

合并资产负债表  
2020年6月30日

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2020年6月30日	2019年12月31日
<b>资产：</b>		
货币资金	87,362,804,606.78	75,606,831,540.12
其中：客户资金存款	74,826,094,627.39	58,802,629,808.32
结算备付金	14,687,693,661.17	12,051,626,421.62
其中：客户备付金	10,701,810,316.66	8,709,706,176.30
贵金属		
拆出资金		
融出资金	62,384,674,333.42	53,048,414,310.76
衍生金融资产	410,871,197.78	53,268,265.39
存出保证金	8,489,171,581.17	6,686,020,016.78
应收款项	4,130,864,628.64	1,922,356,926.44
应收款项融资		
合同资产		
买入返售金融资产	32,465,672,336.68	39,096,417,410.12
持有待售资产		
<b>金融投资：</b>		
交易性金融资产	115,547,134,832.34	105,364,096,706.12
债权投资	2,515,035,175.12	958,995,689.13
其他债权投资	62,655,520,531.33	44,029,179,919.64
其他权益工具投资	8,921,606,230.33	9,435,341,611.23
长期股权投资	1,283,695,850.75	1,228,079,233.02
投资性房地产	42,172,331.83	44,011,973.47
固定资产	661,501,580.92	674,114,832.80
在建工程	140,120,535.43	144,165,661.76
使用权资产	800,970,635.55	841,423,299.64
无形资产	132,538,853.85	140,272,158.89
商誉		
递延所得税资产	1,353,694,125.09	1,210,593,048.07
其他资产	970,637,195.33	971,017,121.79
资产总计	404,956,380,223.51	353,506,226,146.79
<b>负债：</b>		
短期借款	4,007,598,032.86	727,723,042.00
应付短期融资款	17,769,280,322.73	17,065,153,234.14
拆入资金	8,999,667,491.83	10,951,073,811.81
交易性金融负债	3,840,386,341.90	280,825,151.55
衍生金融负债	689,284,460.36	193,411,055.04
卖出回购金融资产款	89,441,329,666.85	83,436,906,465.52

代理买卖证券款	91,713,221,146.60	71,878,855,059.26
代理承销证券款		
应付职工薪酬	3,499,901,612.53	3,396,881,266.31
应交税费	815,863,039.61	1,235,557,850.36
应付款项	3,124,518,663.07	2,319,754,713.32
合同负债	45,068,302.01	40,573,118.91
持有待售负债		
预计负债		
长期借款	5,001,082,191.78	5,001,082,191.78
应付债券	81,030,872,539.04	66,780,049,758.13
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	814,492,458.15	865,462,842.95
递延收益		
递延所得税负债	3,003,042.31	2,557,994.93
其他负债	15,409,693,494.15	11,951,807,875.09
负债合计	326,205,262,805.78	276,127,675,431.10
所有者权益（或股东权益）：		
实收资本（或股本）	47,000,000,000.00	47,000,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积	3,273,875,823.46	3,273,875,823.46
减：库存股		
其他综合收益	-955,340,937.97	-329,172,052.11
盈余公积	3,085,670,661.04	3,085,670,661.04
一般风险准备	7,261,655,031.27	7,234,747,796.18
未分配利润	17,464,967,321.53	15,539,264,834.45
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	77,130,827,899.33	75,804,387,063.02
少数股东权益	1,620,289,518.40	1,574,163,652.67
所有者权益（或股东权益）合计	78,751,117,417.73	77,378,550,715.69
负债和所有者权益（或股东权益）总计	404,956,380,223.51	353,506,226,146.79

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



母公司资产负债表

2020年6月30日

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	2020年6月30日	2019年12月31日
<b>资产:</b>		
货币资金	66,587,076,051.62	55,497,110,341.70
其中: 客户资金存款	59,510,208,400.35	46,498,317,555.02
结算备付金	13,119,192,228.50	10,400,563,677.72
其中: 客户备付金	8,181,599,316.08	6,437,899,938.41
贵金属		
拆出资金		
融出资金	55,598,971,558.52	47,977,430,091.36
衍生金融资产	407,739,874.11	51,648,536.43
存出保证金	1,530,997,175.34	1,368,310,308.86
应收款项	2,371,663,617.72	1,220,720,647.35
应收款项融资		
合同资产		
买入返售金融资产	24,054,918,493.42	30,610,105,031.38
持有待售资产		
<b>金融投资:</b>		
交易性金融资产	102,807,630,786.12	96,011,751,381.86
债权投资	364,561,914.38	369,052,072.16
其他债权投资	62,424,708,822.02	43,310,479,496.16
其他权益工具投资	8,921,606,230.33	9,435,341,611.23
长期股权投资	13,231,681,389.26	13,159,393,372.52
投资性房地产	42,172,331.83	44,011,973.47
固定资产	601,790,508.15	608,409,847.68
在建工程	126,387,556.14	134,717,768.55
使用权资产	664,549,049.10	674,017,974.03
无形资产	114,634,888.75	119,999,542.78
商誉		
递延所得税资产	1,190,035,381.42	1,077,181,914.65
其他资产	1,608,275,147.56	1,469,521,517.86
资产总计	355,768,593,004.29	313,539,767,107.75
<b>负债:</b>		
短期借款		
应付短期融资款	17,769,280,322.73	17,065,153,234.14
拆入资金	8,999,667,491.83	10,951,073,811.81
交易性金融负债	3,390,359,676.72	0.00
衍生金融负债	685,118,810.62	188,002,525.16
卖出回购金融资产款	88,478,336,402.77	83,079,010,470.52

代理买卖证券款	67,773,811,769.84	53,021,920,336.71
代理承销证券款		
应付职工薪酬	3,006,508,003.52	2,771,566,675.58
应交税费	689,794,475.36	1,123,749,185.74
应付款项	3,067,314,590.29	1,911,123,342.49
合同负债	47,169.81	
持有待售负债		
预计负债		
长期借款	5,001,082,191.78	5,001,082,191.78
应付债券	81,010,018,848.49	66,763,375,614.28
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	679,446,781.92	695,354,743.14
递延收益		
递延所得税负债		
其他负债	2,561,039,948.63	534,322,716.20
负债合计	283,111,826,484.31	243,105,734,847.55
所有者权益（或股东权益）：		
实收资本（或股本）	47,000,000,000.00	47,000,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积	3,023,312,985.09	3,023,312,985.09
减：库存股		
其他综合收益	-1,073,973,062.40	-405,739,020.12
盈余公积	3,085,670,661.04	3,085,670,661.04
一般风险准备	6,017,247,398.66	5,999,976,555.53
未分配利润	14,604,508,537.59	11,730,811,078.66
所有者权益（或股东权益）合计	72,656,766,519.98	70,434,032,260.20
负债和所有者权益（或股东权益）总计	355,768,593,004.29	313,539,767,107.75

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



## 合并利润表

2020年1—6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	2020年半年度	2019年半年度
一、营业总收入	9,243,751,562.56	7,468,468,862.93
利息净收入	1,971,599,064.56	1,333,603,941.16
其中:利息收入	5,327,155,702.64	4,902,086,426.25
利息支出	3,355,556,638.08	3,568,482,485.09
手续费及佣金净收入	3,406,464,080.90	3,253,013,522.96
其中:经纪业务手续费净收入	2,439,940,955.72	2,082,442,655.82
投资银行业务手续费净收入	404,062,802.89	587,090,896.87
资产管理业务及基金管理业务手续费净收入	552,916,863.14	534,716,080.47
投资收益(损失以“-”号填列)	2,768,189,042.70	2,642,180,844.53
其中:对联营企业和合营企业的投资收益	170,717,560.36	102,840,412.81
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益(损失以“-”号填列)		
净敞口套期收益(损失以“-”号填列)		
其他收益	196,227,829.23	16,191,874.37
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	335,937,691.81	198,977,136.35
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-4,931,750.20	-4,939,995.12
其他业务收入	569,300,634.94	29,416,173.02
资产处置收益(损失以“-”号填列)	964,968.62	25,365.66
二、营业总支出	4,409,580,172.48	3,733,389,891.91
税金及附加	64,100,330.32	60,076,392.72
业务及管理费	3,639,754,598.41	3,414,463,285.56
资产减值损失		
信用减值损失	168,795,113.34	256,597,871.38
其他资产减值损失		
其他业务成本	536,930,130.41	2,252,342.25
三、营业利润(亏损以“-”号填列)	4,834,171,390.08	3,735,078,971.02
加:营业外收入	1,224,436.71	4,424,632.01
减:营业外支出	34,204,340.67	15,808,253.60
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	4,801,191,486.12	3,723,695,349.43
减:所得税费用	831,166,171.51	691,251,055.58
五、净利润(净亏损以“-”号填列)	3,970,025,314.61	3,032,444,293.85
(一)按经营持续性分类		
1.持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)	3,970,025,314.61	3,032,444,293.85
2.终止经营净利润(净亏损以“-”号填列)		
(二)按所有权归属分类		

1.归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列）	3,930,606,303.67	3,001,265,246.54
2.少数股东损益（净亏损以“-”号填列）	39,419,010.94	31,179,047.31
六、其他综合收益的税后净额	-586,746,392.76	1,174,253,793.93
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	-604,165,467.36	1,173,795,987.09
（一）不能重分类进损益的其他综合收益	-317,903,591.17	1,138,914,525.70
1.重新计量设定受益计划变动额		
2.权益法下不能转损益的其他综合收益		
3.其他权益工具投资公允价值变动	-317,903,591.17	1,138,914,525.70
4.企业自身信用风险公允价值变动		
（二）将重分类进损益的其他综合收益	-286,261,876.19	34,881,461.39
1.权益法下可转损益的其他综合收益	-7,276,632.07	5,171,264.59
2.其他债权投资公允价值变动	-342,107,517.66	-25,876,143.86
3.金融资产重分类计入其他综合收益的金额		
4.其他债权投资信用损失准备	9,172,055.28	40,192,389.17
5.现金流量套期储备		
6.外币财务报表折算差额	53,950,218.26	15,393,951.49
7.其他		
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	17,419,074.60	457,806.84
七、综合收益总额	3,383,278,921.85	4,206,698,087.78
归属于母公司所有者的综合收益总额	3,326,440,836.31	4,175,061,233.63
归属于少数股东的综合收益总额	56,838,085.54	31,636,854.15
八、每股收益：		
（一）基本每股收益(元/股)	0.08	0.07
（二）稀释每股收益(元/股)	0.08	0.07

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：



母公司利润表

2020年1—6月

编制单位:申万宏源证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	2020年半年度	2019年半年度
一、营业总收入	8,660,044,924.15	6,047,866,005.84
利息净收入	1,356,629,898.55	808,375,411.72
其中:利息收入	4,533,992,000.23	4,201,680,356.83
利息支出	3,177,362,101.68	3,393,304,945.11
手续费及佣金净收入	2,813,617,858.38	2,570,807,210.51
其中:经纪业务手续费净收入	1,969,172,425.57	1,700,650,857.97
投资银行业务手续费净收入	212,114,245.55	272,904,297.52
资产管理业务及基金管理业务手续费净收入	623,349,573.58	563,177,926.34
投资收益(损失以“-”号填列)	3,894,290,791.61	2,490,421,063.30
其中:对联营企业和合营企业的投资收益	179,832,398.81	106,265,041.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益(损失以“-”号填列)		
净敞口套期收益(损失以“-”号填列)		
其他收益	179,740,350.60	9,859,175.24
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	403,741,062.09	159,894,738.44
汇兑收益(损失以“-”号填列)	2,932,215.23	508,280.04
其他业务收入	8,125,776.70	7,974,760.93
资产处置收益(损失以“-”号填列)	966,970.99	25,365.66
二、营业总支出	3,096,440,731.79	2,897,625,756.40
税金及附加	55,388,084.90	53,287,771.48
业务及管理费	2,891,490,303.00	2,634,364,712.44
资产减值损失		
信用减值损失	147,346,358.86	207,720,930.23
其他资产减值损失		
其他业务成本	2,215,985.03	2,252,342.25
三、营业利润(亏损以“-”号填列)	5,563,604,192.36	3,150,240,249.44
加:营业外收入	412,949.50	4,389,908.90
减:营业外支出	32,900,028.93	15,245,306.86
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	5,531,117,112.93	3,139,384,851.48
减:所得税费用	662,152,229.37	564,566,735.61
五、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,868,964,883.56	2,574,818,115.87
(一)持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)	4,868,964,883.56	2,574,818,115.87
(二)终止经营净利润(净亏损以“-”号填列)		
六、其他综合收益的税后净额	-646,230,623.78	1,152,961,929.74
(一)不能重分类进损益的其他综合收益	-317,903,591.17	1,138,914,525.70

