-4,378,312.94	1,286,862.65
投资损失（收益以“-”号填列）	-17,373,488.34	-140,539,948.68
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-115,294,731.54	48,872,330.19
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	8,894,742.82	55,131,169.85
交易性金融资产等的减少（增加以“-”号填列）	-5,401,715,986.29	572,630,622.03

经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-8,781,278,466.43	-2,939,401,331.32
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	8,465,967,510.02	-879,595,772.26
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-3,415,491,924.30	-1,874,236,164.66
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b>		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况：</b>		
现金的期末余额	19,122,120,644.96	16,204,633,971.65
减：现金的期初余额	16,204,633,971.65	14,761,488,368.92
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	2,917,486,673.31	1,443,145,602.73

**(2) 本期收到的处置子公司的现金净额**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币  
金额

本期处置子公司于本期收到的现金或现金等价物	2,389,857.00
减：丧失控制权日子公司持有的现金及现金等价物	11,545.06
加：以前期间处置子公司于本期收到的现金或现金等价物	
处置子公司收到的现金净额	2,378,311.94

**(3) 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	19,122,120,644.96	16,204,633,971.65
其中：库存现金	9,138.61	10,324.67
可随时用于支付的银行存款	15,945,391,975.52	13,884,977,617.89
可随时用于支付的其他货币资金		
结算备付金	3,176,719,530.83	2,319,646,029.09
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	19,122,120,644.96	16,204,633,971.65
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

**55、所有权或使用权受到限制的资产**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	100,000.00	保证金冻结
交易性金融资产	7,187,299,891.90	为质押式回购交易设定质押
交易性金融资产	205,134,600.00	为债券借贷交易设定质押
交易性金融资产	61,371,720.00	充抵期货保证金

交易性金融资产	86,007,614.30	已融出证券
其他债权投资	197,174,600.00	为质押式回购交易设定质押
合计	7,737,088,426.20	/

其他说明：

详见本财务报表附注七、1，七、8、(2) □，七、10、(2)。

## 56、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	-	-	1,010,166,402.02
其中：美元	10,367,034.27	6.5249	67,643,861.88
港币	1,119,775,241.87	0.84164	942,447,634.56
新加坡元	15,179.87	4.9345	74,905.58
结算备付金	-	-	13,485,103.73
其中：美元	988,338.07	6.5249	6,448,807.08
港币	8,360,221.29	0.84164	7,036,296.65
融出资金	-	-	288,243,147.26
其中：港币	342,477,956.44	0.84164	288,243,147.26
应收款项	-	-	13,083,590.67
其中：美元	100.00	6.5249	652.49
港币	15,544,577.47	0.84164	13,082,938.18
存出保证金	-	-	8,699,647.68
其中：美元	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港币	8,243,340.00	0.84164	6,937,924.68
其他应收款	-	-	4,898,511.74
其中：港币	5,820,198.35	0.84164	4,898,511.74
债权投资	-	-	16,805,556.03
其中：港币	19,967,629.90	0.84164	16,805,556.03
短期借款	-	-	252,520,360.23
其中：港币	300,033,696.39	0.84164	252,520,360.23
代理买卖证券款	-	-	916,583,363.15
其中：美元	8,300,060.77	6.5249	54,157,066.49
港币	1,024,609,882.20	0.84164	862,352,661.24
新加坡元	14,922.57	4.9345	73,635.42
应付职工薪酬	-	-	3,726,781.92
其中：港币	4,428,000.00	0.84164	3,726,781.92
应付款项	-	-	34,239,434.03
其中：港币	40,681,804.61	0.84164	34,239,434.03
其他应付款	-	-	7,751,807.09
其中：美元	108.00	6.5249	704.69
港币	9,209,522.36	0.84164	7,751,102.40
合计			2,570,203,705.55

(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

重要的境外经营实体	主要经营地	记账本位币	记账本位币的选择依据
国金金融控股(香港)有限公司	香港	港币	该实体经营所处的主要经济环境中的货币
国金证券(香港)有限公司	香港	港币	该实体经营所处的主要经济环境中的货币

## 57、政府补助

### 1. 政府补助基本情况

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
与收益相关	90,522,433.32	营业外收入	90,522,433.32

## 58、其他

√适用 □不适用

基本每股收益和稀释每股收益的计算过程

本公司按照中国证监会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第9号——净资产收益率和每股收益的计算及披露(2010年修订)》(中国证券监督管理委员会公告〔2010〕2号)、《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(2008)》(中国证券监督管理委员会公告〔2008〕43号)要求计算的每股收益如下:

### (1) 计算结果

报告期利润	本期金额		上期金额	
	基本每股收益	稀释每股收益	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	0.616	0.616	0.429	0.429
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	0.592	0.592	0.413	0.413

### (2) 基本每股收益的计算过程

项目	序号	本期金额	上期金额
归属于公司普通股股东的净利润	A	1,862,640,224.66	1,298,539,701.33
非经常性损益	B	71,639,840.20	49,133,614.31
扣除非经常性损益后的归属于公司普通股股东的净利润	C=A-B	1,791,000,384.46	1,249,406,087.02
期初股份总数	D	3,024,359,310.00	3,024,359,310.00
因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数	E		



发行新股或债转股等增加股份数	F		
增加股份次月起至报告期期末的累计月数	G		
因回购等减少股份数	H		
减少股份次月起至报告期期末的累计月数	I		
报告期缩股数	J		
报告期月份数	K	12	12
发行在外的普通股加权平均数	$L=D+E+F \times G/K-H \times I/K-J$	3,024,359,310.00	3,024,359,310.00
基本每股收益	$M=A/L$	0.616	0.429
扣除非经常损益基本每股收益	$N=C/L$	0.592	0.413

## (3) 稀释每股收益

稀释每股收益= $P1/(S0+S1+Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk + \text{认股权证、股份期权、可转换债券等增加的普通股加权平均数})$

其中：P1 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润，并考虑稀释性潜在普通股对其影响，按《企业会计准则》及有关规定进行调整。公司在计算稀释每股收益时，考虑所有稀释性潜在普通股对归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润和加权平均股数的影响，按照其稀释程度从大到小的顺序计入稀释每股收益，直至稀释每股收益达到最小值。

## 八、合并范围的变更

## 1、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

单位:元 币种:人民币

子公司名称	股权处置价款	股权处置比例 (%)	股权处置方式	丧失控制权的时点	丧失控制权时点的确定依据	处置价款与处置投资对应的合并财务报表层面享有该子公司净资产份额的差额	丧失控制权之日剩余股权的比例 (%)	丧失控制权之日剩余股权的账面价值	丧失控制权之日剩余股权的公允价值	按照公允价值重新计量剩余股权产生的利得或损失	丧失控制权之日剩余股权公允价值的确定方法及主要假设	与原子公司股权投资相关的其他综合收益转入投资损益的金额
国金凯歌(厦门)资本管理有限公司	2,389,857.00	51.00	股权转让	2020年4月30日	股权变更	239,102.49	0.00	0.00	0.00	0.00	不适用	0.00

其他说明:

适用 不适用

原纳入合并范围的国金期货复也稳健2号集合资产管理计划、民企发展之国金4号单一资管计划已于本期内到期终止并完成清算，不再纳入合并范围。

## 九、在其他主体中的权益

## 1、在子公司中的权益

## (1). 企业集团的构成

√适用 □不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
国金期货有限责任公司	四川省成都市	四川省成都市	期货经纪、期货投资咨询	100.00		非同一控制下企业合并
国金鼎兴投资有限公司	上海市	上海市	投资业务	100.00		自行设立
国金创新投资有限公司	上海市	上海市	投资业务	100.00		自行设立
国金道富投资服务有限公司	上海市	上海市	金融产品设计、后台运营服务	55.00		自行设立
国金金融控股（香港）有限公司[注]	香港	香港	投资业务	100.00		自行设立
国金鼎兴资本管理有限公司	上海市	上海市	投资管理、投资业务		100.00	自行设立
上海佐誉资产管理有限公司	上海市	上海市	资产管理、投资业务		51.00	自行设立
国金证券（香港）有限公司	香港	香港	证券业务		100.00	非同一控制下企业合并
国金财务（香港）有限公司	香港	香港	放贷		100.00	非同一控制下企业合并

注:本期国金金融控股（香港）有限公司以发行股份为对价，从母公司和少数股东处取得国金证券（香港）有限公司和国金财务（香港）有限公司 100.00%的股权。本期母公司购买国金金融控股（香港）有限公司少数股东持有的全部股权。

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

本公司对由公司同时作为管理人和投资人的结构化主体，综合评估持有其投资份额而享有的回报以及作为其管理人的管理人报酬是否使本公司所享有的可变回报构成重大影响，并据此判断本公司是否为结构化主体的主要责任人，将满足条件的结构化主体确认为构成控制并纳入合并报表范围。

