
东莞证券股份有限公司
公司债券年度报告
(2021 年)

二〇二二年四月

重要提示

发行人承诺将及时、公平地履行信息披露义务。

本公司董事、高级管理人员已对年度报告签署书面确认意见。公司监事会（如有）已对年度报告提出书面审核意见，监事已对年度报告签署书面确认意见。

发行人及全体董事、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，并承担相应的法律责任。

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告

。

重大风险提示

投资者在评价和投资本公司债券时，应认真考虑各项可能对本公司债券的偿付、债券价值判断和投资者权益保护产生重大不利影响的各项风险因素，并仔细阅读募集说明书中“风险因素”等有关章节内容。

报告期内公司面临的风险因素与上一报告期没有发生重大变化。

本报告中所涉及的未来发展战略等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请广大投资者谨慎决策投资，注意投资风险。

目录

重要提示.....	2
重大风险提示.....	3
释义.....	5
第一节 发行人情况.....	6
一、 公司基本信息.....	6
二、 信息披露事务负责人.....	6
三、 报告期内控股股东、实际控制人及其变更情况.....	7
四、 报告期内董事、监事、高级管理人员的变更情况.....	7
五、 公司业务和经营情况.....	8
六、 公司治理情况.....	16
第二节 债券事项.....	18
一、 公司信用类债券情况.....	18
二、 公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况.....	22
三、 公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况.....	23
四、 公司债券报告期内募集资金使用情况.....	23
五、 公司信用类债券报告期内资信评级调整情况.....	24
六、 公司债券担保、偿债计划及其他偿债保障措施情况.....	24
七、 中介机构情况.....	27
第三节 报告期内重要事项.....	28
一、 财务报告审计情况.....	28
二、 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正.....	28
三、 合并报表范围调整.....	30
四、 资产情况.....	30
五、 负债情况.....	31
六、 利润及其他损益来源情况.....	33
七、 报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十.....	33
八、 非经营性往来占款和资金拆借.....	33
九、 对外担保情况.....	34
十、 报告期内信息披露事务管理制度变更情况.....	34
十一、 向普通投资者披露的信息.....	34
第四节 特定品种债券应当披露的其他事项.....	34
一、 发行人为可交换债券发行人.....	34
二、 发行人为非上市公司非公开发行可转换公司债券发行人.....	35
三、 发行人为其他特殊品种债券发行人.....	35
四、 发行人为永续期公司债券发行人.....	35
五、 其他特定品种债券事项.....	35
第五节 发行人认为应当披露的其他事项.....	35
第六节 备查文件目录.....	36
财务报表.....	38
附件一： 发行人财务报表.....	38

释义

公司、本公司、发行人、东莞证券	指	东莞证券股份有限公司
本集团	指	东莞证券股份有限公司及子公司
中国证监会、证监会	指	中国证券监督管理委员会
广东证监局	指	中国证券监督管理委员会广东监管局
华联期货	指	华联期货有限公司
东证锦信	指	东证锦信投资管理有限公司
东证宏德	指	东莞市东证宏德投资有限公司
华期资本	指	华期资本管理（广州）有限公司
东莞市国资委	指	东莞市人民政府国有资产监督管理委员会
锦龙股份	指	广东锦龙发展股份有限公司，股票代码（000712），为东莞证券股东之一
东莞控股	指	东莞发展控股股份有限公司，股票代码（000828），为东莞证券股东之一
金控集团	指	东莞金融控股集团有限公司，为东莞证券股东之一
金控资本	指	东莞金控资本投资有限公司，为东莞证券股东之一
新世纪科教	指	东莞市新世纪科教拓展有限公司，为东莞证券股东之一
17 东莞债	指	东莞证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券，债券代码（143019）
19 东莞 01	指	东莞证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第一期），债券代码（151256）
19 东莞债	指	东莞证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券，债券代码（151438）
19 东莞 02	指	东莞证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第二期），债券代码（162093）
20 东莞 01	指	东莞证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券（第一期），债券代码（175215）
21 东莞 C1	指	东莞证券股份有限公司 2021 年非公开发行次级债券（第一期）（178179）
21 东莞 01	指	东莞证券股份有限公司 2021 年公开发行公司债券（第一期）（188393）
22 东莞 01	指	东莞证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（149869）
募集资金专项账户	指	发行人在银行开立的专项用于债券募集资金的接收、存储、划转与本息偿付的账户
报告期	指	2021 年 1 月 1 日至 2021 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

第一节 发行人情况

一、公司基本信息

中文名称	东莞证券股份有限公司
中文简称	东莞证券
外文名称（如有）	Dongguan Securities Co., Ltd.
外文缩写（如有）	Dongguan Securities
法定代表人	陈照星
注册资本（万元）	150,000.00
实缴资本（万元）	150,000.00
注册地址	广东省东莞市 莞城区可园南路一号
办公地址	广东省东莞市 莞城区可园南路一号金源中心 30 楼
办公地址的邮政编码	523011
公司网址（如有）	www.dgzq.com.cn
电子信箱	zqswbgs@dgzq.com.cn

二、信息披露事务负责人

姓名	李志方
在公司所任职务类型	<input type="checkbox"/> 董事 <input checked="" type="checkbox"/> 高级管理人员
信息披露事务负责人具体职务	副总裁兼财务总监、董事会秘书
联系地址	广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 31 楼
电话	0769-22113832
传真	0769-22116999
电子信箱	lzf@dgzq.com.cn

三、报告期内控股股东、实际控制人及其变更情况

（一）报告期内控股股东的变更情况

适用 不适用

（二）报告期内实际控制人的变更情况

适用 不适用

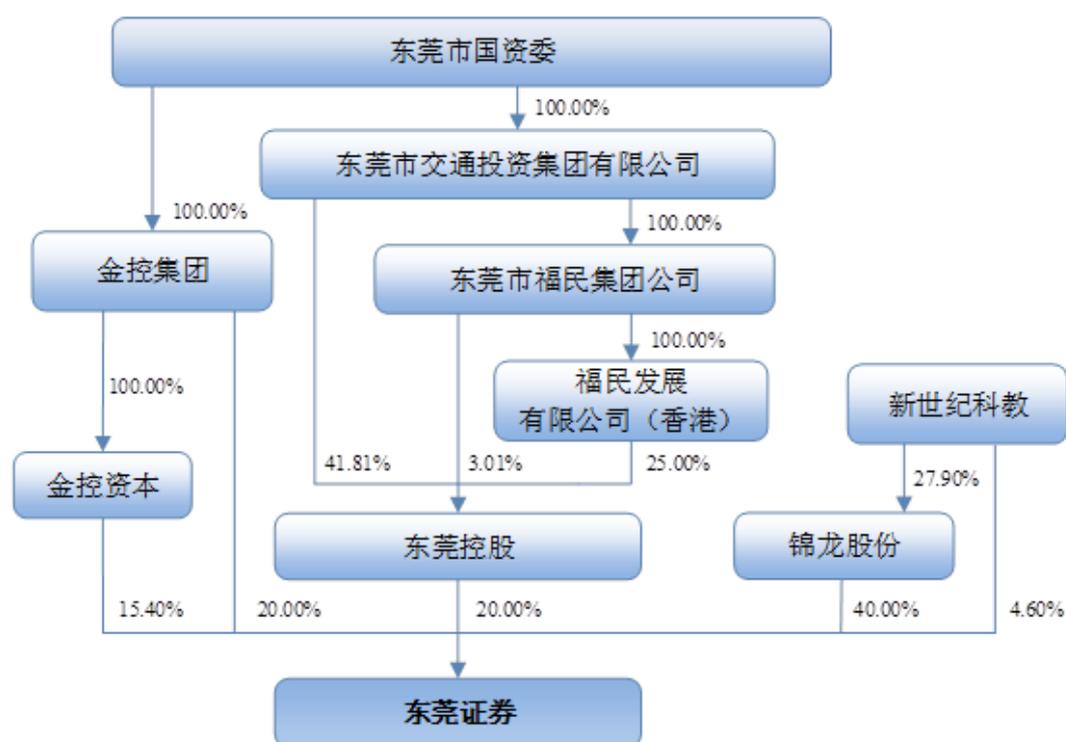
（三）报告期末控股股东、实际控制人信息

报告期末控股股东名称：无

报告期末控股股东对发行人的股权（股份）质押占控股股东持股的百分比（%）：不适用

报告期末实际控制人名称：东莞市人民政府国有资产监督管理委员会

公司与控股股东、实际控制人之间的产权及控制关系的方框图（有实际控制人的披露至实际控制人，无实际控制人的披露至最终自然人、法人或结构化主体）



控股股东、实际控制人为非机关法人或者法律法规规定的其他主体

适用 不适用

四、报告期内董事、监事、高级管理人员的变更情况

（一）报告期内董事、监事、高级管理人员是否发生变更

发生变更 未发生变更

变更人员类型	变更人员名称	变更人员职务	决定/决议变更时间或辞任时间	工商登记完成时间
监事	赖淑娴	监事	2021年9月2日	2022年2月7日

高级管理人员	吴健文	副总裁	2021 年 6 月 11 日	无工商登记
高级管理人员	徐楠	首席信息官	2021 年 3 月 31 日	无工商登记

（二） 报告期内董事、监事、高级管理人员离任人数

报告期内董事、监事、高级管理人员的离任（含变更）人数：3 人，离任人数占报告期初全体董事、监事、高级管理人员人数 12.5%。

（三） 定期报告批准报出日董事、监事、高级管理人员名单

定期报告批准报出日发行人的全体董事、监事、高级管理人员名单如下：

发行人董事长：陈照星

发行人的其他董事：朱凤廉、张丹丹、刘瑜、王庆明、张烙仰、刘金山、黄驰、周润书

发行人的监事：陈就明、张海梅、肖冰、罗志红、聂燕峰

发行人的总经理：潘海标

发行人的财务负责人：李志方

发行人的其他高级管理人员：郜泽民、郭小筠、季王锋、陈爱章、郭天顺、杜绍兴

五、公司业务和经营情况

（一） 公司业务情况

1. 报告期内公司业务范围、主要产品（或服务）及其经营模式

报告期内公司业务、经营情况及公司所在行业情况未发生重大变化，持续稳健经营，对公司偿债能力无不利影响。

公司业务范围包括：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；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品。（凭有效许可证经营）（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

根据不同业务类型，公司的业务主要可以分为证券经纪业务、自营业务、投资银行业务、资产管理业务、信用业务、期货业务、私募投资基金业务、另类投资业务等。

2. 报告期内公司所处行业情况，包括所处行业基本情况、发展阶段、周期性特点等，以及公司所处的行业地位、面临的主要竞争状况，可结合行业特点，针对性披露能够反映公司核心竞争力的行业经营性信息

