

公司代码：601555

公司简称：东吴证券

东吴证券股份有限公司 2021 年半年度报告

重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人范力、主管会计工作负责人袁维静及会计机构负责人(会计主管人员)王菁声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司本报告期末拟定利润分配预案、公积金转增股本预案。

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等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请投资者注意投资风险。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告的真实性和完整性

否

十、重大风险提示

公司主营业务与国内宏观经济环境、资本市场走势高度相关，经济金融政策变化和资本市场的波动都将对公司经营业绩产生重大影响。

公司已在本报告中详细描述在日常经营活动中可能面临的风险，本公司面临的重大风险主要包括政策风险、市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、声誉风险等。敬请查阅本报告第四节中可能面对的风险及应对措施。

十一、其他

适用 不适用

目录

第一节	释义	5
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	管理层讨论与分析.....	8
第四节	公司治理.....	31
第五节	环境与社会责任.....	33
第六节	重要事项.....	36
第七节	股份变动及股东情况.....	39
第八节	优先股相关情况.....	41
第九节	债券相关情况.....	41
第十节	财务报告.....	46
第十一节	证券公司信息披露.....	185

备查文件目录	载有法定代表人签名的半年度报告文本。
	载有法定代表人、主管会计机构负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报告原文。

第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
东吴证券/本公司/公司	指	东吴证券股份有限公司
中国证监会/证监会	指	中国证券监督管理委员会
江苏证监局	指	中国证券监督管理委员会江苏监管局
《章程》	指	《东吴证券股份有限公司章程》
上交所	指	上海证券交易所
东吴创投	指	东吴创业投资有限公司
东吴创新资本	指	东吴创新资本管理有限责任公司
东吴期货	指	东吴期货有限公司
东吴基金	指	东吴基金管理有限公司
东吴新加坡	指	东吴证券中新（新加坡）有限公司
东吴香港	指	东吴证券（香港）金融控股有限公司
元	指	人民币元

第二节 公司简介和主要财务指标

一、 公司信息

公司的中文名称	东吴证券股份有限公司
公司的中文简称	东吴证券
公司的外文名称	SoochowSecuritiesCo., Ltd.
公司的外文名称缩写	SCS
公司的法定代表人	范力
公司总经理	范力

注册资本和净资产

	本报告期末	上年度末
注册资本	38.81亿元	38.81亿元
净资产	180.62亿元	195.90亿元

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

公司主要单项业务资格详见附录。

二、 联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	杨伟	平磊
联系地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号	江苏省苏州工业园区星阳街5号
电话	0512-62601555	0512-62601555
传真	0512-62938812	0512-62938812
电子信箱	yangw@dwzq.com.cn	pingl@dwzq.com.cn

三、基本情况变更简介

公司注册地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号
公司注册地址的历史变更情况	报告期内未发生变更
公司办公地址	江苏省苏州工业园区星阳街5号
公司办公地址的邮政编码	215021
公司网址	www.dwzq.com.cn
电子信箱	dwzqdb@dwzq.com.cn
报告期内变更情况查询索引	报告期内未发生变更

四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载半年度报告的网站地址	http://www.sse.com.cn
公司半年度报告备置地点	江苏省苏州工业园区星阳街5号公司董事会办公室
报告期内变更情况查询索引	报告期内未发生变更

五、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码
A股	上海证券交易所	东吴证券	601555

六、其他有关资料

适用 不适用

七、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
营业收入	4,071,482,440.25	3,589,268,711.66	13.43
归属于母公司股东的净利润	1,336,415,624.22	1,030,536,040.36	29.68
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,316,755,652.80	1,028,809,390.32	27.99
经营活动产生的现金流量净额	1,073,139,896.08	7,023,079,205.73	-84.72
其他综合收益	-100,257,290.33	-182,176,738.39	-
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年同期末增减 (%)
资产总额	112,831,533,801.85	105,474,550,200.92	6.98
负债总额	84,329,424,276.08	77,264,229,402.54	9.14
归属于母公司股东的权益	28,164,916,797.95	27,879,893,402.91	1.02
所有者权益总额	28,502,109,525.77	28,210,320,798.38	1.03

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同 期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.35	0.29	20.69
稀释每股收益(元/股)	0.35	0.29	20.69
扣除非经常性损益后的基本每股收 益(元/股)	0.34	0.29	17.24
加权平均净资产收益率(%)	4.72	4.25	增加0.47个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净 资产收益率(%)	4.65	4.25	增加0.40个百分 点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用**(三) 母公司的净资本及风险控制指标**

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	18,062,012,694.18	19,590,074,763.47
净资产	27,269,068,880.87	27,346,839,994.08
风险覆盖率(%)	240.40	245.21
资本杠杆率(%)	21.04	21.28
流动性覆盖率(%)	226.40	261.77
净稳定资金率(%)	138.73	156.29
净资本/净资产(%)	66.24	71.64
净资本/负债(%)	38.05	41.20
净资产/负债(%)	57.45	57.51
自营权益类证券及证券衍生品/ 净资本(%)	22.14	29.53
自营非权益类证券及其衍生品/ 净资本(%)	178.62	162.08
融资(含融券)的金额/净资本(%)	123.93	107.29

八、 境内外会计准则下会计数据差异适用 不适用**九、 非经常性损益项目和金额**适用 不适用

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注(如适用)
非流动资产处置损益	487,088.01	
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	23,617,037.24	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-719,059.41	
其他符合非经常性损益定义的损益项目	9,223,035.22	
少数股东权益影响额	-4,847,877.55	
所得税影响额	-8,100,252.09	
合计	19,659,971.42	

十、其他

适用 不适用

第三节 管理层讨论与分析

一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

（一）报告期内公司从事的主要业务及经营模式

公司从事的主要业务包括经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务。

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，代销金融产品，通过互联网交易平台提供专业化研究和投资咨询服务，协助投资者作出投资决策，获取手续费、佣金及相关收入。

投资银行业务主要是向企业、机构（包括个人）、政府等提供金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板推荐、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务，获得承销费、保荐费、财务顾问费等相关收入。

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、直接投资类、衍生工具、做市业务及其他另类金融产品的投资交易，获取投资收益。

资管及基金管理业务是根据资产规模及客户需求开发资产管理产品、基金产品及提供相关服务，包括集合资产管理业务、单一资产管理业务、专项资产管理业务及基金管理业务，获取管理费、业绩报酬及其他收入。

信用交易业务主要包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务，获取利息及相关收入。

（二）报告期内公司所属行业的发展阶段、周期性特点以及公司所处的行业地位

2021 年，中国经济仍持续复苏，逐步进入常态化发展阶段。资本市场继续全面深化改革，证券行业处于新的发展阶段。证券行业规模和资本实力稳步增长，服务实体经济和投资者能力不断增强，合规和风险管理体系逐步健全，行业履行社会责任成效显著，行业文化建设全面推进，进一步夯实了稳中求进和守正创新的基础，证券行业高质量发展取得良好开端。

报告期内，中国经济运行稳中加固，发展动力进一步增强，证券行业景气度上升，沪深两市股指同比增长，上证指数上涨 3.40%，深证综指上涨 4.78%，行业业绩稳步提升。据中国证券业协会统计，截至 2021 年 6 月 30 日，139 家证券公司总资产为 9.72 万亿元，净资产为 2.39 万亿元，净资本为 1.86 万亿元，客户交易结算资金余额（含信用交易资金）1.79 万亿元，受托管理资金本金总额 10.45 万亿元。

近年来，公司坚持以建设规范化、市场化、科技化、国际化现代证券控股集团为发展愿景，以“坚持根据地、融入长三角、服务中小微”为战略导向，以客户为中心，立足新发展阶段，贯彻新发展理念，服务新发展格局，充分发挥多元化业务平台优势、全产业链服务的综合金融优势，持续提升风险合规管理水平，各项业务经营稳步推进，行业影响力逐年提升，公司连续七年获得证券公司分类评价 A 类 A 级。

二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

（一）扎根苏州、深耕长三角，具备显著的区位优势和发展潜力

长三角地区是中国经济最具竞争力和发展潜力的区域板块，公司长期扎根苏州，长期坚持“做深、做熟、做透、做细”的根据地发展方针，并积极融入长三角一体化发展国家战略，在长三角地区复制根据地战略，充分发挥长三角地区自然禀赋优良、经济基础雄厚、城镇体系完整、体制环境优良、科创资源密集的区位优势，依托优质客户资源，公司各项业务的开拓以及综合化经营得以加快推进。随着经济结构转型的深入推进以及《长江三角洲区域一体化发展规划纲要》的实施，长三角地区的市场空间将不断拓展，具备更加蓬勃的发展潜力，为公司未来奠定了良好的基础。

（二）组织优势、专业优势持续积累，综合业务竞争实力快速提升

公司有效推进战略布局、业务布局，持续积累组织优势和专业优势。投行业务以打造“一流投行”为愿景，坚持以企业需求为导向，依托专业优势，紧抓科创板及试点注册制改革机遇，围绕企业发展的全生命周期，为客户提供全产业链的综合金融服务；研究业务以提升研究和服务能力为核心目标，坚持“专业创造价值”的理念，为客户提供一流的品牌化投研服务，市场影响力逐年提升，对内服务公司战略，为各项业务提供智力支撑，将研究价值转化为投资价值，推动公司业务协同发展；境内外一体化的金融服务平台加快推进，实现了在新加坡、香港等境外资本市场的业务布局，更好服务长三角实体企业金融需求；大运营优化成效明显，从流程、管理以及 IT 等各方面构建了大运营体系，实现了经纪、资管、自营条线运营集中，全面提升服务和运营支撑能力。

（三）信息技术开发持续投入，金融科技赋能财富管理转型

公司一直以来高度重视金融科技建设工作，在业务引领、科技赋能的战略方针下逐步实现创新发展对业务发展的支撑与推动作用。在确保安全稳定运行的前提下，公司探索以大数据、云计算、区块链、人工智能作为核心推动力，目标实现公司经纪业务、投行业务、全面风险管理、大运营体系等的全面数字化转型。建设完成了新一代核心交易系统 A5、数据与技术中台、秀财财富管理 APP、新一代 CRM、全面风险管理平台、RAMS 信息系统支撑平台，大投行管理等一批行业领先的信息系统，实现了混合云基础建设、大数据分析治理、智慧服务体系等关键技术领域的

核心竞争力提升。新一代核心交易系统、信息技术应用创新、异地灾备中心、行业联盟链、私募线上销售等项目作为证券行业试点，获得了领导与专家的一致认可。其中，行业首个全内存、全业务集中交易系统 A5 与全新一代秀财 APP 的上线，标志着公司综合财富管理技术体系逐步建设完成，也将有效地提升客户行情交易体验，增强公司综合金融服务专业能力。

（四）具有完善的全面风险管理体系，合规风控管理审慎高效

公司切实按照“四个突出”的监管要求，全力以赴将“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化建设要求内化于心、外化于行，全面提升公司合规风控管理的能力、质量和效率，公司连续 7 年分类评级为 A 类 A 级。公司建立了良好的公司治理结构和规范的合规风控组织架构，各级管理和监督机构之间权责明确、运作规范；制定了有效的合规风控管理机制，包括风险应对和处理机制、常态化监督检查机制、有效激励和问责机制在内的各项机制；持续加大合规风险信息投入，运用科技手段实现合规风险的系统化管理，有助于不断提升合规风控能力，实现了风险合规管理与业务发展的统筹兼顾和动态均衡，保障了公司业务的持续健康发展。

（五）坚持党建引领，形成了东吴特色的企业文化和人才机制

公司始终坚持加强党的建设，将党的领导融入公司法人治理结构和现代企业制度，运用党的创新理论解决经营管理实际问题和推动事业发展，为企业深化改革、转型发展营造良好的发展环境，为公司建设成为规范化、市场化、科技化、国际化现代证券控股集团提供了重要保障。

公司深入贯彻证券行业文化建设要求，秉承“为实体经济增添活力、为美好生活创造价值”的企业使命，坚持“规范化、市场化、科技化、国际化的现代证券控股集团”的企业愿景，倡导“待人忠、办事诚、共享共赢”的核心价值观。公司核心管理团队长期保持稳定，高管团队具备丰富的金融从业和管理经验。公司不断完善用人机制和激励机制，加强干部队伍建设和人才培养工作，创新人才机制，释放人才活力，同时加大人才引进力度，搭建平台、营造氛围，打造了一支专业突出、素质过硬、作风优良的人才队伍。

三、经营情况的讨论与分析

“十四五”是证券行业迈向高质量发展的重要机遇期，全面注册制改革持续推进，市场活跃度进一步提升，券商聚焦实体经济提升服务能力，适应注册制要求向专业化、主动管理转型，在构建新发展格局中寻找新的定位，差异化发展愈加显著。

今年以来，公司顺应资本市场改革的步伐，牢固树立“坚持根据地、融入长三角、服务中小微”的战略导向，经营业绩同比实现增长。报告期内，公司实现营业收入 40.71 亿元，实现利润总额 17.31 亿元，净利润 13.45 亿元，归属于母公司股东的净利润 13.36 亿元。报告期末，公司总资产 1,128.32 亿元，归属于上市公司股东的净资产 281.65 亿元。

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

适用 不适用

四、报告期内主要经营情况

(一) 主营业务分析

1 财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	4,071,482,440.25	3,589,268,711.66	13.43
营业成本	2,339,749,828.12	2,258,227,411.90	3.61
经营活动产生的现金流量净额	1,073,139,896.08	7,023,079,205.73	-84.72
投资活动产生的现金流量净额	2,562,654,091.05	69,740,628.56	3,574.55
筹资活动产生的现金流量净额	-1,001,804,052.51	-1,340,440,208.42	-

公司实现营业收入 40.71 亿元，同比上升 13.43%，主要原因为：经纪及财富管理业务收入同比上升 39.20%，资管及基金管理业务收入同比上升 36.04%，信用交易业务收入同比上升 26.35%，投资与交易业务收入同比上升 2.37%。公司营业成本 23.40 亿元，同比上升 3.61%。主要原因为：经纪及财富管理业务成本同比上升 34.63%。

经营活动产生的现金净流入为 10.73 亿元，主要流入项目为：代理买卖证券收到的现金净额为 42.61 亿元；收取利息、手续费及佣金的现金为 32.06 亿元；拆入资金净增加额为 20.00 亿元；回购业务资金净增加额为 19.18 亿元；收到其他与经营活动有关的现金为 9.43 亿元。主要流出项目为：支付其他与经营活动有关的现金为 76.05 亿元；融出资金净增加额为 17.19 亿元；支付给职工及为职工支付的现金为 11.33 亿元；支付利息、手续费及佣金的现金为 7.48 亿元；支付的各项税费为 5.61 亿元。经营活动产生的现金流量净流入额比上年同期减少的主要原因是支付其他与经营活动有关的现金、支付给职工及为职工支付的现金、融出资金净增加额、支付的各项税费、支付利息、手续费及佣金的现金的增加。

投资活动产生的现金净流入为 25.63 亿元，主要流入项目为：收回投资收到的现金为 37.48 亿元；取得投资收益收到的现金为 3.59 亿元。主要流出项目为：投资支付的现金为 11.17 亿元；取得子公司及其他营业单位支付的现金净额为 3.72 亿元，购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金为 0.56 亿元。投资活动产生的现金净流入额较去年同期增加的主要原因是收回投资所收到的现金、取得投资收益收到的现金的增加。

筹资活动产生的现金净流出为 10.02 亿元，主要流出项目为：偿还债务支付的现金为 221.53 亿元；分配股利、利润或偿付利息支付的现金为 9.51 亿元；支付其他与筹资活动有关的现金为 3.51 亿元。主要流入项目为：取得借款收到的现金为 184.96 亿元；发行债券收到的现金为 39.91 亿元。筹资活动产生的现金净流出额较去年减少的主要原因是取得借款收到的现金、发行债券收到的现金较去年同期增加。

主营业务分行业、分产品、分地区情况：

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
经纪及财富管理业务	1,145,069,653.70	661,615,140.57	42.22	39.20	34.63	增加 1.96 个百分点
投资银行业务	398,942,931.31	241,129,401.61	39.56	-11.15	-0.39	减少 6.53 个百分点
投资与交易业务	1,758,293,870.15	837,375,582.09	52.38	2.37	-0.13	增加 1.20 个百分点
资管及基金管理业务	261,306,710.45	151,669,170.72	41.96	36.04	-32.92	增加 59.66 个百分点
信用交易业务	503,268,103.62	166,011,242.42	67.01	26.35	-59.13	增加 68.98 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
江苏省内	564,877,807.49	250,381,944.43	55.68	10.26	27.55	减少 6.01 个百分点
江苏省外	158,931,695.50	64,894,672.86	59.17	12.24	32.88	减少 6.34 个百分点
总部及子公司	3,347,672,937.26	2,024,473,210.83	39.53	14.05	0.57	增加 8.11 个百分点
合计	4,071,482,440.25	2,339,749,828.12	42.53	13.43	3.61	增加 5.45 个百分点

1. 经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，通过提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。报告期内，经纪及财富管理业务实现营业收入 11.45 亿元，同比增长 39.20%。

公司积极推进财富管理转型，优化组织架构，经管委更名为财富管理委员会，设立秀财事业部，发展金融科技，全力打造新一代数字化财富管理模式，服务客户投资理财需求。报告期内，公司完善了分支机构评价体系，稳步推进梯队人才建设，强化团队管理，市场化改革日趋完善；持续推进公司经纪业务数字化运营体系建设，提高业务流程线上化、自助化率，有效支持了各业务场景的数字化闭环运营及业务开展的降本增效，稳步推进财富管理平台建设，完善秀财 APP，强化业务系统支撑；进一步推进精细化管理，对网点布局进行优化，推进数字网点建设。

报告期内，公司经纪业务新增客户数量，较去年同期增长 40%。代理买卖业务成交量（A 股+基金）21901 亿元，同比增长 9.3%，市场占比 0.946%，比去年同期下降 10.5%。

公司研究所持续推进研究团队建设，强化研究咨询质量，实现研究行业全覆盖。目前，已形成以总量金融、上游能源、高端制造、大消费和 TMT 五大产业链研究为核心的证券投资研究体系，覆盖包括宏观、固定收益、金融工程、策略、新三板、海外及全部二十八个申万一级行业研究领域。报告期内，研究所持续用一流的研究服务开拓并维护公募基金机构客户及一些优质保险资管、私募客户等，完善研究业务对内服务，积极探索投行、经纪、研究一体化的服务模式，发挥产业链优势服务公司核心客户，提升研究定价能力，为客户创造更高价值。

公司通过控股子公司东吴期货有限公司开展期货经纪业务。报告期内，东吴期货利用期货市场风险管理与价格发现的重要功能，为实体企业、机构投资者和个人投资者提供多元化的风险管理与财富管理服务。东吴期货着力提升综合服务、科技赋能、人才引领、党建强企、合规风控五个方面，全面开拓进取、创新发展，业务规模与营收保持稳健快速发展。报告期内，东吴期货完成总成交量 11,797.21 万手，同比增长 69.9%，市占率 1.59%，同比增长 15.2%；总成交金额 70,548.08 亿元，同比增长 98.5%，市占率 1.23%，同比增长 14.7%，成交量与成交金额的增长幅度超越全市场。东吴期货在大商所的成交量排名由 2020 年全年的第 25 名上升至第 19 名，在郑商所的成交量排名保持第 6 名。报告期内，东吴期货实现营业收入 91,451.65 万元，实现净利润 3,197.42 万元。

2. 投资银行业务

投资银行业务主要是向机构客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板业务、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务。报告期内，公司投资银行业务实现收入 3.99 亿元，同比减少 11.15%。

股权融资业务。股权融资业务紧紧围绕公司战略方针，加强承揽承销，推动专业聚焦。坚持苏州核心根据地战略，“点+面”合力确保项目储备，提升苏州市占率；稳步提升外区域业务规模，以“点”带“面”，打造东吴品牌；坚持“抓早抓小、投早投小”，以产业链推进业务协同；稳步完善架构建设及团队扩张，精细化推进内部管理；今年上半年，公司完成 IPO 项目 4 单，再融资项目 4 单，根据 WIND 数据，合计募资 31.4 亿元，其中，华亚智能为深市主板、中小板合并后的首批上市企业；上声电子为科创板首家成功上市的汽车声学企业；明志科技为中国铸造行业首家科创板上市公司。报告期内，公司在第十四届新财富最佳投行评选榜单中荣获进步最快投行等多个奖项、荣获 2020 年度 wind 股权承销快速进步奖和 wind 再融资承销快速进步奖、荣获《证券时报》最受上市公司尊敬的成长性投行奖项。

固定收益业务。公司深入贯彻根据地战略，持续深化与地方政府、地方国有企业以及地方金融机构的战略合作，公司债券及企业债券融资在苏州大市持续保持领先地位，市占率超过 50%；同时积极拓展南通、徐州、无锡、连云港、镇江等省内市场，公司债券+企业债券承销规模保持江苏省内第一；积极实践债券创新品种，储备和推进短期公司债、创新创业公司债/科技创新公司债、

绿色债券/碳中和公司债、扶贫债/乡村振兴债等创新项目。据 wind 统计，2021 年上半年，公司合计承销各类信用债券 99 只，承销规模合计 609.38 亿元，同比分别上升 11.24%和 32.55%。其中公司债+企业债承销规模合计 358.75 亿元，较 2020 年同期上升 16.08%，行业排名第 15 名，较去年同期相比上升 3 名。创新业务方面，公司成功发行全国首批基础设施公募 REITs-东吴苏园产业 REIT 项目，并顺利完成了中建 14 期工程尾款资产支持专项计划、元禾控股科创债、吴中金控双创债、太湖旅游碳中和绿色公司债等创新项目。

新三板业务。报告期内，新三板市场深化改革的效力逐步显现，公司加大市场拓展力度，做好优质项目储备，坚持实干进取，业务稳中求进。2021 年上半年，公司推荐挂牌企业 2 家，新增申报挂牌企业 4 家，行业并列第 6 名；完成挂牌企业定向发行 12 次，融资次数行业排名第 5 名；申报精选层项目 3 家，申报家数行业并列第 2 名。截至 2021 年 6 月 30 日，公司累计挂牌项目数量为 438 家，行业排名第 5 名，督导企业家数为 290 家，行业排名第 3 名。累计申报精选层家数为 6 家，行业排名第 6 名。

3. 投资与交易业务

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。报告期内，公司投资与交易业务共实现业务收入 17.58 亿元，同比增长 2.37%。

权益类证券投资方面，2021 年上半年，A 股大幅震荡，热点切换频繁，公司权益类投资整体表现稳健。公司优化资产配置结构，加大底层基础资产的配置，加强对量化投资领域的拓展，进一步巩固中间层资产投资，提高资金使用效率，深入挖掘，拓展重点投资项目。同时积极发展创新业务，进一步完善创新业务基础设施，积极准备场外期权一级交易商资格申请。

固定收益类证券投资方面，2021 年上半年债券市场总体呈现宽幅震荡格局，公司有效控制风险和市值波动，固定收益类投资总体收益稳健。公司进一步加大“固收+”策略投资框架建设投入力度，探索不同种类金融资产的定价方法，优化资产配置结构，采取主动投资管理模式，综合运用利率衍生品等多种金融工具，有效对冲市场利率风险，提高整体投资交易能力。同时公司积极拓展创新业务，报告期内有序推进黄金 ETF、信用风险缓释工具、深交所报价回购等多品种业务资格的申请与筹备。

公司通过全资子公司东吴创新资本开展另类投资业务。上半年，东吴创新资本继续贯彻落实根据地战略，业务范围立足苏州，辐射长三角，逐步提升业务能力、管理能力、风控能力，保证资产稳健增值的基础上，适度把握新的投资领域，配合公司投行部门推进科创板跟投工作，携手智能制造行业的头部企业投资建设智能科技产业园。上半年，东吴创新资本实现营业收入 25,878.71 万元，净利润 19,600.76 万元。

公司通过全资子公司东吴创投开展私募股权投资基金业务。上半年东吴创投积极拓展苏州及长三角的项目资源，完成苏州东吴产业并购引导基金合伙企业（有限合伙）的设立工作，母基金已经完成首期出资。截止到 6 月底，共完成五个项目的股权投资，金额 39000 万元。东吴创投上半年实现营业收入 1,963.96 万元，净利润 955.24 万元。

4. 资管及基金管理业务

资管及基金管理业务是提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。报告期内，资产管理业务实现收入 2.61 亿元，同比增长 36.04%。

公司资管业务继续向主动管理转型，聚焦固定收益产品，引进人才，加速梯队建设，加强投资管理，优化流程，严守风控底线。公司资管产品类型不断丰富、固收主力产品规模不断扩大，产品业绩良好，资管各期限的固收产品没有出现信用和流动性风险。上半年公司共计新设资管计划 34 只，其中，固定收益类 18 只，权益类 5 只，混合类 11 只。截至报告期末，按净资产口径统计公司受托资管管理总规模 625.09 亿元。

公司通过控股子公司东吴基金开展基金管理业务。报告期内，东吴基金沿着“权益突围、固收筑基”的发展路径，聚焦优质战略合作客户，深耕细作夯实主动管理基础。报告期内，东吴基金抢抓契机，发行“东吴瑞盈”摊余债基，做优资管结构；与母公司合作，完成“东吴苏州工业园区产业园封闭式基础设施证券投资基金”基础设施公募 REITs 项目，并作为管理人；全面布局互联网金融渠道，主题基金改造成效初显；拓宽专户主动发展脉络，专户定增一对多产品落地。

截至 6 月 30 日，东吴基金管理的资产规模合计 392.95 亿元，其中，公募基金管理规模 261.92 亿元，专户资产管理规模 128.82 亿元，子公司专项资产管理规模 2.21 亿元。截止 6 月 30 日，东吴基金实现营业收入 11,235.63 万元，同比增长 25.83%；实现净利润 1,475.61 万元，同比增长 151.14%。

5. 信用交易业务

信用交易业务主要为个人及机构客户提供包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等资本中介业务。报告期内，信用交易业务实现营业收入 5.03 亿元，同比增长 26.35%。

报告期内，公司融资融券业务进一步完善风险管理，不断筑牢风险堤坝，加强客户服务，开展转融通等新业务，两融业务规模创公司历史新高。公司两融系统顺利完成 A5 系统切换，运行平稳；融资融券担保品（股票）评分模型初步完成搭建，风控评价体系进一步完善。截止 6 月 30 日，公司两融业务规模 201.13 亿元，比年初增长 10.46%，同比增长 55.6%。

报告期内，公司股票质押业务形成结构优化、资产质量持续提升的发展态势。公司严控风险，高质量开展新增股质业务及展期业务，继续加大风险资产处置力度，风险资产规模明显下降。同时，公司加强信用质控体系建设，提高业务管理信息化水平，实现业务稳健发展。

截止 6 月 30 日，公司融资融券业务规模为 206.13 亿元，总体维持担保比例为 318%。表内股票质押业务规模 42.55 亿元，表内股票质押担保物市值 82.97 亿元，维持担保比例为 195%，表外股票质押业务规模为 22.49 亿元。

2 本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

(二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

(三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上年期末数	上年期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上年期末变动比例 (%)	情况说明
存出保证金	4,745,059,736.24	4.21	3,125,558,058.04	2.96	51.81	主要是由于本期末交易保证金和履约保证金增加所致
应收款项	4,239,008,450.20	3.76	376,891,916.23	0.36	1,024.73	主要是由于本期末定期贷款增加所致
债权投资	93,037,236.34	0.08	224,095,373.07	0.21	-58.48	主要是由于本期末定向工具规模减少所致
其他权益工具投资	2,353,135,875.60	2.09	3,843,359,653.81	3.64	-38.77	主要是本期其他权益工具处置所致
固定资产	1,557,498,278.34	1.38	649,911,472.33	0.62	139.65	主要是由于本期在建工程转入固定资产所致
在建工程			879,705,555.60	0.83	-100.00	主要是由于本期在建工程转入固定资产所致
短期借款	4,634,321,839.62	4.11	1,069,956,134.02	1.01	333.13	主要是由于本期末信用借款增加所致
拆入资金	2,002,022,222.22	1.77			-	主要是由于本期末转融

						通融入款项增加所致
交易性金融负债	1,268,950,682.54	1.12	1,978,636,180.90	1.88	-35.87	主要是由于本期末合并结构化主体产生的交易性金融负债减少所致
应交税费	178,276,113.52	0.16	417,602,767.42	0.40	-57.31	主要是由于本期末应付企业所得税减少所致
应付票据	272,570,000.00	0.24	177,170,000.00	0.17	53.85	主要是由于本期末应付银行承兑汇票增加所致
应付账款	992,240,672.00	0.88	405,002,473.26	0.38	145.00	主要是由于本期末交易所质押借款增加所致
递延所得税负债	97,450,648.79	0.09	57,846,309.94	0.05	68.46	主要是由于本期末应纳税暂时性差异增加所致
其他负债	1,522,790,624.54	1.35	802,986,871.92	0.76	89.64	主要是由于本期末应付股利增加所致

2. 境外资产情况

√适用 □不适用

(1) 资产规模

其中：境外资产 1,301,958,816.08（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 1.15%。

(2) 境外资产相关说明

□适用 √不适用

3. 截至报告期末主要资产受限情况

√适用 □不适用

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见“第十节 财务报告 附注 5、61 所有权或使用权收到限制的资产”的相关内容。

4. 其他说明

□适用 √不适用

(四) 投资状况分析

1、 对外股权投资总体分析

√适用 □不适用

报告期末，集团长期股权投资 19.35 亿元，与上年末相比增加 3.97 亿元，增幅为 25.79%。具体内容详见“第十节 财务报告 附注 5、12 长期股权投资”和“附注 7、在其他主体中的权益”。

(1) 重大的股权投资

√适用 □不适用

被投资单位名称	主营业务	持股比例	期末账面价值	报告期投资收益
苏州资产管理有限公司	不良资产管理	20%	1,295,405,235.43	60,367,187.62
东吴（苏州）金融科技有限公司	网络技术服务	32%	234,083,090.63	-5,300,628.46

(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

参见“第十节 财务报告 附注 9、1 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值”

(五) 重大资产和股权出售

□适用 √不适用

(六) 主要控股参股公司分析

√适用 □不适用

1. 东吴基金管理有限公司，注册资本为 1 亿元人民币，公司持有 70% 的股权，经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。截止 2021 年 6 月 30 日，东吴基金总资产 4.76 亿元，净资产 3.29 亿元，2021 年上半年实现营业收入 11,235.63 万元，净利润 1,475.61 万元。

2. 东吴期货有限公司，注册资本为 7.7 亿元人民币，本公司持有 93.8% 的股权，其经营范围包括：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询、资产管理等业务。截止 2021 年 6 月 30 日，东吴期货总资产 99.80 亿元，净资产 9.74 亿元，2021 年上半年实现营业收入 91,451.65 万元，净利润 3,197.42 万元。

3. 东吴创业投资有限公司，注册资本为 12 亿元人民币，为公司全资子公司，其经营范围包括：创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。截止 2021 年 6 月 30 日，东吴创投总资产 12.47 亿元，净资产 12.26 亿元，2021 年上半年实现净利润 955.24 万元。

4. 东吴创新资本管理有限责任公司，注册资本为 50 亿元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：另类投资。截止 2021 年 6 月 30 日，东吴创新资本总资产 45.96 亿元，净资产 45.83 亿元，2021 年上半年实现净利润 19,600.76 万元。

5. 东吴证券中新（新加坡）有限公司，注册资本为 6000 万新加坡元，为公司控股子公司。截止 2021 年 6 月 30 日，东吴新加坡总资产 2.78 亿元人民币，净资产 2.68 亿元人民币，2021 年上半年实现营业收入 1,520.23 万元人民币，净利润 653.81 万元人民币。

6. 东吴证券（香港）金融控股有限公司，注册资本 12.60 亿港元，为公司全资子公司。截止 2021 年 6 月 30 日，东吴香港总资产 71.43 亿元人民币，净资产 14.32 亿元人民币，2021 年上半年实现净利润 17,301.98 万元人民币。

(七) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

本集团合并的结构化主体主要是指本集团作为管理人或投资者的资产管理计划。本集团综合评估因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。

本年纳入本集团合并报表范围的结构化产品共 22 个（其中有 3 个产品已于 2021 上半年度清算）。于 2021 年 6 月 30 日，合并资产管理计划的总资产为人民币 4,663,258,860.06 元。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险

√适用 □不适用

1. 公司经营活动面临的主要风险

(1) 政策性风险

政策性风险指国家宏观调控措施、与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等的变动，对公司经营产生的不利影响。一方面，国家宏观调控措施对证券市场影响较大，宏观政策、利率、汇率的变动及调整力度与金融市场的走势密切相关，直接影响公司的经营状况；另一方面，证券行业是受高度监管的行业，监管部门出台的监管政策直接关系到证券公司的经营情况变动，若公司在日常经营中因不适应或违反法规、政策或监管要求，可能会受到监管机构罚款、暂停或取消业务资格等行政处罚，导致公司遭受经济损失或声誉损失。

(2) 市场风险

市场风险指因市场利率、汇率、证券及商品价格的不利变动或急剧波动而导致公司所持有的金融资产发生损失的风险。市场风险包括利率风险、股票价格风险、汇率风险及衍生品标的价格

波动风险等。公司的市场风险主要涉及股票投资、债券投资、产品投资、衍生品交易及资产管理相关投资业务。主要表现为所投资证券价格发生不利变动或波动引起的投资损失的可能性。

（3）信用风险

信用风险是指公司在开展业务时，发行人、交易对手未能履行合同规定的义务或由于信用等级下降、履约能力下降，给证券公司带来损失的风险。公司的信用风险主要源于融资融券业务、股票质押式回购交易等信用业务以及非权益类投资业务等。主要表现为债券等主体违约、交易对手违约、客户违约等造成公司损失的可能性。

（4）操作风险

操作风险主要指在公司业务范畴内，由于不完善或有问题的内部程序、员工和信息系统或外部事件给公司业务造成直接或间接损失的风险。主要表现在由内部程序、人员、信息系统、外部事件等原因，引发客户投诉、信访、诉讼，或导致账户透支、各类业务差错、系统故障事件，甚至收到内外部监管函件等，最终给公司带来直接损失或造成监管扣分、负面影响的可能性。

（5）流动性风险

流动性风险，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。公司的流动性风险可能来自于资产负债结构不匹配、资产变现困难、交易对手延期支付或违约，以及市场风险、信用风险、声誉风险等类别风险向流动性风险的转化等。

（6）声誉风险

声誉风险主要是指因公司经营管理及其他行为或外部事件导致证券公司股东、员工、客户、第三方合作机构及监管机构等对证券公司的公开负面评价的风险。公司声誉风险主要是由合规性风险、操作风险、流动风险、信用风险、员工道德风险等引起。

2. 公司已经或计划采取的风险应对措施

报告期内，公司风险管理工作围绕增强风险防控能力、推动公司高质量发展的工作部署，认真落实公司总体风控政策，实施风险总量管理、风险分类管理、业务分类风险管理，建立科学有效的风险控制指标体系，对公司面临的风险及其变化趋势进行识别、评估、监测、分析，提出相应控制措施及应对方案，始终做到公司风险的可知、可控、可承受。

（1）持续推进全面风险管理体系

公司的风险管理组织架构由公司董事会下设的风险控制委员会、经营管理层下设的风险管理委员会及首席风险官、风险管理部门、业务部门和分支机构设立的合规风控专员四个层级构成。公司设首席风险官负责公司全面风险管理工作，风险管理部门推动全面风险管理工作，监测、评

估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构和子公司的风险管理工作。各业务部门、分支机构和子公司在日常工作中全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

公司风险管理制度体系基本健全，自上至下覆盖各类别风险、各项业务，为日常风险管理工作提供明确的依据和指导原则。公司制订了《风险管理基本制度》，并按照风险类型分别制订了公司层级的《风险管理办法》、《市场风险管理实施细则》、《信用风险管理实施细则》、《操作风险管理实施细则》、《流动性风险管理办法》、《子公司风险管理实施细则》等，同时针对各业务分别制订了相应的具体风险管理工作规则。

公司制定了年度风险偏好、风险容忍度及风险限额等风险控制指标体系，强化风险控制指标落实执行。风险偏好按照公司经营和风险管理目标、风险应对政策以及外部信用评级方面进行描述；风险容忍度指标按照流动性风险、市场风险、操作风险、信用风险分别设置；风险限额管理根据公司资本、业务和风控监管指标情况，针对不同风险种类和各业务条线的特点，由公司经营层根据市场及经营情况在授权范围内对风险容忍度指标进一步分解、细化和落实经营授权限额指标和风险分类关键指标。

公司通过制度建设、分级授权建立完善覆盖各项业务的风险控制措施及应对机制，根据风险监测和评估结果，选择与公司风险偏好相适应的风险回避、降低、转移和承受等应对策略，建立起合理、有效的资产负债管理、资本补充、资产减值、风险对冲、规模调整等应对机制。建立了风险应急机制以应对流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件，制定及时有效的应急应变措施和预案，明确应急触发条件、风险处置的组织体系、措施、方法和程序，并通过压力测试、应急演练等机制进行持续改进。建立了顺畅的风险报告与应对机制，对于一般风险事件由各部门、分支机构、子公司提出处理方案，风险管理部门监督并跟踪执行情况；对于重大风险事件，各部门、分支机构、子公司、风险管理部门将有关情况连同处理建议报首席风险官和相关领导，风险事件处置完成后，各部门、分支机构及子公司会同风险管理部门评估原因，并据此完善制度流程；对于风险责任人，按照公司制度问责或处罚。