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司纳入合并报表范围的结构化主体为 3 个资产管理计划和 4 个有限合伙企业。上述合并结构化主体的总资产为人民币 4,128,510,044.84 元。

## (2). 重要的非全资子公司

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	少数股东持股比例	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
国金道富投资服务有限公司	45.00%	10,663,286.58		73,513,234.32

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明：

□适用 √不适用

其他说明：

适用 不适用

## (3). 重要非全资子公司的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	期末余额						期初余额					
	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计
国金道富投资服务有限公司	738,654,841.38	9,010,187.85	747,665,029.23	581,784,055.58	2,518,230.73	584,302,286.31	450,941,956.94	9,206,627.98	460,148,584.92	319,088,053.47	1,393,980.93	320,482,034.40

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
国金道富投资服务有限公司	80,057,405.70	23,696,192.40	23,696,192.40	272,281,016.15	67,008,978.93	15,019,994.62	15,019,994.62	71,247,780.41

## 2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

√适用 □不适用

## (1). 在子公司所有者权益份额的变化情况的说明

√适用 □不适用

子公司名称	变动时间	变动前持股比例	变动后持股比例
国金金融控股（香港）有限公司	2020年4月30日	99.00%	99.999999%
国金金融控股（香港）有限公司	2020年12月31日	99.999999%	100.00%
国金证券（香港）有限公司	2020年4月30日	99.9999993%	99.999999%
国金证券（香港）有限公司	2020年12月31日	99.999999%	100.00%
国金财务（香港）有限公司	2020年4月30日	99.9999889%	99.999999%
国金财务（香港）有限公司	2020年12月31日	99.999999%	100.00%

## (2). 交易对于少数股东权益及归属于母公司所有者权益的影响

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

	国金金融控股（香港）有限公司[注 1]
购买成本/处置对价	
--现金	
--非现金资产的公允价值	2.54
购买成本/处置对价合计	2.54
减：按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	3.41
差额	-0.87
其中：调整资本公积	-0.87
调整盈余公积	
调整未分配利润	

	国金证券（香港）有限公司[注 2]
购买成本/处置对价	
--现金	
--非现金资产的公允价值	0.00
购买成本/处置对价合计	0.00
减：按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	1.03
差额	-1.03
其中：调整资本公积	-1.03
调整盈余公积	
调整未分配利润	

	国金财务（香港）有限公司[注 3]
购买成本/处置对价	
--现金	
--非现金资产的公允价值	0.00

购买成本/处置对价合计	0.00
减：按取得/处置的股权比例计算的子公司净资产份额	0.91
差额	-0.91
其中：调整资本公积	-0.91
调整盈余公积	
调整未分配利润	

注 1：资本公积调整系交易对于少数股东权益的影响。

注 2：资本公积调整系交易对于归属于母公司所有者权益的影响。

注 3：资本公积调整系交易对于少数股东权益的影响。

### 3、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	
国金基金管理有限公司	北京市	北京市	基金募集、基金销售、资产管理	49.00		权益法

#### (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
	国金基金管理有限公司	国金基金管理有限公司
流动资产	281,138,854.39	254,126,062.43
非流动资产	35,100,013.50	37,651,517.88
资产合计	316,238,867.89	291,777,580.31
流动负债	63,829,980.44	49,746,823.20
非流动负债		
负债合计	63,829,980.44	49,746,823.20
少数股东权益		
归属于母公司股东权益	252,408,887.45	242,030,757.11
按持股比例计算的净资产份额	123,680,354.85	118,595,070.98
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	123,680,354.85	118,595,070.98
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值		

营业收入	169,313,022.86	169,728,504.18
净利润	10,378,130.34	1,364,242.27
终止经营的净利润		
其他综合收益		
综合收益总额	10,378,130.34	1,364,242.27
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

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	448,752,501.62	456,335,623.76
下列各项按持股比例计算的合计数	-	-
--净利润	9,985,411.94	-2,737,514.08
--其他综合收益		-367,260.45
--综合收益总额	9,985,411.94	-3,104,774.53

## (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

联营企业向本公司转移资金的能力不存在重大限制。

## 4、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

√适用 □不适用

本公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本公司发起设立的投资基金和资产管理计划等，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收取管理费，其募资方式是向投资者发行投资产品。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体收取管理费收入及业绩报酬。

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体所享有的权益皆通过本公司资产负债表中的交易性金融资产项目进行核算，其账面价值为 365,016,363.84 元，最大损失敞口与账面价值相近。

## 十、与金融工具相关的风险

√适用 □不适用

详见附注十五、风险管理。

## 十一、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			合计
	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	
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
(一) 交易性金融资产	1,275,256,312.24	16,351,826,249.44	1,246,007,895.03	18,873,090,456.71

1.以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	1,275,256,312.24	16,351,826,249.44	1,246,007,895.03	18,873,090,456.71
(1) 债券	114,301,637.37	11,222,312,788.15		11,336,614,425.52
(2) 公募基金	177,946,537.27	294,482,194.25		472,428,731.52
(3) 股票/股权	983,008,137.60		514,661,864.27	1,497,670,001.87
(4) 其他		4,835,031,267.04	731,346,030.76	5,566,377,297.80
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(1) 债券				
(2) 公募基金				
(3) 股票/股权				
(4) 其他				
(二) 其他债权投资		1,019,343,647.45		1,019,343,647.45
(三) 其他权益工具投资		2,412,303,104.51	276,907,042.34	2,689,210,146.85
(四) 衍生金融资产		704,900.00		704,900.00
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	<b>1,275,256,312.24</b>	<b>19,784,177,901.40</b>	<b>1,522,914,937.37</b>	<b>22,582,349,151.01</b>
(五) 交易性金融负债	1,443,000,000.00	555,825,621.81		1,998,825,621.81
1.以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	1,443,000,000.00	48,019,584.00		1,491,019,584.00
其中：发行的交易性债券				
其他	1,443,000,000.00	48,019,584.00		1,491,019,584.00
2.指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债		507,806,037.81		507,806,037.81
(六) 衍生金融负债	1,824,880.00	80,808,000.24	367,301.70	83,000,181.94
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	<b>1,444,824,880.00</b>	<b>636,633,622.05</b>	<b>367,301.70</b>	<b>2,081,825,803.75</b>

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

√适用 □不适用

本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

√适用 □不适用

项 目	期末公允价值	可观察输入值
(一) 交易性金融资产	16,351,826,249.44	
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	16,351,826,249.44	
(1) 债券	11,222,312,788.15	债券收益率
(2) 公募基金	294,482,194.25	投资标的单位净值
(3) 股票/股权		



(4) 其他	4,835,031,267.04	投资标的单位净值
(二) 其他债权投资	1,019,343,647.45	债券收益率
(三) 其他权益工具投资	2,412,303,104.51	投资标的单位净值
(四) 衍生金融资产	704,900.00	债券收益率
持续以公允价值计量的资产总额	19,784,177,901.40	
(五) 交易性金融负债	555,825,621.81	
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	48,019,584.00	
其中：发行的交易性债券		
其他	48,019,584.00	债券收益率
2. 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	157,711,868.13	投资标的单位净值
	350,094,169.68	标的商品价格\合同利率
(六) 衍生金融负债	80,808,000.24	标的商品价格\合同利率
持续以公允价值计量的负债总额	636,633,622.05	

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

项目	期末公允价值	估值技术	重大不可观察输入值	对公允价值的影响
交易性金融资产	1,246,007,895.03			
(1) 限售股	192,644,638.63	市价折扣法	流动性折扣	流动性折价越大，公允价值越低
(2) 股票、未上市股权	322,017,225.64	主要采用市场法，考虑流动性折扣	流动性折扣	流动性折价越大，公允价值越低
(3) 其他投资	731,346,030.76	主要采用市场法，考虑流动性折扣	流动性折扣	流动性折价越大，公允价值越低
其他权益工具投资	276,907,042.34	主要采用市场法，考虑流动性折扣	流动性折扣	流动性折价越大，公允价值越低
衍生金融负债	367,301.70	期权定价模型	波动率	波动率越高，公允价值越高

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

	交易性金融资产	其他权益工具投资	衍生金融负债
年初余额	934,740,289.62	264,617,041.84	
计入损益的公允价值变动	36,565,683.03		367,301.70
计入其他综合收益的公允价值变动		12,290,000.50	

买入	479,070,383.73		
转入第三层级[注 1]	2,237,009.08		
转出第三层级[注 2]	-35,604,069.34		
处置	-171,001,401.09		
期末余额	1,246,007,895.03	276,907,042.34	367,301.70

注 1：根据新三板股票在一定期间内的成交活跃度，其公允价值计量层级从第一层级转至第三层级。

注 2：当限售股解禁可在市场进行交易时，其公允价值计量层级从第三层级转至第一层级，转出金额为 26,017,130.64 元；根据新三板股票在一定期间内的成交活跃度，其公允价值计量层级从第三层级转至第一层级，转出金额为 9,586,938.70 元。