1.重新计量设定受益计划变动额		
2.权益法下不能转损益的其他综合收益		
3.其他权益工具投资公允价值变动	-317,903,591.17	1,138,914,525.70
4.企业自身信用风险公允价值变动		
(二) 将重分类进损益的其他综合收益	-328,327,032.61	14,047,404.04
1.权益法下可转损益的其他综合收益	-7,276,632.07	5,171,264.59
2.其他债权投资公允价值变动	-338,456,529.24	-18,842,264.90
3.金融资产重分类计入其他综合收益的金额		
4.其他债权投资信用损失准备	17,406,128.70	27,718,404.35
5.现金流量套期储备		
6.外币财务报表折算差额		
7.其他		
七、综合收益总额	4,222,734,259.78	3,727,780,045.61
八、每股收益：		
(一) 基本每股收益(元/股)	0.10	0.06
(二) 稀释每股收益(元/股)	0.10	0.06

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



## 合并现金流量表

2020年1—6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	2020年半年度	2019年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量:</b>		
销售商品、提供劳务收到的现金		
向其他金融机构拆入资金净增加额		
收取利息、手续费及佣金的现金	7,952,225,807.41	7,870,218,796.30
拆入资金净增加额		8,957,555.62
回购业务资金净增加额	11,686,634,089.77	2,988,238,224.33
代理买卖证券收到的现金净额	19,839,316,885.45	19,069,736,319.66
收到其他与经营活动有关的现金	2,529,433,044.95	3,359,765,220.46
经营活动现金流入小计	42,007,609,827.58	33,296,916,116.37
为交易目的而持有的金融资产净增加额	3,260,281,512.15	727,151,399.64
拆入资金净减少额	1,954,209,351.22	
拆出资金净增加额		
融出资金净增加额	9,264,454,972.14	5,692,845,189.55
返售业务资金净增加额		
支付利息、手续费及佣金的现金	2,091,066,349.19	2,237,246,600.10
支付给职工及为职工支付的现金	2,768,286,150.50	2,614,727,585.27
支付的各项税费	1,646,767,988.06	716,604,539.77
支付其他与经营活动有关的现金	4,660,249,359.79	3,578,649,510.16
经营活动现金流出小计	25,645,315,683.05	15,567,224,824.49
经营活动产生的现金流量净额	16,362,294,144.53	17,729,691,291.88
<b>二、投资活动产生的现金流量:</b>		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金	1,400,572,783.61	209,104,728.82
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	6,725,807.95	3,130,252.63
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		
收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计	1,407,298,591.56	212,234,981.45
投资支付的现金	18,959,834,009.89	354,755,002.96
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	83,194,491.94	74,347,965.70
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计	19,043,028,501.83	429,102,968.66
投资活动产生的现金流量净额	-17,635,729,910.27	-216,867,987.21

三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金		4,000,000,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		
取得借款收到的现金	4,007,579,157.12	504,343,460.10
发行债券收到的现金	57,977,759,995.66	33,756,618,558.12
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计	61,985,339,152.78	38,260,962,018.22
偿还债务支付的现金	43,392,206,042.00	31,745,252,055.41
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,263,454,655.61	3,871,038,245.11
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润	10,712,219.82	6,755,443.39
支付其他与筹资活动有关的现金		
支付租赁负债的现金	192,234,100.97	160,489,870.32
筹资活动现金流出小计	45,847,894,798.58	35,776,780,170.84
筹资活动产生的现金流量净额	16,137,444,354.20	2,484,181,847.38
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-4,931,750.20	-4,939,995.12
五、现金及现金等价物净增加额	14,859,076,838.26	19,992,065,156.93
加：期初现金及现金等价物余额	97,311,190,718.60	95,731,656,899.96
六、期末现金及现金等价物余额	112,170,267,556.86	115,723,722,056.89

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



申万宏源  
母公司现金流量表

2020年1-6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	2020年半年度	2019年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量:</b>		
销售商品、提供劳务收到的现金		
向其他金融机构拆入资金净增加额		
收取利息、手续费及佣金的现金	5,890,781,782.80	5,886,750,049.60
拆入资金净增加额		8,957,555.62
回购业务资金净增加额	18,070,343,660.21	
代理买卖证券收到的现金净额	14,929,393,001.07	18,013,478,181.39
收到其他与经营活动有关的现金	31,353,999.60	589,965,818.57
经营活动现金流入小计	38,921,872,443.68	24,499,151,605.18
为交易目的而持有的金融资产净增加额	1,771,144,381.71	2,808,398,927.27
拆出资金净增加额		
拆入资金净减少额	1,954,209,351.22	
返售业务资金净增加额		
回购业务资金净减少额		1,451,819,531.23
融出资金净增加额	7,044,569,206.14	5,038,580,729.68
支付利息、手续费及佣金的现金	1,849,513,214.87	1,935,806,467.77
支付给职工及为职工支付的现金	2,013,456,489.52	1,999,633,095.36
支付的各项税费	1,079,901,595.74	1,138,967,404.16
支付其他与经营活动有关的现金	1,088,002,224.20	15,685,132.65
经营活动现金流出小计	16,800,796,463.40	14,388,891,288.12
经营活动产生的现金流量净额	22,121,075,980.28	10,110,260,317.06
<b>二、投资活动产生的现金流量:</b>		
收回投资收到的现金		1,584,641,347.17
取得投资收益收到的现金	2,622,949,503.03	966,075,539.23
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	5,929,130.02	
收到其他与投资活动有关的现金		7,726,712.72
投资活动现金流入小计	2,628,878,633.05	2,558,443,599.12
投资支付的现金	18,546,694,667.34	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	80,042,090.59	66,431,120.71
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计	18,626,736,757.93	66,431,120.71
投资活动产生的现金流量净额	-15,997,858,124.88	2,492,012,478.41
<b>三、筹资活动产生的现金流量:</b>		
吸收投资收到的现金		4,000,000,000.00

取得借款收到的现金		
发行债券收到的现金	57,987,862,000.00	33,757,167,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流入小计	57,987,862,000.00	37,757,167,000.00
偿还债务支付的现金	42,664,483,000.00	31,277,239,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,226,886,105.14	3,920,215,514.27
支付租赁负债的现金	19,018,156.56	125,423,704.65
支付其他与筹资活动有关的现金		
筹资活动现金流出小计	44,910,387,261.70	35,322,878,218.92
筹资活动产生的现金流量净额	13,077,474,738.30	2,434,288,781.08
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	2,932,215.23	508,280.04
五、现金及现金等价物净增加额	19,203,624,808.93	15,037,069,856.59
加：期初现金及现金等价物余额	71,656,753,511.61	69,779,574,609.61
六、期末现金及现金等价物余额	90,860,378,320.54	84,816,644,466.20

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



合并所有者权益变动表

2020年1—6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	归属于母公司所有者权益						少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本	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		
2019年12月31日余额	47,000,000,000.00	3,273,875,823.46	-329,172,052.11	3,085,670,661.04	7,234,747,796.18	15,539,264,834.45	1,574,163,652.67	77,378,550,715.69
加: 会计政策变更								
2020年1月1日余额	47,000,000,000.00	3,273,875,823.46	-329,172,052.11	3,085,670,661.04	7,234,747,796.18	15,539,264,834.45	1,574,163,652.67	77,378,550,715.69
本期增减变动金额								
1.综合收益总额			-604,165,467.36			3,930,606,303.67	56,838,085.54	3,383,278,921.85
2.所有者投入和减少资本								
-所有者投入的普通股								
3.利润分配								
-提取盈余公积								
-提取一般风险准备					26,907,235.09	-26,907,235.09		
-对所有者的分配						-2,000,000,000.00	-10,712,219.81	-2,010,712,219.81
4.所有者权益内部结转								
-其他综合收益结转留存收益			-22,003,418.50			22,003,418.50		
2020年6月30日余额	47,000,000,000.00	3,273,875,823.46	-955,340,937.97	3,085,670,661.04	7,261,655,031.27	17,464,967,321.53	1,620,289,518.40	78,751,117,417.73

法定代表人:



主管会计工作负责人:



会计机构负责人:



合并所有者权益变动表

2019年1-6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	归属于母公司所有者权益						少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本	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		
2018年12月31日余额	43,000,000,000.00	3,009,372,679.20	-1,479,862,183.67	2,594,585,920.60	6,043,431,429.26	13,508,948,529.72	1,748,028,377.52	68,424,504,752.63
加: 会计政策变更								
2019年1月1日余额	43,000,000,000.00	3,009,372,679.20	-1,479,862,183.67	2,594,585,920.60	6,043,431,429.26	13,508,948,529.72	1,748,028,377.52	68,424,504,752.63
本期增减变动金额								
1.综合收益总额			1,173,795,987.09			3,001,265,246.54	31,636,854.15	4,206,698,087.78
2.所有者投入和减少资本								
-所有者投入的普通股	4,000,000,000.00							4,000,000,000.00
-收购子公司非控股权 益		264,503,144.26					-264,503,144.26	
3.利润分配								
-提取盈余公积								
-提取一般风险准备					7,480,886.58	-7,480,886.58		
-对所有者的分配						-2,000,000,000.00	-6,755,443.38	-2,006,755,443.38
4.所有者权益内部结转								
-其他综合收益结转留 存收益			-150,095,622.35			150,095,622.35		
2019年6月30日余额	47,000,000,000.00	3,273,875,823.46	-456,161,818.93	2,594,585,920.60	6,050,912,315.84	14,652,828,512.03	1,508,406,644.03	74,624,447,397.03

法定代表人:



主管会计工作负责人:



会计机构负责人:



母公司权益变动表

2020年1-6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	实收资本	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	所有者权益合计
2019年12月31日余额	47,000,000,000.00	3,023,312,985.09	-405,739,020.12	3,085,670,661.04	5,999,976,555.53	11,730,811,078.66	70,434,032,260.20
加:会计政策变更							
2020年1月1日余额	47,000,000,000.00	3,023,312,985.09	-405,739,020.12	3,085,670,661.04	5,999,976,555.53	11,730,811,078.66	70,434,032,260.20
本期增减变动金额							
1.综合收益总额			-646,230,623.78			4,868,964,883.56	4,222,734,259.78
2.所有者投入资本							
-所有者投入的普通股							
3.利润分配							
-提取盈余公积							
-提取一般风险准备					17,270,843.13	-17,270,843.13	
-对所有者的分配						-2,000,000,000.00	-2,000,000,000.00
4.所有者权益内部结转							
-其他综合收益结转留存收益			-22,003,418.50			22,003,418.50	
2020年6月30日余额	47,000,000,000.00	3,023,312,985.09	-1,073,973,062.40	3,085,670,661.04	6,017,247,398.66	14,604,508,537.59	72,656,766,519.98

