

申万宏源证券有限公司 2021 年上半年

合并财务报表重要项目的说明

以下注释项目除特别注明外，金额单位为人民币元。

1 货币资金

(1) 按类别列示

	2021 年 6 月 30 日
库存现金	71,099.17
银行存款	92,285,705,650.11
其中：客户存款	67,896,725,467.24
公司存款	24,388,980,182.87
其他货币资金	17,918,018.00
合计	92,303,694,767.28

(2) 按币种列示

	2021 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
库存现金			
人民币	6,085.82	1.00000	6,085.82
美元	72.22	6.46010	466.57
港币	59,777.20	0.83208	49,739.41
其他币种			14,807.37
小计			71,099.17
银行存款			
公司存款			
人民币	22,240,381,144.68	1.00000	22,240,381,144.68
美元	53,235,938.35	6.46010	343,909,485.35
港币	2,093,735,144.05	0.83208	1,742,155,138.66
其他币种			65,592,238.56
小计			24,392,038,007.25
客户存款			
人民币	62,784,051,932.19	1.00000	62,784,051,932.19
美元	365,391,974.56	6.46010	2,360,468,694.86
港币	3,265,997,322.42	0.83208	2,717,571,052.04
其他币种			34,633,788.15
小计			67,896,725,467.24
银行存款合计			92,288,763,474.49

其他货币资金			
人民币	17,918,018.00	1.00000	17,918,018.00
小计			92,306,752,591.66
减：减值准备			(3,057,824.38)
合计			92,303,694,767.28

其中，融资融券业务

	2021年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
客户信用资金			
人民币	7,422,733,834.70	1.00000	7,422,733,834.70
美元	124,819,585.85	6.46010	806,347,006.55
港币	3,190,521,911.80	0.83208	2,654,769,472.37
其他币种			34,633,788.16
小计			10,918,484,101.78
合计			10,918,484,101.78

(3) 受限制的货币资金

于2021年6月30日，本集团使用受到限制的货币资金为人民币590,164,123.74元。

2 结算备付金

(1) 按类别列示

	2021年6月30日
客户备付金	12,842,057,430.17
公司备付金	10,451,573,525.10
合计	23,293,630,955.27

(2) 按币种列示

	2021年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
公司备付金			
公司自有备付金			
人民币	9,954,105,690.60	1.00000	9,954,105,690.60
美元	4,233,244.87	6.46010	27,347,185.18
港币	35,452,978.54	0.83208	29,499,714.39
小计			10,010,952,590.17

公司信用备付金			
人民币	440,620,934.93	1.00000	440,620,934.93
公司备付金合计			10,451,573,525.10
客户备付金			
客户普通备付金			
人民币	6,358,145,193.61	1.00000	6,358,145,193.61
美元	402,119,830.56	6.46010	2,597,734,317.38
港币	310,648,031.24	0.83208	258,484,013.84
其他币种			12,193,867.72
小计			9,226,557,392.55
客户信用备付金			
人民币	3,528,085,981.31	1.00000	3,528,085,981.31
美元	6,176,354.54	6.46010	39,899,867.96
港币	57,102,908.80	0.83208	47,514,188.35
小计			3,615,500,037.62
客户备付金合计			12,842,057,430.17
合计			23,293,630,955.27

3 融出资金

(1) 按客户类别列示

2021年6月30日

境内	
其中：个人	61,756,480,315.49
机构	11,760,282,383.87
小计	73,516,762,699.36
减：减值准备	(417,733,521.40)
账面价值小计	73,099,029,177.96
境外	
其中：个人	5,473,410,903.79
机构	928,530,414.00
小计	6,401,941,317.79
减：减值准备	-

账面价值小计	6,401,941,317.79
账面价值合计	79,500,970,495.75

(2) 融资融券业务担保物公允价值

	2021年6月30日
股票	247,456,079,976.38
基金	12,048,157,001.25
资金	8,665,610,266.35
债券	339,229,256.60
合计	268,509,076,500.58

4 衍生金融资产和衍生金融负债

		2021年6月30日	
		非套期工具	
	名义金额	公允价值	
		资产	负债
权益衍生工具	141,931,629,672.06	2,366,328,402.45	4,730,373,477.69
利率衍生工具	141,214,322,850.00	8,990.08	211,435.63
商品衍生工具	41,353,396,951.43	231,696,669.14	127,215,418.47
信用衍生工具	390,000,000.00	1,339,570.34	668,939.84
合计	324,889,349,473.49	2,599,373,632.01	4,858,469,271.63

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、黄金延期和其他商品期货产生的公允价值变动金额，而并未反映在上述衍生金融工具科目中。于2021年6月30日，本集团未到期的上述衍生金融工具合约的公允价值为人民币155,949,773.20元。

5 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

	2021年6月30日
债券	13,113,886,176.54
股票	11,900,652,970.38
小计	25,014,539,146.92

减：减值准备	(883,029,743.81)
合计	<u>24,131,509,403.11</u>

(2) 按业务类别列示

	2021年6月30日
债券质押式回购	13,113,886,176.54
股票质押式回购	<u>11,900,652,970.38</u>
小计	<u>25,014,539,146.92</u>
减：减值准备	(883,029,743.81)
合计	<u>24,131,509,403.11</u>

于2021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1,800,000,000.00元。

(3) 担保物金额

	2021年6月30日
担保物	29,527,538,862.93
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	<u>-</u>

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2021年6月30日，上述交易所国债逆回购的金额为人民币7,223,427,914.99元。

6 应收款项

	2021年6月30日
应收清算款项	3,609,995,359.94
应收资管业务款	1,399,907,297.13
应收手续费及佣金	317,635,817.64
逾期应收款	<u>18,667,731.82</u>
小计	<u>5,346,206,206.53</u>
减：坏账准备	<u>(560,896,594.63)</u>

合计	4,785,309,611.90
----	------------------

7 存出保证金

(1) 按类别列式

2021年6月30日

交易保证金	11,490,186,570.78
履约保证金	2,867,813,823.50
转融通保证金	2,263,132,249.16
信用保证金	148,173,083.85
	16,769,305,727.29

合计	16,769,305,727.29
----	-------------------

(2) 按币种列示

2021年6月30日

	原币金额	折算汇率	人民币金额
交易保证金			
人民币	11,472,389,258.05	1.00000	11,472,389,258.05
美元	540,000.00	6.46010	3,488,454.00
港币	17,196,494.00	0.83208	14,308,858.73
小计			11,490,186,570.78
信用保证金			
人民币	146,443,700.43	1.00000	146,443,700.43
港币	2,078,386.00	0.83208	1,729,383.42
小计			148,173,083.85
履约保证金			
人民币	2,867,813,823.50	1.00000	2,867,813,823.50
转融通保证金			
人民币	2,263,132,249.16	1.00000	2,263,132,249.16
合计			16,769,305,727.29