公司风险管理系统基于业务复杂程度和风险指标体系，运用科技手段实现符合整体风险管理需要的系统化管理，系统对业务与风险信息进行采集、汇总、计量、预警和监控，覆盖各风险类型、业务条线、业务部门、分支机构及子公司，并致力于实现同一业务、同一客户相关风险信息的集中管理。根据公司信息系统建设规划和数据管理规划，每年制定风险管理信息技术系统专项预算，推进风险管理系统建设工作，完善风险数据管理和质量保障机制，明确风险管理系统和风险数据集市的应用目标、管理范围、实现手段、工作流程，逐步提升风险管理系统管控能力和风险数据应用价值。

公司开展业务或者产品创新建立内部评估和审查机制，对创新业务或产品的合规性、可行性

和可能产生的风险进行充分的评估论证，并制定管理制度，明确操作流程、风险控制措施和保护客户利益的措施。风险管理及合规部门全程参与创新业务的方案论证、风险与收益特征评估、多元化风险应对策略制定、风控指标设定等，财务部、信息技术部等中后台部门参与相关制度的制定和系统建设等，确保中后台的意见在方案、制度、策略中体现。创新活动开展后，注重过程的控制，及时纠正偏离目标行为，建立覆盖公司全部业务的动态监控系统，针对不同业务和产品制定相应的风险限额，对于超越风险限额的情况进行准确计算、动态监控和自动预警，并建立资本补充与业务规模、结构调整机制，明确异常情况的报告路径和处理办法。

公司建立健全信息披露及信息报告机制，规范各类重要信息收集、处理、传递、贮存及使用流程，保障各部门、分支机构及子公司、风险管理部门、经营管理层、董事会之间风险信息传递与反馈的及时、准确、完整，保障信息披露及信息报告的规范、及时。各部门、分支机构及子公司对所负责事项的内部控制执行情况、风险暴露状况以及实质性风险损失进行定期和不定期评估与分析，形成内部控制与风险评估报告。

（2）各类风险的应对措施

① 市场风险的控制

公司主要从限额管理、证券池管理、风险评估及风险对冲等方面来控制公司的市场风险。

限额管理：公司建立自上而下的风险限额指标，包括市场风险敞口、投资集中度以及止盈止损等关键风控指标，通过交易系统及风险管理系统，事前控制和动态监测投资交易行为及资产变动情况，及时进行风险预警提示。设置单一标的在多个业务条线及投资组合的集中度指标，分散单证券投资风险；通过设置单项投资的止盈止损、各业务条线损失限额以及公司市场风险总容忍度，有效控制单项投资和公司自营投资业务市场风险亏损过大的情况。

证券池管理：公司建立证券池管理机制，通过证券池分级管理，细化投资标的优选标准及投资额度，严格把控投资标的资质，强化事前投资准入审核；持续监测跟踪标的资质变动，及时更新证券池标的；定期评估证券池准入标准，结合业务开展需求和市场行情，优化准入要求。

风险评估：公司根据市场环境变化，结合投资策略，强化对标的跟踪及产品投资的风险穿透式管理，全面评估业务承担的市场风险；运用市场风险计量等方法定期评估公司面临的市场风险状态和风险承受能力，包括但不限于投资绩效分析、市场风险指标（在险价值、希腊字母风险指标等）的测算、压力测试等方法；针对市场大幅波动或面临较强下跌风险时，加大测算频率，控制公司在极端情况下可能承担的风险损失，确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。

风险对冲：公司积极研究量化对冲等投资策略，灵活运用量化模型及金融衍生工具，开展风险中性的投资交易业务、对冲部分市场风险敞口。公司通过期货、期权、互换等场内外衍生品对冲股票价格波动、利率变化等风险因子对组合收益的影响，同时积极寻找市场套利机会，通过Delta、

Gamma、DV01、久期等风险敏感性指标，跟踪监测市场风险指标，有效控制方向性风险敞口。

② 信用风险的控制

公司主要采取证券标的信用评估、交易对手管理、尽职调查、限额管理、风险化解与处置及合同管理等方式控制信用风险。

证券标的信用评估：在非权益类证券投资业务中，公司通过建立证券池管理机制和统一内部信用评级机制，细化投资标的筛选标准，定期、不定期评估、更新证券池准入标准和证券池标的，强化事前准入审核，严防非权益类证券信用风险；持续跟踪债券发行人信用变化，对信用风险显著增加的投资标的，及时调整内评等级。在信用业务中，建立标的证券评级、评估体系，审慎评估标的资质，确定证券质押率，密切跟踪质押、担保标的风险事项，评估对客户及公司的影响。

交易对手管理：在非权益类证券投资业务中，选择资本实力强，盈利状况好，管理和运作规范、信用良好的交易对手，建立交易对手库，并定期、不定期评估、更新交易对手清单，减少不良交易对手产生的信用风险，持续跟踪交易对手信用状况变化，评估其偿债能力。对信用业务客户，全面了解客户资信水平和风险承受能力，综合确定客户信用评级、授信额度，采取盯市、回访等措施及时了解客户信用资质变化，评估其偿债能力，对于失信客户执行黑名单管理。

尽职调查：在非权益类证券投资中，对债券发行人、交易对手开展必要的尽职调查，研究债券发行人、交易对手的偿债、履约能力，规避兑付风险。在信用业务中，加强事前尽职调查，从融入方资信状况、资金用途、还款来源及增信措施等多方面了解、评估项目风险情况，提交全面的项目可行性分析报告、尽职调查报告等，为公司业务决策提供支持。

限额管理：在非权益类证券投资业务方面，设定同一标的、同一发行人风险敞口、集中度指标；在信用业务方面，设定单一客户、单一证券信用风险敞口、集中度指标，控制单一品种、单一业务或单一客户的信用风险。通过信用风险限额管理，进一步加强对债券投资、股票质押等重点业务领域风险管控。

风险化解与处置：定期对投资的非权益类证券、信用业务开展风险排查工作，第一时间发现潜在风险，及时采取必要的风险化解措施，避免债券发行人、信用业务融资人资信情况恶化给客户、公司带来的损失。对于违约风险项目，及时采取风险处置措施，并充分做好与客户的沟通工作，尽可能避免或降低信用风险给客户、公司造成的损失。

合同管理：公司在合同订立的过程中严格贯彻公司的有关制度，实行分级审批，防止欺诈或不公平条款产生的合同风险。

③ 操作风险的控制

公司主要通过制度流程管理、决策授权管理、人员和权限管理、系统管理等措施控制操作风险。

制度流程管理：公司建立和完善各项业务制度，优化操作流程，定期梳理和评估各业务的操作风险点，制定相应的控制措施，事先建立重大操作风险应急预案和风险处置流程。

决策授权管理：公司建立业务决策授权体系，定期调整各决策委员会、业务部门的职责与决策授权权限，明确授权的范围、事项、权限、时效和责任，并严格按照授权逐级审批、设置相应的系统权限，定期检查权限执行情况，确保授权管理的有效落实。

人员和权限管理：公司通过细化部门岗位职责和权限、建立培训机制、优化考核机制，加强人员管理。公司依据重要业务部门、关键岗位之间不相容、适当分离及相互制约的原则，逐步细化各部门的岗位职责，合理分配人员权限，完善各业务系统的权限管理，确保人员岗位精确覆盖业务操作各个环节；公司通过加强人员业务知识、专业技能、系统操作、合规风控、职业道德等培训，提高员工素质、防范道德风险、减少操作失误；同时公司通过激励与约束并行的绩效考核机制，提高员工责任心，降低操作差错。

系统管理：公司建立设计严谨、逻辑清晰的业务生产及业务管理系统，设置必要的操作风险控制节点，通过系统自动化，有效控制业务操作中的人为失误与差错；公司建立操作风险系统，收集操作风险数据，识别重点业务的重点操作风险部位，形成操作风险预警机制；同时通过建立应急预案和定期演练，在信息系统发生故障时，降低负面影响，减少实际损失。

④ 流动性风险的控制

公司主要通过对流动性的统筹管理、跟踪监测以及应急测试等措施控制流动性风险。

流动性统筹管理：公司坚持资金的整体运作，由资金运营部负责管理公司的资金调配。在境内交易所和银行间市场，公司具有较好的资信水平，维持着比较稳定的拆借、回购等短期融资通道；同时也通过公募或私募的方式发行公司债、次级债、收益凭证等补充公司长期运营资金，从而使公司的整体流动性状态保持在较为安全的水平。

公司不断完善流动性管理体系，在微观操作上，公司强化资金头寸管理，确保日间流动性安全；在宏观策略上，公司建立优质流动性资产储备池，持有充足的高流动性资产以满足公司应急流动性需求。

流动性跟踪监测：公司对未来一段时间内的资金负债情况进行每日监测与评估，通过对特定时间点和时间段的资产负债匹配情况的分析以及对资金缺口等指标的计算，来评估公司的资金支付能力。

公司严格按照监管部门风险控制指标中有关规定进行证券投资，并设定了更为严格的公司预警指标，对达到公司预警指标的投资及时跟踪和处置；定期开展流动性风险的监测分析、压力测试和情景分析，监测流动性风险限额执行情况，并结合流动性风控指标测算情况合理制定公司融资计划。

流动性应急测试：公司制定流动性风险应急方案，并定期开展应急演练，模拟极端情形下应急处置流程，有效提高风险化解能力，防范公司流动性风险事件。

⑤ 声誉风险的控制

公司将声誉风险管理纳入全面风险管理体系，建立声誉风险管理机制，要求各部门、分公司、营业部、子公司主动有效地防范声誉风险和应对声誉风险事件，对经营管理过程中存在的声誉风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理，最大限度地减少对公司声誉及品牌形象造成的损失和负面影响。

公司在开展业务过程中对合规性风险、操作风险、流动风险、信用风险等进行充分评估，从源头上防范声誉风险。强化舆情监测，落实舆情报告制度，积极应对、妥善预防声誉风险，强化与媒体的沟通，为公司营造良好的媒体环境。

报告期内，整体舆情平稳，未发生重大声誉风险事件。

(二) 其他披露事项

√适用 □不适用

1. 前期已披露涉案金额在 1000 万以上的诉讼进展及新增诉讼

序号	起诉(申请)方	应诉(被申请)方	诉讼(仲裁)基本情况	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)基本情况及诉讼进展
1	公司	张跃飞	公司起诉张跃飞承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金5,000万元及相应的利息、违约金，并承担诉讼费、律师费等费用。	张跃飞股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。2018年12月25日作出一审判决，支持本公司诉讼请求，判决生效后，公司申请强制执行，因未取得处置权终结本次执行程序。公司将积极推进后续执行程序。
2	公司	浙江大东南集团有限公司、黄水寿、黄飞刚	公司起诉大东南集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金2亿元以及相应利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用；要求黄水寿、黄飞刚对上述全部债务承担连带清偿责任。	大东南集团有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。目前判决已生效，公司就保证人申请强制执行，正在执行程序中。另大东南进入破产重整，已收到首期分配款。
3	公司	绍兴金晖越商投资合伙企业(有限合伙)	公司起诉绍兴金晖越商投资合伙企业(有限合伙)承担股票质押式	借款本金余额4,817.55万元及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	绍兴金晖越商投资合伙企业(有限合伙)股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。判决生效后，公司申

		伙)	回购业务违约的民事责任		请执行，正在执行过程中。
4	公司	国购投资有限公司、袁启宏、国购产业控股有限公司	公司起诉国购投资有限公司承担16国购01债券违约的民事责任	债券本金4,861.9万元以及相应的利息，并承担律师费、诉讼费等费用；要求袁启宏以其质押物对前述债务承担清偿责任；要求国购控股对前述债务承担连带清偿责任。	国购投资有限公司16国购01债券违约，公司向安徽省高级人民法院提起诉讼。法院作出判决，支持公司诉讼请求。因国购投资有限公司、合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司已被合肥中院裁定进入破产程序，目前已申报债权。
5	公司	上海华信国际集团有限公司	公司起诉上海华信国际集团有限公司承担18沪信02违约的民事责任	债券本金3,000万元以及相应的利息，并承担律师费、诉讼费等费用。	上海华信国际集团有限公司18沪信02违约，公司向苏州工业园区人民法院提起诉讼。法院作出判决，支持公司诉讼请求。债务人上海华信已进入破产清算程序，已向管理人申报债权，且债权已经管理人审查认定。
6	公司	安徽省外经建设集团有限公司	公司起诉安徽省外经建设集团有限公司承担16皖经02、16皖经03债券违约的民事责任	债券本金9,993万元以及相应利息，并承担律师费、诉讼费等费用。	安徽省外经建设集团有限公司16皖经02、16皖经03债券违约，公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院将该案件移送合肥中院管辖。合肥中院已于2020年10月20日开庭审理。2020年12月15日收到判决书，支持公司诉请，该判决已生效。2020年12月25日，合肥中院裁定受理安徽省华安外经建设（集团）有限公司破产重整一案。目前已申报债权。
7	公司	海航实业集团有限公司	公司起诉海航实业集团有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额27,581.74万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	海航实业集团有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。之后案件被移送至海南一中院，海南一中院已于2020年6月18日开庭。2021年3月5日法院判决支持公司部分诉请，公司已上诉。另2021年2月10日，海南高院受理海航实业集团有限公司破产重整一案，公司已向管理人申报债权。

8	公司	高玉根	公司起诉高玉根承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额1.34亿元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	高玉根股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。法院于2020年12月22日判决，支持公司诉请，判决已生效。公司已申请执行，正在执行过程中。
9	公司	长海县獐子岛投资发展中心、长海县獐子岛大耗经济发展中心	公司起诉长海县獐子岛投资发展中心承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额1.4亿元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用；要求长海县獐子岛大耗经济发展中心以其质押物对上述债务承担清偿责任。	长海县獐子岛投资发展中心股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。法院于2020年9月17日开庭。2021年1月19日收到法院判决，支持公司诉请，该判决已生效。公司已申请执行，正在执行过程中。
10	公司	山东永华投资有限公司、王勇、张树芳、西王集团有限公司	公司起诉山东永华投资有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额1.32亿元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用；要求西王集团有限公司以其质押物对上述债务承担清偿责任；要求王勇、张树芳、西王集团有限公司对上述债务承担连带清偿责任。	山东永华投资有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。已于2020年12月22日收到判决书，支持公司诉请，被告已上诉。于2021年4月27日二审开庭，2021年5月27日判决驳回上诉，维持原判，2021年6月8日，递交执行申请材料。双方执行和解，已签订执行和解协议。
11	公司	北京昂展科技发展有限公司、成都市家锦置业有限公司	公司起诉北京昂展科技发展有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额26,910万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用；要求成都市家锦置业有限公司以其抵押物对上述债务承担清偿责任。	北京昂展科技发展有限公司股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。2020年8月31日双方调解结案。因债务人未履行调解协议，公司已申请执行，正在执行过程中。
12	公司	上海大新华实业有限公司	公司起诉上海大新华实业有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额13,750万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	上海大新华实业有限公司股票质押式回购业务违约，公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院已判决，支持公司诉请，被告已上诉。省高院于2021年5月27日判决驳回上诉，维持原判。已申请执行。

13	公司	新沂必康、李宗松	公司起诉新沂必康新医药产业综合体投资有限公司、李宗松承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额19,741.18万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	新沂必康新医药产业综合体投资有限公司、李宗松质押式回购合同违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。2020年11月27日判决,支持公司诉请,被告已上诉。2021年5月28日二审判决驳回上诉,维持原判,公司已申请执行。2021年6月15日,延安市中级人民法院受理新沂必康新医药产业综合体投资有限公司破产重整案。
14	公司	敦化康平投资	公司起诉敦化市康平投资有限责任公司承担证券回购合同违约的民事责任	借款本金余额13,036.11万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	敦化市康平投资有限责任公司证券回购合同违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。法院于2020年12月14日开庭,2021年5月28日判决支持公司诉请,2021年6月29日向法院申请执行。
15	江南农商行	天弘基金管理有限公司	原告江南农商行起诉被告天弘基金管理有限公司承担违约赔偿损失约为2.13亿元,列公司为第三人,承担连带责任	被告天弘基金管理有限公司承担违约赔偿损失约为2.13亿元,列公司为第三人,承担连带责任。	常州中院已立案,被告天弘基金管理有限公司提出管辖权异议,后省高院裁定书驳回天弘基金管辖权异议。2021年5月21日、7月9日常州中院两次开庭。
16	公司	董洁群	董洁群融资融券业务违约,公司在苏州园区法院提起诉讼	两融资金20,736,828.68元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	公司向苏州园区法院起诉,已申请保全。2021年3月25日、7月29日两次开庭,待判决。
公司作为产品管理人(代资产管理计划)发起的诉讼涉及金额在1000万以上的诉讼					
1	公司	富贵鸟股份有限公司、爱建证券有限责任公司	公司起诉富贵鸟股份有限公司承担“16富贵01”债券违约的民事责任	债券本金5,000万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、仲裁费等费用;爱建证券有限责任公司对上述债务承担连带清偿责任。	富贵鸟股份有限公司“16富贵01”债券违约,公司代表资管计划向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。泉州中院已裁定进入破产清算程序,资产拍卖结束,收到分配方案,待分配。

2	公司	国购投资有限公司、合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司	公司起诉国购投资有限公司承担“17国购01”债券违约的民事责任	债券本金7,000万元以及相应的利息,并承担律师费、诉讼费等费用,要求合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司对前述债券承担连带清偿责任。	国购投资有限公司“17国购01”债券违约,公司代表资管计划向苏州市中级人民法院提起诉讼,法院于2019年12月18日判决,支持公司诉请,判决已生效。2020年6月12日,安徽合肥市中院裁定国购投资有限公司等43家公司合并重整,目前已申报债权。
3	公司	国购投资有限公司、袁启宏、国购产业控股有限公司	公司起诉国购投资有限公司承担“16国购01”、“16国购02”、“16国购03”债券违约的民事责任	债券本金12,040万元及相应的利息,并承担律师费、诉讼费等费用;要求袁启宏以其质押物对前述债务承担清偿责任;要求国购产业控股有限公司对前述债务承担连带清偿责任。	国购投资有限公司“16国购01”、“16国购02”、“16国购03”债券违约,公司代表资管计划向安徽省高级人民法院提起诉讼。法院于2019年3月1日立案受理,并于5月21日开庭审理,后作出判决,支持公司诉讼请求。目前判决已生效。因国购投资有限公司、合肥华源物业发展有限责任公司、国购产业控股有限公司已被合肥中院裁定进入破产程序,目前已申报债权。
4	公司	新沂必康、李宗松、GUOXIAOJIA	公司起诉新沂必康、李宗松、GUOXIAOJIA承担质押式证券回购合同违约的民事责任	借款本金余额28,443万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	新沂必康、李宗松、GUOXIAOJIA 质押式证券回购合同违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。2020年8月18日证据交换,2021年4月27日开庭,2021年5月26日一审判决,被告上诉,等待二审。2021年6月15日,延安市中级人民法院受理新沂必康新医药产业综合体投资有限公司破产重整案。
5	公司	李宗松、新沂必康、GUOXIAOJIA	公司起诉李宗松、新沂必康、GUOXIAOJIA承担质押式证券回购合同违约的民事	借款本金余额17,163万元以及相应的利息、违约金,并承担律师费、诉讼费等费用。	李宗松、新沂必康、GUOXIAOJIA 质押式证券回购合同违约,公司向苏州市中级人民法院提起诉讼。2020年8月18日证据交换,2021年4月27日开庭,2021年

			责任		5月26日一审判决，被告上诉，等待二审。2021年6月15日，延安市中级人民法院受理新沂必康新医药产业综合体投资有限公司破产重整案。
6	公司	何志涛	公司起诉何志涛承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额19,530万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	何志涛股票质押式回购业务违约，公司代表“东吴汇智7号”集合资管计划向苏州市中级人民法院提起诉讼。苏州中院于2020年2月18日立案受理，已进行证据交换。2021年5月11日，收到判决书。何志涛已上诉。
7	公司	北京晋商联盟投资管理有限公司、大连国贸中心大厦有限公司	公司起诉北京晋商联盟投资管理有限公司、大连国贸中心大厦有限公司承担股票质押式回购业务违约的民事责任	借款本金余额23,300万元以及相应的利息、违约金，并承担律师费、诉讼费等费用。	被告股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼。2021年4月8日已完成证据交换、8月2日开庭。
8	公司	泰禾集团股份有限公司	公司起诉泰禾集团股份有限公司“17泰禾MTN001”、“17泰禾MTN002”债券违约民事责任	债券本金7000万元及相应的利息，违约金，并承担律师费、诉讼费等。	2021年4月28日福州中级人民法院立案受理，于2021年6月22日第一次开庭。

上述代资管产品发起的诉讼，涉及公司自有资金为43,270.96万元。

2. 回购事宜

2021年3月5日，公司召开董事会审议通过了回购方案。2021年3月11日，公司首次实施回购股份，2021年3月30日，公司完成回购。本次回购合计回购公司A股股份38,799,814股，占公司总股本的0.9999%，回购最高价为人民币9.76元/股，回购最低价为人民币8.78元/股，回购均价为人民币9.05元/股，使用资金总额为人民币350,977,160.28元（不含交易费用）。公司本次回购A股股份总数为38,799,814股，全部存放于公司回购专用证券账户，拟作为限制性股票股权激励计划的股票来源。

3. 公司配股事宜

报告期内，公司董事会、股东大会审议通过了配股相关议案，公司拟配股公开发行证券，募集资金总额不超过人民币 85 亿元，用于发展资本中介业务，投资与交易业务，信息技术及风控合规投入、向全资子公司增资、偿还债务。目前公司正组织相关申报审批工作。

第四节 公司治理

一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2021 年第一次临时股东大会	2021-4-23	上海证券交易所网站	2021-4-24	审议通过了《关于选举公司第四届董事会成员（非职工董事）的议案》、《关于选举公司第四届监事会成员（非职工监事）的议案》、《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》
2020 年年度股东大会	2021-6-25	上海证券交易所网站	2021-6-26	审议通过了年度相关议案及配股再融资相关议案

表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

股东大会情况说明

适用 不适用

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

适用 不适用

姓名	担任的职务	变动情形
刘凡	董事	离任
黄艳	董事	离任
沈光俊	监事	离任
马晓	监事	离任
酆美英	监事	离任
沈光俊	董事	选举
马晓	董事	选举
刘凡	监事	选举
黄艳	监事	选举
丁惠琴	监事	选举
冯恂	副总裁、董事会秘书	离任
杨伟	董事会秘书	聘任
刘凡	监事	离任
鄂华	监事	选举

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

2021 年 4 月 10 日，因工作调整，冯恂女士辞去公司副总裁、董事会秘书职务。公司指定公司执委杨伟先生代行董事会秘书职责，代行期限不超过三个月。

2021 年 4 月 15 日，公司第四届职工代表大会第六次会议选举孙中心先生为公司第四届董事会职工董事；选举王晋康先生、陈建国先生为公司第四届监事会职工监事。

2021 年 4 月 23 日，鉴于公司第三届董事会、监事会任期已满，公司 2021 年第一次临时股东大会选举范力先生、朱剑先生、沈光俊先生、朱建根先生、郑刚先生、马晓先生为公司第四届董事会董事，裴平先生、尹晨先生、权小锋先生、陈忠阳先生为公司第四届董事会独立董事；选举黄艳女士、刘凡先生、唐焯先生、丁惠琴女士为公司第四届监事会监事。

2021 年 4 月 23 日，公司第四届董事会第一次（临时）会议选举范力先生为第四届董事会董事长；聘任范力先生为公司总裁；聘任孙中心先生为公司常务副总裁、首席信息官；聘任袁维静女士为公司副总裁、财务负责人；聘任高海明先生为公司副总裁；聘任李齐兵先生为公司合规总监，首席风险官；聘任杨伟先生为公司董事会秘书（待取得资格后正式任职）、公司执委；聘任刘辉先生、姚眺女士、潘劲松先生为公司执委。

同日，公司第四届监事会第一次（临时）会议选举王晋康先生为公司第四届监事会监事会主席。

2021 年 6 月 7 日，因工作调整，刘凡先生辞去公司监事职务。2021 年 6 月 25 日，公司 2020 年年度股东大会选举鄂华先生为公司监事。

2021 年 7 月 23 日，杨伟先生取得董事会秘书任职资格并完成相关审核，正式担任公司董事会秘书。

三、利润分配或资本公积金转增预案

半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	否
---------	---

四、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

（一）相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

（二）临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况
适用 不适用

其他激励措施
适用 不适用

第五节 环境与社会责任

一、环境信息情况

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

适用 不适用

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

(三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

(四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

适用 不适用

(五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

适用 不适用

二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

适用 不适用

公司积极贯彻落实党中央、国务院决策部署，积极响应“摘帽不摘责任、摘帽不摘政策、摘帽不摘帮扶、摘帽不摘监管”精神，坚持经济效益与社会效益并重，秉持“待人忠、办事诚、共享共赢”的核心价值观，扎实开展乡村振兴、捐资助学、改善民生等公益慈善工作。以 832 个贫困县全部摘帽为新的起点，持续开展帮扶工作，为巩固拓展脱贫攻坚成果、全面推进乡村振兴贡献东吴力量。

(一) 成立慈善组织，履行社会责任

3 月 20 日，公司举行社会责任项目发布暨慈善基金会揭牌仪式，市委副书记、市长李亚平出席活动。会上，公司全额出资 1000 万元注册成立的“东吴证券慈善基金会”正式揭牌，该基金会是苏州市属国企的首家慈善基金会，也是江苏省内券商成立的首家慈善基金会，标志着东吴证券慈善工作迈入了新阶段。同时，公司还签约发布了涵盖捐资助学、扶贫帮困、改善民生等 9 个慈善项目，总额达 1098 万元。其中，向贵州省铜仁市（原国家级贫困地区）捐赠 100 万元，对铜仁市因病、因灾、因学、因意外原因等情况出现返贫致贫风险的困难家庭给予资金救助，巩固提升铜仁市脱贫攻坚成果。

（二）持续教育帮扶，改善教学环境

报告期内，公司持续开展“牵手行动”教育帮扶，向贵州省铜仁市石阡县、思南县及松桃苗族自治县等 3 个脱贫县捐赠 100 万元，结对帮扶 500 名困难学生，资助其完成学业。捐赠 100 万元开展“粉笔画人生·携手绘百年”贵州乡村少年绘画艺术公益项目，用粉笔画这样一个孩子们喜爱的艺术形式，关心支持贵州脱贫攻坚过程中出现的移民搬迁和留守儿童，将粉笔画艺术与关心关爱留守儿童有效融合，提升乡村青少年的艺术素养和综合素质，丰富易地扶贫搬迁安置点青少年课外生活，以美化人，以美育人，让乡村儿童在学习绘画的同时，感受爱和理解，描绘美好生活和梦想，从而获得前进的动力和奋斗的勇气。在贵州省铜仁市、黔南州、黔东南州三地 20 所学校相继举办粉笔画艺术培训班 100 余场，参与学习培训的学生近 1.7 万人。2021 年 6 月，公司从学生们围绕“建党百年、我的家乡、美好生活”三个主题创作的画作中，精选出 100 幅优秀作品举办庆祝中国共产党成立 100 周年画展，向党的百年华诞献礼。该项目于 7 月 2 日在苏州电视台《新闻夜班车》栏目进行了报道。

（三）推进乡村振兴，共创美好家园

公司联合苏州市民政部门，在苏州 10 个县市区中选取发展较为薄弱的城镇，开展共创“美好家园”慈善项目，主要用于乡村建设、乡村治理、改善民生等乡村振兴方面。该项目将分三年（2021-2022 年）实施，每个县市区三年累计投入 100 万元，累计总额达 1000 万元。同时，公司还将在项目落地的乡镇挂牌“东吴证券志愿服务实践点”，组织开展志愿服务活动。报告期内，依托公司成立的 35 支总人数共 606 人志愿服务队，扎实推动“我为群众办实事”实践活动和“党员在行动”志愿服务活动不断走向深入，先后组织昆山、吴江、张家港、高新区、吴中区五地的党员志愿者扎实开展共创“美好家园”志愿服务活动。围绕看望慰问在党 50 年老党员、倡导理性投资、垃圾分类、安全生产等主题，积极践行“为实体经济增添活力，为美好生活创造价值”的企业使命，充分发挥党员先锋模范作用，努力为群众办实事、办好事。相关志愿服务报道于 7 月 1 日在苏州电视台《联播苏州》栏目播出。

（四）践行慈善文化，关爱困难群体

报告期内，公司联合市慈善总会、市教育局开展校园慈善文化建设项目，捐赠 63 万余元购买《慈善读本》5 万余册，发放给苏州 21 所试点学校的近 5 万名学生。在南京大学、苏州大学分别设立奖学金、助学金、奖教金，2021 年捐赠 109 万元，惠及两校师生 145 人。向苏州市退役军人关爱基金会捐赠 30 万元，为苏州市姑苏区 6122 名退役军人购买“苏惠保”健康保险，有效解决退役军人群体因病致贫、因病返贫问题，解决他们的后顾之忧。同时，公司还将捐赠 480 万元，联合苏州市民政局、市妇联、市总工会、团市委分别开展困境儿童“明天计划+”慈善项目、苏州市困难职工生活救助项目、对口帮扶苏州市困境家庭学生慈善项目、苏州市青少年“立体关爱”

公益项目，开展苏州市困境儿童医疗救助，帮扶资助苏州市困难职工家庭、困境家庭学生，助力苏州市青少年健康发展。

第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

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

适用 不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行
与首次公开发行相关的承诺	解决同业竞争	苏州国际发展集团有限公司	苏州国际发展集团有限公司出具了《有关消除或避免同业竞争的承诺函》，承诺苏州国际发展集团有限公司及其附属公司、参股公司：将不会在中国境内单独或与他人，以任何形式（包括但不限于投资、并购、联营、合资、合作、合伙、承包或租赁经营、购买上市公司股票或参股）直接或间接从事或参与或协助从事或参与任何与前述本公司开展的业务构成竞争或可能构成竞争的业务或活动。目前及将来不会利用在发行人的控股股东地位，损害发行人及其他发行人股东的利益。	永久有效	否	是

二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

三、违规担保情况

适用 不适用

四、半年报审计情况

适用 不适用

五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

适用 不适用

六、破产重整相关事项

适用 不适用

七、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

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

适用 不适用

九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

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

十、重大关联交易

(一) 与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项适用 不适用**4、 涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况**适用 不适用**(三) 共同对外投资的重大关联交易****1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项**适用 不适用

事项概述	查询索引
公司及其他关联方共同出资设立苏州并购母基金	详见公司 2021 年 1 月 19 日公告

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项适用 不适用**3、 临时公告未披露的事项**适用 不适用**(四) 关联债权债务往来****1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项**适用 不适用**2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项**适用 不适用**3、 临时公告未披露的事项**适用 不适用**(五) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务**适用 不适用**(六) 其他重大关联交易**适用 不适用**(七) 其他**适用 不适用

公司日常关联交易详见财务报表附注。

十一、 重大合同及其履行情况**1 托管、承包、租赁事项**适用 不适用

2 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

□适用 √不适用

3 其他重大合同

□适用 √不适用

十二、 其他重大事项的说明

□适用 √不适用

第七节 股份变动及股东情况**一、股本变动情况****(一) 股份变动情况表****1、 股份变动情况表**

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

2、 股份变动情况说明

□适用 √不适用

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

□适用 √不适用

4、 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

□适用 √不适用

(二) 限售股份变动情况

□适用 √不适用

二、 股东情况**(一) 股东总数：**

截止报告期末普通股股东总数(户)	107,878
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0

(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、标记或冻结情况		股东 性质
					股 份 状 态	数 量	
苏州国际发展集团有限公司	0	917,220,819	23.64	0	质押	260,000,000	国有法人
中新苏州工业园区投资管理有限公司	0	130,000,000	3.35	0	无	0	国有法人
张家港市直属国有资产经营有限公司	0	115,790,030	2.98	0	无	0	国有法人

中国证券金融股份有限公司	-7,787,846	106,485,989	2.74	0	无	0	未知
苏州高新国有资产经营管理集团有限公司	0	91,000,000	2.35	0	无	0	国有法人
苏州营财投资集团有限公司	0	83,952,120	2.16	0	无	0	国有法人
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	0	80,382,601	2.07	0	无	0	国有法人
苏州物资控股(集团)有限责任公司	0	71,300,892	1.84	0	无	0	国有法人
苏州信托有限公司	0	69,056,000	1.78	0	无	0	国有法人
中国建设银行股份有限公司-国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	-9,095,970	57,191,048	1.47	0	无	0	未知
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				
苏州国际发展集团有限公司	917,220,819	人民币普通股	917,220,819				
中新苏州工业园区投资管理有限公司	130,000,000	人民币普通股	130,000,000				
张家港市直属公有资产经营有限公司	115,790,030	人民币普通股	115,790,030				
中国证券金融股份有限公司	106,485,989	人民币普通股	106,485,989				
苏州高新国有资产经营管理集团有限公司	91,000,000	人民币普通股	91,000,000				
苏州营财投资集团有限公司	83,952,120	人民币普通股	83,952,120				
苏州工业园区国有资产控股发展有限公司	80,382,601	人民币普通股	80,382,601				
苏州物资控股(集团)有限责任公司	71,300,892	人民币普通股	71,300,892				
苏州信托有限公司	69,056,000	人民币普通股	69,056,000				
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	57,191,048	人民币普通股	57,191,048				
前十名股东中回购专户情况说明	不适用						
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	不适用						
上述股东关联关系或一致行动的说明	苏州国际发展集团有限公司和苏州营财投资集团有限公司、苏州信托有限公司之间为存在控制关系的关联方。苏州国际发展集团有限公司持有苏州营财投资集团有限公司 100% 的股权，同时持有苏州信托有限公司 70.01% 的股权，因此，苏州国际发展集团有限公司、苏州营财投资集团有限公司和苏州信托有限公司为一致行动人。未发现上述其他股东之间存在关联关系，也未发现上述其他股东属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。						
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用						

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件
 适用 不适用

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

三、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

(三) 其他说明

适用 不适用

四、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

第八节 优先股相关情况

适用 不适用

第九节 债券相关情况

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

适用 不适用

(一) 企业债券

适用 不适用

(二) 公司债券

适用 不适用

1. 公司债券基本情况

单位：元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
东吴 2017 年面向合格投	17 东吴债	143021	2017-03-13	2017-03-13	2022-03-13	25.00	4.70	每年付息一次, 到期	上海证券交易所	面向合格投资者	报价、询价和协	否

资者公 公开发 行公司 债券								一次 还本, 最后 一期 利息 随本 金的 兑付 一起 支付。			议交 易	
东吴证 券非公 开发 行 2017 年次 级 债 券 (第 一 期) 品 种 二	17 东 吴 02	145495	2017-04-26	2017-04-26	2022-04-26	16.50	5.50	每 年 付 息 一 次, 到 期 一 次 还 本, 最 后 一 期 利 息 随 本 金 的 兑 付 一 起 支 付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价 、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券非公 开发 行 2017 年次 级 债 券 (第 二 期) (品 种 二)	17 东 吴 04	145551	2017-05-22	2017-05-22	2022-05-22	12.30	5.60	每 年 付 息 一 次, 到 期 一 次 还 本, 最 后 一 期 利 息 随 本 金 的 兑 付 一 起 支 付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价 、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2018 年非 公 开 发 行 公 司 债 券 (第 二 期)	18 东 吴 F2	151059	2018-12-29	2018-12-29	2021-12-29	10	4.60	每 年 付 息 一 次, 到 期 一 次 还 本, 最 后 一 期 利 息 随 本 金 的 兑 付 一 起 支 付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价 、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2019 年非 公 开 发 行 次 级 债 券 (第 一 期)	19 东 吴 C1	151255	2019-03-18	2019-03-18	2022-03-18	20	4.25	每 年 付 息 一 次, 到 期 一 次 还 本, 最 后 一 期 利 息 随 本 金 的 兑 付 一 起 支 付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价 、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2019 年非 公 开 发 行 次 级 债 券 (第 一 期)	19 东 吴 F1	151420	2019-04-16	2019-04-16	2022-04-16	20	4.20	每 年 付 息 一 次, 到 期	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者		否

开发行 公司债 券(第 一期)								一次 还本, 最后 一期 利息 随本 金的 兑付 一起 支付。				
东吴证 券 2019 年公 开发 行公 司债 券	19 东 吴债	155596	2019-08-12	2019-08-12	2022-08-12	30	3.60	每年 付息 一次, 到期 一次 还本, 最后 一期 利息 随本 金的 兑付 一起 支付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2020 年非 公开 发行 次级 债 券(第 一 期)(疫 情防 控 债)	20 东 吴 C1	166134	2020-02-25	2020-02-25	2023-02-25	10	3.80	每年 付息 一次, 到期 一次 还本, 最后 一期 利息 随本 金的 兑付 一起 支付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2020 年非 公开 发行 次级 债 券(第 二 期)	20 东 吴 C2	166981	2020-06-10	2020-06-10	2023-06-10	5	3.80	每年 付息 一次, 到期 一次 还本, 最后 一期 利息 随本 金的 兑付 一起 支付。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 合 格 投 资 者	报 价、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2020 年面 向专 业投 资者 公 开发 行公 司债 券(第 一 期)(品 种一)	20 东 吴 G1	175162	2020-09-21	2020-09-21	2021-09-24	26	3.29	到 期 一 次 还 本 付 息。	上 海 证 券 交 易 所	面 向 专 业 投 资 者	报 价、 询 价 和 协 议 交 易	否
东吴证 券 2020 年面 向专 业投 资者 公 司	20 东 吴 G2	175163	2020-09-21	2020-09-21	2023-09-21	14	3.81	每 年 付 息 一 次, 到 期 一 次 还 本,	上 海 证 券 交 易 所	面 向 专 业 投 资 者	报 价、 询 价 和 协 议 交 易	否