## 6、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

本公司不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：货币资金、结算备付金、融出资金、存出保证金、应收款项、买入返售金融资产、债权投资、其他资产（金融资产）、短期借款、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付款项、应付债券和其他负债（金融负债）。于 2020 年 12 月 31 日，不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 十二、关联方及关联交易

### 1、本企业的母公司情况

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例(%)	母公司对本企业的表决权比例(%)
长沙涌金（集团）有限公司	长沙市开福区芙蓉中路一段 129 号	房地产开发经营；经济与商务咨询服务（不含金融、证券、期货咨询）；日用百货、五金产品、建材、装饰材料、农产品、化工产品的销售。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）	9,565	18.09	18.09

本企业的母公司情况的说明：

公司实际控制人：陈金霞女士通过长沙涌金（集团）有限公司、涌金投资控股有限公司合计控制本公司已发行股份的 26.33%，系本公司实际控制人。

### 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

本公司的子公司情况详见附注九、在其他主体中的权益。

### 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

本公司重要的联营企业情况详见附注九、在其他主体中的权益。

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

√适用 □不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
国金涌富资产管理有限公司	联营企业

#### 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
云南国际信托有限公司	同一实际控制人
涌金投资控股有限公司	持股 5%以上股东
上海泓成创业投资合伙企业（有限合伙）	同一实际控制人
上海祥禾股权投资合伙企业（有限合伙）	同一实际控制人
上海祥禾涌原股权投资合伙企业（有限合伙）	同一实际控制人
上海聚澄创业投资合伙企业(有限合伙)	同一实际控制人
宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合伙）	同一实际控制人

#### 5、关联交易情况

公司与关联方之间的交易按照市场价格进行，无任何高于或低于正常交易价格的情况发生；存在控制关系且已纳入公司合并财务报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

##### (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

##### ① 向关联方支付的业务及管理费

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
国金基金管理有限公司	支付咨询服务费	2,415,386.71	3,376,047.69
国金涌富资产管理有限公司	支付咨询服务费	8,567,125.43	10,113,464.15
	支付系统服务费		169,811.32

出售商品/提供劳务情况表

√适用 □不适用

##### ② 向关联方收取的手续费及佣金收入

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
云南国际信托有限公司	公司取得证券经纪业务收入	768,526.58	16,515,620.71
	公司取得咨询业务收入	418,107.41	188,679.24
国金基金管理有限公司	公司取得证券经纪业务收入	67,811,244.65	55,043,427.07
	公司取得 PB 业务手续费收入	639,791.54	896,801.76
	公司取得咨询业务收入	587,501.89	1,048,266.01
涌金投资控股有限公司	公司取得证券经纪业务收入	3,625.08	15,299.54
长沙涌金（集团）有限公司	公司取得证券经纪业务收入	545.13	26.20

上海泓成创业投资合伙企业（有限合伙）	公司取得证券经纪业务收入	14,777.54	6,584.08
上海祥禾股权投资合伙企业（有限合伙）	公司取得证券经纪业务收入	75,548.86	39,872.56
上海祥禾涌原股权投资合伙企业（有限合伙）	公司取得证券经纪业务收入	1,250.00	3,206.40
陈金霞	公司取得证券经纪业务收入		9,270.68
上海聚澄创业投资合伙企业(有限合伙)、上海泓成创业投资合伙企业（有限合伙）、涌金投资控股有限公司、长沙涌金（集团）有限公司、实际控制人、公司董事等	关联方认购公司发行的资管产品，公司因此取得资产管理业务收入	14,632,341.95	5,309,117.21

**(2). 关联方资产转让、债务重组情况**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
国金基金管理有限公司	向公司转让办公设备		32,918.81

**(3). 关键管理人员报酬**

√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
关键管理人员报酬	105,472,049.89	100,494,379.36

**(4). 其他关联交易**

√适用 □不适用

## ① 共同投资

关联方	关联交易内容	本期金额	上期金额
国金涌富资产管理有限公司	公司全资子公司国金创新投资有限公司与关联方国金涌富资产管理有限公司共同投资宁波国金涌富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）合伙人份额，国金创新投资有限公司本期实缴 600 万元。	6,000,000.00	
国金涌富资产管理有限公司	公司全资子公司国金创新投资有限公司与关联方国金涌富资产管理有限公司共同投资宁波国金瑞富企业管理咨询合伙企业（有限合伙）合伙人份额，国金创新投资有限公司本期实缴 3000 万元。	30,000,000.00	
国金涌富资产管理有限公司	公司全资子公司国金创新投资有限公司与关联方国金涌富资产管理有限公司、宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合	83,333,300.00	

宁波梅山保税港区涌瑞股权投资合伙企业（有限合伙）	伙）共同投资宁波锐石企业管理咨询合伙企业（有限合伙）合伙人份额，国金创新投资有限公司本期实缴 8,333.33 万元。		
--------------------------	---	--	--

## ② 持有关联方发行的金融产品

关联方名称	产品名称	期末余额	年初余额
国金基金管理有限公司	国金金腾通	73,618,026.68	204,058,445.16
	国金基金-国金基本面	1,046,400.00	10,454,000.00
	国金基金-国金智联中国		31,224,000.00
	国金基金-国金可持续发展	1,434,517.01	20,078,000.00
	国金基金-国金军工	11,707,000.00	
	国金基金-国金美丽中国	1,319,903.25	
	国金基金-新智能	62,771,070.51	54,084,260.92
	国金基金-国金沪深港地产	1,002,600.00	
	国金基金-国金原料药	19,457,590.96	
	国金基金-国金在线娱乐	19,131,130.76	
	国金基金-国金电力脱碳	1,499,550.00	
	国金基金-国金零售休闲	48,914,799.92	
	国金量化添利	14,531,039.19	
云南国际信托有限公司	云南信托-星辰		5,083,483.07
	云南信托-云钛		38,306,790.00
	云南信托-至善		122,690,779.34
	云南信托-云象		83,391,476.70
	云南信托-财富		41,215,623.77
	云南信托-东证维信		6,048,166.67

## ③ 关联方认购公司发行的债务融资工具

关联方名称	期末余额	年初余额
公司董事等关联人		100,000.00

**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	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
代销手续费收入	国金基金管理有限公司	19,782,533.79	197,825.34	16,209,513.80	162,095.14
PB业务手续费收入	国金基金管理有限公司	259,530.47	2,595.30		

**十三、 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

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司无需要披露的重大承诺事项。

**2、 或有事项****(1). 资产负债表日存在的重要或有事项**

√适用 □不适用

① 购买公司发行的负有有限风险补偿义务的集合资产管理计划

2017 年 7 月，公司设立了“国金慧源质押宝 2 号集合资产管理计划”（以下简称“慧源质押宝 2 号”）并担任管理人。根据管理合同，管理人自有资金以该期参与份额为限对当期非管理人持有人份额提供有限补偿。若第 i 期计划份额单位累计净值小于集合计划份额面值时，则管理人将根据合同约定，以第 i 期安全垫份额对应资产为限对本次到期的该期安全垫份额以外的其他份额的本金进行有限补偿。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司自有资金投入慧源质押宝 2 号份额为 1,514.76 万元，产品净值高于份额面值。

② 公司为境外子公司提供融资担保

2020 年 3 月，公司与中国邮政储蓄银行股份有限公司成都市分行（以下简称邮储银行成都市分行）签署《开立跨境保函/备用信用证合同》，由邮储银行成都市分行向境外银行开具备用信用证，金额壹亿元港币，备用信用证有效期为壹年，国金证券（香港）有限公司在不超过上述备用信用证开具金额范围内向境外银行提取银行贷款。2020 年 3 月 24 日，邮储银行成都市分行向境外银行开出备用信用证，金额壹亿元港币。

除上述事项外，截至 2020 年 12 月 31 日，本公司无其他应披露未披露的重大或有事项。

**十四、 资产负债表日后事项****1、 重要的非调整事项**

□适用 √不适用

## 2、利润分配情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

拟分配的利润或股利	211,705,151.70
经审议批准宣告发放的利润或股利	

2021年3月31日，公司第十一届董事会第十三次会议审议通过了《国金证券股份有限公司二〇二〇年度利润分配预案》，以截至2020年12月31日公司总股本3,024,359,310股为基数，向全体股东每10股派发现金股利0.70元人民币（含税），不进行资本公积转增股本或送股。上述预案待股东大会审议通过后实施。

## 3、其他资产负债表日后事项说明

√适用 □不适用

(1). 2021年1月，公司完成2021年短期公司债券（第一期）（面向专业投资者）发行工作，发行总金额10亿元，发行价格100元/张，票面利率2.99%，起息日期为2021年1月13日，兑付日期为2021年10月15日。公司完成2021年短期公司债券（第二期）（面向专业投资者）发行工作，发行总金额15亿元，发行价格100元/张，票面利率3.20%，起息日期为2021年1月28日，兑付日期为2021年11月24日。