8 金融投资：交易性金融资产

(1) 按类别列示

2021年6月30日

	公允价值	初始成本
债券	115,805,888,738.24	113,597,088,745.66
公募基金	25,734,480,847.41	25,743,323,233.08
股票	21,469,019,202.85	20,610,618,738.40
银行理财产品	986,064,687.65	986,064,687.65
贵金属	466,978,228.50	478,032,973.23
券商资管产品	1,015,390,417.88	1,201,451,207.01
信托计划	422,452,793.93	421,116,200.17

其他	26,149,191,388.69	25,072,537,533.65
合计	192,049,466,305.15	188,110,233,318.85

(2) 交易性金融资产中已融出证券情况

于2021年6月30日,本集团交易性金融资产余额中包含的融出证券余额于12(1)融出证券中披露。本集团融出证券收到的担保物于3(2)中披露。

(3) 存在限售期及承诺条件的交易性金融资产

于2021年6月30日,本集团交易性金融资产中有人民币2,254,985,185.54元的股票投资存在限售期限。

于2021年6月30日,本集团交易性金融资产中有人民币86,180,098,950.35元的债券投资为卖出回购金融资产款设定质押。

于2021年6月30日,本集团交易性金融资产中有人民币3,194,491,300.00元的债券投资为债券借贷业务设定质押。

9 金融投资：债权投资

	2021年6月30日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
债券	788,051,318.88	25,250,945.64	(30,214,087.96)	783,088,176.56
资产管理计划	520,802,734.82	-	(208,321,093.92)	312,481,640.90
信托计划	300,000,000.00	-	(227,683,304.49)	72,316,695.51
合计	1,608,854,053.70	25,250,945.64	(466,218,486.37)	1,167,886,512.97

10 金融投资：其他债权投资

(1) 按类别列式

	2021年6月30日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
公司债	10,152,052,866.95	281,242,028.73	(447,211,535.43)	9,986,083,360.25	428,742,548.97
企业债	8,955,898,025.60	249,732,770.52	(41,982,885.86)	9,163,647,910.26	18,926,982.49
中期票据	4,637,574,858.22	90,893,068.49	(7,142,078.22)	4,721,325,848.49	7,029,971.91
地方债	2,176,535,401.53	27,068,657.54	5,753,781.47	2,209,357,840.54	2,739,395.51
金融债	40,885,235.49	550,435.62	(1,273,715.49)	40,161,955.62	-
其他	7,031,860,739.72	213,603,678.15	37,589,519.60	7,283,053,937.47	27,105,713.18
合计	32,994,807,127.51	863,090,639.05	(454,266,913.93)	33,403,630,852.63	484,544,612.06

(2) 存在承诺条件的其他债权投资

于2021年6月30日,本集团其他债权投资中有人民币12,013,742,582.28元的债券投资为卖出回购金融资产款设定质押。

于2021年6月30日，本集团其他债权投资中人民币9,273,240,800.00元的债券投资为债券借贷业务设定质押。

11 金融投资：其他权益工具投资

	2021年6月30日		
	初始成本	公允价值	本期确认的股利收入
非交易性权益工具	4,887,019,296.94	3,505,178,220.62	412,590,945.80

(i) 该项目为本公司与其他若干家证券公司投资于中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)统一运作的专户。根据相关合约，由本公司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。本公司出于非交易性目的对该专户等投资进行管理。该专户投资已于2021年上半年全部收回。

于2021年6月30日，本集团其他权益工具投资中有人民币313,866,378.00元非交易性权益工具投资为转融通业务设定质押。

于2021年1月1日至6月30日止期间，本集团终止确认的其他权益工具投资无累计利得或损失从其他综合收益转入留存收益。

12 融出证券

(1) 按项目分析

	2021年6月30日
交易性金融资产	7,546,597,213.85
其他权益工具投资	1,799,663,834.83
融出证券总额	9,346,261,048.68
转融通融入证券总额	6,874,947,592.58

(2) 融券业务违约情况

于2021年6月30日，本集团融券业务均无重大合约逾期。

13 长期股权投资

(1) 按类别列示

2021年6月30日

合营企业

-不重要的合营企业	54,959,859.09
联营企业	
-重要的联营企业	1,592,138,656.16
-不重要的联营企业	52,706,729.50
减：长期股权投资减值准备	
-合营企业	-
-联营企业	-
合计	1,699,805,244.75

(2) 长期股权投资明细情况

被投资单位名称	2021年 1月1日	本期增减变动						2021年 6月30日	减值准备 期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认 的投资收益	其他综合收益	其他权 益变动	宣告发放现金股 利或利润		
合营企业									
上海中万宏源嘉实股 权投资合伙企业(有 限合伙)	5,043,215.38	-	-	(612.05)	-	-	-	-	5,042,603.33
厦门市象屿泓鼎现代 物流投资合伙企业 (有限合伙)	468,400.08	-	-	405.68	-	-	-	-	468,805.76
珠海中宏格金医疗健 康产业投资基金合 伙企业(有限合伙)	49,414,346.49	-	-	34,103.51	-	-	-	-	49,448,450.00
小计	54,925,961.95	-	-	33,897.14	-	-	-	-	54,959,859.09
联营企业									
富国基金管理有限公 司	1,448,836,624.99	-	-	344,534,427.58	(696,896.41)	-	(200,535,500.00)	-	1,592,138,656.16
桐乡中万泓鼎成长二 号股权投资基金合 伙企业(有限合伙)	51,683,752.98	-	-	425,401.48	-	-	-	-	52,109,154.46

重庆市富荣股权投资

基金合伙企业(有限

合伙)

498,746.35	-	-	98,828.69	-	-	-	597,575.04	-
1,501,019,124.32	-	-	345,058,657.75	(696,896.41)	-	(200,535,500.00)	1,644,845,385.66	-
1,555,945,086.27	-	-	345,092,554.89	(696,896.41)	-	(200,535,500.00)	1,699,805,244.75	-

(3) 合营企业基本情况

合营企业	注册地、 主要经营地	业务性质	实收资本 人民币元	持有权益比例	
				直接	间接
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	1.00 亿元	-	31.00%
厦门市象屿泓鼎现代物流合伙企业(有限合伙)	福建厦门	股权投资	0.21 亿元	-	50.00%
珠海申宏格金医疗健康产业投资基金合伙企业(有限合伙)	广东珠海	股权投资	2.51 亿元	-	20.00%

(4) 联营企业基本情况

联营企业	注册地、 主要经营地	业务性质	实收资本 人民币元	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	5.20 亿元	27.775%	-
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金合伙企业(有限合伙)(i)	浙江嘉兴	股权投资	1.51 亿元	-	13.16%
重庆市富荣股权投资基金合伙企业(有限合伙)(i)	重庆	股权投资	0.50 亿元	-	1.00%

- (i) 本集团于该被投资企业的股权低于 20%，但由于公司章程细则、有限合伙协议及其他公司治理文件载明的相关安排，本集团对该被投资企业拥有重大影响或共同控制。