法定代表人:



主管会计工作负责人:



会计机构负责人:



母公司权益变动表

2019年1—6月

编制单位:申万宏源证券有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	实收资本	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	所有者权益合计
2018年12月31日余额	43,000,000,000.00	3,023,312,985.09	-1,479,480,525.22	2,594,585,920.60	4,953,300,393.88	10,239,258,418.27	62,330,977,192.62
加:会计政策变更							
2019年1月1日余额	43,000,000,000.00	3,023,312,985.09	-1,479,480,525.22	2,594,585,920.60	4,953,300,393.88	10,239,258,418.27	62,330,977,192.62
本期增减变动金额							
1.综合收益总额			1,152,961,929.74			2,574,818,115.87	3,727,780,045.61
2.所有者投入资本							
-所有者投入的普通股	4,000,000,000.00						4,000,000,000.00
3.利润分配							
-提取盈余公积							
-提取一般风险准备							
-对所有者的分配						-2,000,000,000.00	-2,000,000,000.00
4.所有者权益内部结转							
-其他综合收益结转留存收益			-150,095,622.35			150,095,622.35	
2019年6月30日余额	47,000,000,000.00	3,023,312,985.09	-476,614,217.83	2,594,585,920.60	4,953,300,393.88	10,964,172,156.49	68,058,757,238.23

法定代表人:



主管会计工作负责人:



会计机构负责人:



## 合并财务报表重要项目的说明

### (一) 货币资金

#### 1 按币种列示

2020年6月30日

	原币金额	折算汇率	人民币金额
现金			574,682.46
其中：人民币	318,370.93	1.00	318,370.93
美元	18,324.92	7.08	129,731.18
港币	62,639.26	0.91	57,217.20
其他币种			69,363.15
银行存款			87,175,356,057.61
其中：自有资金			12,349,261,430.22
其中：人民币	11,201,944,067.94	1.00	11,201,944,067.94
美元	94,132,525.73	7.08	666,410,853.60
港币	491,676,311.36	0.91	449,116,786.48
其他币种			31,789,722.19
其中：客户资金			74,826,094,627.39
其中：人民币	69,495,575,978.87	1.00	69,495,575,978.87
美元	339,618,519.04	7.08	2,404,327,998.41
港币	3,177,836,259.56	0.91	2,902,762,601.90
其他币种			23,428,048.21
其他货币资金	162,544,768.81	1.00	162,544,768.81
其中：人民币	162,544,768.81	1.00	162,544,768.81
小计			87,338,475,508.88
加：应收利息			26,800,280.51
减：减值准备			(2,471,182.61)
合计			87,362,804,606.78



申万  
万忠

其中，融资融券业务

2020年6月30日

	原币金额	折算汇率	人民币金额
自有信用资金			10,078,862,278.17
其中：人民币	9,084,384,564.81	1.00	9,084,384,564.81
美元	75,708,302.49	7.08	535,976,636.09
港币	467,071,744.32	0.91	426,641,991.94
其他币种			31,859,085.34
客户信用资金			4,205,809,877.40
其中：人民币	468,080,782.27	1.00	468,080,782.27
美元	126,621,236.06	7.08	896,414,553.37
港币	3,084,917,060.95	0.91	2,817,886,493.54
其他币种			23,428,048.21
小计			14,284,672,155.57
加：应收利息			
合计			14,284,672,155.57

## 2 受限制的货币资金

2020年6月30日

证券层面一般风险准备	55,121,360.35
基金公司一般风险准备	397,024,890.36
——其他货币资金-申购证券冻结款	161,315,514.17
合计	613,461,764.88

## (二) 结算备付金

2020年6月30日

	原币金额	折算汇率	人民币金额
公司自有备付金			4,119,888,324.28
其中：人民币	3,577,982,479.59	1.00	3,577,982,479.59
美元	57,654,596.05	7.08	408,165,490.84
港币	138,429,929.56	0.91	126,447,428.28
其他			7,292,925.56
公司信用备付金			437,946,144.20
其中：人民币	372,256,052.69	1.00	372,256,052.69
美元	4,566,614.49	7.08	32,329,329.70
港币	36,522,118.09	0.91	33,360,761.81
客户普通备付金			8,708,405,862.54
其中：人民币	7,872,018,303.25	1.00	7,872,018,303.25
美元	98,322,501.44	7.08	696,073,770.55
港币	153,610,303.95	0.91	140,313,788.74
其他币种			-
客户信用备付金			1,421,453,330.15
其中：人民币	1,421,453,330.15	1.00	1,421,453,330.15
美元			
港币			
其他币种			
小计			14,687,693,661.17
加：应收利息			
合计			14,687,693,661.17

### (三) 融出资金

#### 1 按客户类别列示

	2020年6月30日
境内	
其中：个人	48,206,794,872.47
机构	10,691,134,821.95
小计	58,897,929,694.42
加：应收利息	1,459,677,221.08
减：减值准备	(186,232,965.43)
账面价值小计	60,171,373,950.07
	-----
境外	
其中：个人	1,411,930,215.78
机构	808,522,332.75
减：减值准备	(7,152,165.18)
账面价值小计	2,213,300,383.35
	-----
账面价值合计	62,384,674,333.42

#### 2 担保物公允价值

	2020年6月30日
货币资金	12,820,005,286.13
债券	285,914,188.81
股票	189,087,192,762.57
基金	2,976,107,906.41
合计	205,169,220,143.92

#### （四）交易性金融资产

##### 1 按类别列示

2020年6月30日

	初始成本	公允价值
债券	75,292,704,705.59	77,166,691,300.95
公募基金	19,539,161,746.78	19,432,607,614.20
股票	3,947,542,905.27	3,802,490,316.68
银行理财产品	723,715,495.36	723,880,788.53
券商资管产品	1,705,154,028.73	1,517,115,410.52
信托计划	1,546,512,443.22	1,549,885,349.99
贵金属	371,155,667.40	374,445,000.00
其他	10,470,045,128.13	10,980,019,051.47
合计	113,595,992,120.48	115,547,134,832.34

##### 2 交易性金融资产中已融出证券情况

本集团交易性金融资产余额中包含融出证券，详细信息参见附注（十二）。本集团融出证券的担保物信息参见附注（三）。

##### 3 存在限售期及承诺条件的交易性金融资产

于2020年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币423,449,462.92元的股票投资存在限售期限。

于2020年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币45,113,129,779.49元的债券投资为卖出回购业务设定质押。

本集团卖出回购业务的情况参见附注（二十六）。

于2020年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币4,470,882,022.77元的债券投资为债券借贷业务设定质押。

(五) 衍生金融资产和衍生金融负债

	名义金额	2020年6月30日	
		非套期工具	
		资产	公允价值 负债
利率衍生工具			
- 国债期货	2,235,941,500.00	7,117,700.00	-
- 利率互换	105,680,000,000.00	-	(182,092,538.91)
权益衍生工具			
- 股指期货	3,388,809,320.00	101,397,540.00	-
- 收益凭证	2,932,338,000.00	-	(11,066,744.06)
- 场内期权	224,334,140.00	38,862,532.00	(106,015,137.00)
- 其他场外工具	99,997,553,726.93	359,017,064.61	(500,813,831.27)
商品衍生工具			
- 商品期权	2,474,648,486.12	12,991,601.17	(26,183,782.74)
- 黄金延期交易	6,867,978,840.00	-	(49,973,401.00)
- 黄金远期交易	5,066,652,260.00	-	(45,204,965.29)
- 其他商品期货	6,558,767,618.88	44,705,265.00	(15,383,780.00)
合计	<b>235,427,023,891.93</b>	<b>564,091,702.78</b>	<b>(936,734,180.27)</b>
减：以现金（收取）/ 支付作为结算		(153,220,505.00)	247,449,719.91
净头寸		<b>410,871,197.78</b>	<b>(689,284,460.36)</b>

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本集团所持有的国债期货、利率互换、股指期货、贵金属期货和其他商品期货产生的公允价值变动金额。因此，衍生金融资产和衍生金融负债项下的国债期货、利率互换、股指期货、贵金属期货和其他商品期货投资按抵销相关暂收暂付款后的净额列示。

## (六) 买入返售金融资产

### 1 按业务类别列示

	注	2020年6月30日
股票质押式回购	(i)	21,252,659,567.00
债券质押式回购		12,014,126,637.11
债券买断式回购		
约定购回式证券		
小计		33,266,786,204.11
加：应收利息		52,658,122.46
减：减值准备		(853,771,989.89)
合计		32,465,672,336.68

(i) 于 2020 年 6 月 30 日，股票质押式回购中剩余到期日一年以上的账面余额为人民币 5,634,165,112.09 元。

### 2 按金融资产种类列示

	2020年6月30日
股票	21,252,659,567.00
债券	12,014,126,637.11
小计	33,266,786,204.11
加：应收利息	52,658,122.46
减：减值准备	(853,771,989.89)
合计	32,465,672,336.68

### 3 担保物余额

	2020年6月30日
担保物	56,818,121,614.03
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	-
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	-

对于通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因此无法获知对手方质押库信息，故上述担保物公允价值未包括交易所国债逆回购所取得的担保物资产的公允价值。

于 2020 年 6 月 30 日，上述交易所国债逆回购的金额为人民币 3,643,700,001.00 元。

## (七) 应收款项

### 1 按明细列示

	2020年6月30日
证券清算款	2,229,780,131.07
资产管理费	1,966,101,805.18
手续费及佣金	225,983,843.06
逾期应收款	37,820,340.70
小计	4,459,686,120.01
减：坏账准备	328,821,491.37
合计	4,130,864,628.64

### 2 按账龄分析

	2020年6月30日			
	账面余额	比例	坏账准备	计提比例
	金额		金额	
人民币元	(%)	人民币元	(%)	
1年以内	4,123,124,289.92	92.45%	(227,022,149.88)	5.51%
1-2年	237,484,804.99	5.33%	(50,792,066.91)	21.39%
2-3年	35,085,167.02	0.79%	(7,017,033.41)	20.00%
3年以上	63,991,858.08	1.43%	(43,990,241.17)	68.74%
合计	4,459,686,120.01	100.00%	(328,821,491.37)	7.37%

### 3 本年计提、收回或转回的坏账准备情况

	2020年6月30日
原金融工具准则下的余额首次执行新金融工具准则的调整金额	-
调整后的年初余额	262,599,975.66
本年计提	66,221,515.71
本年收回或转回	
本年核销	
年末余额	328,821,491.37

(i) 本年坏账准备收回或转回金额重要的  
本集团本年无重要的坏账准备收回或转回情况。

(ii) 本年重要的应收账款核销情况

本集团本年无重要的应收款项核销情况。

4 按欠款方归集的期末余额前五名的应收款项情况

	性质	2020年6月30日		占应收款项总额的比例
		金额 人民币元	账龄	
申万宏源证券恒赢1号集合资产管理计划	资产管理业务款	193,000,000.00	1年以内	4.33%
宏源证券天添利现金集合资产管理计划	资产管理业务款	111,190,000.00	1年以内	2.49%
申万宏源灵通丰利360天11003号集合资产管理计划	资产管理业务款	85,075,802.13	1-2年	1.91%
宏源证券宏源10号股债双鑫集合资产管理计划N类	资产管理业务款	82,718,538.36	1年以内 /1-2年/2-3年	1.85%
申万宏源灵通尊利720天04001号集合资产管理计划	资产管理业务款	73,500,000.00	1年以内	1.65%
合计		545,484,340.49		12.23%