（1） 所处行业情况

在中国经济的发展进程中，中国证券市场在改善融资结构、优化资源配置、促进经济发展等方面发挥了十分重要的作用，已经成为中国社会经济体系的重要组成部分。但与世界主要发达国家相比，中国资本市场仍处于起步阶段，发展潜力巨大，随着中国多层次资本市场体系的建立和完善，新股发行体制改革的深化，新三板、股指期货等制度创新和产品创新的推进，中国证券市场正在逐步走向成熟，将在优化资源配置、促进企业转制、改善融资结构、加速经济发展等方面发挥更重要的作用。

20 世纪 70 年代末期以来的中国经济改革大潮，推动了我国证券市场的萌生和发展。

在过去的 40 多年间，我国证券市场经历了从无到有，从小到大，从区域到全国的发展历程，证券市场在改善融资结构、优化资源配置、促进经济发展等方面发挥了十分重要的作用，已成为我国社会经济体系不可替代的组成部分。

1990 年，上海证券交易所和深圳证券交易所相继成立，标志着新中国集中交易的证券市场正式诞生。1992 年 10 月，国务院证券管理委员会和中国证监会成立，标志着中国证券市场开始逐步纳入全国统一监管框架。1999 年《证券法》的实施及 2005 年、2006 年《证券法》和《公司法》的修订，使中国证券市场在法制化建设方面迈出了重要步伐。2004 年 1 月国务院《关于推进资本市场改革开放和稳定发展的若干意见》的出台标志着中央政府对证券市场发展的高度重视。此后中国证券市场进行了一系列重大制度变革，主要包括实施股权分置改革、提高上市公司质量、证券公司综合治理、大力发展机构投资者、改革发行制度、建立多层次市场体系和多样化产品结构。2014 年 1 月和 5 月，国务院相继发布《国务院关于推进资本市场改革开放和稳定发展的若干意见》和《关于进一步促进资本市场健康发展的若干意见》，上述改革将进一步提高我国证券市场的市场化程度，促进行业稳定发展。

2018 年中央经济工作会议指出，资本市场在金融运行中具有牵一发而动全身的作用，要通过深化改革，打造一个规范、透明、开放、有活力、有韧性的资本市场。科创板设立、试点注册制、系统重要性证券机构建设等改革新政频出，将不断增强资本市场开放性、包容性和竞争力。

2018 年以来，监管部门继续贯彻依法监管、全面监管和从严监管的监管理念，先后颁布了投行内控指引、资产管理、债券交易、境外子公司管理规范等系列基础性监管新规，相关规则更加严密细致，对证券公司的经营管理产生了重大的影响。中央全面深化改革委员会已通过设立上交所科创板并试点注册制总体实施方案，对证券公司的产业研究能力、定价能力、机构销售能力、客户开发能力、整体协同能力等方面，提出了更高的要求。随着行业对外开放加速，外资加快申请设立控股证券公司；商业银行纷纷成立理财子公司，大资管领域的竞争格局将发生变化；行业集中度不断提升，证券公司间的竞争强度增加，证券行业竞争进一步加剧。

新《证券法》于 2020 年 3 月 1 日起实施，资本市场改革发展稳步推进。部分券商获批基金投顾业务试点资格，有利于券商加速从传统经纪业务向财富管理转型，拓宽券商业务内容。短期证券市场受疫情发展情况影响，但中长期随着资本市场改革的持续推进和利好政策的出台落地，证券市场行情有望进一步回暖。

根据中国证券业协会统计，2021 年度，证券公司共服务 481 家企业完成境内首发上市，融资金额达到 5,351.46 亿元，分别同比增加 87 家、增长 13.87%。其中，在科创板首发上市的“硬科技”企业有 162 家，融资 2,029.04 亿元；在创业板首发上市的成长型创新创业企业有 199 家，融资 1,475.11 亿元。两板首发上市家数占全年 IPO 家数的 75.05%，融资金

额占全年 IPO 融资总额的 65.48%，引导资本有效支持科技创新。2021 年证券公司服务 527 家境内上市公司实现再融资，融资金额达到 9,575.93 亿元，分别同比增加 132 家、增长 8.10%。证券公司承销债券 15.23 万亿元，同比增长 12.53%。证券行业 2021 年实现投资银行业务净收入 699.83 亿元，同比增长 4.12%。证券行业积极践行新发展理念，服务实体经济取得新成效。

2021 年全行业 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。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%。

（2）公司所处行业地位

发行人是总部设在东莞市的全国性证券公司。根据近三年证券公司分类评价结果，公司 2019 年被评为 B 类 B 级，2020 年被评为 A 类 A 级，2021 年被评为 A 类 A 级。根据中国证券业协会的统计数据，发行人 2020 年经营业绩排名情况如下：

项目	排名
总资产	第 42 位
净资产	第 65 位
净资本	第 64 位
营业收入	第 42 位
净利润	第 44 位
净资产收益率	第 6 位
代理买卖证券业务收入	第 19 位

从各项排名情况来看，公司业务表现处于行业中等水平之上，同时各类业务发展速度较快，具有较好的成长性及较强的市场竞争力，各项业务呈现出良好的发展态势。

（3）公司的竞争优势和发展定位及战略发展目标

发行人的竞争优势为：

① 证券经纪业务区域竞争优势突出

发行人在东莞地区具有较高的知名度，其证券经纪业务具有较强的区域竞争优势。

② 业务发展趋于多元化

除巩固经纪业务基础外，近年来发行人资管业务主动管理能力提升，投资银行业务亦取得较快发展，业务多元化发展情况较好。

③ 收益率水平在行业中具有比较优势

凭借良好的经营表现及费用管控能力，发行人整体盈利能力较强，净资本收益率排名相对居前。

公司的发展定位为：以创新为导向，走差异化发展道路，把公司建设成特色鲜明、重点突出、业务全面的全国性综合金融服务商。

公司战略发展目标如下：

- ① 完善法人治理结构，健全内部控制机制；
- ② 积极推动建立多渠道的净资本补充机制，使公司净资本规模达到 100 亿元以上；
- ③ 在做大做强经纪业务的基础上，重点推进大投行业务和大资管业务发展，做精做强信用业务、自营业务和私募基金业务，积极发展创新业务，持续提升公司核心竞争能力，不断增强收入来源多元化战略，使公司各项业务指标达到国内中等规模以上证券公司水平，主要经营指标力争稳定进入全国前 30 名。

围绕上述战略发展目标，公司业务发展主线是：以经纪业务为基础，大投行和大资管业务为重点，大力推进包括融资融券业务、固定收益业务、投资管理业务、研究咨询业务等多项业务的全面发展；公司业务拓展地域布局是：植根东莞，积极向珠三角、长三角以及环渤海经济圈等沿海经济发达地区扩张，进而辐射全国。

3.报告期内公司业务、经营情况及公司所在行业情况是否发生重大变化，以及变化对公司生产经营和偿债能力产生的影响

报告期内公司业务、经营情况及公司所在行业情况未发生重大变化，公司生产经营和偿债能力良好。

（二） 新增业务板块

报告期内新增业务板块

是 否

（三） 主营业务情况

1. 主营业务分板块、分产品情况

(1) 各业务板块基本情况

单位：亿元 币种：人民币

业务板块	本期				上年同期			
	营业收入	营业成本	毛利率（%）	收入占比（%）	营业收入	营业成本	毛利率（%）	收入占比（%）
证券经纪业务	14.78	6.78	54.13	39.94	13.91	5.84	57.98	43.95
证券自营业务	2.83	2.08	26.36	7.65	2.59	1.61	37.83	8.18
投资银行业务	3.79	2.51	33.61	10.24	2.91	1.93	33.79	9.19
资产管理业务	0.66	0.22	66.39	1.78	0.82	0.25	69.33	2.59
信用业务	8.93	-1.55	117.32	24.13	7.47	0.26	96.47	23.60
期货业务	1.46	0.91	38.00	3.94	1.33	0.86	35.56	4.20
私募投资基金业务	-0.24	0.15	-	-0.65	-0.23	0.14	-	-0.73

业务板块	本期				上年同期			
	营业收入	营业成本	毛利率（%）	收入占比（%）	营业收入	营业成本	毛利率（%）	收入占比（%）
另类投资业务	1.31	0.06	95.41	3.54	0.44	0.03	94.08	1.39
其他	3.97	12.63	-218.32	10.73	3.68	10.04	-172.86	11.63
合并抵销	-0.47	-0.11	-	-1.27	-1.28	-0.08	-	-4.04
合计	37.01	23.69	35.99	100.00	31.65	20.89	33.99	100.00

(2) 各业务板块分产品（或服务）情况

√适用 □不适用

请在表格中列示占公司合并口径营业收入或毛利润 10%以上的产品（或服务），或者虽然未达到占公司合并口径营业收入或毛利润 10%以上这一条件，但在所属业务板块中收入占比最高的产品（或服务）

单位：亿元 币种：人民币

产品/服务	所属业务板块	营业收入	营业成本	毛利率（%）	营业收入比上年同期增减（%）	营业成本比上年同期增减（%）	毛利率比上年同期增减（%）
证券经纪业务	证券经纪业务	14.78	6.78	54.13	6.26	16.00	-6.64
投资银行业务	投资银行业务	3.79	2.51	33.61	30.11	30.46	-0.53
信用业务	信用业务	8.93	-1.55	117.32	19.52	-686.98	21.61
其他	其他	3.97	12.63	-218.32	7.84	25.80	26.30
合计	—	31.47	20.37	—	63.73	-614.72	—

2. 收入和成本分析

各业务板块、各产品（或服务）营业收入、营业成本、毛利率等指标同比变动在 30%以上的，发行人应当结合所属行业整体情况、经营模式、业务开展实际情况等，进一步说明相关变动背后的经营原因及其合理性。

报告期内证券自营业务、投资银行业务、信用业务、另类投资业务营业收入、营业成本、毛利率等指标同比变动在 30%以上。

1、证券自营业务

固定收益类投资业务：2021 年，国内疫情防控常态化、经济稳步复苏，前三季度维持灵活适度的货币政策，债券市场以震荡格局为主，进入四季度货币政策整体宽松，市场预期开始转变，债券收益率出现较大幅度的下行，十年期国债收益率年末降至 2.78%，较年初下行了 36 个基点。公司积极研究市场，持续引进人才，运用多元化投资策略合理配置，保持适当杠杆率，同时加大了波段交易的频率，在四季度的收益率下行时及时降低了杠杆，截至 2021 年末，非权益类证券及衍生品规模为 133.13 亿元，较去年同期略有上升，取得了较好的投资收益。

权益类投资业务：2021 年，A 股市场整体以震荡为主，指数分化严重，局部行情较为明显。公司自营权益类证券投资部门在公司“1+3+N”战略规划指引下，以投资工作为核心，持续优化投资策略、调整和优化专业的投资团队，探索期货、期权做市等新的业务方向，并根据市场情况优化调整股票、基金、衍生品等自营业务的投资配置，截至 2021 年末权益类自营业务规模为 4.51 亿元，较去年同期有所下降，取得了一定的投资收益。

