

信用评级公告

信评委公告 [2023]046 号

中诚信国际关于天风证券股份有限公司 2022 年度业绩预亏以及计提资产减值准备的关注公告

天风证券股份有限公司(以下简称“天风证券”或“公司”)发行的“20 天风 01”、“20 天风 C1”、“20 天风 C2”、“20 天风 C3”、“21 天风 01”、“21 天风 02”、“21 天风 04”、“21 天风 05”、“21 天风 C1”、“22 天风 01”、“22 天风 02”、“22 天风 03”、“22 天风 04”、“22 天风 05”由中诚信国际信用评级有限责任公司(以下简称“中诚信国际”)进行相关评级工作。

根据天风证券 2023 年 1 月 31 日发布的《天风证券股份有限公司 2022 年度业绩预亏公告》，天风证券预计 2022 年度实现归属于母公司所有者的净利润为人民币-12.71 亿元，与上年同期相比，将出现亏损；预计 2022 年度实现归属于母公司所有者的扣除非经常性损益后的净利润为人民币-13.17 亿元。天风证券表示，本期业绩预亏的主要原因是营收占比较高的自营业务收入大幅减少、计提各项资产减值准备以及参股单位出现巨额亏损等。

根据天风证券 2023 年 1 月 31 日发布的《天风证券股份有限公司关于计提资产减值准备的公告》，天风证券 2022 年度预计计提各项资产减值准备共计 60,610.32 万元，占公司最近一个会计年度经审计净利润的 10%以上，将减少公司 2022 年度利润总额 60,610.32 万元，减少公司 2022 年度净利润 45,587.22 万元。其中，2022 年度公司预计计提融出资金减值准备-5,044.39 万元，主要原因系一方面融出资金业务规模减少；另一方面融出资金业务在风险处置后，转至其

他应收款项下所致。2022 年度公司预计计提买入返售金融资产减值准备 4,982.97 万元，主要原因系公司按照预期信用损失模型计提减值准备。2022 年度公司按照预期信用损失模型预计计提应收款项坏账准备 14,660.47 万元。2022 年度公司预计计提其他资产减值准备 46,011.27 万元，主要原因系公司融出资金业务资产处置后形成的其他应收款计提坏账准备 7,675.23 万元及持有的债权投资减值 40,362.18 万元。

公司预告数据仅为初步核算数据，业绩预告内容未经注册会计师审计，具体准确的财务数据以公司正式披露的经审计后的 2022 年年度报告为准。中诚信国际将持续关注公司经营变化情况和财务状况，对公司信用状况进行跟踪评估并及时披露相关信息。

特此公告

中诚信国际信用评级有限责任公司

二〇二三年二月一日