所有上述联营企业及合营企业均使用权益法进行核算。

(5) 重要联营企业的主要财务信息

下表列示了本集团重要联营企业的主要财务信息。该联营企业的重要会计政策、会计估计与本集团的会计政策、会计估计无重大差异，该联营企业的主要财务信息是在按投资时公允价值为基础调整后的金额。此外，下表还列示了这些财务信息按照权益法调整至本集团对联营企业投资账面价值的调节过程：

	富国基金管理有限公司 2021年6月30日
资产总额	9,590,772,560.95
负债总额	(3,858,500,171.53)
净资产	5,732,272,389.42
持股比例	0.28
按持股比例计算的净资产份额	1,592,138,656.16
调整事项	-
对联营企业投资的账面价值	1,592,138,656.16

1月1日至6月30日止期间

2021年

营业收入	3,998,339,410.40
净利润	1,241,936,015.26
其他综合收益	(2,584,136.61)
其他调整	(1,412,972.53)
综合收益总额	1,237,938,906.12

本集团本期间收到的来自联营企业的股利 200,535,500.00

于2021年6月30日,本集团重要联营企业为非上市公司,不存在公开市场报价。

(6) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

2021年6月30日

合营企业:	
投资账面价值合计	54,959,859.09
下列各项按持股比例计算的合计数	
-净利润	33,897.14
-其他综合收益	-
-综合收益总额	33,897.14
联营企业:	
投资账面价值合计	52,706,729.50
下列各项按持股比例计算的合计数	
-净利润亏损	524,230.17
-其他综合收益	-
-综合收益总额	524,230.17

14 投资性房地产

房屋及建筑物

成本	
2020年12月31日余额	91,019,200.94
本期增加	414,960.79
本期减少	-
2021年6月30日余额	91,434,161.73

减：累计折旧	
2020年12月31日余额	(50,686,510.75)
本期增加	(2,254,602.43)
本期减少	-
	<hr/>
2021年6月30日余额	(52,941,113.18)
	<hr/>
账面价值	
2021年6月30日余额	38,493,048.55
	<hr/>

于2021年6月30日，本集团投资性房地产采用成本法模式计量，无按公允价值计量的投资性房地产。

于2021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。

15 固定资产

(1) 账面价值

	2021年6月30日
固定资产	2,267,922,032.01
减：累计折旧	(1,628,546,318.39)
固定资产减值准备	(283,970.97)
	<hr/>
合计	639,091,742.65
	<hr/>

(2) 固定资产增减变动表

成本	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
2020年1月1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							
- 本年购置	903,045.32	3,176,758.45	104,000.00	55,327,935.28	12,246,744.08	-	71,758,483.13
- 在建工程转入	-	-	-	55,724,699.99	-	-	55,724,699.99
本年减少							
- 转让和出售	-	(32,793,721.27)	-	(7,962,350.17)	(706,712.43)	(2,786,423.28)	(44,249,207.15)
- 清理报废	-	(11,921,114.90)	(1,392,319.20)	(76,852,002.72)	(3,190,771.07)	(601,624.06)	(93,957,831.95)
2020年12月31日余额	931,762,684.36	53,244,853.85	19,548,040.13	1,105,821,316.52	83,391,232.74	67,877,901.36	2,261,646,028.96
本期增加							
- 本期购置	-	784,395.58	-	33,899,567.15	938,317.39	-	35,622,280.12
- 在建工程转入	-	-	-	10,279,672.81	304,547.46	1,790,376.22	12,374,596.49
本期减少							
- 清理报废	-	(203,045.27)	(195,820.80)	(40,288,784.79)	(1,033,222.70)	-	(41,720,873.56)
2021年6月30日余额	931,762,684.36	53,826,204.16	19,352,219.33	1,109,711,771.69	83,600,874.89	69,668,277.58	2,267,922,032.01

(3) 暂时闲置的固定资产

于2021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2021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2021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2021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10,983,586.88元。

		2021年6月30日		
		账面余额	减值准备	账面价值
16	在建工程			
(1)	在建工程账面价值			
	无形资产开发支出	94,710,373.91	-	94,710,373.91
	自有房产装修工程	33,064,780.82	-	33,064,780.82
	租入房产装修工程	19,807,478.57	-	19,807,478.57
	其他	23,341,997.81	-	23,341,997.81
	合计	170,924,631.11	-	170,924,631.11

(2) 在建工程项目变动

工程名称	资金来源	2021年1月1日	本期增加	本期减少		2021年6月30日
				本期转入固定资产	其他减少	
自有房产装修工程	自有	34,572,571.17	282,585.87	(1,790,376.22)	-	33,064,780.82
无形资产开发支出	自有	88,207,746.06	38,575,945.73	-	(32,073,317.88)	94,710,373.91
租入房产装修工程	自有	6,885,302.17	17,222,699.61	-	(4,300,523.21)	19,807,478.57
其他	自有	28,486,303.04	5,439,915.04	(10,584,220.27)	-	23,341,997.81
合计		158,151,922.44	61,521,146.25	(12,374,596.49)	(36,373,841.09)	170,924,631.11

17 无形资产

	计算机软件	其他	合计
成本			
2020年12月31日余额	644,583,231.97	319,676,795.94	964,260,027.91
本期增加	49,889,469.43	6,716.50	49,896,185.93
本期减少	-	(94,182.61)	(94,182.61)
2021年6月30日余额	<u>694,472,701.40</u>	<u>319,589,329.83</u>	<u>1,014,062,031.23</u>
减：累计摊销			
2020年12月31日余额	(477,239,890.20)	(302,291,411.47)	(779,531,301.67)
本期增加	(46,442,442.20)	(973,017.00)	(47,415,459.20)
本期减少	-	53,917.50	53,917.50
2021年6月30日余额	<u>(523,682,332.40)</u>	<u>(303,210,510.97)</u>	<u>(826,892,843.37)</u>
减：减值准备			
2021年6月30日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
账面价值			
2021年6月30日	<u>170,790,369.00</u>	<u>15,703,238.94</u>	<u>186,493,607.94</u>

于2021年6月30日，本集团均无用于抵押或担保的重大无形资产。

18 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 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

	2021年6月30日
递延所得税资产	1,567,552,420.41
递延所得税负债	<u>1,774,999.49</u>
净额	<u>1,565,777,420.92</u>

(2) 未经抵销的递延所得税资产

	2021年6月30日	
	可抵扣暂时性差异 及可抵扣亏损	递延所得税资产
资产减值准备	2,379,517,705.36	592,494,485.17
公允价值变动	3,117,455,898.12	779,047,441.67
已计提尚未支付的工资及奖金	3,291,680,700.33	822,920,175.09
其他	145,326,305.58	36,315,205.73
小计	8,933,980,609.39	2,230,777,307.66
互抵金额	(2,652,899,549.02)	(663,224,887.25)
互抵后金额	6,281,081,060.37	1,567,552,420.41

(3) 未经抵销的递延所得税负债

	2021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	(2,647,354,431.60)	(661,838,607.90)
其他	(13,633,314.50)	(3,161,278.84)
小计	(2,660,987,746.10)	(664,999,886.74)
互抵金额	2,652,899,549.02	663,224,887.25
互抵后金额	(8,088,197.08)	(1,774,999.49)

