

证券代码：002939

证券简称：长城证券

# 长城证券股份有限公司

## 2021年年度报告



**长城证券**  
GREAT WALL SECURITIES

2022年04月

## 第一节 重要提示、目录和释义

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

二、公司负责人张巍、主管会计工作负责人李翔及会计机构负责人（会计主管人员）阮惠仙声明：  
保证本年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

三、本报告经公司第二届董事会第十四次会议审议通过。本公司全体董事均亲自出席董事会会议，未有董事对本报告提出异议。

四、本公司年度财务报告已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了标准无保留意见的审计报告。

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

六、公司经本次董事会审议通过的利润分配预案为：

以总股本 3,103,405,351 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 1.5 元（含税），不送红股，不以公积金转增股本。

七、风险提示：

公司的业务、财务状况和经营业绩可能在多方面受中国及相关业务所在地区的整体经济及市场状况的影响。公司所处的证券行业具有较强的周期性，根据对宏观经济形势、行业发展状况及公司经营情况的分析，未来存在公司经营业绩随着我国证券市场周期性变化而大幅波动的风险。此外，公司在经营活动中还面临市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等。请投资者认真阅读本报告“第三节 管理层讨论与分析”相关内容，并特别注意上述风险因素。

## 目 录

第一节 重要提示、目录和释义 .....	1
第二节 公司简介和主要财务指标.....	5
第三节 管理层讨论与分析 .....	15
第四节 公司治理.....	39
第五节 环境和社会责任 .....	72
第六节 重要事项.....	74
第七节 股份变动及股东情况 .....	96
第八节 优先股相关情况 .....	102
第九节 债券相关情况.....	103
第十节 财务报告.....	111

## 备查文件目录

- 一、载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表。
- 二、载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。
- 三、报告期内公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。
- 四、其他有关资料。

## 释 义

释义项	指	释义内容
长城证券、本公司、公司	指	长城证券股份有限公司
长城有限	指	长城证券有限责任公司，本公司前身
华能集团	指	中国华能集团有限公司，本公司实际控制人
华能资本、控股股东	指	华能资本服务有限公司，本公司控股股东
华能财务	指	中国华能财务有限责任公司
深圳能源	指	深圳能源集团股份有限公司
深圳新江南	指	深圳新江南投资有限公司
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》《章程》	指	《长城证券股份有限公司章程》
《主板规范运作指引》	指	《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号——主板上市公司规范运作》
《股票上市规则》	指	《深圳证券交易所股票上市规则》
中国证监会、证监会	指	中国证券监督管理委员会
深圳证监局	指	中国证券监督管理委员会深圳监管局
中国银保监会	指	中国银行保险监督管理委员会
国资委	指	国有资产监督管理委员会
中证协	指	中国证券业协会
深交所	指	深圳证券交易所
上交所	指	上海证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
长城长富	指	深圳市长城长富投资管理有限公司，本公司全资子公司
长城投资	指	深圳市长城证券投资有限公司，本公司全资子公司
宝城期货	指	宝城期货有限责任公司，本公司控股子公司
长城富浩	指	深圳长城富浩私募股权基金管理有限公司，原长城富浩基金管理有限公司，本公司控股孙公司
华能宝城物华	指	华能宝城物华有限公司，本公司控股孙公司
长城基金	指	长城基金管理有限公司，本公司参股公司
景顺长城	指	景顺长城基金管理有限公司，本公司参股公司
报告期	指	2021 年度（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日）
上年度	指	2020 年度（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日）
元、万元、亿元	指	人民币元、人民币万元、人民币亿元
资产证券化、ABS	指	以基础资产所产生的现金流为偿付支持，通过结构化等方式进行信用增级，在此基础上发行资产支持证券的业务活动
IPO	指	首次公开发行股票
ESG	指	环境、社会和公司治理

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司信息

股票简称	长城证券	股票代码	002939
股票上市证券交易所	深圳证券交易所		
公司的中文名称	长城证券股份有限公司		
公司的中文简称	长城证券		
公司的外文名称	China Great Wall Securities Co.,Ltd.		
公司的外文名称缩写	CGWS		
公司的法定代表人	张巍		
公司的总裁	李翔		
注册地址	广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层		
注册地址的邮政编码	518033		
公司注册地址历史变更情况	2019 年 11 月，公司注册地址由“深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层”变更为“深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层”		
办公地址	广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层		
办公地址的邮政编码	518033		
公司网址	<a href="http://www.cgws.com">http://www.cgws.com</a>		
电子信箱	cczqir@cgws.com		
公司注册资本	3,103,405,351 元		
公司净资产	17,285,634,977.56 元		

### 二、联系人和联系方式

	董事会秘书
姓名	吴礼信
联系地址	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 19 层
电话	0755-83516072
传真	0755-83516244
电子信箱	cczqir@cgws.com

### 三、信息披露及备置地点

公司披露年度报告的证券交易所网站	深圳证券交易所网站（ <a href="http://www.szse.cn">www.szse.cn</a> ）
公司披露年度报告的媒体名称及网址	《证券时报》《证券日报》《中国证券报》《上海证券报》、巨潮资讯网（ <a href="http://www.cninfo.com.cn">www.cninfo.com.cn</a> ）
公司年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 19 层公司董事会办公室

#### 四、注册变更情况

统一社会信用代码	91440300192431912U
公司上市以来主营业务的变化情况	公司于 2021 年 3 月换领了新的《经营证券期货业务许可证》，证券期货业务范围增加“证券投资基金托管”。
历次控股股东的变更情况	无变更

#### 五、各单项业务资格

公司及公司所设证券营业部、分公司均持有中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司经营范围为：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券投资基金托管业务。

截至报告期末，公司及子公司各单项业务资格如下：

##### （一）经纪业务相关资格

序号	业务资格	批准机构
1	上海证券交易所会员资格	上海证券交易所
2	深圳证券交易所会员资格	深圳证券交易所
3	期权结算业务资格	中国证券登记结算有限责任公司
4	数字证书认证业务代理及使用	中国证券登记结算有限责任公司
5	股票质押式回购业务交易权限	上海证券交易所
6	股票质押式回购业务交易权限	深圳证券交易所
7	约定购回式证券交易权限	深圳证券交易所
8	证券业务外汇经营许可证	国家外汇管理局
9	代销金融产品业务资格	深圳证监局
10	转融通业务	中国证券金融股份有限公司
11	债券质押式报价回购业务试点	中国证监会
12	约定购回式证券交易权限	上海证券交易所
13	向保险机构投资者提供交易单元	中国银保监会
14	融资融券业务资格	中国证监会
15	为期货公司提供中间介绍业务资格	中国证监会
16	中国证券登记结算有限责任公司结算参与者	中国证券登记结算有限责任公司
17	开放式证券投资基金代销业务资格	中国证监会
18	深圳B股结算会员资格	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
19	网上证券委托业务资格	中国证监会
20	深港通下港股通业务交易权限	深圳证券交易所
21	港股通业务交易权限	上海证券交易所
22	证券投资咨询业务资格	中国证监会

##### （二）投资银行业务相关资格

序号	业务资格	批准机构
1	非金融企业债务融资工具承销商（证券公司类）	中国银行间市场交易商协会

2	主办券商业务	全国中小企业股份转让系统有限责任公司
3	代办系统主办券商业务资格	中国证券业协会
4	主办券商做市业务	全国中小企业股份转让系统

**(三) 资产管理业务相关资格**

序号	业务资格	批准机构
1	受托管理保险资金业务	中国银保监会
2	集合资产管理电子签名合同试点	深圳证监局
3	集合资产管理业务	深圳证监局
4	定向资产管理业务	深圳证监局
5	受托投资管理业务资格	中国证监会

**(四) OTC 业务相关资格**

序号	业务资格	批准机构
1	柜台市场试点	中国证券业协会
2	股票收益互换交易业务	中国证券业协会
3	场外期权业务二级交易商	中国证券业协会

**(五) 自营业务相关资格**

序号	业务资格	批准机构
1	上海证券交易所股票期权交易参与者	上海证券交易所
2	利率互换交易	深圳证监局
3	股指期货交易	深圳证监局
4	上海证券交易所大宗交易系统合格投资者资格	上海证券交易所
5	进入全国银行间同业市场	中国人民银行
6	信用风险缓释工具业务	中国证监会
7	信用保护合约核心交易商	上海证券交易所
8	信用保护凭证创设机构	上海证券交易所
9	深圳证券交易所股票期权交易参与者	深圳证券交易所

**(六) 公司其他主要业务资格**

序号	业务资格	批准机构
1	保险兼业代理业务许可证 (A类)	中国银保监会
2	中国证券投资基金业协会会员	中国证券投资基金业协会
3	微信证券业务	中国证监会
4	客户资金消费支付服务	中国证券投资者保护基金有限责任公司
5	私募基金综合托管业务试点	中国证监会
6	私募基金业务外包服务机构	中国证券投资基金业协会
7	互联网证券业务试点	中国证券业协会
8	开展直接投资业务	深圳证监局
9	证券投资基金托管资格	中国证监会

**(七) 控股子公司及其下属子公司主要业务资质**

公司名称	业务资格	批准机构
长城长富	私募投资基金管理人	中国证券投资基金业协会
	中国证券投资基金业协会会员	中国证券投资基金业协会
	合格境内投资者境外投资试点资格 (取得资格主体为长城长富子公司长城富浩)	深圳市人民政府金融发展服务办公室
	外商投资股权投资管理业务资格 (取得资格主体为长城长富子公司长城富浩)	深圳市外商投资股权投资企业试点工作领导小组办公室
长城投资	中国证券业协会会员	中国证券业协会
宝城期货	经营证券期货业务许可证	中国证监会
	上海国际能源交易中心会员	上海国际能源交易中心
	中国金融期货交易所交易全面结算会员	中国金融期货交易所
	中国期货业协会会员	中国期货业协会
	资产管理业务	中国期货业协会
	期货投资咨询业务资格	中国证监会
	大连商品交易所会员	大连商品交易所
	上海期货交易所会员	上海期货交易所
	郑州商品交易所会员	郑州商品交易所
	金融期货经纪业务资格	中国证监会
	上海证券交易所股票期权交易参与者	上海证券交易所
	深圳证券交易所股票期权交易参与者	深圳证券交易所
	中国证券投资基金业协会会员	中国证券投资基金业协会

**六、公司历史沿革**

长城证券股份有限公司，原为长城证券有限责任公司，系经中国人民银行银复[1995]417号文批复，于1996年5月2日领取企业法人营业执照，成立时注册资本为15,700万元。

2000年3月8日，经中国证监会证监机构字[2000]43号文核准，公司注册资本由15,700万元增至82,500万元；2006年4月21日，经中国证监会证监机构字[2006]75号文核准，公司注册资本由82,500万元增至92,500万元；2007年4月17日，经中国证监会证监机构字[2007]87号文核准，公司将部分股东认购的64,200万元次级债转增股本，注册资本由92,500万元增至156,700万元；2007年12月26日，经中国证监会证监机构字[2007]342号文核准，公司注册资本由156,700万元增至206,700万元。

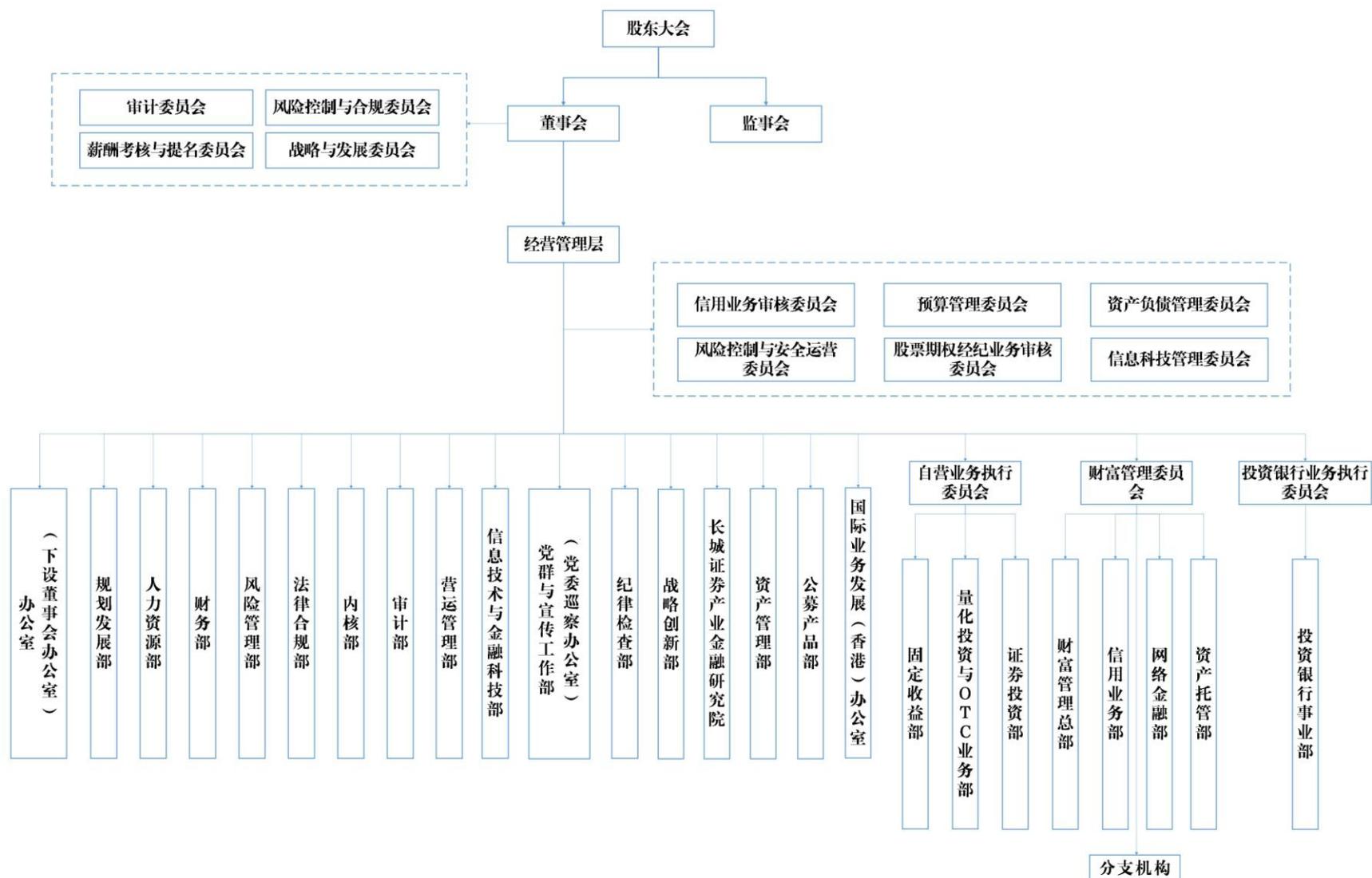
2015年3月31日，公司召开了长城证券股份有限公司创立大会等会议，长城证券有限责任公司整体变更为长城证券股份有限公司，并于2015年4月17日完成了上述变更的工商登记及监管备案。

2015年11月30日，公司注册资本由206,700万元增至279,306.4815万元，并于2015年12月28日经深圳证监局深证局机构字[2015]97号文备案。

经中国证监会证监许可[2018]808号文核准，2018年10月26日，公司首次公开发行股票310,340,536股并在深交所上市，股票代码：002939。首次公开发行完成后，公司注册资本由279,306.4815万元增至310,340.5351万元。

## 七、公司组织机构情况

### (一) 公司组织机构



## (二) 境内外重要分公司

截至 2021 年末，本公司共设有 14 家分公司，均为境内分公司，无境外分公司。公司分公司基本情况如下表所示：

分公司名称	注册地址	设立时间	营运资金	负责人	联系电话
长城证券股份有限公司北京分公司	北京市西城区西直门外大街 112 号 4 层 402、8 层	2009 年 6 月 19 日	5000 万元	李雷	010-88367710
长城证券股份有限公司浙江分公司	浙江省杭州市下城区延安路 385 号 杭州嘉里中心 2 幢 904、905 室	2012 年 8 月 28 日	1000 万元	黄翔	0571-89775180
长城证券股份有限公司广东分公司	珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -307 (集中办公区)	2014 年 1 月 24 日	1000 万元	彭湃	020-88835076
长城证券股份有限公司前海分公司	深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室 (入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	2014 年 4 月 8 日	3000 万元	苏五洲	0755-83514322
长城证券股份有限公司江西分公司	江西省南昌市红谷滩区丰和南大道 2111 号世茂新城 4-2# 商业楼 115 室、116 室、117 室、118 室	2016 年 11 月 9 日	500 万元	詹攸	0791-86688819
长城证券股份有限公司江苏分公司	南京市建邺区庐山路 168 号新地中心二期 1101、1112 室	2017 年 1 月 9 日	500 万元	卫雪梅	025-82223128
长城证券股份有限公司湖北分公司	武汉市东湖新技术开发区光谷三路 777 号 A 办公楼 4 层 401-35 号	2016 年 12 月 29 日	5000 万元	夏俊伟	027-85802978
长城证券股份有限公司重庆分公司	重庆市黔江区城西文体路 89 号 1 幢 406 室	2017 年 1 月 19 日	500 万元	郑海涛	023-89077900
长城证券股份有限公司四川分公司	成都高新区天府大道北段 966 号 4 栋 5 层 40518-40523 号	2016 年 11 月 29 日	500 万元	苗伟民	028-64770383
长城证券股份有限公司深圳分公司	深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道 6008 号深圳特区报业大厦 17 层 1703、1704	2016 年 12 月 13 日	500 万元	杨炜东	0755-23957638
长城证券股份有限公司山东分公司	山东省青岛市市北区龙城路 31 号 4 号楼 2017 户	2017 年 2 月 6 日	500 万元	崔艳	0532-58555766
长城证券股份有限公司上海分公司	中国 (上海) 自由贸易试验区世博馆路 200 号 A 座 8 层	2016 年 11 月 29 日	500 万元	张伟	021-31829666
长城证券股份有限公司海南分公司	海南省海口市滨海大道 103 号财富广场写字楼 28-B、28-C 房	2018 年 10 月 29 日	1000 万元	刘宏飞	0898-66787513
长城证券股份有限公司福建分公司	福建省福州市鼓楼区鼓东街道五四路 158 号环球广场 1110 室	2020 年 4 月 16 日	500 万元	姜成	0591-87311369

## (三) 境内外控股子公司、参股公司

子公司名称	注册地址	设立时间	注册资本	持股比例	负责人	联系电话
深圳市长城长富投资管理有限公司	深圳市福田区深南大道 6008 号 特区报业大厦 31 层 F	2012 年 6 月 20 日	6 亿元	100.00%	吴礼信	0755-83537495

深圳市长城证券投资 有限公司	深圳市前海深港合作区前湾一 路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳 市前海商务秘书有限公司）	2014 年 11 月 24 日	10 亿元	100.00%	童强	0755-83515548
宝城期货有限责任 公司	杭州市求是路 8 号公元大厦南 裙 1-101、1-201、1-301、1-501 室，北楼 302 室	1993 年 3 月 27 日	6 亿元	80.00%	范小新	0571-88151166
长城基金管理有限 公司	深圳市福田区益田路 6009 号新 世界商务中心 4101-4104	2001 年 12 月 27 日	1.5 亿元	47.059%	王军	0755-23982338
景顺长城基金管理 有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉 里建设广场第一座 21 层（仅限 于办公）	2003 年 6 月 12 日	1.3 亿元	49.00%	李进	0755-82370388

#### （四）证券营业部数量和分布情况

截至 2021 年末，公司共设有营业部 118 家，证券营业部的数量及分布情况如下表：

省市或地区	营业部家数	省市或地区	营业部家数	省市或地区	营业部家数
北京	7	湖南	2	吉林	1
河北	4	江苏	11	辽宁	3
天津	1	四川	4	陕西	2
浙江	14	重庆	4	内蒙古	2
广东	20	江西	5	安徽	2
广西	2	上海	6	贵州	2
山东	6	海南	1	云南	3
湖北	5	福建	5	甘肃	1
河南	3	山西	2		

## 八、其他有关资料

公司聘请的会计师事务所：

会计师事务所名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所办公地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
签字会计师姓名	陈晓莹、梁永圻

公司聘请的报告期内履行持续督导职责的保荐机构

适用  不适用

公司聘请的报告期内履行持续督导职责的财务顾问

适用  不适用

## 九、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

是  否

**合并**

	2021 年	2020 年	本年比上年增减	2019 年
营业总收入（元）	7,756,796,088.56	6,868,697,463.16	12.93%	3,899,142,493.53
归属于上市公司股东的净利润（元）	1,765,610,928.44	1,501,641,468.72	17.58%	992,167,143.29
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元）	1,761,903,298.90	1,497,258,401.35	17.68%	990,357,971.98
其他综合收益的税后净额（元）	91,257,007.73	-3,979,492.80	不适用	24,219,712.36
经营活动产生的现金流量净额（元）	-1,229,285,409.09	-4,766,011,920.29	不适用	-2,689,834,391.18
基本每股收益（元/股）	0.57	0.48	18.75%	0.32
稀释每股收益（元/股）	0.57	0.48	18.75%	0.32
加权平均净资产收益率	9.38%	8.58%	上升 0.80 个百分点	5.95%
	2021 年末	2020 年末	本年末比上年末增减	2019 年末
资产总额（元）	92,696,887,190.63	72,212,882,184.60	28.37%	59,095,592,936.50
负债总额（元）	72,583,850,428.44	53,686,308,272.28	35.20%	41,743,400,940.95
归属于上市公司股东的净资产（元）	19,591,038,668.35	18,075,701,983.15	8.38%	16,919,414,595.84

**母公司**

	2021 年	2020 年	本年比上年增减	2019 年
营业总收入（元）	4,207,511,657.24	3,805,907,403.34	10.55%	3,062,598,558.64
净利润（元）	1,646,577,077.40	1,444,976,475.35	13.95%	970,396,469.96
扣除非经常性损益的净利润（元）	1,643,946,825.94	1,442,942,098.29	13.93%	969,415,522.65
其他综合收益的税后净额（元）	91,264,662.23	-3,979,492.80	不适用	24,219,712.36
经营活动产生的现金流量净额（元）	-3,713,782,551.28	-5,418,997,325.61	不适用	-3,074,342,504.16
基本每股收益（元/股）	0.53	0.47	12.77%	0.31
稀释每股收益（元/股）	0.53	0.47	12.77%	0.31
加权平均净资产收益率	8.88%	8.35%	上升 0.53 个百分点	5.88%
	2021 年末	2020 年末	本年末比上年末增减	2019 年末
资产总额（元）	84,131,891,264.45	67,306,605,268.11	25.00%	55,349,124,685.36
负债总额（元）	64,879,950,611.41	49,451,439,587.85	31.20%	38,593,581,399.04
所有者权益总额（元）	19,251,940,653.04	17,855,165,680.26	7.82%	16,755,543,286.32

公司最近三个会计年度扣除非经常性损益前后净利润孰低者均为负值，且最近一年审计报告显示公司持续经营能力存在不确定性

是  否

扣除非经常损益前后的净利润孰低者为负值

是  否

**十、境内外会计准则下会计数据差异**

**（一）同时按照国际会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况**

适用  不适用

公司报告期不存在按照国际会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况。

**(二) 同时按照境外会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况**

适用  不适用

公司报告期不存在按照境外会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况。

**(三) 境内外会计准则下会计数据差异原因说明**

适用  不适用

**十一、分季度主要财务指标**

合并

单位：元

	第一季度	第二季度	第三季度	第四季度
营业总收入	1,417,261,479.35	2,237,740,371.87	2,227,210,907.95	1,874,583,329.39
归属于上市公司股东的净利润	304,210,395.24	529,172,534.91	521,162,315.47	411,065,682.82
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	284,354,796.81	550,476,925.57	519,202,806.52	407,868,770.00
经营活动产生的现金流量净额	-1,222,933,261.21	663,018,967.57	832,535,586.12	-1,501,906,701.57

母公司

单位：元

	第一季度	第二季度	第三季度	第四季度
营业总收入	772,051,936.11	1,225,998,959.82	1,146,538,218.62	1,062,922,542.69
净利润	280,098,986.54	491,082,896.52	496,823,642.04	378,571,552.30
扣除非经常性损益的净利润	260,331,931.28	508,010,101.68	494,383,837.28	381,220,955.70
经营活动产生的现金流量净额	-1,535,666,514.46	226,270,735.78	224,926,203.08	-2,629,312,975.68

上述财务指标或其加总数是否与公司已披露季度报告、半年度报告相关财务指标存在重大差异

是  否

**十二、非经常性损益项目及金额**

单位：元

项目	2021 年金额	2020 年金额	2019 年金额	说明
非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）	30,369.59	500,949.39	162,313.47	
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）	22,377,399.29	20,479,559.88	3,399,950.00	
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回	25,241,291.62	2,004,448.46	84,590.35	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-33,426,529.43	-8,146,931.61	593,601.29	

其他符合非经常性损益定义的损益项目	1,980,249.60	-8,767,500.00	0.00	
减：所得税影响额	11,068,467.47	1,584,634.36	1,121,727.80	
少数股东权益影响额（税后）	1,426,683.66	102,824.39	1,309,556.00	
合计	3,707,629.54	4,383,067.37	1,809,171.31	--

其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况

适用  不适用

将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益

项目的情况说明

适用  不适用

项目	涉及金额（元）	原因
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益	1,479,535,682.34	作为证券经营机构，公司持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资均属于公司正常经营业务。所产生的公允价值变动收益以及投资收益不作为非经常性损益披露。

### 十三、母公司净资本及有关风险控制指标

单位：元

项目	2021 年末	2020 年末	本年末比上年末增减
核心净资本	14,585,634,977.56	13,533,730,173.02	7.77%
附属净资本	2,700,000,000.00	2,400,000,000.00	12.50%
净资本	17,285,634,977.56	15,933,730,173.02	8.48%
净资产	19,251,940,653.04	17,855,165,680.26	7.82%
净资本/各项风险资本准备之和	208.65%	195.17%	上升 13.48 个百分点
表内外资产总额	69,097,721,977.98	54,604,192,728.98	26.54%
风险覆盖率	208.65%	195.17%	上升 13.48 个百分点
资本杠杆率	21.11%	24.79%	下降 3.68 个百分点
流动性覆盖率	312.07%	230.58%	上升 81.49 个百分点
净稳定资金率	143.29%	169.93%	下降 26.64 个百分点
净资本/净资产	89.79%	89.24%	上升 0.55 个百分点
净资本/负债	36.19%	46.13%	下降 9.94 个百分点
净资产/负债	40.30%	51.69%	下降 11.39 个百分点
自营权益类证券及证券衍生品/净资本	17.10%	11.48%	上升 5.62 个百分点
自营固定收益类证券/净资本	196.86%	161.29%	上升 35.57 个百分点

## 第三节 管理层讨论与分析

### 一、报告期内公司所处行业的情况

2021年是全面建设社会主义现代化国家新征程的开启之年，也是“十四五”开局之年。证券行业主动融入经济社会发展全局和国家发展战略，立足新发展阶段、贯彻新发展理念、构建新发展格局，积极服务资本市场改革发展，服务实体经济和助力居民财富管理的能力持续增强，合规风控水平不断提升，整体经营成效稳中有进。根据中证协发布数据，截至2021年末，证券行业总资产为10.59万亿元，净资产为2.57万亿元，较上年末分别增加19.07%、11.34%；全行业140家证券公司实现营业收入5,024.10亿元，实现净利润1,911.19亿元，证券行业业绩稳健增长，资本实力不断增强。

2021年，证券行业紧扣服务构建新发展格局，全力支持实体经济高质量发展。一是强化科创板“硬科技”定位，提升创业板对成长型创新创业企业的服务功能，引导要素资源加速向科技创新领域集聚。二是加强大宗商品期现联动监管，服务保供稳价大局。三是全面深化资本市场改革开放，有序推进股票发行注册制准备工作，平稳实施深市主板和中小板合并，加速形成常态化退市机制，顺利设立北交所服务专精特新企业发展。四是精准拆弹，持续巩固私募基金、债券违约等重点领域重大风险防范化解攻坚战成效，股市、债市、期市平稳运行。五是权益类基金再创新高，形成了长期资金“进得来、留得住”的市场环境，上市公司质量不断提高，市场韧性明显增强。

2021年，公司行业排名稳步提升。根据中证协统计数据，公司营业收入位列行业第28名，较上年提升1名；净利润位列行业第25名，较上年提升1名；财务顾问业务净收入位列行业第13名，较上年提升3名；投资咨询业务净收入位列行业第19名，较上年提升4名；融资融券利息收入位列行业第21名，较上年提升1名。公司作为计划管理人发行企业资产证券化产品36只，全市场第9名，连续4年稳居行业前十。2021年，公司各项改革发展工作获得广泛认可，斩获行业权威奖项40余项，荣获深圳市直机关工委奖项2个，得到深圳市财政局、深交所、中证协等机构的数项通报表扬，涉及财富管理、金融科技、投行资管、投资研究、公司治理、财务管理、风险管理、投资者关系、品牌建设、党的建设等诸多领域，公司的企业形象和社会声誉显著提升。

### 二、报告期内公司从事的主要业务

公司坚持以客户为中心，洞察客户需求，向个人、机构及企业客户提供多元、全方位的金融产品和服务，并从事自营投资与交易，主要业务如下：

**财富管理业务：**接受委托代客户买卖股票、基金、债券等有价证券，为客户提供投资咨询、投资组合建议、产品销售、资产配置等增值服务，赚取手续费及佣金收入；为客户提供融资融券、股票质押式回购及约定购回交易等资本中介服务，赚取利息收入。

**投资银行业务：**为客户提供发行上市保荐、股票承销、债券承销、资产证券化、资产重组、收购兼并等股权融资、债务融资和财务顾问服务，赚取承销费、保荐费及财务顾问费收入。

资产管理业务：为客户提供集合资产管理、单一资产管理、专项资产管理等资产管理服务，赚取管理费及投资业绩报酬收入。

证券投资及交易业务：以自有资金买卖有价证券，包括权益类投资、量化投资与OTC、固定收益类投资和新三板投资业务，赚取投资收益。

此外，公司还开展为客户提供基金管理、产业金融及投资研究、股权投资等业务，赚取手续费及佣金收入和投资收益。

### 三、核心竞争力分析

#### （一）公司战略科学完整，高度契合国家发展方向，聚焦电力、能源领域打造特色化、差异化核心竞争力

公司立足中央企业、上市公司、金融机构三大属性，深入挖掘自身资源禀赋，以“安全”“领先”为战略指导思想，努力践行“四个革命、一个合作”的能源安全战略，发挥公司作为能源央企控股上市券商的优势地位，全面规划零碳能源的金融助力路径，积极服务于碳达峰、碳中和“3060”目标的国家级绿色发展战略。公司牢牢抓住能源市场和资本市场两大历史机遇，坚持转型和创新双轨驱动，重点培育以“三投、两力”为内涵的核心竞争力（“三投”指投研、投行、投资，“两力”指获客能力和定价能力），聚焦科创金融、绿色金融、产业金融形成差异化、特色化竞争优势，围绕双碳产业链、科创金融港重点打造全新的“一链一圈”产业金融新模式，奋力创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司。

#### （二）股东产业背景深厚，绿色转型市场机遇巨大，有助于公司推进产融结合、打造发展特色

公司控股股东为华能资本，实际控制人为华能集团，主要股东为深圳能源、深圳新江南（央企招商局集团有限公司旗下投资公司）。华能集团为国内发电领域的标志性公司，深圳能源为国内领先的能源与环保综合服务商，招商局集团有限公司为业务多元的综合企业，上述股东及公司实际控制人积极贯彻落实国家实现碳达峰、碳中和的战略部署和发展绿色低碳循环经济的重大决策，大力推动绿色转型、自主创新，具有深厚的绿色能源产业基础和丰富的产业链场景，为公司创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司提供坚实的发展基础。同时，华能资本及其下属企业涉足保险、信托、期货、融资租赁等各类金融业务，有利于与公司发挥协同效应，实现资源共享和优势互补，为公司提供了较大的业务发展空间。另外，公司积极为股东及其关联企业提供全生命周期的综合性金融服务，配合其资源整合工作，深化产融结合，服务实体经济，积极践行金融行业“脱虚向实”。

#### （三）公司区位优势合理、重点集中，参控股公司覆盖金融行业多业务领域

公司总部位于深圳，将充分受益于粤港澳大湾区、深圳先行示范区“双区”驱动，深圳经济特区、深圳先行示范区“双区”叠加的黄金发展期；分支机构覆盖全国重点区域，布局科学合理、重点集中，已完成全国26个省市自治区的布局，设有北京、上海、广东、浙江等十余家分公司，在北京、上海、广州、杭州、南京、成都等主要城市共设有一百余家营业部，可为公司带来巨大增量发展空间。公司参控股长城基金、景顺长城、宝城期货、长城长富、长城投资，覆盖公募基金、期货、私募基金、另类投资等领域，与各参控股公司在品牌、客户、渠道、产品、信息等方面形成资源共享，并实现跨业务合作，尤其是景顺长城作为股票投资领先的多资产管理专家，是中外合资基金公司创新合作的发展典范，近年来为公司作出了积极

的业绩贡献。

#### （四）公司业务牌照齐备，以客户为中心，已形成多功能协调发展的金融业务体系

公司拥有覆盖广泛的全业务牌照，以客户为中心不断推动战略转型，形成了多功能协调发展的金融业务体系。财富管理条线以两融业务为抓手，以网络金融业务拓渠道，构建公司发展的“护城河”；投资银行聚焦科创金融，为科创类企业提供全生命周期综合金融服务，展现出“火车头”的带动效应；资产管理发布“鑫、享、势、城、盈、红、创新”新产品系列，构建ESG投研体系，成为连接公司资金端与资产端的腰部力量，为客户提供“金管家”服务；创立产业金融研究院并正式发布长城证券碳中和系列指数，证券投资基金托管资格获批，投研业务逐步踏上“智慧投资”征程，机构业务“智囊团”专家阵容日趋壮大。

#### （五）“数字券商”建设高效推进，赋能经营创新发展，打造安全、领先、智慧、高效的数字化能力

公司顺应市场发展趋势，积极落实“1+6+N”金融科技发展规划，战略推进“数字券商”建设，打造安全、领先、智慧、高效的数字化能力，构建“大平台+小前端”赋能体系，推动金融科技从局部赋能向科技与业务共创、全面赋能转变。公司积极开展金融科技能力建设，打造业务赋能、支撑体系赋能与科技能力三大平台，从“业务链赋能”和“平台场景化”两个维度实现数字金融双轮驱动。公司发布全新移动交易终端“长城炼金术”APP并根据客户需求快速迭代，开发用于电力资产快速估值的“云动华能”等系列小程序，加快数据治理，推进客户画像，实现覆盖全产品类的资产分析、五大投资能力评估，推动产品模型建设及行情中心建设，打造数据生态。通过金融科技赋能，推进前中后台数字化再造，将技术优势转化为业务胜势，打造场景生态丰富、线上线下协同、用户体验极致、产品创新灵活、运营管理高效、风险控制智能的一体化数字金融生态，高效推动公司高质量发展。

#### （六）经营发展持续稳健，风控合规保障有力，具有良好的声誉与知名度

公司作为国内较早成立的证券公司，坚持“安全”“领先”战略指导思想，筑牢风控之本、稳扎经营之基，高度重视风控合规管理，持续倡导和推进风控合规文化建设，以全面化、精细化和科技化为发展主线，构建全面风险管理体系和合规管理体系，实现对公司各业务线、控股子公司的风险管理全覆盖。公司坚持风控合规与业务发展并举，建立与自身业务发展相匹配的风控合规体系，有效保障了公司稳健经营和高质量发展，被市场和监管部门广泛认可，行业知名度和品牌影响力不断提升。

## 四、主营业务分析

### （一）概述

2021年，面对百年变局和世纪疫情，在党中央、国务院的坚强领导下，我国紧紧围绕新发展阶段、新发展理念、新发展格局逻辑主线，迈出了高质量发展的新步伐，实现了“十四五”良好开局。虽然受新冠疫情、供给冲击、需求收缩、预期转弱等多重因素影响，我国经济仍然承压而上，实现超预期恢复性增长，经济发展和疫情防控均保持全球领先地位。经济转型升级换挡提速，传统制造业、房地产等产业逐步调整的同时，新型服务业和高端制造业正在兴起，通过技术变革实现弯道超

车的企业快速崛起，这些蓬勃发展的行业公司总体上为投资者带来了积极的回报。伴随着政策变化、经济发展、产业变迁，我国资产和资本市场也在发生历史性的剧变和重构，以北交所设立为代表的多层次资本市场建设正在积极推进。作为资本市场的核心主体以及助力实现共同富裕目标的重要参与者，证券公司的发展环境不断优化、发展空间不断扩大，并在监管引导及政策红利催化下，进一步强化特色化、差异化发展优势。

2021年，公司深入贯彻新发展理念，持续服务新发展格局，正式迈入“十四五”战略规划“建设”阶段，全面开启特色化证券公司新征程，大力探索高质量发展新路径。经过科学谋划、精心部署，公司“十四五”战略规划蓝图正式展卷：以“安全”“领先”为战略指导思想，打造以“数字券商、智慧投资、科创金融”为目标的综合型现代投资银行，坚持转型和创新双轨驱动，实现本质安全和高质量发展，奋力创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司。公司以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，明确战略管理PMO“双循环”机制，构建“十四五”战略规划落地实施保障体系，确保重大战略举措“按时、按质、高效”落地，分类评价冲A如期实现，科创金融智慧生态平台正式亮相，产业协同不断深入，治理水平持续提升，经营业绩创近年新高，发展新潜能进一步释放，市场竞争力进一步增强。

截至报告期末，公司总资产9,269,689万元，比上年末增长28.37%，归属于母公司的净资产1,959,104万元，比上年末增长8.38%。报告期内，公司实现营业总收入775,680万元，归属于母公司股东净利润176,561万元，同比分别增长12.93%、17.58%，加权平均净资产收益率9.38%，同比增长0.80个百分点。

2022年，公司步入“十四五”战略规划“见效年”，将继续以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，坚守金融服务实体经济宗旨，坚持稳中求进发展总基调，坚定“安全”“领先”战略指导思想，依照公司“十四五”战略规划路径，科学部署“见效年”的战略任务与举措，持续推动各业务板块的转型与创新，不断提升公司核心竞争力和行业影响力，向着特色化一流证券公司目标阔步前行，奋力谱写公司高质量发展新篇章，以优异成绩迎接党的二十大胜利召开。

## 1、财富管理业务

### (1) 2021年市场环境

2021年，A股市场结构性行情加剧，上证综指振幅仅12.06%，创历史新低，板块跌宕起伏、走势分化。截至报告期末，上证综指上涨4.8%，深证成指上涨2.67%，创业板指上涨12.02%。

### (2) 经营举措及业绩

2021年，公司财富管理业务以数字化推动平台化建设，以专业化提升产业化能力，全方位多层次推进转型升级。报告期内，公司财富管理条线的融资融券、金融产品销售、投资咨询、衍生品等业务均创历史新高：融资融券业务规模持续攀升，截至报告期末，公司融资融券时点余额较上年末增长25%，时点余额市场份额1.268%，创历史新高，报告期内实现融资融券利息收入13.32亿元，同比增长27%；金融产品销售能力不断提升，代销金融产品净收入突破1亿元，同比增长23%；投顾线上服务持续强化创新，探索多元化投顾业务服务模式，投资咨询业务净收入较去年同比增长40%；股票期权深交所全年累计成交额位列行业第14名。

同时，公司全面推进财富管理线上业务运营和管理。报告期内，公司大力开拓银行、互联网等新增获客渠道，深挖存量

渠道潜力，提升基础客户规模；搭建线上业务场景，提升线上金融产品销售能力；以客户为中心，推动建设线上用户分层管理体系和自动化运营平台，提高客户运营与管理能力。

### （3）2022年展望

2022年，公司财富管理业务将坚持“以客户为中心”，以融资融券业务为抓手，持续优化客户结构；构建优质、丰富的产品货架，积极布局基金投顾业务，持续打造“长城量化30品牌”；不断提升深交所、上交所个股期权月成交额排名，力争将个股期权业务打造成为行业内明星业务；不断加强产品和服务创新，积极培育“单项冠军”业务，逐步打造长城证券品牌化产品，持续提升行业影响力；深入细化“总-分-营”管理体系，以管理精细化推动业务精细化；深化平台化科技赋能，不断丰富客户层级权益，加强精细化运营和线上线下融合，全面加速财富管理转型。

## 2、投资银行业务

### （1）2021年市场环境

2021年，股权和债权市场融资规模均实现增长，据统计，股权市场融资总额1.82万亿元，同比增长8.28%；债券市场发行规模61.9万亿元，同比增长8.03%。

### （2）经营举措及业绩

2021年，公司投行业务结构持续优化，实现股债并进，稳步推进区域深耕和行业专业化，投行投资化初见成效，坚持探索内外部业务协同和投承联动。截至报告期末，公司投行IPO过会项目5家，涉及新材料、TMT、大健康、高端制造等行业，投行投资化在消费金融及租赁行业取得重要突破，发行多只符合国家战略和政策的绿色债。2021年，公司在证券公司公司债券业务执业能力评价结果中获评A类。

### （3）2022年展望

2022年，公司投行业务将紧抓发展机遇，全方位提升和支持股权业务发展，继续巩固并加强债券业务；持续深耕重点区域，继续推进投行特色化和专业化转型；深度聚焦电力、能源和科创产业相关行业，积极打造专业领域团队化和团队业务专业化；逐步推行“以客户为中心”的体系化协同，坚持探索投行与投资联动，打造全产业链投行；继续加强投行信息化建设，运用金融科技手段促进投行业务发展提质增效；进一步加强产融结合，积极开展绿色金融服务，助力实体经济转型升级。

## 3、资产管理业务

### （1）2021年市场环境

2021年，随着资管新规过渡期临近结束，金融机构进入资产管理业务整改冲刺阶段，“大资管”时代行业的竞争日趋激烈，券商资管规模呈逐步下降趋势。在大集合管理业务操作指引等一系列政策推动下，当前券商资管面临着全面转型。

### （2）经营举措及业绩

2021年，公司资管业务继续坚定向主动管理方向发展，发布“鑫、享、势、城、盈、红、创新”等系列产品，覆盖固定收益、固收+、多策略、量化对冲等多种产品类型，持续建设、完善资产管理产品序列。资产证券化业务保持良好发展势头，并不断探索创新，年内发行了单体购物中心CMBS、绿色ABS等政策鼓励与行业前沿项目。报告期内，公司提前完成大集合

资管产品的改造并推出两只公募大集合产品,不符合资管新规的存量业务与资管产品均已完成整改或按照监管机构要求进行报备。

同时,公司积极推动资产管理ESG投研体系建设,搭建底层数据库和评价模型,开展绿色资产研究。2021年12月,公司加入联合国支持的“负责任投资原则”组织,成为国内第五家加入该组织的证券公司(含券商资产管理子公司)。

截至报告期末,公司资产管理业务受托资产净值为772.79亿元,其中公募基金(含公募大集合)受托资产净值为21.78亿元,集合资产管理计划受托资产净值为30.55亿元,单一资产管理计划受托资产净值为430.13亿元,专项资产管理计划受托资产净值为290.33亿元。

### (3) 2022年展望

2022年,公司资产管理业务将着力提升投研实力,夯实固定收益类投资能力,加强多策略投资能力,完善ESG投研体系建设;稳健发展公募资管业务,利用多方渠道推动两只公募大集合产品销售,通过公募大集合产品规模的增长推动资产管理业务规模迈上新的台阶。

## 4、证券投资及交易业务

### (1) 2021年市场环境

2021年,权益市场震荡加剧与风格反复切换,给机构投资者带来较大挑战,业绩分化相当显著,尤其是2021年9月之后强势的周期股突然下跌,量化类策略普遍出现一定回撤。债市一波三折,上半年春节后央行缩量操作,引发10年期国债收益率上升到年内高位;其后经济下行压力增大,资金面恢复平稳偏宽,利率逐步回落;下半年央行两次降准点燃货币宽松预期,10年期国债收益率快速下行,创年内新低。

### (2) 经营举措及业绩

2021年,公司固定收益投资业务继续取得稳健业绩,投资组合规模和久期维持稳定,结构性波段调整的交易量和成效高于往年;FICC业务有序推进,利率衍生品投资策略进一步丰富;积极探索被动策略,进一步升级大宗商品研究框架。量化投资与OTC业务始终坚持“低波动、高协同、收益稳健”的业务定位,继续围绕场内弱敞口策略、FOF/MOM策略和场外衍生品三条主线开展业务,不断提升量化类系列策略的投研实力,升级原有策略框架,研发迭代新策略,同时初步搭建场外期权结构的设计定价框架和对冲交易流程。权益投资业务在守住风险底限的前提下,积极调整资产结构、寻找投资机遇,实现持续正收益的投资业绩。新三板投资抓住北交所、新三板跨层转板机会,借助智慧生态平台产业链分析及投研逻辑传导,增厚优质中小企业权益资产。

报告期内,公司自营投资业务能力获得行业专业认可,获评中国金融期货交易所颁发的“2020年度国债期货最佳进步奖”、中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心颁发的“银行间本币市场交易平台8月X-Bond进步机构”“银行间本币市场2021年度市场影响力奖”、中央国债登记结算有限责任公司颁发的“企业债投资业务年度开拓贡献机构”“自营结算100强”等。

### (3) 2022年展望

2022年,经济面临“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力,央行货币政策加强跨周期调节力度,注重充足发力、

精准发力和靠前发力，着力加大对重点领域和薄弱环节的金融支持，实现总量稳、结构优的较好组合。整体来看，债市环境稳定，权益市场存在较多不确定性因素，市场风格将逐渐从高景气转为平衡成长。

公司固定收益投资业务将重视波段机会，挖掘套利空间，严控信用风险，同时在投研体系、中间业务、固收量化系统建设、能源产业与碳金融市场研究等方面夯实能力基础。量化投资与OTC业务将继续坚持“低波动、高协同、收益稳健”的业务定位，聚焦核心能力建设，持续拓展自研策略池，丰富完善投资策略框架，增加覆盖资产品种。权益投资业务将秉承守住底线、抓住变化、权益资产多元配置的思路，继续发掘个股投资价值，同时提升重点赛道的覆盖和深耕能力，聚焦健康消费、科技互联、先进制造三大方向，优化迭代投资框架，在平衡风险收益特征的基础上，努力提升收益率和收入规模。新三板投资业务将继续筛选并投资具有直接转板预期的新三板优质项目。

## 5、子公司经营情况

### （1）期货业务

公司通过控股子公司宝城期货开展期货业务。报告期内，宝城期货代理成交额60,183.61亿元，同比增长57.77%，期末客户保证金规模达67.13亿元，同比增长63.06%。

### （2）私募股权基金业务

公司通过全资子公司长城长富开展私募股权基金业务。截至报告期末，长城长富资产总额6.37亿元，净资产6.30亿元。

### （3）另类投资业务

公司通过全资子公司长城投资开展另类投资业务。截至报告期末，长城投资投资产品市值6.81亿元，同比增长19.47%。报告期内，长城投资以自有资金新增投资项目共11个，投资金额为1.86亿元。

## （二）收入与成本

### 1、营业总收入构成

单位：元

项目	2021 年		2020 年		同比增减
	金额	占营业总收入比重	金额	占营业总收入比重	
手续费及佣金净收入	1,996,520,743.67	25.74%	1,638,208,374.41	23.85%	21.87%
利息净收入	358,033,096.70	4.62%	424,982,245.13	6.19%	-15.75%
投资收益及公允价值变动收益	2,246,715,030.22	28.96%	1,967,225,320.42	28.64%	14.21%
其他收益	22,377,399.29	0.29%	17,979,559.88	0.26%	24.46%
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,446,667.92	-0.02%	-3,756,429.91	-0.05%	不适用
其他业务收入	3,134,596,486.60	40.41%	2,824,058,393.23	41.11%	11.00%
营业总收入合计	7,756,796,088.56	100%	6,868,697,463.16	100%	12.93%

相关数据同比发生变动 30% 以上的原因说明

√ 适用 □ 不适用

汇兑收益：2021 年，公司汇兑收益-144.67 万元，较上年度增加 230.98 万元，主要系受外汇价格波动影响，公司汇兑收益同比增加。

## 2、公司已签订的重大销售合同、重大采购合同情况

适用  不适用

## 3、营业成本构成

单位：元

营业成本构成项目	2021 年		2020 年		同比增减
	金额	占营业成本比重	金额	占营业成本比重	
税金及附加	40,136,062.24	0.72%	30,485,887.70	0.61%	31.65%
业务及管理费	2,500,687,728.23	45.02%	2,154,116,194.39	42.77%	16.09%
信用减值损失	-3,144,635.54	-0.06%	98,113,824.96	1.95%	-103.21%
其他业务成本	3,017,485,669.97	54.32%	2,754,104,951.87	54.68%	9.56%
营业支出合计	5,555,164,824.90	100.00%	5,036,820,858.92	100.00%	10.29%

相关数据同比发生变动 30% 以上的原因说明

税金及附加：2021 年公司税金及附加 4,013.61 万元，较 2020 年度增加 965.02 万元，主要系公司应税收入增加。

信用减值损失：2021 年公司信用减值损失-314.46 万元，较 2020 年度减少 10,125.85 万元，主要系公司根据预期信用损失模型计算的信用减值金额减少。

## 4、报告期内合并范围是否发生变动

是  否

详见本报告“第十节 财务报告”之附注“六、合并范围的变更”相关部分。

## 5、公司报告期内业务、产品或服务发生重大变化或调整有关情况

适用  不适用

### (三) 费用

单位：元

项目	2021 年	2020 年	同比增减	重大变动说明
职工薪酬	1,819,499,713.07	1,553,572,345.27	17.12%	不适用
使用权资产折旧费	126,343,024.73	-	不适用	2021 年公司执行新租赁准则新增项目
业务宣传费	101,493,567.75	73,950,511.03	37.25%	主要系公司业务开展，加大宣传力度，导致费用开支增加
折旧摊销费	94,615,173.85	89,457,365.95	5.77%	不适用
电子设备运转费	70,690,899.81	52,454,209.27	34.77%	主要系公司加强 IT 投入，增加软件维护费及技术服务费支出
席位运行费	41,902,231.94	37,843,557.47	10.72%	不适用
投资者保护基金	40,132,849.98	17,588,897.59	128.17%	主要系公司营业收入增加及上缴比例提高

租赁费及物业管理费	30,470,200.02	169,915,356.73	-82.07%	2021 年公司执行新租赁准则影响
通讯费	30,245,005.66	36,299,710.55	-16.68%	不适用
咨询费	21,826,503.67	31,878,772.94	-31.53%	主要系公司本年减少咨询费用支出
其他	123,468,557.75	91,155,467.59	35.45%	主要系期货居间业务费支出增加
合计	2,500,687,728.23	2,154,116,194.39	16.09%	不适用

#### (四) 研发投入

适用  不适用

#### (五) 现金流

单位：元

项目	2021 年	2020 年	同比增减
经营活动现金流入小计	25,990,721,300.83	12,007,827,593.35	116.45%
经营活动现金流出小计	27,220,006,709.92	16,773,839,513.64	62.28%
经营活动产生的现金流量净额	-1,229,285,409.09	-4,766,011,920.29	不适用
投资活动现金流入小计	876,042,872.63	1,250,173,274.97	-29.93%
投资活动现金流出小计	83,785,344.36	330,276,074.41	-74.63%
投资活动产生的现金流量净额	792,257,528.27	919,897,200.56	-13.88%
筹资活动现金流入小计	29,091,455,256.03	28,345,743,057.20	2.63%
筹资活动现金流出小计	22,991,759,750.48	20,501,345,921.00	12.15%
筹资活动产生的现金流量净额	6,099,695,505.55	7,844,397,136.20	-22.24%
现金及现金等价物净增加额	5,661,220,956.81	3,994,525,986.56	41.72%

相关数据同比发生重大变动的主要影响因素说明

适用  不适用

经营活动现金流入小计：2021 年，公司经营活动现金流入同比增加 1,398,289.37 万元，主要系回购业务现金净流入及二级子公司华能宝城物华销售大宗商品收到的款项增加。

经营活动现金流出小计：2021 年，公司经营活动现金流出同比增加 1,044,616.72 万元，主要系为交易目的而持有的金融资产现金净流出及二级子公司华能宝城物华购买大宗商品支付的款项增加。

投资活动现金流出小计：2021 年，公司投资活动现金流出同比减少 24,649.07 万元，主要系公司投资支付的现金同比减少。

报告期内公司经营活动产生的现金净流量与本年度净利润存在重大差异的原因说明

适用  不适用

2021 年，公司实现净利润 18.46 亿元，与本期公司经营活动产生的现金净流量有较大差异，主要与公司所处行业现金流变动特点有关。公司经营活动产生的现金流量净额包括代理买卖证券、融出资金、资金拆借、回购等业务资金进出，涉及的现金流量大且频繁，但与年度净利润关联度不高。

## 五、主营业务构成情况

### (一) 主营业务分业务情况

单位：元

业务类别	营业总收入	营业支出	营业利润率	营业总收入比上年同期增减	营业支出比上年同期增减	营业利润率比上年同期增减
财富管理业务	2,810,100,965.63	1,063,901,124.65	62.14%	19.03%	14.64%	上升 1.45 个百分点
投资银行业务	574,745,827.71	401,485,571.53	30.15%	27.32%	9.15%	上升 11.64 个百分点
资产管理业务	140,417,719.53	81,264,302.59	42.13%	32.91%	18.72%	上升 6.92 个百分点
证券投资及交易业务	1,143,364,968.49	125,417,234.08	89.03%	-9.40%	-32.25%	上升 3.70 个百分点

相关数据同比发生变动 30% 以上的原因

资产管理业务：营业总收入同比增加 32.91%，主要系公司积极布局资产管理业务转型，资产管理业务收入同比增长。

证券投资及交易业务：营业支出同比减少 32.25%，主要系证券投资及交易业务收入减少导致证券投资及交易业务费用支出等同比减少。

公司主营业务数据统计口径在报告期发生调整的情况下，公司最近 1 年按报告期末口径调整后的主营业务数据

适用  不适用

### (二) 主营业务分地区情况

营业总收入地区分部情况

单位：元

地区	2021 年		2020 年		营业总收入比上年同期增减
	分支机构数量	营业总收入	分支机构数量	营业总收入	
安徽	2	11,614,857.39	2	8,443,366.90	37.56%
北京	8	82,738,958.30	8	87,905,261.15	-5.88%
福建	6	17,424,870.70	6	18,952,453.71	-8.06%
甘肃	1	1,371,051.66	1	1,734,795.04	-20.97%
广东	23	316,888,545.71	23	284,920,560.73	11.22%
广西	2	13,007,705.73	2	15,466,075.95	-15.90%
贵州	2	3,299,878.33	2	3,669,883.93	-10.08%
海南	2	10,623,836.52	2	11,628,954.44	-8.64%
河北	4	11,228,655.00	4	9,871,882.51	13.74%
河南	3	9,051,138.14	3	8,631,365.68	4.86%
黑龙江	1	495,450.88	1	2,134,826.01	-76.79%
湖北	6	47,062,092.49	6	45,068,741.55	4.42%
湖南	3	14,654,179.65	3	14,487,286.17	1.15%
吉林	1	2,446,118.59	1	1,307,010.02	87.15%
江苏	12	54,233,125.51	12	43,823,191.69	23.75%
江西	6	16,815,550.52	6	17,816,353.05	-5.62%

辽宁	4	26,468,676.68	4	29,154,252.11	-9.21%
内蒙古	3	4,123,725.62	3	2,540,305.09	62.33%
山东	7	24,645,851.55	7	21,915,882.75	12.46%
山西	2	2,116,435.63	2	2,074,238.55	2.03%
陕西	2	18,495,459.18	2	17,594,694.45	5.12%
上海	7	24,012,572.08	7	23,658,870.92	1.50%
四川	5	21,149,139.78	5	18,223,940.31	16.05%
天津	1	894,676.11	1	929,128.31	-3.71%
云南	3	17,802,626.52	3	19,449,138.92	-8.47%
浙江	15	58,886,169.99	14	60,173,127.93	-2.14%
重庆	5	32,632,839.20	5	32,282,617.98	1.08%
总部及子公司	-	6,912,611,901.10	-	6,064,839,257.31	13.98%
合计	136	7,756,796,088.56	135	6,868,697,463.16	12.93%

营业利润地区分部情况

单位：元

地区	2021 年		2020 年		营业利润比上年同期增减
	分支机构数量	营业利润	分支机构数量	营业利润	
安徽	2	1,618,207.78	2	2,041,587.86	-20.74%
北京	8	29,937,658.44	8	43,360,754.33	-30.96%
福建	6	-4,655,952.06	6	3,407,760.55	-236.63%
甘肃	1	-809,744.28	1	-183,954.87	不适用
广东	23	182,965,066.66	23	163,123,456.84	12.16%
广西	2	1,786,137.23	2	5,763,318.97	-69.01%
贵州	2	-1,794,185.32	2	-1,061,200.82	不适用
海南	2	1,992,526.17	2	4,603,091.10	-56.71%
河北	4	391,841.68	4	558,986.02	-29.90%
河南	3	-121,192.04	3	433,303.00	-127.97%
黑龙江	1	-1,373,742.05	1	64,995.70	-2,213.59%
湖北	6	21,381,568.78	6	21,701,141.89	-1.47%
湖南	3	4,458,569.85	3	6,017,967.80	-25.91%
吉林	1	-76,354.26	1	-832,636.09	不适用
江苏	12	11,378,500.43	12	10,018,759.42	13.57%
江西	6	-4,285,777.85	6	-1,482,517.19	不适用
辽宁	4	973,150.16	4	7,346,328.15	-86.75%
内蒙古	3	-2,363,025.63	3	-2,089,539.30	不适用
山东	7	4,248,841.53	7	4,628,477.38	-8.20%
山西	2	-1,770,383.47	2	-985,054.44	不适用
陕西	2	6,729,737.59	2	7,937,168.31	-15.21%
上海	7	-15,268,389.73	7	-6,569,150.66	不适用

四川	5	5,362,186.59	5	3,853,865.43	39.14%
天津	1	-991,421.46	1	-398,157.18	不适用
云南	3	10,564,872.37	3	13,368,126.13	-20.97%
浙江	15	-817,742.25	14	16,708,258.96	-104.89%
重庆	5	6,470,821.99	5	11,268,531.31	-42.58%
总部及子公司	-	1,945,699,486.81	-	1,519,272,935.64	28.07%
合计	136	2,201,631,263.66	135	1,831,876,604.24	20.18%