2、投资银行业务

股权业务方面：2021年，股权业务机遇和挑战并存，一方面，注册制、北交所新政等措施推动A股市场迎来了直接融资的大时代；另一方面，随着监管部门职能的转变，监管高压态势持续升温。作为中等规模券商，公司及时调整业务策略，重点布局注册制和北交所项目，积极开拓和培养优质项目，加大投行业务“三道防线”实质性作用，进一步控制项目风险。2021年成功保荐4家IPO项目发行，完成2家非公开发行以及1家可转债项目，股权承销业务规模合计45.17亿元，其中IPO业务承销规模合计35.89亿元，同比增长87.81%，创历史新高，股权承销业务逐步进入良性循环。

债券业务方面：2021年，债券市场流动性方面，央行推动实施稳健的货币政策，保持流动性合理充裕，稳健的货币政策继续聚焦支持实体经济。债券市场制度建设方面，在监管趋严的大背景下，今年监管部门相继发布制度文件，推动债券市场制度统一，强化信息披露要求，注重风险防范工作，进一步促进债券市场的规范发展。2021年公司债务融资业务稳步推进，债券承销规模共197.41亿元，较上年同比增长12%，其中公司主承销各类公司债券29支，承销规模合计110.76亿元；分销各类公司债券12支，分销规模合计20.62亿元；分销其他债券99支，分销规模合计66.03亿元。

全国股份转让系统业务方面：2021年，全国股份转让系统市场规模持续收缩，公司成功推荐3家企业挂牌，助力8家次挂牌企业融资7.72亿元。公司对持续督导项目实施分层培养，对标北交所要求推进优质项目的辅导与申报，同时，公司按照全国股份转让系统的最新监管要求，进一步加强对已挂牌公司的持续督导工作，确保信息披露及时、准确与完整。

3、信用业务

2021年A股市场权重股与中小板股票行情走势分化较大，融资融券业务市场整体规模为1.83万亿元，融资融券业务整体市场业务规模涨幅较2020年明显放缓。截止2021年末，公司融资融券业务融出资金余额128.53亿元，同比增长19.97%。股票质押业务方面，公司为控制风险，主动缩减规模，截至2021年末，公司自有资金股票质押规模5.96亿元，同比减少37.03%。

2021年公司不断增加信用业务相关投入，提高业务管理效率，促进融资融券业务的持续发展，融资规模取得了规模性的增长，融券业务取得突破。股票质押业务方面，2021年继续以逐步压缩业务规模、缓释业务风险为主，取得了良好的工作效果。公司抓住市场机遇提升两融业务规模的同时不断加强风险管理能力，完善信用业务管理制度体系，加强融资融券证券管理和信用业务盯市管理，强化股票质押业务事后资金监管与贷后管理；持续加强科技赋能金融，充分利用金融科技优化系统性能并规范业务发展，积极促进信用业务的开展。

4、另类投资子公司业务

截至2021年末，另类投资子公司东证宏德存量跟投母公司保荐的科创板上市企业4家，具体为利扬芯片、鼎通科技、生益电子及博力威，分别持有战略跟投股份170.50万股、106.45万股、499.09万股、125.00万股，跟投规模1.43亿元；其他另类投资业务投资4,255.20万元；年内顺利完成科创板首个跟投项目联瑞新材的全面退出。同时，东证宏德开展战略配售股份的转融通证券出借业务，2021年度实现融券收入846.45万元。

（四） 公司关于业务发展目标的讨论与分析

1.结合公司面临的特定环境、所处行业及所从事业务的特征，说明报告期末的业务发展目标

公司的发展定位为：以创新为导向，走差异化发展道路，把公司建设成特色鲜明、重点突出、业务全面的全国性综合金融服务商。

公司战略发展目标如下：

- （1）完善法人治理结构，健全内部控制机制；
- （2）积极推动建立多渠道的净资本补充机制，使公司净资本规模达到100亿元以上；
- （3）在做大做强经纪业务的基础上，重点推进大投行业务和大资管业务发展，做精做强

信用业务、自营业务和私募基金业务，积极发展创新业务，持续提升公司核心竞争能力，不断增强收入来源多元化战略，使公司各项业务指标达到国内中等规模以上证券公司水平，主要经营指标力争稳定进入全国前30名。

围绕上述战略发展目标，公司业务发展主线是：以经纪业务为基础，大投行和大资管业务为重点，大力推进包括融资融券业务、固定收益业务、投资管理业务、研究咨询业务等多项业务的全面发展；公司业务拓展地域布局是：植根东莞，积极向珠三角、长三角以及环渤海经济圈等沿海经济发达地区扩张，进而辐射全国。

2.公司未来可能面对的风险，对公司的影响以及已经采取或拟采取的措施

（1）影响公司业务经营活动的各项风险因素及表现

报告期内，影响公司业务经营活动的风险主要有：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、法律合规风险和新业务风险等方面。2021年，股票市场及债券市场整体呈上涨趋势，公司稳步有序开展各项业务，同时做好相应的风险管理，全年未新增发生重大风险事件，同时积极推进处置往年风险事件，并顺利办结“于雷事件”与“赵淦鸿事件”衍生的全部司法案件，消除该两起事件对公司的影响，有效将公司整体风险水平控制在合理范围内。

（2）针对上述风险，公司已（拟）采取的风险防范对策和措施

①市场风险管理措施

针对市场风险，公司建立了自上而下的风险限额管理体系，根据风险偏好设定公司市场风险容忍度及整体风险限额，并将整体风险限额在各业务条线之间细化分解。公司董事会确定年度业务总规模及风险政策，公司经营管理层将董事会确定的年度业务总规模和风险政策等进行分解，并审批确定相应风险限额，公司各业务部门在业务范围和审批权限内进行投资操作。公司建立了以风险价值（VaR）为核心，包括基点价值（DV01）、集中度、止盈止损、最大回撤、夏普比例等指标在内的市场风险监控和业绩评估体系，主要采用风险限额的方式对市场风险进行管理，对以上各项风险指标各相关业务部门采取组合投资、逐日盯市、对冲缓释、系统硬控、监控预警等手段进行风险控制。风险管理部每日计量市场风险水平，监测业务单位执行风险限额的情况及公司整体市场风险状况，定期和不定期地向业务单位提示风险、向公司经营管理层汇报风险状况。

②信用风险管理措施

在债券投资业务方面，公司通过加强风险防范意识、操作上限制可投资债券的信用等级、设立规模及集中度指标、制定交易对手评级及交易结算有关制度、建立投资标的产品库、持续跟踪发行人信用资质变化等方式进行风险控制。第一，对交易对手方进行尽职调查，了解其在市场中的业务情况及信誉状况；第二，根据业务发展及时充实投研力量，提高对市场的分析能力，防止因债券流动性问题导致资金链断裂而违约；第三，回购融资方面，拓宽资金融入渠道，坚持银行间市场和交易所市场互相补充，防止因客户结构单一造成资金紧张时的还款违约风险；第四，积极采取质押回购、买断式回购、同业拆借等方式多渠道融入资金；第五，完善债券出入库的决策机制，减少不被纳入地方政府性负债的债券和民营企业私募债或非公开发行公司债仓位；第六，建立投后跟踪管理、舆情监控以及风险排查机制，对出现风险较大或出现风险隐患的债券及时采取相应的处置措施。

在信用业务开展过程中，公司重点关注融资融券客户及股票质押融入方的信用风险，加强落实客户适当性管理和尽职调查工作，通过多角度多层次考察客户的资产情况、偿还能力、过往信用记录、投资经验等因素综合评估客户信用风险，进一步完善客户准入标准，控制信用等级过低的客户进入。同时公司综合运用以下手段进行风险防控，即采取严格的分级授信制度控制客户的融资金额，分散信用风险；建立黑名单制度和强制平仓机制；将前期涨幅过大的证券的折算率适当调低，或者提高盯市监控阈值指标和控制最高开仓限额。针对主动管理的债权类投行业务、资管非标债权业务和私募基金业务面临的信用风险，通过以下方式进行防范：一是选择优质项目，即对发行人或融资方尽量选择国企类企业，同时项目优先考虑纳入地方政府性负债的项目或有政府平台类企业做担保或提供足额抵质押增信；二是谨慎选择评级公司，督促其在项目存续期内做好评级跟踪工作；三是在项目存续期内，及时掌握发行人或融资方经营状况的变化，并对其偿还能力进行持续的跟踪和评

价；四是做好对项目增信措施的跟踪与评估；五是规范与强化发行人或融资方的信息披露工作，确保内外部监督到位。

为了进一步强化信用风险管控，对部分重大投融资项目和投资银行类项目，由项目承办部门的项目人员和风险管理部的风控人员按照公司相关制度要求联合开展实地调查。项目承办部门和风险管理部门各自对项目风险和可行性进行评估分析，分别出具独立的评估报告，并提交公司风险管理执行委员会、公司经营管理层等进行审议决策。公司通过实施双审查工作机制深入项目现场进行风险评估，强化了对项目的了解深度，有效防范项目的信用风险。

③流动性风险管理措施

公司建立以董事会为最高决策机构、经营管理层为执行管理机构、风险管理部为流动性风险管理工作统筹单位、计财部为流动性风险管理的主要负责单位、除风险管理部和计财部以外的其他单位为执行落实主体的流动性风险管理组织架构。公司建立健全流动性风险管理体系，强化资金管理、融资管理、现金流管理、压力测试及流动性应急计划管理等职能。公司制订了《东莞证券股份有限公司自有资金管理办法》《东莞证券股份有限公司流动性管理办法》《东莞证券股份有限公司流动性风险管理办法》《东莞证券股份有限公司债务融资管理办法》，以加强公司资金使用管理、流动性管理、流动性风险监测及风险事件管理、债务融资管理，防范流动性风险。

公司通过制订年度资金使用计划和财务预算，明确业务规模，加强资金、资产、负债和流动性指标管理，保留现金类储备，维护和拓宽融资渠道等综合手段管理流动性风险。公司根据流动性状况进行现金流测算，计量现金流缺口，对资产流动性、融资渠道稳定性进行定期评估，尽量保持融资渠道方式、期限、交易对手方的分散性，保证资产负债在期限上的适度匹配，保持各业务条线的资金使用规模在年度自有资金使用规模限额之内。

公司成立了流动性应急小组，建立了流动性应急方案，设立了公司日间最低现金类储备。当流动性指标数值触发制度规定情景时，公司按照全面风险应急管理制度相关规定启动预警和应急处置流程，应急处置措施包括：申请动用现金类储备；调动市场客户资源，与已建立战略合作关系的各家银行、基金等机构，利用双边合作关系，通过债务方式获得资金支持；减少或暂停业务资金的新增使用，必要时压缩业务规模；出售长期资产、固定资产或股权等资产；启动资本补充程序等。