开发行公司债券(第一期)(品种二)									最后一期利息随本金的兑付一起支付。				
东吴证券 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	21 东吴 01	175636	2021-01-15	2021-01-15	2024-01-15	20	3.60		每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所	面向专业投资者	报价、询价和协议交易	否
东吴证券 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)	21 东吴 C1	188062	2021-04-28	2021-04-28	2024-04-28	20	3.95		每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	上海证券交易所	面向专业投资者	报价、询价和协议交易	否

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

逾期未偿还债券

适用 不适用

关于逾期债项的说明

适用 不适用

2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

3. 信用评级结果调整情况

适用 不适用

4. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响

适用 不适用

5. 公司债券其他情况的说明

适用 不适用

(三) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

□适用 √不适用

(四) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

□适用 √不适用

(五) 主要会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比 上年度末增减 (%)	变动原因
流动比率	1.48	1.70	-12.94	
速动比率	1.48	1.70	-12.94	
资产负债率 (%)	65.81	64.86	1.46	
贷款偿还率 (%)	100.00	100.00		
	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上 年同期增减 (%)	变动原因
扣除非经常性损益后净利润	1,320,488,894.88	1,031,140,411.26	28.06	
EBITDA 全部债务比 (%)	5.27	5.08	3.74	
利息保障倍数	3.09	2.46	25.61	
现金利息保障倍数	2.24	6.05	-62.98	主要是本期经营活动产生的现金流量净额减少所致。
EBITDA 利息保障倍数	3.21	2.53	26.88	
利息偿付率 (%)	100.00	100.00		

二、转换公司债券情况

□适用 √不适用

第十节 财务报告

一、审计报告

□适用 √不适用

二、财务报表

合并资产负债表

2021 年 6 月 30 日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	5.01	25,131,753,016.69	23,550,623,073.76
其中：客户资金存款		22,395,579,311.99	19,972,497,020.66
结算备付金	5.02	5,114,748,490.30	4,022,703,604.97
其中：客户备付金		4,292,722,318.99	3,635,439,157.44
融出资金	5.03	19,867,292,670.77	18,049,801,302.82
衍生金融资产	5.04	6,607,721.44	7,949,263.29
存出保证金	5.05	4,745,059,736.24	3,125,558,058.04
应收款项	5.06	4,239,008,450.20	376,891,916.23
买入返售金融资产	5.07	5,842,907,256.80	7,018,448,234.30
金融投资：			
交易性金融资产	5.08	34,774,730,606.61	34,115,122,757.46
债权投资	5.09	93,037,236.34	224,095,373.07
其他债权投资	5.10	5,388,695,509.97	6,264,932,127.78
其他权益工具投资	5.11	2,353,135,875.60	3,843,359,653.81
长期股权投资	5.12	1,934,927,444.69	1,538,178,928.49
固定资产	5.13	1,557,498,278.34	649,911,472.33
在建工程	5.14		879,705,555.60
使用权资产	5.15	231,289,376.27	
无形资产	5.16	218,814,918.03	230,916,590.07
商誉	5.17	313,880,670.44	315,844,316.37
递延所得税资产	5.18	728,933,153.02	854,571,053.96
其他资产	5.19	289,213,390.10	405,936,918.57
资产总计		112,831,533,801.85	105,474,550,200.92
负债：			
短期借款	5.23	4,634,321,839.62	1,069,956,134.02
应付短期融资款	5.24	7,879,181,790.53	8,400,919,247.63
拆入资金	5.25	2,002,022,222.22	
交易性金融负债	5.26	1,268,950,682.54	1,978,636,180.90
衍生金融负债	5.04	4,555,192.99	3,535,520.85
卖出回购金融资产款	5.27	11,447,154,292.46	10,717,911,545.84
代理买卖证券款	5.28	29,459,276,127.09	25,197,694,220.26
应付职工薪酬	5.29	1,086,697,712.60	1,184,966,047.79
应交税费	5.30	178,276,113.52	417,602,767.42
应付票据	5.31	272,570,000.00	177,170,000.00
应付款项	5.32	992,240,672.00	405,002,473.26

合同负债	5.33	20,169,806.60	20,248,472.58
应付债券	5.34	23,234,360,597.29	26,829,753,610.13
租赁负债	5.35	229,405,953.29	
递延所得税负债	5.18	97,450,648.79	57,846,309.94
其他负债	5.36	1,522,790,624.54	802,986,871.92
负债合计		84,329,424,276.08	77,264,229,402.54
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	5.37	3,880,518,908.00	3,880,518,908.00
资本公积	5.38	16,739,471,341.56	16,738,719,260.67
减：库存股	5.39	370,229,016.47	19,220,540.31
其他综合收益	5.40	-65,013,217.33	10,214,293.84
盈余公积	5.41	999,241,215.48	999,241,215.48
一般风险准备	5.42	2,485,789,459.49	2,479,309,440.09
未分配利润	5.43	4,495,138,107.22	3,791,110,825.14
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		28,164,916,797.95	27,879,893,402.91
少数股东权益		337,192,727.82	330,427,395.47
所有者权益（或股东权益）合计		28,502,109,525.77	28,210,320,798.38
负债和所有者权益（或股东权益）总计		112,831,533,801.85	105,474,550,200.92

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

母公司资产负债表

2021年6月30日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年6月30日	2020年12月31日
资产：			
货币资金		17,712,405,008.28	16,557,112,668.94
其中：客户资金存款		16,727,227,976.93	15,111,886,948.19
结算备付金		5,623,664,088.24	4,217,793,091.85
其中：客户备付金		4,292,722,318.99	3,635,439,157.44
融出资金		19,591,757,850.58	17,773,535,774.34
衍生金融资产		1,609,055.69	
存出保证金		655,958,172.93	225,822,171.01
应收款项	15.01	38,653,781.00	33,407,859.54
买入返售金融资产		4,657,919,625.95	6,270,089,161.84
金融投资：			
交易性金融资产		28,758,659,630.52	27,343,180,782.74
其他债权投资		5,353,223,421.29	6,272,297,615.32
其他权益工具投资		2,093,711,156.89	3,803,934,935.10
长期股权投资	15.02	8,483,952,284.41	8,476,183,686.25
固定资产		1,514,036,367.22	603,211,298.13
在建工程			879,705,555.60
使用权资产		102,446,352.73	

无形资产		185,457,511.19	195,908,850.11
商誉		11,749,999.80	11,749,999.80
递延所得税资产		639,122,325.73	732,027,730.35
其他资产	15.03	143,458,966.30	157,293,737.79
资产总计		95,567,785,598.75	93,553,254,918.71
负债：			
应付短期融资款		7,879,181,790.53	8,400,919,247.63
拆入资金		2,002,022,222.22	
交易性金融负债		13,907,189.69	46,900,714.00
衍生金融负债		4,205,387.99	3,508,078.35
卖出回购金融资产款		11,447,154,292.46	10,626,015,724.81
代理买卖证券款		20,834,714,792.60	18,659,000,563.40
应付职工薪酬		917,473,855.82	971,315,109.00
应交税费		138,734,762.32	338,098,956.34
应付款项		856,873,351.69	109,682,445.87
合同负债		20,169,806.60	18,769,809.43
应付债券		23,234,360,597.29	26,829,753,610.13
租赁负债		95,049,430.83	
其他负债		854,869,237.84	202,450,665.67
负债合计		68,298,716,717.88	66,206,414,924.63
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		3,880,518,908.00	3,880,518,908.00
资本公积		16,618,727,469.51	16,625,441,979.30
减：库存股		370,229,016.47	19,220,540.31
其他综合收益		57,216,088.32	101,058,271.37
盈余公积		999,241,215.48	999,241,215.48
一般风险准备		2,278,758,982.05	2,274,042,866.73
未分配利润		3,804,835,233.98	3,485,757,293.51
所有者权益（或股东权益）合计		27,269,068,880.87	27,346,839,994.08
负债和所有者权益（或股东权益）总计		95,567,785,598.75	93,553,254,918.71

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

合并利润表

2021年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年半年度	2020年半年度
一、营业总收入		4,071,482,440.25	3,589,268,711.66
利息净收入	5.44	331,976,972.24	251,553,915.34
其中：利息收入		1,210,699,829.24	1,197,511,989.85
利息支出		878,722,857.00	945,958,074.51
手续费及佣金净收入	5.45	1,504,915,628.36	1,233,393,909.84
其中：经纪业务手续费净收入		935,280,420.35	638,190,907.21
投资银行业务手续费净收入		400,409,655.81	449,019,598.00
资产管理业务手续费净收入		73,360,649.71	73,675,605.63
投资收益（损失以“-”号填列）	5.46	1,197,883,563.00	1,000,431,156.72

其中：对联营企业和合营企业的投资收益		70,329,387.11	53,476,478.90
其他收益	5.47	32,840,072.46	17,431,000.00
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5.48	265,983,264.15	329,897,423.21
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-133,409.34	2,907,065.52
其他业务收入	5.49	737,476,678.43	755,398,037.48
资产处置收益（损失以“-”号填列）	5.50	539,670.95	-1,743,796.45
二、营业总支出		2,339,749,828.12	2,258,227,411.90
税金及附加	5.51	12,709,764.31	21,278,214.48
业务及管理费	5.52	1,526,257,822.24	1,041,539,778.49
信用减值损失	5.53	68,534,225.41	440,336,369.69
其他业务成本	5.54	732,248,016.16	755,073,049.24
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,731,732,612.13	1,331,041,299.76
加：营业外收入	5.55	2,091,229.21	1,572,162.51
减：营业外支出	5.56	2,862,871.56	13,432,079.89
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,730,960,969.78	1,319,181,382.38
减：所得税费用	5.57	385,964,225.93	284,972,280.37
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,344,996,743.85	1,034,209,102.01
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,344,996,743.85	1,034,209,102.01
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）		1,336,415,624.22	1,030,536,040.36
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		8,581,119.63	3,673,061.65
六、其他综合收益的税后净额		-100,257,290.33	-182,176,738.39
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	5.40	-98,441,503.05	-180,983,336.62
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-83,955,720.16	-178,629,689.29
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		-1,338,298.76	2,033,395.29
3. 其他权益工具投资公允价值变动		-82,617,421.40	-180,663,084.58
（二）将重分类进损益的其他综合收益		-14,485,782.89	-2,353,647.33
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-4,146,639.61	138,672.28
2. 其他债权投资公允价值变动		2,337,687.58	1,035,738.98
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		9,445,917.86	-14,708,877.83
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额		-22,122,748.72	11,180,819.24
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	5.40	-1,815,787.28	-1,193,401.77
七、综合收益总额		1,244,739,453.52	852,032,363.62
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,237,974,121.17	849,552,703.74
归属于少数股东的综合收益总额		6,765,332.35	2,479,659.88

八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)		0.35	0.29
（二）稀释每股收益(元/股)		0.35	0.29

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

母公司利润表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021 年半年度	2020 年半年度
一、营业总收入		2,526,430,576.18	2,137,128,732.87
利息净收入	15.04	262,934,309.78	192,731,975.70
其中：利息收入		1,106,044,464.89	1,102,899,519.05
利息支出		843,110,155.11	910,167,543.35
手续费及佣金净收入	15.05	1,282,449,289.72	1,088,629,152.53
其中：经纪业务手续费净收入		827,601,266.62	588,910,488.97
投资银行业务手续费净收入		387,891,171.70	442,226,781.02
资产管理业务手续费净收入		46,135,360.54	43,506,026.48
投资收益（损失以“－”号填列）	15.06	724,570,090.85	631,071,839.96
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		40,460,251.60	44,397,371.81
其他收益		12,473,551.92	12,659,301.75
公允价值变动收益（损失以“－”号填列）	15.07	240,665,937.26	212,772,722.94
汇兑收益（损失以“－”号填列）		-344,934.86	115,049.20
其他业务收入		3,116,023.81	1,004,297.24
资产处置收益（损失以“－”号填列）		566,307.70	-1,855,606.45
二、营业总支出		1,308,674,392.28	1,187,849,923.87
税金及附加		11,123,443.14	18,672,268.54
业务及管理费		1,216,295,855.11	829,507,799.00
信用减值损失		81,255,094.03	339,669,856.33
三、营业利润（亏损以“－”号填列）		1,217,756,183.90	949,278,809.00
加：营业外收入		350,673.44	331,351.02
减：营业外支出		2,259,807.11	13,370,317.39
四、利润总额（亏损总额以“－”号填列）		1,215,847,050.23	936,239,842.63
减：所得税费用		266,144,671.70	214,022,634.48
五、净利润（净亏损以“－”号填列）		949,702,378.53	722,217,208.15
（一）持续经营净利润（净亏损以“－”号填列）		949,702,378.53	722,217,208.15
（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		-67,056,174.93	-194,868,658.26
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-82,617,421.40	-180,663,084.58
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		-82,617,421.40	-180,663,084.58
（二）将重分类进损益的其他综合收益		15,561,246.47	-14,205,573.68
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-1,677,143.65	138,672.28

2. 其他债权投资公允价值变动		17,823,330.11	364,631.87
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		-584,939.99	-14,708,877.83
七、综合收益总额		882,646,203.60	527,348,549.89

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

合并现金流量表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年半年度	2020年半年度
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		545,151,299.77	3,148,454,428.83
收取利息、手续费及佣金的现金		3,206,466,995.21	2,805,054,423.88
拆入资金净增加额		2,000,000,000.00	3,000,000,000.00
回购业务资金净增加额		1,918,311,778.50	
代理买卖证券收到的现金净额		4,261,285,893.51	4,514,853,361.96
收到其他与经营活动有关的现金	5.59 (1)	942,933,260.63	997,247,541.64
经营活动现金流入小计		12,874,149,227.62	14,465,609,756.31
为交易目的而持有的金融负债净减少额		36,366,856.72	12,122,433.93
融出资金净增加额		1,718,694,757.60	1,224,545,668.45
回购业务资金净减少额			1,234,658,431.94
支付利息、手续费及佣金的现金		747,814,012.56	564,875,117.56
支付给职工及为职工支付的现金		1,132,574,372.35	767,143,294.89
支付的各项税费		560,988,176.75	356,577,169.06
支付其他与经营活动有关的现金	5.59 (2)	7,604,571,155.56	3,282,608,434.75
经营活动现金流出小计		11,801,009,331.54	7,442,530,550.58
经营活动产生的现金流量净额	5.60 (1)	1,073,139,896.08	7,023,079,205.73
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		3,747,531,289.16	863,387,116.06
取得投资收益收到的现金		358,947,553.27	195,797,391.73
取得子公司及其他营业单位收到的现金净额			437,379,382.45
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			73,650,297.57
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		679,708.28	639,086.92
投资活动现金流入小计		4,107,158,550.71	1,570,853,274.73
投资支付的现金		1,116,539,662.76	1,454,977,049.69
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		55,964,796.90	46,135,596.48
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		372,000,000.00	

投资活动现金流出小计		1,544,504,459.66	1,501,112,646.17
投资活动产生的现金流量净额		2,562,654,091.05	69,740,628.56
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			5,913,328,574.40
取得借款收到的现金		18,495,508,159.99	11,182,532,985.40
发行债券收到的现金		3,991,000,000.00	1,504,343,000.00
筹资活动现金流入小计		22,486,508,159.99	18,600,204,559.80
偿还债务支付的现金		22,153,127,000.00	18,243,487,000.00
支付租赁有关的现金		33,253,322.54	
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		950,923,413.80	1,652,157,768.22
支付其他与筹资活动有关的现金	5.59 (3)	351,008,476.16	45,000,000.00
筹资活动现金流出小计		23,488,312,212.50	19,940,644,768.22
筹资活动产生的现金流量净额		-1,001,804,052.51	-1,340,440,208.42
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-18,244,231.87	25,525,087.60
五、现金及现金等价物净增加额	5.60 (1)	2,615,745,702.75	5,777,904,713.47
加：期初现金及现金等价物余额		27,247,045,647.76	21,305,468,663.16
六、期末现金及现金等价物余额	5.60 (2)	29,862,791,350.51	27,083,373,376.63

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

母公司现金流量表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年半年度	2020年半年度
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额			2,273,636,678.39
收取利息、手续费及佣金的现金		2,606,953,445.77	2,428,563,669.21
拆入资金净增加额		2,000,000,000.00	3,000,000,000.00
回购业务资金净增加额		2,367,258,622.92	
代理买卖证券收到的现金净额		2,160,092,264.71	4,119,556,869.20
收到其他与经营活动有关的现金		38,388,891.02	14,377,783.20
经营活动现金流入小计		9,172,693,224.42	11,836,135,000.00
为交易目的而持有的金融资产净增加额		624,905,594.32	
为交易目的而持有的金融负债净减少额		36,366,856.72	12,122,433.93
融出资金净增加额		1,711,954,232.48	1,141,831,014.62
回购业务资金净减少额			1,965,452,204.77
支付利息、手续费及佣金的现金		453,924,239.17	413,588,097.54
支付给职工及为职工支付的现金		915,673,294.48	614,238,378.38
支付的各项税费		436,077,782.51	253,153,485.39
支付其他与经营活动有关的现金		769,062,284.03	574,692,850.03
经营活动现金流出小计		4,947,964,283.71	4,975,078,464.66
经营活动产生的现金流量净额	15.08	4,224,728,940.71	6,861,056,535.34

	(1)		
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		3,339,643,770.20	863,377,825.77
取得投资收益收到的现金		328,097,576.37	187,578,348.55
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		178,876.14	527,276.92
投资活动现金流入小计		3,667,920,222.71	1,051,483,451.24
投资支付的现金		777,230,521.35	1,232,760,289.41
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		48,826,251.39	31,583,426.65
投资活动现金流出小计		826,056,772.74	1,264,343,716.06
投资活动产生的现金流量净额		2,841,863,449.97	-212,860,264.82
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			5,913,328,574.40
取得借款收到的现金		14,940,573,680.00	10,655,910,000.00
发行债券收到的现金		3,991,000,000.00	1,504,343,000.00
筹资活动现金流入小计		18,931,573,680.00	18,073,581,574.40
偿还债务支付的现金		22,153,127,000.00	18,243,487,000.00
支付租赁有关的现金		17,152,271.49	
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		935,784,473.72	1,641,123,147.01
支付其他与筹资活动有关的现金		351,008,476.16	45,000,000.00
筹资活动现金流出小计		23,457,072,221.37	19,929,610,147.01
筹资活动产生的现金流量净额		-4,525,498,541.37	-1,856,028,572.61
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-1,400,709.08	2,916,117.89
五、现金及现金等价物净增加额	15.08 (1)	2,539,693,140.23	4,795,083,815.80
加：期初现金及现金等价物余额		20,753,602,813.88	17,735,736,367.79
六、期末现金及现金等价物余额	15.08 (2)	23,293,295,954.11	22,530,820,183.59

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

合并所有者权益变动表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年半年度								少数股东权益	所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益									
	实收资本(或股本)	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
一、上年期末余额	3,880,518,908.00	16,738,719,260.67	19,220,540.31	10,214,293.84	999,241,215.48	2,479,309,440.09	3,791,110,825.14	330,427,395.47	28,210,320,798.38	
加：会计政策变更										
前期差错更正										
其他										
二、本年期初余额	3,880,518,908.00	16,738,719,260.67	19,220,540.31	10,214,293.84	999,241,215.48	2,479,309,440.09	3,791,110,825.14	330,427,395.47	28,210,320,798.38	
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）		752,080.89	351,008,476.16	-75,227,511.17		6,480,019.40	704,027,282.08	6,765,332.35	291,788,727.39	
（一）综合收益总额				-98,441,503.05			1,336,415,624.22	6,765,332.35	1,244,739,453.52	
（二）所有者投入和减少资本		752,080.89	351,008,476.16						-350,256,395.27	
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		752,080.89	351,008,476.16						-350,256,395.27
(三) 利润分配						6,480,019.40	-609,174,350.26		-602,694,330.86
1. 提取盈余公 积									
2. 提取一般风 险准备						6,480,019.40	-6,480,019.40		
3. 对所有者(或 股东)的分配							-602,694,330.86		-602,694,330.86
4. 其他									
(四) 所有者权 益内部结转				23,213,991.88			-23,213,991.88		
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				23,213,991.88			-23,213,991.88		
四、本期期末余 额	3,880,518,908.00	16,739,471,341.56	370,229,016.47	-65,013,217.33	999,241,215.48	2,485,789,459.49	4,495,138,107.22	337,192,727.82	28,502,109,525.77

项目	2020 年半年度								少数股东权 益	所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益									
	实收资本(或股 本)	资本公积	减: 库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
一、上年期末余	3,000,000,000.00	11,765,216,102.69	19,220,540.31	125,477,406.24	848,900,937.29	2,153,950,217.90	3,081,589,047.65	299,879,055.64	21,255,792,227.10	

额									
加：会计政策变更					-2,054,009.43	-4,108,018.86	-14,378,066.04		-20,540,094.33
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	3,000,000,000.00	11,765,216,102.69	19,220,540.31	125,477,406.24	846,846,927.86	2,149,842,199.04	3,067,210,981.61	299,879,055.64	21,235,252,132.77
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）	880,518,908.00	4,969,603,897.03		-170,191,525.21		11,097,882.09	504,556,109.82	2,479,659.88	6,198,064,931.61
（一）综合收益总额				-180,983,336.62			1,030,536,040.36	2,479,659.88	852,032,363.62
（二）所有者投入和减少资本	880,518,908.00	4,969,603,897.03							5,850,122,805.03
1.所有者投入的普通股	880,518,908.00	4,970,209,617.45							5,850,728,525.45
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		-605,720.42							-605,720.42
（三）利润分配						11,097,882.09	-515,188,119.13		-504,090,237.04
1.提取盈余公积									
2.提取一般风险准备						11,097,882.09	-11,097,882.09		
3.对所有者（或股东）的分配							-504,090,237.04		-504,090,237.04
4.其他									
（四）所有者权益内部结转				10,791,811.41			-10,791,811.41		
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				10,791,811.41			-10,791,811.41		
四、本期期末余额	3,880,518,908.00	16,734,819,999.72	19,220,540.31	-44,714,118.97	846,846,927.86	2,160,940,081.13	3,571,767,091.43	302,358,715.52	27,433,317,064.38

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

母公司所有者权益变动表

2021 年 1—6 月

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年半年度							
	实收资本(或股本)	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年期末余额	3,880,518,908.00	16,625,441,979.30	19,220,540.31	101,058,271.37	999,241,215.48	2,274,042,866.73	3,485,757,293.51	27,346,839,994.08
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年期初余额	3,880,518,908.00	16,625,441,979.30	19,220,540.31	101,058,271.37	999,241,215.48	2,274,042,866.73	3,485,757,293.51	27,346,839,994.08
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）		-6,714,509.79	351,008,476.16	-43,842,183.05		4,716,115.32	319,077,940.47	-77,771,113.21
（一）综合收益总额				-67,056,174.93			949,702,378.53	882,646,203.60
（二）所有者投入和减少资本		-6,714,509.79	351,008,476.16					-357,722,985.95
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		-6,714,509.79	351,008,476.16					-357,722,985.95
(三) 利润分配						4,716,115.32	-607,410,446.18	-602,694,330.86
1. 提取盈余公积								
2. 提取一般风险准备						4,716,115.32	-4,716,115.32	
3. 对所有者(或股东)的分配							-602,694,330.86	-602,694,330.86
4. 其他								
(四) 所有者权益内部结转				23,213,991.88			-23,213,991.88	
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				23,213,991.88			-23,213,991.88	
四、本期期末余额	3,880,518,908.00	16,618,727,469.51	370,229,016.47	57,216,088.32	999,241,215.48	2,278,758,982.05	3,804,835,233.98	27,269,068,880.87

项目	2020 年半年度							
	实收资本(或股本)	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年期末余额	3,000,000,000.00	11,657,819,494.42	19,220,540.31	129,966,338.16	848,900,937.29	1,964,114,786.54	2,944,107,768.09	20,525,688,784.19
加：会计政策变更					-2,054,009.43	-4,108,018.86	-14,378,066.04	-20,540,094.33
前期差错更正								
其他								
二、本年期初余额	3,000,000,000.00	11,657,819,494.42	19,220,540.31	129,966,338.16	846,846,927.86	1,960,006,767.68	2,929,729,702.05	20,505,148,689.86
三、本期增减变动金额(减少以	880,518,908.00	4,969,603,897.03		-184,076,846.85		5,844,320.88	201,490,838.82	5,873,381,117.88

“—”号填列)								
(一) 综合收益总额				-194,868,658.26			722,217,208.15	527,348,549.89
(二) 所有者投入和减少资本	880,518,908.00	4,969,603,897.03						5,850,122,805.03
1. 所有者投入的普通股	880,518,908.00	4,970,209,617.45						5,850,728,525.45
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		-605,720.42						-605,720.42
(三) 利润分配						5,844,320.88	-509,934,557.92	-504,090,237.04
1. 提取盈余公积								
2. 提取一般风险准备						5,844,320.88	-5,844,320.88	
3. 对所有者(或股东)的分配							-504,090,237.04	-504,090,237.04
4. 其他								
(四) 所有者权益内部结转				10,791,811.41			-10,791,811.41	
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				10,791,811.41			-10,791,811.41	
四、本期期末余额	3,880,518,908.00	16,627,423,391.45	19,220,540.31	-54,110,508.69	846,846,927.86	1,965,851,088.56	3,131,220,540.87	26,378,529,807.74

公司负责人：范力

主管会计工作负责人：袁维静

会计机构负责人：王菁

附注 1、公司基本情况

1. 公司概况

√适用 □不适用

东吴证券股份有限公司（原名苏州证券公司、苏州证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司，以下简称“本公司”，本公司及其子公司以下简称“本集团”）成立于 1993 年 4 月 10 日，1998 年 1 月 9 日经中国人民银行江苏省分行苏银复（1998）30 号批复同意增资改制，注册资本增至 10,400 万元，公司名称变更登记为苏州证券有限责任公司，2001 年 12 月 19 日经中国证监会证监机构字（2001）308 号“关于苏州证券有限责任公司增资扩股并更名的批复”，注册资本由 10,400 万增至 100,000 万元人民币，公司更名为东吴证券有限责任公司。

2008 年 6 月 23 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]831 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更注册资本的批复”，增加注册资本人民币 50,000 万元，变更后的注册资本为人民币 150,000 万元。

2009 年 12 月 8 日经公司 2009 年度第二次临时股东会决议并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]310 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复”批准，本公司整体变更为东吴证券股份有限公司，变更后，公司的注册资本为人民币 150,000 万元，由全体股东以截至 2009 年 9 月 30 日经审计后的公司净资产折股。

2011 年 1 月 25 日经公司 2011 年第一次临时股东大会决议并经中国证券监督管理委员会“证监许可[2011]1887 号”文核准，公司首次公开发行 50,000 万股新股。公司股票于 2011 年 12 月 12 日起在上海证券交易所上市交易，注册资本变更为人民币 200,000 万元。

2013 年 9 月 9 日经公司 2013 年第二次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2014 年 2 月 13 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可[2014]200 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 70,000 万股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 70,000 万元，变更后公司注册资本为人民币 270,000 万元。

2015 年 11 月 16 日经公司 2015 年第四次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2015 年 12 月 23 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可[2015]3035 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 30,000 万股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 30,000 万元，变更后公司注册资本为人民币 300,000 万元。

2019 年 12 月 27 日，经中国证监会“证监许可（2019）2984 号”《关于核准东吴证券股份有限公司配股的批复》，核准公司向原股东配售股份。2020 年 3 月，公司完成配股发行，发行数量 880,518,908 股，并于 2020 年 4 月 8 日完成了工商变更登记手续，公司注册资本增加至 3,880,518,908 元。

公司住所：苏州工业园区星阳街 5 号。

2020 年 4 月 8 日，取得由苏州市工商行政管理局核准变更登记的新企业法人营业执照，统一社会信用代码：91320000137720519P

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

2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，本年度变化情况详见本附注六“合并范围的变更”。

附注 2、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

本公司已评价自报告期末起至少 12 个月的持续经营能力，本公司管理层相信公司能自本财务报表批准日后不短于 12 个月的可预见未来期间内持续经营。因此，本公司以持续经营为基础编制截至 2021 年 6 月 30 日止的财务报表。

附注 3、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

√适用 □不适用

本集团金融工具的核算、承销证券业务的核算、融资融券的核算、转融通业务的核算、收入的确认和计量、资产减值准备等交易和事项的会计政策和会计估计，是按照公司实际业务特点制定的，详见本附注三之相关描述。

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

本公司记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

本集团下属子公司、合营企业及联营企业，根据其经营所处的主要经济环境自行决定其记账本位币，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

参与合并的各方在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时性的，为同一控制下企业合并。合并方在企业合并中取得的资产和负债，以被合并方的资产、负债（包括最终控制方收购被合并方而形成的商誉）在最终控制方合并财务报表中的账面价值为基础，进行相关会计处理。合并方取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）不足以冲减的，调整留存收益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

通过多次交易分步实现的同一控制下企业合并，合并方在取得被合并方控制权之前持有的长期股权投资，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一方最终控制之日孰晚日与合并日之间已确认有关损益、其他综合收益和其他所有者权益变动，分别冲减比较报表期间的期初留存收益或当期损益。

(2) 非同一控制下的企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下企业合并。购买方支付的合并成本是为取得被购买方控制权而支付的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和。购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。购买方在购买日对合并成本进行分配，确认所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。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（参见附注三、19）；合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益。

通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并的，对于购买日之前持有的被购买方的长期股权投资，按照该长期股权投资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损益；购买日之前持有的被购买方的长期股权投资涉及在权益法核算下的其他综合收益的，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理，除净损益、其他综合收益和利润分配外的其他股东权益变动，转为购买日所属当期损益。对于购买日之前持有的被购买方的其他权益工具投资，该权益工具投资在购买日之前累计在其他综合收益的公允价值变动转入留存损益。

5. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，包括本公司及本公司的子公司（指被本公司控制的主体，包括企业、被投资单位中可分割部分、以及企业所控制的结构化主体等）。控制，是指拥有对被投资单位的权力，通过参与被投资单位的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资单位的权力影响其回报金额。子公司的经营成果、财务状况和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

本公司通过同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，视同被合并子公司在本公司最终控制方对其实施控制时纳入合并范围，并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。

本公司通过非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以购买日确定的各项可辨认资产、负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整，并自购买日起将被合并子公司纳入合并范围。

子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时，在编制合并财务报表时按本公司的会计期间或会计政策对子公司的财务报表进行必要的调整。合并范围内企业之间所有重大交易、余额以及未实现损益在编制合并财务报表时予以抵消。内部交易发生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则不予抵消。

子公司少数股东应占的权益、损益和综合收益总额分别在合并资产负债表的股东权益中和合并利润表的净利润及综合收益总额项目后单独列示。如果子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的，其余额仍冲减少数股东权益。

对于购买子公司少数股权或因处置部分股权投资但没有丧失对该子公司控制权的交易，作为权益性交易核算，调整归属于母公司所有者权益和少数股东权益的账面价值以反映其在子公司中相关权益的变化。少数股东权益的调整额与支付/收到对价的公允价值之间的差额调整资本公积，资本公积不足冲减的，调整留存收益。

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，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、其他所有者权益变动，在丧失控制权时转为当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，需考虑各项交易是否构成一揽子交易，处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：(1) 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；(2) 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；(3) 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；(4) 一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

不属于一揽子交易的，对其中每一项交易分别按照前述进行会计处理；若各项交易属于一揽子交易的，将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

6. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

√适用 □不适用

合营安排分为共同经营和合营企业。共同经营，是指合营方享有该安排相关资产且承担该安排相关负债的合营安排。合营企业，是指合营方仅对该安排的净资产享有权利的合营安排。

共同经营的合营方应当确认其与共同经营中利益份额相关的下列项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理：（一）确认单独所持有的资产，以及按其份额确认共同持有的资产；

(二) 确认单独所承担的负债，以及按其份额确认共同承担的负债；(三) 确认出售其享有的共同经营产出份额所产生的收入；(四) 按其份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；(五) 确认单独所发生的费用，以及按其份额确认共同经营发生的费用。

合营方向共同经营投出或出售资产等(该资产构成业务的除外)，在该资产等由共同经营出售给第三方之前，应当仅确认因该交易产生的损益中归属于共同经营其他参与方的部分。投出或出售的资产发生符合《企业会计准则第 8 号——资产减值》等规定的资产减值损失的，合营方应当全额确认该损失。

合营方自共同经营购买资产等(该资产构成业务的除外)，在将该资产等出售给第三方之前，应当仅确认因该交易产生的损益中归属于共同经营其他参与方的部分。购入的资产发生符合《企业会计准则第 8 号——资产减值》等规定的资产减值损失的，合营方应当按其承担的份额确认该部分损失。

对共同经营不享有共同控制的参与方，如果享有该共同经营相关资产且承担该共同经营相关负债的，应当按照前述规定进行会计处理。

7. 现金及现金等价物的确定标准

现金及现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

8. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

(1) 外币交易的会计处理

发生外币交易时，采用按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的汇率折算。于资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，除根据借款费用核算方法应予资本化的，计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，于资产负债表日仍采用交易发生日的即期汇率折算。

(2) 外币财务报表的折算

境外经营的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，股东权益项目除未分配利润项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。境外经营的利润表中的收入和费用项目，采用年平均汇率折算。上述折算产生的外币报表折算差额，在其他综合收益中单独列示。

9. 金融工具

适用 不适用

(一) 金融资产和金融负债的确认和终止确认

本集团成为金融工具合同的一方时，应当确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或负债终止确认，是指本集团将之前确认的金融资产或金融负债从资产负债表中予以转出。

1、金融资产的终止确认：

满足下列条件之一时，本集团终止确认该金融资产：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 本集团将收取金融资产现金流量的合同权利转移给其他方；
- (3) 本集团保留了收取金融资产现金流量的合同权利，但承担了将收取的现金流量支付给一个或多个最终收款方的合同义务，且(a)实质上转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，或(b)虽然实质上既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但未保留对该金融资产的控制。

2、金融负债的终止确认

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本集团终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。本集团与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，本集团应当终止确认原金融负债，同时确认一项新金融负债。

本集团对原金融负债（或其一部分）的合同条款做出实质性修改的，应当终止确认原金融负债，同时按照修改后的条款确认一项新金融负债。

（二）金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产在初始确认时，根据本集团企业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分为：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金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

除非本集团改变管理金融资产的业务模式，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

管理金融资产的业务模式，是指本集团如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本集团所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本集团以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本集团对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本集团对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(1) 以摊余成本计量的金融资产

本集团将同时符合下列条件的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

①管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

(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（债务工具）

本集团将同时符合下列条件的金融资产，分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）：

①本集团管理该金融资产的业务模式是既以收取合同现金流量为目标又以出售金融资产为目标；

②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

(3)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）

对于非交易性权益工具投资，本集团可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

满足下列条件之一的，表明本集团持有该金融资产的目的是交易性的：取得相关金融资产的目的主要是为了近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但符合财务担保合同的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从工具发行方的角度符合权益工具的定义。

(4)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本集团将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，企业可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；以摊余成本计量的金融负债。

企业对所有金融负债均不得进行重分类。

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。

在初始计量时，符合以下条件之一的金融负债，企业可将其不可撤销地指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债：

①能够消除或显著减少会计错配；

②根据正式书面文件载明的企业风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在公司内部以此为基础向关键管理人员报告。

(2) 以摊余成本计量的金融负债

除下列各项外，本集团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不属于上述情形的财务担保合同，以及不属于上述情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

（三）金融资产和金融负债的计量

1、初始计量

初始确认的金融资产或金融负债，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或金融负债，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。

企业取得金融资产所支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的利息或现金股利，应当单独确认为应收项目进行处理。

2、后续计量

(1) 以摊余成本计量的金融资产

该类金融资产采用实际利率法以摊余成本进行后续计量。在其终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时产生的利得或损失，计入当期损益。

(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）

该类金融资产以公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息收入、减值损失或利得和汇兑损益计入当期损益，其余公允价值变动均计入其他综合收益。当金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益转出，计入当期损益。

(3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）

该类金融资产以公允价值进行后续计量。其公允价值的后续变动计入其他综合收益，不计提减值准备。除了获得的股利收入（明确作为投资成本部分收回的股利收入除外）计入当期损益外，其他相关的利得和损失（包括汇兑损益）均计入其他综合收益，且后续不得转入损益。当金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益转出，计入留存收益。

(4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

该类金融资产以公允价值进行后续计量，其产生的所有利得或损失计入当期损益。

(5) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债以公允价值进行后续计量。其产生的所有利得或损失计入当期损益，除非是将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的，则该金融负债所产生的利得或损失按照下列规定进行处理：①由本集团自身信用风险变动引起的该金融负债公允价值的变动金额，应当计入其他综合收益；②该金融负债的其他公允价值变动计入当期损益。按照①对该金融负债的自身信用风险变动的影响进行处理会造成或扩大损益中的会计错配的，本集团应当将该金融负债的全部利得或损失（包括自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失应当从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(6) 以摊余成本计量的金融负债

该类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。在其终止确认或按照实际利率法摊销时产生的利得或损失，计入当期损益。

（四）金融资产和金融负债公允价值的确定

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产或者转移一项负债所需支付的价格。本集团以主要市场的价格计量相关资产或负债的公允价值；不存在主要市场的，以最有利市场的价格计量相关资产或负债的公允价值。在确定公允价值时，本集团采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

