

公司代码：600958

公司简称：东方证券

东方证券股份有限公司 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、公司负责人金文忠、主管会计工作负责人张建辉及会计机构负责人（会计主管人员）尤文杰声明：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

公司未拟定2021年上半年利润分配预案或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

本报告可能包含前瞻性陈述，包括未来计划和发展战略。除历史事实陈述以外的所有声明均为或可视为前瞻性陈述。公司及其任何子公司均不承担因新数据而公开更新或修订任何前瞻性陈述的义务。敬请投资者注意此类投资风险，不要过度依赖前瞻性陈述。

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内容的真实性、准确性和完整性

否

十、重大风险提示

公司的业务受整体经济及政治状况影响，如宏观经济及货币政策、金融及证券行业的法律法规、市场、商业及金融部门的涨跌趋势、货币及利率水平波动、长短期市场资金来源的可用性、

融资成本等。作为一家证券公司，公司的业务直接受证券市场固有风险影响，包括市场波动、投资意愿变动、交易量波动、流动性变动及证券行业市场信誉或市场感知信誉。

公司经营中面临的风险主要包括：因国家宏观调控措施，与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等变动，从而对证券公司经营产生不利影响的政策性风险；在证券市场中因股票价格、利率、汇率等的变动而导致价值未预料到的潜在损失的风险；债务人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，给公司造成损失的风险；由于内部流程不完善、员工操作失误及不当行为、信息系统故障缺陷以及外部事件导致的操作风险；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所需资金的流动性风险；公司信息技术系统不能提供正常服务，影响公司业务正常开展的风险；信息技术系统和关键数据的保护、备份措施不足，导致公司业务不连续或信息安全风险；公司经营、管理及其他行为或外部事件导致对公司声誉产生负面评价的风险；公司的产品或服务被不法分子利用从事洗钱活动，因此对公司在法律、声誉、合规、经营等方面造成不利影响的洗钱风险。此外，公司也与其他金融机构一样，经营管理过程中不可避免面临着一定程度的合规风险、法律风险、道德风险等，对这些风险类型，公司施行的全面风险管理体系已经全面覆盖，并明确了相应的主办部门，建立了相应的管理制度，实施了相应的技术措施。

公司已在本报告中详细描述存在的市场风险、信用风险、流动性风险等，请参见管理层讨论与分析中关于公司可能面对的风险因素及对策的内容。

十一、其他

适用 不适用

本报告的分析及阐述，未特别指明的，均以合并会计报表口径为基础。

目录

第一节	释义.....	5
第二节	公司简介和主要财务指标.....	7
第三节	管理层讨论与分析.....	17
第四节	公司治理.....	54
第五节	环境与社会责任.....	61
第六节	重要事项.....	66
第七节	股份变动及股东情况.....	84
第八节	优先股相关情况.....	90
第九节	债券相关情况.....	91
第十节	财务报告.....	96
第十一节	证券公司信息披露.....	224

备查文件目录	经法定代表人签字和公司盖章的本次半年报全文和摘要
	经法定代表人、主管会计工作的负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签字并盖章的2021年半年度财务会计报告

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		
A 股	指	公司每股面值人民币 1 元的内资股，于上交所上市并进行交易
报告期	指	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
《标准守则》	指	《香港上市规则》附录十所载之《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》
东方投行	指	东方证券承销保荐有限公司，是公司全资子公司
东方金控	指	东方金融控股（香港）有限公司，是公司全资子公司
东证创投	指	上海东方证券创新投资有限公司，是公司全资子公司
东证期货	指	上海东证期货有限公司，是公司全资子公司
东证资本	指	上海东方证券资本投资有限公司，是公司全资子公司
东证资管	指	上海东方证券资产管理有限公司，是公司全资子公司
东证国际	指	东证国际金融集团有限公司，是东方金控全资子公司
董事会	指	东方证券董事会
董事	指	东方证券董事
ESG 报告	指	环境、社会及管治报告
公司/本公司/母公司/东方证券	指	东方证券股份有限公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《公司章程》	指	《东方证券股份有限公司章程》
汇添富基金	指	汇添富基金管理股份有限公司，是公司参股公司
H 股	指	公司每股面值人民币 1 元的境外上市外资股，于香港联交所上市及以港元买卖
IPO	指	首次公开招股
集团/本集团/我们	指	东方证券股份有限公司及其子公司
监事	指	东方证券监事
监事会	指	东方证券监事会
《企业管治守则》	指	《香港上市规则》附录十四所载之《企业管治守则》及《企业管治报告》
上海证监局	指	中国证券监督管理委员会上海监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
申能集团	指	申能（集团）有限公司
上证指数	指	上海证券综合指数
深证成指	指	深圳成分股指数

香港	指	中国香港特别行政区
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
香港证监会	指	香港证券与期货事务监察委员会
《香港上市规则》	指	香港联合交易所有限公司证券上市规则
新三板	指	全国中小企业股份转让系统
元、千元、万元、百万元、亿元	指	人民币元、千元、万元、百万元、亿元（特别注明除外）
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《证券及期货条例》	指	香港法例第 571 章证券及期货条例
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
中债登	指	中央国债登记结算有限责任公司
中证登	指	中国证券登记结算有限责任公司

第二节 公司简介和主要财务指标

一、 公司信息

公司的中文名称	东方证券股份有限公司
公司的中文简称	东方证券
公司的外文名称	ORIENT SECURITIES COMPANY LIMITED
公司的外文名称缩写	DFZQ
公司的法定代表人	金文忠
公司总经理	金文忠
公司授权代表	宋雪枫、金文忠
联席公司秘书	王如富、梁颖娴

注册资本和净资本

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	6,993,655,803.00	6,993,655,803.00
净资本	36,169,608,767.08	37,834,826,350.42

公司的经营范围：

证券经纪；融资融券；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；
 证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券承销（限国债、地方债
 等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企
 业债务融资工具））；股票期权做市业务；证券投资基金托管。【依法须批准的项目，经相关部
 门批准后方可开展经营活动】

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

序号	业务资质名称	核准机关及批准文号
1	经营证券期货业务许可证	中国证监会（编号：913100001322947763）
2	进入全国银行间同业拆借市场和债券市场，从事拆借、购买债券、债券现券交易和债券回购业务资格	中国人民银行货币政策司（银货政[2000]108号）
3	开展网上证券委托业务资格	中国证监会（证监信息字[2001]8号）
4	开展开放式证券投资基金代销业务资格	中国证监会（证监基金字[2004]50号）
5	开展“上证基金通”业务资格	上交所会员部（上交所[2005]）

6	从事短期融资券承销业务资格	中国人民银行（银发[2005]275号）
7	从事相关创新活动的试点证券公司	中国证券业协会（中证函[2004]266号）
8	代办股份转让主办券商业务资格	中国证券业协会（中证协函[2006]158号）
9	报价转让业务资格	中国证券业协会（中证协函[2006]173号）
10	上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格	上交所（上证会字[2007]45号）
11	金融期货经纪业务资格的批复	中国证监会（证监期货字[2007]351号）
12	中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与者资格	中证登（中国结算函字[2008]25号）
13	金融期货交易结算业务资格	中国证监会（证监许可[2008]684号）
14	直接投资业务试点资格	中国证监会（机构部部函[2009]475号）
15	开展为期货公司提供中间介绍业务资格	中国证监会（沪证监机构字[2010]132号）
16	设立全资子公司上海东方证券资产管理有限公司，开展证券资产管理业务资格	中国证监会（证监许可[2010]518号）
17	经营证券期货业务许可证	中国证监会（编号：91310000555998513B）
18	开展融资融券业务资格	中国证监会（证监许可[2010]764号）
19	1号牌照-证券交易	香港证券及期货事务监察委员会（中央编号AVD362）
	4号牌照-就证券提供意见	
20	9号牌照-提供资产管理	香港证券及期货事务监察委员会（中央编号AVH864）
21	实施证券经纪人制度资格	中国证监会（沪证监机构字[2010]514号）
22	2号牌照-期货合约交易	香港证券及期货事务监察委员会（中央编号AWD036）
23	出资设立东方花旗证券有限公司，开展投资银行业务资格	中国证监会（证监许可[2011]2136号）
24	从事债券质押式报价回购业务试点资格	中国证监会（机构部部函[2012]20号）
25	向保险机构投资者提供综合服务资格	中国保险监督管理委员会（资金部函[2012]4号）
26	开展约定购回式证券交易业务资格	中国证监会（机构部部函[2012]481号）
		上交所（上证会字[2012]167号）
		深交所（深证会[2013]15号）
27	保险资金投资管理人资格	中国保监会（资金部函[2012]4号）
28	转融资业务试点及转融通业务资格	中国证券金融股份有限公司（中证金函[2012]149号、中证金函[2012]153号）
29	资产管理业务资格	中国证监会（证监许可[2012]1501号）
30	开展保险机构特殊机构业务资格	中国保险监督管理委员会（《关于开展保险机构特殊机构客户业务的通知》）
31	保荐机构资格	中国证监会（证监许可[2013]33号）
32	经营证券期货业务许可证	中国证监会（编号：91310000132110914L）

33	从事代销金融产品业务资格	上海证监局（沪证监机构字[2013]52号）
34	作为主办券商在全国中小企业股份转让系统从事经纪业务资格	全国中小企业股份转让系统有限责任公司（股转系统函[2013]44号）
35	开展有限合伙型私募基金综合托管业务	中国证监会（机构部部函[2013]174号）
36	开展客户证券资金消费支付服务试点资格	中国证监会（机构部部函[2013]207号）
37	证券投资业务许可证	中国证监会（RQF2013HKS015）
38	公司股票质押式回购业务资格	上交所（上证会[2013]77号）
		深交所（深证会[2013]60号）
39	开展代理证券质押登记业务资格	中证登（《代理证券质押登记业务资格确认函》）
40	公开募集证券投资基金管理业务资格	中国证监会（证监许可[2013]1131号）
41	权益类收益互换与场外期权业务资格	中国证券业协会（中证协函[2013]923号）
42	参与转融券业务试点资格	中国证券金融股份有限公司（中证金函[2013]227号）
43	外币有价证券经纪业务资格	国家外汇管理局上海分局（上海汇复[2014]15号）
44	《证券业务外汇经营许可证》	国家外汇管理局（SC201102）
45	作为主办券商在全国中小企业股份转让系统从事做市业务资格	全国中小企业股份转让系统有限责任公司（股转系统公告[2014]54号、股转系统函[2014]707号）
46	机构间私募产品报价与服务系统第一批参与者资格	中证资本市场发展监测中心有限责任公司（报价系统参与人名单公告[第一批]）
47	6号牌照-就机构融资提供意见	香港证券及期货事务监察委员会（中央编号BDN128）
48	港股通业务交易权限	上交所（上证函[2014]626号）
49	柜台市场试点资格	中国证券业协会（中证协函[2014]632号）
50	黄金现货合约自营业务试点资格	中国证监会（基金机构监管部部函[2014]1876号）
51	互联网证券业务试点	中国证券业协会（《关于互联网证券业务试点证券公司名单的公告》（第3号））
52	非金融企业债务融资工具主承销业务资质	中国银行间市场交易商协会（中国银行间市场交易商协会公告[2014]16号）
53	上海证券交易所期权交易参与者资格，并开通股票期权经纪、自营业务交易权限；公司期权结算业务资格	上交所（上证函[2015]61号）
54	开展客户保证金转账转入服务资格	中国证券登记结算公司（中国结算函字[2015]11号）
		中国证券投资者保护基金公司（证保函[2015]67号）
55	股票期权做市业务资格	中国证监会（证监许可[2015]163号）
56	开展非金融企业债务融资工具报价业务资格	中国银行间市场交易商协会（中市协备[2015]32号）
57	证券投资基金销售业务资格	上海证监局（沪证监许可[2015]61号）

58	经营证券期货业务许可证, 经营范围为证券(不含国债、政策性银行金融债、短期融资券及中期票据)承销与保荐	中国证监会(编号: 913100007178330852)
59	基金销售业务资格	中国证监会(编号: 000000519)
60	私募基金业务外包服务机构	中国基金业协会
61	短期融资券发行资格	中国证监会(机构部函[2015]3337号)
62	深港通下港股通业务交易权限	深交所(深证会[2016]326号)
63	报价系统做市业务试点公司资格	中证机构间报价系统股份有限公司(中证报价函[2016]185号)
64	银行间黄金询价业务资格	上海黄金交易所(上金交发[2017]81号)
65	上海证券交易所股票期权交易参与者资格	上交所(上证函[2017]165号)
66	深圳证券交易所质押式报价回购交易权限	深交所(深证会[2017]371号)
67	上证 50ETF 期权主做市商资格	上交所(上证函[2018]430号)
68	证券投资基金托管资格	中国证监会(证监许可[2018]1686号)
69	从事证券承销业务资格(限国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种(包括但不限于非金融企业债务融资工具))	上海证监局(沪证监许可[2019]8号)
70	上交所上市基金主做市商业资格	上交所(上证函[2019]101号)
71	信用衍生品业务资格(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及监管认可的其他信用衍生品卖出业务)	中国证监会(机构部函[2019]463号)
72	国债期货做市业务资格	中国证监会(机构部函[2019]1023号)
73	互联网理财账户规范试点	中国证券业协会(中证协函[2019]185号)
74	深交所股票期权业务交易权限	深交所(深证会[2019]470号)
75	商品期权做市业务资格	中国证监会(机构部函[2019]3058号)
76	股指期货做市业务资格	中国证监会(机构部函[2019]3067号)
77	深交所沪深 300ETF 期权主做市商业资格	深交所(深证会[2019]483号)
78	上交所沪深 300ETF 期权主做市商业资格	上交所(上证函[2019]2300号)
79	合格境内机构投资者资格	中国证监会(证监许可[2019]1470号)
80	结售汇业务经营资格	国家外汇管理局(汇复[2020]10号)
81	代客外汇业务资格	国家外汇管理局(汇综便函[2020]482号)
82	基金投资顾问业务资格	证券基金机构监管部(机构部函[2021]1686号)

此外, 公司还拥有中国证券业协会会员资格、上交所会员资格、深交所会员资格、中国国债协会会员资格、上海黄金交易所会员资格、中证登结算参与者资格及中国证券投资基金业协会会员资格。

二、 联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	王如富	李婷婷
联系地址	中国上海市黄浦区中山南路119号11层	中国上海市黄浦区中山南路119号11层
电话	+86-021-63325888	+86-021-63325888
传真	+86-021-63326010	+86-021-63326010
电子信箱	wangrf@orientsec.com.cn	litingting@orientsec.com.cn

三、 基本情况变更简介

公司注册地址	中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦
公司办公地址	中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12-14层、22层、25-27层、29层、32层、37-40层
公司办公地址的邮政编码	200010
香港营业地址	香港中环皇后大道中100号第28至29层
公司网址	http://www.dfzq.com.cn
电子信箱	ir@orientsec.com.cn

四、 信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的网站地址	http://www.sse.com.cn
登载半年度报告的香港联交所指定网站的网址	http://www.hkexnews.hk
公司半年度报告备置地点	中国上海市黄浦区中山南路119号11层

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	上交所	东方证券	600958
H股	香港联交所	东方证券	03958

六、 其他有关资料

√适用 □不适用

公司聘请的会计师事务所（境内）	名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
	办公地址	中国上海市黄浦区延安东路222号30楼
	签字会计师姓名	史曼、潘竹筠

公司聘请的会计师事务所（境外）	名称	德勤·关黄陈方会计师行
	办公地址	香港金钟道 88 号太古广场一座 35 楼
	签字会计师姓名	马庆辉
首席风险官兼合规总监	杨斌	
中国内地法律顾问	国浩律师（上海）事务所	
香港法律顾问	高伟绅律师行	
A 股股份登记处	中证登上海分公司	
H 股股份登记处	香港中央证券登记有限公司	

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	13,276,756,060.33	9,625,293,303.92	37.94
归属于母公司股东的净利润	2,700,359,705.45	1,526,023,784.18	76.95
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	2,629,382,749.50	1,439,023,469.06	82.72
经营活动产生的现金流量净额	6,195,082,392.54	11,580,969,930.57	-46.51
其他综合收益	130,572,107.11	3,826,432.81	3,312.37
	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	311,282,608,938.94	291,117,441,584.43	6.93
负债总额	250,211,386,246.91	230,886,297,555.25	8.37
归属于母公司股东的权益	61,047,868,729.12	60,202,850,867.31	1.40
所有者权益总额	61,071,222,692.03	60,231,144,029.18	1.39

（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）	0.37	0.22	68.18
稀释每股收益（元/股）	不适用	不适用	不适用
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.36	0.21	71.43
加权平均净资产收益率（%）	4.60	2.80	增加1.80个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	4.47	2.64	增加1.83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	36,169,608,767.08	37,834,826,350.42
净资产	55,657,721,733.35	55,664,052,007.07
风险覆盖率(%)	228.02	229.94
资本杠杆率(%)	11.86	11.95
流动性覆盖率(%)	256.42	245.56
净稳定资金率(%)	141.16	151.06
净资本/净资产(%)	64.99	67.97
净资本/负债(%)	24.34	25.76
净资产/负债(%)	37.46	37.90
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	27.42	33.23
自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%)	342.05	327.05

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	-359,441.66	
计入当期损益的政府补助,但与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	114,868,857.44	财政扶持
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-19,978,513.89	主要是捐赠支出
其他符合非经常性损益定义的损益项目	105,039.38	
所得税影响额	-23,658,985.32	
合计	70,976,955.95	

十、 其他
 适用 不适用

按《证券公司年度报告内容与格式准则(2013年修订)》(中国证监会公告【2013】41号),公司合并财务报表和母公司财务报表主要项目会计数据。

(一) 合并财务报表主要项目

单位:元 币种:人民币

项目	2021年6月30日	2020年12月31日	增减幅度(%)
衍生金融资产	51,651,456.31	155,876,469.76	-66.86
应收款项	1,167,321,321.43	874,405,553.22	33.50
合同资产	0.00	1,741,886.80	-100.00
其他权益工具投资	6,096,378,358.59	10,936,457,571.84	-44.26
在建工程	37,152,494.19	65,838,524.98	-43.57
其他资产	6,256,027,877.00	2,137,999,709.85	192.61
资产总额	311,282,608,938.94	291,117,441,584.43	6.93
短期借款	4,148,571,185.09	579,732,185.45	615.60
应付短期融资款	4,691,930,367.56	16,255,485,786.37	-71.14
拆入资金	4,654,383,638.90	9,670,113,871.43	-51.87
衍生金融负债	978,080,029.00	504,956,696.48	93.70
代理承销证券款	120,499,979.00	346,000,000.00	-65.17
应交税费	394,915,618.70	782,814,613.10	-49.55
应付款项	1,228,431,981.12	576,584,579.01	113.05
合同负债	258,380,269.16	404,123,622.43	-36.06
其他负债	3,881,842,583.73	1,936,286,692.04	100.48
负债总额	250,211,386,246.91	230,886,297,555.25	8.37
其他综合收益	166,494,983.90	35,594,335.59	367.76
股东权益总额	61,071,222,692.03	60,231,144,029.18	1.39
项目	2021年1-6月	2020年1-6月	增减幅度(%)
营业收入	13,276,756,060.33	9,625,293,303.92	37.94
利息净收入	708,352,653.59	336,608,240.83	110.44
手续费及佣金净收入	4,424,984,341.56	2,817,250,323.92	57.07
投资收益	2,575,688,129.17	1,944,928,789.20	32.43
公允价值变动收益	89,744,588.77	1,015,589,268.07	-91.16
汇兑收益	104,668,961.49	78,067,628.10	34.07
其他业务收入	5,354,289,423.03	3,416,891,954.81	56.70
业务及管理费	4,749,664,071.05	3,188,445,812.35	48.96
信用减值损失	258,543,664.09	1,290,109,741.13	-79.96
其他业务成本	5,178,802,093.35	3,425,198,181.61	51.20
所得税费用	431,370,712.35	252,232,557.88	71.02

净利润	2,698,036,733.06	1,524,870,708.46	76.94
归属于母公司股东的净利润	2,700,359,705.45	1,526,023,784.18	76.95
其他综合收益的税后净额	130,572,107.11	3,826,432.81	3,312.37
经营活动产生的现金流量净额	6,195,082,392.54	11,580,969,930.57	-46.51

(二) 母公司财务报表主要项目

单位:元 币种:人民币

项目	2021年6月30日	2020年12月31日	增减幅度(%)
衍生金融资产	29,880,981.32	140,085,973.58	-78.67
应收款项	359,573,661.28	236,450,026.41	52.07
其他权益工具投资	6,048,554,377.39	10,868,377,303.52	-44.35
在建工程	23,248,552.02	49,090,408.01	-52.64
资产总额	233,076,884,830.94	228,615,067,514.28	1.95
应付短期融资款	4,691,930,367.56	16,255,099,446.23	-71.14
拆入资金	4,654,383,638.90	9,670,113,871.43	-51.87
衍生金融负债	969,081,236.86	486,364,134.27	99.25
应交税费	91,854,201.27	198,279,717.43	-53.67
应付款项	302,654,288.76	172,917,242.52	75.03
其他负债	2,432,867,347.51	779,855,226.10	211.96
负债总额	177,419,163,097.59	172,951,015,507.21	2.58
其他综合收益	333,319,735.20	178,831,351.45	86.39
股东权益总额	55,657,721,733.35	55,664,052,007.07	-0.01
项目	2021年1-6月	2020年1-6月	增减幅度(%)
营业收入	4,537,861,205.13	4,446,494,586.96	2.05
利息净收入	433,385,469.53	326,651,689.69	32.68
手续费及佣金净收入	1,434,861,738.73	1,096,372,701.45	30.87
公允价值变动收益	-199,448,753.29	695,554,811.15	-128.67
汇兑收益	120,554,350.89	26,661,675.88	352.16
业务及管理费	2,511,175,575.65	1,577,754,448.05	59.16
信用减值损失	252,837,936.75	1,288,483,665.02	-80.38
其他业务成本	1,036,915.70	2,152,999.91	-51.84
营业外支出	8,397,480.62	14,452,928.97	-41.90
所得税费用	-48,401,918.68	21,255,566.94	-327.71
净利润	1,830,215,611.70	1,545,246,316.42	18.44

其他综合收益的税后净额	149,368,065.33	301,198.28	49,491.27
经营活动产生的现金流量净额	2,200,627,608.78	6,778,882,709.28	-67.54

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

公司是一家经中国证监会批准设立的提供证券、期货、资产管理、投行、投资咨询及证券研究等全方位、一站式金融服务的综合类证券公司。经过多年发展，公司形成了自营投资、资产管理、证券研究等优势业务的业内领先地位。

报告期内，公司主要从事以下五大类业务：

• 投资管理

公司为客户提供资产管理计划、券商公募证券投资基金产品及私募股权投资基金管理。

- 公司通过全资子公司东证资管开展资产管理业务，提供包括集合资产管理、单一资产管理、专项资产管理和公开募集证券投资基金在内的完整的资产管理业务产品线。
- 公司通过持股 35.412%且作为第一大股东的联营企业汇添富基金为客户开展基金管理业务。
- 公司通过全资子公司东证资本从事私募股权投资基金管理业务。

• 经纪及证券金融

公司开展证券经纪业务和期货经纪业务，并为客户提供融资融券业务、股票质押回购业务、场外交易及托管业务等服务。

- 公司的证券经纪业务主要是通过营业部接受客户的委托或按照客户指示代理客户买卖股票、基金及债券。
- 公司通过全资子公司东证期货开展期货经纪业务，东证期货是上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、上海国际能源交易中心会员及中国金融期货交易所全面结算会员，为客户提供商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售等服务。
- 公司通过东证期货旗下全资子公司东证润和开展风险管理业务，通过期货、现货两个市场的仓单服务、基差贸易、场外期权帮助企业管理经营价格风险。
- 公司的融资融券业务主要是投资者向公司提供担保物，借入资金买入证券（融资交易）或借入证券并卖出（融券交易）。
- 公司的股票质押式回购交易业务是指符合条件的资金融入方将其持有的股票或其他证券质押给公司，从公司融入资金，并约定在未来返还资金、解除质押的交易。
- 公司为客户提供 OTC 金融产品，同时提供转让及做市报价等服务。
- 公司托管业务主要包括为私募基金、公募基金等各类资管机构提供资产托管和基金服务等。

• 证券销售及交易

公司的证券销售及交易业务以自有资金开展，包括权益类投资及交易业务、固定收益类投资及交易业务、金融衍生品交易业务、创新投资及证券研究服务。

- 公司从事专业的权益类投资及交易业务和固定收益类投资及交易业务，投资及交易品种包括各类股票、基金、债券、衍生品等，同时积极布局 FICC 业务。
- 公司开展金融衍生品交易业务，灵活运用衍生品工具和量化交易策略，以期获取低风险的绝对收益。
- 公司通过全资子公司东证创投从事另类投资业务，投资产品包括股权投资、特殊资产投资、量化投资等。
- 公司向机构客户提供研究服务，客户通过公司进行基金分仓，并根据公司提供的研究服务质量确定向公司租用专用单元交易席位以及分配的交易量。

• 投资银行

公司的投资银行业务主要通过公司固定收益业务总部和全资子公司东方投行进行。

- 公司提供股票承销与保荐服务，包括首次公开发行、非公开发行和配股等再融资项目的承销与保荐服务。
- 公司提供债券承销服务，包括公司债、企业债、国债、金融债等承销服务。
- 公司提供并购重组、新三板推荐挂牌及企业改制等相关的财务顾问服务。

• 管理本部及其他业务

公司的管理本部及其他业务主要包括总部资金业务及境外业务等。

- 总部资金业务主要包括总部融资业务和流动性储备管理。
- 公司通过全资子公司东方金控开展国际化业务，业务经营地位于香港。东方金控通过其全资子公司东证国际及各持牌公司经营由香港证监会按照《证券及期货条例》规管的经纪业务、资产管理业务、投资银行业务、保证金融资业务等。

2021 年上半年，我国受益于严格的疫情管控措施与稳中求进的政策步调，经济持续稳定恢复，势头良好，股票市场活跃度提升。报告期内，证券行业实现营业收入人民币 2,324.14 亿元，较上年同期提升 8.91%；实现净利润人民币 902.79 亿元，较上年同期提升 8.58%。营业收入方面，证券行业实现代理买卖证券业务净收入（含席位租赁收入）人民币 580.40 亿元，同比增加 10.95%；证券承销与保荐业务净收入 267.81 亿元，同比增加 21.13%；资产管理业务净收入人民币 144.68 亿元，同比增加 1.24%；证券投资收益（含公允价值变动）697.88 亿元，同比下降 0.69%。资本规模方面，证券行业资本实力稳步提升；截至报告期末，证券行业总资产为人民币 9.72 万亿元，净资产为人民币 2.39 万亿元，较年初分别增长 9.21%、3.46%。

报告期内，公司整体实力、行业地位保持稳定，财务状况良好。投资管理业务保持行业领先地位，财富管理转型迈入新台阶，投资银行业务排名稳步提升。公司严守风控底线，在证券公司分类评级中获评 A 类 AA 级，连续 13 年获得 A 类 AA 级或 A 级券商评级。

二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

公司核心竞争力主要体现在公司治理、人才队伍、业务能力、党建文化等方面。

1、完善的公司治理，持续的股东支持。

公司严格按照法律法规的要求建立规范的治理架构，特别是公司 A 股、H 股上市后，治理结构进一步完善，运作更加规范，确保股东大会、董事会、监事会和经营层各司其职、各尽其责。有效发挥党委的领导核心和政治核心作用，不断探索形成富有特色的治理机制。报告期内，公司完成新一届董事会、监事会的换届工作，领导班子完成架构调整，公司法人治理体系持续完善。

公司股东结构长期保持稳定，申能集团等股东对公司创新发展给予了持续且有力的支持，特别是近年来，在公司市场化机制改革、资本补充运作等重大事项上给予重点支持，保障了公司创新发展的可持续性。

2、专业优秀的人才队伍，与时俱进的人才机制。

公司人才队伍专业优秀。一是领导班子团结进取。公司高管团队从业经验丰富，对证券及金融行业拥有深刻的洞察，对企业发展有着正确的发展观、风险观和共同价值观。公司调整充实了领导班子和高管团队，并同步优化强化了激励约束考核机制。二是业务团队专业稳定。公司各业务团队具有多年积累的市场经验，专业能力突出，形成了多项业务品牌。三是人才队伍结构合理。公司既加强对领军型、高端型人才的吸引，又加强后备人才储备，员工队伍呈现高素质、年轻化、专业化特点，人员总量、岗位匹配、用工形式、人力成本之间结构更加均衡合理。

公司拥有与时俱进的人才机制。公司建立了较为明晰的员工发展通道，加强干部队伍年轻化建设，推进干部人才交流，加强干部人才梯队储备。公司高度重视人才市场化机制。近年来，公司先后实施员工薪酬市场化对标、财富管理事业部制改革、汇添富基金实施员工持股计划、上市公司 H 股员工持股计划等，公司人才机制保持与时俱进，不断激发人才活力。

3、优势业务较为突出，投资能力形成品牌。

公司业务牌照齐全，具有全功能全产业链的服务能力，其中投资能力尤为突出，资产管理、基金管理、固定收益投资、证券投资等投资管理业务一贯秉持价值投资理念，历经市场考验，长期业绩业内领先，享有较高的品牌声誉。

公司资产管理业务长期业绩优异，东证资管作为公司全资子公司，坚持“专业投研+专业服务”双核驱动，提升产品回报，资产管理业务收入连续四年在券商行业排名第一，近三年、近五年权益类、固定收益类基金绝对收益率继续保持行业领先，“东方红”品牌享誉市场。汇添富基金抓住公募基金行业爆发式增长机遇，非货币公募基金月均管理规模行业排名靠前，资产管理总规模突破万亿，“长三角一体化 ETF”项目获得上海金融创新奖；固定收益业务投资收益保持稳定，持仓结构优化，债券承销发行能力形成良好口碑；权益类投资长期业绩较好，业绩保持稳定；金

融衍生品业务在公司资产配置中发挥对冲风险管理作用，上半年该项业务获得中金所股指期货期权优秀做市商银奖。

4、创新转型上拓发展空间，合规风控下守稳健经营底线。

公司持续推动创新转型并已取得积极成效。公司创新资格齐备，创新收入占比始终高于30%的战略规划要求，部分创新业务已形成业内品牌效应与先发优势，不少创新业务项目先后获得各类创新奖项。公司长期重视体制创新工作，如落实上市公司H股员工持股计划、优化领导班子考核与激励约束机制等，近年来，加强集团协同创新，完善设定集团协同考核指标，集团协同机制更加健全。

公司秉承合规创造价值理念，落实全面风险管理，不断提升合规与风险管理工作的有效性，连续13年获评A类券商。落实财富管理业务条线穿透试点，制定投行业务试点方案，加强集团合规穿透管理；推进集团风控指标并表管理系统建设，启动同一业务同一客户归口管理，启动金融资产业务数据治理工作，加速推进母子公司系统对接。上半年未发生重大违规事项与风险事件，未发生信息系统安全事故，切实守住了稳健经营底线。

5、弘扬党建文化优势，党建与企业文化建设再上台阶。

公司高度重视党建和企业文化建设工作，始终坚持“党建和企业文化就是生产力”的理念，坚持以党建固本筑基，用文化凝心塑魂，坚持两手抓、两手都要硬。公司开展党史学习教育动员会，举办“伟大开端”中国共产党创建图片展，召开公司党史学习教育动员会暨党委中心组学习扩大会，组织实施2021年职工文化节。开展公司行业文化建设调研总结，完成公司2021年度ESG工作整体规划，推进“可持续发展委员会”成立，公司在中证协组织的证券公司文化建设实践评估中获得A类评价。公司党建企业文化工作卓有成效，为公司持续健康稳健发展提供强大的组织保障和精神动力。

三、经营情况的讨论与分析

2021年上半年，随着新冠疫苗接种范围扩大、宏观调控工具施行，全球经济迎来一定程度的复苏。在宽松的货币政策与供需缺口扩大的多重影响下，全球大宗商品价格持续上涨，带动上半年全球通胀大幅上升，美联储加息预期增强，全球宏观经济仍面临较多不确定性。其中，我国受益于严格的疫情管控措施与稳中求进的政策步调，经济持续稳定恢复，势头良好。报告期内，我国GDP达53.22万亿元，同比增长12.7%，两年平均增长5.3%。上半年，面临诸多外部不确定性，A股市场经历了大幅调整、整体微涨、分化显著，其中，上证指数上涨3.40%，深证成指上涨4.78%，创业板指上涨17.22%；交投活跃度持续提升，沪深股票日均成交额9,087.63亿元，同比增加19.89%；同时，债券市场维持区间震荡，10年国债收益率下行7bp至3.07%附近，中债总全价指数上涨0.24%。

适逢建党百年之际，公司上下秉持“稳增长，控风险，促改革”的经营策略，围绕“两提升、两稳固、一突破”等中心工作，立足岗位，真抓实干，努力实现了优异的业绩。公司提速财富管

理转型发展，深挖客户需求提升服务能力，稳步拓展机构金融服务，打造全业务链机构经纪服务体系。公司代销权益类产品规模显著提升，保有量规模超 500 亿元。公司获批公募基金投顾业务资格。公司固定收益业务投资规模稳定，持仓结构优化，外汇代客业务实现首单交易，农发债做市、国开债做市均位居全市场前二，国债期货做市业务获中金所优秀做市商金奖。公司资产管理优势持续巩固，业务规模再上新台阶，东证资管管理规模达 3,525.88 亿元，受托资产管理业务净收入行业排名第一，汇添富基金管理规模超 1.2 万亿元，综合实力稳居行业前列。东方投行行业排名显著提升，主承销的和辉光电项目创年内注册制融资规模纪录，联席主承销年内规模最大的金融债“21 浦发银行 01”，首次入围中国铁路建设债券承销团。东证期货发挥衍生品专业服务优势，不断拓展目标客户群体，获得历史最佳半年度经营业绩，ROE 创新高。

报告期内，公司积极开展资本补充工作，配股再融资项目取得阶段性进展，后续将稳步推进项目的进程。公司完成董监事会换届工作，优化公司领导班子成员激励约束考核机制，持续完善各部门、子公司绩效考核体系，加强干部选拔培养，深化能上能下机制。

公司强化合规风控一线责任要求，加强合规考核和合规问责，落实合规风控穿透管理试点，拟定合规风控垂直管理方案，启动公司分级授权决策等体系专项建设工作。集团风险并表系统上线，实现 T+1 日集团各项风险指标的动态监测。公司获评证券公司分类评价 A 类 AA 级，未发生重大违法违规事件。

公司有效发挥资产配置职能，统筹调度财务资源，主动运用资产负债配置工具支持业务创新发展。同时提升流动性管控水平，合理控制融资成本，流动性覆盖率和净稳定资金率符合监管要求。为进一步整合资源、提高效率，有效提升业务拓展与客户综合服务能力，审议通过公司吸收合并公司投行全资子公司。

公司加快科技赋能突破，融合引领取得良好进展，推进服务治理统一架构改造，持续建设金融科技大数据、人工智能、区块链等技术中台及共享能力中心。东方赢家 APP 新一代 5.0 架构实现了 6*24 基金销售及单向视频等重要功能。

公司大力推进行业文化建设，获评证券公司文化建设实践 A 类，成立“可持续发展委员会”，举办“碳中和愿景下的 ESG 投资”论坛。公司开展党史学习教育和“我为群众办实事”等实践活动庆祝建党 100 周年。

截至报告期末，公司总资产 3,112.83 亿元，较上年末增加 6.93%，归属于母公司所有者权益 610.48 亿元，较上年末增加 1.40%；母公司净资本 361.70 亿元，较上年末下降 4.40%；归属于母公司所有者的净利润 27.00 亿元，同比增加 76.95%。公司实现营业收入 132.77 亿元，其中投资管理业务 28.83 亿元，占比 20.56%；经纪及证券金融业务 79.52 亿元，占比 56.71%；证券销售及交易业务 20.56 亿元，占比 14.66%；投资银行业务 8.22 亿元，占比 5.86%；管理本部及其他业务 3.10 亿元，占比 2.21%。（分部业务营业收入、营业支出及其占比未考虑合并抵消因素，下同）

单位:元 币种:人民币

主营业务分业务情况						
分业务	营业收入	营业成本	营业利润率(%)	营业收入比上年同期增减(%)	营业成本比上年同期增减(%)	利润率比上年同期增减(%)
投资管理	2,882,525,565.44	1,218,578,279.80	57.73	70.63	34.85	增加 11.22 个百分点
经纪及证券金融	7,952,070,016.75	6,965,141,925.23	12.41	38.97	19.76	增加 14.04 个百分点
证券销售及交易	2,056,480,357.59	526,870,919.44	74.38	-22.48	27.19	减少 10.01 个百分点
投资银行	822,379,350.86	500,951,900.08	39.09	46.16	93.71	减少 14.95 个百分点
管理本部及其他	309,690,535.67	1,071,587,498.15	-246.02	不适用	84.41	不适用
主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业成本	营业利润率(%)	营业收入比上年同期增减(%)	营业成本比上年同期增减(%)	利润率比上年同期增减(%)
上海	462,736,081.77	288,395,981.45	37.68	20.80	36.72	减少 7.26 个百分点
辽宁	58,633,768.03	49,629,049.05	15.36	-4.99	10.39	减少 11.79 个百分点
广东	44,044,809.00	61,553,076.89	-39.75	20.57	37.16	减少 16.90 个百分点
浙江	38,528,633.05	57,564,548.44	-49.41	27.59	42.81	减少 15.93 个百分点
广西	32,241,540.39	31,700,495.74	1.68	-1.35	29.51	减少 23.42 个百分点
其他地区分支机构	188,925,203.57	363,378,435.47	-92.34	23.88	53.24	减少 36.85 个百分点
公司总部及境内子公司	12,934,791,214.05	9,339,234,987.85	27.80	34.47	28.60	增加 3.30 个百分点
境内小计	13,759,901,249.86	10,191,456,574.89	25.93	33.38	29.58	增加 2.17 个百分点
境外子公司	216,372,547.01	94,802,722.94	56.19	不适用	-15.11	不适用
抵消	-699,517,736.54	-45,959,896.11	不适用	不适用	不适用	不适用
合计	13,276,756,060.33	10,240,299,401.72	22.87	37.94	28.84	增加 5.45 个百分点

(1) 投资管理

公司为客户提供资产管理计划、券商公募证券投资基金产品及私募股权投资业务。报告期内，投资管理业务实现营业收入人民币 28.83 亿元，占比 20.56%。

资产管理

公司主要通过全资子公司东证资管开展资产管理业务。

市场环境

2021 年上半年，全球经济在波动中延续复苏势头，中国经济继续保持稳定恢复态势；A 股整体呈现宽幅振荡行情，各板块表现分化，上证指数累计微涨 3.4%，创业板指累计涨幅达 17.22%；债券市场收益率震荡下行，整体表现平稳。公募基金募集节奏跟随市场行情跌宕起伏，募集规模创出同期历史纪录，头部效应愈发显著；证券公司加速资管子公司落地，谋求公募牌照；贝莱德发行首只公募基金，标志着内外资管机构已进入到了同台竞技的新时代。行业竞争日益激烈，资管新规下各类型资管机构聚焦核心业务力求破局。

经营举措及业务发展

2021 年上半年，东证资管积极应对行业发展形势，持续加强投研能力建设，充实专业服务团队力量，继续巩固优势领域，加大权益类基金布局，推动固收业务稳步发展，完善普通 FOF 产品线，有序推进大集合公募化改造工作，公司盈利能力持续强劲，管理规模实现新的突破。截至报告期末，东证资管受托资产管理总规模人民币 3,525.88 亿元，其中公募基金管理规模人民币 2,602.03 亿元；旗下长期封闭¹权益类基金²规模达到人民币 1,031 亿元，占东证资管所有权益类基金规模达到 63%。2021 年上半年，公司受托资产管理业务净收入行业排名第 1 位（数据来源：中国证券业协会）。

东证资管始终践行价值投资理念，以为投资者创造更好的投资体验为目标，专注提升“专业投研+专业服务”双轮驱动的核心竞争力，长期投资业绩保持行业前列，为客户实现资产的长期保值增值。截至 2021 年 6 月 30 日，东证资管近七年股票投资主动管理收益率 538.52%，近五年股票投资主动管理收益率 206.21%，排名均位于行业首位（数据来源：银河证券基金研究中心——基金管理人股票投资主动管理能力长期评价榜单）。东证资管旗下固定收益类基金近五年绝对收益率 28.22%，排名位于行业第十（数据来源：海通证券研究所金融产品研究中心——基金公司权益及固定收益类资产业绩排行榜）。

下表载列东证资管按产品类型划分的资产管理规模：

（人民币百万元）	截至 2021 年 6 月 30 日	截至 2020 年 12 月 31 日
集合资产管理计划	61,723.41	59,251.52
单一资产管理计划	17,458.94	27,333.53
专项资产管理计划	13,202.45	12,332.00
券商公募基金	260,203.32	199,631.24
合 计	352,588.12	298,548.29

¹ 长期封闭基金指封闭运作期在三年及以上的定期开放基金和封闭运作基金（处于封闭期），以及投资者最短持有期限在三年及以上的持有期基金。

² 权益类基金指 Wind 分类口径下的普通股票型、混合型（不含偏债混合型）基金，不含基金中基金。统计时间截至 2021 年 6 月 30 日，数据来源于公募基金季报和 Wind。

东证资管荣获包括 Insights & Mandates《投资洞见与委托》“China A-share Equity (3 Years) 中国 A 股基金(3 年)投资表现大奖”、《上海证券报》第十八届中国基金业“金基金奖”榜单“金基金 TOP 公司奖”等在内的多项行业殊荣。

发展规划与展望

未来，东证资管将升级进化投资研究体系，进一步强化投研一体化优势；点面结合加强客户开发，拓展服务广度和深度；继续大力发展公募业务，完成所有大集合公募化改造工作，推动资产配置类业务、Smart Beta 指数新产品布局，不断丰富产品谱系；结合品牌优化升级加大品牌投放，提升品牌覆盖率和感知力；持续加强人才梯队建设，构建具有吸引力和市场竞争力的机制；切实提高合规风控水平，在稳健经营中探索公司发展新动能、新突破。

通过汇添富基金进行的基金管理

公司主要通过持股 35.412%且为第一大股东的联营企业汇添富基金开展基金管理业务。

市场环境

2021 年上半年，中国经济在高效疫情防控的基础上持续复苏，资本市场改革加快推进，金融双向开放进程不断提速，数字化赋能行业创新变革愈加凸显，居民理财需求持续释放，资产管理行业正处于蓬勃发展的新起点，面临巨大的发展机遇。

经营举措及业务发展

报告期内，汇添富基金持续推进业务战略，按照 2021 年经营计划及“数字化提升年”的要求，全面增强投资管理、风险管理、客户服务和产品创新等核心能力。截至报告期末，汇添富基金资产管理总规模突破人民币 1.2 万亿元。其中，公募基金规模超人民币 9,500 亿元，较年初增长 14%；二季度末非货币理财公募基金月均规模达人民币 6,058.15 亿元，排名行业前列。汇添富基金各项业务取得全面发展，进一步完善多策略产品体系，发行成立 21 只公募基金，新发规模超人民币 670 亿元；与理财子公司等机构客户合作进一步深入，全渠道战略进一步推进，电商业务取得创新发展；继续推进养老金业务、ESG 责任投资等战略业务布局，基金投资顾问业务试点方案已获得中国证监会无异议复函。

报告期内，汇添富基金中长期投资业绩保持优异，综合实力稳居行业前列，荣获《上海证券报》第十八届中国基金业“金基金奖”榜单“海外投资回报基金管理公司奖”“社会责任投资(ESG)基金管理公司奖”、上海市文明单位等多个奖项。

发展规划与展望

未来，在内外环境发生深刻变化、资本市场结构性表现延续的背景下，资管行业发展将面临更大的机遇和挑战。其中，投资管理能力突出、综合实力领先的头部资产管理机构将在行业竞争中更具优势。汇添富基金将继续践行证券基金行业“合规、诚信、专业、稳健”的文化建设要

求，秉持一切从长期出发的经营理念，坚持客户第一，持续锤炼投资管理、风险管理、客户服务、产品创新四大核心能力，夯实基础，拥抱变革，努力打造中国最受认可的资产管理品牌。

私募股权投资

市场环境

2021 年上半年，市场逐步适应了疫情常态化防控以及国际局势变化的压力，整体体现出回暖的态势。国内全面建设小康社会、“十三五”计划完美收官，也使各机构对整个国内市场持更加乐观的态度。募资市场同比有所上升，募资的两极分化程度有所扩大，募集金额小于 1 亿人民币的基金占比升高，人民币市场的募资困难仍然存在；投资方面，投资热度依然相对集中于生物技术/医疗健康、半导体及电子设备、互联网、IT 等行业，股权投资的科创氛围日益浓厚。

经营举措及业务发展

截至报告期末，东证资本在管基金 51 只，管理规模约人民币 167.87 亿元；东证资本及其管理的基金累计投资项目 208 个，累计投资金额约人民币 267 亿元，其中共有 60 个项目实现退出；在投金额约人民币 99.96 亿元，投资项目 148 个；储备项目 3 个。

近年来，在新冠疫情持续影响、强监管态势延续以及国资监管加强的背景下，东证资本依托母公司的全面合规风控管理，在优化运营管理、增加合规性运营、加强风险控制管理等方面都有所进步，在国有资金 LP 方面建立起了一定的信任感和品牌。另外，自科创板开板以及创业板注册制以来，东证资本管理之私募股权投资基金所投资的项目中有 14 家企业申报了科创板 IPO（2021 年上半年新申报 1 家），其中 9 家成功上市；有 9 家标的企业申报了创业板 IPO（2021 年上半年新申报 2 家），其中 3 家已完成上市，3 家已通过上市委员会审议。

报告期内，东证资本荣获投中 2020 年度“中国最佳私募股权投资机构 TOP100”“中国最佳中资私募股权投资机构 TOP50”“中国最佳券商私募基金子公司 TOP10”等荣誉。

发展规划与展望

2021 年下半年，东证资本将继续积极努力，做好做强东证资本私募股权投资基金管理的品牌，把握国家战略机遇，深入发掘企业价值。进一步加强合规化水平，提高风险控制能力，持续做好各项整改工作，在投资风险和投资收益中探寻平衡点，不断提升业务素养。

(2) 经纪及证券金融

公司经纪及证券金融板块主要包括证券经纪业务、期货经纪业务、大宗商品交易以及包括融资融券和股票质押式回购在内的证券金融业务等。报告期内，经纪及证券金融业务实现营业收入人民币 79.52 亿元，占比 56.71%。

证券经纪

公司经纪业务主要依托财富管理业务总部及下设分支机构开展。

市场环境

2021 年上半年,伴随着经济持续复苏与货币市场流动性相对充足,股票市场交投活跃度持续,股基成交额达人民币 115.73 万亿元,同比增长 22.21%。以注册制改革为引领的资本市场全面深改打开了券商财富管理业务发展空间,权益市场投资偏好提升带来增量资金入市,券商主动顺应行业发展趋势,财富管理转型初见成效,行业呈现稳步上升趋势,特别是具备财富管理业务特色的券商在资本市场改革和行业发展新趋势下储备了更好的竞争优势。

经营举措及业务发展

报告期内,公司积极推进经纪业务向财富管理转型,从渠道管理和存量客户服务方面入手,全面升级服务方案,实现了高质量发展。截至报告期末,公司共有证券分支机构 177 家,覆盖 87 个城市,遍及国内所有省份。2021 上半年,公司证券经纪业务收入市占率 1.76%,行业排名第 21 名,较去年同期增长 14.41%。报告期内,公司累计新增开户数 21.01 万户,同比增长 58.06%。截至报告期末,公司客户数为 204.66 万户,较期初增长 11.15%,托管资产总额人民币 8,595.28 亿元,较期初增长 17.72%。

集中精力发展金融产品代销业务,市场排名及业绩贡献攀升。自财富管理业务总部成立以来,公司将金融产品代销及金融产品体系建设作为财富管理工作的核心内容,持续加大对产品代销的支持力度。一方面,公司持续跟踪和走访公募、私募和 WOFE 等优秀管理人,与核心头部和特色成长型管理人建立良好的合作关系。另一方面,公司重视提升产品代销节奏感,推动产品准入科学化、细化并完善各项代销工作节奏链,提升人才队伍专业性,不断挖掘一线员工产品代销积极性。报告期内,公司权益类产品销售规模人民币 177.13 亿元,同比增长 139.2%,产品相关收入达人民币 4.76 亿元,其中代销收入人民币 2.99 亿元,同比增加 159%。公司坚持长期投资、价值投资理念,引导客户提升持有周期,截至报告期末,主动管理权益类产品保有规模达到人民币 506.49 亿元,较期初增加 30.53%,含 ETF 权益类产品保有规模达到人民币 561 亿元,较期初增加 18.11%;根据基金业协会数据,公司股票+混合公募基金保有规模人民币 494 亿元,在券商中排名第 5 位。报告期内,顺利获批公募基金投顾业务资格,待监管机构验收通过后,将尽快开展业务。

下表载列所示期间集团代理销售金融产品的种类及金额(包括场外交易(OTC)产品):

(人民币百万元)	2021 年 1-6 月	2020 年 1-6 月
公募基金(含货币类)	78,065	75,957
券商集合理财产品	33	1
信托计划	1,363	1,362
私募基金产品	1,946	356
其他金融产品	518	3,196
合 计	81,925	80,872

拓展机构客户，打造全业务链机构经纪服务体系。报告期内，公司成功举办“东方证券全业务链机构经纪服务发布会”，统筹财富管理、研究、交易、衍生品、托管、系统科技等业务资源，打造机构客户全业务链的服务生态，并通过构建机构客户共享协同计划，集中资源提升公司服务机构客户的能力。此外，公司上线“东方睿御”风险预警系统，为机构客户提供企业财务预警服务。报告期内，公司积极拓展客户基础，深化 WFOE 及 QFII 客户服务，新增多家优质量化私募的深度覆盖，与多家信托公司建立业务联系，截至报告期末已完成近 400 家机构客户的覆盖。

创新高净值客户服务模式，发力私人财富业务。公司于 2020 年末在财富管理业务总部下正式设立私人财富部，专注为高净值客户提供一站式综合金融服务。报告期内，私人财富部紧跟高净值客户服务需求，重点围绕投资研究、私募产品、家族办公室和线上服务等功能搭建专业人才队伍，在部分分支机构试点向高净值客户推出“美丽东方-财富 100”资产配置服务和家族办公室服务并完成首单签约，旨在以财富规划为抓手，以个性化服务场景为依托，以 1+N 为服务模式，为高净值客户提供高质量、定制化高端财富管理服务。截至报告期末，公司零售端高净值客户数量较期初增长 14.15%，高于公司客户总数增速。