④操作风险管理措施

公司根据外部监管自律规则和内部制度规定，制定并完善《东莞证券股份有限公司操作风险管理办法》，上线操作风险管理系统，实施经纪业务分支机构合规风控主管联合管理，加强风险管理培训和考核，提高操作风险管理水平。目前公司主要运用“风险与控制自我评估”、“损失数据收集”和“关键风险指标”三大操作风险管理工具对公司操作风险进行管理，结合公司经营业务情况设置操作风险损失、系统可用率、员工离职率、员工培训学时等操作风险指标，并持续进行监测，确保操作风险限额符合要求。

为有效管理操作风险，公司根据业务发展需要及时建立、完善规章制度和业务流程，各业务均制定操作流程、差错处理流程和风险应急预案，并根据年度计划积极组织员工参加业务培训以提高员工操作技能和风险意识，不断增加系统建设投入以提高基础设施应用水平。公司加强内部印章和授权管理，强调业务部门作为第一道风险防线的作用，通过工作指引等手段梳理现行流程、环节说明和制度框架，寻找各项业务流程上的风险控制点，对业务流程中不适应管理需要及运作要求的方面进行完善和修正，并就公司整体和各业务线存在的不足以及风险管理措施进行监控，保证制度、流程和风控措施有效执行，防范操作风险。

⑤法律、合规风险管理措施

在控制合规风险方面，一是完成公司制度回头看专项工作，结合监管最新政策动向以及公司业务实际经营发展需要，重塑公司制度体系，逐步实现制度的科学性、合理性、可操作性；二是通过强化、细化、标准化各项合规管理措施的要求，建立健全事前审查咨询、宣导教育、培训指导一事中监测、检查、督导一事事后考核、问责的合规管理体系，并在过程管理中做好跟踪督导，促进各单位分支机构按要求履行合规管理工作；三是建立隔离墙监控管理机制，通过亲属证券账户管理、桌面监控、固定电话录音及视频监控等管理措施，加强对敏感信息知情人执业行为合规性的监控和管理；四是多措并举，全面提升经纪业务

分支机构合规专员履职专业性与独立性，积极发挥合规管理前移作用；五是明确公司董事会、监事会、经营管理层、高级管理人员、合规总监、各单位第一负责人、合规管理部门、合规管理人员及全体工作人员等各层级的合规管理职责；六是加强合规队伍建设，完善合规管理人员薪酬激励、合规考核和合规问责体系，强化子公司合规管理措施，实现合规管理的全面覆盖；七是通过更新各条线业务合规考试题库、每周汇总下发监管动态及合规知识一点通等方式，组织各条线合规专员进行学习、测试，多途径多手段让合规人员及时了解监管动态、行业合规风险案例，督促合规专员持续学习，并指导其对所在单位进行自查自纠，提升合规团队防范合规风险的意识及专业能力。

通过上述措施，公司力图构建全面而有效的合规体系，努力打造不想和不敢违规的合规文化氛围，防范公司法律风险与合规风险，为公司业务稳步开展保驾护航，确保公司合法合规有序经营。

⑥新业务风险管理措施

公司以“创新业务发展、合规风控先行”为风险管理理念，不断提高对创新业务风险的识别和防范能力。为控制创新业务风险，公司采取以下应对措施：一是建立针对新业务的管理制度、流程和审批路径；二是积极组织、协调各有关业务部门，通过沟通协调，充分了解新业务的运作模式、估值模型和系统等；三是识别和鉴定开展新业务所面临的风险点和风险类型；四是针对不同类型的风险，采取相应的有针对性的防控措施；五是对新业务进行详尽的测试，包括运作流程、业务系统、估值模型等；六是持续跟踪新业务运作情况，定期评估新业务开展的经营状况，并进行优化完善。

六、公司治理情况

（一） 发行人报告期内是否存在与控股股东、实际控制人以及其他关联方之间不能保证独立性的情况：

是 否

（二） 发行人关联交易的决策权限、决策程序、定价机制及信息披露安排

1、发行人关联交易的决策权限

（1）公司拟与关联人（关联法人和关联自然人）之间的单笔关联交易（上市公司提供担保、受赠现金资产、单纯减免上市公司义务的债务除外）金额在人民币2,000万元以上，应聘请具有执业证券、期货相关业务资格的证券服务机构对交易标的出具审计或评估报告，并将该交易事项提交公司股东大会审议。

（2）若交易标的为公司股权，公司应当提供具有执行证券、期货相关业务资格的会计师事务所，按照企业会计准则对交易标的最近一年又一期的财务会计报告出具审计报告，审计截止日距审议该交易事项的股东大会召开日不得超过六个月；若交易标的为股权以外的其他非现金资产，公司应当提供具有执行证券、期货相关业务资格的资产评估事务所出具的评估报告，评估基准日距审议该交易事项的股东大会召开日不得超过一年。

（3）与日常经营相关的关联交易所涉及的交易标的，可以不进行审计或评估。

（4）如关联自然人为董事、高级管理人员的，其与公司的交易还须经股东大会同意。

（5）公司与关联自然人发生的交易金额在30万元以上的关联交易（公司提供担保除外）；公司与关联法人发生的交易金额在300万元以上的关联交易（公司提供担保除外），由公司董事会审议通过。

（6）公司拟与关联人达成的总额高于300万元人民币或高于公司最近经审计净资产的5%的关联交易，应当由独立董事认可后，提交董事会讨论。独立董事在作出判断前，可以聘请中介机构出具独立财务顾问报告，作为其判断的依据。公司审计委员会应当同时对该关联交易事项进行审核，形成书面意见，提交董事会审议，并报告监事会。审计委员会可以聘请独立财务顾问出具报告，作为其判断的依据。

（7）董事会权限范围以下的关联交易由公司总裁审批。

2、发行人关联交易的决策程序

（1）重大关联交易

公司拟与关联人发生重大关联交易的，应当在独立董事发表事前认可意见后，提交董事会

审议。独立董事作出判断前，可以聘请独立财务顾问出具报告，作为其判断的依据。公司审计委员会应当同时对该关联交易事项进行审核，形成书面意见，提交董事会审议，并报告监事会。审计委员会可以聘请独立财务顾问出具报告，作为其判断的依据。

（2）日常关联交易

公司与关联人进行日常关联交易时，按以下程序进行审议：

- ①已经股东大会或董事会审议通过且正在执行的日常关联交易协议，如果执行过程中主要条款未发生重大变化的，公司应当在年度报告和中期报告中按要求披露各协议的实际履行情况，并说明是否符合协议的规定；如果协议在执行过程中主要条款发生重大变化或协议期满需要续签的，公司应当将新修订或续签的日常关联交易协议，根据协议涉及的总交易金额提交董事会或股东大会审议，协议没有具体总交易金额的，应当提交股东大会审议；
- ②首次发生的日常关联交易，公司应当与关联人订立书面协议，根据协议涉及的总交易金额提交董事会或股东大会审议，协议没有具体总交易金额的，应当提交股东大会审议；该协议经审议通过后，根据其进行的日常关联交易按照前款规定办理；
- ③每年新发生的各类日常关联交易数量较多，需要经常订立新的日常关联交易协议等，难以按照前项规定将每份协议提交董事会或股东大会审议的，公司可以在公布上一年度报告之前，按类别对本公司当年度将发生的日常关联交易总金额进行合理预计，根据预计结果提交董事会或股东大会审议；公司实际执行中超出预计总金额的，应当根据超出量重新提请董事会或股东大会审议。

3、关联交易的定价机制

（1）公司与关联人之间的关联交易应签订书面协议。协议的签订应当遵循平等、自愿、等价、有偿的原则，协议内容应明确、具体。

（2）公司应采取有效措施防止关联人以垄断采购和销售业务渠道等方式干预公司的经营，损害公司利益。关联交易活动应遵循商业原则，关联交易的价格原则上应不偏离市场独立第三方的价格或收费的标准。

4、关联交易的信息披露安排

公司应于每月前5个工作日内通过机构综合监管信息系统报送《证券公司关联方专项监管报表》。监管部门另有规定的从其规定。

（三） 发行人关联交易情况

1. 日常关联交易

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

关联交易类型	该类关联交易的金额
提供劳务	0.03
接受劳务	0.02
关联租赁（接受关联方租赁服务和向关联方提供租赁服务）	0.01
关键管理人报酬	0.34
关联方认购本公司发行的资产管理计划	0.26
购买关联方理财产品	4.00
与关联方进行债券交易情况	5.60
向关联方拆入资金	6.25
以报价回购方式向关联方融入资金	0.62
在关联商业银行储蓄资金期末余额（自有资金和客户资金）	22.54
对关联方的利息支出	0.21
收取关联方的利息收入	0.47
购买关联方证券取得投资收益	0.03

2. 其他关联交易

适用 不适用

3. 担保情况

适用 不适用

4. 报告期内与同一关联方发生的关联交易情况

报告期内与同一关联方发生关联交易累计占发行人上年末净资产百分之一百以上的

适用 不适用

（四） 发行人报告期内是否存在违反法律法规、公司章程、公司信息披露事务管理制度等规定的情况

是 否

（五） 发行人报告期内是否存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况

是 否

（六） 发行人是否属于应当履行环境信息披露义务的主体

是 否

第二节 债券事项

一、公司信用类债券情况

（一） 结构情况

截止报告期末，发行人口径有息债务余额 181.40 亿元，其中公司信用类债券余额 118.90 亿元，占有息债务余额的 65.55%；银行贷款余额 0 亿元，占有息债务余额的 0%；非银行金融机构贷款 0 亿元，占有息债务余额的 0%；其他有息债务余额 62.50 亿元，占有息债务余额的 34.45%。

单位：亿元 币种：人民币

有息债务类别	到期时间					合计
	已逾期	6 个月以内（含）；	6 个月（不含）至 1 年（含）	1 年（不含）至 2 年（含）	2 年以上（不含）	
公司债券	-	20.5	10	28	22	80.5
次级债券	-	20			18.4	38.4
短期融资券	-	15	15			30
收益凭证		20.90	4.30	0.25	0.10	25.55
转融通融入资金	-	5.95				5.95
融资融券出让收益权回购	-	1				1

截止报告期末，发行人层面发行的公司信用类债券中，公司债券余额 118.90 亿元，企业债券余额 0 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0 亿元，且共有 50.50 亿元公司信用类债券在 2022 年内到期或回售偿付。