1、公允价值确定的基本原则

对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价

值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

对不存在活跃市场的投资品种，应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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。对于以公允价值计量的金融负债，本集团已考虑不履约风险，并假定不履约风险在负债转移前后保持不变。不履约风险是指企业不履行义务的风险，包括但不限于企业自身信用风险。

2、公允价值层次

本集团对于以公允价值计量的金融资产和金融负债，按照其公允价值计量所使用的输入值分为以下三个层次：

第一层次：输入值是计量日能够取得的相同金融资产或金融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金融资产或金融负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：输入值是相关金融资产或金融负债的不可观察输入值。

(五) 金融工具减值

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。信用损失是指企业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。

本集团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进行减值会计处理并确认损失准备。

1、金融工具减值阶段的划分

本集团可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：

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，本集团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；

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，本集团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；

第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，本集团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。

上述三阶段的划分，适用于购买或源生时未发生信用减值的金融工具。对于购买或源生时已发生信用减值的金融工具，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。对于符合准则规定条件且适用本集团已做出相应会计政策选择的应收款项和其他应收款，始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

2、金融工具减值的账务处理

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，本集团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。在每个资产负债表日，本集团将整个存续期内预期信用损失的变动金额作为减值损失或利得计入当期损益。

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

对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具），本集团在其他综合收益中确认其损失准备，并将减值损失或利得计入当期损益，且不减少金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

（六）金融资产转移的确认依据和计量方法

本集团在判断金融资产转移是否满足金融资产终止确认条件时，采用实质重于形式的原则。本集团已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。

本集团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：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其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（或部分）转移满足终止确认条件的，本集团将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 被转移金融资产（或终止确认部分）在终止确认日的账面价值；
- (2) 因转移金融资产（或终止确认部分）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。

金融资产转移不满足终止确认条件的，继续确认该金融资产，并将收到的对价确认为一项金融负债。

（七）衍生工具及嵌入衍生工具

衍生工具包括股指期货、国债期货、商品期货、利率互换、权益互换及场内期权等。衍生工具于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量。衍生工具的公允价值变动计入当期损益。因股指期货、国债期货、商品期货及部分利率互换合约每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与业务相关的暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

对于包含嵌入衍生工具的混合合同，若主合同属于金融资产，本集团不从该混合合同中分拆嵌入衍生工具，而将该混合合同作为一个整体适用关于金融资产分类的会计准则规定。

若主合同不属于金融资产，且同时符合下列条件的，本集团从混合工具中分拆嵌入衍生工具，作为单独的衍生金融工具处理：嵌入衍生工具与该主合同在经济特征及风险方面不紧密相关；与该嵌入衍生工具具有相同条款的单独工具符合衍生工具的定义；该混合合同不是以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。该嵌入衍生工具在取得日或后续资产负债表日的公允价值无法单独计量，则将混合合同整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

（八）金融资产和金融负债的抵销

当本集团具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

（九）权益工具

发行权益工具收到的对价扣除交易费用后，计入股东权益。回购自身权益工具支付的对价和交易费用，减少股东权益。权益工具的公允价值变动不予确认。

回购自身股份时，回购的股份作为库存股管理，回购股份的全部支出转为库存股成本，同时进行备查登记。库存股不参与利润分配，在资产负债表中作为股东权益的备抵项目列示。

库存股注销时，按注销股票面值总额减少股本，库存股成本超过面值总额的部分，应调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）的余额不足冲减的，调整留存收益；库存股成本低于面值总额的，低于面值总额的部分增加资本公积（股本溢价）。

库存股转让时，转让收入高于库存股成本的部分，增加资本公积（股本溢价）；低于库存股成本的部分，应调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）的余额不足冲减的，调整留存收益。

10. 客户交易结算资金

本集团接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等有价证券而收到的款项，全额存入本集团指定的银行账户，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。

本集团接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等有价证券时，如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额加上代扣代交的相关税费和应向客户收取

的佣金等费用之和减少客户交易结算资金；如卖出证券成交总额大于买入证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额减去代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用后的余额增加客户交易结算资金。

11. 买入返售和卖出回购业务

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（包括股票、债券、票据等），合同或协议到期日，再以约定价格返售相同之金融产品。

卖出回购交易按照合同或协议的约定，以一定的价格将相关资产（包括股票、债券、票据等）出售给交易对手，合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。

买入返售及卖出回购业务按发生时实际支付或收到的款项入账，并在资产负债表中确认；买入返售的标的资产在表外作备查登记，卖出回购的标的资产仍在资产负债表中确认。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。

12. 融资融券业务

融资融券业务，是指证券公司向客户出借资金供其买入上市证券或者出借上市证券供其卖出，并收取担保物的经营活动。融资融券业务类型主要包括融资业务和融券业务。

融资业务：证券公司将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。融出资金按借给客户资金的本金计量。

融券业务：将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，此项业务融出的证券不满足终止确认条件，继续确认该金融资产，计入融出证券。

融资融券利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等按期确认利息收入。

证券公司对客户融资融券并代理客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

13. 转融通业务

转融通业务包括转融资业务和转融券业务。转融资业务是指中国证券金融股份有限公司（以下简称证金公司）将自有或者依法筹集的资金出借给证券公司，供其办理融资业务的经营活动。转融券业务是指证金公司将自有或者融入的证券出借给证券公司，供其办理融券业务的经营活动。

转融资业务：对于融入的资金，证券公司在资产负债表内确认为资产，同时确认一项对出借方的负债，计入“拆入资金”科目，并在“利息支出”科目核算转融通业务产生的利息费用。

转融券业务：对于融入的证券，由于其主要收益或风险不由证券公司享有或承担，公司不将其计入资产负债表，但在财务报表附注中披露转融通融入的证券期末市值和转融通融入后拆借给客户的证券期末市值等信息。

14. 长期股权投资

√适用 □不适用

(一)控制、共同控制、重大影响的判断标准

控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。共同控制是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。重大影响是指对被投资方的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。在确定能否对被投资单位实施控制或施加重大影响时，已考虑投资方和其他方持有的被投资单位当期可转换公司债券、当期可执行认股权证等潜在表决权因素。

(二)投资成本确定

企业合并形成的长期股权投资，按以下方法确定投资成本：

(1)对于同一控制下企业合并形成的对子公司投资，以在合并日取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中账面价值的份额作为长期股权投资的投资成本。

分步实现的同一控制下企业合并，在合并日根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额，确定长期股权投资的初始投资成本；初始投资成本与达到合并前长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积（资/股本溢价），资本公积不足冲减的，冲减留存收益。合并日之前持有的股权投资，因采用权益法核算而确认的其他综合收益暂不进行会计处理，直至处置该项投资时采用与投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理；因采用权益法核算而确认的被投资单位净资产总除净损益、其他综合收益和利润分配以外的所有者权益其他变动，暂不进行会计处理，直至处置该项投资时转入当期损益。其中，处置后的剩余股权采用成本法或权益法核算的，其他综合收益和其他所有者权益应按比例结转，处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量准则进行会计处理的，其他综合收益和其他所有者权益应全部结转。

(2)对于非同一控制下企业合并形成的对子公司投资，以企业合并成本作为投资成本。

追加投资能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的，以购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本；购买日之前持有的被购买方的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在处置该项投资时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。

除企业合并形成的长期股权投资以外，其他方式取得的长期股权投资，按以下方法确定投资成本：

(1)以支付现金取得的长期股权投资，按实际支付的购买价款作为投资成本。

(2)以发行权益性证券取得的长期股权投资，按发行权益性证券的公允价值作为投资成本。

因追加投资等原因，能够对被投资单位单位施加重大影响或实施共同控制但不构成控制的，应当按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》确定的原持有股权的公允价值加上新增投资成本之和，作为改按权益法核算的初始投资成本。

（三）后续计量及损益确认方法

1、对子公司投资

在母公司财务报表中，对子公司投资采用成本法核算，在被投资单位宣告分派的现金股利或利润时，确认投资收益。

2、对合营企业投资和对联营企业投资

对合营企业投资和对联营企业投资采用权益法核算，具体会计处理包括：

对于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，其差额包含在长期股权投资成本中；对于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成本。

取得对合营企业投资和对联营企业投资后，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，分别确认投资损益和其他综合收益并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现金股利或利润应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。

在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益的份额时，以取得投资时被投资单位可辨认净资产的公允价值为基础确定，对于被投资单位的会计政策或会计期间与本集团不同的，权益法核算时按照本集团的会计政策或会计期间对被投资单位的财务报表进行必要调整。与合营企业和联营企业之间内部交易产生的未实现损益按照持股比例计算归属于本集团的部分，在权益法核算时予以抵消。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

对合营企业或联营企业发生的净亏损，除本集团负有承担额外损失义务外，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限。被投资企业以后实现净利润的，在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入资本公积。处置该项投资时，将原计入资本公积的部分按相应比例转入当期损益。

处置长期股权投资，其账面价值与实际取得价款的差额计入当期损益，采用权益法核算的长期股权投资，处置时，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础，按相应比例对原计入其他综合收益的部分进行会计处理。

减值方法及减值准备计提方法参见附注 3、21。

因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》核算，其在丧失共同控制或重大影响之日

的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，应当在终止采用权益法核算时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。

因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位控制的，在编制个别财务报表时，处置后的剩余股权能够对被投资单位实施共同控制或重大影响的，改按权益法核算，并对剩余股权视同自取得时即采用权益法核算进行调整。处置后剩余股权不能对被投资单位实施共同控制或重大影响的，按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定进行会计处理，其在丧失控制权之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。

15. 固定资产

(1). 确认条件

√适用 □不适用

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的并且使用年限超过一年的有形资产。固定资产在取得时，按取得时的成本入账。与购买或建造固定资产有关的一切直接或间接成本，在所购建资产达到预定可使用状态前所发生的，全部资本化为固定资产的成本。固定资产折旧采用直线法平均计算，并按固定资产的原值扣除残值和其预计使用年限制定折旧率。

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

(2). 折旧方法

√适用 □不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋建筑物	年限平均法	30~35	3%~5%	2.71%~3.23%
运输设备	年限平均法	5~10	3%~5%	9.5%~19.4%
办公设备及其他	年限平均法	5	3%~5%	19%~19.4%

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

减值测试方法及会计处理方法参见附注 3、21。

16. 在建工程

√适用 □不适用

在建工程按实际成本计量，实际成本包括在建期间发生的各项工程支出、工程达到预定可使用状态前的资本化的借款费用以及其他相关费用等。在建工程不计提折旧。

当所建工程项目达到预定可使用状态时，转入固定资产核算；尚未办理竣工决算的，按估计价值转帐，待办理竣工决算手续后再作调整。

减值测试方法及会计处理方法参见附注 3、21。

17. 使用权资产（自 2021 年 1 月 1 日起适用）√适用 不适用

本集团使用权资产类别主要包括房屋建筑物。

在租赁期开始日，本集团将其可在租赁期内使用租赁资产的权利确认为使用权资产，包括：租赁负债的初始计量金额；在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；承租人发生的初始直接费用；承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。本集团后续采用年限平均法对使用权资产计提折旧。能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，本集团在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，本集团在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。

本集团按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值时，如使用权资产账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，本集团将剩余金额计入当期损益。

18. 无形资产√适用 不适用

无形资产是指本集团拥有或者控制的没有实物形态的可辨认非货币性资产。

无形资产按照成本进行初始计量。

使用寿命有限的无形资产，自其可供使用时起在使用寿命内采用年限平均法摊销，计入当期损益；每年年度终了，对其使用寿命及摊销方法进行复核，若与以前估计不同的，改变摊销期限和摊销方法。

各项无形资产的摊销年限如下：

类别	摊销年限(年)
土地使用权	40
交易席位费	10
软件及其他	5

使用寿命不确定的无形资产不摊销；在每个会计期间对其使用寿命进行复核，如果有证据表明其使用寿命是有限的，估计其使用寿命并按上述方法进行摊销。

19. 商誉

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是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。对商誉不摊销，以其成本扣除累计减值准备后的金额计量。商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。商誉的减值方法及会计处理方法参见附注 3、21。

20. 长期待摊费用√适用 不适用

长期待摊费用按实际发生额入账，按费用项目的受益期限采用直线法平均摊销。本集团对以经营租赁方式租入的固定资产改良支出，其发生符合资本化条件的各项支出，计入本项目，按剩余租赁期与 5 年两者中较短的期限平均摊销。如果 5 年内同一经营租入固定资产又发生类似改良支出，将上次未摊完的长期待摊费用余额一次性计入当期损益。

21. 资产减值

适用 不适用

除附注 3、9 所述金融工具的减值以外，本集团在资产负债表日检查长期股权投资、固定资产、在建工程、使用权资产及使用寿命确定的无形资产是否存在可能发生减值的迹象；如果该等资产存在减值迹象，则估计其可收回金额。使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

估计资产的可收回金额以单项资产为基础，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，则以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。可收回金额为资产或者资产组的公允价值减去处置费用后的净额与其预计未来现金流量的现值两者之中的较高者。如果资产的可收回金额低于其账面价值，按其差额计提资产减值准备，并计入当期损益。

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

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

22. 应付职工薪酬

适用 不适用

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。本集团在职工提供服务的会计期间，将应付的职工薪酬确认为负债。

本集团按规定参加由政府机构设立的职工社会保障体系，包括基本养老保险、医疗保险、住房公积金及其他社会保障制度，相应的支出于发生时计入相关资产成本或当期损益。

在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，本集团在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：本集团不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；本集团确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

23. 租赁负债（自 2021 年 1 月 1 日起适用）

适用 不适用

在租赁期开始日，本集团将尚未支付的租赁付款额的现值确认为租赁负债，短期租赁和低价值资产租赁除外。在计算租赁付款额的现值时，本集团采用租赁内含利率作为折现率；无法确定租赁内含利率的，采用承租人增量借款利率作为折现率。本集团按照固定的周期性利率计算租赁负债在租赁期内各期间的利息费用，并计入当期损益，但另有规定计入相关资产成本的除外。未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额于实际发生时计入当期损益，但另有规定计入相关资产成本的除外。

租赁期开始日后，当实质固定付款额发生变动、担保余值预计的应付金额发生变化、用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动、购买选择权、续租选择权或终止选择权的评估结果或实际行权情况发生变化时，本集团按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债。

24. 预计负债

适用 不适用

与或有事项相关的义务同时满足下列条件的，应当确认为预计负债：

- (1) 该义务是企业承担的现时义务；
- (2) 履行该义务很可能导致经济利益流出企业；
- (3) 该义务的金额能够可靠地计量。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。

如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定。

在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

- (1) 或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定。
- (2) 或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

25. 收入

适用 不适用

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。取得相关商品或服务的控制权，是指能够主导该商品的使用或该服务的提供并从中获得几乎全部的经济利益。

满足下列条件之一时，本集团属于在某一段时间内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：

- (1) 客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益；
- (2) 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；
- (3) 本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团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，本集团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，本集团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，本集团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或服务控制权时，本集团会考虑下列迹象：

- (1) 本集团就该商品或服务享有现时收款权利；
- (2) 本集团已将该商品的实物转移给客户；
- (3) 本集团已将该商品的法定所有权或所有权上的主要风险和报酬转移给客户；
- (4) 客户已接受该商品或服务。

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值（参见附注三、9）。本集团拥有的、无条件（仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示。本集团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。

与本集团取得与客户之间的合同产生的收入相关的具体会计政策描述如下：

代理买卖证券业务手续费收入及期货经纪业务手续费收入于交易日在达成有关交易后确认。

承销收入于本集团完成承销合同中的履约义务时确认收入。

保荐业务、财务顾问业务和投资咨询服务业务收入根据合同条款在本集团履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

受托客户资产管理业务收入，于受托投资管理合同到期，与委托人结算时，本集团按合同规定的比例计算应由本集团享有的管理费收益，确认为当期收益；或合同中规定本集团按约定比例收取管理费和业绩报酬，则在合同期内分期确认管理费和业绩报酬收益。

其他收入在客户取得相关商品或服务的控制权时确认。

投资收益

持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）在持有期间取得的利息、红利、股息或现金股利计入投资收益。

金融资产转移满足终止确认条件的，除了初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具），应当将下列两项金额的差额计入投资收益：

- (1) 终止确认部分的账面价值；
- (2) 终止确认部分的对价，与原计入股东权益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金
额之和。

采用成本法核算的长期股权投资，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；采用权益法核算的长期股权投资，根据应享有或应分担的被投资单位实现的净损益确认投资收益。

利息收入

存款利息收入：在相关的收入金额能够可靠地计量，相关的经济利益可以收到时，按资金使用时间和实际利率确认利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

买入返售证券收入：在当期到期返售的，按返售价格与买入成本价格的差额，确认利息收入；在当期没有到期的，根据买入返售金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入，但对于已发生信用减值的金融资产，改按该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

融资融券业务利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等确认利息收入。

其他以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）：根据相关金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入，但对于已发生信用减值的金融资产，改按该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

26. 合同资产与合同负债

√适用 □不适用

本集团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

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。

合同负债

合同负债是指已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务。

27. 与合同成本有关的资产

√适用 □不适用

本集团与合同成本有关的资产包括合同取得成本和合同履约成本。

本集团为取得合同发生的增量成本预期能够收回的，作为合同取得成本确认为一项资产，除非该资产摊销期限不超过一年。

本集团为履行合同发生的成本，不适用存货、固定资产或无形资产等相关准则的规范范围的，且同时满足下列条件的，作为合同履约成本确认为一项资产：

- (1) 该成本与一份当前或预期取得的合同直接相关，包括直接人工、直接材料、制造费用（或类似费用）、明确由客户承担的成本以及仅因该合同而发生的其他成本；
- (2) 该成本增加了企业未来用于履行履约义务的资源；
- (3) 该成本预期能够收回。

本集团对与合同成本有关的资产采用与该资产相关的收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。

与合同成本有关的资产，其账面价值高于下列两项差额的，本集团将超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失：

- (1) 企业因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价；
- (2) 为转让该相关商品或服务估计将要发生的成本。

以前期间减值的因素之后发生变化，使得（1）减（2）的差额高于该资产账面价值的，应当转回原已计提的资产减值准备，并计入当期损益，但转回后的资产账面价值不应超过假定不计提减值准备情况下该资产在转回日的账面价值。

28. 政府补助

适用 不适用

政府文件规定用于购建或以其他方式形成长期资产的，作为与资产相关的政府补助；政府文件不明确的，以取得该补助必须具备的基本条件为基础进行判断，以购建或以其他方式形成长期资产为基本条件的作为与资产相关的政府补助，除此之外的作为与收益相关的政府补助。

与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的，确认为递延收益，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。

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，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期平均分配，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，尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

29. 所得税

适用 不适用

本集团采用资产负债表债务法进行所得税会计处理。

除与直接计入股东权益的交易或事项有关的所得税影响计入股东权益外，当期所得税费用和递延所得税费用（或收益）计入当期损益。

当期所得税费用是按本年度应纳税所得额和税法规定的税率计算的预期应交所得税，加上对以前年度应交所得税的调整。

资产负债表日，如果纳税主体拥有以净额结算的法定权利并且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行，那么当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列示。

递延所得税资产和递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定，按照预期收回资产或清偿债务期间的适用税率计量。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度抵扣的亏损和税款递减。递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

对于既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）的非企业合并交易中产生的资产或负债初始确认形成的暂时性差异，不确认递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生递延所得税。

资产负债表日，根据递延所得税资产和负债的预期收回或结算方式，依据已颁布的税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量该递延所得税资产和负债的账面金额。

资产负债表日，递延所得税资产及递延所得税负债在同时满足以下条件时以抵销后的净额列示：

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

30. 租赁（自 2021 年 1 月 1 日起适用）

√适用 □不适用

租赁的识别

在合同开始日，本集团评估合同是否为租赁或者包含租赁，如果合同中一方让渡了在一定期间内控制一项或多项已识别资产使用的权利以换取对价，则该合同为租赁或者包含租赁。为确定合同是否让渡了在一定期间内控制已识别资产使用的权利，本集团评估合同中的客户是否有权获得在使用期间内因使用已识别资产所产生的几乎全部经济利益，并有权在该使用期间主导已识别资产的使用。

单独租赁的识别

合同中同时包含多项单独租赁的，本集团将合同予以分拆，并分别各项单独租赁进行会计处理。同时符合下列条件的，使用已识别资产的权利构成合同中的一项单独租赁：

- (1) 承租人可从单独使用该资产或将其与易于获得的其他资源一起使用中获利；
- (2) 该资产与合同中的其他资产不存在高度依赖或高度关联关系。

租赁和非租赁部分的分拆

合同中同时包含租赁和非租赁部分的，本集团作为出租人和承租人时，将租赁和非租赁部分分拆后进行会计处理。

租赁期的评估

租赁期是本集团有权使用租赁资产且不可撤销的期间。本集团有续租选择权，即有权选择续租该资产，且合理确定将行使该选择权的，租赁期还包含续租选择权涵盖的期间。本集团有终止租赁选择权，即有权选择终止租赁该资产，但合理确定将不会行使该选择权的，租赁期包含终止租赁选择权涵盖的期间。发生本集团可控范围内的重大事件或变化，且影响本集团是否合理确定将行使相应选择权的，本集团对其是否合理确定将行使续租选择权、购买选择权或不行使终止租赁选择权进行重新评估。

作为承租人

本集团作为承租人的一般会计处理见附注三、17 和附注三、23。

租赁变更

租赁变更是原合同条款之外的租赁范围、租赁对价、租赁期限的变更，包括增加或终止一项或多项租赁资产的使用权，延长或缩短合同规定的租赁期等。

租赁发生变更且同时符合下列条件的，本集团将该租赁变更作为一项单独租赁进行会计处理：

- (1) 该租赁变更通过增加一项或多项租赁资产的使用权而扩大了租赁范围；
- (2) 增加的对价与租赁范围扩大部分的单独价格按该合同情况调整后的金额相当。

租赁变更未作为一项单独租赁进行会计处理的，在租赁变更生效日，本集团重新确定租赁期，并采用修订后的折现率对变更后的租赁付款额进行折现，以重新计量租赁负债。在计算变更后租赁付款额的现值时，本集团采用剩余租赁期间的租赁内含利率作为折现率；无法确定剩余租赁期间的租赁内含利率的，采用租赁变更生效日的本集团增量借款利率作为折现率。

就上述租赁负债调整的影响，本集团区分以下情形进行会计处理：

- (1) 租赁变更导致租赁范围缩小或租赁期缩短的，本集团调减使用权资产的账面价值，以反映租赁的部分终止或完全终止，部分终止或完全终止租赁的相关利得或损失计入当期损益；
- (2) 其他租赁变更，本集团相应调整使用权资产的账面价值。

短期租赁和低价值资产租赁

本集团将在租赁期开始日，租赁期不超过 12 个月，且不包含购买选择权的租赁认定为短期租赁；将单项租赁资产为全新资产时价值低的租赁认定为低价值资产租赁。本集团转租或预期转租

租赁资产的，原租赁不认定为低价值资产租赁。本集团对短期租赁和低价值资产租赁选择不确认使用权资产和租赁负债。在租赁期内各个期间按照直线法计入相关的资产成本或当期损益。

作为出租人

租赁开始日实质上转移了与租赁资产所有权有关的几乎全部风险和报酬的租赁为融资租赁，除此之外的均为经营租赁。本集团作为转租出租人时，基于原租赁产生的使用权资产对转租赁进行分类。

作为经营租赁出租人

经营租赁的租金收入在租赁期内各个期间按直线法确认为当期损益，未计入租赁收款额的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

31. 经营租赁（适用于 2020 年度）

1、租入资产

经营租赁租入资产的租金费用在租赁期内按直线法确认为相关资产成本或费用。或有租金在实际发生时计入当期损益。

2、租出资产

经营租赁租出资产所产生的租金收入在租赁期内按直线法确认为收入。经营租赁租出资产发生的初始直接费用，直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

32. 利润分配

适用 不适用

当年实现的税后利润于弥补以前年度亏损后，本公司根据《公司法》的规定，按照当年税后利润的 10% 足额提取法定盈余公积金，但本公司法定盈余公积金累计额达到本公司注册资本的 50% 时，可不再提取；根据《金融企业财务规则》的要求，按照税后利润的 10% 足额提取一般风险准备；根据《证券法》的要求，按不低于税后利润的 10% 提取交易风险准备金。经股东大会批准，本公司可从税后利润中提取任意盈余公积金。

本公司提取的一般风险准备金及交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算，用于弥补证券交易的损失。经股东大会批准，本公司提取的法定盈余公积金和任意盈余公积金可用于弥补本公司的亏损或者转增股本，但法定盈余公积金转为股本时，所留存的该项公积金不得少于转增前本公司注册资本的 25%。

本公司资本公积金不得用于弥补公司的亏损。

本公司可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得用于向股东进行现金分配。以前年度未分配利润，可并入当年度未分配利润向股东分配。

33. 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本集团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) 公司管理层能够定期评价该组成部分的经营业绩，以决定向其分配资源、评价业绩；
- (3) 能够取得该部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相同或相类似的经济特征，并且满足一定条件，本集团将其合并为一个经营分部。

34. 重大会计判断和估计

√适用 □不适用

运用上述会计政策过程中，由于经营活动内在的不确定性，本集团需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。本集团管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。导致出现重大调整风险的重要会计估计和关键假设如下：

（一）应用会计政策过程中所作的重要判断

1、金融资产的分类

a) 业务模式

金融资产于初始确认时的分类取决于本集团管理金融资产的业务模式，在判断业务模式时，本集团考虑包括企业评价和向关键管理人员报告金融资产业绩的方式、影响金融资产业绩的风险及其管理方式以及相关业务管理人员获得报酬的方式等。在评估是否以收取合同现金流量为目标时，本集团需要对金融资产到期日前的出售原因、时间、频率和价值等进行分析判断。

b) 合同现金流量特征

金融资产于初始确认时的分类取决于金融资产的合同现金流量特征，需要判断合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金为基础的利息的支付时，包含对货币时间价值的修正进行评估时，需要判断与基准现金流量相比是否具有显著差异、对包含提前还款特征的金融资产，需要判断提前还款特征的公允价值是否非常小等。

2、金融资产转移

管理层需要就金融资产的转移作出重大判断，确认与否会影响会计核算方法及本集团的财务状况和经营成果。

3、合并范围的确定

评估本集团是否作为投资者控制被投资企业时须考虑所有事实及情况。控制的定义包含以下三项要素：1) 拥有对被投资者的权力；2) 通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；3) 有能力运用对被投资者的权力影响其回报的金额。倘若有事实及情况显示上述一项或多项要素发生了变化，则本集团需要重新评估其是否对被投资企业构成控制。对于本集团管理并投资的结构化主体（如资产管理计划和基金等），本集团会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。在评估时，本集团需要估计结构化主体收益率、管理费、业绩报酬以及持有份额等可变因素，进而测算本集团享有的可变回报及回报的可变性，以分析评估本公司是否达到控制标准。若本集团对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

（二）会计估计中采用的关键假设和不确定因素

1、金融工具的公允价值

对于缺乏活跃交易市场的金融工具，本集团运用估值方法确定其公允价值。在估值时，本集团需对诸如自身和交易对手的信用风险、市场波动率和相关性等方面进行估计，这些相关因素假设的变化会对金融工具的公允价值产生影响。

2、金融资产的减值

本集团采用预期信用损失模型对金融工具的减值进行评估，应用预期信用损失模型需要做出重大判断和估计，需考虑所有合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。在做出该等判断和估计时，本集团根据历史还款数据结合经济政策、宏观经济指标、行业风险等因素推断债务人信用风险的预期变动。

3、除金融资产和商誉以外的其他资产减值

如附注三、21 所述，本集团于资产负债表日对除金融资产和商誉之外的其他资产（固定资产、在建工程等）判断是否存在可能发生减值的迹象。在进行减值测试时，当资产或资产组的账面价值高于可收回金额，表明发生了减值。预计未来现金流量现值时，管理层必须估计该项资产或资产组的预计未来现金流量，并选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

4、商誉减值

本集团每年对商誉进行减值测试。在进行减值测试时，需要将商誉分配到相应的资产组或资产组组合，并预计资产组或者资产组组合未来产生的现金流量，同时选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

5、所得税

在正常的经营活动中，涉及的很多交易和事项的最终税务处理都存在不确定性，本集团根据相关税收法规谨慎判断交易对应的所得税影响并相应计提所得税。递延所得税资产只有在未来有足够纳税所得并可用于抵销有关暂时性差异时才可确认。对此需要就某些交易的税务处理作出重

大判断。如果这些税务事项的最终认定结果与最初入账的金额存在差异，该差异将对作出上述最终认定期间的所得税费用和递延所得税的金额产生影响。

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

2018 年，财政部颁布了修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》（简称“新租赁准则”），新租赁准则采用与现行融资租赁会计处理类似的单一模型，要求承租人对除短期租赁和低价值资产租赁以外的所有租赁确认使用权资产和租赁负债，并分别确认折旧和利息费用。本集团自 2021 年 1 月 1 日开始按照新修订的租赁准则进行会计处理，对首次执行日前已存在的合同，选择不重新评估其是否为租赁或者包含租赁，并根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首次执行日新租赁准则与现行租赁准则的差异追溯调整本报告期期初留存收益：

(1) 对于首次执行日之前的经营租赁，本集团根据剩余租赁付款额按首次执行日的增量借款利率折现的现值计量租赁负债，并根据每项租赁按照与租赁负债相等的金额，并根据预付租金进行必要调整计量使用权资产。

(2) 本集团对使用权资产进行减值测试并进行相应的会计处理。

本集团对首次执行日之前租赁资产属于低价值资产的经营租赁或将于 12 个月内完成的经营租赁，采用简化处理，未确认使用权资产和租赁负债。此外，本集团对于首次执行日之前的经营租赁，采用了下列简化处理：

(1) 计量租赁负债时，具有相似特征的租赁可采用同一折现率；使用权资产的计量可不包含初始直接费用；

(2) 存在续租选择权或终止租赁选择权的，本集团根据首次执行日前选择权的实际行使及其他最新情况确定租赁期；

(3) 作为使用权资产减值测试的替代，本集团评估了包含租赁的合同在首次执行日前是否为亏损合同，并根据首次执行日前计入资产负债表的亏损准备金额调整使用权资产；

(4) 首次执行日前的租赁变更，本集团根据租赁变更的最终安排进行会计处理。

此外，首次执行日开始本集团将偿还租赁负债本金和利息所支付的现金在现金流量表中计入筹资活动现金流出，支付的采用简化处理的短期租赁付款额和低价值资产租赁付款额以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额仍然计入经营活动现金流出。

(2)、重要会计估计变更

适用 不适用

(3)、2021 年起首次执行新租赁准则调整首次执行当年年初财务报表相关情况

适用 不适用

合并资产负债表

单位：元 币种：人民币

项目	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日	调整数
资产：			
货币资金	23,550,623,073.76	23,550,623,073.76	
其中：客户资金存款	19,972,497,020.66	19,972,497,020.66	

结算备付金	4,022,703,604.97	4,022,703,604.97	
其中：客户备付金	3,635,439,157.44	3,635,439,157.44	
融出资金	18,049,801,302.82	18,049,801,302.82	
衍生金融资产	7,949,263.29	7,949,263.29	
存出保证金	3,125,558,058.04	3,125,558,058.04	
应收款项	376,891,916.23	376,891,916.23	
买入返售金融资产	7,018,448,234.30	7,018,448,234.30	
金融投资：			
交易性金融资产	34,115,122,757.46	34,115,122,757.46	
债权投资	224,095,373.07	224,095,373.07	
其他债权投资	6,264,932,127.78	6,264,932,127.78	
其他权益工具投资	3,843,359,653.81	3,843,359,653.81	
长期股权投资	1,538,178,928.49	1,538,178,928.49	
固定资产	649,911,472.33	649,911,472.33	
在建工程	879,705,555.60	879,705,555.60	
使用权资产		218,770,460.11	218,770,460.11
无形资产	230,916,590.07	230,916,590.07	
商誉	315,844,316.37	315,844,316.37	
递延所得税资产	854,571,053.96	854,571,053.96	
其他资产	405,936,918.57	397,728,495.34	-8,208,423.23
资产总计	105,474,550,200.92	105,685,112,237.80	210,562,036.88
负债：			
短期借款	1,069,956,134.02	1,069,956,134.02	
应付短期融资款	8,400,919,247.63	8,400,919,247.63	
交易性金融负债	1,978,636,180.90	1,978,636,180.90	
衍生金融负债	3,535,520.85	3,535,520.85	
卖出回购金融资产款	10,717,911,545.84	10,717,911,545.84	
代理买卖证券款	25,197,694,220.26	25,197,694,220.26	
应付职工薪酬	1,184,966,047.79	1,184,966,047.79	
应交税费	417,602,767.42	417,602,767.42	
应付票据	177,170,000.00	177,170,000.00	
应付款项	405,002,473.26	405,002,473.26	
合同负债	20,248,472.58	20,248,472.58	
应付债券	26,829,753,610.13	26,829,753,610.13	
租赁负债		214,400,739.43	214,400,739.43
递延所得税负债	57,846,309.94	57,846,309.94	
其他负债	802,986,871.92	799,148,169.37	-3,838,702.55
负债合计	77,264,229,402.54	77,474,791,439.42	210,562,036.88
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	3,880,518,908.00	3,880,518,908.00	
资本公积	16,738,719,260.67	16,738,719,260.67	
减：库存股	19,220,540.31	19,220,540.31	

其他综合收益	10,214,293.84	10,214,293.84	
盈余公积	999,241,215.48	999,241,215.48	
一般风险准备	2,479,309,440.09	2,479,309,440.09	
未分配利润	3,791,110,825.14	3,791,110,825.14	
归属于母公司所有者权益 (或股东权益)合计	27,879,893,402.91	27,879,893,402.91	
少数股东权益	330,427,395.47	330,427,395.47	
所有者权益(或股东权益)合计	28,210,320,798.38	28,210,320,798.38	
负债和所有者权益(或 股东权益)总计	105,474,550,200.92	105,685,112,237.80	210,562,036.88

各项目调整情况的说明：

√适用 □不适用

对于 2020 年财务报表中披露的重大经营租赁尚未支付的最低租赁付款额，本集团按 2021 年 1 月 1 日本集团增量借款利率折现的现值，与 2021 年 1 月 1 日计入资产负债表的租赁负债的差异调整过程如下：

2020 年 12 月 31 日重大经营租赁最低租赁付款额	259,144,028.57
减：采用简化处理的租赁付款额	26,510,147.86
其中：短期租赁	2,375,332.25
剩余租赁期少于 12 个月的租赁	24,134,815.61
剩余租赁期超过 12 个月的低价值租赁	
2021 年 1 月 1 日增量借款利率	3.60%-5.50%
2021 年 1 月 1 日租赁负债	214,400,739.43

母公司资产负债表

单位：元 币种：人民币

项目	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日	调整数
资产：			
货币资金	16,557,112,668.94	16,557,112,668.94	

其中：客户资金存款	15,111,886,948.19	15,111,886,948.19	
结算备付金	4,217,793,091.85	4,217,793,091.85	
其中：客户备付金	3,635,439,157.44	3,635,439,157.44	
融出资金	17,773,535,774.34	17,773,535,774.34	
存出保证金	225,822,171.01	225,822,171.01	
应收款项	33,407,859.54	33,407,859.54	
买入返售金融资产	6,270,089,161.84	6,270,089,161.84	
金融投资：			
交易性金融资产	27,343,180,782.74	27,343,180,782.74	
其他债权投资	6,272,297,615.32	6,272,297,615.32	
其他权益工具投资	3,803,934,935.10	3,803,934,935.10	
长期股权投资	8,476,183,686.25	8,476,183,686.25	
固定资产	603,211,298.13	603,211,298.13	
在建工程	879,705,555.60	879,705,555.60	
使用权资产		76,774,973.11	76,774,973.11
无形资产	195,908,850.11	195,908,850.11	
商誉	11,749,999.80	11,749,999.80	
递延所得税资产	732,027,730.35	732,027,730.35	
其他资产	157,293,737.79	150,647,433.11	-6,646,304.68
资产总计	93,553,254,918.71	93,623,383,587.14	70,128,668.43
负债：			
应付短期融资款	8,400,919,247.63	8,400,919,247.63	
交易性金融负债	46,900,714.00	46,900,714.00	
衍生金融负债	3,508,078.35	3,508,078.35	
卖出回购金融资产款	10,626,015,724.81	10,626,015,724.81	
代理买卖证券款	18,659,000,563.40	18,659,000,563.40	
应付职工薪酬	971,315,109.00	971,315,109.00	
应交税费	338,098,956.34	338,098,956.34	
应付款项	109,682,445.87	109,682,445.87	
合同负债	18,769,809.43	18,769,809.43	
应付债券	26,829,753,610.13	26,829,753,610.13	
租赁负债		70,128,668.43	70,128,668.43
其他负债	202,450,665.67	202,450,665.67	
负债合计	66,206,414,924.63	66,276,543,593.06	70,128,668.43
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	3,880,518,908.00	3,880,518,908.00	
资本公积	16,625,441,979.30	16,625,441,979.30	
减：库存股	19,220,540.31	19,220,540.31	
其他综合收益	101,058,271.37	101,058,271.37	
盈余公积	999,241,215.48	999,241,215.48	
一般风险准备	2,274,042,866.73	2,274,042,866.73	
未分配利润	3,485,757,293.51	3,485,757,293.51	

所有者权益（或股东权益）合计	27,346,839,994.08	27,346,839,994.08	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	93,553,254,918.71	93,623,383,587.14	70,128,668.43