(4) 未确认递延所得税资产明细

	2021年6月30日
未确认暂时性差异	234,613,559.79

19 使用权资产

	房屋及建筑物
原值	
2020年12月31日余额	1,411,320,896.51
本期增加	228,664,738.04
本期减少	(95,126,871.59)

2021年6月30日余额	<u>1,544,858,762.96</u>
减：累计折旧	
2020年12月31日余额	(530,493,884.58)
本期计提	(179,679,665.62)
本期减少	<u>58,675,734.63</u>
2021年6月30日余额	<u>(651,497,815.57)</u>
减：减值准备	
2020年12月31日余额	-
本期计提	-
本期减少	<u>-</u>
2021年6月30日余额	<u>-</u>
账面价值	
2021年6月30日余额	<u>893,360,947.39</u>

20 其他资产

		2021年6月30日
大宗商品存货		488,868,568.57
其他应收款	(1)	324,716,732.31
预付款项		223,046,159.33
待抵扣税项		72,634,560.71
长期待摊费用	(2)	68,345,573.79
应收利息		44,101,729.11
待摊费用		3,452,111.76
抵债资产		1,000,000.00
其他	(3)	<u>23,930,722.60</u>
合计		<u>1,250,096,158.18</u>

(1) 其他应收款

(a) 按明细列式

		2021年6月30日
其他应收款余额		610,148,576.91
减：坏账准备		<u>(285,431,844.60)</u>
合计		<u>324,716,732.31</u>

(b) 按账龄分析

2021年6月30日

	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1年以内	113,866,115.82	18.66	(11,486,241.58)	10.09
1-2年	233,152,365.04	38.21	(34,894,498.58)	14.97
2-3年	30,027,090.16	4.92	(22,117,450.05)	73.66
3年以上	233,103,005.89	38.21	(216,933,654.39)	93.06
合计	610,148,576.91	100.00	(285,431,844.60)	46.78

(2) 长期待摊费用

	2021年 1月1日	本期购入	在建工程转入	本期摊销	本期转出	2021年 6月30日
租入资产改良支出	65,067,744.07	3,307,942.01	4,300,523.21	(21,046,697.93)	-	51,629,511.36
其他	15,098,430.99	11,820,103.33	-	(10,202,471.89)	-	16,716,062.43
合计	80,166,175.06	15,128,045.34	4,300,523.21	(31,249,169.82)	-	68,345,573.79

(3) 于2021年6月30日,其他包括本公司因收购子公司形成的商誉。商誉减值评估每年执行一次。可收回金额根据资产的公允价值减去处置费用后的净额与使用现值两者之间较高者确定。本集团根据预计的未来现金流量现值测试商誉不存在减值

21

资产减值准备

	2021年1月1日	本期计提	本期转回	本期核销	其他变动	2021年6月30日
货币资金	3,697,695.83	-	(639,871.45)	-	-	3,057,824.38
融出资金	340,239,373.24	77,563,403.43	-	(69,255.27)	-	417,733,521.40
应收款项	540,836,633.24	83,482,551.81	(63,422,590.42)	-	-	560,896,594.63
买入返售金融资产	988,979,545.22	4,086,003.37	(110,022,339.22)	(13,465.56)	-	883,029,743.81
债权投资	453,507,493.13	30,440,053.11	(17,503,094.72)	-	(225,965.15)	466,218,486.37
其他债权投资	289,448,326.65	251,839,884.64	(56,613,893.51)	-	(129,705.72)	484,544,612.06
其他应收款	252,513,532.27	26,152,108.51	-	-	6,766,203.82	285,431,844.60
金融工具减值准备小计	2,869,222,599.58	473,564,004.87	(248,201,789.32)	(82,720.83)	6,410,532.95	3,100,912,627.25
固定资产	283,970.97	-	-	-	-	283,970.97

无形资产	675,579.92	-	-	-	-	-	675,579.92
其他资产	3,740,619.29	-	(3,054,832.57)	-	-	-	685,786.72
其他资产减值准备小计	4,700,170.18	-	(3,054,832.57)	-	-	-	1,645,337.61
合计	2,873,922,769.76	473,564,004.87	(251,256,621.89)	(82,720.83)	6,410,532.95	3,102,557,964.86	

22 短期借款

银行借款							7,253,266,756.60
------	--	--	--	--	--	--	------------------

23 应付短期融资款

债券名称	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 %	2021年1月1日 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2021年6月30日 人民币元	
20 申证 D5	35.00	2020/07/27	12 个月	35.00	2.97	3,544,997,534.26	51,547,808.24	-	3,596,545,342.50	
20 申证 D7	33.00	2020/09/10	9 个月	33.00	3.15	3,326,708,009.32	48,477,744.13	(3,375,185,753.45)	-	
20 申方宏源 CP008BC	40.00	2020/10/19	3 个月	40.00	2.88	4,023,173,858.20	181,758.24	(4,023,355,616.44)	-	
20 申方宏源 CP009BC	40.00	2020/11/23	3 个月	40.00	3.30	4,013,618,320.85	11,696,747.64	(4,025,315,068.49)	-	
20 申方宏源 CP010BC	30.00	2020/12/14	3 个月	30.00	2.94	3,004,349,589.04	14,256,986.30	(3,018,606,575.34)	-	
20 申证 13	63.00	2020/12/18	9 个月	63.00	3.13	6,290,644,294.91	109,562,966.47	-	6,400,207,261.38	
21 申方宏源 CP001BC	30.00	2021/01/25	3 个月	30.00	2.48	-	3,013,453,150.68	(3,013,453,150.68)	-	
21 申方宏源 CP002BC	30.00	2021/02/25	3 个月	30.00	2.84	-	3,015,172,602.74	(3,015,172,602.74)	-	
21 申方宏源 CP003BC	40.00	2021/06/10	3 个月	40.00	2.35	-	4,004,840,630.65	-	4,004,840,630.65	
21 申证 D1	35.00	2021/02/26	6 个月	35.00	2.97	16,301,577,417.51	13,073,133,962.91	(17,716,729,518.23)	11,657,981,862.19	
收益凭证(i)							40,505,069,024.09	26,874,858,938.38	(38,187,818,285.37)	29,192,109,677.10
合计							40,505,069,024.09	26,874,858,938.38	(38,187,818,285.37)	29,192,109,677.10

于 2021 年 6 月 30 日，本集团发行的应付短期融资款没有出现拖欠本金、利息或赎回款项的违约情况。

(i) 于 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本集团共发行 435 期期限一年以内的收益凭证。
于 2021 年 6 月 30 日，本集团发行的收益凭证采用固定年利率或与若干股指挂钩的浮动利率两种方式计息，其中固定利率区间为 2.80%-6.80%。

24 拆入资金

	2021 年 6 月 30 日
转融通拆入资金	2,000,833,333.33
银行拆入资金	1,000,000,000.00
其他拆入资金	888,656,066.37
	<hr/>
合计	3,889,489,399.70
	<hr/>