（二） 债券基本信息列表（以未来行权（含到期及回售）时间顺序排列）

单位：亿元 币种：人民币

1、债券名称	东莞证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券
2、债券简称	17 东莞债
3、债券代码	143019
4、发行日	2017 年 3 月 8 日
5、起息日	2017 年 3 月 8 日
6、2022 年 4 月 30 日后的最近回售日	-
7、到期日	2022 年 3 月 8 日
8、债券余额	10.50
9、截止报告期末的利率(%)	4.62
10、还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利。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
11、交易场所	上交所
12、主承销商	财通证券股份有限公司
13、受托管理人（如有）	财通证券股份有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向合格投资者交易的债券
15、适用的交易机制	竞价、报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第一期）
2、债券简称	19 东莞 01
3、债券代码	151256
4、发行日	2019 年 3 月 15 日
5、起息日	2019 年 3 月 15 日
6、2022 年 4 月 30 日后的最近回售日	-
7、到期日	2022 年 3 月 15 日
8、债券余额	10.00
9、截止报告期末的利率(%)	4.50
10、还本付息方式	采取单利按年计息，不计复利，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
11、交易场所	上交所
12、主承销商	东莞证券股份有限公司
13、受托管理人（如有）	东北证券股份有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向合格机构投资者交易的债券
15、适用的交易机制	报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券
--------	----------------------------

2、债券简称	19 东莞债
3、债券代码	151438
4、发行日	2019年4月19日
5、起息日	2019年4月19日
6、2022年4月30日后的最近回售日	-
7、到期日	2022年4月19日
8、债券余额	20.00
9、截止报告期末的利率(%)	4.90
10、还本付息方式	采取单利按年计息，不计复利，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
11、交易场所	上交所
12、主承销商	东莞证券股份有限公司
13、受托管理人（如有）	东北证券股份有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向合格机构投资者交易的债券
15、适用的交易机制	报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券（第二期）
2、债券简称	19 东莞 02
3、债券代码	162093
4、发行日	2019年9月12日
5、起息日	2019年9月12日
6、2022年4月30日后的最近回售日	-
7、到期日	2022年9月12日
8、债券余额	10.00
9、截止报告期末的利率(%)	4.60
10、还本付息方式	采取单利按年计息，不计复利，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
11、交易场所	上交所
12、主承销商	东莞证券股份有限公司
13、受托管理人（如有）	东北证券股份有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向合格机构投资者交易的债券
15、适用的交易机制	报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司2020年公开发行公司债券（第一期）
2、债券简称	20 东莞 01
3、债券代码	175215
4、发行日	2020年9月25日
5、起息日	2020年9月25日

6、2022年4月30日后的最近回售日	2023年9月25日
7、到期日	2025年9月25日
8、债券余额	28.00
9、截止报告期末的利率(%)	4.40
10、还本付息方式	本期债券采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金一起支付
11、交易场所	上交所
12、主承销商	东方证券承销保荐有限公司
13、受托管理人（如有）	东方证券承销保荐有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向专业投资者交易的债券
15、适用的交易机制	竞价、报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司2021年非公开发行次级债券（第一期）
2、债券简称	21东莞C1
3、债券代码	178179
4、发行日	2021年3月23日
5、起息日	2021年3月23日
6、2022年4月30日后的最近回售日	-
7、到期日	2024年3月23日
8、债券余额	18.40
9、截止报告期末的利率(%)	5.00
10、还本付息方式	采取单利按年计息，不计复利，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。
11、交易场所	上交所
12、主承销商	东莞证券股份有限公司
13、受托管理人（如有）	国海证券股份有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向专业投资者交易的债券
15、适用的交易机制	报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司2021年公开发行公司债券（第一期）
2、债券简称	21东莞01
3、债券代码	188393
4、发行日	2021年7月22日
5、起息日	2021年7月22日
6、2022年4月30日后的最近回售日	2024年7月22日
7、到期日	2026年7月22日
8、债券余额	22.00

9、截止报告期末的利率(%)	3.75%
10、还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金一起支付
11、交易场所	上交所
12、主承销商	东方证券承销保荐有限公司
13、受托管理人（如有）	东方证券承销保荐有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向专业投资者交易的债券
15、适用的交易机制	竞价、报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

1、债券名称	东莞证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)
2、债券简称	22 东莞 01
3、债券代码	149869
4、发行日	2022 年 4 月 6 日
5、起息日	2022 年 4 月 6 日
6、2022 年 4 月 30 日后的最近回售日	-
7、到期日	2025 年 4 月 6 日
8、债券余额	30.00
9、截止报告期末的利率(%)	3.50%
10、还本付息方式	采用单利按年计息，不计复利，每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金一起支付
11、交易场所	深交所
12、主承销商	东方证券承销保荐有限公司
13、受托管理人（如有）	东方证券承销保荐有限公司
14、投资者适当性安排（如适用）	面向专业投资者交易的债券
15、适用的交易机制	竞价、报价、询价和协议交易
16、是否存在终止上市的风险（如适用）及其应对措施	否

二、公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况

本公司所有公司债券均不含选择权条款 本公司的债券有选择权条款

债券代码：175215

债券简称：20 东莞 01

债券包括的条款类型：

调整票面利率选择权 回售选择权 发行人赎回选择权 可交换债券选择权

其他选择权

选择权条款的触发和执行情况：

本期债券相应选择权在报告期内均未到行权期

债券代码：188393

债券简称：21 东莞 01

债券包括的条款类型：

调整票面利率选择权 回售选择权 发行人赎回选择权 可交换债券选择权
 其他选择权

选择权条款的触发和执行情况：

本期债券相应选择权在报告期内均未到行权期

三、公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况

本公司所有公司债券均不含投资者保护条款 本公司的债券有投资者保护条款

四、公司债券报告期内募集资金使用情况

本公司所有公司债券在报告期内均未使用募集资金

本公司的债券在报告期内使用了募集资金

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：178179

债券简称	21 东莞 C1
募集资金总额	18.40
募集资金报告期内使用金额	18.40
募集资金期末余额	0
报告期内募集资金专项账户运作情况	2021年3月募集资金18.40亿元存入募集资金专项账户，当月划出18.40亿元，用于补充营运资金及偿还有息债务
约定的募集资金使用用途（请全文列示）	拟将本期债券募集资金用于偿还有息债务和补充公司营运资金
是否调整或改变募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
调整或改变募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生调整或变更）	不适用
报告期内募集资金是否存在违规使用情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
报告期内募集资金的违规使用情况（如有）	不适用
募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有）	不适用
报告期内募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用
报告期内募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	不适用
截至报告期末实际的募集资金使用用途	用于偿还有息债务和补充公司营运资金
报告期内募集资金使用情况是否与募集说明书的约定一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
募集资金用途是否包含用于项目建设，项目的进展情况及运营效益（如有）	不适用

单位：亿元 币种：人民币

债券代码：188393

债券简称	21 东莞 01
------	----------

募集资金总额	22.00
募集资金报告期内使用金额	22.00
募集资金期末余额	0
报告期内募集资金专项账户运作情况	2021年7月募集资金22.00亿元存入募集资金专项账户，7月划出15.16亿元，8月划出6.84亿元，用于补充营运资金及偿还有息债务
约定的募集资金使用用途（请全文列示）	本期债券募集资金扣除发行费用后，拟将11亿元用于偿还到期债务，11亿元用于补充营运资金
是否调整或改变募集资金用途	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
调整或改变募集资金用途履行的程序及信息披露情况（如发生调整或变更）	不适用
报告期内募集资金是否存在违规使用情况	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
报告期内募集资金的违规使用情况（如有）	不适用
募集资金违规使用的，是否已完成整改及整改情况（如有）	不适用
报告期内募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 <input checked="" type="checkbox"/> 不适用
报告期内募集资金使用违反地方政府债务管理规定的情形及整改情况（如有）	不适用
截至报告期末实际的募集资金使用用途	将11亿元用于偿还到期债务，11亿元用于补充营运资金
报告期内募集资金使用情况是否与募集说明书的约定一致	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
募集资金用途是否包含用于项目建设，项目的进展情况及运营效益（如有）	不适用

五、公司信用类债券报告期内资信评级调整情况

适用 不适用

六、公司债券担保、偿债计划及其他偿债保障措施情况

（一）报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施变更情况

适用 不适用

（二）截至报告期末担保、偿债计划及其他偿债保障措施情况

适用 不适用

债券代码：143019

债券简称	17 东莞债
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本次债券发行后，发行人将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于每年的利息支付和到期的本金兑付，以充分保障投资者的利益。为了充分、有效地维护债券持有人的利益，公司为按时、足额偿付本次债券制定了一系列工作计划，包括确定专门部门与人员、

	安排偿债资金、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，努力形成一套确保本次债券安全付息、兑付的保障措施。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

债券代码：151256

债券简称	19 东莞 01
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本次债券发行后，发行人将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于利息支付和到期的本金兑付。发行人聘请债券受托管理人并与债券受托管理人共同拟定《债券持有人会议规则》，充分保障投资者的利益。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

债券代码：151438

债券简称	19 东莞债
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本次债券发行后，公司将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于利息支付和到期的本金兑付。公司聘请债券受托管理人并与债券受托管理人共同拟定《债券持有人会议规则》，充分保障投资者的利益。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

债券代码：162093

债券简称	19 东莞 02
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本次债券发行后，发行人将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于利息支付和到期的本

	金兑付。发行人聘请债券受托管理人并与债券受托管理人共同拟定《债券持有人会议规则》，充分保障投资者的利益。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

债券代码：175215

债券简称	20 东莞 01
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本期债券发行后，发行人将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于利息支付和到期的本金兑付。发行人聘请债券受托管理人并与债券受托管理人共同拟定《债券持有人会议规则》，充分保障投资者的利益。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

债券代码：178179

债券简称	21 东莞 C1
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本期债券发行后，发行人将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按计划使用，及时、足额准备资金用于利息支付和到期的本金兑付。发行人聘请债券受托管理人并与债券受托管理人共同拟定《债券持有人会议规则》，充分保障投资者的利益。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

债券代码：188393

债券简称	21 东莞 01
担保、偿债计划及其他偿债保障措施内容	本期债券发行后，发行人将根据债务结构进一步加强资产负债管理、流动性管理和募集资金运用管理，保证资金按

	计划使用，及时、足额准备资金用于利息支付和到期的本金兑付。发行人聘请债券受托管理人并与债券受托管理人共同拟定《债券持有人会议规则》，充分保障投资者的利益。
担保、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有）	无
报告期内担保、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况	报告期内，公司经营状况良好，保有充足的金融资产和稳定的融资渠道，按募集说明书相关承诺执行偿债计划及其他偿债保障措施。

七、中介机构情况

（一）出具审计报告的会计师事务所

√适用 □不适用

名称	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址	武汉市武昌区东湖路169号众环海华大厦
签字会计师姓名	韩振平、潘桂权

（二）受托管理人/债权代理人

债券代码	143019
债券简称	17 东莞债
名称	财通证券股份有限公司
办公地址	杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1106室
联系人	戴炜
联系电话	0571-86783103