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

财政部于 2018 年 12 月修订了《企业会计准则第 21 号—租赁》(以下简称“新租赁准则”)，根据要求，公司自 2021 年 1 月 1 日起执行新租赁准则，因实施新租赁准则引起的具体影响科目及金额见上述调整报表。

(4)、2021 年起首次执行新租赁准则追溯调整前期比较数据的说明

适用 不适用

36. 其他

适用 不适用

附注 4、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	根据财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36号）、《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税[2016]46号）以及《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》（财税[2016]70号）等规定，自 2016 年 5 月 1 日起，公司的主营业务收入适用增值税，税率为 6%。根据财政部和国家税务总局 2016 年 12 月 21 日发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税收政策的通知》，纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于财税[2016]36 号的金融商品转让。	1%-16%

	资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。根据财政部和国家税务总局 2017 年 1 月 6 日发布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳。根据《关于支持个体工商户复工复产增值税政策的公告》（财政部税务总局公告 2020 年第 13 号）以及《关于延续实施应对疫情部分税费优惠政策公告》（财政部税务总局公告 2021 年第 7 号）的有关规定，自 2020 年 3 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日，除湖北省外，其他省、自治区、直辖市的增值税小规模纳税人，适用 3% 征收率的应税销售收入，减按 1% 征收增值税。	
城市维护建设税	按流转税额的 7% 计征。城建税实行就地缴纳的办法，公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳城建税。	7%
企业所得税	按应纳税所得额计征	16.5%、17%、25%
教育费附加及地方教育费附加	按流转税额的 5% 计征	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（%）
本公司及本公司的境内子公司	25
本公司的香港子公司	16.50
本公司的新加坡子公司	17

附注 5、合并财务报表项目注释

1、货币资金

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

项目	期末余额	期初余额
库存现金	203,596.85	165,837.47
银行存款	25,112,400,009.05	23,471,843,494.40
其中：客户存款	22,395,579,311.99	19,972,497,020.66
公司存款	2,716,820,697.06	3,499,346,473.74
其他货币资金	19,149,410.79	78,613,741.89
合计	25,131,753,016.69	23,550,623,073.76

(2) 按币种列示

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：	/	/	203,596.85	/	/	165,837.47
人民币	/	/	203,596.85	/	/	165,837.47
银行存款：	/	/	25,112,400,009.05	/	/	23,471,843,494.40
其中：自有资金	/	/	2,716,820,697.06	/	/	3,499,346,473.74
人民币	/	/	2,154,781,084.18	/	/	2,847,996,404.85
美元	41,955,444.13	6.4601	271,036,364.62	13,964,493.06	6.5249	91,116,920.77
港元	284,095,503.89	0.8321	236,395,868.79	609,995,823.66	0.8416	513,372,485.19
新加坡元	11,049,161.64	4.8027	53,065,808.61	9,193,214.51	4.9314	45,335,418.03
其他	/	/	1,541,570.86	/	/	1,525,244.90
客户资金	/	/	22,395,579,311.99	/	/	19,972,497,020.66
人民币	/	/	21,433,837,999.69	/	/	18,903,100,363.91
美元	26,311,440.53	6.4601	169,974,536.97	34,911,643.65	6.5249	227,794,983.65
港元	950,223,503.01	0.8321	790,680,976.85	997,431,852.72	0.8416	839,438,647.25
新加坡元	37,760.31	4.8027	181,351.44	31,593.76	4.9314	155,801.47
其他	/	/	904,447.04	/	/	2,007,224.38
其他货币资金：	/	/	19,149,410.79	/	/	78,613,741.89
人民币	/	/	10,114,285.09	/	/	9,100,457.27
美元	10,805.97	6.4601	69,807.65	9,328,269.11	6.5249	60,866,023.12

港元	10,774,327.66	0.8321	8,965,318.05	10,274,787.90	0.8416	8,647,261.50
合计	/	/	25,131,753,016.69	/	/	23,550,623,073.76

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	/	/	3,847,199.69	/	/	124,578,665.69
人民币	/	/	3,847,199.69	/	/	124,578,665.69
客户信用资金	/	/	2,039,637,566.35	/	/	1,497,137,798.61
人民币	/	/	1,615,339,644.68	/	/	1,497,137,798.61
美元	6,742,455.08	6.4601	43,556,934.06		6.5249	
港元	453,020,904.08	0.8321	376,958,694.28		0.8416	
其他	/	/	3,782,293.33	/	/	
合计	/	/	2,043,484,766.04	/	/	1,621,716,464.30

货币资金的说明：

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本集团使用受限制的货币资金为人民币 350,535,937.78 元，主要是本集团纳入合并范围内的子公司计提的一般风险准备金、保证金存款以及本公司客户交易结算资金被司法机关冻结的金额（2020 年 12 月 31 日：人民币 295,003,709.96 元）。

于 2021 年 6 月 30 日，本集团存放在境外（包括香港）的货币资金折合人民币 1,431,838,693.56 元（2020 年 12 月 31 日：折合人民币 1,985,011,435.81 元）。

2、 结算备付金

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

项目	期末余额	期初余额
客户备付金	4,292,722,318.99	3,635,439,157.44
公司备付金	822,026,171.31	387,264,447.53
合计	5,114,748,490.30	4,022,703,604.97

(2) 按币种列示

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：	/	/	822,026,171.31	/	/	387,264,447.53
人民币	/	/	815,571,219.11	/	/	380,744,746.96
美元	999,203.14	6.4601	6,454,952.20	999,203.14	6.5249	6,519,700.57
客户普通备付金：	/	/	3,736,540,315.80	/	/	3,067,075,276.95
人民币	/	/	3,679,495,499.86	/	/	3,011,665,863.32
美元	7,982,115.50	6.4601	51,565,264.34	7,529,015.62	6.5249	49,126,074.02
港元	6,585,208.03	0.8321	5,479,551.60	7,465,945.36	0.8416	6,283,339.61
客户信用备付金：	/	/	556,182,003.19	/	/	568,363,880.49
人民币	/	/	556,182,003.19	/	/	568,363,880.49
合计	/	/	5,114,748,490.30	/	/	4,022,703,604.97

3、融出资金

√适用 □不适用

(1) 按开户性质列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	19,620,935,869.30	17,801,729,464.80
其中：个人	16,141,650,319.47	14,674,345,856.73
机构	3,479,285,549.83	3,127,383,608.07
减：减值准备	29,178,018.72	28,193,690.46
账面价值小计	19,591,757,850.58	17,773,535,774.34
境外	302,274,382.21	295,533,857.09
其中：个人	127,998,476.77	111,773,498.85
机构	174,275,905.44	183,760,358.24
减：减值准备	26,739,562.02	19,268,328.61
账面价值小计	275,534,820.19	276,265,528.48
账面价值合计	19,867,292,670.77	18,049,801,302.82

(2) 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
----	--------	--------

融资业务融出资金	19,620,935,869.30	17,801,729,464.80
孖展业务融资	302,274,382.21	295,533,857.09
减：减值准备	55,917,580.74	47,462,019.07
融出资金净值	19,867,292,670.77	18,049,801,302.82

(3) 按账龄列示

账龄	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1-3 个月	8,740,855,247.26	43.87	9,763,653.21	17.46
3-6 个月	2,365,846,403.55	11.87	3,005,429.61	5.37
6 个月以上	8,816,508,600.70	44.26	43,148,497.92	77.17
合计	19,923,210,251.51	100.00	55,917,580.74	100.00
账龄	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1-3 个月	7,695,493,344.71	42.52	9,021,221.52	19.01
3-6 个月	5,472,050,155.51	30.24	10,416,815.51	21.95
6 个月以上	4,929,719,821.67	27.24	28,023,982.04	59.04
合计	18,097,263,321.89	100.00	47,462,019.07	100.00

(4) 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
证券	63,596,053,685.40	52,617,573,704.83
资金	2,039,938,752.48	1,945,933,045.57
合计	65,635,992,437.88	54,563,506,750.40

融出资金的说明：

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，融出资金中有本金人民币 388,194,356.52 元被用于债权收益权转让业务，质押到期日为 2021 年 7 月 26 日（2020 年 12 月 31 日：人民币 761,864,424.38 元，质押到期日为 2021 年 2 月 25 日）。

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		资产	负债
权益衍生工具				1,831,126,300.00	1,086,355.37	2,293,957.99				731,385,406.32		95,522.12
信用衍生工具				150,000,000.00		2,004,400.00				220,000,000.00		3,256,590.00
利率衍生工具				698,828,600.00						227,756,800.00		
货币衍生工具				129,220,965.93	4,582,256.07					146,629,168.26	7,949,263.29	
其他衍生工具				8,542,687,756.12	939,110.00	256,835.00				1,617,906,780.00		183,408.73
合计				11,351,863,622.05	6,607,721.44	4,555,192.99				2,943,678,154.58	7,949,263.29	3,535,520.85

衍生金融工具的说明：

部分本集团持有的衍生金融工具为每日无负债结算，于 2021 年 6 月 30 日本集团持有的未到期的每日无负债结算合约的公允价值为浮亏人民币 15,828,205.49 元（2020 年 12 月 31 日：浮亏人民币 20,786,048.16 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	/	/	4,086,615,722.57	/	/	2,995,298,094.59
其中：人民币	/	/	4,047,074,099.04	/	/	2,979,015,132.97
美元	723,548.25	6.4601	4,674,194.05	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港元	41,902,931.72	0.8321	34,867,429.48	17,254,323.45	0.8416	14,521,238.62
信用保证金	/	/	24,528,016.30	/	/	31,817,421.07
其中：人民币	/	/	24,528,016.30	/	/	31,817,421.07
期货业务结算担保金	/	/	18,712,956.33	/	/	15,703,215.14
其中：人民币	/	/	17,464,806.33			14,440,815.14
港元	1,500,000.00	0.8321	1,248,150.00	1,500,000.00	0.8416	1,262,400.00
履约保证金	/	/	615,203,041.04	/	/	82,739,327.24
其中：人民币	/	/	615,203,041.04	/	/	82,739,327.24
合计	/	/	4,745,059,736.24	/	/	3,125,558,058.04

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
应收两融业务客户款	30,563,974.63	21,536,828.68
应收清算款	3,216,936.55	242,395,009.91
应收资产管理业务产品管理费	51,641,819.73	56,919,676.53
应收基金业务服务费	9,956,107.52	10,550,701.54
应收其他手续费及佣金	11,998,645.02	5,912,156.47
应收经纪及交易商	22,960,246.64	22,832,121.06
定期贷款	4,152,726,183.45	53,014,954.22
其他（注）	5,751,485.12	4,139,183.66
合计	4,288,815,398.66	417,300,632.07
减：坏账准备(按一般模型计提)	30,563,974.63	21,536,828.68
减：坏账准备(按简化模型计提)	19,242,973.83	18,871,887.16
应收款项账面价值	4,239,008,450.20	376,891,916.23

注：其他的应收款项主要为应收信用保护合约保护费等，其中并未包含股票质押式回购业务。

(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	4,257,097,333.11	99.26	386,724,941.54	92.67

1-2 年	2,436,562.76	0.06	24,116,355.42	5.78
2-3 年	23,287,602.93	0.54	6,459,335.11	1.55
3 年以上	5,993,899.86	0.14		
合计	4,288,815,398.66	100.00	417,300,632.07	100.00

(3) 按评估方式列示

账龄	期末				期初			
	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	70,847,541.13	1.65	49,108,137.09	69.32	64,103,804.31	15.36	40,085,487.28	62.53
组合计提坏账准备	4,217,967,857.53	98.35	698,811.37	0.02	353,196,827.76	84.64	323,228.56	0.09
合计	4,288,815,398.66	100.00	49,806,948.46	1.16	417,300,632.07	100.00	40,408,715.84	9.68

(4) 应收款项账面净额前五名

单位名称	账面净额	账龄	占应收款项余额的比例 (%)	款项性质
胡冉	102,002,625.85	1 年以内	2.41	定期贷款
杨翠珑	81,659,675.07	1 年以内	1.93	定期贷款
顾惠东	77,634,518.22	1 年以内	1.83	定期贷款
杨子江	71,488,199.68	1 年以内	1.69	定期贷款
SANLINK DEVELOPMENT LTD	51,145,248.90	1 年以内	1.21	定期贷款
合计	383,930,267.72		9.07	

期末应收款项余额中无应收持有本公司 5%以上（含 5%）股份的股东及其他关联方的款项。

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
股票质押式回购	4,254,760,887.07	5,389,771,430.57
债券质押式回购	3,127,988,047.60	3,846,066,461.59
减：减值准备	1,539,841,677.87	2,217,389,657.86
账面价值合计	5,842,907,256.80	7,018,448,234.30

(2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	4,254,760,887.07	5,389,771,430.57
债券	3,127,988,047.60	3,846,066,461.59
减：减值准备	1,539,841,677.87	2,217,389,657.86
买入返售金融资产账面价值	5,842,907,256.80	7,018,448,234.30

(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	11,170,047,873.88	11,123,622,702.66

对于通过交易所操作的债券逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因此无法获知对手方质押库信息，故上述担保物公允价值未包括交易所债券逆回购所取得的担保物资产的公允价值。于2021年6月30日和2020年12月31日，上述交易所债券逆回购的金额分别为人民币 489,507,214.29 元和 206,758,916.84 元。

(4) 约定购回、股票质押式回购融出资金按剩余期限（不含减值准备）分类披露

期限	期末账面余额		期初账面余额	
	约定购回式证券	股票质押式回购	约定购回式证券	股票质押式回购
1 个月内		3,041,118,907.75		4,276,440,847.44
1 个月至 3 个月		11,296,729.32		169,466,133.72
3 个月至 1 年		1,202,345,250.00		943,864,449.41
1 年以上				
合计		4,254,760,887.07		5,389,771,430.57

买入返售金融资产的说明：

√适用 □不适用

于2021年6月30日买入返售金融资产中无债券及资产收益权被用作卖出回购等业务的质押物（2020年12月31日：无）。

8、交易性金融资产

√适用 □不适用

(1) 交易性金融资产按投资品种列示

单位：元 币种：人民币

期末余额						
类别	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计
债券	21,930,428,855.43		21,930,428,855.43	22,913,433,321.49		22,913,433,321.49
公募基金	2,822,477,148.47		2,822,477,148.47	2,763,016,927.94		2,763,016,927.94
私募基金及专户	3,116,116,011.01		3,116,116,011.01	2,774,384,311.75		2,774,384,311.75
股票	1,961,271,781.76		1,961,271,781.76	1,601,366,759.04		1,601,366,759.04
银行理财产品	1,471,801,564.00		1,471,801,564.00	1,465,575,229.89		1,465,575,229.89
券商资管产品	24,163,213.12		24,163,213.12	23,209,367.07		23,209,367.07
信托计划	1,070,122,068.29		1,070,122,068.29	1,090,621,400.00		1,090,621,400.00
其他	2,378,349,964.53		2,378,349,964.53	2,415,010,719.64		2,415,010,719.64
合计	34,774,730,606.61		34,774,730,606.61	35,046,618,036.82		35,046,618,036.82
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	22,403,928,229.32		22,403,928,229.32	23,472,000,569.85		23,472,000,569.85
公募基金	2,813,014,611.55		2,813,014,611.55	2,770,690,600.77		2,770,690,600.77
私募基金及专户	2,733,810,082.92		2,733,810,082.92	2,402,458,784.17		2,402,458,784.17
股票	1,735,428,273.21		1,735,428,273.21	1,549,383,322.00		1,549,383,322.00
银行理财产品	725,482,591.84		725,482,591.84	724,000,000.00		724,000,000.00
券商资管产品	23,139,777.35		23,139,777.35	23,209,367.07		23,209,367.07
信托计划	1,504,947,168.29		1,504,947,168.29	1,520,201,400.00		1,520,201,400.00
其他	2,175,372,022.98		2,175,372,022.98	2,221,098,556.23		2,221,098,556.23
合计	34,115,122,757.46		34,115,122,757.46	34,683,042,600.09		34,683,042,600.09

(2) 变现有限制的交易性金融资产

	限制条件	期末余额	期初余额
债券	质押	12,255,173,735.89	9,777,584,017.00
基金	已融出证券	485,981,858.80	332,320,728.70
股票	已融出证券	13,482,309.63	47,988,740.61
股票	存在限售期	476,354,756.30	509,634,113.80
理财产品	质押	30,000,000.00	84,000,000.00
合计		13,260,992,660.62	10,751,527,600.11

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
定向工具	90,539,363.75	3,231,541.69	733,669.10	93,037,236.34	221,841,001.56	3,731,052.46	1,476,680.95	224,095,373.07
合计	90,539,363.75	3,231,541.69	733,669.10	93,037,236.34	221,841,001.56	3,731,052.46	1,476,680.95	224,095,373.07

其他说明：

于 2021 年 6 月 30 日，债权投资无被用作卖出回购业务的质押物（2020 年 12 月 31 日：部分债权投资被用作卖出回购业务的质押物，账面价值为人民币 160,252,751.08 元，质押到期日为 2023 年 10 月 13 日）。

10、 其他债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
金融债	608,088,929.29	5,805,824.66	9,402,660.71	623,297,414.66	110,695.49	767,075,823.12	14,822,861.64	6,069,596.88	787,968,281.64	150,531.89
企业债	2,886,004,597.19	86,531,956.14	29,339,947.81	3,001,876,501.14	3,883,417.20	3,030,036,145.24	74,608,652.79	2,757,569.76	3,107,402,367.79	3,171,336.71
公司债	1,180,646,083.26	52,032,696.72	-32,884,312.81	1,199,794,467.17	38,515,650.60	1,300,846,515.12	34,935,160.02	-10,789,240.76	1,324,992,434.38	29,606,240.88
其他	540,054,781.05	11,837,787.00	11,834,558.95	563,727,127.00	270,811.59	1,005,067,838.84	28,125,073.97	11,376,131.16	1,044,569,043.97	601,527.53
合计	5,214,794,390.79	156,208,264.52	17,692,854.66	5,388,695,509.97	42,780,574.88	6,103,026,322.32	152,491,748.42	9,414,057.04	6,264,932,127.78	33,529,637.01

其他说明：

于 2021 年 6 月 30 日,其他债权投资中部分债券被用作卖出回购业务的质押物,期末公允价值为人民币 644,898,802.70 元,质押到期日为 2021 年 7 月 2 日至 2021 年 7 月 7 日(2020 年 12 月 31 日: 756,545,603.00 元,质押到期日为 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 1 月 5 日)。

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	
非交易性证券	2,007,800,974.14	1,961,403,402.86	72,086,354.46	1,360,470,179.64	1,293,723,561.00	122,548,387.14	战略持有
非上市股权	423,888,600.00	391,732,472.74	1,540,000.00	203,888,600.00	160,040,102.30	4,000,000.00	战略持有
证金专户			141,000,279.35	2,278,350,000.00	2,389,595,990.51		
合计	2,431,689,574.14	2,353,135,875.60	214,626,633.81	3,842,708,779.64	3,843,359,653.81	126,548,387.14	/

(2). 本期终止确认的其他权益工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期终止确认时的公允价值	本期股利收入	终止确认时的累计利得或损失本期从其他综合收益转入留存收益的金额	处置该项投资的原因
非交易性证券	1,069,981,551.29	10,301,157.37	-30,951,989.17	战略调整
证金专户	2,278,350,000.00	141,000,279.35		战略调整
合计	3,348,331,551.29	151,301,436.72	-30,951,989.17	/

(3). 变现有限制的其他权益工具投资

项目	限制条件	期末余额	期初余额
非交易性证券	已融出证券	82,249,557.03	94,476,598.11
非交易性证券	设定质押		19,626,320.00
非交易性证券	存在限售期		4,785,955.62
合计		82,249,557.03	118,888,873.73

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		
联营企业										
许昌市绿野农业科技有限公司	3,001,782.82									3,001,782.82
华元恒道（上海）投资管理有限公司	36,560,437.85			-754,174.27	-1,338,298.76					34,467,964.82
东吴（苏州）金融科技有限公司	239,383,719.09			-5,300,628.46						234,083,090.63
苏州资产管理有限公司	894,129,284.23	372,000,000.00		60,367,187.62	-4,091,236.42		27,000,000.00			1,295,405,235.43

苏州企业 征信服务 有限公司	20,965,441.73			-2,784,033.27						18,181,408.46	
中证信用 增进股份 有限公司	309,171,677.39			15,951,772.29	-55,403.19	752,080.89	13,500,000.00			312,320,127.38	
China Reform Puissance Overseas Holdings Ltd	1,218.85				-12.1					1,206.75	
CDG Overseas Managemen t Co. Ltd.	34,965,366.53			2,849,263.20	-348,001.33					37,466,628.40	
合计	1,538,178,928.49	372,000,000.00		70,329,387.11	-5,832,951.80	752,080.89	40,500,000.00			1,934,927,444.69	

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	办公设备及其他	运输工具	合计
一、账面原值：				
1. 期初余额	728,453,889.99	417,040,087.44	18,622,472.05	1,164,116,449.48
2. 本期增加金额	932,984,337.75	14,237,309.01		947,221,646.76
(1) 购置		14,237,309.01		14,237,309.01
(2) 在建工程转入	932,984,337.75			932,984,337.75
3. 本期减少金额	134,154.00	2,544,256.40		2,678,410.40
(1) 处置或报废	134,154.00	2,544,256.40		2,678,410.40
外币报表折算差额		-102,222.98	-7,836.12	-110,059.10
4. 期末余额	1,661,304,073.74	428,630,917.07	18,614,635.93	2,108,549,626.74
二、累计折旧				
1. 期初余额	195,016,615.74	302,940,493.03	16,247,868.38	514,204,977.15
2. 本期增加金额	18,773,620.56	20,607,875.05	277,658.78	39,659,154.39
(1) 计提	18,773,620.56	20,607,875.05	277,658.78	39,659,154.39
3. 本期减少金额	95,231.14	2,390,558.99		2,485,790.13
(1) 处置或报废	95,231.14	2,390,558.99		2,485,790.13
外币报表折算差额		-325,499.58	-1,493.43	-326,993.01
4. 期末余额	213,695,005.16	320,832,309.51	16,524,033.73	551,051,348.40
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	1,447,609,068.58	107,798,607.56	2,090,602.20	1,557,498,278.34
2. 期初账面价值	533,437,274.25	114,099,594.41	2,374,603.67	649,911,472.33

其他说明：

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本集团无用于抵押担保、暂时闲置以及未办妥产权证书的固定资产（2020 年 12 月 31 日：无）。

14、在建工程

(1). 在建工程情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
上海富源置地广场项目				863,123,084.27		863,123,084.27

昆山汇金财富广场项目				16,582,471.33		16,582,471.33
合计				879,705,555.60		879,705,555.60

(2). 在建工程项目变动情况

本期	资金来源	期初余额	本年增加	本年减少	期末余额
上海富源置地广场项目	自有	863,123,084.27	52,105,749.11	915,228,833.38	
昆山汇金财富广场项目	自有	16,582,471.33	1,173,033.04	17,755,504.37	
合计		879,705,555.60	53,278,782.15	932,984,337.75	

15、使用权资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	218,770,460.11	218,770,460.11
2. 本期增加金额	44,830,445.20	44,830,445.20
3. 本期减少金额	432,935.00	432,935.00
外币报表折算差额	-1,186,965.88	-1,186,965.88
4. 期末余额	261,981,004.43	261,981,004.43
二、累计折旧		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额	30,864,409.32	30,864,409.32
3. 本期减少金额	135,024.40	135,024.40
外币报表折算差额	-37,756.76	-37,756.76
4. 期末余额	30,691,628.16	30,691,628.16
三、减值准备		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额		
3. 本期减少金额		
4. 期末余额		
四、账面价值		
1. 期末账面价值	231,289,376.27	231,289,376.27
2. 期初账面价值	218,770,460.11	218,770,460.11

16、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	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合计
一、账面原值					

1. 期初余额	104,423,670.70	379,980,706.49	15,149,517.10	26,375,382.36	525,929,276.65
2. 本期增加 金额		14,394,331.83			14,394,331.83
(1) 购置		14,394,331.83			14,394,331.83
(2) 内部研 发					
(3) 企业合 并增加					
3. 本期减少 金额					
(1) 处置					
外币报表折算差 额		-17,774.26	-9,500.00	-293,034.62	-320,308.88
4. 期末余额	104,423,670.70	394,357,264.06	15,140,017.10	26,082,347.74	540,003,299.60
二、累计摊销					
1. 期初余额	31,809,960.89	247,230,894.97	14,137,084.03	1,834,746.69	295,012,686.58
2. 本期增加 金额	1,305,295.92	24,037,249.15	25,000.02	843,596.39	26,211,141.48
(1) 计提	1,305,295.92	24,037,249.15	25,000.02	843,596.39	26,211,141.48
3. 本期减少 金额					
(1) 处置					
外币报表折算差 额		-17,707.18		-17,739.31	-35,446.49
4. 期末余额	33,115,256.81	271,250,436.94	14,162,084.05	2,660,603.77	321,188,381.57
三、减值准备					
1. 期初余额					
2. 本期增加 金额					
(1) 计提					
3. 本期减少 金额					
(1) 处置					
4. 期末余额					
四、账面价值					
1. 期末账面 价值	71,308,413.89	123,106,827.12	977,933.05	23,421,743.97	218,814,918.03
2. 期初账面 价值	72,613,709.81	132,749,811.52	1,012,433.07	24,540,635.67	230,916,590.07

其他说明：

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本集团无形资产无抵押担保情况(2020 年 12 月 31 日：无)。

17、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	
购买营业部商誉	11,749,999.80					11,749,999.80
购买子公司商誉	408,798,908.08				1,963,645.93	406,835,262.15
合计	420,548,907.88				1,963,645.93	418,585,261.95

(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		处置		
非同一控制下企业合并形成的商誉	104,704,591.51					104,704,591.51
合计	104,704,591.51					104,704,591.51

本集团商誉主要由收购子公司及营业部形成。其中于 2014 年通过非同一控制下企业合并取得东吴基金管理有限公司股权形成的商誉期末账面原值为人民币 2.31 亿元，累计确认商誉减值准备人民币 1.05 亿元；于 2020 年通过非同一控制下企业合并取得东吴证券（国际）金融控股有限公司股权形成的商誉期末账面原值为人民币 1.64 亿元，未确认商誉减值准备。本集团充分考虑对生产经营活动的管理和监控方式、以及对资产的持续使用和处置，结合企业合并所产生的协同效应，认定能够独立产生现金流量的最小的资产组组合，并将合并形成的商誉分配至该些资产组组合进行减值测试。

18、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
尚未支付的职工薪酬	1,043,581,256.42	260,895,314.11	1,114,537,734.33	278,634,433.58
信用减值准	1,631,926,572.61	407,981,643.15	2,300,288,640.15	575,072,160.04

备				
交易性金融资产公允价值变动	1,282,960,855.93	320,740,213.98	1,538,029,635.99	384,507,409.00
交易性金融负债公允价值变动	1,470,067.82	367,516.96	560,714.00	140,178.50
其他权益工具投资公允价值变动	181,296,919.63	45,324,229.91	199,003,226.35	49,750,806.59
衍生金融工具公允价值变动	12,676,513.56	3,169,128.39	14,468,091.38	3,617,022.85
其他	81,837,385.00	20,459,346.25	78,360,903.14	19,590,225.79
合计	4,235,749,570.97	1,058,937,392.75	5,245,248,945.34	1,311,312,236.35

(2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产公允价值变动	492,319,620.48	116,600,073.01	463,545,473.00	109,332,556.56
其他债权投资公允价值变动	63,705,266.87	15,926,316.72	40,720,746.70	10,180,186.68
其他权益工具投资公允价值变动	102,614,507.83	25,653,626.96	199,525,387.26	49,881,346.82
衍生金融工具公允价值变动	2,411,900.00	602,975.00	2,400,438.54	600,109.64
其他	1,074,687,587.31	268,671,896.83	1,378,373,170.51	344,593,292.63
合计	1,735,738,882.49	427,454,888.52	2,084,565,216.01	514,587,492.33

(3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	330,004,239.73	728,933,153.02	456,741,182.39	854,571,053.96
递延所得税负债	330,004,239.73	97,450,648.79	456,741,182.39	57,846,309.94

(4). 未确认递延所得税资产明细

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣暂时性差异	127,072,069.06	127,072,069.06
合计	127,072,069.06	127,072,069.06

19、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
其他应收款	228,496,954.33	274,370,725.15
长期待摊费用	30,385,984.05	29,930,223.93
预付款项	49,540,914.48	31,215,329.71
预交企业所得税	644,441.99	19,999,405.52
待摊费用	14,437,739.65	10,120,121.76
其他	97,599,427.52	164,407,266.99
减：减值准备	131,892,071.92	132,314,577.72
合计	289,213,390.10	397,728,495.34

(2) 其他应收款

√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
其他应收款	189,101,045.41	271,483,093.42
应收股利	39,395,908.92	2,887,631.73
减：坏账准备	131,892,071.92	132,314,577.72
合计	96,604,882.41	142,056,147.43

按账龄分析

种类	期末			
	账面金额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	88,227,478.06	38.62	4,158,769.04	3.16
1-2 年	105,593,376.30	46.21	99,027,952.87	75.08
2-3 年	26,426,400.73	11.57	24,746,105.40	18.76
3 年以上	8,249,699.24	3.60	3,959,244.61	3.00
合计	228,496,954.33	100.00	131,892,071.92	100.00

种类	期初			
	账面金额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)

1 年以内	140,448,657.50	51.19	12,104,476.50	9.15
1-2 年	123,325,806.87	44.95	115,963,118.00	87.64
2-3 年	3,279,872.54	1.20	648,789.10	0.49
3 年以上	7,316,388.24	2.66	3,598,194.12	2.72
合计	274,370,725.15	100.00	132,314,577.72	100.00

按坏账准备计提方式列示

种类	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	126,619,496.97	55.41	126,619,496.97	100.00
组合计提坏账准备	101,877,457.36	44.59	5,272,574.95	5.18
合计	228,496,954.33	100.00	131,892,071.92	57.72

种类	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	127,355,120.74	46.42	127,355,120.74	100.00
组合计提坏账准备	147,015,604.41	53.58	4,959,456.98	3.37
合计	274,370,725.15	100.00	132,314,577.72	48.23

于 2021 年 6 月 30 日,其他应收款账面净额中金额较大的前五单位名称、净额及款项性质如下:

单位名称	账面净额	账龄	占其他应 收款净额 比例 (%)	款项性质
昆高新芯微电子(江苏)有限公司	15,000,000.00	1 年以内	15.53	预付投资款
Swire Properties Management Limited - Pacific Place	5,037,290.43	1 年以内	5.21	房屋租赁保证金
China Reform Conson Soochow Overseas Fund I L.P.	4,884,069.00	1 年以内	5.06	应收基金分红款
兴佳利业股权投资基金管理有限公司	2,180,630.26	1-2 年	2.26	应收资管产品赎回款
中船置业有限公司	2,160,180.48	部分 1-2 年	2.24	房屋租赁保证金
合计	29,262,170.17		30.30	

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

(3) 长期待摊费用

项目	取得方式	期初余额	本期增加	本期减少		外币报表折算差额	期末余额
				本期摊销	其他		

					减少		
装修费	购入	23,602,869.20	6,056,801.91	5,135,908.10		-38,950.73	24,484,812.28
网络工程	购入	4,198,156.88	171,221.00	572,048.09		-33,955.51	3,763,374.28
办公家具	购入	1,197,210.38	293,501.98	305,448.02			1,185,264.34
水电增容	购入	27,842.86		14,352.66			13,490.20
消防工程	购入	904,144.61	174,127.04	139,228.70			939,042.95
合计		29,930,223.93	6,695,651.93	6,166,985.57		-72,906.24	30,385,984.05

20、 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	689,745,007.95	660,923,235.22
—交易性金融资产	499,464,168.43	380,309,469.31
—转融通融入证券	108,031,282.49	186,137,167.80
—其他权益工具	82,249,557.03	94,476,598.11

融券业务的说明：

于 2021 年 6 月 30 日，本集团转融通融入证券总额为人民币 108,031,282.49 元（2020 年 12 月 31 日：186,141,729.00 元）。

于 2021 年 6 月 30 日，融券业务无违约情况（2020 年 12 月 31 日：无）。

21、 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		其他	期末余额
			转回	转/核销		
融出资金减值准备	47,462,019.07	8,688,771.27			-233,209.60	55,917,580.74
买入返售金融资产减值准备	2,217,389,657.86	220,258,938.76	227,749,799.18	670,057,119.57		1,539,841,677.87
应收款项坏账准备	40,408,715.84	10,287,937.25	885,208.49		-4,496.14	49,806,948.46

其他应收款坏账准备	132,314,577.72	2,618,086.20	2,482,076.36	557,234.43	-1,281.21	131,892,071.92
债权投资减值准备	1,476,680.95			704,473.34	-38,538.51	733,669.10
其他债权投资减值准备	33,529,637.01	10,372,472.00	779,919.98		-341,614.15	42,780,574.88
商誉减值准备	104,704,591.51					104,704,591.51
合计	2,577,285,879.96	252,226,205.48	231,897,004.01	671,318,827.34	-619,139.61	1,925,677,114.48

22、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	29,455,189.80		26,462,390.94	55,917,580.74
买入返售金融资产减值准备	1,641,243.10	972,215.55	1,537,228,219.22	1,539,841,677.87
应收款项坏账准备 (一般模型)			30,563,974.63	30,563,974.63
应收款项坏账准备 (简化模型)	/	698,811.37	18,544,162.46	19,242,973.83
债权投资减值准备	733,669.10			733,669.10
其他债权投资减值准备	9,954,392.29		32,826,182.59	42,780,574.88
其他应收款坏账准备	5,272,574.95		126,619,496.97	131,892,071.92
合计	47,057,069.24	1,671,026.92	1,772,244,426.81	1,820,972,522.97
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	28,456,536.79		19,005,482.28	47,462,019.07
买入返售金融资产减值准备	4,518,158.15		2,212,871,499.71	2,217,389,657.86
应收款项坏账准备 (一般模型)			21,536,828.68	21,536,828.68
应收款项坏账准备 (简化模型)	/	323,228.56	18,548,658.60	18,871,887.16

债权投资减值准备	1,476,680.95			1,476,680.95
其他债权投资减值准备	6,001,073.70	185,317.28	27,343,246.03	33,529,637.01
其他应收款坏账准备	4,959,456.98		127,355,120.74	132,314,577.72
合计	45,411,906.57	508,545.84	2,426,660,836.04	2,472,581,288.45

买入返售金融资产的信用减值准备主要为股票质押式回购业务产生，股票质押式回购业务的信用减值准备明细情况如下：

2021年6月30日	账面原值	信用减值准备	担保物市值
风险阶段划分			
未来12个月预期信用损失	1,156,355,500.83	1,641,243.10	4,863,639,938.37
整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	97,221,555.00	972,215.55	173,846,400.00
整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	3,001,183,831.24	1,537,228,219.22	3,259,338,282.21
合计	4,254,760,887.07	1,539,841,677.87	8,296,824,620.58

23、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	4,634,321,839.62	1,069,956,134.02
合计	4,634,321,839.62	1,069,956,134.02

其他说明：

√适用 □不适用

于2021年06月30日，本集团无逾期借款（2020年12月31日：无）。

24、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	票面利率	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
短期融资券	2.47%-3.28%	4,010,453,698.63	11,162,688,383.57	9,557,956,438.36	5,615,185,643.84
收益凭证	2.30%-7.00%	4,390,465,549.00	3,292,656,189.46	5,419,125,591.77	2,263,996,146.69
合计	/	8,400,919,247.63	14,455,344,573.03	14,977,082,030.13	7,879,181,790.53

25、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	2,002,022,222.22	
合计	2,002,022,222.22	

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				
1 至 3 个月	2,002,022,222.22	2.80%		
3 至 12 个月				
1 年以上				
合计	2,002,022,222.22	/		/

26、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
浮动收益凭证	13,907,189.69		13,907,189.69	46,900,714.00		46,900,714.00
其他		1,255,043,492.85	1,255,043,492.85		1,931,735,466.90	1,931,735,466.90
合计	13,907,189.69	1,255,043,492.85	1,268,950,682.54	46,900,714.00	1,931,735,466.90	1,978,636,180.90

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的描述性说明：

√适用 □不适用

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债是部分合并结构化主体中归属于其他投资者的权益，本集团有义务于结构化主体到期或其他投资者赎回时基于账面净值及该结构化主体的有关条款向其他投资者付款。

27、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
债券质押式回购	11,146,833,459.13	9,967,029,254.17
信用业务债权收益权	300,320,833.33	750,882,291.67
合计	11,447,154,292.46	10,717,911,545.84

(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	11,146,833,459.13	9,967,029,254.17
信用业务债权收益权	300,320,833.33	750,882,291.67
合计	11,447,154,292.46	10,717,911,545.84

(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	12,048,846,538.59	10,594,307,171.08
信用业务债权收益权	388,194,356.52	761,864,424.38
合计	12,437,040,895.11	11,356,171,595.46

28、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	20,838,997,609.94	18,570,425,512.28
机构	6,151,570,095.76	4,265,008,974.88
小计	26,990,567,705.70	22,835,434,487.16
信用业务		
其中：个人	1,637,351,191.75	1,480,005,299.12
机构	831,357,229.64	882,254,433.98
小计	2,468,708,421.39	2,362,259,733.10
合计	29,459,276,127.09	25,197,694,220.26

29、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	1,160,225,505.39	1,003,472,075.21	1,102,472,781.46	1,061,224,799.14
二、离职后福利-设定提存计划	24,740,542.40	41,676,148.34	40,943,777.28	25,472,913.46
三、辞退福利		1,788,688.73	1,788,688.73	
合计	1,184,966,047.79	1,046,936,912.28	1,145,205,247.47	1,086,697,712.60