(2). 2021年3月，公司完成2021年度第一期短期融资券发行工作，发行总金额10亿元，发行价格100元/张，票面利率2.74%，起息日期为2021年3月11日，兑付日期为2021年6月10日。

## 十五、风险管理

### 1、风险管理政策及组织架构

#### (1). 风险管理政策

√适用 □不适用

公司全面风险管理的目标是建立健全与公司风险偏好、自身发展战略相适应的全面风险管理体系，保障公司持续稳健运行。全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司制定并持续完善风险管理制度体系，明确风险管理的目标、原则、组织架构、授权体系、相关职责、基本程序等，并针对不同风险类型制定可操作的风险识别、评估、监测、应对、报告的方法和流程，公司通过评估、审计稽核、检查等方式保证风险管理制度的贯彻落实。

公司制定包括风险容忍度和风险限额等的风险控制指标体系，并通过情景分析、压力测试等方法计量风险、评估承受能力、指导资源配置。风险控制指标经公司董事会、经理层或其授权机构审批并逐级分解至各部门、分支机构及子公司，公司对分解后指标的执行情况进行监控和管理。

## (2). 风险治理组织架构

适用 不适用

公司严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了完整有效的风险管理结构体系。

公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构。公司董事会负责审议通过公司风险管理的总体目标、基本政策；审议通过公司风险管理的机构设置及其职责；审议批准公司全面风险管理的基本制度等。董事会设立风险控制委员会，风险控制委员会对董事会负责，向董事会报告。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。

公司经理层是全面风险管理工作的组织机构，并对全面风险管理承担主要责任，履行的职责包括：制定风险管理制度，并适时调整；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构等。公司经理层设立风险管理委员会，作为公司风险管理的议事机构。公司设专职首席风险官，由其负责全面风险管理工作。

公司风险管理部、合规管理部、审计稽核部、法律事务部、内核部是公司专职内控部门，分别独立行使相应的风险管理职能，对公司面临的主要风险进行事前、事中和事后管理，并负责沟通协调相关风险管理工作。公司风险管理部和内核部在首席风险官领导下，履行公司风险管理职责，推动公司风险管理工作。公司总裁办公室、计划财务部、资金部、清算部、信息技术部门、人力资源部等中后台职能部门除承担本部门内部的风险控制职能外，同时按各自职责对各部门及分支机构履行相应的风险管理职能。

公司各业务部门、分支机构及子公司负责人负责按照公司全面风险管理的要求履行一线风险管理职能，确保风险管理覆盖到所有业务流程和岗位。公司各业务部门、分支机构及子公司建立并完善内部风险管理制度，对所开展的业务进行风险识别、评估、管理、控制、协调和报告等风险管理工作，并按公司规定及时上报相关数据。

## 2、信用风险

适用 不适用

信用风险指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。

公司的信用风险主要来自以下方面：其一，经纪业务代理客户买卖证券等，在结算当日客户的资金不足以支付交易所需的情况下，或者客户资金由于其他原因出现缺口，公司代客户进行结算后客户违约的风险；其二，在融资融券业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务等融资类业务中，客户未能履行合同约定而带来损失的风险；其三，固定收益类证券投资的违约风险，即所投资固定收益类证券的发行人出现违约，拒绝支付到期本金和利息带来的损失；其四，利率互换、股票收益互换、场外期权、远期交易等场外衍生品交易的对手方违约风险，即交易对手方到期未能按照合同履行相应支付义务的风险。

公司的货币资金、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；买入返售金融资产中债券质押式或买断式回购有充足的担保物；应收款主要为预付款项、各项押金等，信用风险较低。公司经纪业务代理客户的证券交易以全额



保证金结算，可以切实规避相关信用风险，因此，公司信用风险主要体现在债券投资交易、融资融券和股票质押式回购交易等业务上。公司重视债券投资交易和交易对手方信用风险的评估和监控，通过选择主要投资国债、高信用等级债券等来控制固定收益类证券投资的信用风险，同时根据《证券公司风险控制指标管理办法》、《证券基金经营机构债券投资交易业务内控指引》等制度要求设置集中度指标以分散投资风险，建立债券投资交易和交易对手管理的相关制度，定期或不定期维护与业务复杂程度相匹配的交易标的、交易对手名单，审慎选择交易标的、交易对手，加强交易监测、报告以确保规范交易等。公司对融资融券业务、股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务的信用风险控制主要通过事前评估、事中监控和事后报告来实现。事前评估方面，主要是通过建立严格的客户选择标准和标准的客户选择流程、量化的客户信用评级体系、分级授信制度、风险客户名单机制，同时对标的折算率、维持担保比例、集中度及规模进行评估分析；事中监控方面，在逐日盯市的基础上，通过风险管理部和业务部门对相关风控指标分别进行独立、动态监控，并及时预警；事后报告方面，风险管理部对日终收盘后主要风控指标进行详细分析和压力测试，业务部门视客户风险状况及时提示客户风险，并按照合同约定条款控制信用风险。在确保担保品充足的前提下，公司结合内外部环境变化，不断完善事前评估、事中监控及事后报告的相关要求、标准。

公司采用预期信用损失模型对适用的金融工具计提预期信用损失。预期信用损失主要计量方法包括违约概率/违约损失率法、损失率法等。违约概率/违约损失率法是指通过估计单笔资产或资产组合的违约风险暴露（EAD）、违约概率（PD）、违约损失率（LGD）等参数计量预期信用损失的方法。损失率法是指在不估计违约概率和违约损失率等情况下，直接估计损失率计量预期信用损失的方法。公司通过对宏观经济因素、行业政策和行业环境等因素的判断，确定前瞻性调整系数，并对预期信用损失的计量结果进行调整。

公司基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行调整：（1）第一阶段：在资产负债表日信用风险较低的金融工具，或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）预期信用损失的金额计量其损失准备；（2）第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，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；（3）第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，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。

公司根据金融资产的特点，针对具有相同风险特征的金融资产界定存在发生信用减值证据的情形。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：（1）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）债权人出于对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）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；（7）其他表明金融资产已发生信用减值的情形。

公司融资融券业务的减值计量采用违约概率/违约损失率法，具体如下：（1）减值阶段划分：①出现以下情况之一的，应被认定为已发生信用减值，划入第三阶段：维持担保比例低于 130%（不含）；逾期天数大于 30 天（不含）；其他可认定为违约的条件。②出现以下情况之一的，应被认定为信用风险已显著增加，划入第二阶段：维持担保比例小于 140%（不含）但高于或等于 130%；发生逾期且逾期天数在 30 天（含）以内；其他可认定为信用风险显著增加的条件。③其他未触发信用风险已显著增加或已发生信用减值条件的融资融券业务划入第一阶段。（2）减值计量方法：公司融资融券业务的减值准备按照违约概率、违约损失率、违约风险暴露之积，并进行前瞻性调整后确定：①违约概率的确定：已发生信用减值的融资融券业务的违约概率按 100%确定；未发生信用减值的融资融券业务的违约概率采用维持担保比例滚动率的方法进行估算。为保证减值计量结果的审慎，公司融资融券业务违约概率不低于 0.5%。②违约损失率的确定：对于未发生信用减值的融资融券业务，违约损失率参考维持担保比例确定。为保证减值计量结果的审慎，未发生信用减值的融资融券业务的违约损失率应不低于 20%。对于余额为 500 万以上的已发生信用减值的融资融券业务，违约损失率可采用个别认定法确定。在评估预期可回收的现金流量时，应首先考虑债务人的信用状态、还款能力，以及担保品的流动性、限售情况、集中度、波动性等因素对担保品变现能力和价值的影响，综合考虑可收取的全部合同现金流量。

公司股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务的减值计量采用违约概率/违约损失率法，具体如下：（1）减值阶段划分：股票质押式回购交易是以股票为质押品的类信贷活动，公司在减值阶段划分时，综合考虑融资主体在报告期末的运营情况、还款能力、司法诉讼、逾期信息、合约的维持担保比例等因素。①股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务，认定为已发生信用减值，划入第三阶段的标准：公司将债务人发生重大财务困难、违反合同、很可能破产或重组等情况作为已发生信用减值的主要证据；当逾期天数大于 90 天（不含），应被认定为已发生信用减值。其他可以参考的因素包括：当前履约保障比例低于最低履约保障比例（不含）；拟对该笔业务进行违约处置；其他可认定为违约的条件等。②当股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务逾期天数大于 30 天（不含）且在 90 天（含）以内，应被认定为信用风险已显著增加，划入第二阶段。其他可以参考的因素包括：当前履约保障比例低于预警履约保障比例但高于等于最低履约保障比例；发生逾期；其他可认定为信用风险显著增加的条件。③其他未触发信用风险已显著增加或已发生信用减值条件的股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务划入第一阶段。公司股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务合同最低履约保障比例不低于 130%，预警履约保障比例不低于 150%。（2）减值计量方法：减值准备按照违约概率、违约损失率、违约风险暴露之积，并进行前瞻性调整后确定。①违约概率的确定：已发生信用减值的股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务的违约概率按 100%确定；未发生信用减值的股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务的违约概率采用履约保障比例滚动率