## 六、非主要经营业务情况

适用  不适用

## 七、资产及负债状况分析

### (一) 资产构成重大变动情况

单位：元

项目	2021 年末		2021 年初		比重增减
	金额	占总资产比例	金额	占总资产比例	
货币资金	19,789,750,981.46	21.35%	15,483,332,227.32	21.31%	0.04%
结算备付金	5,114,550,784.40	5.52%	3,759,748,581.73	5.17%	0.35%
融出资金	23,614,329,242.76	25.47%	18,905,975,788.68	26.02%	-0.55%
衍生金融资产	1,190,017.61	0.00%	25,945,842.03	0.04%	-0.04%
存出保证金	3,091,822,150.55	3.34%	2,214,824,323.11	3.05%	0.29%
应收款项	360,468,282.94	0.39%	729,317,081.32	1.00%	-0.61%
买入返售金融资产	1,852,474,205.94	2.00%	2,623,354,700.54	3.61%	-1.61%
交易性金融资产	33,611,273,075.74	36.26%	23,904,133,746.43	32.90%	3.36%
债权投资	29,250,000.00	0.03%	98,846,263.53	0.14%	-0.11%
其他债权投资	704,504,669.39	0.76%	1,088,108,127.40	1.50%	-0.74%
其他权益工具投资	191,679,684.61	0.21%	172,050,208.23	0.24%	-0.03%
长期股权投资	2,298,222,888.33	2.48%	1,820,601,017.99	2.51%	-0.03%
固定资产	154,485,604.76	0.17%	165,649,525.95	0.23%	-0.06%
使用权资产	413,456,798.29	0.45%	469,623,251.44	0.65%	-0.20%
无形资产	92,447,912.23	0.10%	88,416,016.02	0.12%	-0.02%
商誉	11,302,586.62	0.01%	11,302,586.62	0.02%	-0.01%
递延所得税资产	164,738,929.52	0.18%	228,927,244.22	0.32%	-0.14%
其他资产	1,200,939,375.48	1.30%	876,086,740.24	1.21%	0.09%
短期借款	319,468,002.74	0.34%	119,040,434.93	0.16%	0.18%
应付短期融资款	6,041,275,705.47	6.52%	5,455,441,936.79	7.51%	-0.99%
拆入资金	1,281,897,777.08	1.38%	500,320,833.33	0.69%	0.69%
交易性金融负债	-	-	39,659,600.00	0.05%	-0.05%
衍生金融负债	84,813,877.97	0.09%	48,304,970.07	0.07%	0.02%

卖出回购金融资产款	14,203,807,051.69	15.32%	9,683,598,590.65	13.33%	1.99%
代理买卖证券款	23,053,222,073.70	24.87%	18,770,614,211.99	25.83%	-0.96%
代理承销证券款	708,932,079.64	0.76%	-	-	0.76%
应付职工薪酬	1,544,979,095.55	1.67%	1,268,669,406.97	1.75%	-0.08%
应交税费	138,619,556.96	0.15%	175,050,410.35	0.24%	-0.09%
应付款项	408,962,131.89	0.44%	345,991,243.52	0.48%	-0.04%
应付债券	23,688,980,678.90	25.56%	16,968,472,593.49	23.35%	2.21%
租赁负债	431,531,603.86	0.47%	484,782,168.62	0.67%	-0.20%
递延所得税负债	2,294,687.96	0.00%	17,194,056.76	0.02%	-0.02%
其他负债	675,066,105.03	0.73%	293,949,983.43	0.40%	0.33%

境外资产占比较高的情况说明

适用  不适用

## (二) 以公允价值计量的资产和负债

适用  不适用

单位：元

项目	期初数	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	本期购买金额	本期出售金额	期末数
金融资产							
1.交易性金融资产 (不含衍生金融资产)	23,904,133,746.43	263,617,767.37	-	-	828,668,924,082.11	819,317,229,787.00	33,611,273,075.74
2.衍生金融资产	25,945,842.03	-32,334,317.68	-	-	366,243,462.34	365,831,650.93	1,190,017.61
3.其他债权投资	1,088,108,127.40	-	739,356.31	-346,219.26	-	375,911,366.31	704,504,669.39
4.其他权益工具投资	172,050,208.23	-	77,536,325.78	-	-	57,906,849.40	191,679,684.61
金融资产小计	25,190,237,924.09	231,283,449.69	78,275,682.09	-346,219.26	829,035,167,544.45	820,116,879,653.64	34,508,647,447.35
上述合计	25,190,237,924.09	231,283,449.69	78,275,682.09	-346,219.26	829,035,167,544.45	820,116,879,653.64	34,508,647,447.35
金融负债	87,964,570.07	-45,099,999.52	-	-	6,488,312,398.76	6,526,657,514.34	84,813,877.97

报告期内公司主要资产计量属性是否发生重大变化

是  否

## (三) 截至报告期末的资产权利受限情况

截至报告期末，公司主要资产受限情况详见本报告“第十节 财务报告”之附注五“8.交易性金融资产”“9.债权投资”“10.其他债权投资”及“11.其他权益工具投资”相关部分。

## (四) 比较式财务报表中变动幅度超过 30%以上项目的情况

单位：元

项目	2021 年末	2020 年末	增减	变动原因
结算备付金	5,114,550,784.40	3,759,748,581.73	36.03%	主要系客户结算备付金增加
衍生金融资产	1,190,017.61	25,945,842.03	-95.41%	主要系权益类收益互换公允价值变动影响

存出保证金	3,091,822,150.55	2,214,824,323.11	39.60%	主要系交易保证金规模增加
应收款项	360,468,282.94	729,317,081.32	-50.57%	主要系业务保证金减少
交易性金融资产	33,611,273,075.74	23,904,133,746.43	40.61%	主要系债券、基金投资规模增加
债权投资	29,250,000.00	98,846,263.53	-70.41%	主要系以摊余成本计量的债权投资减少
其他债权投资	704,504,669.39	1,088,108,127.40	-35.25%	主要系本期收回其他债权投资影响
使用权资产	413,456,798.29	-	不适用	主要系执行新租赁准则影响
其他资产	1,200,939,375.48	891,457,965.19	34.72%	主要系华能宝城物华应收贸易款增加
短期借款	319,468,002.74	119,040,434.93	168.37%	主要系华能宝城物华短期借款增加
拆入资金	1,281,897,777.08	500,320,833.33	156.22%	主要系拆入资金规模增加
交易性金融负债	-	39,659,600.00	-100.00%	主要系债券借贷规模减少
衍生金融负债	84,813,877.97	48,304,970.07	75.58%	主要系衍生工具公允价值变动影响
卖出回购金融资产款	14,203,807,051.69	9,683,598,590.65	46.68%	主要系债券正回购规模增加
代理承销证券款	708,932,079.64	-	不适用	主要系证券承销业务资金增加
应付债券	23,688,980,678.90	16,968,472,593.49	39.61%	主要系发行债券规模增加
递延所得税负债	2,294,687.96	17,194,056.76	-86.65%	主要系金融资产公允价值变动影响
租赁负债	431,531,603.86	-	不适用	主要系执行新租赁准则影响
其他负债	675,066,105.03	293,949,983.43	129.65%	主要系华能宝城物华应付贸易款增加
其他综合收益	12,808,175.64	-45,638,921.48	不适用	主要系其他权益工具投资公允价值变动影响
未分配利润	3,939,699,617.34	2,967,954,128.83	32.74%	主要系本期盈利影响
项目	2021 年	2020 年	增减	变动原因
公允价值变动收益	186,183,450.17	63,933,891.74	191.21%	主要系自营投资的证券估值变动影响
汇兑损失	-1,446,667.92	-3,756,429.91	不适用	主要系外汇价格波动影响
税金及附加	40,136,062.24	30,485,887.70	31.65%	主要系应税收入增加
信用减值损失	-3,144,635.54	98,113,824.96	-103.21%	主要系本期应收账款和融出资金减值损失转回
营业外收入	709,793.09	3,357,393.47	-78.86%	主要系本期未收到与日常经营活动无关的政府补助
营业外支出	34,105,952.93	8,503,375.69	301.09%	主要系合同纠纷赔偿金额增加
少数股东损益	79,993,266.11	28,958,550.18	176.23%	主要系子公司本期利润增加
归属母公司股东的其他综合收益的税后净额	91,257,007.73	-3,979,492.80	不适用	主要系金融资产公允价值变动影响
归属于少数股东的综合收益总额	79,993,266.11	28,958,550.18	176.23%	主要系子公司本期利润增加
经营活动产生的现金流量净额	-1,229,285,409.09	-4,766,011,920.29	不适用	主要系本期回购业务资金净流入金额增加
汇率变动对现金及现金等价物的影响	-1,446,667.92	-3,756,429.91	不适用	主要系外汇价格波动影响

## （五）融资渠道、长短期负债结构分析

### 1、融资渠道

从融资方式来看，公司有股权融资和债务融资两种方式。从融资期限来看，公司短期融资渠道包括同业拆借、通过银行间和交易所市场进行债券回购、发行短期融资券、短期收益凭证、短期债权收益权转让与回购、转融通等；中长期融资渠道包括发行公司债券、次级债券、长期收益凭证、长期债权收益权转让与回购、资产证券化产品等。

2021 年，公司综合运用短期和中长期融资渠道筹措资金，包括开展同业拆借、实施债券回购、转融通、发行公司债券及证券公司次级债券、发行短期融资券、发行收益凭证等。

## 2、负债结构

2021 年末，公司总负债 488.22 亿元（不含代理买卖证券款、代理承销证券款），其中应付债券占比 48.52%，应付短期融资款占比 12.37%，卖出回购金融资产款占比 29.09%，拆入资金（含转融通）占比 2.63%，其他占比 7.39%。

以融资期限分类：剩余期限一年以上长期负债 147.23 亿元，占比 30.16%；剩余期限一年以内短期负债 340.99 亿元，占比 69.84%。截至报告期末，公司无到期未偿还的债务。

## 3、流动性管理措施与政策

公司通过合理的资产配置、多元化的负债融资、动态的资产负债管理，兼顾业务发展与风险管控，实现风险与收益的平衡。

公司实施审慎且全面的流动性风险管理和资产负债管理，保持适当的高流动性资产储备，制定合理的流动性风险指标及限额体系，定期开展流动性风险压力测试，实时监控流动性状况；根据公司负债期限和结构，结合各业务条线资金需求变化和现金流预测情况，动态调整资金计划，运用各种融资渠道和工具适时进行融资，以满足正常和压力情景下公司持续经营的流动性需求，确保流动性覆盖率和净稳定资金率等流动性风险监管指标持续满足监管要求，并留有一定的弹性与余地。

## 4、融资能力分析

公司经营稳健、信用记录良好，各项风险监管指标均满足相关要求，且外部融资渠道通畅。公司拥有全国银行间同业拆借资格，且与各主要商业银行保持着良好的业务合作关系，为公司通过货币市场及时融入资金提供了有力保障。截至 2021 年 12 月 31 日，公司共获得银行授信额度人民币 618 亿元，已使用额度为 159 亿元，未使用额度为 459 亿元。公司系 A 股上市券商，债务融资渠道畅通，具备面向市场筹措资金的能力。

# 八、投资状况

## （一）对外股权投资总体情况

适用  不适用

报告期投资额（元）	上年同期投资额（元）	变动幅度
90,000,000.00	-	不适用

报告期内，公司向全资子公司长城投资实缴增资 90,000,000.00 元。

## （二）报告期内获取的重大的股权投资情况

适用  不适用

## （三）报告期内正在进行的重大的非股权投资情况

适用  不适用

#### (四) 金融资产投资

##### 1、证券投资情况

√ 适用 □ 不适用

单位：元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
基金	009324.OF	长城中债 3-5 年国开行债券指数 A	640,212,271.11	公允价值计量	-	2,241,552.40	-	640,212,271.11	-	2,241,552.40	642,453,823.51	交易性金融资产	自有资金
债券	171126.SH	20 北京 13	504,962,200.00	公允价值计量	-	15,037,800.00	-	504,962,200.00	-	17,148,574.89	527,018,717.81	交易性金融资产	自有资金
基金	400006.OF	东方金账簿货币 B	400,000,000.00	公允价值计量	251,566,535.57	5,285,118.70	-	450,000,000.00	299,980,000.00	6,825,410.69	406,871,654.27	交易性金融资产	自有资金
基金	510050.OF	华夏上证 50ETF	364,465,495.45	公允价值计量	26,742,751.36	-7,865,689.72	-	2,057,931,295.64	1,719,806,135.53	-30,468,256.94	357,002,221.75	交易性金融资产	自有资金
基金	004373.OF	金鹰增益货币 B	350,000,000.00	公允价值计量	150,685,854.71	2,622,970.55	-	450,000,000.00	250,000,000.00	5,037,700.12	353,308,825.26	交易性金融资产	自有资金
债券	210009.IB	21 附息国债 09	313,249,272.71	公允价值计量	-	1,910,987.29	-	14,964,945,990.00	14,651,696,717.29	-3,150,964.64	316,065,425.75	交易性金融资产	自有资金
基金	003468.OF	富荣货币 B	300,000,000.00	公允价值计量	200,880,474.35	4,282,488.15	-	250,000,000.00	150,000,000.00	4,282,488.15	305,162,962.50	交易性金融资产	自有资金
基金	010603.OF	长城中债 5-10 年国开债指数 A	299,999,000.00	公允价值计量	-	148,646.82	-	299,999,000.00	-	148,646.82	300,147,646.82	交易性金融资产	自有资金
债券	173876.IB	21 四川 53	251,192,750.00	公允价值计量	-	1,048,500.00	-	251,192,750.00	-	1,070,760.27	253,665,907.53	交易性金融资产	自有资金
基金	310339.OF	申万菱信收益宝货币 B	250,000,000.00	公允价值计量	-	2,220,747.48	-	450,000,000.00	200,000,000.00	2,987,321.83	252,220,747.48	交易性金融资产	自有资金
期末持有的其他证券投资			30,133,077,134.82	-	24,633,262,729.60	236,684,645.70	78,275,682.09	808,541,086,485.36	802,532,558,471.58	1,707,208,560.84	30,822,789,497.06	-	--
合计			33,807,158,124.09	-	25,263,138,345.59	263,617,767.37	78,275,682.09	828,860,329,992.11	819,804,041,324.40	1,713,331,794.43	34,536,707,429.74	-	--
证券投资审批董事会公告披露日期			2021 年 4 月 13 日										
证券投资审批股东会公告披露日期			不适用										

##### 2、衍生品投资情况

□ 适用 √ 不适用

## （五）募集资金使用情况

### 1、募集资金总体使用情况

√ 适用 □ 不适用

单位：万元

募集年份	募集方式	募集资金总额	本期已使用募集资金总额	已累计使用募集资金总额	报告期内变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额比例	尚未使用募集资金总额	尚未使用募集资金用途及去向	闲置两年以上募集资金金额
2021年	公开发行公司债券	800,000.00	800,000.00	800,000.00	-	-	-	-	不适用	-
2021年	非公开发行证券公司次级债券	100,000.00	100,000.00	100,000.00	-	-	-	-	不适用	-
合计	-	900,000.00	900,000.00	900,000.00	-	-	-	-	-	-

#### 募集资金总体使用情况说明

经中国证监会《关于同意长城证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》（证监许可〔2020〕1461号）核准，同意公司采用分期发行的方式向专业投资者公开发行面值总额不超过人民币 70 亿元公司债券的注册申请。公司于 2021 年 1 月 18 日发行 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期），规模为人民币 10 亿元，利率为 3.57%，期限为 3 年。截至 2021 年 12 月 31 日，上述募集资金已全部用于补充公司营运资金，与发行债券时承诺的募集资金用途一致。

公司于 2020 年 8 月取得深交所《关于长城证券股份有限公司 2020 年证券公司次级债券符合深交所转让条件的无异议函》（深证函〔2020〕666 号），对公司申请确认发行面值合计不超过人民币 20 亿元的证券公司次级债券符合深交所转让条件，深交所无异议。公司于 2021 年 3 月 22 日发行 2021 年非公开发行次级债券（第一期），规模为人民币 10 亿元，利率为 4.25%，期限为 3 年。截至 2021 年 12 月 31 日，上述募集资金已全部用于补充公司营运资金，与发行债券时承诺的募集资金用途一致。

经中国证监会《关于同意长城证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》（证监许可〔2021〕1276 号）核准，同意公司采用分期发行的方式向专业投资者公开发行面值总额不超过人民币 100 亿元公司债券的注册申请。公司于 2021 年 5 月 21 日发行 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期），规模为人民币 20 亿元，其中品种一规模为人民币 14 亿元，利率为 3.39%，期限为 3 年，品种二规模为人民币 6 亿元，利率为 3.20%，期限为 2 年；于 2021 年 6 月 21 日发行 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期），规模为人民币 10 亿元，利率为 3.67%，期限为 3 年；于 2021 年 7 月 23 日发行 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期），规模为人民币 20 亿元，其中品种一规模为人民币 10 亿元，利率为 3.07%，期限为 2 年，品种二规模为人民币 10 亿元，利率为 3.24%，期限为 3 年；于 2021 年 9 月 22 日发行 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期），规模为人民币 20 亿元，其中品种一规模为人民币 13 亿元，利率为 3.30%，期限为 3 年，品种二规模为人民币 7 亿元，利率为 3.69%，期限为 5 年。截至 2021 年 12 月 31 日，上述募集资金已全部用于补充公司营运资金，与发行债券时承诺的募集资金用途一致。

## 2、募集资金承诺项目情况

适用  不适用

单位：万元

承诺投资项目和超募资金投向	是否已变更项目(含部分变更)	募集资金承诺投资总额	调整后投资总额(1)	本报告期投入金额	截至期末累计投入金额(2)	截至期末投资进度(3)= (2)/(1)	项目达到预定可使用状态日期	本报告期实现的效益	是否达到预计效益	项目可行性是否发生重大变化
承诺投资项目										
补充公司营运资金	否	900,000.00	900,000.00	900,000.00	900,000.00	100.00%	不适用	不适用	不适用	否
承诺投资项目小计	--	900,000.00	900,000.00	900,000.00	900,000.00	--	--	不适用	--	--
合计	--	900,000.00	900,000.00	900,000.00	900,000.00	--	--	--	--	--
未达到计划进度或预计收益的情况和原因(分具体项目)					不适用					
项目可行性发生重大变化的情况说明					无					
超募资金的金额、用途及使用进展情况					不适用					
募集资金投资项目实施地点变更情况					不适用					
募集资金投资项目实施方式调整情况					不适用					
募集资金投资项目先期投入及置换情况					不适用					
用闲置募集资金暂时补充流动资金情况					不适用					
项目实施出现募集资金结余的金额及原因					不适用					
尚未使用的募集资金用途及去向	截至 2021 年 12 月 31 日, 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)、2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)、2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)、2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)、2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)募集资金专户余额均为 0 元; 2021 年非公开发行次级债券(第一期)募集资金专户余额为 45,080.10 元, 为募集资金留存期间产生的利息收入。									
募集资金使用及披露中存在的问题或其他情况					无					

## 3、募集资金变更项目情况

适用  不适用

## 九、重大资产和股权出售

### (一) 出售重大资产情况

适用  不适用

### (二) 出售重大股权情况

适用  不适用

## 十、主要控股参股公司分析

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	总资产	净资产	营业总收入	营业利润	净利润
深圳市长城长富投资管理有限公司	子公司	设立私募基金，筹集并管理募集资金进行对外投资；使用自有资金投资于本公司或下设机构设立的私募基金；为客户提供私募基金相关的财务顾问服务	600,000,000.00	637,324,503.95	629,774,941.14	16,642,572.64	4,889,647.84	3,203,665.30
深圳市长城证券投资有限公司	子公司	股权投资、金融产品投资和其他另类投资业务	1,000,000,000.00	685,819,392.43	662,975,482.26	49,648,101.05	15,114,762.79	10,938,307.14
宝城期货有限责任公司	子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询和资产管理	600,000,000.00	9,025,186,567.80	1,287,471,374.01	3,488,143,717.17	247,808,300.12	185,330,251.73
长城基金管理有限公司	参股公司	基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务	150,000,000.00	2,253,224,737.14	1,657,859,367.90	1,037,765,890.19	243,761,225.14	165,000,372.69
景顺长城基金管理有限公司	参股公司	证券投资基金的募集和管理、特定客户资产管理计划的销售和管理及投资顾问业务	130,000,000.00	5,175,827,650.00	3,116,315,945.00	4,520,264,470.00	1,858,373,876.00	1,402,144,962.00

报告期内取得和处置子公司的情况

√ 适用 □ 不适用

公司名称	报告期内取得和处置子公司方式	对整体生成经营和业绩的影响
南京长茂宏懿投资管理有限公司	清算	无重大影响

详见本报告“第十节 财务报告”之附注“六、合并范围的变更”相关内容。

主要控股参股公司情况说明：

### 1、景顺长城基金管理有限公司

景顺长城为本公司的参股公司，本公司持有其49%的股权。本年度景顺长城营业收入和净利润较上年分别增长70.07%、70.67%，主要系旗下基金业绩整体表现优异，公司整体管理规模提升，带动公司营业收入同比增长。

### 2、长城基金管理有限公司

长城基金为本公司的参股公司，本公司持有其47.059%的股权。本年度长城基金营业收入和净利润较上年分别增长16.42%、3.99%，主要系旗下基金产品整体业绩良好，基金净值持续增长，公司资产管理规模稳步提升，带动公司营业收入同比增长。

### 3、宝城期货有限责任公司

宝城期货为本公司的控股子公司，本公司持有其80%股权。宝城期货下设一家控股子公司华能宝城物华，主要从事动力煤套期保值、现货贸易等产融结合业务。本年度宝城期货营业收入较上年增长16.14%，净利润较上年增加139.44%，主要系经纪业务收入增加及子公司业务增长。

### 4、深圳市长城证券投资有限公司

长城投资为本公司全资子公司。本年度长城投资营业收入较上年减少8.57%，主要系公司金融产品投资整体浮盈较上年度减少。

### 5、深圳市长城长富投资管理有限公司

长城长富为本公司全资子公司。本年度长城长富营业收入较上年增长9.00%，主要系本年度公司在持股权益基金浮盈增加。

## 十一、公司控制的结构化主体情况

适用  不适用

公司综合考虑合并报表范围内公司合计享有结构化主体的可变回报等因素，认定将 64 个结构化主体纳入合并报表范围。

## 十二、公司未来发展的展望

### （一）发展环境与行业趋势

1、稳字当头，经济稳增长基础上推动高质量发展。疫情冲击下，百年变局正在加速演进。2022年在“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力下，“稳字当头、稳中求进”且“政策发力适当靠前”将是总政策基调，预计财政政策更加积极，货币政策的结构性进一步加强。我国经济在“双循环”新发展格局、“双碳”目标、共同富裕的长期战略规划导向下，有望启动新一轮供需结构的全面优化，在保障经济稳定的基础上，走出一条高质量发展之路。

2、深化改革，多层次资本市场建设服务国家战略。新发展理念将进一步引领特色化、多层次资本市场建设，资产端与资金端政策将加快实施与落地，助力社会融资结构改善、资源配置效率提升。在资产端，资本市场将围绕上市公司质量改善、注册制全面实施、基础制度体系完善等持续发力，并借助“红绿灯”制度引导资本有序发展，强化服务实体经济的能力。在资金端，随着国民投资理财需求的持续增长及海外资金的热情高涨，资本市场将进一步推动金融产品创新，同时推进高水平双向开放。通过供需两端发力，资本市场将加大对国家战略的服务支持，在推进科技创新、绿色转型、产业数字化及共同富裕建设上更好地发挥资本力量。

3、潜能释放，证券行业将迎来新一轮增量窗口。2022年是资本市场深化改革大年，券商将直接受益于注册制改革、多层次资本市场建设、促进直接融资发展等政策利好，持续释放金融服务实体经济的潜能。券商密集通过再融资“补血”，资本中介业务将迎来高速发展，倒逼券商不断提升资本实力、专业能力、协同能力。长远来看，财富管理赛道的价值重估、细分特色领域的开拓、ROE的长期持续提升等是证券行业值得重点关注的核心变量。同时，不少券商加大金融科技的投入力度，推动业务与管理层面的数字化转型，部分券商通过“部落制”改革推动组织模式与经营模式的创新，将给证券行业发展带来

更多改进与提升的空间。

4、服务产融，积极把握新能源发展及“双碳”机遇。中央经济工作会议再次为我国“双碳”工作开展进行了谋划和部署。2022年，助力“双碳”战略仍然是金融体系服务实体经济的重要内容，预计绿色金融顶层设计将进一步完善，绿色债券产品标准、绿色资产证券化产品、碳汇产品体系等都将进一步丰富。金融机构有望凭借专业能力与资源优势，围绕新能源革命、技术革命、电网革命等，通过产融发展新模式，助力“双碳”目标达成。

## （二）公司未来发展战略

面对百年未有之大变局，站在“两个一百年”的历史交汇点，公司深入贯彻和学习中央“十四五”规划精神，立足新起点、新形势、新格局，总结26年来发展经验，回顾“十三五”期间取得的发展成绩，集全公司之力高标准编制了公司“十四五”战略规划。在公司“十四五”战略规划指引下，公司将坚持贯彻“安全”“领先”指导思想，完整、准确、全面贯彻新发展理念，以成为更具责任和价值的金融企业为核心使命，奋力推进公司“十四五”战略规划各项目标及工作任务，以科创金融、绿色金融、产业金融为主要特色，聚焦“数字券商、智慧投资、科创金融”，以数字化、平台化、专业化、产业化四大建设，全面推动质量变革、效率变革、动力变革，全面增强公司竞争力、创新力和抗风险能力，向“创建精于电力、能源领域的特色化一流证券公司”愿景目标奋勇前进。

## （三）2022 年度经营计划

1、坚守金融服务实体经济宗旨，坚持稳中求进发展总基调，实现八个“见效”，切实推进“十四五”战略规划出实绩、见实效：（1）完成再融资发行，补充资本实力要见效；（2）瞄准分类评价保A常态化，安全领先要见效；（3）提升业务核心竞争力，专业化特色化要见效；（4）加速产业金融转型，产业化发展要见效；（5）全盘推动金融科技部署，数字化转型要见效；（6）深化组织模式变革，“一平台多中心”要见效；（7）强化队伍建设，打造高质量人才体系要见效；（8）构建党建新格局，党建引领高质量发展要见效。

2、五大业务板块坚持“以客户为中心”，持续打造专业化、特色化核心竞争力。（1）财富管理业务：继续深化转型，持续巩固信用业务发展优势、丰富优质金融产品货架、提高获客能力，力保重点业务行业排名提升，积极培育细分领域或重点赛道的冠军业务；（2）投资银行业务：坚持“两个聚焦”，大力加强股权业务发展，巩固债券业务发展，借助数字化平台，挖掘专精特新产业机会，强化公司特色化发展的核心驱动力；（3）资产管理业务：扎实推进投研实力、产品策略、客户渠道以及ESG投研系统建设，长期打造长城系资产管理品牌形象，成为连接公司资金端与资产端的腰部力量；（4）证券投资及交易业务：持续加强智慧投资能力建设，坚持多元化投资策略，提高穿越周期的可持续增长能力；（5）机构业务：持续探索协同发展模式，为实现公司投资交易、托管外包、机构经纪等业务共同增长提供重要支撑。

3、子公司着力提升平台赋能能力，打造具有竞争力且形成良好协同的发展体系。

## （四）公司可能面对的风险

针对自身特点，遵循关联性和重要性原则，公司主要面临的重大风险因素有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等。具体如下：

## 1、市场风险

市场风险是指因市场价格、利率、汇率等变动而导致公司表内和表外业务面临潜在损失的风险。公司涉及市场风险的业务主要包括权益类证券投资、固定收益类证券投资、衍生品投资等。市场风险管理的措施包括：

(1) 根据公司风险偏好，确定公司总体的容忍度和风险限额。通过将公司整体的风险限额分配至各业务线及业务部门、内部控制部门监督执行、重大风险及时评估与报告等方式控制公司总体的市场风险水平在合适范围内。

(2) 根据业务性质与风险属性，建立正面清单或负面清单实现证券名单管理，并定期维护更新。

(3) 根据业务开展和风险管理需要对持有的头寸进行风险对冲；设置止损限额，及时止损。

(4) 完善压力测试模型、组织压力测试、对测试结果进行分析、运用，并为对公司有重大影响的情形指定应急处理方案，提出对相关政策和程序进行改进的建议。

(5) 通过一系列测量方式估计可能的市场风险损失，建立具有层次性、全面性、针对性和权威性的市场风险指标体系，从而对公司整体风险和各业务部门局部风险进行清晰揭示，有效评估全公司市场风险。

(6) 业务部门密切监控本部门市场风险指标，定期向风险管理部通报本部门市场风险管理的总体状况，并及时通报重大市场风险事件。

## 2、信用风险

信用风险是指交易对手或债务工具融资人不愿或无力履行合同条件而构成违约，致使公司遭受损失的风险。公司面临的信用风险主要来自于债券投资业务、融资融券业务、股票质押式回购及衍生品交易业务等。信用风险管理的措施包括：

(1) 根据经营战略、业务特点、客户特点和总体风险偏好，在充分考虑信用风险与市场风险、流动性风险相互影响与转换的基础上，确定公司可承受的信用风险水平。

(2) 完善公司内部评级体系，严格业务准入，根据风险承受能力、资金供应能力和客户信用风险水平，对客户统一核定授信额度，并在授信额度内开展授信业务。

(3) 建立健全各业务口的履约保障管理机制，在授信业务中采用单一或组合使用合格抵质押品、净额结算、保证和信用衍生工具方式转移或降低授信业务信用风险。

(4) 对公司信用风险进行监控、预警，基于公司各类风险敞口全面分析信用风险，完善信用风险信息传递和汇报机制，保证各类信用风险信息能以可理解的方式及时、合理、准确地在各部门及管理层流动、传递和汇总。

## 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。公司制定了《流动性风险管理办法》和《流动性风险应急处理实施细则》，明确公司资金流动性风险管理的总体目标、管理模式、组织职责以及流动性风险识别、计量、监测和控制的方法和程序。流动性风险管理的措施包括：

(1) 实施限额管理，根据业务规模、性质、复杂程度、流动性风险偏好和市场变化情况等，设定流动性风险限额并进行监控。公司每年对流动性风险限额进行一次评估，必要时进行调整。

(2) 建立现金流测算和分析框架，有效计量、监测和控制正常和压力情景下未来不同时间段的现金流缺口。加强日间流动性管理，确保具有充足的日间流动性头寸和相关融资安排，及时满足正常和压力情景下的日间支付需求，并对异常情况及时预警。

(3) 建立健全流动性风险压力测试机制，定期根据市场及公司经营变化情况对流动性风险控制指标进行压力测试，分析其承受短期和中长期压力的能力，及时制定融资策略。

(4) 持有充足的优质流动性资产，确保在压力情景下能够及时满足流动性需求。强化融资抵（质）押品管理，确保其能够满足正常和压力情景下日间和不同期限融资交易的抵（质）押品需求，并且能够及时履行向相关交易对手返售抵（质）押品的义务。

(5) 完善融资策略，提高融资来源的多元化和稳定程度。

#### 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。操作风险管理的措施包括：

(1) 推进重点业务流程梳理，完善业务审查机制，逐步建立操作风险三大工具（RCSA、KRI和LDC）应用场景及机制、闭环管理机制，加强操作风险文化建设，全面提升操作风险管理水平。

(2) 梳理公司各项管理及审批权限，明确公司内部授权审批的内容、方式及节点，完善公司授权管理体系。

(3) 关注并收集外部监管条例，及时更新公司监测指标和控制措施。

(4) 进行日常操作风险监控，定期检查并分析各部门操作风险的管理情况，确保操作风险制度和措施得到贯彻落实；及时向出现操作风险的部门出示预警提示书，通知其及时作出相应的风险处理。

(5) 跟踪风险事件处理进展和结果，以风险周报、月报的形式向公司领导汇报。将行业和公司内部的操作风险案例进行收集和整理，形成风险事件库，定期分析比对，优化内部管理。

#### 5、合规风险

合规风险是指公司或工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规和准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。合规风险管理的措施如下：

(1) 加强事前风险防范。公司通过制度建设、合规培训与宣导等方式，倡导和推进合规经营的合规文化建设，培育全体工作人员合规意识，提升合规管理人员职业荣誉感和专业化、职业化水平；进一步加强与完善合规管理系统建设，加大投入促进信息化建设，丰富风险防范的监测手段和措施，严把风险准入关，控制和减少各类风险事件；积极参与新业务、新方案，实现风控合规前置，有力防范合规风险的发生。

(2) 加强事后合规检查。公司通过合规检查与调查及时发现违法违规行为，并按照监管要求与公司制度相关规定报告，及时纠正违法违规情况。在监管风险发生前，采用内部检查与调查、采取合规措施如发送合规提示函、通报、谈话等方式进行防范。

(3) 加大责任追究力度。对监管部门或自律组织下发的函件，公司及分支机构、子公司针对检查发现的问题，立即召开专题会议，认真反省，吸取教训，研究制定相关整改方案及改进措施，逐项落实整改，并对相关责任人进行责任追究。

### 十三、报告期内接待调研、沟通、采访等活动

接待时间	接待地点	接待方式	接待对象类型	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料	调研的基本情况索引
2021 年 4 月 21 日	公司	网络沟通	个人、机构	公众投资者	2020 年年度报告交流	《2021 年 4 月 21 日投资者关系活动记录表》(编号: 2021-001), 网址: 互动易 ( <a href="http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-04-22/1209770014.PDF">http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-04-22/1209770014.PDF</a> )
2021 年 8 月 23 日	公司	实地调研	机构	华泰证券南方基金	战略规划、股东协同、业务发展情况、控参股公司管理等	《2021 年 8 月 23 日投资者关系活动记录表》(编号: 2021-002), 网址: 互动易 ( <a href="http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-08-24/1210841836.PDF">http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-08-24/1210841836.PDF</a> )
2021 年 9 月 7 日	公司	实地调研	机构	国泰君安	战略规划、非公开发行等	《2021 年 9 月 7 日投资者关系活动记录表》(编号: 2021-003), 网址: 互动易 ( <a href="http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-09-08/1210987738.PDF">http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-09-08/1210987738.PDF</a> )
2021 年 11 月 15 日	公司	实地调研	机构	安信证券	战略规划、业务发展情况、非公开发行等	《2021 年 11 月 15 日投资者关系活动记录表》(编号: 2021-004), 网址: 互动易 ( <a href="http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-11-17/1211613974.PDF">http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-11-17/1211613974.PDF</a> )
2021 年 11 月 25 日	公司	实地调研	机构	信达证券天弘基金	业务发展情况、控参股公司管理、战略规划等	《2021 年 11 月 25 日投资者关系活动记录表》(编号: 2021-005), 网址: 互动易 ( <a href="http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-11-29/1211722223.PDF">http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-11-29/1211722223.PDF</a> )
2021 年 11 月 30 日	公司	网络沟通	个人、机构	公众投资者	2021 年公司经营发展情况交流	《2021 年 11 月 30 日投资者关系活动记录表》(编号: 2021-006), 网址: 互动易 ( <a href="http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-12-01/1211763776.PDF">http://static.cninfo.com.cn/finalpage/2021-12-01/1211763776.PDF</a> )

此外，报告期内，公司根据已披露信息，及时回复深交所“互动易”平台投资者提问115则，通过投资者咨询电话（0755-83516072）及投资者咨询邮箱（cczqir@cgws.com）回答投资者各类咨询228次。

## 第四节 公司治理

### 一、公司治理的基本状况

公司严格按照《公司法》《证券法》《证券公司治理准则》《上市公司治理准则》《股票上市规则》《主板规范运作指引》等相关法律法规、规范性文件的规定，建立了由股东大会、董事会、监事会、经营管理层组成的法人治理结构，形成了权责明确、运作规范、相互协调、相互制衡的机制。

报告期内，公司持续加强股东大会、董事会、监事会（以下简称“三会”）规范运作，制定或修订了一系列制度，进一步为公司法人治理结构的规范化运行提供了制度保证；公司按照《公司法》《公司章程》等规定召集、召开“三会”会议，公司“三会”运作规范透明，决议合法有效；公司严格履行信息披露义务，真实、准确、完整、及时、公平地披露信息，保障全体股东的知情权并公平获得信息。

报告期内，公司组织召开股东大会 3 次、董事会会议 10 次、监事会会议 5 次，会议的召集、提案、通知、召开、表决和决议等环节均依法运作、规范有效，充分发挥了各层级的决策或监督作用。报告期内，公司共召开董事会战略与发展委员会会议 2 次、董事会风险控制与合规委员会会议 4 次、董事会审计委员会会议 9 次、董事会薪酬考核与提名委员会会议 6 次，各专门委员会针对重大事项提供了专业意见，对提高董事会的科学决策水平、提升董事会的工作质量起到了重要作用。同时，公司高度重视独立董事在董事会决策中提出的专业建议和发挥的监督作用，在可能影响中小投资者权益的重要事项上充分听取了独立董事意见。

#### （一）股东与股东大会

股东大会是公司的权力机构，股东通过股东大会行使权利。公司股东大会的召集、召开、提案、表决、决议、记录以及决议的执行等事项均严格遵守法律法规、规范性文件、《公司章程》和《股东大会议事规则》等相关规定，切实保证股东大会依法规范地行使职权，确保所有股东、特别是中小股东能够充分行使自己的权利。

#### （二）董事与董事会

公司严格按照《公司章程》的规定聘任和变更董事，董事人数和人员构成均符合法律法规的要求，独立董事比例符合规定。公司董事会能够不断完善董事会议事规则，董事会会议的召集、召开及表决程序合法有效，决策程序和议事规则规范透明。公司董事会设立了战略与发展委员会、风险控制与合规委员会、审计委员会和薪酬考核与提名委员会 4 个专门委员会，并制订了相应的工作细则，明确了各委员会的权责、决策程序和议事规则。公司制定了《独立董事工作制度》，独立董事能够独立客观地维护公司及股东的合法权益，并在董事会进行决策时起到制衡作用。公司制定了《董事会秘书工作细则》，董事会秘书负责公司股东大会、董事会、董事会专门委员会会议的筹备，会议记录和会议文件的保管，信息披露及投资者关系管理等事务。

#### 1、董事会的组成

公司设董事会，董事会对股东大会负责。根据《公司章程》规定，公司董事会由 12 名董事组成，其中非独立董事 8 名，独立董事 4 名。董事由公司股东大会选举产生，每届任期 3 年，任期届满时可连选连任，独立董事的连任时间不得超过 6 年。

## 2、董事会的职责

董事会是公司的经营决策机构，根据《公司章程》规定，董事会主要行使下列职权：召集股东大会，并向股东大会报告工作；执行股东大会的决议；决定公司的经营计划和投资方案；制订公司的年度财务预算、决算方案；制订公司的利润分配方案和弥补亏损方案；制订公司增加或者减少注册资本、发行债券或其他证券及上市方案；拟定公司重大收购、收购本公司股票或者合并、分立、解散及变更公司形式的方案；在股东大会授权范围内，决定公司对外投资、收购出售资产、资产抵押、对外担保事项、关联交易等事项；决定公司内部管理机构的设置；聘任或者解聘公司总裁、合规负责人、董事会秘书；根据总裁的提名，聘任或者解聘公司副总裁、财务负责人等高级管理人员，并决定其报酬事项和奖惩事项；制订公司的基本管理制度；制订《公司章程》的修改方案；管理公司信息披露事项；向股东大会提请聘请或更换为公司审计的会计师事务所；听取公司总裁的工作汇报并检查总裁的工作；审议公司按照监管要求定期提交的合规报告；制订公司董事薪酬的数额和发放方式的方案；决定公司因《公司章程》第二十六条第一款第（三）项、第（五）项、第（六）项规定的情形收购本公司股份；法律、行政法规、部门规章或《公司章程》规定，以及股东大会授予的其他职权。

### （三）监事和监事会

公司严格按照法律法规、规范性文件和《公司章程》的规定聘任和变更监事，监事人数和人员构成均符合法律法规的要求。公司监事会能够不断完善监事会议事规则，监事会会议的召集、召开、提案、表决、决议等程序合法有效。

#### 1、监事会的组成

公司设监事会。根据《公司章程》规定，公司监事会由 5 名监事组成，其中 3 名为股东代表监事，由公司股东大会选举产生，2 名为职工代表监事，由公司职工通过职工代表大会、职工大会或者其他形式民主选举产生。监事每届任期 3 年，任期届满可连选连任。

#### 2、监事会的职责

根据《公司章程》规定，监事会行使下列职权：应当对董事会编制的公司定期报告进行审核并提出书面审核意见；检查公司财务；对董事、高级管理人员执行公司职务的行为和履行合规管理职责的情况进行监督，对发生重大合规风险负有主要责任或领导责任或者违反法律、行政法规、《公司章程》或者股东大会决议的董事、高级管理人员提出罢免的建议；当董事、高级管理人员的行为损害公司的利益时，要求董事、高级管理人员予以纠正；提议召开临时股东大会，在董事会不履行《公司法》规定的召集和主持股东大会职责时召集和主持股东大会；向股东大会提出提案；依照《公司法》第一百五十一条的规定，对董事、高级管理人员提起诉讼；发现公司经营情况异常，可以进行调查，必要时，可以聘请会计师事务所、律师事务所等专业机构协助其工作，费用由公司承担；制订公司监事薪酬的数额和发放方式的方案；法律、行政法规和《公司章程》规定的其他职权。

#### （四）党委

公司设立党委。党委设书记 1 名，由董事长担任；设副书记 2 名、其他委员若干名。公司党委根据《中国共产党章程》《中国共产党国有企业基层组织工作条例（试行）》等党内法规履行职责，承担全面从严治党主体责任，贯彻落实新时代党的建设总体要求和新时代党的组织路线，依照规定讨论和决定公司重大事项，支持股东大会、董事会、监事会和经营管理层依法依章程行使职权，发挥把方向、管大局、促落实的领导作用，通过权责法定、权责透明、协调运转、有效制衡的公司治理机制，推动党的主张和重大决策转化为公司实际行动，确保党的理论和路线方针政策在公司得到全面贯彻落实。董事会决定公司重大问题，应当事先听取公司党委的意见。

#### （五）经营管理层

公司经营管理层含总裁、副总裁、合规总监、财务负责人、董事会秘书、首席信息官等高级管理人员，高级管理人员由董事长或总裁提名，由董事会决议聘任或解聘。公司严格按照《公司章程》的规定聘任和变更高级管理人员，公司经营管理层产生的程序符合《公司法》和《公司章程》的规定，崔学峰先生的证券公司高级管理人员任职备案程序尚待完成，公司其他高级管理人员均已取得相关任职资格批复或已完成任职备案程序。根据《公司章程》规定，总裁作为经营管理的主要负责人，对董事会负责，行使下列职权：主持公司的日常经营管理工作，组织实施董事会决议，并向董事会报告工作；组织实施公司年度经营计划和投资方案；拟订公司内部管理机构设置方案；拟订公司的基本管理制度；制订公司的具体规章；提请董事会聘任或者解聘公司副总裁、财务负责人及其他高级管理人员（合规总监、董事会秘书除外）；决定聘任或者解聘除应由董事会决定聘任或者解聘以外的其他管理人员；提议召开董事会临时会议；支持合规总监及合规部门工作，督促下属各单位为合规管理人员履职提供有效保障；《公司章程》或董事会授予的其他职权。

公司总裁办公会下设信用业务审核委员会、预算管理委员会、资产负债管理委员会、风险控制与安全运营委员会、股票期权经纪业务审核委员会、信息科技管理委员会、自营业务执行委员会、财富管理委员会、投资银行业务执行委员会 9 个专业委员会，强化了管理层决策的专业性、合规性和科学性。

#### （六）董事长及总裁

公司董事长与总裁分设，以提高各自职责的独立性、可问责性以及权力和授权的分布平衡，并充分发挥决策层对执行层的监督制约机制。董事长与总裁各司其职，根据《公司章程》规定，董事长为公司的法定代表人，行使主持股东大会和召集、主持董事会会议，督促、检查董事会决议的执行等职权。总裁作为经营管理的主要负责人，对董事会负责，行使相关经营管理职权。

#### （七）信息披露工作

公司严格按照《股票上市规则》《主板规范运作指引》和公司《信息披露管理制度》等相关规定，持续完善公司信息披露工作机制，优化信息披露管理流程，提升公司信息披露质量，加强公司对外披露信息的管控力度。报告期内，公司积极履行相关信息披露义务，严格通过指定信息披露媒体发布公司相关信息，共披露了 207 份公告文件（公告编号 2021-001 至 2021-089），充分披露了可能对公司股票价格产生重大影响各类重大信息。公司披露的信息真实、准确、完整、及时、公

平，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏等任何违反信息披露相关规定的情形，提高了公司的透明度，保障了投资者的知情权。

## （八）投资者关系管理

公司投资者关系管理工作持续多渠道、全方位扎实推进。报告期内，公司举办了年度报告网上业绩说明会，积极参加了深圳辖区上市公司投资者网上集体接待日活动，并通过投资者咨询电话（0755-83516072）、投资者咨询邮箱（cczqir@cgws.com）、传真（0755-83516244）保障投资者与公司日常交流沟通渠道畅通，通过深交所“互动易”交流平台及时回复全部 115 则投资者提问，并指定专人负责投资者关系管理工作，确保投资者能够与公司充分交流，帮助投资者全面、客观了解公司情况，正确引导市场预期。

公司治理的实际状况与法律、行政法规和中国证监会发布的关于上市公司治理的规定是否存在重大差异

是  否

## 二、公司相对于控股股东、实际控制人在保证公司资产、人员、财务、机构、业务等方面的独立情况

公司自设立以来，严格按照《公司法》《证券法》和《公司章程》及其他法律法规和规章制度的要求规范运作，在资产、人员、财务、机构、业务等方面均独立于公司的控股股东、实际控制人及其控制的其他企业，具备独立完整的业务体系及面向市场自主经营的能力，具体体现在以下几个方面：

### （一）资产独立完整情况

公司完整拥有房屋、办公设备、商标等资产，不存在以公司资产、权益或信用为控股股东、实际控制人及其控制的其他企业的债务提供担保的情况，也不存在资产、资金被控股股东、实际控制人及其控制的其他企业占用而损害公司利益的情况。

### （二）人员独立完整情况

公司的经营和行政管理完全独立于公司控股股东、实际控制人及其控制的其他企业，拥有独立的劳动、人事、工资等管理体系及独立的员工队伍，员工工资发放、福利支出与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业严格分离。

公司董事、监事、高级管理人员均严格按照《公司法》《公司章程》及其他法律、法规和规范性文件规定的程序推选和任免，公司的董事（包括独立董事）、非职工监事以及总裁、副总裁、合规总监、董事会秘书、首席信息官等高级管理人员均由公司股东大会、董事会或监事会依法选举产生或者聘任，职工监事由公司职工代表大会民主选举产生，不存在股东超越公司董事会、监事会、职工代表大会和股东大会作出任免决定的情形，不存在有关法律、法规禁止的兼职情况。公司总裁、副总裁、合规总监、董事会秘书、首席信息官等高级管理人员均专职在公司工作并领取报酬，未在公司股东单位兼职，不存在交叉任职的情况，亦没有在与公司业务相同或相近的其他企业任职的情况；公司财务人员亦未在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业中兼职。

### （三）财务独立完整情况

公司已设立独立的财务部门，配备专门的财务人员，并根据现行会计制度和准则建立了独立的核算体系和财务管理制度，

独立进行财务决策，具有规范、独立的财务会计制度和内部控制制度。本公司独立在银行开立账户，不存在与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业共用银行账户的情形，不存在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业任意干预公司资金运用及占用公司资金的情况。公司具有独立的纳税人资格，依法独立进行纳税登记、纳税申报和履行纳税义务，不存在与股东单位混合纳税的情况。截至报告期末，公司不存在资金被控股股东、实际控制人及其控制的其他企业以借款、代偿债务、代垫款项或者其他方式占用的情形，不存在为公司股东及其控制的其他企业提供担保的情形。

#### （四）机构独立完整情况

公司依照《公司法》和《公司章程》设立了股东大会、董事会、监事会等权力、决策及监督机构，建立了符合自身经营特点、独立完整的内部经营管理机构，各机构严格依照《公司法》《公司章程》以及公司各项规章制度的规定行使职权。

公司在经营和管理机构方面与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业完全分开，不存在混合经营、合署办公的情形，不存在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业干预公司机构设置的情况。公司控股股东、实际控制人及其控制的其他企业各职能部门与公司各职能部门之间不存在任何上下级关系，不存在控股股东、实际控制人及其控制的其他企业直接干预公司经营的情况。

#### （五）业务独立完整情况

公司主要从事经中国证监会批准的各项证券业务，与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业之间不存在竞争关系或业务依赖情况，拥有独立完整的业务经营体系，具有面向市场独立开展业务的能力，与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业间不存在显失公平的关联交易。

公司的业务发展规划、目标等均由公司自主决定，不存在受公司控股股东、实际控制人及其控制的其他企业控制的情形。

### 三、同业竞争情况

适用  不适用

### 四、报告期内召开的年度股东大会和临时股东大会的有关情况

#### （一）本报告期股东大会情况

会议届次	会议类型	投资者参与比例	召开日期	披露日期	会议决议
2020 年度股东大会	年度股东大会	71.98%	2021 年 6 月 21 日	2021 年 6 月 22 日	披露网址：巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)，公告名称：《2020 年度股东大会决议公告》，公告编号：2021-033。
2021 年第一次临时股东大会	临时股东大会	73.96%	2021 年 8 月 13 日	2021 年 8 月 14 日	披露网址：巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)，公告名称：《2021 年第一次临时股东大会决议公告》，公告编号：2021-051。
2021 年第二次临时股东大会	临时股东大会	72.54%	2021 年 12 月 27 日	2021 年 12 月 28 日	披露网址：巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)，公告名称：《2021 年第二次临时股东大会决议公告》，公告编号：2021-088。

(二) 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

五、董事、监事和高级管理人员情况

(一) 基本情况

报告期内，公司董事、监事和高级管理人员均不存在持有公司股份、股票期权、限制性股票及相关增减变动情况。

姓名	职务	任职状态	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期
张巍	党委书记、董事长	现任	男	51	2020年10月30日	本届董事会换届之日
周朝晖	副董事长	现任	男	50	2020年10月30日	本届董事会换届之日
段一萍	董事	现任	女	46	2020年6月22日	本届董事会换届之日
段心焯	董事	现任	女	45	2019年4月25日	本届董事会换届之日
祝建鑫	董事	现任	男	46	2015年6月19日	本届董事会换届之日
陆小平	董事	现任	男	59	2020年10月30日	本届董事会换届之日
苏敏	董事	现任	女	53	2020年10月30日	本届董事会换届之日
彭磊	董事	现任	女	49	2015年3月31日	本届董事会换届之日
马庆泉	独立董事	现任	男	72	2016年6月21日	2022年6月20日
王化成	独立董事	现任	男	58	2016年7月1日	2022年6月30日
何捷	独立董事	现任	男	46	2015年8月19日	股东大会选举产生新任独立董事之日
李建辉	独立董事	现任	男	52	2016年10月31日	2022年10月30日
米爱东	监事会主席	现任	女	53	2015年3月31日	本届监事会换届之日
顾文君	监事	现任	女	39	2020年10月30日	本届监事会换届之日
李晓霏	监事	现任	男	51	2015年7月15日	本届监事会换届之日
曾晓玲	职工监事	现任	女	46	2020年10月30日	本届监事会换届之日
许明波	职工监事	现任	男	50	2020年10月30日	本届监事会换届之日
李翔	总裁、党委副书记	现任	男	53	2019年4月3日	聘任期满之日
	财务负责人	现任			2020年10月30日	聘任期满之日
崔学峰	党委副书记、副总裁	现任	男	57	2021年5月31日	聘任期满之日
何青	党委委员、副总裁	现任	女	53	2016年9月5日	聘任期满之日
徐浙鸿	副总裁	现任	女	52	2017年7月19日	聘任期满之日
曾贲	党委委员、副总裁	现任	男	46	2019年6月28日	聘任期满之日
韩飞	党委委员、副总裁	现任	男	47	2019年8月21日	聘任期满之日
吴礼信	董事会秘书	现任	男	52	2015年3月31日	聘任期满之日
赵昕倩	合规总监	现任	女	39	2020年10月30日	聘任期满之日
	首席风险官	现任			2020年10月30日	聘任期满之日
徐楠	首席信息官	现任	男	40	2021年8月19日	聘任期满之日

1、报告期是否存在任期内董事、监事离任和高级管理人员解聘的情况

是  否

## 2、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	类型	日期	原因
崔学峰	副总裁	聘任	2021 年 5 月 31 日	经公司第二届董事会第六次会议审议通过，聘任崔学峰先生为公司副总裁。
徐楠	首席信息官	聘任	2021 年 8 月 19 日	经公司第二届董事会第八次会议审议通过，聘任徐楠先生为公司首席信息官。

### (二) 任职情况

#### 1、公司现任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历以及目前在公司的主要职责

##### (1) 董事会成员

**张巍**先生，1970 年 12 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，教授级高级工程师，中共党员，现任公司党委书记、董事长。1992 年 6 月至 1993 年 11 月，任北京动力经济学院教务处干部；1993 年 11 月至 2001 年 9 月，历任中国电力企业联合会教育培训部干部、主任科员；2001 年 9 月至 2002 年 12 月，任中国华能集团公司市场营销部主管；2002 年 12 月至 2006 年 3 月，历任华能国际电力股份有限公司营销部高级工程师、营销一处副处长、综合处副处长（主持工作）；2006 年 3 月至 2011 年 11 月，历任华能资本总经理工作部副经理、副经理（主持工作）、经理；2008 年 11 月至 2012 年 4 月，任长城有限董事；2011 年 11 月至 2014 年 8 月，历任华能财务党组成员、纪检组长，党组成员、副总经理；2014 年 8 月至 2019 年 7 月，历任华能碳资产经营有限公司党组成员、副总经理，党组书记、总经理，党委书记、总经理，党委副书记、总经理（其间：2016 年 12 月至 2019 年 1 月，挂职四川省科技厅任党组成员、副厅长（正厅级）；2017 年 9 月至 2018 年 12 月，任四川发展（控股）有限责任公司、四川省旅游投资集团有限责任公司外部董事）；2019 年 7 月至 2020 年 6 月，任华能能源交通产业控股有限公司总经理、党委委员、副书记；2020 年 6 月至今，任华能资本党委委员、公司党委书记；2020 年 11 月至今，任上海证券交易所理事会政策咨询委员会委员；2020 年 12 月至今，任长城投资董事长；2020 年 10 月至今，任公司董事长。

**周朝晖**先生，1971 年 1 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，工程师，中共党员，现任公司副董事长。1995 年 6 月至 2008 年 6 月，就职于深圳能源，历任办公室业务主办、证券部业务副主任、业务主任、副部长、证券事务代表；2008 年 3 月至 2020 年 6 月，历任深圳能源董事长秘书，董事会办公室高级经理、代职主任、主任、总经理，证券事务代表；2020 年 6 月至今，任深圳能源董事会秘书、证券事务代表、董事会办公室总经理；2015 年 6 月至 2020 年 10 月，任公司监事；2020 年 10 月至今，任公司副董事长。

**段一萍**女士，1975 年 11 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，高级经济师，中共党员。1997 年 8 月至 2001 年 7 月，历任民福房地产开发有限公司总经理办公室职员，财务部出纳、会计、会计主管；2001 年 9 月至 2004 年 6 月，就读于中国人民大学财政金融学院；2004 年 6 月至 2019 年 7 月，历任华能资本研究发展部业务主管、主管、部门副经理（主持工作）、部门经理；2019 年 7 月至 2020 年 7 月，任华能资本研究发展部主任；2020 年 7 月至今，任华能资本副总经理、党

委委员。2020 年 6 月至今，任公司董事。

**段心焯**女士，1976 年 12 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，正高级经济师，中共党员。1999 年 7 月至 2002 年 6 月，任中国建筑文化中心文化事业部干部；2002 年 7 月至 2004 年 5 月，就读于澳大利亚南昆士兰大学；2004 年 6 月至 2009 年 7 月，任华能资本研究发展部业务主管（其间：2007 年 6 月至 2009 年 6 月，任长城有限投资银行事业部执行董事）；2009 年 7 月至 2017 年 12 月，历任华能资本研究发展部主管、投资管理部副经理、股权管理部副经理、股权管理部副经理（主持工作）；2017 年 12 月至 2019 年 7 月，任华能资本股权管理部经理；2019 年 7 月至 2020 年 9 月，任华能资本股权管理部主任；2020 年 9 月至 2021 年 4 月，任华能资本总经理助理兼股权管理部主任；2021 年 4 月至今，任华能资本总经理助理兼人力资源部主任。2019 年 4 月至今，任公司董事。

**祝建鑫**先生，1975 年 11 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，正高级会计师，中共党员。2000 年 7 月至 2002 年 7 月，就职于中国电子信息产业集团公司；2002 年 7 月至 2004 年 6 月，就职于中国太平洋人寿保险北京分公司；2004 年 6 月至 2016 年 10 月，历任华能资本计划财务部业务主管、主管兼经理助理、副经理、副经理（主持工作）；2016 年 10 月至 2019 年 7 月，任华能资本计划财务部经理；2019 年 7 月至 2020 年 12 月，任华能资本计划财务部主任；2020 年 12 月至今，任华能资本副总会计师兼计划财务部主任。2015 年 6 月至今，任公司董事。

**陆小平**先生，1962 年 6 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，高级会计师，中共党员。1982 年 8 月至 1984 年 6 月，任衡南县茶市镇人民政府会计；1984 年 6 月至 1988 年 6 月，任湖南省衡阳市油泵油嘴厂科长助理；1988 年 6 月至 1989 年 9 月，任湖南省望城县监察局监察员兼会计；1989 年 9 月至 1992 年 7 月，就读于中南财经大学；1992 年 7 月至 1995 年 12 月，任深圳市鹏基工业发展总公司科员；1995 年 12 月至 1998 年 9 月，任深圳市中深国际技术经济合作股份有限公司计财部副经理；1998 年 12 月至 2003 年 8 月，任深圳市能源集团有限公司审计部主任审计师；2003 年 8 月至 2015 年 4 月，任深圳南山热电股份有限公司财务总监；2015 年 4 月至 2017 年 8 月，任深圳能源财务有限公司副总经理；2017 年 8 月至今，任深圳能源财务部总经理。2020 年 10 月至今，任公司董事。

**苏敏**女士，1968 年 2 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，高级会计师、注册会计师、注册资产评估师，中共党员。1990 年 7 月至 1996 年 10 月，历任合肥市西市区（现蜀山区）财政局科员、局长助理；1996 年 10 月至 2004 年 6 月，历任安徽省经贸委财政金融处科员、副主任科员、主任科员，办公室财务科科长，机关服务中心副主任，办公室副主任，行财处副处长；2004 年 6 月至 2007 年 5 月，任安徽省国资委产权管理局副局长；2007 年 5 月至 2011 年 4 月，历任安徽省能源集团有限公司总会计师，副总经理、总会计师；2011 年 3 月至 2015 年 8 月，任中国海运集团总公司总会计师、党组成员；2015 年 9 月至 2019 年 2 月，历任招商局金融集团有限公司总经理、党委副书记，总经理兼首席运营官（COO）、党委副书记；2018 年 6 月至 2019 年 2 月，任招商局集团有限公司金融事业群/平台执行委员会副主任（常务）；2019 年 2 月至今，任招商局集团有限公司金融事业群/平台执行委员会副主任（常务）、党委副书记。2020 年 10 月至今，任公司董事。

**彭磊**女士，1972 年 10 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，经济师，中共党员。1996 年 3 月至 2001 年 1 月，就职于中国南山开发集团有限公司金融投资部；2001 年 1 月至 2002 年 1 月，就职于深圳经济特区证券公司资产管理部；2002

年 5 月至 2016 年 4 月，就职于招商局金融集团有限公司，历任友联资产管理公司执行董事，招商局金融集团有限公司综合管理部副经理、审计稽核部经理、中国业务部经理、总经理助理；2016 年 4 月至 2019 年 2 月，任招商局金融集团有限公司副总经理；2018 年 6 月至 2021 年 6 月，任招商局集团有限公司金融事业群/平台执行委员会执行委员（常务）；2021 年 7 月至今，任深圳市招商平安资产管理有限责任公司副总经理；2011 年 6 月至 2015 年 3 月，任长城有限董事；2015 年 3 月至今，任公司董事。