(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	1,149,801,106.49	917,114,888.46	1,018,759,132.75	1,048,156,862.20
二、职工福利费	1,551,666.24	13,145,616.18	13,919,496.08	777,786.34
三、社会保险费	723,146.77	22,859,378.26	22,879,792.14	702,732.89
其中：医疗保险费	659,991.90	20,673,007.55	20,671,998.88	661,000.57
工伤保险费	19,622.03	420,922.39	414,316.17	26,228.25
生育保险费	43,532.84	1,765,448.32	1,793,477.09	15,504.07
四、住房公积金	961,574.04	35,112,211.86	35,207,925.01	865,860.89
五、工会经费和职工教育经费	7,188,011.85	15,239,980.45	11,706,435.48	10,721,556.82
合计	1,160,225,505.39	1,003,472,075.21	1,102,472,781.46	1,061,224,799.14

(3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	491,460.76	38,776,229.53	38,162,252.73	1,105,437.56
2、失业保险费	49,081.64	1,219,918.81	1,201,524.55	67,475.90
3、企业年金缴费	24,200,000.00	1,680,000.00	1,580,000.00	24,300,000.00
合计	24,740,542.40	41,676,148.34	40,943,777.28	25,472,913.46

30、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
企业所得税	100,935,554.78	305,038,265.07
个人所得税	50,025,791.19	70,104,645.63
增值税	22,265,887.46	34,355,330.86
城市维护建设税	1,628,941.89	2,356,704.53
教育费附加	1,066,709.24	1,590,253.26
其他税费	2,353,228.96	4,157,568.07
合计	178,276,113.52	417,602,767.42

31、应付票据

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

种类	期末余额	期初余额
银行承兑汇票	272,570,000.00	177,170,000.00
合计	272,570,000.00	177,170,000.00

32、应付款项

√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	156,842,071.21	218,580,885.06
交易所质押借款	724,728,800.00	133,672,200.00
应付佣金	31,065,246.82	18,628,603.23
应付第三方存管费	14,862,312.65	16,427,462.78
其他	64,742,241.32	17,693,322.19
合计	992,240,672.00	405,002,473.26

33、合同负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
手续费及佣金预收款	20,169,806.60	18,769,809.43
销售货物预收款		1,478,663.15
合计	20,169,806.60	20,248,472.58

34、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	发行日期	到期日期	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
17 东吴债	100.00	2017-3-13	2022-3-13	2,500,000,000.00	4.70	2,587,310,141.10	61,259,040.06	117,500,000.00	2,531,069,181.16
18 东吴 F1	100.00	2018-1-29	2021-1-29	4,500,000,000.00	5.70	4,736,406,063.03	20,093,936.97	4,756,500,000.00	
18 东吴 F2	100.00	2018-12-29	2021-12-29	1,000,000,000.00	4.60	998,743,440.96	23,618,622.25		1,022,362,063.21
19 东吴 F1	100.00	2019-4-16	2022-4-16	2,000,000,000.00	4.20	2,055,634,509.16	43,244,763.61	84,000,000.00	2,014,879,272.77
19 东吴债	100.00	2019-8-12	2022-8-12	3,000,000,000.00	3.60	3,034,219,148.27	55,906,155.76		3,090,125,304.03
20 东吴 G1	100.00	2020-9-21	2021-9-24	2,600,000,000.00	3.29	2,614,969,119.57	49,744,009.88		2,664,713,129.45
20 东吴 G2	100.00	2020-9-21	2023-9-21	1,400,000,000.00	3.81	1,408,879,428.84	29,165,889.62		1,438,045,318.46
20 东吴 S1	100.00	2020-11-26	2021-5-25	2,800,000,000.00	3.55	2,799,155,786.56	49,863,813.44	2,849,019,600.00	
21 东吴 01	100.00	2021-1-15	2024-1-15	2,000,000,000.00	3.60		2,024,872,355.95		2,024,872,355.95
19 东吴 C1 次级债	100.00	2019-3-18	2022-3-18	2,000,000,000.00	4.25	2,062,559,511.11	44,066,088.04	85,000,000.00	2,021,625,599.15
21 东吴 C1 次级债	100.00	2021-4-28	2024-4-28	2,000,000,000.00	3.95		2,008,499,332.02		2,008,499,332.02
17 东吴 02 次级债	100.00	2017-4-26	2022-4-26	1,650,000,000.00	5.50	1,712,157,534.25	45,002,054.79	90,750,000.00	1,666,409,589.04
17 东吴 04 次级债	100.00	2017-5-22	2022-5-22	1,230,000,000.00	5.60	1,272,271,561.64	34,156,931.51	68,880,000.00	1,237,548,493.15
20 东吴 C1 次级债	100.00	2020-2-25	2023-2-25	1,000,000,000.00	3.80	1,032,289,617.49	18,828,190.73	38,000,000.00	1,013,117,808.22
20 东吴 C2 次级债	100.00	2020-6-10	2023-6-10	500,000,000.00	3.80	510,671,232.88	9,421,917.80	19,000,000.00	501,093,150.68
至尊宝 364 天 199 期	100.00	2020-2-13	2021-2-23	1,857,000.00	3.85	1,920,071.86	10,577.26	1,930,649.12	

至尊宝 364 天 201 期	100.00	2020-2-20	2021-2-23	1,194,000.00	3.85	1,233,671.87	6,800.89	1,240,472.76	
至尊宝 364 天 200 期	100.00	2020-2-17	2021-2-23	860,000.00	3.85	888,846.53	4,898.45	893,744.98	
至尊宝 369 天 213 期	100.00	2020-4-2	2021-4-6	432,000.00	3.55	443,925.01	3,579.05	447,504.06	
合计	/	/	/	30,184,343,000.00	/	26,829,753,610.13	4,517,768,958.08	8,113,161,970.92	23,234,360,597.29

35、 租赁负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
房屋及建筑物	229,405,953.29	214,400,739.43
合计	229,405,953.29	214,400,739.43

36、 其他负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付并表结构化主体其他投资者款项	514,542,740.27	498,671,629.98
其他应付款	849,523,508.22	173,339,586.24
预提费用	83,791,682.44	57,100,710.49
期货风险准备金	57,514,617.39	52,599,117.75
投资者保护基金	12,937,696.69	14,018,478.03
其他	4,480,379.53	3,418,646.88
合计	1,522,790,624.54	799,148,169.37

其他应付款

项目	期末余额		期初余额	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
其他应付款	246,829,177.36	29.06	173,339,586.24	100.00
其中：逾期应付款项				
应付股利	602,694,330.86	70.94		
合计	849,523,508.22	100.00	173,339,586.24	100.00

期末其他应付款主要明细：

内容	金额	款项性质	账龄
东辰控股集团有限公司	65,355,395.60	往来款	部分 1-2 年
野村证券	30,092,512.76	往来款	1 年以内
盛冠达量化精选 B 一期 私募证券投资基金	21,282,840.03	应付收益互换保证金	1 年以内
员工风险金	8,588,390.42	员工风险金	部分 3 年以上
中国国际金融股份有限公司	6,000,000.00	应付债券承销费	1 年以内
合计	131,319,138.81		

于 2021 年 6 月 30 日其他应付款中无欠本集团 5%以上（含 5%）股份的股东单位款项情况（2020 年 12 月 31 日：无）。

37、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	3,880,518,908.00						3,880,518,908.00

38、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)	16,621,217,375.66			16,621,217,375.66
其他资本公积	117,501,885.01	752,080.89		118,253,965.90
合计	16,738,719,260.67	752,080.89		16,739,471,341.56

39、库存股

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
库存股	19,220,540.31	351,008,476.16		370,229,016.47
合计	19,220,540.31	351,008,476.16		370,229,016.47

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

2021年3月5日，本公司第三届董事会第四十次（临时）会议审议通过了《关于回购公司A股股份的议案》。截至2021年3月30日，已完成回购本公司A股股份38,799,814股，占本公司总股本的0.9999%，回购最高价为人民币9.76元/股，回购最低价为人民币8.78元/股，回购均价为人民币9.05元/股，回购价款共计人民币351,008,476.16元。本次回购A股股份全部存放于公司回购专用证券账户，拟作为限制性股票股权激励计划的股票来源。

40、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	5,385,268.24	-111,494,860.63	-27,539,140.47		-23,213,991.88	-83,955,720.16	-83,955,720.16		-55,356,460.04
权益法下不能转损益的其他综合收益	4,993,647.65	-1,338,298.76				-1,338,298.76	-1,338,298.76		3,655,348.89
其他权益工具投资公允价值变动	391,620.59	-110,156,561.87	-27,539,140.47		-23,213,991.88	-82,617,421.40	-82,617,421.40		-59,011,808.93
二、将重分类进损益的其他综合收益	4,829,025.60	-10,509,218.69	5,746,130.04	46,221.44		-16,301,570.17	-14,485,782.89	-1,815,787.28	-9,656,757.29
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-425,655.27	-4,146,639.61				-4,146,639.61	-4,146,639.61		-4,572,294.88
其他债权投资公允价值变动	518,797.71	8,325,019.05	5,941,110.03	46,221.44		2,337,687.58	2,337,687.58		2,856,485.29
其他债权投资信用损失准备	32,244,709.67	9,250,937.87	-194,979.99			9,445,917.86	9,445,917.86		41,690,627.53
外币财务报表折算差额	-27,508,826.51	-23,938,536.00				-23,938,536.00	-22,122,748.72	-1,815,787.28	-49,631,575.23
其他综合收益合计	10,214,293.84	-122,004,079.32	-21,793,010.43	46,221.44	-23,213,991.88	-100,257,290.33	-98,441,503.05	-1,815,787.28	-65,013,217.33

计									
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	11,361,816.32	-238,850,717.52	-60,221,028.23		-10,791,811.41	-178,629,689.29	-178,629,689.29		-156,476,061.56
权益法下不能转损益的其他综合收益	1,236,628.23	2,033,395.29				2,033,395.29	2,033,395.29		3,270,023.52
其他权益工具投资公允价值变动	10,125,188.09	-240,884,112.81	-60,221,028.23		-10,791,811.41	-180,663,084.58	-180,663,084.58		-159,746,085.08
二、将重分类进损益的其他综合收益	114,115,589.92	-2,247,860.59	-4,781,415.31	6,080,603.82		-3,547,049.10	-2,353,647.33	-1,193,401.77	111,761,942.59
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	-383,033.33	138,672.28				138,672.28	138,672.28		-244,361.05
其他债权投资公允价值变动	53,169,198.65	-10,133,955.42	121,543.96	-11,291,238.36		1,035,738.98	1,035,738.98		54,204,937.63
其他债权投资信用损失准备	19,145,512.42	-2,239,994.92	-4,902,959.27	17,371,842.18		-14,708,877.83	-14,708,877.83		4,436,634.59
外币财务报表折算差额	42,183,912.18	9,987,417.47				9,987,417.47	11,180,819.24	-1,193,401.77	53,364,731.42
其他综合收益合计	125,477,406.24	-241,098,578.11	-65,002,443.54	6,080,603.82	-10,791,811.41	-182,176,738.39	-180,983,336.62	-1,193,401.77	-44,714,118.97

41、 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	999,241,215.48			999,241,215.48
合计	999,241,215.48			999,241,215.48

42、 一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	本期减少	期末余额
一般风险准备	1,365,234,751.91	6,480,019.40		1,371,714,771.31
交易风险准备	1,114,074,688.18			1,114,074,688.18
合计	2,479,309,440.09	6,480,019.40		2,485,789,459.49

43、 未分配利润

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上年度
调整前上期末未分配利润	3,791,110,825.14	3,081,589,047.65
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		-14,378,066.04
调整后期初未分配利润	3,791,110,825.14	3,067,210,981.61
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,336,415,624.22	1,707,245,952.72
减：提取法定盈余公积		152,394,287.62
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备	6,480,019.40	329,467,241.05
应付普通股股利	602,694,330.86	504,090,237.04
其他综合收益结转留存收益	-23,213,991.88	-2,605,656.52
期末未分配利润	4,495,138,107.22	3,791,110,825.14

44、 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	1,210,699,829.24	1,197,511,989.85
其中：拆出资金利息收入		
融资融券利息收入	610,998,646.83	407,607,257.29
存放金融同业利息收入	281,619,402.55	298,798,959.68
买入返售金融资产利息收入	163,060,137.00	320,809,384.75
其中：约定购回利息收入		70,192.55
股权质押回购利息收入	148,392,663.07	314,310,566.31
债权投资利息收入	13,274,541.19	9,571,861.99
其他债权投资利息收入	136,722,939.56	160,724,526.14

其他	5,024,162.11	
利息支出	878,722,857.00	945,958,074.51
其中：短期借款利息支出	15,778,251.67	11,188,136.40
应付短期融资款利息支出	118,388,594.38	69,827,300.65
拆入资金利息支出	30,013,596.50	65,759,858.33
其中：转融通利息支出	18,653,059.73	41,979,166.67
卖出回购金融资产款利息支出	132,243,682.83	110,618,238.49
代理买卖证券款利息支出	50,244,188.66	41,826,159.49
应付债券利息支出	527,761,583.04	635,281,961.71
其中：次级债券利息支出	165,646,431.39	262,413,811.00
租赁负债利息支出	3,726,001.80	
其他	566,958.12	11,456,419.44
利息净收入	331,976,972.24	251,553,915.34

45、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	836,578,758.39	593,188,619.54
证券经纪业务收入	1,076,066,051.39	821,178,474.64
其中：代理买卖证券业务	747,061,244.25	722,685,684.43
交易单元席位租赁	285,536,205.25	89,889,240.89
代销金融产品业务	43,468,601.89	8,603,549.32
证券经纪业务支出	239,487,293.00	227,989,855.10
其中：代理买卖证券业务	239,487,293.00	227,989,855.10
2. 期货经纪业务净收入	98,701,661.96	45,002,287.67
期货经纪业务收入	344,787,242.86	166,318,493.84
期货经纪业务支出	246,085,580.90	121,316,206.17
3. 投资银行业务净收入	400,409,655.81	449,019,598.00
投资银行业务收入	407,857,061.48	452,067,711.21
其中：证券承销业务	344,604,653.27	367,179,183.92
证券保荐业务	13,320,754.73	20,183,172.77
财务顾问业务	49,931,653.48	64,705,354.52
投资银行业务支出	7,447,405.67	3,048,113.21
其中：证券承销业务	7,447,405.67	3,048,113.21
4. 资产管理业务净收入	73,360,649.71	73,675,605.63
资产管理业务收入	74,386,442.36	77,525,525.33
资产管理业务支出	1,025,792.65	3,849,919.70
5. 基金管理业务净收入	57,400,762.96	36,715,365.11
基金管理业务收入	57,400,762.96	36,715,365.11
6. 投资咨询业务净收入	31,081,219.03	23,194,141.86
投资咨询业务收入	31,081,219.03	23,194,141.86
7. 其他手续费及佣金净收入	7,382,920.50	12,598,292.03
其他手续费及佣金收入	12,553,350.12	14,342,424.48
其他手续费及佣金支出	5,170,429.62	1,744,132.45

合计	1,504,915,628.36	1,233,393,909.84
其中：手续费及佣金收入	2,004,132,130.20	1,591,342,136.47
手续费及佣金支出	499,216,501.84	357,948,226.63

(2) 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	1,132,075.48	9,764,150.94
并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	48,799,578.00	54,941,203.58

46、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	70,329,387.11	53,476,478.90
处置长期股权投资产生的投资收益		31,125,779.99
金融工具投资收益	1,127,554,175.89	915,828,897.83
其中：持有期间取得的收益	789,710,235.50	755,753,661.35
—交易性金融工具	575,083,601.69	694,413,032.64
—其他权益工具投资	214,626,633.81	61,340,628.71
处置金融工具取得的收益	337,843,940.39	160,075,236.48
—交易性金融工具	344,316,939.02	168,591,594.14
—其他债权投资	46,221.44	6,080,603.82
—衍生金融工具	-6,519,220.07	-14,596,961.48
合计	1,197,883,563.00	1,000,431,156.72

(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	569,948,453.55	694,493,630.69
	处置取得收益	351,776,595.26	168,591,594.14
分类为以公允价值计量且其变动	持有期间收益		-80,598.05

计入当期损益的金融负债	处置取得收益	-2,324,508.10	
-------------	--------	---------------	--

对联营企业和合营企业的投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原因
苏州资产管理有限公司	60,367,187.62	33,501,975.83	被投资单位的净利润发生变动
中证信用增进股份有限公司	15,951,772.29	13,009,921.17	被投资单位的净利润发生变动
四川华体照明科技股份有限公司		2,194,254.20	被投资单位的净利润发生变动
华元恒道(上海)投资管理有限公司	-754,174.27	-59,153.57	被投资单位的净利润发生变动
东吴(苏州)金融科技有限公司	-5,300,628.46	6,944,006.46	被投资单位的净利润发生变动
苏州企业征信服务有限公司	-2,784,033.27	-2,114,525.19	被投资单位的净利润发生变动
CDG Overseas Management Co. Ltd.	2,849,263.20		被投资单位的净利润发生变动
合计	70,329,387.11	53,476,478.90	

47、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
与日常活动相关的政府补助	23,617,037.24	7,218,425.04
其中：产业扶持资金	20,554,116.31	4,468,413.80
财政国库划入款		500,000.00
专项资金	3,062,920.93	2,250,011.24
个税手续费返还	9,223,035.22	10,212,574.96
合计	32,840,072.46	17,431,000.00

48、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	312,781,571.77	411,270,921.30
交易性金融负债	-57,292,905.66	-95,518,538.42
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	-56,383,518.48	-94,725,337.31
衍生金融工具	10,494,598.04	14,145,040.33
合计	265,983,264.15	329,897,423.21

49、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
贸易收入	735,654,048.94	749,925,414.09
其他	1,822,629.49	5,472,623.39
合计	737,476,678.43	755,398,037.48

50、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
固定资产处置收益	624,485.82	111,810.00
固定资产处置损失	-84,814.87	-1,855,606.45
合计	539,670.95	-1,743,796.45

51、税金及附加

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
城市维护建设税	6,350,303.68	10,537,573.79
教育费附加	4,577,030.28	6,919,371.82
房产税	1,589,132.32	1,588,952.28
印花税	124,533.60	1,723,687.70
其他	68,764.43	508,628.89
合计	12,709,764.31	21,278,214.48

52、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
职工薪酬	1,046,936,912.28	683,958,646.37
咨询费	94,509,354.11	41,144,377.39
固定资产折旧费	39,659,154.39	33,520,583.21
业务开发费	35,784,344.81	21,881,471.84
使用权资产折旧费	30,864,409.32	
电子设备运转费	28,249,964.52	13,162,260.09
无形资产摊销费	26,211,141.48	22,477,881.51
宣传费	24,759,735.07	27,281,873.90
交易所会员年费	24,279,437.39	22,637,922.86
租赁费及物业费	20,953,335.98	61,719,794.04
邮电通讯费	13,471,111.29	12,254,545.75
投资者保护基金	12,339,979.17	10,054,225.08
交易所设施使用费	11,574,833.31	4,594,445.46

会议费	9,430,682.55	1,506,041.41
其他	107,233,426.57	85,345,709.58
合计	1,526,257,822.24	1,041,539,778.49

53、信用减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
应收款项减值损失	9,402,728.76	-706,721.00
其他应收款减值损失	136,009.84	8,976,335.54
买入返售金融资产信用风险损失	40,714,163.52	433,316,266.37
融出资金信用风险损失	8,688,771.27	990,483.70
其他债权投资信用风险损失	9,592,552.02	-2,239,994.92
合计	68,534,225.41	440,336,369.69

54、其他业务成本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
贸易成本	732,248,016.16	755,073,049.24
合计	732,248,016.16	755,073,049.24

55、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	45,773.59	16,504.85	45,773.59
其中：固定资产处置利得	45,773.59	16,504.85	45,773.59
其他	2,045,455.62	1,555,657.66	2,045,455.62
合计	2,091,229.21	1,572,162.51	2,091,229.21

56、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
公益性捐赠支出	52,000.00	13,053,060.18	52,000.00
其他	2,810,871.56	379,019.71	2,810,871.56
合计	2,862,871.56	13,432,079.89	2,862,871.56

57、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	206,666,973.00	284,176,879.54
递延所得税费用	179,297,252.93	795,400.83
合计	385,964,225.93	284,972,280.37

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	1,730,960,969.78
按法定/适用税率计算的所得税费用	432,740,242.45
子公司适用不同税率的影响	-523,048.17
调整以前期间所得税的影响	-37,493,207.97
归属于合营企业和联营企业的损益	-17,582,346.78
非应税收入的影响	-418,101.33
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	343,691.30
其他	8,896,996.43
所得税费用	385,964,225.93

58、其他综合收益

√适用 □不适用

详见附注 40

59、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
政府补助及手续费返还	32,840,072.46	17,431,000.00
其他业务收入	833,248,248.80	853,137,833.57
收益互换保证金	21,282,840.03	
三个月以上定期存款和使用受限制货币资金净变动	1,052,304.69	
收到北京金融资产交易所保证金		89,580,000.00
其他	54,509,794.65	37,098,708.07
合计	942,933,260.63	997,247,541.64

(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
存出保证金净变动	1,619,501,681.39	70,482,781.84
支付的业务及管理费	315,907,095.59	243,915,198.45

投资者保护基金	13,530,940.22	7,311,315.94
支付纳入合并范围的结构化主体其他持有人的现金净额	759,642,235.08	2,367,272,755.57
其他业务成本	735,037,243.27	372,730,648.60
支付的衍生金融产品现金净流出	253,382.99	3,789,249.73
三个月以上定期存款和使用受限制货币资金净变动	55,532,229.19	28,999,256.78
定期贷款业务净增加额	4,099,711,229.23	
其他往来变动		134,805,000.00
公益性捐赠支出	52,000.00	13,053,060.18
其他	5,403,118.60	40,249,167.66
合计	7,604,571,155.56	3,282,608,434.75

(3). 支付的其他与筹资活动有关的现金

√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
支付的配股承销费		45,000,000.00
库存股回购	351,008,476.16	
合计	351,008,476.16	45,000,000.00

60、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
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	1,344,996,743.85	1,034,209,102.01
加：其他资产减值损失		
信用减值损失	68,534,225.41	440,336,369.69
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	39,659,154.39	33,520,583.21
使用权资产摊销	30,864,409.32	
无形资产摊销	26,211,141.48	22,477,881.51
长期待摊费用摊销	6,166,985.57	4,989,078.92
处置报废固定资产、无形资产和其他长期资产的(收益)/损失	-487,088.01	1,795,955.87
公允价值变动损失(收益以“—”号填列)	-315,881,590.41	-408,184,286.14
净利息支出	515,656,950.14	546,001,010.63
投资损失(收益以“—”号填列)	-285,002,242.36	-152,023,491.42
递延所得税	179,297,252.93	795,400.83
经营性应收项目的减少(增加以	-6,623,224,078.55	2,588,008,193.91

“—”号填列)		
经营性应付项目的增加(减少以“—”号填列)	6,068,103,800.44	2,936,678,494.31
汇兑损益	18,244,231.88	-25,525,087.60
经营活动产生的现金流量净额	1,073,139,896.08	7,023,079,205.73
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	29,862,791,350.51	27,083,373,376.63
减: 现金的期初余额	27,247,045,647.76	21,305,468,663.16
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	2,615,745,702.75	5,777,904,713.47

(2) 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	29,862,791,350.51	27,247,045,647.76
其中: 库存现金	203,596.85	165,837.47
可随时用于支付的银行存款	24,728,917,662.85	23,145,752,114.69
可随时用于支付的其他货币资金	19,149,410.79	78,613,741.89
结算备付金	5,114,520,680.02	4,022,513,953.71
二、现金等价物		
三、期末现金及现金等价物余额	29,862,791,350.51	27,247,045,647.76

其他说明:

√适用 □不适用

现金及现金等价物不包含三个月以上定期存款和使用受限制的现金及现金等价物。

61、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	期初账面价值
交易性金融资产	13,260,992,660.62	10,751,527,600.11
债权投资		160,252,751.08
其他债权投资	644,898,802.70	756,545,603.00
其他权益工具投资	82,249,557.03	118,888,873.73

货币资金	350,535,937.78	295,003,709.96
融出资金	388,194,356.52	761,864,424.38
其他资产	43,908,480.00	57,372,725.15
合计	14,770,779,794.65	12,901,455,687.41

其他说明：

于 2021 年 6 月 30 日，本集团使用受限制的货币资金为人民币 350,535,937.78 元，主要是本集团纳入合并范围内的子公司计提的一般风险准备金、保证金存款以及本公司客户交易结算资金被司法机关冻结的金额（2020 年 12 月 31 日：人民币 295,003,709.96 元）。

62、外币货币性项目

(1). 外币货币性项目：

适用 不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金	-	-	
其中：美元	68,277,690.63	6.4601	441,080,709.24
港币	1,245,093,334.56	0.8321	1,036,042,163.69
新加坡元	11,086,921.95	4.8027	53,247,160.05
其他币种	-	-	2,446,017.90
结算备付金	-	-	
其中：美元	8,981,318.64	6.4601	58,020,216.54
港币	6,585,208.03	0.8321	5,479,551.60
融出资金	-	-	
其中：美元	813,468.28	6.4601	5,255,086.44
港币	353,736,404.39	0.8321	294,344,062.09
存出保证金	-	-	
其中：美元	723,548.25	6.4601	4,674,194.05
港币	43,402,931.72	0.8321	36,115,579.48
代理买卖证券款	-	-	
其中：美元	36,416,711.03	6.4601	235,255,594.94
港币	974,345,495.38	0.8321	810,752,886.71
短期借款	-	-	
其中：港币	5,569,428,962.41	0.8321	4,634,321,839.62

附注 6、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

适用 不适用

2、同一控制下企业合并

适用 不适用

3、反向购买

适用 不适用

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

5、其他原因的合并范围变动

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

适用 不适用

6、其他

适用 不适用

纳入合并范围的结构化主体

本集团根据企业会计准则 33 号《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》，对于本集团作为管理人或投资人，且综合评估本集团因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本集团面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并。

附注 7、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	
东吴期货有限公司	苏州	上海	商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理。	93.80		购买
东吴创业投资有限公司	苏州	昆山	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。	100.00		设立
东吴创新资本管理有限责任公司	苏州	昆山	资产管理、投资管理，投资咨询；项目投资、实业投资、股权投资；贵金属、金属材料、食用农产品、化工原料及产品（不含危险化学品）销售。	100.00		设立
东吴基金管理有限公司	上海	上海	基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理、中国证监会许可的其他业务。	70.00		购买
上海新东方优胜资产管理有限公司	上海	上海	为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。		70.00	设立
东吴并购资本管理（上海）有限公司	上海	上海	资产管理，股权投资管理，投资咨询。		100.00	设立
东吴并购股权投资基金（上海）合伙企业（有限合伙）	上海	上海	股权投资，股权投资管理，实业投资，资产管理，投资咨询		100.00	设立
上海东吴玖盈投资管理有限公司	上海	上海	投资管理及咨询，实物投资等		100.00	设立
东吴证券中新（新加坡）有限公司	新加坡	新加坡	资产管理业务及监管部门核准的其他证券业务（具体业务范围以监管部门核准为准）	75.00		设立
昆山东吴阳澄创业投资中心（有限合伙）	昆山	昆山	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。		50.50	设立
东吴证券（香港）金融控股有限公司	香港	香港	投资	100.00		设立
东吴（香港）投资有限公司	香港	香港	投资		100.00	设立
东吴国际资本有限责任公司	开曼群	开曼群岛	投资		100.00	设立

	岛					
东吴中新资产管理（亚洲）有限公司	新加坡	新加坡	基金管理		100.00	设立
东吴中新资本（亚洲）有限公司	新加坡	新加坡	企业融资及证券交易		100.00	购买
昆山高新科创投资中心（有限合伙）	昆山	昆山	创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构（以上不得从事金融、类金融业务）		20.00	设立
东吴证券（国际）金融控股有限公司	香港	香港	除持有子公司股份以外，不从事其他经营性活动，不向其子公司以外的第三人提供融资和担保		100.00	购买
东吴证券国际经纪有限公司	香港	香港	证券经纪		100.00	购买
东吴证券国际融资有限公司	香港	香港	投资银行		100.00	购买
东吴证券国际资产管理有限公司	香港	香港	资产管理		100.00	购买
东吴证券国际资本有限公司	香港	香港	创业投资		100.00	购买
东吴证券国际期货有限公司	香港	香港	期货交易		100.00	购买
东吴证券国际研究有限公司	香港	香港	证券研究咨询		100.00	购买
东吴证券国际期货研究有限公司	香港	香港	期货研究咨询		100.00	购买
东吴证券国际外汇有限公司	香港	香港	外汇交易		100.00	购买

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

截至 2021 年 6 月 30 日，本公司间接持有昆山高新科创投资中心（有限合伙）20.00%的股权比例。根据昆山高新科创投资中心（有限合伙）的合伙协议，本公司的全资子公司东吴创业投资有限公司作为唯一的执行事务合伙人，可以控制合伙企业的投资决策。因此，公司管理层认为公司对昆山高新科创投资中心（有限合伙）具有实际控制，故将其认定为子公司。

(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
东吴期货有限公司	6.20	1,982,397.57		60,418,764.80
东吴证券中新(新加坡)有限公司	25.00	1,634,525.52		67,111,923.18
东吴基金管理有限公司	30.00	4,945,013.12		102,322,504.67

(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		上年末余额	
	资产合计	负债合计	资产合计	负债合计
东吴期货有限公司	9,980,170,772.11	9,005,674,565.69	7,359,574,329.04	6,417,052,276.94
东吴证券中新(新加坡)有限公司	278,190,932.64	9,743,239.94	366,361,907.67	97,189,167.93
东吴基金管理有限公司	475,896,985.02	146,707,261.25	428,781,146.03	114,347,484.55

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
东吴期货有限	914,516,472.37	31,974,154.32	31,974,154.32	747,332,151.30	855,041,749.36	24,022,667.77	24,022,667.77	-75,043,871.51

公司								
东吴证券中新 (新加坡)有限公司	15,202,335.42	6,538,102.09	-725,047.04	5,113,415.47	17,484,605.29	7,820,835.07	3,047,227.99	-19,204,104.52
东吴基金管理有限公司	112,356,278.69	14,756,062.28	14,756,062.28	6,599,277.39	89,290,243.53	5,875,674.88	5,875,674.88	-3,010,580.76

2、在合营企业或联营企业中的权益

√适用 □不适用

(1). 重要的合营企业或联营企业

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
东吴(苏州)金融科技有限公司	苏州	苏州	网络技术服务		32.00	权益法
苏州资产管理有限公司	苏州	苏州	不良资产管理	8.00	12.00	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		上年末余额/ 上期发生额	
	东吴(苏州)金融科技有限公司	苏州资产管理有限公司	东吴(苏州)金融科技有限公司	苏州资产管理有限公司
资产合计	1,038,622,131.10	24,609,114,975.51	1,179,290,330.23	19,533,403,322.11
负债合计	307,112,472.88	17,060,352,794.66	431,216,208.06	14,029,158,205.68
归属于母公司股东权益	731,509,658.22	6,477,026,177.17	748,074,122.17	4,470,646,421.17
按持股比例计算的净资产份额	234,083,090.63	1,295,405,235.43	239,383,719.09	894,129,284.23
对联营企业权益投资的账面价值	234,083,090.63	1,295,405,235.43	239,383,719.09	894,129,284.23
营业收入	5,853,493.84	938,159,542.73	18,695,966.98	517,183,638.97
净利润	-16,564,463.94	301,835,938.10	21,700,020.19	167,509,879.17
其他综合收益		-20,456,182.10		353,760.28
综合收益总额	-16,564,463.94	281,379,756.00	21,700,020.19	167,863,639.45

(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	405,439,118.63	404,665,925.17
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	15,262,827.95	13,030,496.61
--其他综合收益	-1,741,715.38	2,718,427.33
--综合收益总额	13,521,112.57	15,748,923.94

3、在纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本集团合并的结构化主体主要是指本集团作为管理人或投资者的资产管理计划。本集团综合评估因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬是否将使本集团面临可变回报的影响重大，并据此判断本集团是否为资产管理计划的主要责任人。

本年纳入本集团合并报表范围的结构化产品共 22 个（其中有 3 个产品已于 2021 上半年度清算）。于 2021 年 6 月 30 日，合并资产管理计划的总资产为人民币 4,663,258,860.06 元。

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

本集团作为结构化主体的管理者，在报告期间对资产管理计划及合伙企业拥有管理权。除已于附注 7、3 所述本集团已合并的结构化主体外，本集团在结构化主体中因持有份额而享有的可变回报并不重大，因此并未合并该等结构化主体。

合并资产负债表中上述投资的账面金额等同由本集团发行未纳入合并范围但持有权益的结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情列示如下：

项目	2021 年 6 月 30 日	
	账面价值	最大风险敞口
交易性金融资产	1,137,812,683.70	1,137,812,683.70
合计	1,137,812,683.70	1,137,812,683.70

本年度本集团从由本集团发起设立但未有自有资金投入且未纳入合并财务报表范围的结构化主体中获取的管理费收入及业绩报酬为人民币 97,984,721.55 元。

本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益，这些结构化主体未纳入本集团的合并财务报表范围，主要包括资产管理计划、信托计划、基金、合伙企业和其他理财产品等。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赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本集团因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情列示如下：

项目	账面价值	最大风险敞口
交易性金融资产	9,184,799,717.03	9,184,799,717.03
合计	9,184,799,717.03	9,184,799,717.03

附注 8、风险管理

√适用 □不适用

1、风险管理政策及组织架构

风险管理政策

为增强集团核心竞争力，保障集团持续、健康、稳定发展，本集团注重对风险的防范与控制，严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，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，以保证各类风险可测、可控和可承受，保障集团稳健经营和各项业务创新发展。

董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。

风险管理组织架构

本公司建立由董事会及其风险控制委员会、公司经营管理层及其风险管理委员会、风险管理职能部门、各部门及分支机构组成的四层级全面风险管理组织架构。

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责对公司风险管理进行监督与指导，将公司总体风险控制在合理的范围内，以确保公司能够对经营活动中的风险控制实施有效的管理。董事会设立的风险控制委员会按照本公司章程和工作细则的相关规定，可在董事会授权范围内履行和协助董事会履行风险管理职责。

经营管理层负责管理公司经营过程中的各类风险，推动公司全面风险管理体系的规划、建设与执行。公司经营管理层下设风险管理委员会，在经营管理层授权范围内开展公司风险管理工作。

本公司设首席风险官，负责公司全面风险管理工作。风险管理职能部门在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。

各业务部门、分支机构在日常工作中应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

本公司各子公司根据所在地法律法规和监管要求，按照公司管理政策和要求，有效开展风险管理工作，并纳入证券公司全面风险管理。子公司董事长和总经理承担子公司风险管理直接责任。

2、公司面临的主要风险及应对措施

在日常管理中，本集团面临的主要风险包括：流动性风险、信用风险、市场风险和操作风险。本集团通过明确风险管理的各个环节和实施内容，采用目标设定、事件识别、风险评估、风险应对、控制活动、信息沟通与报告等的全面风险管理基本工作方法，科学有效地开展集团的风险管理工作。

流动性风险管理

流动性风险是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。

主要包括两个方面：一是资产的流动性风险，是指由于资产不能及时变现或变现成本过高，导致自营投资及客户资产造成损失的风险；二是负债的流动性风险，是指公司缺乏现金不能按时支付债务或正常营业支出的风险。

本集团已建立并健全了资金业务的风险评估和监测制度，重点做好自有资金的合理安排，严格控制资金流动性风险，使各项资金比例严格控制在公司可承受风险范围之内。在资金需求方面，主要体现为日常运营资金需求、自营证券投资、信用业务用资需求、固定资产采购与对外投资等，报告期内集团密切关注市场变化，动态调整资产配置，合理控制各品种证券的投资规模和持仓集中度，剩余期限分布合理，流动性风险不大。同时，公司的融资渠道主要有公司债券、短期融资券、质押回购、拆入资金等，能够满足公司日常运营所需资金以及资本密集型业务快速增长所需要的资金，因此有能力支付可预见的到期债务或承诺。在流动性日常管理和风控指标监测方面，公司每日编制资金头寸表、汇总短期资金预约表、进行日间资金盯市、完成自营业务交收工作；按月计算和报送流动性覆盖率、净稳定资金率；编制公司现金流预测表，关注资金缺口并进行资金预警；定期分析公司资金使用状况，流动比率、资产错配比率等指标；对流动性覆盖率、净稳定资金率动态监测并定期开展流动性风险的监测分析、压力测试和情景分析，监测流动性风险限额执行情况。

随着未来集团业务的快速发展，将对流动性提出更高要求。为满足上述情况带来的挑战，集团将不断完善流动性管理的制度建设、风险防范机制，在监管允许范围之内，努力拓宽融资渠道，合理安排负债结构，努力保持较强的偿债能力，积极提高各项业务的盈利水平和可持续发展能力。