互联网金融方面。报告期内，公司全新升级统一移动门户东方赢家 APP 的核心业务功能，依托数字化运营和场景构建，建立客户分层管理和服务体系；致力数字化产品创新和数据价值挖掘，打造以“赢家百宝箱”为品牌的投资决策工具体系，形成特色增值服务；科技赋能，构建数字化共享能力，提高客户服务效能。截至报告期末，公司在互联网及手机平台拥有活跃经纪客户 52 万余人，股基交易额人民币 2.02 万亿元；通过互联网及手机移动终端进行交易的客户数占总客户数 99%，线上交易额占比 84%，线上新增开户数占同期全部开户数 99%。

发展规划与展望

未来，公司将进一步优化客户分层，实现对客户需求更细颗粒度的定位，全面提升经营方案与用户匹配的精准度与有效性。公司持续加强金融科技应用和客户运营，全面拥抱数字时代，促进业务的转型发展。在金融产品业务方面，完善产品严选三维评价模式，持续增强产品设计和定制能力，构建精品化、差异化、有竞争力的产品线，提高产品客户渗透率和转化率。在机构经纪业务方面，以主经纪商业务为抓手，推进定制化交易业务和交易执行服务，快速拓展客户规模和 AUM，持续布局外资机构 WOFE 业务，获得与海外优秀投资机构共成长、共赢的业务空间。在私人银行业务方面，结合自身资源禀赋，强化和引入高端人才，提供全面的财富管理、财富规划、财富融资服务。

在基金投顾业务方面，公司将以取得基金投顾业务牌照为契机，再度深化改革，围绕客户长期利益有效增值进行系统性和全局性产品体系建设。在千人千面基础上不断改善客户体验，在营业部层面进行更加精细化的营销管理，全力以赴成为专业、纯粹和具有行业责任的财富管理机构。

期货经纪

公司通过全资子公司东证期货开展期货经纪业务。

市场环境

2021 年上半年，国内期货市场继续保持高速发展水平，受经济复苏和疫情抑制供给带来的双重因素影响，大宗商品价格上半年普遍上涨，对风险管理的需求刺激了市场成交大幅上升。报告期内，全市场累计成交量和成交额分别同比增长 47.37% 和 73.05%，其中成交额已经接近 2019 年全年水平；全市场客户权益规模在二季度首次突破万亿元，接近人民币 1.1 万亿元。同时，行业头部效应持续凸显，排名前十的期货公司成交规模超过全行业 40%。

经营举措及业务发展

在行业大发展的背景形势下，东证期货创造了半年度的历史最佳经营业绩，半年度 ROE 达到 7.17%。报告期内公司发挥衍生品专业服务优势，不断拓展目标客户群体，上半年新增机构开户共计 855 个，其中公募基金 86 个、私募基金及证券 481 个、保险 49 个、产业 229 个，其他机构 10 个。截至上半年末，东证期货机构客户权益人民币 439.97 亿元，较期初增长 29%。移动金融业务蓬勃发展，上半年互联网业务开户数 9,244 个，同比增长 23.51%；APP 新增注册数 76,536 个，同比增长 148%。资产管理业务规模稳步增长，截至报告期末，资产管理业务规模人民币 120.96 亿元，较期初增长 16%。

报告期内，公司按成交量口径的全市场占有率排名行业第一，这离不开东证期货通过技术、研究双核心竞争力累积多年优势，信息技术系统和研究实力在行业保持领先地位，并在机构业务领域深耕多年，品牌形象逐步推广。报告期内，东证期货将已有的繁微数据中心和数行科技公司的移动大数据整合结合，发挥协作优势，完成了繁微整体品牌包装宣传，并在二季度成功举办线上发布会。技术方面，公司积极调整高速交易柜台系统的布置，着力提升配置、变更管理与应急处置的能力，促进程序化系统的有效安全运作。

报告期内，东证期货荣获上海期货交易所“优秀会员金奖”、上海国际能源交易中心“优秀会员”、中国金融期货交易所“优秀会员白金奖”、大连商品交易所“优秀会员金奖”、郑州商品交易所“优秀会员”等奖项。

发展规划与展望

下半年，东证期货将加大投入，推进公司前中后台数字化转型，将金融科技嵌入公司全局发展。公司将坚持以金融科技助力衍生品发展为主线，通过大数据、云计算、人工智能、区块链等金融科技手段打造研究和技术两大核心竞争力，坚持市场化、国际化、集团化发展方向，朝着建设一流衍生品服务商的目标继续前行。

证券金融

市场环境

报告期内，随着融资融券标的扩容、市场活跃度提升，融资融券规模持续增长。截至报告期末，全市场融资融券余额人民币 17,842.03 亿元，较上年末增长 10.20%，余额创下近六年来新高。其中融资余额人民币 16,281.56 亿元，较上年末增长 9.86%；融券余额人民币 1,560.47 亿元，较上年末增长 13.92%。

报告期内，全市场股票质押规模持续保持下降趋势。根据证券业协会统计，截至报告期末，全市场自有出资股票质押规模人民币 2,648.63 亿元，较上年末下降 11.98%。

经营举措及业务发展

融资融券业务方面，公司积极把握市场机遇，通过拓展融券券源渠道、聚焦机构客户与高净值客户，持续优化业务及客户结构。同时进一步完善风险管理体系，实现业务发展与风险控制的有机结合。截至报告期末，公司融资融券余额人民币 249.43 亿元，较上年末增长 10.54%，市占率提升至 1.40%，维持担保比例高于市场平均水平。

股票质押业务方面，公司继续贯彻落实“控风险、降规模”的工作思路，持续推进股票质押业务规模压缩与风险处置工作。截至报告期末，公司股票质押业务余额人民币 137.51 亿元，均为自有资金出资，较上年末下降超过人民币 16 亿元，规模得到有效压缩。

发展规划与展望

未来，公司将积极把握资本市场改革机遇，在巩固原有优势的基础上，优化业务结构、精细业务管理、提升风险管理效能，推动融资融券业务稳健发展；持续加大力度推进股票质押业务分策清退及风险化解工作，稳步压降股票质押业务规模。

其他业务

场外业务

报告期内，证券市场维持震荡。同时，处于资管新政实施的过渡期最后一年，资产端风险事件频频发生，带动类固收产品的收益率持续走低，在严监管政策延续的环境下，业务和产品的创新空间有限。

报告期内，公司场外业务适应市场变化，在完善 OTC 平台功能的基础上，积极支持和服务公司财富管理业务，打造公司产品中心、构建产品中台，包括：拟定产品中心建设方案、建设金融产品管理系统、实现场外产品交易的集中管理提升客户服务、新增外部系统联通对接等；创新业务方面，积极协同落地公司代客外汇业务。报告期内，由于开放式基金并入场外，公司场外业务总体规模同比大幅增长，达到人民币 915.02 亿元，其中原 OTC 系统业务规模人民币 134.52 亿元；推进集团协同，对接公司融资需求，发行收益凭证 96.81 亿元，积极为营业部提供产品定制及交易服务。

未来，公司场外市场业务将以配合财富管理业务为重点，持续围绕建设公司产品中心、打造产品中台为基础、以服务为手段、以集团协同为导向、以合规为底线，不断推进业务的发展。

托管业务

报告期内，公募基金、私募基金总规模持续攀升，继续保持增长势头，伴随着多家券商申请基金托管牌照，行业竞争格局进一步加剧。

报告期内，公司持续强化线上特色增值服务质量，拓展业务协同外延，充实综合服务内涵。全面构建托管业务总部集团内的线上“托管+”生态链，催生业务合作新机遇。与此同时，挖掘公司内部业务交互合作机会，为外部机构客户提供与财富管理业务总部、证券金融业务总部、金融衍生品业务总部和子公司的业务对接，深化公司部门间业务的有机整合。报告期内，公司业务规模、产品数量、客户数量分别较年初增长 18.14%、19.28%、7.10%，其中证券类业务规模增长了 42.83%。同时，公司产品结构逐步优化，证券类产品在托管外包的产品占比提升 8.38%，达到 48.48%。

未来，公司将继续落实以“稳增长，控风险，促改革”的经营策略为导向，客户服务为动力，金融科技为手段，合规风控为底线的方针，大力发展“托管+”综合金融服务生态链，动态优化运营服务能力，巩固产品全生命周期风险控制和业务内控能级。

（3） 证券销售及交易

公司的证券销售及交易业务以自有资金开展，包括自营交易（权益类投资及交易、固定收益类投资及交易、金融衍生品交易）、创新投资及证券研究服务。报告期内，证券销售及交易业务实现营业收入人民币 20.56 亿元，占比 14.66%。

自营交易

市场环境

2021 年上半年，全球疫情反复、中美关系面临挑战、美联储货币政策转向势头已现，全球风险资产承受压力。报告期内，受益于疫苗接种的推进和宏观经济政策的持续支持，我国经济持续健康恢复，就业物价总体稳定，主要宏观指标处于合理区间；资本市场方面，“碳中和”等长期重磅政策推出，公募 REITS 首批试点落地，市场关注度更加集中，投资标的分化显著。

报告期内，面临诸多外部不确定性，A 股市场经历了大幅调整、整体微涨，其中，上证指数上涨 3.40%，深证成指上涨 4.78%。货币政策以稳为主，重在调结构和防风险，债券市场维持区间震荡，报告期内，10 年国债收益率下行 7bp 至 3.07%附近，中债总全价指数上涨 0.24%。

经营举措及业务发展

下表载列集团按资产类别划分的自营交易业务余额：

(人民币百万元)	截至 2021 年 6 月 30 日	截至 2020 年 12 月 31 日
股票	8,226.00	7,472.66
基金	2,552.26	3,139.66
债券	94,152.68	83,051.22
其他 ^(注)	2,268.11	2,328.19
总 计	107,199.05	95,991.73

注：主要包括使用自有资金对资产管理计划及财富管理产品进行的投资。

权益类自营投资方面。报告期内，公司以自下而上的选股思路，集中资源研究财务稳健且具有优质管理水平的标的公司，严控回撤、持仓平衡，投资收益超越主要市场指数。此外，公司构建指定类高分红投资策略，并布局公募 FOF、私募 FOF、量化策略自研投资等创新领域，着力提升收益的稳定性。

新三板业务方面。公司持续优化新三板项目处置，推动优质企业 IPO 及精选层申报。截至报告期末，公司新三板持仓中已上市项目 2 个、IPO 过会项目 4 个、IPO 辅导项目 1 个，另有多个项目已进入精选层或符合精选层公开发行条件。

FICC 业务方面。报告期内，公司加强投研协同，夯实核心竞争力，自营业务的规模和业绩继续保持行业领先地位。

- 债券投资方面，公司在加强债券信用风险管理的同时及时调整仓位结构，坚持配置为主，交易为辅的投资策略。报告期内，银行间市场现券交易量同比增长 16%、利率互换交易量同比增长 29%，银行间市场现券交易量、利率互换交易量规模均位于证券公司前列。
- 做市方面，公司成为银行间债券市场做市业务新老规则过渡转换之后首批做市商，积极更新报价策略，至今运行良好。报告期内，公司银行间市场做市成交量同比增长 23%，债券通成交量同比增长 43%，做市业务排名继续保持行业领先。其中，公司国开债做市业务排名全市场前二，农发债做市业务排名全市场前二，国债期货做市业务获得中金所颁发的年度国债期货优秀做市商金奖第一名。
- FICC 创新转型方面，公司黄金大宗业务规模提升，黄金套利交易，黄金 ETF 做市、金交所竞价交易、收益凭证发行均平稳发展；公司外汇业务进一步完善相关系统、制度和团队建设，加强与监管沟通，实现首单代客外汇业务落地，并取得良好反响。报告期内，公司荣获上海黄金交易所 2020 年度优秀特别会员、年度最佳产品推广贡献机构、年度最佳租借业务参与机构、年度优秀交易员等奖项及荣誉称号。

衍生品业务方面。报告期内，公司紧密围绕 ROE 指标，进行资源优化配置，基本面量化业务、做市业务和场外衍生品业务实现了稳健发展。其中，基本面量化业务紧密跟踪市场风格、及时调整规模与持仓结构，收益率与公募量化对冲基金相比排名居前。做市业务方面，公司拥有上市基金、上证 50ETF 期权、沪深 300ETF 期权、中金所股指期货、白银期货、螺纹钢期货等多个品种的做市商资格，成功入选市场上首批公募 REITs 做市商，整体取得了较好的做市收益。场外衍生品方面，公司不断优化系统建设，场外期权名义本金规模同比增长超 300%，并积极开展收益凭证业务。报告期内，公司荣获中金所“2020 年度股指期货优秀做市商银奖”、上期所“2020 年度做市业务银奖”。

发展规划与展望

权益类自营投资方面。公司将在做好微观的基本面研究的前提下，加大宏观的研究和预判，以灵活的投资策略为主，提升投资策略的前瞻性、多元性，不断优化收益率表现。

新三板业务方面。公司将继续推进新三板项目管理，提升资产回收效率，并有序开展精选层及其他新三板股票投资工作，参与混合做市改革，力争抓住改革机遇提高投资收益。

FICC 业务方面，公司将进一步深化投研工作、扩大客户范围，推动固定收益业务向销售交易和代客展业转型，推动 FICC 业务链完善，提高中间收入占比。

金融衍生品业务方面。公司将稳步发展基本面量化业务，在保证策略 ROE 的同时，有效控制回撤；继续优化做市系统，提高收益，降低波动；提高场外衍生品对冲能力、产品设计能力及模型研究能力，持续推进场外期权一级交易商申请工作。

创新投资

公司通过全资子公司东证创投开展另类投资业务。东证创投业务主要涉及特殊资产收购与处置、股权投资、量化投资等方面。

市场环境

在特殊资产业务方面，不良资产市场的供给和需求同步扩大，资产端的价格有望持续走低；市场参与主体从“4+2”向“4+2+N”转型，债转股等处置手段登上舞台，知名外资机构纷纷参与。股权投资方面，以往以一、二级市场价差为主要投资逻辑的 Pre-IPO 纯财务投资机会和盈利空间将越来越少，产业资本的影响力将进一步提高；同时，随着多层次资本市场形成，退出的效率与渠道不断增加。量化投资方面，优秀的外资资管机构进入，国内量化龙头涌现，行业发展高歌猛进，规模一路飙升。

经营举措及业务发展

东证创投资产配置聚焦于量化投资、特殊资产业务和股权投资业务三个方面，结合每一大类的投资周期与风险水平不断优化配置结构，提升收益的稳定性，在报告期内取得了较好的业绩。

稳步推进特殊资产收购与处置业务。报告期内，东证创投特殊资产业务新增投资人民币 8.66 亿元。截至报告期末，特殊资产业务存量项目 24 个，存量规模人民币 30.7 亿元。

稳步开展股权投资业务。截至报告期末，公司股权业务项目存量个数 49 个，投资规模人民币 16.90 亿元，通过跟投制度提升风险管理效率。此外，东证创投积极参与公司科创板战略配售，累计跟投科创板合计 6 个、规模人民币 3.54 亿元。

拓展量化对冲基金投资。公司与优秀的量化机构合作，全年配置灵活调仓的量化私募基金，跟踪产品表现并适时调整投资方案；同时，对市场上优秀的管理人进行研究与尽调，优化投资效果。

发展规划与展望

随着资产布局基本完成，东证创投将进入管理的精细化和业务的专业化阶段。

特殊资产业务中，东证创投将积极提升渠道优势，在并购、重组、全链条一体化等领域构建综合运营能力，夯实核心竞争力，进而提升 ROE 和资本回报。股权投资方面，东证创投将锁定精品投行赛道，深挖 TMT、医药、新材料等行业，重质不重量，实现风险可控下的较高投资收益，同时做好科创板跟投等工作。量化投资方面，东证创投将积极把握优秀外资管理机构进入市场的机会，动态管理调整，降低组合风险，提高收益率。

证券研究

市场环境

证券研究业务竞争日趋激烈，市场新进入者层出不穷，优质的研究实力是制胜关键。公司始终贯彻外部佣金与内部服务并重的战略，在竞争激烈的佣金分仓市场中稳扎稳打，实现了较好业绩；同时着力服务公司各业务部门，构建内部协同布局。

经营举措及业务发展

截至报告期末，公司证券研究业务共有研究岗位人员 83 人，具备分析师资格 63 人，具备投顾资格 26 人，报告期内共发布各类研究报告 1,061 篇。公司扎实做好基本面深度研究，创立并不断深化战略研究，力求在相关领域培育新的竞争优势。报告期内，在稳固原有公募客户市场研究排名的同时，积极开拓新的公募和非公募客户。

外部佣金方面，公司深耕公募市场，以机构客户为基础，努力提升市占率水平，同时增加客户覆盖，积极开拓非公募客户。报告期内，研究所实现佣金收入人民币 3.67 亿元。其中，公募佣金（含专户、社保、年金席位）收入人民币 3.33 亿元，同比增长 58%，市占率为 3.06%，在核心公募基金客户的研究排名持续提升。报告期内，新增公募客户 3 家，银行客户 2 家，私募、保险及其他客户 24 家，全面覆盖新成立的银行理财子公司。

内部协同方面，研究所与公司多个业务条线确立合作方案，以研究促进投行、财富管理等多项业务发展，探索企业客户的服务路径，通过内部协同为更广义的产业资本提供高价值服务。

发展规划与展望

未来，公司将继续强化研究业务的核心竞争力，提升外部佣金的获取能力；同时以研究为抓手，积极发挥集团协同作用，为各类客户提供综合金融服务。

(4) 投资银行

公司主要通过全资子公司东方投行及公司固定收益业务总部从事投资银行业务。东方投行主要从事股票和公司债券的承销与保荐、企业债和资产支持证券的承销、并购重组、新三板推荐挂牌及企业改制等相关的财务顾问服务；固定收益业务总部主要从事国债、金融债等承销服务。报告期内，投资银行业务实现营业收入人民币 8.22 亿元，占比 5.86%。

股票承销

市场环境

报告期内，得益于国内经济稳步复苏以及注册制进一步发挥积极影响，股权资本市场投资热情旺盛。根据 Wind 数据，2021 上半年全市场首发上市 245 家企业，同比大幅增长 105.88%，IPO 融资规模人民币 2,109.50 亿元，同比增长 51.46%；增发家数 232 家，同比增长 90.16%，融资规模人民币 3,679.67 亿元，同比增长 3.10%。

经营举措及业务发展

东方投行充分发挥集团公司资源优势，抓住注册制的良好机遇，致力服务实体经济，迅速提升了投行业务的行业地位。报告期内，东方投行完成股权融资项目 13 个，同比增长 160.00%，主承销金额人民币 208.47 亿元，同比增长 258.84%。

公司 IPO 项目承销 6 家，同比增长 200.00%；承销规模总计人民币 111.08 亿元，同比提升 545.37%，超过去年全年之和，排名行业第五位。其中，东方投行独家保荐的和辉光电项目在科创板顺利上市，创下了报告期内注册制融资规模记录，是科创板设立以来实际募资规模第三的项目。公司主板、创业板及科创板储备及申报项目多面开花，数量也呈现良好的增长势头。再融资方面，报告期内公司非公开发行及配套融资主承销项目共 7 家，承销规模人民币 97.39 亿元，同比增长 138.21%。其中不乏三七互娱、密尔克卫等行业代表项目。

同时，东方投行严格把关项目质量控制和风险控制，报告期内公司保荐 IPO 项目过会率 100%，且不存在取消审核或暂缓表决情况。报告期内，东方投行荣获《证券时报》“最受上市公司尊敬的成长性投行”、“最受上市公司尊敬的资本市场部（股权）”等荣誉，得到了社会各界的广泛认可。

下表载列公司担任主承销商的各类股权融资交易明细：

(人民币百万元)	2021 年 1-6 月	2020 年 1-6 月
首次公开发行：		
发行次数	6	2
主承销金额	11,108.26	1,721.23
再融资：		
发行次数	7	3
主承销金额	9,738.56	4,088.30

合计:		
发行次数	13	5
主承销金额	20,846.82	5,809.53

发展规划与展望

2021 年下半年，东方投行将坚持“现代投资银行”战略，充分把握东方证券吸收合并的机会进行资源联动，稳固提升投行业务的行业地位；认真落实各项规则要求，切实履行中介机构责任，做好资本市场“看门人”，坚定服务实体经济和保护投资者利益的决心，为推动全行业高质量发展做出贡献。同时，为应对注册制的改革方向，东方投行将加强医药医疗、互联网服务、电子、高端装备制造等行业团队建设，打造基于行业的客户覆盖与项目执行能力。

债券承销

市场环境

2021 年上半年，经济见顶回落，行业和企业分化加大，宏观政策重心逐步转向稳增长，货币政策稳中偏松，信用债收益率全面下行，非金融类信用债发行和净增量均出现回落。报告期内，各类债券发行共人民币 29.53 万亿元，同比增长 14%。非金融类信用债方面，报告期内合计发行量为人民币 6.04 万亿元，同比减少 5.1%，净融资增量为人民币 0.98 万亿元，同比下降 67%。从区域看分化明显，城投融资情况较好的江浙粤等优势区域净融资规模较大，部分弱区域或风险区域净融资量为负。信用风险方面，报告期内，违约发行人数量减少，监管和地方政府多次表态对恶意“逃废债”零容忍、积极保障债券兑付、恢复市场信心。

经营举措及业务发展

报告期内，公司债券承销业务主承销项目 100 个，主承销总金额人民币 638.95 亿元。

报告期内，东方投行债券业务在优质客户，特别在 AAA 大型央企、国企、金融机构上继续深耕，今年已参与承销如建设银行 RMBS 系列、浦发银行金融债、东方航空公司债、渤海银行金融债等百亿规模的大型项目。在团队建设方面，继续引进债券行业优秀人才，增强各区域的市场覆盖能力。在产品创新方面，东方投行作为联席主承销的“21 苏银租赁绿色债 01”成功发行，为全国首单非银机构“碳中和”专题绿色金融债，支持实体经济发展，助力碳达峰。报告期内，在债券市场新增违约金额扩大的环境下，东方投行债券承销项目依然维持“零违约”。

报告期内，公司利率债销售保持行业领先。记账式国债承销、国开行金融债承销和农发行金融债承销均位列券商前三名；非金融企业债务融资工具在券商类主承销商中排名同比上升 1 位至第 10 名。报告期内，公司荣获中央国债登记结算有限公司、国家开发银行、中国农业发展银行、上交所、深交所等多个机构颁发的优秀承销商等相关奖项。

下表载列公司担任主承销商的各类债券承销明细：

(人民币百万元)	2021 年 1-6 月	2020 年 1-6 月
公司债券：		
主承销次数	41	38
主承销金额	26,598	27,090
企业债券：		
主承销次数	7	3
主承销金额	4,106	2,023
金融债：		
主承销次数	8	3
主承销金额	11,420	3,860
资产支持证券：		
主承销次数	9	2
主承销金额	6,106	1,460
非金融企业债务融资工具：		
主承销次数	35	30
主承销金额	15,665	14,424
合计：		
主承销次数	100	76
主承销金额	63,895	48,857

发展规划与展望

在利率债承销方面，公司将继续保持国债、政策性银行金融债的同行业承销排名优势，继续深挖客户交易性需求，努力扩大客户范围，完善客户结构，并积极配合完成公司各项融资类项目发行的销售工作。

东方投行在债券承销业务方面，将积极推进人员扩充、业务拓展。未来，在回归母公司后，投行承销业务风险指标将得到优化、债券承销业务牌照将实现统一，借助于集团的资金优势和投资能力，债券承销业务将实现进一步发展。

财务顾问

市场环境

报告期内，受注册制的持续推进、以及通过兼并收购实现退出回报率相对较低等因素影响，境内并购重组市场项目数量较少的状况延续。同时，受新冠疫情与复杂的国际环境影响，跨境并购更加困难，交易的不确定性显著增加。

经营举措及业务发展

报告期内，东方投行并购业务有序开展，共过会或完成并购及资产重组项目 2 个，交易规模总额约人民币 12.72 亿元。其中，并购重组项目士兰微通过中国证监会审核，1 家跨境并购项目（纳思达收购 Rainbow Tech International Limited 100%股份）签署了收购协议。此外，去年通过行政审核的上海凤凰项目和纳思达项目已于 2021 年上半年完成重组。东方投行在行政审批类并购重组交易中担任独立财务顾问的执行能力出众，2021 年上半年并购重组过会率继续保持 100%，过会金额排名券商第 11 位。

发展规划与展望

未来，东方投行将专注优势产业，着力打造在通信及半导体、先进制造类、汽车、医疗、消费品等领域具有领先优势的业务品牌，主动引导实力买家放眼全球，大力发展跨境并购。同时，积极推进内部协作，主动发现客户的其他金融服务需求。

(5) 管理本部及其他

公司管理本部及其他业务主要包括总部资金业务、境外业务及金融科技等。报告期内，管理本部及其他业务实现营业收入人民币 3.10 亿元，占比 2.21%。

资金业务

市场环境

报告期内，尽管美联储缩减 QE 规模的预期不断加强，但全球总体的货币环境仍维持了宽松局面。我国经济总体延续稳定恢复态势，货币政策稳字当头，保持了连续性、稳定性、可持续性，上半年银行间市场流动性总体充裕。同时，信用债违约不断增多给债券基金等非银金融机构流动性带来考验，使得银行与非银之间的流动性分化明显。

经营举措及业务发展

公司资金业务旨在提升公司综合资金管理能力和流动性风险管理、负债管理及流动性储备管理等。报告期内，公司以不断完善流动性风险管理体系和加强融资精细化管理为目标，通过规范流程、制度建设以及系统开发为抓手，不断提升流动性风险管控能力。

报告期内，公司持续优化储备资产结构以提升流动性的安全边际，实现资金安全性、流动性和收益性的有效统一。在上半年面临复杂多变的市场环境背景下，公司实现资金平稳跨季的同时，始终确保流动性指标满足监管要求。截至报告期末，母公司流动性覆盖率和净稳定资金率分别为 256.42% 和 141.16%，远高于 120% 的监管预警值。

发展规划与展望

未来，公司将不断提升流动性管理系统化水平，不断优化内部资金转移定价模型，持续完善集团整体流动性管理框架；同时稳步推进公司债务融资工具的集中统筹管理，持续优化债务结构，兼顾流动性安全边际及经济效益。

境外业务

市场环境

2021 年上半年，全球疫情防控进入常态化，各主要经济体复苏信号较为明显，境内紧信用、稳货币、去杠杆政策坚定，人民币兑美元走强。股票市场在经历年初下行后，于第二季度逐步回升，恒生指数上半年小幅上扬；境内债券市场负面信号频发，长期美国国债收益率飙升，导致亚洲地区债券市场压力有增无减。

经营举措及业务发展

公司主要通过全资子公司东方金控、东证国际及其子公司开展相关境外业务。其中，东证国际作为集团国际化业务平台，通过各香港证监会持牌全资子公司开展证券经纪、期货经纪、资产管理、投资银行、融资融券等业务。报告期内，东证国际秉承“巩固优势业务、推动结构转型、领先业务创新”的经营策略，基础中介业务转型调整，增强蓄力，买方业务坚持维稳基调，内部管理增质提效，信息技术建设不断升级，整体发展趋势向好。

资产管理业务方面，积极丰富产品线配置、提升品牌影响力。截至报告期末，东证国际资产管理规模约 132 亿港元，居在港中资券商第 3 位；管理产品共 30 只，首支独立管理的公募基金东方红大中华债券基金顺利成立。报告期内，东方红增利基金在 Asia Asset Management 杂志举办的 2021 Best of the Best Awards 评选中荣获“在岸人民币债券基金（5 年）—投资表现大奖”；在 I&M 杂志举办的 2021 年专业投资大奖评选中，东方红增利基金荣获“在岸人民币债券基金（5 年）—投资表现大奖”，全球睿选 1 号基金荣获“亚太区（除日本）股票基金（3 年）—投资表现大奖”。

固定收益业务方面，东证国际坚持长短仓对冲的绝对收益策略，灵活运用可转债、特殊投资机会、空仓交易策略，整体实现正回报。

大经纪业务不断突破。截至报告期末，东证国际经纪客户总量达 32 万户，较期初增长 39%，市场占有率增长约 10%；开展股票期权细分业务，促进财富管理转型。机构交易客户圈层加速增厚，从在港中资公募基金公司向在港中资保险公司、私募基金、QDII 基金、家族信托等拓展；正式启动香港市场卖方港股研究报告推送业务，加强 PB 系统推广力度，完善“三位一体”机构交易生态圈。

大投行业务方面。报告期内，东证国际完成股权承销项目 2 个、在开展股权保荐项目 4 个、储备股权承销项目 6 个；完成债券承销项目 30 个，其中亚洲 G3（除日本外）中资美元高收益债

券承销数目位列在港中资券商第 4 名。东证国际不断丰富金融市场细分业务种类，做市业务与二级市场债券撮合业务顺利落地。

发展规划与展望

公司将坚持稳增长、控风险、补短板、促改革的工作总基调，发挥诚信合规、团结协作、执行有力、主动有为的精神，以核心理念为引领，以市场竞争为驱动，做大做强基础业务，稳固提升买方业务优势，打造品牌效应，深化集团跨境协同，推进数字金融创新业务，构建差异化竞争优势，持续完善内部管理机制，坚持合规风控底线不动摇，做好东方证券国际化先锋、集团全业务跨境延伸工作。

金融科技

市场环境

2021 年 3 月 11 日，十三届全国人大四次会议表决通过了《十四五发展规划》，明确提出要“加快数字化发展”，推进数字产业化和产业数字化，推动数字经济与实体经济深度融合。与此同时，证券行业数字化转型加速推进，金融科技正从服务业务向引领业务和赋能业务转变。2020 年，证券行业信息技术投入金额人民币 262.87 亿元，同比增长 21.31%，持续加大信息技术领域的投入为行业数字化转型和高质量发展奠定坚实基础。

经营举措及业务发展

公司将数字化转型作为战略驱动力推动企业高质量发展。运用金融科技驱动商业模式变革和管理模式优化，将数字化体验全面覆盖客户服务、投资决策、运营管理、合规风控等领域，优化客户体验、赋能业务发展、提升管理效能，打造数字化的核心竞争力。

推动管理模式变革，加强数字化管理体系建设。通过东方数仓体系的构建，推进集团风控指标并表管理、同一客户、同一业务、统一授信等系统建设，实现了风控指标集团化管理的目标；管理系统的信息化自研已覆盖公司各业务条线；持续推进 IT 数字化管理体系建设，加强效能管理，推动公司数字化转型。

内外结合，推出多种融合模式。通过技术干部在业务部门和子公司兼职管理，以及技术骨干派驻制，及时响应业务需求；试点 OKR 管理模式，在重点项目中将创新工作机制常态化落地，形成上下一致的目标驱动，促进内部协同融合；加强实践外部产学研融合，与企业 and 高校联手打造金融科技共融生态。

推进技术架构转型，实践中台战略。IT 中台架构初步构建完成，以共享能力中心为依托，完成“厚中台，薄应用”的整体落地；构建完成以东方数仓为代表的数中台，以及以东方大脑、东方区块链为代表的创新能力中台，实现创新技术融合输出；研发运行一体化迭代升级，服务治理统一架构深度应用推广。

加大自主研发力度，提升核心竞争力。在工作机制、技术管理以及文化建设等诸多措施保障下，形成多款具有行业影响力和竞争力的科技产品。加强自主研发，在更极速、更前沿、更多客、更高效、更海量、更安全等六个方面体现出科技赋能的价值，提升核心竞争力。

赋能业务场景，形成科技与业务的双轮驱动与深度融合。在自营投资领域，进一步提升超级投资管理平台（SIMP）的战略定位，加大资源投入，制定进一步深度融合举措；通过自主研发，优化底层技术架构，在交易所债券业务、银行间市场、国债期货做市方面加速推进建设，助力公司自营投资业务发展。在财富管理领域，东方赢家 APP 通过“赢计划”进一步提升用户体验，实现 7*24 小时开放式基金交易和客户自助开户等重点功能；东方雨燕（OST）极速交易系统性能优势明显，赋能机构业务快速发展。东方睿（系列）交易服务产品逐步体系化、规模化，性能持续提升；持续优化自主研发的 FPGA 行情硬件加速方案，性能优于市场同类产品；自主研发的基金投顾交易系统和资产配置平台助力公司财富管理转型。

报告期内，公司在技术架构转型方面《跨语言服务治理框架在证券行业的探索与实践》项目获得深交所证券期货业金融科技研究发展中心（深圳）2020 年度研究课题二等奖。

发展规划与展望

未来，根据现有规划路径，公司将从数字化管理体系建设、技术架构转型以及科技业务融合三个维度持续推进科技发展，落实公司数字化、集团化、国际化的战略发展目标。

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	13,276,756,060.33	9,625,293,303.92	37.94
营业成本	10,240,299,401.72	7,948,233,358.75	28.84
经营活动产生的现金流量净额	6,195,082,392.54	11,580,969,930.57	-46.51
投资活动产生的现金流量净额	2,152,716,192.68	2,376,109,730.06	-9.40
筹资活动产生的现金流量净额	1,137,190,537.89	-5,984,726,248.97	不适用

营业收入变动原因说明：公司实现营业收入 132.77 亿元，同比增加 36.51 亿元，增幅 37.94%。营业收入变动的主要原因为：公司资管、经纪、投行等手续费净收入及对汇添富基金的投资收益同比增加。按收入构成来看，其中：利息净收入 7.08 亿元，同比增加 3.72 亿元，增幅 110.44%，主要是经纪业务客户交易结算资金规模增长较快，带动相应利息收入同比增加；手续费及佣金净

收入 44.25 亿元，同比增加 16.08 亿元，增幅 57.07%，主要原因是资产管理、证券经纪、投资银行等主要业务手续费收入增加；投资收益 25.76 亿元，同比增加 6.31 亿元，增幅 32.43%，主要原因是证券自营及对汇添富基金投资收益增加；公允价值变动收益 0.90 亿元，同比减少 9.26 亿元，降幅 91.16%，主要是公司所持有的交易性金融资产公允价值减少；汇兑收益 1.05 亿元，同比增加 0.27 亿元，增幅 34.07%，主要是汇率变动影响；其他营业收入 53.54 亿元，同比增加 19.37 亿元，增幅 56.70%，主要是子公司大宗商品销售收入同比增加。

营业成本变动原因说明：公司营业支出 102.40 亿元，同比增加 22.92 亿元，增幅 28.84%。其中，税金及附加 0.53 亿元，同比增加 0.09 亿元，增幅 19.81%，主要是子公司城建税、教育费附加等支出同比增加；业务及管理费 47.50 亿元，同比增加 15.61 亿元，增幅 48.96%，主要是营业收入增加，与收入相关的人工成本等主要运营成本相应增加；信用减值损失 2.59 亿元，同比减少 10.32 亿元，降幅 79.96%，主要是股票质押式回购业务计提的减值准备同比减少；其他营业成本 51.79 亿元，同比增加 17.54 亿元，增幅 51.20%，主要是子公司大宗商品销售成本增加。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：经营活动产生的现金流量净额为 61.95 亿元，其中：现金流入 327.55 亿元，占现金流入总量的 48.38%，主要是代理买卖证券收到的现金净额 122.77 亿元，收取利息、手续费及佣金的现金 62.89 亿元，回购业务资金净增加额 53.87 亿元，交易性金融负债净增加额 29.87 亿元；现金流出 265.60 亿元，占现金流出总量的 45.63%，主要是拆入资金净减少额 50.16 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金 32.01 亿元，融出资金净增加额 23.42 亿元。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：投资活动产生的现金流量净额为 21.53 亿元，其中：现金流入 68.37 亿元，占现金流入总量的 10.10%，主要是其他权益工具投资净减少额 30.06 亿元，取得投资收益收到的现金 20.60 亿元，债权投资净减少额 13.36 亿元；现金流出 46.84 亿元，占现金流出总量的 8.05%，主要是其他债权投资净增加额 44.89 亿元，购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 1.88 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：筹资活动产生的现金流量净额为 11.37 亿元，其中：现金流入 281.06 亿元，占现金流入总量的 41.52%，主要是发行债券收到的现金 240.76 亿元，取得借款收到的现金 40.30 亿元；现金流出 269.69 亿元，占现金流出总量的 46.33%，主要是偿还债务支付的现金 254.37 亿元，分配股利、利润或偿付利息支付的现金 13.53 亿元。

利润表中变动超过30%以上项目情况表

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)	主要原因
利息净收入	708,352,653.59	336,608,240.83	110.44	主要是客户资金利息收入增加
手续费及佣金净收入	4,424,984,341.56	2,817,250,323.92	57.07	资管、经纪、投行等主要业务收入增加
投资收益	2,575,688,129.17	1,944,928,789.20	32.43	证券自营及对汇添富基金投资收益增加
公允价值变动收益	89,744,588.77	1,015,589,268.07	-91.16	交易性金融资产公允价值减少
汇兑收益	104,668,961.49	78,067,628.10	34.07	汇率变动影响
其他业务收入	5,354,289,423.03	3,416,891,954.81	56.70	子公司大宗商品销售收入增加
资产处置收益	8,517.05	-74,779.40	不适用	固定资产处置亏损减少
业务及管理费	4,749,664,071.05	3,188,445,812.35	48.96	人工成本等主要运营成本增加
信用减值损失	258,543,664.09	1,290,109,741.13	-79.96	股票质押式回购业务计提的减值准备减少
其他业务成本	5,178,802,093.35	3,425,198,181.61	51.20	子公司大宗商品销售成本增加
所得税费用	431,370,712.35	252,232,557.88	71.02	递延所得税费用增加
其他综合收益的税后净额	130,572,107.11	3,826,432.81	3,312.37	主要是其他权益工具投资公允价值变动增加
基本每股收益	0.37	0.22	68.18	净利润增加所致

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
货币资金	74,449,331,298.79	23.92	65,640,359,556.65	22.55	13.42	客户交易结算资金增加
结算备付金	24,834,159,746.73	7.98	21,516,356,646.61	7.39	15.42	客户交易结算资金增加
融出资金	23,480,866,622.62	7.54	21,171,919,414.06	7.27	10.91	融资业务规模增加
衍生金融资产	51,651,456.31	0.02	155,876,469.76	0.05	-66.86	衍生工具公允价值变动形成的资产减少
存出保证金	2,311,823,436.65	0.74	2,183,089,694.77	0.75	5.90	存出保证金增加
应收款项	1,167,321,321.43	0.38	874,405,553.22	0.30	33.50	主要是应收手续费和清算款增加
合同资产			1,741,886.80	0.00	-100	本期子公司合同资产减少
买入返售金融资产	13,336,386,959.15	4.28	14,460,425,371.36	4.97	-7.77	股票质押式回购业务融出资金减少
交易性金融资产	76,452,700,723.03	24.56	72,701,117,042.70	24.97	5.16	交易性债券、股票及股权投资增加
债权投资	4,828,679,090.22	1.55	6,243,897,149.81	2.14	-22.67	持有至到期的债券资产减少
其他债权投资	67,389,989,287.86	21.65	62,645,974,916.84	21.52	7.57	主要是自营债券规模增加
其他权益工具投资	6,096,378,358.59	1.96	10,936,457,571.84	3.76	-44.26	主要是权益类证券投资减少
投资性房地产	39,332,069.08	0.01	40,460,670.03	0.01	-2.79	本期部分转租房产到期
长期股权投资	6,060,631,677.57	1.95	5,771,193,948.89	1.98	5.02	主要是权益法下确认的投资损益增加
固定资产	2,046,860,039.41	0.66	2,019,601,972.64	0.69	1.35	新增资产投入大于折旧
在建工程	37,152,494.19	0.01	65,838,524.98	0.02	-43.57	在建工程项目减少
使用权资产	786,926,324.38	0.25	847,354,948.02	0.29	-7.13	租赁资产新增小于折旧
无形资产	209,275,750.92	0.07	215,313,094.34	0.07	-2.80	本期软件摊销大于软件新增
商誉	32,135,375.10	0.01	32,135,375.10	0.01	-	

递延所得税资产	1,414,979,029.91	0.45	1,455,922,066.16	0.5	-2.81	可抵扣暂时性差异减少
其他资产	6,256,027,877.00	2.01	2,137,999,709.85	0.73	192.61	主要是境外子公司其他应收款增加
短期借款	4,148,571,185.09	1.33	579,732,185.45	0.2	615.60	境外子公司信用借款增加
应付短期融资款	4,691,930,367.56	1.51	16,255,485,786.37	5.58	-71.14	应付短期收益凭证减少
拆入资金	4,654,383,638.90	1.50	9,670,113,871.43	3.32	-51.87	同业拆入规模减小
交易性金融负债	17,347,274,201.11	5.57	14,576,073,144.23	5.01	19.01	主要是境外子公司交易性金融负债增加
衍生金融负债	978,080,029.00	0.31	504,956,696.48	0.17	93.70	主要是黄金掉期形成的衍生负债变化
卖出回购金融资产款	57,416,887,936.49	18.45	52,860,883,439.73	18.16	8.62	主要是债券正回购规模增加
代理买卖证券款	78,920,066,090.72	25.35	66,642,671,158.50	22.89	18.42	期货经纪业务客户交易结算资金增加
代理承销证券款	120,499,979.00	0.04	346,000,000.00	0.12	-65.17	子公司代理承销债券款减少
应付职工薪酬	2,629,780,910.11	0.84	2,608,008,552.75	0.9	0.83	本期新增计提职工薪酬
应交税费	394,915,618.70	0.13	782,814,613.10	0.27	-49.55	主要是应交企业所得税减少
应付款项	1,228,431,981.12	0.39	576,584,579.01	0.2	113.05	主要是子公司应付手续费增加
合同负债	258,380,269.16	0.08	404,123,622.43	0.14	-36.06	子公司预收大宗商品交易款减少
应付债券	72,720,557,081.66	23.36	62,265,473,497.68	21.39	16.79	本期新增发行长期债券
租赁负债	796,734,938.00	0.26	856,910,328.86	0.29	-7.02	应付经营场所租赁款减少
递延所得税负债	23,049,436.56	0.01	20,179,387.19	0.01	14.22	应纳税暂时性差异增加
其他负债	3,881,842,583.73	1.25	1,936,286,692.04	0.67	100.48	主要是计提应付股利

其他说明

截至报告期末，公司总资产 3,112.83 亿元，较上年末增加 201.65 亿元，增幅 6.93%。公司资产中，货币资金、结算备付金及存出保证金 1,015.95 亿元，较上年末增加 122.56 亿元，占总资产的 32.64%；各项金融投资及衍生金融资产 1,548.19 亿元，较上年末增加 21.36 亿元，占总

资产的 49.74%；融出资金、买入返售金融资产及应收款 379.85 亿元，较上年末增加 14.78 亿元，占总资产的 12.20%；长期股权投资、固定资产及其他 168.84 亿元，较上年末增加 42.96 亿元，占总资产的 5.42%。报告期内，公司资产规模稳定，结构合理，流动性充足。

截至报告期末，公司总负债 2,502.11 亿元，较上年末增加 193.25 亿元，增幅 8.37%。扣除代理买卖证券款和代理承销证券款后，资产负债率为 73.70%，较上年末增加 0.57 个百分点。公司负债中，短期借款、应付短期融资款、拆入资金及卖出回购金融资产款 709.12 亿元，较上年末减少 84.54 亿元，占总负债的 28.34%；交易性金融负债和衍生金融负债 183.25 亿元，较上年末增加 32.44 亿元，占总负债的 7.32%；代理买卖证券款和代理承销证券款 790.41 亿元，较上年末增加 120.52 亿元，占总负债的 31.59%；应付债券 727.21 亿元，较上年末增加 104.55 亿元，占总负债的 29.06%；应付薪酬、税金及其他 92.12 亿元，较上年末增加 20.27 亿元，占总负债的 3.69%。

2. 境外资产情况

适用 不适用

(1) 资产规模

其中：境外资产 242.84（单位：亿元 币种：人民币），占总资产的比例为 7.80%。

(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

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

截至报告期末，集团长期股权投资 60.61 亿元，较上年末增加 2.89 亿元，增幅 5.02%。变动原因主要系集团对汇添富基金等联营企业的投资在权益法下确认的投资损益增加。集团对外股权投资参见“第十节、七、（十七）长期股权投资”。

(1) 重大的股权投资

适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

所持对象名称	占该公司股权比例	期末账面价值	报告期损益	报告期所有者权益变动
汇添富基金管理股份有限公司	35.412%	279,706.77	55,496.71	-465.40

注：本期损益指该项投资对报告期公司净利润的影响。

本期所有者权益变动不包括报告期损益的影响。

(2) 重大的非股权投资

适用 不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目（元）	期末投资成本	期末账面价值	报告期内购入或出售的净额	报告期内公允价值变动	报告期内投资收益
1、交易性金融资产	73,900,561,324.21	76,452,700,723.03	3,651,339,590.28	175,212,264.41	1,758,326,736.37
2、其他债权投资	65,854,906,921.89	67,389,989,287.86	4,514,877,648.86	13,914.49	56,085,807.99
3、其他权益工具投资	6,184,484,932.06	6,096,378,358.59	-5,045,133,246.57	221,914,232.66	351,664,409.47
4、衍生金融工具	31,529,553.01	-926,428,572.69	212,855,328.98	-825,560,413.49	-344,447,386.84

(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) 上海东证期货有限公司，注册资本人民币 23 亿元，公司持有 100% 的股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，上海东证期货有限公司总资产人民币 568.70 亿元，净资产人民币 35.05 亿元；2021 年上半年实现营业收入人民币 59.29 亿元，净利润人民币 2.41 亿元。

主营业务：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理，基金销售。

(2) 上海东方证券资本投资有限公司，注册资本人民币 40 亿元，公司持有 100% 的股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，上海东方证券资本投资有限公司总资产人民币 49.28 亿元，净资产人民币 48.45 亿元；2021 年上半年实现营业收入人民币 2.96 亿元，净利润人民币 1.49 亿元。

主营业务：设立直投资基金，对企业进行股权投资，或投资于与股权投资相关的其他投资基金；为客户提供与股权投资相关的财务顾问服务；经中国证监会认证可开展的其他业务。

(3) 上海东方证券资产管理有限公司，注册资本人民币 3 亿元，公司持有 100% 的股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，上海东方证券资产管理有限公司总资产人民币 49.71 亿元，净资产人民币 29.01 亿元；2021 年上半年实现营业收入（主营业务收入）人民币 19.70 亿元，主营业务利润人民币 8.38 亿元，净利润人民币 6.65 亿元。

主营业务：证券资产管理业务、公开募集证券投资基金管理业务。

(4) **东方证券承销保荐有限公司**，注册资本人民币 8 亿元，公司持有 100%的股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，东方证券承销保荐有限公司总资产人民币 21.03 亿元，净资产人民币 14.27 亿元；2021 年上半年实现营业收入人民币 5.98 亿元，净利润人民币 0.76 亿元。

主营业务：证券（不含国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企业债务融资工具））承销与保荐；中国证监会批准的其他业务。

(5) **上海东方证券创新投资有限公司**，注册资本人民币 62.5 亿元，公司持有 100%股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，上海东方证券创新投资有限公司总资产人民币 68.96 亿元，净资产人民币 67.37 亿元；2021 年上半年实现营业收入（主营业务收入）人民币 4.29 亿元，主营业务利润人民币 3.68 亿元，净利润人民币 2.78 亿元。

主营业务：创业投资，金融产品投资，投资管理和投资咨询。

(6) **东方金融控股（香港）有限公司**，注册资本港币 27.54 亿元，公司持有 100%的股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，东方金融控股（香港）有限公司总资产港币 253.28 亿元，净资产港币 26.72 亿元；2021 年上半年实现营业收入港币 2.60 亿元，净利润港币 1.39 亿元。

主营业务：投资控股，通过设立不同子（孙）公司分别经营由香港证监会按照《证券及期货条例》规管的经纪业务、企业融资和资产管理等业务。

(7) **汇添富基金管理股份有限公司**，注册资本人民币 1.33 亿元，公司持有 35.412%的股权。

截至 2021 年 6 月 30 日，汇添富基金管理股份有限公司总资产人民币 115.53 亿元，净资产人民币 78.99 亿元；2021 年上半年实现营业收入（主营业务收入）人民币 46.07 亿元，主营业务利润人民币 20.53 亿元，净利润人民币 15.70 亿元。

主营业务：基金募集，基金销售，资产管理，经中国证监会许可的其他业务。

(七) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

公司将部分结构化主体纳入合并范围，包括公司管理并投资的资产管理计划和基金。公司主要从是否对结构化主体拥有权力，通过参与结构化主体的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对结构化主体的权力影响其回报金额三个要素判断是否够控制结构化主体。

截至报告期末，公司纳入合并报表范围的结构化主体共计 18 个，合计净资产金额人民币 7,470,904,683.84 元。报告期内，公司合并报表范围中新增 3 个结构化主体，减少 7 个结构化主体。

本期纳入合并范围的结构化主体情况如下：

单位：元 币种：人民币

纳入合并范围的结构化主体	2021 年 6 月末或 2021 年 1-6 月
资产总额	8,037,186,673.62
负债总额	566,281,989.78
净资产总额	7,470,904,683.84
营业收入	110,041,417.89
净利润	82,160,288.95

(八) 募集资金情况

经中国证监会核准，公司于 2016 年 7 月 8 日于香港联交所发行境外上市外资股(H 股)股票，并于 2016 年 8 月 3 日行使超额配售权。H 股募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审验，并出具德师报(验)字(16)第 1082 号验资报告。根据验资报告内容，公司本次公开发行境外上市外资股(H 股)933,709,090 股，售股股东已出售 93,370,910 股 H 股，共计 1,027,080,000 股，每股面值为人民币 1 元，每股 H 股为港币 8.15 元，以港币现金缴纳，共计港币 8,370,702,000.00 元，在扣除交易费及其他费用总计港币 145,045,025.30 元后，港币 8,225,656,974.70 元已存入 H 股募集资金账户，以实际资金划至上述账户日中国人民银行公布的港币兑人民币汇率中间价折合人民币 7,083,154,510.65 元(包含已取得的利息收入)。此等募集资金在扣除划转给社保基金会的募集款及其他发行费用后，公司 H 股募集资金净额为港币 7,417,133,357.56 元。