**马庆泉**先生，1949 年 9 月出生，中国籍，无境外永久居留权，博士，中共党员。1988 年 7 月至 1993 年 5 月，任中共中央党校经济学教授、校委秘书、研究室主任；1993 年 5 月至 1999 年 3 月，历任广发证券股份有限公司（现名）常务副总裁、总裁、副董事长；1999 年 3 月至 2000 年 3 月，任嘉实基金管理有限公司董事长；2000 年 3 月至 2005 年 5 月，历任中国证券业协会第 2 届协会副理事长、秘书长，第 3 届协会常务副会长，第 4 届协会常务副会长、基金业专业委员会主任；2005 年 5 月至 2011 年 3 月，任广发基金管理有限公司董事长；2011 年至 2018 年底，任香山财富论坛副理事长；2013 年至 2018 年底，任中国金融技术研究院执行院长；2000 年至今，任中国人民大学经济学院兼职教授、博士生导师，特华博士后科研工作站博士后导师；2013 年 9 月至今，任北京香山财富投资管理有限公司董事长；2018 年 12 月至今，任北京香云汇商贸有限公司执行董事、经理。2016 年 6 月至今，任公司独立董事。

**王化成**先生，1963 年 1 月出生，中国籍，无境外永久居留权，博士，中国人民大学教授，中共党员。1988 年 7 月至 1990 年 6 月，任中国人民大学会计系助教；1990 年 6 月至 1993 年 5 月，任中国人民大学会计系讲师；1993 年 6 月至 1998 年 6 月，任中国人民大学会计系副教授；1998 年 7 月至 2001 年 5 月，任中国人民大学会计系教授；2001 年 6 月至今，任中国人民大学商学院教授。2016 年 7 月至今，任公司独立董事。

**何捷**先生，1975 年 2 月出生，中国香港籍，硕士，美国注册会计师、香港注册会计师。1997 年 9 月至 2005 年 1 月，先后就职于安达信会计师事务所、普华永道会计师事务所；2005 年 1 月至 2008 年 12 月，任 SOHU.COM INC.（搜狐）财务部高级财务总监；2009 年 1 月至 2014 年 3 月，任 CHANGYOU.COM LIMITED（搜狐畅游）首席财务官；2014 年 7 月至 2021 年 5 月，任狐狸金服（北京）信息技术咨询有限公司董事长、总经理；2021 年 9 月至今，任顺丰控股股份有限公司副总经理兼首席财务官；2021 年 11 月至今，任顺丰控股股份有限公司董事。2015 年 8 月至今，任公司独立董事。

**李建辉**先生，1969 年 6 月出生，中国籍，无境外永久居留权，本科。1991 年 8 月至 1992 年 9 月，任齐鲁制药厂干部；1992 年 10 月至 1994 年 5 月，任济南市涉外律师事务所律师；1994 年 6 月至 1999 年 5 月，任惠州市中天律师事务所合伙人；1999 年 6 月至 2001 年 5 月，任广东金地律师事务所律师；2001 年 6 月至 2003 年 3 月，任广东海埠律师事务所律师；2003 年 4 月至 2007 年 9 月，任广东君言律师事务所合伙人；2007 年 10 月至 2013 年 12 月，任北京市竞天公诚（深圳）律师事务所律师合伙人；2014 年 1 月至今，任北京市天元（深圳）律师事务所合伙人。2016 年 10 月至今，任公司独立董事。

## （2）监事会成员

**米爱东**女士，1968 年 5 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，高级经济师，中共党员，现任公司监事会主席。1991 年 8 月至 2000 年 12 月，就职于华能财务，先后任职于信贷一部、证券外汇部、国际业务部、信贷部、计划资金部；

2000 年 12 月至 2007 年 1 月，历任华能财务总经理工作部副经理、综合计划部经理；2007 年 1 月至 2011 年 11 月，任华能资本人力资源部经理；2011 年 11 月至 2014 年 10 月，任华能资本总经理助理兼人力资源部经理；2014 年 10 月至今，任华能资本总经理助理。2008 年 11 月至 2014 年 12 月，任长城有限董事；2014 年 12 月至 2015 年 3 月，任长城有限监事；2017 年 1 月至 2020 年 4 月，任公司纪委书记；2015 年 3 月至今，任公司监事会主席。

**顾文君**女士，1982 年 10 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，国际注册内审师，中共党员。2005 年 7 月至 2008 年 4 月，任深圳能源投资股份有限公司监审部职员；2008 年 4 月至 2018 年 4 月，任深圳能源审计风控部专员、高级专员；2018 年 4 月至 2019 年 4 月，任深圳能源纪检监察室副主任；2019 年 4 月至今，任深圳能源审计风控部副总经理。2020 年 10 月至今，任公司监事。

**李晓霏**先生，1970 年 9 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，经济师，中共党员。1993 年 7 月至 2003 年 10 月，先后任职于深圳市南油（集团）有限公司人力资源部、总经理办公室、计划发展部和租赁部；2003 年 10 月至 2006 年 10 月，任深圳市平方汽车园区有限公司行政人事部经理、董事会秘书；2006 年 10 月至 2010 年 5 月，任招商局集团有限公司人力资源部高级经理；2010 年 5 月至 2014 年 11 月，任招商局金融集团有限公司人力资源部总经理；2014 年 11 月至 2016 年 11 月，任招商局金融集团有限公司总经理助理兼人力资源部总经理；2016 年 11 月至 2017 年 11 月，任招商局金融集团有限公司总经理助理；2017 年 11 月至 2019 年 2 月，任招商局金融集团有限公司副总经理；2018 年 6 月至 2021 年 12 月，任招商局集团有限公司金融事业群/平台执行委员会执行委员（常务）；2021 年 12 月至今，任招商局集团有限公司人力资源部副部长。2015 年 7 月至今，任公司监事。

**曾晓玲**女士，1975 年 8 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，注册会计师（CPA）、英国特许公认会计师（ACCA），中共党员。2003 年 5 月加入公司，曾任长城有限风险管理部总经理助理、副总经理；2015 年 3 月至 2015 年 7 月，任公司风险管理部副总经理；2015 年 7 月至 2016 年 3 月，任公司风控合规管理部总经理；2016 年 3 月至 2018 年 8 月，任公司风控合规管理部总经理兼风险管理部总经理；2018 年 8 月至 2019 年 3 月，任公司风险管理部总经理；2019 年 3 月至 2021 年 3 月，任公司总裁助理兼风险管理部总经理；2021 年 3 月至今，任公司总裁助理兼人力资源部总经理；2020 年 10 月至今，任公司职工监事。

**许明波**先生，1971 年 8 月出生，中国籍，无境外永久居留权，博士，中共党员。1998 年 9 月加入公司，曾任长城有限财务部主任会计师、审计监察部总经理、国际业务发展（香港）办公室总经理；2015 年 3 月至 2021 年 5 月，历任公司国际业务发展（香港）办公室总经理、人力资源部总经理、党委办公室主任、党建工作部主任、党群与宣传部主任；2021 年 5 月至今，任公司党群与宣传部主任兼党委巡察办公室主任；2020 年 10 月至今，任公司职工监事。

### （3）高级管理人员

**李翔**先生，1968 年 12 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，中共党员，现任公司总裁、党委副书记。1992 年 7 月至 1993 年 5 月，任北京石景山人民检察院办公室秘书；1993 年 5 月至 1995 年 8 月，任海南汇通国际信托投资公司证券总部办公室主任；1995 年 8 月至 2010 年 7 月，历任长城有限人事部副总经理、人事监察部总经理、青岛营业部（筹）总经

理、新开发筹备小组成员、广州营业部筹备组组长、广州营业部总经理、深圳营业一部总经理、营销管理总部总经理兼深圳一部总经理、营销总监、营销管理总部总经理；2010年7月至2015年3月，任长城有限副总裁；2015年3月至2019年4月，任公司副总裁；2018年12月至2019年4月，任公司副总裁（代行总裁职责）；2019年3月至今，任公司党委副书记；2019年4月至今，任公司总裁；2020年10月至今，任公司财务负责人。

**崔学峰**先生，1964年6月出生，中国籍，无境外永久居留权，本科，中共党员，现任公司党委副书记、副总裁。1987年9月至2003年4月，任职于中国华能技术开发公司，历任项目经营部经理、成都公司总经理、上海公司总经理等职务；2003年4月至2004年8月，任职于华能综合产业公司，历任企管部经理、监察审计部经理；2004年8月至2005年12月，任上海华能实业公司总经理；2005年12月至2011年10月，任职于华能综合产业公司，历任政工部经理、监察审计部经理等职务；2011年10月至2020年12月，任华能集团审计部副主任；2015年6月至2017年11月，任华能资本监事。2020年12月至今，任公司党委副书记；2021年5月至今，任公司副总裁。

**何青**女士，1968年11月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，中共党员，现任公司党委委员、副总裁。1991年7月至2014年5月，就职于华能财务，历任管理部负责人、营业部副经理、信贷部副经理、客户服务部副经理、客户服务部经理、总经理助理、副总经理等职务；2014年6月至2016年5月，任华能天成融资租赁有限公司副总经理；2016年9月至今，任公司副总裁。

**徐浙鸿**女士，1969年5月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，现任公司副总裁。1992年6月至1993年9月，任海南省信托投资公司农业信贷部经理助理；1994年4月至1997年10月，任中海（海南）海盛船务股份有限公司职员；1997年10月至2012年4月，任招商证券股份有限公司投资银行总部执行董事；2012年4月至2015年3月，历任长城有限投资银行事业部质量控制部总经理、资本市场部总经理；2015年4月至2015年7月，任公司投行业务总监；2015年7月至2020年10月，任公司合规总监；2016年12月至2020年10月，任公司首席风险官；2017年7月至今，任公司副总裁。

**曾贇**先生，1975年3月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，中共党员，现任公司党委委员、副总裁。1997年7月至1998年8月，就职于深圳市汇凯进出口有限公司五金矿产部；1998年8月至1999年2月，就职于深圳市华新股份有限公司五金矿产部；1999年3月至2015年3月，历任长城有限债券业务部总经理助理、固定收益部总经理助理（主持工作）、固定收益部总经理、固定收益总监等职务；2015年3月至2015年7月，任公司固定收益总监兼固定收益部总经理；2015年7月至2019年6月，任公司总裁助理兼固定收益部总经理；2019年6月至2019年9月，任公司副总裁兼固定收益部总经理；2020年1月至今，任上海证券交易所理事会债券发展委员会委员；2019年9月至今，任公司副总裁。

**韩飞**先生，1974年4月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，中共党员，现任公司党委委员、副总裁。1997年6月至2015年3月，历任长城有限深圳东园路证券营业部员工、经纪业务管理总部员工、郑州健康路证券营业部（筹）筹建组组长、南宁民族大道证券营业部总经理、创新产品开发部副总经理（主持工作）、营销管理总部副总经理、广州天河北营业部总经理、广东分公司（筹）负责人、广东分公司总经理等职务；2015年3月至2018年12月，任公司广东分公司总经理；2018年12月至2019年8月，任公司经纪业务总部总经理兼广东分公司总经理；2019年8月至今，任公司副总裁。

**吴礼信**先生，1969 年 11 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，注册会计师，中共党员，现任公司董事会秘书。1991 年 7 月至 1995 年 3 月，任安徽省地矿局三二六地质队会计主管；1995 年 3 月至 1997 年 7 月，任深圳中达信会计师事务所审计一部部长；1997 年 7 月至 2002 年 10 月，历任大鹏证券有限责任公司计财综合部经理、资金结算部副总经理；2002 年 10 月至 2003 年 3 月，任第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理；2003 年 4 月至 2015 年 3 月，历任长城有限财务部总经理、财务负责人；2015 年 3 月至 2019 年 4 月，任公司董事会秘书兼财务负责人；2017 年至今，任长城基金监事会主席；2020 年 3 月至今，任长城长富董事长；2020 年 4 月至今，任上海证券交易所理事会战略发展委员会副主任委员；2020 年 6 月至今，任长城富浩董事长；2019 年 4 月至今，任公司董事会秘书。

**赵昕倩**女士，1982 年 6 月出生，中国籍，无境外永久居留权，硕士，现任公司合规总监、首席风险官。2005 年 10 月至 2014 年 6 月，历任深圳证监局机构监管一处科员、副主任科员、主任科员；2014 年 7 月至 2017 年 3 月，任深圳证监局机构监管一处副处长；2017 年 4 月至 2018 年 7 月，任深圳证监局投资者保护工作处副处长；2018 年 7 月至 2019 年 3 月，任深圳证监局机构监管二处副处长；2019 年 3 月至 2020 年 10 月，任深圳证监局机构监管一处（前海办公室）副处长。2020 年 10 月至 2021 年 3 月，任公司合规总监、首席风险官；2021 年 3 月至今，任公司合规总监、首席风险官兼风险管理部总经理。

**徐楠**先生，1981 年 5 月出生，中国籍，无境外永久居留权，博士，中共党员，现任公司首席信息官。2006 年 10 月至 2007 年 6 月，任香港城市大学电脑科学系副研究员；2007 年 7 月至 2010 年 11 月，就读于香港城市大学；2010 年 11 月至 2012 年 11 月，任上海证券交易所 IT 规划与服务部研究员；2012 年 11 月至 2016 年 11 月，任职于海通证券股份有限公司信息技术管理部；2016 年 11 月至 2021 年 6 月，任职于东莞证券股份有限公司，历任金融科技管理总部常务副总经理（主持工作）、金融科技管理总部总经理、总裁助理、首席信息官。2021 年 8 月至今，任公司首席信息官。

## 2、在股东单位任职情况

√ 适用 □ 不适用

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务	任期起始日期	任期终止日期	在股东单位是否领取报酬津贴
张巍	华能资本服务有限公司	党委委员	2020 年 6 月	至今	否
周朝晖	深圳能源集团股份有限公司	董事会秘书	2020 年 6 月	至今	是
		董事会办公室总经理	2014 年 1 月	至今	
		证券事务代表	2008 年 6 月	至今	
段一萍	华能资本服务有限公司	副总经理、党委委员	2020 年 7 月	至今	是
		董事会秘书	2021 年 2 月	至今	
段心焯	华能资本服务有限公司	总经理助理	2020 年 9 月	至今	是
		股权管理部主任	2019 年 7 月	2021 年 4 月	
		人力资源部主任	2021 年 4 月	至今	
祝建鑫	华能资本服务有限公司	副总会计师	2020 年 12 月	至今	是
		计划财务部主任	2019 年 7 月	至今	
陆小平	深圳能源集团股份有限公司	财务部总经理	2017 年 8 月	至今	是

米爱东	华能资本服务有限公司	总经理助理	2011 年 11 月	至今	否
顾文君	深圳能源集团股份有限公司	审计风控部副总经理	2019 年 4 月	至今	是
在股东单位任职情况的说明		无			

### 3、在其他单位任职情况

√ 适用 □ 不适用

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务	任期起始日期	任期终止日期	在其他单位是否领取报酬津贴
张 巍	深圳市长城证券投资有限公司	董事长	2020 年 12 月	至今	否
	景顺长城基金管理有限公司	董事	2022 年 2 月	至今	否
周朝晖	深圳市创新投资集团有限公司	监事	2012 年 5 月	至今	否
	国泰君安证券股份有限公司	监事	2021 年 6 月	至今	否
	深圳市东部电力有限公司	执行董事、总经理	2021 年 6 月	至今	否
	深圳能源环保股份有限公司	董事	2021 年 11 月	至今	否
	深圳市鹏湾电力运营有限公司	执行董事、总经理	2021 年 11 月	至今	否
段一萍	永诚财产保险股份有限公司	监事	2015 年 3 月	2021 年 1 月	否
	华能贵诚信托有限公司	董事	2017 年 6 月	至今	否
	北京云成金融信息服务有限公司	董事	2021 年 11 月	至今	否
	北京金融资产交易所有限公司	董事	2021 年 9 月	至今	否
段心焯	北京金融资产交易所有限公司	监事	2017 年 4 月	2021 年 9 月	否
	华能景顺罗斯（北京）投资基金管理有限公司	董事	2017 年 8 月	至今	否
	华能天成融资租赁有限公司	董事	2014 年 7 月	至今	否
	华能贵诚信托有限公司	董事	2019 年 5 月	至今	否
祝建鑫	华能景顺罗斯（北京）投资基金管理有限公司	监事	2010 年 6 月	至今	否
陆小平	深圳能源财务有限公司	董事	2018 年 3 月	至今	否
	深能合和电力（河源）有限公司	董事	2018 年 12 月	至今	否
	深能（香港）国际有限公司	董事	2018 年 10 月	至今	否
苏 敏	招商局集团有限公司	金融事业群/平台执行委员会副主任（常务）	2018 年 6 月	至今	否
	招商局金融集团有限公司	董事	2015 年 12 月	至今	是
	深圳市招融投资控股有限公司	总经理	2017 年 12 月	至今	否
	招商银行股份有限公司	非执行董事	2016 年 4 月	至今	否
	招商证券股份有限公司	董事	2016 年 6 月	至今	否
	招商局融资租赁有限公司	董事长、总经理	2016 年 6 月	至今	否
	博时基金管理有限公司	董事	2018 年 9 月	至今	否
彭 磊	招商局集团有限公司	金融事业群/平台执行委员会执行委员（常务）	2018 年 6 月	2021 年 6 月	否
	招商证券股份有限公司	董事	2007 年 8 月	至今	否

	招商局通商融资租赁有限公司	董事	2018 年 8 月	至今	否
	深圳市招商平安资产管理有限责任公司	董事	2018 年 12 月	至今	是
		副总经理	2021 年 7 月	至今	
	深圳市招商平安投资管理有限公司	董事	2021 年 11 月	至今	否
招商投资管理（深圳）有限公司	董事	2021 年 11 月	至今	否	
马庆泉	北京香山财富投资管理有限公司	董事长、总经理	2013 年 9 月	至今	是
	中国人民大学	兼职教授	2000 年 1 月	至今	是
	北京香云汇商贸有限公司	执行董事、经理	2018 年 12 月	至今	否
王化成	中国人民大学	教授	1998 年 7 月	至今	是
	华夏银行股份有限公司	独立董事	2014 年 2 月	至今	是
	中国铁建股份有限公司	独立董事	2014 年 10 月	2021 年 12 月	是
	同方股份有限公司	独立董事	2020 年 2 月	至今	是
	京东方科技集团股份有限公司	独立董事	2015 年 7 月	2021 年 5 月	是
何捷	顺丰控股股份有限公司	副总经理、首席财务官	2021 年 9 月	至今	是
		董事	2021 年 11 月	至今	
	嘉里物流联网有限公司	董事	2021 年 10 月	至今	否
	狐狸金服金融科技集团（香港）有限公司	董事长、首席执行官	2014 年 5 月	2021 年 6 月	否
	狐狸金服（北京）信息科技有限公司	董事长	2016 年 10 月	2021 年 9 月	否
	北京银河世界科技有限公司	董事	2015 年 8 月	2021 年 5 月	否
	搜易居（北京）网络技术有限公司（原搜易贷（北京）金融信息服务有限公司）	董事长	2014 年 4 月	2021 年 9 月	否
	狐狸金服（北京）信息技术咨询有限公司	董事长、总经理	2014 年 7 月	2021 年 5 月	否
	盈狐数科（天津）信息技术有限公司	董事长、总经理	2015 年 2 月	2021 年 5 月	否
	磐石盈富（天津）资产管理有限公司	董事长、总经理	2015 年 4 月	2021 年 6 月	否
	磐石众智（天津）资产管理有限公司	董事长、总经理	2015 年 4 月	2021 年 6 月	否
	云狐天下征信有限公司	董事长、总经理	2015 年 9 月	2021 年 5 月	否
	东方麦子（北京）财务顾问有限公司	执行董事、总经理	2015 年 7 月	2021 年 6 月	否
	狐狸互联网小额贷款（宁波）有限公司	董事长	2017 年 6 月	2021 年 6 月	否
	狐狸普惠（天津）投资有限公司（原狐狸金服投资有限公司）	执行董事、总经理	2017 年 7 月	2021 年 7 月	否
	狐狸普惠科技有限公司	董事长、总经理	2018 年 5 月	2021 年 7 月	否
	狐狸普惠科技（北京）有限公司	执行董事、总经理	2018 年 6 月	2021 年 5 月	否
	狐狸投资管理（宁波）有限公司	执行董事	2018 年 8 月	2021 年 6 月	否
	盈狐（天津）融资租赁有限公司	执行董事、总经理	2016 年 10 月	2021 年 7 月	否
	狐狸普惠（宁波）信息技术咨询有限公司	执行董事、总经理	2019 年 4 月	2021 年 7 月	否
李建辉	北京市天元（深圳）律师事务所	合伙人	2014 年 1 月	至今	是
	深圳市菁华贸易有限公司	监事	2019 年 11 月	2021 年 3 月	否
	万魔声学股份有限公司	独立董事	2020 年 10 月	至今	是

顾文君	深能保定发电有限公司	董事	2019年9月	至今	否
	深圳能源燃气投资控股有限公司	监事	2019年11月	至今	否
	惠州深能投资控股有限公司	监事会主席	2021年9月	至今	否
李晓霏	招商局集团有限公司	金融事业群/平台 执行委员会执行 委员（常务）	2018年6月	2021年12月	否
		人力资源部副 部长	2021年12月	至今	是
	招商证券股份有限公司	监事	2014年5月	至今	否
曾晓玲	深圳市长城长富投资管理有限公司	董事	2020年2月	至今	否
	宝城期货有限责任公司	监事	2017年8月	2021年12月	否
	深圳市长城证券投资有限公司	董事	2014年4月	至今	否
	长城基金管理有限公司	董事	2021年5月	至今	否
许明波	长城基金管理有限公司	董事	2020年6月	2021年5月	否
	宝城期货有限责任公司	董事	2017年8月	2021年12月	否
李翔	景顺长城基金管理有限公司	董事	2018年9月	2022年2月	否
韩飞	长城基金管理有限公司	董事	2020年6月	至今	否
吴礼信	深圳市长城长富投资管理有限公司	董事长	2020年3月	至今	否
	长城基金管理有限公司	监事会主席	2017年2月	至今	否
	深圳长城富浩私募股权基金管理有限公司 (原长城富浩基金管理有限公司)	董事长	2020年6月	至今	否
赵昕倩	深圳市长城长富投资管理有限公司	董事	2020年12月	至今	否
在其他 单位任 职情况 的说明	无				

#### 4、公司现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员近三年证券监管机构处罚的情况

适用  不适用

### (三) 董事、监事、高级管理人员报酬情况

#### 1、董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序、确定依据、实际支付情况

(1) 董事、监事和高级管理人员薪酬管理的基本制度及决策程序：公司依照《年度绩效奖金管理办法》和《高管人员及公司绩效考核与薪酬激励管理办法》对高级管理人员薪酬进行管理。董事、监事报酬由股东大会决定，外部董事（除独立董事外）、监事（除监事会主席、职工监事外）不在公司领取报酬；高级管理人员报酬由董事会及其薪酬考核与提名委员会决定。

(2) 董事、监事和高级管理人员报酬确定依据：由公司薪酬制度决定，与岗位和绩效挂钩。

(3) 董事、监事和高级管理人员薪酬实际支付情况：报告期内，本公司董事、监事和高级管理人员共有 26 人，其中报告期内在公司领取报酬的有 17 人，报告期内公司向上述人员发放报酬合计 2,911.44 万元。

## 2、公司报告期内董事、监事和高级管理人员报酬情况

单位：万元

姓名	职务	性别	年龄	任职状态	从公司获得的税前报酬总额	是否在公司关联方获取报酬
张巍	党委书记、董事长	男	51	现任	154.20	否
周朝晖	副董事长	男	50	现任	-	是
段一萍	董事	女	46	现任	-	是
段心焯	董事	女	45	现任	-	是
祝建鑫	董事	男	46	现任	-	是
陆小平	董事	男	59	现任	-	是
苏敏	董事	女	53	现任	-	是
彭磊	董事	女	49	现任	-	是
马庆泉	独立董事	男	72	现任	15.00	是
王化成	独立董事	男	58	现任	15.00	是
何捷	独立董事	男	46	现任	15.00	是
李建辉	独立董事	男	52	现任	15.00	是
米爱东	监事会主席	女	53	现任	123.20	否
顾文君	监事	女	39	现任	-	是
李晓霏	监事	男	51	现任	-	是
曾晓玲	职工监事	女	46	现任	207.47	否
许明波	职工监事	男	50	现任	166.41	否
李翔	总裁、党委副书记、财务负责人	男	53	现任	488.13	否
崔学峰	党委副书记、副总裁	男	57	现任	82.40	否
何青	党委委员、副总裁	女	53	现任	294.40	否
徐浙鸿	副总裁	女	52	现任	314.12	否
曾贇	党委委员、副总裁	男	46	现任	280.27	否
韩飞	党委委员、副总裁	男	47	现任	289.20	否
吴礼信	董事会秘书	男	52	现任	290.24	否
赵昕倩	合规总监、首席风险官	女	39	现任	96.23	否
徐楠	首席信息官	男	40	现任	65.18	否
合计	--	--	--	--	2,911.44	--

注：公司高级管理人员报酬包括基本工资和奖金，上述报酬数据为当年税前实际发放数，包含往年递延至 2021 年发放的奖金。

## 六、报告期内召开的董事会会议、监事会会议的有关情况

### (一) 本报告期董事会情况

会议届次	召开日期	披露日期	会议决议
第二届董事会第三次会议	2021 年 1 月 8 日	2021 年 1 月 12 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第三次会议决议公告》，公告编号：2021-001。
第二届董事会第四次会议	2021 年 4 月 9 日	2021 年 4 月 13 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第四次会议决议公告》，公告编号：2021-014。
第二届董事会第五次会议	2021 年 4 月 27 日	2021 年 4 月 29 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第五次会议决议公告》，公告编号：2021-022。
第二届董事会第六次会议	2021 年 5 月 31 日	2021 年 6 月 1 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第六次会议决议公告》，公告编号：2021-029。
第二届董事会第七次会议	2021 年 7 月 26 日	2021 年 7 月 27 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第七次会议决议公告》，公告编号：2021-041。
第二届董事会第八次会议	2021 年 8 月 19 日	2021 年 8 月 21 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第八次会议决议公告》，公告编号：2021-055。
第二届董事会第九次会议	2021 年 9 月 2 日	2021 年 9 月 4 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第九次会议决议公告》，公告编号：2021-060。
第二届董事会第十次会议	2021 年 10 月 27 日	2021 年 10 月 28 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第十次会议决议公告》，公告编号：2021-072。
第二届董事会第十一次会议	2021 年 12 月 9 日	2021 年 12 月 10 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第十一次会议决议公告》，公告编号：2021-083。
第二届董事会第十二次会议	2021 年 12 月 30 日	2021 年 12 月 31 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届董事会第十二次会议决议公告》，公告编号：2021-089。

## （二）董事出席董事会及股东大会的情况

董事出席董事会及股东大会的情况							
董事姓名	本报告期应参加董事会次数	现场出席董事会次数	以通讯方式参加董事会次数	委托出席董事会次数	缺席董事会次数	是否连续两次未亲自参加董事会会议	出席股东大会次数
张巍	10	2	8	0	0	否	3
周朝晖	10	1	9	0	0	否	3
段一萍	10	1	9	0	0	否	3
段心焯	10	1	9	0	0	否	3
祝建鑫	10	1	9	0	0	否	3
陆小平	10	2	8	0	0	否	3
苏敏	10	1	9	0	0	否	3
彭磊	10	0	10	0	0	否	3
马庆泉	10	1	9	0	0	否	3
王化成	10	1	9	0	0	否	3
何捷	10	1	9	0	0	否	3
李建辉	10	1	9	0	0	否	3

报告期内，公司董事不存在连续两次未亲自出席董事会的情况。

## （三）董事对公司有关事项提出异议的情况

董事对公司有关事项是否提出异议

是  否

报告期内董事对公司有关事项未提出异议。

## （四）董事履行职责的其他说明

董事对公司有关建议是否被采纳

是  否

2021 年，公司董事会全体董事严格遵守法律法规和《公司章程》的规定，忠实、勤勉履行职责和义务。公司董事充分理解并积极配合公司相关工作需要，按照规定出席董事会和相关专门委员会会议，认真审议各项议案，在公司发展、制度修订、关联交易、风控合规等方面为公司提供具有针对性、前瞻性、建设性的意见和建议；在董事会闭会期间，认真阅读公司提供的各类文件、报告，及时了解公司的经营管理状况。公司严格做好董事会现场会议记录工作，认真落实董事提出的相关意见建议，将董事会专业、科学的决策意见有效转化为促进公司规范运作和可持续发展的动力。

公司董事会专门委员会均按照《公司章程》和相应工作细则的有关规定，认真履行职责，发挥专业优势，为提升董事会决策的科学性和前瞻性提供了有力支持。公司董事积极参加董事会和各专门委员会会议，深入了解公司经营情况，充分发挥专业所长，认真审议各项议案；公司独立董事对公司重大事项独立、客观发表意见，切实起到了保护投资者尤其是中小投资者利益的作用。

**(五) 本报告期监事会情况**

会议届次	召开日期	参会监事	披露日期	会议决议
第二届监事会第二次会议	2021 年 4 月 9 日	米爱东、顾文君、 李晓霏、曾晓玲、 许明波	2021 年 4 月 13 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届监事会第二次会议决议公告》，公告编号：2021-018。
第二届监事会第三次会议	2021 年 4 月 27 日	米爱东、顾文君、 李晓霏、曾晓玲、 许明波	2021 年 4 月 29 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届监事会第三次会议决议公告》，公告编号：2021-024。
第二届监事会第四次会议	2021 年 7 月 26 日	米爱东、顾文君、 李晓霏、曾晓玲、 许明波	2021 年 7 月 27 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届监事会第四次会议决议公告》，公告编号：2021-046。
第二届监事会第五次会议	2021 年 8 月 19 日	米爱东、顾文君、 李晓霏、曾晓玲、 许明波	2021 年 8 月 21 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届监事会第五次会议决议公告》，公告编号：2021-056。
第二届监事会第六次会议	2021 年 10 月 27 日	米爱东、顾文君、 李晓霏、曾晓玲、 许明波	2021 年 10 月 28 日	表决通过，披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn），公告名称：《第二届监事会第六次会议决议公告》，公告编号：2021-073。

## 七、董事会下设专门委员会在报告期内的情况

委员会名称	成员情况	召开会议次数	召开日期	会议内容	提出的重要意见和建议	其他履行职责的情况	异议事项具体情况
战略与发展委员会	张巍（主任委员）、苏敏、马庆泉	2	2021 年 4 月 2 日	关于公司《“十四五”战略规划》的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 7 月 23 日	1.关于公司符合非公开发行 A 股股票条件的议案； 2.关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案； 3.关于公司非公开发行股票募集资金使用可行性分析报告的议案。	不适用	不适用	无
风险控制与合规委员会	陆小平（主任委员）、段心焯、王化成	4	2021 年 1 月 29 日	关于《长城证券股份有限公司反洗钱 2020 年年度报告》的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 4 月 2 日	1.关于公司 2020 年度合规报告的议案； 2.关于公司 2020 年度全面风险管理报告的议案； 3.关于公司 2020 年度风险控制指标报告的议案； 4.关于公司 2021 年度风险偏好和风险容忍度的议案； 5.关于公司 2021 年度自营投资额度的议案； 6.关于公司 2021 年度融资类业务规模的议案； 7.关于修订《长城证券股份有限公司全面风险管理制度》的议案； 8.关于制定《长城证券股份有限公司反洗钱和反恐怖融资工作管理办法》的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 8 月 12 日	关于公司 2021 年上半年风险控制指标报告的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 12 月 7 日	1.关于修订《公司章程》的议案； 2.关于修订公司《董事会议事规则》的议案。	不适用	不适用	无
薪酬考核与提名委员会	马庆泉（主任委员）、周朝晖、段一萍、何捷、李建辉	6	2021 年 4 月 2 日	关于公司 2020 年度董事履职考核和薪酬情况专项说明的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 4 月 26 日	关于公司 2020 年度合规负责人考核报告的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 5 月 31 日	关于聘任公司副总裁的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 8 月 12 日	关于聘任公司首席信息官的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 9 月 2 日	1.关于公司 2020 年度考核结果、绩效奖金总额及高级管理人员奖金总额的议案； 2.关于公司 2020 年度高级管理人员履职、绩效考核和薪酬情况专项说明的议案； 3.关于公司 2020 年度高级管理人员绩效考核结果及奖金分配的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 12 月 29 日	关于制定公司《职业经理人任期制和契约化管理办法》的议案。	不适用	不适用	无

审计委员会	王化成（主任委员）、祝建鑫、彭磊、何捷、李建辉	9	2021 年 3 月 29 日	关于公司 2020 年度内部审计工作报告及 2021 年度审计工作计划的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 4 月 2 日	1.关于听取德勤华永会计师事务所年度审计工作总结汇报的议案（非表决事项）； 2.关于公司 2020 年年度报告的议案； 3.关于公司 2020 年度财务决算报告的议案； 4.关于公司 2020 年度利润分配预案的议案； 5.关于公司 2020 年度内部控制自我评价报告的议案； 6.关于公司 2021 年度预计日常关联交易的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 4 月 26 日	关于公司 2021 年第一季度报告的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 5 月 8 日	关于公司 2021 年第一季度内部审计工作报告及第二季度工作计划的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 7 月 30 日	1.关于公司 2021 年上半年度内部审计工作报告及第三季度工作计划的议案； 2.关于公司 2020 年度反洗钱业务专项审计报告的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 8 月 12 日	关于公司 2021 年半年度报告的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 10 月 25 日	1.关于公司 2021 年第三季度报告的议案； 2.关于公司 2021 年第三季度内部审计工作报告及第四季度工作计划的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 12 月 7 日	关于续聘会计师事务所的议案。	不适用	不适用	无
			2021 年 12 月 28 日	关于听取德勤华永会计师事务所年度审计工作相关事项汇报的议案（非表决事项）。	不适用	不适用	无

## 八、监事会工作情况

监事会在报告期内的监督活动中发现公司是否存在风险

是  否

监事会对报告期内的监督事项无异议。

## 九、公司员工情况

### (一) 员工数量、专业构成及教育程度

报告期末母公司在职员工的数量（人）	3,029
报告期末主要子公司在职员工的数量（人）	261
报告期末在职员工的数量合计（人）	3,290
当期领取薪酬员工总人数（人）	3,290
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数（人）	0
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数（人）
技术人员	136
财务人员	69
行政人员	38
研究人员	83
投资银行业务人员	317
资产管理业务人员	78
经纪业务人员	1,986
管理人员	222
其他人员	361
合计	3,290
教育程度	
教育程度类别	数量（人）
博士	18
硕士	889
本科	1,966
大专及以下	417
合计	3,290

### (二) 薪酬政策

公司严格遵守《劳动法》《劳动合同法》等国家和地方有关劳动及社会保障方面的法律、法规，建立了完善的人力资源管理制度和流程，规范用工，切实保障员工的权益。

公司职工薪酬由基本工资、效益奖金、津贴、补贴、职工福利费、社会保险费、住房公积金、工会经费及职工教育经费等组成。公司实行宽带固定薪酬和绩效奖金、业务奖励相结合的薪酬制度。全资子公司的薪酬制度参照母公司执行，控股子公司的薪酬制度参照母公司规则自行制定。

公司根据自身战略规划、业务发展阶段、行业环境变化等，适时对薪酬制度进行市场化改革创新、优化完善，以保障薪酬水平具有一定市场竞争力。

### (三) 培训计划

培训体系建设方面：公司 2021 年年底成立“长城人才发展研修院”，以“员工成长顾问、业务发展伙伴、企业变革助手”作为研修院的发展定位，以“持续激发员工‘价值再升’，实现‘人才强企’”作为研修院的发展使命，推进“人才梯队培养、职业公开课、上岗认证”三大人才培养体系，并行完善各业务线常规业务培训，通过“1+1+1”模式夯实人才日常培养。

培训活动方面：2021 年度继续推进“高、中、基、潜”四类人才梯队培训，包括高层干部参与“金融领军人才研修班”；中层干部完成“干部党史学习及领导力提升延安班”“中层干部领导力战略共识及领导力”培训；后备干部完成相关专业培训并结业；校招新员工完成职场新人线下集训。其他常规业务类培训包括公司各部参加基金年鉴、协会面授系统的业务培训等。

#### （四）劳务外包情况

适用  不适用

### 十、委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况

截至报告期末，公司签订《证券经纪人委托合同》的经纪人共 953 人。公司对经纪人采取分级管理模式：分级管理是指公司总部统一制定招聘、薪酬、绩效考核、培训、合规管理、日常执业规范等制度和规范，分支机构可在公司制度范围内根据自身情况自主安排经纪人的入职、提成比例、培训、考核等事项。

### 十一、公司利润分配及资本公积金转增股本情况

#### （一）报告期内利润分配政策，特别是现金分红政策的制定、执行或调整情况

适用  不适用

公司严格遵守《公司章程》的相关规定，实行同股同利，根据各股东持有公司股份的比例对股利和其他形式的利益进行分配。截至首次公开发行人民币普通股（A 股）完成前滚存的未分配利润由发行完成后的新老股东按持股比例享有。

##### 1、公司利润分配原则

公司实行同股同利的股利政策，股东依照其所持有的股份份额获得股利和其他形式的利益分配；公司实行连续、稳定的利润分配政策，公司利润分配应注重对股东的合理投资回报，并兼顾公司的可持续发展。

##### 2、公司利润分配的形式

公司可以采取现金、股票或现金与股票相结合的方式分配利润，并优先采用现金分红的利润分配方式。在公司盈利、各项风险控制指标符合监管要求、综合考虑公司经营和长期发展需要的前提下，公司将积极采取现金方式分配利润。公司董事会可以根据公司的盈利状况及资金需求状况提议公司进行中期现金分红。在确保足额现金股利分配的前提下，公司可以采取股票股利的方式进行利润分配。

##### 3、利润分配的具体条件和比例

在满足公司正常生产经营的资金需求情况下，如公司无重大投资计划或重大现金支出等事项发生，公司每连续三年以现金方式累计分配的利润不少于该三年实现的年均可分配利润的 30%。

根据公司上市后三年股东分红回报规划，除遵照上述股利分配政策外，公司董事会在制定利润分配预案时，应当综合考虑公司所处行业特点、发展阶段、自身经营模式、盈利水平以及是否有重大资金支出安排等因素，区分下列情形，并按照《公司章程》规定的程序，提出差异化的现金分红政策：公司发展阶段属成熟期且无重大资金支出安排的，进行利润分配时，现金分红在本次利润分配中所占比例最低应达到 80%；公司发展阶段属成熟期且有重大资金支出安排的，进行利润分配时，现金分红在本次利润分配中所占比例最低应达到 40%；公司发展阶段属成长期且有重大资金支出安排的，进行利润分配时，现金分红在本次利润分配中所占比例最低应达到 20%。

#### 4、公司利润分配的决策程序

##### (1) 制订利润分配方案的决策程序

公司董事会根据每一会计年度公司的盈利情况、资金需求和股东回报规划提出公司年度利润分配方案并提交股东大会审议。董事会提交股东大会的利润分配方案，经董事会全体董事过半数表决通过。独立董事对利润分配方案发表独立意见。对于利润分配方案中的现金分红事项，独立董事可以征集中小股东的意见，提出分红提案，并直接提交董事会审议。股东大会审议利润分配方案前，公司通过多种渠道主动与独立董事以及中小股东进行沟通和交流，充分听取中小股东的意见和诉求，及时答复中小股东关心的问题。公司在召开审议利润分配方案的股东大会时，除现场会议外，还向股东提供网络形式的投票平台。公司股东大会对利润分配方案作出决议后，公司董事会在股东大会召开后 2 个月内完成股利（或股份）的派发事项。

##### (2) 调整利润分配方案的决策程序

公司根据行业监管政策、自身经营情况、投资规划和长期发展的需要，或者根据外部经营环境发生重大变化而确需调整利润分配政策的，调整后的利润分配政策不得违反法律、行政法规及中国证监会和深交所的有关规定，有关调整利润分配政策议案由董事会根据公司经营状况和中国证监会的有关规定拟定，并提交股东大会审议决定。董事会拟定调整利润分配政策议案过程中，充分听取独立董事意见，并进行详细论证。董事会审议调整利润分配政策议案须经董事会全体董事过半数表决通过，独立董事发表明确意见，并可征集中小股东的意见。监事会对董事会制订或修改的利润分配政策进行审议，须经全体监事过半数通过，并对利润分配政策的执行情况进行监督。股东大会审议调整利润分配政策议案时，通过多种渠道主动与中小股东进行沟通和交流，征集中小股东的意见和诉求。公司利润分配政策的制订或修改提交股东大会审议时，由出席股东大会的股东（包括股东代理人）所持表决权的 2/3 以上通过，并且相关股东大会会议审议时公司须为股东提供网络投票便利条件。

现金分红政策的专项说明	
是否符合公司章程的规定或股东大会决议的要求：	是
分红标准和比例是否明确和清晰：	是
相关的决策程序和机制是否完备：	是
独立董事是否履职尽责并发挥了应有的作用：	是
中小股东是否有充分表达意见和诉求的机会，其合法权益是否得到了充分保护：	是
现金分红政策进行调整或变更的，条件及程序是否合规、透明：	不适用

**(二) 公司报告期内盈利且母公司可供股东分配利润为正但未提出现金红利分配预案**

适用  不适用

**(三) 董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案**

适用  不适用

每 10 股送红股数 (股)	0
每 10 股派息数 (元) (含税)	1.5
每 10 股转增数 (股)	0
分配预案的股本基数 (股)	3,103,405,351
现金分红金额 (元) (含税)	465,510,802.65
以其他方式 (如回购股份) 现金分红金额 (元)	0
现金分红总额 (含其他方式) (元)	465,510,802.65
可分配利润 (元)	3,456,546,413.43
现金分红总额 (含其他方式) 占利润分配总额的比例	100%
本次现金分红情况	
以公司总股本 3,103,405,351 股为基数, 向全体股东每 10 股派发现金红利 1.5 元 (含税), 合计派发 465,510,802.65 元。	
利润分配或资本公积金转增预案的详细情况说明	
经德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙) 审计确认, 公司 2021 年度母公司净利润人民币 1,646,577,077.40 元, 其他综合收益结转留存收益等影响 32,809,910.61 元, 根据《公司法》《证券法》《金融企业财务规则》等规定, 公司按母公司年度净利润的 10% 计提法定盈余公积金 164,657,707.74 元, 按 10% 计提一般风险准备 164,657,707.74 元, 按 10% 计提交易风险准备 164,657,707.74 元, 按大集合产品管理费收入 10% 计提风险准备 388,845.89 元, 加上年初未分配利润 2,695,855,911.89 元, 扣除 2021 年内分配给股东的利润 310,340,535.10 元后, 母公司 2021 年末的未分配利润为人民币 3,570,540,395.69 元。根据中国证监会证监机构字[2007]320 号文的相关规定, 可供分配利润中公允价值变动收益部分, 不得向股东进行现金分配, 年末累计可供分配利润中公允价值变动损益 (税后) 为 113,993,982.26 元, 公司 2021 年末可供投资者现金分红部分为人民币 3,456,546,413.43 元。	
2021 年度利润分配预案: 以公司总股本 3,103,405,351 股为基数, 向全体股东按每 10 股派发现金红利 1.5 元 (含税) 派发 2021 年度红利, 合计派发 465,510,802.65 元, 不送红股, 不以资本公积转增股本。公司剩余的未分配利润转入下一年度。	

**十二、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况**

适用  不适用

公司报告期无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

**十三、报告期内的内部控制制度建设及实施情况**

**(一) 内部控制建设及实施情况**

公司根据内部控制建设需要, 制定了一系列较为完整的制度、条例、办法及工作流程等, 并根据外部监管要求、业务发展及管理需求及时修订完善。目前公司内部控制制度基本涵盖公司主要营运环节, 具有较强的操作性, 有关内部控制制度能有效传递给各级单位和各级员工。公司持续有效地完善了内部控制制度, 2021 年公司持续完善内部控制制度, 制定或修订制度、细则等, 内容涵盖投资银行业务、资产管理业务、经纪业务、固定收益业务、场外期权业务、分支机构管理、合规管

理、风险管理、信息技术管理、营运管理、人力资源管理、财务管理等方面。公司现行制度及工作流程与国家法律法规、监管规章要求及公司实际工作情况相符，各部门现行制度及工作流程设计合理、覆盖全面，涵盖各项业务涉及的各个环节及参与部门，对业务环节执行及参与部门职责进行了明确规定。

公司按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立健全了董事会、经营管理层及合规负责人、内控管理部门、业务管理部门和业务分支机构等多层级的内部控制组织架构，并明确了各级机构应当承担的内部控制职责。根据公司业务性质、发展战略、文化理念和管理要求等因素，公司已按照科学、高效、制衡的原则合理设置内部职能机构，明确各机构的职责权限、部门内部岗位名称、职责等，部门之间、岗位之间、业务之间依照合规和风控要求，建立起相互制衡、信息沟通、隔离墙等内部控制机制，各部门及部门内部各岗位各司其职、各负其责、相互制约、相互协调。

报告期内，公司对纳入评价范围的业务与事项均已建立了内部控制，公司的内部控制机制和风险管理架构健全，内部控制制度能够贯彻落实执行，在内部控制环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面切实发挥了管理控制作用。实际执行过程中亦不存在重大偏差，达到了公司内部控制的目标，不存在影响财务报告和非财务报告的重大缺陷和重要缺陷。能够为实现业务合法合规地开展、发现和控制风险及提高经营效率和效果等目标提供合理的保证。

**(二) 报告期内发现的内部控制重大缺陷的具体情况**

是  否

**十四、公司报告期内对子公司的管理控制情况**

适用  不适用

**十五、内部控制自我评价报告或内部控制审计报告**

**(一) 内控自我评价报告**

内部控制评价报告全文披露日期	2022 年 4 月 12 日	
内部控制评价报告全文披露索引	披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）；公告名称：《2021 年度内部控制自我评价报告》	
纳入评价范围单位资产总额占公司合并财务报表资产总额的比例	100%	
纳入评价范围单位营业总收入占公司合并财务报表营业总收入的比例	100%	
缺陷认定标准		
类别	财务报告	非财务报告
定性标准	重大缺陷：业务损失方面产生较大影响，无法达到部分营运目标或关键业绩指标；信息错报影响方面，错误信息可能会导致使用者做出重大的错误决策或截然相反的决策，造成不可挽回的决策损失；信息系统对数据完整性及业务运营的影响方面，对系统数据完整性具有重大影响，数据的非授权改动对业务运	重大缺陷：营运影响方面，严重损伤公司核心竞争力，严重损害公司为客户服务的能力；监管影响方面，公司被监管部门撤销相关业务许可；声誉影响方面，负面消息在全国各地流传，引起公众关注，引发诉讼，对公司

	<p>作带来重大损失或造成财务数据记录的重大错误。对业务正常运营造成重大影响，致使业务操作大规模停滞和持续出错。</p> <p>重要缺陷：业务损失方面有一定影响，但是经过一定的弥补措施仍可能达到营运目标或关键业绩指标；信息错报影响方面，对信息使用者有一定的影响，可能会影响使用者对于事物性质的判断，在一定程度上可能导致错误的决策；信息系统对数据完整性及业务运营的影响方面，对系统数据完整性具有一定影响，数据的非授权改动对业务运作带来一定的损失及对财务数据记录的准确性产生一定的影响。对业务正常运营造成一定影响，致使业务操作效率低下。</p> <p>一般缺陷：业务损失方面有极小影响或轻微影响，例如对收入、客户、市场份额等有轻微影响；信息错报影响方面，对内、外部信息使用者不会产生影响，或对信息准确性有轻微影响，但不会影响使用者的判断；信息系统对数据完整性及业务运营的影响方面，对系统数据完整性不会产生影响。对业务正常运营没有产生影响，或对系统数据完整性会产生有限影响，数据的非授权改动对业务运作及财务数据记录产生损失轻微。对业务正常运营没有直接影响，业务部门及客户没有察觉。</p>	<p>声誉造成重大损害。</p> <p>重要缺陷：营运影响方面，对内外部均造成了一定影响，比如关键员工或客户流失；监管影响方面，公司被监管部门暂停相关业务许可；声誉影响方面，负面消息在某区域流传，对公司声誉造成中等损害。</p> <p>一般缺陷：营运影响方面，对日常营运没有影响，或仅影响内部效率，不直接影响对外展业；监管影响方面，除被监管部门撤销或暂停相关业务许可以外的其他监管影响；声誉影响方面，负面消息在公司内部流传，公司声誉没有受损，或负面消息在当地局部流传，对公司声誉造成轻微损害。</p>
<p>定量标准</p>	<p>重大缺陷：一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过营业收入总额或资产总额的 2%（含），或超过利润总额的 10%（含），并且反映为严重偏离公司内部控制目标的。</p> <p>重要缺陷：一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果大于营业收入总额或资产总额的 1%（含），小于营业收入总额或资产总额的 2%（不含）；或大于利润总额的 5%（含）小于利润总额的 10%（不含），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的。</p> <p>一般缺陷：一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果小于营业收入总额或资产总额的 1%（不含），或小于利润总额的 5%（不含）。</p>	<p>重大缺陷：一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过资产总额的 2%（含），或超过利润总额的 10%（含），并且反映为严重偏离公司内部控制目标的。</p> <p>重要缺陷：一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果大于资产总额的 1%（含），小于资产总额的 2%（不含）；或大于利润总额的 5%（含）小于利润总额的 10%（不含），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的。</p> <p>一般缺陷：一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果小于资产总额的 1%（不含），或小于利润总额的 5%（不含）。</p>
<p>财务报告重大缺陷数量（个）</p>	0	
<p>非财务报告重大缺陷数量（个）</p>	0	
<p>财务报告重要缺陷数量（个）</p>	0	
<p>非财务报告重要缺陷数量（个）</p>	0	

**（二）内部控制审计报告**

√ 适用 □ 不适用

内部控制审计报告中的审议意见段	
长城证券于 2021 年 12 月 31 日按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。	
内控审计报告披露情况	已披露
内部控制审计报告全文披露日期	2022 年 4 月 12 日

内部控制审计报告全文披露索引	披露网址：巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）；公告名称：《2021 年度内部控制审计报告》
内控审计报告意见类型	标准无保留意见
非财务报告是否存在重大缺陷	否

会计师事务所是否出具非标准意见的内部控制审计报告

是  否

会计师事务所出具的内部控制审计报告与董事会的自我评价报告意见是否一致

是  否

## 十六、动态风险控制指标监控和补足机制建立情况

### （一）公司动态的风险控制指标监控机制建立情况

根据《证券公司风险控制指标管理办法》《证券公司风险控制指标计算标准规定》《证券公司风险控制指标动态监控系统指引》《证券公司流动性风险管理指引》等规定，公司制定了《风险控制指标管理办法》《流动性风险管理办法》《风险控制指标动态监控系统管理办法》，建立了风险控制指标动态监控系统，对净资本和流动性指标等各项风险控制指标进行日常监控与分析，及时向监管部门报告风险指标变动及超预警、超标情况；按月向监管部门上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营和资产管理的业务监管报表及专项监管报表等；新开展业务及时纳入风险控制指标监控体系；监管标准如有调整，及时按新要求调整监控系统，对监控系统的有效性、准确性进行校对及维护。

### （二）风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

为做好事前业务规模风险控制，保证公司净资本和流动性风险控制指标任一时点均在监管范围内，公司建立了多种场景的压力测试方法，涵盖多项业务及投资决策，为公司进行资金分配、确定业务规模、安排融资计划提供决策支持。

### （三）资本补足机制

公司建立了净资本补足机制，确保公司净资本和流动性风险控制指标任一时点均在监管范围内。当净资本和流动性指标等风险控制指标达到公司内部预警标准时，立即启动内部应急机制，采取措施补足净资本或优化业务结构化解风险。

### （四）报告期内风险控制指标达标情况

2021 年，公司以净资本和流动性为核心的风险控制指标整体运行良好。截至报告期末，公司各项风险控制指标均符合监管要求，详见本报告“第二节 公司简介和主要财务指标”之“十三、母公司净资本及有关风险控制指标”。

## 十七、风险管理情况

### （一）全面风险管理落实情况

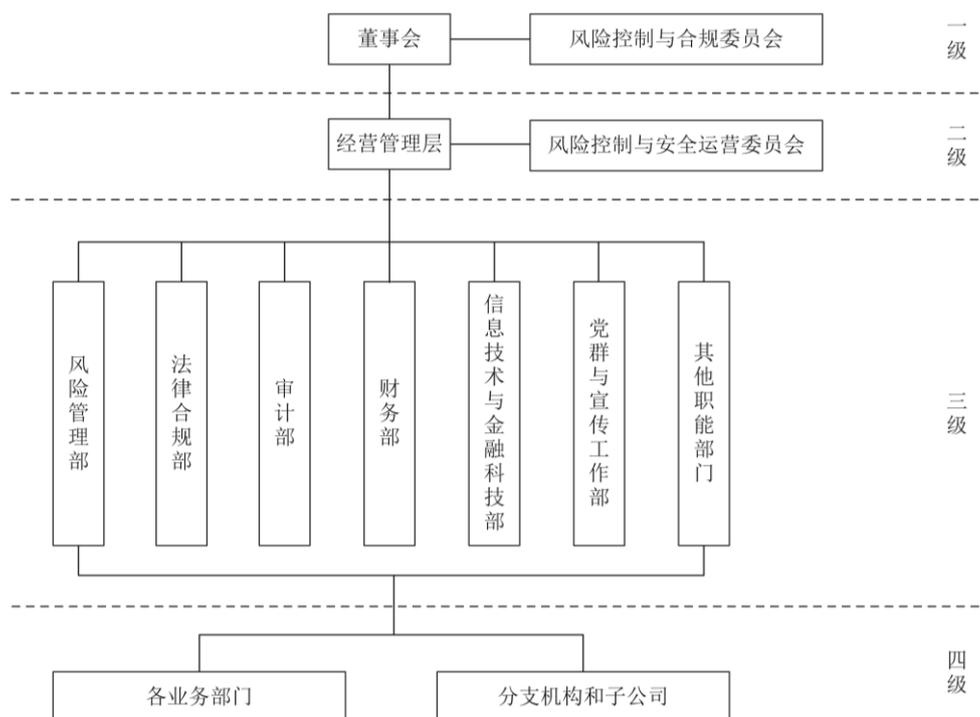
公司通过实施全面的风险管理机制和内部控制流程，建立了涵盖市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险、声誉风险的监测、评估与管理体系统。

报告期内，公司对照《证券公司风险控制指标管理办法》和《证券公司全面风险管理规范》等监管文件，制定落实全面风险管理要求的工作方案，从全面风险管理的组织架构、管理制度、信息系统、指标体系、人才队伍等方面进行了梳理自查

和全面建设，明确以董事会风险控制与合规委员会为首的四级风险管理组织架构，加大对风险管理信息技术系统及风险管理  
人员能力提升的投入，确保全面风险管理工作满足管理规范的各项要求。

### 1、风险管理组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，公司风险管理组织结构图及各级组织、人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：



#### (1) 董事会风险控制与合规委员会

公司董事会承担全面风险管理的最终责任，负责审批公司全面风险管理基本制度、风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额，董事会风险控制与合规委员会是董事会下设的专门委员会，负责审议公司风险管理总体目标和风险管理基本政策，对须董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见。

#### (2) 经营管理层及风险控制与安全运营委员会

公司经营管理层依据董事会的授权，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，对全面风险管理承担主要责任。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作。公司总裁办公会下设风险控制与安全运营委员会，风险控制与安全运营委员会根据总裁办公会授权，负责经营过程中风险事项评估，并对各业务条线进行风险承担的授权。

#### (3) 风险管理职能部门

公司风险管理职能部门包括风险管理部、法律合规部、审计部、财务部、信息技术与金融科技部、党群与宣传部等部门。风险管理部是公司风险控制的职能管理部门及风险控制与安全运营委员会的日常办事机构，履行全面风险管理职责，负责推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、子公司、分支机构的风险管理工作，牵头管理公司面临的市场风险、信用风险、操作风险，监控流动性风险指标，制定

并完善风险管理政策、制度和流程。法律合规部负责牵头管理公司的法律合规风险和洗钱风险，通过实施合规与法律咨询、合规与法律审核、合规与法律培训、合规报告、合规检查、合规考核、信息隔离管理、反洗钱日常监控等风险管理职能对公司合规风险、法律风险和洗钱风险进行有效地监控、识别、评估、报告和防范，避免公司受到法律制裁、监管处罚、重大财物损失或声誉损失。审计部是对公司经营活动、财务收支、经济效益、经济责任进行内部审查和监督的专门机构，负责公司各项审计、检查、内控评价等工作，确保公司内控体系有效运行。财务部是公司会计核算、财务管理的职能机构，负责公司会计核算、财务分析、预算管理、资金筹集、自有资金使用和流动性管理等工作。信息技术与金融科技部是公司信息系统规划、建设、运行、管理与维护的主管部门，负责持续以信息技术稳定支持公司各条业务线运作和经营管理，持续加强公司数据治理和数据决策能力，全面提升公司风控合规水平和运营效率。党群与宣传部牵头管理公司的声誉风险，负责日常舆情监测和舆情风险报告处置等工作。其他风险管理职能部门分别在其职责范围内行使相应的风险管理职能。

#### （4）各业务部门、分支机构及子公司的风险管理岗位

各业务部门、子公司及分支机构的负责人是各单位风险管理工作的第一责任人。为加强一线单位的风险管理工作，各业务部门、子公司及分支机构设置了风控经理岗位，负责本单位一线具体风险管理事务，协助本单位负责人建立并完善风险管理工作机制。另外，公司修订并发布《风控考核办法》，进一步加强公司业务一线风险管理工作的有效性、确保各一线风控岗位尽职履责，四级风控体系落到实处。

## 2、风险管理制度体系

为推动公司风险管理体系的有效运作，确保公司各项业务经营活动在合规运作及风险可测、可控、可承受的前提下开展，公司制订了完善的风险管理规章制度体系，由上至下覆盖各类风险类型、各项业务，为日常风险管理工作提供明确的依据。主要的规章制度包括：《全面风险管理制度》《市场风险管理办法》《信用风险管理办法》《操作风险管理办法》《流动性风险管理办法》《合规管理办法》等。针对各业务分别制定了相应的风险管理办法，主要包括：《固定收益自营业务风险管理办法》《自营权益投资风险管理办法》《资产管理业务风险管理办法》《经纪业务风险管理办法》《场外期权交易业务风险管理办法》《代销金融产品业务风险管理办法》《控股子公司风险管理办法》等。

## 3、风险管理量化指标体系建设

公司自上而下建立了风险偏好、风险容忍度和风险限额的风险管理量化指标体系。公司每年初确定风险偏好、风险容忍度指标，并根据不同的业务性质、规模和复杂程度，将风险容忍度、风险限额指标进一步细分至各业务条线和业务部门，定期监控、报告风险限额执行情况。

## 4、压力测试机制

根据《证券公司压力测试指引》，公司制订了《风控指标压力测试管理办法》，明确了多部门分工合作的压力测试组织体系、压力测试触发情景的定性定量标准，通过建立常规化的压力测试机制有效评估压力情况下公司风险控制指标、各类型风险限额指标的状况。

## 5、专业人才

风险管理部配备了熟悉证券业务与风险管理技能的专业人员，并提供相应的资源支持。风险管理部对自营投资、资产管理、融资融券、股票质押等业务进行嵌入式监控和风险预警，对创新业务进行风险评估，对风险事项提出处理意见，并且监督落实。

## 6、系统建设

公司持续推进各类风险管理信息系统的建设和升级工作，目前已上线的风险管理系统包括市场风险管理系统、信用风险内评系统、流动性管理系统、净资本管理系统、并表系统、同一客户以及业务监控系统等。为完善公司全面风险管理系统建设，加强风险数据治理，公司已完成风险数据集市项目，包括公司市场和信用风险数据集市的建设、市场风险监测自动化、风险集市 APP 页面及管理驾驶舱等内容，进一步贯彻和落实全面风险管理规范的要求。此外，为了加强公司操作风险管理，目前正在积极部署操作风险管理系统，以便实现三大工具的应用落地。