于资产负债表日，本集团各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

项目	2021 年 6 月 30 日							合计
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	
短期借款		4,593,343,850.63	343,241.25	42,634,723.75				4,636,321,815.63
应付短期融资款		3,448,024,631.24	4,296,659,136.56	158,918,631.51				7,903,602,399.31
拆入资金			2,014,311,111.11					2,014,311,111.11
交易性金融负债		60,158,854.67	852,848,684.25	360,001,107.22				1,273,008,646.14
衍生金融负债		2,314,001.39	236,791.60		2,004,400.00			4,555,192.99
卖出回购金融资产款		11,452,519,678.41						11,452,519,678.41
代理买卖证券款	29,459,276,127.09							29,459,276,127.09
应付票据			30,000,000.00	242,570,000.00				272,570,000.00
应付款项	948,332,192.00	43,908,480.00						992,240,672.00
租赁负债		6,151,002.85	9,955,278.77	55,790,136.71	166,913,173.74	6,252,374.09		245,061,966.16
应付债券			2,846,880,000.00	11,080,130,000.00	10,473,680,000.00			24,400,690,000.00
其他负债	843,935,117.80	514,542,740.27						1,358,477,858.07
合计	31,251,543,436.89	20,120,963,239.46	10,051,234,243.54	11,940,044,599.19	10,642,597,573.74	6,252,374.09		84,012,635,466.91

项目	2020 年 12 月 31 日							合计
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	无期限	
短期借款		1,028,549,703.80	347,160.00	43,121,480.00				1,072,018,343.80
应付短期融资款		99,387,466.88	6,135,759,554.23	2,223,408,539.38				8,458,555,560.49
交易性金融负债		34,121,122.97	1,858,043,806.69	96,382,508.98				1,988,547,438.64
衍生金融负债		246,412.35	134,126.00	74,832.50	3,080,150.00			3,535,520.85
卖出回购金融资产款		9,971,008,759.55	759,920,342.47					10,730,929,102.02

代理买卖证券款	25,197,694,220.26						25,197,694,220.26
应付票据			78,570,000.00	98,600,000.00			177,170,000.00
应付款项	351,362,913.26	53,639,560.00					405,002,473.26
应付债券		4,756,500,000.00	244,561,573.50	7,055,357,336.00	16,054,810,000.00		28,111,228,909.50
其他负债	166,589,586.24	402,109,751.45		96,561,878.53			665,261,216.22
合计	25,715,646,719.76	16,345,562,777.00	9,077,336,562.89	9,613,506,575.39	16,057,890,150.00		76,809,942,785.04

信用风险管理

信用风险是指本集团客户（或交易对手）未能履行合同所规定的义务，或信用质量发生变化影响金融工具价值，从而给本集团带来损失的风险。

本集团的货币资金主要存放在国有商业银行或资产充足率符合规定的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

报告期内，本集团面临的信用风险主要体现在债券投资、融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易、合同履行等方面。具体表现为：一是投资对象的违约或评级下降；二是交易对手的违约。

为控制信用风险，本集团以债券发行人主体信用状况与债项增信措施的综合分析为基础，建立债券信用评级体系，对重点持仓债券进行调研，严控所投债券的品质，密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，研究完善证券池、交易对手库，以实现规避债券违约风险的目标。本集团自营债券投资业务主要投资品种为国债、短期融资券、中期票据、公司债及企业债等。本集团对自营债券投资注重分散投资，对债券等非权益类证券持有量严格控制在集团及监管机构规定的范围内，并密切跟踪投资债项、主体的经营情况和信用评级变化，投资标的信用风险控制良好。另外，本集团在银行间市场开展债券交易时始终坚持按规定选择使用合适的结算方式，并采用 DVP 结算控制交易对手结算违约而产生的信用风险。本集团对债券投资采用违约概率/违约损失率方法，按照单项资产或资产组合，以映射外部评级主标尺方法估计的违约概率、历史违约损失率等风险参数为基础，经前瞻性调整得到各风险参数来计量预期信用损失。

在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务方面，为防范此类业务客户的信用风险，公司设置风险控制指标和预警阈值，强化内控机制，建立逐日盯市制度，对交易进行实时监控、主动预警，公司通过客户资信审核、授信审核、客户账户监控、及时提示交易规则等措施，严格控制融资融券业务的各个风险因素。针对股票质押式回购交易业务，公司设计了业务准入标准，还专门建立了严格的尽职调查、项目审核、规模与集中度控制、盯市、项目跟踪和平仓等制度，从业务开展的各阶段严格控制风险。本集团对融资类业务（含融出资金、约定购回、股票质押式回购等）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、银行间或交易所拆出资金、逆回购）等，按信用风险特征的相似性和相关性进行分组，根据历史损失经验、目前经济状况、预计组合中已经存在的损失等计量预期信用损失。

本集团对符合准则规定条件且适用本集团已做出相应会计政策选择的应收款项采用简化模型计量预期信用损失。本集团选择运用简化模型计量预期信用损失时，不再区分信用风险是否显著增加，而是始终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。

除上述采用简化模型以外的金融资产，本集团采用一般模型计量预期信用损失准备。本集团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：

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，本集团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；

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，本集团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；

第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，本集团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。

同时，考虑以下情况：

(1) 因融资融券、约定购回交易业务、股票质押式回购交易业务根据合同约定经强制平仓形成的应收款项由于信用风险较高，按照预期回收情况计算预期信用损失；

(2) 因证券清算形成的应收款项、本集团担任管理人或托管人的应收管理费和托管费、业绩报酬、席位佣金等由于信用风险极低，可考虑不计提减值准备；

(3) 已发生信用风险或金额重大的金融资产单独进行减值测试，通过预估其未来现金流量现值或预估其坏账损失率计提减值准备。

对于购买或源生时已发生信用减值的金融工具，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。

信用风险较低的标准

如果金融工具于资产负债表日的信用风险较低，即认为该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其支付合同现金流量义务的能力很强，即使较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化，也不一定会降低借款人履行其支付合同现金流量业务的能力，那么该金融工具具有较低的信用风险。

信用风险显著增加的判断标准

本集团在每个资产负债表日，评估信用风险自初始确认后是否显著增加。在评估信用风险是否显著增加时，本集团考虑事项包括但不限于：

- (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。

如果合同付款逾期超过（含）30日，则通常可以推定金融资产的信用风险显著增加，除非本集团以合理成本即可获得合理且有依据的信息，证明即使逾期超过30日，信用风险仍未显著增加。

已发生信用减值的认定

当本集团对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，则该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括但不限于下列可观察信息：

- (1) 发行方或债务人发生重大财务困难；
- (2) 债务人违反合同；
- (3) 公司出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- (4) 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- (5) 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；
- (6) 以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实。

如果一项金融工具逾期超过（含）90 日，则本集团推定该金融工具已发生违约，除非有合理且有依据的信息，表明以更长的逾期时间作为违约标准更为恰当。

股票质押业务三阶段划分标准

对于股票质押式回购业务，本集团充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券所属板块、流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况、发行人经营情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的平仓线（一般不低于 130%）。

(1) 履约保障比例大于等于平仓线，且本金或利息的逾期天数小于 30 天（不含）的股票质押式回购业务，应确认为第一阶段；

(2) 履约保障比例在 100%（含）至平仓线之间，或本金或利息的逾期天数大于 30 天（含）小于 90 天（不含），或质押标的股票出现司法冻结、特别处理（ST）、司法诉讼等异常现象的股票质押式回购业务，应确认为第二阶段；

(3) 履约保障比例小于 100%（不含），或本金或利息的逾期天数大于 90 天（含），或其他表明已发生信用减值的股票质押式回购业务，应确认为第三阶段。

预期信用损失计量的参数（一般模型）

根据信用风险是否发生显著增加以及是否已发生信用减值，本集团对不同的资产分别以 12 个月或整个存续期的预期信用损失计量减值准备。预期信用损失计量的关键参数包括违约概率、违约损失率和违约风险敞口。本集团考虑历史统计数据（如交易对手评级、担保方式及抵质押物类别、还款方式等）的定量分析及前瞻性信息，建立违约概率、违约损失率及违约风险敞口模型。

- 违约概率是指债务人在未来 12 个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。本集团基于历史违约数据、内部及外部评级信息、前瞻性信息等因素估计违约概率；

- 违约损失率是指本集团对违约风险暴露发生损失程度作出的预期。根据交易对手的类型、追索的方式和优先级，以及担保品的不同，违约损失率也有所不同。违约损失率以违约发生时风险敞口损失的百分比表示；

- 违约风险敞口是指在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本集团应被偿付的金额；

- 前瞻性信息，信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。本集团通过进行历史数据分析，识别出影响各业务类型信用风险及预期信用损失的关键经济指标，定期根据经济指标预测以及专家评估，确定前瞻性信息对违约概率等参数的影响。

股票质押业务预期信用损失计量（一般模型）

本集团基于可获取的内外部信息，如：历史违约数据、履约保障比例、担保物变现能力等因素，定期对融资人进行风险评估。本期末各阶段减值损失率区间如下：

第一阶段：根据不同的履约保障比例，减值损失率一般为 0.1%-1.0%；

第二阶段：根据不同的履约保障比例，减值损失率为 1%；

第三阶段：综合考虑质押物总估值、履约保障比例、融资人信用状况及还款能力、其他担保资产价值情况、第三方提供连带担保等定性与定量指标，逐项评估每笔业务的可收回金额，确定减值准备金额。

下表列示了本集团资产负债表项目的最大信用风险敞口。该最大敞口为考虑担保或其他信用增级方法影响前的金额。

项目	本期末	上年末
货币资金	25,131,549,419.84	23,550,457,236.29
结算备付金	5,114,748,490.30	4,022,703,604.97
融出资金	19,867,292,670.77	18,049,801,302.82
衍生金融资产	6,607,721.44	7,949,263.29
买入返售金融资产	5,842,907,256.80	7,018,448,234.30
应收款项	4,239,008,450.20	376,891,916.23
存出保证金	4,745,059,736.24	3,125,558,058.04
交易性金融资产	22,222,635,070.73	22,589,218,628.21
债权投资	93,037,236.34	224,095,373.07
其他债权投资	5,388,695,509.97	6,264,932,127.78
其他	96,604,882.41	142,056,147.43
最大信用风险敞口	92,748,146,445.04	85,372,111,892.43

市场风险管理

市场风险是指利率、汇率以及其他市场因素变动而引起金融工具的价值变化，进而对未来收益或者未来现金流量可能造成潜在损失的风险。影响本集团业务的市场风险主要包括市场价格风险和利率风险。

其他价格风险

其他价格风险，是指汇率风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险，无论这些变动是由与单项金融工具或其发行方有关的因素引起的，还是由与市场内交易的所有类似金融工具有关的因素引起的。其他价格风险可源于商品价格、股票市场指数、权益工具价格以及其他风险变量的变化。

下表说明了，在所有其他变量保持不变，本集团的净损益和其他综合收益的税后净额对股票及股权投资、基金投资、理财产品、券商资管产品、衍生金融工具等的公允价值的每 10% 的变动（以资产负债表日的账面价值为基础）的敏感性。

2021 年 1-6 月	金融工具公允价值增加 /(减少)	净损益增加/(减少)	其他综合收益的税后净额增加/(减少)	股东权益合计增加 /(减少)
金融工具	10.00%	911,092,146.91	176,485,190.67	1,087,577,337.58
金融工具	-10.00%	-911,092,146.91	-176,485,190.67	-1,087,577,337.58

2020 年 1-6 月	金融工具公允价值增加 /(减少)	净损益增加/(减少)	其他综合收益的税后净额增加/(减少)	股东权益合计增加 /(减少)
金融工具	10.00%	676,223,069.56	346,851,600.83	1,023,074,670.39
金融工具	-10.00%	-676,223,069.56	-346,851,600.83	-1,023,074,670.39

利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集团持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、融出资金、存出保证金、债券投资与买入返售金融资产等，利率敏感性负债主要为短期借款、应付短期融资券、拆入资金、代理买卖证券款、卖出回购金融资产款、应付债券等。

本集团通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法来衡量上述持有资产的利率风险。

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。

表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

金融资产	2021 年 6 月 30 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	24,883,909,368.10	111,000,000.00	105,000,000.00	14,408,100.00		17,435,548.59	25,131,753,016.69
结算备付金	5,114,520,680.02					227,810.28	5,114,748,490.30
融出资金	3,171,906,074.30	4,207,347,681.15	12,286,417,377.18			201,621,538.14	19,867,292,670.77
衍生金融资产						6,607,721.44	6,607,721.44
买入返售金融资产	4,318,267,400.00		1,511,921,917.11			12,717,939.69	5,842,907,256.80
应收款项						4,239,008,450.20	4,239,008,450.20
存出保证金	947,912,907.57					3,797,146,828.67	4,745,059,736.24
交易性金融资产	146,362,030.15	37,784,497.39	4,882,553,523.80	14,988,499,880.24	1,495,371,478.15	13,224,159,196.88	34,774,730,606.61
债权投资				90,539,363.75		2,497,872.59	93,037,236.34
其他债权投资	18,079,952.56		130,355,541.17	4,548,453,455.90	536,332,196.22	155,474,364.12	5,388,695,509.97
其他权益工具投资						2,353,135,875.60	2,353,135,875.60
其他资产						96,604,882.41	96,604,882.41
合计	38,600,958,412.70	4,356,132,178.54	18,916,248,359.26	19,641,900,799.89	2,031,703,674.37	24,106,638,028.61	107,653,581,453.37

金融负债	2021 年 6 月 30 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
短期借款	4,592,380,203.24		41,605,000.00			336,636.38	4,634,321,839.62
拆入资金		2,000,000,000.00				2,022,222.22	2,002,022,222.22
应付短期融资款	3,428,473,000.00	4,272,126,000.00	154,875,000.00			23,707,790.53	7,879,181,790.53
交易性金融负债	13,907,189.69	845,409,084.31				409,634,408.54	1,268,950,682.54
衍生金融负债						4,555,192.99	4,555,192.99
卖出回购金融资产款	11,443,233,000.00					3,921,292.46	11,447,154,292.46
代理买卖证券款	29,457,603,417.30					1,672,709.79	29,459,276,127.09
应付票据						272,570,000.00	272,570,000.00
应付款项						992,240,672.00	992,240,672.00

租赁负债			2,824,498.14	213,399,531.60	13,181,923.55		229,405,953.29
应付债券		2,598,390,334.93	10,369,393,650.54	9,877,818,420.06		388,758,191.76	23,234,360,597.29
其他负债	510,811,060.67					847,666,797.40	1,358,477,858.07
合计	49,446,407,870.90	9,715,925,419.24	10,568,698,148.68	10,091,217,951.66	13,181,923.55	2,947,085,914.07	82,782,517,228.10
净头寸	-10,845,449,458.20	-5,359,793,240.70	8,347,550,210.58	9,550,682,848.23	2,018,521,750.82	21,159,552,114.54	24,871,064,225.27

金融资产	2020 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	23,309,369,566.54	110,972,560.00	101,000,000.00	14,794,200.00		14,486,747.22	23,550,623,073.76
结算备付金	4,022,513,953.71					189,651.26	4,022,703,604.97
融出资金	2,852,889,083.17	4,575,677,055.88	10,439,271,451.06			181,963,712.71	18,049,801,302.82
衍生金融资产						7,949,263.29	7,949,263.29
买入返售金融资产	5,906,749,182.07	164,235,600.00	939,657,015.21			7,806,437.02	7,018,448,234.30
应收款项						376,891,916.23	376,891,916.23
存出保证金	563,492,780.97					2,562,065,277.07	3,125,558,058.04
交易性金融资产	241,365,812.03	1,155,764,285.76	9,645,084,715.74	10,187,041,152.89	966,803,758.71	11,919,063,032.33	34,115,122,757.46
债权投资				220,385,064.78		3,710,308.29	224,095,373.07
其他债权投资	18,105,834.13	305,481,819.45	392,874,578.82	4,865,277,607.57	531,471,135.32	151,721,152.49	6,264,932,127.78
其他权益工具投资						3,843,359,653.81	3,843,359,653.81
其他资产						142,056,147.43	142,056,147.43
合计	36,914,486,212.62	6,312,131,321.09	21,517,887,760.83	15,287,498,025.24	1,498,274,894.03	19,211,263,299.15	100,741,541,512.96

金融负债	2020 年 12 月 31 日						
	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	合计
短期借款	1,027,239,643.25		42,080,000.00			636,490.77	1,069,956,134.02
应付短期融资款	98,955,000.00	6,074,191,000.00	2,191,326,000.00			36,447,247.63	8,400,919,247.63
交易性金融负债		1,483,894,762.50	46,900,714.00			447,840,704.40	1,978,636,180.90

衍生金融负债		13,201.60				3,522,319.25	3,535,520.85
卖出回购金融资产款	9,962,746,294.76	750,000,000.00				5,165,251.08	10,717,911,545.84
代理买卖证券款	25,195,518,168.84					2,176,051.42	25,197,694,220.26
应付票据						177,170,000.00	177,170,000.00
应付款项						405,002,473.26	405,002,473.26
应付债券	4,499,529,013.85	3,911,000.00	6,379,214,100.51	15,249,899,505.60		697,199,990.17	26,829,753,610.13
其他负债	402,109,751.45		96,561,878.53			166,589,586.24	665,261,216.22
合计	41,186,097,872.15	8,312,009,964.10	8,756,082,693.04	15,249,899,505.60		1,941,750,114.22	75,445,840,149.11
净头寸	-4,271,611,659.53	-1,999,878,643.01	12,761,805,067.79	37,598,519.64	1,498,274,894.03	17,269,513,184.93	25,295,701,363.85

市场利率的波动主要影响本集团持有的以公允价值计量的生息资产的估值。假设收益率曲线平行移动 100 个基点，对本集团各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

	2021 年 6 月 30 日/2021 年 1-6 月		2020 年 6 月 30 日/2020 年 1-6 月	
	股东权益	净利润	股东权益	净利润
收益率曲线向上平移 100 个基点	-354,692,468.17	-283,670,607.16	-252,069,065.18	-210,308,230.29
收益率曲线向下平移 100 个基点	366,977,543.54	292,046,784.86	260,708,210.37	217,780,973.35

操作风险管理

操作风险是指在集团业务范畴内，由不完善或有问题的内部程序、员工和信息科技系统，以及外部事件给集团业务造成直接或间接损失的风险。

本集团操作风险管理包括操作风险的识别与评估、限额管理、操作风险监测、操作风险控制、操作风险报告、操作风险处置等流程。本集团通过业务检查、穿行测试、事件分析等方法评估公司整体与各业务的操作风险情况，并针对操作风险较大的业务及部位，以风险提示函、警示函、评估报告等方式，对相关部门进行风险预警，督促整改。

报告期内，经过内部数据的收集与分析，重新修正了操作风险的识别与评估模型；对部分存在操作风险的业务要求建立制度或优化流程进行风险控制；集团对业务授权进行调整，并根据调整的授权梳理各业务的权限管理；集团加强各类培训，提高技能和职业道德，减少操作失误；集团优化信息系统，实现部分业务系统自动化，减少人为失误与差错。

3、 资本管理

本集团资本管理的主要目标是保障本集团的持续经营，能够通过制定与风险水平相当的产品和服务价格并确保以合理融资成本获得融资的方式，持续为股东提供回报。

本集团根据经济形势以及相关资产的风险特征的变化对其进行调整。为维持或调整资本结构，本集团可以调整对股东的利润分配、向股东归还资本、发行新股、次级债或可转债等。

本集团采用净资本来管理资本。净资本是指根据证券公司的业务范围和公司资产负债的流动性特点，在净资产的基础上对资产负债等项目和有关业务进行风险调整后得出的综合性风险控制指标。

于 2020 年 1 月 23 日及 2020 年 3 月 20 日，中国证监会先后颁布了《证券公司风险控制指标计算标准规定》（2020 年修订版）及《证券公司风险控制指标管理办法》（2020 年修订版），对证券公司必须持续符合的风险控制指标体系及标准进行了修改，并要求于 2020 年 6 月 1 日起施行，本公司须就风险控制指标持续达到下列标准：

- (1) 净资本与各项风险资本准备之和的比率不得低于 100%（“比率 1”）；
- (2) 净资本与净资产的比率不得低于 20%（“比率 2”）；
- (3) 净资本与负债的比率不得低于 8%（“比率 3”）；
- (4) 净资产与负债的比率不得低于 10%（“比率 4”）；
- (5) 自营权益类证券及证券衍生品与净资本的比率不得超过 100%（“比率 5”）；

- (6) 自营非权益类证券及证券衍生品与净资本的比率不得超过 500% (“比率 6”);
 (7) 核心净资本与表内外资产总额的比率不得少于 8% (“比率 7”);
 (8) 优质流动性资产与未来 30 天现金净流出量的比率不得少于 100% (“比率 8”);
 (9) 可用稳定资金与所需稳定资金的比率不得少于 100% (“比率 9”);
 (10) 融资(含融券)的金额与净资本的比率不得超过 400% (“比率 10”)。

本公司的净资本及上述比例如下:

	标准	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
净资本		18,062,012,694.18	19,590,074,763.47
比率 1	≥100%	240.40%	245.21%
比率 2	≥20%	66.24%	71.64%
比率 3	≥8%	38.05%	41.20%
比率 4	≥10%	57.45%	57.51%
比率 5	≤100%	22.14%	29.53%
比率 6	≤500%	178.62%	162.08%
比率 7	≥8%	21.04%	21.28%
比率 8	≥100%	226.40%	261.77%
比率 9	≥100%	138.73%	156.29%
比率 10	≤400%	123.93%	107.29%

上述比例均系依据中华人民共和国企业会计准则编制的财务信息为基础计算得出。

本公司若干子公司亦须遵守分别由中国证监会及香港证券及期货事务监察委员会所颁布的中国及香港监管要求的资本规定。

附注 9、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	
一、持续的公允价值计量				
(一) 交易性金融资产	3,438,334,957.72	29,147,110,985.55	2,189,284,663.34	34,774,730,606.61
(1) 债券	890,985,838.40	20,874,151,733.27	165,291,283.76	21,930,428,855.43
(2) 基金	1,406,501,246.00	4,532,091,913.48		5,938,593,159.48
(3) 股票	1,140,847,873.32	672,677,201.78	147,746,706.66	1,961,271,781.76
(4) 其他		3,068,190,137.02	1,876,246,672.92	4,944,436,809.94
(二) 其他债权投资		5,388,695,509.97		5,388,695,509.97
(三) 其他权益工具投资	1,769,497,038.40	9,148,125.01	574,490,712.19	2,353,135,875.60

(1) 非交易性证券/非上市股权	1,769,497,038.40	9,148,125.01	574,490,712.19	2,353,135,875.60
(四) 衍生金融资产		6,607,721.44		6,607,721.44
持续以公允价值计量的资产总额	5,207,831,996.12	34,551,562,341.97	2,763,775,375.53	42,523,169,713.62
(五) 交易性金融负债		1,268,950,682.54		1,268,950,682.54
(六) 衍生金融负债	2,550,792.99		2,004,400.00	4,555,192.99
持续以公允价值计量的负债总额	2,550,792.99	1,268,950,682.54	2,004,400.00	1,273,505,875.53

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

√适用 □不适用

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

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

√适用 □不适用

对于交易性金融资产及其他债权投资中的债券投资，其公允价值是按相关债券登记结算机构估值系统报价确定的。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

对于交易性金融资产及负债、其他债权投资和其他权益工具投资中不存在公开市场的债务、权益工具投资及结构化主体等，其公允价值以估值技术确定。估值技术所需的可观察输入值包括但不限于收益率曲线、资产净值等估值参数。

对于衍生金融资产和负债，其公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日，采用类似衍生金融工具的市场利率或汇率将未来现金流折现，以验证报价的合理性。

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

√适用 □不适用

对于股票、非上市股权投资、债务工具投资及衍生金融工具，本集团从交易对手处询价或者采用估值技术来确定其公允价值，估值技术包括现金流量折现法和市场法等。其公允价值的计量采用了重要的不可观察参数，比如流动性折扣、风险调整折现率、波动率等。持续第三层次公允价值计量的金融工具对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

2021年6月30日	公允价值	估值技术	不可观察输入值	对公允价值的影响
股票/非上市股权投资	2,234,820,530.13	市场法	流动性折扣	流动性折扣越大公允价值越低
非上市股权投资	363,663,561.64	近期交易价	不适用	不适用
债务工具投资	165,291,283.76	现金流量折现法	风险调整折现率	风险调整折现率越高公允价值越低
衍生金融负债	-2,004,400.00	现金流量折现法	风险调整折现率	风险调整折现率越高公允价值越低

5、 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 债权 投资	其他权益工具投 资	衍生金融资 产	衍生金融负债
本期期初余额	1,868,550,755.55		343,898,334.58		-3,412,556.20
转入第三层次					
转出第三层次					
本期损益影响合计	133,219,612.49			590,651.58	433,820.20
本期其他综合收益影响合计			15,908,993.45		
购买	520,869,578.01		231,956,306.77	89,748.42	
发行					-3,425,609.40
出售/结算	-333,355,282.71		-17,272,922.61	-680,400.00	4,399,945.40
本期期末余额	2,189,284,663.34		574,490,712.19		-2,004,400.00
对于在报告期末持有的资产/负债，计入损益的当期未实现利得或损失的变动	23,013,666.60			-45,600.00	670,613.80

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

√适用 □不适用

对于持续的以公允价值计量的资产和负债，本集团在每个报告期末通过重新评估分类（基于对整体公允价值计量有重大影响的最低层次输入值），判断各层次之间是否存在转换。

于财务报告期间，本集团持有的按公允价值计量的金融工具在第一层次和第二层次之间无重大转换。

7、 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

本集团管理层认为，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。

附注 10、关联方及关联交易

1、 第一大股东情况

√适用 □不适用

第一大股东持股情况如下（单位：人民币万股）

关联方名称	关联方关系	期末			期初		
		持股数	持股比例	表决权比例	持股数	持股比例	表决权比例
苏州国际发展集团有限公司	股东	91,722.08	23.64%	23.64%	91,722.08	23.64%	23.64%

关联方名称	注册地	存在控制关系的期间	注册资本			
			期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
苏州国际发展集团有限公司	中国苏州	2006年起	人民币 250,000.00万元	人民币 750,000.00万元		人民币 1,000,000.00万元

受本公司第一大股东控制的其他股东所持公司股份或权益及其变化

企业名称	期末余额		期初余额	
	持股数	持股比例(%)	持股数	持股比例(%)
苏州营财投资集团公司	8,395.21 万股	2.16	8,395.21 万股	2.16
苏州信托有限公司	6,905.60 万股	1.78	6,905.60 万股	1.78

苏州国际发展集团有限公司及其控制的其他股东合计持有公司 27.58%股份。

2、 本企业的子公司情况

√适用 □不适用

本企业子公司的情况详见附注 7、1

3、 本企业合营和联营企业情况

√适用 □不适用

本企业重要的合营或联营企业详见附注 7、2

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
上海华元恒道资产管理有限公司	联营企业华元恒道（上海）投资管理有限公司的子公司
苏州元禾控股股份有限公司	本公司董事担任董事
国寿安保基金管理有限公司	本公司董事担任董事（2021年6月离任）
苏州国发创业投资控股有限公司	国发集团的子公司，本公司董事任董事、监事长
东吴人寿保险股份有限公司	本公司监事担任董事
苏州信托有限公司	国发集团的子公司，本公司董事任董事长，本公司董事任董事
弦高（苏州）资产管理有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司

苏州工业园区国有资本投资运营控股有限公司	苏州工业园区经济发展有限公司的一致行动人
昆山创业控股集团有限公司	本公司监事任总裁
苏州市融资再担保有限公司	国发集团的子公司，本公司监事任董事长
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司
信和安（苏州）商业保理有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司
东吴朴捷（北京）信息技术有限公司	联营企业东吴（苏州）金融科技有限公司的子公司
苏州资产管理有限公司	本公司董事担任董事
张家港市直属国有资产经营有限公司	本公司监事担任高管
苏州新建元控股集团有限公司	本公司董事担任董事
苏州园恒融资租赁有限公司	国发集团的子公司
苏州工业园区经济发展有限公司	本公司监事担任董事
苏州市住房置业融资担保有限公司	国发集团的子公司
昆山市国科创业投资有限公司	本公司监事任董事长
苏州国发高新创业投资管理有限公司	国发集团的子公司
苏州国发营财不动产经营管理有限公司	国发集团的子公司
苏州营财投资集团有限公司	国发集团的子公司，本公司董事任董事长
中证征信（深圳）有限公司	联营企业中证信用增进股份有限公司的子公司
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	国发集团的子公司
苏州城市发展基金管理有限公司	国发集团的子公司

5、主要关联交易

√适用 □不适用

(1) 向关联方收取的手续费及佣金收入

1) 证券经纪业务收入

单位：元 币种：人民币

企业名称	本期金额	上期金额
上海华元恒道资产管理有限公司	622,226.64	534,884.50
苏州元禾控股股份有限公司	347,642.90	165,226.00
苏州国际发展集团有限公司	244,130.26	460,769.04
苏州信托有限公司	114,095.20	56,915.93
苏州国发创业投资控股有限公司	86,202.00	169,050.85
弦高（苏州）资产管理有限公司	57,474.51	
苏州资产管理有限公司	39,599.78	
昆山创业控股集团有限公司	24,192.55	
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	1,057.52	482.99
张家港市直属国有资产经营有限公司	449.39	
东吴（苏州）金融科技有限公司	278.61	68,246.44
国寿安保基金管理有限公司		252,904.02
苏州市信用再担保有限公司		2,000.00
信和安（苏州）商业保理有限公司		53.65
合计	1,537,349.36	1,710,533.42

2) 财务顾问业务收入

单位：元 币种：人民币

企业名称	本期金额	上期金额
苏州信托有限公司	176,721.70	530,895.32
合计	176,721.70	530,895.32

3) 证券承销业务收入:

单位: 元 币种: 人民币

企业名称	本期金额	上期金额
苏州国际发展集团有限公司	8,490,566.04	8,490,566.04
张家港市直属公有资产经营有限公司	3,786,792.45	
苏州国发创业投资控股有限公司	2,830,188.68	
苏州资产管理有限公司	1,358,490.57	
苏州园恒融资租赁有限公司	1,225,316.98	
苏州新建元控股集团有限公司	666,273.58	
苏州元禾控股股份有限公司	158,490.57	566,037.73
合计	18,516,118.87	9,056,603.77

(2) 向关联方支付的利息支出

单位: 元 币种: 人民币

企业名称	本期金额	上期金额
苏州元禾控股股份有限公司	248,505.50	80,456.08
昆山创业控股集团有限公司	60,396.43	22,898.97
苏州国发创业投资控股有限公司	57,604.11	20,679.75
苏州工业园区国有资本投资运营控股有限公司	54,359.74	
弦高(苏州)资产管理有限公司	19,064.66	
张家港市直属公有资产经营有限公司	14,356.43	
苏州国际发展集团有限公司	10,085.49	82,209.55
苏州市融资再担保有限公司	5,469.27	2,556.98
苏州信托有限公司	4,719.02	1,596.24
苏州工业园区经济发展有限公司	2,247.39	3,681.56
昆山市国科创业投资有限公司	313.30	319.04
苏州资产管理有限公司	154.34	
上海华元恒道资产管理有限公司	118.74	0.53
东吴(苏州)金融科技有限公司	11.80	103.91
苏州市住房置业融资担保有限公司	3.32	3.38
苏州国发高新创业投资管理有限公司	0.93	7.19
华元恒道(上海)投资管理有限公司	0.78	0.79
信和安(苏州)商业保理有限公司		57.25
东吴在线(上海)金融信息服务有限公司		12.72
合计	477,411.25	214,583.94

(3) 向关联方支付的房屋租赁费

单位: 元 币种: 人民币

企业名称	本期金额	上期金额
------	------	------

苏州营财投资集团有限公司	1,720,960.00	
苏州国发营财不动产经营管理有限公司	1,034,760.52	743,062.00
合计	2,755,720.52	743,062.00

(4) 应收关联方房租保证金

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末金额	期初金额
昆山创业控股集团有限公司		170,000.00
合计		170,000.00

(5) 向关联方支付的软件研发及外包服务费

企业名称	本期金额	上期金额
中证征信（深圳）有限公司	1,169,811.32	
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司		8,564,393.40
东吴朴捷（北京）信息技术有限公司	2,435,643.56	
合计	3,605,454.88	8,564,393.40

(6) 购买关联方发行的保险产品

单位：元 币种：人民币

企业名称	本期金额	上期金额
东吴人寿保险股份有限公司	3,507,080.00	1,736,064.00
合计	3,507,080.00	1,736,064.00

(7) 关联方持有本集团发行的信用保护合约

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末金额	期初金额
苏州市信用再担保有限公司		200,000.00
合计		200,000.00

(8) 关联方存放在本集团的货币资金——三方存管的代理买卖证券款

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末金额	期初金额
张家港市直属公有资产经营有限公司	97,170,784.80	
苏州工业园区国有资本投资运营控股有限公司	59,423,075.80	21,664,816.06
苏州国际发展集团有限公司	23,738,051.61	
昆山创业控股集团有限公司	11,087,669.95	1,084,939.78
苏州市融资再担保有限公司	4,005,469.27	3,750,000.00
弦高（苏州）资产管理有限公司	3,173,497.35	25,525,901.33
苏州工业园区经济发展有限公司	1,271,799.33	1,269,551.94
东吴在线（上海）金融信息服务有限公司	1,151,345.23	
昆山市国科创业投资有限公司	177,292.62	176,979.32
上海华元恒道资产管理有限公司	161,575.83	69,710.02
苏州国发创业投资控股有限公司	57,604.11	1,166,292.69
苏州信托有限公司	19,699.12	19,664.31
东吴（苏州）金融科技有限公司	10,468.94	148.83
苏州元禾控股股份有限公司	6,835.32	13,352.06
苏州市住房置业融资担保有限公司	1,877.45	1,874.13

华元恒道（上海）投资管理有限公司	442.40	441.62
苏州资产管理有限公司	154.34	
苏州国发高新创业投资管理有限公司	0.93	3,986.14
苏州吴中国发创业投资管理有限公司	0.05	0.05
合计	201,457,644.45	54,747,658.28

(9) 关联方持有由本集团作为管理人募集设立的集合资产管理计划份额

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末份额	期初份额
苏州资产管理有限公司	94,470,715.36	94,470,715.36
苏州市住房置业担保有限公司	26,000,000.00	26,000,000.00
苏州营财投资集团有限公司	20,000,000.00	20,000,000.00
苏州市融资再担保有限公司	20,000,000.00	20,000,000.00
东吴（苏州）金融科技有限公司	100,000.00	100,000.00
合计	160,570,715.36	160,570,715.36

(10) 关联方持有由本集团作为管理人募集设立的定向资产管理计划份额

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末份额	期初份额
苏州信托有限公司	2,180,000,000.00	2,180,000,000.00
苏州国际发展集团有限公司	117,281,722.80	117,281,722.80
昆山创业控股集团有限公司	22,614,400.00	22,614,400.00
苏州市住房置业融资担保有限公司	50,000,000.00	50,000,000.00
合计	2,369,896,122.80	2,369,896,122.80

(11) 本集团持有由关联方作为管理人募集设立的信托计划净值

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末净值	期初净值
苏州信托有限公司	929,580,000.00	1,089,580,000.00
合计	929,580,000.00	1,089,580,000.00

(12) 本集团持有由关联方作为管理人募集设立的基金净值

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末净值	期初净值
弦高（苏州）资产管理有限公司		4,215,000.00
合计		4,215,000.00

(13) 关联方持有由本集团作为管理人募集设立的基金份额

单位：元 币种：人民币

企业名称	期末份额	期初份额
苏州资产管理有限公司	1,640,267,519.00	273,304,864.00
苏州国际发展集团有限公司	1,108,780,400.00	379,012,160.00
苏州信托有限公司	848,780,400.00	
苏州工业园区经济发展有限公司	350,000,000.00	
合计	3,947,828,319.00	652,317,024.00

(14) 关键管理人员报酬

单位：元 币种：人民币

本期金额	上期金额
6,502,877.00	6,019,501.00

根据中国证监会 2012 年下发的《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》（第 88 号令）及公司章程，本公司高级管理人员包括总裁、副总裁、财务负责人、董事会秘书、合规总监、首席风险官等。

本公司 2021 上半年度高级管理人员任职期间从本公司获得的税前报酬总额为人民币 6,502,877.00 元（2020 上半年度：人民币 6,019,501.00 元）。

附注 11、重大或有事项

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本集团不存在重大或有事项

附注 12、承诺事项

√适用 □不适用

资本承诺事项

项目	期末	期初
已签约但未拨付	45,231,998,646.08	28,845,213,363.26
合计	45,231,998,646.08	28,845,213,363.26

附注 13、资产负债表日后事项

√适用 □不适用

本期无重大资产负债表日后事项

附注 14、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

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，在经营分部的基础上本集团确定了经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务、公司总部及其他等 6 个报告分部。分部信息相关的会计政策参见附注 3、33。

本集团各个报告分部提供的主要服务分别如下：

(1) 经纪及财富管理业务分部从事于代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，同时也提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。

(2) 投资银行业务分部向客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板挂牌、ABS 发行、并购重组等。

(3) 投资与交易业务分部以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券（含非上市股权）、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。