的方法进行估算。为保证减值计量结果的审慎，公司股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务违约概率应不低于 0.5%。②违约损失率的确定：对于未发生信用减值的股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务，违约损失率参考履约保障比例确定。为保证减值计量结果的审慎，未发生信用减值的股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务的违约损失率应不低于 20%。对于余额为 500 万以上的已发生信用减值的股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务，违约损失率可采用个别认定法确定。在评估预期可回收的现金流量时，应首先考虑债务人的信用状态、还款能力，以及担保品的流动性、限售情况、集中度、波动性等因素对担保品变现能力和价值的影响，综合考虑可收取的全部合同现金流量。

公司债券投资业务的减值计量采用违约概率/违约损失率法，具体如下：（1）减值阶段划分：①出现以下情况之一的，应被认定为已发生信用减值，划入第三阶段：发生本金逾期或利息逾期；债项评级或主体评级为违约级“C”或“D”；中债市场隐含评级为“C”；发行人被列于违约债券清单中；其他可认定为违约的条件。②出现以下情况之一的，应被认定为信用风险已显著增加，划入第二阶段：最新债项或主体评级自初始确认后发生评级下调，且下调后的评级为 AA 级（不含）以下；中债市场隐含评级自初始确认后发生评级下调，且下调后的评级为 A+（含）及以下；债券信用利差和价格的重重大不利变化，债项连续二十个工作日内中债估值收益率高于同期限国债估值收益率 700bp 及以上；发行人被列于债券负面清单中；其他可认定为信用风险显著增加的条件。③其他未触发信用风险已显著增加或已发生信用减值条件的债项划入第一阶段。上述评级是指债项评级；若债项评级无法取得，可选择发行人主体评级。（2）减值计量方法：减值准备按照违约概率、违约损失率、违约风险暴露之积，并进行前瞻性调整后确定。①违约概率的确定：已发生信用减值的债券，违约概率按 100%确定；未发生信用减值的债券，应根据相关债项或主体最新的外部评级结果，参照行业发布的最新外部评级与违约概率的映射规则来确定；若债项评级和主体评级均无法取得，可谨慎选择阶段一最低评级要求 AA 对应的违约概率。②违约损失率的确定：债券的违约损失率一般应按照行业发布的参考值确定，无担保的高级债权和次级债权的违约损失率分别为 45%和 75%；中华人民共和国财政部发行的国债、中国人民银行发行的中央银行票据以及政策性金融债，由于信用风险极低，预期信用损失可视为接近于零，故将 LGD 设置为 0。对于已发生信用减值的债券投资业务，违约损失率可采用个别认定法确定。在评估预期可回收的现金流量时，应首先考虑债务人的信用状态、还款能力，以及担保品的流动性、限售情况、集中度、波动性等因素对担保品变现能力和价值的影响，综合考虑可收取的全部合同现金流量。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司金融工具预期信用损失准备计提情况：

单位：万元

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	1,682.13	30.26	1,281.92	2,994.31
应收款项坏账准备(简化模型)		26.76	420.82	447.58
买入返售金融资产减值准备	5,107.75	8,442.23	3,608.44	17,158.42
债权投资减值准备	16.18	5.44		21.62
其他债权投资减值准备	96.39		566.36	662.75
其他应收款坏账准备		221.96	3,006.67	3,228.63
其他信用减值准备			65.47	65.47
合计	6,902.45	8,726.65	8,949.68	24,578.78

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，本公司最大信用风险敞口金额列示如下：

单位：万元

涉及信用风险的项目	期末余额
货币资金	1,596,599.33
结算备付金	317,701.80
融出资金	1,481,537.25
衍生金融资产	70.49
存出保证金	141,576.23
应收款项	9,094.46
买入返售金融资产	804,975.32
交易性金融资产	1,133,661.44
债权投资	16,991.82
其他债权投资	101,934.36
其他资产（金融资产）	11,368.63
合计	5,615,511.13

### 3、流动风险

√适用 □不适用

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。公司在经营过程中，受宏观政策、市场变化、经营状况、信用程度等因素的影响，或因公司资产负债结构不匹配而产生流动性风险。另外，由于公司投资银行业务大额包销、自营业务投资规模过大、长期资产比例过高等因素，会导致公司资金周转不畅、流动性出现困难。公司建立了有效的流动性风险管理组织架构，明确了董事会、经理层及首席风险官、相关部门在流动性风险管理中的职责和报告路线；建立动态的以净资本和流动性为核心的风险控制指标监控体系，并开发了风险控制指标动态监控系统；对流动性覆盖率、净稳定资金率等流动性风险计量指标进行计算和监控；建立资金监控的相关内控制度，对货币资金、结算备付金、存出保证金等金融资产，由公司资金部、清算部进行监控，对影响流动性的业务和流动性较低的资产投资，需公司相关决策机构进行审议；设立自营分公司，由经理层授权自营分公司在限额内进行证券投资，并根据证券市场行情及公司流动性需求，严格控制自营业务投资范

围及规模；审慎选择信用级别较高的商业银行存放各项货币资金，有力地保证了货币资金的流动性和安全性。公司重视资产和负债到期日的匹配并有效控制匹配差异，以保证到期债务的支付。

公司 2020 年 12 月 31 日持有的金融负债剩余到期期限情况：

单位：万元

金融负债	即期	3 个月以内	3 个月到 1 年	1 至 5 年	5 年以上	合计
短期借款		25,252.04				25,252.04
应付短期融资款		444,490.67	357,513.65			802,004.32
拆入资金		115,763.56				115,763.56
交易性金融负债	4,801.96	103,209.42	76,100.00	15,771.18		199,882.56
衍生金融负债	182.49	616.70	7,500.83			8,300.02
卖出回购金融资产款		652,382.40				652,382.40
代理买卖证券款	1,639,282.76					1,639,282.76
应付款项	57,871.89	5,109.24				62,981.13
应付债券			308,394.62	358,968.08		667,362.70
其他负债（金融负债）	5,547.80	1,610.58				7,158.38
合计	1,707,686.90	1,348,434.61	749,509.10	374,739.26		4,180,369.87

截至 2020 年 12 月 31 日，母公司流动性覆盖率为 261.09%，净稳定资金率为 149.43%，持续符合监管要求。

#### 4、市场风险

√适用 □不适用

公司涉及的市场风险是指持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因市场不利变动而发生波动并造成损失的风险，包括利率风险、汇率风险和价格风险等。

公司建立了自上而下，由董事会，公司经理层，风险管理部、合规管理部、计划财务部等中后台，各业务部门及其证券投资决策委员会等组成的多道风险防线。公司建立了风险限额管理体系，主要包括规模限额、止损限额、风险限额等。董事会确定自营业务风险偏好和容忍度；公司经理层确定自营业务的投资规模和风险限额；证券投资决策委员会确定单个项目的规模、止损限额；证券自营部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、止损线等进行前端控制；风险管理部通过风险管理系统进行动态监控，及时进行风险提示，督促业务部门进行风险处置等。

##### (1) 风险价值

公司采用风险价值(VaR)方法对各类投资金融工具及持仓组合的市场风险进行评估和分析。计量口径包含母公司及主要子公司。风险价值是指在给定的置信度下衡量给定资产或负债在给定时间内可能发生的最大（价值）损失。公司所使用的风险价值模型置信度为 95%，目标期间为下个交易日。具体分析如下表所示：

单位：万元

项目	期末数	
	风险价值	风险价值/净资产

VaR (95%, 1天)	12,900.05	0.57%
---------------	-----------	-------

注：市场风险 VaR 值中包括证金公司专户投资，该部分投资的 VaR 值参考股票指数的历史波动模拟计算得出。

### (2)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因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。公司生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。一般而言，生息资产和付息负债的利率同向变动。客户资产和负债方面，生息资产和负债主要由证券经纪业务产生，客户资金存款和代买卖证券款的期限相互匹配，利率风险较小；针对自营债券投资业务，公司积极跟踪国家货币政策动向和市场利率走势，严格控制债券投资规模、久期和杠杆率，合理配置资产，利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具，同时利用国债期货等衍生品对冲部分利率风险敞口。

公司倾向于选择利率波动风险较低的债券。截至 2020 年 12 月 31 日，公司自营债券投资的组合修正久期为 3.65，组合基点价值为 610.45 万元。

下表为基于自营债券投资和利率类衍生工具的利率风险敏感度分析，假设在其他变量不变的情况下，市场利率增减 50 个基点对净利润及所有者权益的影响。

单位：万元

项 目	本期金额	
	对净利润的影响	对所有者权益的影响
市场利率上升50个基点	-7,886.10	-1,028.12
市场利率下降50个基点	7,886.10	1,028.12