## (八) 存出保证金

2020年6月30日

	原币金额	折算汇率	人民币金额
交易保证金			7,669,288,580.92
其中：人民币	7,642,205,831.86	1.00	7,642,205,831.86
美元	540,000.29	7.08	3,822,930.00
港币	24,907,982.60	0.91	22,751,946.44
其他币种			507,872.61
信用保证金			80,220,732.32
其中：人民币	78,698,079.99	1.00	78,698,079.99
港币	1,666,943.00	0.91	1,522,652.33
履约保证金			682,098,722.71
其中：人民币	862,436,518.02	0.79	682,098,722.71
转融通保证金			57,563,545.22
其中：人民币	57,563,545.22	1.00	57,563,545.22
小计			8,489,171,581.17
加：应收利息			
合计			<b>8,489,171,581.17</b>

(九) 债权投资

	初始成本	2020年6月30日		账面价值
		利息	减值准备	
资产管理计划与信 托计划等	853,802,734.82	-	(383,993,127.00)	469,809,607.82
企业债	2,017,038,794.65	41,797,738.25	(13,610,965.60)	2,045,225,567.30
合计	<b>2,870,841,529.47</b>	<b>41,797,738.25</b>	<b>(397,604,092.60)</b>	<b>2,515,035,175.12</b>

## (十) 其他债权投资

### 1 按类别列示

	初始成本	利息	<u>2020年6月30日</u> 公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	3,532,818,560.24	30,152,278.27	(112,152,370.24)	3,450,818,468.27	-
地方债	6,282,531,755.37	114,222,160.57	(734,451.37)	6,396,019,464.57	(7,183,197.40)
金融债	2,359,307,113.12	24,485,000.85	(44,601,263.12)	2,339,190,850.85	(263,659.14)
企业债	8,343,596,721.13	190,963,047.57	(21,729,174.71)	8,512,830,593.99	(17,348,777.40)
中期票据	7,171,100,148.25	100,566,676.13	(59,960,738.25)	7,211,706,086.13	(12,113,196.16)
公司债	22,717,842,858.25	642,621,923.61	(253,502,930.09)	23,106,961,851.77	(239,777,598.22)
其他	11,260,371,295.35	286,101,265.41	91,520,654.99	11,637,993,215.75	(17,717,311.66)
合计	<b>61,667,568,451.71</b>	<b>1,389,112,352.41</b>	<b>(401,160,272.79)</b>	<b>62,655,520,531.33</b>	<b>(294,403,739.98)</b>

### 2 存在承诺条件的其他债权投资

于2020年6月30日，本集团其他债权投资中有人民币26,566,762,151.90元的债券投资为卖出回购业务设定质押。

于2020年6月30日，本集团其他债权投资中有人民币9,833,242,939.15元的债券投资为债券借贷业务设定质押。

(十一) 其他权益工具投资

2020年6月30日

	初始成本	本期末公允价值
非交易性权益工具	10,246,598,358.81	8,921,606,230.33

于2020年6月30日，以上其他权益工具投资中包括本集团与其他若干家证券公司投资于证金公司设立的专户投资。该专户由本集团与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险分享投资收益，由证金公司进行统一运作与投资管理。本集团出于非交易性目的对该专户等投资进行管理，并将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，在其他权益工具投资科目核算。于2020年6月30日，本集团根据证金公司提供的资产报告确定上述投资的年末公允价值为人民币6,359,057,338.94元。

于2020年6月30日，本集团其他权益工具投资中有人民币328,762,086.00元非交易性权益工具投资为转融通融入资金业务设定质押。本集团转融通融入资金业务的情况参见附注(二十四)。

## (十二) 融出证券

### (1) 按项目分析

	注	2020年6月30日
交易性金融资产		418,362,764.80
其他权益工具投资		291,554,243.96
转融通融入证券		728,896,572.29
融出证券总额	(i)	1,438,813,581.05
转融通融入证券总额		1,016,586,620.65

(i) 融出证券的担保情况参见附注（三）。

### (2) 融券业务违约情况

于2020年6月30日，本集团融券业务无重大合约逾期。

(十三) 长期股权投资

(1) 按类别列示

	2020年6月30日
对合营企业的投资	
- 不重要的合营企业	60,828,440.39
对联营企业的投资	
- 重要的联营企业	1,168,390,170.53
- 不重要的联营企业	54,477,239.83
小计	1,283,695,850.75
减：减值准备	
- 合营企业	-
- 联营企业	-
合计	<b>1,283,695,850.75</b>

(2) 长期股权投资明细情况

合营企业		2020年增减变动								
被投资单位	年初余额	追加投资	减少投资	权益法下确认的投资收益	其他综合收益	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他	年末余额
珠海申宏格金医疗健康产业投资基金合伙企业(有限合伙)	49,151,305.30			582,951.35						49,734,256.65
上海申万宏源嘉实股权投资合伙企业(有限合伙)	10,829,336.88		(3,206,560.56)	2,629,971.30						10,252,747.62
厦门市象屿泓鼎现代物流投资合伙企业(有限合伙)	16,283,448.35		(4,350,000.00)	(11,092,012.23)						841,436.13
小计	76,264,090.53		(7,556,560.56)	(7,879,089.58)	-	-	-	-	-	60,828,440.39

联营企业

2020 年增减变动

被投资单位	年初余额	追加投资	减少投资	权益法下确认的投资收益	其他综合收益	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他	年末余额
富国基金管理有限公司	1,096,102,153.79			179,832,398.80	(7,276,632.06)		(100,267,750.00)			1,168,390,170.53
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	54,712,988.70			(1,235,748.87)		-				53,477,239.83
重庆市富荣股权投资基金合伙企业（有限合伙）	1,000,000.00									1,000,000.00
小计	1,151,815,142.49			178,596,649.93	(7,276,632.06)	-	(100,267,750.00)	-	-	1,222,867,410.36
合计	1,228,079,233.02	-	(7,556,560.56)	170,717,560.35	(7,276,632.06)		(100,267,750.00)	-	-	1,283,695,850.75

(3) 合营企业基本情况

合营企业	注册地及 主要经营地	业务性质	实收资本	持有权益比例	
				直接	间接
珠海申宏格金医疗健康产业投资基金-本年新增	珠海	股权投资		0	25.00%
上海申万宏源嘉实股权投资合伙企业(有限合伙)	上海	股权投资		-	31.00%
厦门市象屿泓鼎现代物流合伙企业(有限合伙)	厦门	股权投资			50.00%

(4) 联营企业基本情况

联营企业	注册地及 主要经营地	业务性质	实收资本	持有权益比例	
				直接	间接
富国基金管理有限公司	上海	基金管理		27.78%	
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金合伙企业(有限合伙)-新增	嘉兴	股权投资			13.16%
重庆市富荣股权投资基金合伙企业(有限合伙)-新增	重庆	股权投资			2.00%

(5) 重要联营企业的主要财务信息

	富国基金管理有限公司 2020年6月30日
资产总额	5,849,431,883.77
负债总额	(1,642,806,607.30)
净资产	4,206,625,276.47
持股比例	27.775%
按持股比例计算的净资产份额	1,168,390,170.53
减：减值准备	-
其他调整	0.00
对联营企业投资的账面价值	1,168,390,170.53
营业收入	1,987,894,426.51
净利润	628,484,848.95
其他综合收益	2,314,961.63
其他调整	9,536,923.99
综合收益总额	621,262,886.59
本年收到的来自联营企业的股利	100,267,750.00

(6) 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

合营企业：	
投资账面价值合计	60,828,440.39
下列各项按持股比例计算的合计数	
- 净利润	(7,879,089.58)
- 其他综合收益	-
综合收益总额	(7,879,089.58)
联营企业：	
投资账面价值合计	54,477,239.83
下列各项按持股比例计算的合计数	
- 净利润	(1,235,748.87)
- 其他综合收益	-
综合收益总额	(1,235,748.87)

#### (十四) 投资性房地产

采用成本法计量的投资性房地产：

	房屋及建筑物
成本	
2019年1月1日余额	
本年增加	
本年减少	
2019年12月31日余额	91,019,200.94
本期增加	-
本期减少	-
2020年6月30日余额	91,019,200.94
减：累计折旧	
2019年1月1日余额	
本年转入	
本年增加	
本年减少	
2019年12月31日余额	(47,007,227.47)
本期转入	
本期增加	(1,839,641.64)
本期减少	
2020年6月30日余额	(48,846,869.11)
账面价值	
2020年6月30日余额	42,172,331.83
2019年12月31日余额	44,011,973.47

于2020年6月30日，本集团认为投资性房地产无需计提减值准备。

于2020年6月30日，本集团投资性房地产无尚未办妥产权证的情况。

(十五) 固定资产

(1) 账面价值

	2020年6月30日
固定资产原价	2,293,129,088.48
减：累计折旧	(1,631,343,536.58)
固定资产减值准备	(283,970.97)
合计	661,501,580.92

(2) 固定资产增减变动表

	房屋及建筑物	运输工具	机械动力设备	电子电器设备	其他设备	自有固定资产装 修	合计
成本							
2019年1月1日							
本年增加	-	-	-	-	-	-	-
- 本年购置							
- 投资性房地产/							
在建工程转入							
本年减少	-	-	-	-	-	-	-
- 转让和出售							
- 清理报废							
- 本年转出							
2019年12月31日余额	930,859,639.04	94,782,931.57	20,836,359.33	1,079,583,034.14	75,041,972.16	71,265,948.70	2,272,369,884.94
本年增加	903,045.31	1,826,149.65	104,000.00	50,172,856.02	1,265,611.88	-	54,271,662.86
- 本年购置	903,045.31	1,826,149.65	104,000.00	17,109,422.20	1,265,611.88	-	21,208,229.04
- 投资性房地产/							
在建工程转入	-	-	-	33,063,433.82	-	-	33,063,433.82
本年减少	-	(9,889,290.60)	(1,050,740.20)	(20,478,629.84)	(1,692,408.71)	(405,796.06)	(33,516,865.41)
- 转让和出售	-	(3,161,136.30)	-	(1,264,973.39)	(7,740.00)	(405,796.06)	(4,839,645.75)
- 清理报废	-	(6,728,154.30)	(1,050,740.20)	(19,213,656.45)	(1,684,668.71)	-	(28,677,219.66)
- 转出到投资							
性房地产	-	-	-	-	-	-	-
2020年06月30日余额	931,762,684.35	86,719,790.62	19,889,619.13	1,109,277,260.32	74,615,175.33	70,860,152.64	2,293,124,682.39
减：累计折旧							
2019年1月1日余额							
本年转入							

本年计提								
本年减少								
2019年12月31日余额	(492,304,942.55)	(82,967,975.62)	(16,962,936.25)	(881,686,658.88)	(69,101,502.15)	(54,947,065.72)	(1,597,971,081.17)	
本年转入								
本年计提	(14,887,366.59)	(2,542,351.62)	(407,987.51)	(35,560,337.23)	(3,543,691.71)	(4,182,340.75)	(61,124,075.41)	
本年减少	-	9,064,440.67	740,604.43	16,007,877.71	1,577,886.80	365,216.47	27,756,026.08	
2020年6月30日余额	(507,192,309.14)	(76,445,886.57)	(16,630,319.33)	(901,239,118.40)	(71,067,307.06)	(58,764,190.00)	(1,631,339,130.50)	
减：减值准备								
2019年1月1日余额								
2019年12月31日余额	(283,970.97)	-	-	-	-	-	(283,970.97)	
2020年06月30日余额	(283,970.97)	-	-	-	-	-	(283,970.97)	
账面价值								
2020年06月30日	424,286,404.24	10,273,904.05	3,259,299.80	208,038,141.92	3,547,868.27	12,095,962.64	661,501,580.92	
2019年12月31日	438,270,725.52	11,814,955.95	3,873,423.08	197,896,375.26	5,940,470.01	16,318,882.98	674,114,832.80	