25 交易性金融负债

	2021 年 6 月 30 日
结构化票据	2,926,432,957.87
债券	2,594,792,910.00
股票	124,455,545.24
黄金	109,935,000.00
	<hr/>
合计	5,755,616,413.11
	<hr/>

26 卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别列示

	2021 年 6 月 30 日
质押式卖出回购	96,853,931,821.60
质押式报价回购	8,890,964,100.00
黄金掉期业务	8,865,881,054.17
买断式卖出回购	500,103,126.37
	<hr/>
合计	115,110,880,102.14
	<hr/>

(2) 按金融资产总类列示

	2021 年 6 月 30 日
债券	97,354,034,947.97
基金	8,890,964,100.00
贵金属	8,865,881,054.17
	<hr/>
合计	115,110,880,102.14
	<hr/>

(3) 担保物金额

2021年6月30日

债券	112,505,204,353.63
贵金属	16,315,572,000.00
基金	13,478,836,169.29
合计	<u>142,299,612,522.92</u>

27 代理买卖证券款

2021年6月30日

普通经纪业务	
- 个人	53,010,432,124.14
- 机构	<u>25,208,349,381.04</u>
小计	78,218,781,505.18
信用业务	
- 个人	8,863,564,168.14
- 机构	<u>1,733,700,474.48</u>
小计	10,597,264,642.62
加：应付利息	<u>142,708.97</u>
合计	<u>88,816,188,856.77</u>

28 应付职工薪酬

	2021年1月1日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
短期薪酬 1)	1,858,518,207.36	2,904,299,341.99	(1,917,367,078.03)	2,845,450,471.32
离职后福利				
- 设定提存计 划 2)	84,431,239.38	215,636,609.03	(203,161,555.76)	96,906,292.65
- 辞退福利	8,297,074.35	4,351,392.53	(4,352,724.81)	8,295,742.07
其他长期职工福利				
- 递延奖金	<u>2,859,851,335.16</u>	<u>161,604,846.98</u>	<u>(49,651,679.66)</u>	<u>2,971,804,502.48</u>
合计	<u>4,811,097,856.25</u>	<u>3,285,892,190.53</u>	<u>(2,174,533,038.26)</u>	<u>5,922,457,008.52</u>

(1) 短期薪酬

	2021年1月1日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
工资、奖金、津贴和补贴	1,716,829,274.92	2,541,024,641.88	(1,568,369,517.00)	2,689,484,399.80
职工福利费	706,520.00	67,042,223.10	(67,536,667.10)	212,076.00
社会保险费	859,496.14	99,287,352.92	(99,232,880.67)	913,968.39
其中：医疗保险费	580,316.44	93,300,075.16	(93,164,435.04)	715,956.56
工 伤 保 险 费	17,429.11	3,578,015.31	(3,579,388.54)	16,055.88
生 育 保 险 费	261,750.59	2,409,262.45	(2,489,057.09)	181,955.95
住房公积金	2,817,409.04	122,578,699.91	(122,295,727.69)	3,100,381.26
工会经费和职工教育经费	136,526,082.58	53,743,154.62	(39,453,422.13)	150,815,815.07
其他	779,424.68	20,623,269.56	(20,478,863.44)	923,830.80
合计	<u>1,858,518,207.36</u>	<u>2,904,299,341.99</u>	<u>(1,917,367,078.03)</u>	<u>2,845,450,471.32</u>

(2) 离职后福利 - 设定提存计划

	2021年1月1日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
基本养老保险	2,311,696.58	150,422,639.19	(150,064,951.27)	2,669,384.50
失业保险费	162,733.32	4,869,006.74	(4,828,839.47)	202,900.59
企业年金缴费	81,956,809.48	60,344,963.10	(48,267,765.02)	94,034,007.56
合计	<u>84,431,239.38</u>	<u>215,636,609.03</u>	<u>(203,161,555.76)</u>	<u>96,906,292.65</u>

(3) 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。

截至 2021 年 6 月 30 日止六个月期间，本公司高级管理人员从公司领取的薪酬总额分别为人民币 10,434,466.37 元，其中，高级管理人员包括总经理、副总经理、财务负责人、合规总监、董事会秘书及实际履行上述职务的人员。

29 应交税费

2021 年 6 月 30 日

企业所得税	274,133,132.33
增值税	128,374,805.27
代扣代缴个人所得税	77,932,862.12
城市维护建设税	5,306,737.02
教育费附加及地方教育附加	4,497,058.27
其他	427,180.69
	<hr/>
合计	490,671,775.70

30 应付款项

2021 年 6 月 30 日

应付履约保证金	6,525,660,467.79
应付清算款项	793,381,133.85
应付手续费及佣金	465,476,218.82
应付销售服务费	74,305,991.58
应付投资者保护基金	63,177,372.28
应付经纪人佣金	11,842,557.66
	<hr/>
合计	7,933,843,741.98