债券代码	151256、162093、151438
债券简称	19 东莞 01、19 东莞 02、19 东莞 债
名称	东北证券股份有限公司
办公地址	北京市西城区锦什坊街28号恒奥中心D座
联系人	刘沛
联系电话	010-63210733

债券代码	178179
债券简称	21 东莞 C1
名称	国海证券股份有限公司
办公地址	深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦29楼
联系人	罗侃侃
联系电话	0755-83716973

债券代码	175215、188393、149869
债券简称	20 东莞 01、21 东莞 01、22 东莞 01
名称	东方证券承销保荐有限公司
办公地址	上海市黄浦区中山南路318号24层

联系人	宋岩伟、刘畅、张智骁、路雨晨
联系电话	021-23153888

（三）资信评级机构

适用 不适用

债券代码	143019、151438、175215、188393、149869
债券简称	17 东莞债、19 东莞债、20 东莞 01、21 东莞 01、22 东莞 01
名称	中诚信国际信用评级有限责任公司
办公地址	北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101

（四）报告期内中介机构变更情况

适用 不适用

第三节 报告期内重要事项

一、财务报告审计情况

标准无保留意见 其他审计意见

二、会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

适用 不适用

变更、更正的类型及原因，并说明是否涉及到追溯调整或重述，以及变更、更正对报告期及比较期间财务报表的影响科目及变更、更正前后的金额，涉及追溯调整或重述的，还应当披露对以往各年度经营成果和财务状况的影响。

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（2018 年修订）》（财会〔2018〕35 号）（以下简称“新租赁准则”），依据新租赁准则的规定对相关会计政策进行变更。

据新租赁准则的规定，对于首次执行日前已存在的合同，本集团选择不重新评估其是否为租赁或者包含租赁。

本集团选择仅对 2021 年 1 月 1 日尚未完成的租赁合同的累计影响数进行调整。首次执行的累积影响金额调整首次执行当期期初（即 2021 年 1 月 1 日）的留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整。

于新租赁准则首次执行日（即 2021 年 1 月 1 日），本集团的具体衔接处理及其影响如下：

①本集团作为承租人

对首次执行日的经营租赁，本集团作为承租人根据剩余租赁付款额按首次执行日的增量借款利率折现的现值计量租赁负债；原租赁准则下按照权责发生制计提的应付未付租金，纳入剩余租赁付款额中。

对首次执行日前的经营租赁，本集团按照与租赁负债相等的金额，并根据预付租金进行必要调整计量使用权资产。本集团于首次执行日对使用权资产进行减值测试，并调整使用权资产的账面价值。

本集团对于首次执行日前的租赁资产属于低价值资产的经营租赁，不确认使用权资产和租赁负债。对于首次执行日除低价值租赁之外的经营租赁，本集团根据每项租赁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。

②本集团作为出租人

对于首次执行日前划分为经营租赁且在首次执行日后仍存续的转租赁，本集团作为转租出租人在首次执行日基于原租赁和转租赁的剩余合同期限和条款进行重新评估和分类。

③执行新租赁准则的主要变化和影响如下：

本集团承租的租赁期超过 12 个月的资产，原作为经营租赁处理，根据新租赁准则，于 2021 年 1 月 1 日确认使用权资产 208,992,466.90 元，租赁负债 201,435,959.52 元。

上述会计政策变更对 2021 年 1 月 1 日财务报表的影响如下：

报表项目	2020 年 12 月 31 日 (变更前) 金额		2021 年 1 月 1 日 (变更后) 金额	
	本集团	本公司	本集团	本公司
应收账款	776,507,271.82	743,336,309.28	768,950,764.44	735,779,801.90
使用权资产	-	-	208,992,466.90	195,172,286.87
租赁负债	-	-	201,435,959.52	187,615,779.49

本集团于 2021 年 1 月 1 日计入资产负债表的租赁负债所采用的增量借款利率的加权平均值为 3.08%。

本集团 2020 年度财务报表中披露的 2020 年末重大经营租赁的尚未支付的最低租赁付款额与 2021 年 1 月 1 日计入租赁负债的差异调整过程如下：

项目	本集团	本公司
2020 年 12 月 31 日重大经营租赁最低租赁付款额	231,123,914.22	214,271,183.51
减：采用简化处理的租赁付款额	7,715,129.79	6,332,718.01
其中：短期租赁	7,715,129.79	6,332,718.01
低价值资产租赁	-	-
调整后 2021 年 1 月 1 日重大经营租赁最低付款额	223,408,784.43	207,938,465.50
增量借款利率加权平均值	3.08%	3.08%
2021 年 1 月 1 日租赁负债	201,435,959.52	187,615,779.49
其中：一年内到期的租赁负债	-	-

三、合并报表范围调整

报告期内新增合并财务报表范围内子公司，且新增的子公司报告期内营业收入、净利润或报告期末总资产任一占合并报表10%以上

适用 不适用

报告期内减少合并财务报表范围内子公司，且减少的子公司上个报告期内营业收入、净利润或上个报告期末总资产占上个报告期合并报表10%以上

适用 不适用

子公司名称	子公司主要经营业务	子公司主要财务数据（营业收入、总资产、净利润）	变动类型（新增或减少）	新增、减少原因
华联期货有限公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、风险管理业务	2021年营业收入915,184,976.25元；总资产2,831,889,843.17元；净利润46,628,375.47元	减少	华联期货股东之一金控集团通过收购其他股东股权，持有华联期货51%的股权，于2021年11月成为华联期货的控股股东，故公司不再将华联期货及其子公司纳入合并范围。

相关事项对公司生产经营和偿债能力的影响：

无

四、资产情况

（一）资产变动情况

公司存在期末余额变动比例超过30%的资产项目

适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

资产项目	本期末余额	占本期末资产总额的比例（%）	上期末余额	变动比例（%）
衍生金融资产	12.42	0	51.67	-75.95
债权投资	30,707.10	0.62	8,495.36	261.46
投资性房地产	84.99	0	263.18	-67.71
商誉	0	0	307.91	-100.00
其他资产	5,379.74	0.11	9,204.89	-41.56

发生变动的的原因：

资产项目	变动原因
衍生金融资产	主要是个股期权权利方余额减少。
债权投资	主要是债权投资规模增加。
投资性房地产	主要是投资性房地产计提折旧导致。

商誉	主要是不再将华联期货及其子公司纳入合并范围影响。
其他资产	主要是不再将华联期货及其子公司纳入合并范围，大宗商品存货减少。

（二） 资产受限情况

1. 资产受限情况概述

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

受限资产类别	受限资产账面价值	资产受限金额	受限资产评估价值（如有）	资产受限金额占该类别资产账面价值的比例（%）
交易性金融资产	41.31	3.76	-	9.09
债权投资	3.07	3.01	-	97.97
其他债权投资	92.61	48.94	-	52.84
合计	136.99	55.70	—	—

2. 单项资产受限情况

单项资产受限金额超过报告期末合并口径净资产百分之十

√适用 □不适用

单位：亿元 币种：人民币

受限资产名称	账面价值	评估价值（如有）	受限金额	受限原因	对发行人可能产生的影响
债券	48.94	-	48.94	为质押式回购业务而设定质押的债券	为公司正常业务开展需要，无重大不利影响

3. 发行人所持重要子公司股权的受限情况

直接或间接持有的重要子公司股权截止报告期末存在的权利受限情况：

□适用 √不适用

五、 负债情况

（一） 负债变动情况

公司存在期末余额变动比例超过 30%的负债项目

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

负债项目	本期末余额	占本期末负债总额的比例（%）	上年末余额	变动比例（%）
应付短期融资款	545,524.83	13.10	256,194.08	112.93
交易性金融负债	566.33	0.01	1,751.89	-67.67

衍生金融负债	8.69	0.00	117.63	-92.61
卖出回购金融资产款	413,659.84	9.93	875,908.25	-52.77
应付职工薪酬	58,306.43	1.40	42,525.75	37.11
应付债券	1,237,020.11	29.70	804,075.52	53.84
递延所得税负债	3,727.67	0.09	1,604.16	132.37
其他负债	247.47	0.01	90,472.00	-99.73

发生变动的的原因：

负债项目	变动原因
应付短期融资款	主要是新增发行短期融资券。
交易性金融负债	主要是不再将原控股子公司华联期货管理的资管产品纳入合并范围影响。
衍生金融负债	主要是个股期权义务方余额减少。
卖出回购金融资产款	主要是卖出回购业务规模减少。
应付职工薪酬	主要是应付职工工资增加。
应付债券	主要是公开发行人公司债券规模增加。
递延所得税负债	主要是其他债权投资的公允价值变动影响。
其他负债	主要是两融资产支持证券到期导致。

（二） 报告期末存在逾期金额超过 1000 万元的有息债务

适用 不适用

（三） 合并报表范围内公司报告期末存在公司信用类债券逾期的

适用 不适用

（四） 有息债务及其变动情况

1. 报告期初合并报表范围内公司有息债务总额：133.74 亿元，报告期末合并报表范围内公司有息债务总额 181.40 亿元，有息债务同比变动 35.63%。2022 年内到期或回售的有息债务总额：112.65 亿元。

报告期末合并报表范围内有息债务中，公司信用类债券余额 118.90 亿元，占有息债务余额的 65.55%；银行贷款余额 0 亿元，占有息债务余额的 0%；非银行金融机构贷款 0 亿元，占有息债务余额的 0%；其他有息债务余额 62.50 亿元，占有息债务余额的 34.45%。

单位：亿元 币种：人民币

有息债务类别	到期时间					合计
	已逾期	6 个月以内（含）	6 个月（不含）至 1 年（含）	1 年（不含）至 2 年（含）	2 年以上（不含）	
公司债券	-	20.50	10.00	28.00	22.00	80.50
次级债券	-	20.00	-	-	18.40	38.40
短期融资券	-	15	15	-	-	30
收益凭证	-	20.90	4.30	0.25	0.10	25.55
转融通融入资	-	5.95	-	-	-	5.95

金						
融资融券出让 收益权回购	-	1.00	-	-	-	1.00

2. 截止报告期末，发行人合并口径内发行的境外债券余额 0 亿元人民币，且在 2022 年内到期的境外债券余额为 0 亿元人民币。

（五） 可对抗第三人的优先偿付负债情况

截至报告期末，可对抗第三人的优先偿付负债情况：

适用 不适用

六、利润及其他损益来源情况

（一） 基本情况

报告期利润总额：13.13 亿元

报告期非经常性损益总额：-0.04 亿元

报告期内合并报表范围利润主要源自非主要经营业务的：

适用 不适用

（二） 投资状况分析

如来源于单个子公司的净利润或单个参股公司的投资收益对发行人合并口径净利润影响达到 10%以上

适用 不适用

（三） 净利润与经营性净现金流差异

报告期公司经营活动产生的现金净流量与报告期净利润存在重大差异的，请说明原因

适用 不适用

2021 年，公司经营活动产生的现金流量净额为-253,218.06 万元，其中经营活动现金流入小计 246,375.72 万元，主要为收到利息、手续费及佣金 294,430.31 万元，代理买卖证券业务现金净额 299,694.29 万元、回购业务资金净增加额-457,129.70 万元。经营活动现金流出小计 499,593.77 万元，主要为融出资金净增加额 137,507.49 万元，支付其他与经营活动有关的现金 238,402.27 万元。2021 年经营活动产生的现金流量净额为负，主要是由于公司债券正回购融资规模下降导致。