公司 H 股招股说明书承诺的募集资金使用情况如下：

- (1) 约 35%将用于进一步发展公司的经纪及证券金融业务；
- (2) 约 30%将用于发展公司的境外业务；
- (3) 约 15%将用于扩大公司的投资管理业务；
- (4) 约 10%将用于发展公司证券销售及交易业务；
- (5) 约 5%将用于资本性支出，以提升信息系统及扩充轻型营业部网络；
- (6) 约 5%将用作营运资金及其他一般企业用途。

截至报告期末，公司 H 股募集资金使用情况如下：港币 25.60 亿元用于进一步发展公司经纪及证券金融业务，港币 22.25 亿元用于发展公司的境外业务，港币 10.97 亿元用于扩大公司投资管理业务，港币 7.32 亿元用于发展公司证券销售及交易业务，港币 2.40 亿元用于资本性支出，港币 4.16 亿元用于营运资金及其他；公司累计使用 H 股募集资金港币 72.70 亿元。除上述资金使用外，公司所募款项剩余资金约港币 1.54 亿元(含募集资金利息及汇兑损益)尚未使用，公司将于未来两年内根据公司发展战略和实际使用需求将剩余募集资金用于资本性支出。(已使用人民币 H 股募集资金汇率按实际结汇汇率计算，未使用人民币 H 股募集资金汇率按照期末汇率计算。)

截至报告期末,公司上述募集资金计划投向与招股说明书、相关公告及通函披露的内容一致,没有发生变更。公司将根据实际业务需求,本着股东利益最大化的原则,在合理的时间安排使用。

(九) 合并报表范围

(1) 与年初相比本期新增合并单位 3 家,具体为:子公司东方金控新增 3 个结构化主体。

(2) 与年初相比本期减少合并单位 7 家,具体为:子公司东方金控减少 6 个结构化主体,子公司东证期货减少 1 个结构化主体。

报表合并范围变更的说明详见第十节财务报告九、合并范围的变更。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险

适用 不适用

公司以建立健全与公司自身发展战略相适应的全面风险管理体系与风险管理能力为风险管理的战略目标,致力于围绕可操作的管理制度、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进行合理有效的风险管控。公司建立了面向组织、业务、风险种类等维度全覆盖的全面风险管理体系:在组织层面,风险管理工作范围覆盖公司各部门、各分支机构、各子公司;在业务层面,覆盖自营投资、信用类业务、投资银行、资产管理、财富管理等各类业务;在风险种类方面,风险管理涵盖市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险等各专业风险类型

公司根据相关法律法规及公司章程,结合公司实际,建立了一套与公司发展情况相适应的风险管理制度体系;构筑了以全面风险管理“三道防线”为基础的组织架构,并建立了分级授权投资决策体系和重大决策审核机制;建立风险控制指标分级预警与跟踪机制,通过各类风险管理系统对风险指标进行监测和预警;每年初制定风险偏好、风险容忍度及风险限额,并对限额进行逐级分解,风险指标体系科学有效;建立了合理的风险管理报告机制,合规风控检查与处置机制,问责与考核机制。

1、市场风险

市场风险主要指在证券市场中因股票价格、利率、汇率等的变动而导致价值未预料到的潜在损失的风险,具体可以分为股票价格风险、利率风险、汇率风险和商品价格风险等,分别是指由证券资产价格、利率、汇率和商品价格等波动给公司带来的风险。

公司围绕总体经营战略,董事会、经营层以及全体员工共同参与,对公司经营中的市场风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。公司董事会、经营层下设相关委员会,各业务部门、各分支机构、各子公司均履行市场风险管理职责。公司各业务部门、分支机构及子公司是市场风险管理的第一道防线。公司风险管理总部负责统筹公司的市场风险管理工作。

公司市场风险管理围绕净资产、流动性管理与风险承受度，分层次，分模块，统筹管理资金、规模、杠杆、风险敞口等风控指标，并从品种、组合、模型、对冲等角度出发对市场风险敞口进行精细化管理，将市场风险控制可在承受范围，实现在可承受的风险水平下的收益最大化。

公司建立覆盖全集团的资产负债配置及市场风险限额体系，反映公司整体市场风险偏好和风险承受能力。公司建立了一套分层级的风险限额授权体系，限额指标细化到主要业务品种，并自上而下分解至不同业务部门，对不同业务和产品实施有效的风险控制，确保风险水平在公司设定的风险偏好之内。风险限额可视当年市场变化及指标预警情况进行调整。

公司密切关注宏观经济指标和趋势、重大经济政策动向，评估宏观因素变化可能给投资带来的系统性风险，定期监测市场风险控制指标，对投资策略进行调整，建立重大事项处置决策、执行及责任机构，制定各种可预期极端情况下的应急预案，并根据严重程度对危机进行分级和管理。

公司运用逐日盯市、集中度分析及定量风险模型对业务规模、风险敞口等进行管理，建立动态止损机制，通过敏感性分析寻找影响投资组合收益的关键因素，并通过情景分析、压力测试等方法评估投资组合对于极端市场波动的承受能力。

报告期内，公司通过对市场的研究，跟踪价格变化，监控汇率风险敞口，根据市场行情变化适时调整自营持仓规模，并运用各类衍生工具进行对冲管理，有效控制市场风险。截至报告期末，公司市场风险总体 VaR（95%，1 天）为 1.27 亿元。

2、信用风险

信用风险主要指债务人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，给公司造成损失的可能性。公司主要信用风险类型包括以下三个方面：一是直接信用风险，即由于发行人未能履行约定契约中的义务而造成的风险；二是交易对手风险，即在衍生品交易或证券融资交易中由于交易对手方及融资方违约造成的风险；三是结算风险，指在交易的清算交收过程中的违约行为，即公司履行交付行为而对方违约。结算风险可能由交易对手违约、流动性约束或运营问题引起。一般发生在非担保交收的外汇和证券结算。

公司董事会、经营层下设相关委员会，各业务部门、各分支机构、各子公司均履行信用风险管理职责。公司各业务部门、分支机构及子公司是信用风险管理的第一道防线。公司风险管理总部负责统筹公司的信用风险管理工作。

公司信用风险管理围绕净资产管理与风险承受度，分层次、分模块，统筹管理规模、交易对手、风险敞口等风控指标，并从品种、模型、对冲等角度出发，对信用风险敞口精细化管理，有效控制信用风险。

公司建立了分级授权管理体系，公司开展涉及信用风险业务的相关业务部门及子公司必须在授权范围内开展工作、履行职责。公司根据监管要求和风险管理需要对信用风险实行限额管理，在公司、业务条线、品种等不同层面，设定信用风险限额，主要包括外部监管指标限额、风险偏好指标限额和资产配置限额，并在业务开展过程中，严格执行公司审议通过的各类信用风险限额，

建立限额指标日常监控机制，对限额超限情况采取有效控制措施，确保在限额范围内开展各类业务。

从业务实践角度，公司建立了针对债券发行主体、交易对手方、融资类业务客户的信用风险管理体系，加强了对其资质和风险的评估工作，通过合同审查、交易及舆情监控等形式进行信用风险管理，重点关注交易过程中的可能违约环节，制定风险处置应急预案。在债券投资及信用风险相关的交易对手业务中，加强对债务发行主体及交易对手的基本面分析，相应地建立了公司信用风险内部评级体系，并通过信用风险管理系统实现了内部评级、统一授信管理、投资品集中度管理、违约客户管理、压力测试、监控预警及风险报告等功能，加强信用风险管控，提升信用风险管理能力；在衍生品交易中，公司对交易对手设定保证金比例和交易规则限制，通过每日盯市、追保、强制平仓等手段来控制交易对手的信用风险敞口；在证券金融业务中，建立了客户的信用等级评定、授信管理、担保品管理、监控报告等机制，并通过强制平仓机制、司法途径等处置风险项目。

3、流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司依照《证券公司流动性风险管理指引》等监管规定和自身风险管理需要，持续完善流动性风险管理系统和内部管理制度体系，设置专岗负责对公司流动性风险进行动态监控、预警、分析和报告。报告期内，持续完善流动性风险管理系统，实现通过信息系统对流动性风险实施有效的识别、计量、监测和控制。公司每年年初审慎确定流动性风险偏好的定性原则和定量指标，并建立了不定期调整机制，对流动性风险实施限额管理，并实施限额执行情况的监测与报告。公司定期进行流动性压力测试和应急演练，并按监管要求每日报送流动性覆盖率、净稳定资金率等指标以确保公司流动性需求能够及时以合理成本得到满足，将流动性风险控制在可承受的范围内。

4、操作风险

操作风险是指由不完善或有问题的内部程序、员工和信息科技系统，以及外部事件所造成损失的风险。

操作风险管理层面，公司已在内控流程基础上细化梳理了操作流程，识别了流程中的操作风险，并按照管理需要对风险进行了分类管理；根据风险的影响程度和发生可能性等建立操作风险评估模型，对识别的操作风险进行分析计量并进行等级评价，确定重点关注和优先控制的风险；建立关键风险指标监测机制，实现对重点关注操作风险的量化监测管理；建立了操作风险损失事件上报机制，实现公司内部操作风险事件上报及行业操作风险事件收集管理；完成开发操作风险管理系统，实现对操作风险的识别、评估、监测、计量和报告等管理。公司已完成全资及控股子公司的操作风险管理实施工作，与母公司保持集团化协同。

5、洗钱及恐怖融资风险

洗钱风险是指金融机构的产品或服务被不法分子利用从事洗钱活动，进而对公司在法律、声誉、合规和经营等方面造成不利影响的风险。

为有效落实中国人民银行《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》的各项要求，2020 年 1 月，公司董事会审议通过《东方证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法》，明确了董事会、监事会、经营层、业务部门及职能管理部门的反洗钱职责，提出公司洗钱风险管理的目标、洗钱风险管理文化建设目标、洗钱风险管理原则、策略和程序等，在集团层面开展洗钱风险统一管理工作。同时，公司开展反洗钱客户信息治理工作，优化完善反洗钱系统功能，并开展了洗钱风险评估。另外，公司将外聘第三方咨询机构开展集团洗钱风险评估和差距分析工作，不断提高反洗钱工作效率和履职能力。面对全面依法从严的监管环境，公司不断加强反洗钱履职能力，提升反洗钱合规管理水平。

6、技术风险

技术风险指公司信息技术系统不能提供正常服务，影响公司业务正常开展的风险；信息技术系统和关键数据的保护、备份措施不足，导致公司业务不连续或信息安全风险；重要信息技术系统不使用监管部门或市场通行的数据交互接口影响公司业务正常开展的风险；重要信息技术系统提供商不能提供技术系统生命周期内的持续支持和服务的风险。

公司非常重视技术风险的管理，IT 战略发展和治理委员会拟定和审核公司 IT 治理目标及发展规划，制定 IT 年度预算，审核重大 IT 项目立项、投入和优先级，评估 IT 重大事项并出具意见。系统研发总部根据相关要求，对信息系统的开发测试等建设工作实施管控，对外包供应商准入及评价进行管理，并对信息系统外部人员的行为进行规范。系统运行总部采取多项措施保障系统稳定运行，在人员和岗位配备上，已完成重要的岗位的双人主备配备；在流程控制方面，按照 ISO20000 的规则管控主要的运维流程，如事件、变更等流程实现分级审批、变更操作有复核、每月出具管理月报、运行月报，在技术层面和管理层面管控系统运行工作；在应急处理方面，严格按照监管要求开展灾备演练和应急预案演练，各运维团队和各营业部定期开展针对具体系统的应急演练；对于数据备份与恢复校验工作，按照年度计划实施，每月有实施有复核有监督；系统权限设置按照既定流程操作，有审批有记录有备案。合规法务管理总部会同风险管理总部对 IT 合规与风险管理事项和相关制度进行审核，定期组织合规检查，并出具合规与风险管理月报。但是，在信息技术迅猛发展的今天，由于设备故障、软件设计缺陷、网络线路连接问题、技术手段不能同步跟进等问题理论上还不能完全杜绝，因而技术风险还不能完全避免。

7、声誉风险

声誉风险主要是指公司经营、管理及其他行为或外部事件导致对公司声誉产生负面评价的风险。

报告期内，公司未面临影响公司声誉的重大舆情事件，个别敏感事件也得到高效妥善处理。

公司的声誉风险的管理主要是：

- ① 进一步加强舆情监测，对主要搜索引擎、近 300 家主流媒体、1,000 余家主流财经及地方都市网站、1500 余家主流财经微博、近 300 家主流财经微信公众号以及 10 余家境外媒体进行全方位、全天候 7*24 小时监测，及时了解公司舆情环境，为有效预防声誉风险打下坚实基础。
- ② 在 OA 内网上线声誉风险事件报备流程，进一步完善敏感舆情报备制度。
- ③ 升级完善声誉风险舆情月报，增加了公司主动传播内容、负面舆情管理情况、同业舆情对比及解读等，以便更为全面的了解公司所面临的舆论环境，为做好声誉风险管理打下坚实的基础。
- ④ 为增强全员声誉风险意识，在全公司完成了一次关于声誉风险管理的全员培训，效果良好。

此外，公司也与其他金融机构一样，经营管理过程中不可避免面临着一定程度的合规风险、法律风险、道德风险等，对这些风险类型，公司施行的全面风险管理体系已经全面覆盖，并明确了相应的主办部门，建立了相应的管理制度，实施了相应的技术措施。

对以上各类风险，公司制定了相应的风险管理政策和措施来识别及评估这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险，努力实现公司总体风险可测、可控、可承受。

(二) 其他披露事项

适用 不适用

第四节 公司治理

一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2021 年第一次临时股东大会	2021-03-05	http://www.sse.com.cn	2021-03-06	议案全部通过
2020 年年度股东大会、2021 年第一次 A 股类别股东大会、2021 年第一次 H 股类别股东大会	2021-05-13	http://www.sse.com.cn	2021-05-14	议案全部通过

表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

股东大会情况说明

适用 不适用

报告期内，公司于 2021 年 3 月 5 日在中国上海市中山南路 119 号 15 楼会议室召开公司 2021 年第一次临时股东大会，审议通过 1 项特别决议议案：《关于修改〈公司章程〉部分条款的议案》；审议通过 2 项普通决议议案：《关于公司董事会换届选举的议案》和《关于公司监事会换届选举的议案》。相关决议结果于会议当日刊登在上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）、香港联交所网站（<http://www.hkexnews.hk>）以及公司网站（<http://www.dfzq.com.cn>），于 2021 年 3 月 6 日刊登于《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》。

报告期内，公司于 2021 年 5 月 13 日在中国上海市中山南路 119 号 15 楼会议室召开公司 2020 年年度股东大会、2021 年第一次 A 股类别股东大会、2021 年第一次 H 股类别股东大会。2020 年年度股东大会审议通过 9 项特别决议议案：《关于修改〈公司章程〉部分条款的议案》《关于公司发行境外债务融资工具一般性授权的议案》《关于公司前次募集资金使用情况报告的议案》《关于公司符合配股发行条件的议案》《关于公司配股公开发行证券方案的议案》《关于公司配股公开发行证券预案的议案》《关于公司配股募集资金使用可行性分析报告的议案》《关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的议案》和《关于提请公司股东大会授权董事会全权办理公司本次配股相关事宜的议案》；审议通过 11 项普通决议议案：《公司 2020 年度董事会工作报告》《公司 2020 年度监事会工作报告》《公司 2020 年度财务决算报告》《公司 2020 年度利润分配方案》《关于公司 2021 年度自营规模的议案》《公司 2020 年年度报告》《关于预计公司 2021 年度日常关联交易的议案》《关于预计公司 2021 年度对外担保的议案》《关于增选公司独立非执行董事的议案》《关于独立监事津贴的议案》和《关于聘请 2021 年度会计师事务所的议案》。2021 年第一次 A 股类别股东大会审议通过 6 项特别决议议案：《关于公司符合配股发行条件的议案》《关于公司配股公开发行证券方案的议案》《关于公司配股公开发行证券预案的议案》《关于公司配股募集资金使用可行性分析报告的议案》《关于向原股东配售股份摊

薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的议案》和《关于提请公司股东大会授权董事会全权办理公司本次配股相关事宜的议案》。2021 年第一次 H 股类别股东大会审议通过了《关于公司符合配股发行条件的议案》《关于公司配股公开发行证券方案的议案》《关于公司配股公开发行证券预案的议案》《关于公司配股募集资金使用可行性分析报告的议案》《关于向原股东配售股份摊薄即期回报的风险提示及填补措施与相关主体承诺的议案》和《关于提请公司股东大会授权董事会全权办理公司本次配股相关事宜的议案》。相关决议结果于会议当日刊登在上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）、香港联交所网站（<http://www.hkexnews.hk>）以及公司网站（<http://www.dfzq.com.cn>），于 2021 年 5 月 14 日刊登于《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》。

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
宋雪枫	执行董事	选举
金文忠	董事长	选举
俞雪纯	董事	选举
程峰	董事	选举
任志祥	董事	选举
罗新宇	独立董事	选举
朱静	职工董事	选举
吴俊豪	股东代表监事	选举
张健	股东代表监事	选举
沈广军	股东代表监事	选举
夏立军	独立监事	选举
阮斐	职工代表监事	选举
丁艳	职工代表监事	选举
杨斌	副总裁	聘任
徐海宁	副总裁	聘任

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

√适用 □不适用

1、2021 年 2 月 9 日，公司召开第三届职工代表大会第五次全体会议，选举朱静女士为公司第五届董事会职工董事，选举杜卫华先生、阮斐女士、丁艳女士为公司第五届监事会职工代表监事，与股东大会选举产生的董监事共同组成公司第五届董监事会。（公告编号：2021-007）

2、2021年3月5日，公司召开2021年第一次临时股东大会，选举宋雪枫先生为公司第五届董事会执行董事，选举俞雪纯先生、程峰先生、任志祥先生为公司第五届董事会非执行董事，任期至第五届董事会届满之日止；选举吴俊豪先生、张健先生、沈广军先生为公司第五届监事会股东代表监事，选举夏立军先生为公司第五届监事会独立监事，任期至第五届监事会届满之日止。

（公告编号：2021-010）

3、2021年3月5日，公司召开第五届董事会第一次会议，选举金文忠先生为公司第五届董事会董事长，任期至第五届董事会届满之日止；聘任杨斌先生、徐海宁女士为公司副总裁，任期至第五届董事会届满之日止。（公告编号：2021-011）

4、2021年5月13日，公司召开2020年年度股东大会，选举罗新宇先生为公司第五届董事会独立非执行董事，任期至第五届董事会届满之日止。（公告编号：2021-030）

三、公司董事、监事及其他信息

（一）董事、监事及有关雇员之证券交易

公司已采纳《标准守则》作为所有董事及监事进行本公司证券交易的行为守则。根据对董事及监事的专门查询后，所有董事及监事均确认：报告期内，各董事及监事均已严格遵守《标准守则》所订之标准。公司亦就有关雇员（定义见《香港上市规则》）买卖公司证券交易事宜设定指引，指引内容不比《标准守则》宽松。公司并没有发现有关雇员违反指引。报告期内，公司现任及离任董事、监事、高级管理人员没有持有公司股份、股票期权，也未被授予限制性股票。

（二）董事、监事相关信息的重大变更

1、公司党委书记、执行董事宋雪枫先生自2021年6月起不再担任上海申能能创能源发展有限公司董事长。

2、公司董事长、执行董事、总裁金文忠先生自2021年1月起不再担任东方金融控股（香港）有限公司董事长，自2021年5月起代行上海东方证券资本投资有限公司总经理。

3、公司非执行董事俞雪纯先生自2021年6月起担任上海申能能创能源发展有限公司董事。

4、公司非执行董事刘炜先生自2021年4月起担任申能股份有限公司党委书记，自2021年4月起不再担任申能（集团）有限公司党委组织部部长、人力资源部总经理。

5、公司独立非执行董事靳庆鲁先生自2021年3月起担任哈尔滨银行股份有限公司独立董事。

6、公司监事会主席张芊先生自2021年3月起不再担任申能（集团）有限公司副总裁，自2021年3月起担任申能（集团）有限公司党委副书记，2021年6月起担任申能（集团）有限公司工会主席。

7、公司股东代表监事沈广军先生自2021年6月起担任上海浦东中银富登村镇银行有限责任公司董事。

8、公司独立监事夏立军先生自2021年4月起不再担任维信诺科技股份有限公司独立董事。

（三）董事、监事服务合约的说明

根据《香港上市规则》第 19A.54 及 19A.55 条，公司已与各董事及监事就（其中包括）遵守相关法律及法规和遵从《公司章程》及仲裁条文订立合约。除上述披露者外，公司并无及并不建议与公司任何董事或监事以其各自作为董事/监事的身份订立任何服务合约（于一年内届满或可由雇主于一年内终止而毋须支付赔偿（不包括法定赔偿）的合约除外）。

（四）员工及薪酬政策

公司重视人才的吸引、激励、培养和使用，实行岗位工资制和绩效奖金相结合的工资制度，薪酬水平与岗位价值、地区市场水平和绩效评估结果挂钩，做到了“效率优先、兼顾公平”。根据适用的中国法律法规，公司与每位员工签订了劳动合同，建立劳动关系。劳动合同内容包含关于合同期限、工作时间和休息休假、劳动报酬和保险福利、劳动保护和劳动条件、合同的变更及解除等条款。

依据适用的中国法律法规，公司为员工建立各项社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险、生育保险）、住房公积金，并按时足额缴纳上述社会保险费和住房公积金。同时依据适用的国家法规，公司于 2006 年建立企业年金制度和补充医疗保险制度，为员工提供补充养老和补充医疗保障。

（五）培训计划

报告期内，公司持续完善人才培养机制，促进员工成长成才，有效健全多层次、多元化、多形式的员工培训体系，帮助员工提高综合素质。公司进一步加大各类人才培养投入，创新多元化培养机制，针对各类人才梯队提供定制化培训课程，保障优秀人才知识补给。

四、公司治理其他情况

作为在中国大陆和香港两地上市的公众公司，公司严格按照境内外上市地的法律、法规及规范性文件的要求，规范运作，致力于维护和提升公司良好的市场形象。报告期内，公司严格遵守中国《公司法》《证券法》《证券公司监督管理条例》《证券公司治理准则》《上市公司治理准则》《企业管治守则》等相关法律法规以及《公司章程》的要求，公司治理水平持续提升；公司“三会一层”的治理架构权责分明、有效制衡、科学决策，有力保障了公司的科学规范运作；公司不断完善内控管理体系建设，使内部控制的完整性、合理性和有效性进一步增强。公司长期以来致力于公司治理结构和制度建设的不断完善。

报告期内，公司经营和管理规范有序，能够严格按照法律法规和规范性文件等有关规定，不断完善规章制度。报告期内，公司根据中国证监会《上市公司章程指引》、中国证券业协会关于证券公司行业文化建设相关要求，结合公司实际及监管部门要求，修改或完善《公司章程》中关于董事会构成、公司文化建设及董事职责划分等相关规定。报告期内，公司召开股东大会 2 次，董事会会议 5 次，监事会会议 4 次，战略发展委员会会议 2 次、合规与风险管理委员会会议 3 次、审计委员会会议 2 次、薪酬与提名委员会会议 4 次，董事会专门委员会会议共计 11 次。公司股东

大会、董事会、监事会的召开程序、表决程序合法有效。报告期内，公司不断加强投资者关系管理及信息披露工作，公司投资者关系管理工作规范、专业，信息披露真实、准确、完整、及时、公平，公司透明度持续提高。

通过制度的建立与不断完善并有效执行，公司治理结构不断规范，公司治理水平不断提高，公司治理的实际情况与中国《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。今年初至 2021 年 3 月 4 日总裁金文忠先生代行董事长职责，且公司 2021 年 3 月 5 日完成换届选举后，金文忠先生为公司董事长兼总裁，公司遵循了《企业管治守则》中除 A.2.1 条之外的所有守则条文；鉴于公司董事会审议通过的《董事会议事规则》和《总裁工作细则》已分别对董事长和总裁的职责分工进行了明确的界定，公司作出重大决策之时，董事会框架下仍由其他执行董事、非执行董事、独立非执行董事及职工董事等十余人共同决策，董事会下设各专门委员会及独立非执行董事均将继续积极发挥专业和监督职能，能够有效处理因董事长兼任总裁可能存在的潜在管治问题，因此公司达到了《企业管治守则》中所列明的绝大多数建议最佳常规条文的要求。

公司治理实际情况与中国《公司法》、中国证监会相关规定和《企业管治守则》的要求不存在差异。

（一）关于股东和股东大会

公司严格按照《公司章程》和《股东大会议事规则》的要求召集、召开股东大会，确保所有股东享有平等地位，能够充分行使自己的权利。

（二）关于董事和董事会

公司严格按照《公司章程》的规定选举和变更董事，董事人数构成和任职资格符合法律、法规的要求。截至报告期末，公司董事会由 13 名董事组成，其中执行董事 2 名，非执行董事 5 名，独立非执行董事 5 名，职工董事 1 名。各位董事能够勤勉尽责地履行职责，维护公司和全体股东的利益。董事会下设战略发展委员会、审计委员会、合规与风险管理委员会、薪酬与提名委员会，各委员会分工明确，权责分明，有效运作，其中审计委员会及薪酬与提名委员会的主任委员由独立非执行董事担任，且全部委员均为非执行董事，半数以上委员为独立非执行董事。

董事会设有审计委员会，符合中国证监会、上交所及香港上市规则的有关规定，截至报告期末，审计委员会由 5 名成员组成，包括靳庆鲁先生、俞雪纯先生、周东辉先生、冯兴东先生和罗新宇先生。审计委员会主要负责公司内、外部审计的沟通、监督及核查等工作，并向董事会提供专业意见。审计委员会已审阅并确认 2021 年半年度财务报告。

（三）关于监事和监事会

公司监事会现由 9 名监事组成，其中职工代表监事 3 名，股东代表监事 5 名，独立监事 1 名，人员任职资格和构成符合法律、法规的要求。公司监事能够勤勉尽责地履行职责，能够本着对股东负责的精神，对公司财务、董事会成员以及高级管理人员履行职责的合法合规性进行监督，并就有关事项向董事会和高级管理层提出建议和改进意见。

（四）关于高级管理层

公司高级管理层产生的程序符合中国《公司法》和《公司章程》的规定，公司高级管理层能够依照法律、法规和董事会的授权，依法合规经营，努力实现股东利益和社会效益的最大化。

（五）公司投资者关系管理工作开展情况

规范专业化的投资者关系管理既是上市公司的应尽义务，也是树立品牌形象与体现企业价值的有效手段。公司高度重视投资者关系管理的相关工作，并将投资者关系的维护与管理作为未来公司资本战略最重要的部署之一。公司不断完善投资者关系管理长效机制，建立 IR 工作体系、工作制度、工作流程；公司通过专设投资者热线、电子邮箱、公司网站、“东方证券投资者关系平台”微信公众号、电话会议、现场接待、网上互动、投资者见面会、业绩发布会、业绩路演及上交所推出的 E 互动平台等多种载体加强与投资者的沟通。

2021 年上半年，公司开展各类路演交流活动共 36 场。其中，为积极响应证监会、交易所等监管部门号召，充分保障各类投资者权益，公司举办 2020 年度业绩说明会，业绩会于全景网和上证路演中心进行双平台视频直播，直播页面浏览量达到 7.4 万次，有效提升了公司的市场关注度。此外，报告期内，公司接待小范围调研活动 9 次，参加券商策略会交流 10 次，接听投资者热线电话并回答投资者提问，通过上证 E 互动耐心解答各类投资者的相关问题 45 个，并于“东方证券投资者关系平台”公众号发布公司经营情况相关推送 18 篇，多维度提升投资者对公司的认同度，推进投资者与公司的协同发展。报告期内，在“第四届新财富最佳 IR 港股公司评选”中，公司获评“最佳 IR 港股公司(A+H 股)”；在证券时报社主办的第十二届中国上市公司投资者关系论坛中，公司获评“最佳投资者关系奖”、“主板最佳董事会奖”等荣誉。

（六）关于信息披露

报告期内，公司认真做好公司信息披露工作，严格按照中国大陆和香港两个上市地的法律、法规及相关规范性文件的要求，真实、准确、完整、及时、公平地披露公司信息。同时，公司根据中国证监会《关于上市公司内幕信息知情人登记管理制度的规定(2021 年)》(证监会公告(2021)5 号)《上海证券交易所上市公司内幕信息知情人报送指引(2020 年)》等要求，修改完善公司《内幕信息知情人登记及保密管理办法》，严格遵照执行该办法的各项有关处理及发布内幕消息的程序和内部控制措施，加强内幕信息保密工作，认真履行内幕信息知情人登记管理及保密义务。公司获得上交所信息披露工作评价结果为 A（最高级别）。

五、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
---------	---

六、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

为建立和完善员工与公司的利益共享机制，提高员工的凝聚力和公司竞争力，吸引和保留优秀人才，促进公司长期、持续、健康发展，促进公司、股东和员工三方的利益最大化，公司于2020年实施了H股员工持股计划。

公司第四届董事会第二十次会议、第四届监事会第十五次会议，2020年第一次临时股东大会审议通过了《关于〈东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）〉及摘要的议案》、《关于授权董事会全权办理公司员工持股计划相关事宜的议案》。2020年7月7日，公司召开第三届职工代表大会第四次全体会议，审议通过了《东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）》及其摘要。公司本次员工持股计划实际参与人数为3,588人，募集资金总额为人民币316,657,000元，其中公司董事、监事和高级管理人员认购金额占本次员工持股计划总额的8.27%。（公告编号：2020-45、46、51、53）

2020年7月23日，公司通过网络投票的方式召开了公司员工持股计划第一次持有人会议，会议审议通过了《关于选举东方证券股份有限公司员工持股计划管理委员会委员的议案》及《关于授权东方证券股份有限公司员工持股计划管理委员会办理本次员工持股计划相关事宜的议案》。（公告编号：2020-056）

公司H股员工持股计划已于2020年12月24日完成标的股票的全部购买及登记过户工作，“东方证券员工持股计划1号单一资产管理计划”及“东方证券员工持股计划2号单一资产管理计划”在二级市场累计买入公司H股股票65,906,800股，占公司总股本的比例为0.942%，占公司H股股本的比例为6.417%，成交金额合计为人民币3.0亿元，剩余资金用于流动性管理。

根据《东方证券股份有限公司员工持股计划》，公司H股员工持股计划所获标的股票的锁定期为12个月，自公司公告最后一笔标的股票完成登记过户之日起算，即2020年12月25日至2021年12月24日。

公司将严格遵守市场交易规则，持续关注公司员工持股计划的实施进展情况，并按照相关规定及时履行信息披露义务。

其他激励措施

适用 不适用

第五节 环境与社会 responsibility

一、环境信息情况

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

适用 不适用

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

1. 因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

2. 参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

公司所处的行业是金融证券业，属于非重点排污单位，主要经营业务为证券经纪；融资融券；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券承销（限国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企业债务融资工具））；股票期权做市业务；证券投资基金托管。

公司始终倡导与推行“绿色办公，低碳生活”的理念，寻求节能、环保、高效的管理模式，将绿色环保概念贯彻于公司的经营管理过程中，积极履行企业公民的责任。公司每年编制 ESG 报告，披露公司在环境方面所做的努力及成果。报告期内，公司不存在因环境问题受到行政处罚的情形。

3. 未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

(三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

(四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

适用 不适用

地球是人类唯一的家园，和谐的自然生态是人类赖以生存的基础，作为一家证券公司，公司在保护生态、防止污染，履行环境责任方面格外重视。一直以来，公司关注地球可持续发展，持续向员工、客户、合作伙伴，通过官方微信平台策划传播形式多样的环境保护理念倡导共计二十余次；通过公司内部各大宣传渠道，面向员工发起五项环保行动倡议，其中包括：开展节水行动、减碳行动、减塑行动、参与野生动物保护和开展可持续消费行动；公司每年都举办“地球一小时”熄灯活动；并于 4 月 22 日世界地球日及 6 月 5 日世界环境日开展“这一刻，我们一起爱地球”环

保主题摄影展和互动项目；同时，公司在支付宝平台，与“白鲸鱼”旧衣服回收小程序联合公司员工旧衣回收，为衣物二次利用创建便捷平台；公司每月向有机肥料制造公益组织提供免费“咖啡渣回收”回收；另外，依托公司公益基金会平台，东方证券联手心得益彰艺术教室学生和志愿者一同前往海边捡拾塑料垃圾，共同践行环保理念。

(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

公司始终倡导与推行低碳环保的经营理念和工作方式，积极推进节能环保制度落实，促进员工养成日常环保行为习惯，推进办公场所可持续运营，通过节能减排、建设绿色数据中心和零废弃会议等方式，为环境保护贡献力量，助力中国 2060 碳中和目标的实现。

报告期内，公司持续打造具有低碳理念的办公场所，办公区域均采用 LED 灯，节约能耗的同时降低线路损耗；严格控制空调夏冬季的运作时间和温度；善用自然光作照明之用，及时关闭办公室电灯，加强办公设备的待机惯例，减少设备电耗；其次，公司倡导节约水资源，安装卫生间感应龙头，定期及时巡检维修用水设备，消除跑冒滴漏现象。另外，公司针对办公环境减少纸张使用推出有效措施，例如：推进发布电子版司报替代纸质版本；所有通知利用 OA 系统公布，推进无纸张化办公；公司社会责任报告印刷全部使用通过森林管理委员会（FSC）认证的纸张。还在绿色装修方面，使用绿色环保型材料装修办公区域，避免污染环境危害人体。同步，针对办公运营产生的有害废弃物委托有资质单位进行回收。

与此同时，在绿色数据中心建设方面，公司依据《关于加强绿色数据中心建设的指导意见》等政策要求，加快推动数据中心低碳转型。金桥数据中心为国家首座获得三星级绿色建筑设计标识证书的金融数据中心，并不断采用节能减排技术提高能源及资源使用效率，降低温室气体排放。

公司持续倡导低碳环保新风尚，自今年以来，公司重力打造“零废弃”理念，全面推进“零废弃”大楼，和“零废弃”会议。在报告期内，公司举办了“可持续发展系列论坛：碳中和背景下的 ESG 投资”和“碳中和背景下的‘绿能’发展”论坛。在两场论坛中，公司积极践行“零废弃”会议的绿色倡导，并将可持续发展理念带到此次活动。会场现场设置了回收装置，由工作人员对会议物料及现场耗材进行科学化管理。活动结束后，会议现场的纸品、胸卡、饮料瓶等废弃物，将被收集后送入工厂，再生成环保商品。此次会议实现了会议现场可持续发展主题论坛中，对会议物料及现场耗材进行科学化管理，并将会议过程中产生的纸品、胸卡、饮料瓶等废弃物集中收集、循环利用。同时，公司鼓励员工使用公共交通及同行共同用车，严格管控公司自有车辆出行；鼓励使用电话视频会议系统进行线上沟通，减少现场会议数量，降低因差旅出行产生的碳排放。

报告期内，公司聚焦减塑议题，多维度参与减塑行动，进一步创新自身的环保实践。在办公大楼内部，公司设置 mini 塑料回收站，鼓励员工参与塑料瓶回收，通过支持塑料的回收再用减少

塑料废弃环节带来的碳排放。未来，公司将进一步聚焦减塑行动，并不断探索针对这一议题的系统化解决方案，以此助力美好生态建设。

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

公司积极响应国家号召和证券行业指引，深入贯彻落实相关文件精神，践行脱贫攻坚及乡村振兴工作。报告期内，公司积极履行企业社会责任，持续响应国家乡村振兴战略的号召，积极巩固拓展脱贫攻坚成果，围绕产业扶贫、教育扶贫、消费扶贫等多个方面开展相关工作。未来，公司还将持续做好各项相关工作，担当时代责任，助力乡村振兴。

(一) 主要策略

1、结合原贫困县资源禀赋，因地制宜进行产业帮扶。

在充分进行实地调研，了解各个原贫困县特色资源的基础上，公司因地制宜地进行产业帮扶。目前，公司以湖北五峰、内蒙古莫旗等地为重点项目落地区域，着力帮助当地发展茶叶、菇娘果等特色产业，积极探索建立长效脱贫机制，以点带面地稳步推进结对帮扶县巩固脱贫攻坚成果工作，做到重点突出、点面结合。

2、坚持以产业扶贫为主，以消费渠道推动原贫困县实现“造血”功能。

公司在各项巩固脱贫攻坚成果工作中，重点坚持能为帮扶对象实现可持续发展的产业帮扶模式，通过整合集团资源及互联网资源，包括联手知名电商网站、特色产业内知名企业等方式，共同促进当地特色产业发展，旨在长久地为原贫困县实现产业“造血”功能。

3、为结对帮扶地区提供人才保障。

公司在相关工作中坚持“扶贫先扶智”的工作思路，持续通过教育扶贫、金融知识讲座、职业技能培训等多种方式，为原贫困县提供智力支持和输送相关人才。

4、充分利用金融企业优势，创新精准扶贫新模式。

公司持续发挥金融企业优势，通过“保险+期货”扶贫等方式帮助原贫困县农户化解农产品价格波动风险，并充分整合并利用相关资源，创新精准扶贫模式，旨在为精准脱贫提供更多具有参考意义和可复制性的案例。

5、强化项目过程管理，推动乡村振兴工作顺利落地。

公司内部成立相关工作领导小组，确立每年重点工作，并通过与结对帮扶地区日常工作联系机制、实地走访调研、事中事后反馈机制等，做好项目过程管理，保障帮扶项目顺利开展，确保乡村振兴工作落实到位。

(二) 工作开展情况

公司及旗下子公司先后与内蒙古莫旗、吉林省通榆县、山西省静乐县、四川省沐川县、湖北省五峰县、宁夏盐池县、陕西省延长县、甘肃省秦安县、云南省景谷县、云南省澜沧县、云南省

孟连县、江西省南康市、云南省富宁县、黑龙江省绥滨县、新疆麦盖提、河南省桐柏县、黑龙江省林甸县、云南省西畴县、甘肃省礼县等 19 个原国家级贫困县签署了结对帮扶协议，开展相关帮扶工作。

报告期内，公司在扶贫方面投入资金共计 393.67 万元，开展扶贫项目共计 4 个。其中，产业扶贫项目 1 个，投入扶贫资金 255.87 万元；教育扶贫项目 3 个，投入扶贫资金 137.80 万元。

1、实施湖北五峰“东方红精选明前春茶”产业扶贫项目

公司为进一步促进五峰茶叶产业发展，公司在当地持续开展了特色茶叶产业扶贫工作，并结合各方资源，持续开展了“东方红精选明前春茶”产业扶贫项目，以进一步推广五峰当地风土人情，并借助旗下资产管理“东方红”品牌的影响力，打造“东方红精选明前春茶”品牌，通过品牌的打造建立持久的市场竞争力和溢价能力。

2、稳步推进内蒙古莫旗“东方菇娘”产业扶贫

在 2017 年至 2020 年取得较好社会效益的基础上，今年公司继续启动“东方菇娘”产业项目，并着手开展相关前期准备工作，具体包括：持续优化菇娘果收果、存储等环节，提升产品质量；为莫旗菇娘果推广及传播设计整体方案，拟通过开发周边衍生品等方式进一步提高产品知名度；完善与本来生活网合作机制，并借助集团优势和电商渠道优势，加大对菇娘产品的推广、销售力度，惠及当地更多贫困农户。

3、持续推进教育扶贫项目

公司在内蒙古莫旗持续开展的教育扶贫工作顺利落地。公司通过学生申请、学校及当地扶贫办审核的方式来确定需要帮扶学生的具体人数，持续进行贫困生资助项目，并将扶贫资金精准发放至建档立卡贫困生家庭中，资助贫困高中生顺利完成学业。报告期内，公司共计为内蒙古莫旗尼尔基第一中学 126 名贫困学生提供资助，资助金额合计为 37.80 万元。2017 年 3 月以来，公司已先后在莫旗尼尔基第一中学开展了九期扶贫资助项目，惠及贫困学生约 950 人次，合计资助金额超过 280 万元。

(三) 后续工作计划

1、扎实推进多地各个产业扶贫项目

自与多个原贫困县结对帮扶以来，公司结合其产业资源禀赋，已因地制宜地开展了多个产业扶贫项目，包括内蒙古莫旗东方菇娘项目、湖北五峰东方红宜红茶项目、宁夏盐池滩羊养殖项目等等，并已取得较好的扶贫成效。未来，公司将继续坚持产业扶贫为主的思路，持续扎实推进在多个原贫困县已开展的重点产业扶贫项目，确保真正达到促进当地产业可持续发展的目标，助力国家乡村振兴战略。

2、持续推进教育扶贫项目

公司将继续根据实际情况，在多个原贫困县开展以贫困生资助为主的教育扶贫项目，并确保将扶贫资金精准发放至建档立卡贫困生家庭中，帮助贫困学生顺利完成学业，解决其后顾之忧。此外，公司还计划继续投入资金用于乡村地区教育基础设施改进等项目。

3、积极做好“双一百”结对帮扶工作

2018 年，公司积极响应上海市国资委“百企帮百村”活动号召，对接帮扶云南文山州富宁县谷拉乡平蒙村。公司将持续以“三带两转”，即带人、带物、带产业，转观念和转村貌为工作重点，着力解决当地贫困群众关心的急难愁问题，助力巩固当地脱贫攻坚成果及更好地发展。

4、持续做好各项公益扶贫工作

根据实地调研及原贫困县实际需求情况，公司及旗下子公司开展了包括援建基础设施、捐赠办公物资、为小学生捐赠学习及生活物品等在内的各项公益扶贫项目。未来，公司将持续加强与乡村地区的日常沟通，深入了解其各项实际需求，并借助旗下心得益彰公益基金会等力量，持续做好各项公益扶贫工作。

第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

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

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与首次公开发行相关的承诺	解决同业竞争	申能集团	申能集团已向本公司出具《避免同业竞争承诺函》，承诺申能集团及其直接、间接控制的公司、企业不以任何形式从事与本公司及其子公司构成竞争或可能构成竞争的业务和经营。	在本公司公开发行 A 股股票并上市后。	否	是	/	/
与再融资相关的承诺	股份限售	申能集团	申能集团承诺自新增持本公司股票在证券交易所上市交易之日起 48 个月不转让或者委托他人管理已直接和间接持有的本公司股份，也不由本公司回购该部分股份。	在本公司 2017 年非公开发行 A 股股票并上市后 48 个月	是	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

报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》中要求披露的涉案金额超过人民币 1,000 万元且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的重大诉讼、仲裁事项，不存在媒体普遍质疑的事项。

公司主要诉讼及仲裁（占公司诉讼及仲裁总额 90% 以上）情况如下：

起诉方	应诉方	诉讼仲裁类型	案由	涉案金额	案件进展
东方证券	大连长富瑞华集团有限公司	诉讼	大连长富瑞华集团有限公司于 2014 年 6 月以其持有的“退市大控”（“大连控股”，600747）限售股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 8 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2017 年 6 月于辽宁高院获执行立案，7 月辽宁高院指定大连中院管辖。2018 年 1 月，大连中院从质押股票首封法院处取得处置权。2019 年 8 月进入司法拍卖程序，在司法评估期间，上市公司于 2019 年 12 月退市，上市公司退市至新三板挂牌，经向主办券商太平洋证券申请，管理人同意提前处置质押股票，于 2020 年 6 月第一次拍卖流拍，7 月召开第一次债权人会议并获得管理人对公司债权的审定。目前等待管理人继续推进破产程序。
东方证券	上海郁泰登硕投资中心（有限合伙）及保证人上海阜兴实业集团有限公司	诉讼	上海郁泰登硕投资中心（有限合伙）于 2016 年 9 月以其持有的“保力新”（“坚瑞沃能”，300116）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由上海阜兴实业集团有限公司提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.70 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2018 年 8 月于上海二中院获执行立案，9 月完成首封冻结。2019 年 9 月进入执行阶段，公司通过司法委托二级市场抛售的方式处置了部分质押股票，收回部分执行款。其余质押股票经 2020 年 1 月司法拍卖流拍后，已由法院作出以股抵债裁定，并完成以股抵债手续，3 月上海二中院因处理其他刑事案件，冻结公司本案执行回款约 0.65 亿元（按已抛售的过户股票数量对应抵债价值计），待刑事案件审结后根据相关法律文书处理。2020 年 3 月公司就处置质押股票不足偿付部分向保证人上海郁泰投资管理有限公司于上海金融法院

					提起保证人之诉。
东方证券	林文智、其配偶以及第三笔交易人福建同孚实业有限公司	诉讼	林文智于 2014 年 9 月起以其持有的“ST 冠福”（“冠福股份”，002102）流通股与公司陆续开展了三笔股票质押式回购交易。其中一笔交易由福建同孚实业有限公司提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.27 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	<p>2019 年 7 月就三笔交易向上海金融法院合并起诉并完成诉讼保全。上海金融法院就上述三笔交易分拆两案，于 2020 年 1 月就涉本金 0.91 亿元的交易案件正式开庭，3 月公司收到一审判判决书，法院支持公司除未实际发生的律师费部分及保全担保费外其他所有诉请。对方未上诉，4 月公司申请执行立案，金融法院于 2021 年 1 月和 2 月分别裁定拍卖股票，4 月拍卖均已成交，并已完成司法过户，5 月公司收到终本裁定。</p> <p>另，上海金融法院移送黄浦法院的案件于 2020 年 3 月立案，8 月正式开庭，11 月，法院作出一审判决，支持公司除未实际发生的律师费部分及保全担保费外其他所有诉请。经公告送达，2021 年 3 月判决生效，4 月获黄浦法院执行立案，目前尚在执行中。</p>
东方证券	北京市梧桐翔宇投资有限公司	诉讼	北京市梧桐翔宇投资有限公司于 2016 年 8 月以其持有的“*ST 德奥”（“德奥通航”，002260）流通股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.24 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2019 年 7 月于上海金融法院诉讼立案，4 月完成第一次开庭。5 月公司收到一审胜诉判决，对方未上诉。7 月公司申请执行立案。9 月质押股票首封法院杭州中院向上海金融法院移送处置权。但因无法确定上市公司何时复牌，于 2020 年 11 月终本。2021 年 1 月，公司申请续封涉案股票。
东方证券	林文昌	诉讼	林文昌于 2016 年 6 月起以其持有的“ST 冠福”（“冠福股份”，002102）限售股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 2.83 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2019 年 9 月于泉州中院执行立案，并完成执行保全。2020 年 3 月泉州中院取得质押股票处置权。2021 年 4 月案涉质押股票挂牌拍卖，并均已成交。现等待执行法院办理司法过户。
东方证券	张庆文	诉讼	张庆文于 2015 年 12 月起以其持有的“*ST 邦讯”（“邦讯技术”，300312）流通股与公司开展股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.86 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2019 年 10 月于北京一中院执行立案。2020 年 3 月法院收到深圳首封股票处置权，公司向法院申请执行。6 月公司与法院沟通拍卖方案。10 月、11 月两次流拍。2021 年 6 月法院出具以股抵债裁定。目前待办理司法过户手续。
东方证券	戴芙蓉	诉讼	戴芙蓉于 2015 年 9 月起以其持有的“*ST 邦讯”（“邦	待偿还本金 1.50 亿元及应付未付利	分两个司法案件处理： 其中，诉讼案件于 2019 年 9 月获黄浦法院正式立案，但被告提起管辖权异

			讯技术”，300312）流通股与公司开展股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	议，黄浦法院予以驳回后被告上诉至上海金融法院，2020 年 1 月上海金融法院出具驳回被告管辖权异议的终审裁定。5 月正式开庭。6 月公司收到一审胜诉判决，除尚未实际支付的律师费及保全担保费，所有诉请得到支持。6 月被告提出上诉。12 月公司收到二审判决，维持原判。2021 年 1 月公司正式向黄浦法院申请执行并立案。5 月法院司法拍卖一拍流拍。6 月黄浦法院作出以股抵债裁定。7 月已完成过户手续。 执行案件于 2019 年 10 月获北京一中院执行立案，2020 年 6 月公司与法院沟通拍卖方案。10 月、11 月两次流拍。2021 年 6 月法院出具以股抵债裁定，目前待办理司法过户手续。
东方证券	徐蕾蕾	诉讼	徐蕾蕾于 2016 年 11 月起以其持有的“皇氏集团”（002329）股份与公司开展股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.19 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2019 年 10 月于北京三中院执行立案，12 月公司与被执行人达成执行和解协议，但因其未按协议还款，公司于 2020 年 1 月申请恢复执行。首封重审案件于 9 月重新开庭，南宁中院于 2021 年 2 月作出判决认定公司享有质押权，但因对方上诉，本案移送至广西高院，目前等待二审。
东方证券	贾全臣法定继承人黄秀珍、王文琪、贾晓钰及交易保证人贾晓钰、王晶晶	诉讼	贾全臣（已故）于 2016 年 9 月以其持有的“青岛中程”（300208）流通股与公司开展了股票质押式回购交易，后贾晓钰、王晶晶对该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。贾全臣在到期日之前去世，未能到期购回，构成违约且质押股票被司法冻结。公司向其财产继承人王文琪、贾晓钰以及保证人主张债权。	待偿还本金 1.15 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2019 年 10 月于上海金融法院诉讼立案，于 2020 年 4 月第一次开庭。8 月公司与被告于法院达成调解，并制作民事调解书。后因被告方未能履行，公司申请强制执行，并由上海金融法院于 2021 年 1 月执行立案。4 月上海金融法院裁定拍卖质押股票，案涉股票定于 2021 年 7 月拍卖。
东方证券	北京东方君盛投资有限公司及保证人冯彪、高	诉讼	北京东方君盛投资有限公司（以下简称“东方君盛”）2017 年 9 月起以其持有的“海南椰岛”（600238）流通股与公司开展股票质	待偿还本金 4.25 亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债	2019 年 11 月于上海金融法院诉讼立案，完成诉讼保全，上海金融法院于 11 月开庭。2021 年 2 月收到一审判判决书，支持我司对债务人东方君盛及保证人冯彪、高忠霖的诉请及全部债权金额；未支持对两位保证人的配偶承担连带责任的诉请。3 月债务人东方君盛上