于 2021 年 6 月 30 日，本集团无账龄超过 1 年的大额应付款项。

31 长期借款

2021 年 6 月 30 日

信用借款	1,500,431,506.85
	<hr/>

于 2021 年 6 月 30 日，本集团长期借款主要系本公司向母公司申万宏源集团借入的长期借款。

32 应付债券

债券名称	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 %	2020年12月31日		本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2021年6月30日	
						人民币元	人民币元			人民币元	人民币元
17 申证 01	75.00	2017/02/17	60 个月	75.00	4.40	7,788,410,958.90	149,178,082.19	(316,438,356.16)	7,621,150,684.93		
17 申证 02	5.00	2017/02/17	84 个月	5.00	4.50	519,664,383.54	10,171,232.87	(21,575,342.44)	508,260,273.97		
18 申证 02	30.00	2018/11/19	36 个月	30.00	4.20	3,014,843,835.61	62,482,191.76	-	3,077,326,027.37		
18 申证 03	15.00	2018/12/10	60 个月	15.00	4.08	1,503,688,767.12	30,348,493.16	-	1,534,037,260.28		
18 申证 C2	46.00	2018/04/12	60 个月	46.00	5.35	4,778,001,095.92	60,682,191.78	(4,838,683,287.70)	-		
19 申证 01	22.00	2019/01/16	36 个月	22.00	3.55	2,275,104,383.52	35,519,452.04	(75,104,383.52)	2,235,519,452.04		
19 申证 03	62.00	2019/03/11	36 个月	62.00	3.68	6,385,028,383.54	106,891,397.25	(221,909,041.07)	6,270,010,739.72		
19 申证 05	81.00	2019/05/09	36 个月	81.00	3.88	8,304,066,739.73	148,960,109.59	(307,391,671.23)	8,145,635,178.09		
19 申证 07	10.00	2019/06/14	24 个月	10.00	3.90	1,021,476,712.34	16,134,246.58	(1,037,610,958.92)	-		
19 申证 08	60.00	2019/09/18	36 个月	60.00	3.43	6,056,778,615.99	102,756,272.81	-	6,159,534,888.80		
20 申证 01	40.00	2020/01/16	24 个月	40.00	3.40	4,129,802,739.27	62,319,428.42	(130,783,561.63)	4,061,338,606.06		
20 申证 02	20.00	2020/01/16	36 个月	20.00	3.55	2,067,635,443.93	32,446,309.54	(68,276,712.36)	2,031,805,041.11		
20 申证 03	10.00	2020/02/21	24 个月	10.00	3.03	1,026,149,315.09	13,365,205.49	(28,722,739.75)	1,010,791,780.83		
20 申证 04	30.00	2020/02/21	36 个月	30.00	3.20	3,082,849,315.09	42,345,205.49	(91,002,739.75)	3,034,191,780.83		
20 申证 06	41.00	2020/07/27	36 个月	41.00	3.49	4,161,940,328.79	70,956,958.92	-	4,232,897,287.71		
20 申证 08	32.00	2020/09/10	36 个月	32.00	3.76	3,225,066,760.40	61,911,075.72	-	3,286,977,836.12		
20 申证 09	22.00	2020/10/26	12 个月	22.00	3.16	2,207,647,243.22	37,479,584.40	-	2,245,126,827.62		
20 申证 10	57.00	2020/10/26	36 个月	57.00	3.68	5,715,786,392.36	108,017,843.40	-	5,823,804,235.76		
20 申证 12	17.00	2020/11/16	24 个月	17.00	3.55	1,700,843,540.97	31,716,402.17	-	1,732,559,943.14		
20 申证 C2	60.00	2020/04/23	36 个月	60.00	3.18	6,125,724,331.86	84,519,079.87	(179,299,726.05)	6,030,943,685.68		
20 申证 C3	60.00	2020/05/25	36 个月	60.00	3.25	6,114,680,020.69	84,578,444.06	(182,178,082.22)	6,017,080,382.53		
21 申证 01	25.00	2021/04/29	36 个月	25.00	3.45	-	2,509,255,587.98	-	2,509,255,587.98		
21 申证 02	20.00	2021/04/29	120 个月	20.00	4.05	-	2,009,283,404.46	-	2,009,283,404.46		
21 申证 03	26.00	2021/05/24	60 个月	26.00	3.63	-	2,603,923,013.18	-	2,603,923,013.18		
21 申证 04	20.00	2021/05/28	36 个月	20.00	3.27	-	2,001,460,461.36	-	2,001,460,461.36		
21 申证 05	25.00	2021/05/28	120 个月	25.00	4.00	-	2,503,395,851.31	-	2,503,395,851.31		
21 申证 C1	30.00	2021/01/21	36 个月	30.00	3.93	-	3,041,141,933.31	-	3,041,141,933.31		
21 申证 C2	38.00	2021/03/11	36 个月	38.00	3.94	-	3,831,457,937.25	-	3,831,457,937.25		
收益凭证(i)						12,004,860,139.19	9,539,171,629.59	(10,818,090,473.40)	10,725,941,295.38		
合计						93,210,049,447.07	29,391,869,025.95	(18,317,067,076.20)	104,284,851,396.82		

(i) 于 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本集团共发行 78 期期限超过一年的收益凭证。于 2021 年 6 月 30 日，本集团发行的收益凭证采用固定年利率或与若干股指挂钩的浮动利率两种方式计息，其中固定利率区间为 3.30%-4.22%。

33 合同负债

2021 年 6 月 30 日

保荐及财务顾问合同	22,752,669.85
-----------	---------------

34 租赁负债

2021 年 6 月 30 日

一年以上的非流动租赁负债	590,926,438.30
一年以内到期的租赁负债	293,537,460.62
合计	884,463,898.92

本集团未纳入租赁负债计量的未来潜在现金流出主要来源于已承诺但尚未开始的租赁等风险敞口。本集团已承诺但尚未开始的租赁预计未来年度现金流出并不重大。

35 其他负债

2021 年 6 月 30 日

合并结构化主体形成的其他金融负债	(1)	10,563,232,187.25
其他应付款	(2)	513,577,319.20
应付股利	(3)	152,362,681.23
期货风险准备	(4)	148,932,354.47
预提费用		134,089,477.33
递延收益		81,325,504.46
合计		11,593,519,523.94

(1) 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。

(2) 其他应付款

2021 年 6 月 30 日

长期应付款	134,195,242.39
资管产品增值税合并纳税结余	120,077,740.36
应付利息	91,518,630.77

应付保证金	36,221,883.16
应付客户分红款	17,536,199.27
代理兑付债券款	16,012,321.51
营业部其他应付款	3,835,558.20
应付工程款	1,691,239.58
其他	92,488,503.96
	<hr/>
合计	513,577,319.20
	<hr/>

于2021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。

(3) 应付股利

2021年6月30日

一年以上应付股利	135,579,958.31
	<hr/>

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。

(4) 期货风险准备

本集团子公司申银万国期货有限公司根据《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。

36 实收资本

本公司注册资本及实收资本结构如下：

	2021年6月30日余额	
	人民币	%
申万宏源集团股份有限公司	53,500,000,000.00	100
	<hr/>	<hr/>

上述实收资本已由会计师事务所验证，并出具了验资报告。

37	资本公积	2021年1月1日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
	资本溢价	3,273,875,823.46	-	-	3,273,875,823.46

38 其他权益工具

	2021年1月1日		本期增加		本期减少		2021年6月30日	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
永续债	-	-	20,000,000.00	2,000,000,000.00	-	-	20,000,000.00	2,000,000,000.00

经中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部机构部函[2020]3544号文核准，本公司于2021年6月24日发行了永续债次级债，面值总额为人民币2,000,000,000.00元，票面利率为4.10%。该永续债的其他主要条款如下：

- 利率在债券存续的前五个计息年度内按票面利率4.10%保持不变，自第六个计息年度起每五年重置一次，每次重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上300个基点确定。
- 除非发生强制付息事件，该永续债的每个付息日，本公司可自行选择将当期利息以及按照合同条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制，前述利息递延不构成本公司未能按照约定足额支付利息。每笔递延利息在递延期间应按当期票面利率累计计息。
- 当存在递延支付利息的情形时，本公司在已递延利息及其孳息全部清偿完毕前不得向普通股股东分红和减少注册资本。
- 清偿顺序在本公司的普通债务和次级债务之后，除非公司清算，投资者不能要求公司加速偿还本次债券的本金。

由于该永续债未构成本公司无法避免的支付现金或其他金融资产的合同义务，因此分类为权益工具，列示为其他权益工具。

39 其他综合收益

- (1) 资产负债表中归属于母公司的其他综合收益情况表

	2021年1月1日	增减变动	2021年6月30日
其他债权投资公允价值变动	(342,924,986.71)	1,514,590.07	(341,410,396.64)
其他债权投资信用减值准备	216,592,837.11	147,281,377.80	363,874,214.91
其他权益工具投资公允价值变动	(693,727,610.47)	(342,653,196.77)	(1,036,380,807.24)
权益法下可转损益的其他综合收益	(2,227,800.45)	(696,896.41)	(2,924,696.86)
外币财务报表折算差额	(106,082,536.06)	(17,699,271.89)	(123,781,807.95)
合计	(928,370,096.58)	(212,253,397.20)	(1,140,623,493.78)