### (3)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。人民币与公司从事业务的其他货币之间的汇率波动会影响本公司的财务状况和经营业绩。期末本公司所面临的汇率风险主要是境外子公司所持有的资产及所承担的负债由于汇率波动而遭受损失的风险。假设其他变量保持不变的前提下，如果人民币对其他外汇币种升值或贬值 5%，本公司净利润将相应变动不超过人民币 527.09 万元。由于外币在公司资产负债及收入结构中所占比例较低，因此汇率风险较小。

### (4)价格风险

公司面临的价格风险主要为证券投资的公允价值因指数水平和个别证券市价的变化而降低的风险。该项风险在数量上表现为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的市价波动对公司利润的影响；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融工具的市价波动对公司其他综合收益的影响。

在权益类证券投资方面，公司对规模进行适当的控制，利用股指期货等衍生品对冲部分风险敞口，并采用风险敏感度、在险值、压力测试等指标衡量和控制市场风险，但这些管理工具和方法的使用仍然受到投资策略、风险对冲策略有效性的影响。

下表为假设其他变量保持不变的情况下，股票、股权、基金、衍生工具及资管产品的价格上升或下降 10%对所得净利润及其他综合收益的影响。

单位：万元

项 目	本期金额	
	对净利润的影响	对其他综合收益的影响
市场价格上升10%	24,481.81	20,169.08
市场价格下降10%	-24,481.81	-20,169.08

## 十六、 其他重要事项

### 1、 分部信息

#### (1). 报告分部的确定依据与会计政策

√适用 □不适用

本公司的报告分部都是提供不同产品或服务的业务单元。由于各种业务需要不同的技术和市场战略，各分部独立管理。

本公司有 4 个报告分部：证券经纪业务分部、投资银行业务分部、证券投资业务分部、资产管理业务分部。各报告分部的会计政策与在“重要会计政策和会计估计”所描述的会计政策相同。

#### (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	本期金额						合计
	证券经纪业务	投资银行业务	证券投资业务	资产管理业务	其他	分部间抵销	
一、营业收入	1,820,603,374.97	1,665,969,189.13	1,175,078,183.59	182,446,672.52	1,285,141,913.90	66,437,834.16	6,062,801,499.95
其中：利息净收入	226,461,337.46	55,872.10	-160,552,901.49	134,245.34	879,055,058.95		945,153,612.36
手续费及佣金净收入	1,593,956,309.33	1,665,913,086.82		182,312,427.18	310,867,937.74	66,437,834.16	3,686,611,926.91
其他	185,728.18	230.21	1,335,631,085.08		95,218,917.21		1,431,035,960.68
二、营业支出	1,095,238,197.43	1,080,204,432.09	245,581,911.46	159,900,869.19	1,207,190,474.11	66,437,834.16	3,721,678,050.12
三、营业利润（亏损）	725,365,177.54	585,764,757.04	929,496,272.13	22,545,803.33	77,951,439.79		2,341,123,449.83
四、利润总额	743,461,533.81	608,772,914.25	943,860,200.00	47,019,896.81	81,273,149.06		2,424,387,693.93
五、资产总额	14,575,395,859.67	1,085,231,521.84	9,913,291,211.08	287,348,289.89	43,574,073,403.97	1,805,000,000.00	67,630,340,286.45
六、负债总额	14,070,395,859.67	885,231,521.84	8,782,249,466.43	237,348,289.89	21,114,933,419.11		45,090,158,556.94
七、补充信息							
1、折旧和摊销费用	60,011,019.00	5,266,615.53	1,741,814.54	2,770,832.43	16,197,248.71		85,987,530.21
2、资本性支出	48,329,756.47	4,676,516.46	1,311,395.60	39,203.56	57,827,966.35		112,184,838.44
3、信用减值损失	991,648.21	629,744.52	15,689,575.60	516,001.73	81,774,954.15		99,601,924.21

(续上表)

项目	上期金额						合计
	证券经纪业务	投资银行业务	证券投资业务	资产管理业务	其他	分部间抵销	
一、营业收入	1,312,457,337.80	883,016,375.02	1,077,398,689.01	136,734,212.74	994,957,121.95	55,049,002.52	4,349,514,734.00

其中：利息净收入	179,035,842.11	69,863.39	-151,021,428.15	174,087.63	742,539,266.79		770,797,631.77
手续费及佣金净收入	1,133,520,993.60	882,835,878.50		136,685,237.07	231,636,616.87	55,049,002.52	2,329,629,723.52
其他	-99,497.91	110,633.13	1,228,420,117.16	-125,111.96	20,781,238.29		1,249,087,378.71
二、营业支出	892,071,699.14	727,615,595.75	167,153,549.76	149,294,345.84	815,973,619.36	55,049,002.52	2,697,059,807.33
三、营业利润（亏损）	420,385,638.66	155,400,779.27	910,245,139.25	-12,560,133.10	178,983,502.59		1,652,454,926.67
四、利润总额	435,211,321.60	167,848,483.39	918,164,122.01	2,444,344.29	182,032,565.93		1,705,700,837.22
五、资产总额	12,329,395,500.91	779,329,103.96	6,124,937,763.65	265,706,574.59	32,431,662,221.62	1,780,000,000.00	50,151,031,164.73
六、负债总额	11,849,395,500.91	579,329,103.96	5,232,649,434.11	215,706,574.59	11,485,537,343.31		29,362,617,956.88
七、补充信息							
1、折旧和摊销费用	48,434,614.27	4,852,652.25	1,190,536.39	3,062,232.37	13,242,692.34		70,782,727.62
2、资本性支出	24,961,396.95	4,070,050.10	2,438,911.13	1,774,857.89	62,763,282.39		96,008,498.46
3、信用减值损失	707,041.72	180,290.56	4,111,474.17	96,405.12	-27,105,249.04		-22,010,037.47

## 2、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）	13,473,513,559.31	-2,139,088.89			18,873,090,456.71
2、衍生金融资产		56,857,832.76			704,900.00
3、其他债权投资	795,752,348.57		-10,874,938.20	971,299.89	1,019,343,647.45
4、其他权益工具投资	2,623,191,791.41		81,754,982.65		2,689,210,146.85
金融资产小计	16,892,457,699.29	54,718,743.87	70,880,044.45	971,299.89	22,582,349,151.01
金融负债	2,263,284,576.38	16,404,009.08			2,081,825,803.75

注：在当日无负债结算制度下，衍生金融资产项下的期货、利率互换、现货延期投资与相关的衍生品暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，为人民币 0.00 元。

## 3、金融工具项目计量基础分类表

### (1). 金融资产计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	15,965,993,258.22					



结算备付金	3,177,017,979.84					
融出资金	14,815,372,516.95					
衍生金融资产				704,900.00		
存出保证金	1,415,762,304.98					
应收款项	90,944,642.04					
买入返售金融资产	8,049,753,172.83					
交易性金融资产				18,873,090,456.71		
债权投资	169,918,187.76					
其他债权投资		1,019,343,647.45				
其他权益工具投资			2,689,210,146.85			
其他资产（金融资产）	113,686,328.18					
合计	43,798,448,390.80	1,019,343,647.45	2,689,210,146.85	18,873,795,356.71		
期初账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	13,906,547,252.59					
结算备付金	2,319,895,282.12					
融出资金	9,178,386,106.25					
衍生金融资产						
存出保证金	985,053,449.62					
应收款项	60,446,787.46					
买入返售金融资产	5,419,444,483.97					
交易性金融资产				13,473,513,559.31		
债权投资	152,973,211.90					
其他债权投资		795,752,348.57				
其他权益工具投资			2,623,191,791.41			
其他资产（金融资产）	122,556,274.35					
合计	32,145,302,848.26	795,752,348.57	2,623,191,791.41	13,473,513,559.31		

(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	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益	
			按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	252,520,360.23			
应付短期融资款	8,020,043,250.21			
拆入资金	1,157,635,555.53			

交易性金融负债		1,491,019,584.00	507,806,037.81	
衍生金融负债		83,000,181.94		
卖出回购金融资产款	6,523,824,040.22			
代理买卖证券款	16,392,827,620.76			
应付款项	629,811,282.05			
应付债券	6,673,626,986.44			
其他负债（金融负债）	71,583,754.25			
合计	39,721,872,849.69	1,574,019,765.94	507,806,037.81	
期初账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	246,534,740.68			
应付短期融资款	3,332,214,079.93			
拆入资金	200,956,944.44			
交易性金融负债		1,233,896,448.00	973,543,146.38	
衍生金融负债		55,844,982.00		
卖出回购金融资产款	2,867,625,222.31			
代理买卖证券款	13,595,885,739.85			
应付款项	505,767,453.18			
应付债券	4,155,167,123.38			
其他负债（金融负债）	69,220,025.70			
合计	24,973,371,329.47	1,289,741,430.00	973,543,146.38	

#### 4、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、债权投资				27,243.97	16,805,556.03
金融资产小计				27,243.97	16,805,556.03