## 7、风险控制指标体系

为确保公司以净资本和流动性为核心的各项风险控制指标满足监管要求，有效控制风险，公司建立“风险控制与安全运营委员会—风险管理部、财务部—业务部门及其他职能管理部门”三级监控体系，负责风险控制指标动态监控工作。公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常监控与分析，并按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等。

## 8、公司创新业务的风险控制

2021 年，公司严守监管底线，有序开展日常业务。与此同时，公司也在积极寻找新的发展机遇、继续推进自主创新，为客户提供创新的业务解决方案。

为使创新业务的风控工作有章可循，公司制定了《全面风险管理制度》《风险控制与安全运营委员会工作条例》《新业务、新产品和新系统风险与合规管理办法》等风控制度对创新业务的设立、风险评估及决策审批流程进行了规范。公司建立了四级风控体系，创新业务均按照内部风控流程要求执行审批。在业务初创阶段，公司风控合规管理部门将对创新业务进行风险评估、压力测试及合规论证等前置风险管理工作；公司风险控制与安全运营委员会对项目进行全面的风险评估，提出风险评估意见及风控措施，并将业务纳入公司全面风险管理体系和风险限额指标进行监控。

在创新活动开展时，公司风险管理部根据创新活动的风险特征，设计各类监控指标和风险限额，实时跟踪创新业务的风险动态，并与业务部门共同制定创新业务风险应急预案，当风险指标出现异常时，及时对业务部门进行风险提示，确保创新活动风险敞口始终控制在公司净资本和流动性水平可承受范围。

另外，公司审计部不定期对公司创新业务开展情况进行稽核，检视创新业务内控机制是否完善、制度是否健全、审批程序是否符合公司规定，针对审计发现的问题及时出具整改报告，促使公司创新业务健康有序地发展。

### （二）风控合规、信息技术投入情况

公司高度重视风控合规工作，在“安全”“领先”的战略指导思想下，深入贯彻风控合规价值创造，将“风险及合规管理全覆盖”作为公司的工作重心，坚持风控合规管理与业务发展并举，加速建设全面风险管理体系。公司风控合规投入主要

包括：风控合规系统建设投入、风控合规人员成本投入、风控合规培训、风控合规外部咨询及其他投入。2021 年，公司风控合规投入总金额为人民币 7,793.99 万元，其中人力成本 7,037.44 万元，风控合规系统建设投入 474.59 万元，培训及其他投入 281.96 万元。

## 十八、合规管理体系建设情况和稽核部门稽核情况

### （一）合规管理体系建设及合规检查情况

公司已建立并不断完善全方位、多层次的合规管理组织架构和制度体系。公司建立董事会风险控制与合规委员会、合规总监、法律合规部、一线合规管理人员四个层级的合规管理组织体系。董事会下设风险控制与合规委员会履行董事会相关合规管理职责，就合规履职情况向董事会报告。合规总监为公司合规负责人，由董事会根据董事长的提名任免，直接向公司董事会负责，合规总监负责对公司经营管理及员工执业行为的合规性进行审查、监督和检查。公司设立法律合规部，承担公司日常合规管理工作，向合规总监负责并报告工作，各一线单位配备合规管理人员负责第一道防线的合规管理具体事务，就本单位合规管理情况向合规总监报告，接受合规总监的监督、指导和考核。

报告期内，公司不断完善制度和机制建设，修订了 20 余项合规管理制度，构建三道防线系统机制和分支机构三级合规管理体系建设，进一步完善立体化合规管理防控机制。公司进一步加强合规文化建设，持续开展合规宣导、培训和征文活动，加强风控合规考核和问责。公司进一步规范合规审查与检查质量建设，一是严把入口关，建立新业务、新产品、新系统的前置审查机制；二是高质量落实日常合规咨询、审核和监测；三是有序开展合规检查工作，内容覆盖融资类业务、资产管理业务、内部控制、反洗钱、证券研究业务、债券交易、员工执业行为等方面。公司进一步推进合规数字赋能，加强合规管理系统建设，自研开发智慧合规风控平台，建设法规库、执业行为管控、反洗钱监控等模块。

### （二）稽核部门建设及稽查情况

审计部为公司独立的监督检查部门，依据国家有关法律法规及本公司的规章制度，对公司各部门、各分支机构及子公司的财务、业务及经营管理等各项活动进行监督、评价和建议。审计部向公司董事会负责，定期或不定期向董事会汇报工作，各项工作接受监事会的检查和监督。审计范围覆盖主要业务条线、子公司及职能部门。公司内部审计人员的任职资格明确，目前审计部已配备了会计、审计、信息技术等必要的专业技术人才。

公司制定了规范的审计制度及工作流程并建立了审计管理系统，对提高审计质量与效率有较好的促进作用。审计人员严格按照各项内部审计制度规定在公司的授权下独立开展审计工作，审计部通过部门三层级复核进行审计项目质量控制。

报告期内，公司各项审计监督工作按照审计计划有序开展，内部审计环境未发生重大变化，审计项目和内控评价检查基本覆盖所有业务和部门，并针对审计检查提出的内控和管理方面的薄弱环节派专人进行跟踪检查，保障整改工作落实到位，积极有效降低风险。

## 十九、董事会关于内部控制责任的声明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告是公

司董事会的责任。监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。经营管理层负责组织领导企业内部控制的日常运行。公司董事会、监事会及公司董事、监事、高级管理人员保证《2021 年度内部控制自我评价报告》内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司内部控制的目的是合理保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，促进实现发展战略。由于内部控制存在的固有局限性，故仅能为实现上述目标提供合理保证。此外，由于情况的变化可能导致内部控制变得不恰当，或对控制政策和程序遵循的程度降低，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的风险。

根据公司财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日（2021 年 12 月 31 日），公司不存在财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。根据公司非财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日（2021 年 12 月 31 日），公司未发现非财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。自内部控制评价报告基准日至内部控制评价报告发出日（2022 年 4 月 12 日）之间，公司没有发生影响内部控制有效性评价结论的情况。

## 二十、建立财务报告内部控制的依据

按照《公司法》《证券法》《会计法》《企业内部控制基本规范》及其配套指引以及《证券公司内部控制指引》等相关法律法规的要求，公司建立了较为完善的业务和财务管理体系，健全财务报告各环节授权批准机制，制定并不断完善相应的规章制度，规范公司财务报告控制流程，明确各岗位职责并充分发挥会计信息技术在业务核算、收入与成本费用支出等方面的管理。

## 二十一、上市公司治理专项行动自查问题整改情况

报告期内，公司按照监管要求对公司治理的情况进行了详细自查，发现公司存在董事会到期未换届情况和董事连续两次未亲自出席董事会会议情形等问题。公司高度重视，及时完成董事会换届并对公司董事、监事、高级管理人员进行了上市公司规范运作及董监高履职责任专题培训，同时在具体实践中进一步丰富董事会召开形式，支持公司董事通过电话、网络、视频等形式出席会议，进一步提升了公司整体规范运作水平。

## 第五节 环境和社会责任

### 一、重大环保问题

上市公司及其子公司是否属于环境保护部门公布的重点排污单位

是  否

公司及各下属子公司均主要从事金融服务相关业务，不属于环境保护部门公布的重点排污单位。

### 二、社会责任情况

公司牢固树立和维护诚信、守法、公正的良好形象，依法纳税，主动承担促进社会经济发展和推动证券行业进步的义务，为社会财富的保值增值、我国资本市场的稳健发展做出了积极贡献。报告期内，公司热心支持乡村振兴、社会公益事业，营造良好的企业文化，加强投资者教育、投资者适当性管理，切实保护投资者权益。详见公司于 2022 年 4 月 12 日在深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《2021 年度社会责任报告》。

### 三、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴的情况

#### （一）巩固脱贫攻坚成果、有序衔接乡村振兴工作概要

为积极贯彻落实党中央关于金融服务实体经济、金融助力乡村振兴方面要求，公司继续对“一司一县”结对帮扶脱贫县江西遂川、湖北团风、湖南新化、宁夏盐池和新疆尼勒克进行常态帮扶，同时还延伸了对陕西榆林、新疆阿合奇和青海尖扎等国家重点帮扶地区的乡村振兴帮扶工作，帮助上述脱贫地区巩固脱贫攻坚成果。

本报告期内，公司因地制宜在消费帮扶、公益帮扶、文化帮扶、智力帮扶、组织帮扶和生态帮扶等方面开展帮扶工作，累计投入资金 958.14 万元。具体来说，报告期内公司累计采购脱贫地区农产品 399.07 万元，公益性支出 534.50 万元，通过开展建设长城证券乡村爱心书屋项目，捐赠爱心桌椅、书柜、书籍，以及开展修路活动等方式大力推动文化帮扶、生态帮扶工作取得进展，并通过开展金融知识培训和联学共建活动等方式深入落实智力帮扶和组织帮扶。另外，公司积极响应中国证监会援疆援藏帮扶号召，聘用 4 名新疆籍和 1 名西藏籍少数民族应届大学毕业生，多渠道巩固脱贫攻坚成果。

#### （二）乡村振兴精准帮扶成效

指标	单位	数量/开展情况
一、总体情况	—	—
其中：1.资金	万元	958.14
二、分项投入	—	—
1.消费帮扶	万元	399.07
2.公益帮扶	万元	523.89
3.文化帮扶	万元	12.61
4.智力帮扶	万元	4.17

5.组织帮扶	万元	7.78
6.生态帮扶	万元	10.6

### (三) 后续精准帮扶计划

2022 年，公司将在乡村振兴、消费助农、教育援助、资本市场知识培训、文化帮扶、组织帮扶、生态帮扶等方面继续开展帮扶工作。在开展乡村振兴帮扶工作方面，考虑到结对帮扶工作的延续性及公司实际情况，将在江西遂川县、湖南新化县、湖北团风县、陕西榆林市横山区等脱贫县中选择一个脱贫县重点开展帮扶工作。在开展消费助农工作方面，将继续推动公司优先采购脱贫县的优质农产品。在开展教育帮扶工作方面，将继续开展对帮扶脱贫县学生的资助及乡村学校教学设施的改善，帮助脱贫县学生更好地完成学业。在开展资本市场知识培训方面，将继续普及对脱贫地区群众的投资者教育工作，同时适当开展投资大讲堂等理财讲座，帮助脱贫地区群众在防范金融风险的同时，提高财产性收入。在开展文化帮扶方面，将对结对帮扶地区开展乡村公共文化设施建设，丰富乡村精神文化生活。在开展组织帮扶方面，将面向结对帮扶地区开展基层党组织联学联建活动，开展党建人才培养，支持农村基层组织建设。在开展生态帮扶方面，支持结对帮扶地区及脱贫地区农业农村生产生活服务设施改善活动，服务美丽乡村建设。

## 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履行完毕及截至报告期末尚未履行完毕的承诺事项

√ 适用 □ 不适用

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
首次公开发行股票时所作承诺	华能集团	股份限售承诺	自公司股票上市之日起三十六个月内，不转让或者委托他人管理华能集团直接或间接持有的发行人股份，也不由公司回购该部分股份。如公司股票上市后六个月内出现特定情形，华能集团持有的公司股票的锁定期限自动延长六个月。	2018年10月26日	自公司股票上市之日起36个月内	已履行完毕
	华能集团	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	已向本公司出具《避免同业竞争的承诺函》，承诺将依照法律、行政法规的规定，不从事与本公司及本公司所控制企业主营业务相同或相似并构成竞争的业务，亦不会通过新设或收购等方式直接或间接控股其他证券公司等。	2018年10月26日	至华能集团按照相关法律法规及股票上市等规则的规定不再需要向公司承担避免同业竞争义务时	正常履行中
	华能集团	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	已向本公司出具《规范关联交易的承诺函》，承诺将不会违反法律法规的规定，违规占用公司的资金或其他资产；与公司发生的关联交易，将按照公平合理和正常的商业交易条件进行，并严格和善意地履行与公司签订的各种关联交易协议，不会向公司谋求任何不当利益或收益；同时将通过对所控制的其他企业的控制权，促使该企业遵守前述承诺等。	2018年10月26日	在公司公开发行A股股票并上市后，华能集团在作为公司实际控制人期间	正常履行中
	华能资本	股份限售承诺	自公司股票上市之日起三十六个月内，不转让或者委托他人管理华能资本直接或间接持有的发行人股份，也不由公司回购该部分股份。如公司股票上市后六个月内出现特定情形，华能资本持有的公司股票的锁定期限自动延长六个月。	2018年10月26日	自公司股票上市之日起36个月内	已履行完毕
	华能资本	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	已向本公司出具《避免同业竞争的承诺函》《避免同业竞争的补充承诺函》，承诺将依照法律、行政法规的规定，不从事与本公司及本公司所控制企业主营业务相同或相似并构成竞争的业务，亦不会通过新设或收购等方式直接或间接控股其他证券公司等。	2018年10月26日	至华能资本按照相关法律法规及股票上市等规则的规定不再需要向公司承担避免同业竞争义务时	正常履行中

	华能资本	关于同业竞争、关联交易、资金占用方面的承诺	已向本公司出具《规范关联交易的承诺函》，承诺将不会违反法律法规的规定，违规占用公司的资金或其他资产；与公司发生的关联交易，将按照公平合理和正常的商业交易条件进行，并严格和善意地履行与公司签订的各种关联交易协议，不会向公司谋求任何不当利益或收益；同时将通过对所控制的其他企业的控制权，促使该等企业遵守前述承诺等。	2018 年 10 月 26 日	在公司公开发行 A 股股票并上市后，华能资本在作为公司股东期间	正常履行中
	华能资本	IPO 稳定股价承诺	公司上市后三年内，除不可抗力等因素导致的股价下跌之外，若长城证券 A 股股票连续 20 个交易日收盘价均低于公司最近一期经审计的每股净资产（最近一期审计基准日后，公司因利润分配、资本公积金转增股本、增发、配股等情况导致公司净资产或股份总数出现变化的，每股净资产相应进行调整），在符合国有资产监督管理部门、证券监督管理部门及证券交易所关于股份回购、股份增持、信息披露等有关规定的情况下，公司、华能资本、公司董事和高级管理人员（独立董事以及不在公司领取薪酬的董事除外）应在 15 个工作日内协商确定启动股价稳定预案规定的及/或有关法律法规、监管机构届时要求的一种或多种措施，以稳定公司股价。华能资本将采取增持长城证券 A 股股票的措施稳定公司股价，即如相关主体确定由华能资本以增持长城证券 A 股股票方式稳定公司股价的，则华能资本应在稳定股价启动条件触发之日起 15 个工作日内向长城证券提出增持公司 A 股股票的计划，并由长城证券按规定予以公告。华能资本为稳定股价之目的进行股份增持的，除应符合相关法律、行政法规和规范性文件之要求外，其单次或连续十二个月内用于增持公司股票的资金不超过最近一个会计年度自长城证券获得的现金分红（税后），且增持价格不高于公司最近一期每股净资产。公司股票若连续五个交易日收盘价均超过公司最近一期经审计的每股净资产时，华能资本可以终止实施股票增持事宜。如相关主体确定采取公司回购 A 股股票措施稳定公司股价，公司应在稳定股价启动条件触发之日起 15 个工作日内召开董事会，审议稳定股价具体方案，并提交股东大会审议。公司对回购股份作出决议，须经出席会议的股东所持表决权的三分之二以上通过，华能资本承诺就该等回购事宜在股东大会上投赞成票。	2018 年 10 月 26 日	自公司股票上市之日起 36 个月内	已履行完毕
	华能资本	股份减持承诺	华能资本所持公司股票在锁定期满后两年内减持的，减持价格不低于发行价，且每年减持的股份数量合计不超过其所持有的公司首次公开发行股票前已发行股份数量的 10%；华能资本所持公司股票在锁定期满后两年后减持的，减持数量视需要而定。自公司股票上市之日起至减持期间如因派发现金红利、送股、转增股	2018 年 10 月 26 日	自公司股票上市之日起 60 个月内	正常履行中

			本、增发新股等事项进行除权、除息的，则减持价格下限、减持股份数量上限将按有关规定进行相应调整。			
	深圳能源	股份减持承诺	深圳能源所持公司股票在锁定期满后两年内减持的，减持价格不低于发行价，且每年减持的股份数量合计不超过其所持有的公司首次公开发行股票前已发行股份数量的 50%；深圳能源所持公司股票在锁定期满后两年后减持的，减持数量视需要而定。自公司股票上市之日起至减持期间如因派发现金红利、送股、转增股本、增发新股等事项进行除权、除息的，则减持价格下限、减持股份数量上限将按有关规定进行相应调整。	2018 年 10 月 26 日	自公司股票上市之日起 36 个月内	已履行完毕
	深圳新江南	股份减持承诺	深圳新江南所持公司股票在锁定期满后两年内，可减持全部或部分所持股份，减持价格不低于公司届时最近一期合并报表口径每股净资产（最近一期报表截止日后，如因派发现金红利、送股、转增股本、增发新股等事项导致公司净资产或股份总数出现变化的，每股净资产应相应进行调整）。	2018 年 10 月 26 日	自公司股票上市之日起 36 个月内	已履行完毕
	公司董事、监事、高级管理人员	IPO 稳定股价承诺	公司上市后三年内，除不可抗力等因素导致的股价下跌之外，若长城证券 A 股股票连续 20 个交易日收盘价均低于公司最近一期经审计的每股净资产（最近一期审计基准日后，公司因利润分配、资本公积金转增股本、增发、配股等情况导致公司净资产或股份总数出现变化的，每股净资产相应进行调整），在符合国有资产监督管理部门、证券监督管理部门及证券交易所关于股份回购、股份增持、信息披露等有关规定的情况下，公司、华能资本、公司董事和高级管理人员（独立董事以及不在公司领取薪酬的董事除外）应在 15 个工作日内协商确定启动股价稳定预案规定的及/或有关法律法规、监管机构届时要求的一种或多种措施，以稳定公司股价。拟通过公司董事及高级管理人员增持长城证券 A 股股票以稳定公司股价的，公司董事、高级管理人员应在稳定股价启动条件触发之日起 15 个工作日内向长城证券提出增持公司 A 股股票的计划，并由长城证券按规定予以公告。公司董事、高级管理人员连续十二个月内用于增持公司股票的资金不超过该等董事、高级管理人员最近一个会计年度自公司领取的薪酬（税后）的 50%。在遵守所适用的法律、法规、规范性文件的前提下，增持价格不高于公司最近一期每股净资产。公司股票若连续五个交易日收盘价均超过公司最近一期经审计的每股净资产时，公司董事、高级管理人员可以终止实施股票增持事宜。自公司首次公开发行股票并上市之日起三年内，公司若聘任新的董事、高级管理人员，将	2018 年 10 月 26 日	自公司股票上市之日起 36 个月内	已履行完毕

			<p>在聘任前要求其签署承诺书，保证其履行本公司本次发行上市时的董事、高级管理人员已做出的相应承诺。如相关主体确定通过公司回购 A 股股票方式稳定公司股价，公司应在稳定股价启动条件触发之日起 15 个工作日内召开董事会，审议稳定股价具体方案。公司董事承诺就该等回购事宜在董事会上投赞成票（如有投票权）。</p>			
	<p>本公司</p>	<p>IPO 稳定股价承诺</p>	<p>公司上市后三年内，除不可抗力等因素导致的股价下跌之外，若长城证券 A 股股票连续 20 个交易日收盘价均低于公司最近一期经审计的每股净资产（最近一期审计基准日后，公司因利润分配、资本公积金转增股本、增发、配股等情况导致公司净资产或股份总数出现变化的，每股净资产相应进行调整），在符合国有资产监督管理部门、证券监督管理部门及证券交易所关于股份回购、股份增持、信息披露等有关规定的情况下，公司、华能资本、公司董事和高级管理人员（独立董事以及不在公司领取薪酬的董事除外）应在 15 个工作日内协商确定启动股价稳定预案规定的及/或有关法律法规、监管机构届时要求的一种或多种措施，以稳定公司股价。拟采取公司回购 A 股股票措施稳定公司股价的，公司应在稳定股价启动条件触发之日起 15 个工作日内召开董事会，审议稳定股价具体方案。公司董事承诺就该等回购事宜在董事会上投赞成票（如有投票权）。公司股东大会对回购股份作出决议，须经出席会议的股东所持表决权的三分之二以上通过，华能资本承诺就该等回购事宜在股东大会上投赞成票。在股东大会审议通过股份回购方案后，公司应依法通知债权人，向国有资产监督管理部门、证券监督管理部门、证券交易所等主管部门报送相关材料，办理审批或备案手续。在完成必需的审批、备案、信息披露等程序后，公司方可实施相应的股份回购方案。公司为稳定股价之目的进行股份回购的，除应符合相关法律、行政法规和规范性文件之要求外，单次触发启动条件时用于回购股份的资金总额原则上不低于公司上一会计年度实现的归属于母公司股东的净利润的 5%，不超过公司上一会计年度实现的归属于母公司股东的净利润的 20%；用于回购股份的资金应为公司自有资金，不得以本次发行上市所募集的资金回购股份；回购价格不高于公司最近一期经审计的每股净资产。公司通过交易所集中竞价交易方式、要约方式或证券监督管理部门认可的其他方式回购公司股票。公司董事会公告回购股份预案后且在回购计划实施完毕前，公司股票若连续五个交易日收盘价均超过公司最近一期经审计的每股净资产时，公司董事会可以做出决议终止回购股份事宜。</p>	<p>2018 年 10 月 26 日</p>	<p>自公司股票上市之日起 36 个月内</p>	<p>已履行完毕</p>

非公开发行股票时所作承诺	公司董事、高级管理人员	其他承诺	1.承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益。2.承诺对自身的职务消费行为进行约束。3.承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动。4.承诺支持由董事会或董事会薪酬与考核委员会制定的薪酬制度与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相挂钩。5.如公司未来实施股权激励计划，承诺支持拟公布的公司股权激励计划的行权条件与公司填补被摊薄即期回报措施的执行情况相挂钩。6.公司本次发行实施完毕前，若中国证券监督管理委员会或深圳证券交易所作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足该等规定时，届时将按照中国证券监督管理委员会或深圳证券交易所的最新规定出具补充承诺。7.承诺切实履行公司制定的有关填补被摊薄即期回报措施以及对此作出的任何有关填补被摊薄即期回报措施的承诺，若违反上述承诺或拒不履行上述承诺给公司或者股东造成损失的，愿意依法承担相应的责任。	2021年7月27日	长期	正常履行中
	华能集团、华能资本	其他承诺	1.承诺不越权干预公司经营管理活动。2.承诺不侵占公司利益。3.公司本次发行实施完毕前，若中国证券监督管理委员会或深圳证券交易所作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足该等规定时，届时将按照中国证券监督管理委员会或深圳证券交易所的最新规定出具补充承诺。4.承诺切实履行公司制定的有关填补被摊薄即期回报措施以及对此作出的任何有关填补被摊薄即期回报措施的承诺，若违反上述承诺或拒不履行上述承诺给公司或者其他股东造成损失的，愿意依法承担相应的责任。	2021年7月27日	长期	正常履行中
	华能资本	股份减持承诺	一、本次发行预案公告日前六个月内，华能资本不存在减持所持有的长城证券股份的情形。二、自本次发行预案公告日至本次发行定价基准日（即本次发行的发行期首日）期间，华能资本将不以任何方式减持所持有的长城证券股份，亦不存在减持所持有的长城证券股份的计划。三、自本次发行定价基准日至本次发行完成后六个月内，华能资本将不以任何方式减持所持有的长城证券股份，亦不存在减持所持有的长城证券股份的计划。四、上述不减持股份包括承诺期间长城证券发生资本公积转增资本、派送股票红利、配股等产生的股份。五、如中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所对于上述在特定期间不存在减持情况及减持计划的承诺有不同意见或要求的，华能资本将按照中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所的意见或要求进行修订并执行。	2021年11月15日	本次非公开发行股票完成后6个月内	正常履行中

	华能集团	股份减持承诺	一、本次发行预案公告日前六个月内，华能集团及其控制的主体不存在减持所持有的长城证券股份的情形。二、自本次发行预案公告日至本次发行定价基准日（即本次发行的发行期首日）期间，华能集团及其控制的主体将不以任何方式减持所持有的长城证券股份，亦不存在减持所持有的长城证券股份的计划。三、自本次发行定价基准日至本次发行完成后六个月内，华能集团及其控制的主体将不以任何方式减持所持有的长城证券股份，亦不存在减持所持有的长城证券股份的计划。四、上述不减持股份包括承诺期间长城证券发生资本公积转增资本、派送股票红利、配股等产生的股份。五、如中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所对于上述在特定期限不存在减持情况及减持计划的承诺有不同意见或要求的，华能集团将按照中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所的意见或要求进行修订并执行。	2021 年 11 月 15 日	本次非公开发行股票完成后 6 个月内	正常履行中
股改承诺	无					
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺						
资产重组时所作承诺						
股权激励承诺						
其他对公司中小股东所作承诺						
承诺是否按时履行	是					
如承诺超期未履行完毕的，应当详细说明未完成履行的具体原因及下一步的工作计划	不适用					

**(二) 公司资产或项目存在盈利预测，且报告期仍处在盈利预测期间，公司就资产或项目达到原盈利预测及其原因做出说明**

适用  不适用

## 二、控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

适用  不适用

公司报告期不存在控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金。

## 三、违规对外担保情况

适用  不适用

公司报告期无违规对外担保情况。

## 四、董事会对最近一期“非标准审计报告”相关情况的说明

适用  不适用

## 五、董事会、监事会、独立董事对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

适用  不适用

## 六、与上年度财务报告相比，会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的情况说明

适用  不适用

报告期内，公司不存在会计估计变更或重大会计差错更正的情况。

2018年，财政部修订发布了《企业会计准则第21号——租赁》（以下简称新租赁准则），要求境内外同时上市的企业以及在境外上市并采用国际财务报告准则或企业会计准则编制财务报表的企业，自2019年1月1日起施行；其他执行企业自2021年1月1日起施行。根据衔接规定，公司自2021年1月1日起执行新租赁准则，选择采用追溯调整法并不调整可比期间数据。经评估，该会计政策变更会增加公司的总资产和总负债，不会对所有者权益和净利润产生重大影响。详见本报告“第十节 财务报告”之附注三“30.1 重要会计政策变更”相关部分。

## 七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明

适用  不适用

详见本报告“第十节 财务报告”之附注“六、合并范围的变更”相关部分。

## 八、聘任、解聘会计师事务所情况

现聘任的会计师事务所

境内会计师事务所名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬（万元）	159.50
境内会计师事务所审计服务的连续年限	3年
境内会计师事务所注册会计师姓名	陈晓莹、梁永炘
境内会计师事务所注册会计师审计服务的连续年限	3年

当期是否改聘会计师事务所

是  否

聘请内部控制审计会计师事务所、财务顾问或保荐人情况

适用  不适用

2021 年度，公司聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司 2021 年度内部控制审计机构，支付内部控制审计费用 30 万元。

## 九、年度报告披露后面临退市情况

适用  不适用

## 十、公司破产重整，兼并、分立以及子公司、分公司、营业部新设和处置等重大情况

### （一）破产重整相关事项

适用  不适用

公司报告期未发生破产重整相关事项。

### （二）公司兼并或分立情况

适用  不适用

### （三）子公司、分公司、营业部新设和处置情况

适用  不适用

1、报告期内，公司未新设子公司；子公司处置情况详见本报告“第三节 管理层讨论与分析”之“十、主要控股参股公司分析”相关内容。

2、报告期内，公司新设 1 家营业部，撤销 4 家营业部，具体如下：

报告期内，公司新设 1 家分支机构。具体情况如下：

分支机构名称	分支机构地址	设立时间
余姚四明西路证券营业部	浙江省余姚市四明西路352-354号	2021年10月26日

报告期内，为进一步优化营业网点布局并加强资源整合，推进财富管理业务转型升级，公司撤销 4 家营业部，具体情况如下：

序号	分支机构名称	分支机构地址
1	哈尔滨友谊西路证券营业部	哈尔滨市道里区友谊西路富力江湾新城公建区T2栋26层2610号
2	朝阳新华路证券营业部	朝阳市双塔区新华路三段9-1号113C号东数第2户、2东数第2户
3	包头青年路证券营业部	内蒙古自治区包头市青山区青年路26号万达广场2-107
4	长沙星沙开元路证券营业部	湖南省长沙县星沙街道湘商世纪鑫城905室

**3、报告期内，共 14 家分支机构进行了搬迁、更名，具体情况如下：**

序号	搬迁前		搬迁后	
	分支机构名称	分支机构地址	分支机构名称	分支机构地址
1	浙江分公司	浙江省杭州市下城区延安路385号杭州嘉里中心2幢905室	浙江分公司	浙江省杭州市下城区延安路385号杭州嘉里中心2幢904、905室
2	江西分公司	江西省南昌市红谷滩万达广场A区A3办公楼-2501室、2502室、2503室、2504室、2510室	江西分公司	江西省南昌市红谷滩区丰和南大道2111号世茂新城4-2#商业楼115室、116室、117室、118室
3	深圳梅林路证券营业部	深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路126号卓越梅林中心广场（南区）卓悦汇B908	深圳梅林路证券营业部	深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路126号卓越梅林中心广场（南区）卓悦汇B908、B909
4	杭州联创街证券营业部	浙江省杭州市余杭区五常街道联创街188号5号楼1-14	杭州余杭塘路证券营业部	浙江省杭州市余杭区五常街道余杭塘路1995-1号
5	武汉关山大道证券营业部	湖北省武汉东湖新技术开发区关山大道355号光谷新世界写字楼A座10层1003号	武汉杨园南路证券营业部	洪山区杨园南路41号长航蓝晶绿洲3栋1层1-2室
6	杭州世纪大道证券营业部	杭州市余杭区南苑街道世纪大道158-1号301、302室	杭州南大街证券营业部	浙江省杭州市余杭区南苑街道南大街270、272号
7	南宁民族大道证券营业部	南宁市民族大道146号三祺广场13层1303A、1306号办公室	南宁民族大道证券营业部	南宁市青秀区民族大道146号三祺广场13层1301、1303A、1306号办公室
8	深圳分公司	深圳市福田区香蜜湖街道深南大道7006号813、815	深圳分公司	深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦17层1703、1704
9	深圳深南大道证券营业部	深圳市福田区深南大道7006号富春东方大厦八楼	深圳深南大道证券营业部	深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦17层1701、1702、1705、1706
10	上海中兴路证券营业部	上海市静安区中兴路1286号403A室	上海北苏州路证券营业部	上海市静安区北苏州路1040号A501室
11	深圳龙翔大道证券营业部	深圳市龙岗区龙翔大道万科天誉中央广场D座高区2603	深圳华为稼先路证券营业部	深圳市龙岗区坂田街道岗头社区稼先路2000号有所为大厦301C座313、314
12	晋江迎宾路证券营业部	福建省泉州市晋江市青阳街道迎宾路新世纪豪园一期7A7	泉州丰海路证券营业部	福建省泉州市丰泽区东海街道法石社区大兴街1466号东海泰禾广场19幢1410-1411室
13	资阳娇子大道证券营业部	资阳市雁江区娇子大道二段383号7(F)1-5和7(F)1-6	资阳蜀乡大道证券营业部	资阳市雁江区沱东新区蜀乡大道728号希望城一期希望财富中心22-7、22-8、22-9号
14	海门解放中路证券营业部	海门经济技术开发区贵都之星3幢二楼210室	南通南大街证券营业部	南通市崇川区南大街129号兴胜大厦一层、二层

报告期内，公司分支机构新设、撤销、变更情况对公司业绩无重大影响。

#### (四) 重大的资产处置、收购、置换、剥离情况

适用  不适用

#### (五) 重组其他公司情况

适用  不适用

### 十一、重大诉讼、仲裁事项

适用  不适用

报告期内，公司未发生以下重大诉讼、仲裁事项：涉案金额超过一千万元，且占上市公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的诉讼、仲裁事项；涉及公司股东大会、董事会决议被申请撤销或者宣告无效的诉讼；证券纠纷代表人诉讼。

截至报告期末，公司未达重大诉讼和仲裁披露标准的其他未了结诉讼和仲裁程序的案件（不含资产管理案件、第三方代起诉案件和通道类业务案件）涉案总金额为 18,350 万元。

### 十二、处罚及整改情况

适用  不适用

报告期内，未发生公司及公司董事、监事、高级管理人员被证券期货监管机构、相关自律组织采取行政处罚、公开谴责，或被财税、外汇、审计等部门作出处罚的情况。

报告期内，公司分支机构存在以下被监管部门采取行政监督管理措施的事项：2021 年 8 月 26 日，辽宁证监局印发了《关于对长城证券股份有限公司沈阳惠工街营业部采取出具警示函措施的决定》（[2021]15 号），指出公司沈阳惠工街营业部存在三个方面的问题。公司已通过提交整改报告、强化客户适当性管理和建立健全分支机构三级合规管理架构等多措并举全面落实完成整改。

### 十三、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

适用  不适用

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

### 十四、重大关联交易

#### (一) 与日常经营相关的关联交易

适用  不适用

报告期内，公司发生的日常关联交易均在预计范围内，其中金额超过 3000 万元且占最近一期经审计净资产 5% 以上的关联交易情况如下：

关联交易方	关联关系	关联交易类型	关联交易内容	关联交易定价原则	关联交易价格	关联交易金额（万元）	占同类交易金额的比例	获批的交易额度（万元）	是否超过获批额度	关联交易结算方式	可获得同类交易市价	披露日期	披露索引
华西证券股份有限公司	公司控股股东前任高管担任该公司副董事长	现券买卖	与关联方在银行间市场进行现券买卖交易	市场原则	不适用	884,580.09	不适用	以实际发生数计算	否	券款对付	不适用	2021年4月13日	披露网址: 巨潮资讯网 (www.cninfo.com.cn), 公告名称: 《关于公司 2021 年度预计日常关联交易的公告》, 公告编号: 2021-017。
招商银行股份有限公司	公司董事担任该公司董事	现券买卖及回购	与关联方在银行间市场进行现券买卖及回购交易	市场原则	不适用	963,070.21	不适用	以实际发生数计算	否	券款对付	不适用	2021年4月13日	披露网址: 巨潮资讯网 (www.cninfo.com.cn), 公告名称: 《关于公司 2021 年度预计日常关联交易的公告》, 公告编号: 2021-017。
招商证券股份有限公司	公司董事担任该公司董事	现券买卖及回购	与关联方在银行间市场进行现券买卖及回购交易	市场原则	不适用	206,137.35	不适用	以实际发生数计算	否	券款对付	不适用	2021年4月13日	披露网址: 巨潮资讯网 (www.cninfo.com.cn), 公告名称: 《关于公司 2021 年度预计日常关联交易的公告》, 公告编号: 2021-017。
博时基金管理有限公司	公司董事担任该公司董事	现券买卖及回购	与关联方在银行间市场进行现券买卖及回购交易	市场原则	不适用	3,287,603.08	不适用	以实际发生数计算	否	券款对付	不适用	2021年4月13日	披露网址: 巨潮资讯网 (www.cninfo.com.cn), 公告名称: 《关于公司 2021 年度预计日常关联交易的公告》, 公告编号: 2021-017。

华夏银行股份有限公司	公司独立董事曾担任该公司独立董事	现券买卖及回购	与关联方在银行间市场进行现券买卖及回购交易	市场原则	不适用	355,982.75	不适用	以实际发生数计算	否	券款对付	不适用	2021年4月13日	披露网址: 巨潮资讯网 (www.cninfo.com.cn), 公告名称: 《关于公司2021年度预计日常关联交易的公告》, 公告编号: 2021-017。
合计				--	--	5,697,373.48	--	以实际发生数计算	--	--	--	--	--
大额销货退回的详细情况				无									
按类别对本期将发生的日常关联交易进行总金额预计的, 在报告期内的实际履行情况				不适用									
交易价格与市场参考价格差异较大的原因				不适用									

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

适用  不适用

(三) 共同对外投资的关联交易

适用  不适用

(四) 关联债权债务往来

适用  不适用

(五) 与存在关联关系的财务公司的往来情况

适用  不适用

贷款业务

关联方	关联关系	贷款额度 (万元)	贷款利率范围	期初余额 (万元)	本期发生额 (万元)		期末余额 (万元)
					本期合计贷款金额	本期合计还款金额	
中国华能财务有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司	20,000.00	4%	0.00	31,377.00	11,377.00	20,000.00

上述贷款业务的借款方为公司控股孙公司华能宝城物华, 报告期内公司 (母公司) 与关联财务公司未发生贷款业务。

## （六）公司控股的财务公司与关联方的往来情况

适用  不适用

## （七）其他重大关联交易

适用  不适用

## 十五、重大合同及其履行情况

### （一）托管、承包、租赁事项情况

#### 1、托管情况

适用  不适用

#### 2、承包情况

适用  不适用

#### 3、租赁情况

适用  不适用

公司报告期不存在损益额达到公司利润总额 10% 以上的托管、承包、租赁情况。

### （二）重大担保

适用  不适用

公司报告期不存在重大担保情况。

### （三）委托他人进行现金资产管理情况

#### 1、委托理财情况

适用  不适用

公司报告期不存在委托理财。

#### 2、委托贷款情况

适用  不适用

公司报告期不存在委托贷款。

### （四）其他重大合同

适用  不适用

公司报告期不存在其他重大合同。

## 十六、其他重大事项的说明

### （一）公司债务融资事项

为及时满足公司业务发展的需要，有序、高效开展公司债务融资工作，公司对债务融资工具进行统筹管理。报告期内，公

司合理安排债务融资工作，公开发行公司债券累计 80 亿元，非公开发行次级债券累计 10 亿元，发行短期融资券累计 130 亿元。截至 2021 年 12 月 31 日，公司债务融资工具总体待偿余额为 297.30 亿元。公司报告期内债券发行情况，详见本报告“第九节 债券相关情况”相关内容。

## （二）2020 年度权益分派实施情况

2021 年 6 月，公司召开 2020 年度股东大会审议通过《关于公司 2020 年度利润分配方案的议案》，公司 2020 年度利润分配以总股本 3,103,405,351 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 1.00 元（含税），合计派发现金红利 310,340,535.10 元，不送红股，不以资本公积转增股本。2021 年 7 月 21 日，公司通过《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露了《2020 年年度权益分派实施公告》（公告编号 2021-040）。2020 年年度权益分派已于 2021 年 7 月 28 日实施完毕。

## （三）组织架构调整事项

为适应公司战略以及市场竞争形势要求，2021 年 4 月，公司第二届董事会第五次会议审议通过《关于公司组织架构调整的议案》，同意对公司组织架构进行调整。详见公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《第二届董事会第五次会议决议公告》（公告编号 2021-022）。

## （四）非公开发行 A 股股票事项

2021 年 7 月、8 月，公司召开第二届董事会第七次会议、2021 年第一次临时股东大会，审议通过《关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案》《关于提请股东大会授权董事会办理本次非公开发行股票相关事宜的议案》等议案。2021 年 9 月，中国证监会对公司本次非公开发行股票行政许可申请予以受理。2021 年 10 月，公司收到《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》；按照反馈意见的要求，公司会同各中介机构认真核查反馈意见所列问题，于 2021 年 11 月完成反馈意见回复。2022 年 2 月，公司召开第二届董事会第十三次会议，审议通过《关于调整公司非公开发行 A 股股票方案的议案》等议案，根据股东大会授权对本次非公开发行股票方案相关内容进行了调整。2022 年 3 月，公司本次非公开发行股票申请获中国证监会发行审核委员会审核通过。详见公司于 2021 年 7 月 27 日、8 月 14 日、9 月 30 日、10 月 20 日、11 月 16 日和 2022 年 2 月 19 日、3 月 15 日、3 月 29 日披露的相关公告。截至本报告披露日，公司尚未收到中国证监会关于本次非公开发行股票的书面核准文件，公司将在收到中国证监会予以核准的正式文件后另行公告，敬请广大投资者注意投资风险。

## （五）修订《公司章程》等相关制度

2021 年 12 月，公司召开 2021 年第二次临时股东大会，审议通过《关于修订〈公司章程〉的议案》和《关于修订公司〈董事会议事规则〉的议案》，公司已按照规定完成《公司章程》备案相关工作。详见公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《第二届董事会第十一次会议决议公告》（公告编号 2021-083）、《2021 年第二次临时股东大会决议公告》（公告编号 2021-088）。

## （六）续聘会计师事务所事项

2021 年 12 月，公司召开 2021 年第二次临时股东大会，审议通过《关于续聘会计师事务所的议案》，同意续聘德勤华永

会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2021 年年报审计会计师事务所，审计费用合计不超过人民币 160 万元，其中财务报表审计费用不超过人民币 130 万元，内部控制审计费用不超过人民币 30 万元。详见公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《第二届董事会第十一次会议决议公告》（公告编号 2021-083）、《关于拟续聘会计师事务所的公告》（公告编号 2021-084）、《2021 年第二次临时股东大会决议公告》（公告编号 2021-088）。

### （七）报告期内公司重大行政许可事项的相关情况

序号	批复名称	批复文号	批复日期
1	关于同意长城证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复	证监许可[2021]1276号	2021年4月14日
2	关于长城证券股份有限公司在香港特别行政区设立长证国际金融有限公司的复函	机构部函[2021]3696号	2021年11月26日

### （八）监管部门对公司的分类评价结果

公司近三年分类评价结果如下表所示：

年份	2021年	2020年	2019年
分类评价结果	A	B	BBB

## 十七、公司子公司重大事项

### （一）全资子公司长城投资相关重大事项

#### 1、注册资本变更情况

2021 年 1 月，长城投资注册资本由 5 亿元变更为 10 亿元。上述事项相关工商变更登记手续已办理完毕。

#### 2、董事、监事、高级管理人员变动情况

2021 年 5 月，经长城投资第二届董事会十三次会议审议通过，聘任童强先生为总经理。上述事项相关工商变更登记手续已办理完毕。

#### 3、法定代表人变动情况

2021 年 6 月，长城投资法定代表人变更为童强先生。上述事项相关工商变更登记手续已办理完毕。

### （二）全资子公司长城长富相关重大事项

#### 1、董事、监事、高级管理人员变动情况

2021 年 4 月，经长城长富第二届董事会第三十五次会议审议通过，聘任周志德先生为副总经理；2022 年 1 月，经长城长富第二届董事会第四十二次会议审议通过，聘任常玉女士为总经理。上述事项相关工商变更登记手续已办理完毕。

#### 2、下设计和存量项目清理情况

报告期内，长城长富完成了太原国投长城基金管理有限公司、福建夜光达科技股份有限公司等下设机构和直投项目的清退工作，并完成了柳州柳银投资基金管理中心（有限合伙）等存量产品的清理工作。

### （三）控股子公司宝城期货相关重大事项

#### 1、董事、监事、高级管理人员变动情况

2021 年 11 月，宝城期货 2021 年工会会员代表大会选举吕颖女士为第九届董事会职工董事，选举沈剑先生为第九届监事会职工监事；2021 年 12 月，经宝城期货 2021 年股东会第四次会议审议通过，选举马晓星女士、范小新先生、彭艳女士、王振先生为第九届董事会董事，选举赵旭强先生为第九届董事会独立董事，选举宋红梅女士、朱延先生为第九届监事会监事；2021 年 12 月，经宝城期货第九届董事会第一次会议审议通过，选举范小新先生为董事长，聘任马春阳先生为总经理；2021 年 12 月，经宝城期货第九届监事会第一次会议审议通过，选举宋红梅女士为监事会主席。上述事项相关工商变更登记手续均已办理完毕。

#### 2、法定代表人变动情况

2021 年 12 月，宝城期货法定代表人变更为范小新先生。上述事项相关工商变更登记手续已办理完毕。

### 十八、报告期内各单项业务资格的变化情况

报告期内，公司各单项业务资格未发生变化。

### 十九、信息披露索引

报告期内，公司共披露了 207 份公告文件（公告编号 2021-001 至 2021-089），具体请查阅《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）的相关信息：

序号	公告编号	公告名称	公告日期
1	—	中信建投证券股份有限公司关于对公司持续督导的培训报告	2021-01-05
2	—	中信建投证券股份有限公司关于公司2020年度定期现场检查报告	2021-01-05
3	2021-001	第二届董事会第三次会议决议公告	2021-01-12
4	2021-002	2021年度第一期短期融资券发行结果公告	2021-01-13
5	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）募集说明书摘要	2021-01-14
6	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）募集说明书	2021-01-14
7	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）信用评级报告	2021-01-14
8	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）发行公告	2021-01-14
9	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）更名公告	2021-01-14
10	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）票面利率公告	2021-01-15
11	—	关于延长公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）簿记建档时间的公告	2021-01-15
12	—	关于延长公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）簿记建档时间的公告	2021-01-15
13	—	关于延长公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）簿记建档时间的公告	2021-01-15
14	2021-003	2019年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）2021年付息公告	2021-01-19
15	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）发行结果公告	2021-01-20
16	2021-004	关于向全资子公司深圳市长城证券投资有限公司增资及其完成工商变更登记的公告	2021-01-20
17	2021-005	关于2020年度第七期短期融资券兑付完成的公告	2021-01-21

18	—	2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）在深圳证券交易所上市的公告	2021-01-22
19	2021-006	2020年度业绩预告	2021-01-23
20	2021-007	2021年度第二期短期融资券发行结果公告	2021-02-10
21	2021-008	2020年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）（疫情防控债）2021年付息公告	2021-02-18
22	2021-009	关于2020年度第八期短期融资券兑付完成的公告	2021-03-11
23	2021-010	2021年度第三期短期融资券发行结果公告	2021-03-16
24	2021-011	2021年非公开发行次级债券（第一期）发行结果公告	2021-03-24
25	2021-012	关于换领经营证券期货业务许可证的公告	2021-03-24
26	2021-013	2021年度第四期短期融资券发行结果公告	2021-04-10
27	2021-014	第二届董事会第四次会议决议公告	2021-04-13
28	—	2020年年度报告	2021-04-13
29	2021-015	2020年年度报告摘要	2021-04-13
30	—	2020年年度审计报告	2021-04-13
31	—	2020年度社会责任报告	2021-04-13
32	—	2020年度募集资金存放与实际使用情况鉴证报告	2021-04-13
33	2021-016	2020年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告	2021-04-13
34	—	2020年度内部控制自我评价报告	2021-04-13
35	—	2020年度内部控制审计报告	2021-04-13
35	—	2020年度监事履职考核和薪酬情况专项说明	2021-04-13
37	—	独立董事关于公司2021年度预计日常关联交易事项的事前认可意见	2021-04-13
38	—	2020年度风险控制指标报告	2021-04-13
39	—	2020年度涉及财务公司关联交易的存贷款等金融业务的专项说明	2021-04-13
40	—	中信建投证券股份有限公司关于公司2021年度预计日常关联交易事项的核查意见	2021-04-13
41	—	2020年度监事会工作报告	2021-04-13
42	—	2020年度董事履职考核和薪酬情况专项说明	2021-04-13
43	—	关于中国华能财务有限责任公司风险持续评估报告	2021-04-13
44	—	2020年度控股股东及其他关联方资金占用情况的专项说明	2021-04-13
45	—	2020年度独立董事工作报告	2021-04-13
46	2021-017	关于公司2021年度预计日常关联交易的公告	2021-04-13
47	—	中信建投证券股份有限公司关于公司2020年度内部控制自我评价报告的核查意见	2021-04-13
48	2021-018	第二届监事会第二次会议决议公告	2021-04-13
49	2021-019	关于会计政策变更的公告	2021-04-13
50	2021-020	关于2021年度第一期短期融资券兑付完成的公告	2021-04-13
51	—	2020年度董事会工作报告	2021-04-13
52	—	独立董事关于第二届董事会第四次会议相关事项的独立意见	2021-04-13
53	2021-021	关于召开2020年度业绩说明会的公告	2021-04-17
54	—	中信建投证券股份有限公司关于长城证券股份有限公司首次公开发行股票之保荐总结报告书	2021-04-24
55	—	中信建投证券股份有限公司关于长城证券股份有限公司2020年度保荐工作报告	2021-04-24
56	2021-022	第二届董事会第五次会议决议公告	2021-04-29

57	—	2021年第一季度报告全文	2021-04-29
58	2021-023	2021年第一季度报告正文	2021-04-29
59	2021-024	第二届监事会第三次会议决议公告	2021-04-29
60	2021-025	关于向专业投资者公开发行公司债券获中国证券监督管理委员会同意注册批复的公告	2021-05-06
61	2021-026	关于2021年度第二期短期融资券兑付完成的公告	2021-05-11
62	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）募集说明书摘要	2021-05-19
63	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）发行公告	2021-05-19
64	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）募集说明书	2021-05-19
65	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）信用评级报告	2021-05-19
66	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）票面利率公告	2021-05-20
67	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）簿记建档时间的公告	2021-05-20
68	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）簿记建档时间的公告（第二次）	2021-05-20
69	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）簿记建档时间的公告（第三次）	2021-05-20
70	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）簿记建档时间的公告（第四次）	2021-05-20
71	2021-027	2021年度第五期短期融资券发行结果公告	2021-05-20
72	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）发行结果公告	2021-05-25
73	2021-028	长城证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）2021年付息公告	2021-05-26
74	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）在深圳证券交易所上市的公告	2021-05-27
75	—	独立董事关于华能宝城物华有限公司与中国华能财务有限责任公司签订流动资金借款合同暨关联交易的事前认可意见	2021-06-01
76	—	关于中国华能财务有限责任公司风险评估报告	2021-06-01
77	—	关于华能宝城物华有限公司在中国华能财务有限责任公司存贷款风险的应急处置预案	2021-06-01
78	2021-029	第二届董事会第六次会议决议公告	2021-06-01
79	2021-030	关于华能宝城物华有限公司与中国华能财务有限责任公司签订流动资金借款合同暨关联交易的公告	2021-06-01
80	2021-031	关于召开2020年度股东大会的通知	2021-06-01
81	—	独立董事关于第二届董事会第六次会议相关事项的独立意见	2021-06-01
82	—	长城证券股份有限公司及其发行的公开发行债券跟踪评级报告	2021-06-04
83	—	长城证券股份有限公司公开发行公司债券2021年跟踪评级报告	2021-06-11
84	2021-032	关于2021年度第三期短期融资券兑付完成的公告	2021-06-11
85	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）募集说明书	2021-06-17
86	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）募集说明书摘要	2021-06-17
87	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）信用评级报告	2021-06-17
88	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）发行公告	2021-06-17
89	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）票面利率公告	2021-06-18

90	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）簿记建档时间的公告	2021-06-18
91	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）簿记建档时间的公告（第二次）	2021-06-18
92	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）簿记建档时间的公告（第三次）	2021-06-18
93	—	关于延长长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）簿记建档时间的公告（第四次）	2021-06-18
94	—	2020年度股东大会的法律意见书	2021-06-22
95	2021-033	2020年度股东大会决议公告	2021-06-22
96	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）发行结果公告	2021-06-23
97	—	长城证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）在深圳证券交易所上市的公告	2021-06-25
98	2021-034	2021年度第六期短期融资券发行结果公告	2021-06-25
99	—	中信建投证券股份有限公司关于长城证券股份有限公司公司债券2020年度受托管理事务报告	2021-06-29
100	—	安信证券股份有限公司关于长城证券股份有限公司公司债券2020年度受托管理事务报告	2021-06-29
101	—	国信证券股份有限公司关于长城证券股份有限公司公司债券2020年度受托管理事务报告	2021-06-29
102	—	长城证券股份有限公司关于行使“20 长城 02”发行人赎回选择权的第一次提示性公告	2021-07-02
103	2021-035	2021 年度第七期短期融资券发行结果公告	2021-07-08
104	2021-036	关于 2021 年度第四期短期融资券兑付完成的公告	2021-07-08
105	2021-037	关于公司证券事务代表辞职的公告	2021-07-08
106	—	长城证券股份有限公司关于行使“20 长城 02”发行人赎回选择权的第二次提示性公告	2021-07-09
107	2021-038	长城证券股份有限公司 2019 年面向合格投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）2021 年付息公告	2021-07-14
108	—	长城证券股份有限公司关于行使“20 长城 02”发行人赎回选择权的第三次提示性公告	2021-07-16
109	2021-039	长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种一）2021 年付息公告	2021-07-20
110	2021-040	2020 年年度权益分派实施公告	2021-07-21
111	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）募集说明书	2021-07-21
112	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）募集说明书摘要	2021-07-21
113	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）信用评级报告	2021-07-21
114	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）发行公告	2021-07-21
115	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）簿记建档时间的公告	2021-07-22
116	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）簿记建档时间的公告（第二次）	2021-07-22
117	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）簿记建档时间的公告（第三次）	2021-07-22
118	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）簿记建档时间的公告（第四次）	2021-07-22
119	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）簿记建档时间的公告（第五次）	2021-07-22

120	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）簿记建档时间的公告（第六次）	2021-07-22
121	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）票面利率公告	2021-07-22
122	2021-041	第二届董事会第七次会议决议公告	2021-07-27
123	2021-042	关于非公开发行 A 股股票构成关联交易暨签订附条件生效的股份认购协议的公告	2021-07-27
124	2021-043	关于公司本次非公开发行股票摊薄即期回报、填补措施及相关主体承诺的公告	2021-07-27
125	2021-044	关于提请股东大会同意华能资本服务有限公司免于以要约方式增持公司股份的公告	2021-07-27
126	2021-045	关于提请股东大会授权董事会办理本次非公开发行股票相关事宜的公告	2021-07-27
127	2021-046	第二届监事会第四次会议决议公告	2021-07-27
128	2021-047	关于召开 2021 年第一次临时股东大会的通知	2021-07-27
129	—	独立董事关于第二届董事会第七次会议相关事项的事前认可意见	2021-07-27
130	—	独立董事关于第二届董事会第七次会议相关事项的独立意见	2021-07-27
131	—	非公开发行 A 股股票预案	2021-07-27
132	—	前次募集资金使用情况专项鉴证报告	2021-07-27
133	—	关于非公开发行股票募集资金使用可行性分析报告	2021-07-27
134	—	前次募集资金使用情况报告	2021-07-27
135	—	未来三年（2021 年-2023 年）股东回报规划	2021-07-27
136	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）发行结果公告	2021-07-27
137	2021-048	2021 年半年度业绩快报	2021-07-29
138	2021-049	长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）2021 年付息公告	2021-07-29
139	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）在深圳证券交易所上市的公告	2021-07-29
140	2021-050	长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）赎回结果暨摘牌公告	2021-07-30
141	2021-051	2021 年第一次临时股东大会决议公告	2021-08-14
142	—	2021 年第一次临时股东大会的法律意见书	2021-08-14
143	2021-052	关于 2021 年度第五期短期融资券兑付完成的公告	2021-08-19
144	2021-053	关于公司独立董事任期届满的公告	2021-08-19
145	2021-054	股票交易异常波动公告	2021-08-20
146	2021-055	第二届董事会第八次会议决议公告	2021-08-21
147	—	独立董事关于第二届董事会第八次会议相关事项的独立意见	2021-08-21
148	2021-056	第二届监事会第五次会议决议公告	2021-08-21
149	—	2021 年半年度报告	2021-08-21
150	2021-057	2021 年半年度报告摘要	2021-08-21
151	—	2021 年上半年风险控制指标报告	2021-08-21
152	—	2021 年半年度财务报告	2021-08-21
153	2021-058	2021 年上半年募集资金存放与实际使用情况的专项报告	2021-08-21
154	—	关于对中国华能财务有限责任公司的风险持续评估报告	2021-08-21
155	2021-059	2021 年度第八期短期融资券发行结果公告	2021-08-31

156	2021-060	第二届董事会第九次会议决议公告	2021-09-04
157	—	2020 年度高级管理人员履职、绩效考核和薪酬情况专项说明	2021-09-04
158	—	独立董事关于第二届董事会第九次会议相关事项的独立意见	2021-09-04
159	2021-061	关于撤销 2 家证券营业部的公告	2021-09-07
160	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）募集说明书	2021-09-16
161	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）发行公告	2021-09-16
162	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）募集说明书摘要	2021-09-16
163	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）信用评级报告	2021-09-16
164	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）簿记建档时间的公告	2021-09-17
165	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）簿记建档时间的公告（第二次）	2021-09-17
166	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）簿记建档时间的公告（第三次）	2021-09-17
167	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）簿记建档时间的公告（第四次）	2021-09-17
168	—	关于延长长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）簿记建档时间的公告（第五次）	2021-09-17
169	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）票面利率公告	2021-09-17
170	2021-062	关于 2021 年度第六期短期融资券兑付完成的公告	2021-09-18
171	2021-063	关于撤销朝阳新华路证券营业部的公告	2021-09-18
172	2021-064	长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）2021 年付息公告	2021-09-23
173	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）发行结果公告	2021-09-24
174	—	长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）在深圳证券交易所上市的公告	2021-09-29
175	2021-065	关于非公开发行股票申请获得中国证监会受理的公告	2021-09-30
176	2021-066	关于 2021 年度第七期短期融资券兑付完成的公告	2021-10-08
177	2021-067	长城证券股份有限公司 2019 年面向合格投资者公开发行公司债券（第三期）付息兑付暨摘牌公告	2021-10-19
178	2021-068	长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种二）2021 年付息公告	2021-10-19
179	2021-069	2021 年度第九期短期融资券发行结果公告	2021-10-20
180	2021-070	关于收到《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》的公告	2021-10-20
181	—	中信建投证券股份有限公司关于长城证券股份有限公司首次公开发行前已发行股份上市流通的核查意见	2021-10-22
182	2021-071	首次公开发行前已发行股份上市流通提示性公告	2021-10-22
183	2021-072	第二届董事会第十次会议决议公告	2021-10-28
184	2021-073	第二届监事会第六次会议决议公告	2021-10-28
185	2021-074	2021 年第三季度报告	2021-10-28
186	2021-075	2021 年度第十期短期融资券发行结果公告	2021-11-12
187	2021-076	关于非公开发行 A 股股票申请文件反馈意见回复的公告	2021-11-16

188	—	关于长城证券股份有限公司非公开发行股票申请文件反馈意见的回复	2021-11-16
189	2021-077	关于控股股东、实际控制人承诺在特定期间不减持公司股份的公告	2021-11-16
190	2021-078	2021 年度第十一期短期融资券发行结果公告	2021-11-17
191	2021-079	关于参加 2021 深圳辖区上市公司投资者网上集体接待日活动的公告	2021-11-26
192	2021-080	关于 2021 年度第八期短期融资券兑付完成的公告	2021-11-30
193	2021-081	关于申请设立香港子公司获得中国证监会同意复函的公告	2021-12-02
194	2021-082	关于撤销长沙星沙开元路证券营业部的公告	2021-12-07
195	2021-083	第二届董事会第十一次会议决议公告	2021-12-10
196	—	独立董事关于续聘会计师事务所事项的事前认可意见	2021-12-10
197	—	独立董事关于第二届董事会第十一次会议相关事项的独立意见	2021-12-10
198	—	内幕信息知情人登记管理制度（2021 年 12 月）	2021-12-10
199	2021-084	关于拟续聘会计师事务所的公告	2021-12-10
200	2021-085	关于召开 2021 年第二次临时股东大会的通知	2021-12-10
201	2021-086	2021 年度第十二期短期融资券发行结果公告	2021-12-14
202	2021-087	关于加入联合国支持的负责任投资原则组织的自愿性信息披露公告	2021-12-24
203	2021-088	2021 年第二次临时股东大会决议公告	2021-12-28
204	—	董事会议事规则（2021 年 12 月）	2021-12-28
205	—	公司章程（2021 年 12 月）	2021-12-28
206	—	2021 年第二次临时股东大会的法律意见书	2021-12-28
207	2021-089	第二届董事会第十二次会议决议公告	2021-12-31