(3) 暂时闲置的固定资产情况

于 2020 年 6 月 30 日，本集团无闲置的重大固定资产。

(4) 通过融资租赁租入的固定资产情况

于 2020 年 6 月 30 日，本集团无通过融资租赁租入的重大固定资产。

(5) 通过经营租赁租出的固定资产的情况

于 2020 年 6 月 30 日，本集团无通过经营租赁租出的重大固定资产。

(6) 未办妥产权证书的固定资产情况

于 2020 年 6 月 30 日，本集团尚未办妥产权证书的固定资产账面价值为人民币 11,143,475.94 元。

## (十六) 在建工程

### (1) 在建工程账面价值

2020年6月30日

	账面余额	减值准备	账面价值
自有房产装修工程	29,036,237.63	-	29,036,237.63
租入房产装修工程	81,143,484.96	-	81,143,484.96
无形资产开发支出	12,852,645.91	-	12,852,645.91
其他	17,088,166.93	-	17,088,166.93
合计	140,120,535.43	-	140,120,535.43

### (2) 在建工程项目变动情况

	资金来源	期初余额	本期增加	本期减少		期末余额
				本期转入固定资产	其他减少	
自有房产装修工程	自有	28,246,794.60	789,443.03	-	-	29,036,237.63
租入房产装修工程	自有	76,804,865.16	82,455,205.84	-	-78,116,586.04	81,143,484.96
无形资产开发支出	自有	8,541,030.68	4,966,414.51	-	-654,799.28	12,852,645.91
其他	自有	30,572,971.80	19,575,830.53	-33,063,433.82	2,798.42	17,088,166.93
合计		144,165,662.24	107,786,893.91	-33,063,433.82	-78,768,586.90	140,120,535.43

## (十七) 无形资产

### 无形资产增减变动表

	计算机软件	其他	合计
成本			
2019年1月1日余额			
本年增加			
本年减少			
2019年12月31日余额	521,935,756.63	319,676,795.94	841,612,552.57
本期增加	30,166,660.80	74,380.94	30,241,041.74
本期减少	-	-	-
2020年6月30日余额	552,102,417.43	319,751,176.88	871,853,594.31
减：累计折旧			
2019年1月1日余额			
本年增加			
本年减少			
2019年12月31日余额	(400,076,706.77)	(300,588,106.99)	(700,664,813.76)
本期增加	(36,881,199.22)	(1,093,147.56)	(37,974,346.78)
本期减少	-	-	-
2020年6月30日余额	(436,957,905.99)	(301,681,254.55)	(738,639,160.54)
减值准备			
2019年12月31日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
2020年6月30日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
账面价值			
2020年6月30日余额	115,144,511.44	17,394,342.41	132,538,853.85
2019年12月31日余额	121,859,049.85	18,413,109.04	140,272,158.89

于2020年6月30日，本集团无用于抵押或担保的重大无形资产。

(十八) 新租赁准则影响

(1) 使用权资产

	使用权资产
成本	
2020年1月1日	1,133,126,129.88
本期新增	136,637,440.84
本期转入	(49,224,666.32)
本期减少	
2020年6月30日	1,220,538,904.40
累计折旧	
2020年1月1日	(291,702,830.24)
本期计提	(165,948,088.22)
本期减少	38,082,649.62
2020年6月30日	(419,568,268.84)
使用权资产净值	
2020年6月30日	800,970,635.55
2020年1月1日	841,423,299.64

(2) 租赁负债

	租赁负债
一年内到期的流动负债	
2020年6月30日	350,678,624.64
一年以上的非流动负债	
2020年6月30日	463,813,833.51
合计	
2020年6月30日	814,492,458.15

## （十九） 递延所得税资产及负债

于资产负债表日，列示在资产负债表中的递延所得税资产和负债净额：

	2020年6月30日
递延所得税资产	1,353,694,125.09
递延所得税负债	(3,003,042.31)
净额	1,350,691,082.78

### （1） 递延所得税资产及负债总额

未经抵销的递延所得税资产

		2020年6月30日
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	1,636,561,795.33	409,140,448.83
公允价值变动	1,612,129,093.52	403,032,273.38
已计提尚未支付的工资及奖金	2,045,022,320.92	511,255,580.23
其他	125,074,579.33	30,265,822.65
小计	<b>5,418,787,789.10</b>	<b>1,353,694,125.09</b>
互抵金额		
互抵后金额	5,418,787,789.10	1,353,694,125.09

未经抵销的递延所得税负债

		2020年6月30日
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
公允价值变动	(13,282,860.07)	(2,077,650.86)
其他	(5,608,433.02)	(925,391.45)
小计	<b>(18,891,293.09)</b>	<b>(3,003,042.31)</b>
互抵金额	-	-
互抵后金额	(18,891,293.09)	(3,003,042.31)

### （2） 未确认递延所得税资产明细

	2020年6月30日
未确认暂时性差异	6,254,278.33
可抵扣亏损	37,901,739.38
合计	44,156,017.71

### （3） 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的到期情况

年份	2020年6月30日
2020年	-
2021年	-
2022年	-
2023年	-
2024年	-
2025年	37,901,739.38
合计	<b>37,901,739.38</b>

(二十) 其他资产

2020年6月30日

	注	
其他应收款	(i)	397,236,449.24
预付款项		188,643,516.63
长期待摊费用	(ii)	80,801,620.70
待摊费用		6,705,553.23
抵债资产		1,000,000.00
应收股利		-
待抵扣税项		34,587,382.69
应收利息		46,513,695.85
存货		154,475,959.42
其他		60,673,017.57
合计		970,637,195.33

(i) 其他应收款

(a) 按明细列示

	本期末
其他应收款余额	590,068,457.58
减：坏账准备	192,832,008.34
合计	397,236,449.24

(b) 按账龄分析

	本期末		计提比例	
	账面余额金额 人民币元	比例 (%)	坏账准备金额 人民币元	例 (%)
1年以内	321,156,919.64	54.43%	1,101,749.17	0.34%
1-2年	36,899,591.42	6.25%	873,000.24	2.37%
2-3年	18,858,699.45	3.20%	789,986.80	4.19%
3年以上	213,153,247.07	36.12%	190,067,272.13	89.17%
合计	590,068,457.58	100.00%	192,832,008.34	32.68%

(c) 本年计提、收回或转回的坏账准备情况

	本期
调整后的年初余额	198,879,249.76
本年计提	
本年收回或转回	(6,047,241.42)
其他	
年末余额	192,832,008.34

(d) 按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款情况

	性质	本期末		占其他应 收款总额 的比例 (%)
		金额 人民币元	账龄	
武汉葛化集团有限公司	应收往来款	63,415,529.00	3年以上	10.75%
北海新宏源物业发展有限公司	应收往来款	30,252,423.87	3年以上	5.13%
中国证券投资者保护基金有限公司	应收往来款	24,974,865.15	3年以上	4.23%
郭熙华	涉案款	23,810,491.74	3年以上	4.04%
湖北潜江恒达公司	应收往来款	18,186,967.14	3年以上	3.08%
合计		160,640,276.90		27.22%

(ii) 长期待摊费用

	期初余额	本期购入	在建工程 转入	本期摊销	期末余额
经营租赁租入固 定资产改良支出	79,886,682.12	1,486,866.93	654,799.28	(15,968,275.11)	66,060,073.22
其他	15,443,575.03	585,247.43	-	(1,287,274.98)	14,741,547.48
合计	95,330,257.15	2,072,114.36	654,799.28	(17,255,550.09)	80,801,620.70

(二十一) 资产减值准备

于本期末，本集团资产减值准备变动情况汇总如下：

	2019年12月31日	本年计提		本年减少 转回	其他变动	2020年6月30日
		计提	核销后收回			
货币资金	2,873,432.42			(402,249.81)		2,471,182.61
融出资金	179,888,215.78	13,496,914.83		-		193,385,130.61
买入返售金融资产	789,488,369.71	64,660,720.18		(377,100.00)		853,771,989.89
以摊余成本计量的债权投资	386,042,099.67	11,564,938.39		(2,945.46)		397,604,092.60
以公允价值计量且其变动计入 其他综合收益的债务工具	278,345,179.69	23,266,492.83		(7,207,932.54)		294,403,739.98
应收款项	262,599,975.66	66,221,515.71				328,821,491.37
可供出售金融资产						-
固定资产	283,970.97					283,970.97
无形资产	675,579.92					675,579.92
其他资产	201,321,024.08	(2,425,240.79)	-	-	-	198,895,783.29
- 其他应收款	198,879,249.76	(6,047,241.42)				192,832,008.34
- 其他	2,441,774.32	3,622,000.63				6,063,774.95
应收利息						-
<b>合计</b>	<b>2,101,517,847.90</b>	<b>176,785,341.15</b>	<b>-</b>	<b>(7,990,227.81)</b>	<b>-</b>	<b>2,270,312,961.24</b>

(二十二) 短期借款

	2020年6月30日
保证借款	4,007,579,157.12
抵押借款	
小计	4,007,579,157.12
加：应付利息	18,875.74
合计	<b>4,007,598,032.86</b>

于2020年6月30日，本集团短期借款主要系香港子公司无抵押银行借款。

(二十三) 应付短期融资款

类型	债券名称	注	面值 人民币 亿元	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率	2020年1月1日		本期增加	本期减少	应付利息	2020年6月30日 账面余额
								账面余额 人民币元	人民币元				
短期公司债	19 申万宏源 CP006BC		40.00	2019/10/23	3 个月	39.99	2.95%	4,022,410,746.97			(4,022,410,746.97)	-	-
短期公司债	19 申万宏源 CP007BC		30.00	2019/11/15	3 个月	29.99	3.10%	3,011,630,183.52			(3,011,630,183.52)	-	-
短期公司债	19 申万宏源 CP008BC		30.00	2019/12/11	3 个月	30.00	3.05%	3,005,264,383.56			(3,005,264,383.56)	-	-
短期公司债	20 申万宏源 CP001BC		40.00	2020/03/09	3 个月	39.99	2.28%	-	3,999,178,928.76		(3,999,178,928.76)	-	-
短期公司债	20 申万宏源 CP002BC		40.00	2020/03/30	3 个月	39.99	1.72%	-	3,999,449,701.21		(3,999,449,701.21)	-	-
短期公司债	20 申万宏源 CP003BC		50.00	2020/04/14	3 个月	49.99	1.40%	-	4,999,785,961.33		-	14,958,904.11	5,014,744,865.44
短期公司债	20 申万宏源 CP004BC		30.00	2020/04/29	3 个月	29.99	1.43%	-	2,999,924,843.88		-	7,404,657.53	3,007,329,501.41
短期公司债小计								<b>10,039,305,314.05</b>	<b>15,998,339,435.18</b>		<b>(18,037,933,944.02)</b>	<b>22,363,561.64</b>	<b>8,022,074,366.85</b>
收益凭证		(i)						<b>7,025,847,920.09</b>	<b>18,246,927,000.00</b>		<b>(15,616,007,920.09)</b>	<b>90,438,955.88</b>	<b>9,747,205,955.88</b>
合计								<b>17,065,153,234.14</b>	<b>34,245,266,435.18</b>		<b>(33,653,941,864.11)</b>	<b>112,802,517.52</b>	<b>17,769,280,322.73</b>

(i) 于 2020 年上半年, 本集团共发行 675 期期限一年以内的收益凭证, 于 2020 年 6 月 30 日, 未到期的产品票面收益率为 0.00%加浮动收益至 3.6%加浮动收益。

(二十四) 拆入资金

	2020年6月30日
转融通融入资金	-
银行拆入资金	8,935,937,137.54
小计	8,935,937,137.54
加：应付利息	63,730,354.29
合计	8,999,667,491.83