七、报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十

是 否

八、非经营性往来占款和资金拆借

（一） 非经营性往来占款和资金拆借余额

1.报告期初，发行人合并口径应收的非因生产经营直接产生的对其他方的往来占款和资金拆借（以下简称非经营性往来占款和资金拆借）余额：0 亿元；

2.报告期内，非经营性往来占款和资金拆借新增：0 亿元，收回：0 亿元；

3.报告期内，非经营性往来占款或资金拆借情形是否存在违反募集说明书相关约定或承诺

的情况

不适用

4.报告期末，未收回的非经营性往来占款和资金拆借合计：0 亿元，其中控股股东、实际控制人及其他关联方占款或资金拆借合计：0 亿元。

（二）非经营性往来占款和资金拆借明细

报告期末，发行人合并口径未收回的非经营性往来占款和资金拆借占合并口径净资产的比例：0%，是否超过合并口径净资产的 10%：

是 否

（三）以前报告期内披露的回款安排的执行情况

完全执行 未完全执行

九、对外担保情况

报告期初对外担保的余额：0 亿元

报告期末对外担保的余额：0 亿元

报告期对外担保的增减变动情况：0 亿元

对外担保中为控股股东、实际控制人和其他关联方提供担保的金额：0 亿元

报告期末尚未履行及未履行完毕的对外单笔担保金额或者对同一对象的担保金额是否超过报告期末净资产 10%：是 否

十、报告期内信息披露事务管理制度变更情况

发生变更 未发生变更

披露变更内容、变更后信息披露事务管理制度的主要内容，并说明对投资者权益的影响

为完善公司信息披露制度，规范本公司及其子公司、参股公司的信息披露行为，加强信息披露事务管理，保护公司、股东、债权人及其他利益相关人的合法权益，根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》《上市公司信息披露管理办法》《深圳证券交易所股票上市规则》《关于加强上市公司监管的规定》等相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、自律规则及公司制度的规定，结合市场环境和实际情况，修订《东莞证券股份有限公司信息披露管理办法》。主要内容包括总则，信息披露工作的组织架构及职责，信息披露的内容与标准，信息披露流程，信息发布管理与保密，信息披露档案管理，子公司、参股公司的信息披露事务管理，问责和附则等内容。变更后不会对投资者权益产生不利影响。

十一、向普通投资者披露的信息

在定期报告批准报出日，发行人是否存续有面向普通投资者交易的债券

是 否

第四节 特定品种债券应当披露的其他事项

一、发行人为可交换债券发行人

适用 不适用

二、发行人为非上市公司非公开发行可转换公司债券发行人

适用 不适用

三、发行人为其他特殊品种债券发行人

适用 不适用

四、发行人为永续期公司债券发行人

适用 不适用

五、其他特定品种债券事项

无

第五节 发行人认为应当披露的其他事项

无

第六节 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（如有）；

三、报告期内在中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿；

四、按照境内外其他监管机构、交易场所等的要求公开披露的年度报告、年度财务信息。

发行人披露的公司债券信息披露文件可在交易所网站上进行查询，上海证券交易所：www.sse.com.cn；深圳证券交易所：www.szse.cn。

（以下无正文）

（以下无正文，为东莞证券股份有限公司 2021 年公司债券年报盖章页）



财务报表

附件一： 发行人财务报表

合并资产负债表

2021年12月31日

编制单位：东莞证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
资产：		
货币资金	16,532,847,885.03	14,397,089,528.88
其中：客户资金存款	14,634,180,849.55	13,248,874,271.75
结算备付金	3,621,574,422.75	4,308,907,477.41
其中：客户备付金	3,242,951,474.09	3,625,285,912.25
贵金属		
拆出资金		
融出资金	13,442,945,901.05	11,167,799,243.99
衍生金融资产	124,243.85	516,692.00
存出保证金	236,681,407.54	234,241,295.41
应收款项	564,604,610.45	776,507,271.82
应收款项融资		
合同资产		
买入返售金融资产	518,585,528.35	587,940,241.08
持有待售资产		
金融投资：		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融资产	4,131,211,264.30	5,060,997,386.60
债权投资	307,070,996.43	84,953,610.80
可供出售金融资产		
其他债权投资	9,260,576,644.21	8,809,692,407.13
其他权益工具投资		
持有至到期投资		
长期股权投资	255,099,230.73	
投资性房地产	849,868.96	2,631,799.80
固定资产	55,630,315.10	54,947,029.77
在建工程	51,126,970.36	44,458,096.94
使用权资产	182,527,590.13	
无形资产	32,736,409.67	26,669,390.44
商誉		3,079,084.78
递延所得税资产	317,404,899.20	331,602,082.83
其他资产	53,797,360.40	92,048,896.81

资产总计	49,565,395,548.51	45,984,081,536.49
负债：		
短期借款		
应付短期融资款	5,455,248,281.84	2,561,940,847.16
拆入资金	595,757,757.05	501,563,333.32
交易性金融负债	5,663,336.79	17,518,892.87
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融负债	86,944.78	1,176,342.00
卖出回购金融资产款	4,136,598,381.31	8,759,082,503.15
代理买卖证券款	17,685,009,313.47	16,878,537,056.61
代理承销证券款		
应付职工薪酬	583,064,281.91	425,257,488.23
应交税费	127,554,718.57	105,486,212.10
应付款项	438,968,191.09	436,129,949.89
合同负债	38,110,365.33	40,824,340.19
持有待售负债		
预计负债		
长期借款		
应付债券	12,370,201,094.81	8,040,755,199.17
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	180,120,807.68	
递延收益		
递延所得税负债	37,276,739.61	16,041,638.28
其他负债	2,474,678.65	904,720,049.18
负债合计	41,656,134,892.89	38,689,033,852.15
所有者权益（或股东权益）：		
实收资本（或股本）	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积	619,797,355.14	619,797,355.14
减：库存股		
其他综合收益	83,794,120.54	17,486,940.68
盈余公积	568,746,127.47	469,728,056.35
一般风险准备	1,733,835,800.62	1,540,847,515.22
未分配利润	3,403,087,251.85	2,898,531,357.44
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	7,909,260,655.62	7,046,391,224.83
少数股东权益		248,656,459.51
所有者权益（或股东权益）合计	7,909,260,655.62	7,295,047,684.34

负债和所有者权益（或股东权益）总计	49,565,395,548.51	45,984,081,536.49
-------------------	-------------------	-------------------

法定代表人：陈照星 主管会计工作负责人：李志方 会计机构负责人：刘盛艳

母公司资产负债表

2021年12月31日

编制单位：东莞证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
资产：		
货币资金	16,386,353,551.80	13,618,802,527.89
其中：客户资金存款	14,654,238,300.87	12,512,593,679.49
结算备付金	3,621,574,422.75	3,004,099,318.06
其中：客户备付金	3,242,951,474.09	2,504,750,379.44
贵金属		
拆出资金		
融出资金	13,442,945,901.05	11,167,799,243.99
衍生金融资产	124,243.85	9,998.00
存出保证金	236,681,407.54	318,593,115.11
应收款项	559,852,847.80	743,336,309.28
应收款项融资		
合同资产		
买入返售金融资产	518,585,528.35	587,940,241.08
持有待售资产		
金融投资：		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融资产	3,699,068,439.18	4,549,779,249.76
债权投资	307,070,996.43	84,953,610.80
可供出售金融资产		
其他债权投资	9,260,576,644.21	8,809,692,407.13
其他权益工具投资		
持有至到期投资		
长期股权投资	765,099,230.73	594,174,088.08
投资性房地产	887,773.81	2,696,129.03
固定资产	55,561,198.68	52,693,294.95
在建工程	51,126,970.36	43,208,233.84
使用权资产	182,527,590.13	
无形资产	32,736,409.67	24,454,548.71
商誉		
递延所得税资产	308,773,405.71	321,101,022.60
其他资产	53,773,381.22	45,133,581.28

资产总计	49,483,319,943.27	43,968,466,919.59
负债：		
短期借款		
应付短期融资款	5,455,248,281.84	2,561,940,847.16
拆入资金	595,757,757.05	501,563,333.32
交易性金融负债	5,663,336.79	251,506.32
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融负债	86,944.78	21,090.00
卖出回购金融资产款	4,136,598,381.31	8,759,082,503.15
代理买卖证券款	17,705,066,764.79	15,118,882,546.87
代理承销证券款		
应付职工薪酬	577,069,603.41	399,424,884.93
应交税费	110,544,830.99	98,329,409.94
应付款项	438,473,565.35	393,292,653.25
合同负债	37,796,679.20	37,505,592.25
持有待售负债		
预计负债		
长期借款		
应付债券	12,370,201,094.81	8,040,755,199.17
其中：优先股		
永续债		
租赁负债	179,915,332.30	
递延收益		
递延所得税负债	9,207,821.11	1,225,878.20
其他负债	2,260,296.19	1,053,250,112.74
负债合计	41,623,890,689.92	36,965,525,557.30
所有者权益（或股东权益）：		
实收资本（或股本）	1,500,000,000.00	1,500,000,000.00
其他权益工具		
其中：优先股		
永续债		
资本公积	619,797,355.14	619,797,355.14
减：库存股		
其他综合收益	83,794,120.54	17,486,940.68
盈余公积	568,746,127.47	469,728,056.35
一般风险准备	1,733,835,800.62	1,531,160,056.26
未分配利润	3,353,255,849.58	2,864,768,953.86
所有者权益（或股东权益）合计	7,859,429,253.35	7,002,941,362.29
负债和所有者权益（或股东权益）总计	49,483,319,943.27	43,968,466,919.59