## 第七节 股份变动及股东情况

### 一、股份变动情况

#### (一) 股份变动情况

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例
一、有限售条件股份	1,439,224,420	46.38%	0	0	0	-1,439,224,420	-1,439,224,420	0	0.00%
国有法人持股	1,439,224,420	46.38%	0	0	0	-1,439,224,420	-1,439,224,420	0	0.00%
二、无限售条件股份	1,664,180,931	53.62%	0	0	0	+1,439,224,420	+1,439,224,420	3,103,405,351	100.00%
人民币普通股	1,664,180,931	53.62%	0	0	0	+1,439,224,420	+1,439,224,420	3,103,405,351	100.00%
三、股份总数	3,103,405,351	100.00%	0	0	0	0	0	3,103,405,351	100.00%

股份变动的原因

适用  不适用

2021 年 10 月 26 日，公司控股股东华能资本所持有的 1,439,224,420 股公司首次公开发行前已发行股份锁定期满，解除限售并上市流通。详见公司于 2021 年 10 月 22 日在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、深交所网站（www.szse.cn）及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《首次公开发行前已发行股份上市流通提示性公告》（公告编号：2021-071）。

股份变动的批准情况

适用  不适用

股份变动的过户情况

适用  不适用

股份变动对最近一年和最近一期基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产等财务指标的影响

适用  不适用

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

股东名称	期初限售股数	本期增加限售股数	本期解除限售股数	期末限售股数	限售原因	解除限售日期

华能资本服务有限公司	1,439,224,420	0	1,439,224,420	0	公司控股股东持有的公司首次公开发行前已发行股份	2021 年 10 月 26 日
合计	1,439,224,420	0	1,439,224,420	0	--	--

## 二、证券发行与上市情况

### (一) 报告期内证券发行（不含优先股）情况

适用  不适用

报告期内，公司未发行股票类、可转换公司债券类、分离交易的可转换公司债券类及其他衍生证券类证券。

报告期内，公司债券发行相关情况详见本报告“第九节 债券相关情况”。

### (二) 公司股份总数及股东结构的变动、公司资产和负债结构的变动情况说明

适用  不适用

### (三) 现存的内部职工股情况

适用  不适用

## 三、股东和实际控制人情况

### (一) 公司股东数量及持股情况

单位：股

报告期末普通股股东总数	71,157	年度报告披露日前上一月末普通股股东总数	82,351	报告期末表决权恢复的优先股股东总数	0	年度报告披露日前上一月末表决权恢复的优先股股东总数	0	
持股 5% 以上的股东或前 10 名股东持股情况								
股东名称	股东性质	持股比例	报告期末持股数量	报告期内增减变动情况	持有有限售条件的股份数量	持有无限售条件的股份数量	质押、标记或冻结情况	
							股份状态	数量
华能资本服务有限公司	国有法人	46.38%	1,439,224,420	0	0	1,439,224,420	-	-
深圳能源集团股份有限公司	国有法人	12.69%	393,972,330	0	0	393,972,330	-	-
深圳新江南投资有限公司	境内非国有法人	12.36%	383,437,823	0	0	383,437,823	-	-
福建湄洲湾控股有限公司	国有法人	1.28%	39,792,304	0	0	39,792,304	质押	19,896,152
香港中央结算有限公司	境外法人	1.10%	34,282,075	+16,401,494	0	34,282,075	-	-
宁夏恒利通经贸有限公司	境内非国有法人	0.60%	18,755,115	-521,400	0	18,755,115	质押	2,560,000
中国建设银行股份有限公司－国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	其他	0.55%	17,158,499	-1,772,150	0	17,158,499	-	-

新疆生产建设兵团国有资产经营有限责任公司	国有法人	0.49%	15,093,728	0	0	15,093,728	-	-
中铁二院工程集团有限责任公司	国有法人	0.43%	13,370,000	0	0	13,370,000	-	-
福建九华发展股份有限公司	境内非国有法人	0.41%	12,796,217	0	0	12,796,217	-	-
战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东的情况	无							
上述股东关联关系或一致行动的说明	<p>1.华能资本的控股股东为华能集团。截至报告期末，公司股东深圳能源的第二大股东是华能国际电力股份有限公司，持有深圳能源 25.02% 股份，华能集团直接和间接合计持有华能国际电力股份有限公司 46.22% 股份；深圳能源的前十大股东之一广东电力发展股份有限公司持有深圳能源 0.32% 股份，广东电力发展股份有限公司的控股股东为广东省能源集团有限公司，华能集团持有广东省能源集团有限公司 24% 股权。</p> <p>2.截至报告期末，福建湄洲湾控股有限公司与福建九华发展股份有限公司的实际控制人均为莆田市国有资产管理委员会。</p> <p>除此之外，公司未获知上述股东之间是否存在关联关系或一致行动关系。</p>							
上述股东涉及委托/受托表决权、放弃表决权情况的说明	不适用							
前 10 名股东中存在回购专户的特别说明	不适用							
前 10 名无限售条件股东持股情况								
股东名称	报告期末持有无限售条件股份数量	股份种类						
		股份种类	数量					
华能资本服务有限公司	1,439,224,420	人民币普通股	1,439,224,420					
深圳能源集团股份有限公司	393,972,330	人民币普通股	393,972,330					
深圳新江南投资有限公司	383,437,823	人民币普通股	383,437,823					
福建湄洲湾控股有限公司	39,792,304	人民币普通股	39,792,304					
香港中央结算有限公司	34,282,075	人民币普通股	34,282,075					
宁夏恒利通经贸有限公司	18,755,115	人民币普通股	18,755,115					
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	17,158,499	人民币普通股	17,158,499					
新疆生产建设兵团国有资产经营有限责任公司	15,093,728	人民币普通股	15,093,728					
中铁二院工程集团有限责任公司	13,370,000	人民币普通股	13,370,000					
福建九华发展股份有限公司	12,796,217	人民币普通股	12,796,217					
前 10 名无限售流通股股东之间，以及前 10 名无限售流通股股东和前 10 名股东之间关联关系或一致行动的说明	<p>1.华能资本的控股股东为华能集团。截至报告期末，公司股东深圳能源的第二大股东是华能国际电力股份有限公司，持有深圳能源 25.02% 股份，华能集团直接和间接合计持有华能国际电力股份有限公司 46.22% 股份；深圳能源的前十大股东之一广东电力发展股份有限公司持有深圳能源 0.32% 股份，广东电力发展股份有限公司的控股股东为广东省能源集团有限公司，华能集团持有广东省能源集团有限公司 24% 股权。</p> <p>2.截至报告期末，福建湄洲湾控股有限公司与福建九华发展股份有限公司的实际控制人</p>							

	均为莆田市国有资产管理委员会。 除此之外，公司未获知前 10 名无限售流通股股东之间，以及前 10 名无限售流通股股东和前 10 名股东之间是否存在关联关系或一致行动关系。
前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明	公司前 10 名普通股股东中，宁夏恒利通经贸有限公司除通过普通证券账户持有 3,392,600 股外，还通过长城证券客户信用交易担保证券账户持有 15,362,515 股，实际合计持有 18,755,115 股。

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

是  否

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

## (二) 持股 10% (含 10%) 以上的前 5 名股东情况

### 1、法人

适用  不适用

股东名称	法定代表人	总经理	成立日期	统一社会信用代码	注册资本	主营业务
华能资本服务有限公司	叶才	叶才	2003 年 12 月 30 日	91110000710932363D	980,000 万元人民币	投资及投资管理；资产管理；资产受托管理；投资及管理咨询服务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）
深圳能源集团股份有限公司	王平洋	李英峰	1993 年 8 月 21 日	91440300192241158P	475,738.9916 万元人民币	各种常规能源和新能源的开发、生产、购销；投资和经营能提高能源使用效益的高科技产业；投资和经营与能源相关的原材料的开发和运输、港口、码头和仓储工业等；经营和进出口本公司能源项目所需的成套设备、配套设备、机具和交通工具等；投资和经营与能源相配套的地产、房地产业和租赁等产业；各种能源工程项目的设计、施工、管理和经营，以及与能源工程相关的人员培训、咨询及其他相关服务业务；环保技术开发、转让和服务；物业管理、自有物业租赁；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营；从事信息系统运营维护，系统集成，软件开发的信息技术服务；计算机软硬件、电子产品、耗材、办公设备销售与租赁；能提高社会效益的其他业务。
深圳新江南投资有限公司	徐鑫	胡晓东	1994 年 11 月 30 日	91440300618829961P	2,300 万美元	投资兴办工业及其它各类实业（具体项目另行申报），投资信息咨询，企业形象设计，商务代理，企业经营策划，财务咨询。

### (2) 自然人

适用  不适用

## (三) 公司控股股东情况

控股股东性质：中央国有控股

控股股东类型：法人

控股股东名称	法定代表人	成立日期	统一社会信用代码	主要经营业务
华能资本服务有限公司	叶才	2003 年 12 月 30 日	91110000710932363D	投资及投资管理；资产管理；资产受托管理；投资及管理咨询服务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）
控股股东报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况		华西证券（002926.SZ），持股数量 29,780 万股，持股比例 11.34%； 晋商银行（02558.HK），持股数量 60,000 万股，持股比例 10.28%。		

控股股东报告期内变更

适用  不适用

公司报告期控股股东未发生变更。

#### （四）公司实际控制人及其一致行动人

实际控制人性质：中央国资管理机构

实际控制人类型：法人

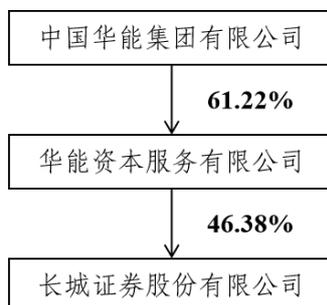
实际控制人名称	法定代表人	成立日期	统一社会信用代码	主要经营业务
中国华能集团有限公司	舒印彪	1989 年 3 月 31 日	9111000010001002XD	组织电力（煤电、气电、水电、风电、太阳能发电、核电、生物质能发电等）、热、冷、汽的开发、投资、建设、生产、经营、输送和销售；组织煤炭、煤层气、页岩气、水资源的开发、投资、经营、输送和销售；信息、交通运输、节能环保、配售电、煤化工和综合智慧能源等相关产业、产品的开发、投资和销售；电力及相关产业技术的科研开发、技术咨询服务、技术转让、工程建设、运行、维护、工程监理以及业务范围内设备的成套、配套、监造、运行、检修和销售；国内外物流贸易、招投标代理、对外工程承包；业务范围内相关的资产管理、物业管理；业务范围内的境内外投资业务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）
实际控制人报告期内控制的其他境内外上市公司的股权情况		华能国际（600011.SH，00902.HK），持股数量 725,537 万股，持股比例 46.22%； 内蒙华电（600863.SH），持股数量 349,576 万股，持股比例 53.56%； 华能水电（600025.SH），持股数量 907,200 万股，持股比例 50.40%； 新能泰山（000720.SZ），持股数量 52,392 万股，持股比例 40.62%。		

实际控制人报告期内变更

适用  不适用

公司报告期实际控制人未发生变更。

公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图



实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司

适用  不适用

**(五)公司控股股东或第一大股东及其一致行动人累计质押股份数量占其所持公司股份数量比例达到 80%**

适用  不适用

**(六) 其他持股在 10%以上的法人股东**

适用  不适用

**(七) 控股股东、实际控制人、重组方及其他承诺主体股份限制减持情况**

适用  不适用

#### 四、股份回购在报告期的具体实施情况

股份回购的实施进展情况

适用  不适用

采用集中竞价交易方式减持回购股份的实施进展情况

适用  不适用

## 第八节 优先股相关情况

适用  不适用

## 第九节 债券相关情况

### 一、企业债券

适用  不适用

报告期公司不存在企业债券。

### 二、公司债券

适用  不适用

#### (一) 公司债券基本信息

截至本报告披露日，公司已发行且在存续期内的公司债券如下：

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额（元）	利率	还本付息方式	交易场所
长城证券股份有限公司 2017 年非公开发行公司债券（品种二）	17 长证 02	114199	2017 年 7 月 27 日	2017 年 7 月 27 日	2022 年 7 月 27 日	780,000,000	5.08%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2019 年面向合格投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）	19 长城 03	112932	2019 年 7 月 15 日	2019 年 7 月 16 日	2022 年 7 月 16 日	2,000,000,000	3.69%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）（疫情防控债）	20 长城 01	149036	2020 年 2 月 19 日	2020 年 2 月 20 日	2023 年 2 月 20 日	1,000,000,000	3.09%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年证券公司次级债券（第一期）	20 长城 C1	115107	2020 年 3 月 12 日	2020 年 3 月 12 日	2025 年 3 月 12 日	1,000,000,000	4.00%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年证券公司次级债券（第二期）	20 长城 C2	115115	2020 年 5 月 22 日	2020 年 5 月 22 日	2023 年 5 月 22 日	1,000,000,000	3.37%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所

长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）	20 长城 03	149183	2020 年 7 月 29 日	2020 年 7 月 31 日	2022 年 7 月 31 日	1,000,000,000	3.25%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券（第三期）	20 长城 C3	115118	2020 年 8 月 21 日	2020 年 8 月 21 日	2023 年 8 月 21 日	1,000,000,000	4.04%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）	20 长城 05	149248	2020 年 9 月 23 日	2020 年 9 月 25 日	2023 年 9 月 25 日	1,000,000,000	3.84%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种一）	20 长城 06	149268	2020 年 10 月 20 日	2020 年 10 月 22 日	2022 年 4 月 22 日	1,000,000,000	3.47%	每 9 个月付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种二）	20 长城 07	149269	2020 年 10 月 20 日	2020 年 10 月 22 日	2022 年 10 月 22 日	1,000,000,000	3.58%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）	21 长城 01	149356	2021 年 1 月 18 日	2021 年 1 月 20 日	2024 年 1 月 20 日	1,000,000,000	3.57%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年非公开发行次级债券（第一期）	21 长城 C1	115122	2021 年 3 月 22 日	2021 年 3 月 22 日	2024 年 3 月 22 日	1,000,000,000	4.25%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）	21 长城 02	149482	2021 年 5 月 21 日	2021 年 5 月 25 日	2024 年 5 月 25 日	1,400,000,000	3.39%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）	21 长城 03	149483	2021 年 5 月 21 日	2021 年 5 月 25 日	2023 年 5 月 25 日	600,000,000	3.20%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）	21 长城 04	149524	2021 年 6 月 21 日	2021 年 6 月 23 日	2024 年 6 月 23 日	1,000,000,000	3.67%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所

长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种一）	21 长城 05	149570	2021 年 7 月 23 日	2021 年 7 月 27 日	2023 年 7 月 27 日	1,000,000,000	3.07%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）（品种二）	21 长城 06	149571	2021 年 7 月 23 日	2021 年 7 月 27 日	2024 年 7 月 27 日	1,000,000,000	3.24%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种一）	21 长城 07	149641	2021 年 9 月 22 日	2021 年 9 月 24 日	2024 年 9 月 24 日	1,300,000,000	3.30%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种二）	21 长城 08	149642	2021 年 9 月 22 日	2021 年 9 月 24 日	2026 年 9 月 24 日	700,000,000	3.69%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）	22 长城 01	149773	2022 年 1 月 10 日	2022 年 1 月 12 日	2025 年 1 月 12 日	1,000,000,000	3.00%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	22 长城 02	149774	2022 年 1 月 10 日	2022 年 1 月 12 日	2027 年 1 月 12 日	1,000,000,000	3.40%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
长城证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）	22 长城 03	149802	2022 年 2 月 17 日	2022 年 2 月 21 日	2027 年 2 月 21 日	1,000,000,000	3.38%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
投资者适当性安排	面向合格投资者公开发行；面向合格机构投资者非公开发行；面向专业投资者公开发行；面向专业机构投资者非公开发行。								
适用的交易机制	面向公众投资者和合格投资者公开发行的债券：集中竞价交易和大宗交易方式。 仅面向合格投资者非公开发行的债券：协议大宗交易方式。								
是否存在终止上市交易的风险和应对措施	截至本报告披露日，不存在终止上市交易的风险。								

逾期未偿还债券

适用  不适用

**(二) 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

### 1、发行人或投资者选择权条款的触发和执行情况

“20 长城 02” 期限为 2 年（1+1），附第 1 年末发行人赎回选择权、发行人调整票面利率选择权及投资者回售选择权。公司已行使赎回选择权并于 2021 年 8 月 2 日完成兑付兑息工作。

### 2、投资者保护条款的触发和执行情况

截至本报告披露日，投资者保护条款未触发。

### （三）中介机构的情况

债券项目名称	中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	中介机构联系人	联系电话
17 长证 02	金元证券股份有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心 4 楼	-	常子昂	0755-83025500
	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、王进、蔡金良	李阔朋	010-828000161
	北京国枫律师事务所	北京市东城区建国门内大街 26 号新闻大厦 7-8 层	-	熊洁	0755-23993388
	联合资信评估股份有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 2 号院 2 号楼 17 层	-	陈凝	010-85172818
19 长城 03、20 长城 01	安信证券股份有限公司	深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1#楼 9 层	-	陈艺	0755-82558271
	华西证券股份有限公司	成都市高新区天府二街 198 号	-	李晓伟	028-86263433
	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、蔡金良、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	北京市竞天公诚律师事务所	深圳市南山区科苑南路 2666 号中国华润大厦 16 楼 05-06 单元	-	易湘洋	0755-21557011
	联合资信评估股份有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 2 号院 2 号楼 17 层	-	陈凝	010-85172818
20 长城 C1	安信证券股份有限公司	深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1#楼 9 层	-	陈艺	0755-82558271
	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、蔡金良、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	北京大成律师事务所	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 B 座 16-21	-	魏星	010-58137799
	上海新世纪资信评估投资服务有限公司	上海市杨浦区控江路 1555 号 A 座 103 室 K-22	-	刘兴堂	021-63504376
20 长城 C2	安信证券股份有限公司	深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1#楼 9 层	-	陈艺	0755-82558271
	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	陈晓莹、洪锐明	梁永炘	020-83969228

	北京大成律师事务所	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 B 座 16-21	-	魏星	010-58137799
	上海新世纪资信评估投资服务有限公司	上海市杨浦区控江路 1555 号 A 座 103 室 K-22	-	刘兴堂	021-63504376
20 长城 C3	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路国信金融大厦 29 层	-	柯方钰	0755-82133436
	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	陈晓莹、洪锐明	梁永炘	020-83969228
	北京大成律师事务所	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 B 座 16-21	-	魏星	010-58137799
	上海新世纪资信评估投资服务有限公司	上海市杨浦区控江路 1555 号 A 座 103 室 K-22	-	刘兴堂	021-63504376
		国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路国信金融大厦 29 层	-	柯方钰
20 长城 03、20 长城 05、20 长城 06、20 长城 07、21 长城 01	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、蔡金良、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	陈晓莹、洪锐明	梁永炘	020-83969228
	北京大成律师事务所	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 B 座 16-21	-	魏星	010-58137799
	上海新世纪资信评估投资服务有限公司	上海市杨浦区控江路 1555 号 A 座 103 室 K-22	-	刘兴堂	021-63504376
		国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路国信金融大厦 29 层	-	柯方钰
21 长城 C1	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	陈晓莹、洪锐明	梁永炘	020-83969228
	北京大成律师事务所	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 B 座 16-21	-	魏星	010-58137799
	联合资信评估股份有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 2 号院 2 号楼 17 层	-	陈凝	010-85172818
		国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路国信金融大厦 29 层	-	柯方钰
21 长城 02、21 长城 03、21 长城 04、21 长城 05、21 长城 06、21 长城 07、21 长城 08、22 长城 01、22 长城 02、22 长城 03	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市海淀区知春路 6 号锦秋国际大厦 A 座 1008 室	李志军、刘志坚	李阔朋	010-828000161
	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	陈晓莹、洪锐明、黄海城	梁永炘	020-83969228
	北京大成律师事务所	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 B 座 16-21	-	魏星	010-58137799
	联合资信评估股份有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 2 号院 2 号楼 17 层	-	陈凝	010-85172818
		国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路国信金融大厦 29 层	-	柯方钰

报告期内上述机构是否发生变化

是  否

#### (四) 募集资金使用情况

截至本报告披露日，公司已发行且在存续期内的公司债券的募集资金使用情况如下：

单位：元

债券项目名称	募集资金总金额	已使用金额	未使用金额	募集资金专项账户运作情况	募集资金违规使用的整改情况	是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致
17 长证 02	780,000,000	780,000,000	0	公司依照募集说明书的相关约定，指定专项账户归集募集资金；截至本报告披露日，募集资金已依照募集说明书中的资金运用计划进行运用。	不适用	是
19 长城 03	2,000,000,000	1,996,250,000	0			
20 长城 01	1,000,000,000	998,125,000	0			
20 长城 C1	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
20 长城 C2	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
20 长城 03	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
20 长城 C3	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
20 长城 05	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
20 长城 06	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
20 长城 07	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
21 长城 01	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
21 长城 C1	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
21 长城 02	1,400,000,000	1,400,000,000	0			
21 长城 03	600,000,000	600,000,000	0			
21 长城 04	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
21 长城 05	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
21 长城 06	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
21 长城 07	1,300,000,000	1,300,000,000	0			
21 长城 08	700,000,000	700,000,000	0			
22 长城 01	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
22 长城 02	1,000,000,000	1,000,000,000	0			
22 长城 03	1,000,000,000	1,000,000,000	0			

募集资金用于建设项目

适用  不适用

公司报告期内变更上述债券募集资金用途

适用  不适用

#### (五) 报告期内信用评级结果调整情况

适用  不适用

根据联合信用评级有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司出具的相关评级报告，截至报告期末，20 长城 C1、20 长城 C2、20 长城 C3、21 长城 C1 的债券信用等级为 AA+；17 长证 02、19 长城 03、20 长城 01、20 长城 03、20 长城 05、

20 长城 06、20 长城 07、21 长城 01、21 长城 02、21 长城 03、21 长城 04、21 长城 05、21 长城 06、21 长城 07、21 长城 08、22 长城 01、22 长城 02、22 长城 03 的债券信用等级为 AAA；公司主体信用等级为 AAA，评级展望为“稳定”。

报告期内，公司债券的信用评级未发生变化。

#### **(六) 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情况和变化情况及对债券投资者权益的影响**

适用  不适用

截至本报告披露日，公司债券担保情况、偿债计划和其他偿债保障措施较相应债券募集说明书中相关章节内容没有重大变化。

17 长证 02、19 长城 03、20 长城 01、20 长城 C1、20 长城 C2、20 长城 03、20 长城 C3、20 长城 05、20 长城 06、20 长城 07、21 长城 01、21 长城 C1、21 长城 02、21 长城 03、21 长城 04、21 长城 05、21 长城 06、21 长城 07、21 长城 08 不设担保等增信机制。公司债券的偿债资金将主要来源于公司日常经营所产生的收入及利润。2019 年度、2020 年度和 2021 年度，公司合并财务报表营业收入分别为 38.99 亿元、68.69 亿元、77.57 亿元，实现归属于母公司的净利润分别为 9.92 亿元、15.02 亿元、17.66 亿元。良好的收入规模和盈利积累，是公司按期偿本付息的有力保障。

公司经营稳健，信用记录良好，各项风险监管指标均满足相关要求，外部融资渠道畅通。公司获得多家商业银行的授信额度，一旦债券兑付时遇到突发性的资金周转问题，公司将通过各种可行的融资方式予以解决。同时，为了充分、有效地维护债券持有人的利益，公司为公司债券的按时、足额偿付做出一系列安排，包括制定《债券持有人会议规则》、设立专门的偿付工作小组、制定并严格执行资金管理计划、充分发挥债券受托管理人的作用和严格履行信息披露义务等，形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施，报告期内上述措施的执行情况，与募集说明书的相关承诺一致。

截至本报告披露日，公司偿债资金专项账户的提取情况与募集说明书相关承诺一致，未发生重大变化。

### **三、非金融企业债务融资工具**

适用  不适用

报告期公司不存在非金融企业债务融资工具。

### **四、可转换公司债券**

适用  不适用

报告期公司不存在可转换公司债券。

### **五、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

## 六、报告期末除债券外的有息债务逾期情况

适用  不适用

## 七、报告期内是否有违反规章制度的情况

是  否

## 八、截至报告期末公司近两年的主要会计数据和财务指标

项目	本报告期末	上年末	本报告期末比上年末增减
流动比率	2.63	2.85	-7.72%
资产负债率	70.82%	65.33%	上升 5.49 个百分点
速动比率	2.63	2.85	-7.72%
项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
扣除非经常性损益后净利润（万元）	184,046.99	152,611.41	20.60%
EBITDA 全部债务比	12.61%	11.58%	上升 1.03 个百分点
利息保障倍数	3.25	3.63	-10.47%
现金利息保障倍数	-0.03	-6.28	不适用
EBITDA 利息保障倍数	3.93	3.76	4.52%
贷款偿还率	100.00%	100.00%	0.00%
利息偿付率	100.00%	100.00%	0.00%

## 第十节 财务报告

### 审计报告

审计意见类型	标准的无保留意见
审计报告签署日期	2022 年 4 月 8 日
审计机构名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
审计报告文号	德师报（审）字（22）第 P02651 号
注册会计师姓名	陈晓莹、梁永妍

#### 长城证券股份有限公司全体股东：

##### 一、审计意见

我们审计了长城证券股份有限公司（以下简称“长城证券”）的财务报表，包括2021年12月31日的合并及母公司资产负债表，2021年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东权益变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城证券2021年12月31日的合并及母公司财务状况以及2021年度的合并及母公司经营成果和合并及母公司现金流量。

##### 二、形成审计意见的基础

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

##### 三、关键审计事项

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

我们确定下列事项是需要在审计报告中沟通的关键审计事项。

###### （一）合并范围的确定

长城证券在开展业务的过程中管理和投资各类结构化主体，例如证券投资基金、资产管理计划、合伙企业等。如财务报表附注七、3及附注七、5所述，于2021年12月31日，长城证券纳入合并财务报表合并范围的结构化主体的净资产合计人民币54.73亿元，长城证券发起设立并持有财务权益的未纳入合并财务报表

合并范围的结构化主体的净资产合计人民币15.28亿元。在确定结构化主体是否纳入合并财务报表的合并范围时，长城证券管理层根据相关合同条款，按照企业会计准则关于“控制”的定义，对长城证券是否控制结构化主体作出判断。上述判断具有一定的复杂性和主观性，且结果与财务报表广泛相关，因此我们将该事项识别为合并财务报表审计的关键审计事项。

针对长城证券结构化主体合并范围确定的事项，我们实施了以下主要审计程序予以应对：

1.测试管理层在确定结构化主体是否纳入合并财务报表的合并范围时建立的关键内部控制的运行有效性；

2.选取样本并审阅相关合同，评估管理层关于长城证券对结构化主体拥有权力的判断是否合理；

3.选取样本，检查管理层在计算可变回报的量级和可变动性时使用的方法和数据是否合理和正确，并进行重新计算；

4.从长城证券对结构化产品拥有的权力、从结构化主体享有的可变回报以及运用权力影响回报金额的能力三方面评价管理层做出的判断是否合理。

#### （二）融出资金预期信用损失的计量

于2021年12月31日，如财务报表附注五、3所述，长城证券在合并及母公司财务报表中列报的融出资金账面价值均为人民币236.14亿元。长城证券采用预期信用损失模型对上述融出资金计提信用损失准备。由于管理层需要对预期信用损失模型涉及的假设及参数的选取作出重大判断，且结果对于财务报表影响重大，因此我们将该事项识别为合并及母公司财务报表审计的关键审计事项。

针对长城证券融出资金预期信用损失的计量事项，我们实施了以下主要审计程序予以应对：

1.测试管理层在计量预期信用损失时建立的关键内部控制运行的有效性；

2.咨询内部专家的意见，评价长城证券预期信用损失模型、相关参数及假设的合理性，包括信用风险的阶段划分、违约概率、违约损失率和前瞻性因子等；

3.选取样本，检查管理层对信用风险显著增加及已发生信用减值的判断在上述融出资金信用风险的阶段划分中的运用是否合理；

4.选取样本，检查预期信用损失模型的主要输入值是否正确，包括信用风险敞口和维持担保比例等；

5.对于已发生信用减值的融出资金，选取样本，检查管理层基于相关债务人和担保人的财务状况以及担保物价值等信息而估计的预期信用损失是否合理。

#### 四、其他信息

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

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

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

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

## 五、管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

治理层负责监督长城证券的财务报告过程。

## 六、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

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

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

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

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国·上海

中国注册会计师：陈晓莹

（项目合伙人）

中国注册会计师：梁永圻

2022年4月8日

## 合并资产负债表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	五、1	19,789,750,981.46	15,483,332,227.32
其中：客户存款		18,279,178,415.25	14,790,241,492.07
结算备付金	五、2	5,114,550,784.40	3,759,748,581.73
其中：客户备付金		3,589,305,326.65	2,765,086,409.56
融出资金	五、3	23,614,329,242.76	18,905,975,788.68
衍生金融资产	五、4	1,190,017.61	25,945,842.03
存出保证金	五、5	3,091,822,150.55	2,214,824,323.11
应收款项	五、6	360,468,282.94	729,317,081.32
买入返售金融资产	五、7	1,852,474,205.94	2,623,354,700.54
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	五、8	33,611,273,075.74	23,904,133,746.43
债权投资	五、9	29,250,000.00	98,846,263.53
其他债权投资	五、10	704,504,669.39	1,088,108,127.40
其他权益工具投资	五、11	191,679,684.61	172,050,208.23
长期股权投资	五、12	2,298,222,888.33	1,821,491,956.28
固定资产	五、13	154,485,604.76	165,649,525.95
使用权资产	五、14	413,456,798.29	
无形资产	五、15	92,447,912.23	88,416,016.02
商誉	五、16	11,302,586.62	11,302,586.62
递延所得税资产	五、17	164,738,929.52	228,927,244.22
其他资产	五、18	1,200,939,375.48	891,457,965.19
<b>资产总计</b>		<b>92,696,887,190.63</b>	<b>72,212,882,184.60</b>

附注为财务报表的组成部分。

## 合并资产负债表（续）

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
短期借款	五、20	319,468,002.74	119,040,434.93
应付短期融资款	五、21	6,041,275,705.47	5,455,441,936.79
拆入资金	五、22	1,281,897,777.08	500,320,833.33
交易性金融负债		-	39,659,600.00
衍生金融负债	五、4	84,813,877.97	48,304,970.07
卖出回购金融资产款	五、23	14,203,807,051.69	9,683,598,590.65
代理买卖证券款	五、24	23,053,222,073.70	18,770,614,211.99
代理承销证券款		708,932,079.64	-
应付职工薪酬	五、25	1,544,979,095.55	1,268,669,406.97
应交税费	五、26	138,619,556.96	175,050,410.35
应付款项	五、27	408,962,131.89	345,991,243.52
应付债券	五、28	23,688,980,678.90	16,968,472,593.49
递延所得税负债	五、17	2,294,687.96	17,194,056.76
租赁负债	五、29	431,531,603.86	
其他负债	五、30	675,066,105.03	293,949,983.43
<b>负债合计</b>		<b>72,583,850,428.44</b>	<b>53,686,308,272.28</b>
<b>股东权益：</b>			
股本	五、31	3,103,405,351.00	3,103,405,351.00
资本公积	五、32	9,220,082,218.87	9,220,082,218.87
其他综合收益	五、33	12,808,175.64	-45,638,921.48
盈余公积	五、34	858,135,511.30	696,550,426.74
一般风险准备	五、35	2,456,907,794.20	2,133,348,779.19
未分配利润	五、36	3,939,699,617.34	2,967,954,128.83
<b>归属于母公司股东权益合计</b>		<b>19,591,038,668.35</b>	<b>18,075,701,983.15</b>
少数股东权益		521,998,093.84	450,871,929.17
<b>股东权益合计</b>		<b>20,113,036,762.19</b>	<b>18,526,573,912.32</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>92,696,887,190.63</b>	<b>72,212,882,184.60</b>

附注为财务报表的组成部分。

第 115 页至 239 页的财务报表由下列负责人签署：

法定代表人：张 巍

主管会计工作负责人：李 翔

会计机构负责人：阮惠仙

## 母公司资产负债表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金		14,894,567,273.50	13,126,067,439.77
其中：客户存款		14,620,017,027.62	12,812,020,506.51
结算备付金		4,485,727,389.90	3,387,640,464.21
其中：客户备付金		3,088,640,693.47	2,337,335,081.22
融出资金		23,614,329,242.76	18,905,975,788.68
衍生金融资产		1,190,017.61	25,945,842.03
存出保证金		610,553,204.56	488,318,276.87
应收款项		360,468,282.94	729,317,081.32
买入返售金融资产		1,210,012,988.38	1,826,142,692.54
金融投资：			
交易性金融资产		33,092,055,246.18	23,477,224,691.72
其他债权投资		704,504,669.39	1,086,908,127.40
其他权益工具投资		191,679,684.61	172,050,208.23
长期股权投资	十五、1	4,028,651,163.21	3,461,920,231.16
固定资产		147,809,706.88	159,561,090.85
使用权资产		391,705,072.23	
无形资产		90,862,692.05	86,555,287.51
递延所得税资产		144,231,735.12	195,923,865.50
其他资产		163,542,895.13	177,054,180.32
<b>资产总计</b>		<b>84,131,891,264.45</b>	<b>67,306,605,268.11</b>

附注为财务报表的组成部分。

## 母公司资产负债表（续）

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
应付短期融资款		6,041,275,705.47	5,455,441,936.79
拆入资金		1,281,897,777.08	500,320,833.33
交易性金融负债		-	39,659,600.00
衍生金融负债		84,813,877.97	48,304,970.07
卖出回购金融资产款		14,203,807,051.69	9,683,598,590.65
代理买卖证券款		16,403,960,179.63	14,909,371,803.01
代理承销证券款		708,932,079.64	-
应付职工薪酬	十五、2	1,451,829,502.11	1,208,877,405.86
应交税费		63,944,889.07	152,925,283.40
应付款项		408,962,131.89	345,991,243.52
应付债券		23,688,980,678.90	16,968,472,593.49
递延所得税负债		-	5,813,127.31
租赁负债		410,943,516.57	
其他负债		130,603,221.39	132,662,200.42
<b>负债合计</b>		<b>64,879,950,611.41</b>	<b>49,451,439,587.85</b>
<b>股东权益：</b>			
股本		3,103,405,351.00	3,103,405,351.00
资本公积		9,250,143,425.21	9,250,143,425.21
其他综合收益		12,808,175.64	-45,646,575.98
盈余公积		858,135,511.30	696,550,426.74
一般风险准备		2,456,907,794.20	2,133,348,779.19
未分配利润		3,570,540,395.69	2,717,364,274.10
<b>股东权益合计</b>		<b>19,251,940,653.04</b>	<b>17,855,165,680.26</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>84,131,891,264.45</b>	<b>67,306,605,268.11</b>

附注为财务报表的组成部分。

## 合并利润表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本年发生额	上年发生额
<b>一、营业总收入</b>		<b>7,756,796,088.56</b>	<b>6,868,697,463.16</b>
利息净收入	五、37	358,033,096.70	424,982,245.13
其中：利息收入		1,852,620,599.67	1,590,222,384.46
利息支出		1,494,587,502.97	1,165,240,139.33
手续费及佣金净收入	五、38	1,996,520,743.67	1,638,208,374.41
其中：经纪业务手续费净收入		1,206,125,536.79	1,034,066,493.03
投资银行业务手续费净收入		574,745,827.71	451,412,788.98
资产管理业务手续费净收入		140,417,719.53	105,651,157.84
投资收益	五、39	2,060,531,580.05	1,903,291,428.68
其中：对联营和合营企业的投资收益		765,004,449.37	476,395,939.13
其他收益	五、40	22,377,399.29	17,979,559.88
公允价值变动收益	五、41	186,183,450.17	63,933,891.74
汇兑损失		-1,446,667.92	-3,756,429.91
其他业务收入	五、42	3,134,596,486.60	2,824,058,393.23
<b>二、营业总支出</b>		<b>5,555,164,824.90</b>	<b>5,036,820,858.92</b>
税金及附加	五、43	40,136,062.24	30,485,887.70
业务及管理费	五、44	2,500,687,728.23	2,154,116,194.39
信用减值损失	五、45	-3,144,635.54	98,113,824.96
其他业务成本	五、46	3,017,485,669.97	2,754,104,951.87
<b>三、营业利润</b>		<b>2,201,631,263.66</b>	<b>1,831,876,604.24</b>
加：营业外收入	五、47	709,793.09	3,357,393.47
减：营业外支出	五、48	34,105,952.93	8,503,375.69
<b>四、利润总额</b>		<b>2,168,235,103.82</b>	<b>1,826,730,622.02</b>
减：所得税费用	五、49	322,630,909.27	296,130,603.12
<b>五、净利润</b>		<b>1,845,604,194.55</b>	<b>1,530,600,018.90</b>
(一)按经营持续性分类			
1.持续经营净利润		1,845,604,194.55	1,530,600,018.90
(二)按所有权归属分类			
1.归属于母公司股东的净利润		1,765,610,928.44	1,501,641,468.72
2.少数股东损益		79,993,266.11	28,958,550.18
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		<b>91,257,007.73</b>	<b>-3,979,492.80</b>
归属母公司股东的其他综合收益的税后净额	五、33	91,257,007.73	-3,979,492.80
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益		90,962,154.94	-793,684.63
1.其他权益工具投资公允价值变动		90,962,154.94	-793,684.63
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益		294,852.79	-3,185,808.17
1.权益法可结转损益的其他综合收益		-	-927,303.80
2.其他债权投资公允价值变动		554,517.23	-2,079,789.46
3.其他债权投资信用减值准备		-259,664.44	-178,714.91
<b>七、综合收益总额</b>		<b>1,936,861,202.28</b>	<b>1,526,620,526.10</b>
归属于母公司股东的综合收益总额	五、33	1,856,867,936.17	1,497,661,975.92
归属于少数股东的综合收益总额		79,993,266.11	28,958,550.18
<b>八、每股收益：</b>			
(一)基本每股收益(元/股)	五、50	0.57	0.48
(二)稀释每股收益(元/股)	五、50	0.57	0.48

附注为财务报表的组成部分。

## 母公司利润表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本年发生额	上年发生额
<b>一、营业总收入</b>		<b>4,207,511,657.24</b>	<b>3,805,907,403.34</b>
利息净收入	十五、3	298,164,658.87	370,477,408.16
其中：利息收入		1,743,763,524.64	1,511,841,246.88
利息支出		1,445,598,865.77	1,141,363,838.72
手续费及佣金净收入	十五、4	1,788,245,029.88	1,521,743,366.72
其中：经纪业务手续费净收入		995,399,356.86	918,357,939.02
投资银行业务手续费净收入		574,745,827.71	451,412,788.98
资产管理业务手续费净收入		140,166,998.69	104,827,508.07
投资收益	十五、5	1,947,645,170.29	1,863,106,097.77
其中：对联营和合营企业的投资收益		765,004,449.37	476,395,939.13
其他收益		19,449,103.85	17,342,503.24
公允价值变动收益	十五、6	147,996,302.76	30,073,691.44
汇兑损失		-1,446,667.92	-3,756,429.91
其他业务收入		7,458,059.51	6,920,765.92
<b>二、营业总支出</b>		<b>2,273,693,104.33</b>	<b>2,087,441,215.35</b>
税金及附加		29,085,097.11	27,021,689.68
业务及管理费	十五、7	2,264,903,855.76	1,992,240,040.84
信用减值损失		-21,416,766.27	67,717,899.72
其他业务成本		1,120,917.73	461,585.11
<b>三、营业利润</b>		<b>1,933,818,552.91</b>	<b>1,718,466,187.99</b>
加：营业外收入		214,613.20	643,019.49
减：营业外支出		34,042,407.07	8,420,631.35
<b>四、利润总额</b>		<b>1,899,990,759.04</b>	<b>1,710,688,576.13</b>
减：所得税费用		253,413,681.64	265,712,100.78
<b>五、净利润</b>		<b>1,646,577,077.40</b>	<b>1,444,976,475.35</b>
(一)按经营持续性分类			
1.持续经营净利润		1,646,577,077.40	1,444,976,475.35
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		<b>91,264,662.23</b>	<b>-3,979,492.80</b>
(一)以后不能重分类进损益的其他综合收益		90,962,154.94	-793,684.63
1.其他权益工具投资公允价值变动		90,962,154.94	-793,684.63
(二)以后将重分类进损益的其他综合收益		302,507.29	-3,185,808.17
1.权益法可结转损益的其他综合收益		-	-927,303.80
2.其他债权投资公允价值变动		554,517.23	-2,079,789.46
3.其他债权投资信用损失准备		-252,009.94	-178,714.91
<b>七、综合收益总额</b>		<b>1,737,841,739.63</b>	<b>1,440,996,982.55</b>

附注为财务报表的组成部分。

## 合并现金流量表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本年发生额	上年发生额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		-	568,368,403.72
收取利息、手续费及佣金的现金		4,738,298,235.16	3,933,663,669.36
拆入资金净增加额		780,000,000.00	-
回购业务资金净增加额		5,286,607,079.68	-
代理买卖证券收到的现金净额		4,372,197,988.87	4,159,634,394.43
代理承销证券收到的现金净额		708,932,079.64	-
收到其他与经营活动有关的现金	五、51(3)	10,104,685,917.48	3,346,161,125.84
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>25,990,721,300.83</b>	12,007,827,593.35
为交易目的而持有的金融资产净增加额		7,661,602,290.80	-
支付利息、手续费及佣金的现金		1,269,195,721.88	1,091,890,442.15
拆入资金净减少额		-	800,000,000.00
回购业务资金净减少额		-	1,208,265,398.78
融出资金净增加额		4,601,604,470.05	6,994,505,046.65
支付给职工以及为职工支付的现金		1,541,966,265.26	1,261,712,717.55
支付的各项税费		608,897,580.69	499,693,612.80
支付其他与经营活动有关的现金	五、51(4)	11,536,740,381.24	4,917,772,295.71
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>27,220,006,709.92</b>	16,773,839,513.64
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	五、51(1)	<b>-1,229,285,409.09</b>	-4,766,011,920.29
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回对外投资收到的现金		527,764,100.11	920,969,020.37
取得投资收益收到的现金		347,922,771.58	328,634,805.73
处置固定资产、无形资产和其他长期资产而收回的现金净额		356,000.94	569,448.87
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>876,042,872.63</b>	1,250,173,274.97
投资支付的现金		-	233,600,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		83,785,344.36	94,193,033.11
支付其他与投资活动有关的现金		-	2,483,041.30
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>83,785,344.36</b>	330,276,074.41
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>792,257,528.27</b>	919,897,200.56
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
取得借款收到的现金		1,139,901,255.42	382,910,162.24
发行债券收到的现金		27,951,554,000.61	27,962,832,894.96
<b>筹资活动现金流入小计</b>		<b>29,091,455,256.03</b>	28,345,743,057.20
偿还债务支付的现金		21,689,791,471.46	19,533,087,719.39
分配股利、利润或偿付利息支出支付的现金		1,159,249,085.53	968,258,201.61
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		7,656,736.89	8,386,732.76
支付其他与筹资活动有关的现金		142,719,193.49	-
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>22,991,759,750.48</b>	20,501,345,921.00
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>6,099,695,505.55</b>	7,844,397,136.20
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		<b>-1,446,667.92</b>	-3,756,429.91
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	五、51(1)	<b>5,661,220,956.81</b>	3,994,525,986.56
加：年初现金及现金等价物余额		19,243,080,809.05	15,248,554,822.49
<b>六、年末现金及现金等价物余额</b>	五、51(2)	<b>24,904,301,765.86</b>	19,243,080,809.05

附注为财务报表的组成部分。

## 母公司现金流量表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	附注	本年发生额	上年发生额
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
收取利息、手续费及佣金的现金		4,202,470,330.72	3,634,171,481.24
拆入资金净增加额		780,000,000.00	-
回购业务资金净增加额		5,131,784,288.14	-
代理买卖证券收到的现金净额		1,584,178,503.78	3,167,166,770.42
代理承销证券收到的现金净额		708,932,079.64	-
收到其他与经营活动有关的现金		40,167,739.62	38,509,797.74
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>12,447,532,941.90</b>	<b>6,839,848,049.40</b>
为交易目的而持有的金融资产净增加额		7,724,298,358.36	379,112,651.67
支付利息、手续费及佣金的现金		1,096,361,261.24	961,352,283.53
拆入资金净减少额		-	800,000,000.00
回购业务资金净减少额		-	771,056,990.78
融出资金净增加额		4,601,604,470.05	6,994,505,046.65
支付给职工以及为职工支付的现金		1,446,488,356.12	1,190,511,665.50
支付的各项税费		543,285,753.61	456,033,769.90
支付其他与经营活动有关的现金		749,277,293.80	706,272,966.98
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>16,161,315,493.18</b>	<b>12,258,845,375.01</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	十五、8	<b>-3,713,782,551.28</b>	<b>-5,418,997,325.61</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回对外投资收到的现金		476,559,412.11	880,969,020.37
取得投资收益收到的现金		344,945,669.99	329,478,246.09
处置固定资产、无形资产和其他长期资产而收回的现金净额		330,250.94	418,348.87
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>821,835,333.04</b>	<b>1,210,865,615.33</b>
投资支付的现金		90,000,000.00	203,600,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		80,587,907.92	91,344,720.02
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>170,587,907.92</b>	<b>294,944,720.02</b>
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>651,247,425.12</b>	<b>915,920,895.31</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
发行债券收到的现金		27,951,554,000.61	27,962,832,894.96
<b>筹资活动现金流入小计</b>		<b>27,951,554,000.61</b>	<b>27,962,832,894.96</b>
偿还债务支付的现金		20,749,970,053.80	19,269,097,719.39
分配股利、利润或偿付利息支出支付的现金		1,137,071,334.13	956,491,284.10
支付其他与筹资活动有关的现金		133,944,059.18	-
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>22,020,985,447.11</b>	<b>20,225,589,003.49</b>
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>5,930,568,553.50</b>	<b>7,737,243,891.47</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		<b>-1,446,667.92</b>	<b>-3,756,429.91</b>
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	十五、8	<b>2,866,586,759.42</b>	<b>3,230,411,031.26</b>
加：年初现金及现金等价物余额		16,513,707,903.98	13,283,296,872.72
<b>六、年末现金及现金等价物余额</b>		<b>19,380,294,663.40</b>	<b>16,513,707,903.98</b>

附注为财务报表的组成部分。

## 合并股东权益变动表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	本年金额							少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益								
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
	附注五、31	附注五、32	附注五、33	附注五、34	附注五、35	附注五、36			
一、上年年末余额	<b>3,103,405,351.00</b>	<b>9,220,082,218.87</b>	<b>-45,638,921.48</b>	<b>696,550,426.74</b>	<b>2,133,348,779.19</b>	<b>2,967,954,128.83</b>	<b>450,871,929.17</b>	<b>18,526,573,912.32</b>	
加：会计政策变更	-	-	-	-3,072,623.18	-6,145,246.36	-21,972,846.33	-230,364.55	-31,421,080.42	
二、本年年初余额	<b>3,103,405,351.00</b>	<b>9,220,082,218.87</b>	<b>-45,638,921.48</b>	<b>693,477,803.56</b>	<b>2,127,203,532.83</b>	<b>2,945,981,282.50</b>	<b>450,641,564.62</b>	<b>18,495,152,831.90</b>	
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-	<b>58,447,097.12</b>	<b>164,657,707.74</b>	<b>329,704,261.37</b>	<b>993,718,334.84</b>	<b>71,356,529.22</b>	<b>1,617,883,930.29</b>	
(一)综合收益总额	-	-	91,257,007.73	-	-	1,765,610,928.44	79,993,266.11	1,936,861,202.28	
(二)股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-980,000.00	-980,000.00	
1.股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-980,000.00	-980,000.00	
(三)利润分配	-	-	-	164,657,707.74	329,704,261.37	-804,702,504.21	-7,656,736.89	-317,997,271.99	
1.提取盈余公积	-	-	-	164,657,707.74	-	-164,657,707.74	-	-	
2.一般风险准备	-	-	-	-	329,704,261.37	-329,704,261.37	-	-	
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	-310,340,535.10	-7,656,736.89	-317,997,271.99	
(四)股东权益内部结转	-	-	-32,809,910.61	-	-	32,809,910.61	-	-	
1.其他综合收益结转留存收益	-	-	-32,809,910.61	-	-	32,809,910.61	-	-	
四、本年年末余额	<b>3,103,405,351.00</b>	<b>9,220,082,218.87</b>	<b>12,808,175.64</b>	<b>858,135,511.30</b>	<b>2,456,907,794.20</b>	<b>3,939,699,617.34</b>	<b>521,998,093.84</b>	<b>20,113,036,762.19</b>	

附注为财务报表的组成部分。

### 合并股东权益变动表（续）

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	上年金额							少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益								
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
	附注五、31	附注五、32	附注五、33	附注五、34	附注五、35	附注五、36			
一、上年年末余额	3,103,405,351.00	9,220,082,218.87	-36,578,753.16	552,052,779.20	1,843,819,279.84	2,236,633,720.09	432,777,399.71	17,352,191,995.55	
二、本年初余额	3,103,405,351.00	9,220,082,218.87	-36,578,753.16	552,052,779.20	1,843,819,279.84	2,236,633,720.09	432,777,399.71	17,352,191,995.55	
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-	-9,060,168.32	144,497,647.54	289,529,499.35	731,320,408.74	18,094,529.46	1,174,381,916.77	
(一)综合收益总额	-	-	-3,979,492.80	-	-	1,501,641,468.72	28,958,550.18	1,526,620,526.10	
(二)股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-2,477,287.96	-2,477,287.96	
1.股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-2,477,287.96	-2,477,287.96	
2.其他	-	-	-	-	-	-	-	-	
(三)利润分配	-	-	-	144,497,647.54	289,529,499.35	-775,401,735.50	-8,386,732.76	-349,761,321.37	
1.提取盈余公积	-	-	-	144,497,647.54	-	-144,497,647.54	-	-	
2.一般风险准备	-	-	-	-	289,529,499.35	-289,529,499.35	-	-	
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	-341,374,588.61	-8,386,732.76	-349,761,321.37	
(四)股东权益内部结转	-	-	-5,080,675.52	-	-	5,080,675.52	-	-	
1.其他综合收益结转留存收益	-	-	-5,080,675.52	-	-	5,080,675.52	-	-	
四、本年年末余额	3,103,405,351.00	9,220,082,218.87	-45,638,921.48	696,550,426.74	2,133,348,779.19	2,967,954,128.83	450,871,929.17	18,526,573,912.32	

附注为财务报表的组成部分。

## 母公司股东权益变动表

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	本年金额						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
一、上年年末余额	3,103,405,351.00	9,250,143,425.21	-45,646,575.98	696,550,426.74	2,133,348,779.19	2,717,364,274.10	17,855,165,680.26
加：会计政策变更	-	-	-	-3,072,623.18	-6,145,246.36	-21,508,362.21	-30,726,231.75
二、本年初余额	3,103,405,351.00	9,250,143,425.21	-45,646,575.98	693,477,803.56	2,127,203,532.83	2,695,855,911.89	17,824,439,448.51
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-	58,454,751.62	164,657,707.74	329,704,261.37	874,684,483.80	1,427,501,204.53
(一)综合收益总额	-	-	91,264,662.23	-	-	1,646,577,077.40	1,737,841,739.63
(二)利润分配	-	-	-	164,657,707.74	329,704,261.37	-804,702,504.21	-310,340,535.10
1.提取盈余公积	-	-	-	164,657,707.74	-	-164,657,707.74	-
2.一般风险准备	-	-	-	-	329,704,261.37	-329,704,261.37	-
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	-310,340,535.10	-310,340,535.10
(三)股东权益内部结转	-	-	-32,809,910.61	-	-	32,809,910.61	-
1.其他综合收益结转留存收益	-	-	-32,809,910.61	-	-	32,809,910.61	-
四、本年年末余额	3,103,405,351.00	9,250,143,425.21	12,808,175.64	858,135,511.30	2,456,907,794.20	3,570,540,395.69	19,251,940,653.04

附注为财务报表的组成部分。

### 母公司股东权益变动表（续）

编制单位：长城证券股份有限公司

金额单位：人民币元

项目	上年金额						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
一、上年年末余额	3,103,405,351.00	9,250,143,425.21	-36,586,407.66	552,052,779.20	1,843,819,279.84	2,042,708,858.73	16,755,543,286.32
二、本年年初余额	3,103,405,351.00	9,250,143,425.21	-36,586,407.66	552,052,779.20	1,843,819,279.84	2,042,708,858.73	16,755,543,286.32
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)	-	-	-9,060,168.32	144,497,647.54	289,529,499.35	674,655,415.37	1,099,622,393.94
(一)综合收益总额	-	-	-3,979,492.80	-	-	1,444,976,475.35	1,440,996,982.55
(二)利润分配	-	-	-	144,497,647.54	289,529,499.35	-775,401,735.50	-341,374,588.61
1.提取盈余公积	-	-	-	144,497,647.54	-	-144,497,647.54	-
2.一般风险准备	-	-	-	-	289,529,499.35	-289,529,499.35	-
3.对股东的分配	-	-	-	-	-	-341,374,588.61	-341,374,588.61
(三)股东权益内部结转	-	-	-5,080,675.52	-	-	5,080,675.52	-
1.其他综合收益结转留存收益	-	-	-5,080,675.52	-	-	5,080,675.52	-
四、本年年末余额	3,103,405,351.00	9,250,143,425.21	-45,646,575.98	696,550,426.74	2,133,348,779.19	2,717,364,274.10	17,855,165,680.26

附注为财务报表的组成部分。

# 长城证券股份有限公司

## 2021 年度

### 财务报表附注

(除特别注明外, 本附注金额单位均为人民币元)

#### 一、 公司基本情况

长城证券股份有限公司(以下简称“本公司”)原为长城证券有限责任公司, 系经中国人民银行银复(1995)417 号文批复, 于 1996 年 5 月 2 日成立, 成立时注册资本为 15,700 万元。

1999 年 10 月 15 日, 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监机构字(2000)43 号《关于长城证券有限责任公司增资扩股的批复》核准, 本公司注册资本增至 82,500 万元。2005 年 12 月 22 日, 经中国证监会证监机构字(2006)75 号《关于长城证券有限责任公司增资扩股的批复》核准, 本公司注册资本增至 92,500 万元。2007 年 4 月 17 日, 经中国证监会证监机构字(2007)87 号《关于长城证券有限责任公司股权变更及增资扩股的批复》核准, 本公司将部分股东认购的 64,200 万元次级债转增实收资本, 转增后注册资本增至 156,700 万元。2007 年 12 月 29 日, 经中国证监会证监机构字(2007)342 号《关于长城证券有限责任公司变更注册资本的批复》核准, 本公司注册资本增至 206,700 万元。

2014 年 11 月 15 日, 长城证券有限责任公司 2014 年股东会第四次临时会议通过决议, 长城证券有限责任公司拟整体变更设立为股份有限公司, 以长城证券有限公司 2014 年 6 月 30 日经审计后的净资产折合为股份有限公司的股份 206,700 万股, 每股面值 1.00 元。长城证券有限责任公司于 2015 年 4 月 17 日整体变更设立为本公司, 并领取了深圳市工商行政管理局核发的编号为 440301102870699 的企业法人营业执照。

2015 年 10 月 27 日, 根据本公司股东会决议[长证股字(2015)第 2 号、第 4 号及第 5 号], 本公司增加注册资本 726,064,815.00 元, 由华能资本服务有限公司、深圳能源集团股份有限公司、深圳新江南投资有限公司、四川长虹电子控股集团有限公司等 16 位股东于 2015 年 10 月 27 日之前一次缴足, 变更后的注册资本为 2,793,064,815.00 元。

2018 年 9 月 28 日, 经中国证券监督管理委员会《关于核准长城证券股份有限公司首次公开发行股票批复》(证监许可[2018]808 号)核准, 本公司向社会公开发行人民币普通股(A 股)股票 310,340,536 股。发行后, 本公司的注册资本由 2,793,064,815.00 元变更为 3,103,405,351.00 元。

2018 年 10 月 26 日, 本公司股票在深圳证券交易所挂牌交易, 简称“长城证券”, 股票代码: 002939。

本公司统一社会信用代码: 91440300192431912U, 注册地址: 广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层。

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

本公司的控股股东为华能资本服务有限公司, 最终控制方为中国华能集团有限公司。

## 一、 公司基本情况(续)

截至 2021 年 12 月 31 日,本公司共有三家控股一级子公司,分别为宝城期货有限责任公司(以下简称“宝城期货公司”)、深圳市长城长富投资管理有限公司(以下简称“长富投资公司”)和深圳市长城证券投资有限公司(以下简称“长城投资公司”)。

截至 2021 年 12 月 31 日,本公司在深圳、北京、上海等地共有 118 家证券营业部,14 家分公司。本公司员工人数合计 3029 人,其中公司董事 12 人,监事 5 人,高级管理人员 9 人。

## 二、 财务报表的编制基础

### 编制基础

本公司及下属子公司(以下简称“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)》及《证券公司财务报表附注编制的特别规定(2018)》披露有关财务信息。

### 持续经营

本集团对自 2021 年 12 月 31 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。

### 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。

以公允价值计量非金融资产时,考虑市场参与者将该资产用于最佳用途产生经济利益的能力,或者将该资产出售给能够用于最佳用途的其他市场参与者产生经济利益的能力。

## 二、 财务报表的编制基础(续)

### 记账基础和计价原则(续)

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

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

## 三、 重要会计政策和会计估计

### 1. 遵循企业会计准则的声明

本公司编制的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本公司于 2021 年 12 月 31 日的母公司及合并财务状况以及 2021 年度的母公司及合并经营成果、母公司及合并股东权益变动和母公司及合并现金流量。

### 2. 会计期间

本集团会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 3. 记账本位币

人民币为本公司及子公司经营所处的主要经济环境中的货币,本公司及子公司以人民币为记账本位币。本公司编制本财务报表时所采用的货币为人民币。

### 4. 非同一控制下企业合并的会计处理方法

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。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。

### 三、 重要会计政策和会计估计(续)

#### 4. 非同一控制下企业合并的会计处理方法(续)

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。

#### 5. 合并财务报表的编制方法

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年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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 5. 合并财务报表的编制方法(续)

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。

#### 6. 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。

#### 7. 外币业务

外币交易在初始确认时采用交易发生日即期汇率折算。

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。

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。

#### 8. 金融工具

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当期损益;对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。当本集团按照《企业会计准则第 14 号——收入》初始确认未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项时,按照《企业会计准则第 14 号——收入》定义的交易价格进行初始计量。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

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)。

##### 8.1 金融资产的分类、确认与计量

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、其他应收款和债权投资等。

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，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。此类金融资产列示为其他债权投资。

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。
- 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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.1 金融资产的分类、确认与计量(续)

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：

- 不符合分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产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的金融资产。
- 在初始确认时，为消除或显著减少会计错配，本集团可以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。

除衍生金融资产外的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。

##### 8.1.1 以摊余成本计量金融资产

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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本集团对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，本集团自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。
- 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，本集团在后续期间，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，并且这一改善可与应用上述规定之后发生的某一事件相联系，本集团转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

##### · 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产相关的减值损失或利得，采用实际利率法计算的利息收入计入当期损益，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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.1 金融资产的分类、确认与计量(续)

###### 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产(续)

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。

##### 8.1.3 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。

#### 8.2 金融工具减值

本集团对以摊余成本计量的金融资产、分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产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《企业会计准则第 14 号——收入》规范的交易形成且未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项，以及由《企业会计准则第 21 号——租赁》规范的交易形成的应收经营租赁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的，本集团在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.2 金融工具减值(续)

###### 8.2.1 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(包括但不限于):

- (1) 同一金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险的外部市场指标是否发生显著变化;
- (2) 金融工具外部信用评级实际或预期是否发生显著变化;
- (3) 预期将导致债务人履行其偿债义务的能力发生显著变化的业务、财务或经济状况是否发生不利变化;
- (4) 债务人经营成果实际或预期是否发生显著变化;
- (5) 同一债务人发行的其他金融工具的信用风险是否显著增加;
- (6) 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;
- (7) 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;
- (8) 实际或预期增信措施有效性发生重大不利变化;
- (9) 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。如果金融工具的违约风险较低,借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强,并且即使较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金义务,则该金融工具被视为具有较低的信用风险。