#### 5、其他

√适用 □不适用

社会责任

2020年1-12月，公司在慈善捐款、扶贫救灾捐款等公益方面的投入金额合计3,649,933.00元。

具体明细如下：

项目	本期金额
慈善捐款	2,050,000.00
扶贫救灾捐款	1,599,933.00
合计	3,649,933.00

十七、 母公司财务报表主要项目注释

1、 长期股权投资

(1) 按类别列示：

项 目	期末余额	年初余额
子公司	1,962,023,770.79	2,027,236,819.31
联营企业	123,680,354.85	118,595,070.98
小 计	2,085,704,125.64	2,145,831,890.29
减：减值准备		65,213,141.21
合 计	2,085,704,125.64	2,080,618,749.08

(2) 对子公司的投资：

被投资单位	年初余额	增减变动	期末余额	在被投资单位持股比例(%)	在被投资单位表决权比例(%)	在被投资单位持股比例与表决权比例不一致的说明	减值准备	本期计提减值准备	本期现金红利
国金期货有限责任公司	318,011,660.50		318,011,660.50	100.00	100.00				
国金鼎兴投资有限公司	1,000,000,000.00		1,000,000,000.00	100.00	100.00				
国金创新投资有限公司	300,000,000.00		300,000,000.00	100.00	100.00				
国金证券（香港）有限公司	334,830,040.00	-334,830,040.00							
国金财务（香港）有限公司	8,421,920.00	-8,421,920.00							
国金金融控股（香港）有限公司[注]		278,038,911.48	278,038,911.48	100.00	100.00				
国金道富投资服务有限公司	65,973,198.81		65,973,198.81	55.00	55.00				
合 计	2,027,236,819.31	-65,213,048.52	1,962,023,770.79						

注:本期国金金融控股（香港）有限公司以发行股份为对价，从母公司和少数股东处取得国金证券（香港）有限公司和国金财务（香港）有限公司 100.00%的股权；本期母公司购买国金金融控股（香港）有限公司少数股东持有的全部股权。

(3) 对合营、联营企业的投资：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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

							润				
一、合营企业											
二、联营企业											
国金基金管理有限公司	118,595,070.98			5,085,283.87						123,680,354.85	
小计	118,595,070.98			5,085,283.87						123,680,354.85	
合计	118,595,070.98			5,085,283.87						123,680,354.85	

## 2、应付职工薪酬

### (1). 应付职工薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,796,776,637.46	2,697,972,973.18	1,864,750,313.67	2,629,999,296.97
二、离职后福利-设定提存计划	451,425.19	6,997,540.29	7,388,791.47	60,174.01
三、辞退福利	94,412.50	2,704,790.35	2,112,603.85	686,599.00
合计	1,797,322,475.15	2,707,675,303.82	1,874,251,708.99	2,630,746,069.98

### (2). 短期薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,768,256,285.12	2,546,564,047.24	1,730,083,811.45	2,584,736,520.91
二、职工福利费	6,300.00	1,222,964.24	1,227,389.24	1,875.00
三、社会保险费	263,653.74	47,849,758.58	47,754,258.73	359,153.59
其中：医疗保险费	236,711.35	44,089,331.20	43,981,605.57	344,436.98
工伤保险费	3,800.45	76,541.80	79,934.55	407.70
生育保险费	23,141.94	3,683,885.58	3,692,718.61	14,308.91
四、住房公积金	265,335.00	49,855,038.62	49,835,608.62	284,765.00
五、工会经费和职工教育经费	27,985,063.60	52,481,164.50	35,849,245.63	44,616,982.47
合计	1,796,776,637.46	2,697,972,973.18	1,864,750,313.67	2,629,999,296.97

### (3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	433,676.06	6,762,035.50	7,137,498.48	58,213.08
2、失业保险费	17,749.13	235,504.79	251,292.99	1,960.93
合计	451,425.19	6,997,540.29	7,388,791.47	60,174.01

## 3、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	1,418,899,976.41	1,130,073,524.46
其中：货币资金及结算备付金利息收入	459,695,763.40	350,328,621.38
融出资金利息收入	782,334,053.78	513,906,041.83
买入返售金融资产利息收入	121,867,823.28	191,950,984.97
其中：约定购回利息收入	193,299.35	1,178,040.90

股权质押回购利息收入	114,725,454.56	185,853,215.23
债权投资利息收入	7,393,112.57	16,618,941.78
其他债权投资利息收入	29,486,125.52	41,998,055.74
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	18,123,097.86	15,270,878.76
利息支出	707,807,584.11	567,689,636.68
其中：应付短期融资款利息支出	177,853,626.92	84,566,736.60
拆入资金利息支出	58,836,849.98	59,298,530.38
其中：转融通利息支出	23,703,194.44	956,944.44
卖出回购金融资产利息支出	154,127,012.96	146,639,702.16
其中：报价回购利息支出		
代理买卖证券款利息支出	56,000,626.19	41,415,303.71
应付债券利息支出	238,459,863.06	223,004,911.92
其中：次级债券利息支出	46,000,000.04	24,071,232.90
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	22,529,605.00	12,764,451.91
利息净收入	711,092,392.30	562,383,887.78

#### 4、 手续费及佣金净收入

##### (1). 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	1,556,521,084.45	1,081,267,316.80
证券经纪业务收入	2,023,471,862.61	1,386,442,160.26
其中：代理买卖证券业务	1,593,238,473.21	1,122,497,598.78
交易单元席位租赁	228,614,245.57	152,723,258.05
代销金融产品业务	201,619,143.83	111,221,303.43
证券经纪业务支出	466,950,778.16	305,174,843.46
其中：代理买卖证券业务	466,950,778.16	305,174,843.46
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
2. 期货经纪业务净收入		
期货经纪业务收入		
期货经纪业务支出		
3. 投资银行业务净收入	1,657,323,435.68	877,226,744.18
投资银行业务收入	1,686,493,294.60	898,512,939.50
其中：证券承销业务	1,534,414,781.53	710,117,757.64
证券保荐业务	81,735,186.11	44,889,060.38
财务顾问业务	70,343,326.96	143,506,121.48
投资银行业务支出	29,169,858.92	21,286,195.32
其中：证券承销业务	27,939,268.61	20,740,933.82
证券保荐业务		
财务顾问业务	1,230,590.31	545,261.50
4. 资产管理业务净收入	106,299,220.41	90,676,816.21
资产管理业务收入	109,364,236.31	91,632,135.71
资产管理业务支出	3,065,015.90	955,319.50
5. 基金管理业务净收入		

基金管理业务收入		
基金管理业务支出		
6.投资咨询业务净收入	89,968,221.90	80,680,278.26
投资咨询业务收入	89,968,221.90	80,680,278.26
投资咨询业务支出		
7.其他手续费及佣金净收入	61,701,426.52	28,612,935.01
其他手续费及佣金收入	61,701,426.52	28,612,935.01
其他手续费及佣金支出		
合计	3,471,813,388.96	2,158,464,090.46
其中：手续费及佣金收入	3,970,999,041.94	2,485,880,448.74
手续费及佣金支出	499,185,652.98	327,416,358.28

## (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	13,933,962.26	103,955,660.39
并购重组财务顾问业务净收入--其他	1,620,754.73	2,147,735.85
其他财务顾问业务净收入	53,558,019.66	36,857,463.74

## (3). 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	410,742,419,741.22	193,389,460.54	326,047,628,917.66	91,288,923.85
银行理财产品				
信托	2,723,353,000.00	4,624,374.64	2,454,390,000.00	16,904,509.91
其他	13,714,982,572.09	3,605,308.65	13,430,266,281.28	3,027,869.67
合计	427,180,755,313.31	201,619,143.83	341,932,285,198.94	111,221,303.43

## (4). 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	42	123	23
期末客户数量	2,665	123	256
其中：个人客户	2,637	15	
机构客户	28	108	256
期初受托资金	2,703,749,402.45	84,310,393,796.02	16,233,763,297.00
其中：自有资金投入	51,866,299.21	3,443,850,729.85	22,475,000.00
个人客户	1,672,984,103.49	60,000,100.38	
机构客户	978,898,999.75	80,806,542,965.79	16,211,288,297.00
期末受托资金	3,278,820,102.43	71,266,471,440.26	11,168,571,200.00
其中：自有资金投入	43,339,838.83	3,464,638,639.20	16,000,000.00
个人客户	2,833,256,022.36	602,840,383.59	
机构客户	402,224,241.24	67,198,992,417.47	11,152,571,200.00
期末主要受托资产初始成本	3,079,875,981.98	73,541,787,637.36	11,168,571,200.00

其中：股票	460,098,080.07	8,070,608,747.72	
国债	71,749,665.06		
其他债券	2,529,430,501.85	3,769,640,853.10	
基金	57,864,645.77	12,672,660.20	
其他	-39,266,910.77	61,688,865,376.34	11,168,571,200.00
当期资产管理业务净收入	26,802,086.01	64,409,659.13	15,087,475.27