	忠霖及其配偶		押式回购交易，并由冯彪、高忠霖提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	权产生的相关费用	诉。目前上海高院已二审立案。
东方证券	深圳市老虎汇资产管理公司及保证人冯彪及其配偶	诉讼	深圳市老虎汇资产管理公司（以下简称“老虎汇”）2017年2月以其持有的“嘉应制药”（002198）流通股与公司开展了股票质押式回购交易，并由实控人冯彪提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	待偿还本金4.70亿元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用	2019年11月于上海金融法院诉讼立案，完成诉讼保全。上海金融法院于2021年1月一审开庭。3月公司收到一审判决书，支持我司对债务人深圳老虎汇及保证人冯彪的诉请及全部债权金额；未支持对保证人的配偶承担连带责任的诉请。债务人老虎汇提出上诉。目前上海高院已二审立案。
东方证券	科迪食品集团股份有限公司及保证人张清海	诉讼	科迪食品集团股份有限公司2015年12月以其持有的“*ST科迪”（“科迪乳业”，002770）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由公司实控人张清海提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	待偿还本金2.32亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2020年5月于上海金融法院一并起诉保证人张清海，完成诉讼立案。6月法院做出保全裁定。10月一审开庭。12月商丘中院受理科迪集团破产案件。2021年2月，上海金融法院作出一审胜诉判决，对方未上诉。5月公司完成债权申报。后续等待管理人推进破产程序。
东方证券	霖灞投资（上海）有限公司及保证人陈仲华、季俊及其配偶	诉讼	霖灞投资（上海）有限公司2016年8月以其持有的“*ST嘉信”（“华谊嘉信”，300071）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由法定代表人陈仲华、股东季俊为该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。	待偿还本金1.09亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2020年6月于上海金融法院诉讼立案，并完成质押股票首封冻结。9月开庭，达成调解并由法院出具民事调解书。因债务人未履行付款义务，2021年1月向上海金融法院申请强制执行。3月金融法院执行立案。5月法院裁定启动拍卖程序并委托评估案涉股票。目前等待委托评估结果。
东方证券	山东东方海洋集团有限公司	诉讼	山东东方海洋集团有限公司2017年10月起以其持有的“*ST东洋”	待偿还本金1.75亿元及应付未付利息、延期利	2020年7月于上海金融法院诉讼立案。12月一审开庭审理。2021年1月收到一审胜诉判决，4月公司获执行立案，5月申请上海金融法院向两个首封法院

			(002086) 与公司开展了股票质押式回购交易, 并由车轶、宋政华、车志远为该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。	息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	济南中院、青岛中院商请移送质押股票处置权。6 月济南中院与青岛中院均已将质押股票的处置权移送给上海金融法院。
东方证券	汕头市澄海区沪美蓄电池有限公司	诉讼	汕头市澄海区沪美蓄电池有限公司 2016 年 5 月起以其持有的“*ST 猛狮”(002684) 股份与公司开展了股票质押式回购交易, 并由陈再喜、陈银卿、陈乐伍、林少军、广东猛狮工业集团有限公司为该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。	待偿还本金 5.69 亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2020 年 8 月于上海金融法院诉讼立案。因本案无法送达所有被告, 故公告送达。2021 年 2 月, 本案开庭审理, 目前待法院判决。
东方证券	旭森国际控股(集团)有限公司	诉讼	旭森国际控股(集团)有限公司于 2016 年 9 月起以其持有的“*ST 环球”(“商赢环球”, 600146) 股份与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 2.39 亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2020 年 12 月于上海金融法院执行立案。被执行人提出异议, 要求不予执行。2021 年 1 月, 上海三中院受理旭森国际破产清算案, 2 月金融法院驳回旭森国际的执行异议, 并告知移送破产程序。公司同月向管理人提交债权申报材料。3 月上海金融法院出具终本裁定。公司债权已经管理人审定确认, 目前等待管理人继续推进破产程序。
东方证券	蔡廷祥	诉讼	蔡廷祥于 2017 年 9 月起以其持有的“文化长城”(300089) 股份与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.69 亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2021 年 1 月于广东潮州中院执行立案。2 月潮州中院向两家首封法院北京一中院、广州中院寄出《移送处置权商请函》。3 月北京一中院回函同意移送处置权; 4 月广州中院回函同意移送处置权; 5 月潮州中院先裁定查封、扣押、冻结蔡廷祥名下相应财产, 后裁定拍卖蔡廷祥持有的上市公司股票。同月蔡廷祥提出书面异议, 6 月潮州中院裁定驳回其异议。
东方证券	珠海中珠集团股份有限公司	诉讼	珠海中珠集团股份有限公司 2017 年 11 月起以其持有的“ST 中珠”(600568) 股份与公司开展股票质押式回购交易, 并由	待偿还本金 4.61 亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生	2021 年 4 月向上海金融法院一并起诉保证人珠海经济特区德正集团有限公司并获立案受理, 并完成财产保全。6 月上海金融法院定于 10 月开庭审理。

			珠海经济特区德正集团有限公司提供不动产抵押担保。上述交易现已违约。	的相关费用。	
东方证券	徐炜	诉讼	徐炜 2017 年 9 月起以其持有的“腾信股份”（300392）股份与公司开展股票质押式回购交易，并由滕瑛琪提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	待偿还本金 4.83 亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2021 年 5 月向上海金融法院一并起诉保证人滕瑛琪并获诉讼立案，并于当月完成财产保全。因起诉材料首轮送达失败，同时推进二轮送达及公告送达。
东方证券	石河子德梅柯投资合伙企业（有限合伙）	诉讼	石河子德梅柯投资合伙企业（有限合伙）2015 年 2 月起以其持有的“*ST 华昌”（300278）股份与公司开展股票质押式回购交易，并由执行事务合伙人陈泽提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。	待偿还本金 1.43 亿元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。	2021 年 5 月于湖北十堰中院执行立案。目前本案尚在执行中。针对保证人之诉，上海金融法院于 2021 年 3 月受理立案，4 月完成财产保全，6 月进行开庭审理。开庭后，法院依职权追加第三人石河子德梅柯，但因对方无法送达，目前将安排公告送达。

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

1、2021 年 2 月 19 日，中国证监会对东方投行出具《关于对东方证券承销保荐有限公司采取出具警示函措施的决定》，上述监管函件认定东方投行作为上海之江生物科技股份有限公司首次公开发行股票并上市的保荐机构，对发行人收入确认政策、固定资产、关联交易和关联方资金占用等情况的核查不充分，内部控制有效性不足。违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》第四条和第三十四条的规定。针对以上问题，东方投行高度重视，第一时间由合规问责小组启动问责程序，对该事项进行调查，并对相关人士进行了合规问责处理。此外，东方投行相关项目执行人员、质控部门、经营管理层均深刻反省、认真总结，切实提高和保障公司投行业务项目质量和执业水平，持续健全和完善公司内部控制和风险管控，确保公司业务持续健康发展。

2、公司无控股股东和实际控制人。报告期内，公司及其董事、监事、高级管理人员不存在被有权机关调查，被司法机关或纪检部门采取强制措施，被移送司法机关或追究刑事责任，被中国

证监会立案调查或行政处罚、被市场禁入、被认定为不适当人选，被环保、安监、税务等其他行政管理部门给予重大行政处罚，以及被证券交易所公开谴责的情形。

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

公司第一大股东为申能集团。报告期内，公司诚信状况良好，不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十、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

1) 集团与申能集团及其联系人发生的关联/连交易

截至本报告日期，申能集团持有公司已发行股本约 25.27%，根据《香港上市规则》第 14A.07(1) 条，申能集团及其联系人为公司的关连人士。报告期内，公司严格按照 2020 年年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2021 年度日常关联交易的议案》、第五届董事会第二次会议审议通过的《关于与申能（集团）有限公司签署〈2021-2023 年关连交易框架协议〉的议案》开展关联/连交易，相关执行情况如下表：

单位：万元 币种：人民币

交易类别	交易项目	相关业务或事项简介	关联方	预计金额	实际金额
证券和金融 服务	手续费及佣金收入	公司向关联方提供代理买卖证券、期货、财务咨询等服务，收取手续费及佣金等。	申能集团及其联系人	12,000.00	26.02
	承销费收入	公司向其提供证券承销服务，收取证券承销费用。			50.49
	客户保证金利息支出	公司向关联方提供代理买卖证券、期货等服务，支付客户资金存款利息等。		1,200.00	7.77
证券和金融 产品交易	债券交易	公司在银行间市场开展债券现券、债券回购、利率互换等交易。		220,000.00	2,000.00
采购商品和 接受劳务	业务及管理费	公司接受其提供的物业、供应燃气等服务。	5,000.00	850.84	

注：公司 2021 上半年与申能集团及其联系人发生的关联/连交易金额占公司同类型业务比重较小。

2) 集团与其他关联方发生的关联交易

报告期内，公司严格按照 2020 年年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2021 年度日常关联交易的议案》约定的年度交易金额上限开展关联交易，相关执行情况如下表：

单位：万元 币种：人民币

交易类别	交易项目	相关业务或事项简介	关联方	预计金额	实际金额
证券和金融服务	手续费及佣金收入	公司向关联方提供代理买卖证券、期货、财务咨询等服务，收取手续费及佣金等。	汇添富基金管理股份有限公司	因交易量难以预计，以实际发生数计算。	15,028.53
			长城基金管理有限公司		119.37
			上海东方证券心得益彰公益基金会		1.47
			上海上报资产管理有限公司		0.10
			关联/连自然人		134.07
	利息收入	公司持有关联方发行的债券而获得相应期间的利息收入。	中国太平洋财产保险股份有限公司	因持有债券的规模及期间难以预计，以实际发生数计算。	239.91
			上海新华发行集团有限公司		101.14
			上海上报资产管理有限公司		77.15
			浙江省能源集团有限公司		0.06
	投资收益	公司购买关联方发行的证券、基金、保险等产品而取得的投资收益。	长城基金管理有限公司	因购买证券及各类产品的规模、收益难以预计，以实际发生数计算。	877.97
			中国太平洋保险(集团)股份有限公司		319.29
			江苏金融租赁股份有限公司		6.74
			浙商银行股份有限公司		-0.30
			绿地控股集团有限公司		-0.74
			上海电气集团股份有限公司		-5.57
	客户保证金利息支出	公司向关联方提供代理买卖证券、期货等服务，支付客户资金存款利息等。	海通证券股份有限公司	因客户资金规模难以预计，以实际发生数计算。	-182.51
			汇添富基金管理股份有限公司		0.38
			上海上报资产管理有限公司		0.13
			绿地控股集团有限公司		0.03
			上海东方证券心得益彰公益基金会		0.01
证券和金融产品交易	证券交易	公司认购、申购关联方发行的股票、债券等证券的期末余额。	汇添富基金管理股份有限公司	因业务的发生及规模的不确定性，以实际发生数计算。	0.47
			上海上报资产管理有限公司		0.38
			绿地控股集团有限公司		0.03
			上海东方证券心得益彰公益基金会		0.01
			关联/连自然人		0.47
			长城基金管理有限公司		24,994.32
			上海建工集团股份有限公司		17,087.12
			中国太平洋财产保险股份有限公司		10,390.07
			上海新华发行集团有限公司		5,207.01
			海通证券股份有限公司		5,155.40
			上海上报资产管理有限公司		4,126.26
			上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司		1,919.22
			浙江省能源集团有限公司		1,000.07
江苏金融租赁股份有限公司	97.60				
中国太平洋保险(集团)股份有限公司	75.32				
绿地控股集团有限公司	52.81				
浙商银行股份有限公司	5.08				
上海电气集团股份有限公司	3.26				
采购商品和接受劳务	业务及管理费	公司接受关联方提供的电力等服务。	国网上海电力公司	因使用量难以预计，以实际发生数计算。	69.56

注：

(1) 存在控制关系且已纳入公司合并会计报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

(2) 公司 2021 年上半年与其他关联方发生的关联交易金额占公司同类型业务比重较小。

(3) 关联/连自然人包括：直接或者间接持有上市公司 5%以上股份的自然人；公司董事、监事及高级管理人员；上述人士的关系密切的家庭成员等。上述交易的适用百分比率均低于《香港上市规则》第 14A.76(1)条所述之最低豁免水平，因此上述交易已完全获豁免遵守《香港上市规则》第 14A 章的所有申报、年度审核、公告、通函及独立股东批准规定。

3) 关联/连交易的交易类别和定价政策

集团预计与关联/连方开展证券和金融产品交易、中介服务等交易，具体交易类别及定价政策如下：

(1) 证券和金融服务

证券和金融服务包括但不限于以下服务：证券、期货经纪；出租交易席位；证券金融产品销售；承销和保荐；财务顾问；受托资产管理；结售汇；证券金融业务；资产托管；证券和金融顾问及咨询等。

证券和金融产品的定价原则乃根据相关服务费用应按照适用的相关法律及法规的要求，并参考当时市场费率后由双方协商确定。具体而言：

- 证券、期货经纪服务 — 由于经纪服务的佣金率在市场上普遍透明及标准化，因此佣金率将参考相关法律及法规的要求，以及适用于独立第三方的佣金费率及经纪交易的估计规模，经订约方公平协商后厘定；

- 出租交易席位服务 — 出租交易席位服务费将参考适用于独立第三方的费用水平，经订约方公平协商后厘定；

- 证券金融产品销售服务 — 厘定服务费的因素包括市场价格、行业惯例及涉及金融产品销售的总额，并参考集团为类似类型及产品属性的产品销售收取的收费水平；

- 承销和保荐服务 — 承销和保荐服务市场竞争激烈，服务费率及相关收费透明度及标准化程度较高。服务收费将参考相关法律及法规的要求，考虑多项因素，包括当时市场条件、拟发行规模、近期类似性质和规模发行的一般市场费率，及类似服务适用于独立第三方的费用水平等因素，经订约方公平协商后厘定；

- 财务顾问服务 — 财务顾问服务收费在市场上透明度及标准化程度较高，服务收费将参考相关法律及法规的要求，考虑当时市场条件、交易性质及规模及类似服务适用于独立第三方的费用水平等因素，经订约方公平协商后厘定；

- 受托资产管理服务 — 资产管理服务费率在市场上透明度及标准化程度较高，服务收费将参考相关法律及法规的要求，考虑受托资产规模、提供指定服务的复杂性及类似服务适用于独立第三方的费用水平等因素，经订约方公平协商后厘定；

- 结售汇服务：结售汇服务的交易汇率将考虑当时银行间外汇市场汇率水平、交易规模及类似服务适用于独立第三方的汇率标准等因素，经订约方公平协商后厘定；

- 证券金融业务服务：证券金融业务服务费将参考适用于独立第三方的费用水平，经订约方公平协商后厘定；

- 资产托管服务 — 资产托管服务费将参照类似类型及规模的交易的现行市场收费水平，经公平协商而厘定；及

- 证券和金融顾问及咨询等其他证券和金融服务：该类服务费用将按照适用的相关法律法规，参考现行市价、交易性质、各方服务成本及类似服务适用于独立第三方的费用水平，经订约方公平协商后厘定。

(2) 证券和金融产品交易

证券和金融产品交易包括但不限于以下交易：1、与权益类产品、非权益类产品及其衍生产品相关的交易：包括但不限于股票、债券、基金、信托、理财产品、资产管理计划、资产证券化产品、互换、期货、期权、远期及其他金融产品；2、与融资相关的交易：金融机构间进行的资金融通行为，包括但不限于同业拆借；回购；相互持有收益凭证、短期融资券、次级债及公司债等债务凭证；3、监管部门允许的其他证券和金融产品交易。

证券和金融产品交易的定价原则应按照适用的相关法律及法规的要求，并参考当时市场费率后由双方协商确定。具体而言：

1、证券和金融产品交易主要通过银行间债券市场和交易所（包括交易所债券市场和期货交易所等）开展。该等交易定价须遵守相关法律法规且受严格监管，按现行市价开展。

在银行间债券市场和交易所债券市场交易的证券和金融产品主要包括大部分固定收益类产品及部分回购交易。在银行间债券市场和交易所债券市场进行交易的价格分别根据银行间债券市场及交易所债券市场的报价厘定，主要参考中央国债登记结算有限责任公司（“CCDC”）发布的相关证券和金融产品的估值，以及中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心（“NIFC”）发布的收益率曲线及成交行情而确定。

银行间债券市场是由中国人民银行根据《全国银行间债券市场债券交易管理办法》高度监管的报价驱动市场。银行间债券市场的交易必须向 NIFC 报告并由 NIFC、CCDC 和中国银行间市场交易商协会（“NAFMII”）共同监管。根据相关法律法规，银行间债券市场的现行市价乃参考 NIFC 所报的买入价和卖出价厘定，而且所有交易，不论通过获授权的货币经纪公司或做市商，还是通过场外磋商进行，均须向 NIFC 报告，并反映于 NIFC 和 CCDC 提供的报价中。NAFMII 是负责监督银行间交易的自律组织，根据 NAFMII 的自律规则（即《银行间债券市场债券交易自律规则》），异常定价或会收到 NAFMII 的纪律处分。

交易所债券市场是由中国证监会监管的指令驱动市场。在交易所债券市场中进行的交易须按交易所所报的现行市价进行。

在交易所交易的证券和金融产品主要包括股票和债券。在交易所进行的交易须按交易所的现行市价进行。

在日常经营活动中，集团与关联/连方亦或会在场外进行证券和金融产品交易。场外衍生品交易的定价主要参考衍生品定价模型厘定，如蒙特卡洛模拟、B-S 模型等。若关联/连方认购集团的证券和金融产品，认购价须考虑所投资资产/业务基本情况及其他投资者认购价后厘定。

2、对于金融机构间借贷，须参考上海银行间同业拆放利率按银行间货币市场所报现行利率进行交易，定价须遵守相关法律法规且受严格监管。

集团在日常经营活动中以适用于独立第三方的利率或按一般商业条款更佳的条款与关联/连方金融机构进行回购交易，定价须考虑质押的证券、融资期限及现行市场利率后厘定。

倘由集团认购关联/连方推出的证券和金融产品，及由关联/连方认购集团推出的证券和金融产品，认购价与其他投资者认购时的认购价相同，该认购价由推出证券和金融产品的金融机构经考虑所投资资产或业务基本情况后厘定。

(3) 采购商品和接受劳务

采购商品和接受劳务包括接受申能集团及其联系人经营范围内的服务，包括但不限于以下交易：接受电力、煤气、天然气、燃气表灶、燃气设备用具、燃气厨房设备等商品和劳务，接受物业管理、燃气输配、燃气工程规划、设计施工等服务。

采购商品和接受劳务定价原则乃按照适用的相关法律及法规的要求，并参考当时市场价格后由双方在各方日常业务过程中，按一般商业条款经公平协商确定。集团与申能集团及其联系人已就有关定价机制原则上达成共识，将由下列方式厘定价格：1、若存在政府定价指引，则以政府指示性价格为准；或 2、若无任何目前适用的政府定价指引，则采纳专卖政府机关先前颁布的政府指示性价格作为基本价格，并通过参照申能集团及其联系人的采购或服务成本价格调整基本价格；上述第 2 项经上述调整后，应为公平合理的价格。

4) 关联/连交易（包括持续关连交易）的内部控制措施

集团已制订关联/连交易的内部指引及政策，已在关联/连交易的认定、发起、定价、决策、披露等主要方面都进行了详细规范，规定了关联/连交易的审批程序。

拟进行的证券和金融服务、证券和金融产品交易以及采购商品和接受劳务之交易的条款（包括定价条款）应与独立第三方就类似服务提供/获提供的条款相似，并应受独立第三方适用的相同内部甄选、审批及监督程序以及定价政策所规限。

公司各业务部门负责监控实际交易金额是否超过年度上限，妥善保存及存置有关关联/连交易的任何文件及记录；公司合规部门对拟发生关联/连交易的合规性、公允性进行审核；董事会办公室、计划财务总部和其他相关部门定期汇总数据，以确保实际发生金额不会超过年度上限，并提醒业务部门管控相关关联/连交易；公司稽核总部对实际发生的关联/连交易进行年度审核。

公司独立非执行董事及核数师会每年审阅公司的持续关联/连交易，董事会（包括独立非执行董事）确认交易的条款属公平合理，乃在集团的日常业务中以一般商业条款或更佳条款进行且符合公司及股东的整体利益。公司核数师须审阅上述持续关联/连交易，并向董事会发出函件确认。

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、 涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

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

适用 不适用

(六) 其他重大关联交易

适用 不适用

(七) 其他

适用 不适用

十一、 重大合同及其履行情况

1 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

2 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	0
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	0
公司对子公司的担保情况	
报告期内对子公司担保发生额合计	65.43
报告期末对子公司担保余额合计（B）	164.45
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	164.45
担保总额占公司净资产的比例（%）	26.93
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）	164.45
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）	
上述三项担保金额合计（C+D+E）	164.45
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	
担保情况说明	报告期内，公司及其全资子公司存在对下属子公司融资类担保金额为人民币0.83亿元，非融资类担保金额为人民币64.60亿元。其中： <ol style="list-style-type: none"> 1、公司全资子公司东方金控为其全资子公司东方证券（香港）获得中国工商银行（亚洲）有限公司1亿港元授信提供全额担保。 2、公司全资子公司东方金控为其境外全资子公司 Orient International Investment Products Limited 设立票据计划用以发行结构化票据提供总额不超过10亿美元的担保。

注：公司美元担保金额按 2021 年 6 月末人民币兑美元即期汇率（1 美元=6.4601 人民币）折算，港元担保金额按 2021 年 6 月末人民币兑港元即期汇率（1 港元=0.83208 人民币）折算。

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

1、报告期内公司营业部、分公司、子公司新设和处置情况

1) 新设证券营业部

报告期内，公司未新设证券营业部，截至报告期末，公司证券营业部总数为 177 家。

2) 证券营业部迁址

① 东方证券股份有限公司嘉兴中山南路证券营业部同城迁址，营业部从中国浙江省嘉兴市秀洲区中山西路 1776 号迁至中国浙江省嘉兴市嘉兴经济技术开发区广益路 864、866、868 号，营业部名称变更为东方证券股份有限公司嘉兴广益路证券营业部。

② 东方证券股份有限公司北京大郊亭南街证券营业部同城迁址，营业部从中国北京市朝阳区大郊亭南街 5 号院 1 号楼 1 层 106 及 2 层 2017 迁至中国北京市朝阳区光华路 8 号 17 幢一层 A111 及二层 A212 房间，营业部名称变更为东方证券股份有限公司北京国贸证券营业部。

3) 新设期货营业部

报告期内，公司期货子公司新设上海东证期货有限公司郑州商都路营业部，营业部地址为中国河南省郑州市郑东新区商都路永平路社区 27 号财信大厦 2 层 7 号、8 号，成立时间 2021 年 4 月 22 日。截至报告期末，公司期货营业部总数为 33 家。

4) 期货营业部迁址

① 上海东证期货有限公司上海新闻路营业部同城迁址，营业部从中国上海市静安区新闻路 1418 号 1 幢 407 室迁至中国（上海）自由贸易试验区福山路 458 号 1107 室，营业部名称变更为上海东证期货有限公司上海福山路营业部。

② 上海东证期货有限公司长沙营业部同城迁址，营业部从中国湖南省长沙市雨花区劳动西路 471 号中天电力大厦 7 楼迁至湖南省长沙市雨花区韶山中路 419 号凯宾商业广场 2118，营业部名称未变更。

5) 子公司增减资事项

① 2021 年 7 月，公司完成向全资子公司东证创投增资人民币 4.5 亿元，并已完成工商变更登记，即东证创投注册资本由人民币 58 亿元变更为人民币 62.5 亿元。上述事宜已经公司总裁办公会议审议通过。本次增资目的在于进一步深化集团协同，积极参与科创板和创业板战略配售，抓住发展机会，有效提升东证创投的市场竞争力和抗风险能力，进一步优化公司整体的业务布局及收入结构。公告编号（2021-038）

② 2021 年 7 月，公司拟对全资子公司东证创投增资人民币 9.50 亿元，对全资子公司东证资本减资人民币 9.50 亿元，上述事宜已经公司总裁办公室会议审议通过。本次增减资目的在于落实

监管整改要求及公司业务发展需要，同时整合子公司业务协调发展，提高集团资金使用效率。公告编号（2021-040）

2、利润分配实施情况

公司 2020 年度利润分配方案已于 2021 年 7 月 8 日实施完毕，本次利润分配以公司总股本 6,993,655,803 股为基数，向 2020 年度现金红利派发股权登记日登记在册的 A 股股东和 H 股股东，每 10 股派发现金红利人民币 2.50 元（含税），分配现金股利人民币 1,748,413,950.75 元。

3、公司吸收合并全资子公司

公司经第五届董事会第四次会议及 2021 年第二次临时股东大会，审议通过了《关于公司吸收合并全资子公司东方证券承销保荐有限公司的议案》。为进一步整合资源、提高效率，有效提升业务拓展和客户综合服务能力，公司拟吸收合并公司投行业务全资子公司东方投行。

（1）本次吸收合并的方式、范围及相关安排

① 公司拟通过吸收合并的方式合并东方投行的全部资产、负债、业务及人员。本次吸收合并完成后，东方投行的所有资产，包括但不限于固定资产、流动资产、客户协议等合并入公司，东方投行全部债权及债务由公司承继，东方投行的员工全部由公司管理接纳，东方投行的独立法人资格注销，原东方投行的分公司在经监管部门批准或备案后拟变更为公司分公司。

② 本次吸收合并不涉及公司的注册资本及股东的变化。

③ 本次吸收合并基准日为 2020 年 12 月 31 日，本次吸收合并以公司和东方投行在基准日经审计的财务数据为准。

④ 吸收合并基准日至本次吸收合并完成日期间所产生的损益由公司享有和承担。

⑤ 吸收合并双方编制资产负债表及财产清单，并进行相应审计评估工作（如需），履行通知债权人和登报公告程序。

⑥ 吸收合并双方共同办理本次吸收合并涉及的证券监管部门审批、国资主管部门审批及评估备案（如需）等手续。

⑦ 将东方投行的所有资产交付公司，吸收合并双方共同办理资产移交手续和相关资产的权属变更登记手续。

⑧ 本次吸收合并事宜获公司股东大会审议通过后，吸收合并双方将签订《吸收合并协议》，并在获得国资主管部门（如需）和证券监管部门批准后尽快办理东方投行注销手续等相关事宜。

（2）本次吸收合并对公司的影响

① 本次吸收合并完成后，公司投行业务牌照分割问题将得以解决，有利于充分发挥全牌照的优势，提高展业效率，进而提升公司综合金融服务水平。

② 本次吸收合并完成后，能够有效解决东方投行作为子公司经营时，流动性风险等指标对开展投行业务的影响和制约。

③ 本次吸收合并完成后，公司投行作为部门整体运作，管理与决策效率将有效提升，有利于推动公司投行业务整体发展。

④ 东方投行为公司全资子公司，本次吸收合并不会对公司合并报表当期损益产生实质性影响，不会对公司合并报表范围内资产、负债状况产生重大影响。

本次吸收合并不构成关联交易，根据《公司法》《公司章程》及相关法律法规的有关规定，本次吸收合并尚需相关监管部门批准。

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)	156,850
------------------	---------

(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	
申能(集团) 有限公司	0	1,767,522,422	25.27	230,000,000	无	-	国有法人
香港中央结 算(代理人) 有限公司	0	1,026,968,730	14.68	-	无	-	境外法人
上海海烟投 资管理有限 公司	0	345,486,596	4.94	-	无	-	国有法人
上海报业集 团	3,348,900	241,092,906	3.45	-	无	-	国有法人

浙能资本控股有限公司	0	208,700,000	2.98	-	无	-	国有法人
中国邮政集团有限公司	0	178,743,236	2.56	-	无	-	国有法人
中国证券金融股份有限公司	-31,084,800	178,025,625	2.55	-	无	-	未知
上海建工集团股份有限公司	0	133,523,008	1.91	-	无	-	国有法人
上海金桥出口加工区开发股份有限公司	-4,500,000	128,640,504	1.84	-	无	-	境内非国有法人
香港中央结算有限公司	-27,312,669	108,973,404	1.56	-	无	-	境外法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
申能(集团)有限公司	1,537,522,422	人民币普通股	1,537,522,422				
香港中央结算(代理人)有限公司	1,026,968,730	境外上市外资股	1,026,968,730				
上海海烟投资管理有限公司	345,486,596	人民币普通股	345,486,596				
上海报业集团	241,092,906	人民币普通股	241,092,906				
浙能资本控股有限公司	208,700,000	人民币普通股	208,700,000				
中国邮政集团有限公司	178,743,236	人民币普通股	178,743,236				
中国证券金融股份有限公司	178,025,625	人民币普通股	178,025,625				
上海建工集团股份有限公司	133,523,008	人民币普通股	133,523,008				
上海金桥出口加工区开发股份有限公司	128,640,504	人民币普通股	128,640,504				
香港中央结算有限公司	108,973,404	人民币普通股	108,973,404				
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	不适用						
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

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	申能（集团）有限公司	230,000,000	2021年12月28日		限售期为48个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		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

五、主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

于 2021 年 6 月 30 日，据公司及董事合理查询所深知，以下主要股东及其他人士（公司董事、监事及最高行政人员除外）于公司股份及相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 2 及 3 分部须向公司披露并根据《证券及期货条例》第 336 条规定须于备存之登记册所登记的权益及淡仓：

股东姓名/名称	股份类别	权益性质	股份数目 <small>(附注 1)</small>	占公司已发行类别总股本之概约百分比(%) <small>(附注 2)</small>	约占公司已发行总股本之概约百分比(%) <small>(附注 2)</small>
申能(集团)有限公司	A 股	实益拥有人	1,767,522,422 (L)	29.62	25.27
中国烟草总公司 <small>(附注 3)</small>	A 股	受控法团权益	345,486,596 (L)	5.79	4.94
上海烟草集团有限责任公司 <small>(附注 3)</small>	A 股	受控法团权益	345,486,596 (L)	5.79	4.94
上海海烟投资管理有限公司 <small>(附注 3)</small>	A 股	实益拥有人	345,486,596 (L)	5.79	4.94
祝立家 <small>(附注 4)</small>	H 股	受控法团权益	94,940,800 (L)	9.24	1.36
孙红艳 <small>(附注 4)</small>	H 股	受控法团权益	94,940,800 (L)	9.24	1.36
红佳金融有限公司 <small>(附注 4)</small>	H 股	受控法团权益	94,940,800 (L)	9.24	1.36
Kaiser Century Investments Limited <small>(附注 4)</small>	H 股	实益拥有人	94,940,800 (L)	9.24	1.36
Raise Sino Investments Limited <small>(附注 5)</small>	H 股	实益拥有人	113,737,200 (L)	11.07	1.63
交通银行股份有限公司 <small>(附注 6)</small>	H 股	受控法团权益	93,991,600 (L)	9.15	1.34
Bank of Communications (Nominee) Company Limited <small>(附注 6)</small>	H 股	受控法团权益	93,991,600 (L)	9.15	1.34
交银国际资产管理有限公司 <small>(附注 6)</small>	H 股	受控法团权益	93,991,600 (L)	9.15	1.34
交银国际控股有限公司 <small>(附注 6)</small>	H 股	受控法团权益	93,991,600 (L)	9.15	1.34
BOCOM International Global Investment Limited <small>(附注 6)</small>	H 股	实益拥有人	93,991,600 (L)	9.15	1.34
上海宁泉资产管理有限公司	H 股	投资经理	112,958,000 (L)	11.00	1.62
汇添富基金管理股份有限公司(代表汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单-资产管理计划、汇添富-东方证券员工持股计划 2 号单-资产管理计划) <small>(附注 7)</small>	H 股	资产管理人	61,838,400 (L)	6.02	0.88

附注:

1. (L)代表好仓。
2. 于2021年6月30日,公司已发行股份共6,993,655,803股,其中包括A股5,966,575,803股及H股1,027,080,000股。
3. 上海海烟投资管理有限公司由上海烟草集团有限责任公司全资拥有,而上海烟草集团有限责任公司由中国烟草总公司全资拥有。因此,根据《证券及期货条例》,中国烟草总公司及上海烟草集团有限责任公司分别被视为于上海海烟投资管理有限公司所持有本公司股份中拥有权益。
4. *Kaiser Century Investments Limited* 由红佳金融有限公司拥有全部权益。红佳金融有限公司由祝立家先生及其配偶孙红艳女士各自拥有50%权益。因此,根据《证券及期货条例》,祝立家先生、孙红艳女士及红佳金融有限公司分别被视为于 *Kaiser Century Investments Limited* 所持有本公司股份中拥有权益。
5. *Raise Sino Investments Limited* 由 *Chu Lam Yiu* 拥有全部权益。
6. *BOCOM International Global Investment Limited* 由交银国际资产管理有限公司全资拥有。交银国际资产管理有限公司由交银国际控股有限公司全资拥有,而交银国际控股有限公司由 *Bank of Communications (Nominee) Company Limited* 全资拥有。*Bank of Communications (Nominee) Company Limited* 由交通银行股份有限公司全资拥有。因此,根据《证券及期货条例》,交通银行股份有限公司、*Bank of Communications (Nominee) Company Limited*、交银国际控股有限公司及交银国际资产管理有限公司分别被视为于 *BOCOM International Global Investment Limited* 所持有本公司股份中拥有权益。
7. 根据本公司员工持股计划,汇添富基金管理股份有限公司(以资产管理人身份)透过汇添富 - 东方证券员工持股计划1号单一资产管理计划及汇添富 - 东方证券员工持股计划2号单一资产管理计划购买及持有本公司股份。

除上文披露者外,于2021年6月30日,概无其他主要股东或人士于公司股份或相关股份中,拥有根据《证券及期货条例》第336条规定须予备存之登记册所记录之任何权益或淡仓。

六、董事、监事及最高行政人员于本公司及相联法团的股份、相关股份或债权证之权益及淡仓

于2021年6月30日,就公司所获得的资料及据董事所知,公司董事、监事及最高行政人员在公司或其相联法团(定义见《证券及期货条例》第XV部分)的股份、相关股份或债权证中概无拥有任何根据《证券及期货条例》第XV部及第7及8分部须通知公司及香港联交所的权益及淡仓(包括根据《证券及期货条例》的该等条文被当作或视为拥有的权益或淡仓),或根

据《证券及期货条例》第352条规定须在存置之权益登记册中记录，或根据《标准守则》的规定需要通知公司和香港联交所之权益或淡仓。

七、回购、出售或赎回公司的上市证券

报告期内，公司及其子公司未回购、出售或赎回公司的任何上市证券。

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：亿元 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
东方证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券	17 东方债	143233	2017 年 8 月 2 日	2017 年 8 月 3 日	2027 年 8 月 3 日	40	4.98	单利按年付息	上交所	面向合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券 (第一期)	19 东方债	163024	2019 年 11 月 21 日	2019 年 11 月 25 日	2022 年 11 月 25 日	49	3.50	单利按年付息	上交所	面向合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券 (面向专业投资者) (第一期)	20 东债 01	163927	2020 年 8 月 17 日	2020 年 8 月 19 日	2023 年 8 月 19 日	40	3.50	单利按年付息	上交所	面向专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2020 年公开发	20 东债 02	175182	2020 年 9 月 24 日	2020 年 9 月 28 日	2023 年 9 月 28 日	35	3.75	单利按年付息	上交所	面向专业投资者	竞价、报价、询价	否

行公司债券（面向专业投资者）（第二期）											和协议交易	
东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第三期）	20 东债 03	175350	2020 年 11 月 2 日	2020 年 11 月 4 日	2023 年 11 月 4 日	35	3.65	单利按年付息	上交所	面向专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期）	21 东债 01	175690	2021 年 1 月 25 日	2021 年 1 月 27 日	2024 年 1 月 27 日	40	3.60	单利按年付息	上交所	面向专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2020 年公开发行永续次级债券（第一期）	20 东证 Y1	175032	2020 年 8 月 24 日	2020 年 8 月 26 日	-	50	4.75	单利按年付息，预计每年付息一次	上交所	面向机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2021 年公开发行次级债券（第一期）	21 东证 C1	175779	2021 年 3 月 4 日	2021 年 3 月 8 日	2024 年 3 月 8 日	25	3.95	单利按年付息	上交所	面向机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2021 年公开发行次级债券（第二期）（品种一）	21 东证 C2	175993	2021 年 4 月 14 日	2021 年 4 月 16 日	2024 年 4 月 16 日	30	3.70	单利按年付息	上交所	面向机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
东方证券股份有限公司 2021 年公开发行次级债券（第二期）（品种二）	21 东证 C3	175994	2021 年 4 月 14 日	2021 年 4 月 16 日	2026 年 4 月 16 日	15	4.20	单利按年付息	上交所	面向机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

报告期内，公司按照募集说明书约定按时足额支付公司债券利息。

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

报告期内，公司境内信用评级等级未变更。

报告期内，中诚信国际信用评级有限责任公司对公司已发行公司债券“17 东方债”、“19 东方债”、“20 东债 01”、“20 东证 Y1”、“20 东债 02”、“20 东债 03”、“21 东债 01”、“21 东证 C1”的信用状况进行了跟踪评级，并出具了《东方证券股份有限公司 2021 年度跟踪评级报告》（信评委函字[2021]跟踪 0290 号），维持公司债券“17 东方债”、“19 东方债”、“20 东债 01”、“20 东证 Y1”、“20 东债 02”、“20 东债 03”、“21 东债 01”、“21 东证 C1”的信用等级为 AAA，维持公司主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。

报告期内，中诚信国际信用评级有限责任公司对公司 2021 年公开发行次级债券（第二期）“21 东证 C2”、“21 东证 C3”的信用状况进行了评级，并出具了《东方证券股份有限公司 2021 年公开发行次级债券（第二期）信用评级报告》（信评委函字[2021]0903D 号），评定公司债券“21 东证 C2”、“21 东证 C3”的信用等级为 AAA，评定公司主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。

报告期内，公司穆迪国际评级从 Baa3 上调至 Baa2。

报告期内，公司标普国际评级维持 BBB-，等级未变更。

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其影响

适用 不适用

报告期内，公司不存在债券增信机制。

偿债计划及其他偿债保障措施：

（一）利息支付

1、存续期内每年支付一次，最后一期利息随本金的兑付一起兑付。“17 东证 02”的付息日为 2018 年至 2022 年每年的 6 月 9 日，“17 东方债”的付息日为 2018 年至 2027 年每年的 8 月 3 日，“19 东方债”的付息日为 2020 年至 2022 年每年的 11 月 25 日，“20 东证 01”的付息日为

2021 年的 3 月 24 日，“20 东证 02”的付息日为 2021 年至 2022 年每年的 3 月 24 日，“20 东证 03”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 6 月 18 日，“20 东债 01”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 8 月 19 日，“20 东债 02”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 9 月 28 日，“20 东债 03”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 11 月 4 日，“21 东债 01”的付息日为 2022 年至 2024 年每年的 1 月 27 日（如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间不另计利息）。

2、债券利息的支付通过登记机构和有关机构办理。利息支付的具体事项将按照国家有关规定，由发行人在中国证监会指定媒体上发布的付息公告中加以说明。

3、根据国家税收法律、法规，投资者投资本次债券应缴纳的有关税金由投资者自行承担。

（二）本金的偿付

1、债券到期一次还本。“17 东证 02”的本金兑付日为 2022 年 6 月 9 日，“17 东方债”的本金兑付日为 2027 年 8 月 3 日，“19 东方债”的本金兑付日为 2022 年 11 月 25 日，“20 东证 01”的本金兑付日为 2021 年 3 月 4 日，“20 东证 02”的本金兑付日为 2022 年 3 月 24 日，“20 东证 03”的本金兑付日为 2023 年 6 月 18 日，“20 东债 01”的本金兑付日为 2023 年 8 月 19 日，“20 东债 02”的本金兑付日为 2023 年 9 月 28 日，“20 东债 03”的本金兑付日为 2023 年 11 月 4 日，“21 东债 01”的本金兑付日为 2024 年 1 月 27 日（如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间不另计利息）。

2、债券本金的偿付通过债券登记机构和有关机构办理。本金偿付的具体事项将按照国家有关规定，由发行人在中国证监会指定媒体上发布的兑付公告中加以说明。

5. 公司债券其他情况的说明

适用 不适用

公司发行海外债券

1、2019 年 8 月 20 日，公司向符合条件的投资者发行 3 亿美元海外债，债券期限为 3 年期，债券利率为 6 个月 LIBOR 加上 1.25%。

2、2019 年 8 月 20 日，公司向符合条件的投资者发行 2 亿欧元海外债，债券期限为 3 年期，债券利率为 0.625%。

3、2019 年 9 月 27 日，公司向符合条件的投资者发行 2 亿新加坡元海外债，债券期限为 3 年期，债券利率为 2.90%。

详见第十节财务报告七应付债券。

（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	1.44	1.31	9.92	流动资产增加, 流动负债减少
速动比率	1.44	1.31	9.92	流动资产增加, 流动负债减少
资产负债率 (%)	73.70	73.13	增加 0.57 个百分点	负债规模增加
	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	2,627,059,777.11	1,437,870,393.34	82.70	净利润增加
EBITDA 全部债务比	0.04	0.03	33.33	息税折旧摊销前利润增加
利息保障倍数	2.43	1.76	38.07	利润总额增加
现金利息保障倍数	4.29	6.11	-29.79	经营性现金流入减少
EBITDA 利息保障倍数	2.59	1.90	36.32	息税折旧前利润增加
贷款偿还率 (%)	100	100	-	
利息偿付率 (%)	100	100	-	

注：资产负债率=（负债总额-代理买卖证券款-代理承销证券款）/（资产总额-代理买卖证券款-代理承销证券款）

二、可转换公司债券情况
 适用 不适用

第十节 财务报告

一、审计报告

□适用 √不适用

二、财务报表

合并资产负债表

2021 年 6 月 30 日

编制单位：东方证券股份有限公司

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	七(一)	74,449,331,298.79	65,640,359,556.65
其中：客户资金存款		56,416,830,685.85	48,384,423,234.76
结算备付金	七(二)	24,834,159,746.73	21,516,356,646.61
其中：客户备付金		22,545,367,998.37	18,591,394,862.89
融出资金	七(五)	23,480,866,622.62	21,171,919,414.06
衍生金融资产	七(六)	51,651,456.31	155,876,469.76
存出保证金	七(七)	2,311,823,436.65	2,183,089,694.77
应收款项	七(八)	1,167,321,321.43	874,405,553.22
合同资产	七(十)		1,741,886.80
买入返售金融资产	七(十一)	13,336,386,959.15	14,460,425,371.36
金融投资：			
交易性金融资产	七(十三)	76,452,700,723.03	72,701,117,042.70
债权投资	七(十四)	4,828,679,090.22	6,243,897,149.81
其他债权投资	七(十五)	67,389,989,287.86	62,645,974,916.84
其他权益工具投资	七(十六)	6,096,378,358.59	10,936,457,571.84
长期股权投资	七(十七)	6,060,631,677.57	5,771,193,948.89
投资性房地产	七(十八)	39,332,069.08	40,460,670.03
固定资产	七(十九)	2,046,860,039.41	2,019,601,972.64
在建工程	七(二十)	37,152,494.19	65,838,524.98
使用权资产	七(二十一)	786,926,324.38	847,354,948.02
无形资产	七(二十二)	209,275,750.92	215,313,094.34
商誉	七(二十三)	32,135,375.10	32,135,375.10
递延所得税资产	七(二十四)	1,414,979,029.91	1,455,922,066.16
其他资产	七(二十五)	6,256,027,877.00	2,137,999,709.85
资产总计		311,282,608,938.94	291,117,441,584.43
负债：			
短期借款	七(二十九)	4,148,571,185.09	579,732,185.45
应付短期融资款	七(三十)	4,691,930,367.56	16,255,485,786.37
拆入资金	七(三十一)	4,654,383,638.90	9,670,113,871.43
交易性金融负债	七(三十二)	17,347,274,201.11	14,576,073,144.23
衍生金融负债	七(六)	978,080,029.00	504,956,696.48
卖出回购金融资产款	七(三十三)	57,416,887,936.49	52,860,883,439.73
代理买卖证券款	七(三十四)	78,920,066,090.72	66,642,671,158.50
代理承销证券款	七(三十五)	120,499,979.00	346,000,000.00
应付职工薪酬	七(三十六)	2,629,780,910.11	2,608,008,552.75

应交税费	七(三十七)	394,915,618.70	782,814,613.10
应付款项	七(三十八)	1,228,431,981.12	576,584,579.01
合同负债	七(三十九)	258,380,269.16	404,123,622.43
应付债券	七(四十三)	72,720,557,081.66	62,265,473,497.68
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	七(四十四)	796,734,938.00	856,910,328.86
递延所得税负债	七(二十四)	23,049,436.56	20,179,387.19
其他负债	七(四十六)	3,881,842,583.73	1,936,286,692.04
负债合计		250,211,386,246.91	230,886,297,555.25
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	七(四十七)	6,993,655,803.00	6,993,655,803.00
其他权益工具	七(四十八)	5,000,000,000.00	5,000,000,000.00
其中：优先股			
永续债		5,000,000,000.00	5,000,000,000.00
资本公积	七(四十九)	28,311,403,655.40	28,311,403,655.40
减：库存股			
其他综合收益	七(五十一)	166,494,983.90	35,594,335.59
盈余公积	七(五十二)	3,676,148,380.92	3,676,148,380.92
一般风险准备	七(五十三)	8,839,815,566.78	8,691,097,190.12
未分配利润	七(五十四)	8,060,350,339.12	7,494,951,502.28
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		61,047,868,729.12	60,202,850,867.31
少数股东权益		23,353,962.91	28,293,161.87
所有者权益（或股东权益）合计		61,071,222,692.03	60,231,144,029.18
负债和所有者权益（或股东权益）总计		311,282,608,938.94	291,117,441,584.43

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

母公司资产负债表

2021 年 6 月 30 日

编制单位：东方证券股份有限公司

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		34,273,645,470.15	30,827,925,102.87
其中：客户资金存款		25,044,448,570.00	22,343,282,321.26
结算备付金		5,999,421,455.57	6,665,101,639.08
其中：客户备付金		3,776,529,622.14	3,820,176,412.38
融出资金		23,161,443,861.58	20,945,414,325.69
衍生金融资产		29,880,981.32	140,085,973.58
存出保证金		1,487,747,471.84	1,368,644,580.82
应收款项		359,573,661.28	236,450,026.41
买入返售金融资产		12,145,682,330.52	14,114,676,723.43
金融投资：			
交易性金融资产		54,080,280,861.59	51,976,489,033.63
债权投资		4,828,679,090.22	6,243,897,149.81
其他债权投资		67,389,989,287.86	62,645,974,916.84
其他权益工具投资		6,048,554,377.39	10,868,377,303.52
长期股权投资	十九(一)	19,020,371,400.10	18,359,113,837.35
投资性房地产		39,568,844.28	40,956,605.82
固定资产		1,961,046,640.48	1,955,354,902.22
在建工程		23,248,552.02	49,090,408.01
使用权资产		490,434,635.95	520,743,257.64
无形资产		167,379,514.99	165,438,139.67
商誉		18,947,605.48	18,947,605.48
递延所得税资产		1,184,119,516.56	1,118,921,115.03
其他资产		366,869,271.76	353,464,867.38
资产总计		233,076,884,830.94	228,615,067,514.28
负债：			
应付短期融资款		4,691,930,367.56	16,255,099,446.23
拆入资金		4,654,383,638.90	9,670,113,871.43
交易性金融负债		13,157,157,947.47	12,277,620,007.87
衍生金融负债		969,081,236.86	486,364,134.27
卖出回购金融资产款		54,107,226,699.66	49,352,916,474.90
代理买卖证券款		28,843,428,375.08	26,064,505,023.18
应付职工薪酬		846,518,025.86	830,595,930.09
应交税费		91,854,201.27	198,279,717.43
应付款项		302,654,288.76	172,917,242.52
应付债券		66,836,789,993.36	56,346,130,110.86
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		485,270,975.30	516,618,322.33
其他负债		2,432,867,347.51	779,855,226.10
负债合计		177,419,163,097.59	172,951,015,507.21
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		6,993,655,803.00	6,993,655,803.00

其他权益工具		4,995,754,716.98	4,995,754,716.98
其中：优先股			
永续债		4,995,754,716.98	4,995,754,716.98
资本公积		28,157,008,370.79	28,157,008,370.79
减：库存股			
其他综合收益		333,319,735.20	178,831,351.45
盈余公积		3,676,148,380.92	3,676,148,380.92
一般风险准备		6,975,302,514.86	6,975,205,014.01
未分配利润		4,526,532,211.60	4,687,448,369.92
所有者权益（或股东权益）合计		55,657,721,733.35	55,664,052,007.07
负债和所有者权益（或股东权益）总计		233,076,884,830.94	228,615,067,514.28

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

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		13,276,756,060.33	9,625,293,303.92
利息净收入	七(五十五)	708,352,653.59	336,608,240.83
其中：利息收入		2,942,873,931.83	2,718,286,957.99
利息支出		2,234,521,278.24	2,381,678,717.16
手续费及佣金净收入	七(五十六)	4,424,984,341.56	2,817,250,323.92
其中：经纪业务手续费净收入		1,579,805,745.95	1,085,830,910.98
投资银行业务手续费净收入		794,879,540.33	553,168,344.39
资产管理业务手续费净收入		1,874,563,697.15	1,113,698,288.46
投资收益（损失以“-”号填列）	七(五十七)	2,575,688,129.17	1,944,928,789.20
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		735,435,771.81	442,811,845.64
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	七(五十九)	19,019,445.67	16,031,878.39
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	七(六十)	89,744,588.77	1,015,589,268.07
汇兑收益（损失以“-”号填列）		104,668,961.49	78,067,628.10
其他业务收入	七(六十一)	5,354,289,423.03	3,416,891,954.81
资产处置收益（损失以“-”号填列）	七(六十二)	8,517.05	-74,779.40
二、营业总支出		10,240,299,401.72	7,948,233,358.75
税金及附加	七(六十三)	53,289,573.23	44,479,623.66
业务及管理费	七(六十四)	4,749,664,071.05	3,188,445,812.35
信用减值损失	七(六十五)	258,543,664.09	1,290,109,741.13
其他资产减值损失			

其他业务成本	七(六十七)	5,178,802,093.35	3,425,198,181.61
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		3,036,456,658.61	1,677,059,945.17
加：营业外收入	七(六十八)	113,941,587.93	122,849,409.62
减：营业外支出	七(六十九)	20,990,801.13	22,806,088.45
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,129,407,445.41	1,777,103,266.34
减：所得税费用	七(七十)	431,370,712.35	252,232,557.88
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,698,036,733.06	1,524,870,708.46
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		2,698,036,733.06	1,524,870,708.46
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）		2,700,359,705.45	1,526,023,784.18
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		-2,322,972.39	-1,153,075.72
六、其他综合收益的税后净额	七(七十一)	130,572,107.11	3,826,432.81
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		130,572,107.11	3,826,432.81
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		166,107,133.30	-50,331,512.32
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		166,107,133.30	-50,331,512.32
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		-35,535,026.19	54,157,945.13
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-7,419,120.38	-6,593,746.02
2. 其他债权投资公允价值变动		14,031,887.82	38,938,108.12
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		-24,517,432.80	9,509,548.20
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额		-17,630,360.83	12,304,034.83
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		2,828,608,840.17	1,528,697,141.27
归属于母公司所有者的综合收益总额		2,830,931,812.56	1,529,850,216.99
归属于少数股东的综合收益总额		-2,322,972.39	-1,153,075.72
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）	二十(二)	0.37	0.22