###### 8.2.2 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:

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

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.2 金融工具减值(续)

##### 8.2.3 预期信用损失的确定

本集团基于单项或组合评估金融工具的预期信用损失。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、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。

##### 8.2.4 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。

#### 8.3 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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.3 金融资产的转移(续)

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,将所转移金融资产在终止确认日的账面价值及因转移金融资产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中对应终止确认部分的金额之和的差额计入当期损益。若本集团转移的金融资产是指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资,之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出,计入留存收益。

金融资产部分转移满足终止确认条件的,将转移前金融资产整体的账面价值在终止确认部分和继续确认部分之间按照转移日各自的相对公允价值进行分摊,并将终止确认部分收到的对价和原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和与终止确认部分在终止确认日的账面价值之差额计入当期损益。若本集团转移的金融资产是指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资,之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出,计入留存收益。

金融资产整体转移未满足终止确认条件的,本集团继续确认所转移的金融资产整体,并将收到的对价确认为金融负债。

##### 8.4 金融负债和权益工具的分类

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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.4 金融负债和权益工具的分类(续)

###### 8.4.1 金融负债的分类、确认及计量

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。

###### 8.4.1.1 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。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)该指定能够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，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在本集团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。

对于被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，该金融负债由本集团自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益，其他公允价值变动计入当期损益。该金融负债终止确认时，之前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。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(包括自身信用风险变动的影响金额)计入当期损益。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.4 金融负债和权益工具的分类(续)

###### 8.4.1 金融负债的分类、确认及计量(续)

###### 8.4.1.2 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。

###### 8.4.2 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。

###### 8.4.3 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。

#### 8.5 衍生工具与嵌入衍生工具

衍生工具，包括股指期货、国债期货、商品期货、利率互换、权益类收益互换以及场外期权业务等。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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 8. 金融工具(续)

##### 8.5 衍生工具与嵌入衍生工具(续)

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合同中分拆，作为单独存在的衍生工具处理。

- (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。

##### 8.6 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金额的法定权利，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。

#### 9. 长期股权投资

##### 9.1 共同控制、重要影响的判断标准

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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 9. 长期股权投资(续)

##### 9.2 初始投资成本的确定

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。

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。

##### 9.3 后续计量及损益确认方法

###### 9.3.1 按成本法核算的长期股权投资

母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主体。

###### 9.3.2 按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。合营安排分为共同经营和合营企业,该分类通过考虑该安排的结构、法律形式以及合同条款等因素根据合营方在合营安排中享有的权利和承担的义务确定。

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集团不一致的,按照本集团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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 9. 长期股权投资(续)

##### 9.3 后续计量及损益确认方法(续)

##### 9.3.2 按权益法核算的长期股权投资(续)

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。

##### 9.3.3 长期股权投资处置

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。

#### 10. 固定资产

##### 10.1 确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。固定资产仅在与其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。

##### 10.2 折旧方法

固定资产从达到预定可使用状态的次月起，采用年限平均法在使用寿命内计提折旧。各类固定资产的折旧方法、预计使用寿命、预计净残值率和年折旧率如下：

资产类别	预计使用寿命(年)	预计净残值率(%)	年折旧率(%)
房屋及建筑物	30	3	3.23
运输工具	9	3	10.78
电子设备	5	0	20.00
办公设备	5	0	20.00

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，本集团目前从该项资产处置中获得的扣除预计处置费用后的金额。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 10. 固定资产(续)

##### 10.3 其他说明

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

#### 11. 借款费用

可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的借款费用，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。

#### 12. 无形资产

无形资产包括交易席位费、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。计算机软件按 5 年摊销，残值率为零。

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。

#### 13. 长期资产减值

本集团在每一个资产负债表日检查长期股权投资、固定资产、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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 13. 长期资产减值(续)

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。

#### 14. 长期待摊费用

本集团的长期待摊费用是指已经支出，但摊销期限在 1 年以上(不含 1 年)的各项费用，如租入的固定资产发生的改良支出等。长期待摊费用在各费用项目的预计受益期间内分期平均摊销，其中租入的固定资产发生的改良支出按租赁合同期限与 5 年孰短年限平均摊销，其他长期待摊费用项目按费用项目的受益期平均摊销，但最长不得超过 10 年。如果长期待摊费用项目不能使以后会计期间受益的，将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

#### 15. 买入返售及卖出回购业务

对于买入返售证券业务，本集团在买入证券时，按实际支付的金额确认为买入返售金融资产。按照商定利率计算确定的买入返售金融资产的利息收入确认为当期收入。

对于卖出回购证券业务，本集团在卖出证券时，按实际收到的金额确认为卖出回购金融资产款。按照商定利率计算确定的卖出回购金融资产款的利息支出确认为当期费用。

#### 16. 融资融券及转融通业务

本集团融资融券业务中，将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金，并按商定利率确认相应利息收入。

本集团融资融券业务中，将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券。对于融出的自有证券，不终止确认该证券，但确认利息收入。

本集团对于转融通融入的资金，确认对出借方的负债，并确认相应利息费用。对于转融通融入的证券，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，并确认相应利息费用。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 17. 客户交易结算资金

本集团收到的客户交易结算资金存放在客户交易结算资金存管银行账户上,与自有资金分开管理,为代理客户证券交易而进行资金清算与交收的款项存入登记结算公司,在结算备付金中进行核算。本集团在收到代理客户买卖证券款的同时确认为资产及负债,代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时,按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等相关费用确认为手续费支出,按规定向客户收取的手续费,在证券买卖交易日确认为手续费收入。

#### 18. 证券承销业务

本集团根据与发行人确定的发售方式,分别进行核算:

- (1) 对于以全额包销方式进行承销证券的业务,在按承购价格购入发行人待发售的证券时,按承销价格确认为一项资产;将证券转售给投资者时,按承销价格确认为证券承销收入,按已承销证券的承购价格结转承销证券的成本;承销期结束后,如有未售出的证券,按承购价格转为金融资产,根据附注三、8“金融工具”进行分类。
- (2) 对于以余额包销方式进行承销证券的业务,在收到发行人发售的证券时,不需要在账内同时确认为一项资产和一项负债,只需在专设的备查账簿中登记承销证券的情况。承销期结束后,如有未售出的证券,按承购价格转为金融资产,根据附注三、8“金融工具”进行分类。
- (3) 对于以代销方式进行承销证券的业务,在收到发行人发售的证券时,不需要在账内同时确认为一项资产和一项负债,只需在专设的备查账簿中登记承销证券的情况。

#### 19. 代理兑付证券

本集团分别对代兑付的证券和收到的兑付资金进行核算,在向委托单位交付已兑付的证券时,同时冲销“代理兑付证券”和“代理兑付证券款”科目。代理兑付证券的手续费收入,在代理兑付证券提供的相关服务完成,与委托方结算时确认手续费收入。

#### 20. 客户资产管理

客户资产管理业务,是指本集团接受委托负责经营管理客户资产的业务,包括单一资产管理、资产支持专项管理业务和集合资产管理业务。

本集团参照基金管理公司对基金产品的财务核算和财务报表编制的要求,对本集团开展的客户资产管理业务单独进行财务核算和编制财务报表。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 21. 职工薪酬

##### 21.1 短期薪酬的会计处理方法

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。

##### 21.2 离职后福利的会计处理方法

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。

##### 21.3 辞退福利的会计处理方法

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。

##### 21.4 其他长期职工福利的会计处理方法

对于其他长期职工福利，符合设定提存计划条件的，按照上述设定提存计划的有关规定进行处理，除此之外按照设定受益计划的有关规定，确认和计量其他长期职工福利净负债或净资产。年末，其他长期职工福利产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动三个组成部分。这些项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

#### 22. 预计负债

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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 22. 预计负债(续)

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。

#### 23. 收入

各项收入同时满足下列条件的，才能予以确认：

- 合同各方已批准该合同并承诺将履行各自义务；
- 该合同明确了合同各方与提供劳务相关的权利和义务；
- 该合同有明确的与提供劳务相关的支付条款；
- 该合同具有商业实质，即履行该合同将改变企业未来现金流量的风险、时间分布或金额；
- 本集团因向客户提供劳务而有权取得的对价很可能收回。

对于不符合上述条件的，只有在不再负有向客户提供劳务的剩余义务，且已向客户收取的对价无需退回时，才能将已收取的对价确认为收入；否则，应当将已收取的对价作为负债进行会计处理。

满足下列条件之一的，应在某一时段内确认收入，否则应在某一时点确认收入：

- 客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益；
- 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；
- 本集团履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且本集团在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时点确认收入的，应当考虑下列迹象：

- 本集团就该商品或服务享有现时收款权利，即客户就该商品或服务负有现时付款义务；
- 本集团已将该商品实物转移给客户，即客户已实际占有该商品；
- 本集团已按合同条款提供全部或阶段性服务，客户已接受该服务；
- 其他表明客户已取得商品控制权或已实质获得服务的迹象

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，本集团为代理人，按照预期有权收取的佣金或手续费的金额确认收入，该金额按照已收或应收对价总额扣除应支付给其他相关方的价款后的净额，或者按照既定的佣金金额或比例确定。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 23. 收入(续)

##### 23.1 手续费及佣金收入

各类型收入的具体确认情况如下：

- (1) 代理买卖证券手续费收入在代理买卖证券交易日确认。
- (2) 承销证券的佣金收入在提供承销服务的结果能够可靠估计时，于发行项目完成后根据合同金额确认；
- (3) 资产管理收入在资产管理相关服务已经提供时，按合同约定确认。
- (4) 代理兑付证券手续费收入在代理兑付证券相关服务完成，并与委托方结算时确认。
- (5) 代理保管证券手续费收入在代理保管证券相关服务完成时确认。
- (6) 咨询、财务顾问服务收入在咨询、财务顾问相关服务完成时确认。
- (7) 代理销售金融产品收入在代理销售金融产品相关服务完成时确认。

##### 23.2 利息收入

根据本金及实际利率按照权责发生制原则确认入账。

##### 23.3 其他收入

在服务已经提供，收入的金额能够可靠地计量，相关的经济利益很可能流入本集团，相关的已发生或将发生的成本能够可靠地计量时，按照有关合同或协议约定的收费时间和方法计算确认当期收入。

#### 24. 政府补助

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。

##### 24.1 与收益相关政府补助的判断依据及会计处理方法

本集团政府补助中地方经济发展贡献奖励等，为与收益相关的政府补助。

与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间相关费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关费用或损失的期间，计入当期损益；用于补偿已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 24. 政府补助(续)

##### 24.1 与收益相关政府补助的判断依据及会计处理方法(续)

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。与本集团日常活动无关的政府补助，计入营业外收入。

#### 25. 递延所得税资产和递延所得税负债

所得税费用包括当期所得税和递延所得税。

##### 25.1 当期所得税

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

##### 25.2 递延所得税资产及递延所得税负债

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

一般情况下所有暂时性差异均确认相关的递延所得税。但对于可抵扣暂时性差异，本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。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 25. 递延所得税资产和递延所得税负债(续)

##### 25.2 递延所得税资产及递延所得税负债(续)

除与直接计入其他综合收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，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。

##### 25.3 所得税的抵销

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

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

#### 26. 租赁

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。

在合同开始日，本集团评估该合同是否为租赁或者包含租赁。如果合同中一方让渡了在一定期间内控制一项或多项已识别资产使用的权利以换取对价，则该合同为租赁或者包含租赁。

##### 26.1 本集团作为承租人

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。

##### 26.1.1 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和租赁负债。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：

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 26. 租赁(续)

##### 26.1 本集团作为承租人(续)

##### 26.1.1 使用权资产(续)

- (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) 本集团发生的初始直接费用；
- (4) 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。

对于使用权资产，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。能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，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，确定使用权资产是否发生减值，并对已识别的减值损失进行会计处理。

##### 26.1.2 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，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，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：

- (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；
- (3) 本集团合理确定将行使的购买选择权的行权价格；
- (4) 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；
- (5) 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，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，并相应调整使用权资产的账面价值。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，本集团将剩余金额计入当期损益。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 26. 租赁(续)

##### 26.1 本集团作为承租人(续)

##### 26.1.2 租赁负债(续)

- (1) 因租赁期变化或购买选择权的评估结果发生变化的，按照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；
- (2) 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率发生变动的，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。

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

- (1) 该租赁变更通过增加一项或多项租赁资产的使用权而扩大了租赁范围；
- (2) 增加的对价与租赁范围扩大部分的单独价格按该合同情况调整后的金额相当。租赁变更未作为一项单独租赁进行会计处理的，在租赁变更生效日，本集团重新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。

##### 26.1.3 短期租赁和低价值租赁

本集团对短期租赁(租赁期不超过12个月且不包含购买选择权的租赁)以及低价值资产租赁，选择不确认使用权资产和租赁负债，将相关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或相关资产成本。

##### 26.2 本集团作为出租人

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。

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。

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

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 27. 利润分配

资产负债表日后，经审议批准的利润分配方案中拟分配的股利，不确认为资产负债表日的负债，在附注中单独披露。

#### 28. 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部，经营分部，是指本集团内同时满足下列条件的组织部分：该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

#### 29. 关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。关联方可为个人或企业。仅仅同受国家控制而不存在其他关联方关系的企业，不构成本集团的关联方。

#### 30. 重要会计政策和会计估计的变更

##### 30.1 重要会计政策变更

###### 租赁准则

本集团自 2021 年 1 月 1 日起执行财政部于 2018 年修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》(以下简称为“新租赁准则”)，新租赁准则统一了经营租赁和融资租赁下承租人的会计处理。除符合条件的短期租赁和低价资产租赁外，承租人须在初始计量时对承租的各项资产考虑未来租赁付款额折现等因素确认使用权资产和租赁负债。后续计量时，在租赁期内使用权资产计提折旧，租赁负债按实际利率法计算利息支出，并定期评估使用权资产减值情况。根据新租赁准则的衔接规定，本集团首次执行新租赁准则的累积影响数，调整本年年初留存收益及财务报表其他相关项目，不调整可比期间信息。本集团详细的租赁会计政策参见附注三、26。

对于首次执行日前已存在的合同，本集团在首次执行日选择不重新评估其是否为租赁或者包含租赁。

###### 本集团作为承租人

本集团根据首次执行新租赁准则累积影响数，调整首次执行日留存收益及财务报表其他相关项目金额，不调整可比期间信息。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 30. 重要会计政策和会计估计的变更(续)

##### 30.1 重要会计政策变更(续)

###### 租赁准则(续)

###### 本集团作为承租人(续)

对于首次执行日前的除低价值租赁外的租赁，本集团根据每项租赁选择采用下列一项或多项简化处理：

- 将于首次执行日后 12 个月内完成的租赁，作为短期租赁处理；
- 计量租赁负债时，具有相似特征的租赁采用同一折现率；
- 使用权资产的计量不包含初始直接费用；
- 存在续租选择权或终止租赁选择权的，本集团根据首次执行日前选择权的实际行使及其他最新情况确定租赁期；
- 作为使用权资产减值测试的替代，本集团根据《企业会计准则第 13 号——或有事项》评估包含租赁的合同在首次执行日前是否为亏损合同，并根据首次执行日前计入资产负债表的亏损准备金额调整使用权资产。

于 2021 年 1 月 1 日，本集团确认租赁负债人民币 484,782,168.62 元和使用权资产人民币 469,623,251.44 元。对于首次执行日前的经营租赁，本集团采用首次执行日增量借款利率折现后的现值计量租赁负债，该等增量借款利率的区间为 3.42% 至 4.00%。

本集团于 2021 年 1 月 1 日确认的租赁负债与 2020 年度财务报表中披露的重大经营租赁承诺的差额信息如下：

	<b>2021 年 1 月 1 日</b>
2020 年 12 月 31 日合并财务报表中披露的重大经营租赁的尚未支付的最低租赁付款额	535,083,210.37
减：2021 年 1 月 1 日尚未起租	6,811,500.68
按 2021 年 1 月 1 日本集团增量借款利率折现的现值	484,782,168.62
2021 年 1 月 1 日新租赁准则下的租赁负债	484,782,168.62
上述折现的现值与租赁负债之间的差额	-

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 30. 重要会计政策和会计估计的变更(续)

##### 30.1 重要会计政策变更(续)

###### 租赁准则(续)

###### 本集团作为承租人(续)

于2021年1月1日，本集团首次施行上述新租赁准则对本集团资产、负债和股东权益的影响汇总如下：

	2020年12月31日	施行新租赁准则影响	2021年1月1日
<b>资产：</b>			
使用权资产	-	469,623,251.44	469,623,251.44
长期股权投资	1,821,491,956.28	-890,938.29	1,820,601,017.99
其他资产	891,457,965.19	-15,371,224.95	876,086,740.24
<b>负债：</b>			
租赁负债	-	484,782,168.62	484,782,168.62
<b>所有者权益：</b>			
盈余公积	696,550,426.74	-3,072,623.18	693,477,803.56
一般风险准备	2,133,348,779.19	-6,145,246.36	2,127,203,532.83
未分配利润	2,967,954,128.83	-21,972,846.33	2,945,981,282.50
少数股东权益	450,871,929.17	-230,364.55	450,641,564.62

###### 本集团作为出租人

本集团无需对作为出租人的租赁调整首次执行新租赁准则当年年初数据。本集团自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

#### 31. 运用会计政策过程中所作的重要判断及会计估计所采用的关键假设和不确定因素

在运用会计政策过程中，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。

### 三、 重要会计政策和会计估计(续)

#### 31. 运用会计政策过程中所作的重要判断及会计估计所采用的关键假设和不确定因素(续)

##### -运用会计政策过程中所作的重要判断

##### 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。

对于本集团管理并投资的结构化主体(如资产管理计划、有限合伙企业等)，本集团会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。若本集团对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。对于本集团以外各方持有的结构化主体份额，因本集团作为发行人具有合约义务以现金回购其发售的份额，本集团将其确认为交易性金融负债或其他负债。

##### 金融资产的分类

本集团确定金融资产的分类时，需要对金融资产的商业模式和合同现金流量特征进行一些重要判断。

本集团在确定金融资产业务模式时考虑的因素包括：评价和向关键管理人员报告金融资产业绩的方式、影响金融资产业绩的风险及其管理方式以及相关业务管理人员获得报酬的方式等。

本集团在评估金融资产的合同现金流量是否与基本借贷安排一致时考虑的因素包括：本金金额可能因提前还款等原因在金融资产的存续期内发生变动，利息是否包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。

##### -会计估计中采用的关键假设和不确定因素

##### 金融资产的公允价值

对于没有活跃市场报价的金融工具，本集团运用各种估值技术确定其公允价值。估值技术包括市场价格模型法、现金流折现法等。在估值时，本集团需对诸如自身和交易对手的信用风险、市场波动率和相关性等方面进行估计，这些相关因素假设的变化会对金融工具的公允价值产生影响。

### 三、重要会计政策和会计估计(续)

#### 31. 运用会计政策过程中所作的重要判断及会计估计所采用的关键假设和不确定因素(续)

##### -会计估计中采用的关键假设和不确定因素(续)

##### 预期信用损失的计量

本集团在对以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资的预期信用损失计量的过程中需要运用如下重要判断：

**信用风险的显著增加：**本集团在评估金融资产预期信用损失时，需考虑定性和定量的信息，以判断金融资产的信用风险自初始确认购入后是否显著增加。

**模型和假设的使用：**本集团采用不同的模型和假设来评估金融资产的预期信用损失。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，这些信息基于不同经济驱动因素的未来走势，以及这些经济驱动因素如何相互影响的假设。

**违约概率：**违约概率是预期信用风险的重要输入值。违约概率是对未来一定时期内发生违约的可能性的估计。对于信用业务，本集团对违约概率的计算涉及历史数据、假设和对未来情况的预期，对于债权投资和其他债权投资，本集团在确定违约概率时参考外部评级确定每个级别对应的违约概率。

**违约损失率：**违约损失率是对违约产生的损失的估计。对于信用业务，本集团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情况确认违约损失率。对于债权投资和其他债权投资，本集团在确定违约损失率时参考无担保高级债权和次级债权的违约损失率。

##### 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确认的金额存在差异，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。

#### 四、 税项

本公司及子公司主要应纳税项及税率列示如下：

税种	计税依据	税率
增值税	应纳税增值额	3%、6%、9%或13%
企业所得税(注)	应纳税所得额	25%
城市维护建设税	实际缴纳增值税额	5%或7%
教育费附加	实际缴纳增值税额	3%
地方教育费附加	实际缴纳增值税额	2%

注： 根据《国家税务总局关于印发<跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法>的公告》(国家税务总局公告 2012 年第 57 号)，本公司实行“统一计算、分级管理、就地预缴、汇总清算、财政调库”的企业所得税征收管理办法。

#### 五、 合并财务报表主要项目注释

##### 1. 货币资金

###### (1) 按类别列示

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
库存现金	19,783.84	41,044.76
银行存款	19,788,712,600.71	15,482,482,405.05
其中：客户存款	18,279,178,415.25	14,790,241,492.07
公司存款	1,509,534,185.46	692,240,912.98
其他货币资金	1,018,596.91	808,777.51
<b>合计</b>	<b>19,789,750,981.46</b>	<b>15,483,332,227.32</b>

## 五、合并财务报表主要项目注释(续)

### 1. 货币资金(续)

#### (2) 按币种列示

项目	币种	2021年12月31日			2020年12月31日		
		原币	折算汇率	折合人民币	原币	折算汇率	折合人民币
现金	人民币	1,700.00	1.0000	1,700.00	-	1.0000	-
	美元	141.56	6.3757	902.55	1,317.56	6.5249	8,596.95
	港币	21,014.30	0.8176	17,181.29	38,554.91	0.8416	32,447.81
<b>现金小计</b>				<b>19,783.84</b>			<b>41,044.76</b>
银行存款	人民币	19,634,625,666.23	1.0000	19,634,625,666.23	15,318,825,661.28	1.0000	15,318,825,661.28
	美元	13,207,660.36	6.3757	84,208,080.17	14,935,676.89	6.5249	97,453,798.14
	港币	85,468,266.04	0.8176	69,878,854.31	78,663,195.85	0.8416	66,202,945.63
<b>银行存款小计</b>				<b>19,788,712,600.71</b>			<b>15,482,482,405.05</b>
其中：							
自有资金	人民币	1,464,845,848.47	1.0000	1,464,845,848.47	646,571,582.53	1.0000	646,571,582.53
	美元	3,577,940.92	6.3757	22,811,877.92	3,576,491.81	6.5249	23,336,251.40
	港币	26,756,921.57	0.8176	21,876,459.07	26,536,453.24	0.8416	22,333,079.05
<b>自有资金小计</b>				<b>1,509,534,185.46</b>			<b>692,240,912.98</b>
客户资金	人民币	18,169,779,817.76	1.0000	18,169,779,817.76	14,672,254,078.75	1.0000	14,672,254,078.75
	美元	9,629,719.44	6.3757	61,396,202.25	11,359,185.08	6.5249	74,117,546.74
	港币	58,711,344.47	0.8176	48,002,395.24	52,126,742.61	0.8416	43,869,866.58
<b>客户资金小计</b>				<b>18,279,178,415.25</b>			<b>14,790,241,492.07</b>
其他货币资金	人民币	1,018,596.91	1.0000	1,018,596.91	808,777.51	1.0000	808,777.51
<b>其他货币资金小计</b>				<b>1,018,596.91</b>			<b>808,777.51</b>
	<b>合计</b>			<b>19,789,750,981.46</b>			<b>15,483,332,227.32</b>

## 五、 合并财务报表主要项目注释(续)

### 1. 货币资金(续)

#### (2) 按币种列示(续)

其中，融资融券业务：

项目	币种	2021年12月31日			2020年12月31日		
		原币	折算汇率	折合人民币	原币	折算汇率	折合人民币
客户信用资金	人民币	3,181,414,758.39	1.0000	3,181,414,758.39	3,085,204,405.48	1.0000	3,085,204,405.48

注： 于 2021 年 12 月 31 日及 2020 年 12 月 31 日，本集团货币资金不存在抵押、冻结等对变现有限制及存在潜在回收风险的款项。

## 五、 合并财务报表主要项目注释(续)

### 2. 结算备付金

#### (1) 按类别列示

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
客户备付金	3,589,305,326.65	2,765,086,409.56
公司备付金	1,525,245,457.75	994,662,172.17
<b>合计</b>	<b>5,114,550,784.40</b>	<b>3,759,748,581.73</b>

#### (2) 按币种列示

项目	币种	2021年12月31日			2020年12月31日		
		原币	折算汇率	折合人民币	原币	折算汇率	折合人民币
结算备付金	人民币	5,081,969,257.93	1.0000	5,081,969,257.93	3,745,712,652.52	1.0000	3,745,712,652.52
	美元	3,890,512.37	6.3757	24,804,739.72	628,326.48	6.5249	4,099,767.45
	港币	9,511,725.48	0.8176	7,776,786.75	11,806,275.86	0.8416	9,936,161.76
<b>结算备付金小计</b>				<b>5,114,550,784.40</b>			<b>3,759,748,581.73</b>
其中:							
自有结算备付金	人民币	1,525,245,457.75	1.0000	1,525,245,457.75	994,662,172.17	1.0000	994,662,172.17
<b>自有资金小计</b>				<b>1,525,245,457.75</b>			<b>994,662,172.17</b>
客户资金	人民币	3,556,723,800.18	1.0000	3,556,723,800.18	2,751,050,480.35	1.0000	2,751,050,480.35
	美元	3,890,512.37	6.3757	24,804,739.72	628,326.48	6.5249	4,099,767.45
	港币	9,511,725.48	0.8176	7,776,786.75	11,806,275.86	0.8416	9,936,161.76
<b>客户资金小计</b>				<b>3,589,305,326.65</b>			<b>2,765,086,409.56</b>
其中:							
客户信用备付金	人民币	647,622,331.10	1.0000	647,622,331.10	84,836,739.33	1.0000	84,836,739.33
<b>合计</b>				<b>5,114,550,784.40</b>			<b>3,759,748,581.73</b>

注： 于 2021 年 12 月 31 日及 2020 年 12 月 31 日，本集团无使用受限的结算备付金。

### 3. 融出资金

#### (1) 按类别列示

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
融资融券业务融出资金	23,664,321,003.02	18,967,998,888.37
其中：个人	20,203,426,710.46	16,477,981,685.83
机构	3,460,894,292.56	2,490,017,202.54
减：减值准备	49,991,760.26	62,023,099.69
<b>账面价值合计</b>	<b>23,614,329,242.76</b>	<b>18,905,975,788.68</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

3. 融出资金(续)

(2) 按账龄分析

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
融资融券业务融出资金	23,664,321,003.02	18,967,998,888.37
其中：1 个月以内	4,519,126,076.22	4,156,528,629.99
1 至 3 个月	2,414,099,396.30	2,073,789,564.46
3 至 6 个月	3,752,419,720.45	5,665,789,019.78
6 个月以上	12,978,675,810.05	7,071,891,674.14
减：减值准备	49,991,760.26	62,023,099.69
<b>账面价值合计</b>	<b>23,614,329,242.76</b>	<b>18,905,975,788.68</b>

注：截至 2021 年 12 月 31 日，本集团无因场外回购业务而质押的融资融券收益权(2020 年 12 月 31 日：人民币 1,081,199,989.32 元)。

(3) 担保物情况

类别	2021 年 12 月 31 日公允价值	2020 年 12 月 31 日公允价值
资金	2,498,094,261.76	2,488,029,028.33
证券	57,445,825,742.76	44,072,852,543.42
<b>合计</b>	<b>59,943,920,004.52</b>	<b>46,560,881,571.75</b>

注： 上述担保物为融出资金和融出证券的担保物。

(4) 信用减值准备

项目	2021 年 12 月 31 日			
	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
账面余额	22,458,364,338.29	1,168,152,804.70	37,803,860.03	23,664,321,003.02
预期信用损失	4,134,346.35	8,053,553.88	37,803,860.03	49,991,760.26
<b>账面价值</b>	<b>22,454,229,991.94</b>	<b>1,160,099,250.82</b>	-	<b>23,614,329,242.76</b>

项目	2020 年 12 月 31 日			
	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
账面余额	16,671,998,244.64	2,255,953,891.49	40,046,752.24	18,967,998,888.37
预期信用损失	5,085,464.94	16,890,882.51	40,046,752.24	62,023,099.69
<b>账面价值</b>	<b>16,666,912,779.70</b>	<b>2,239,063,008.98</b>	-	<b>18,905,975,788.68</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

4. 衍生金融工具

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	非套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
资产		负债	资产		负债	
权益衍生工具	2,914,134,166.86	1,190,017.61	28,552,146.12	2,216,674,186.32	18,020,714.22	29,868,391.62
其中：权益类收益互换	77,338,000.00	7,171.61	28,376,846.12	736,380,866.32	17,473,514.83	22,808,031.62
股指期货	1,656,198,520.00	-	20,625,060.00	1,224,414,320.00	-	11,602,180.00
减：可抵销暂收暂付款		-	20,625,060.00		-	11,602,180.00
股票期权	1,082,097,646.86	1,182,846.00	-	158,079,000.00	-	7,060,360.00
场外期权	98,500,000.00	-	175,300.00	97,800,000.00	547,199.39	-
利率衍生工具	40,965,000,000.00	-	4,048,396.45	39,315,000,000.00	2,298,016.65	-
其中：利率互换	40,965,000,000.00	-	4,048,396.45	39,315,000,000.00	2,298,016.65	-
其他衍生工具	6,252,654,283.41	-	52,213,335.40	7,732,843,890.00	5,627,111.16	18,436,578.45
其中：国债期货	5,744,873,000.00	-	12,254,700.00	7,219,000,000.00	3,788,250.00	-
减：可抵销暂收暂付款		-	12,254,700.00		3,788,250.00	-
其他	507,781,283.41	-	52,213,335.40	513,843,890.00	5,627,111.16	18,436,578.45
<b>合计</b>	<b>50,131,788,450.27</b>	<b>1,190,017.61</b>	<b>84,813,877.97</b>	<b>49,264,518,076.32</b>	<b>25,945,842.03</b>	<b>48,304,970.07</b>

注： 期货投资业务实行当日无负债结算制度，本集团年末所持有的股指期货及国债期货合约产生的持仓损益已经结算并包括在结算备付金中。因此，衍生金融工具项下的股指期货、国债期货合约形成的金融资产或金融负债与相关的暂收暂付款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额列示。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

5. 存出保证金

(1) 按币种列示

币种	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	原币	折算汇率	折合人民币	原币	折算汇率	折合人民币
人民币	3,088,874,311.55	1.0000	3,088,874,311.55	2,211,800,200.11	1.0000	2,211,800,200.11
美元	270,000.00	6.3757	1,721,439.00	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港币	1,500,000.00	0.8176	1,226,400.00	1,500,000.00	0.8416	1,262,400.00
<b>合计</b>			<b>3,091,822,150.55</b>			<b>2,214,824,323.11</b>

(2) 存出保证金按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易保证金	2,689,799,083.48	2,066,478,477.38
信用保证金	402,023,067.07	148,345,845.73
<b>合计</b>	<b>3,091,822,150.55</b>	<b>2,214,824,323.11</b>

6. 应收款项

(1) 按明细类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收违约债权款	107,498,414.20	139,164,863.52
应收手续费及佣金	66,231,146.81	54,218,590.65
应收权益互换保证金	16,660,000.00	543,325,325.72
其他	262,398,886.79	127,585,325.65
<b>合计</b>	<b>452,788,447.80</b>	<b>864,294,105.54</b>
减：坏账准备	92,320,164.86	134,977,024.22
<b>应收款项账面价值</b>	<b>360,468,282.94</b>	<b>729,317,081.32</b>

(2) 按账龄列示

账龄	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	339,641,605.09	75.01	14,782.94	-
1 至 2 年	1,612,390.77	0.36	1,200.00	0.07
2 至 3 年	19,212,000.00	4.24	5,373,860.00	27.97
3 年以上	92,322,451.94	20.39	86,930,321.92	94.16
<b>合计</b>	<b>452,788,447.80</b>	<b>100.00</b>	<b>92,320,164.86</b>	

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

6. 应收款项(续)

(2) 按账龄列示(续)

账龄	2020 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	701,064,789.19	81.11	9,139.39	-
1 至 2 年	19,731,811.32	2.28	394,636.23	2.00
2 至 3 年	40,249,060.09	4.66	40,081,597.83	99.58
3 年以上	103,248,444.94	11.95	94,491,650.77	91.52
<b>合计</b>	<b>864,294,105.54</b>	<b>100.00</b>	<b>134,977,024.22</b>	

(3) 按评估方式列示

评估方式	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单项计提坏账准备	107,498,414.20	23.74	91,802,820.03	85.40
组合计提坏账准备	345,290,033.60	76.26	517,344.83	0.15
<b>合计</b>	<b>452,788,447.80</b>	<b>100.00</b>	<b>92,320,164.86</b>	

评估方式	2020 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单项计提坏账准备	139,164,863.52	16.10	134,296,069.35	96.50
组合计提坏账准备	725,129,242.02	83.90	680,954.87	0.09
<b>合计</b>	<b>864,294,105.54</b>	<b>100.00</b>	<b>134,977,024.22</b>	

(4) 应收款项金额前五名单位情况

单位名称	金额	占应收款项 总额比例(%)	坏账准备 年末余额	坏账准备 计提比例(%)	款项内容
中央国债登记结算有限责任公司	212,844,600.00	47.01	-	-	应收债券本息
徐州中森通浩新型板材有限公司	32,995,551.54	7.29	32,995,551.54	100.00	违约债权
重庆市福星门业(集团)有限公司	32,983,550.89	7.28	32,983,550.89	100.00	违约债权
旭诚系列私募基金	19,190,000.00	4.24	5,373,200.00	28.00	基金清算款
北信利通债券投资集合资金信托 计划第 118 期投资组合	18,000,000.00	3.98	16,121,205.83	89.56	违约债权
<b>合计</b>	<b>316,013,702.43</b>	<b>69.80</b>	<b>87,473,508.26</b>		

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

7. 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
债券	1,858,814,891.04	2,629,587,630.79
股票	28,325,130.54	20,228,117.18
减：减值准备	34,665,815.64	26,461,047.43
<b>账面价值</b>	<b>1,852,474,205.94</b>	<b>2,623,354,700.54</b>

(2) 按业务类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
债券质押式回购	1,858,814,891.04	1,828,351,251.13
股票质押式回购	28,325,130.54	20,228,117.18
债券买断式逆回购	-	801,236,379.66
<b>合计</b>	<b>1,887,140,021.58</b>	<b>2,649,815,747.97</b>
减：减值准备	34,665,815.64	26,461,047.43
<b>账面价值</b>	<b>1,852,474,205.94</b>	<b>2,623,354,700.54</b>

(3) 股票质押式回购的剩余期限

剩余期限	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
一个月以内	4,325,130.54	17,016,380.70
一个月至三个月以内	-	3,211,736.48
三个月至一年以内	14,000,000.00	-
一年以上	10,000,000.00	-
<b>合计</b>	<b>28,325,130.54</b>	<b>20,228,117.18</b>
减：减值准备	1,774,883.96	4,981,999.45
<b>账面价值</b>	<b>26,550,246.58</b>	<b>15,246,117.73</b>

(4) 担保物情况

业务类型	2021 年 12 月 31 日公允价值	2020 年 12 月 31 日公允价值
债券质押式回购	2,154,459,102.20	1,943,889,431.30
股票质押式回购	177,090,004.96	31,117,038.31
债券买断式逆回购	-	846,637,696.80
<b>合计</b>	<b>2,331,549,107.16</b>	<b>2,821,644,166.41</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

7. 买入返售金融资产(续)

(5) 信用减值准备

项目	2021 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期 信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	1,826,470,469.12	-	60,669,552.46	1,887,140,021.58
预期信用损失	-	-	34,665,815.64	34,665,815.64
<b>账面价值</b>	<b>1,826,470,469.12</b>	<b>-</b>	<b>26,003,736.82</b>	<b>1,852,474,205.94</b>

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期 信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期 信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	2,583,995,303.69	-	65,820,444.28	2,649,815,747.97
预期信用损失	81,158.05	-	26,379,889.38	26,461,047.43
<b>账面价值</b>	<b>2,583,914,145.64</b>	<b>-</b>	<b>39,440,554.90</b>	<b>2,623,354,700.54</b>

8. 交易性金融资产

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	初始成本	公允价值	初始成本
债券	19,673,801,406.61	19,494,192,177.48	15,634,629,062.85	15,556,277,669.84
股票	1,380,837,030.73	1,282,759,155.66	1,158,174,781.08	964,395,758.28
基金	7,714,102,911.32	7,442,764,471.94	3,514,591,525.67	3,427,760,248.52
证券公司资产管理计划	3,741,929,688.89	3,617,501,568.43	2,444,107,036.47	2,412,456,943.87
信托产品	562,692,588.84	578,216,271.78	736,293,990.92	730,785,647.68
其他	537,909,449.35	450,010,033.65	416,337,349.44	422,073,115.64
<b>合计</b>	<b>33,611,273,075.74</b>	<b>32,865,443,678.94</b>	<b>23,904,133,746.43</b>	<b>23,513,749,383.83</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

8. 交易性金融资产(续)

(2) 存在有承诺条件的交易性金融资产

项目	限售条件或变现方面的其他重大限制	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股票	为融资融券业务而转让过户；限售股	118,928,003.26	197,846,464.54
基金	为融资融券业务而转让过户；以管理人身份认购的基金份额；承诺不退出；未过封闭期	123,900,103.47	249,698,326.12
债券	为质押式回购业务而设定质押；债券借贷业务；国债充抵期货保证金	14,758,534,718.44	9,616,864,275.78
证券公司资产管理计划	以管理人身份认购的资产管理计划份额；承诺不退出；维持杠杆比例	142,953,838.04	197,268,034.40
信托产品	承诺不退出	3,788,220.00	58,914,230.37
股权投资	承诺不退出	51,428,800.00	-
<b>合计</b>		<b>15,199,533,683.21</b>	<b>10,320,591,331.21</b>

9. 债权投资

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日			
	初始成本	应计利息	减值准备	账面价值
证券公司资产管理计划	65,000,000.00	-	35,750,000.00	29,250,000.00
其他	19,995,312.00	-	19,995,312.00	-
<b>合计</b>	<b>84,995,312.00</b>	<b>-</b>	<b>55,745,312.00</b>	<b>29,250,000.00</b>

项目	2020 年 12 月 31 日			
	初始成本	应计利息	减值准备	账面价值
证券公司资产管理计划	65,000,000.00	-	29,250,000.00	35,750,000.00
信托产品	50,000,000.00	1,285,479.45	189,215.92	51,096,263.53
其他	20,000,000.00	-	8,000,000.00	12,000,000.00
<b>合计</b>	<b>135,000,000.00</b>	<b>1,285,479.45</b>	<b>37,439,215.92</b>	<b>98,846,263.53</b>

(2) 存在有承诺条件的债权投资

项目	限制条件	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
信托产品	承诺不退出	-	31,240,125.37
<b>合计</b>		<b>-</b>	<b>31,240,125.37</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

9. 债权投资(续)

(3) 信用减值准备

项目	2021 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	-	-	84,995,312.00	84,995,312.00
预期信用损失	-	-	55,745,312.00	55,745,312.00
<b>账面价值</b>	-	-	<b>29,250,000.00</b>	<b>29,250,000.00</b>

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	51,285,479.45	-	85,000,000.00	136,285,479.45
预期信用损失	189,215.92	-	37,250,000.00	37,439,215.92
<b>账面价值</b>	<b>51,096,263.53</b>	-	<b>47,750,000.00</b>	<b>98,846,263.53</b>

10. 其他债权投资

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日				
	初始成本	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
企业债	542,450,065.12	13,038,609.95	-5,243,922.12	550,244,752.95	1,090,715.84
中期票据	150,130,005.81	4,215,616.44	-85,705.81	154,259,916.44	107,114.25
<b>合计</b>	<b>692,580,070.93</b>	<b>17,254,226.39</b>	<b>-5,329,627.93</b>	<b>704,504,669.39</b>	<b>1,197,830.09</b>

项目	2020 年 12 月 31 日				
	初始成本	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
企业债	897,365,864.92	21,320,140.15	-5,998,801.92	912,687,203.15	1,344,559.63
中期票据	169,925,572.32	4,365,534.25	-70,182.32	174,220,924.25	189,283.72
其他	1,200,000.00	-	-	1,200,000.00	10,206.00
<b>合计</b>	<b>1,068,491,437.24</b>	<b>25,685,674.40</b>	<b>-6,068,984.24</b>	<b>1,088,108,127.40</b>	<b>1,544,049.35</b>

(2) 存在有承诺条件的其他债权投资

项目	限制条件	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
债券	质押式回购业务而设定 质押；债券借贷业务	508,078,946.64	571,810,687.44
信托	承诺不退出	-	1,200,000.00
<b>合计</b>		<b>508,078,946.64</b>	<b>573,010,687.44</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

10. 其他债权投资(续)

(3) 信用减值准备

项目	2021 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	679,392,707.62	25,111,961.77	-	704,504,669.39
预期信用损失	621,187.49	576,642.60	-	1,197,830.09
<b>账面价值</b>	<b>679,392,707.62</b>	<b>25,111,961.77</b>	<b>-</b>	<b>704,504,669.39</b>

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	1,056,574,063.30	31,534,064.10	-	1,088,108,127.40
预期信用损失	1,207,683.16	336,366.19	-	1,544,049.35
<b>账面价值</b>	<b>1,056,574,063.30</b>	<b>31,534,064.10</b>	<b>-</b>	<b>1,088,108,127.40</b>

11. 其他权益工具投资

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	初始成本	公允价值	初始成本	公允价值
股票	120,145,291.15	166,679,684.61	173,765,140.55	144,263,208.23
其他	43,993,771.07	25,000,000.00	48,280,771.07	27,787,000.00
<b>合计</b>	<b>164,139,062.22</b>	<b>191,679,684.61</b>	<b>222,045,911.62</b>	<b>172,050,208.23</b>

(2) 存在有承诺条件的其他权益工具投资

项目	限制条件	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股票	限售股	129,330,432.00	129,449,331.90
<b>合计</b>		<b>129,330,432.00</b>	<b>129,449,331.90</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

12. 长期股权投资

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
对联营/合营企业投资	2,298,222,888.33	1,827,227,075.26
减：长期股权投资减值准备	-	5,735,118.98
<b>长期股权投资账面价值</b>	<b>2,298,222,888.33</b>	<b>1,821,491,956.28</b>

(2) 长期股权投资明细

被投资单位	核算方法	投资成本	2020 年 12 月 31 日	执行新租赁准则影响	2021 年 1 月 1 日	本年增减变动			2021 年 12 月 31 日	在被投资单位持股比例(%)	在被投资单位表决权比例(%)
						减少投资	权益法下确认的投资损益	现金红利			
联营/合营企业											
景顺长城基金管理有限公司	权益法	66,843,800.00	1,110,121,309.89	-890,938.29	1,109,230,371.60	-	687,042,906.10	-263,969,960.00	1,532,303,317.70	49.00	49.00
长城基金管理有限公司	权益法	92,184,190.00	711,370,646.39	-	711,370,646.39	-	77,961,543.27	-23,412,619.03	765,919,570.63	47.059	47.059
深圳市通商投资有限公司	权益法	-	5,735,118.98	-	5,735,118.98	-5,735,118.98	-	-	-	-	-
<b>合计</b>		<b>159,027,990.00</b>	<b>1,827,227,075.26</b>	<b>-890,938.29</b>	<b>1,826,336,136.97</b>	<b>-5,735,118.98</b>	<b>765,004,449.37</b>	<b>-287,382,579.03</b>	<b>2,298,222,888.33</b>		

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

13. 固定资产

(1) 固定资产情况

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
固定资产原价	457,891,474.92	464,526,002.91
减：累计折旧	303,278,970.16	298,749,576.96
固定资产减值准备	126,900.00	126,900.00
<b>固定资产账面价值</b>	<b>154,485,604.76</b>	<b>165,649,525.95</b>

(2) 固定资产增减变动表

项目	房屋及建筑物	运输工具	电子设备	办公设备	合计
<b>一、账面原值</b>					
2020 年 12 月 31 日	173,828,510.79	40,744,190.72	209,480,974.54	40,472,326.86	464,526,002.91
本年增加	-	443,893.80	23,251,718.23	3,759,744.15	27,455,356.18
(1)购置	-	443,893.80	23,251,718.23	3,759,744.15	27,455,356.18
本年减少	-	415,690.00	31,704,979.25	1,969,214.92	34,089,884.17
(1)清理报废	-	415,690.00	31,704,979.25	1,969,214.92	34,089,884.17
2021 年 12 月 31 日	173,828,510.79	40,772,394.52	201,027,713.52	42,262,856.09	457,891,474.92
<b>二、累计折旧</b>					
2020 年 12 月 31 日	100,367,616.25	35,448,377.65	135,661,602.43	27,271,980.63	298,749,576.96
本年增加	6,314,887.18	1,179,992.04	26,477,940.88	4,507,907.52	38,480,727.62
(1)计提	6,314,887.18	1,179,992.04	26,477,940.88	4,507,907.52	38,480,727.62
本年减少	-	403,219.30	31,629,333.23	1,918,781.89	33,951,334.42
(1)清理报废	-	403,219.30	31,629,333.23	1,918,781.89	33,951,334.42
2021 年 12 月 31 日	106,682,503.43	36,225,150.39	130,510,210.08	29,861,106.26	303,278,970.16
<b>三、减值准备</b>					
2020 年 12 月 31 日	-	126,900.00	-	-	126,900.00
2021 年 12 月 31 日	-	126,900.00	-	-	126,900.00
<b>四、账面价值</b>					
2021 年 12 月 31 日	67,146,007.36	4,420,344.13	70,517,503.44	12,401,749.83	154,485,604.76
2020 年 12 月 31 日	73,460,894.54	5,168,913.07	73,819,372.11	13,200,346.23	165,649,525.95

## 五、合并财务报表主要项目注释(续)

## 13. 固定资产(续)

## (3) 年末未办妥产权证书的固定资产

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
深圳市平湖坤宜福苑人才住房	7,603,863.15	政府人才住房, 无房产证
深圳市颂德花园人才住房	1,772,256.79	政府人才住房, 无房产证
深圳市松坪山三期人才住房	822,207.37	政府人才住房, 无房产证
深圳市红树福苑人才住房	537,607.05	政府人才住房, 无房产证
深圳市先科花园	270,981.20	待办证
北京市和平里八区联建住宅	177,856.97	1997 年与某矿产开发经营公司签订《联建协议书》, 尚未办理房产证
大连市中山区华乐一区住宅	130,638.24	待办证
<b>合计</b>	<b>11,315,410.77</b>	

## 14. 使用权资产

项目	房屋租赁
<b>一、账面原值</b>	
2021 年 1 月 1 日	722,168,966.50
本年增加	102,086,992.84
本年减少	111,505,531.21
2021 年 12 月 31 日	712,750,428.13
<b>二、累计折旧:</b>	
2021 年 1 月 1 日	252,545,715.06
本年增加-计提	126,343,024.73
本年减少-处置	79,595,109.95
2021 年 12 月 31 日	299,293,629.84
<b>三、账面价值:</b>	
2021 年 12 月 31 日	413,456,798.29
2021 年 1 月 1 日	469,623,251.44

本集团租赁的资产为房屋及建筑物, 租赁期为 13 个月至 12 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。在厘定租赁期及评估不可撤销期间的长度时, 本集团应用合同的定义并厘定合同可强制执行的期间。

本集团本年度与租赁相关的现金流出合计人民币 123,579,574.83 元。

本年度计入当期损益的简化处理的短期租赁费用, 详见附注五、44、业务及管理费; 租赁负债的利息费用, 详见附注五、37、利息净收入。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

15. 无形资产

项目	软件	交易席位费	合计
<b>一、账面原值</b>			
2020 年 12 月 31 日	254,876,140.07	10,535,491.35	265,411,631.42
本年增加	36,552,104.76	-	36,552,104.76
(1)购置	36,552,104.76	-	36,552,104.76
本年减少	2,683,879.25	-	2,683,879.25
(1)处置	2,683,879.25	-	2,683,879.25
2021 年 12 月 31 日	288,744,365.58	10,535,491.35	299,279,856.93
<b>二、累计摊销</b>			
2020 年 12 月 31 日	166,626,790.45	10,368,824.95	176,995,615.40
本年增加	32,470,208.51	50,000.04	32,520,208.55
(1)计提	32,470,208.51	50,000.04	32,520,208.55
本年减少	2,683,879.25	-	2,683,879.25
(1)处置	2,683,879.25	-	2,683,879.25
2021 年 12 月 31 日	196,413,119.71	10,418,824.99	206,831,944.70
<b>三、账面价值</b>			
2021 年 12 月 31 日	92,331,245.87	116,666.36	92,447,912.23
2020 年 12 月 31 日	88,249,349.62	166,666.40	88,416,016.02

16. 商誉

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	账面余额	减值准备	净额	账面余额	减值准备	净额
宝城期货 有限责任公司	11,302,586.62	-	11,302,586.62	11,302,586.62	-	11,302,586.62
<b>合计</b>	<b>11,302,586.62</b>	<b>-</b>	<b>11,302,586.62</b>	<b>11,302,586.62</b>	<b>-</b>	<b>11,302,586.62</b>

于 2007 年 8 月，本集团通过非同一控制下企业合并的方式收购宝城期货公司的股权。因合并成本超过获得的宝城期货公司可辨认净资产公允价值份额，本集团将其差额确认为商誉。

于 2021 年 12 月 31 日，本集团将宝城期货公司作为一个资产组，并对上述商誉进行减值测试，确认并没有发生减值损失。本集团认为在进行减值测试时已根据可以获得的信息做出适当假设，如果对该资产组未来现金流量现值进行预计所依据的关键假设发生改变，则可能导致可收回金额低于其包括商誉在内的账面价值。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

17. 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产和递延所得税负债

项目	2021年12月31日	
	递延所得税资产/负债	可抵扣/应纳税暂时性差异
一、递延所得税资产：		
资产减值准备	68,711,090.61	274,844,362.43
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	36,861,874.88	147,447,499.47
其他债权投资公允价值变动	1,332,406.98	5,329,627.93
应付未付款	145,199,751.46	580,799,005.82
其他	338,252.89	1,353,011.56
<b>合计</b>	<b>252,443,376.82</b>	<b>1,009,773,507.21</b>
二、递延所得税负债：		
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	78,365,536.89	313,462,147.54
其他权益工具投资公允价值变动	11,633,598.37	46,534,393.46
<b>合计</b>	<b>89,999,135.26</b>	<b>359,996,541.00</b>

项目	2020年12月31日	
	递延所得税资产/负债	可抵扣/应纳税暂时性差异
一、递延所得税资产：		
资产减值准备	66,142,523.59	264,570,094.42
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	27,645,939.17	110,583,756.68
其他债权投资公允价值变动	1,517,246.06	6,068,984.24
其他权益工具投资公允价值变动	7,750,483.08	31,001,932.32
应付未付款	125,532,799.43	502,131,197.75
其他	338,252.89	1,353,011.56
<b>合计</b>	<b>228,927,244.22</b>	<b>915,708,976.97</b>
二、递延所得税负债：		
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	17,194,056.76	68,776,227.02
<b>合计</b>	<b>17,194,056.76</b>	<b>68,776,227.02</b>

(2) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

项目	2021年12月31日		2020年12月31日	
	递延所得税资产和 负债互抵金额	抵销后递延所得税 资产或负债余额	递延所得税资产和 负债互抵金额	抵销后递延所得税 资产或负债余额
递延所得税资产	87,704,447.30	164,738,929.52	-	228,927,244.22
递延所得税负债	87,704,447.30	2,294,687.96	-	17,194,056.76

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

17. 递延所得税资产和递延所得税负债(续)

(3) 未确认递延所得税资产明细

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
可抵扣暂时性差异	62,690,205.12	68,426,775.68
可抵扣亏损	9,417,049.85	7,859,600.41
<b>合计</b>	<b>72,107,254.97</b>	<b>76,286,376.09</b>

注：未确认递延所得税资产主要包括其他应收款坏账准备、可弥补亏损等项目，因无法确定未来期间是否可以转回及未确认的可抵扣亏损在可补亏期限内是否产生足够的应纳税所得额，本集团出于谨慎性原则未确认相关的递延所得税资产。

18. 其他资产

项目		2021年12月31日	2020年12月31日
应收贸易款		973,245,446.16	650,433,215.96
其他应收款	(1)	102,128,605.68	134,176,321.37
长期待摊费用	(2)	59,662,552.57	71,655,780.05
预缴税款		-	27,200.08
待摊费用		1,673,284.88	1,925,281.03
其他		64,229,486.19	33,240,166.70
<b>合计</b>		<b>1,200,939,375.48</b>	<b>891,457,965.19</b>

(1) 其他应收款

① 按账龄列示

项目	2021 年 12 月 31 日		
	账面金额	比例(%)	坏账准备
1 年以内	100,612,857.42	53.57	38,289,311.34
1 年至 2 年	6,247,337.23	3.33	116,525.91
2 年至 3 年	20,700,128.05	11.02	620,877.84
3 年以上	60,259,126.70	32.08	46,664,128.63
<b>合计</b>	<b>187,819,449.40</b>	<b>100.00</b>	<b>85,690,843.72</b>

项目	2020 年 12 月 31 日		
	账面金额	比例(%)	坏账准备
1 年以内	91,155,182.29	50.25	51,520.67
1 年至 2 年	22,931,554.00	12.64	457,342.01
2 年至 3 年	8,380,003.93	4.62	248,645.41
3 年以上	58,950,273.94	32.49	46,483,184.70
<b>合计</b>	<b>181,417,014.16</b>	<b>100.00</b>	<b>47,240,692.79</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

18. 其他资产(续)

(1) 其他应收款(续)

② 按评估方式列示

账龄	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单项计提坏账准备	82,611,527.94	43.98	82,611,527.94	100.00
组合计提坏账准备	105,207,921.46	56.02	3,079,315.78	2.93
<b>合计</b>	<b>187,819,449.40</b>	<b>100.00</b>	<b>85,690,843.72</b>	

账龄	2020 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
单项计提坏账准备	44,371,327.93	24.46	44,371,327.93	100.00
组合计提坏账准备	137,045,686.23	75.54	2,869,364.86	2.09
<b>合计</b>	<b>181,417,014.16</b>	<b>100.00</b>	<b>47,240,692.79</b>	

(2) 长期待摊费用

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
装修工程	53,609,733.22	62,897,506.49
机房工程	3,253,742.28	4,177,719.83
网络工程	1,241,757.90	1,994,071.75
其他	1,557,319.17	2,586,481.98
<b>合计</b>	<b>59,662,552.57</b>	<b>71,655,780.05</b>

## 五、合并财务报表主要项目注释(续)

## 19. 资产减值准备明细表

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加		本年减少		2021 年 12 月 31 日
		计提	其他	转回	转销	
<b>金融资产:</b>						
融出资金减值准备	62,023,099.69	-	-	12,031,339.43	-	49,991,760.26
应收款项坏账准备	134,977,024.22	5,209,589.96	-	25,241,291.62	22,625,157.70	92,320,164.86
买入返售金融资产 减值准备	26,461,047.43	10,752,577.81	-	-	2,547,809.60	34,665,815.64
债权投资减值准备	37,439,215.92	18,306,096.08	-	-	-	55,745,312.00
其他债权投资减值准备	1,544,049.35	-	-	346,219.26	-	1,197,830.09
其他应收款坏账准备	47,240,692.79	205,950.92	38,244,200.01	-	-	85,690,843.72
<b>小计</b>	<b>309,685,129.40</b>	<b>34,474,214.77</b>	<b>38,244,200.01</b>	<b>37,618,850.31</b>	<b>25,172,967.30</b>	<b>319,611,726.57</b>
<b>非金融资产:</b>						
长期股权投资减值准备	5,735,118.98	-	-	-	5,735,118.98	-
固定资产减值准备	126,900.00	-	-	-	-	126,900.00
<b>小计</b>	<b>5,862,018.98</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,735,118.98</b>	<b>126,900.00</b>
<b>合计</b>	<b>315,547,148.38</b>	<b>34,474,214.77</b>	<b>38,244,200.01</b>	<b>37,618,850.31</b>	<b>30,908,086.28</b>	<b>319,738,626.57</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

20. 短期借款

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
信用借款	319,468,002.74	119,040,434.93
<b>合计</b>	<b>319,468,002.74</b>	<b>119,040,434.93</b>

21. 应付短期融资款

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付短期融资券	4,515,077,808.21	3,018,141,571.46
短期收益凭证	1,526,197,897.26	2,437,300,365.33
<b>合计</b>	<b>6,041,275,705.47</b>	<b>5,455,441,936.79</b>

(2) 年末未到期的短期融资款情况

债券类型	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
短期融资券(注 1)	3,018,141,571.46	13,095,641,168.25	11,598,704,931.50	4,515,077,808.21
短期收益凭证(注 2)	2,437,300,365.33	5,364,110,516.40	6,275,212,984.47	1,526,197,897.26
<b>合计</b>	<b>5,455,441,936.79</b>	<b>18,459,751,684.65</b>	<b>17,873,917,915.97</b>	<b>6,041,275,705.47</b>

注 1: 于本年末, 本公司发行的未到期短期融资券于 2022 年 1 月 18 日至 2022 年 9 月 9 日间到期, 利率区间为 2.63% 至 2.71%。

注 2: 于本年末, 本公司发行的短期收益凭证包括浮动利率收益凭证和固定利率收益凭证。上述未到期收益凭证于 2022 年 1 月 5 日至 2022 年 9 月 16 日间到期, 其中固定利率收益凭证的利率区间为 3.30% 至 6.00%。

22. 拆入资金

(1) 按分类列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
转融通融入资金	1,281,897,777.08	-
同业拆借拆入资金	-	500,320,833.33
<b>合计</b>	<b>1,281,897,777.08</b>	<b>500,320,833.33</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

22. 拆入资金(续)

(2) 按剩余期限及利率(区间)列示

剩余期限	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	利率区间(%)	账面余额	利率区间(%)
1 个月以内	-	-	500,320,833.33	3.30
1 个月至 3 个月	1,281,897,777.08	2.80	-	-
3 个月至 1 年	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>1,281,897,777.08</b>		<b>500,320,833.33</b>	

23. 卖出回购金融资产款

(1) 按标的物类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
证券	14,203,807,051.69	8,674,474,979.54
融资融券收益权	-	1,009,123,611.11
<b>合计</b>	<b>14,203,807,051.69</b>	<b>9,683,598,590.65</b>

(2) 按业务类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
质押式回购	14,203,807,051.69	8,424,091,937.33
买断式回购	-	254,383,042.21
融资融券收益权回购	-	1,009,123,611.11
<b>合计</b>	<b>14,203,807,051.69</b>	<b>9,683,598,590.65</b>

(3) 担保物信息

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
质押式回购	16,466,410,388.30	11,033,525,204.50
买断式回购	-	254,727,860.00
融资融券收益权回购	-	1,081,199,989.32
<b>合计</b>	<b>16,466,410,388.30</b>	<b>12,369,453,053.82</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

24. 代理买卖证券款

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
普通经纪业务小计	18,250,000,170.69	15,636,432,704.17
其中：个人客户	12,947,606,818.72	12,018,365,960.97
法人客户	5,302,393,351.97	3,618,066,743.20
信用业务小计	4,803,221,903.01	3,134,181,507.82
其中：个人客户	3,149,614,374.33	2,854,855,426.66
法人客户	1,653,607,528.68	279,326,081.16
<b>合计</b>	<b>23,053,222,073.70</b>	<b>18,770,614,211.99</b>