(4) 资管及基金管理业务分部提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。

(5) 信用交易业务分部包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务。

(6) 公司总部及其他分部系总部运营及除上述主营业务外的其他业务。

(2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

2021 年 6 月 30 日报告分部的财务信息

单位：元 币种：人民币

项目	经纪及财富管理业务	投资银行业务	投资与交易业务	资管及基金管理业务	信用交易业务	公司总部及其他	合并抵销	合计
一、营业收入	1,145,069,653.70	398,942,931.31	1,758,293,870.15	261,306,710.45	503,268,103.62	6,638,070.46	-2,036,899.44	4,071,482,440.25
其中：手续费及佣金净收入	955,234,003.04	398,942,931.31	12,527,162.56	137,343,623.28	1,191,950.47		-324,042.30	1,504,915,628.36
投资收益			1,167,928,172.02	29,955,390.98				1,197,883,563.00
其他收入（含公允价值变动）	189,835,650.66		577,838,535.57	94,007,696.19	502,076,153.15	6,638,070.46	-1,712,857.14	1,368,683,248.89
二、营业支出	661,615,140.57	241,129,401.61	837,375,582.09	151,669,170.72	166,011,242.42	283,986,190.15	-2,036,899.44	2,339,749,828.12
三、营业利润（亏损）	483,454,513.13	157,813,529.70	920,918,288.06	109,637,539.73	337,256,861.20	-277,348,119.69		1,731,732,612.13
四、利润总额	481,515,490.72	157,639,345.56	922,038,448.27	109,862,984.61	337,256,861.20	-277,352,160.58		1,730,960,969.78
五、资产总额	31,023,682,289.59	43,010,691.19	57,051,233,321.58	2,634,756,694.22	26,229,422,187.77	4,233,700,812.61	-8,384,272,195.11	112,831,533,801.85
六、负债总额	30,181,573,643.53	108,462,932.08	33,469,749,567.02	2,412,928,762.42	17,234,750,207.02	1,571,207,712.51	-649,248,548.50	84,329,424,276.08
七、补充信息								
1. 折旧与摊销费用	36,135,287.80	2,679,990.61	15,249,381.28	12,390,769.51	61,910.34	36,384,351.22		102,901,690.76
2. 资本性支出	5,864,338.89	699,003.45	356,678.17	4,595,602.87		77,090,451.54		88,606,074.92
3. 信用减值损失	33,769.41	103,791.89	9,622,074.13	-30,708,389.29	88,860,080.69	622,898.58		68,534,225.41
4. 其他资产减值损失								

2020 年 6 月 30 日报告分部的财务信息

项目	经纪及财富管	投资银行业	投资与交易业	资管及基金管	信用交易业务	公司总部及	合并抵销	合计
----	--------	-------	--------	--------	--------	-------	------	----

	理业务	务	务	理业务		其他		
一、营业收入	822,579,325.55	449,019,598.00	1,717,571,364.55	192,085,339.52	398,315,485.64	9,142,248.65	555,349.75	3,589,268,711.66
其中：手续费及佣金净收入	652,087,471.44	449,019,598.00	13,998,506.29	117,914,102.93	666,208.25		-291,977.07	1,233,393,909.84
投资收益			848,358,757.65	152,070,568.37			1,830.70	1,000,431,156.72
其他收入(含公允价值变动)	170,491,854.11		855,214,100.61	-77,899,331.78	397,649,277.39	9,142,248.65	845,496.12	1,355,443,645.10
二、营业支出	491,422,230.98	242,067,348.31	838,461,770.73	226,087,668.16	406,171,992.04	54,306,548.05	-290,146.37	2,258,227,411.90
三、营业利润(亏损)	331,157,094.57	206,952,249.69	879,109,593.82	-34,002,328.64	-7,856,506.40	-45,164,299.40	845,496.12	1,331,041,299.76
四、利润总额	328,427,137.64	210,009,475.64	879,102,359.05	-32,355,013.13	-7,901,757.93	-58,100,818.89		1,319,181,382.38
五、资产总额	25,591,220,192.75	35,336,372.91	53,688,043,965.14	5,774,780,908.11	17,860,219,431.63	3,926,855,715.02	-6,861,285,159.91	100,015,171,425.65
六、负债总额	24,866,327,520.49	142,099,261.68	30,349,506,480.55	5,113,462,819.13	11,594,597,182.29	608,314,571.59	-112,993,568.79	72,561,314,266.94
七、补充信息								
1. 折旧与摊销费用	33,016,306.76	917,800.90	2,787,289.08	5,396,863.56	42,276.62	18,827,006.72		60,987,543.64
2. 资本性支出	30,561,003.52	103,414.03	8,752,372.01	3,148,691.93	3,326.55	3,566,788.44		46,135,596.48
3. 信用减值损失	6,368.98	34,032.83	-2,172,638.17	100,666,513.36	341,609,152.08	192,940.61		440,336,369.69
4. 其他资产减值损失								

2、 租赁

√适用 □不适用

作为承租人

	2021 年半年度
租赁负债利息费用	3,726,001.80
计入当期损益的采用简化处理的短期租赁费用	20,953,335.98
计入当期损益的采用简化处理的低价值资产租赁费用（短期租赁除外）	
与租赁相关的总现金流出	54,206,658.52

于 2021 年 6 月 30 日，本集团无重大未纳入租赁负债计量的未来潜在现金流出。本集团承租的租赁资产包括经营过程中使用的房屋及建筑物，租赁期通常为 1-10 年。

3、 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
1、交易性金融资产（不含衍生金融资产）	34,115,122,757.46	312,781,571.77			34,774,730,606.61
2、衍生金融工具	4,413,742.44	10,494,598.04			2,052,528.45
3、其他债权投资	6,264,932,127.78		2,856,485.29	9,592,552.02	5,388,695,509.97
4、其他权益工具投资	3,843,359,653.81		-59,011,808.93		2,353,135,875.60
5、交易性金融负债	1,978,636,180.90	-56,383,518.48			1,268,950,682.54

4、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	25,131,753,016.69					
结算备付金	5,114,748,490.30					
融出资金	19,867,292,670.77					
衍生金融资产				6,607,721.44		
买入返售金融资产	5,842,907,256.80					
应收款项	4,239,008,450.20					
存出保证金	4,745,059,736.24					
交易性金融资产				34,774,730,606.61		
债权投资	93,037,236.34					
其他债权投资		5,388,695,509.97				
其他权益工具投资			2,353,135,875.60			
其他资产	96,604,882.41					
合计	65,130,411,739.75	5,388,695,509.97	2,353,135,875.60	34,781,338,328.05		
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	指定为以公允价值计量且其变动计入	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	按照《金融	按照《套期会计》

		其他综合收益的金融资产	其他综合收益的非交易性权益工具投资	量且其变动计入当期损益的金融资产	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	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	23,550,623,073.76					
结算备付金	4,022,703,604.97					
融出资金	18,049,801,302.82					
衍生金融资产				7,949,263.29		
买入返售金融资产	7,018,448,234.30					
应收款项	376,891,916.23					
存出保证金	3,125,558,058.04					
交易性金融资产				34,115,122,757.46		
债权投资	224,095,373.07					
其他债权投资		6,264,932,127.78				
其他权益工具投资			3,843,359,653.81			
其他资产	142,056,147.43					
合计	56,510,177,710.62	6,264,932,127.78	3,843,359,653.81	34,123,072,020.75		

(2). 金融负债计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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

短期借款	4,634,321,839.62			
应付短期融资款	7,879,181,790.53			
拆入资金	2,002,022,222.22			
交易性金融负债		13,907,189.69	1,255,043,492.85	
衍生金融负债		4,555,192.99		
卖出回购金融资产款	11,447,154,292.46			
代理买卖证券款	29,459,276,127.09			
应付票据	272,570,000.00			
应付款项	992,240,672.00			
应付债券	23,234,360,597.29			
租赁负债	229,405,953.29			
其他负债	1,358,477,858.07			
合计	81,509,011,352.57	18,462,382.68	1,255,043,492.85	
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	1,069,956,134.02			
应付短期融资款	8,400,919,247.63			
交易性金融负债		46,900,714.00	1,931,735,466.90	
衍生金融负债		3,535,520.85		
卖出回购金融资产款	10,717,911,545.84			
代理买卖证券款	25,197,694,220.26			
应付票据	177,170,000.00			
应付款项	405,002,473.26			
应付债券	26,829,753,610.13			
其他负债	665,261,216.22			

合计	73,463,668,447.36	50,436,234.85	1,931,735,466.90
----	-------------------	---------------	------------------

5、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

适用 不适用

报告期内，公司董事会、股东大会审议通过了配股相关议案，公司拟配股公开发行证券，募集资金总额不超过人民币 85 亿元，用于发展资本中介业务，投资与交易业务，信息技术及风控合规投入、向全资子公司增资、偿还债务。目前公司正组织相关申报审批工作。

6、其他

适用 不适用

附注 15、母公司财务报表主要项目注释

1、应收款项

(1) 按明细列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收资产管理业务产品管理费	52,736,223.56	55,872,915.68
应收其他手续费及佣金	10,583,218.74	5,912,156.47
应收两融业务客户款	30,563,974.63	21,536,828.68
其他	5,021,816.95	3,456,128.27
合计	98,905,233.88	86,778,029.10
减：坏账准备(按一般模型计提)	30,563,974.63	21,536,828.68
减：坏账准备(按简化模型计提)	29,687,478.25	31,833,340.88
应收款项账面价值	38,653,781.00	33,407,859.54

(2) 按账龄分析

账龄	期末		期初	
	账面余额		账面余额	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	占账面余额合计比例 (%)
1 年以内	56,574,881.15	57.20	43,068,605.95	49.63
1-2 年	2,436,562.76	2.46	34,728,642.60	40.02
2-3 年	33,899,890.11	34.28	8,980,780.55	10.35
3 年以上	5,993,899.86	6.06		
合计	98,905,233.88	100.00	86,778,029.10	100.00

(3) 按计提坏账列示

项目	期末			
	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	83,300,198.08	84.22	59,552,641.51	71.49
组合计提坏账准备	15,605,035.80	15.78	698,811.37	4.48
合计	98,905,233.88	100.00	60,251,452.88	60.92

项目	期初			
	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	77,409,744.36	89.20	53,046,941.00	68.53

组合计提坏账准备	9,368,284.74	10.80	323,228.56	3.45
合计	86,778,029.10	100.00	53,370,169.56	61.50

(4) 应收账款账面净额前五名

于 2021 年 6 月 30 日，应收款项账面净额中金额较大的前五名单位名称、净额及款项性质如下：

单位名称	账面净额	账龄	占应收款项 净额比例(%)	款项性质
东吴-建行-银华 3 号 定向资产管理计划	2,690,081.03	2-3 年	6.96	资产管理业务产品 管理费
东吴-建行-银华 2 号 定向资产管理计划	2,689,935.86	2-3 年	6.96	资产管理业务产品 管理费
东吴-建行-银华 1 号 定向资产管理计划	2,663,047.59	2-3 年	6.89	资产管理业务产品 管理费
江苏银行股份有限公司	1,800,000.00	1-2 年	4.66	信用保护合约保费
东吴-建行-国寿东吴 固定收益组合	1,028,298.92	1-2 年	2.66	资产管理业务产品 管理费
合计	10,871,363.40		28.13	

2、长期股权投资

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

项 目	期末余额	期初余额
子公司	7,635,291,591.22	7,635,291,591.22
联营企业	848,660,693.19	840,892,095.03
合计	8,483,952,284.41	8,476,183,686.25

(2) 长期股权投资明细情况

1、子公司投资情况

单位：元 币种：人民币

被投资单位	核算方法	投资成本	期初余额	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
东吴期货有限公司	成本法	808,741,736.00	808,741,736.00		808,741,736.00	93.80%	93.80%				
东吴创新资本管理有限责任公司	成本法	4,238,263,753.43	4,238,263,753.43		4,238,263,753.43	100.00%	100.00%				
东吴创业投资有限公司	成本法	1,054,200,000.00	1,054,200,000.00		1,054,200,000.00	100.00%	100.00%				
东吴证券中新(新加坡)有限公司	成本法	225,263,250.00	225,263,250.00		225,263,250.00	75.00%	75.00%				
东吴证券(香港)金融控股有限公	成本	1,076,695,566.08	1,076,695,566.08		1,076,695,566.08	100.00%	100.00%				

司	法										
东吴基金管理有 限公司	成 本 法	232,127,285.71	232,127,285.71		232,127,285.71	70.00%	70.00%				
合 计		7,635,291,591.22	7,635,291,591.22		7,635,291,591.22						

2、联营企业投资情况

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初 余额	本期增减变动								期末 余额	减值准备 期末余额
		追加 投资	减少 投资	权益法下确认 的投资损益	其他综合收 益调整	其他权益变 动	宣告发放现 金股利或利 润	计 提 减 值 准 备	其他		
苏州资产管 理有限公司	510,754,975.91			27,292,512.58	-1,621,740.46	-7,466,590.68	10,800,000.00			518,159,157.35	
中证信用增 进股份有限 公司	309,171,677.39			15,951,772.29	-55,403.19	752,080.89	13,500,000.00			312,320,127.38	
苏州企业征 信服务有限 公司	20,965,441.73			-2,784,033.27						18,181,408.46	
合计	840,892,095.03			40,460,251.60	-1,677,143.65	-6,714,509.79	24,300,000.00			848,660,693.19	

3、其他资产

(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
其他应收款	63,290,539.81	28,017,413.24
长期待摊费用	17,763,823.40	18,726,528.54
待摊费用	10,311,227.34	6,378,743.69
预付款项	29,114,178.91	29,539,197.64
其他	31,471,243.35	76,709,426.76
减：减值准备	8,492,046.51	8,723,876.76
合计	143,458,966.30	150,647,433.11

(2) 其他应收款

款项性质	期末账面余额	期初账面余额
其他应收款	25,434,630.89	25,129,781.51
应收股利	37,855,908.92	2,887,631.73
减：坏账准备	8,492,046.51	8,723,876.76
其他应收款净额	54,798,493.30	19,293,536.48

按账龄分析

种类	期末			
	账面金额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	52,103,064.37	82.33	4,057,718.39	47.78
1-2 年	1,654,662.42	2.61	165,466.24	1.95
2-3 年	1,658,482.11	2.62	331,696.42	3.91
3 年以上	7,874,330.91	12.44	3,937,165.46	46.36
合计	63,290,539.81	100.00	8,492,046.51	100.00

种类	期初			
	账面金额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	16,269,573.18	58.07	4,509,910.90	51.70
1-2 年	1,957,860.38	6.99	195,786.04	2.24
2-3 年	2,922,700.08	10.43	584,540.02	6.70
3 年以上	6,867,279.60	24.51	3,433,639.80	39.36
合计	28,017,413.24	100.00	8,723,876.76	100.00

按减值准备评估方式分析

种类	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)

单项计提坏账准备	3,719,487.76	5.88	3,719,487.76	100.00
组合计提坏账准备	59,571,052.05	94.12	4,772,558.75	8.01
合计	63,290,539.81	100.00	8,492,046.51	13.42

种类	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	4,455,111.53	15.90	4,455,111.53	100.00
组合计提坏账准备	23,562,301.71	84.10	4,268,765.23	18.12
合计	28,017,413.24	100.00	8,723,876.76	31.14

期末其他应收款项账面净额前五名情况

单位名称	账面净额	账龄	占其他应收款 净额比例 (%)	款项性质
鼎和财产保险股份有限公司	1,923,681.71	部分 2-3 年	3.51	房屋租赁保证金
上海陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司	1,836,039.12	部分 3 年以上	3.35	房屋租赁保证金
陈宁	1,105,856.64	1 年以内	2.02	房屋租赁保证金
慈溪市新城河建设投资有限公司	792,000.00	1 年以内	1.45	履约保证金
如皋市经济贸易开发总公司	792,000.00	1 年以内	1.45	投标保证金
合计	6,449,577.47		11.78	

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

(3) 长期待摊费用

单位：元币种：人民币

项目	取得方式	期初余额	本期增加	本期减少		外币报表折算差额	期末余额
				本期摊销	其他减少		
装修费	购入	15,855,142.30	2,946,316.96	3,823,856.99			14,977,602.27
网络工程	购入	1,134,300.02	171,221.00	263,357.18			1,042,163.84
办公家具	购入	1,197,210.38	293,501.98	305,448.02			1,185,264.34
水电增容	购入	27,842.86		14,352.66			13,490.20
消防工程	购入	512,032.98	137,429.79	104,160.02			545,302.75
合计		18,726,528.54	3,548,469.73	4,511,174.87			17,763,823.40

4、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	1,106,044,464.89	1,102,899,519.05
其中：融资融券利息收入	583,958,569.83	397,106,390.57
买入返售金融资产利息收入	156,479,057.30	296,297,723.39
其中：约定购回利息收入		70,192.55
股权质押回购利息收入	147,567,808.70	292,835,587.76
其他债权投资利息收入	138,954,446.41	160,724,526.14
存放金融同业收入	226,652,391.35	248,770,878.95
利息支出	843,110,155.11	910,167,543.35
其中：短期借款利息支出	939,165.97	235,041.70
应付短期融资款利息支出	118,388,594.38	69,827,300.65
拆入资金利息支出	30,013,596.50	65,759,858.33
其中：转融通利息支出	18,653,059.73	41,979,166.67
卖出回购金融资产利息支出	128,157,587.20	104,727,482.95
代理买卖证券款利息支出	36,389,504.34	34,335,898.01
应付债券利息支出	527,761,583.05	635,281,961.71
其中：次级债券利息支出	165,646,431.40	262,413,811.00
租赁负债利息支出	1,460,123.67	
利息净收入	262,934,309.78	192,731,975.70

5、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	827,601,266.62	588,910,488.97
证券经纪业务收入	1,059,324,998.95	812,911,019.46
其中：代理买卖证券业务	730,320,191.81	714,133,289.90
交易单元席位租赁	285,536,205.25	90,174,180.24
代销金融产品业务	43,468,601.89	8,603,549.32
证券经纪业务支出	231,723,732.33	224,000,530.49
其中：代理买卖证券业务	231,723,732.33	224,000,530.49
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	387,891,171.70	442,226,781.02
投资银行业务收入	395,338,577.37	445,274,894.23
其中：证券承销业务	333,552,893.66	363,164,470.30
证券保荐业务	13,320,754.73	17,547,169.81
财务顾问业务	48,464,928.98	64,563,254.12
投资银行业务支出	7,447,405.67	3,048,113.21
其中：证券承销业务	7,447,405.67	3,048,113.21

4. 资产管理业务净收入	46,135,360.54	43,506,026.48
资产管理业务收入	47,161,153.19	47,355,946.18
资产管理业务支出	1,025,792.65	3,849,919.70
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	18,996,024.80	8,332,671.20
投资咨询业务收入	18,996,024.80	8,332,671.20
7. 其他手续费及佣金净收入	1,825,466.06	5,653,184.86
其他手续费及佣金收入	6,995,895.68	7,397,317.31
其他手续费及佣金支出	5,170,429.62	1,744,132.45
合计	1,282,449,289.72	1,088,629,152.53
其中：手续费及佣金收入	1,527,816,649.99	1,321,271,848.38
手续费及佣金支出	245,367,360.27	232,642,695.85

(2). 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	1,132,075.48	9,764,150.94
并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	47,332,853.50	54,799,103.18

6、投资收益

(1). 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	40,460,251.60	44,397,371.81
金融工具投资收益	684,109,839.25	586,674,468.15
其中：持有期间取得的收益	628,809,107.07	519,794,018.59
—交易性金融工具	415,722,473.26	458,453,389.88
—其他权益工具投资	213,086,633.81	61,340,628.71
处置金融工具取得的收益	55,300,732.18	66,880,449.56
—交易性金融工具	100,377,347.44	71,561,536.32
—其他债权投资	46,221.44	6,080,603.82
—衍生金融工具	-45,122,836.70	-10,761,690.58
合计	724,570,090.85	631,071,839.96

(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	持有期间收益	415,722,473.26	458,533,987.93
	处置取得收益	102,701,855.54	71,561,536.32

金融资产			
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		-80,598.05
	处置取得收益	-2,324,508.10	

7、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	240,984,433.20	219,860,032.00
交易性金融负债	-909,353.82	
衍生金融工具	590,857.88	-7,087,309.06
合计	240,665,937.26	212,772,722.94

8、现金流量表补充资料

√适用 □不适用

(1) 将净利润调节为经营活动现金流量

补充资料	本期发生额	上期发生额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	949,702,378.53	722,217,208.15
加：其他资产减值损失		
信用减值损失	81,255,094.03	339,669,856.33
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	35,064,522.01	30,051,261.29
使用权资产折旧	14,941,530.60	
无形资产摊销	23,231,055.65	20,322,746.74
长期待摊费用摊销	4,511,174.87	4,147,884.21
报废及处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-513,724.76	1,907,765.87
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-242,126,890.93	-220,031,677.94
利息支出（收益以“-”号填列）	509,595,020.66	544,619,777.92
投资损失（收益以“-”号填列）	-253,593,106.85	-111,818,604.34
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	106,960,417.76	-11,210,585.43
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-1,874,327,814.11	506,493,842.14
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	4,868,628,574.17	5,037,603,178.29
汇兑损益	1,400,709.08	-2,916,117.89
经营活动产生的现金流量净额	4,224,728,940.71	6,861,056,535.34
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	23,293,295,954.11	22,530,820,183.59
减：现金的期初余额	20,753,602,813.88	17,735,736,367.79

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	2,539,693,140.23	4,795,083,815.80

(2) 现金和现金等价物的构成

项目	期末余额	期初余额
一、现金	23,293,295,954.11	20,753,602,813.88
其中：库存现金	75,502.67	66,488.61
可随时用于支付的银行存款	17,664,619,710.48	16,535,895,177.98
可随时用于支付的其他货币资金	5,159,238.09	33,751.34
结算备付金	5,623,441,502.87	4,217,607,395.95
二、现金等价物		
三、期末现金及现金等价物余额	23,293,295,954.11	20,753,602,813.88

附注 16、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	487,088.01	
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）	23,617,037.24	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-719,059.41	
其他符合非经常性损益定义的损益项目	9,223,035.22	
所得税影响额	-8,100,252.09	
少数股东权益影响额	-4,847,877.55	
合计	19,659,971.42	

本集团对非经常性损益项目的确认依照中国证券监督管理委员会《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》（公告[2008]43 号）的规定执行。

本集团持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及衍生金融工具等，这些金融工具产生的公允价值变动损益，持有期间获得的投资收益以及处置取得的投资收益乃本集团正常经营业务，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	4.72	0.35	0.35
扣除非经常性损益后归属于	4.65	0.34	0.34

公司普通股股东的净利润			
-------------	--	--	--

3、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

4、 其他

适用 不适用

董事长：范力

董事会批准报送日期：2021 年 8 月 14 日

修订信息

适用 不适用

第十一节 证券公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

适用 不适用

二、 监管部门对公司的分类结果

适用 不适用

公司 2021 年度分类评级为 A 类 A 级。

附录：

公司主要单项业务资格

1、母公司拥有的主要业务资格和业务许可

(1) 2001 年 5 月 6 日，中国证监会出具“证监信息字[2001]5 号”《关于兴业证券股份有限公司等十家证券公司网上证券委托业务资格的批复》，核准公司开展网上证券委托业务资格。

(2) 2001 年 8 月 5 日，中国证监会出具“证监机构字[2001]134 号”《关于苏州证券有限责任公司经营外资股业务资格的批复》，核准公司从事外资股经纪业务的资格。

(3) 2002 年 8 月 1 日，中国证监会出具“证监机构字[2002]231 号”《关于东吴证券有限责任公司股票主承销商资格的批复》，核准公司的股票主承销商资格。

(4) 2002 年 8 月 13 日，中国证监会出具“证监机构字[2002]244 号”《关于核准东吴证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》，核准公司从事受托投资管理业务的资格。

(5) 2002 年 12 月 2 日，中国国债协会出具“财债协[2002]35 号”《关于批准成为中国国债协会会员的通知》，批准公司成为中国国债协会会员。

(6) 2003 年 4 月 1 日，中国人民银行出具“银复[2003]68 号”《中国人民银行关于东吴证券有限责任公司等 7 家证券公司成为全国银行间同业拆借市场成员的批复》，批准公司成为全国银行间同业拆借市场成员，从事同业拆借业务。

(7) 2003 年 12 月 12 日，中国证监会出具“证监基金字[2003]141 号”《关于东吴证券有限责任公司开放式证券投资基金代销业务资格的批复》，核准公司开办开放式证券投资基金代销业务资格。

(8) 2004 年 11 月 25 日，上海证券交易所出具“上证会字[2004]44 号”《关于上海证券交易所国债买断式回购交易参与主体认定的通知》，批准公司为上海证券交易所国债买断式回购交易参与主体。

(9) 2005 年 5 月 26 日，中国证监会出具“机构部部函[2005]208 号”《关于同意东吴证券有限责任公司申请企业年金基金投资管理人资格的函》，核准公司企业年金基金投资管理人资格。

(10) 2008 年 7 月 10 日，中国证监会出具“证监许可[2008]909 号”《关于核准东吴证券有限责任公司为期货公司提供中间介绍业务资格的批复》，核准公司为东吴期货提供中间介绍业务的资格。

(11) 2009 年 3 月 9 日，中国证券业协会出具“中证协函[2009]78 号”《关于授予从事代办股份转让主办券商业务资格的函》，中国证券业协会授予公司从事代办股份转让主办券商业务资格。

(12) 2009 年 3 月 9 日，中国证券业协会出具“中证协函[2009]79 号”《关于授予东吴证券有限责任公司报价转让业务资格的函》，授予公司报价转让业务资格。

(13) 2009 年 9 月 9 日，中国证监会出具“机构部部函[2009]416 号”《关于对东吴证券有限责任公司开展直接投资业务试点的无异议函》，核准公司设立全资子公司东吴投资有限公司，开展直接投资业务试点。

(14) 2010 年 5 月 28 日，江苏证监局批准公司自营业务参与股指期货交易。

(15) 2012 年 4 月 26 日，中国证监会出具“机构部部函[2012]206 号”《关于东吴证券股份有限公司从事债券质押式报价回购业务试点方案的无异议函》，核准公司开展债券质押式报价回购业务试点。

(16) 2012 年 4 月 27 日，中国证监会出具“证监许可[2012]604 号”《关于核准东吴证券股份有限公司融资融券业务资格的批复》，核准公司开展融资融券业务。

(17) 2012 年 5 月 17 日，中国证监会出具“证监许可[2012]63 号”《关于东吴证券股份有限公司开展债券质押式报价回购业务试点相关事项的通知》，公司获准开展债券质押式报价回购业务。

(18) 2012 年 6 月 11 日，中国证券业协会出具“中证协函[2012]373 号”《关于反馈证券公司中小企业私募债券承销业务试点实施方案专业评价结果的函》，通过了公司的中小企业私募债券承销业务试点资格。

(19) 2012 年 7 月 6 日，江苏省证监局出具“苏证监机构函[2012]293 号”《关于东吴证券资产管理业务参与股指期货交易的备案函》，批准公司资产管理业务参与股指期货交易资格。

(20) 2012 年 9 月 6 日，国家外汇管理局颁发“外汇字第 SC201219 号”《证券业务外汇经营许可证》，公司根据国家外汇管理局的规定每年报送书面报告。

(21) 2012 年 9 月 19 日，中国保险监督管理委员会出具“资金部函[2012]20 号”《关于向保险机构投资者提供综合服务的评估函》，批准公司向保险机构投资者提供交易单元。

(22) 2012 年 9 月 27 日，上海证券交易所出具“上证会字[2012]191 号”《关于确认东吴证券股份有限公司约定购回式证券交易权限的通知》，公司获准开展约定购回式证券交易业务。

(23) 2012 年 11 月 8 日，中国证券金融股份有限公司出具“中证金函[2012]154 号”《关于申请参与转融通业务的复函》，批准公司参与转融通业务。

(24) 2013 年 1 月 12 日，深圳证券交易所出具“深证会[2013]15 号”《关于约定购回式证券交易权限开通的通知》，批准公司开展约定购回式证券交易业务。

(25) 2013 年 1 月 28 日，江苏证监局出具“苏证监机构字[2013]37 号”《关于核准东吴证券股份有限公司代销金融产品业务资格的批复》，核准公司开展代销金融产品业务。

(26) 2013 年 7 月 1 日，上海证券交易所出具的“上证会字[2013]73 号”《关于确认东吴证券股份有限公司股票质押式回购业务交易权限的通知》，核准公司开展股票质押式回购业务。

(27) 2013 年 11 月 8 日，公司提交《投资管理人受托管理保险资金报告材料》取得中国保险监督管理委员会备案通知，可以开展受托管理保险资金业务。

(28) 2014 年 2 月 14 日，中国证券登记结算有限责任公司以《代理证券质押登记业务资格确认函》，批准公司代理证券质押登记业务资格。

(29) 2014 年 6 月 24 日，全国中小企业股份转让系统有限责任公司出具“股转系统函[2014]727 号”《主办券商业务备案函》，核准公司全国中小企业股份转让系统做市商资格。

(30) 2014 年 10 月 10 日，上海证券交易所出具的“上证函[2014]599 号”《关于同意开通东吴证券股份有限公司港股通业务交易权限的通知》，同意开通公司 A 股交易单元的港通业务交易权限。

(31) 2014 年 11 月 24 日，中国证券投资者保护基金公司出具的“证保函[2014]277 号”《关于东吴证券股份有限公司开展私募基金综合托管业务的无异议函》，批准公司开展私募基金综合托管业务。

(32) 2014 年 12 月 16 日，中国证券业协会出具的“中证协函[2014]776 号”《关于同意开展柜台市场试点的函》，同意公司开展柜台市场试点。

(33) 2015 年 1 月 23 日，上海证券交易所出具“上证函[2015]135 号”《关于东吴证券股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知》，核准公司开通股票期权经纪业务权限。

(34) 2015 年 1 月 28 日，上海证券交易所出具“上证函[2015]197 号”《关于开通股票期权自营交易权限的通知》，同意开通公司股票期权自营业务交易权限。

(35) 2015 年 3 月 3 日，中国证券业协会出具“中证协函[2015]115 号”《关于同意开展互联网证券业务试点的函》，同意公司开展互联网证券业务试点。

(36) 2015 年 6 月 1 日，中国证券登记结算有限责任公司出具“中国结算办字[2015]451 号”《关于东吴证券单向视频开户创新方案的无异议函》，同意公司试点使用单向视频方式验证投资者身份。

(37) 2015 年 6 月 1 日，中国证券登记结算有限责任公司出具“中国结算办字[2015]457 号”《关于东吴证券 H5 引流开户方案的无异议函》，同意公司试点实施引流开户方案。

(38) 2016 年 11 月 3 日，深圳证券交易所出具“深证会[2016]326 号”《关于同意开通国信证券等会员单位深港通下港股通业务交易权限的通知》，同意开通公司相关交易单元的深港通下港股通业务交易权限。

(39) 2018 年 7 月 31 日，中国证券业协会出具的“中证协函 2018[389]号”《关于同意场外期权业务二级交易商备案的函》，同意公司备案为场外期权业务二级交易商。

(40) 2019 年 2 月 28 日，中国证监会出具“机构部函[2019]465 号”《关于东吴证券申请信用衍生品业务的监管意见书》，同意公司开展银行间市场信用风险缓释工具、交易所市场信用风险缓释工具以及监管认可的其他信用衍生品卖出业务。

(41) 2021 年 3 月 23 日，深圳证券交易所出具《关于同意东吴证券开展上市公司股权激励行权融资业务试点的函》（深证函（2021）210 号），同意公司开展上市公司股权激励行权融资业务试点。

(42) 公司现持有中国证监会于 2017 年 11 月 15 日下发的《经营证券期货业务许可证》，统一社会信用代码为：91320000137720519P。

公司还具备上海证券交易所会员资格、深圳证券交易所会员资格、中国国债协会会员资格、中国证券业协会会员资格、江苏省证券业协会会员资格，中国证券登记结算有限责任公司结算参与人资格、中国证券投资基金业协会会员资格。

2、子公司拥有的业务资格和业务许可

(1) 东吴期货

1) 2007 年 11 月 2 日，中国证监会出具“证监期货字[2007]252 号”《关于核准东吴期货有限公司金融期货经纪业务资格的批复》，核准东吴期货金融期货经纪业务资格，经营范围变更为：商品期货经纪、金融期货经纪。

2) 2007 年 11 月 2 日，中国证监会出具“证监期货字[2007]253 号”《关于核准东吴期货有限公司金融期货交易结算业务资格的批复》，核准东吴期货金融期货交易结算业务资格。

3) 2011 年 9 月 14 日，中国证监会出具“证监许可[2011]1446 号”《关于核准东吴期货有限公司期货投资咨询业务资格的批复》，核准东吴期货期货投资咨询业务资格，经营范围变更为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询。

4) 2015 年 1 月 16 日，中国期货业协会出具“中期协备字[2015]20 号”《关于东吴期货有限公司资产管理业务予以登记的通知》，对东吴期货资产管理业务予以登记。

5) 2015 年 3 月 9 日, 中国期货业协会出具“中期协备字[2015]64 号”《关于东吴期货有限公司设立风险管理公司予以备案的通知》, 对东吴期货关于设立风险管理公司开展以风险管理服务为主的业务试点予以备案。

6) 2016 年 1 月 14 日, 中国证监会核发东吴期货《经营证券期货业务许可证》, 统一社会信用代码为 913100001321138080, 载明证券期货业务范围为商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询, 资产管理。

(2) 东吴基金

1) 2011 年 12 月 27 日, 中国证监会出具“证监许可[2011]2110 号”《关于核准东吴基金管理有限公司从事特定客户资产管理业务的批复》, 核准东吴基金从事特定资产管理业务。

2) 2017 年 5 月 16 日, 中国证监会核发东吴基金《经营证券期货业务许可证》, 统一社会信用代码为 913100007664967591, 证券期货业务范围为公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。

(3) 新东吴优胜

1) 2018 年 1 月 29 日, 中国证监会核发新东吴优胜《经营证券期货业务许可证》, 统一社会信用代码为: 91310101062563511R, 证券期货业务范围为特定客户资产管理。

(4) 东吴新加坡

1) 2016 年 1 月 27 日, 新加坡金融监管局 (MAS) 核发东吴新加坡《资本市场服务 (CMS) 许可》, 许可东吴新加坡依法经营基金管理。2018 年 3 月 16 日, 东吴新加坡成为控股公司, 由子公司东吴中新资产管理 (亚洲) 有限开展基金管理业务。

2) 2016 年 10 月 27 日, 中国证监会核发东吴新加坡《经营证券期货业务许可证》, 统一社会信用代码 (境外机构编号) 为 RQF2016SGF192, 证券期货业务范围为境内证券投资。2018 年 12 月 3 日, 该资格由子公司东吴中新资产管理 (亚洲) 有限公司承继。

(5) 上海东吴玖盈投资管理有限公司

1) 2015 年 3 月 9 日, 中国期货业协会出具“中期协备字[2015]66 号”《关于上海东吴玖盈投资管理有限公司试点业务予以备案的通知》, 对上海东吴玖盈投资管理有限公司试点业务予以备案。备案试点业务为仓单服务、基差交易、合作套保、定价服务。

2) 2018 年 2 月 1 日, 中国期货业协会出具“中期协备字[2018]8 号”《关于上海东吴玖盈投资管理有限公司试点业务予以备案的通知》, 对上海东吴玖盈投资管理有限公司做市业务试点业务予以备案。

(6) 东吴中新资本 (亚洲) 有限公司

2018年2月23日，新加坡金融管理局（MAS）核发东吴中新资本（亚洲）有限公司 CMS100678 号《资本市场服务（CMS）许可证》，许可东吴中新资本（亚洲）有限公司依证券期货法（SFA）从事证券交易和公司金融咨询业务。2018年10月8日，许可范围更新为企业融资顾问业务和资本市场产品交易。

（7）东吴中新资产管理（亚洲）有限公司

1) 2018年2月23日，新加坡金融管理局（MAS）核发东吴中新资产管理（亚洲）有限公司 CMS100679 号《资本市场服务（CMS）许可证》，许可东吴中新资产管理（亚洲）有限公司依证券期货法（SFA）从事基金管理业务。2018年10月8日，许可范围更新为基金管理业务和资本市场产品交易。

2) 2018年3月16日，东吴中新资产管理（亚洲）有限公司承继母公司东吴新加坡基金管理业务资格。

3) 2018年12月3日，中国证监会出具“证监许可[2018]2005号”《关于核准东吴中新资产管理（亚洲）有限公司人民币合格境外机构投资者资格的批复》，核准东吴中新资产管理（亚洲）有限公司承继母公司东吴新加坡境内证券投资业务资格。

4) 2019年5月23日，国家外汇管理局出具“汇复[2019]11号”《国家外汇管理局关于东吴中新资产管理（亚洲）有限公司承继东吴证券中新（新加坡）有限公司 RQFII 投资额度的批复》，批准东吴中新资产管理（亚洲）有限公司承继母公司东吴新加坡已获批的 RQFII 投资额度，RQFII 投资额度为 15 亿元人民币。

5) 2019年6月11日，中国证监会核发东吴中新资产管理（亚洲）有限公司《经营证券期货业务许可证》，统一社会信用代码（境外机构编号）为 RQF2018SGF222，证券期货业务范围为境内证券投资。

（8）东吴香港

1) 2020年5月19日，中国证监会核发东吴证券（国际）金融控股有限公司《经营证券期货业务许可证》，统一社会信用代码（境外机构编号）为 RQF2013HKS014，证券期货业务范围为境内证券投资。

2) 2020年3月23日，香港证监会核发东吴证券国际期货有限公司第2类及第5类牌照，中央编码为：AZQ989，允许进行期货合约交易及就期货合约提供意见。

3) 2020年3月23日，香港证监会核发东吴证券国际经纪有限公司第1类及第4类牌照，中央编码为：AYA587，允许进行证券交易及就证券提供意见。

4) 2020年3月19日，香港证监会核发东吴证券国际资产管理有限公司第4类及第9类牌照，中央编码为：AYA628，允许提供资产管理及就证券提供意见。

5)2020 年 3 月 19 日,香港证监会核发东吴证券国际融资有限公司第 6 类牌照,中央编码为:BBG379,允许就机构融资提供意见。