(二) 稀释每股收益(元/股)		不适用	不适用
-----------------	--	-----	-----

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

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		4,537,861,205.13	4,446,494,586.96
利息净收入	十九(二)	433,385,469.53	326,651,689.69
其中：利息收入		2,525,388,010.18	2,508,714,184.42
利息支出		2,092,002,540.65	2,182,062,494.73
手续费及佣金净收入	十九(三)	1,434,861,738.73	1,096,372,701.45
其中：经纪业务手续费净收入		1,202,497,460.44	876,511,495.98
投资银行业务手续费净收入		224,284,056.25	264,158,890.93
资产管理业务手续费净收入			
投资收益（损失以“-”号填列）	十九(四)	2,734,792,172.54	2,286,952,423.46
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		554,967,055.37	229,256,516.54
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		10,030,277.15	11,384,340.73
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-199,448,753.29	695,554,811.15
汇兑收益（损失以“-”号填列）		120,554,350.89	26,661,675.88
其他业务收入		3,666,373.61	2,993,110.19
资产处置收益（损失以“-”号填列）		19,575.97	-76,165.59
二、营业总支出		2,794,996,359.68	2,902,409,118.59
税金及附加		29,945,931.58	34,018,005.61
业务及管理费		2,511,175,575.65	1,577,754,448.05
信用减值损失		252,837,936.75	1,288,483,665.02
其他资产减值损失			
其他业务成本		1,036,915.70	2,152,999.91
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,742,864,845.45	1,544,085,468.37
加：营业外收入		47,346,328.19	36,869,343.96
减：营业外支出		8,397,480.62	14,452,928.97
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,781,813,693.02	1,566,501,883.36
减：所得税费用		-48,401,918.68	21,255,566.94
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,830,215,611.70	1,545,246,316.42
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,830,215,611.70	1,545,246,316.42
（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		149,368,065.33	301,198.28
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		164,507,563.92	-50,300,960.85
1. 重新计量设定受益计划变动额			

2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动		164,507,563.92	-50,300,960.85
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		-15,139,498.59	50,602,159.13
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-4,653,953.61	2,154,465.40
2. 其他债权投资公允价值变动		14,031,887.82	38,938,145.53
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		-24,517,432.80	9,509,548.20
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		1,979,583,677.03	1,545,547,514.70
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益(元/股)			
(二) 稀释每股收益(元/股)			

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

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：			
交易性金融负债净增加额		2,986,975,776.07	1,677,458,687.50
收取利息、手续费及佣金的现金		6,289,386,837.93	4,501,363,237.79
回购业务资金净增加额		5,386,836,079.49	4,307,767,333.24
代理买卖证券收到的现金净额		12,277,394,932.22	9,865,956,377.98
收到其他与经营活动有关的现金	七(七十二)1	5,814,117,089.95	4,087,476,058.53
经营活动现金流入小计		32,754,710,715.66	24,440,021,695.04
拆入资金净减少额		5,015,730,232.53	815,337,965.23
融出资金净增加额		2,342,365,458.40	1,608,995,238.52
交易性金融资产净增加额		533,712,391.67	27,233,953.95
代理承销证券支付的现金净额		225,500,021.00	80,000,000.00
支付利息、手续费及佣金的现金		809,863,599.89	1,171,673,418.33
支付给职工及为职工支付的现金		3,200,799,792.89	2,435,814,688.94
支付的各项税费		874,103,444.14	477,896,583.09
支付其他与经营活动有关的现金	七(七十二)2	13,557,553,382.60	6,242,099,916.41
经营活动现金流出小计		26,559,628,323.12	12,859,051,764.47
经营活动产生的现金流量净额		6,195,082,392.54	11,580,969,930.57
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		48,139,617.12	114,214,856.55
取得投资收益收到的现金		2,060,379,635.58	1,579,362,556.58
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		555,682.97	5,979,060.45
其他交易性金融资产净减少额		385,538,561.46	
其他债权投资净减少额			5,335,790,850.43

债权投资净减少额		1,336,202,000.00	508,533,497.33
其他权益工具投资净减少额		3,005,992,899.82	
投资活动现金流入小计		6,836,808,396.95	7,543,880,821.34
投资支付的现金		6,300,000.00	556,500,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		187,822,910.99	134,374,168.00
使用权资产预付租金支付的现金		678,921.42	656,628.08
其他交易性金融资产净增加额			4,453,649,342.26
其他债权投资净增加额		4,489,290,371.86	
其他权益工具投资净增加额			22,590,952.94
投资活动现金流出小计		4,684,092,204.27	5,167,771,091.28
投资活动产生的现金流量净额		2,152,716,192.68	2,376,109,730.06
三、筹资活动产生的现金流量：			
取得借款收到的现金		4,029,957,532.80	1,436,332,787.31
发行债券收到的现金		24,076,210,498.28	36,240,746,790.26
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		28,106,168,031.08	37,677,079,577.57
偿还债务支付的现金		25,437,138,587.20	40,527,764,233.39
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,352,561,345.63	2,487,108,038.15
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		2,616,226.57	34,192,381.26
租赁负债本金支付额		163,135,249.98	152,317,386.36
租赁负债利息支付额		16,142,310.38	19,032,278.05
支付其他与筹资活动有关的现金	七(七十二)6		475,583,890.59
筹资活动现金流出小计		26,968,977,493.19	43,661,805,826.54
筹资活动产生的现金流量净额		1,137,190,537.89	-5,984,726,248.97
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		52,844,227.47	238,467,409.68
五、现金及现金等价物净增加额		9,537,833,350.58	8,210,820,821.34
加：期初现金及现金等价物余额		86,853,417,188.80	61,940,172,286.80
六、期末现金及现金等价物余额		96,391,250,539.38	70,150,993,108.14

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

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：			
收取利息、手续费及佣金的现金		2,889,621,725.47	2,545,857,369.26
交易性金融资产净减少额		413,514,457.49	
交易性金融负债净增加额		980,984,915.71	1,662,970,319.51
回购业务资金净增加额		6,430,097,788.19	4,932,169,650.40
代理买卖证券收到的现金净额		2,778,923,351.90	5,354,675,413.91
收到其他与经营活动有关的现金		306,132,751.72	622,566,695.39
经营活动现金流入小计		13,799,274,990.48	15,118,239,448.47

拆入资金净减少额		5,015,730,232.53	815,337,965.23
融出资金净增加额		2,249,430,156.31	1,638,381,166.17
交易性金融资产净增加额			2,307,380,614.47
支付利息、手续费及佣金的现金		1,170,695,218.93	1,026,814,837.16
支付给职工及为职工支付的现金		1,854,807,091.76	1,340,929,293.63
支付的各项税费		187,220,832.90	213,526,465.78
支付其他与经营活动有关的现金		1,120,763,849.27	996,986,396.75
经营活动现金流出小计		11,598,647,381.70	8,339,356,739.19
经营活动产生的现金流量净额		2,200,627,608.78	6,778,882,709.28
二、投资活动产生的现金流量：			
取得投资收益收到的现金		2,762,545,753.79	2,155,079,720.87
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		533,659.59	3,030,552.20
其他交易性金融资产净减少额		553,201,826.43	
其他债权投资净减少额			5,335,790,850.47
债权投资净减少额		1,336,202,000.00	508,533,497.33
其他权益工具投资净减少额		2,988,614,658.22	
投资活动现金流入小计		7,641,097,898.03	8,002,434,620.87
投资支付的现金		450,000,000.00	1,287,510,429.53
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		133,755,637.00	99,552,499.71
使用权资产预付租金支付的现金		482,124.46	656,628.11
其他交易性金融资产净增加额			3,619,077,637.83
其他债权投资净增加额		4,489,290,371.86	
其他权益工具投资净增加额			31,670,905.96
投资活动现金流出小计		5,073,528,133.32	5,038,468,101.14
投资活动产生的现金流量净额		2,567,569,764.71	2,963,966,519.73
三、筹资活动产生的现金流量：			
取得借款收到的现金		32,000,000.00	595,243,073.68
发行债券收到的现金		24,076,210,498.28	36,240,746,790.26
筹资活动现金流入小计		24,108,210,498.28	36,835,989,863.94
偿还债务支付的现金		25,008,265,960.00	39,890,799,899.39
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,122,168,764.63	2,225,269,777.73
租赁负债本金支付额		108,107,960.15	96,264,176.63
租赁负债利息支付额		10,074,883.97	10,939,205.48
筹资活动现金流出小计		26,248,617,568.75	42,223,273,059.23
筹资活动产生的现金流量净额		-2,140,407,070.47	-5,387,283,195.29
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		7,614,350.89	60,502,488.51
五、现金及现金等价物净增加额		2,635,404,653.91	4,416,068,522.23
加：期初现金及现金等价物余额		37,270,278,035.64	33,351,673,065.35
六、期末现金及现金等价物余额		39,905,682,689.55	37,767,741,587.58

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

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											
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
	优先股	永续债	其他									
一、上年期末余额	6,993,655,803.00		5,000,000,000.00		28,311,403,655.40		35,594,335.59	3,676,148,380.92	8,691,097,190.12	7,494,951,502.28	28,293,161.87	60,231,144,029.18
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年期初余额	6,993,655,803.00		5,000,000,000.00		28,311,403,655.40		35,594,335.59	3,676,148,380.92	8,691,097,190.12	7,494,951,502.28	28,293,161.87	60,231,144,029.18
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)							130,900,648.31		148,718,376.66	565,398,836.84	-4,939,198.96	840,078,662.85
(一)综合收益总额							130,572,107.11			2,700,359,705.45	-2,322,972.39	2,828,608,840.17
(二)所有者投入和减少资本												
1.所有者投入的普通股												
2.其他权益工具持有者投入资本												
3.股份支付计入所有者权益的金额												
4.其他												
(三)利润分配									148,718,376.66	-2,134,632,327.41	-2,616,226.57	-1,988,530,177.32
1.提取盈余公积												
2.提取一般风险准备									148,718,376.66	-148,718,376.66		
3.对所有者(或股东)的分配										-1,748,413,950.75	-2,616,226.57	-1,751,030,177.32
4.对其他权益工具持有者的分配										-237,500,000.00		-237,500,000.00
5.其他												
(四)所有者权益内部结转							328,541.20			-328,541.20		
1.资本公积转增资本(或股本)												
2.盈余公积转增资本(或股本)												
3.盈余公积弥补亏损												
4.设定受益计划变动额结转留存收益												
5.其他综合收益结转留存收益												

6. 其他					328,541.20				-328,541.20		
四、本期期末余额	6,993,655,803.00		5,000,000,000.00	28,311,403,655.40	166,494,983.90	3,676,148,380.92	8,839,815,566.78	8,060,350,339.12	23,353,962.91	61,071,222,692.03	

项目	2020 年半年度										
	归属于母公司所有者权益									少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	
优先股		永续债	其他								
一、上年期末余额	6,993,655,803.00			28,254,929,991.63		499,960,781.41	3,445,689,429.69	7,997,676,253.44	6,773,604,053.96	46,120,419.71	54,011,636,732.84
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	6,993,655,803.00			28,254,929,991.63		499,960,781.41	3,445,689,429.69	7,997,676,253.44	6,773,604,053.96	46,120,419.71	54,011,636,732.84
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)				11,928,038.45		-5,253,520.20		86,646,166.70	399,409,200.04	-16,145,720.73	476,584,164.26
(一) 综合收益总额						3,826,432.81			1,526,023,784.18	-1,153,075.72	1,528,697,141.27
(二) 所有者投入和减少资本				11,928,038.45						-11,928,038.45	
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				11,928,038.45						-11,928,038.45	
(三) 利润分配								86,646,166.70	-1,135,694,537.15	-3,064,606.56	-1,052,112,977.01
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备								86,646,166.70	-86,646,166.70		
3. 对所有者(或股东)的分配									-1,049,048,370.45	-3,064,606.56	-1,052,112,977.01
4. 其他											
(四) 所有者权益内部结转						-9,079,953.01			9,079,953.01		
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					-9,079,953.01				9,079,953.01		
6. 其他											
四、本期期末余额	6,993,655,803.00			28,266,858,030.08	494,707,261.21	3,445,689,429.69	8,084,322,420.14	7,173,013,254.00	29,974,698.98		54,488,220,897.10

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

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)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	6,993,655,803.00		4,995,754,716.98		28,157,008,370.79		178,831,351.45	3,676,148,380.92	6,975,205,014.01	4,687,448,369.92	55,664,052,007.07
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	6,993,655,803.00		4,995,754,716.98		28,157,008,370.79		178,831,351.45	3,676,148,380.92	6,975,205,014.01	4,687,448,369.92	55,664,052,007.07
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)							154,488,383.75		97,500.85	-160,916,158.32	-6,330,273.72
(一)综合收益总额							149,368,065.33			1,830,215,611.70	1,979,583,677.03
(二)所有者投入和减少资本											
1.所有者投入的普通股											
2.其他权益工具持有者投入资本											
3.股份支付计入所有者权益的金额											
4.其他											
(三)利润分配									97,500.85	-1,986,011,451.60	-1,985,913,950.75
1.提取盈余公积											
2.提取一般风险准备									97,500.85	-97,500.85	
3.对所有者(或股东)的分配										-1,985,913,950.75	-1,985,913,950.75
4.其他											
(四)所有者权益内部结转							5,120,318.42			-5,120,318.42	
1.资本公积转增资本(或											

股本										
2. 盈余公积转增资本(或股本)										
3. 盈余公积弥补亏损										
4. 设定受益计划变动额结转留存收益										
5. 其他综合收益结转留存收益										
6. 其他						5,120,318.42			-5,120,318.42	
四、本期末余额	6,993,655,803.00		4,995,754,716.98		28,157,008,370.79	333,319,735.20	3,676,148,380.92	6,975,302,514.86	4,526,532,211.60	55,657,721,733.35

项目	2020 年半年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年期末余额	6,993,655,803.00				28,157,008,370.79		556,061,852.46	3,445,689,429.69	6,667,921,526.55	4,766,558,982.91	50,586,895,965.40
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年期初余额	6,993,655,803.00				28,157,008,370.79		556,061,852.46	3,445,689,429.69	6,667,921,526.55	4,766,558,982.91	50,586,895,965.40
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）							-8,778,754.73		314.07	505,277,584.91	496,499,144.25
（一）综合收益总额							301,198.28			1,545,246,316.42	1,545,547,514.70
（二）所有者投入和减少资本											
1. 所有者投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
（三）利润分配									314.07	-1,049,048,684.52	-1,049,048,370.45
1. 提取盈余公积											
2. 提取一般风险准备									314.07	-314.07	-1,049,048,370.45
3. 对所有者（或股东）的分配										-1,049,048,370.45	
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转							-9,079,953.01			9,079,953.01	
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						-9,079,953.01				9,079,953.01
6. 其他										
四、本期期末余额	6,993,655,803.00			28,157,008,370.79		547,283,097.73	3,445,689,429.69	6,667,921,840.62	5,271,836,567.82	51,083,395,109.65

公司负责人：金文忠

主管会计工作负责人：张建辉

会计机构负责人：尤文杰

三、公司基本情况

1. 公司概况

适用 不适用

东方证券股份有限公司前身东方证券有限责任公司系由申能(集团)有限公司、上海外滩房屋置换有限公司作为发起人股东,联合上海市财政局及 12 家大型企业集团,通过收购抚顺证券公司及受让上海浦东发展银行和上海城市合作银行(现上海银行)所属证券经营机构,并以增资方式设立的有限责任公司。中国人民银行 1997 年 10 月 18 日以银复[1997]400 号文《关于抚顺证券公司更名、迁址和增资改制的批复》和 1998 年 2 月 23 日银复[1998]52 号文《关于设立东方证券有限责任公司的批复》批准同意。1998 年 3 月 3 日由中国人民银行颁发 J11312900062 号《中华人民共和国金融机构法人许可证》,1997 年 12 月 11 日由上海市工商行政管理局颁发法人营业执照,注册号为 150050030000,注册资本为人民币 10 亿元。

2003 年 8 月 13 日经上海市人民政府以沪府体改审(2003)004 号《关于同意设立东方证券股份有限公司的批复》和 2003 年 9 月 12 日中国证券监督管理委员会以证监机构字[2003]184 号文《关于同意东方证券有限责任公司改制、增资扩股并更名的批复》批准同意,公司变更为股份有限公司,以 2002 年 12 月 31 日净资产 113,979.18 万元折股,并以货币资金增资 100,000.00 万元,变更后股份总额为 213,979.18 万元。

经过历次增资,公司股票于 2015 年 3 月 23 日在上海证券交易所上市,股票代码为 600958。公司股票于 2016 年 7 月 8 日在香港联合交易所上市,股票代码为 03958。

根据公司 2017 年第三届董事会第二十五次会议、第三届董事会第二十六次会议、第三届董事会第三十次会议、第三届董事会第三十二次会议、2017 年第一次临时股东大会、2017 年第一次 A 股类别股东大会及 2017 年第一次 H 股类别股东大会决议,同时经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1940 号文核准,公司非公开发行人民币普通股(A 股)股票 778,203,792 股。此次非公开发行股份增加注册资本计人民币 778,203,792.00 元,变更后的注册资本为人民币 6,993,655,803.00 元。

截至 2021 年 6 月 30 日,公司经批准已设立 177 家营业部。公司之子公司的基本情况参见附注十。

公司统一社会信用代码为 913100001322947763,注册地为“中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦”,公司总部办公地为上海市中山南路 119 号东方证券大厦,法定代表人金文忠。

2. 合并财务报表范围

适用 不适用

公司纳入合并报表范围的子公司详见附注十、(1)。

四、财务报表的编制基础

1. 编制基础

本集团执行财政部颁布的企业会计准则及相关规定。此外，本集团还按照《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号—财务报告的一般规定(2014 年修订)》披露有关财务信息。

2. 记账基础和计价原则

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

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

公允价值是市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。无论公允价值是可观察到的还是采用估值技术估计的，在本财务报表中计量和披露的公允价值均在此基础上予以确定。

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

- 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

3. 持续经营

适用 不适用

本集团对自 2021 年 6 月 30 日起 12 个月的持续经营能力进行了评价，未发现对持续经营能力产生重大怀疑的事项和情况。因此，本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

适用 不适用

1. 遵循企业会计准则的声明

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

2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

3. 营业周期

适用 不适用

4. 记账本位币

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

5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用 不适用

企业合并分为同一控制下的企业合并和非同一控制下的企业合并。本集团的重大企业合并均为非同一控制下的企业合并。

非同一控制下的企业合并及商誉

参与合并的企业在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制，为非同一控制下的企业合并。

合并成本指购买方为取得被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债和发行的权益性工具的公允价值。通过多次交易分步实现非同一控制下的企业合并的，合并成本为购买日支付的对价与购买日之前已经持有的被购买方的股权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。

购买方在合并中所取得的被购买方符合确认条件的可辨认资产、负债及或有负债在购买日以公允价值计量。合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，作为一项资产确认为商誉并按成本进行初始计量。合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，计入当期损益。因企业合并形成的商誉在合并财务报表中单独列报，并按照成本扣除累计减值准备后的金额计量。

6. 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予以确定。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。一旦相关事实和情况的变化导致上述控制定义涉及的相关要素发生了变化，本集团将进行重新评估。

子公司的合并起始于本集团获得对该子公司的控制权时，终止于本集团丧失对该子公司的控制权时。

对于本集团处置的子公司，处置日（丧失控制权的日期）前的经营成果和现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

对于通过非同一控制下的企业合并取得的子公司，其自购买日（取得控制权的日期）起的经营成果及现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

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

本公司与子公司及子公司相互之间发生的内部交易对合并财务报表的影响于合并时抵销。

子公司所有者权益中不属于母公司的份额作为少数股东权益，在合并资产负债表中股东权益项目下以“少数股东权益”项目列示。子公司当期净损益中属于少数股东权益的份额，在合并利润表中净利润项目下以“少数股东损益”项目列示。

少数股东分担的子公司的亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额，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，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，在丧失控制权时转为当期投资收益。

7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

8. 现金及现金等价物的确定标准

现金是指本集团库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指本集团持有的期限短（一般指从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

(1) 外币业务

外币交易在初始确认时，采用交易发生日的即期汇率折算。

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

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

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

(2) 外币财务报表折算

为编制合并财务报表，境外经营的外币财务报表按以下方法折算为人民币报表：资产负债表中的所有资产、负债类项目按资产负债表日的即期汇率折算；股东权益项目按发生时的即期汇率折算；利润表中的所有项目及反映利润分配发生额的项目按交易发生日的即期汇率折算；年初未分配利润为上一年折算后的年末未分配利润；年末未分配利润按折算后的利润分配各项目计算列示；折算后资产类项目与负债类项目和股东权益类项目合计数的差额确认为其他综合收益并计入股东权益。

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

年初数和上年实际数按照上年财务报表折算后的数额列示。

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

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

10. 金融工具

金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

适用 不适用

本集团在成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关的交易费用直接计入损益；对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。当本集团按照《企业会计准则第 14 号—收入》（“收入准

则”)确认的未包含重大融资成分应收账款或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的,初始确认的应收账款则按照收入准则定义的交易价格进行初始计量。

实际利率法是指计算金融资产或金融负债的摊余成本以及将利息收入或利息费用分摊计入各会计期间的方法。实际利率,是指将金融资产或金融负债在预计存续期的估计未来现金流量,折现为该金融资产账面余额或该金融负债摊余成本所使用的利率。在确定实际利率时,在考虑金融资产或金融负债所有合同条款(如提前还款、展期、看涨期权或其他类似期权等)的基础上估计预期现金流量,但不考虑预期信用损失。

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

(1) 金融资产的分类、确认和计量

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

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本集团管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本集团将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金、应收款项和债权投资等。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本集团管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标的,则该金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产,此类金融资产为其他债权投资。

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

金融资产满足下列条件之一的,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,主要是为了近期出售或回购。
- 相关金融资产在初始确认时属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分,且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式。
- 相关金融资产属于衍生工具。但符合财务担保合同定义的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,列示于交易性金融资产。

- 不符合分类为以摊余成本计量的金融资产或分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益，除衍生金融资产单独列示外，列示于交易性金融资产。

- 在初始确认时，为消除或显著减少会计错配，以及符合条件的包含嵌入衍生工具的混合合同，本集团可将金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

1) 分类为以摊余成本计量的金融资产

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

本集团对分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法确认利息收入。除下列情况外，本集团根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

- 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入；

- 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，并且这一改善在客观上可与应用上述规定之后发生的某一事件相联系如债务人的信用评级被上调，转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

2) 分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

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

指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资的公允价值变动在其他综合收益中进行确认，该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本集团持有该等非交易性权益工具投资期间，在本集团收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本集团，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。

3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

(2) 金融工具减值

本集团对分类为以摊余成本计量的金融工具、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工具、应收账款等以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

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

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

本集团在前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，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。

1) 信用风险显著增加

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

本集团在评估信用风险是否显著增加时会考虑如下因素：

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

于资产负债表日，若本集团判断金融工具只具有较低的信用风险，则本集团假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

2) 已发生信用减值的金融资产

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

- 发行方或债务人发生重大财务困难；
- 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；

- 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- 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；
- 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。

3) 预期信用损失的确定

本集团对部分应收款项在单项资产的基础上确定其信用损失，其余应收款项在组合基础上采用减值矩阵确定相关金融工具的信用损失。本集团以共同风险特征为依据，将金融工具分为不同组别。本集团采用的共同信用风险特征包括：金融工具类型、信用风险评级、担保物类型、初始确认日期、剩余合同期限、债务人所处行业、担保品相对于金融资产的价值等。

本集团按照下列方法确定相关金融工具的预期信用损失：

- 对于金融资产，信用损失为本集团应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值；

- 对于未提用的贷款承诺，信用损失为在贷款承诺持有人提用相应贷款的情况下，本集团应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值。本集团对贷款承诺预期信用损失的估计，与其对该贷款承诺提用情况的预期保持一致；

- 对于资产负债表日已发生信用减值但并非购买或源生已发生信用减值的金融资产，信用损失为该金融资产账面余额与按原实际利率折现的估计未来现金流量的现值之间的差额。

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

4) 减记金融资产

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

(3) 金融资产的转移

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

若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。本集团按照下列方式对相关负债进行计量：

- 被转移金融资产以摊余成本计量的，相关负债的账面价值等于继续涉入被转移金融资产的账面价值减去本集团保留的权利（如果本集团因金融资产转移保留了相关权利）的摊余成本并加上本集团承担的义务（如果本集团因金融资产转移承担了相关义务）的摊余成本，相关负债不指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 被转移金融资产以公允价值计量的，相关负债的账面价值等于继续涉入被转移金融资产的账面价值减去本集团保留的权利（如果本集团因金融资产转移保留了相关权利）的公允价值并加上本集团承担的义务（如果本集团因金融资产转移承担了相关义务）的公允价值，该权利和义务的公允价值应为按独立基础计量时的公允价值。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，针对分类为以摊余成本计量的金融资产与分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，将所转移金融资产的账面价值及因转移而收到的对价与原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和的差额计入当期损益。针对被本集团指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值在终止确认部分和继续确认部分之间按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将终止确认部分收到的对价和原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和与终止确认部分在终止确认日的账面价值之差额计入当期损益或留存收益。

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

(4) 负债和权益的分类

本集团根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。

1) 金融负债的分类及计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其中，除衍生金融负债单独列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债列示为交易性金融负债。

金融负债满足下列条件之一，表明本集团承担该金融负债的目的是交易性的：

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

本集团将符合下列条件之一的金融负债，在初始确认时可以指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：(1) 该指定可以消除或显著减少会计错配；(2) 根据本集团正式书面文件载明的风险管理或投资策略，该金融负债所在的金融负债组合或金融资产和金融负债组合以公允价值为基础进行管理和业绩评价并在企业内部以此为基础向关键管理人员报告；(3) 符合条件的包含嵌入衍生工具的混合合同。

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

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

其他金融负债

除金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债、财务担保合同及贷款承诺外的其他金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，按摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益。

本集团与交易对手方修改或重新议定合同，未导致按摊余成本进行后续计量的金融负债终止确认，但导致合同现金流量发生变化的，本集团重新计算该金融负债的账面价值，并将相关利得或损失计入当期损益。重新计算的该金融负债的账面价值，本集团根据将重新议定或修改的合同现金流量按金融负债的原实际利率折现的现值确定。对于修改或重新议定合同所产生的所有成本或费用，本集团调整修改后的金融负债的账面价值，并在修改后金融负债的剩余期限内进行摊销。

2) 金融负债的终止确认

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

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

3) 权益工具

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

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

(5) 衍生工具与嵌入衍生工具

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

对于嵌入衍生工具与主合同构成的混合合同，若主合同属于金融资产的，本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。

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

(1) 嵌入衍生工具的经济特征和风险与主合同的经济特征及风险不紧密相关。

(2) 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。

(3) 该混合合同不是以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。

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

(6) 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，且该种法定权利是当前可执行的，同时本集团计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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

详见附注十七、信用风险。

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

合同资产，是指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。本集团拥有的无条件(即，仅取决于时间流逝)向客户收取对价的权利作为应收款项单独列示。

(2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法适用 不适用**15. 持有待售资产**适用 不适用**16. 债权投资****债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法**适用 不适用

详见附注十七、信用风险。

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

详见附注十七、信用风险。

18. 长期股权投资适用 不适用**(1) 共同控制、重大影响的判断标准**

控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。共同控制是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。重大影响是指对被投资方的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制

这些政策的制定。在确定能否对被投资单位实施控制或施加重大影响时，已考虑投资方和其他方持有的被投资单位当期可转换公司债券、当期可执行认股权证等潜在表决权因素。

(2) 初始投资成本的确定

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

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

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

除企业合并形成的长期股权投资外其他方式取得的长期股权投资，按成本进行初始计量。对于因追加投资能够对被投资单位实施重大影响或实施共同控制但不构成控制的，长期股权投资成本为按照《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》确定的原持有股权投资的公允价值加上新增投资成本之和。

(3) 后续计量及损益确认方法

1) 成本法核算的长期股权投资

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

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

2) 权益法核算的长期股权投资

本集团对联营企业和合营企业的投资采用权益法核算。联营企业是指本集团能够对其施加重大影响的被投资单位，合营企业是指本集团仅对该安排的净资产享有权利的合营安排。

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

采用权益法核算时，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资收益和其他综合收益，同时调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应享有的部分，相应减少长期股权投资的账面价值；对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并

计入资本公积。在确认应享有被投资单位净损益的份额时，以取得投资时被投资单位各项可辨认资产等的公允价值为基础，对被投资单位的净利润进行调整后确认。被投资单位采用的会计政策及会计期间与本公司不一致的，按照本公司的会计政策及会计期间对被投资单位的财务报表进行调整，并据以确认投资收益和其他综合收益。对于本集团与联营企业及合营企业之间发生的交易，投出或出售的资产不构成业务的，未实现内部交易损益按照享有的比例计算归属于本集团的部分予以抵销，在此基础上确认投资损益。但本集团与被投资单位发生的未实现内部交易损失，属于所转让资产减值损失的，不予以抵销。

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

3) 处置长期股权投资

处置长期股权投资时，其账面价值与实际取得价款的差额，计入当期损益。采用权益法核算的长期股权投资，处置后的剩余股权仍采用权益法核算的，原采用权益法核算而确认的其他综合收益采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理，并按比例结转当期损益；因被投资方除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动而确认的所有者权益，按比例结转入当期损益。

19. 投资性房地产

投资性房地产是指为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产。本集团的投资性房地产为已出租的建筑物。

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

本集团采用成本模式对投资性房地产进行后续计量，并按照与房屋建筑物或土地使用权一致的政策进行折旧或摊销。

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

20. 固定资产

(1). 确认条件

适用 不适用

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

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

(2). 折旧方法

适用 不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	年限平均法	30	3	3.23
机器设备	年限平均法	3-10	3	9.70-32.33
运输设备	年限平均法	6	3	16.17
其他设备	年限平均法	5	3	19.40

预计净残值是指假定固定资产预计使用寿命已满并处于使用寿命终了时的预期状态，本集团从该项资产处置中获得的扣除预计处置费用后的金额。

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

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。

(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

适用 不适用

21. 在建工程

适用 不适用

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。在建工程在达到预定可使用状态后结转为固定资产。

22. 借款费用

适用 不适用

可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的借款费用，在资产支出已经发生、借款费用已经发生、为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或生产活动已经开始时，

开始资本化；构建或者生产的符合资本化条件的资产达到预定可使用状态或者可销售状态时，停止资本化。其余借款费用在发生当期确认为费用。

专门借款当期实际发生的利息费用，减去尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额予以资本化；一般借款根据累计资产支出超过专门借款部分的资产支出加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率，确定资本化金额。资本化率根据一般借款的加权平均利率计算确定。

23. 使用权资产

√适用 □不适用

在租赁期开始日，除进行简化处理的短期租赁和低价值资产租赁除外，承租人应当对租赁确认使用权资产和租赁负债。

使用权资产，是指承租人可在租赁期内使用租赁资产的权利。

(1) 使用权资产初始计量

租赁期开始日，是指出租人提供租赁资产使其可供承租人使用的起始日期。

使用权资产应当按照成本进行初始计量。该成本包括：

- 1、租赁负债的初始计量金额；
- 2、在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；
- 3、承租人发生的初始直接费用；
- 4、承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。

租赁激励，是指出租人为达成租赁向承租人提供的优惠，包括出租人向承租人支付的与租赁有关的款项、出租人为承租人偿付或承担的成本等。

初始直接费用，是指为达成租赁所发生的增量成本。增量成本是指若企业不取得该租赁，则不会发生的成本。

(2) 使用权资产后续计量

公司作为承租人能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，应当在租赁资产剩余使用寿命内按照直线法计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，应当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。

24. 无形资产

(1). 计价方法、使用寿命、减值测试

√适用 □不适用

无形资产包括交易席位费、计算机软件等。

无形资产按成本进行初始计量。使用寿命有限的无形资产自可供使用时起，对其原值减去预计净残值和已计提的减值准备累计金额在其预计使用寿命内采用直线法分期平均摊销。使用寿命不确定的无形资产不予摊销。使用寿命有限的软件的摊销期限为 3 年。交易席位费能为本集团带来经济利益的具体期限并不确定，故作为使用寿命不确定的无形资产。

年末，对使用寿命有限的无形资产的使用寿命和摊销方法进行复核，必要时进行调整。

(2). 内部研究开发支出会计政策

√适用 □不适用

研究阶段的支出，于发生时计入当期损益。

开发阶段的支出同时满足下列条件的，确认为无形资产，不能满足下述条件的开发阶段的支出计入当期损益：

- (1) 完成该无形资产以使其能够使用或出售在技术上具有可行性；
- (2) 具有完成该无形资产并使用或出售的意图；
- (3) 无形资产产生经济利益的方式，包括能够证明运用该无形资产生产的产品存在市场或无形资产自身存在市场，无形资产将在内部使用的，能够证明其有用性；
- (4) 有足够的技术、财务资源和其他资源支持，以完成该无形资产的开发，并有能力使用或出售该无形资产；
- (5) 归属于该无形资产开发阶段的支出能够可靠地计量。

无法区分研究阶段支出和开发阶段支出的，将发生的研发支出全部计入当期损益。

25. 长期资产减值

√适用 □不适用

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

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

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

的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

26. 长期待摊费用

√适用 □不适用

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

27. 附回购条件的资产转让

√适用 □不适用

(1) 买入返售金融资产

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

(2) 卖出回购金融资产款

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

(3) 债券借贷

公司根据债券借贷协议，以自持的债券作为质押债券，从其他金融机构借入其他债券，同时约定在未来某一时期归还所借入的标的债券，且向债券融出方支付借贷费用，并由债券融出方返还相应质押债券。持有期间债券利息归债券融出方所有。借入的债券不在资产负债表内确认。如果该类债券出售给第三方，则将偿还标的债券的义务确认为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

28. 合同负债

合同负债的确认方法

√适用 □不适用

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

29. 职工薪酬

(1)、短期薪酬的会计处理方法

适用 不适用

本集团在职工为其提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。本集团发生的职工福利费，在实际发生时根据实际发生额计入当期损益或相关资产成本。职工福利费为非货币性福利的，按照公允价值计量。

本集团为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金，以及本集团按规定提取的工会经费和职工教育经费，在职工为本集团提供服务的会计期间，根据规定的计提基础和计提比例计算确定相应的职工薪酬金额，确认相应负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2)、离职后福利的会计处理方法

适用 不适用

离职后福利全部为设定提存计划。

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

(3)、辞退福利的会计处理方法

适用 不适用

本集团向职工提供辞退福利的，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：本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。

(4)、其他长期职工福利的会计处理方法

适用 不适用

30. 预计负债

适用 不适用

当与或有事项相关的义务是本集团承担的现时义务，且履行该义务很可能导致经济利益流出，以及该义务的金额能够可靠地计量，则确认为预计负债。在资产负债表日，考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素，按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行计量。如果货币时间价值影响重大，则以预计未来现金流出折现后的金额确定最佳估计数。如果清偿预计负债所需支出全部或部分预期由第三方补偿的，补偿金额在基本确定能够收到时，作为资产单独确认，且确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

31. 租赁负债

适用 不适用

租赁负债应当按照租赁期开始日尚未支付的租赁付款额的现值进行初始计量。

(1) 租赁负债初始计量

在计算租赁付款额的现值时，承租人应当采用租赁内含利率作为折现率；无法确定租赁内含利率的，应当采用承租人增量借款利率作为折现率。

租赁内含利率，是指使出租人的租赁收款额的现值与未担保余值的现值之和等于租赁资产公允价值与出租人的初始直接费用之和的利率。

承租人增量借款利率，是指承租人在类似经济环境下为获得与使用权资产价值接近的资产，在类似期间以类似抵押条件借入资金须支付的利率。

租赁付款额，是指承租人向出租人支付的与在租赁期内使用租赁资产的权利相关的款项，包括：

- 1、固定付款额及实质固定付款额，存在租赁激励的，扣除租赁激励相关金额；
- 2、取决于指数或比率的可变租赁付款额，该款项在初始计量时根据租赁期开始日的指数或比率确定；
- 3、购买选择权的行权价格，前提是承租人合理确定将行使该选择权；
- 4、行使终止租赁选择权需支付的款项，前提是租赁期反映出承租人将行使终止租赁选择权；
- 5、根据承租人提供的担保余值预计应支付的款项。

实质固定付款额，是指在形式上可能包含变量但实质上无法避免的付款额。

可变租赁付款额，是指承租人为取得在租赁期内使用租赁资产的权利，向出租人支付的因租赁期开始日后的事实或情况发生变化（而非时间推移）而变动的款项。取决于指数或比率的可变租赁付款额包括与消费者价格指数挂钩的款项、与基准利率挂钩的款项和为反映市场租金费率变化而变动的款项等。

担保余值，是指与出租人无关的一方向出租人提供担保，保证在租赁结束时租赁资产的价值至少为某指定的金额。

未担保余值，是指租赁资产余值中，出租人无法保证能够实现或仅由与出租人有关的一方予以担保的部分。

(2) 租赁负债后续计量

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。按照《企业会计准则第 17 号——借款费用》等其他准则规定应当计入相关资产成本的，从其规定。

未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额应当在实际发生时计入当期损益。

在租赁期开始日后，发生下列情形的，本集团重新确定租赁付款额，并按变动后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债：

- 1、续租选择权或终止租赁选择权的评估结果发生变化，或者前述选择权的实际行使情况与原评估结果不一致等导致租赁期变化的，应当根据新的租赁期重新确定租赁付款额；
- 2、购买选择权的评估结果发生变化的，应当根据新的评估结果重新确定租赁付款额。

在计算变动后租赁付款额的现值时，本集团采用重估日的承租人增量借款利率作为修订后的折现率。

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，并将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。其他租赁变更导致租赁负债重新计量的，本集团相应调整使用权资产的账面价值。

32. 股份支付

适用 不适用

33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

本集团发行的永续债，同时符合以下条件的，作为权益工具：

(1) 该金融工具不包括交付现金或其他金融资产给其他方，或在潜在不利条件下与其他方交换金融资产或金融负债的合同义务；(2) 将来须用或可用企业自身权益工具结算该金融工具的，如该金融工具为非衍生工具，不包括交付可变数量的自身权益工具进行结算的合同义务；如为衍生工具，企业只能通过以固定数量的自身权益工具交换固定金额的现金或其他金融资产结算该金融工具。

归类为权益工具的永续债等金融工具，利息支出或股利分配作为本集团的利润分配，其回购、注销等作为权益的变动处理，相关交易费用从权益中扣减。

34. 回购本公司股份

适用 不适用

35. 收入

(1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

本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控制权时，按照分摊至该项履约义务的交易价格确认收入。履约义务，是指合同中本集团向客户转让可明确区分商品或服务的承诺。交易价格，是指本集团因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，但不包含代第三方收取的款项以及本集团预期将退还给客户的款项。

满足下列条件之一的，属于在某一时间段内履行的履约义务，本集团按照履约进度，在一段时间内确认收入：(1) 客户在本集团履约的同时即取得并消耗所带来的经济利益；(2) 客户能够控制本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。否则，本集团在客户取得相关商品或服务控制权的时点确认收入。

合同中包含两项或多项履约义务的，本集团在合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务。

合同资产，是指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。本集团拥有的无条件(即，仅取决于时间流逝)向客户收取对价的权利作为应收款项单独列示。

合同负债，是指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。

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

本集团具体主要收入如下：

(1) 手续费及佣金收入

手续费及佣金收入的金额按照本集团在日常经营活动中提供劳务时，已收或应收合同或协议价款的公允价值确定。

本集团履行了合同中的履约义务，客户取得相关商品或服务的控制权时，确认相关的手续费及佣金收入：

1、经纪业务收入

经纪业务佣金收入于交易日在达成有关交易后确认。经纪业务的处理与结算手续费收入于提供有关服务后确认。

2、投资银行业务收入

证券和债券承销业务在承销合同中约定的履约义务完成时点按照合同或协议约定的金额确认收入；承销及保荐费于承销或保荐责任完成时确认。

3、资产管理业务收入

资产管理业务手续费于本集团有权收取资产管理协议中约定的收入时确认。

(2) 其他业务收入

以合同到期结算时或提供服务时确认为收入。

(2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况

适用 不适用

36. 合同成本

适用 不适用

37. 利润分配

适用 不适用

公司交纳所得税后的利润，按照下列顺序分配：

- 1、弥补上一年度的亏损。
- 2、按净利润的一定比例提取一般风险准备。
- 3、按净利润的一定比例提取法定盈余公积金
- 4、按净利润的一定比例提取交易风险准备。
- 5、提取任意盈余公积金。
- 6、支付股东股利。

公司法定公积金累计额为公司注册资本的百分之五十以上的，可以不再提取。提取法定公积金后，是否提取任意公积金由股东大会决定。公司不在弥补公司亏损和提取一般风险准备金、法定公积金、交易风险准备金和任意盈余公积金之前向股东分配利润。

38. 政府补助

(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

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

政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量；公允价值不能够可靠取得的，按照名义金额计量。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值/确认为递延收益，并在相关资产的使用寿命内平均分配分期计入当期损益。

(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关成本费用和损失的，确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益/冲减相关成本；用于补偿已经发生的相关成本费用和损失的，直接计入当期损益/冲减相关成本。

与本集团日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益/冲减相关成本费用。与本集团日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

39. 递延所得税资产/递延所得税负债

适用 不适用

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

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

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

本集团确认与子公司、联营企业及合营企业投资相关的应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债，除非本集团能够控制暂时性差异转回的时间，而且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。对于与子公司、联营企业及合营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，只有当暂时性差异在可预见的未来很可能转回，且未来很可能获得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额时，本集团才确认递延所得税资产。

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

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

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

40. 租赁

(1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

租赁，是指在一定期间内，出租人将资产的使用权让与承租人以获取对价的合同。

对于首次执行日后签订或变更的合同，在合同开始/变更日，本集团评估该合同是否为租赁或者包含租赁。除非合同条款和条件发生变化，本集团不重新评估合同是否为租赁或者包含租赁。

(1) 本集团作为承租人的租赁

1) 租赁的分拆

合同中同时包含一项或多项租赁和非租赁部分的，本集团将各项单独租赁和非租赁部分进行分拆，按照各租赁部分单独价格及非租赁部分的单独价格之和的相对比例分摊合同对价。

为便于实务操作，如果本集团能够合理预期将具有类似特征的租赁作为一个组合进行会计处理与对该组合中的各单项租赁分别进行会计处理相比不会对财务报表产生显著的影响，本集团将具有类似特征的租赁作为一个组合进行会计处理。

2) 使用权资产

除短期租赁和低价值资产租赁外，本集团在租赁期开始日对租赁确认使用权资产。租赁期开始日，是指出租人提供租赁资产使其可供本集团使用的起始日期。

使用权资产按照成本进行初始计量。该成本包括：

- 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；
- 本集团发生的初始直接费用；
- 本集团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。

本集团参照《企业会计准则第 4 号—固定资产》有关折旧规定，对使用权资产计提折旧。本集团能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，使用权资产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，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《企业会计准则第 8 号—资产减值》的规定来确定使用权资产是否已发生减值，并对已识别的减值损失进行会计处理。

3) 租赁负债

除短期租赁和低价值资产租赁外，本集团在租赁期开始日按照该日尚未支付的租赁付款额的现值对租赁负债进行初始计量。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，采用增量借款利率作为折现率。

租赁付款额是指本集团向出租人支付的与在租赁期内使用租赁资产的权利相关的款项，包括：

- 固定付款额及实质固定付款额，存在租赁激励的，扣除租赁激励相关金额；
- 取决于指数或比率的可变租赁付款额；
- 本集团合理确定将行使的购买选择权的行权价格；
- 租赁期反映出本集团将行使终止租赁选择权的，行使终止租赁选择权需支付的款项；
- 根据本集团提供的担保余值预计应支付的款项。

租赁期开始日后，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，并计入当期损益或相关资产成本。

在租赁期开始日后，发生下列情形的，本集团重新计量租赁负债，并调整相应的使用权资产，若使用权资产的账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，本集团将差额计入当期损益：

- 因租赁期变化或购买选择权的评估结果发生变化的，本集团按变动后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债；

- 根据担保余值预计的应付金额或者用于确定租赁付款额的指数或者比例发生变动，本集团按照变动后的租赁付款额和原折现率计算的现值重新计量租赁负债。租赁付款额的变动源自浮动利率变动的，使用修订后的折现率。

4) 短期租赁和低价值资产租赁

本集团对房屋及建筑物及机器设备的短期租赁以及低价值资产租赁，选择不确认使用权资产和租赁负债。短期租赁，是指在租赁期开始日，租赁期不超过 12 个月且不包含购买选择权的租赁。低价值资产租赁，是指单项租赁资产为全新资产时价值较低的租赁。本集团将短期租赁和低价值资产租赁的租赁付款额，在租赁期内各个期间按照直线法计入当期损益。

5) 租赁变更

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：

- 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；
- 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，本集团重新分摊变更后合同的对价，重新确定租赁期，并按照变更后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债。

租赁变更导致租赁范围缩小或租赁期缩短的，本集团相应调减使用权资产的账面价值，并将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。其他租赁变更导致租赁负债重新计量的，本集团相应调整使用权资产的账面价值。

(2) 本集团作为出租人的租赁

1) 租赁的分拆

合同中同时包含租赁和非租赁部分的，本集团根据《企业会计准则第 14 号—收入》关于交易价格分摊的规定分摊合同对价，分摊的基础为租赁部分和非租赁部分各自的单独价格。

2) 租赁的分类

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。融资租赁以外的其他租赁为经营租赁。

本集团作为出租人记录经营租赁业务

在租赁期内各个期间，本集团采用直线法，将经营租赁的租赁收款额确认为租金收入。本集团发生的与经营租赁有关的初始直接费用于发生时予以资本化，在租赁期内按照与租金收入确认相同的基础进行分摊，分期计入当期损益。

本集团取得的与经营租赁有关的未计入租赁收款额的可变租赁收款额，在实际发生时计入当期损益。

3) 转租赁

本集团作为转租出租人，将原租赁及转租赁合同作为两个合同单独核算。本集团基于原租赁产生的使用权资产，而不是原租赁的标的资产，对转租赁进行分类。

4) 租赁变更

经营租赁发生变更的，本集团自变更生效日起将其作为一项新租赁进行会计处理，与变更前租赁有关的预收或应收租赁收款额视为新租赁的收款额。

(2)、融资租赁的会计处理方法

适用 不适用

(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

见上述租赁准则会计政策的描述。

41. 融资融券业务

适用 不适用

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

本集团对融出的资金，确认应收债权，在资产负债表中列示为融出资金，并确认相应利息收入；用于融出的证券，在初始确认时分类为交易性金融资产或指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资，已融出的证券，不终止确认该证券，但确认相应手续费收入。

为融资业务向中国证券金融股份有限公司借入的资金，在资产负债表中作为拆入资金列示，按摊余成本乘以实际利率确认利息支出。本集团对于融入的证券，由于其主要收益或风险不由本集团享有或承担，不确认该证券，确认相应手续费支出。

42. 资产证券化业务

适用 不适用

43. 其他重要的会计政策和会计估计

适用 不适用

运用会计政策中所作的重要判断和会计估计所采用的关键假设和不确定因素

本集团在运用附注五所描述的会计政策过程中，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。这些判断、估计和假设是基于本集团管理层过去的历史经验，并在考虑其他相关因素的基础上作出的。实际的结果可能与本集团的估计存在差异。

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

运用会计政策过程中所作的重要判断

(1) 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：(a) 拥有对被投资者的权力；(b) 通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；及 (c) 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。

对于本集团担任管理人的集合资产管理计划和基金，本集团会评估其持有的份额连同管理人报酬和信用增级对这些集合资产管理计划和基金所产生的可变回报的风险敞口是否足够重大，从而表明本集团是主要责任人。如果本集团担任主要责任人的角色，则需要将这些集合资产管理计划和基金纳入合并范围。

(2) 确定金融资产的分类

金融资产的分类和计量取决于金融资产的合同条款是否规定了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，以及业务模式的测试结果。本集团确认业务模式时主要考虑如何对金融资产组进行管理，以达到特定业务目标。该评估涵盖能够反映所有相关证据的判断，包括如何评估和计量金融资产业绩、影响金融资产业绩的风险、以及如何管理金融资产及相关业务管理人员如何获得报酬。本集团通过监控到期前终止确认的、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，以了解其处置的原因，以及这些原因是否与持有金融资产业务目标保持一致。

会计估计中采用的关键假设和不确定因素

资产负债表日，会计估计中很可能导致未来期间资产、负债账面价值作出重大调整的关键假设和不确定性主要有：

(1) 金融资产的公允价值

本集团对没有活跃交易市场的金融资产，通过各种估值方法确定其公允价值。本集团使用的估值方法包括相同或相似资产的最近成交价和现金流贴现模型分析等。当本集团采用估值技术对公允价值进行评估时，会在最大程度上利用可观察市场数据；当可观察的市场数据无法获得时，将对估值方法中的重大不可观察信息做出估计。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资产的公允价值产生影响。

(2) 融出资金和买入返售金融资产的减值

本集团对融出资金和买入返售金融资产评估预期信用损失。本集团在融出资金和买入返售金融资产的预期信用损失计量过程中运用重大的会计判断和估计。

信用风险的显著增加：预期信用损失模型中减值准备的确认为第一阶段资产采用 12 个月内的预期信用损失，第二阶段或第三阶段资产采用整个存续期内的预期信用损失。当初始确认后信用风险显著增加时，资产进入第二阶段；当已发生信用减值时，资产进入第三阶段。在评估资产的信用风险是否显著增加和金融资产是否已发生信用减值时，本集团会考虑定性和定量的合理且有依据的前瞻性信息。

建立具有相似信用风险特征的资产组：当预期信用损失在组合的基础上计量时，金融工具是基于相似的风险特征而组合在一起的。本集团持续评估这些金融工具是否继续保持具有相似的信用风险特征，用以确保一旦信用风险特征发生变化，金融工具将被适当地重分类。这可能会导致新建资产组合或将资产重分类至某个现存资产组合，从而更好地反映这类资产的类似信用风险特征。当信用风险显著增加时，资产从第一阶段转入第二阶段。同时也发生在当资产仍评估为 12 个月内或整个存续期内的预期信用损失时，由于资产组的信用风险不同而导致预期信用损失的金额不同。