25. 应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
一、短期薪酬及长期薪酬	1,254,835,641.49	1,696,598,469.27	1,411,509,367.59	1,539,924,743.17
二、离职后福利-设定提存计划	13,833,765.48	116,211,250.64	124,990,663.74	5,054,352.38
三、辞退福利	-	6,689,993.16	6,689,993.16	-
<b>合计</b>	<b>1,268,669,406.97</b>	<b>1,819,499,713.07</b>	<b>1,543,190,024.49</b>	<b>1,544,979,095.55</b>

(2) 短期薪酬及长期薪酬列示

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,241,559,258.95	1,555,673,649.27	1,269,034,313.73	1,528,198,594.49
二、职工福利费	-	18,680,215.32	18,680,215.32	-
三、社会保险费	40,225.84	37,814,512.06	37,854,737.90	-
其中：医疗保险费	35,989.81	35,478,317.43	35,514,307.24	-
工伤保险费	-	695,683.32	695,683.32	-
生育保险费	4,236.03	1,640,511.31	1,644,747.34	-
四、住房公积金	-	57,922,491.29	57,922,491.29	-
五、工会经费和职工教育经费	13,236,156.70	23,559,621.74	25,069,629.76	11,726,148.68
六、其他	-	2,947,979.59	2,947,979.59	-
<b>合计</b>	<b>1,254,835,641.49</b>	<b>1,696,598,469.27</b>	<b>1,411,509,367.59</b>	<b>1,539,924,743.17</b>

于 2021 年 12 月 31 日,应付职工薪酬中包含的长期薪酬余额为人民币 664,462,423.65 元(2020 年 12 月 31 日: 人民币 433,427,701.78 元)。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

25. 应付职工薪酬(续)

(3) 设定提存计划列示

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
年金缴费	13,833,765.48	46,434,341.17	55,213,754.27	5,054,352.38
基本养老保险费	-	68,113,028.34	68,113,028.34	-
失业保险费	-	1,663,881.13	1,663,881.13	-
<b>合计</b>	<b>13,833,765.48</b>	<b>116,211,250.64</b>	<b>124,990,663.74</b>	<b>5,054,352.38</b>

26. 应交税费

税种	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
增值税	54,164,388.39	28,649,041.79
企业所得税	40,034,615.25	79,063,789.55
个人所得税	19,043,680.55	40,698,189.11
资管产品增值税	15,147,343.87	20,766,848.08
城市维护建设税	3,355,151.70	1,675,988.61
教育费附加	2,773,939.66	1,567,582.54
其他税费	4,100,437.54	2,628,970.67
<b>合计</b>	<b>138,619,556.96</b>	<b>175,050,410.35</b>

27. 应付款项

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付清算款	232,086,246.88	131,308,679.80
应付权益互换保证金	61,069,349.50	91,325,723.86
应付基金款	56,632,644.95	67,703,298.83
其他	59,173,890.56	55,653,541.03
<b>合计</b>	<b>408,962,131.89</b>	<b>345,991,243.52</b>

28. 应付债券

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
公司债	23,201,199,395.49	15,030,425,570.99
长期收益凭证	487,781,283.41	1,938,047,022.50
<b>合计</b>	<b>23,688,980,678.90</b>	<b>16,968,472,593.49</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

28. 应付债券(续)

(2) 年末应付债券情况

项目	起息日期	到期日期	期限	票面利率	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
17 长证 02(注 1)	2017 年 7 月 27 日	2022 年 7 月 27 日	5 年	5.08%	797,260,865.78	39,624,000.01	39,624,000.00	797,260,865.79
19 长城 01(注 2)	2019 年 1 月 21 日	2022 年 1 月 21 日	3 年	3.67%	1,034,789,589.06	36,700,000.01	36,700,000.00	1,034,789,589.07
19 长城 03(注 3)	2019 年 7 月 16 日	2022 年 7 月 16 日	3 年	3.69%	2,032,516,701.21	74,999,195.35	73,800,000.00	2,033,715,896.56
19 长城 05(注 3)	2019 年 10 月 21 日	2021 年 10 月 21 日	2 年	3.40%	1,006,077,842.22	27,922,157.78	1,034,000,000.00	-
19 长证 01(注 4)	2019 年 3 月 19 日	2022 年 3 月 19 日	3 年	4.20%	1,033,254,794.51	42,000,000.00	42,000,000.00	1,033,254,794.51
20 长城 01(注 3)	2020 年 2 月 20 日	2023 年 2 月 20 日	3 年	3.09%	1,025,480,633.54	31,485,403.09	30,900,000.00	1,026,066,036.63
20 长城 03(注 5)	2020 年 7 月 31 日	2022 年 7 月 31 日	2 年	3.25%	1,010,726,403.30	34,381,798.08	32,500,000.00	1,012,608,201.38
20 长城 04(注 5)	2020 年 8 月 28 日	2022 年 2 月 28 日	1.5 年	3.37%	1,008,715,493.92	36,209,754.41	25,205,752.98	1,019,719,495.35
20 长城 05(注 5)	2020 年 9 月 25 日	2023 年 9 月 25 日	3 年	3.84%	1,006,861,200.49	39,622,057.43	38,400,000.00	1,008,083,257.92
20 长城 06(注 5)	2020 年 10 月 22 日	2022 年 4 月 22 日	1.5 年	3.47%	1,003,460,076.55	37,205,192.07	25,953,698.92	1,014,711,569.70
20 长城 07(注 5)	2020 年 10 月 22 日	2022 年 10 月 22 日	2 年	3.58%	1,003,550,463.59	37,665,412.66	35,800,000.00	1,005,415,876.25
20 长城 C1(注 6)	2020 年 3 月 12 日	2025 年 3 月 12 日	5 年	4.00%	1,032,328,767.09	39,999,999.96	40,000,000.00	1,032,328,767.05
20 长城 C2(注 6)	2020 年 5 月 22 日	2023 年 5 月 22 日	3 年	3.37%	1,020,681,643.82	33,699,999.98	33,700,000.00	1,020,681,643.80
20 长城 C3(注 7)	2020 年 8 月 21 日	2023 年 8 月 21 日	3 年	4.04%	1,014,721,095.91	40,400,000.04	40,400,000.00	1,014,721,095.95
21 长城 01(注 5)	2021 年 1 月 20 日	2024 年 1 月 20 日	3 年	3.57%	-	1,031,217,333.71	-	1,031,217,333.71
21 长城 02(注 8)	2021 年 5 月 25 日	2024 年 5 月 25 日	3 年	3.39%	-	1,424,482,574.01	-	1,424,482,574.01
21 长城 03(注 8)	2021 年 5 月 25 日	2023 年 5 月 25 日	2 年	3.20%	-	610,035,050.58	-	610,035,050.58
21 长城 04(注 8)	2021 年 6 月 23 日	2024 年 6 月 23 日	3 年	3.67%	-	1,016,168,737.36	-	1,016,168,737.36
21 长城 05(注 8)	2021 年 7 月 27 日	2023 年 7 月 27 日	2 年	3.07%	-	1,010,319,347.66	-	1,010,319,347.66
21 长城 06(注 8)	2021 年 7 月 27 日	2024 年 7 月 27 日	3 年	3.24%	-	1,010,778,152.61	-	1,010,778,152.61
21 长城 07(注 8)	2021 年 9 月 24 日	2024 年 9 月 24 日	3 年	3.30%	-	1,307,158,865.42	-	1,307,158,865.42
21 长城 08(注 8)	2021 年 9 月 24 日	2026 年 9 月 24 日	5 年	3.69%	-	704,497,312.70	-	704,497,312.70
21 长城 C1(注 7)	2021 年 3 月 22 日	2024 年 3 月 22 日	3 年	4.25%	-	1,033,184,931.48	-	1,033,184,931.48
长期收益凭证(注 9)	2019 年 4 月 19 日至 2021 年 12 月 30 日	21 年 1 月 18 日至 2024 年 12 月 30 日	366 天至 1102 天	4.18%-4.20%/浮动利 率	1,938,047,022.50	669,502,682.68	2,119,768,421.77	487,781,283.41
<b>合计</b>					<b>16,968,472,593.49</b>	<b>10,369,259,959.08</b>	<b>3,648,751,873.67</b>	<b>23,688,980,678.90</b>

## 五、 合并财务报表主要项目注释(续)

### 28. 应付债券(续)

#### (2) 年末应付债券情况(续)

注 1: 根据深圳证券交易所《关于长城证券股份有限公司 2017 年非公开发行公司债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函〔2017〕252 号), 本公司获准发行面值不超过 30 亿元的非公开发行公司债券。本公司在深圳证券交易所完成本次公司债券发行, 其中 3 年期品种发行金额为 22.2 亿元, 5 年期品种发行金额为 7.8 亿元。其中, “17 长证 01” 已到期兑付。

注 2: 根据中国证监会《关于核准长城证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2018]2105 号), 本公司获准向合格投资者公开发行面值总额不超过 10 亿元公司债券。本公司在深圳证券交易所完成本次公司债券发行, 发行金额为 10 亿元。

注 3: 根据中国证监会《关于核准长城证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2019]1118 号), 本公司获准向合格投资者公开发行面值总额不超过 40 亿元公司债券。本公司在深圳证券交易所先后发行“19 长城 03”、“19 长城 05”、“20 长城 01” 共三期公司债券, 发行总金额为 40 亿元, 各期发行金额分别为 20 亿元、10 亿元、10 亿元。其中, “19 长城 05” 已到期兑付。

注 4: 根据深圳证券交易所《关于长城证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函[2019]30 号), 本公司获准发行面值总额不超过 10 亿元的非公开发行公司债券。本公司在深圳证券交易所完成本次公司债券发行, 发行金额为 10 亿元。

注 5: 根据中国证监会《关于同意长城证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可〔2020〕1461 号), 本公司获准向专业投资者公开发行面值总额不超过 70 亿元公司债券。本公司在深圳证券交易所先后发行“20 长城 02”、“20 长城 03”、“20 长城 04”、“20 长城 05”、“20 长城 06”、“20 长城 07”、“21 长城 01” 共七期公司债券, 发行总金额为 70 亿元, 各期发行金额均为 10 亿元。其中“20 长城 02” 已到期兑付。

## 五、 合并财务报表主要项目注释(续)

## 28. 应付债券(续)

## (2) 年末应付债券情况(续)

注 6: 根据深圳证券交易所《关于长城证券股份有限公司 2019 年证券公司次级债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函[2019]684 号), 本公司获准向合格机构投资者发行面值总额不超过 20 亿元的证券公司次级债券。本公司在深圳证券交易所先后发行“20 长城 C1”、“20 长城 C2”共两期证券公司次级债券, 发行总金额为 20 亿元, 各期发行金额均为 10 亿元。

注 7: 根据深圳证券交易所《关于长城证券股份有限公司 2020 年证券公司次级债券符合深交所转让条件的无异议函》(深证函[2020]666 号), 本公司获准向专业机构投资者发行面值总额不超过 20 亿元的证券公司次级债券。本公司在深圳证券交易所先后发行“20 长城 C3”、“21 长城 C1”共两期证券公司次级债券, 发行总金额为 20 亿元, 各期发行金额均为 10 亿元。

注 8: 根据中国证监会《关于同意长城证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》(证监许可[2021]1276 号), 本公司获准向专业投资者公开发行面值总额不超过 100 亿元公司债券。本公司在深圳证券交易所先后发行“21 长城 02”、“21 长城 03”公司债券、“21 长城 04”、“21 长城 05”、“21 长城 06”、“21 长城 07”、“21 长城 08”共七期公司债券, 发行总金额为 70 亿元, 各期发行金额分别为 14 亿元、6 亿元、10 亿元、10 亿元、10 亿元、13 亿元、7 亿元。

注 9: 本集团本年存续的长期收益凭证包括浮动利率收益凭证和固定利率收益凭证, 其中固定利率收益凭证的票面利率为 4.18% 至 4.20%。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

29. 租赁负债

项目	2021年12月31日
房屋及建筑物	431,531,603.86
<b>合计</b>	<b>431,531,603.86</b>
其中：一年内到期的租赁负债	123,231,278.27

30. 其他负债

项目		2021年12月31日	2020年12月31日
其他应付款项	(1)	167,371,510.15	161,907,154.78
期货风险准备金	(2)	63,959,115.02	53,384,994.80
应付贸易款		393,860,262.88	23,019,922.22
应付股利	(3)	19,969,230.18	19,969,230.18
其他		29,905,986.80	35,668,681.45
<b>合计</b>		<b>675,066,105.03</b>	<b>293,949,983.43</b>

(1) 其他应付款项

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
押金及预提费用	52,136,717.61	48,870,326.22
风险抵押金	22,737,402.37	18,400,316.11
中国证券投资者保护基金	22,094,607.61	12,351,864.07
应付信息咨询费	-	24,241,211.25
其他	70,402,782.56	58,043,437.13
<b>合计</b>	<b>167,371,510.15</b>	<b>161,907,154.78</b>

(2) 期货风险准备金

期货风险准备金是宝城期货公司按照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%计提。

(3) 应付股利

单位名称	2021年12月31日	2020年12月31日
海南华莱实业投资有限公司	14,359,230.18	14,359,230.18
海南汇通国际信托投资公司	5,610,000.00	5,610,000.00
<b>合计</b>	<b>19,969,230.18</b>	<b>19,969,230.18</b>

31. 股本

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
股本	3,103,405,351.00	3,103,405,351.00

## 五、合并财务报表主要项目注释(续)

### 32. 资本公积

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股本溢价	9,218,119,667.34	9,218,119,667.34
其他资本公积	1,962,551.53	1,962,551.53
<b>合计</b>	<b>9,220,082,218.87</b>	<b>9,220,082,218.87</b>

### 33. 其他综合收益

项目	2020 年 12 月 31 日	本年发生额					2021 年 12 月 31 日
		本年所得税前发生额	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	减：所得税费用	税后归属于母公司	
<b>一、以后不能重分类进损益的其他综合收益</b>	<b>-42,245,220.31</b>	<b>121,282,873.26</b>	<b>-</b>	<b>32,809,910.61</b>	<b>30,320,718.32</b>	<b>58,152,244.33</b>	<b>15,907,024.02</b>
其中：其他权益工具投资公允价值变动损益	-42,245,220.31	121,282,873.26	-	32,809,910.61	30,320,718.32	58,152,244.33	15,907,024.02
<b>二、以后将重分类进损益的其他综合收益</b>	<b>-3,393,701.17</b>	<b>4,102,667.56</b>	<b>3,709,530.51</b>	<b>-</b>	<b>98,284.26</b>	<b>294,852.79</b>	<b>-3,098,848.38</b>
其中：其他债权投资公允价值变动损益	-4,551,738.18	4,312,779.29	3,573,422.98	-	184,839.08	554,517.23	-3,997,220.95
其他债权投资信用减值准备	1,158,037.01	-210,111.73	136,107.53	-	-86,554.82	-259,664.44	898,372.57
<b>其他综合收益合计</b>	<b>-45,638,921.48</b>	<b>125,385,540.82</b>	<b>3,709,530.51</b>	<b>32,809,910.61</b>	<b>30,419,002.58</b>	<b>58,447,097.12</b>	<b>12,808,175.64</b>

## 五、合并财务报表主要项目注释(续)

## 34. 盈余公积

项目	2020年12月31日	执行新租赁准则影响	本年增加额	本年减少额	2021年12月31日
法定盈余公积	696,550,426.74	-3,072,623.18	164,657,707.74	-	858,135,511.30
<b>合计</b>	<b>696,550,426.74</b>	<b>-3,072,623.18</b>	<b>164,657,707.74</b>	<b>-</b>	<b>858,135,511.30</b>

## 35. 一般风险准备

项目	2020年12月31日	执行新租赁准则影响	本年增加额	本年减少额	2021年12月31日
一般风险准备(注 1)	1,067,254,717.13	-3,072,623.18	165,046,553.63	-	1,229,228,647.58
交易风险准备(注 2)	1,066,094,062.06	-3,072,623.18	164,657,707.74	-	1,227,679,146.62
<b>合计</b>	<b>2,133,348,779.19</b>	<b>-6,145,246.36</b>	<b>329,704,261.37</b>	<b>-</b>	<b>2,456,907,794.20</b>

注 1：根据《金融企业财务规则》要求，一般风险准备金按母公司净利润之 10% 提取，以及根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》(中国证监会公告〔2018〕39 号)的规定，本公司资管业务自 2018 年 11 月起，按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。

注 2：根据《证券法》要求，交易风险准备金按母公司净利润之 10% 提取。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

36. 未分配利润

项目	2021 年度	2020 年度
上年年末余额	2,967,954,128.83	2,236,633,720.09
加：执行新租赁准则影响	-21,972,846.33	
本年年初余额	2,945,981,282.50	2,236,633,720.09
本年增加额	1,798,420,839.05	1,506,722,144.24
其中：本年净利润转入	1,765,610,928.44	1,501,641,468.72
其他综合收益转入	32,809,910.61	5,080,675.52
本年减少额	804,702,504.21	775,401,735.50
其中：本年提取盈余公积数	164,657,707.74	144,497,647.54
本年提取一般风险准备	165,046,553.63	145,031,851.81
本年提取交易风险准备	164,657,707.74	144,497,647.54
本年分配现金股利	310,340,535.10	341,374,588.61
<b>本年年末余额</b>	<b>3,939,699,617.34</b>	<b>2,967,954,128.83</b>

37. 利息净收入

项目	2021 年度	2020 年度
利息收入：		
存放金融同业利息收入	447,828,768.17	405,922,938.83
其中：自有资金存款利息收入	52,212,693.42	54,025,524.28
客户资金存款利息收入	395,616,074.75	351,897,414.55
融资融券利息收入	1,333,979,180.93	1,047,841,991.30
买入返售金融资产利息收入	20,110,079.30	46,806,341.46
其中：股票质押式回购利息收入	969,117.48	6,227,639.66
债权投资利息收入	1,742,424.84	19,421,573.14
其他债权投资利息收入	48,832,170.25	69,945,415.78
其他	127,976.18	284,123.95
<b>利息收入小计</b>	<b>1,852,620,599.67</b>	<b>1,590,222,384.46</b>
利息支出：		
短期借款利息支出	15,439,713.20	3,500,457.44
应付短期融资款利息支出	178,401,759.51	173,817,793.21
拆入资金利息支出	30,704,142.28	18,443,785.20
其中：转融通利息支出	27,801,378.43	6,093,990.81
卖出回购金融资产款利息支出	368,586,140.60	345,812,621.55
客户资金利息支出	94,232,881.08	80,020,590.38
应付债券利息支出	753,152,221.26	516,986,799.41
租赁负债利息支出	17,851,359.70	
其他	36,219,285.34	26,658,092.14
<b>利息支出小计</b>	<b>1,494,587,502.97</b>	<b>1,165,240,139.33</b>
<b>利息净收入</b>	<b>358,033,096.70</b>	<b>424,982,245.13</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

38. 手续费及佣金净收入

项目	2021 年度	2020 年度
<b>手续费及佣金收入：</b>		
经纪业务收入	1,915,442,325.78	1,608,761,391.54
其中：证券经纪业务	1,499,900,374.46	1,385,231,299.98
其中：代理买卖证券业务	1,227,963,264.49	1,174,874,129.73
交易单位席位租赁	161,468,760.57	118,763,951.38
代销金融产品业务	110,468,349.40	91,593,218.87
期货经纪业务	415,541,951.32	223,530,091.56
投资银行业务	605,400,850.23	496,111,191.19
其中：证券承销业务	443,623,023.03	340,443,796.29
证券保荐业务	26,292,452.86	18,013,207.56
财务顾问业务	135,485,374.34	137,654,187.34
资产管理业务	143,528,123.74	114,047,481.40
基金管理业务	9,815,116.62	15,158,871.44
投资咨询业务	78,438,466.28	55,782,445.76
其他	39,101.42	239,008.95
<b>手续费及佣金收入小计</b>	<b>2,752,663,984.07</b>	<b>2,290,100,390.28</b>
<b>手续费及佣金支出：</b>		
经纪业务支出	709,316,788.99	574,694,898.51
其中：证券经纪业务	504,558,457.60	466,997,301.84
其中：代理买卖证券业务	488,475,643.93	451,709,553.00
交易单位席位租赁	8,344,226.44	7,373,801.53
代销金融产品业务	7,738,587.23	7,913,947.31
期货经纪业务	204,758,331.39	107,697,596.67
投资银行业务	30,655,022.52	44,698,402.21
其中：证券承销业务	25,385,365.96	42,483,888.91
证券保荐业务	275,140.42	-
财务顾问业务	4,994,516.14	2,214,513.30
资产管理业务	3,110,404.21	8,396,323.56
基金管理业务	-	2,514,570.68
投资咨询业务	1,584,158.40	1,614,918.72
其他	11,476,866.28	19,972,902.19
<b>手续费及佣金支出小计</b>	<b>756,143,240.40</b>	<b>651,892,015.87</b>
<b>手续费及佣金净收入</b>	<b>1,996,520,743.67</b>	<b>1,638,208,374.41</b>
其中：财务顾问业务净收入	130,490,858.20	135,439,674.04
其中：并购重组财务顾问净收入—境内上市企业	2,673,432.02	13,360,763.20
并购重组财务顾问净收入—其他	751,174.91	1,390,401.68
其他财务顾问净收入	127,066,251.27	120,688,509.16

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

38. 手续费及佣金净收入(续)

(1) 代理销售金融产品

代销金融产品业务	2021 年度		2020 年度	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金产品	190,397,174,914.06	98,385,976.12	205,134,094,934.82	88,324,703.38
资产管理业务产品	243,943,275.64	768,076.31	380,317,052.08	401,590.49
其他	3,016,593,888.10	11,314,296.97	1,567,808,971.03	2,866,925.00
<b>合计</b>	<b>193,657,712,077.80</b>	<b>110,468,349.40</b>	<b>207,082,220,957.93</b>	<b>91,593,218.87</b>

(2) 受托客户资产管理业务

项目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	资产支持证券 管理业务
年末产品数量	34	61	45
年末客户数量	7,180	61	562
其中：个人客户	7,064	1	0
机构客户	116	60	562
年初受托资金	6,788,834,356.98	83,198,339,310.76	39,725,171,048.00
其中：自有资金投入	231,992,991.79	-	314,238,448.00
个人客户	2,967,417,475.72	-	-
机构客户	3,589,423,889.47	83,198,339,310.76	39,410,932,600.00
年末受托资金	6,901,995,403.72	46,035,156,384.64	28,825,828,391.92
其中：自有资金投入	171,377,853.14	-	-
个人客户	2,689,703,853.10	70,350,989.80	-
机构客户	4,040,913,697.48	45,964,805,394.84	28,825,828,391.92
年末主要受托资产初始成本	6,470,318,880.15	44,111,705,588.87	28,940,864,421.73
其中：股票	445,683,123.29	115,524,781.48	-
债券	5,214,706,302.82	9,866,343,186.10	-
基金	182,253,810.64	460,867,340.29	-
期货	264,374,984.00	-	-
信托	15,374,328.89	6,196,274,068.56	-
资产支持证券	291,492,090.82	50,000,000.00	28,940,864,421.73
专项资产管理计划	-	174,294,567.85	-
资产收益权	-	3,319,142,000.00	-
其他	56,434,239.69	23,929,259,644.59	-
当期资产管理业务净收入	49,683,729.83	86,823,969.35	3,910,020.35

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

39. 投资收益

(1) 投资收益明细情况

项目	2021 年度	2020 年度
权益法核算的长期股权投资收益	765,004,449.37	476,395,939.13
处置长期股权投资产生的投资收益	194,648.91	-3,269.67
金融工具投资收益	1,293,352,232.17	1,435,666,259.22
其中：持有期间取得的收益	988,570,584.23	962,898,304.45
-交易性金融资产	988,321,914.23	962,555,684.45
-其他权益工具投资	248,670.00	342,620.00
处置金融工具取得的收益	304,781,647.94	472,767,954.77
-交易性金融资产	458,066,975.29	472,325,973.62
-其他债权投资	3,076,467.54	469,554.51
-交易性金融负债	-9,569,802.28	-5,277,198.26
-衍生金融工具	-146,791,992.61	5,249,624.90
其他	1,980,249.60	-8,767,500.00
<b>合计</b>	<b>2,060,531,580.05</b>	<b>1,903,291,428.68</b>

(2) 对联营企业的投资收益

被投资单位	2021 年度	2020 年度
景顺长城基金管理公司	687,042,906.10	402,777,623.71
长城基金管理有限公司	77,961,543.27	73,618,315.42
<b>合计</b>	<b>765,004,449.37</b>	<b>476,395,939.13</b>

40. 其他收益

项目	2021 年度	2020 年度
政府补助	22,377,399.29	17,979,559.88
<b>合计</b>	<b>22,377,399.29</b>	<b>17,979,559.88</b>

41. 公允价值变动收益

项目	2021 年度	2020 年度
交易性金融资产	263,617,767.37	34,597,208.47
交易性金融负债	1,314,484.42	-444,237.84
衍生金融工具	-78,748,801.62	29,780,921.11
<b>合计</b>	<b>186,183,450.17</b>	<b>63,933,891.74</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

42. 其他业务收入

项目	2021 年度	2020 年度
现货贸易业务收入	3,127,195,109.15	2,817,339,897.39
其他	7,401,377.45	6,718,495.84
<b>合计</b>	<b>3,134,596,486.60</b>	<b>2,824,058,393.23</b>

43. 税金及附加

项目	2021 年度	2020 年度
城市维护建设税	17,453,775.42	14,709,187.78
教育费附加及地方教育费附加	12,710,342.31	11,205,991.29
房产税	1,762,683.85	1,279,395.40
其他	8,209,260.66	3,291,313.23
<b>合计</b>	<b>40,136,062.24</b>	<b>30,485,887.70</b>

44. 业务及管理费

项目	2021 年度	2020 年度
职工薪酬	1,819,499,713.07	1,553,572,345.27
使用权资产折旧费	126,343,024.73	
业务宣传费	101,493,567.75	73,950,511.03
折旧摊销费	94,615,173.85	89,457,365.95
电子设备运转费	70,690,899.81	52,454,209.27
席位运行费	41,902,231.94	37,843,557.47
投资者保护基金	40,132,849.98	17,588,897.59
租赁费及物业管理费	30,470,200.02	169,915,356.73
通讯费	30,245,005.66	36,299,710.55
咨询费	21,826,503.67	31,878,772.94
其他	123,468,557.75	91,155,467.59
<b>合计</b>	<b>2,500,687,728.23</b>	<b>2,154,116,194.39</b>

45. 信用减值损失

项目	2021年度	2020年度
坏账损失(转回以“-”号填列)	-19,825,750.74	4,968,921.31
融出资金减值损失(转回以“-”号填列)	-12,031,339.43	47,291,473.87
买入返售金融资产减值损失	10,752,577.81	16,109,023.73
其他债权投资减值损失(转回以“-”号填列)	-346,219.26	-238,286.51
债权投资减值损失	18,306,096.08	29,982,692.56
<b>合计</b>	<b>-3,144,635.54</b>	<b>98,113,824.96</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

46. 其他业务成本

项目	2021 年度	2020 年度
现货贸易业务成本	3,017,190,882.90	2,754,050,954.89
其他	294,787.07	53,996.98
<b>合计</b>	<b>3,017,485,669.97</b>	<b>2,754,104,951.87</b>

47. 营业外收入

项目	2021 年度	2020 年度
非流动资产报废利得	142,229.51	536,857.35
与日常经营活动无关的政府补助	-	2,500,000.00
其他	567,563.58	320,536.12
<b>合计</b>	<b>709,793.09</b>	<b>3,357,393.47</b>

48. 营业外支出

项目	2021 年度	2020 年度
违约和赔偿损失	28,600,548.01	73,928.26
公益性捐赠支出	5,344,988.00	8,369,439.13
非流动资产报废损失	111,859.92	35,907.96
其他	48,557.00	24,100.34
<b>合计</b>	<b>34,105,952.93</b>	<b>8,503,375.69</b>

49. 所得税费用

(1) 所得税费用的组成

项目	2021 年度	2020 年度
当期所得税费用	292,824,329.08	359,180,806.02
递延所得税费用	29,806,580.19	-63,050,202.90
<b>合计</b>	<b>322,630,909.27</b>	<b>296,130,603.12</b>

(2) 所得税费用与会计利润的关系

项目	2021 年度	2020 年度
利润总额	2,168,235,103.82	1,826,730,622.02
按法定税率计算的所得税费用	542,058,775.95	456,682,655.50
非应税收入的影响	-223,333,502.07	-136,851,228.22
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	6,906,373.78	-4,034,396.86
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-	-281,576.90
本年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	1,722,811.44	174.72
其他	-4,723,549.83	-19,385,025.12
<b>所得税费用</b>	<b>322,630,909.27</b>	<b>296,130,603.12</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

50. 每股收益

(1) 计算基本每股收益时，归属于母公司普通股股东的损益为：

项目	本年金额
归属于公司普通股股东的净利润	1,765,610,928.44
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	1,761,903,298.90

(2) 计算基本每股收益时，当期发行在外普通股加权平均数为：

单位：股

项目	本年金额
年初发行在外的普通股加权平均数	3,103,405,351.00
年末发行在外的普通股加权平均数	3,103,405,351.00

(3) 每股收益

报告期利润	基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	0.57	0.57
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	0.57	0.57

因本公司不存在稀释性潜在普通股，故本公司稀释每股收益等于基本每股收益。

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

51. 合并现金流量情况

(1) 现金流量表补充资料

项目	2021 年度	2020 年度
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量:</b>		
净利润	1,845,604,194.55	1,530,600,018.90
加: 信用减值损失(转回以“-”号填列)	-3,144,635.54	98,113,824.96
固定资产折旧	38,480,727.62	38,326,493.74
使用权资产折旧	126,343,024.73	
无形资产摊销	32,520,208.55	28,556,378.44
长期待摊费用摊销	23,614,237.68	22,574,493.77
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	-30,369.59	-500,949.39
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-211,249,280.17	-19,640,081.74
利息支出	964,845,053.67	694,305,050.06
汇兑损失	1,446,667.92	3,756,429.91
投资损失(收益以“-”号填列)	-816,022,363.37	-566,099,794.71
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	44,705,948.99	-70,689,853.82
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	-14,899,368.80	7,639,650.92
交易性金融资产的减少(增加以“-”号填列)	-9,405,277,360.44	-457,542,909.93
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-272,576,958.66	-9,103,806,935.88
经营性应付项目的增加	6,416,354,863.77	3,028,396,264.48
经营活动产生的现金流量净额	-1,229,285,409.09	-4,766,011,920.29
<b>2. 现金及现金等价物净变动情况:</b>		
现金的年末余额	24,904,301,765.86	19,243,080,809.05
减: 现金的年初余额	19,243,080,809.05	15,248,554,822.49
现金及现金等价物净增加额	5,661,220,956.81	3,994,525,986.56

(2) 现金及现金等价物

项目	2021 年度	2020 年度
<b>一、现金</b>	<b>24,904,301,765.86</b>	<b>19,243,080,809.05</b>
其中: 库存现金	19,783.84	41,044.76
可随时用于支付的银行存款	19,788,712,600.71	15,482,482,405.05
可随时用于支付的其他货币资金	1,018,596.91	808,777.51
可随时用于支付的结算备付金	5,114,550,784.40	3,759,748,581.73
<b>二、年末现金及现金等价物余额</b>	<b>24,904,301,765.86</b>	<b>19,243,080,809.05</b>

(3) 收到其他与经营活动有关的现金

项目	2021 年度	2020 年度
大宗商品交易款项	9,407,648,518.61	3,205,821,189.98
政府补助	22,377,399.29	20,479,559.88
收到的其他款项及往来款	674,659,999.58	119,860,375.98
<b>合计</b>	<b>10,104,685,917.48</b>	<b>3,346,161,125.84</b>

五、 合并财务报表主要项目注释(续)

51. 合并现金流量情况(续)

(4) 支付其他与经营活动有关的现金

项目	2021 年度	2020 年度
大宗商品交易款项	9,347,845,566.81	3,620,612,457.12
存出保证金增加额	876,997,827.44	606,857,173.95
支付的业务及管理费	478,689,658.06	528,478,346.62
支付的其他款项及往来款	833,207,328.93	161,824,318.02
<b>合计</b>	<b>11,536,740,381.24</b>	<b>4,917,772,295.71</b>

52. 外币货币性项目

项目	年末外币余额	折算汇率	年末折算人民币余额
货币资金			154,105,018.32
其中：美元	13,207,801.92	6.3757	84,208,982.72
港币	85,489,280.34	0.8176	69,896,035.60
结算备付金			32,581,526.47
其中：美元	3,890,512.37	6.3757	24,804,739.72
港币	9,511,725.48	0.8176	7,776,786.75
存出保证金			2,947,839.00
其中：美元	270,000.00	6.3757	1,721,439.00
港币	1,500,000.00	0.8176	1,226,400.00
代理买卖证券款			133,494,071.02
其中：美元	12,687,155.04	6.3757	80,889,494.39
港币	64,340,235.62	0.8176	52,604,576.63

六、 合并范围的变更

1. 非同一控制下企业合并

本公司本年度无非同一控制下企业合并变更情况。

2. 同一控制下企业合并

本公司本年度无同一控制下企业合并变更情况。

## 六、 合并范围的变更(续)

### 3. 其他原因的合并范围变动

#### (1) 清算子公司导致的合并范围变动

本年度,本集团之子公司深圳市长城长富投资管理有限公司清算其子公司南京长茂宏懿投资管理有限公司, 本年末不再纳入合并范围。

#### (2) 本年度新增纳入合并范围的结构化主体

本年度,本集团作为 27 个新增资产管理计划的主要投资人,能够对其实施控制,故本年将其纳入合并范围。

#### (3) 本年度不再纳入合并范围的结构化主体

本年度,本集团控制的 7 个资产管理计划由于赎回份额或清算,本年末不再将其纳入合并范围。

## 七、 在其他主体中的权益

### 1. 子公司情况

#### (1) 通过设立或投资等方式取得的子公司

单位:人民币万元

子公司全称	主要经营地	注册地	业务性质	注册资本	持股比例 (%)	表决权比例 (%)	是否合并报表
华能宝城物华有限公司 (注 1)	上海市	上海市	投资及贸易	50,000.00	51.00	51.00	是
深圳市长城证券投资 有限公司	广东省深圳市	广东省深圳市	另类投资	100,000.00	100.00	100.00	是
深圳市长城长富投资管理 有限公司	广东省深圳市	广东省深圳市	资本投资服务	60,000.00	100.00	100.00	是
北京长城弘瑞投资管理 有限公司(注 2)	北京市	北京市	股权投资与管理	1,000.00	100.00	100.00	是
深圳长城富浩私募股权 基金管理有限公司(注 2)	广东省深圳市	广东省深圳市	股权投资与管理	5,000.00	90.00	90.00	是
青岛长城高创创业投资 管理有限公司(注 2)	山东省青岛市	山东省青岛市	股权投资与管理	500.00	80.00	80.00	是

注 1: 宝城期货有限责任公司的下属子公司。

注 2: 深圳市长城长富投资管理有限公司的下属子公司。

#### (2) 非同一控制下企业合并取得的子公司

子公司全称	主要经营地	注册地	业务性质	注册资本	持股比例 (%)	表决权比例 (%)	是否合并报表
宝城期货有限责任公司	浙江省杭州市	浙江省杭州市	金融期货 类	60,000.00	80.00	80.00	是

七、 在其他主体中的权益(续)

2. 在子公司中的权益

(1) 重要非全资子公司

子公司名称	少数股东持股比例(%)	本年归属于少数股东的损益	本年向少数股东支付的股利	年末少数股东权益余额
宝城期货有限责任公司	20.00	79,914,050.62	7,511,237.71	515,013,909.30

(2) 重要的非全资子公司主要财务信息

子公司名称	年末余额	
	资产合计	负债合计
宝城期货有限责任公司	9,025,186,567.80	7,737,715,193.79

子公司名称	2021 年度发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
宝城期货有限责任公司	3,488,143,717.17	185,330,251.73	185,330,251.73	2,460,709,030.29

3. 在合并的结构化主体中的权益

于 2021 年 12 月 31 日，本集团纳入合并财务报表范围的结构化主体合计 64 个(2020 年 12 月 31 日：44 个)，纳入合并范围的结构化主体净资产为人民币 5,472,815,968.61 元(2020 年 12 月 31 日：3,078,798,352.22 元)。

4. 在联营/合营企业中的权益

(1) 重要的联营/合营企业

联营企业名称	主要经营地/注册地	业务性质	持股比例(%)		对联营/合营企业投资的会计处理方法
			直接	间接	
景顺长城基金管理有限公司	广东省深圳市	基金管理	49.00	-	权益法核算
长城基金管理有限公司	广东省深圳市	基金管理	47.059	-	权益法核算

## 七、 在其他主体中的权益(续)

## 4. 在联营/合营企业中的权益(续)

## (2) 重要联营/合营企业的主要财务信息

项目	2021 年 12 月 31 日/2021 年度		2020 年 12 月 31 日/2020 年度	
	景顺长城基金管理有限公司	长城基金管理有限公司	景顺长城基金管理有限公司	长城基金管理有限公司
资产合计	5,175,827,650.00	2,253,224,737.14	3,307,087,738.00	1,959,580,370.62
负债合计	2,059,511,705.00	595,365,369.24	1,052,384,310.00	412,569,746.53
少数股东权益	-	54,738,947.48	-	56,205,686.47
归属于母公司的股东权益	3,116,315,945.00	1,603,120,420.42	2,254,703,428.00	1,490,804,937.62
按持股比例计算的净资产份额	1,526,994,813.05	754,412,438.64	1,104,804,679.72	701,557,895.59
调整事项	5,308,504.65	11,507,131.99	5,316,630.17	9,812,750.80
对联营企业权益投资的账面价值	1,532,303,317.70	765,919,570.63	1,110,121,309.89	711,370,646.39
存在公开报价的权益投资的公允价值	不适用	不适用	不适用	不适用
营业收入	4,520,264,470.00	1,037,765,890.19	2,657,897,448.00	891,402,801.12
净利润	1,402,144,962.00	165,000,372.69	821,538,824.00	158,670,723.93
归属于母公司的净利润	1,402,144,962.00	162,067,111.68	821,538,824.00	155,413,851.49
其他综合收益	-	-	-	-682,104.91
综合收益总额	1,402,144,962.00	165,000,372.69	821,538,824.00	157,988,619.02
企业本年收到的来自联营企业的股利	263,969,960.00	23,412,619.03	206,180,524.00	17,548,113.93

## 5. 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本集团作为结构化主体的管理人，对结构化主体拥有管理权，这些主体包括资产管理计划及有限合伙企业。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，其募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及业绩报酬。

本年末，由本集团发起设立并持有财务权益的未纳入合并财务报表合并范围的结构化主体的净资产为人民币 1,527,762,903.83 元(2020 年 12 月 31 日：1,972,710,694.09 元)，其中，本集团享有的权益在本集团资产负债表中的相关资产项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项目	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	账面价值	最大风险敞口	账面价值	最大风险敞口
交易性金融资产	146,610,325.74	146,610,325.74	196,411,714.07	196,411,714.07

本集团在上述结构化主体中的投资管理而获得的收入请参见附注五、38。

## 八、 关联方关系及其交易

### 1. 关联方认定标准

根据《企业会计准则第 36 号——关联方披露》，一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的，构成关联方。

根据《上市公司信息披露管理办法》(中国证监会令第 40 号)及《深圳证券交易所股票上市规则》(2020 年修订)，将特定情形的关联法人和关联自然人也认定为关联方。

### 2. 关联方关系

#### (1) 母公司及最终控制方情况

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本公司的持股比例(%)	母公司对本公司的表决权比例(%)
华能资本服务有限公司	北京市	实业投资及资产管理、资产受托管理；投资策划；信息咨询服务	980,000 万	46.38	46.38

本公司的最终控制方为中国华能集团有限公司。

八、 关联方关系及其交易(续)

2. 关联方关系(续)

(2) 本公司的下属企业有关信息

本公司的子公司情况详见附注七、1 “子公司情况”。

(3) 本公司的联营企业情况

本公司的联营企业情况详见附注五、12 “长期股权投资”。

(4) 与本集团发生交易的其他关联方情况

其他关联方名称	其他关联方与本公司关系
华能贵诚信托有限公司	受控股股东控制的公司
华能天成融资租赁有限公司	受控股股东控制的公司
华能投资管理有限公司	受控股股东控制的公司
天津华人投资管理有限公司	受控股股东控制的公司
天津源融投资管理有限公司	受控股股东控制的公司
永诚财产保险股份有限公司	受控股股东控制的公司
华能云成商业保理(天津)有限公司	受控股股东控制的公司
中国华能财务有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力开发公司	受同一最终控制方控制的公司
北方联合电力有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能综合产业有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能澜沧江水电股份有限公司	受同一最终控制方控制的公司
上海华能电子商务有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能武汉发电有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
华能吉林发电有限公司九台电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能淮阴第二发电有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能湖南岳阳发电有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
中国华能集团燃料有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司井冈山电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司大连电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司上海石洞口第一电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能巢湖发电有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
华能太仓港务有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
上海华永投资发展有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能河南中原燃气发电有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司福州电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司丹东电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司德州电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司玉环电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司长兴电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能国际电力股份有限公司营口电厂	受同一最终控制方控制的公司
云南滇东雨汪能源有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能云南滇东能源有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司

八、 关联方关系及其交易(续)

2. 关联方关系(续)

(4) 与本集团发生交易的其他关联方情况(续)

其他关联方名称	其他关联方与本公司关系
华能罗源发电有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
华能海南发电股份有限公司海口电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能莱芜发电有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能山东发电有限公司八角发电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能广东燃料有限公司	受同一最终控制方控制的公司
上海瑞宁航运有限公司	受同一最终控制方控制的公司
江苏华能智慧能源供应链科技有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能秦煤瑞金发电有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
上海华能电子商务有限公司北方分公司	受同一最终控制方控制的公司
华能供应链平台科技有限公司	受同一最终控制方控制的公司
北京聚鸿物业管理有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能招标有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能吉林发电有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能新能源股份有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能吉林发电有限公司长春热电厂	受同一最终控制方控制的公司
华能曹妃甸港口有限公司	受同一最终控制方控制的公司
山东新能泰山发电股份有限公司	受同一最终控制方控制的公司
华能荆门热电有限责任公司	受同一最终控制方控制的公司
中国华能集团香港财资管理有限公司	受同一最终控制方控制的公司
深圳能源燃气投资控股有限公司	本公司持股 5% 以上股东控制的公司
深能水电投资管理有限公司	本公司持股 5% 以上股东控制的公司
深圳市能源电力服务有限公司	本公司持股 5% 以上股东控制的公司
深圳新江南投资有限公司	持股 5% 以上股东
深圳能源集团股份有限公司	持股 5% 以上股东
招商证券股份有限公司	本公司董事担任该公司董事
博时基金管理有限公司	本公司董事担任该公司董事
招商银行股份有限公司	本公司董事担任该公司董事
华夏银行股份有限公司	本公司独立董事曾担任该公司独立董事
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	本公司董事曾担任该公司董事(自 2020 年 8 月起解除关联关系)
兴银基金管理有限责任公司	本公司独立董事曾担任该公司独立董事(自 2020 年 6 月起解除关联关系)
上海时代航运有限公司	本公司控股股东高管担任该公司董事
晋商银行股份有限公司	本公司控股股东高管担任该公司董事
华西证券股份有限公司	本公司控股股东前高管担任该公司董事
华夏盛世基金管理有限公司	本公司控股股东高管担任该公司董事
长城嘉信资产管理有限公司	本公司联营企业长城基金控制的公司
四川长虹电子控股集团有限公司	本公司前监事担任该公司高管(自 2021 年 11 月起解除关联关系)
关联自然人	本公司关联自然人

## 八、 关联方关系及其交易(续)

### 3. 关联交易

#### (1) 向关联方提供代理买卖证券服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
华能天成融资租赁有限公司	代理买卖证券业务收入	2,133,962.26	2,218,975.47
华能资本服务有限公司	代理买卖证券业务收入	569,492.23	185,837.15
华能澜沧江水电股份有限公司	代理买卖证券业务收入	44,640.76	34,024.16
中国华能财务有限责任公司	代理买卖证券业务收入	32,951.43	70,897.81
晋商银行股份有限公司	代理买卖证券业务收入	2,068.44	-
华能综合产业有限公司	代理买卖证券业务收入	387.93	-
华能贵诚信托有限公司	代理买卖证券业务收入	-	167,431.55
华能投资管理有限公司	代理买卖证券业务收入	-	3,069.15
天津华人投资管理有限公司	代理买卖证券业务收入	-	19,452.58
天津源融投资管理有限公司	代理买卖证券业务收入	-	22,123.31
四川长虹电子控股集团有限公司	代理买卖证券业务收入	-	42,689.23
<b>合计</b>		<b>2,783,503.05</b>	<b>2,764,500.41</b>

#### (2) 向关联方支付客户资金存款利息

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
深圳能源集团股份有限公司	客户资金存款利息支出	591,567.89	334,290.37
华能天成融资租赁有限公司	客户资金存款利息支出	207,424.69	358,574.67
中国华能集团有限公司	客户资金存款利息支出	48,109.29	71,620.16
华能资本服务有限公司	客户资金存款利息支出	21,603.56	12,470.50
华能国际电力开发公司	客户资金存款利息支出	5,056.38	5,094.14
中国华能财务有限责任公司	客户资金存款利息支出	4,032.37	168,062.67
华能澜沧江水电股份有限公司	客户资金存款利息支出	1,825.88	6,684.27
晋商银行股份有限公司	客户资金存款利息支出	1,481.57	668,292.40
长城基金管理有限公司	客户资金存款利息支出	872.27	826.49
华能综合产业有限公司	客户资金存款利息支出	857.51	27.33
长城嘉信资产管理有限公司	客户资金存款利息支出	433.43	-
天津源融投资管理有限公司	客户资金存款利息支出	348.10	1,099.38
华能吉林发电有限公司	客户资金存款利息支出	347.49	-
深圳新江南投资有限公司	客户资金存款利息支出	217.01	215.05
四川长虹电子控股集团有限公司	客户资金存款利息支出	3.24	841.14
华能投资管理有限公司	客户资金存款利息支出	0.49	5,679.51
北方联合电力有限责任公司	客户资金存款利息支出	0.36	0.36
天津华人投资管理有限公司	客户资金存款利息支出	0.08	1,490.90
华能国际电力股份有限公司	客户资金存款利息支出	0.01	0.56
华能贵诚信托有限公司	客户资金存款利息支出	-	9,939.63
华夏盛世基金管理有限公司	客户资金存款利息支出	-	2.80
<b>合计</b>		<b>884,181.62</b>	<b>1,645,212.33</b>

八、 关联方关系及其交易(续)

3. 关联交易(续)

(3) 向关联方提供资产管理服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
晋商银行股份有限公司	资产管理业务收入	3,222,946.52	1,953,260.89
华能资本服务有限公司	资产管理业务收入	1,875,297.06	1,499,264.72
华能国际电力开发公司	资产管理业务收入	14,004.64	944,420.98
关联自然人	资产管理业务收入	9,103.75	-
华能天成融资租赁有限公司	资产管理业务收入	-	465.25
长城嘉信资产管理有限公司	资产管理业务收入	-	383,647.79
<b>合计</b>		<b>5,121,351.97</b>	<b>4,781,059.63</b>

(4) 存放于关联方的资金余额及产生的利息收入

a. 存放于关联方资金余额

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
招商银行股份有限公司	银行存款	97,694,534.81	34,050,706.52
华夏银行股份有限公司	银行存款	1,669,009.52	571,361.65
<b>合计</b>		<b>99,363,544.33</b>	<b>34,622,068.17</b>

b. 存放于关联方的资金产生的利息收入

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
招商银行股份有限公司	资金存放利息收入	4,452,488.18	1,954,981.39
中国华能财务有限责任公司	资金存放利息收入	42,126.46	32,309.47
华夏银行股份有限公司	资金存放利息收入	5,556.09	2,612.53
<b>合计</b>		<b>4,500,170.73</b>	<b>1,989,903.39</b>

(5) 向关联方出租证券交易席位

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
长城基金管理有限公司	交易单元席位租赁收入	31,971,513.16	23,358,106.72
景顺长城基金管理有限公司	交易单元席位租赁收入	16,876,564.35	10,061,710.42
博时基金管理有限公司	交易单元席位租赁收入	6,342,484.45	221,861.19
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	交易单元席位租赁收入		395,219.32
<b>合计</b>		<b>55,190,561.96</b>	<b>34,036,897.65</b>

八、 关联方关系及其交易(续)

3. 关联交易(续)

(6) 代销关联方的基金产品

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
景顺长城基金管理有限公司	代销基金产品业务收入	19,748,334.06	7,591,277.87
长城基金管理有限公司	代销基金产品业务收入	10,025,010.65	12,253,941.08
博时基金管理有限公司	代销基金产品业务收入	117,806.35	120,628.56
兴银基金管理有限责任公司	代销基金产品业务收入		43,033.32
摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	代销基金产品业务收入		3,232.46
<b>合计</b>		<b>29,891,151.06</b>	<b>20,012,113.29</b>

(7) 向关联方提供财务顾问服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
华能投资管理有限公司	财务顾问服务收入	4,056,603.77	-
深圳能源燃气投资控股有限公司	财务顾问服务收入	144,339.62	418,867.92
华能河南中原燃气发电有限公司	财务顾问服务收入	-	566,037.74
深能水电投资管理有限公司	财务顾问服务收入	-	382,075.47
<b>合计</b>		<b>4,200,943.39</b>	<b>1,366,981.13</b>

(8) 向关联方提供证券承销服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
华能资本服务有限公司	证券承销服务收入	529,245.28	-
深圳能源集团股份有限公司	证券承销服务收入	113,207.54	150,943.40
华能贵诚信托有限公司	证券承销服务收入	28,301.89	-
华能新能源股份有限公司	证券承销服务收入	23,584.91	-
招商证券股份有限公司	证券承销服务收入	-	9,433,962.26
中国华能集团有限公司	证券承销服务收入	-	3,537,735.85
华西证券股份有限公司	证券承销服务收入	-	2,830,188.68
华能澜沧江水电股份有限公司	证券承销服务收入	-	679,245.28
<b>合计</b>		<b>694,339.62</b>	<b>16,632,075.47</b>

(9) 持有关联方非公开发行的债券或管理的产品

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
长城基金管理有限公司	基金产品	89,673,004.92	-
长城基金管理有限公司	资管计划	78,765,383.14	76,608,447.23
天津源融投资管理有限公司	基金产品	57,450,000.00	50,500,000.00
华能贵诚信托有限公司	信托计划	-	84,898,169.86
<b>合计</b>		<b>225,888,388.06</b>	<b>212,006,617.09</b>

## 八、 关联方关系及其交易(续)

### 3. 关联交易(续)

#### (10)与关联方发生的现券买卖及回购交易等

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
博时基金管理有限公司	回购	32,666,563,000.00	-
华西证券股份有限公司	现券买卖	8,845,800,890.00	3,576,426,105.91
招商银行股份有限公司	回购	5,973,920,000.00	3,246,200,000.00
招商银行股份有限公司	现券买卖	3,656,782,050.00	1,390,923,422.55
华夏银行股份有限公司	回购	3,220,000,000.00	1,100,000,000.00
招商证券股份有限公司	现券买卖	1,105,673,500.00	2,223,515,111.13
招商证券股份有限公司	回购	955,700,000.00	-
华夏银行股份有限公司	现券买卖	339,827,450.00	142,059,284.50
博时基金管理有限公司	现券买卖	209,467,800.00	-
晋商银行股份有限公司	现券买卖	-	106,561,114.66
<b>合计</b>		<b>56,973,734,690.00</b>	<b>11,785,685,038.75</b>

#### (11)向关联方提供证券咨询服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
华能贵诚信托有限公司	投资咨询服务收入	-	2,593,605.86
华能资本服务有限公司	投资咨询服务收入	-	355,052.58
<b>合计</b>		<b>-</b>	<b>2,948,658.44</b>

#### (12)与关联方发生的大宗商品交易

关联方名称	项目	2021 年	2020 年
中国华能集团燃料有限公司	大宗商品交易收入	485,182,867.42	76,566,766.37
华能供应链平台科技有限公司	大宗商品交易收入	322,826,262.89	108,246,625.56
华能巢湖发电有限责任公司	大宗商品交易收入	168,820,720.42	31,208,853.08
山东新能泰山发电股份有限公司	大宗商品交易收入	158,425,590.23	-
江苏华能智慧能源供应链科技有限公司	大宗商品交易收入	149,738,878.39	101,489,490.21
华能武汉发电有限责任公司	大宗商品交易收入	77,691,525.52	18,422,281.91
华能淮阴第二发电有限公司	大宗商品交易收入	51,583,958.54	100,865,778.51
华能吉林发电有限公司九台电厂	大宗商品交易收入	25,148,770.79	53,328,874.52
华能国际电力股份有限公司井冈山电厂	大宗商品交易收入	10,430,932.68	18,535,886.27
华能湖南岳阳发电有限责任公司	大宗商品交易收入	9,765,623.58	112,051,359.77
华能曹妃甸港口有限公司	大宗商品交易收入	5,782,621.10	-
华能吉林发电有限公司长春热电厂	大宗商品交易收入	2,505,595.73	-
华能云南滇东能源有限责任公司	大宗商品交易收入	2,132,680.41	4,864,738.06
华能荆门热电有限责任公司	大宗商品交易收入	690,972.42	-
华能秦煤瑞金发电有限责任公司	大宗商品交易收入	79,691.17	31,116,230.08
华能国际电力股份有限公司大连电厂	大宗商品交易收入	-	27,210,159.27
华能国际电力股份有限公司上海石洞口第一电厂	大宗商品交易收入	-	16,280,898.31
上海华能电子商务有限公司	大宗商品交易收入	-	12,176,334.13
华能国际电力股份有限公司福州电厂	大宗商品交易收入	-	88,266,414.25
华能国际电力股份有限公司丹东电厂	大宗商品交易收入	-	14,280,204.40
华能国际电力股份有限公司德州电厂	大宗商品交易收入	-	10,525,298.14
华能国际电力股份有限公司玉环电厂	大宗商品交易收入	-	55,511,755.75
华能国际电力股份有限公司长兴电厂	大宗商品交易收入	-	19,116,117.69
华能国际电力股份有限公司营口电厂	大宗商品交易收入	-	25,977,678.24

八、 关联方关系及其交易(续)

3. 关联交易(续)

(12)与关联方发生的大宗商品交易(续)

关联方名称	项目	2021 年	2020 年
云南滇东雨汪能源有限公司	大宗商品交易收入	-	4,522,275.86
华能罗源发电有限责任公司	大宗商品交易收入	-	59,328,415.06
华能海南发电股份有限公司海口电厂	大宗商品交易收入	-	27,068,467.34
华能莱芜发电有限公司	大宗商品交易收入	-	4,898,786.35
华能山东发电有限公司八角发电厂	大宗商品交易收入	-	18,981,852.76
华能广东燃料有限公司	大宗商品交易收入	-	6,509,828.50
上海瑞宁航运有限公司	大宗商品交易收入	-	19,697,559.49
上海华能电子商务有限公司北方分公司	大宗商品交易收入	-	9,627,864.40
<b>合计</b>		<b>1,470,806,691.29</b>	<b>1,076,676,794.28</b>
江苏华能智慧能源供应链科技有限公司	大宗商品交易支出	121,755,338.63	196,092,458.67
上海华能电子商务有限公司	大宗商品交易支出	83,764,216.28	25,656,664.89
华能曹妃甸港口有限公司	大宗商品交易支出	3,210,490.57	-
华能太仓港务有限责任公司	大宗商品交易支出	1,167,554.26	126,272.83
上海瑞宁航运有限公司	大宗商品交易支出	-	6,902,721.45
上海时代航运有限公司	大宗商品交易支出	-	439,257.80
永诚财产保险股份有限公司	大宗商品交易支出	-	14,361.25
<b>合计</b>		<b>209,897,599.74</b>	<b>229,231,736.89</b>

(13)向关联方购买产品服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
深圳能源集团股份有限公司	业务及管理费	55,102,320.36	53,911,459.52
上海华永投资发展有限公司	业务及管理费	16,576,228.70	17,277,159.49
北京聚鸿物业管理有限公司	业务及管理费	7,603,502.08	-
永诚财产保险股份有限公司	业务及管理费	2,650,357.07	2,986,888.89
长城嘉信资产管理有限公司	手续费及佣金支出	105,975.32	214,429.34
深圳市能源电力服务有限公司	业务及管理费	-	4,334,086.34
<b>合计</b>		<b>82,038,383.53</b>	<b>78,724,023.58</b>

(14)向关联方融资利息支出

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
招商银行股份有限公司	利息支出	23,222,375.19	8,531,178.08
中国华能财务有限责任公司	利息支出	4,212,879.30	1,947,833.34
华能云成商业保理(天津)有限公司	利息支出	-	192,328.75
<b>合计</b>		<b>27,435,254.49</b>	<b>10,671,340.17</b>

八、 关联方关系及其交易(续)

3. 关联交易(续)

(15)关联方往来余额

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
长城基金管理有限公司	应收款项	14,392,775.41	5,775,013.17
博时基金管理有限公司	应收款项	7,983,198.18	6,273,195.96
景顺长城基金管理有限公司	应收款项	7,546,383.73	3,179,912.05
中国华能集团香港财资管理有限公司	应收款项	960,000.00	-
深圳能源燃气投资控股有限公司	应收款项	-	8,660.38
<b>合计</b>		<b>30,882,357.32</b>	<b>15,236,781.56</b>
深圳能源集团股份有限公司	其他应收款	14,113,279.65	14,113,279.65
北京聚鸿物业管理有限公司	其他应收款	3,400.00	2,300.00
华能招标有限公司	其他应收款	-	90,000.00
<b>合计</b>		<b>14,116,679.65</b>	<b>14,205,579.65</b>
华夏银行股份有限公司	应付款项	2,100,000.00	-
<b>合计</b>		<b>2,100,000.00</b>	-
北京聚鸿物业管理有限公司	其他应付款	619,958.42	-
<b>合计</b>		<b>619,958.42</b>	-
中国华能财务有限责任公司	短期借款	200,198,611.14	-
招商银行股份有限公司	应付短期融资款	-	608,087,671.22
<b>合计</b>		<b>200,198,611.14</b>	<b>608,087,671.22</b>
深圳能源集团股份有限公司	租赁负债	159,584,690.40	-
上海华永投资发展有限公司	租赁负债	36,504,922.18	-
<b>合计</b>		<b>196,089,612.58</b>	-

(16)关联方认购公司非公开发行的公司债券

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
招商银行股份有限公司	认购公司债	300,000,000.00	-
<b>合计</b>		<b>300,000,000.00</b>	-

## 八、 关联方关系及其交易(续)

### 3. 关联交易(续)

#### (17)关联方向本公司提供承销服务

关联方名称	业务内容	2021 年	2020 年
招商银行股份有限公司	债券承销	1,973,490.57	465,188.68
华西证券股份有限公司	债券承销	-	1,768,867.93
<b>合计</b>		<b>1,973,490.57</b>	<b>2,234,056.61</b>

#### (18)关键管理人员报酬

项目	2021 年	2020 年
关键管理人员报酬	29,114,395.96	27,866,146.97

## 九、 股份支付

截至 2021 年 12 月 31 日止，本集团不存在股份支付事项。

## 十、 承诺事项及或有事项

### 4. 重要承诺事项

#### (1) 资本承诺

项目	2021 年 12 月 31 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	31,995,263.18	20,705,730.75

### 5. 或有事项

本集团开展业务过程中存在因诉讼、仲裁或监管调查而导致经济利益流出本集团的风险。本集团依据企业会计准则评估后认为上述风险发生的可能性较低。于资产负债表日，本集团不存在对合并财务状况具有重大影响的未决或有事项。