(二十五) 交易性金融负债

	<u>2020年6月30日</u>		<u>合计</u>
	<u>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</u>	<u>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</u>	
债券	3,072,359,676.72	-	3,072,359,676.72
黄金	318,000,000.00	-	318,000,000.00
结构化票据	450,026,665.18	-	450,026,665.18
其他	-	-	-
合计	3,840,386,341.90	-	3,840,386,341.90

于2020年6月30日，其他交易性金融负债主要为资产管理计划其他份额持有者在合并结构化主体中享有的权益。

## (二十六) 卖出回购金融资产款

### (1) 按业务类别列示

2020年6月30日

质押式卖出回购	78,597,770,638.20
场外协议回购	9,962,337,500.00
买断式卖出回购	672,942,373.03
质押式报价回购	43,446,000.00
小计	89,276,496,511.23
加：应付利息	164,833,155.62
合计	89,441,329,666.85

### (2) 按金融资产种类列示

2020年6月30日

债券	79,314,159,011.23
信用业务债权收益权	1,500,000,000.00
贵金属	8,462,337,500.00
小计	89,276,496,511.23
加：应付利息	164,833,155.62
合计	89,441,329,666.85

### (3) 担保物信息

2020年6月30日

债券	86,699,935,298.39
信用业务债权收益权	1,621,173,370.66
贵金属	9,446,800,000.00
合计	97,767,908,669.05

(二十七) 代理买卖证券款

	2020年6月30日
普通经纪业务	
- 个人	61,627,317,975.09
- 机构	17,265,755,176.68
小计	78,893,073,151.77
信用业务	
- 个人	10,496,014,150.88
- 机构	2,323,991,135.25
小计	12,820,005,286.13
加：应付利息	142,708.70
合计	91,713,221,146.60

## (二十八) 应付职工薪酬

	期初余额	本期发生额	本期支付额	期末余额
短期薪酬	1,484,287,940.79	2,576,432,810.67	2,512,457,819.15	1,548,262,932.31
离职后福利 - 设定 提存计划	4,732,948.40	120,241,772.49	109,788,676.42	15,186,044.47
辞退福利	8,297,074.35	375,590.39	375,590.39	8,297,074.35
其他长期职工福利- 递延奖金	1,899,563,302.77	174,256,323.16	145,664,064.53	1,928,155,561.40
合计	3,396,881,266.31	2,871,306,496.71	2,768,286,150.49	3,499,901,612.53

### (i) 短期薪酬

	期初余额	本期发生额	本期支付额	期末余额
工资、奖金、津贴和 补贴	1,354,497,077.06	2,286,937,125.06	2,226,867,652.80	1,414,566,549.32
职工福利费	878,931.00	45,160,608.35	45,249,239.35	790,300.00
社会保险费	1,165,515.25	59,318,332.66	59,326,192.29	1,157,655.62
- 医疗保险费	525,322.83	54,545,370.22	54,548,450.94	522,242.11
- 工伤保险费	13,166.21	809,511.27	804,946.87	17,730.61
- 生育保险费	627,026.21	3,963,451.17	3,972,794.48	617,682.90
住房公积金	1,597,420.56	113,208,825.81	112,361,073.35	2,445,173.02
工会经费和职工教育 经费	125,507,631.20	47,922,709.79	46,576,727.54	126,853,613.45
其他	641,365.72	23,885,209.00	22,076,933.82	2,449,640.90
合计	1,484,287,940.79	2,576,432,810.67	2,512,457,819.15	1,548,262,932.31

### (ii) 离职后福利-设定提存计划

	期初余额	本期发生额	本期支付额	期末余额
基本养老保险	2,399,920.44	74,647,587.12	74,359,871.67	2,687,635.89
失业保险费	397,334.08	2,123,365.03	2,364,894.59	155,804.52
企业年金缴费	1,935,693.88	43,470,820.34	33,063,910.16	12,342,604.06
合计	4,732,948.40	120,241,772.49	109,788,676.42	15,186,044.47

### (iii) 基本养老保险、失业保险及企业年金的缴费情况

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

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

本集团境外公司符合资格的职工参加当地的福利供款计划。境外公司按照当地政府机构的规定为职工供款。

本集团应付职工薪酬中并无属于拖欠性质的余额。

(二十九) 应交税费

	2020年6月30日
企业所得税	316,680,535.92
增值税	137,253,375.62
个人所得税	343,000,026.80
城市维护建设税	10,046,501.70
教育费附加及地方教育费附加	7,133,310.42
其他	1,749,289.15
合计	815,863,039.61

(三十) 应付款项

	2020年6月30日
证券清算款	1,084,991,461.02
手续费及佣金	83,512,031.25
证券期货投资保护基金	46,993,191.78
保证金	1,806,830,252.67
经纪人报酬	14,447,145.68
销售服务费	87,744,580.67
合计	3,124,518,663.07

于2020年6月30日，本集团无账龄超过1年的大额应付款项。

(三十一) 合同负债

	2020年6月30日
保荐及财务顾问合同	45,068,302.01
资产管理合同	-
合计	45,068,302.01

于2020年6月30日，分摊至本期末尚未履行（或部分未履行）履约义务的交易价格总额为人民币157,614,615.18元，该金额代表预计将从保荐及财务顾问业务和资产管理业务中确认的收入。本集团将在履约义务完成时确认收入，其中大部分预计将在未来12至24个月内完成。

(三十二) 长期借款

	2020年6月30日
信用借款	5,000,000,000.00
加：应付利息	1,082,191.78
合计	5,001,082,191.78

于2020年6月30日，本集团长期借款主要系向本公司母公司申万宏源集团借入的长期借款。

## (三十三) 应付债券

类型	债券名称	注	面值 人民币 亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面利率 %	期初余额 人民币元	本年增加 人民币元	本年减少 人民币元	应付利息 人民币元	期末余额 人民币元
公司债	17 申证 01		75.00	2017/02/17	60 个月	75	4.40%	7,787,506,849.31	-	(287,506,849.31)	122,054,794.52	7,622,054,794.52
公司债	17 申证 02		5.00	2017/02/17	84 个月	5	4.50%	519,602,739.71	-	(19,602,739.71)	8,321,917.80	508,321,917.80
公司债	18 申证 01		20.00	2018/11/19	24 个月	20	4.10%	2,009,660,273.97	-	(9,660,273.97)	50,547,945.20	2,050,547,945.20
公司债	18 申证 02		30.00	2018/11/19	36 个月	30	4.20%	3,014,843,835.61	-	(14,843,835.61)	77,671,232.85	3,077,671,232.85
公司债	18 申证 03		15.00	2018/12/10	60 个月	15	4.08%	1,503,688,767.12	-	(3,688,767.12)	34,204,931.51	1,534,204,931.51
次级债	17 申证 C2		43.00	2017/11/16	36 个月	43	5.30%	4,328,721,643.83	-	(28,721,643.83)	142,359,452.05	4,442,359,452.05
次级债	18 申证 C1		14.00	2018/04/12	24 个月	14	5.25%	1,453,161,643.82	-	(1,453,161,643.82)	-	-
次级债	18 申证 C2		46.00	2018/04/12	60 个月	46	5.35%	4,778,001,095.91	-	(178,001,095.91)	53,939,726.03	4,653,939,726.03
次级债	18 申证 C3		42.00	2018/05/21	24 个月	42	5.38%	4,339,290,410.95	-	(4,339,290,410.95)	-	-
次级债	18 申证 C5		51.00	2018/09/17	24 个月	51	4.69%	5,169,463,397.26	-	(69,463,397.26)	188,730,739.70	5,288,730,739.70
公司债	19 申证 01		22.00	2019/01/16	36 个月	22	3.55%	2,274,890,410.92	-	(74,890,410.92)	35,733,424.64	2,235,733,424.64
公司债	19 申证 03		62.00	2019/03/11	36 个月	62	3.68%	6,385,028,383.54	-	(185,028,383.54)	70,010,739.72	6,270,010,739.72
公司债	19 申证 05		81.00	2019/05/09	36 个月	81	3.88%	8,304,066,739.73	-	(204,066,739.73)	45,635,178.09	8,145,635,178.09
公司债	19 申证 07		10.00	2019/06/14	24 个月	10	3.90%	1,021,476,712.34	-	(21,476,712.34)	1,816,438.36	1,001,816,438.36
公司债	19 申万宏源金融债 01		60.00	2019/09/18	36 个月	59.96	3.43%	6,055,359,049.11	-	(58,496,834.88)	161,820,821.91	6,158,683,036.14
公司债	20 申证 01		40.00	2020/01/16	24 个月	40	3.40%	-	4,000,000,000.00	-	62,224,657.53	4,062,224,657.53
公司债	20 申证 02		20.00	2020/01/16	36 个月	20	3.55%	-	2,000,000,000.00	-	32,484,931.52	2,032,484,931.52
公司债	20 申证 03		10.00	2020/02/21	24 个月	10	3.03%	-	1,000,000,000.00	-	10,874,794.53	1,010,874,794.53
公司债	20 申证 04		30.00	2020/02/21	36 个月	30	3.20%	-	3,000,000,000.00	-	34,454,794.53	3,034,454,794.53
次级债	20 申证 C2		60.00	2020/04/23	36 个月	60	3.18%	-	6,000,000,000.00	-	36,069,041.10	6,036,069,041.10
次级债	20 申证 C3		60.00	2020/05/25	36 个月	60	3.25%	-	6,000,000,000.00	-	19,767,123.29	6,019,767,123.29
小计								<b>58,944,761,953.12</b>	<b>22,000,000,000.00</b>	<b>(6,947,899,738.89)</b>	<b>1,188,722,684.88</b>	<b>75,185,584,899.11</b>
收益凭证		(i)						7,835,287,805.01	1,740,935,000.00	(3,906,501,805.01)	175,566,639.93	<b>5,845,287,639.93</b>
合计								<b>66,780,049,758.13</b>	<b>23,740,935,000.00</b>	<b>-10,854,401,543.90</b>	<b>1,364,289,324.81</b>	<b>81,030,872,539.04</b>

(i) 于 2020 年上半年度, 本集团共发行 91 期期限超过一年的收益凭证, 于 2020 年 6 月 30 日, 未到期产品的票面收益率为 3.30%至 5.15%。

#### (三十四) 其他负债

	2020年6月30日
合并结构化主体形成的其他金融负债	12,542,557,305.43
其他应付款	445,069,253.46
应付股利	2,141,298,406.59
期货风险准备	123,917,482.98
预提费用	68,521,914.25
递延收益	88,329,131.44
合计	15,409,693,494.15

##### (i) 合并结构化主体形成的其他金融负债

合并结构化主体形成的其他金融负债为本集团纳入合并范围内结构化主体产生的应付其他权益持有人持有的权益。

##### (ii) 其他应付款

	2020年6月30日
长期应付款	133,830,667.15
应付客户分红款	16,593,772.67
营业部其他应付款	40,234,962.66
代理兑付证券款	6,635,569.27
应付工程款	2,478,819.30
应付集团	
应付资管产品增值税	80,905,826.00
应付保证金	75,668,584.20
其他	88,721,052.21
合计	445,069,253.46

于2020年6月30日，除长期应付款和应付客户分红款外，本集团无账龄超过1年的重要其他应付款。

长期应付款系根据原上海申银证券有限公司与原上海万国证券公司合并协议的规定，对原上海申银证券有限公司评估净资产超出其应缴纳出资金额的部分，作为本公司向原上海申银证券有限公司股东的负债，参照有关市场利率有偿进行使用。