模型和假设的使用：本集团采用不同的模型和假设来评估预期信用损失。本集团通过判断来确定每类金融资产的最适用模型，以及确定这些模型所使用的假设，包括信用风险的关键驱动因素相关的假设。

前瞻性信息：在评估预期信用损失时，本集团使用了合理且有依据的前瞻性信息，这些信息基于对不同经济驱动因素的未来走势的假设，以及这些经济驱动因素如何相互影响的假设。

违约率：违约率是计量预期信用损失的重要输入值。违约率是对未来一定时期内发生违约的可能性的估计，其计算涉及历史数据、假设和对未来情况的预期。

违约损失率：违约损失率是对违约产生的损失的估计。它基于合同现金流与借款人预期收到的现金流之间的差异，且考虑了抵押品产生的现金流和整体信用增级。

有关上述会计估计详见附注十七、(二)。

(3) 所得税以及递延所得税

本集团在正常的经营活动中，有部分交易其最终的税务处理和计算存在一定的不确定性。如果这些税务事项的最终认定结果同最初入账的金额存在差异，则该差异将对其最终认定期间的当期所得税和递延所得税产生影响。

本集团递延所得税资产的确认主要取决于是否有足够的应纳税暂时性差异可供利用的情况或取得其他确凿的证据表明其于未来期间能够取得足够的应纳税所得额。当有客观证据表明本集团于可抵扣暂时性差异转回的未来期间能够产生足够的应纳税所得额，则本集团以很可能取得的应纳税所得额为限，确认相关的递延所得税资产。

44. 重要会计政策和会计估计的变更

(1)、重要会计政策变更

适用 不适用

(2)、重要会计估计变更
 适用 不适用

(3)、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

(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

45. 其他
 适用 不适用

六、税项
1. 主要税种及税率

主要税种及税率情况

 适用 不适用

税种	计税依据	税率
增值税	按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	6%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税额	7%
企业所得税	应纳税所得额	25%
教育费附加	实际缴纳的流转税额	3%
地方教育费附加	实际缴纳的流转税额	2%

注 1：2016 年 3 月 23 日，财政部、国家税务总局联合发布《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 号），要求从 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。自 2016 年 5 月 1 日起，本集团由缴纳营业税改为缴纳增值税。

本集团适用增值税。本公司及子公司购进应税货物或接受应税劳务及服务，取得的增值税进项税额可以按相关规定抵扣销项税额。增值税应纳税额为当期销项税额抵减当期可抵扣进项税额后的余额。当期销项税额小于当期进项税额不足抵扣时，其不足部分可以结转下期继续抵扣。销项税额按根据相关税法规定计算的销售额计算，本公司提供的金融服务适用 6% 的税率。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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 (%)
本公司及设立于中国大陆的子公司	25
香港地区的子公司	注

注：本集团设立于香港地区的子公司所得税按照 2018 年 3 月 28 日由香港立法会签署生效的《2017 年税务(修订)(第 7 号)条例草案》的要求，实体的首 200 万元利润将按 8.25% 课税，而超

过 200 万元利润则按 16.5% 课税。(2020 年度: 实体的首 200 万元利润将按 8.25% 课税, 而超过 200 万元利润则按 16.5% 课税)。

2. 税收优惠

适用 不适用

3. 其他

适用 不适用

七、合并财务报表项目注释

1、货币资金

适用 不适用

(1) 按类别列示

单位: 元

类别	期末余额	期初余额
库存现金	161,437.30	287,629.71
银行存款	74,290,832,865.46	65,248,779,303.68
其中: 客户存款	56,416,830,685.85	48,384,423,234.76
公司存款	17,874,002,179.61	16,864,356,068.92
其他货币资金	158,336,996.03	391,292,623.26
合计	74,449,331,298.79	65,640,359,556.65

(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:	/	/	161,437.30	/	/	287,629.71
人民币	/	/	136,501.91	/	/	203,097.92
港元	29,966.82	0.8321	24,935.39	100,441.77	0.8416	84,531.79
银行存款:	/	/	74,290,832,865.46	/	/	65,248,779,303.68
其中: 自有资金	/	/	17,372,483,932.90	/	/	16,035,291,549.34
人民币	/	/	15,321,244,704.22	/	/	13,301,047,583.59
美元	138,666,784.29	6.4601	895,801,293.17	211,224,501.48	6.5249	1,378,218,749.70
港元	1,334,290,301.08	0.8321	1,110,262,959.53	1,526,512,201.57	0.8416	1,284,712,668.84
欧元	1,612,139.22	7.6862	12,391,224.49	6,783,045.49	8.0250	54,433,940.07
其他			32,783,751.49			16,878,607.14
其中: 公司信用资金			501,518,246.71			829,064,519.58
人民币			501,518,246.71			829,064,519.58
公司存款合计			17,874,002,179.61			16,864,356,068.92
客户资金	/	/	53,464,650,201.03	/	/	45,732,676,675.33
人民币	/	/	51,836,715,456.66	/	/	44,146,931,620.49
美元	93,571,117.30	6.4601	604,478,774.86	65,216,829.80	6.5249	425,533,292.76
港元	1,111,382,284.06	0.8321	924,781,198.57	1,359,920,101.26	0.8416	1,144,508,757.22
欧元	1,585,857.03	7.6862	12,189,214.28	1,539,225.60	8.0250	12,352,285.47
其他			86,485,556.66			3,350,719.39
客户信用资			2,952,180,484.82			2,651,746,559.43

金						
人民币			2,952,180,484.82			2,651,746,559.43
客户存款合计			56,416,830,685.85			48,384,423,234.76
其他货币资金:	/	/	158,336,996.03	/	/	391,292,623.26
人民币	/	/	152,197,876.85	/	/	391,292,623.26
美元	950,313.34	6.4601	6,139,119.18			
合计	/	/	74,449,331,298.79	/	/	65,640,359,556.65

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	/	/	501,518,246.71	/	/	829,064,519.58
人民币	/	/	501,518,246.71	/	/	829,064,519.58
客户信用资金	/	/	2,952,180,484.82	/	/	2,651,746,559.43
人民币	/	/	2,952,180,484.82	/	/	2,651,746,559.43
合计	/	/	3,453,698,731.53	/	/	3,480,811,079.01

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

□适用 √不适用

货币资金的说明：

√适用 □不适用

于 2021 年 6 月 30 日，本集团受限制的货币资金金额为 150,408,145.87 元。（2020 年 12 月 31 日，本集团受限制的货币资金金额为 132,708,255.74 元）。

2、 结算备付金

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

单位：元

类别	期末余额	期初余额
客户备付金	22,545,367,998.37	18,591,394,862.89
公司备付金	2,288,791,748.36	2,924,961,783.72
合计	24,834,159,746.73	21,516,356,646.61

(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:	/	/	2,125,097,243.22	/	/	2,726,937,655.47
人民币	/	/	2,125,097,243.22	/	/	2,726,937,655.47
公司信用备付金:	/	/	163,694,505.14	/	/	198,024,128.25
人民币	/	/	163,694,505.14	/	/	198,024,128.25
客户普通备付金:	/	/	22,235,985,518.32	/	/	18,291,394,823.77

人民币	/	/	21,635,755,750.98	/	/	18,035,922,032.12
美元	35,014,230.26	6.4601	226,195,428.90	31,575,757.14	6.5249	206,028,657.76
港元	67,577,363.31	0.8321	56,231,124.01	58,750,159.09	0.8416	49,444,133.89
其他			317,803,214.43			
客户信用备付金:	/	/	309,382,480.05	/	/	300,000,039.12
人民币	/	/	309,382,480.05	/	/	300,000,039.12
合计	/	/	24,834,159,746.73	/	/	21,516,356,646.61

3、贵金属

适用 不适用

4、拆出资金

适用 不适用

5、融出资金

适用 不适用

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

类别	期末余额	期初余额
1. 融资融券业务融出资金	23,167,218,848.00	20,951,466,503.22
2. 孖展融资	359,988,958.94	267,053,777.38
小计	23,527,207,806.94	21,218,520,280.60
减：减值准备	46,341,184.32	46,600,866.54
融出资金净值	23,480,866,622.62	21,171,919,414.06

(2) 按客户类别列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
个人	18,671,891,898.33	16,880,091,261.76
机构	4,495,326,949.67	4,071,375,241.46
香港孖展融资	359,988,958.94	267,053,777.38
小计	23,527,207,806.94	21,218,520,280.60
减：减值准备	46,341,184.32	46,600,866.54
账面价值小计	23,480,866,622.62	21,171,919,414.06
账面价值合计	23,480,866,622.62	21,171,919,414.06

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	3,563,519,815.92	2,865,292,937.51
债券	23,195,737.46	51,818,994.77
股票	75,470,621,808.74	75,119,588,720.24
基金	2,354,851,545.03	2,346,444,094.81
合计	81,412,188,907.15	80,383,144,747.33

融出资金的说明:

适用 不适用

2021 年 6 月 30 日在卖出回购协议下作为担保物资产的融出资金账面价值为 4,220,372,325.29 元(2020 年 12 月 31 日: 3,819,545,927.18 元)。

6、衍生金融工具

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

类别	期末					期初				
	套期工具		非套期工具			套期工具		非套期工具		
	名义金额	公允价值	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	名义金额	公允价值	
				资产	负债				资产	负债
利率衍生工具			464,400,838,450.00	715,609.82	8,279,453.30			493,662,395,750.00	1,754,767.01	11,397,640.57
权益衍生工具			14,574,472,047.00	29,262,655.45	76,164,595.78			10,535,023,424.42	73,793,884.96	78,136,610.46
信用衍生工具			356,054,568.72	1,384,292.64	406,953.74			375,690,784.00	650,958.15	3,150,669.29
其他衍生工具			57,088,549,449.31	20,288,898.40	893,229,026.18			37,478,969,176.38	79,676,859.64	412,271,776.16
合计			536,419,914,515.03	51,651,456.31	978,080,029.00			542,052,079,134.80	155,876,469.76	504,956,696.48

已抵销的衍生金融工具:

适用 不适用

衍生金融工具的说明:

注 1: 本集团除香港子公司外于本期末所持有的国债期货、股指期货、商品期货、黄金延期,均为每日无负债结算。在当日无负债结算制度下,结算备付金已包括本集团所持有的股指期货、国债期货和商品期货合约产生的公允价值变动金额。香港的股指期货合约与商品期货并未采用无负债结算制度,其衍生金融资产及负债均系香港子公司衍生业务产生。

衍生金融工具项下的境内国债期货合约、境内股指期货合约、商品期货合约、黄金延期合约以及利率互换合约形成的金融资产或金融负债与相关业务的暂收暂付款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额列示,为人民币零元。抵销前衍生金融资产/负债与国债期货、股指期货、商品期货、黄金延期以及利率互换的暂收/暂付款的期末金额如下表所示:

单位: 元 币种: 人民币

	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	衍生金融资产 / 暂收款	衍生金融负债 / 暂付款	衍生金融资产 / 暂付款	衍生金融负债 / 暂付款
利率互换合约	62,305,439.03		132,048,689.81	
国债期货合约	14,257,150.00		6,617,000.00	
股指期货合约		39,330,180.00		78,316,860.00
商品期货合约		2,540,035.00		20,854,745.00
黄金延期合约	4,850.00		10,790.00	
外汇期权合约		11,011.13		

外汇掉期合约	66,249,933.99		85,350,301.26	
外汇远期合约	446,640.39		11,613,368.85	

注 2:本集团与符合一定条件的客户约定在未来一定期限内,按照约定的名义本金和收益率进行权益收益互换。该互换合约的收益率与标的权益证券的市场表现挂钩。

注 3:本集团与符合一定条件的客户签订了一系列与黄金价格相关的期权合约。尽管黄金的公允价值具有波动性,这些期权合约组合在一起以使得本集团支付相对固定的费用支出。

7、存出保证金

√适用 □不适用

单位:元

项目	期末账面余额			期初账面余额		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
交易保证金	/	/	906,337,590.34	/	/	829,247,936.42
其中:人民币	/	/	682,340,480.99	/	/	668,512,664.15
美元	34,351,930.98	6.4601	221,916,909.35	3,488,612.44	6.5249	22,762,847.27
港元	2,499,939.91	0.8321	2,080,200.00	163,940,619.06	0.8416	137,972,425.00
信用保证金	/	/	43,759,833.37	/	/	48,492,488.02
其中:人民币	/	/	43,759,833.37	/	/	48,492,488.02
履约保证金	/	/	1,361,726,012.94	/	/	1,305,349,270.33
其中:人民币	/	/	1,333,257,955.35	/	/	1,141,590,901.92
港元	34,212,303.32	0.8321	28,468,057.59	194,579,810.37	0.8416	163,758,368.41
合计	/	/	2,311,823,436.65	/	/	2,183,089,694.77

8、应收款项

(1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末余额	期初余额
应收清算款	557,798,634.01	435,545,767.20
应收手续费及佣金	620,367,162.79	451,060,951.38
合计	1,178,165,796.80	886,606,718.58
减:坏账准备(按简化模型计提)	10,844,475.37	12,201,165.36
应收款项账面价值	1,167,321,321.43	874,405,553.22

(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(%)	坏账准备	比例(%)	金额	比例(%)	坏账准备	比例(%)
1年以内	1,157,353,620.89	98.23	5,394,926.35	0.47	871,110,629.96	98.25	3,809,869.99	0.44
1-2年	9,605,780.70	0.82	48,028.91	0.50	438,451.88	0.05	2,192.26	0.50
2-3年	109,097.64	0.01	11,586.34	10.62	9,817,876.05	1.11	5,377,904.31	54.78
3年以上	11,097,297.57	0.94	5,389,933.77	48.57	5,239,760.69	0.59	3,011,198.80	57.47
合计	1,178,165,796.80	100.00	10,844,475.37	0.92	886,606,718.58	100.00	12,201,165.36	1.38

(3) 按计提坏账列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备:								
单项计提坏账准备:	9,787,976.68	0.83	5,383,387.17	55.00	12,791,305.58	1.44	8,383,387.17	65.54
单项计小计	9,787,976.68	0.83	5,383,387.17	55.00	12,791,305.58	1.44	8,383,387.17	65.54
组合计提坏账准备:								
组合计提坏账准备	1,168,377,820.12	99.17	5,461,088.20	0.47	873,815,413.00	98.56	3,817,778.19	0.44
组合小计	1,168,377,820.12	99.17	5,461,088.20	0.47	873,815,413.00	98.56	3,817,778.19	0.44
合计	1,178,165,796.80	100.00	10,844,475.37	0.92	886,606,718.58	100.00	12,201,165.36	1.38

(4) 应收款项金额前五单位名称/性质情况

单位：元 币种：人民币

单位名称	金额	账龄	坏账准备	性质或内容	占应收款项总额比例
东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金	21,152,388.19	1年以内	105,761.94	应收管理费	1.80%
东方红启东三年持有期混合型证券投资基金	17,784,533.48	1年以内	88,922.67	应收管理费	1.51%
东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金	17,084,470.54	1年以内	85,422.35	应收管理费	1.45%
东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金	16,553,200.43	1年以内	82,766.00	应收管理费	1.40%
华夏基金管理有限公司	12,474,540.67	1年以内	62,372.70	应收手续费	1.06%

9、 应收款项融资

 适用 不适用

10、 合同资产

(1). 合同资产情况

 适用 不适用

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
投行业务手续费				1,741,886.80		1,741,886.80
合计				1,741,886.80		1,741,886.80

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

 适用 不适用

(3). 本期合同资产计提减值准备情况

 适用 不适用

其他说明：

 适用 不适用

11、 买入返售金融资产

(1) 按业务类别

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票质押式回购	14,729,108,792.46	16,338,943,231.20

债券质押式回购	1,995,353,280.82	2,028,907,238.63
债券买断式回购	1,190,661,628.20	1,126,520,529.47
减：减值准备	4,578,736,742.33	5,033,945,627.94
账面价值合计	13,336,386,959.15	14,460,425,371.36

说明：股票质押式回购 2021 年 6 月末三阶段原值和减值金额分别如下：一阶段原值 373,693,046.21 元，减值余额 200,252.19 元；二阶段原值 543,727,892.02 元，减值余额 8,214,809.16 元；三阶段原值 13,811,687,854.23 元，减值余额 4,570,321,680.98 元。（2020 年年末三阶段原值和减值金额分别如下：一阶段原值 684,492,734.50 元，减值余额 271,595.83 元；二阶段原值 2,936,498,660.27 元，减值余额 26,276,216.71 元；三阶段原值 12,717,951,836.43 元，减值余额 5,007,397,815.40 元。）

(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	14,729,108,792.46	16,338,943,231.20
债券	3,186,014,909.02	3,155,427,768.10
减：减值准备	4,578,736,742.33	5,033,945,627.94
买入返售金融资产账面价值	13,336,386,959.15	14,460,425,371.36

(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	17,986,487,441.49	17,837,382,646.06

注 1：通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因无法获知对手方质押库信息而无法披露，故此金额并未包括交易所国债逆回购所取得的担保物资产的公允价值。其所担保的买入返售金融资产 2021 年 6 月 30 日余额为人民币 546,186,168.77 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 652,647,368.20 元）。

(4) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	14,579,608,791.46	16,100,121,842.45
一个月至三个月内		238,821,388.75
三个月至一年内	149,500,001.00	
合计	14,729,108,792.46	16,338,943,231.20

12、持有待售资产

□适用 √不适用

13、交易性金融资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末余额						
类别	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计
债券	30,832,329,055.36		30,832,329,055.36	30,317,033,418.66		30,317,033,418.66
公募基金	8,082,649,992.44		8,082,649,992.44	7,576,154,410.78		7,576,154,410.78
股票及股权	11,108,902,740.89		11,108,902,740.89	10,872,668,866.19		10,872,668,866.19
银行理财产品	2,482,628,973.21		2,482,628,973.21	2,479,341,219.91		2,479,341,219.91
券商资管产品	2,184,528,763.36		2,184,528,763.36	2,011,657,136.96		2,011,657,136.96
信托计划	213,418,444.36		213,418,444.36	198,785,276.31		198,785,276.31
其他	21,548,242,753.41		21,548,242,753.41	20,444,920,995.40		20,444,920,995.40
合计	76,452,700,723.03		76,452,700,723.03	73,900,561,324.21		73,900,561,324.21
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	26,977,230,840.64		26,977,230,840.64	26,512,297,118.09		26,512,297,118.09
公募基金	11,407,654,399.00		11,407,654,399.00	10,913,348,495.23		10,913,348,495.23
股票及股权	8,839,918,130.44		8,839,918,130.44	8,375,681,194.69		8,375,681,194.69
银行理财产品	2,710,547,492.45		2,710,547,492.45	2,694,000,000.00		2,694,000,000.00
券商资管产品	2,745,531,139.70		2,745,531,139.70	2,502,111,944.64		2,502,111,944.64
信托计划	276,318,813.46		276,318,813.46	266,717,119.89		266,717,119.89
其他	19,743,916,227.01		19,743,916,227.01	18,985,065,861.39		18,985,065,861.39
合计	72,701,117,042.70		72,701,117,042.70	70,249,221,733.93		70,249,221,733.93

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的描述性说明

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

1、于 2021 年 6 月 30 日，交易性金融资产中含拟融出证券的账面价值人民币 151,392,515.42 元（2020 年 12 月 31 日：人民币 144,212,016.82 元）。

2、变现受限制的交易性金融资产

单位：元 币种：人民币

项目	限售条件或变现方面的其他重大限制	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
股票及其他 ^(注 1)	限售股及其他	332,114,716.36	680,415,839.51
债券	卖出回购业务作为担保物	21,920,761,904.91	14,545,294,427.67
债券	债券借贷作为担保物	582,283,776.00	1,003,785,297.29
基金	卖出回购业务作为担保物	6,017,072,043.46	5,460,045,330.30
债券及其他	其他负债作为担保物	337,471,753.68	872,743,083.24

注 1：本集团期末持有的存在限售期限的交易性金融资产包括存在限售期限的股票、以自有资金投资的集合资产管理计划和其他投资产品。

14、 债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额				期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
金融债	2,671,982,551.19	60,818,274.21		2,732,800,825.40	2,833,989,784.65	73,433,569.72		2,907,423,354.37
企业债	40,083,823.56	2,356,504.16	3,219.54	42,437,108.18	40,372,980.33	971,211.13	15,792.76	41,328,398.70
中期票据	120,000,000.00	3,550,684.84	47,789.57	123,502,895.27	360,000,000.00	20,734,360.64	131,700.57	380,602,660.07
公司债	654,974,000.00	12,862,851.77	179,709.33	667,657,142.44	1,548,973,156.63	52,168,831.39	515,350.02	1,600,626,638.00
其他	1,250,000,000.00	12,281,118.93		1,262,281,118.93	1,302,201,993.31	11,716,096.41	1,991.05	1,313,916,098.67
合计	4,737,040,374.75	91,869,433.91	230,718.44	4,828,679,090.22	6,085,537,914.92	159,024,069.29	664,834.40	6,243,897,149.81

其他说明：

变现受限制的债权投资

单位：元 币种：人民币

项目	限售条件或变现方面的其他重大限制	2021年6月30日
债券	卖出回购业务作为担保物	4,601,682,764.40

15、 其他债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	预期信用损失(注)	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	预期信用损失(注)
国债	14,709,725,029.99	124,412,152.27	-44,443,545.99	14,789,693,636.27		16,195,809,281.49	168,058,789.22	-124,741,501.49	16,239,126,569.22	
金融债	1,167,594,312.35	29,571,608.87	8,768,869.45	1,205,934,790.67	488,229.62	1,386,372,694.62	27,405,595.91	13,598,400.78	1,427,376,691.31	550,716.58
企业债	11,817,862,611.46	329,230,954.41	34,936,655.37	12,182,030,221.24	112,532,625.63	9,878,356,109.02	254,976,775.82	53,245,870.62	10,186,578,755.46	110,598,170.05
中期票据	6,625,821,675.05	237,509,629.86	64,939,354.96	6,928,270,659.87	46,741,897.20	6,444,971,104.63	130,037,380.96	52,574,415.38	6,627,582,900.97	47,213,957.33
公司债	11,307,418,730.26	297,823,012.25	-19,504,634.98	11,585,737,107.53	34,118,797.02	11,204,677,096.53	298,623,524.62	-47,773,026.37	11,455,527,594.78	63,953,490.51
其他	20,226,484,562.78	333,700,663.98	138,137,645.52	20,698,322,872.28	45,919,160.46	16,229,842,986.74	262,718,417.20	217,221,001.16	16,709,782,405.10	50,174,285.92
合计	65,854,906,921.89	1,352,248,021.64	182,834,344.33	67,389,989,287.86	239,800,709.93	61,340,029,273.03	1,141,820,483.73	164,125,160.08	62,645,974,916.84	272,490,620.39

其他说明：

其他债权投资的预期信用损失计入其他综合收益。

变现受限制的其他债权投资

单位：元 币种：人民币

项 目	限售条件或变现方面的其他重大限制	2021 年 6 月 30 日
债券	债券借贷作为担保物	3,045,892,572.00
债券	卖出回购业务作为担保物	25,187,304,391.54

16、其他权益工具投资

(1). 按项目披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
股票 ^(注1)	3,421,527,652.80	3,184,622,742.86	30,159,557.84	3,426,340,899.37	2,793,477,118.37	124,843,517.44	战略投资
永续债投资 ^(注2)	2,762,957,279.26	2,911,755,615.73	18,857,547.17	2,912,957,279.26	3,013,878,663.01	146,131,320.79	非交易目的
其他			302,647,304.46	4,890,320,000.00	5,129,101,790.46		战略投资
合计	6,184,484,932.06	6,096,378,358.59	351,664,409.47	11,229,618,178.63	10,936,457,571.84	270,974,838.23	/

注 1：于 2021 年 6 月 30 日，本集团将部分以非交易性目的持有的股票及未上市股权投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资。

于 2021 年 6 月 30 日，其他权益工具投资中含拟融出证券的账面价值人民币 41,926,165.80 元(2020 年 12 月 31 日：人民币 66,185,227.00 元)。

注 2：于 2021 年 6 月 30 日，本集团将部分永续债投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资。本集团拟长期持有这些永续债投资并获取相关股利收入。

变现受限制的其他权益工具投资

单位：元 币种：人民币

项 目	限售条件或变现方面的其他重大限制	2021年6月30日	2020年12月31日
永续债投资	卖出回购业务作为担保物	4,521,638,400.00	1,686,324,106.32
永续债投资	债券借贷作为担保物		11,745,124.78
股票	限售股	77,057,771.77	33,780,614.28

(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
股票	40,420,861.26		-1,362,933.24	规避系统性风险
永续债投资	151,379,189.39	4,905,660.38	1,034,392.04	规避系统性风险
其他	4,890,320,000.00	302,647,304.46		产品清算
合计	5,082,120,050.65	307,552,964.84	-328,541.20	/

其他说明：

 适用 不适用

17、长期股权投资

 适用 不适用

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

项 目	期末余额	年初余额
联营企业	6,060,631,677.57	5,771,193,948.89
小计	6,060,631,677.57	5,771,193,948.89
减：减值准备		
合 计	6,060,631,677.57	5,771,193,948.89

(2) 长期股权投资详细情况如下:

单位: 元 币种: 人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备		
一、合营企业										
小计										
二、联营企业										
汇添富基金管理股份有限公司	2,585,810,107.82			554,967,055.37	-2,071,496.74	-2,582,456.87	-339,055,539.01			2,797,067,670.57
东证睿波(上海)投资中心(有限合伙)	143,074,843.30			12,700,256.74	-1,705,167.19					154,069,932.85
东证腾骏(上海)投资合伙企业(有限合伙)	4,621,294.13		-1,953,799.00	-3,005.93						2,664,489.20
海宁春秋投资合伙企业(有限合伙)	37,825,949.29		-3,389,485.18	2,849,143.08			-11,016,529.72			26,269,077.47
海宁东证蓝海并购投资合伙企业(有限合伙)	342,727,700.00		-29,059,000.00	-64,460,910.00						249,207,790.00
宜兴东证睿元股权投资合伙企业(有限合伙)	41,286,291.10			-685,272.22						40,601,018.88
珠海横琴东证云启科创投资合伙企业(有限合伙)	2,700,778.82	6,300,000.00		-26,029.99						8,974,748.83
宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙)	114,986,410.26			83,694.33						115,070,104.59
南通东证富象股权投资中心(有限合伙)	69,942,919.81			132,849,285.66						202,792,205.47
成都交子东方投资发展合伙企业(有限合伙)	498,608,495.12			47,435,084.01						546,043,579.13
上海诚毅新能源创业投资有限公司	176,618,080.53			24,056,001.91						200,674,082.44
上海东证春医投资中心(有限合伙)	115,472,319.77			-17,236.47						115,455,083.30
上海东证今缘股权投资基金合伙企业(有限合伙)	2,147,555.55			-12,543.04						2,135,012.51
上海东证远誉投资中心(有限合伙)	335,182.83			-11,333.49						323,849.34
OCI International Holdings Limited	426,301,253.11			48,109.68	-1,059,999.58					425,289,363.21
诚泰融资租赁(上海)有限公司	974,835,614.55			29,585,784.15			-46,667,236.89			957,754,161.81
上海君煜投资中心(有限合伙)	1,247,861.40			-32,738.09						1,215,123.31
上海东恺投资管理有限公司	20,873,752.30			-2,649,769.56						18,223,982.74
嘉兴君兆投资管理合伙企业(有限合伙)	29,716,573.61			-317,046.69						29,399,526.92
上海顾歌资产管理有限公司	31,794,444.79			-921,169.77						30,873,275.02
深圳盟海五号智能产业投资合伙企业(有限合伙)	63,822,155.21			2,884.68						63,825,039.89
温州俊元资产管理合伙企业(有限合伙)	83,141,797.10		-13,737,332.95							69,404,464.15
杭州数行科技有限公司	3,302,568.49			-4,472.55						3,298,095.94
小计	5,771,193,948.89	6,300,000.00	-48,139,617.13	735,435,771.81	-4,836,663.51	-2,582,456.87	-396,739,305.62			6,060,631,677.57
合计	5,771,193,948.89	6,300,000.00	-48,139,617.13	735,435,771.81	-4,836,663.51	-2,582,456.87	-396,739,305.62			6,060,631,677.57

18、投资性房地产

投资性房地产计量模式

(1). 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	63,516,422.78	63,516,422.78
2. 本期增加金额		
(1) 外购		
(2) 存货\固定资产\在建工程转入		
(3) 企业合并增加		
3. 本期减少金额	5,598,455.92	5,598,455.92
(1) 处置		
(2) 其他转出	5,598,455.92	5,598,455.92
4. 期末余额	57,917,966.86	57,917,966.86
二、累计折旧和累计摊销		
1. 期初余额	23,055,752.75	23,055,752.75
2. 本期增加金额	877,845.75	877,845.75
(1) 计提或摊销	877,845.75	877,845.75
3. 本期减少金额	5,347,700.72	5,347,700.72
(1) 处置		
(2) 其他转出	5,347,700.72	5,347,700.72
4. 期末余额	18,585,897.78	18,585,897.78
三、减值准备		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额		
(1) 计提		
3. 本期减少金额		
(1) 处置		
(2) 其他转出		
4. 期末余额		
四、账面价值		
1. 期末账面价值	39,332,069.08	39,332,069.08
2. 期初账面价值	40,460,670.03	40,460,670.03

(2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况:

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

19、固定资产

(1). 固定资产情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	办公设备	合计
一、账面原值：					
1. 期初余额	1,879,841,016.73	909,174,369.34	42,762,265.55	121,140,953.64	2,952,918,605.26
2. 本期增加金额	1,135,725.69	115,726,675.11	2,201,571.31	13,440,675.89	132,504,648.00
(1) 购置	1,135,725.69	51,940,223.59	2,201,571.31	9,813,521.91	65,091,042.50
(2) 在建工程转入		63,786,451.52		3,627,153.98	67,413,605.50
(3) 企业合并增加					
3. 本期减少金额		13,601,472.08	319,194.00	1,319,363.16	15,240,029.24
(1) 处置或报废		13,456,255.18	312,582.00	1,304,196.10	15,073,033.28
(2) 外币报表折算差额		145,216.90	6,612.00	15,167.06	166,995.96
4. 期末余额	1,880,976,742.42	1,011,299,572.37	44,644,642.86	133,262,266.37	3,070,183,224.02
二、累计折旧					
1. 期初余额	199,205,457.06	629,547,334.32	30,354,463.16	74,209,378.08	933,316,632.62
2. 本期增加金额	30,972,288.51	66,136,802.50	1,936,931.00	5,238,549.87	104,284,571.88
(1) 计提	30,972,288.51	66,136,802.50	1,936,931.00	5,238,549.87	104,284,571.88
3. 本期减少金额		12,803,263.22	307,894.81	1,166,861.86	14,278,019.89
(1) 处置或报废		12,700,882.70	303,204.54	1,159,030.52	14,163,117.76
(2) 外币报表折算差额		102,380.52	4,690.27	7,831.34	114,902.13
4. 期末余额	230,177,745.57	682,880,873.60	31,983,499.35	78,281,066.09	1,023,323,184.61
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	1,650,798,996.85	328,418,698.77	12,661,143.51	54,981,200.28	2,046,860,039.41
2. 期初账面价值	1,680,635,559.67	279,627,035.02	12,407,802.39	46,931,575.56	2,019,601,972.64

(2). 暂时闲置的固定资产情况

适用 不适用

(3). 通过融资租赁租入的固定资产情况

适用 不适用

(4). 通过经营租赁租出的固定资产

适用 不适用

(5). 未办妥产权证书的固定资产情况

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

20、在建工程

(1). 在建工程情况

√适用 □不适用

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
金桥数据中心网络设备项目	1,335,119.72		1,335,119.72	20,522,378.79		20,522,378.79
营业部装修及设备更新	7,630,665.61		7,630,665.61	8,752,728.67		8,752,728.67
子公司办公室装修	5,273,003.77		5,273,003.77			
其他	22,913,705.09		22,913,705.09	36,563,417.52		36,563,417.52
合计	37,152,494.19		37,152,494.19	65,838,524.98		65,838,524.98

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

□适用 √不适用

(3). 本期计提在建工程减值准备情况

□适用 √不适用

其他说明

□适用 √不适用

21、使用权资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	运输设备	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	1,379,962,693.04	3,336,128.64	1,383,298,821.68
2. 本期增加金额	106,638,804.86		106,638,804.86
3. 本期转入	5,598,455.92		5,598,455.92
4. 本期减少金额	25,901,899.05		26,134,455.92
5. 外币报表折算差额	-760,941.92		-760,941.92
6. 期末余额	1,465,537,112.85	3,336,128.64	1,468,873,241.49
二、累计折旧			
1. 期初余额	534,611,716.54	1,332,157.12	535,943,873.66
2. 本期增加金额	163,270,842.48	563,288.23	163,834,130.71
3. 本期转入	5,347,700.72		5,347,700.72
4. 本期减少金额	22,848,461.60		22,848,461.60
5. 外币报表折算差额	-330,326.38		-330,326.38
6. 期末余额	680,051,471.76	1,895,445.35	681,946,917.11

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	785,485,641.09	1,440,683.29	786,926,324.38
2. 期初账面价值	845,350,976.50	2,003,971.52	847,354,948.02

其他说明：

本集团租赁了多项资产，包括房屋及建筑物和交通运输设备，租赁期为 1 年到 10 年。租赁条款系在个别基础上磋商，包括各种不同条款及条件。在厘定租期及评估不可撤回租赁期间的长度时，本集团应用合同的定义并厘定合同可强制执行的期间。

2021 年 6 月 30 日，本集团与租赁相关的现金流出合计人民币 179,956,481.78 元。

2021 年 6 月 30 日，计入当期损益的简化处理的短期租赁费用为人民币 11,435,339.52 元、低价值资产租赁费用为人民币 421,418.95 元。于 2021 年 6 月 30 日，本集团的短期租赁组合与列示于附注七、64 的租赁费对应的短期租赁相类似。

22、无形资产

(1). 无形资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	计算机软件	交易席位费	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	684,034,925.86	61,552,797.50	745,587,723.36
2. 本期增加金额	50,170,734.45		50,170,734.45
(1) 购置	50,170,734.45		50,170,734.45
3. 本期减少金额	100,644.10		100,644.10
(1) 处置			
(2) 外币报表折算差额	100,644.10		100,644.10
4. 期末余额	734,105,016.21	61,552,797.50	795,657,813.71
二、累计摊销			
1. 期初余额	490,464,414.50	39,810,214.52	530,274,629.02
2. 本期增加金额	56,206,831.05		56,206,831.05
(1) 计提	56,206,831.05		56,206,831.05
3. 本期减少金额	99,397.28		99,397.28
(1) 处置			

(2) 外币报表折算差额	99,397.28		99,397.28
4. 期末余额	546,571,848.27	39,810,214.52	586,382,062.79
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	187,533,167.94	21,742,582.98	209,275,750.92
2. 期初账面价值	193,570,511.36	21,742,582.98	215,313,094.34

(2). 未办妥产权证书的土地使用权情况

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

本集团交易席位费主要包括上海证券交易所、深圳证券交易所和全国中小企业股份转让系统的交易席位费。

使用寿命不确定的交易席位费的减值测试

本公司管理层认为持有的交易席位费的使用寿命不确定，主要系其预计带来现金净流入的具体期限不确定。交易席位费将于使用寿命确定时才开始摊销。本集团持有的交易席位费每年或者当有迹象表明其可能减值时将其进行减值测试。本集团持有的交易席位费所属的经纪业务资产组的预计可收回金额超过该资产组的账面价值，因此管理层认为截至 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本集团交易席位费未发生减值。

23、商誉

(1). 商誉账面原值

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加		本期减少		期末余额
		企业合并形成的		处置		
收购营业部商誉	18,947,605.48					18,947,605.48
东证期货商誉	13,187,769.62					13,187,769.62
合计	32,135,375.10					32,135,375.10

(2). 商誉减值准备

适用 不适用

(3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息
 适用 不适用

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

本集团进行商誉的减值测试时，将商誉分摊至两个独立的资产组，分别为本公司收购的证券经纪营业部（“资产组 A”）及本公司收购的上海东证期货有限公司（“资产组 B”）。

截至 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，资产组 A 和资产组 B 的预计可收回金额均超过该资产组的账面价值，故本集团认为其均不存在减值。

资产组 A 和资产组 B 的预计可收回金额按照未来现金流量的现值确定。预计现金流量的现值以管理层的财务预算为基础按照折现率 15% 计算确定。根据资产组的历史业绩和管理层对未来市场发展的预期，管理层认为以上资产组的账面价值预计超过可收回金额的可能性很低。

(5). 商誉减值测试的影响
 适用 不适用

其他说明：

 适用 不适用

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

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
可抵扣亏损			6,034,307.40	1,508,576.85
以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融工具			129,035,446.71	32,258,861.68
应付职工薪酬	1,274,939,805.04	318,734,951.26	1,532,262,374.24	383,065,593.56
坏账准备	1,434,168,096.84	358,542,024.21	720,714,856.60	180,178,714.15
买入返售金融资产减值准备	4,578,736,742.32	1,144,684,185.58	5,033,945,627.94	1,258,486,406.99
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、衍生金融资产/负债			374,711,308.44	93,677,827.11
其他	15,208,604.40	3,802,151.10	7,247,185.76	1,811,796.44
合计	7,303,053,248.60	1,825,763,312.15	7,803,951,107.09	1,950,987,776.78

(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
以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融工具	97,463,023.92	24,365,755.98		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、衍生金融资产/负债	1,515,360,311.64	378,840,077.91	2,028,326,104.04	507,081,526.01
长期股权投资	122,511,539.64	30,627,884.91	32,654,287.20	8,163,571.80
合计	1,735,334,875.20	433,833,718.80	2,060,980,391.24	515,245,097.81

(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	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	1,414,979,029.91	1,455,922,066.16
递延所得税负债	23,049,436.56	20,179,387.19

(4). 未确认递延所得税资产明细
 适用 不适用

(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期
 适用 不适用

其他说明：

 适用 不适用

25. 其他资产
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
其他应收款	4,350,800,141.54	354,157,255.42
长期待摊费用	148,476,708.42	140,221,702.24
贷款和委托贷款	39,291,551.56	78,720,680.82
预付款项	538,995,260.93	459,301,919.63
其他	1,178,464,214.55	1,105,598,151.74
合计	6,256,027,877.00	2,137,999,709.85

其他应收款按款项性质列示：

 适用 不适用

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

 适用 不适用

其他资产的说明:

1、其他应收款

(1) 按明细列示

单位: 元 币种: 人民币

	期末余额	期初余额
其他应收款余额	5,768,207,488.07	1,057,519,251.55
减: 坏账准备	1,417,407,346.53	703,361,996.13
其他应收款净值	4,350,800,141.54	354,157,255.42

(2) 评估方式列示

单位: 元 币种: 人民币

	期末余额				年初余额			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	计提比例 (%)	账面余额	比例 (%)	坏账准备	计提比例 (%)
单项计提坏账准备	1,458,557,656.78	25.29	1,411,387,709.21	96.77	755,035,344.04	71.40	701,895,396.47	92.96
组合计提坏账准备	4,309,649,831.29	74.71	6,019,637.32	0.14	302,483,907.51	28.60	1,496,599.66	0.49
合计	5,768,207,488.07	100.00	1,417,407,346.53	24.57	1,057,519,251.55	100.00	703,361,996.13	66.51

(3) 按账龄分析

单位: 元 币种: 人民币

	期末余额				期初余额			
	账面余额	比例 (%)	坏账准备	比例 (%)	账面余额	比例 (%)	坏账准备	比例 (%)
1 年以内	4,150,859,937.54	71.96	2,138,700.45	0.05	274,519,161.11	25.96	1,334,709.43	0.49
1-2 年	27,049,931.28	0.47	93,170.47	0.34	118,551,501.69	11.21	73,057,312.41	61.62
2-3 年	137,856,527.05	2.39	73,160,309.62	53.07	7,645,180.91	0.72	38,110.89	0.50
3 年以上	1,452,441,092.20	25.18	1,342,015,165.99	92.40	656,803,407.84	62.11	628,931,863.40	95.76
合计	5,768,207,488.07	100.00	1,417,407,346.53	24.57	1,057,519,251.55	100.00	703,361,996.13	66.51

2、贷款委托贷款

单位: 元 币种: 人民币

	期末余额	期初余额
贷款和委托贷款余额	39,488,996.54	79,116,262.13
减: 坏账准备	197,444.98	395,581.31
贷款和委托贷款净值	39,291,551.56	78,720,680.82

注: 于 2021 年 6 月 30 日, 本集团之子公司以质押的方式向若干企业出借资金, 期限为一年。

3、长期待摊费用

单位: 元 币种: 人民币

	2020 年 12 月 31 日	本期增加额	本期摊销额	其他减少额	汇率差额	2021 年 6 月 30 日
租入固定资产改良支出	133,208,295.21	30,672,455.78	22,407,215.56		-115,747.31	141,357,788.12
其他	7,013,407.03	3,134,625.68	3,029,112.41			7,118,920.30
合计	140,221,702.24	33,807,081.46	25,436,327.97		-115,747.31	148,476,708.42

26、 融券业务情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券		
—交易性金融资产	437,762,592.80	445,322,506.07
—其他权益工具投资	163,351,842.00	128,849,004.40
—转融通融入证券	1,420,025,955.14	1,317,694,542.01
转融通融入证券总额	2,021,140,389.94	1,891,866,052.48

融券业务违约情况：

□适用 √不适用

27、 资产减值准备变动表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	转入/（转出）	核销	期末余额
融出资金减值准备	46,600,866.54	-88,661.26		171,020.96	46,341,184.32
买入返售金融资产减值准备	5,033,945,627.94	273,226,391.73	-711,575,077.95	16,860,199.39	4,578,736,742.33
债权投资减值准备	664,834.40	-434,115.96			230,718.44
坏账准备	715,958,742.80	3,915,446.13	711,575,077.95	3,000,000.00	1,428,449,266.88
金融工具及其他项目信用减值准备小计	5,797,170,071.68	276,619,060.64		20,031,220.35	6,053,757,911.97
合计	5,797,170,071.68	276,619,060.64		20,031,220.35	6,053,757,911.97
其他债权投资预期信用损失（注1）	272,490,620.39	-18,564,964.32		14,124,946.14	239,800,709.93

资产减值准备的说明：

注1：其他债权投资的预期信用损失准备在其他综合收益中确认。

28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

金融工具类别	期末余额			
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	合计
融出资金减值准备	982,112.25	158,234.01	45,200,838.06	46,341,184.32
应收款项坏账准备(简化模型)	/	5,447,917.77	5,396,557.60	10,844,475.37
买入返售金融资产减值准备	200,252.19	8,214,809.16	4,570,321,680.98	4,578,736,742.33
其中：股票质押式回购	200,252.19	8,214,809.16	4,570,321,680.98	4,578,736,742.33
债权投资减值准备	230,718.44			230,718.44
其他应收款坏账准备	3,070,073.30		1,414,534,718.21	1,417,604,791.51
合计	4,483,156.18	13,820,960.94	6,035,453,794.85	6,053,757,911.97
其他债权投资减值准备(注)	11,619,915.29	199,490.64	227,981,304.00	239,800,709.93
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	1,054,384.07	310,040.77	45,236,441.70	46,600,866.54
应收款项坏账准备(简化模型)	/	3,817,778.19	8,383,387.17	12,201,165.36
买入返售金融资产减值准备	271,595.83	26,276,216.71	5,007,397,815.40	5,033,945,627.94
其中：股票质押式回购	271,595.83	26,276,216.71	5,007,397,815.40	5,033,945,627.94
债权投资减值准备	664,834.40			664,834.40
其他应收款坏账准备	1,862,180.97		701,895,396.47	703,757,577.44
合计	3,852,995.27	30,404,035.67	5,762,913,040.74	5,797,170,071.68
其他债权投资(注)	14,218,904.04	171,979.90	258,099,736.45	272,490,620.39

注：其他债权投资的预期信用损失准备在其他综合收益中确认。

29、短期借款

(1). 短期借款分类

□适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
信用借款	4,148,571,185.09	579,732,185.45
合计	4,148,571,185.09	579,732,185.45

(2). 已逾期未偿还的短期借款情况

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

30、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率(%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
20 东证 01 (20 亿-1 年) ^(注 1)	100	2020/3/24	365D	2,000,000,000	2.70	2,041,806,716.81		2,041,806,716.81	
2020 东方证 券 CP006 (30 亿-87 天) ^(注 2)	100	2020/10/20	87D	3,000,000,000	2.88	3,017,196,045.40		3,017,196,045.40	
短期收益凭 证 ^(注 3)				11,925,814,960.00	2.10-3.80	11,196,483,024.16	12,049,765,795.98	18,554,318,452.58	4,691,930,367.56
合计	/	/	/	16,925,814,960.00	/	16,255,485,786.37	12,049,765,795.98	23,613,321,214.79	4,691,930,367.56

应付短期融资款的说明：

注 1：根据上交所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》（上证函[2017]491 号），公司于 2020 年 3 月 24 日成功发行 2020 年第一期非公开发行公司债券（简称“20 东证 01”），规模为人民币 20 亿元，债券期限为 365 天，债券发行利率为 2.70%。

注 2：根据《中国人民银行关于核定东方证券股份有限公司短期融资券最高待偿还余额的通知》（银发[2019]50 号），公司于 2020 年 10 月 16 日成功发行 2020 年第三期短期融资券（简称“20 东方证券 CP006”），规模为人民币 30 亿元，债券期限为 87 天，债券发行利率为 2.88%。

注 3：根据中国证监会《关于同意开展场外市场收益凭证业务试点的函》（中证协函[2014]285 号），本公司获准试点开展收益凭证业务。于 2021 年 6 月 30 日，未到期收益凭证的票面利率为 2.10%至 3.80%（于 2020 年 12 月 31 日：未到期收益凭证的票面利率为 2.1%至 10.00%）。

31、拆入资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
银行拆入资金	3,151,362,805.57	8,666,963,871.43
转融通融入资金	1,503,020,833.33	1,003,150,000.00
合计	4,654,383,638.90	9,670,113,871.43

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	502,683,333.33	2.80%		
1 至 3 个月	500,233,333.33	2.80%	1,003,150,000.00	2.80%
3 至 12 个月	500,104,166.67	2.50%		
合计	1,503,020,833.33	/	1,003,150,000.00	/

32、交易性金融负债

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
债券(注 1)	4,411,683,013.86		4,411,683,013.86	2,254,362,770.18		2,254,362,770.18
结构化主体(注 2)		1,882,810,525.89	1,882,810,525.89		1,262,525,977.61	1,262,525,977.61
结构化收益产品(注 3)		611,729,179.06	611,729,179.06		1,153,184,396.44	1,153,184,396.44
其他	9,427,181,400.00	1,013,870,082.30	10,441,051,482.30	9,906,000,000.00		9,906,000,000.00
合计	13,838,864,413.86	3,508,409,787.25	17,347,274,201.11	12,160,362,770.18	2,415,710,374.05	14,576,073,144.23

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

注 1、系债券借贷业务借入债券后卖出产生的交易性金融负债。

注 2、系因本集团能够实施控制而纳入合并财务报表范围的结构化主体的其他份额持有人利益。

注 3、结构化收益产品主要系本集团发行的结构化票据和收益凭证。收益凭证合约包含嵌入式衍生金融工具，整份合约在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益。

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

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

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

33、卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
买断式卖出回购	5,170,895,830.96	3,507,966,964.83
质押式卖出回购	43,770,635,922.15	40,728,628,912.65
质押式报价回购	4,931,551,322.24	5,218,791,867.80
其他卖出回购	3,543,804,861.14	3,405,495,694.45
合计	57,416,887,936.49	52,860,883,439.73

(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	49,564,965,720.62	44,856,999,176.67
基金	4,308,117,354.73	4,598,388,568.61
融出资金收益权	3,543,804,861.14	3,405,495,694.45
合计	57,416,887,936.49	52,860,883,439.73

(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	56,231,387,460.85	47,041,196,091.52
基金	6,017,072,043.46	5,460,045,330.30
其他	4,220,372,325.29	3,819,545,927.18
合计	66,468,831,829.60	56,320,787,349.00

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

期限	期末账面余额	利率区间	期初账面余额	利率区间
一个月内	1,903,099,322.24	0.35%-5.58%	1,444,467,385.55	2.60%-5.58%
一个月至三个月内	1,377,616,000.00	2.50%-4.18%	1,593,389,854.55	2.70%-4.18%
三个月至一年内	1,650,836,000.00	2.95%-4.10%	2,180,934,627.70	0.35%-4.10%
一年以上				
合计	4,931,551,322.24		5,218,791,867.80	

卖出回购金融资产款的说明:

适用 不适用

34、代理买卖证券款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
普通经纪业务		
其中：个人	27,221,197,482.17	23,834,030,040.42
机构	48,135,348,792.63	39,943,348,180.57
小计	75,356,546,274.80	63,777,378,220.99
信用业务		
其中：个人	2,416,015,031.87	2,038,271,304.51
机构	1,147,504,784.05	827,021,633.00
小计	3,563,519,815.92	2,865,292,937.51
合计	78,920,066,090.72	66,642,671,158.50

35、代理承销证券款

√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
股票	120,499,979.00	
债券		346,000,000.00
合计	120,499,979.00	346,000,000.00

36、应付职工薪酬

(1). 应付职工薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	2,514,303,596.31	2,966,704,274.22	3,012,490,510.56	2,468,517,359.97
二、离职后福利-设定提存计划	93,704,956.44	255,867,876.03	188,309,282.33	161,263,550.14
三、辞退福利				
四、一年内到期的其他福利				
合计	2,608,008,552.75	3,222,572,150.25	3,200,799,792.89	2,629,780,910.11

(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	2,511,816,732.80	2,723,339,200.10	2,769,997,934.38	2,465,157,998.52
二、职工福利费	2,880.00	38,893,095.80	38,855,627.01	40,348.79
三、社会保险费	303,330.11	76,884,971.21	76,473,658.49	714,642.83
其中：医疗保险费	296,501.29	75,293,469.41	74,904,491.73	685,478.97
工伤保险费	4,816.80	1,073,346.46	1,055,543.09	22,620.17
生育保险费	2,012.02	518,155.34	513,623.67	6,543.69
四、住房公积金	279,553.79	74,530,773.58	74,721,075.79	89,251.58
五、工会经费和职工教育经费	1,898,808.21	53,531,115.13	52,917,096.49	2,512,826.85
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
八、其他	2,291.40	-474,881.60	-474,881.60	2,291.40
合计	2,514,303,596.31	2,966,704,274.22	3,012,490,510.56	2,468,517,359.97