法定代表人：陈照星 主管会计工作负责人：李志方 会计机构负责人：刘盛艳

合并利润表
2021年1—12月

单位:元 币种:人民币

项目	2021年度	2020年度
一、营业总收入	3,700,721,181.20	3,164,719,266.44
利息净收入	735,708,061.94	698,063,635.63
其中：利息收入	1,678,502,591.77	1,471,048,516.48
利息支出	942,794,529.83	772,984,880.85
手续费及佣金净收入	1,881,888,084.01	1,706,027,759.66
其中：经纪业务手续费净收入	1,382,612,530.20	1,267,042,578.35
投资银行业务手续费净收入	370,905,992.07	287,462,730.26
资产管理业务手续费净收入	65,605,608.46	80,531,550.31
投资收益（损失以“-”号填列）	186,673,303.35	130,387,377.57
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	2,847,561.94	
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）		1,573,516.60
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）		
其他收益	18,423,253.24	24,495,092.51
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	116,957,989.36	17,750,451.11
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-424,778.61	-1,169,389.49
其他业务收入	761,332,405.60	589,143,981.36
资产处置收益（损失以“-”号填列）	162,862.31	20,358.09
二、营业总支出	2,368,801,755.04	2,089,079,671.16
税金及附加	23,200,118.10	20,161,578.74
业务及管理费	1,594,384,659.78	1,326,626,342.91
资产减值损失		
信用减值损失	4,907,515.04	157,003,233.09
其他资产减值损失	-656,432.57	991,594.21
其他业务成本	746,965,894.69	584,296,922.21
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	1,331,919,426.16	1,075,639,595.28
加：营业外收入	1,008,422.63	964,123.16
减：营业外支出	20,098,859.75	15,119,834.68
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,312,828,989.04	1,061,483,883.76
减：所得税费用	295,380,304.04	256,581,955.90
五、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,017,448,685.00	804,901,927.86
（一）按经营持续性分类		
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	1,017,448,685.00	804,901,927.86
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）	996,632,002.46	781,648,250.01
2.少数股东损益（净亏损以“-”号填列）	20,816,682.54	23,253,677.85
六、其他综合收益的税后净额	66,307,179.86	-9,566,801.56
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	66,307,179.86	-9,566,801.56
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		
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		
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	66,307,179.86	-9,566,801.56
1.权益法下可转损益的其他综合收益		
2.其他债权投资公允价值变动	25,040,713.72	50,101,168.65
3.可供出售金融资产公允价值变动损益		
4.金融资产重分类计入其他综合收益的金额		
5.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益		
6.其他债权投资信用损失准备	41,266,466.14	-59,667,970.21
7.现金流量套期储备（现金流量套期损益的有效部分）		
8.外币财务报表折算差额		
9.其他		
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		
七、综合收益总额	1,083,755,864.86	795,335,126.30
归属于母公司所有者的综合收益总额	1,062,939,182.32	772,081,448.45
归属于少数股东的综合收益总额	20,816,682.54	23,253,677.85
八、每股收益：		
（一）基本每股收益(元/股)	0.66	0.52
（二）稀释每股收益(元/股)	0.66	0.52

本期发生同一控制下企业合并的，被合并方在合并前实现的净利润为：0 元,上期被合并方实现的净利润为：0 元。

法定代表人：陈照星 主管会计工作负责人：李志方 会计机构负责人：刘盛艳

母公司利润表
2021 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

项目	2021 年度	2020 年度
一、营业总收入	2,729,198,515.31	2,429,593,608.17

利息净收入	698,971,693.88	647,985,606.26
其中：利息收入	1,642,236,668.80	1,442,511,459.88
利息支出	943,264,974.92	794,525,853.62
手续费及佣金净收入	1,773,473,783.19	1,609,095,250.57
其中：经纪业务手续费净收入	1,291,028,644.74	1,194,004,262.75
投资银行业务手续费净收入	370,905,992.07	287,462,730.26
资产管理业务手续费净收入	63,224,442.73	75,799,972.07
投资收益（损失以“-”号填列）	199,062,100.34	124,532,804.01
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	22,847,903.98	
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）		1,573,516.60
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）		
其他收益	17,866,640.53	14,627,255.47
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	37,069,081.64	26,392,808.87
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-424,778.61	-1,164,190.09
其他业务收入	3,017,132.03	8,103,850.87
资产处置收益（损失以“-”号填列）	162,862.31	20,222.21
二、营业总支出	1,515,168,672.67	1,407,350,716.16
税金及附加	21,406,860.29	19,332,246.46
业务及管理费	1,486,485,968.09	1,226,033,515.80
资产减值损失		
信用减值损失	4,780,054.31	156,919,256.29
其他资产减值损失		
其他业务成本	2,495,789.98	5,065,697.61
三、营业利润（亏损以“-”号填列）	1,214,029,842.64	1,022,242,892.01
加：营业外收入	1,001,875.13	907,765.55
减：营业外支出	19,997,016.09	14,458,511.37
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,195,034,701.68	1,008,692,146.19
减：所得税费用	252,731,229.15	238,361,622.58
五、净利润（净亏损以“-”号填列）	942,303,472.53	770,330,523.61
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）	942,303,472.53	770,330,523.61
（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	66,307,179.86	-9,566,801.56
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		
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		
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	66,307,179.86	-9,566,801.56

1.权益法下可转损益的其他综合收益		
2.其他债权投资公允价值变动	25,040,713.72	50,101,168.65
3.可供出售金融资产公允价值变动损益		
4.金融资产重分类计入其他综合收益的金额		
5.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益		
6.其他债权投资信用损失准备	41,266,466.14	-59,667,970.21
7.现金流量套期储备（现金流量套期损益的有效部分）		
8.外币财务报表折算差额		
9.其他		
七、综合收益总额	1,008,610,652.39	760,763,722.05
八、每股收益：		
（一）基本每股收益(元/股)	0.63	0.51
（二）稀释每股收益(元/股)	0.63	0.51

法定代表人：陈照星 主管会计工作负责人：李志方 会计机构负责人：刘盛艳

合并现金流量表

2021年1—12月

单位：元 币种：人民币

项目	2021年度	2020年度
一、经营活动产生的现金流量：		
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	2,944,303,082.21	2,752,720,084.49
拆入资金净增加额	75,887,657.50	384,088,005.46
回购业务资金净增加额	-4,571,296,958.18	4,043,814,506.41
代理买卖证券收到的现金净额	2,996,942,854.75	2,606,167,899.54
收到其他与经营活动有关的现金	1,017,920,541.54	963,187,534.14
经营活动现金流入小计	2,463,757,177.82	10,749,978,030.04
融出资金净增加额	1,375,074,920.71	2,865,973,924.64
代理买卖证券支付的现金净额		
为交易目的而持有的金融资产净增加额	-839,427,172.79	1,246,410,118.53
拆出资金净增加额		
返售业务资金净增加额		
支付利息、手续费及佣金的现金	629,440,889.82	732,395,402.08
支付给职工及为职工支付的现金	984,618,296.04	903,239,596.88
支付的各项税费	462,208,096.24	444,748,634.08
支付其他与经营活动有关的现金	2,384,022,701.11	3,269,864,184.07
经营活动现金流出小计	4,995,937,731.13	9,462,631,860.28

经营活动产生的现金流量净额	-2,532,180,553.31	1,287,346,169.76
二、投资活动产生的现金流量：		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金		
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	254,370.00	48,963.83
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	254,370.00	48,963.83
投资支付的现金		
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	105,587,193.28	73,978,857.58
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	2,264,476,154.41	
投资活动现金流出小计	2,370,063,347.69	73,978,857.58
投资活动产生的现金流量净额	-2,369,808,977.69	-73,929,893.75
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金		
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		
发行债券收到的现金	7,040,000,000.00	2,800,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金	2,932,300,000.00	3,129,870,000.00
筹资活动现金流入小计	9,972,300,000.00	5,929,870,000.00
偿还债务支付的现金	2,892,180,000.00	3,817,390,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	665,516,346.29	556,283,392.74
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润	10,200,000.00	8,303,806.99
支付其他与筹资活动有关的现金	61,727,954.19	2,496,000.00
筹资活动现金流出小计	3,619,424,300.48	4,376,169,392.74
筹资活动产生的现金流量净额	6,352,875,699.52	1,553,700,607.26
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-424,778.61	-1,164,190.09
五、现金及现金等价物净增加额	1,450,461,389.91	2,765,952,693.18
加：期初现金及现金等价物余额	18,691,057,357.86	15,925,104,664.68
六、期末现金及现金等价物余额	20,141,518,747.77	18,691,057,357.86

法定代表人：陈照星 主管会计工作负责人：李志方 会计机构负责人：刘盛艳

母公司现金流量表

2021年1—12月

单位:元 币种:人民币

项目	2021年度	2020年度
一、经营活动产生的现金流量:		
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	2,794,720,392.98	2,618,113,773.80
拆入资金净增加额	75,887,657.50	384,088,005.46
回购业务资金净增加额	-4,571,296,958.18	4,043,808,572.83
代理买卖证券收到的现金净额	2,685,217,841.52	2,055,654,536.58
收到其他与经营活动有关的现金	129,082,623.64	196,479,981.52
经营活动现金流入小计	1,113,611,557.46	9,298,144,870.19
融出资金净增加额	1,375,074,920.71	2,865,973,924.64
代理买卖证券支付的现金净额		
为交易目的而持有的金融资产净增加额	-921,683,422.54	1,055,138,761.56
拆出资金净增加额		
返售业务资金净增加额		
支付利息、手续费及佣金的现金	613,746,624.93	725,650,985.38
支付给职工及为职工支付的现金	914,454,660.73	845,721,981.60
支付的各项税费	431,117,950.07	428,634,189.47
支付其他与经营活动有关的现金	1,476,179,509.28	2,568,342,781.09
经营活动现金流出小计	3,888,890,243.18	8,489,462,623.74
经营活动产生的现金流量净额	-2,775,278,685.72	808,682,246.45
二、投资活动产生的现金流量:		
收回投资收到的现金		
取得投资收益收到的现金	9,800,000.00	7,840,000.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	251,585.00	44,261.00
收到其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流入小计	10,051,585.00	7,884,261.00
投资支付的现金	110,000,000.00	
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	104,591,900.50	71,775,325.95
支付其他与投资活动有关的现金		
投资活动现金流出小计	214,591,900.50	71,775,325.95
投资活动产生的现金流量净额	-204,540,315.50	-63,891,064.95
三、筹资活动产生的现金流量:		
吸收投资收到的现金		
取得借款收到的现金		
发行债券收到的现金	7,040,000,000.00	2,800,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金	2,932,300,000.00	3,129,870,000.00
筹资活动现金流入小计	9,972,300,000.00	5,929,870,000.00

偿还债务支付的现金	2,892,180,000.00	3,817,390,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	655,316,346.29	547,979,585.75
支付其他与筹资活动有关的现金	60,268,924.67	2,496,000.00
筹资活动现金流出小计	3,607,765,270.96	4,367,865,585.75
筹资活动产生的现金流量净额	6,364,534,729.04	1,562,004,414.25
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-424,778.61	-1,164,190.09
五、现金及现金等价物净增加额	3,384,290,949.21	2,305,631,405.66
加：期初现金及现金等价物余额	16,610,790,814.45	14,305,159,408.79
六、期末现金及现金等价物余额	19,995,081,763.66	16,610,790,814.45

法定代表人：陈照星 主管会计工作负责人：李志方 会计机构负责人：刘盛艳