##### (iii) 应付股利

	2020年6月30日
一年以上应付股利	135,051,679.59

本集团应付股利系原申银万国与原宏源证券吸收合并前应付普通股股利。其中，超过一年尚未支付部分主要是由于相应股权质押冻结或股权转让等历史原因导致的。

##### (iv) 期货风险准备

本集团子公司申银万国期货有限公司和宏源期货有限公司根据《商品期货交易财务管理暂行规定》按商品和金融期货经纪业务手续费收入的5%计提期货风险准备并计入当期损益。动用风险准备金弥补因自身原因造成的损失或是按规定核销难以收回的垫付风险损失款时，冲减期货风险准备金余额。

(三十五) 股本

本公司注册资本及实收资本结构如下:

	期末余额	
	人民币	%
申万宏源集团股份有限公司	47,000,000,000.00	100

上述实收资本已由会计师事务所验证, 并出具了验资报告。

(三十六) 资本公积

	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本公积	3,273,875,823.46			3,273,875,823.46

(三十七) 其他综合收益

	归属于母公司股东的 其他综合收益年初余 额	本年所得税前发生 额	减：前期计入其他 综合收益本期转入 损益	本年发生额		处置其他权益工具 转未分配利润	税后归属于少 数股东	归属于母公司股东 的其他综合收益年 末余额
				减：所得税费用	税后归属于母公司			
不能重分类进损益的其他 综合收益	(653,837,086.69)	(423,871,454.89)	-	105,967,863.72	(317,903,591.17)	(22,003,418.50)	-	(993,744,096.36)
其中：								
权益法下不能转损益的其 他综合收益						-		-
其他权益工具投资公允价 值变动	(653,837,086.69)	(423,871,454.89)		105,967,863.72	(317,903,591.17)	(22,003,418.50)		(993,744,096.36)
企业自身信用风险公允价 值变动						-		-
将重分类进损益的其他综 合收益	324,665,034.58	38,350,834.27	(414,195,855.73)	107,002,219.87	(286,261,876.19)		17,419,074.60	38,403,158.39
其中：								
权益法下可转损益的其他 综合收益	9,167,706.08	(7,276,632.07)	-	-	(7,276,632.07)			1,891,074.01
其他债权投资公允价值变 动	44,795,662.37	(48,265,827.14)	(414,195,855.73)	112,818,843.08	(345,710,934.41)		(3,931,905.38)	(300,915,272.04)
其他债权投资信用减值准 备	207,817,093.55	16,058,560.29	-	(5,816,623.21)	12,775,472.03		(2,533,534.95)	220,592,565.58
外币报表折算差异	62,884,572.58	77,834,733.19	-		53,950,218.26		23,884,514.93	116,834,790.84
其他								
合计	(329,172,052.11)	(385,520,620.62)	(414,195,855.73)	212,970,083.59	(604,165,467.36)	(22,003,418.50)	17,419,074.60	(955,340,937.97)

(三十八) 盈余公积

	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	2,849,799,213.70			2,849,799,213.70
任意盈余公积	235,871,447.34			235,871,447.34
合计	3,085,670,661.04	-	-	3,085,670,661.04

(三十九) 一般风险准备

	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一般风险准备	3,910,710,212.28	26,907,235.09	-	3,937,617,447.37
交易风险准备	3,324,037,583.90	-	-	3,324,037,583.90
合计	7,234,747,796.18	26,907,235.09	-	7,261,655,031.27

(四十) 利润分配及未分配利润

(1) 本集团的利润分配情况如下:

	2020年1-6月
期初未分配利润	15,539,264,834.45
加: 会计政策变更	-
加: 本期归属于母公司股东的净利润	3,930,606,303.67
减: 提取法定盈余公积	
提取任意盈余公积	
提取一般风险准备	(26,907,235.09)
提取交易风险准备	-
应付普通股股利	(2,000,000,000.00)
其他综合收益结转	22,003,418.50
期末未分配利润	17,464,967,321.53

(2) 提取各项盈余公积和风险准备

本集团按照相关法律法规及公司章程规定提取 2020 半年度财务报表的法定盈余公积、任意盈余公积、一般风险准备及交易风险准备。

(3) 期末未分配利润的说明

于 2020 年 6 月 30 日, 本集团的未分配利润余额中包括子公司提取的盈余公积归属于母公司部分人民币 650,988,784.84 元。

(四十一) 手续费及佣金净收入

	注	2020年1-6月
证券经纪业务净收入		<b>2,331,238,541.63</b>
——证券经纪业务收入		<b>2,944,597,635.97</b>
——代理买卖证券业务		2,568,753,533.23
——交易单元席位租赁		306,846,177.86
——代销金融产品业务		68,997,924.88
——证券经纪业务支出		<b>(613,359,094.34)</b>
——代理买卖证券业务		(613,359,094.34)
期货经纪业务净收入		<b>108,702,414.09</b>
——期货经纪业务收入		124,345,988.10
——期货经纪业务支出		(15,643,574.01)
投资银行业务净收入		<b>404,062,802.89</b>
——投资银行业务收入		<b>413,513,168.66</b>
——证券承销业务		297,381,526.43
——证券保荐业务		21,644,394.25
——财务顾问业务	(i)	94,487,247.98
——投资银行业务支出		<b>(9,450,365.77)</b>
——证券承销业务		(9,448,465.77)
——财务顾问业务	(i)	(1,900.00)
资产管理业务净收入		<b>417,159,400.89</b>
——资产管理业务收入		419,072,029.15
——资产管理业务支出		(1,912,628.26)
基金管理业务		
——基金管理业务收入		<b>135,757,462.25</b>
投资咨询业务净收入		<b>9,543,459.15</b>
——投资咨询业务收入		29,733,236.42
——投资咨询业务支出		(20,189,777.27)
其中：手续费及佣金收入合计		4,067,019,520.55
手续费及佣金支出合计		(660,555,439.65)
合计		<b>3,406,464,080.90</b>

(i) 财务顾问业务

	2020年1-6月
——全国股转系统推荐业务	62,916,037.52
——并购重组-境内上市公司	18,974,905.71
——其他	12,594,404.75
合计	94,485,347.98

(2) 手续费及佣金收入的分解

	2020年1-6月	
	<u>在某一时点确认收入</u>	<u>在一段时间内确认收入</u>
证券经纪及投资咨询业务收入	2,974,330,872.39	
期货经纪业务收入	124,345,988.10	
投资银行业务收入	413,513,168.66	
资产管理及基金管理业务收入		554,829,491.40
合计	3,512,190,029.15	554,829,491.40

(四十二) 利息净收入

利息收入	2020年1-6月
货币资金及结算备付金利息收入	1,004,894,588.89
融出资金利息收入	2,007,828,118.31
买入返售金融资产利息收入	939,658,147.72
其中：约定购回利息收入	-
股权质押回购利息收入	663,797,358.09
其他	-
债权投资利息收入	43,911,287.53
其他债权投资利息收入	1,330,863,560.19
利息收入小计	<b>5,327,155,702.64</b>
利息支出	
短期借款利息支出	(52,606,728.38)
长期借款利息支出	(97,938,356.17)
应付短期融资款利息支出	(244,172,937.76)
拆入资金利息支出	(174,756,856.61)
其中：转融通利息支出	(11,006,981.01)
卖出回购金融资产款利息支出	(1,037,971,968.87)
其中：报价回购利息支出	(93,242.12)
代理买卖证券款利息支出	(143,607,849.48)
应付债券利息支出	(1,505,962,890.06)
其中：次级债券利息支出	(520,320,398.61)
合并结构化主体形成的其他金融负债利息支出	(82,633,481.58)
租赁负债利息支出	(15,768,292.04)
其他	(137,277.14)
利息支出小计	<b>(3,355,556,638.08)</b>
利息净收入	<b>1,971,599,064.56</b>

#### (四十三) 投资收益

	2020年1-6月
权益法核算的长期股权投资收益	
金融工具投资收益	170,717,560.36
其中：持有期间取得的收益	2,274,996,677.30
其中：交易性金融工具	2,250,787,989.27
其他权益工具投资	24,208,688.03
应收款项类投资	
处置金融工具取得的收益	322,474,805.05
其中：交易性金融工具	125,556,258.13
其他债权投资	414,195,855.73
衍生金融工具	(217,277,308.81)
债权投资	
合计	2,768,189,042.70

#### (四十四) 公允价值变动收益

	2020年1-6月
交易性金融资产	491,583,421.68
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	
交易性金融负债	(33,664,642.57)
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	
衍生金融工具	(121,981,087.30)
<b>合计</b>	<b>335,937,691.81</b>

#### (四十五) 资产处置收益

项目	2020年1-6月	2020年1-6月计入 非经常性损益的金额
固定资产处置收益/(损失)	964,968.62	964,968.62

(四十六) 其他收益

	2020年1-6月	2020年1-6月 非经常性损益的金额
与收益相关的政府补助	196,227,829.23	196,227,829.23

(四十七) 其他业务收入

	2020年1-6月
贸易销售收入	543,045,806.55
资产出租和保管收入	2,889,203.39
其他	23,365,625.00
合计	569,300,634.94

(四十八) 税金及附加

	2020年1-6月
城市维护建设税	33,309,889.23
教育费附加及地方教育费附加	23,790,755.45
其他	6,999,685.64
合计	64,100,330.32

(四十九) 业务及管理费

	2020年1-6月
职工费用	2,871,306,496.72
租赁费及物业费	62,406,308.40
办公运营费	82,225,716.55
业务推广费	19,644,261.45
差旅费	21,014,413.24
固定资产折旧	61,124,075.41
邮电通信费	41,989,988.51
无形资产摊销	37,974,346.78
长期待摊费用摊销	17,255,550.09
电子设备运转费	37,729,300.61
交易单元费	42,736,630.28
专业服务及咨询费	46,047,107.10
投资者保护基金	45,639,100.42
期货风险准备金	5,926,309.82
其他	30,607,327.11
使用权资产折旧	165,948,088.22
基金销售费用	50,179,577.69
合计	3,639,754,598.41

(五十) 信用减值损失

	2020年1-6月
买入返售金融资产	64,283,620.18
货币资金	(402,249.81)
应收账款	66,221,515.71
其他资产	(2,425,240.79)
融出资金	13,496,914.83
债权投资	11,561,992.93
其他债权投资	16,058,560.29
合计	168,795,113.34

(五十一) 其他业务成本

	2020年1-6月
资产出租和保管支出	1,839,641.64
其他	535,090,488.77
合计	536,930,130.41

(五十二) 营业外收入

	2020年1-6月	2020年6月30日计入非经常性损益的金额
其他收入	1,224,436.71	1,224,436.71

(五十三) 营业外支出

	2020年1-6月	2020年6月30日计入非经常性损益的金额
对外捐赠及赞助支出	31,609,220.00	31,609,220.00
处置非流动资产损失	1,046,890.96	1,046,890.96
违约金及赔偿毁损	437,531.92	437,531.92
其他	1,110,697.79	1,110,697.79
合计	34,204,340.67	34,204,340.67

#### (五十四) 所得税费用

##### (1) 本期所得税费用组成

	2020年1-6月
本年所得税	767,732,351.74
递延所得税的变动	77,648,526.79
汇算清缴差异	(14,214,707.02)
合计	831,166,171.51

##### (2) 所得税费用与会计利润的关系

	2020年1-6月
利润总额	4,801,191,486.12
按税率25%计算的预期所得税	1,200,297,871.53
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	461,833.73
非应税收入的影响	(362,879,121.56)
子公司适用不同税率的影响	(7,071,882.71)
本年未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异的影响	9,475,434.85
使用前期未确认递延所得税资产的暂时性差异的影响	-
汇算清缴差异调整	(9,117,964.33)
其他	-
所得税费用	831,166,171.51