(2) 利润表中归属于母公司的其他综合收益情况表

	2021年1月1日至6月30日止期间		
	本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益本年转出	减：所得税费用
将重分类进损益的其他综合收益			
其他债权投资公允价值变动	(136,820,073.91)	138,849,302.18	1,514,590.07
其他债权投资信用减值准备	196,375,170.40	-	147,281,377.80
权益法下可转损益的其他综合收益	(696,896.41)	-	(696,896.41)
外币财务报表折算差额	(17,699,271.89)	-	(17,699,271.89)
不能重分类进损益的其他综合收益			
其他权益工具投资公允价值变动	(456,870,929.02)	-	(342,653,196.77)
合计	(415,712,000.83)	138,849,302.18	(212,253,397.20)

40 盈余公积

	2021年1月1日	本期提取	本期减少	2021年6月30日
法定盈余公积金	3,677,762,495.96	-	-	3,677,762,495.96
任意盈余公积金	235,871,447.34	-	-	235,871,447.34
	<u>3,913,633,943.30</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>3,913,633,943.30</u>

41 一般风险准备

	2021年1月1日	本期增加	本期减少	2021年6月30日
一般风险准备	4,939,903,023.57	31,025,687.09	-	4,970,928,710.66
交易风险准备	4,247,387,033.17	-	-	4,247,387,033.17
	<u>9,187,290,056.74</u>	<u>31,025,687.09</u>	<u>-</u>	<u>9,218,315,743.83</u>

42 未分配利润

	1月1日至6月30日止期间 2021年
期初未分配利润	18,705,440,569.87
加：本期归属于母公司所有者的净利润	4,406,331,421.28
其他综合收益结转	-
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	(31,025,687.09)
提取交易风险准备	-
对所有者的分配	<u>(3,000,000,000.00)</u>
期末未分配利润	<u>20,080,746,304.06</u>

(1) 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期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。

(2) 向所有者分配现金股利

经本公司单一股东申万宏源集团 2021 年 6 月 24 日分配股利的决议，本公司向股东分配现金股利人民币 3,000,000,000.00 元。

(3) 期末未分配利润的说明

于 2021 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 767,565,409.36 元。

43 手续费及佣金净收入

(1) 按收入类别列示

	注	1月1日至6月30日止期间 2021年
证券经纪业务净收入		2,506,019,157.09
证券经纪业务收入		3,165,013,313.79
其中：代理买卖证券业务		2,554,480,891.21
交易单元席位租赁		404,734,758.05
代销金融产品业务		205,797,664.53
证券经纪业务支出		(658,994,156.70)
其中：代理买卖证券业务		(658,994,156.70)
期货经纪业务净收入		226,677,993.61
期货经纪业务收入		277,601,835.64
期货经纪业务支出		(50,923,842.03)
投资银行业务净收入		713,974,378.01
投资银行业务收入		734,933,057.07
其中：证券承销业务		589,221,047.92
证券保荐业务		45,503,773.72
财务顾问业务	(a)	100,208,235.43
投资银行业务支出		(20,958,679.06)
其中：证券承销业务		(20,938,774.33)
财务顾问业务	(a)	(19,904.73)
资产管理业务净收入		307,780,759.35
资产管理业务收入		308,558,381.29
资产管理业务支出		(777,621.94)
基金管理业务净收入		275,720,815.46
基金管理业务收入		275,720,815.46
基金管理业务支出		-
投资咨询业务净收入		18,137,955.14
投资咨询业务收入		41,802,701.44
投资咨询业务支出		(23,664,746.30)
合计		4,048,311,058.66
其中：手续费及佣金收入合计		4,803,630,104.69
手续费及佣金支出合计		(755,319,046.03)

(a) 财务顾问业务

	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	
并购重组财务顾问业务净收入		
- 境内上市公司		6,868,871.72
其他财务顾问业务净收入		93,319,458.98
合计		100,188,330.70

(2) 手续费及佣金收入的分解

	2021年1月1日至6月30日止期间	
	在某一时点 确认收入	在一段时间内 确认收入
证券经纪及投资咨询业务收入	3,206,816,015.23	-
期货经纪业务收入	277,601,835.64	-
投资银行业务收入	734,933,057.07	-
资产管理及基金管理业务收入	-	584,279,196.75
合计	4,219,350,907.94	584,279,196.75

44 利息净收入

	1月1日至6月30日止期间	
	2021年	
利息收入		
货币资金及结算备付金利息收入		1,076,503,572.53
融出资金利息收入		2,729,597,782.24
买入返售金融资产利息收入		356,477,345.11
其中：股票质押回购利息收入		293,774,070.58
债权投资利息收入		38,087,205.08
其他债权投资利息收入		1,138,226,478.76
利息收入小计		5,338,892,383.72
利息支出		
短期借款利息支出		(41,649,504.90)
应付短期融资款利息支出		(467,238,053.45)
拆入资金利息支出		(220,326,154.58)
其中：转融通利息支出		(14,988,888.87)
卖出回购金融资产款利息支出		(1,292,461,428.48)
其中：报价回购利息支出		(111,163,275.31)
代理买卖证券款利息支出		(170,472,497.79)
长期借款利息支出		(24,116,438.37)
应付债券利息支出		(1,767,773,847.82)
其中：次级债券利息支出		(325,621,205.51)
合并结构化主体形成的其他金融负债利息支出		(98,999,501.83)
租赁负债利息支出		(17,791,153.20)
其他		(11,740.65)

利息支出小计	(4,100,840,321.07)
利息净收入	1,238,052,062.65

45 投资收益

	1月1日至6月30日止期间 2021年
权益法核算的长期股权投资收益	345,092,554.89
金融工具投资收益	4,284,838,258.68
其中：持有期间取得的收益	3,628,737,851.00
其中：交易性金融工具	3,216,146,905.20
其他权益工具投资	412,590,945.80
处置金融工具取得的收益	656,100,407.68
其中：交易性金融工具	628,400,867.29
其他债权投资	35,137,076.23
衍生金融工具	(7,437,535.84)
合计	4,629,930,813.57

46 公允价值变动损益

	1月1日至6月30日止期间 2021年
交易性金融资产	446,308,834.42
交易性金融负债	(4,854,155.78)
衍生金融工具	(622,624,531.21)
合计	(181,169,852.57)

47 其他收益

	1月1日至6月30日止期间 2021年
与收益相关的政府补助	
财政奖励与财政补贴	26,866,138.03
专项扶持资金	16,601,909.06
合计	43,468,047.09