(3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	845,534.79	94,819,947.97	94,260,488.55	1,404,994.21
2、失业保险费	20,304.70	3,145,431.50	3,090,690.27	75,045.93
3、企业年金缴费	92,839,116.95	157,902,496.56	90,958,103.51	159,783,510.00
合计	93,704,956.44	255,867,876.03	188,309,282.33	161,263,550.14

其他说明：

 适用 不适用

37、应交税费

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税	48,578,782.06	121,580,568.87
企业所得税	295,408,653.15	570,866,847.89
个人所得税	29,490,815.03	35,590,598.07
城市维护建设税	4,275,568.43	10,565,425.83
教育费附加及地方教育费附加	1,833,191.75	4,529,455.49
限售股个人所得税	13,834,230.53	9,063,190.01
其他	1,494,377.75	30,618,526.94
合计	394,915,618.70	782,814,613.10

38、应付款项

(1). 应付款项列示

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付手续费及佣金	749,578,029.55	260,589,391.70
应付清算款项	478,853,951.57	315,995,187.31
合计	1,228,431,981.12	576,584,579.01

(2). 应付票据

 适用 不适用

其他说明：

 适用 不适用

39、合同负债

(1). 合同负债情况

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
预收基金管理费	3,618,040.80	17,118,074.89
预收大宗商品交易款	230,293,952.89	387,005,547.54
预收投行业务款项	24,468,275.47	
合计	258,380,269.16	404,123,622.43

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

其他说明:

适用 不适用**40、 持有待售负债**适用 不适用**41、 预计负债**适用 不适用**42、 长期借款****(1). 长期借款分类**适用 不适用

其他说明，包括利率区间:

适用 不适用

43、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
16 东方次级债 ^(注 1)	100	2016-11-14	5	4,000,000,000.00	3.45	4,018,376,192.83	68,457,197.68		4,086,833,390.51
17 东次 02 ^(注 2)	100	2017-04-26	3	1,500,000,000.00	5.10	1,552,806,065.39	33,526,797.65	71,679,452.05	1,514,653,410.99
17 东次 04 ^(注 3)	100	2017-05-15	3	1,500,000,000.00	5.35	1,551,002,003.41	36,975,838.53	77,725,982.00	1,510,251,859.94
17 东证 02 ^(注 4)	100	2017-06-09	5	1,000,000,000.00	5.50	1,031,474,650.11	26,217,854.68	54,246,575.34	1,003,445,929.45
2017 公司债 ^(注 5)	100	2017-08-03	10	4,000,000,000.00	4.98	4,084,022,170.45	98,782,977.90		4,182,805,148.35
17 海外美元债 ^(注 6)	200,000 美元	2017-11-30	5	500,000,000.00 美元	3.63	3,250,660,219.87	36,885,846.52	58,677,033.46	3,228,869,032.93
18 海外美元债 ^(注 7)	2,000,000 美元	2018-03-22	4	250,000,000.00 美元	3.63	1,607,019,152.06	23,364,549.20	29,338,516.72	1,601,045,184.54
19 东次 01 ^(注 8)	100	2019-03-19	3	6,000,000,000.00	4.20	6,199,379,336.31	113,227,196.16	240,263,013.70	6,072,343,518.77
19 东次 02 ^(注 9)	100	2019-06-14	3	4,000,000,000.00	4.20	4,093,204,992.73	78,784,495.36	163,031,325.92	4,008,958,162.17
2019 公司债 ^(注 10)	100	2019-11-25	3	4,900,000,000.00	3.50	4,917,663,854.50	85,093,096.76		5,002,756,951.26
19 海外美元债 ^(注 11)	200,000 美元	2019-08-20	3	300,000,000.00 美元	6 个月 LIBOR+1.25	1,964,549,612.41	18,446,265.00	35,930,826.12	1,947,065,051.29
19 海外欧元债 ^(注 12)	100,000 欧元	2019-08-20	3	200,000,000.00 欧元	0.63	1,600,812,742.78	8,838,929.31	68,337,220.85	1,541,314,451.24
19 海外新加坡元债 ^(注 13)	250,000 新元	2019-09-27	3	200,000,000.00 新元	2.90	990,959,309.93	15,069,785.82	40,732,453.16	965,296,642.59
20 海外美元债 ^(注 14)	100 美元	2020-10-13	3	160,000,000.00 美元	2.40	1,042,492,161.46	5,348,371.35	12,448,887.48	1,035,391,645.33
20 东证 02 ^(注 15)	100	2020-03-24	2	3,000,000,000.00	2.95	3,067,944,196.11	38,759,359.67	83,866,683.90	3,022,836,871.88
20 东证 03 ^(注 16)	100	2020-6-18	3	4,000,000,000.00	3.45	4,073,785,323.97	62,467,925.46	131,572,602.74	4,004,680,646.69
20 东债 01 ^(注 17)	100	2020-08-19	3	4,000,000,000.00	3.50	4,051,633,823.85	69,447,557.02		4,121,081,380.87
20 东债 02 ^(注 18)	100	2020-09-28	3	3,500,000,000.00	3.75	3,534,160,958.90	65,085,157.11		3,599,246,116.01
20 东债 03 ^(注 19)	100	2020-11-04	3	3,500,000,000.00	3.65	3,519,845,644.23	63,428,807.10		3,583,274,451.33
21 东债 01 ^(注 20)	100	2021-01-27	3	4,000,000,000.00	3.60		4,061,150,684.93		4,061,150,684.93
21 东证 C1 ^(注 21)	100	2021-03-08	3	2,500,000,000.00	3.95		2,530,960,744.47		2,530,960,744.47
21 东证 C2 ^(注 22)	100	2021-04-16	3	3,000,000,000.00	3.70		3,020,806,107.47		3,020,806,107.47
21 东证 C3 ^(注 23)	100	2021-04-16	5	1,500,000,000.00	4.20		1,511,950,474.89		1,511,950,474.89
长期收益凭证 ^(注 24)				500,000,000.00	3.20-4.25	6,113,681,086.38	607,790,685.33	1,157,932,547.95	5,563,539,223.76
合计	/	/	/	/	/	62,265,473,497.68	12,680,866,705.37	2,225,783,121.39	72,720,557,081.66

应付债券说明，包括可转换公司债券的转股条件、转股时间：

注 1：2016 年 11 月 14 日，根据 2015 年度股东大会审议通过的《关于公司发行次级债券(含永续次级债券)的议案》，以及上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司成功发行了 2016 年第一期次级债券，规模为人民币 40 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 3.45%。

注 2：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司于 2017 年 4 月 26 日成功发行了 2017 年第一期次级债券品种二简称“17 东次 02”))，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 3 年，债券发行利率为 5.10%。

注 3：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司于 2017 年 5 月 15 日成功发行了 2017 年第二期次级债券(品种二简称“17 东次 04”)，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 3 年，债券发行利率为 5.35%。

注 4：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2017]491 号)，公司于 2017 年 6 月 9 日成功发行了 2017 年第一期非公开发行公司债券(品种二简称“17 东证 02”)，规模为人民币 10 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 5.50%。

注 5：经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]974 号文核准，公司获准面向合格投资者公开发行面值不超过人民币 40 亿元的公司债券。2017 年 8 月 3 日，公司实际发行规模为人民币 40 亿元，债券期限为 10 年期，债券发行利率为 4.98%。

注 6：海外美元债以 Orient HuiZhi Limited 为发行主体，公司提供担保。2017 年 11 月 30 日，Orient HuiZhi Limited 向符合条件的投资者发行 5 亿美元海外债，到期日为 2022 年 11 月 30 日，债券发行利率为 3.63%。

注 7：海外美元债以 Orient HuiZhi Limited 为发行主体，东方证券股份有限公司提供担保。2018 年 3 月 22 日，公司向符合条件的投资者发行 2.5 亿美元海外债，到期日为 2022 年 11 月 30 日，债券发行利率为 3.63%。

注 8：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2019]306 号)，公司于 2019 年 3 月 19 日成功发行了东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)(简称“19 东次 01”)，规模为人民币 60 亿元，期限 3 年，最终票面利率 4.20%。

注 9：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2019]306 号)，公司于 2019 年 6 月 14 日成功发行了东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第二期)(简称“19 东次 02”)，规模为人民币 40 亿元，期限 3 年，最终票面利率 4.20%。

注 10：经中国证券监督管理委员会“证监许可(2019)900 号”批复核准，东方证券股份有限公司(以下简称“发行人”)获准向合格投资者公开发行总额不超过人民币 49 亿元(含 49 亿元)的公司债券。2019 年 11 月 25 日，公司实际发行规模为人民币 49 亿元，债券期限为 3 年期，债券发行利率为 3.50%。

注 11: 2019 年 8 月 20 日, 公司向符合条件的投资者发行 3 亿美元海外债, 债券期限为 3 年期, 债券利率为 6 个月 LIBOR 加上 1.25%。

注 12: 2019 年 8 月 20 日, 公司向符合条件的投资者发行 2 亿欧元海外债, 债券期限为 3 年期, 债券利率为 0.625%。

注 13: 2019 年 9 月 27 日, 公司向符合条件的投资者发行 2 亿新加坡元海外债, 债券期限为 3 年期, 债券利率为 2.90%。

注 14: 海外美元债以 Orient HuiZhi Limited 为发行主体, 东方证券股份有限公司提供担保。2020 年 10 月 13 日, 公司向符合条件的投资者发行 1.6 亿美元海外债, 到期日为 2023 年 10 月 13 日, 债券发行利率为 2.40%。

注 15: 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2020]160 号), 公司于 2020 年 3 月 24 日成功发行了 2020 年第一期非公开发行公司债券(品种二简称“20 东证 02”), 规模为人民币 30 亿元, 债券期限为 2 年, 债券发行利率为 2.95%。

注 16: 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2020]160 号), 公司于 2020 年 6 月 18 日成功发行了 2020 年第二期非公开发行公司债券(品种一简称“20 东证 03”), 规模为人民币 40 亿元, 债券期限为 3 年, 债券发行利率为 3.45%。

注 17: 经中国证券监督管理委员会“证监许可(2020)1329 号”批复核准, 公司获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元(含 200 亿元)的公司债券。2020 年 8 月 19 日, 公司实际发行规模为人民币 40 亿元, 债券期限为 3 年期, 债券发行利率为 3.50%。

注 18: 经中国证券监督管理委员会“证监许可(2020)1329 号”文件注册, 公司获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元(含 200 亿元)的公司债券。2020 年 9 月 28 日, 公司实际发行规模为人民币 35 亿元, 债券期限为 3 年期, 债券发行利率为 3.75%。

注 19: 经中国证券监督管理委员会“证监许可(2020)1329 号”文件注册, 公司获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元(含 200 亿元)的公司债券。2020 年 11 月 4 日, 公司实际发行规模为人民币 35 亿元, 债券期限为 3 年期, 债券发行利率为 3.65%。

注 20: 经中国证券监督管理委员会“证监许可(2020)1329 号”批复核准, 公司获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元(含 200 亿元)的公司债券。2021 年 1 月 27 日, 公司实际发行规模为人民币 40 亿元, 债券期限为 3 年期, 债券发行利率为 3.60%。

注 21: 经中国证券监督管理委员会“证监许可(2021)465 号”文件注册, 公司获准向专业投资者公开发行总额不超过 100 亿元的次级债券。2021 年 3 月 8 日, 公司成功发行了 2021 年第一期公开发行次级债券(品种简称“21 东证 C1”), 规模为人民币 25 亿元, 债券期限为 3 年, 债券发行利率为 3.95%。

注 22: 经中国证券监督管理委员会“证监许可(2021)465 号”文件注册, 公司获准向专业投资者公开发行总额不超过 100 亿元的次级债券。公司于 2021 年 4 月 16 日成功发行了 2021 年第二期公开发行次级债券(品种简称“21 东证 C2”), 规模为人民币 30 亿元, 债券期限为 3 年, 债券发行利率为 3.70%。

注 23：经中国证券监督管理委员会“证监许可〔2021〕465 号”文件注册，公司获准向专业投资者公开发行总额不超过 100 亿元的次级债券。公司于 2021 年 4 月 16 日成功发行了 2021 年第二期公开发行次级债券(品种简称“21 东证 C3”)，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 4.20%。

注 24：长期收益凭证为本集团发行的期限大于一年的收益凭证。于 2021 年 6 月 30 日，未到期长期收益凭证的票面利率为 3.20%至 4.25%(于 2020 年 12 月 31 日：未到期长期收益凭证的票面利率为 4.00%至 4.25%)。

44、 租赁负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
租赁负债	796,734,938.00	856,910,328.86
合计	796,734,938.00	856,910,328.86

其他说明：

租赁负债的到期期限分析如下：

单位：元 币种：人民币

期 限	2021 年 6 月 30 日
3 个月以内	91,642,046.42
3 个月-1 年	221,517,838.16
1-2 年	247,403,603.87
2-3 年	158,885,110.69
3-5 年	68,793,380.14
5 年以上	8,492,958.72
合 计	796,734,938.00

45、 递延收益

□适用 √不适用

46、 其他负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
应付普通股股利	1,723,047,535.61	80,000.00
应付永续债利息	237,500,000.00	
其他应付款	1,877,119,824.24	1,923,550,764.14
代理兑付债券款	802,403.76	802,403.76
预提费用	43,372,820.12	11,853,524.14
合计	3,881,842,583.73	1,936,286,692.04

其他应付款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
证券投资者保护基金 ^(注1)	39,662,407.22	34,601,932.62

期货风险准备金 ^(注2)	123,668,021.91	106,004,794.44
履约保证金	467,833,429.05	775,057,149.97
其他应付款项	1,245,955,966.06	1,007,886,887.11
合计	1,877,119,824.24	1,923,550,764.14

其他负债的说明:

注 1: 证券投资者保护基金系公司根据中国证监会证监发[2007]50 号文《关于印发〈证券公司缴纳证券投资者保护基金实施办法(试行)〉的通知》、中国证监会机构部部函[2007]268 号文《关于发布实施〈证券公司分类监管工作指引(试行)〉的通知》按营业收入的一定比例计提, 2021 年和 2020 年计提比例均为 0.50%。

注 2: 依据《期货公司监督管理办法》(证监会令[2007]第 43 号)和《商品期货交易财务管理暂行规定》(财商字[1997]44 号)的有关规定, 本公司按代理手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5%提取期货风险准备金。

47、股本

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	6,993,655,803.00						6,993,655,803.00

48、其他权益工具

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

□适用 √不适用

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

发行在外的金融工具	期初		本期增加		本期减少		期末	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
公司 2020 年永续次级债券(第一期)	50,000,000.00	5,000,000,000.00					50,000,000.00	5,000,000,000.00
合计	50,000,000.00	5,000,000,000.00					50,000,000.00	5,000,000,000.00

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明, 以及相关会计处理的依据:

□适用 √不适用

其他说明:

√适用 □不适用

注 1：中国证监会于 2020 年 7 月 2 日下发《关于东方证券股份有限公司发行永续次级债券有关意见的复函》（机构部函[2020]1577 号），对本公司公开发行永续次级债券事项无异议。本公司于 2020 年 8 月 26 日完成 2020 年公开永续次级债券（第一期）的发行，发行规模为人民币 50 亿元。

注 2：本次永续次级债券无担保，以每 5 个计息年度为一个周期。在每一个重定价周期到期日，本公司有权选择将债券的期限延长至下一个重定价周期，或完全赎回债券。首个周期的票面利率为初始基准利率加上初始利差；后续周期的票面利率调整为当期基准利率加上初始利差再加 300 个基点，当期基准利率为票面利率重置日前 5 个工作日中国债券信息网公布的中债国债收益率曲线中，待偿期为 5 年的国债收益率算术平均值。本期债券附设发行人递延支付利息权，除非发生强制付息事件，本期债券的每个付息日，发行人可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于发行人未能按照约定足额支付利息的行为。强制性支付利息事件仅限于付息日前 12 个月内发行人向普通股股东分红和减少注册资本的情形。

49、资本公积

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价(股本溢价)	28,251,704,604.61			28,251,704,604.61
其他资本公积	59,699,050.79			59,699,050.79
合计	28,311,403,655.40			28,311,403,655.40

50、库存股

适用 不适用

51、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期发生金额						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	-219,870,455.09	221,476,177.73	55,369,044.43		-328,541.20	166,435,674.50	166,435,674.50		-53,434,780.59
其中：重新计量设定受益计划变动额									
其他权益工具投资公允价值变动	-219,870,455.09	221,476,177.73	55,369,044.43		-328,541.20	166,435,674.50	166,435,674.50		-53,434,780.59
二、将重分类进损益的其他综合收益	255,464,790.68	17,055,600.20	-3,495,181.60	56,085,807.99		-35,535,026.19	-35,535,026.19		219,929,764.49
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	3,603,955.56	-7,419,120.38				-7,419,120.38	-7,419,120.38		-3,815,164.82
其他债权投资公允价值变动	123,093,870.06	74,794,991.81	4,677,296.00	56,085,807.99		14,031,887.82	14,031,887.82		137,125,757.88
其他债权投资信用损失准备	204,367,965.29	-32,689,910.40	-8,172,477.60			-24,517,432.80	-24,517,432.80		179,850,532.49
外币财务报表折算差额	-108,804,016.03	-17,630,360.83				-17,630,360.83	-17,630,360.83		-126,434,376.86
其他	33,203,015.80								33,203,015.80
其他综合收益合计	35,594,335.59	238,531,777.93	51,873,862.83	56,085,807.99	-328,541.20	130,900,648.31	130,900,648.31		166,494,983.90

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	-200,232,319.70	-64,467,929.91	-16,116,982.48		-28,712,812.04	-19,638,135.39	-19,638,135.39		-219,870,455.09
其中：重新计量设定受益计划变动额									
其他权益工具投资公允价值变动	-200,232,319.70	-64,467,929.91	-16,116,982.48		-28,712,812.04	-19,638,135.39	-19,638,135.39		-219,870,455.09
二、将重分类进损益的其他综合收益	700,193,101.11	-189,767,947.99	-108,393,328.13	363,353,690.57		-444,728,310.43	-444,728,310.43		255,464,790.68
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	13,285,631.83	-9,681,676.27				-9,681,676.27	-9,681,676.27		3,603,955.56
其他债权投资公允价值变动	559,155,504.81	-218,061,822.43	-145,353,878.25	363,353,690.57		-436,061,634.75	-436,061,634.75		123,093,870.06
其他债权投资信用损失准备	93,486,314.88	147,842,200.53	36,960,550.12			110,881,650.41	110,881,650.41		204,367,965.29
外币财务报表折算差额	1,062,633.79	-109,866,649.82				-109,866,649.82	-109,866,649.82		-108,804,016.03
其他	33,203,015.80								33,203,015.80
其他综合收益合计	499,960,781.41	-254,235,877.90	-124,510,310.61	363,353,690.57	-28,712,812.04	-464,366,445.82	-464,366,445.82		35,594,335.59

52、 盈余公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	2,825,199,500.29			2,825,199,500.29
任意盈余公积	850,948,880.63			850,948,880.63
合计	3,676,148,380.92			3,676,148,380.92

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

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

53、 一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例（%）	本期减少	期末余额
一般风险准备	4,112,322,589.26	148,718,376.66			4,261,040,965.92
交易风险准备	4,578,774,600.86				4,578,774,600.86
合计	8,691,097,190.12	148,718,376.66			8,839,815,566.78

一般风险准备的说明

本集团的一般风险准备金包括了本公司及子公司的一般风险准备金和交易风险准备金。

根据《金融企业财务规则》要求，一般风险准备金按公司年度净利润之 10%提取。自 2020 年起，公司按照净利润之 10%提取一般风险准备金。

根据《证券法》等法律法规的规定，交易风险准备金按本公司净利润之 10%提取。

根据《关于修改〈关于基金管理公司提取风险准备金有关问题的通知〉的决定》（证监会公告[2008]46号）以及《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（中国证监会公告[2018]39号）的规定，本公司之子公司上海东方证券资产管理有限公司分别按基金管理费收入之 10%与大集合资产管理业务管理费收入之 10%计提一般风险准备金。

54、 未分配利润

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	7,494,951,502.28	6,773,604,053.96
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	7,494,951,502.28	6,773,604,053.96
加：本期归属于母公司所有者的净利润	2,700,359,705.45	1,526,023,784.18
减：提取法定盈余公积		
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备	148,718,376.66	86,646,166.70
应付普通股股利	1,748,413,950.75	1,049,048,370.45

应付永续债利息	237,500,000.00	
转作股本的普通股股利		
加：所有者权益内部结转	-328,541.20	9,079,953.01
期末未分配利润	8,060,350,339.12	7,173,013,254.00

55、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	2,942,873,931.83	2,718,286,957.99
其中：货币资金及结算备付金利息收入	713,416,984.72	468,931,922.47
融出资金利息收入	688,870,341.63	469,087,444.87
买入返售金融资产利息收入	133,312,600.19	379,643,458.61
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	112,676,957.04	359,794,543.84
债权投资利息收入	93,554,929.13	131,061,300.28
其他债权投资利息收入	1,309,515,591.52	1,263,574,871.05
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	4,203,484.64	5,987,960.71
利息支出	2,234,521,278.24	2,381,678,717.16
其中：短期借款利息支出	14,806,724.30	22,734,071.96
应付短期融资款利息支出	148,848,810.63	227,494,646.36
拆入资金利息支出	45,058,571.27	56,678,021.58
其中：转融通利息支出	14,026,388.89	20,270,833.33
卖出回购金融资产款利息支出	684,899,831.53	609,072,208.76
其中：报价回购利息支出	91,779,371.05	75,420,978.90
代理买卖证券款利息支出	52,559,955.69	42,138,684.49
应付债券利息支出	1,272,573,904.72	1,405,586,487.28
其中：次级债券利息支出	423,057,136.56	573,367,330.71
租赁负债利息支出	15,773,480.10	17,974,596.73
利息净收入	708,352,653.59	336,608,240.83

56、手续费及佣金净收入
(1) 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	1,217,905,601.90	894,309,430.44
证券经纪业务收入	1,521,061,815.60	1,138,298,937.50
其中：代理买卖证券业务	831,701,535.54	740,741,461.20
交易单元席位租赁	390,117,305.21	281,910,720.55
代销金融产品业务	299,242,974.85	115,646,755.75
证券经纪业务支出	303,156,213.70	243,989,507.06
其中：代理买卖证券业务	303,156,213.70	238,923,473.20
2. 期货经纪业务净收入	361,900,144.05	191,521,480.54
期货经纪业务收入	362,792,936.88	192,774,168.56
期货经纪业务支出	892,792.83	1,252,688.02
3. 投资银行业务净收入	794,879,540.33	553,168,344.39
投资银行业务收入	832,364,325.82	590,705,175.73
其中：证券承销业务	760,082,059.18	572,525,842.63
证券保荐业务	32,288,375.47	2,726,344.75
财务顾问业务	39,993,891.17	15,452,988.35
投资银行业务支出	37,484,785.49	37,536,831.34
其中：证券承销业务	37,484,785.49	36,747,831.34
财务顾问业务		789,000.00
4. 资产管理业务净收入	1,874,563,697.15	1,113,698,288.46
资产管理业务收入	1,909,755,023.04	1,115,323,423.41
资产管理业务支出	35,191,325.89	1,625,134.95
5. 基金管理业务净收入	67,977,267.61	82,827,741.25
基金管理业务收入	67,977,267.61	82,827,741.25
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	67,850,560.62	38,611,030.31
投资咨询业务收入	67,852,447.41	38,634,709.55
投资咨询业务支出	1,886.79	23,679.24
7. 其他手续费及佣金净收入	39,907,529.90	-56,885,991.47
其他手续费及佣金收入	124,108,608.85	23,459,544.32
其他手续费及佣金支出	84,201,078.95	80,345,535.79
合计	4,424,984,341.56	2,817,250,323.92
其中：手续费及佣金收入	4,885,912,425.21	3,182,023,700.32
手续费及佣金支出	460,928,083.65	364,773,376.40

(2) 财务顾问业务净收入
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	13,015,800.00	943,396.23
并购重组财务顾问业务净收入--其他	2,007,547.17	
其他财务顾问业务净收入	23,650,959.15	13,720,592.12

57、投资收益
(1) 投资收益情况
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	735,435,771.81	442,811,845.64
处置长期股权投资产生的投资收益		2,937,541.47
金融工具投资收益	1,840,252,357.36	1,499,179,402.09
其中：持有期间取得的收益	1,150,127,109.25	937,414,340.27
—交易性金融资产	884,916,743.45	912,747,171.80
—其他权益工具投资	351,664,409.47	87,428,120.26
—交易性金融负债	-86,454,043.67	-62,760,951.79
处置金融工具取得的收益	690,125,248.11	561,765,061.82
—交易性金融资产	873,409,992.92	285,481,790.18
—其他债权投资	56,085,807.99	417,971,638.88
—衍生金融工具	-344,447,386.84	-69,477,989.72
—交易性金融负债	105,076,834.04	-72,210,377.52
合计	2,575,688,129.17	1,944,928,789.20

58、净敞口套期收益
 适用 不适用

59、其他收益
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助	6,196,195.22	4,127,225.94
手续费返回	12,718,211.07	11,896,800.45
其他	105,039.38	7,852.00
合计	19,019,445.67	16,031,878.39

60、公允价值变动收益
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	175,212,264.41	801,971,871.77
交易性金融负债	740,092,737.85	-323,688,582.67
衍生金融工具	-825,560,413.49	537,305,978.97
合计	89,744,588.77	1,015,589,268.07

61、其他业务收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
咨询服务	2,415,094.27	12,150,943.06
租赁	2,733,203.94	2,661,812.27
大宗商品交易收入及其他	5,349,141,124.82	3,402,079,199.48
合计	5,354,289,423.03	3,416,891,954.81

62、资产处置收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
非持有待售的固定资产处置收益	8,517.05	-74,779.40
合计	8,517.05	-74,779.40

其他说明：

□适用 √不适用

63、税金及附加

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准
城市维护建设税	26,976,925.45	20,130,160.51	按实际缴纳的增值税7%计征
教育费附加	19,270,153.51	14,394,078.73	按实际缴纳增值税的3%计征
房产税	4,855,658.61	8,154,540.78	
其他	2,186,835.66	1,800,843.64	
合计	53,289,573.23	44,479,623.66	/

64、业务及管理费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	3,222,572,150.25	2,032,918,520.70
代销手续费	507,434,509.51	308,646,656.18
折旧费	268,118,702.59	248,319,613.63
电子设备运转费	143,284,984.87	154,316,837.47
通讯费	89,747,996.23	42,832,957.95
无形资产摊销	56,206,831.05	41,768,547.70
业务招待费	53,931,805.59	29,925,473.85
差旅费	44,581,349.86	23,726,482.36
咨询费	43,536,965.21	44,630,989.44
投资者保护基金	37,558,318.08	29,780,807.83

长期待摊费用摊销	25,436,327.97	26,963,285.90
租赁费	13,165,414.20	16,608,287.83
其他	244,088,715.64	188,007,351.51
合计	4,749,664,071.05	3,188,445,812.35

65、信用减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
坏账损失	3,946,328.49	35,791,045.08
其他债权投资减值损失	-18,564,964.32	12,679,397.61
债权投资减值损失	-434,115.96	-522,525.44
买入返售金融资产减值损失	273,226,391.73	1,241,605,587.15
融出资金减值损失	370,024.15	556,236.73
合计	258,543,664.09	1,290,109,741.13

66、其他资产减值损失

□适用 √不适用

67、其他业务成本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
大宗商品交易	5,177,924,247.60	3,423,281,367.16
投资性房地产折旧	877,845.75	1,916,814.45
合计	5,178,802,093.35	3,425,198,181.61

68、营业外收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
政府补助	113,297,259.40	121,404,008.02	113,297,259.40
其他	644,328.53	1,445,401.60	644,328.53
合计	113,941,587.93	122,849,409.62	113,941,587.93

计入当期损益的政府补助

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补助项目	本期发生金额	上期发生金额	与资产相关/与收益相关
金融企业扶持资金	113,002,746.15	119,890,115.00	与收益相关
其他	294,513.25	1,513,893.02	与收益相关

其他说明：

□适用 √不适用

69、营业外支出

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	362,749.60		362,749.60
其中：固定资产处置损失	362,749.60		362,749.60
对外捐赠	19,728,888.00	16,609,232.96	19,728,888.00
赔偿款支出	643,586.36	3,320,773.50	643,586.36
其他	255,577.17	2,876,081.99	255,577.17
合计	20,990,801.13	22,806,088.45	20,990,801.13

70、所得税费用

(1) 所得税费用表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	438,133,050.02	195,752,116.07
递延所得税费用	-8,170,290.97	69,127,338.51
以前年度所得税调整	1,407,953.30	-12,646,896.70
合计	431,370,712.35	252,232,557.88

(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	3,129,407,445.41
按法定/适用税率计算的所得税费用	782,351,861.35
子公司适用不同税率的影响	-27,977.55
调整以前期间所得税的影响	1,407,953.30
非应税收入的影响	-397,277,806.47
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	47,206,610.45
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-21,539,590.17
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	22,596,169.46
在其他地区的子公司税率不一致的影响	-3,346,508.02
所得税费用	431,370,712.35

其他说明：

□适用 √不适用

71、其他综合收益

√适用 □不适用

详见附注七、51 其他综合收益

72、现金流量表项目
(1). 收到的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
收到政府补助补贴款	113,297,259.40	121,404,008.02
收到的其他业务收入	5,354,289,423.03	3,416,891,954.81
其他	327,510,961.85	533,148,217.31
收到的其他收益	19,019,445.67	16,031,878.39
合计	5,814,117,089.95	4,087,476,058.53

(2). 支付的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付的其他业务及管理费	1,177,330,059.19	838,475,844.42
营业外支出支付的现金	19,795,356.55	21,985,528.33
支付的存出保证金净额	128,733,741.88	434,688,023.93
支付的其他业务成本	5,177,924,247.60	3,423,281,367.16
其他	7,053,769,977.38	1,523,669,152.57
合计	13,557,553,382.60	6,242,099,916.41

(3). 收到的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

(4). 支付的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

(5). 收到的其他与筹资活动有关的现金

□适用 √不适用

(6). 支付的其他与筹资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
少数股东撤资支付的现金		475,583,890.59
合计		475,583,890.59

73、现金流量表补充资料
(1) 现金流量表补充资料

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
1. 将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	2,698,036,733.06	1,524,870,708.46
加：资产减值准备		

信用减值损失	258,543,664.09	1,290,109,741.13
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	268,996,548.34	250,236,428.08
无形资产摊销	56,206,831.05	41,768,547.70
长期待摊费用摊销	25,436,327.97	26,963,285.90
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	1,130,679.49	386,930.56
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-89,744,588.77	-1,015,589,268.07
利息收入（收益以“-”号填列）	-1,403,070,520.65	-1,394,636,171.33
利息支出（收益以“-”号填列）	1,452,002,919.75	1,673,789,802.33
汇兑损失（收益以“-”号填列）	-104,668,961.49	-78,067,628.10
投资损失（收益以“-”号填列）	-1,387,385,470.93	-1,123,032,924.51
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-11,040,340.34	118,756,939.22
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	2,870,049.37	-36,717,080.32
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的减少（增加以“-”号填列）	-1,703,181,108.58	-984,101,147.95
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的增加（减少以“-”号填列）	2,968,141,834.74	1,812,430,016.81
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-8,661,343,582.58	1,303,428,884.48
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	11,824,151,378.02	8,170,372,866.18
经营活动产生的现金流量净额	6,195,082,392.54	11,580,969,930.57
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	96,391,250,539.38	70,150,993,108.14
减: 现金的期初余额	86,853,417,188.80	61,940,172,286.80
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	9,537,833,350.58	8,210,820,821.34

(2) 本期支付的取得子公司的现金净额

适用 不适用

(3) 本期收到的处置子公司的现金净额

适用 不适用

(4) 现金和现金等价物的构成

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	96,391,250,539.38	86,853,417,188.80
其中: 库存现金	161,437.30	287,629.71
可随时用于支付的银行存款	71,406,592,359.32	65,218,993,482.26
可随时用于支付的其他货币资金	158,336,996.03	232,695,864.91
可随时用于支付的结算备付金	24,826,159,746.73	21,401,440,211.92
二、现金等价物		
其中: 三个月内到期的债券投资		

三、期末现金及现金等价物余额	96,391,250,539.38	86,853,417,188.80
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

其他说明：

适用 不适用

74、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

适用 不适用

75、所有权或使用权受到限制的资产

适用 不适用

76、外币货币性项目

(1). 外币货币性项目：

适用 不适用

77、套期

适用 不适用

78、政府补助

1. 政府补助基本情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
金融企业扶持资金	113,002,746.15	营业外收入	113,002,746.15
其他	294,513.25	营业外收入	294,513.25

2. 政府补助退回情况

适用 不适用

79、其他

适用 不适用

八、资产证券化业务的会计处理

适用 不适用

九、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

适用 不适用

2、同一控制下企业合并

适用 不适用

3、反向购买

适用 不适用

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

5、其他原因的合并范围变动

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

适用 不适用

1) 结构化主体变化

本期新增 3 个结构化主体纳入合并报告范围，减少 7 个结构化主体纳入合并范围。

6、其他

适用 不适用

十、在其他主体中的权益

1、在子公司中的权益

(1). 企业集团的构成

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	
1、上海东证期货有限公司	上海	上海	期货经纪	100		非同一控制下企业合并
1)上海东祺投资管理有限公司	上海	上海	投资管理		100	设立
2)东证润和资本管理有限公司	上海	上海	投资管理		100	设立
3)Orient Futures International (Singapore) Pte Ltd	新加坡	新加坡	外汇经纪人和交易商		100	设立
2、上海东方证券资产管理有限公司	上海	上海	证券资产管理	100		设立
3、上海东方证券创新投资有限公司	上海	上海	投资	100		设立
4、东方证券承销保荐有限公司	上海	上海	投资银行	100		设立
5、东方金融控股(香港)有限公司	香港	香港	集团管理	100		设立
1)东方证券(香港)有限公司	香港	香港	证券经纪		100	设立
2)东方期货(香港)有限公司	香港	香港	期货经纪		100	设立
3)东方资产管理(香港)有限公司	香港	香港	证券资产管理		100	设立
4)东方融资(香港)有限公司	香港	香港	投资银行		100	设立
5)东方信贷财务(香港)有限公司	香港	香港	财务融资		100	设立
6)东方鸿盛有限公司	BVI	BVI	特殊目的		100	设立
7)东方智汇有限公司	BVI	BVI	特殊目的		100	设立
8)Orient Zhisheng Limited	BVI	BVI	特殊目的		100	设立
9)Orient HuiZhi Limited	BVI	BVI	特殊目的		100	设立
10)东证国际金融集团有限公司	香港	香港	投资管理		100	设立
11)东证科技(深圳)有限公司	深圳	深圳	软件开发服务		100	设立
12) Orient International Investment Products Limited	BVI	BVI	产品投资		100	设立
6、上海东方证券资本投资有限公司	上海	上海	股权投资	100		设立
1)东方星晖(北京)投资基金管理有限公司	北京	北京	投资管理		57.95	设立
2)海宁东方红投资管理有限公司	浙江	浙江	投资管理		51	设立
3)上海东方富厚股权投资管理有限公司	上海	上海	投资管理		58	设立
4)东石发展有限公司	香港	香港	投资管理		100	设立
5)新疆东证新城股权投资管理有限公司	新疆	新疆	投资管理		51	设立

6) 海宁东证投资管理有限公司	浙江	浙江	投资管理		58	设立
7) 东方翌睿(上海)投资管理有限公司	上海	上海	投资管理		51	设立
8) 东方弘泰资本投资(成都)有限公司	四川	四川	投资管理		51	设立
9) Golden Power Group Limited	BVI	BVI	投资管理		100	设立
10) 诚麒环球有限公司	BVI	BVI	投资管理		100	设立
11) 景德镇北汽东证产业投资管理有限公司	江西	江西	投资管理		66	设立
12) 东方睿信有限公司	香港	香港	投资管理		100	设立
13) 东方睿义(上海)投资管理有限公司	上海	上海	投资管理		100	设立

(2). 重要的非全资子公司

适用 不适用

(3). 重要非全资子公司的主要财务信息

适用 不适用

(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制:

适用 不适用

(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持:

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

本期末, 本集团合并了某些结构化主体, 包括本集团管理并投资的资产管理计划和基金。本集团主要从是否对结构化主体拥有权力, 通过参与结构化主体的相关活动而享有可变回报, 并且有能力运用对结构化主体的权力影响其回报金额三个要素判断是否够控制结构化主体。

2021年6月30日, 纳入合并财务报表范围的结构化主体的净资产为人民币7,471百万元(2020年12月31日: 人民币7,368百万元)。

截至2021年6月30日及2020年12月31日, 本集团于纳入合并范围的资产管理计划中所持有的份额的公允价值分别为人民币5,588百万元及人民币6,105百万元。截至2021年6月30日及2020年12月31日, 本集团并未持有结构化产品的次级部分。

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

适用 不适用

3、在合营企业或联营企业中的权益

适用 不适用

(1). 重要的合营企业或联营企业

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
汇添富基金管理股份有限公司	上海	上海	基金募集、销售，资产管理	35.412		权益法

(2). 重要合营企业的主要财务信息
 适用 不适用

(3). 重要联营企业的主要财务信息
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
	汇添富基金管理股份有限公司	汇添富基金管理股份有限公司
资产合计	11,552,626,586.40	10,980,067,122.30
负债合计	3,653,356,524.49	3,531,077,230.95
净资产	7,899,270,061.91	7,448,989,891.35
少数股东权益		146,346,774.68
归属于母公司股东权益	7,899,270,061.91	7,302,643,116.67
对联营企业权益投资的账面价值	2,797,067,670.57	2,585,810,107.82
营业收入	4,607,312,855.44	2,394,092,240.31
净利润	1,570,239,224.42	652,099,631.83
其他综合收益	-5,850,033.15	6,084,341.71
综合收益总额	1,564,389,191.27	658,183,973.54
本年度收到的来自联营企业的股利	339,055,539.01	

(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	3,263,564,007.00	3,185,383,841.07
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	180,468,716.44	213,555,329.10
--其他综合收益	-2,765,166.77	-8,748,211.42
--综合收益总额	177,703,549.67	204,807,117.68

(5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明：
 适用 不适用

(6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损
 适用 不适用

(7). 与合营企业投资相关的未确认承诺
 适用 不适用

(8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债
 适用 不适用

4、重要的共同经营
 适用 不适用

5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

 适用 不适用

本集团发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本集团发起设立的资产管理计划、基金和有限合伙企业。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并收取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本集团在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体收取管理费收入。本集团所承担的与产品收益相关的可变回报并不重大，因此，本集团未合并此类产品。

截至 2021 年 6 月 30 日，本集团管理的未纳入合并范围的基金、有限合伙企业及资产管理计划的净资产为人民币 383,758 百万元(2020 年 12 月 31 日 328,845 百万元)。

本年度本集团从由本集团发起设立并管理的但未纳入合并财务报表范围的资产管理计划、有限合伙企业和基金中获取的管理费收入为人民币 1,983 百万元(2020 年上半年：人民币 1,198 百万元)。

2021 年 6 月 30 日和 2020 年 12 月 31 日本集团对发起设立的未合并资产管理计划、基金和有限合伙企业中所享有的权益在本集团合并资产负债表中的相关资产账面价值信息及对应的最大损失敞口的信息：

单位：元 币种：人民币

	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	投资账面价值	最大损失敞口	投资账面价值	最大损失敞口
交易性金融资产	2,727,232,690.20	2,727,232,690.20	2,918,024,487.23	2,918,024,487.23
长期股权投资	1,438,552,937.41	1,438,552,937.41	1,194,076,808.79	1,194,076,808.79
合计	4,165,785,627.61	4,165,785,627.61	4,112,101,296.02	4,112,101,296.02

本集团通过直接持有投资而在结构化主体中享有的权益在本集团合并资产负债表中的相关资产负债项目列示如下：

单位：元 币种：人民币

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	投资账面价值	投资账面价值
交易性金融资产	23,063,568,951.84	26,884,403,557.90
其他权益工具投资		5,129,101,790.46
长期股权投资	188,898,108.43	357,581,318.50
合计	23,252,467,060.27	32,371,086,666.86

6、其他

适用 不适用

十一、与金融工具相关的风险

适用 不适用

相关风险描述见附注十七、风险管理

十二、公允价值的披露

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

适用 不适用

本集团部分金融资产及金融负债于每个报告期末以公允价值进行后续计量。下表列示了这些金融资产及金融负债的公允价值如何确定的相关信息(包括公允价值层级、估值技术和所使用主要输入值)。

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	30,565,241,171.83	41,730,219,495.20	4,208,891,512.31	76,504,352,179.34
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	30,565,241,171.83	41,730,219,495.20	4,208,891,512.31	76,504,352,179.34
(1) 债务工具投资	16,125,713,464.91	14,706,615,590.45		30,832,329,055.36
(2) 权益工具投资	14,439,527,706.92	26,971,952,448.44	4,208,891,512.31	45,620,371,667.67
(3) 衍生金融资产		51,651,456.31		51,651,456.31
2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(二) 其他债权投资	34,790,846,383.69	32,599,142,904.17		67,389,989,287.86
(三) 其他权益工具投资	4,451,052,601.22	1,280,756,842.85	364,568,914.52	6,096,378,358.59
(四) 投资性房地产				
1. 出租用的土地使用权				
2. 出租的建筑物				
3. 持有并准备增值后转让的土地使用权				
(五) 生物资产				
1. 消耗性生物资产				
2. 生产性生物资产				
持续以公允价值计量的资产总额	69,807,140,156.74	75,610,119,242.22	4,573,460,426.83	149,990,719,825.79
(六) 交易性金融负债	9,427,320,736.10	8,476,706,675.89	421,326,818.12	18,325,354,230.11
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	9,427,320,736.10	5,389,623,706.76		14,816,944,442.86
其中：发行的交易性债券				
衍生金融负债	139,336.10	977,940,692.90		978,080,029.00
其他	9,427,181,400.00	4,411,683,013.86		13,838,864,413.86
2. 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债		3,087,082,969.13	421,326,818.12	3,508,409,787.25
其他		3,087,082,969.13	421,326,818.12	3,508,409,787.25

持续以公允价值计量的负债总额	9,427,320,736.10	8,476,706,675.89	421,326,818.12	18,325,354,230.11
二、非持续的公允价值计量				
(一) 持有待售资产				
非持续以公允价值计量的资产总额				
非持续以公允价值计量的负债总额				

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

适用 不适用

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

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

项 目	期末公允价值	期初公允价值	估值技术	重大不可观察输入值
交易性金融资产				
债券-银行间市场的债券	14,706,615,590.45	10,888,803,129.83	现金流量折现法，未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作为主要参数进行估算。	不适用
股票-全国中小企业股份转让系统交易的股票	135,972,273.65	112,730,806.12	最近交易价格	不适用
基金-其他基金	6,731,246,236.72	9,501,764,748.15	基于基金的净值，参考所投资的资产组合的可观察（报价）市值及相关费用确定。	不适用
其他投资-金融机构发行的集合资产管理计划	17,684,754,634.53	18,371,376,631.07	所占份额对应的产品净值，参考产品的资产净值，按产品所投资的资产组合的可观察（报价）市值及相关费用确定。	不适用
其他投资-银行间市场的永续债	2,419,979,303.54	2,424,721,008.22	现金流量折现法。未来现金流量基于不同类型永续债的利率收益曲线作为主要参数进行估算。	不适用
其他债权投资				
债券-银行间市场的债券	32,572,425,703.87	35,591,710,354.63	现金流量折现法，未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作为主要参数进行估算。	不适用
债券-交易所的债券	26,717,200.30		现金流量折现法，未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作为主要参数进行估算。	不适用
其他权益工具投资				
债券-银行间市场的永续债	1,236,396,566.45	1,270,593,214.24	现金流量折现法，未来现金流量基于不同类型永续债的利率收益曲线作为主要参数进行估算。	不适用
股票-全国中小企业股份转让系统交易的股票	44,360,276.40	42,752,152.80	最近交易价格	不适用
其他投资-证券公司专户投资		5,129,101,790.46	所占份额对应的产品净值，参考产品的资产净值，按产品所投资的资产组合的可观察（报价）值及相关费用确定。	不适用
交易性金融负债				
债券-银行间市场的债券	4,411,683,013.86	2,254,362,770.18	现金流量折现法，未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作	不适用

			为主要参数进行估算。	
合并结构化主体其他份额持有人利益	1,461,483,707.77	819,690,257.55	所占份额对应的产品净值,参考产品的资产净值,按产品所投资的资产组合的可观察(报价)市值及相关费用确定。	不适用
其他	662,380,858.41	684,641,276.44	底层挂钩资产的成交价。	不适用
其他	963,218,402.95	468,543,120.00	现金流量折现法。未来现金流量基于期货交易所标的黄金报价以及本公司和交易对手协议里所协定的价格而计算的相关标的黄金收益率进行估算。	不适用
衍生金融工具				
利率互换-资产	715,609.82	1,728,173.16	现金流量折现法。未来现金流量是根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率,并按反应交易对手信贷风险的利率折现。	不适用
利率互换-负债	-8,279,453.30	-11,355,436.62	现金流量折现法。未来现金流量是根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率,并按反应交易对手信贷风险的利率折现。	不适用
商品远期-负债	-932,654.01		最近成交价	不适用
权益类收益互换-资产	114,400.24	2,336,676.57	基于中国证券交易所报价计算的相关标的权益证券收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。	不适用
权益类收益互换-负债	-457,298.85	-2,482,843.47	基于中国证券交易所报价计算的相关标的权益证券收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。	不适用
股票期权-资产	25,176,151.43	70,875,468.89	最近成交价	不适用
股票期权-负债	-16,264,959.00	-58,197,099.42	最近成交价	不适用
股票挂钩工具-资产	4,086,504.02	249,534.90	基于中国证券交易所对相关标的权益证券的报价与本公司和交易对手协议里所协定的固定价格的差额进行计算。	不适用
股票挂钩工具-负债	-47,497,877.58	-17,120,144.19	基于中国证券交易所对相关标的权益证券的报价与本公司和交易对手协议里所协定的固定价格的差额进行计算。	不适用
嵌入期权式收益凭证-负债	-12,262,423.12	-34,689.43	根据合约利率并考虑标的资产市场报价来进行相关计算。	不适用
信用违约互换-资产	1,384,292.64	650,958.15	现金流量折现法。未来现金流量基于合约利率,考虑标的资产信用违约风险,并按反应交易对手信贷风险的利率折现。	不适用
信用违约互换-负债	-406,953.74	-3,150,669.29	现金流量折现法。未来现金流量基于合约利率,考虑标的资产信用违约风险,并按反应交易对手信贷风险的利率折现。	不适用
商品期货-资产			最近成交价	不适用
黄金掉期-资产			基于底层挂钩黄金的市场报价进行计算。	不适用
黄金掉期-负债		-49,029,150.00	基于底层挂钩黄金的市场报价进行计算。	不适用
黄金远期-负债	-87,849,506.81	-36,223,621.89	基于底层挂钩黄金的市场报价进行计算。	不适用

商品期权-资产	20,106,973.07	12,473,079.50	最近成交价。	不适用
商品期权-负债	-3,009,440.00	-1,371,680.00	最近成交价。	不适用
商品互换-负债	-684,350,050.00		现金流量折现法。未来现金流量意味着看涨期权与看跌期权行权价之间的价差，并按到期收益率折现。	
黄金期权-资产		12,852,855.69	现金流量折现法。未来现金流量体现看涨期权与看跌期权行权价之间的价差，并按可观察的收益曲线折现。	不适用
黄金期权-负债		-268,564,073.99	现金流量折现法。未来现金流量体现看涨期权与看跌期权行权价之间的价差，并按可观察的收益曲线折现。	不适用
货币互换-负债	-7,468,732.20	-15,001,917.24	现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。	不适用
非权益类收益互换-资产		4,564,634.73	基于相关标的证券报价计算的收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。	不适用
非权益类收益互换-负债		-615,340.04	基于相关标的证券报价计算的收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。	不适用
外汇期货-资产		47,509.16	最近成交价。	不适用
外汇远期-资产	67,525.09	49,738,780.56	现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。	不适用
外汇远期-负债	-108,551,844.29	-41,465,993.00	现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。	不适用
外汇期权-负债	-609,500.00		现金流量折现法。未来现金流量体现看涨期权与看跌期权行权价之间的价差，并按可观察的收益曲线折现。	不适用
利率互换期权-资产		26,593.85	现金流量折现法。未来现金流量根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率进行估算。	不适用
利率互换期权-负债		-42,203.95	现金流量折现法。未来现金流量根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率进行估算。	不适用

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

本集团第三层级公允价值计量项目主要包括未上市股权、限售股等，其中未上市股权公允价值系基于可比企业的财务比率(如市盈率、市净率等)计算得到并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定；限售股采用期权模型就流动性进行折价。

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

√适用 □不适用

下表列示了公允价值在第三层级计量的金融资产的变动情况

单位:元 币种:人民币

	其他权益工具投资	交易性金融资产
2021年1月1日余额	296,625,147.32	3,892,397,816.50
计入损益的公允价值变动		134,393,693.87
计入其他综合收益的公允价值变动	65,290,348.65	
买入	20,564,659.64	773,905,527.22
转入第三层级		8,760,058.88
转出第三层级 ^(注1)		-478,153,464.53
处置	-17,911,241.09	-122,412,119.63
2021年6月30日余额	364,568,914.52	4,208,891,512.31

注1: 此处主要包括之前在全国中小企业股份转让系统交易的停牌股和在交易所上市的限售股。其中: 当全国中小企业股份转让系统交易的股票复牌可在市场进行交易时, 其公允价值计量层级从第三层级转至第二层级; 当交易所上市的限售股已经解禁可在市场进行交易时, 其公允价值计量层级从第三层级转至第一层级。

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

7、本期内发生的估值技术变更及变更原因

适用 不适用

8、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

适用 不适用

集团不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括: 货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、应收款项、存出保证金、其他金融资产、短期借款、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、长期借款、代理买卖证券款、应付款项、应付债券和其他金融负债等。

本集团管理层认为, 除以下项目外, 年末其他以摊余成本计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。