#### (五十五) 现金流量表项目

##### (1) 收到其他与经营活动有关的现金

	2020年1-6月
合并结构化主体收到的现金	1,346,703,973.00
收回业务意向金	-
收到政府补助	196,227,829.23
房屋租赁收入	3,033,663.56
收到的保证金	215,380,133.92
大宗商品贸易收到的现金	629,769,320.83
其他	138,318,124.41
合计	2,529,433,044.95

##### (2) 支付其他与经营活动有关的现金

	2020年1-6月
大宗商品贸易支付的现金	621,881,266.85
资管业务款支付的现金	921,869,020.00
支付运营和管理费用	245,340,310.64
支付的往来款项	688,446,663.49
支付租赁费及物业费用	65,526,623.82
支付证券投资者保护基金	32,898,897.28
支付专业服务及咨询费	102,000,285.88
支付的存出保证金	1,803,172,839.20
其他	179,113,452.62
合计	4,660,249,359.79

## (五十六) 现金流量表相关情况

### (1) 现金流量表补充资料

#### (a) 将净利润调节为经营活动的现金流量:

	2020年1-6月
净利润	3,970,025,314.61
加: 资产减值损失	168,795,113.34
固定资产折旧	61,124,075.41
无形资产摊销	37,974,346.78
长期待摊费用摊销	17,255,550.09
投资性房地产折旧	1,839,641.64
使用权资产折旧	165,948,088.22
处置或报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	(964,968.62)
公允价值变动损失	(335,937,691.81)
利息支出	541,674,356.68
汇兑收益	4,931,750.20
投资收益	(609,122,104.12)
递延所得税资产增加	(143,101,077.02)
递延所得税负债增加	220,749,603.81
交易性金融工具的减少/(增加)	(5,565,587,206.70)
经营性应收项目的增加	(8,071,485,532.05)
经营性应付项目的减少	25,820,340,150.88
其他	77,834,733.19
经营活动产生的现金流量净额	16,362,294,144.53

#### (b) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:

自2020年1月1日至2020年6月30日止期间, 本集团无涉及现金收支的重大投资和筹资活动。

#### (c) 现金及现金等价物净变动情况:

	2020年1-6月
现金的期末余额	574,682.46
减: 现金的期初余额	(539,473.92)
加: 现金等价物的期末余额	12,184,292,207.11
减: 现金等价物的期初余额	(13,215,146,294.44)
现金及现金等价物净增加额	(1,030,818,878.79)

### (2) 本期取得或处置子公司及其他营业单位的有关信息

自2020年1月1日至2020年6月30日止期间, 除现金出资新设子公司外, 本集团无重大购买或处置子公司的交易。

### (3) 现金和现金等价物的构成

	2020年1-6月
(a) 货币资金	
-库存现金	574,682.46
-可随时用于支付的银行存款	85,296,477,751.48
-可随时用于支付的其他货币资金	1,229,254.64
-三个月以上定期存款	1,426,732,055.42
-使用受限制的货币资金	613,461,764.88

小计	87,338,475,508.88
(b) 结算备付金	14,687,693,661.17
(c) 现金等价物	12,184,292,207.11
(d) 期末货币资金、结算备付金及现金等价物	<b>114,210,461,377.16</b>
减：三个月以上定期存款	(1,426,732,055.42)
使用受限制的货币资金	(613,461,764.88)
(e) 期末可随时变现的现金及现金等价物余额	112,170,267,556.86

## (五十七) 外币货币性项目

### (1) 外币货币性项目

	2020年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
货币资金			
其中：美元	433,769,369.69	7.08	3,070,868,583.20
港币	3,669,575,210.18	0.91	3,351,936,605.59
其他币种			55,287,133.55
结算备付金			
其中：美元	160,543,711.98	7.08	1,136,568,591.09
港币	328,562,351.61	0.91	300,121,978.84
其他币种			7,292,925.56
融出资金			
其中：港币	2,423,038,731.07	0.91	2,213,300,383.35
应收款项			
其中：港币	2,198,585,038.38	0.91	2,008,275,412.97
存出保证金			
其中：美元	540,000.29	7.08	3,822,930.00
港币	26,574,925.60	0.91	24,274,598.78
其他币种			507,872.61
其他资产			
其中：港币	92,528,749.69	0.91	84,519,456.72
短期借款			
其中：港币	4,387,368,892.73	0.91	4,007,598,032.86
代理买卖证券款			
其中：美元	523,455,218.81	7.08	3,705,799,206.87
港币	4,577,514,594.53	0.91	4,181,284,713.68
其他币种			
应付款项			
其中：港币	18,934,779.35	0.91	17,295,783.95
其他负债			
其中：港币	51,906,050.08	0.91	47,413,059.92

### (2) 境外经营实体说明

本集团主要境外经营实体为本公司子公司申万宏源(香港)有限公司，其经营地在香港，记账本位币为港币。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定，报告期内未发生变化。

## (五十八) 关联方

### 关联交易情况

#### (1) 手续费及佣金收入

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
中央汇金及其旗下公司	交易单元席位租赁收入	55,372,704.05
中央汇金及其旗下公司	资管业务收入	295,513.38
中央汇金及其旗下公司	代销金融产品业务收入	4,771,285.24
中央汇金及其旗下公司	财务顾问业务收入	-
中央汇金及其旗下公司	经纪业务手续费收入	15,629.35
中央汇金及其旗下公司	投行业务手续费及佣金收入	182,616,528.52
富国基金管理有限公司	交易单元席位租赁收入	45,117,941.13
富国基金管理有限公司	代销金融产品业务收入	1,578,833.88
上海久事(集团)有限公司	经纪业务手续费收入	318,300.00
上海汽车集团财务有限责任公司	资管业务管理费收入	23,856.81
上海汽车集团财务有限责任公司	经纪业务手续费收入	1,409,950.83
上海通用汽车金融有限责任公司	投行业务手续费及佣金收入	-
上海国际信托有限公司	财务顾问业务收入	562,226.04
上海通用汽车金融有限责任公司	投行业务手续费及佣金收入	11,310,566.04
四川发展(控股)有限责任公司	投行业务手续费及佣金收入	1,028,207.55
宏源汇智投资有限公司	资管业务收入	-
宏源汇智投资有限公司	投资咨询业务收入	212,264.15
宏源期货	期货经纪业务收入	5,471,254.22
宏源期货	经纪业务手续费收入	-
申万宏源集团股份有限公司	资管业务管理费收入	-
申万宏源集团股份有限公司	投资银行业务手续费收入	-
	合计	310,105,061.19

#### (2) 手续费及佣金支出

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
中央汇金及其旗下公司	代理买卖证券支出	31,380,588.70
中央汇金及其旗下公司	资产管理业务支出	8,046,651.57
宏源汇智	投资银行业务支出	-
宏源期货	期货交易手续费支出	-
渤海银行股份有限公司	资产管理业务支出	-
合计	合计	39,427,240.27

#### (3) 利息收入

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
中央汇金及其旗下公司	存放金融同业利息收入	667,351,433.14
宏源期货	利息收入	-
	合计	667,351,433.14

#### (4) 利息支出

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
中央汇金及其旗下公司	卖出回购金融资产款利息支出	74,728,557.92
中央汇金及其旗下公司	短期借款利息支出	-
中央汇金及其旗下公司	拆入资金利息支出	16,288,836.11

中央汇金及其旗下公司	租赁负债利息支出	346,160.07
申万宏源集团股份有限公司	长期借款利息支出	92,394,675.97
申万宏源集团股份有限公司	租赁负债利息支出	1,405,388.30
	<b>合计</b>	<b>185,163,618.37</b>

(5) 投资收益

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
中央汇金及其旗下公司	债券利息收益	7,598,942.13
富国基金管理有限公司	长期股权投资持有损益	179,832,398.81
上海国际信托有限公司	处置金融工具的损益	-
星展银行(中国)有限公司	处置金融工具的损益	-
宏源汇富创业投资有限公司	处置金融工具的损益	-
国泰基金管理有限公司	持有金融工具的损益	1,349,955.00
国泰基金管理有限公司	处置金融工具的损益	1,975,960.81
富国基金管理有限公司	处置债券收入	81,259.85
中国中药有限公司	处置债券收入	3,486.34
上汽通用汽车金融有限责任公司	处置债券收入	79,298.64
金融街控股股份有限公司	处置债券收入	24,128.77
中建投租赁股份有限公司	处置债券收入	52,433.32
渤海银行股份有限公司	处置金融工具的损益	5,313,225.36
	<b>合计</b>	<b>196,311,089.03</b>

(6) 业务及管理费

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
中央汇金及其旗下公司	租赁费、物业费及其他	2,449,511.69
中央汇金及其旗下公司	电子设备运转费及其他	163,725.66
中央汇金及其旗下公司	H股上市募集资金(聘请中介机构费用-农银国际-合规)	617,763.31
申万宏源集团股份有限公司	租赁费及物业费	
上海市证券同业公会	会费支出	432,000.00
上海金融联合会	会员费支出	5,000.00
申万宏源集团股份有限公司	使用权资产折旧	21,626,373.24
申万宏源集团股份有限公司	专业服务及咨询费	-
申银万国创新资本管理有限公司	车辆租赁支出	40,495.44
申万宏源发展成都股权投资管理有限公司	咨询费支出	-
宏源期货	咨询费支出	-
中央汇金及其旗下公司	折旧与摊销费用	3,616,256.28
申万宏源集团股份有限公司	折旧与摊销费用	16,898,762.88
	<b>合计</b>	<b>45,849,888.50</b>

(7) 其他业务收入

关联方	关联交易类型	2020年1-6月
宏源期货	房屋租赁收入	95,769.04
	<b>合计</b>	

(8) 信用减值损失

无。

## 关联方款项余额

(1) 货币资金			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
中央汇金及其旗下公司	存放关联方款项		53,194,593,306.08
(2) 交易性金融资产			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
中央汇金及其旗下公司	债券		426,557,091.20
(3) 衍生金融资产			
无。			
(4) 卖出回购金融资产			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
中央汇金及其旗下公司	卖出回购金融资产		23,302,435,883.53
(5) 结算备付金			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
宏源期货有限公司	结算备付金		318,014,135.73
(6) 应收款项			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
中央汇金及其旗下公司	应收手续费及佣金		11,615,425.96
中央汇金及其旗下公司	应收手续费及佣金		181,794,925.40
富国基金管理有限公司	应收手续费及佣金		8,773,239.43
	合计		202,183,590.79
(7) 存出保证金			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
宏源期货有限公司	存出保证金		67,673,943.70
(8) 其他资产			
无。			
(9) 长期借款			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
申万宏源集团股份有限公司	长期借款		5,001,082,191.77
(10) 代理买卖证券款			
无。			
(11) 应付款项			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
中央汇金及其旗下公司	应付款项		33,350,774.69
(12) 其他权益工具投资			
关联方	关联交易类型	2020年1-6月	
中央汇金及其旗下公司	持有金融资产（光大银行股票）		111,826,505.32

(13) 其他负债  
无。

(14) 应付债券  
无。

(15) 使用权资产

**关联方**

申万宏源集团股份有限公司  
中央汇金及其旗下公司

**关联交易类型**

使用权资产

使用权资产

**合计**

**2020年1-6月**

101,392,577.08

22,286,450.68

**123,679,027.76**

(16) 租赁负债

**关联方**

申万宏源集团股份有限公司  
中央汇金及其旗下公司

**关联交易类型**

租赁负债

租赁负债

**合计**

**2020年1-6月**

66,453,592.35

14,794,002.84

**81,247,595.19**

(17) 拆入资金

**关联方**

中央汇金及其旗下公司

**关联交易类型**

拆入资金

**合计**

**2020年1-6月**

1,700,029,333.33

**1,700,029,333.33**