手续费及佣金净收入的说明：

√适用 □不适用

注：产品正回购交易融入资金在“期末主要受托资产初始成本—其他”中扣减。

## 5、 投资收益

### (1). 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	5,085,283.87	446,188.06
金融工具投资收益	1,511,722,003.56	1,116,251,671.68
其中：持有期间取得的收益	895,367,323.12	950,798,755.06
— 交易性金融工具	895,367,323.12	799,801,540.26
— 其他权益工具投资		150,997,214.80
处置金融工具取得的收益	616,354,680.44	165,452,916.62
— 交易性金融工具	464,892,211.45	179,973,865.32
— 其他债权投资	2,063,690.04	-9,512,670.90
— 衍生金融工具	149,398,778.95	-5,008,277.80
合计	1,516,807,287.43	1,116,697,859.74

公司本期不存在投资收益汇回的重大限制。

### (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	895,367,323.12	799,801,540.26
	处置取得收益	504,567,470.14	179,586,991.28
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益	-8,833,321.65	9,992,751.42
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置取得收益	-30,841,937.04	-9,605,877.38

**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	-89,276,822.04	148,086,561.04
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	-9,142,945.18	24,869,029.52
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	13,954,363.14	-16,213,227.59
衍生金融工具	80,819,798.39	-33,661,813.61
合计	-17,599,968.83	139,293,776.95

**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	2,707,675,303.82	1,842,061,855.02
咨询费	83,270,142.84	83,189,210.53
电子设备运转费	82,118,468.62	58,335,774.19
租赁费	74,555,571.85	73,915,272.75
交易所会员年费	52,971,300.59	45,237,792.74
差旅费	46,096,990.03	61,313,222.01
折旧费	37,324,490.65	27,719,935.83
业务招待费	36,888,938.37	33,446,450.80
无形资产摊销	30,695,811.61	25,632,802.39
投资者保护基金	26,867,658.48	18,810,975.89
长期待摊费用摊销	12,150,336.65	11,625,866.40
其他	160,342,889.40	145,429,502.35
合计	3,350,957,902.91	2,426,718,660.90

**8、 其他**

√适用 □不适用

现金流量表补充资料

补充资料	本期金额	上期金额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	1,794,163,914.61	1,248,469,602.13
加：信用减值损失	70,812,901.30	-71,370,007.83
其他资产减值损失		35,518,931.09
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	37,324,490.65	27,719,935.83
无形资产摊销	30,695,811.61	25,632,802.39
长期待摊费用摊销	12,150,336.65	11,625,866.40



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）	-230.21	75,850.18
固定资产报废损失（收益以“－”号填列）	1,022,018.22	831,752.14
公允价值变动损失（收益以“－”号填列）	73,842,901.59	-127,036,668.46
利息支出（收入以“－”号填列）	379,434,251.89	248,954,651.00
汇兑损失（收益以“－”号填列）	1,201,526.08	-250,346.30
投资损失（收益以“－”号填列）	-7,148,973.91	-141,930,731.96
递延所得税资产减少（增加以“－”号填列）	-101,095,519.85	59,942,453.69
递延所得税负债增加（减少以“－”号填列）	-15,882,299.31	28,190,532.66
交易性金融资产的减少（增加以“－”号填列）	-5,187,624,508.40	-2,450,692,322.95
经营性应收项目的减少（增加以“－”号填列）	-8,829,830,620.98	-103,531,459.28
经营性应付项目的增加（减少以“－”号填列）	7,673,949,632.19	-824,861,531.55
其他		
经营活动产生的现金流量净额	-4,066,984,367.87	-2,032,710,690.82
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	16,113,854,965.04	13,837,752,577.14
减：现金的年初余额	13,837,752,577.14	12,640,538,061.18
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的年初余额		
现金及现金等价物净增加额	2,276,102,387.90	1,197,214,515.96

## 十八、 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	-974,961.09	
越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免		

计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	90,522,433.32	财政扶持及奖励款
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-6,209,278.10	
其他符合非经常性损益定义的损益项目	12,656,454.68	
所得税影响额	-23,998,662.20	
少数股东权益影响额	-356,146.41	
合计	71,639,840.20	

本公司持有交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有交易性金融资产期间取得的投资收益，以及处置交易性金融资产、其他债权投资、交易性金融负债和衍生金融工具取得的投资收益属于本公司正常经营业务，因此不作为非经常性损益项目。

**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	8.63	0.616	0.616
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	8.30	0.592	0.592

**3、其他**

√适用 □不适用

公司主要会计报表项目变动情况及原因说明

单位：元 币种：人民币

项 目	期末余额 (或本期金额)	年初余额 (或上期金额)	增减幅度 (%)	主要原因
结算备付金	3,177,017,979.84	2,319,895,282.12	36.95	报告期末客户交易结算资金增加。
融出资金	14,815,372,516.95	9,178,386,106.25	61.42	报告期末融资融券融出资金增加。
存出保证金	1,415,762,304.98	985,053,449.62	43.72	报告期末交易保证金增加。
应收款项	90,944,642.04	60,446,787.46	50.45	报告期末应收资产管理费增加。
买入返售金融资产	8,049,753,172.83	5,419,444,483.97	48.53	报告期末债券质押式回购增加。
交易性金融资产	18,873,090,456.71	13,473,513,559.31	40.08	报告期末债券投资增加。
固定资产	107,314,744.71	82,086,210.63	30.73	报告期末电子设备增加。
递延所得税资产	421,029,661.56	308,381,799.47	36.53	报告期末可抵扣暂时性差异增加。
应付短期融资款	8,020,043,250.21	3,332,214,079.93	140.68	报告期末短期融资券增加。
拆入资金	1,157,635,555.53	200,956,944.44	476.06	报告期末转融通融入资金增加。
卖出回购金融资产款	6,523,824,040.22	2,867,625,222.31	127.50	报告期末债券回购融入资金增加。
应付职工薪酬	2,689,797,674.48	1,848,955,477.50	45.48	报告期末已提未付职工薪酬增加。
应交税费	454,177,948.87	157,387,311.79	188.57	报告期末已提未付税金增加。
应付债券	6,673,626,986.44	4,155,167,123.38	60.61	报告期末应付公司债券增加。
手续费及佣金净收入	3,686,611,926.91	2,329,629,723.52	58.25	报告期内投资银行业务净收入、证券经纪业务净收入增加。
投资收益	1,339,785,548.97	994,000,895.19	34.79	报告期内交易性金融工具投资收益增加。
公允价值变动收益	71,122,752.95	245,401,722.57	-71.02	报告期内交易性金融工具公允价值变动减少。
业务及管理费	3,586,639,701.52	2,661,882,213.14	34.74	报告期内营业收入增加相应费用增加。
信用减值损失	99,601,924.21	-22,010,037.47	-	报告期内买入返售金融资产减值增加。
营业外收入	91,907,319.94	57,522,113.60	59.78	报告期内收到的政府补助增加。
所得税费用	550,695,831.67	407,637,958.36	35.09	报告期内公司利润总额增加相应所得税

				增加。
其他综合收益的税后净额	31,361,037.73	123,213,097.10	-74.55	报告期内其他权益工具投资公允价值变动减少。
经营活动产生的现金流量净额	-3,415,491,924.30	-1,874,236,164.66	-	报告期内为交易目的而持有的金融资产及融出资金增加。
投资活动产生的现金流量净额	-295,981,937.47	979,760,567.55	-130.21	报告期内债权投资收回的现金减少。
筹资活动产生的现金流量净额	6,652,764,569.72	2,327,742,624.49	185.80	报告期内发行债券收到的现金增加。

## 第十二节 备查文件目录

备查文件目录	载有董事长冉云先生签名的二〇二〇年度报告文本
备查文件目录	载有董事长冉云先生、主管会计工作的总经理金鹏先生、会计机构负责人李登川先生签章的财务报告文件
备查文件目录	报告期内在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》和《证券时报》上公开披露过的所有公司文件的正本及公告稿
备查文件目录	公司《章程》
备查文件目录	其他有关资料

董事长：冉云

董事会批准报送日期：2021 年 3 月 31 日

### 修订信息

适用 不适用

## 第十三节 证券公司信息披露

### 一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

时间	行政许可批复名称	行政许可批复文号
2020 年 1 月 17 日	关于核定国金证券股份有限公司短期融资券最高待偿还余额的通知	厅便函[2020]9 号
2020 年 1 月 21 日	关于核准国金证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复	证监许可[2020]191 号
2020 年 2 月 27 日	关于核准国金证券股份有限公司设立 6 家分支机构的批复	川证监机构（2020）9 号
2020 年 9 月 21 日	关于同意国金证券股份有限公司向专业投资者公开发行短期公司债券注册的批复	证监许可[2019]2295 号

### 二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2018 年度	A 类 A 级
2019 年度	A 类 A 级
2020 年度	A 类 AA 级