单位:元 币种:人民币

	2021年6月30日		2020年12月31日	
	账面价值	公允价值	账面价值	公允价值
债权投资	4,828,679,090.22	4,836,403,301.91	6,243,897,149.81	6,242,304,714.29
应付债券				
- 公司债券	32,581,278,180.77	32,917,527,600.00	28,280,530,622.12	28,446,997,200.00
- 次级债券	24,256,757,669.21	24,257,714,500.00	17,414,768,590.67	17,412,690,500.00
- 收益凭证	5,563,539,223.76	5,561,142,722.60	6,113,681,086.38	5,943,530,251.24
- 其他	10,318,982,007.92	10,521,916,404.78	10,456,493,198.51	10,694,234,491.95
总计	72,720,557,081.66	73,258,301,227.38	62,265,473,497.68	62,497,452,443.19

9、其他

适用 不适用

十三、 关联方及关联交易

1、 本企业的母公司情况

适用 不适用

2、 本公司的第一大股东情况

被投资单位名称	注册地	业务性质	注册资本	对本公司 持股比例 (%)	对本公司 表决权比例 (%)
申能(集团)有限公司	上海	电力	2,000,000.00 万元	25.27	25.27

3、 本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注“十、在其他主体中的权益”。

适用 不适用

4、 本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注“十、在其他主体中的权益”。

适用 不适用

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

适用 不适用

5、 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
申能股份有限公司	股东的子公司
申能集团财务有限公司	股东的子公司
上海久联集团有限公司	股东的子公司
上海大众燃气有限公司	股东的子公司
上海申能物业管理有限公司	股东的子公司
上海申能诚毅股权投资有限公司	股东的子公司
上海申能融资租赁有限公司	股东的子公司
长城基金管理有限公司	其他
上海新华发行集团有限公司	其他
海通证券股份有限公司	其他
上海建工集团股份有限公司	其他
中国太平洋财产保险股份有限公司	其他
中国太平洋保险(集团)股份有限公司	其他
上海上报资产管理有限公司	其他
浙江省能源集团有限公司	其他
绿地控股集团有限公司	其他

上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司	其他
----------------	----

其他说明：

本集团通过二级公开市场开展证券交易，交易对手包括关联方。

6、关联交易情况

(1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

适用 不适用

出售商品/提供劳务情况表

适用 不适用

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

适用 不适用

(2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表：

适用 不适用

关联托管/承包情况说明：

适用 不适用

本公司委托管理/出包情况表：

适用 不适用

关联管理/出包情况说明：

适用 不适用

(3). 关联租赁情况

本公司作为出租方：

适用 不适用

本公司作为承租方：

适用 不适用

关联租赁情况说明

适用 不适用

(4). 关联担保情况

本公司作为担保方

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

被担保方	担保金额	担保起始日	担保到期日	担保是否已经履行完毕
Orient HuiZhi Limited	5.91 亿美元	2017.11.29	2022.11.30	否
Orient HuiZhi Limited	2.93 亿美元	2018.3.22	2022.11.30	否
东证国际金融集团有限公司	1.8 亿美元	2019.12.27		
东证国际金融集团有限公司	5,000 万美元	2020.5.13	2022.6.18	否
Orient International Investment Products Limited	1.5 亿美元	2020.7.28		
东证国际金融集团有限公司	7.6 亿港元	2020.7.31		
Orient HongSheng Limited	1.72 亿美元	2020.10.13	2023.10	否
东方证券（香港）有限公司	1 亿港元			
Orient International Investment Products Limited	10 亿美元			

本公司作为被担保方

 适用 不适用

关联担保情况说明

 适用 不适用

(5). 关联方资金拆借
 适用 不适用

(6). 关联方资产转让、债务重组情况
 适用 不适用

(7). 关键管理人员报酬
 适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	2,406.87	3,525.79

(8). 其他关联交易
 适用 不适用

① 本集团向申能(集团)有限公司及其子公司提供了如下服务：

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易类型及内容	关联交易定价方式及决策程序	本期发生额	上期发生额

申能(集团)有限公司	代理买卖证券手续费收入	市场原则	89,430.86	45,436.10
	客户保证金利息支出	市场原则	2,223.86	
	代理买卖证券手续费收入	市场原则	66,054.30	
	客户保证金利息支出	市场原则	7,152.89	1.86
申能集团财务有限公司	代理买卖证券手续费收入	市场原则		45,436.10
	客户保证金利息支出	市场原则	22,826.25	7,042.13
上海久联集团有限公司	代理买卖证券手续费收入	市场原则	34,709.39	35.66
	客户保证金利息支出	市场原则	32,878.57	708.77
上海大众燃气有限公司	客户保证金利息支出	市场原则	10,483.18	7,369.45
上海申能物业管理有限公司	客户保证金利息支出	市场原则	24.57	24.49
上海申能融资租赁有限公司	承销手续费收入	市场原则	504,944.44	
上海申能诚毅股权投资有限公司	客户保证金利息支出	市场原则	1.24	0.07
	处置联营企业的投资收益	市场原则		2,937,541.47

② 本集团向联营企业提供如下服务：

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易类型及内容	关联交易定价方式及决策程序	本期发生额	上期发生额
汇添富基金管理股份有限公司	交易席位出租收入	市场原则	105,401,325.41	79,844,551.51
	代销金融产品业务收入	市场原则	44,882,086.38	32,379,437.28
	代理买卖证券手续费收入	市场原则	1,894.61	16,643.86
	客户保证金利息支出	市场原则	3,762.75	3,729.35
海宁东证蓝海并购投资合伙企业(有限合伙)	基金管理收入	市场原则		14,079,244.89
	代理买卖证券手续费收入	市场原则	130,707.03	
	客户保证金利息支出	市场原则	61,135.94	1,442.94
诚泰融资租赁(上海)有限公司	财务顾问收入	市场原则		2,207.55
	客户保证金利息支出	市场原则	955.18	0.08
南通东证富象股权投资中心(有限合伙)	基金管理收入	市场原则		5,584,905.50
	客户保证金利息支出	市场原则	70.36	
宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙)	基金管理收入	市场原则	10,613,207.59	7,641,509.42
	客户保证金利息支出	市场原则	2,203.47	
成都交子东方投资发展合伙企业(有限合伙)	基金管理收入	市场原则	4,245,283.03	
宜兴东证睿元股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理收入	市场原则	4,094,339.64	
上海东恺投资管理有限公司	代理买卖证券手续费收入	市场原则		75.00
	客户保证金利息支出	市场原则	0.01	1.90

③ 本集团向其他关联方提供如下服务：

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易类型及内容	关联交易定价方式及决策程序	本期发生额	上期发生额
长城基金管理有限公司	交易席位出租收入	市场原则	1,192,604.03	1,466,718.82
	代理销售金融产品收入	市场原则	1,129.72	1,783.58
上海建工集团股份有限公司	客户保证金利息支出	市场原则	28.22	23,685.47
上海上报资产管理有限公司	客户保证金利息支出	市场原则	1,302.20	2.54
绿地控股集团有限公司	客户保证金利息支出	市场原则	324.48	280,707.65

④ 关联方向本集团提供如下服务：

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易类型及内容	关联交易定价方式及决策程序	本期发生额	上期发生额
上海申能物业管理有限公司	物业费支出	市场原则	83,421,239.63	2,847,776.29
上海大众燃气有限公司	燃气费支出	市场原则	166,306.30	109,359.70

⑤ 申能集团及其下属子公司在本集团代理买卖证券款余额

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额	期初余额
代理买卖证券款	上海建工集团股份有限公司	15,968.50	15,940.28
代理买卖证券款	上海久联集团有限公司	7,730,286.58	12,664,906.95
代理买卖证券款	上海大众燃气有限公司	5,932,421.64	5,921,938.46
代理买卖证券款	申能集团财务有限公司	205,572.79	9,864,612.64
代理买卖证券款	申能(集团)有限公司	1,730,192,131.57	14,482.52
代理买卖证券款	上海申能物业管理有限公司	13,905.22	13,880.65
代理买卖证券款	上海申能诚毅股权投资有限公司	1.24	6,720.10
合计		1,736,360,000.96	28,502,481.60

⑥ 联营企业在本集团代理买卖证券款余额

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额	期初余额
代理买卖证券款	汇添富基金管理股份有限公司	2,085,139.36	2,085,060.16
代理买卖证券款	海宁东证蓝海并购投资合伙企业(有限合伙)	5,194,812.09	38,338.35
代理买卖证券款	诚泰融资租赁(上海)有限公司	596,287.34	40.15
代理买卖证券款	上海东恺投资管理有限公司		1.90
代理买卖证券款	宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙)	1,246,940.78	1,244,737.31
合计		9,123,179.57	3,368,177.87

⑦ 其他关联方在本集团代理买卖证券款余额

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额	期初余额
代理买卖证券款	上海建工集团股份有限公司		15,940.28
代理买卖证券款	上海上报资产管理有限公司	3,101.78	14,701,799.58
代理买卖证券款	绿地控股集团有限公司	183,625.66	183,301.18
合计		186,727.44	14,901,041.04

⑧ 本公司持有关联方管理的产品

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面价值	期初账面价值
交易性金融资产	上海东恺投资管理有限公司	239,845,101.52	132,176,801.83
交易性金融资产	汇添富基金管理股份有限公司	1,186,623,274.61	955,227,487.20

⑨ 本集团持有关联方作为发行主体的证券

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面价值	期初账面价值
交易性金融资产	上海建工集团股份有限公司		67,424.00
交易性金融资产	海通证券股份有限公司	51,553,991.53	13,669,858.50
交易性金融资产	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	753,220,000.00	22,138,252.80
交易性金融资产	长城基金管理有限公司	249,943,208.91	279,866,170.50
交易性金融资产	绿地控股集团有限公司	528,105.00	214,544.00
交易性金融资产	上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司	19,192,169.31	15,732,495.60
交易性金融资产	诚泰融资租赁(上海)有限公司	123,506,810.18	289,115,844.52
其他债权投资	上海新华发行集团有限公司	52,070,068.46	51,018,013.56
其他债权投资	浙江省能源集团有限公司	10,000,684.93	
其他债权投资	中国太平洋财产保险股份有限公司	103,900,660.23	106,408,946.22
其他债权投资	上海上报资产管理有限公司	41,262,575.32	40,444,821.86
其他权益工具投资	上海建工集团股份有限公司	170,871,232.88	166,785,095.89

⑩ 本集团持有关联方作为发行主体的证券而产生的利息收入

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易类型及内容	2021年6月30日	2020年6月30日
上海新华发行集团有限公司	利息收入	1,011,372.44	1,072,054.64
中国太平洋财产保险股份有限公司	利息收入	2,399,052.57	
上海上报资产管理有限公司	利息收入	771,461.75	817,749.44
浙江省能源集团有限公司	利息收入	646.16	
绿地控股集团有限公司	利息收入		388,711.65

⑪ 本集团持有关联方作为发行主体的证券而产生的投资收益

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易类型及内容	2021 年 6 月 30 日	2020 年 6 月 30 日
上海建工集团股份有限公司	投资收益		
诚泰融资租赁(上海)有限公司	投资收益	4,037,271.41	4,610,495.94
海通证券股份有限公司	投资收益	-1,825,118.35	
长城基金管理有限公司	投资收益	8,779,669.95	6,657,775.60
中国太平洋保险(集团)股份有限公司	投资收益	3,192,851.87	
绿地控股集团有限公司	投资收益	-7,408.13	
上海申能诚毅股权投资有限公司	投资收益		2,937,541.47

7、 关联方应收应付款项

(1). 应收项目

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
其他应收款	上海东证春医投资中心(有限合伙)	9,849,395.63		9,849,395.63	
应收手续费及佣金	汇添富基金管理股份有限公司	72,320,367.10		9,657,795.92	

(2). 应付项目

 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
合同负债	宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙)		2,122,641.52

8、 关联方承诺

 适用 不适用

9、 其他

 适用 不适用

存在控制关系且已纳入本公司合并财务报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

十四、 股份支付

1、 股份支付总体情况

适用 不适用

2、 以权益结算的股份支付情况

适用 不适用

3、 以现金结算的股份支付情况

适用 不适用

4、 股份支付的修改、终止情况

适用 不适用

5、 其他

适用 不适用

十五、 承诺及或有事项

1、 重要承诺事项

适用 不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

1. 资本承诺

单位：元 币种：人民币

	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
至资产负债表日止，已签约但尚未于财务报表中确认的：		
- 购建长期资产承诺	34,257,780.89	49,320,699.83

2、 或有事项

(1). 资产负债表日存在的重要或有事项

适用 不适用

(2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

3、 其他

适用 不适用

十六、 资产负债表日后事项

1、 重要的非调整事项

适用 不适用

2、 利润分配情况

适用 不适用

3、 销售退回

适用 不适用

4、 其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

1、 关于吸收合并全资子公司的

本公司于 2021 年 7 月 20 日召开第二次临时股东大会，批准了有关本公司吸收合并全资子公司东方证券承销保荐有限公司的议案。本次吸收合并需待相关监管部门批准。

2、 发行短期融资券和公司债券

本公司于 2021 年 8 月 11 日完成了公开发行“东方证券股份有限公司 2021 年公开发行短期公司债券（面向专业投资者）（第一期）”，发行总额为人民币 30 亿元，债券期限 350 天，票面利率为 2.68%。

十七、 风险管理

1、 风险管理政策及组织架构

(1). 风险管理政策

适用 不适用

公司致力于推行“全员合规，风控为本”的风险管理理念，注重全面风险和内控管理体系以及风险管理文化的建设。通过多途径夯实公司全体员工的风险管理意识和风险管理专业化水平。公司着力实现风险管理、合规管理与内部控制三者间的有机融合与衔接，构建了较为完善的、内生性的全面风险管理体系和有效的内部控制机制，覆盖公司所有业务、各子公司、各个部门、分支机构和全体人员，不断推进集团化风险管理，并贯穿于决策、执行、监督、反馈等各个环节。

公司对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、技术风险、声誉风险、合规风险、法律风险、道德风险等实施风险管理全覆盖，切实保障公司总体风险可测可控可承受。

公司建立了风险识别与评估、风险监测与计量、风险分析与应对的风险管理机制，采取定性和定量相结合的风险计量方法，提升对各类风险的专业化管理能力；贯彻全面风险管理多视角的风险审查机制，对开展的各项新业务、新产品进行严格审核，对日常业务运行中的各重要风险环

节进行动态监控；通过敏感性分析及压力测试，动态监测、评估公司经营过程中的各类别风险状况及风险承受能力。

全面风险管理体系离不开完备的信息技术系统。公司近几年持续增加信息技术方面的资源投入，通过搭建风险管理驾驶舱、全面风险管理系统、风控指标动态管理系统和各类专项风险管理信息系统，不断推进风险管理工作中信息技术的实践应用，风险管理的及时性和准确性得到有效提升。

(2). 风险治理组织架构

√适用 □不适用

公司致力于构筑严密有效的风险管理“三道防线”。通过建立各业务部门、各分支机构、各子公司重要一线岗位的双人、双职、双责及岗位分离制衡机制，形成第一道防线；风险管理职能部门协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作，其他相关职能部门对各自职责范围内的合规与风险管理事项进行检查和督导，通过相关部门及相关岗位的相互制衡、监督，形成第二道防线；风险监督管理部门对各业务及职能部门风险管理工作实施有效的监督，形成第三道防线。

公司按照《证券公司全面风险管理规范》的要求，结合自身的运营需求，建立包括董事会，经营管理层，首席风险官，风险管理各职能部门，各业务部门、分支机构及子公司五个层次的风险管理架构，各层级在授权范围内履行风险管理职责。

2、信用风险

√适用 □不适用

信用风险主要指债务人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，给公司造成损失的风险。公司的信用风险目前主要来自于证券金融业务中的融资方信用风险以及证券投资业务中的固定收益类投资业务中的债券发行人信用风险以及衍生品交易等业务中交易对手方的违约风险等。

公司围绕净资本管理与风险承受度，分层次、分模块，统筹管理规模、交易对手、风险敞口等风控指标，从品种、模型、对冲等角度出发，对信用风险敞口进行精细化管理，有效控制信用风险。

从业务实践角度，公司分别建立了针对债券发行主体、交易对手方、融资类业务客户的信用风险管理体系，加强了对其资质和风险的评估工作，通过合同审查、交易及舆情监控等形式进行信用风险管理，重点关注交易过程中的可能违约环节，制定风险处置应急预案。在债券投资及信用风险相关的交易对手业务中，加强对债务发行主体及交易对手的基本面分析，相应地建立了公司信用风险内部评级体系，并通过信用风险管理系统实现了内部评级、统一授信管理、投资品集中度管理、违约客户管理、压力测试、监控预警及风险报告等功能，加强信用风险管控，提升信

用风险管理能力；在衍生品交易中，公司对交易对手设定保证金比例和交易规则限制，通过每日盯市、追保、强制平仓等手段来控制交易对手的信用风险敞口；在证券金融业务中，建立了客户的信用等级评定、授信管理、担保品管理、监控报告等机制，并通过动态平仓机制及时处置潜在风险。

如附注五所述，本集团采用简化方法，对于应收款项按照整个存续期预期信用损失确认减值准备。本集团对于其他金融资产监测并评估其信用风险自初始确认后是否已显著增加，若该金融资产的信用风险自初始确认后已显著增加，本集团按照相当于该金融资产整个存续期内预期信用损失的金额而并非未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。

在进行信用风险相关评估时，本集团将考虑所有合理且有依据的定性及定量信息，包括无须付出不必要的额外成本或努力的历史经验及前瞻性信息。本集团在评估每个资产组合的信用风险是否显著增加时考虑不同的因素。

在评估信用风险是否显著增加时，本集团可能考虑的相关因素如下：

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

本集团货币资金、结算备付金和存出保证金等金融资产的信用风险有限，主要系相关对手方为国有商业银行、清算所、证券交易所、期货交易所、商品交易所以及国际评级机构评定的外部评级较高的商业银行等。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团货币资金、结算备付金、拆入资金和存出保证金不存在信用风险显著增加的情形。

本集团主要依靠外部信用评级来评估债券投资的信用风险。通常情况下，当出现下列情况时，表明债券投资的信用风险显著上升：相对于初始确认日国内评级机构评定的原外部评级在 AA 以上(含)其信用等级发生下调，且下调后信用等级在 AA 以下(不含)B 以上(不含)；相对于初始确认日国内评级机构评定的原外部评级在 AA 以下(不含)其信用等级发生下调但未下调至 B 等级。截至 2021 年 6 月 30 日，本集团主要以投资债权评级为 AA 级以上(含)的债券为主。

融资融券金融资产包括客户取得融出资金金额和融券卖出金额。这些金融资产主要的信用风险来自于客户未能及时支付本息或归还证券而产生违约。本集团制定了严格的平仓制度，并对融

资融券客户的信用账户执行整体监控，设置预警线和平仓线，根据客户信用账户维持担保比例变化对客户信用账户资产负债进行监控，确保担保资产充足。通常情况下，如果客户信用账户维持担保比例低于预警线则表明其信用风险已经显著增加。

在买入返售金融资产业务方面，本集团通过设置定量、定性标准以判断相关金融资产的信用风险自初始确认后是否发生显著变化，判断标准主要包括逾期天数、维保比的变化以及其他表明信用风险显著变化的定性和定量标准。对于股票质押式回购业务，本集团考虑担保证券所属板块、流动性、限售情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的平仓线。一般而言，限售股项目的平仓线不低于 140%，流通股项目的平仓线不低于 130%。本集团在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的基础上，分析评估每笔业务自初始确认后信用风险的变化。通常情况下，按以下标准划分三个阶段：若履约保障比例不低于平仓线，且未出现逾期情形，则属于第一阶段；若履约保障比例低于平仓线或逾期，或出现其他信用风险显著增加的情形，而根据交易实质判断尚未发生信用减值，则进入第二阶段。若履约保障比例低于平仓线超过 90 天或逾期超过 90 天，本集团结合债务人的还款能力、还款意愿、担保资产价值及其他债务解决措施等因素逐一进行评估，依据交易实质判断是否已发生信用减值，若已发生信用减值，则划入第三阶段。

本集团采用三阶段模型对除应收款项以外的其余以摊余成本计量的金融资产和其他债权投资计量预期信用损失。本集团根据相关金融资产自初始确认日起信用风险的变化情况在以下三阶段进行划分：

第一阶段：初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，应当按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备；

第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加，但尚无客观减值证据的金融工具，应当按照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，应当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。

该预期信用损失模型中涉及的评估因素主要包括违约概率、违约风险敞口和违约损失率等：

- 违约概率表示在特定时间段内相关交易发生违约的可能性的估计；其计算涉及历史数据和对未来情况的预期等；

- 违约风险敞口指在未来 12 个月或整个剩余存续期中，在违约发生时本公司应被偿付的金额。

- 违约损失率表示对发生违约情形的交易产生的损失估计；本集团根据历史资料，在考虑担保措施带来的现金流以及整体信用增级的基础上进行估计，并进行前瞻性调整

预期信用损失的计量是基于违约概率、违约损失率和违约风险敞口的概率加权结果。

本集团在判断金融资产的信用风险自初始确认后是否显著增加以及计量预期信用损失时，均结合了前瞻性信息。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。关键经济指标包括宏观经济指标和反映市场波动率的指标，如广义货币供应量、居民消费价格指数、工业品出厂价格指数等。其中：

- 广义货币供应量增长率：2021 年上半年末预测值取值范围在 7.74%至 10.32%之间；
- 居民消费价格指数增长率：2021 年上半年末预测值取值范围在 1.05%至 1.40%之间；
- 工业品出厂价格指数增长率：2021 年上半年末预测值取值范围在 4.88%至 6.51%之间。

为了确定这些经济指标与违约概率和违约损失率之间的关系，本集团通过建立经济模型来评估这些经济指标的历史变动对违约概率和违约损失率的影响。

本集团根据反映上述已考虑新型冠状病毒肺炎疫情影响的主要经济指标的情景，对预期信用损失进行前瞻性估计。本集团在组合基础上确定相关金融工具的预期信用损失时，本集团基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，共同信用风险特征的例子可包括但不限于：金融工具类型、信用风险评级、担保品类型、剩余到期期限和担保物相对于金融资产的价值。本集团将定期评估该分类以确保其具有共同信用风险特征。

若不考虑担保品和其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面金额(即，扣除减值准备后的净额)。本集团最大信用风险敞口金额列示如下：

单位：元 币种：人民币

涉及信用风险的项目	2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
货币资金	74,449,331,298.79	65,640,359,556.65
结算备付金	24,834,159,746.73	21,516,356,646.61
存出保证金	2,311,823,436.65	2,183,089,694.77
融出资金	23,480,866,622.62	21,171,919,414.06
交易性金融资产	30,832,329,055.36	26,977,230,840.64
衍生金融资产	51,651,456.31	155,876,469.76
买入返售金融资产	13,336,386,959.15	14,460,425,371.36
应收款项	1,167,321,321.43	874,405,553.22
其他债权投资	67,389,989,287.86	62,645,974,916.84
债权投资	4,828,679,090.22	6,243,897,149.81
其他资产	4,414,721,415.58	432,877,936.24
合计	247,097,259,690.70	222,302,413,549.96

3、流动风险

√适用 □不适用

流动性风险指证券公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

流动性风险管理方面，报告期内公司依照《证券公司流动性风险管理指引》和风控指标管理办法新规持续完善流动性风险管理系统和内部管理制度体系，设置专岗负责对公司流动性风险进行动态监控、预警、分析和报告。每年初公司审慎确定流动性风险偏好的定性原则和定量标准，年中根据市场变化和业务发展适时调整相关流动性风控指标。定期进行流动性压力测试和应急演练，并按监管要求每日报送流动性覆盖率、净稳定资金率等指标。确保公司流动性需求能够及时以合理成本得到满足，将流动性风险控制在可承受的范围内。

本集团持有的非衍生金融负债按剩余合同义务到期期限的未折现现金流分析列示如下。表格所列未折现的现金流包括利息及本金的现金流。

单位：元 币种：人民币

项 目	期末余额						账面价值
	即期	3 个月内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年及以上	总计	
短期借款		4,130,517,274.95	30,470,200.00			4,160,987,474.95	4,148,571,185.09
应付短期融资款		4,527,872,124.20	200,417,024.16			4,728,289,148.36	4,691,930,367.56
拆入资金		4,158,825,362.64	506,268,550.23			4,665,093,912.87	4,654,383,638.90
代理买卖证券款	78,920,066,090.72					78,920,066,090.72	78,920,066,090.72
代理承销证券款	120,499,979.00					120,499,979.00	120,499,979.00
交易性金融负债	611,729,179.06	5,254,840,262.65	6,870,638,136.39	1,667,110,246.83	4,575,729,510.19	18,980,047,335.12	17,347,274,201.11
应付款项	1,228,431,981.12					1,228,431,981.12	1,228,431,981.12
其他负债	3,753,199,047.61					3,753,199,047.61	3,753,199,047.61
卖出回购金融资产		54,122,687,561.87	3,363,239,697.22			57,485,927,259.09	57,416,887,936.49
租赁负债		88,843,767.91	228,300,362.21	531,458,167.35	10,661,065.01	859,263,362.48	796,734,938.00
应付债券		2,505,115,920.79	26,028,406,673.54	44,759,644,081.17	4,398,400,000.00	77,691,566,675.50	72,720,557,081.66
合 计	84,633,926,277.51	74,788,702,275.01	37,227,740,643.75	46,958,212,495.35	8,984,790,575.20	252,593,372,266.82	245,798,536,447.26
项 目	期初余额						账面价值
	即期	3 个月内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年及以上	总计	
短期借款		431,893,819.22	153,637,500.00			585,531,319.22	579,732,185.45
应付短期融资款		12,015,024,894.92	4,356,227,219.34			16,371,252,114.26	16,255,485,786.37
拆入资金		9,676,204,695.97				9,676,204,695.97	9,670,113,871.43
代理买卖证券款	66,642,671,158.50					66,642,671,158.50	66,642,671,158.50
代理承销证券款	346,000,000.00					346,000,000.00	346,000,000.00
交易性金融负债	657,569,692.90	7,634,218,506.16	5,881,807,340.01	460,785,106.04		14,634,380,645.11	14,576,073,144.23
应付款项	576,584,579.01					576,584,579.01	576,584,579.01
其他负债	1,867,453,267.90					1,867,453,267.90	1,867,453,267.90
卖出回购金融资产		48,250,607,121.95	5,005,401,829.76			53,256,008,951.71	52,860,883,439.73
租赁负债		82,384,574.41	233,001,700.08	590,983,012.55	13,796,451.90	920,165,738.94	856,910,328.86
应付债券		289,000,000.00		51,915,968,927.17	4,398,400,000.00	67,148,273,238.34	62,265,473,497.68
合 计	70,090,278,698.31	78,379,333,612.63	26,174,979,900.36	52,967,737,045.76	4,412,196,451.90	232,024,525,708.96	226,497,381,259.16

由于衍生金融工具对公司现金流影响较小，因此上述未贴现现金流中未包括衍生金融工具的影响。

4、市场风险

√适用 □不适用

市场风险主要指在证券市场中因股市价格、利率、汇率等的变动而导致损失的风险。公司的市场风险主要来自于证券投资业务。公司的各业务部门、各分支机构、各子公司是市场风险管理的第一道防线。公司的风险管理职能部门负责统筹市场风险管理工作。

目前，为加强市场风险的管控，公司采取了如下措施：

(1) 运用逐日盯市、集中度分析及定量风险模型对规模、杠杆、风险敞口、久期等进行管理，建立动态跟踪止损机制。

(2) 通过敏感性分析寻找影响投资组合收益的关键因素，并通过情景分析、压力测试等方法评估投资组合对于极端市场波动的承受能力。

(3) 进行多元化和科学化的资产配置，利用股指期货等衍生品对冲风险，运用各种投资策略实现套期保值。

(4) 密切关注宏观经济指标和趋势，重大经济政策动向，评估宏观因素变化可能给投资带来的系统性风险。

(5) 建立重大事项处置决策、执行及责任机构，制定各种可预期极端情况下的应急预案，并根据严重程度对重大事项进行分级和管理。

1. 利率风险

利率风险是指公司的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本公司面临的利率风险的资产主要包括公司的现金及银行余额、结算备付金、融资客户垫款、买入返售金融资产及债券投资等。管理层透过对利率重定价的错配程度及久期的缺口设立限额，积极监控公司的利息净额风险。公司通过短期的资金拆借、收益凭证、短期融资券等来获取资金流动性，从而应对短期头寸的缺口。

中国人民银行所报的现行利率、上海银行间同业拆放利率和香港银行间同业拆放利率波动为公司现金流量利率风险的主要来源。

于各资产负债表日，本集团金融资产和金融负债按合同约定的利率重新定价日或到期日(以较早者为准)的情况如下：

单位：元 币种：人民币

	期末余额						合计
	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	非生息	
金融资产：							
货币资金	71,505,915,526.48	1,250,891,647.94	1,627,111,138.20	65,412,986.17			74,449,331,298.79
结算备付金	24,834,159,746.73						24,834,159,746.73
融出资金	2,139,340,249.40	6,767,103,272.83	14,574,423,100.39				23,480,866,622.62
交易性金融资产	830,098,160.02	898,715,712.77	4,496,635,954.75	20,268,945,611.80	4,337,933,616.02	45,620,371,667.67	76,452,700,723.03
衍生金融资产						51,651,456.31	51,651,456.31
买入返售金融资产	13,186,639,631.48		149,747,327.67				13,336,386,959.15
应收款项						1,167,321,321.43	1,167,321,321.43
存出保证金	2,311,823,436.65						2,311,823,436.65
其他债权投资	13,496,489,018.64	717,073,789.32	5,344,999,998.92	31,959,573,439.66	15,871,853,041.32		67,389,989,287.86
其他权益工具投资						6,096,378,358.59	6,096,378,358.59
债权投资	478,754,777.13	335,837,552.93	465,366,802.05	2,119,002,772.60	1,429,717,185.51		4,828,679,090.22
其他资产	3,722,688,033.79		39,291,551.55			652,346,940.26	4,414,326,525.60
金融资产合计	132,505,908,580.32	9,969,621,975.79	26,697,575,873.53	54,412,934,810.23	21,639,503,842.85	53,588,069,744.26	298,813,614,826.98
金融负债：							
短期借款	3,969,371,185.09	150,000,000.00	29,200,000.00				4,148,571,185.09
应付短期融资款	2,892,270,012.55	1,601,619,815.17	198,040,539.84				4,691,930,367.56
拆入资金	3,654,046,138.90	500,233,333.33	500,104,166.67				4,654,383,638.90
交易性金融负债	285,645,145.62	3,465,437,760.34	6,653,856,649.98	1,479,562,858.58	2,917,580,402.29	2,545,191,384.30	17,347,274,201.11
衍生金融负债						978,080,029.00	978,080,029.00
卖出回购金融资产款	51,314,986,604.63	2,791,747,223.11	3,310,154,108.75				57,416,887,936.49
代理买卖证券款	78,920,066,090.72						78,920,066,090.72
代理承销证券款						120,499,979.00	120,499,979.00
应付款项						1,228,431,981.12	1,228,431,981.12
应付债券	2,025,490,639.28		24,257,371,728.19	42,254,889,565.84	4,182,805,148.35		72,720,557,081.66
租赁负债	38,576,345.40	53,065,701.02	221,517,838.16	475,082,094.70	8,492,958.72		796,734,938.00
其他负债						3,753,199,047.61	3,753,199,047.61
金融负债合计	143,100,452,162.19	8,562,103,832.97	35,170,245,031.59	44,209,534,519.12	7,108,878,509.36	8,625,402,421.03	246,776,616,476.26
金融资产负债净头寸	-10,594,543,581.87	1,407,518,142.82	-8,472,669,158.06	10,203,400,291.11	14,530,625,333.49	44,962,667,323.23	52,036,998,350.72

	期初余额						合计
	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	非生息	
金融资产：							
货币资金	65,457,260,606.47	50,390,694.44	67,295,269.57	65,412,986.17			65,640,359,556.65
结算备付金	21,516,356,646.61						21,516,356,646.61
融出资金	1,456,820,276.66	6,670,845,639.30	13,044,253,498.10				21,171,919,414.06
交易性金融资产	419,311,340.00	2,282,402,792.61	5,770,777,628.43	12,838,976,852.92	5,665,762,226.68	45,723,886,202.06	72,701,117,042.70
衍生金融资产		12,852,855.69				143,023,614.07	155,876,469.76
买入返售金融资产	14,260,090,364.15	200,335,007.21					14,460,425,371.36
应收款项						874,405,553.22	874,405,553.22
存出保证金	2,183,089,694.77						2,183,089,694.77
其他债权投资	956,203,159.44	978,047,413.47	5,660,761,117.55	24,409,841,921.43	30,641,121,304.95		62,645,974,916.84
其他权益工具投资						10,936,457,571.84	10,936,457,571.84
债权投资	357,798,878.96	480,428,208.64	1,408,876,480.51	1,925,868,347.25	2,070,925,234.45		6,243,897,149.81
其他资产			78,720,680.82			354,157,255.42	432,877,936.24
金融资产合计	106,606,930,967.06	10,675,302,611.36	26,030,684,674.98	39,240,100,107.77	38,377,808,766.08	58,031,930,196.61	278,962,757,323.86
金融负债：							
短期借款	364,298,096.43	215,434,089.02					579,732,185.45
应付短期融资款	6,049,340,744.44	5,925,800,757.29	4,280,344,284.64				16,255,485,786.37
拆入资金	9,169,763,871.43	500,350,000.00					9,670,113,871.43
交易性金融负债	4,009,362,770.18	2,769,000,000.00	5,850,543,120.00			1,947,167,254.05	14,576,073,144.23
衍生金融负债		268,564,073.99				236,392,622.49	504,956,696.48
卖出回购金融资产款	45,681,063,263.04	2,245,794,090.66	4,934,026,086.03				52,860,883,439.73
代理买卖证券款	66,642,671,158.50						66,642,671,158.50
代理承销证券款						346,000,000.00	346,000,000.00
应付款项						576,584,579.01	576,584,579.01
应付债券			8,759,659,379.66	49,421,791,947.57	4,084,022,170.45		62,265,473,497.68
租赁负债	37,122,579.09	43,855,896.06	225,654,601.56	539,316,613.05	10,960,639.10		856,910,328.86
其他负债						1,867,453,267.90	1,867,453,267.90
金融负债合计	131,953,622,483.11	11,968,798,907.02	24,050,227,471.89	49,961,108,560.62	4,094,982,809.55	4,973,597,723.45	227,002,337,955.64
金融资产负债净头寸	-25,346,691,516.05	-1,293,496,295.66	1,980,457,203.09	-10,721,008,452.85	34,282,825,956.53	53,058,332,473.16	51,960,419,368.22

敏感度分析

以下敏感度分析基于计息资产及负债的利率风险。该分析假设于各报告期末未结清的计息资产及负债于整个年度未结清，在其他变量不变的情况下，利率增减 50 个基点对净利润及所有者权益的影响。

单位：千元 币种：人民币

项 目	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	对净利润的影响	对所有者权益的影响	对净利润的影响	对所有者权益的影响
市场利率上升 50 个基点	-454,866	-1,725,712	-333,117	-1,384,387
市场利率下降 50 个基点	357,035	1,592,829	340,630	1,457,181

1. 汇率风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。除海外子公司持有以不同于相关集团实体功能货币的外币计值的金融资产外，公司仅持有少量以外币计值的投资。管理层认为本集团的外汇汇率风险并不重大，因为本集团的外币资产与负债占本集团总资产与总负债的比率极低。

2. 其他价格风险

其他价格风险主要指因股票价格、衍生金融工具价格和商品价格的不利变动而导致公司发生损失的风险。从定量角度而言，公司面临的价格风险主要体现在由于交易性金融工具的价格波动同比例影响公司的利润变动，以及由于其他债权投资和其他权益工具的价格波动同比例影响公司的股东权益变动。除日常监控投资头寸、交易及盈利指标外，公司亦在日常风险监控中主要使用风险敏感度指标及压力测试指标。

敏感度分析

以下分析假设其他变量保持不变的情况下，股权证券、基金、衍生工具、集合资产管理计划以及其他交易性金融工具的价格增加或减少 10%对所得税前利润及所得税前其他综合收益的影响。下述正数表示所得税前利润及所得税前其他综合收益增加，反之亦然。

单位：千元 币种：人民币

项 目	2021 年 6 月 30 日		2020 年 12 月 31 日	
	对利润总额的影响	对其他综合收益的影响	对利润总额的影响	对其他综合收益的影响
市场价格上升 10%	2,734,667	609,638	3,079,873	1,093,646
市场价格下降 10%	-2,734,667	-609,638	-3,079,873	-1,093,646

十八、 其他重要事项

1、 前期会计差错更正

(1). 追溯重述法

适用 不适用

(2). 未来适用法适用 不适用**2、 债务重组**适用 不适用**3、 资产置换****(1). 非货币性资产交换**适用 不适用**(2). 其他资产置换**适用 不适用**4、 年金计划**适用 不适用

本公司设立的企业年金方案由具备企业年金基金受托人资格的机构管理。根据方案的规定，与本公司签订全日制劳动合同且满足一定条件的在岗员工可参加该方案，公司承担企业缴费，员工承担个人缴费。参加方案后，如公司发生经营性亏损时，当年可终止缴费。

5、 终止经营适用 不适用**6、 分部信息****(1). 报告分部的确定依据与会计政策**适用 不适用

本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。本集团的经营业务根据业务的性质以及所提供的产品和劳务分开组织和管理。

以下是对本集团经营分部详细信息的概括：

投资管理业务主要包括向客户提供资产管理、基金管理及私募股权投资管理服务所赚取的管理费及咨询费，以及来自私募股权投资的投资收益；

经纪及证券金融业务主要包括证券经纪、期货经纪业务所赚取的手续费及佣金，大宗商品交易以及提供融资融券服务所赚取的利息等；

证券销售及交易业务涵盖自营交易和另类投资等，主要包括买卖股票、债券、基金、衍生品、另类投资及其他金融产品所赚取的投资收益等，以及提供相关投资研究活动赚取的费用等；

投资银行业务主要包括证券承销及保荐、以及提供财务顾问服务而赚取的手续费及佣金；

管理本部及其他主要涵盖公司总部运营及香港海外业务，包括因一般营运资金用途而赚取的利息收入及产生的支出。

分部报告信息根据各分部向管理层报告时采用的会计政策及计量基础披露，这些会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础保持一致。

分部利润/(亏损)指分摊所得税费用前各分部所赚得的利润/所产生的亏损，该指标提交管理层供其分配资源及评估业绩。

分部资产/负债分配予各分部。

(2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	投资管理	经纪及证券金融	证券销售及交易	投资银行	管理本部及其他	分部间抵销	合计
本期							
一、营业收入	2,882,525,565.44	7,952,070,016.75	2,056,480,357.59	822,379,350.86	309,690,535.67	746,389,765.98	13,276,756,060.33
1、手续费及佣金净收入	1,995,842,257.84	1,440,729,575.43	172,318,815.68	791,314,291.26	58,995,140.62	34,215,739.27	4,424,984,341.56
2、投资收益	894,749,058.33	-42,093,028.31	1,110,084,151.00	15,603,572.96	1,399,471,442.48	802,127,067.29	2,575,688,129.17
3、利息净收入	33,177,345.23	1,173,971,110.35	758,197,954.92	14,708,473.14	-1,289,215,668.94	-17,513,438.89	708,352,653.59
4、其他收入	-41,243,095.96	5,379,462,359.28	15,879,435.99	753,013.50	140,439,621.51	-72,439,601.69	5,567,730,936.01
二、营业支出	1,218,578,279.80	6,965,141,925.23	526,870,919.44	500,951,900.08	1,071,587,498.15	42,831,120.98	10,240,299,401.72
三、营业利润	1,663,947,285.64	986,928,091.52	1,529,609,438.15	321,427,450.78	-761,896,962.48	703,558,645.00	3,036,456,658.61
四、资产总额	13,134,029,797.83	129,206,712,068.90	117,517,938,005.85	2,103,011,364.60	68,380,182,100.37	19,059,264,398.61	311,282,608,938.94
五、负债总额	2,574,634,331.67	87,616,386,319.49	60,580,422,274.55	676,180,446.98	101,594,372,915.54	2,830,610,041.32	250,211,386,246.91
六、补充信息							
1、折旧和摊销费用	32,514,330.38	136,703,102.62	16,780,113.47	21,456,954.46	143,493,362.41	308,155.98	350,639,707.36
2、资本性支出	36,754,723.68	78,224,474.20	799,080.20	11,508,576.11	143,538,839.09		270,825,693.28
3、信用减值损失	3,663,904.86	271,818,477.45	-18,281,736.19	121,376.99	1,221,640.98		258,543,664.09
上期							
一、营业收入	1,689,341,305.07	5,722,201,852.65	2,652,982,568.36	562,646,459.42	-460,033,767.71	541,845,113.87	9,625,293,303.92
1、手续费及佣金净收入	1,221,070,825.99	956,479,770.47	69,789,408.25	534,885,125.20	66,239,312.23	31,214,118.22	2,817,250,323.92
2、投资收益	367,663,797.26	242,220,052.75	1,293,091,206.17	9,110,351.50	556,245,600.72	523,402,219.20	1,944,928,789.20
3、利息净收入	20,973,592.52	1,046,935,309.87	771,657,998.64	11,512,205.89	-1,527,426,254.87	-12,955,388.78	336,608,240.83
4、其他收入	79,633,089.30	3,476,566,719.56	518,443,955.30	7,138,776.83	444,907,574.21	184,165.23	4,526,505,949.97
二、营业支出	903,658,455.54	5,815,757,158.92	414,246,842.66	258,607,954.49	581,098,007.10	25,135,059.96	7,948,233,358.75
三、营业利润	785,682,849.53	-93,555,306.27	2,238,735,725.70	304,038,504.93	-1,041,131,774.81	516,710,053.91	1,677,059,945.17
四、资产总额	12,257,302,395.54	114,848,731,131.86	108,038,849,695.86	2,599,190,764.37	70,597,344,183.62	17,223,976,586.82	291,117,441,584.43
五、负债总额	2,411,486,796.59	75,823,775,960.72	57,293,144,347.14	1,048,107,533.16	95,826,184,980.52	1,516,402,062.88	230,886,297,555.25
六、补充信息							
1、折旧和摊销费用	33,589,422.61	125,027,008.98	10,180,254.26	20,396,274.65	130,040,457.42	265,156.24	318,968,261.68
2、资本性支出	6,519,469.64	102,262,182.12	2,304,752.35	30,013,168.21	109,082,359.50		250,181,931.82
3、信用减值损失	-51,324.27	1,276,320,761.88	12,250,325.09	6,208.69	1,583,769.74		1,290,109,741.13

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

□适用 √不适用

(4). 其他说明

适用 不适用

7、 租赁

适用 不适用

8、 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用 不适用

9、 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

适用 不适用

10、其他

适用 不适用

十九、 母公司财务报表主要项目注释

1、 长期股权投资

适用 不适用

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

	期末余额	期初余额
子公司	16,223,303,729.53	15,773,303,729.53
联营企业	2,797,067,670.57	2,585,810,107.82
合计	19,020,371,400.10	18,359,113,837.35

(2) 对子公司投资

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本年增加	本年减少	本年计提减值准备	期末余额
上海东证期货有限公司	2,312,420,000.00				2,312,420,000.00
上海东方证券资产管理有限公司	300,000,000.00				300,000,000.00
上海东方证券资本投资有限公司	4,000,000,000.00				4,000,000,000.00
东方金融控股(香港)有限公司	2,340,040,000.00				2,340,040,000.00
东方证券承销保荐有限公司	1,020,843,729.53				1,020,843,729.53
上海东方证券创新投资有限公司	5,800,000,000.00	450,000,000.00			6,250,000,000.00
合计	15,773,303,729.53	450,000,000.00			16,223,303,729.53

(3) 对联营企业投资

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		
联营企业											
汇添富基金管理股份有限公司	2,585,810,107.82			554,967,055.37	-2,071,496.74	-2,582,456.87	-339,055,539.01			2,797,067,670.57	
合计	2,585,810,107.82			554,967,055.37	-2,071,496.74	-2,582,456.87	-339,055,539.01			2,797,067,670.57	

2、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	2,525,388,010.18	2,508,714,184.42
其中：货币资金及结算备付金利息收入	322,973,429.50	286,878,862.00
融出资金利息收入	664,257,723.58	449,932,439.77
买入返售金融资产利息收入	135,060,919.78	377,266,711.32
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	114,429,115.58	359,794,543.84
债权投资利息收入	93,554,929.13	131,061,300.28
其他债权投资利息收入	1,309,515,591.52	1,263,574,871.05
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	25,416.67	
利息支出	2,092,002,540.65	2,182,062,494.73
其中：短期借款利息支出		39,991.90
应付短期融资款利息支出	148,848,810.63	204,795,700.80
拆入资金利息支出	39,357,947.42	56,678,021.58
其中：转融通利息支出	14,026,388.89	20,270,833.33
卖出回购金融资产利息支出	671,687,734.32	565,288,729.02
其中：报价回购利息支出	91,779,371.05	75,420,978.90
代理买卖证券款利息支出	52,525,662.79	42,127,530.18
长期借款利息支出		
应付债券利息支出	1,169,655,596.94	1,302,375,633.71
其中：次级债券利息支出	424,970,653.97	576,502,323.81
租赁负债利息支出	9,926,788.55	10,756,887.54
利息净收入	433,385,469.53	326,651,689.69

3、手续费及佣金净收入

(1). 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	1,202,497,460.44	876,511,495.98
证券经纪业务收入	1,502,582,667.74	1,115,434,969.18
其中：代理买卖证券业务	813,307,499.94	718,088,424.05
交易单元席位租赁	390,117,305.21	281,919,564.19
代销金融产品业务	299,157,862.59	115,426,980.94
证券经纪业务支出	300,085,207.30	238,923,473.20
其中：代理买卖证券业务	300,085,207.30	238,923,473.20
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	224,284,056.25	264,158,890.93
投资银行业务收入	239,275,462.14	300,616,456.98
其中：证券承销业务	239,275,462.14	300,616,456.98
投资银行业务支出	14,991,405.89	36,457,566.05

其中：证券承销业务	14,991,405.89	35,668,566.05
财务顾问业务		789,000.00
4. 资产管理业务净收入		
资产管理业务收入		
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入		
基金管理业务收入		
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	19,580,241.41	20,848,316.19
投资咨询业务收入	19,582,128.20	20,871,995.43
投资咨询业务支出	1,886.79	23,679.24
7. 其他手续费及佣金净收入	-11,500,019.37	-65,146,001.65
其他手续费及佣金收入	72,052,815.17	15,199,534.14
其他手续费及佣金支出	83,552,834.54	80,345,535.79
合计	1,434,861,738.73	1,096,372,701.45
其中：手续费及佣金收入	1,833,493,073.25	1,452,122,955.73
手续费及佣金支出	398,631,334.52	355,750,254.28

(2). 财务顾问业务净收入

适用 不适用

(3). 资产管理业务

适用 不适用

手续费及佣金净收入的说明：

适用 不适用

4、投资收益

(1). 投资收益情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益	717,836,368.62	639,243,318.02
权益法核算的长期股权投资收益	554,967,055.37	229,256,516.54
金融工具投资收益	1,461,988,748.55	1,418,452,588.90
其中：持有期间取得的收益	982,061,715.87	646,096,040.01
—交易性金融工具	679,265,053.32	611,253,468.63
—其他权益工具投资	351,664,409.47	86,924,248.05
—交易性金融负债	-48,867,746.92	-52,081,676.67
处置金融工具取得的收益	479,927,032.68	772,356,548.89
—交易性金融工具	618,540,052.41	676,924,817.83
—其他债权投资	56,085,807.99	417,950,699.59
—衍生金融工具	-190,372,390.72	-246,367,454.83
—交易性金融负债	-4,326,437.00	-76,151,513.70
合计	2,734,792,172.54	2,286,952,423.46

5、其他

√适用 □不适用

(1) 现金流量表补充资料

单位：元 币种：人民币

	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	1,830,215,611.70	1,545,246,316.42
加：资产减值损失		
信用减值损失	252,837,936.75	1,288,483,665.02
固定资产、使用权资产和投资性房地产折旧	199,654,789.77	182,321,305.90
无形资产摊销	42,919,387.63	31,888,675.47
长期待摊费用摊销	17,378,226.24	18,201,806.60
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	1,325,942.34	869,276.70
公允价值变动损失/(收益)	199,448,753.29	-695,554,811.15
利息收入	-1,403,070,520.65	-1,394,636,171.33
利息支出	1,328,431,196.12	1,517,968,213.95
汇兑损失	-120,554,350.89	-26,661,675.88
投资收益	-1,891,109,471.12	-1,530,721,825.20
递延所得税资产减少/(增加)	-118,245,847.39	21,255,566.94
交易性金融资产的减少/(增加)	-483,151,276.89	-3,191,638,751.43
交易性金融负债的增加/(减少)	1,033,967,948.67	1,790,997,858.21
经营性应收项目的减少/(增加)	-1,047,325,480.06	1,336,111,831.70
经营性应付项目的减少/(增加)	2,357,904,763.27	5,884,751,427.36
经营活动产生的现金流量净额	2,200,627,608.78	6,778,882,709.28
2. 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的年末余额	39,905,682,689.55	37,767,741,587.58
减：现金的年初余额	37,270,278,035.64	33,351,673,065.35
加：现金等价物的年末余额		
减：现金等价物的年初余额		
现金及现金等价物净增加/(减少)额	2,635,404,653.91	4,416,068,522.23

二十、 补充资料

1、 当期非经常性损益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	-359,441.66	
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）	114,868,857.44	财政扶持
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-19,978,513.89	主要是捐赠支出
其他符合非经常性损益定义的损益项目	105,039.38	
所得税影响额	-23,658,985.32	
合计	70,976,955.95	

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

适用 不适用

2、净资产收益率及每股收益

适用 不适用

报告期利润	加权平均净资产收益率 (%)	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	4.60	0.37	不适用
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	4.47	0.36	不适用

3、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

4、其他

适用 不适用

董事长：金文忠

董事会批准报送日期：2021 年 8 月 27 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

序号	发文单位	文件标题	文号	发文日期
1	中国证监会	关于同意东方证券股份有限公司向专业投资者公开发行次级公司债券注册的批复	证监许可[2021]465号	2021年2月8日
2	证券基金机构监管部	关于东方证券股份有限公司试点开展基金投资顾问业务有关事项的复函	机构部函[2021]1686号	2021年6月2日

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2021年公司分类评级结果获评A类AA级。