

公司代码：600918

公司简称：中泰证券

# 中泰证券股份有限公司 2020 年半年度报告

## 重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、本半年度报告未经审计。

四、公司负责人李玮、主管会计工作负责人袁西存及会计机构负责人(会计主管人员)刘健声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

无

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告中所涉及的未来计划等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请投资者注意投资风险。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、重大风险提示

公司主营业务与国内外经济形势、资本市场走势相关，资本市场波动、行业监管政策调整等因素都将对公司经营业绩产生直接或间接的影响。

公司已在本报告中详细描述在日常经营活动中可能面临的风险，本公司面临的重大风险主要包括合规风险、洗钱与恐怖融资风险、信用风险、市场风险、操作风险、流动性风险、声誉风险等，敬请查阅本报告第四节“经营情况的讨论与分析”中的相关内容。

十、其他

适用 不适用

## 目录

第一节	释义.....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	4
第三节	公司业务概要.....	12
第四节	经营情况的讨论与分析.....	14
第五节	重要事项.....	33
第六节	普通股股份变动及股东情况.....	49
第七节	优先股相关情况.....	54
第八节	董事、监事、高级管理人员情况.....	54
第九节	公司债券相关情况.....	56
第十节	财务报告.....	63
第十一节	备查文件目录.....	223
第十二节	证券公司信息披露.....	223

## 第一节 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
公司、本公司、中泰证券、母公司	指	中泰证券股份有限公司
本集团	指	中泰证券股份有限公司及下属控股子公司
报告期	指	2020年1月1日至2020年6月30日
本报告期末	指	2020年6月30日
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
莱钢集团	指	莱芜钢铁集团有限公司
山钢集团	指	山东钢铁集团有限公司
兖矿集团	指	兖矿集团有限公司
济钢集团	指	济钢集团有限公司
鲁信集团	指	山东省鲁信投资控股集团有限公司
鲁证期货	指	鲁证期货股份有限公司
中泰资本	指	中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司
中泰国际	指	中泰金融国际有限公司
中泰资管	指	中泰证券（上海）资产管理有限公司
中泰创投	指	中泰创业投资（深圳）有限公司
中泰物业	指	齐鲁中泰物业有限公司
万家基金	指	万家基金管理有限公司
齐鲁股权	指	齐鲁股权交易中心有限公司

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司信息

公司的中文名称	中泰证券股份有限公司
公司的中文简称	中泰证券
公司的外文名称	ZHONGTAI SECURITIES CO., LTD.
公司的外文名称缩写	ZHONGTAI SECURITIES
公司的法定代表人	李玮
公司总经理	毕玉国

### 注册资本和净资产

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	6,968,625,756	6,271,763,180
净资产	24,919,272,984.16	22,469,820,892.35

注：经中国证监会证监许可[2020]736号文核准，公司于2020年5月20日公开发行69,686.2576万股人民币普通股新股，公司总股本由627,176.318万股增至696,862.5756万股。截至报告期末，本次公开发行涉及的注册资本变更工商登记手续尚在办理之中。

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

**母公司主要业务资质：**

公司经营范围包括：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；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；股票期权做市；证券投资基金托管。此外，公司还具有以下业务资格：

1.中国人民银行批准的业务资格：全国银行间同业拆借市场同业拆借业务。

2.中国证监会批准的业务资格：外资股经纪商、为期货公司提供中间介绍业务、保荐机构、参与股指期货保值交易、债券质押式报价回购业务、参与国债期货交易、人民币利率互换业务、客户资金消费支付服务试点。

3.国家外汇管理局批准的业务资格：外币有价证券经纪业务。

4.中国证券业协会批准的业务资格：柜台交易业务、互联网证券业务试点、股票收益互换业务、场外期权业务。

5.沪、深证券交易所批准的业务资格：权证交易、港股通业务、股票期权经纪业务、股票期权自营业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购业务、沪深300ETF期权主做市商、上交所上证50ETF期权主做市商、上交所固定收益证券综合电子平台交易商、上交所上市基金主做市商、深交所上市公司股权激励行权融资业务试点、深交所质押式报价回购交易、深交所期权程序化交易。

6.中国证券登记结算有限责任公司批准的业务资格：结算参与者资格、B股结算业务、权证买入合资格结算参与者、代理证券质押登记业务、托管人资金结算业务。

7.中国证券金融股份有限公司批准的业务资格：转融通业务资格试点、转融资业务试点、转融券业务试点、科创板转融券。

8.其他机构批准的业务资格：全国中小企业股份转让系统主办券商、向保险机构投资者提供综合服务、军工涉密业务咨询服务、非金融企业债务融资工具承销商、标准债券远期交易、利率期权交易、中金所沪深300股指期货做市商、私募基金业务外包服务、ETF一级交易商、机构间私募产品报价与服务系统参与者、报价商、估值商和做市商。