## 十一、资产负债表日后事项

### 1. 重大债权筹资

本公司于 2022 年 1 月 10 日公开发行 2022 年公司债券（第一期），本期债券分为两个产品，其中产品一发行规模为人民币 10 亿元，票面利率为 3.00%，期限为 3 年；产品二发行规模为人民币 10 亿元，票面利率为 3.40%，期限为 5 年。

本公司于 2022 年 1 月 13 日公开发行 2022 年度第一期短期融资券，发行规模为人民币 10 亿元，票面利率为 2.65%，期限为 9 个月。

本公司于 2022 年 2 月 17 日公开发行 2022 年公司债券（第二期），发行规模为人民币 10 亿元，票面利率为 3.38%，期限为 5 年。

### 2. 非公开发行股票

2022 年 3 月 28 日，中国证监会发行审核委员会审核通过本公司非公开发行股票的申请。截至 2022 年 4 月 8 日，本公司尚未收到中国证监会关于本次非公开发行股票的书面核准文件。

### 3. 利润分配

本公司于 2022 年 4 月 8 日经第二届董事会第十四次会议审议通过 2021 年度利润分配预案，以本公司截至 2021 年 12 月 31 日总股份 3,103,405,351 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利人民币 1.5 元(含税)，共分配利润人民币 465,510,802.65 元。上述股利分配预案尚待股东大会审议。

## 十二、公允价值的披露

### 1. 金融工具项目计量基础

#### (1) 金融资产计量基础分类表

2021 年 12 月 31 日账面价值				
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益
		分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	19,789,750,981.46	-	-	-
结算备付金	5,114,550,784.40	-	-	-
融出资金	23,614,329,242.76	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	1,190,017.61
存出保证金	3,091,822,150.55	-	-	-
应收款项	360,468,282.94	-	-	-
买入返售金融资产	1,852,474,205.94	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	33,611,273,075.74
债权投资	29,250,000.00	-	-	-
其他债权投资	-	704,504,669.39	-	-
其他权益工具投资	-	-	191,679,684.61	-
其他金融资产	1,109,752,112.57	-	-	-
<b>合计</b>	<b>54,962,397,760.62</b>	<b>704,504,669.39</b>	<b>191,679,684.61</b>	<b>33,612,463,093.35</b>

2020 年 12 月 31 日账面价值				
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益
		分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	15,483,332,227.32	-	-	-
结算备付金	3,759,748,581.73	-	-	-
融出资金	18,905,975,788.68	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	25,945,842.03
存出保证金	2,214,824,323.11	-	-	-
应收款项	729,317,081.32	-	-	-
买入返售金融资产	2,623,354,700.54	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	23,904,133,746.43
债权投资	98,846,263.53	-	-	-
其他债权投资	-	1,088,108,127.40	-	-
其他权益工具投资	-	-	172,050,208.23	-
其他金融资产	795,409,447.35	-	-	-
<b>合计</b>	<b>44,610,808,413.58</b>	<b>1,088,108,127.40</b>	<b>172,050,208.23</b>	<b>23,930,079,588.46</b>

十二、公允价值的披露(续)

1. 金融工具项目计量基础(续)

(2) 金融负债计量基础分类表

2021 年 12 月 31 日账面价值		
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益 分类为以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债
短期借款	319,468,002.74	-
应付短期融资款	6,041,275,705.47	-
拆入资金	1,281,897,777.08	-
衍生金融负债	-	84,813,877.97
卖出回购金融资产款	14,203,807,051.69	-
代理买卖证券款	23,053,222,073.70	-
代理承销证券款	708,932,079.64	-
应付款项	408,962,131.89	-
应付债券	23,688,980,678.90	-
租赁负债	431,531,603.86	-
其他金融负债	590,735,559.44	-
<b>合计</b>	<b>70,728,812,664.41</b>	<b>84,813,877.97</b>

2020 年 12 月 31 日账面价值		
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益 分类为以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债
短期借款	119,040,434.93	-
应付短期融资款	5,455,441,936.79	-
拆入资金	500,320,833.33	-
交易性金融负债	-	39,659,600.00
衍生金融负债	-	48,304,970.07
卖出回购金融资产款	9,683,598,590.65	-
代理买卖证券款	18,770,614,211.99	-
应付款项	345,991,243.52	-
应付债券	16,968,472,593.49	-
其他金融负债	220,336,801.04	-
<b>合计</b>	<b>52,063,816,645.74</b>	<b>87,964,570.07</b>

十二、公允价值的披露(续)

2. 以公允价值计量的资产和负债的公允价值

项目	2021 年 12 月 31 日			
	第一层次 公允价值计量	第二层次 公允价值计量	第三层次 公允价值计量	合计
	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
<b>(一)交易性金融资产</b>	<b>8,363,570,273.43</b>	<b>24,653,688,632.64</b>	<b>594,014,169.67</b>	<b>33,611,273,075.74</b>
- 债券	6,262,362,183.00	13,388,834,398.99	22,604,824.62	19,673,801,406.61
- 股票	1,139,297,609.81	87,355,263.74	154,184,157.18	1,380,837,030.73
- 基金	961,910,480.62	6,752,192,430.70	-	7,714,102,911.32
- 其他	-	4,425,306,539.21	417,225,187.87	4,842,531,727.08
<b>(二)其他债权投资</b>	<b>89,689,795.61</b>	<b>614,814,873.78</b>	-	<b>704,504,669.39</b>
- 债券	89,689,795.61	614,814,873.78	-	704,504,669.39
<b>(三)其他权益工具投资</b>	<b>153,964,800.00</b>	<b>1,862,600.00</b>	<b>35,852,284.61</b>	<b>191,679,684.61</b>
- 股票	153,964,800.00	1,862,600.00	10,852,284.61	166,679,684.61
- 其他	-	-	25,000,000.00	25,000,000.00
<b>(四)衍生金融资产</b>	<b>1,182,846.00</b>	<b>7,171.61</b>	-	<b>1,190,017.61</b>
- 权益类收益互换	-	7,171.61	-	7,171.61
- 其他	1,182,846.00	-	-	1,182,846.00
<b>持续以公允价值计量的 资产总额</b>	<b>8,608,407,715.04</b>	<b>25,270,373,278.03</b>	<b>629,866,454.28</b>	<b>34,508,647,447.35</b>
<b>(五)衍生金融负债</b>	-	<b>84,813,877.97</b>	-	<b>84,813,877.97</b>
- 权益类收益互换	-	28,376,846.12	-	28,376,846.12
- 场外期权	-	175,300.00	-	175,300.00
- 利率互换	-	4,048,396.45	-	4,048,396.45
- 其他衍生工具	-	52,213,335.40	-	52,213,335.40
<b>持续以公允价值计量的 负债总额</b>	-	<b>84,813,877.97</b>	-	<b>84,813,877.97</b>

十二、公允价值的披露(续)

2. 以公允价值计量的资产和负债的公允价值(续)

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	第一层次 公允价值计量	第二层次 公允价值计量	第三层次 公允价值计量	
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
<b>(一)交易性金融资产</b>	<b>7,468,490,527.36</b>	<b>15,857,257,684.91</b>	<b>578,385,534.16</b>	<b>23,904,133,746.43</b>
-债券	6,505,456,627.74	9,129,172,435.11	-	15,634,629,062.85
-股票	791,835,315.00	167,050,200.22	199,289,265.86	1,158,174,781.08
-基金	171,198,584.62	3,343,392,941.05	-	3,514,591,525.67
-其他	-	3,217,642,108.53	379,096,268.30	3,596,738,376.83
<b>(二)其他债权投资</b>	<b>220,264,889.32</b>	<b>867,843,238.08</b>	<b>-</b>	<b>1,088,108,127.40</b>
-债券	220,264,889.32	866,643,238.08	-	1,086,908,127.40
-其他	-	1,200,000.00	-	1,200,000.00
<b>(三)其他权益工具投资</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>172,050,208.23</b>	<b>172,050,208.23</b>
-股票	-	-	144,263,208.23	144,263,208.23
-其他	-	-	27,787,000.00	27,787,000.00
<b>(四)衍生金融资产</b>	<b>-</b>	<b>25,945,842.03</b>	<b>-</b>	<b>25,945,842.03</b>
-权益类收益互换	-	17,473,514.83	-	17,473,514.83
-其他	-	8,472,327.20	-	8,472,327.20
<b>持续以公允价值计量的 资产总额</b>	<b>7,688,755,416.68</b>	<b>16,751,046,765.02</b>	<b>750,435,742.39</b>	<b>25,190,237,924.09</b>
<b>(五)交易性金融负债</b>	<b>-</b>	<b>39,659,600.00</b>	<b>-</b>	<b>39,659,600.00</b>
<b>(六)衍生金融负债</b>	<b>7,060,360.00</b>	<b>41,244,610.07</b>	<b>-</b>	<b>48,304,970.07</b>
-权益类收益互换	-	22,808,031.62	-	22,808,031.62
-股票期权	7,060,360.00	-	-	7,060,360.00
-其他衍生工具	-	18,436,578.45	-	18,436,578.45
<b>持续以公允价值计量的 负债总额</b>	<b>7,060,360.00</b>	<b>80,904,210.07</b>	<b>-</b>	<b>87,964,570.07</b>

3. 持续第一层级公允价值计量项目市价的确定依据

本集团及本公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场年末时点收盘价。

## 十二、公允价值的披露(续)

### 4. 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

项目	2021 年 12 月 31 日 公允价值	2020 年 12 月 31 日 公允价值	估值技术	输入值
<b>(一)交易性金融资产</b>	<b>24,653,688,632.64</b>	<b>15,857,257,684.91</b>		
-债券	13,388,834,398.99	9,129,172,435.11	现金流量折现法	债券收益率
-股票	87,355,263.74	167,050,200.22	经调整的市场报价	市场报价
-基金	6,752,192,430.70	3,343,392,941.05	投资标的市价组合法	投资标的市价
-其他	4,425,306,539.21	3,217,642,108.53	投资标的市价组合法	投资标的市价
<b>(二)其他债权投资</b>	<b>614,814,873.78</b>	<b>867,843,238.08</b>		
-债券	614,814,873.78	866,643,238.08	现金流量折现法	债券收益率
-其他	-	1,200,000.00	投资标的市价组合法	投资标的市价
<b>(三)其他权益工具投资</b>	<b>1,862,600.00</b>	-		
-股票	1,862,600.00	-	经调整的市场报价	市场报价
<b>(四)衍生金融资产</b>	<b>7,171.61</b>	<b>25,945,842.03</b>		
-权益类收益互换	7,171.61	17,473,514.83	按标的市价与对手协议的 固定收益之差计算	标的市价
-利率互换	-	2,298,016.65	现金流量折现法	远期利率/折现率
-场外期权	-	547,199.39	期权定价模型	标的指数报价
-其他	-	5,627,111.16	按挂钩产品净值之差计算	挂钩产品净值
<b>资产合计</b>	<b>25,270,373,278.03</b>	<b>16,751,046,765.02</b>		
<b>(五)交易性金融负债</b>	-	<b>39,659,600.00</b>	<b>现金流量折现法</b>	<b>债券收益率</b>
<b>(六)衍生金融负债</b>	<b>84,813,877.97</b>	<b>41,244,610.07</b>		
-利率互换	4,048,396.45	-	现金流量折现法	远期利率/折现率
-权益类收益互换	28,376,846.12	22,808,031.62	按标的市价与对手协议的 固定收入之差计算	标的市价
-场外期权	175,300.00	-	期权定价模型	标的指数报价
-其他	52,213,335.40	18,436,578.45	按挂钩产品净值之差计算	挂钩产品净值
<b>负债合计</b>	<b>84,813,877.97</b>	<b>80,904,210.07</b>		

十二、公允价值的披露(续)

5. 持续第三层级公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

项目	2021 年 12 月 31 日 公允价值	2020 年 12 月 31 日 公允价值	估值技术	输入值	对公允价值的影响
<b>(一)交易性金融资产</b>	<b>594,014,169.67</b>	<b>578,385,534.16</b>			
-股票	45,270,347.20	2,555,960.00	上市公司比较法	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
-股票	30,213,428.72	2,020,000.00	近期投资价格法	最近交易价	最近交易价越高，公允价值越高
-股票	78,700,381.26	179,838,055.86	期权模型	流动性折扣	流动性折扣越高，公允价值越低
-股票	-	14,875,250.00	现金流量折现法	折现率	折现率越低，公允价值越高
-债券	22,604,824.62	-	现金流量折现法	折现率	折现率越低，公允价值越高
-其他	37,350,000.00	35,880,000.00	上市公司比较法	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
-其他	-	1,000,000.00	市价折扣法	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
-其他	312,875,185.87	292,216,268.30	投资标的市价组合法	投资标的市价	投资标的市价越高，公允价值越高
-其他	48,000,002.00	46,000,000.00	近期投资价格法	最近交易价	最近交易价越高，公允价值越高
-其他	19,000,000.00	-	现金流量折现法	折现率	折现率越低，公允价值越高
-其他	-	4,000,000.00	现金流量折现法	折现率	折现率越低，公允价值越高
<b>(二)其他权益工具投资</b>	<b>35,852,284.61</b>	<b>172,050,208.23</b>			
-股票	2,455,572.01	13,865,876.33	市价折扣法	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
-股票	8,396,712.60	948,000.00	近期投资价格法	最近交易价	最近交易价越高，公允价值越高
-股票	-	129,449,331.90	期权模型	流动性折扣	流动性折扣越高，公允价值越低
-其他	25,000,000.00	27,787,000.00	近期投资价格法	最近交易价	最近交易价越高，公允价值越高
<b>资产合计</b>	<b>629,866,454.28</b>	<b>750,435,742.39</b>			

## 十二、公允价值的披露(续)

### 6. 持续第三层次公允价值计量项目，年初与年末账面价值之间的调节信息

项目	其他权益工具投资	交易性金融资产
<b>2020年12月31日</b>	<b>172,050,208.23</b>	<b>578,385,534.16</b>
当期利得或损失总额	16,237,008.83	-133,357,224.92
-计入当期损益	-	-133,357,224.92
-计入其他综合收益	16,237,008.83	-
购入	-	68,410,285.61
发行	-	-
结算及处置	11,443,114.00	95,510,364.33
转入第三层次 (由其他层次转入第三层次)	-	256,024,266.62
转出第三层次 (由第三层次转出到其他层次)	140,991,818.45	79,938,327.47
<b>2021年12月31日</b>	<b>35,852,284.61</b>	<b>594,014,169.67</b>
对于在报告年末持有的资产和负债， 计入损益的当期未实现利得或损失的变动	-	-991,412.45

### 7. 不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

本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、债权投资、其他金融资产、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付款项、应付债券和其他金融负债等。于 2021 年 12 月 31 日，除应付债券外，不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异，应付债券的账面价值与公允价值之间的偏离度小于 1.00%。

## 十三、风险管理

### 1. 市场风险

市场风险是指由资产的市场价格(包括金融资产价格)变化或波动而引起未来损失的可能性。本集团涉及市场风险的业务主要包括权益类证券投资、固定收益类证券投资、衍生品投资等。市场风险管理的措施包括：

- (1) 制定明确的投资决策授权体系，业务决策和风险监控相互独立。公司证券交易投资业务实行分级授权管理和严格的岗位分工及权限管理，研究、投资、交易、内控实行人员与岗位分离。公司董事会根据公司资产、负债、资本充足率、风险偏好等情况确定业务规模、可承受风险限额等。经营管理层投资决策委员会根据董事会授权对公司各项证券投资运作进行决策。各业务部门为证券交易投资业务的执行机构，在公司确定的自营规模和可承受风险限额内，根据投资决策委员会的授权负责具体投资工作。公司风险管理部作为风险管理中台，参与各业务部门的业务决策流程，履行市场风险业务的审核、监测、评估和报告职责，实现对市场风险的全过程管理。

### 十三、风险管理(续)

#### 1. 市场风险(续)

- (2) 全面实行嵌入式风险管理，覆盖所有市场风险业务线，实现市场风险的集中化和精细化管理。针对权益投资、固定收益投资、资产管理、衍生品投资等业务，公司采用统一的组织架构、管理平台、管理流程和计量模型进行集中化管理，对市场风险总量进行计量、汇总、预警和监控。根据不同业务类型和业务特点，公司设置了独立的风险监控岗，分别对权益投资、固定收益投资、资产管理投资、衍生品投资进行审核、评估和监控，风险管理流程涵盖事前的业务授权和风控阈值审核、风险和收益评估，事中的市场风险状况实时监控和预警反馈，事后的风险收益绩效评估等，通过嵌入式的风控流程实现市场风险的全面化、集中化和精细化管理。
- (3) 使用国际通用的市场风险量化模型和计量方法，准确地从多维度计量各层级的市场风险暴露，对市场风险实施限额管理。公司建立了以风险价值(VaR)模型为核心的量化指标体系，科学有效地计量投资组合市场风险，范围涵盖全资产全品种，包括股票、债券、期货、基金、大宗商品和场内衍生品等。风险管理部通过一系列测量方式估计可能的市场风险损失，既包括在市场正常波动状况下的可能损失，也包括市场极端变动状况下的可能损失。风险管理部主要通过 VaR 和敏感性分析的方式对正常波动情况下的短期可能损失进行衡量，采用压力测试的方法对极端情况下的可能损失进行评估。

本集团建立了包括公司、业务部门或业务线的分层风险限额指标体系，自上而下、由整体到局部逐级细化，风险限额指标包括业务规模限额、投资比例限额、敏感性限额、风险敞口限额、VaR 限额、杠杆率限额及止损限额等。本公司董事会确定总体风险偏好、容忍度限额，本集团通过业务授权体系将包括风险偏好、容忍度限额指标在内的各类风险限额指标层层分解和下达，各级业务部门及分支机构、子公司均须在业务授权范围和风险指标额度内开展业务经营活动。风险管理部依据量化风险限额指标对业务进行监测和控制。

- (4) 建立及时有效的监控和预警机制、多通道的报告体系。本集团建立了内部市场风险报告制度，通过日报、周报、月报等定期报告和专项报告形式对各项业务面临的风险进行评估，揭示各项业务风险暴露情况、风险限额指标执行情况和预警情况。业务部门作为市场风险的一线管理人员，动态管理和报告其持仓所暴露的市场风险。风险管理部独立对本集团总体及各部门市场风险状况进行评估，当接近或突破风险限额时，风险管理部会向相关管理人员和业务部门进行预警提示，并和相关人员进行讨论，采取降低风险暴露或其他风险缓释措施化解风险。

#### 风险价值(VaR)分析

风险价值(VaR)是在给定置信区间的情况下，用以计量投资组合在某一时间期限内，因市场利率变动或股票价格变动而引起最大损失的风险指标。本公司通过风险价值(VaR)和敏感性分析对本公司整体面临的市场风险进行计量和评估，采用历史模拟法计算。

### 十三、风险管理(续)

#### 1. 市场风险(续)

##### 风险价值(VaR)分析(续)

本公司按风险类别分类的 1 日 95% 置信区间下的风险价值(VaR)分析概况如下:

单位: 人民币万元

项目	前瞻期 1 日, 置信度 95%, 历史模拟法	
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
权益敏感性金融工具	4,762.27	4,129.19
利率敏感性金融工具	793.96	1,485.36
整体组合风险价值	5,334.95	4,741.97

##### 利率风险

利率风险是指本集团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。本集团的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及融出资金等。

### 十三、风险管理(续)

#### 1. 市场风险(续)

##### 利率风险(续)

项目	2021 年 12 月 31 日						合计
	1 个月内	1 至 3 个月	3 个月至 12 个月	1 年至 5 年	5 年以上	非生息	
<b>金融资产</b>							
货币资金	19,788,712,600.71	-	-	-	-	1,038,380.75	19,789,750,981.46
结算备付金	5,114,550,784.40	-	-	-	-	-	5,114,550,784.40
融出资金	878,684,631.17	6,411,866,776.10	16,311,699,895.19	-	-	12,077,940.30	23,614,329,242.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-	1,190,017.61	1,190,017.61
存出保证金	3,091,822,150.55	-	-	-	-	-	3,091,822,150.55
应收款项	-	-	-	-	-	360,468,282.94	360,468,282.94
买入返售金融资产	1,802,412,458.16	-	14,033,791.78	10,024,219.18	-	26,003,736.82	1,852,474,205.94
交易性金融资产	548,218,495.20	403,372,410.83	1,983,851,612.94	12,354,539,192.96	4,342,669,882.35	13,978,621,481.46	33,611,273,075.74
债权投资	-	-	-	-	-	29,250,000.00	29,250,000.00
其他债权投资	63,939,476.51	10,535,000.00	201,318,539.45	428,711,653.43	-	-	704,504,669.39
其他权益工具投资	-	-	-	-	-	191,679,684.61	191,679,684.61
其他金融资产	-	-	-	-	-	1,109,752,112.57	1,109,752,112.57
<b>小计</b>	<b>31,288,340,596.70</b>	<b>6,825,774,186.93</b>	<b>18,510,903,839.36</b>	<b>12,793,275,065.57</b>	<b>4,342,669,882.35</b>	<b>15,710,081,637.06</b>	<b>89,471,045,207.97</b>
<b>金融负债</b>							
短期借款	-	89,106,058.33	230,361,944.41	-	-	-	319,468,002.74
应付短期融资款	1,009,965,431.50	1,003,746,849.31	4,007,563,424.66	-	-	20,000,000.00	6,041,275,705.47
拆入资金	-	1,281,897,777.08	-	-	-	-	1,281,897,777.08
衍生金融负债	-	-	-	-	-	84,813,877.97	84,813,877.97
卖出回购金融资产款	14,203,807,051.69	-	-	-	-	-	14,203,807,051.69
代理买卖证券款	23,053,222,073.70	-	-	-	-	-	23,053,222,073.70
代理承销证券款	-	-	-	-	-	708,932,079.64	708,932,079.64
应付款项	-	-	-	-	-	408,962,131.89	408,962,131.89
应付债券	1,034,789,589.07	2,052,974,289.86	5,863,712,409.68	14,249,723,106.88	-	487,781,283.41	23,688,980,678.90
租赁负债	-	28,967,543.19	94,263,735.08	296,745,745.89	11,554,579.70	-	431,531,603.86
其他金融负债	-	-	-	-	-	590,735,559.44	590,735,559.44
<b>小计</b>	<b>39,301,784,145.96</b>	<b>4,456,692,517.77</b>	<b>10,195,901,513.83</b>	<b>14,546,468,852.77</b>	<b>11,554,579.70</b>	<b>2,301,224,932.35</b>	<b>70,813,626,542.38</b>
<b>净头寸</b>	<b>-8,013,443,549.26</b>	<b>2,369,081,669.16</b>	<b>8,315,002,325.53</b>	<b>-1,753,193,787.20</b>	<b>4,331,115,302.65</b>	<b>13,408,856,704.71</b>	<b>18,657,418,665.59</b>

### 十三、风险管理(续)

#### 1. 市场风险(续)

##### 利率风险(续)

项目	2020 年 12 月 31 日						合计
	1 个月内	1 至 3 个月	3 个月至 12 个月	1 年至 5 年	5 年以上	非生息	
<b>金融资产</b>							
货币资金	15,482,482,405.05	-	-	-	-	849,822.27	15,483,332,227.32
结算备付金	3,759,748,581.73	-	-	-	-	-	3,759,748,581.73
融出资金	849,981,141.90	5,830,741,219.44	12,213,449,756.58	-	-	11,803,670.76	18,905,975,788.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-	25,945,842.03	25,945,842.03
存出保证金	2,214,824,323.11	-	-	-	-	-	2,214,824,323.11
应收款项	-	-	-	-	-	729,317,081.32	729,317,081.32
买入返售金融资产	2,580,702,279.14	3,211,866.50	-	-	-	39,440,554.90	2,623,354,700.54
交易性金融资产	338,527,480.44	547,582,903.42	1,716,518,440.24	8,212,713,775.71	4,819,286,463.04	8,269,504,683.58	23,904,133,746.43
债权投资	21,276,057.89	-	29,820,205.64	-	-	47,750,000.00	98,846,263.53
其他债权投资	-	-	24,002,411.50	1,062,905,715.90	-	1,200,000.00	1,088,108,127.40
其他权益工具投资	-	-	-	-	-	172,050,208.23	172,050,208.23
其他金融资产	-	-	-	-	-	795,409,447.35	795,409,447.35
<b>小计</b>	<b>25,247,542,269.26</b>	<b>6,381,535,989.36</b>	<b>13,983,790,813.96</b>	<b>9,275,619,491.61</b>	<b>4,819,286,463.04</b>	<b>10,093,271,310.44</b>	<b>69,801,046,337.67</b>
<b>金融负债</b>							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	48,304,970.07	48,304,970.07
交易性金融负债	39,659,600.00	-	-	-	-	-	39,659,600.00
短期借款	-	336,484.25	118,703,950.68	-	-	-	119,040,434.93
应付短期融资款	1,005,971,780.82	2,117,957,945.19	2,331,512,210.78	-	-	-	5,455,441,936.79
拆入资金	500,320,833.33	-	-	-	-	-	500,320,833.33
卖出回购金融资产款	9,683,598,590.65	-	-	-	-	-	9,683,598,590.65
代理买卖证券款	18,770,614,211.99	-	-	-	-	-	18,770,614,211.99
应付款项	-	-	-	-	-	345,991,243.52	345,991,243.52
应付债券	-	10,356,164.38	2,533,156,042.34	14,024,347,728.77	-	400,612,658.00	16,968,472,593.49
其他金融负债	-	-	-	-	-	220,336,801.04	220,336,801.04
<b>小计</b>	<b>30,000,165,016.79</b>	<b>2,128,650,593.82</b>	<b>4,983,372,203.80</b>	<b>14,024,347,728.77</b>	<b>-</b>	<b>1,015,245,672.63</b>	<b>52,151,781,215.81</b>
<b>净头寸</b>	<b>-4,752,622,747.53</b>	<b>4,252,885,395.54</b>	<b>9,000,418,610.16</b>	<b>-4,748,728,237.16</b>	<b>4,819,286,463.04</b>	<b>9,078,025,637.81</b>	<b>17,649,265,121.86</b>

### 十三、风险管理(续)

#### 1. 市场风险(续)

##### 利率敏感性分析

以下敏感性分析基于计息资产及负债的利率风险。该分析假设年末结余的计息资产及负债一直持有至到期，在其他变量不变的情况下，假设市场利率上升或下降 100 个基点对本集团收入、其他综合收益的影响如下：

项目	2021 年 12 月 31 日	
	影响收入	影响其他综合收益
上升 100 个基点	-117,814,418.83	-7,090,215.25
下降 100 个基点	115,099,583.27	7,284,052.91

项目	2020 年 12 月 31 日	
	影响收入	影响其他综合收益
上升 100 个基点	-246,546,674.07	-16,090,539.62
下降 100 个基点	257,326,408.42	16,590,343.15

#### 2. 流动性风险

本集团制定了《流动性风险管理办法》和《流动性风险应急处理实施细则》，明确本集团资金流动性风险管理的总体目标、管理模式、组织职责以及流动性风险识别、计量、监测和控制的方法和程序。主要的管理措施包括：

- (1) 实施流动性风险限额管理，根据业务规模、性质、复杂程度、流动性风险偏好和市场变化情况等，设定流动性风险限额并进行监控。对流动性风险评估主要采用风险指标分析方法，即通过对流动性覆盖率、净稳定资金率、流动性缺口率、流动性比例、优质流动资产、资产及负债集中度、流动性储备等主要指标的分析，评估和计量本集团总体流动性风险状况。
- (2) 建立现金流测算和压力测试分析框架，考虑在当前资产负债项目的合同现金流、增量业务现金流和特定项目客户行为对现金流的影响，对融资渠道和运用情况进行动态的分析和评估，有效计量、监测、控制正常和压力情景下未来不同时间段的现金流缺口。
- (3) 建立并完善融资策略，提高融资来源的多元化和稳定程度。加强负债品种、期限、交易对手、融资抵(质)押品和融资市场等的集中度管理，适当设置集中度限额。
- (4) 制定流动性突发事件的应急计划和处置方案，应急处理包括启动程序、流动性紧急补充方案、报告制度等，并定期对应急计划进行评估，不断更新和完善应急处置方案。

### 十三、风险管理(续)

#### 2. 流动性风险(续)

本集团持有的金融负债按未折现剩余合同义务到期期限分析如下：

项目	2021 年 12 月 31 日					合计	账面价值
	即时偿还	3 个月内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上		
<b>非衍生金融负债</b>							
短期借款	-	89,954,525.00	233,523,055.51	-	-	323,477,580.51	319,468,002.74
应付短期融资款	-	2,019,987,767.12	4,087,574,794.52	-	-	6,107,562,561.64	6,041,275,705.47
拆入资金	-	1,289,059,555.56	-	-	-	1,289,059,555.56	1,281,897,777.08
卖出回购金融资产款	-	14,211,192,157.98	-	-	-	14,211,192,157.98	14,203,807,051.69
代理买卖证券款	23,053,222,073.70	-	-	-	-	23,053,222,073.70	23,053,222,073.70
代理承销证券款	708,932,079.64	-	-	-	-	708,932,079.64	708,932,079.64
应付款项	20,640,800.00	263,588,958.21	123,992,871.25	739,502.43	-	408,962,131.89	408,962,131.89
应付债券	-	3,253,075,000.00	6,383,739,000.00	15,575,123,890.00	-	25,211,937,890.00	23,688,980,678.90
租赁负债	-	32,901,432.53	104,768,653.04	313,442,542.99	12,514,847.50	463,627,476.06	431,531,603.86
其他金融负债	18,705,231.95	432,094,542.87	114,675,476.95	18,441,535.57	6,818,772.10	590,735,559.44	590,735,559.44
<b>非衍生金融负债合计</b>	<b>23,801,500,185.29</b>	<b>21,591,853,939.27</b>	<b>11,048,273,851.27</b>	<b>15,907,747,470.99</b>	<b>19,333,619.60</b>	<b>72,368,709,066.42</b>	<b>70,728,812,664.41</b>
衍生金融负债	4,048,396.45	-	28,508,997.94	52,256,483.58	-	84,813,877.97	84,813,877.97

### 十三、风险管理(续)

#### 2. 流动性风险(续)

本集团持有的金融负债按未折现剩余合同义务到期期限分析如下：(续)

2020 年 12 月 31 日							
项目	即时偿还	3 个月内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	合计	账面价值
<b>非衍生金融负债</b>							
短期借款	-	338,489.74	120,846,586.83	-	-	121,185,076.57	119,040,434.93
应付短期融资款	-	3,138,689,041.10	2,368,292,054.79	-	-	5,506,981,095.89	5,455,441,936.79
拆入资金	-	500,458,333.33	-	-	-	500,458,333.33	500,320,833.33
交易性金融负债	-	39,659,600.00	-	-	-	39,659,600.00	39,659,600.00
卖出回购金融资产款	-	9,688,764,451.89	-	-	-	9,688,764,451.89	9,683,598,590.65
代理买卖证券款	18,770,614,211.99	-	-	-	-	18,770,614,211.99	18,770,614,211.99
应付款项	-	192,109,234.72	86,586,788.00	67,295,220.80	-	345,991,243.52	345,991,243.52
应付债券	-	159,956,164.38	2,927,940,986.30	14,939,136,658.00	-	18,027,033,808.68	16,968,472,593.49
其他金融负债	-	112,061,144.55	82,129,551.72	26,146,104.77	-	220,336,801.04	220,336,801.04
<b>非衍生金融负债合计</b>	<b>18,770,614,211.99</b>	<b>13,832,036,459.71</b>	<b>5,585,795,967.64</b>	<b>15,032,577,983.57</b>	-	<b>53,221,024,622.91</b>	<b>52,103,476,245.74</b>
<b>衍生金融负债</b>	<b>7,060,360.00</b>	<b>27,700.56</b>	-	<b>41,216,909.51</b>	-	<b>48,304,970.07</b>	<b>48,304,970.07</b>

### 十三、风险管理(续)

#### 3. 信用风险

信用风险是指因交易对手无法履约或其信用评级、履约能力等改变而给本集团带来的损失可能性。本集团面临的信用风险主要来自于债券投资业务、融资融券业务、股票质押式回购及衍生品交易业务等。

##### 信用风险管理的措施

- (1) 建立统一的信用风险管理政策。本集团通过建立四级风险管理架构、分级授权决策机制，实现本集团信用风险的统一管理。针对各类信用业务明确了交易对手尽职调查、授信审查、担保品管理、授信后检查以及信用风险处置等管理流程。
- (2) 建立信用风险量化评估和限额管理体系。本公司针对部分信用类业务构建了量化计量模型，包括授信测算模型、担保品折算模型、内部评级模型等，对业务信用风险进行测算。本公司在总体和各部门层面设置了信用风险限额指标，限额指标包括业务规模、行业限额、个券限额、损失率限额、集中度限额等，风险管理部对信用类预期损失进行测算，评估和监测信用风险限额执行情况，定期编制包括信用风险暴露、预期损失、违约率等在内的信用风险报告，并按规定及时向管理层和业务部门报送。
- (3) 信用类产品投资方面，本公司制定了交易方式、发行主体、债券评级的准入标准和债券信用等级评价体系，对发行人所处行业、发行主体和担保人进行内部信用评估，设立债券禁投库，各业务部门不得投资禁投库主体债券。风险管理部持续开展债券持仓风险排查、关注持仓债券舆情状况，对出现风险的主体及相关重大负面信息予以预警提示。
- (4) 对融资融券、股票质押式回购等融资类业务，本集团建立了从授信管理、担保品管理、监控报告，到追保平仓管理等涵盖业务全流程的管理体系；在客户准入上严格执行尽职调查、合规审查、征信评级和授信审批程序，通过负面清单和折算率模型动态调整担保品。业务部门履行日常监控、沟通、平仓和报告职责，风险管理部独立监控和报告，定期开展压力测试评估极端情形下的可能损失情况。
- (5) 对衍生品交易对手的信用风险，本集团建立了交易对手评级和授信管理制度，定期跟踪评估交易对手情况。

##### 预期信用损失计量

本集团根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的要求，采用预期信用损失模型计量金融工具信用减值准备。预期信用损失模型基于金融工具自初始确认后信用风险是否显著增加，采用三阶段法对金融工具进行风险阶段划分，计量金融工具预期信用损失。第一阶段包括自初始确认以来信用风险没有显著增加或在报告日存在低风险的金融工具；第二阶段包括自初始确认以来信用风险显著增加，但是没有发生信用减值的金融工具；第三阶段包括在报告日存在客观减值迹象的金融工具。

### 十三、风险管理(续)

#### 3. 信用风险(续)

##### 预期信用损失计量(续)

对于第一阶段的金融工具，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减值准备；对于第二、三阶段的金融工具，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其减值准备。新金融工具准则实施以来，本集团预期信用损失模型运行稳健，对信用风险变化的反应灵敏，预期信用损失的计量动态反映客户及交易对手信用资质变化、市场行情波动及宏观经济变动等因素的影响。新金融工具准则下的减值准备计提工作与本集团信用风险管理目标一致。通过预期信用损失的计量，本集团实现了信用风险的量化管理，明确了管理的目标和途径。

##### 前瞻性信息

对于三阶段的金融工具本集团均考虑了前瞻性因素。本集团对前瞻性因子调整采用莫顿模型，该预测模型包含时间序列，考虑悲观、中性和乐观三种情形对本集团环境进行预测，代入模型进行测算。

若不考虑担保品或其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面金额(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：

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
货币资金	19,789,750,981.46	15,483,332,227.32
结算备付金	5,114,550,784.40	3,759,748,581.73
融出资金	23,614,329,242.76	18,905,975,788.68
衍生金融资产	1,190,017.61	25,945,842.03
存出保证金	3,091,822,150.55	2,214,824,323.11
应收款项	360,468,282.94	729,317,081.32
买入返售金融资产	1,852,474,205.94	2,623,354,700.54
交易性金融资产(注)	20,278,324,440.45	16,397,648,139.35
债权投资	29,250,000.00	98,846,263.53
其他债权投资	704,504,669.39	1,088,108,127.40
其他金融资产	1,109,752,112.57	795,409,447.35
<b>最大信用风险敞口</b>	<b>75,946,416,888.07</b>	<b>62,122,510,522.36</b>

注： 交易性金融资产包含债券、信托产品、融出证券。

十三、风险管理(续)

3. 信用风险(续)

预期信用损失计量(续)

下表列示了在新金融工具准则下纳入减值评估范围的主要金融工具损失准备在本年内的变动情况以及按预期信用损失不同阶段列示的信用情况：

融出资金	第1阶段	第2阶段	第3阶段	合计
	12个月预期信用损失	未发生信用减值的金融资产(整个存续期预期信用损失)	已发生信用减值的金融资产(整个存续期预期信用损失)	
<b>2020年12月31日余额</b>	<b>5,085,464.94</b>	<b>16,890,882.51</b>	<b>40,046,752.24</b>	<b>62,023,099.69</b>
转移至第1阶段	8,374,220.76	-8,374,220.76	-	-
转移至第2阶段	-134,407.32	134,407.32	-	-
转移至第3阶段	-	-124,016.95	124,016.95	-
计提/(转回)合计	-9,190,932.03	-473,498.24	-2,366,909.16	<b>-12,031,339.43</b>
<b>2021年12月31日余额</b>	<b>4,134,346.35</b>	<b>8,053,553.88</b>	<b>37,803,860.03</b>	<b>49,991,760.26</b>

买入返售金融资产	第1阶段	第2阶段	第3阶段	合计
	12个月预期信用损失	未发生信用减值的金融资产(整个存续期预期信用损失)	已发生信用减值的金融资产(整个存续期预期信用损失)	
<b>2020年12月31日余额</b>	<b>81,158.05</b>	-	<b>26,379,889.38</b>	<b>26,461,047.43</b>
转移至第1阶段	-	-	-	-
转移至第2阶段	-	-	-	-
转移至第3阶段	-	-	-	-
计提/(转回)合计	-81,158.05	-	10,833,735.86	<b>10,752,577.81</b>
终止确认金融资产而转出	-	-	-2,547,809.60	<b>-2,547,809.60</b>
<b>2021年12月31日余额</b>	-	-	<b>34,665,815.64</b>	<b>34,665,815.64</b>

债权投资	第1阶段	第2阶段	第3阶段	合计
	12个月预期信用损失	未发生信用减值的金融资产整个存续期预期信用损失	已发生信用减值的金融资产整个存续期预期信用损失	
<b>2020年12月31日余额</b>	<b>189,215.92</b>	-	<b>37,250,000.00</b>	<b>37,439,215.92</b>
转移至第1阶段	-	-	-	-
转移至第2阶段	-	-	-	-
转移至第3阶段	-	-	-	-
计提/(转回)合计	-189,215.92	-	18,495,312.00	<b>18,306,096.08</b>
<b>2021年12月31日余额</b>	-	-	<b>55,745,312.00</b>	<b>55,745,312.00</b>

### 十三、风险管理(续)

#### 3. 信用风险(续)

##### 预期信用损失计量(续)

其他债权投资	第1阶段	第2阶段	第3阶段	合计
	12个月预期信用损失	未发生信用减值的金融资产(整个存续期预期信用损失)	已发生信用减值的金融资产(整个存续期预期信用损失)	
<b>2020年12月31日余额</b>	<b>1,207,683.16</b>	<b>336,366.19</b>	-	<b>1,544,049.35</b>
转移至第1阶段	-	-	-	-
转移至第2阶段	-25,254.01	25,254.01	-	-
转移至第3阶段	-	-	-	-
计提/(转回)合计	-561,241.66	215,022.40	-	<b>-346,219.26</b>
<b>2021年12月31日余额</b>	<b>621,187.49</b>	<b>576,642.60</b>	-	<b>1,197,830.09</b>

#### 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。操作风险管理的措施包括：

- (1) 实行集中领导、分级管理的授权体制，各部门和分支机构在被授予的权限范围内行使权力和开展业务活动，明确制定各业务活动的管理制度办法、操作指引、流程及审批权限，严禁越权从事交易或业务活动。
- (2) 采取风险与控制自我评估、关键风控点识别等多项措施，对业务开展过程中所面临的各类操作风险进行识别和防控。针对各类业务的特点，公司不定期采取协调会、自查等方式，深入了解业务开展情况、人员情况及控制机制等，评估业务部门可能存在的风险，不断完善风险控制手段，并根据风险评估结果进一步加强对关键风险点的控制和管理。
- (3) 建立操作风险事件监测、汇报和分析机制。持续收集内、外部风险事件，对损失事件影响、内控缺失情况进行归因分析，形成风险和损失事件库，以加强风险来源的识别工作；及时向出现操作风险的部门出具预警提示，通知其及时作出相应的风险处理；对与操作风险损失事件、审计、监管检查所发现的问题相关的整改措施落实情况进行统一追踪，确保整改措施落实到位。
- (4) 进行日常操作风险监控，定期检查并分析各部门操作风险的管理情况，确保操作风险制度和措施得到贯彻落实。
- (5) 积极宣导风险管理文化，定期进行行业风险案例专题研究，强调创新业务开展前的风险识别与控制，使操作风险管理覆盖公司各前中后台部门和分支机构，有效强化了操作风险的事前控制、事中监控和事后改进。

### 十三、风险管理(续)

#### 5. 合规风险

合规风险是指公司或工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规和准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。合规风险管理的措施包括：

- (1) 加强事前风险防范。公司通过制度建设、合规培训与宣导等方式，倡导和推进合规经营的合规文化建设，培育全体工作人员合规意识，提升合规管理人员职业荣誉感和专业化、职业化水平。积极参与新业务、新方案，实现风控合规前置，有力防范了合规风险的发生。
- (2) 加强事后合规检查。公司通过合规检查与调查及时发现违法违规行为，并按照监管与公司制度规定报告，及时纠正违法违规情况。在监管风险发生前，采用内部检查与调查、发送合规提示函或合规警示函等方式进行防范。
- (3) 加大责任追究力度。对监管部门或自律组织下发的函件，公司及分支机构、子公司针对检查发现的问题，立即召开专题会议，认真反省，吸取教训，研究制定相关整改方案，逐项落实整改，并对相关责任人进行了责任追究。

### 十四、其他重要事项

#### 1. 分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据划分经营分部。管理层定期评价经营分部，以决定向其分配资源。本集团在经营分部的基础上确定了5个报告分部，包括财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务、证券投资及交易业务、其他业务。

本集团各个报告分部提供的主要服务分别如下：

- 财富管理业务主要包括为客户提供证券代理买卖、金融产品代销、期货经纪、融资融券业务、约定购回及股票质押式回购等业务。
- 投资银行业务包括股权融资、债券融资、财务顾问等业务。
- 资产管理业务包括为客户提供的资产管理业务。
- 证券投资及交易业务包括固定收益证券、股票、金融衍生品等投资与交易业务。
- 其他业务包括为客户提供的基金管理、投资研究、投资咨询、股权投资等业务。

分部会计政策与合并财务报表会计政策一致，分部间转移交易以实际交易价格为基础计算，分部收入和分部费用按各分部的实际收入和费用确定。

十四、其他重要事项(续)

1. 分部报告(续)

项目	2021 年度					合计
	财富管理业务	投资银行业务	资产管理业务	证券投资及交易业务	其他	
1.营业收入	2,810,100,965.63	574,745,827.71	140,417,719.53	1,143,364,968.49	3,088,166,607.20	7,756,796,088.56
其中：手续费及佣金净收入	1,203,004,217.74	574,745,827.71	140,417,719.53	-	78,352,978.69	1,996,520,743.67
利息净收入	1,600,097,288.34	-	-	-336,170,713.85	-905,893,477.79	358,033,096.70
2.营业支出	1,063,901,124.65	401,485,571.53	81,264,302.59	125,417,234.08	3,883,096,592.05	5,555,164,824.90
3.营业利润	1,746,199,840.98	173,260,256.18	59,153,416.94	1,017,947,734.41	-794,929,984.85	2,201,631,263.66
4.资产总额	49,371,151,974.16	63,682,257.67	21,442,507.46	38,517,272,387.44	4,723,338,063.90	92,696,887,190.63
5.负债总额	23,826,821,356.79	1,175,777,518.11	93,750,564.95	15,743,022,871.39	31,744,478,117.20	72,583,850,428.44
6.补充信息						
(1)折旧与摊销费用	87,241,299.42	2,501,509.77	494,103.21	897,555.65	129,823,730.53	220,958,198.58
(2)资本性支出	54,364,118.96	770,277.11	648,637.96	2,305,987.85	25,696,322.48	83,785,344.36

#### 十四、其他重要事项(续)

##### 1. 分部报告(续)

项目	2020 年度					合计
	财富管理业务	投资银行业务	资产管理业务	证券投资及交易业务	其他	
1.营业收入	2,360,879,725.02	451,412,788.98	105,651,157.84	1,261,969,139.41	2,688,784,651.91	6,868,697,463.16
其中: 手续费及佣金净收入	1,031,063,645.23	451,412,788.98	105,651,157.84	-	50,080,782.36	1,638,208,374.41
利息净收入	1,320,547,766.62	-	-	-228,766,641.88	-666,798,879.61	424,982,245.13
2.营业支出	928,064,183.31	367,839,345.10	68,449,184.32	185,129,682.59	3,487,338,463.60	5,036,820,858.92
3.营业利润	1,432,815,541.71	83,573,443.88	37,201,973.52	1,076,839,456.82	-798,553,811.69	1,831,876,604.24
4.资产总额	38,720,350,685.19	72,819,365.37	22,866,418.03	30,022,493,607.49	3,374,352,108.52	72,212,882,184.60
5.负债总额	19,246,005,307.91	387,197,074.03	61,620,886.54	9,569,389,006.55	24,422,095,997.25	53,686,308,272.28
6.补充信息						
(1)折旧与摊销费用	21,047,145.96	2,477,941.25	242,855.56	528,096.20	65,161,326.98	89,457,365.95
(2)资本性支出	49,931,715.02	1,072,099.56	630,117.57	1,933,370.18	40,625,730.78	94,193,033.11

#### 十四、其他重要事项(续)

##### 2. 融券业务情况

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
	公允价值	公允价值
融出证券	55,662,061.80	81,074,147.32
其中：交易性金融资产	41,830,445.00	26,725,085.58
转融通融入证券	13,831,616.80	54,349,061.74

##### 3. 社会责任

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
捐赠支出	5,344,988.00	8,369,439.13

#### 十五、母公司财务报表项目注释

##### 1. 长期股权投资

###### (1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
对子公司投资	1,730,428,274.88	1,640,428,274.88
对联营/合营企业投资	2,298,222,888.33	1,827,227,075.26
<b>小计</b>	<b>4,028,651,163.21</b>	<b>3,467,655,350.14</b>
减：长期股权投资减值准备	-	5,735,118.98
<b>长期股权投资账面价值</b>	<b>4,028,651,163.21</b>	<b>3,461,920,231.16</b>

## 十五、母公司财务报表项目注释(续)

### 1. 长期股权投资(续)

#### (2) 长期股权投资明细列示

被投资单位	核算方法	投资成本	2020年 12月31日	执行新租赁 准则影响	2021年 1月1日	本年增减变动				2021年 12月31日	在被投资 单位持股 比例(%)	在被投资 单位表决权 比例(%)
						追加投资	减少投资	权益法下确认的 投资损益	现金红利			
一、子公司												
1.宝城期货有限责任 公司	成本法	540,428,274.88	540,428,274.88	-	540,428,274.88	-	-	-	-	540,428,274.88	80.00	80.00
2.深圳市市长城长富投 资管理有限公司	成本法	600,000,000.00	600,000,000.00	-	600,000,000.00	-	-	-	-	600,000,000.00	100.00	100.00
3.深圳市市长城证券投 资有限公司	成本法	590,000,000.00	500,000,000.00	-	500,000,000.00	90,000,000.00	-	-	-	590,000,000.00	100.00	100.00
<b>小计</b>		<b>1,730,428,274.88</b>	<b>1,640,428,274.88</b>	<b>-</b>	<b>1,640,428,274.88</b>	<b>90,000,000.00</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,730,428,274.88</b>		
二、联营/合营企业												
1.景顺长城基金管理 有限公司	权益法	66,843,800.00	1,110,121,309.89	-890,938.29	1,109,230,371.60	-	-	687,042,906.10	-263,969,960.00	1,532,303,317.70	49.00	49.00
2.长城基金管理有限 公司	权益法	92,184,190.00	711,370,646.39	-	711,370,646.39	-	-	77,961,543.27	-23,412,619.03	765,919,570.63	47.059	47.059
3.深圳市通商投资有 限公司	权益法	-	5,735,118.98	-	5,735,118.98	-	-5,735,118.98	-	-	-	-	-
<b>小计</b>		<b>159,027,990.00</b>	<b>1,827,227,075.26</b>	<b>-890,938.29</b>	<b>1,826,336,136.97</b>	<b>-</b>	<b>-5,735,118.98</b>	<b>765,004,449.37</b>	<b>-287,382,579.03</b>	<b>2,298,222,888.33</b>		
<b>合计</b>		<b>1,889,456,264.88</b>	<b>3,467,655,350.14</b>	<b>-890,938.29</b>	<b>3,466,764,411.85</b>	<b>90,000,000.00</b>	<b>-5,735,118.98</b>	<b>765,004,449.37</b>	<b>-287,382,579.03</b>	<b>4,028,651,163.21</b>		

十五、母公司财务报表项目注释(续)

2. 应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
一、短期薪酬及长期薪酬	1,195,043,640.38	1,574,926,264.35	1,323,194,755.00	1,446,775,149.73
二、离职后福利-设定提存计划	13,833,765.48	109,411,889.60	118,191,302.70	5,054,352.38
三、辞退福利	-	6,689,993.16	6,689,993.16	-
<b>合计</b>	<b>1,208,877,405.86</b>	<b>1,691,028,147.11</b>	<b>1,448,076,050.86</b>	<b>1,451,829,502.11</b>

(2) 短期薪酬及长期薪酬列示

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,188,191,951.76	1,445,195,318.23	1,191,260,170.77	1,442,127,099.22
二、职工福利费	-	17,869,467.45	17,869,467.45	-
三、社会保险费	-	34,230,485.07	34,230,485.07	-
其中：医疗保险费	-	32,084,702.60	32,084,702.60	-
工伤保险费	-	627,707.09	627,707.09	-
生育保险费	-	1,518,075.38	1,518,075.38	-
四、住房公积金	-	53,270,689.13	53,270,689.13	-
五、工会经费和职工教育经费	6,851,688.62	21,495,596.01	23,699,234.12	4,648,050.51
六、其他	-	2,864,708.46	2,864,708.46	-
<b>合计</b>	<b>1,195,043,640.38</b>	<b>1,574,926,264.35</b>	<b>1,323,194,755.00</b>	<b>1,446,775,149.73</b>

于 2021 年 12 月 31 日,应付职工薪酬中包含的长期薪酬余额为人民币 664,462,423.65 元(2020 年 12 月 31 日: 人民币 433,427,701.78 元)。

(3) 设定提存计划列示

项目	2020 年 12 月 31 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
基本养老保险费	-	62,911,385.30	62,911,385.30	-
失业保险费	-	1,490,198.08	1,490,198.08	-
年金缴费	13,833,765.48	45,010,306.22	53,789,719.32	5,054,352.38
<b>合计</b>	<b>13,833,765.48</b>	<b>109,411,889.60</b>	<b>118,191,302.70</b>	<b>5,054,352.38</b>

十五、母公司财务报表项目注释(续)

3. 利息净收入

项目	2021 年度	2020 年度
<b>利息收入</b>		
存放金融同业利息收入	343,228,257.46	334,096,738.98
其中：自有资金存款利息收入	38,449,462.56	43,224,608.04
客户资金存款利息收入	304,778,794.90	290,872,130.94
融资融券利息收入	1,332,425,821.27	1,047,841,991.30
买入返售金融资产利息收入	19,098,496.78	46,542,384.32
其中：股票质押式回购利息收入	969,117.48	6,227,639.66
债权投资利息收入	50,802.70	13,130,592.55
其他债权投资利息收入	48,832,170.25	69,945,415.78
其他	127,976.18	284,123.95
<b>利息收入小计：</b>	<b>1,743,763,524.64</b>	<b>1,511,841,246.88</b>
<b>利息支出</b>		
应付短期融资款利息支出	178,401,759.51	173,817,793.21
拆入资金利息支出	30,704,142.28	18,443,785.20
其中：转融通利息支出	27,801,378.43	6,093,990.81
卖出回购金融资产利息支出	368,586,140.60	345,812,621.55
客户资金利息支出	61,772,070.79	59,644,747.21
应付债券利息支出	753,152,221.26	516,986,799.41
租赁负债利息支出	17,346,505.36	
其他	35,636,025.97	26,658,092.14
<b>利息支出小计</b>	<b>1,445,598,865.77</b>	<b>1,141,363,838.72</b>
<b>利息净收入</b>	<b>298,164,658.87</b>	<b>370,477,408.16</b>

十五、母公司财务报表项目注释(续)

4. 手续费及佣金净收入

项目	2021 年度	2020 年度
手续费及佣金收入：		
证券经纪业务	1,499,957,814.46	1,385,355,240.86
其中：代理买卖证券业务	1,228,020,704.49	1,174,998,070.61
交易单位席位租赁	161,468,760.57	118,763,951.38
代销金融产品业务	110,468,349.40	91,593,218.87
投资银行业务	605,400,850.23	496,111,191.19
其中：证券承销业务	443,623,023.03	340,443,796.29
证券保荐业务	26,292,452.86	18,013,207.56
财务顾问业务	135,485,374.34	137,654,187.34
资产管理业务	143,277,402.90	113,223,831.63
基金服务业务	9,102,508.66	9,829,605.69
投资咨询业务	77,589,409.67	55,782,445.76
其他	4,009,477.08	3,047,620.53
<b>手续费及佣金收入小计</b>	<b>2,339,337,463.00</b>	<b>2,063,349,935.66</b>
手续费及佣金支出：		
证券经纪业务	504,558,457.60	466,997,301.84
其中：代理买卖证券业务	488,475,643.93	451,709,553.00
交易单位席位租赁	8,344,226.44	7,373,801.53
代销金融产品业务	7,738,587.23	7,913,947.31
投资银行业务	30,655,022.52	44,698,402.21
其中：证券承销业务	25,385,365.96	42,483,888.91
证券保荐业务	275,140.42	-
财务顾问业务	4,994,516.14	2,214,513.30
资产管理业务	3,110,404.21	8,396,323.56
投资咨询业务	1,584,158.40	1,614,918.72
其他	11,184,390.39	19,899,622.61
<b>手续费及佣金支出小计</b>	<b>551,092,433.12</b>	<b>541,606,568.94</b>
<b>手续费及佣金净收入</b>	<b>1,788,245,029.88</b>	<b>1,521,743,366.72</b>

十五、母公司财务报表项目注释(续)

5. 投资收益

项目	2021 年度	2020 年度
成本法核算的长期股权投资收益	-	6,365,498.59
权益法核算的长期股权投资收益	765,004,449.37	476,395,939.13
处置长期股权投资产生的投资收益	194,648.91	-
金融工具投资收益	1,180,465,822.41	1,389,112,160.05
其中：持有期间取得的收益	969,793,078.14	912,137,498.28
-交易性金融资产	969,544,408.14	911,794,878.28
-其他权益工具投资	248,670.00	342,620.00
处置金融工具取得的收益	210,672,744.27	476,974,661.77
-衍生金融工具	-224,955,517.94	8,299,788.17
-交易性金融资产	442,121,596.95	473,482,517.35
-其他债权投资	3,076,467.54	469,554.51
-交易性金融负债	-9,569,802.28	-5,277,198.26
其他	1,980,249.60	-8,767,500.00
<b>合计</b>	<b>1,947,645,170.29</b>	<b>1,863,106,097.77</b>

6. 公允价值变动收益

项目	2021 年度	2020 年度
交易性金融资产	225,430,619.96	807,668.17
交易性金融负债	1,314,484.42	-444,237.84
衍生金融工具	-78,748,801.62	29,710,261.11
<b>合计</b>	<b>147,996,302.76</b>	<b>30,073,691.44</b>

7. 业务及管理费

项目	2021 年度	2020 年度
职工薪酬	1,691,028,147.11	1,461,685,933.25
使用权资产折旧费	118,534,627.58	
折旧摊销费	91,293,859.11	86,635,700.99
业务宣传费	83,889,453.77	61,194,209.09
电子设备运转费	60,100,409.52	52,449,734.94
席位运行费	40,981,050.75	37,088,840.47
投资者保护基金	39,750,531.83	17,349,373.67
通讯费	27,813,354.17	26,428,672.88
租赁费及物业管理费	27,028,341.76	158,275,515.13
咨询费	20,626,454.71	30,324,787.77
其他	63,857,625.45	60,807,272.65
<b>合计</b>	<b>2,264,903,855.76</b>	<b>1,992,240,040.84</b>

## 十五、母公司财务报表项目注释(续)

## 8. 现金流量补充资料

项目	2021 年度	2020 年度
<b>1.将净利润调节为经营活动现金流量:</b>		
净利润	1,646,577,077.40	1,444,976,475.35
加: 信用减值损失(转回以“-”号填列)	-21,416,766.27	67,717,899.72
固定资产折旧	36,445,675.40	36,112,460.62
使用权资产折旧	118,534,627.58	
无形资产摊销	32,127,322.86	28,228,980.22
长期待摊费用摊销	22,720,860.85	22,294,260.15
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	-11,132.35	-381,167.42
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	-173,062,132.76	14,220,118.56
利息支出	948,900,486.13	690,804,592.62
汇兑损失	1,446,667.92	3,756,429.91
投资损失(收益以“-”号填列)	-814,330,741.23	-566,180,066.05
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	32,207,213.17	-61,172,439.31
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	-5,813,127.31	-2,029,104.04
交易性金融资产的减少(增加以“-”号填列)	-9,389,399,934.50	-1,358,593,450.03
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	691,579,879.24	-7,809,342,385.43
经营性应付项目的增加	3,159,711,472.59	2,070,590,069.52
经营活动产生的现金流量净额	-3,713,782,551.28	-5,418,997,325.61
<b>2.现金及现金等价物净变动情况:</b>		
现金的年末余额	19,380,294,663.40	16,513,707,903.98
减: 现金的年初余额	16,513,707,903.98	13,283,296,872.72
<b>现金及现金等价物净增加额</b>	<b>2,866,586,759.42</b>	<b>3,230,411,031.26</b>

## 十六、财务报表的批准

本财务报表于 2022 年 4 月 8 日经本公司董事会批准。

\*\*\*财务报表结束\*\*\*

**补充资料:**

**1. 当期非经常性损益明细表**

非经常性损益明细	2021 年度	2020 年度
非流动性资产处置损益, 包括已计提资产减值准备的冲销部分	30,369.59	500,949.39
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	22,377,399.29	20,479,559.88
其他符合非经常性损益定义的损益项目	1,980,249.60	-8,767,500.00
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回	25,241,291.62	2,004,448.46
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-33,426,529.43	-8,146,931.61
非经常性损益合计	16,202,780.67	6,070,526.12
减: 所得税影响金额	11,068,467.47	1,584,634.36
扣除所得税影响后的非经常性损益	5,134,313.20	4,485,891.76
其中: 归属于母公司股东的非经常性损益	3,707,629.54	4,383,067.37
归属于少数股东的非经常性损益	1,426,683.66	102,824.39

**2. 净资产收益率和每股收益**

本净资产收益率和每股收益计算表是本公司按照中国证监会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 9 号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010 年修订)的有关规定而编制的。

2021 年度:

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	9.38%	0.57	0.57
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	9.36%	0.57	0.57

2020 年度:

报告期利润	加权平均净资产收益率	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	8.58%	0.48	0.48
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	8.56%	0.48	0.48

因本公司不存在稀释性潜在普通股, 故本公司稀释每股收益等于基本每股收益。