48 其他业务收入

	1月1日至6月30日止期间 2021年
大宗商品销售收入	1,258,059,036.71
其他	30,817,843.88

合计 1,288,876,880.59

49 税金及附加

1月1日至6月30日止期间

2021年

城市维护建设税 38,195,567.71
教育费附加及地方教育附加 27,083,499.82
其他 9,903,502.35

合计 75,182,569.88

50 业务及管理费

1月1日至6月30日止期间

2021年

职工费用 3,285,892,190.53
使用权资产折旧费 179,679,665.62
基金销售费用 119,107,599.72
电子设备运转费 95,694,404.58
邮电通信费 91,605,187.74
办公运营费 66,149,720.17
固定资产折旧 65,666,113.26
租赁费及物业费 62,130,522.23
交易单元费 57,001,823.60
专业服务及咨询费 55,027,142.30
其他 217,658,450.55

合计 4,295,612,820.30

51 信用减值损失

1月1日至6月30日止期间

2021年

其他债权投资 195,225,991.13
融出资金 77,563,403.43
其他资产 26,152,108.51
应收款项 20,059,961.39
债权投资 12,936,958.39
货币资金 (639,871.45)
买入返售金融资产 (105,936,335.85)

合计 225,362,215.55

52 其他业务成本

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2021年
大宗商品销售成本	1,249,703,570.42
其他	2,254,602.43
合计	<u>1,251,958,172.85</u>

53 营业外支出

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2021年
对外捐赠及赞助支出	33,171,198.95
报废非流动资产损失	1,796,800.73
违约金及赔偿毁损	1,171,023.53
其他	4,395,252.25
合计	<u>40,534,275.46</u>

54 所得税费用

(1) 本期所得税费用组成

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2021年
当期所得税费用	811,752,488.03
递延所得税费用	(73,327,746.27)
合计	<u>738,424,741.76</u>

(2) 所得税费用与会计利润的关系

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2021年
税前利润	<u>5,190,258,798.75</u>
按中国法定税率 25%计算的所得税费用	1,297,564,699.69
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	14,961,677.57
非应纳税收入的影响	(574,151,460.56)
子公司适用不同税率的影响	(5,137,454.39)
汇算清缴差异调整	20,075,272.92
其他	(14,887,993.47)
所得税费用	<u>738,424,741.76</u>

55 现金流量表附注

(1) 现金流量表补充资料

(a) 将净利润调节为经营活动现金流量

	1月1日至6月30日止期间
	2021年
净利润	4,451,834,056.99
加： 信用减值损失	225,362,215.55
其他资产减值损失	(3,054,832.57)
使用权资产折旧	179,679,665.62
固定资产折旧	65,666,113.26
无形资产摊销	47,415,459.20
长期待摊费用摊销	31,249,169.82
投资性房地产折旧	2,254,602.43
处置或报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损益	(240,034.97)
公允价值变动损益	181,169,852.57
利息净支出	1,138,239,808.64
汇兑损益	(88,656.83)
投资收益	(792,820,576.92)
递延所得税资产增加	(157,843,832.61)
递延所得税负债减少	(373,084.82)
交易性金融工具的增加	(37,300,043,664.00)
经营性应收项目的增加	(6,533,520,018.98)
经营性应付项目的增加	11,515,478,249.50
经营活动产生的现金流量净额	<u>(26,949,635,508.12)</u>

(b) 不涉及现金收支的重大经营、投资和筹资活动

于2021年1月1日至6月30日止期间，本集团无不涉及现金收支的重大投资和筹资活动。

(2) 收到的其他与经营活动有关的现金

	1月1日至6月30日止期间
	2021年
大宗商品贸易收到的现金	1,497,689,329.42
收到的政府补助	43,505,131.76
房屋租赁收入	5,228,980.29
其他	<u>49,734,922.11</u>

合计	1,596,158,363.58
 (3) 支付的其他与经营活动有关的现金	
	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	<u>2021年</u>
往来款项支付的现金	1,438,699,790.81
大宗商品贸易支付的现金	1,343,241,275.84
合并结构化主体净减少的现金	677,991,369.78
支付的存出保证金	605,271,044.48
支付运营和管理费用	527,451,116.35
支付租赁费及物业费用	62,130,522.23
支付专业服务及咨询费	55,027,142.30
资管业务款支付的现金	44,747,345.00
支付证券投资者保护基金	25,803,470.89
其他	461,478,653.00
合计	5,241,841,730.68
 (4) 现金及现金等价物净变动情况	
	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	<u>2021年</u>
现金的期末余额	114,296,056,382.11
减：现金的期初余额	(106,972,481,360.75)
加：现金等价物的期末余额	13,124,108,345.61
减：现金等价物的期初余额	(11,624,053,203.13)
现金及现金等价物净增加额	8,823,630,163.84
 (5) 现金及现金等价物的构成	
	<u>2021年6月30日</u>
货币资金	
其中：库存现金	71,099.17
可随时用于支付的银行存款	90,997,685,325.25
可随时用于支付的其他货币资金	4,718,018.00
三个月以上定期存款	637,500,000.00
受限制的货币资金	590,164,123.74
小计	92,230,138,566.16
结算备付金	23,293,581,939.69

现金等价物	13,124,108,345.61
期末货币资金、结算备付金及现金等价物	128,647,828,851.46
其中：三个月以上定期存款	(637,500,000.00)
受限制的货币资金	(590,164,123.74)
期末现金及现金等价物余额	<u>127,420,164,727.72</u>

56 货币性项目

(1) 外币货币性项目

	2021年6月30日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
货币资金			
其中：美元	418,627,985.13	6.46010	2,704,378,646.77
港币	5,359,792,243.67	0.83208	4,459,775,930.11
其他币种			100,240,834.09
合计			<u>7,264,395,410.97</u>
结算备付金			
其中：美元	412,529,429.97	6.46010	2,664,981,370.52
港币	403,203,918.58	0.83208	335,497,916.58
其他币种			12,193,867.72
合计			<u>3,012,673,154.82</u>
融出资金			
其中：港币	7,693,901,208.76	0.83208	<u>6,401,941,317.79</u>
应收款项			
其中：港币	3,368,559,209.52	0.83208	<u>2,802,910,747.06</u>
存出保证金			
其中：美元	540,000.00	6.46010	3,488,454.00
港币	19,274,880.00	0.83208	<u>16,038,242.15</u>
合计			<u>19,526,696.15</u>
其他资产			
其中：港币	248,198,478.91	0.83208	<u>206,520,990.34</u>
短期借款			
其中：美元	384,575,913.91	6.46010	2,484,398,861.44
港币	5,686,000,000.00	0.83208	<u>4,731,206,880.00</u>

合计			<u>7,215,605,741.44</u>
代理买卖证券款			
其中：美元	633,817,754.07	6.46010	4,094,526,073.04
港币	4,099,973,473.17	0.83208	3,411,505,927.56
其他币种			<u>34,824,698.60</u>
合计			<u>7,540,856,699.20</u>
应付款项			
其中：港币	35,661,056.12	0.83208	<u>29,672,851.58</u>
其他负债			
其中：港币	353,429,941.47	0.83208	<u>294,081,985.70</u>

(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。