**子公司主要业务资质：**

**中泰资管：**

1.证券资产管理

2.公开募集证券投资基金管理

**鲁证期货：**

1.经营证券期货业务许可证

- 2.金融期货经纪业务资格
- 3.期货投资咨询业务资格
- 4.资产管理业务资格
- 5.中金所全面结算会员资格
- 6.中国期货业协会设立子公司开展以风险管理服务为主的业务试点
- 7.上海期货交易所会员资格
- 8.大连商品交易所会员资格
- 9.郑州商品交易所会员资格
- 10.中国期货业协会团体会员资格
- 11.上海证券交易所股票期权业务资格
- 12.上海国际能源交易中心会员资格
- 13.香港证券及期货事务监察委员会牌照《证券及期货条例》(香港法例第571章)

**中泰国际:**

- 1.中国证券监督管理委员会核准的人民币合格境外机构投资者资格
- 2.香港工业贸易署发出的香港服务提供者证明书
- 3.香港证券及期货事务监察委员会证券公司牌照第 1 类(证券交易)及第 4 类(就证券提供意见)
- 4.香港联合交易所有限公司中华通交易所参与者资格
- 5.香港联合交易所有限公司交易所参与者资格
- 6.香港联合交易所有限公司期权买卖交易所参与者资格
- 7.香港联合交易所期权结算有限公司直接结算参与者资格
- 8.香港中央结算有限公司中华通直接结算参与者资格
- 9.香港中央结算有限公司直接结算参与者资格
- 10.香港证券及期货事务监察委员会期货公司牌照第 2 类(期货合约交易)
- 11.香港期货结算有限公司直接结算参与者资格
- 12.香港期货交易有限公司期货交易商资格
- 13.香港证券及期货事务监察委员会融资公司牌照第 1 类(证券交易)及第 6 类(就机构融资提供意见)
- 14.香港证券及期货事务监察委员会资管公司牌照第 4 类(就证券提供意见)及第 9 类(提供资产管理)
- 15.香港证券及期货事务监察委员会金融产品公司牌照第 1 类(证券交易)
- 16.香港强制性公积金计划管理局强积金主事中介人
- 17.香港保险业监管局一般及长期业务(包括相连长期业务) 持牌保险中介人牌照
- 18.新加坡金融管理局新加坡证券公司的 Capital Markets Services 牌照(证券交易)

19.新加坡金融管理局新加坡资管公司的 Capital Markets Services 牌照(基金管理)

20.宏润（上海）融资租赁有限公司持有中国（上海）自由贸易试验区管理委员会的外商独资融资租赁业务备案，以及持有中国银行间市场交易商协会会员资格

**中泰资本：**

1.私募投资基金业务

**中泰创投：**

1.另类投资业务

**二、 联系人和联系方式**

	董事会秘书
姓名	张晖
联系地址	济南市市中区经七路86号
电话	0531-68889038
传真	0531-68889001
电子信箱	ztsdb@zts.com.cn

**三、 基本情况变更简介**

公司注册地址	济南市市中区经七路 86 号
公司注册地址的邮政编码	250001
公司办公地址	济南市市中区经七路86号
公司办公地址的邮政编码	250001
公司网址	www.zts.com.cn
电子信箱	ztsdb@zts.com.cn
报告期内变更情况查询索引	无

**四、 信息披露及备置地点变更情况简介**

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的中国证监会指定网站的网址	www.sse.com.cn
公司半年度报告备置地点	济南市市中区经七路86号证券大厦2011董事会办公室
报告期内变更情况查询索引	无

**五、 公司股票简况**

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称
A股	上海证券交易所	中泰证券	600918	不适用

**六、 其他有关资料**

适用 不适用

## 七、公司主要会计数据和财务指标

## (一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减 (%)
营业收入	4,802,218,063.26	4,819,776,546.85	-0.36
归属于母公司股东的净利润	1,383,125,268.50	1,188,514,204.21	16.37
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,361,164,731.90	1,168,196,938.97	16.52
经营活动产生的现金流量净额	6,339,807,671.68	9,918,958,113.04	-36.08
其他综合收益	37,877,472.94	314,584,547.52	-87.96
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年同期增减 (%)
资产总额	154,646,313,981.59	146,613,149,711.09	5.48
负债总额	121,415,392,690.14	111,606,582,579.68	8.79
归属于母公司股东的权益	32,112,095,656.87	33,909,579,330.15	-5.30
所有者权益总额	33,230,921,291.45	35,006,567,131.41	-5.07

## (二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期 (1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.19	0.16	18.75
稀释每股收益(元/股)	0.19	0.16	18.75
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.19	0.16	18.75
加权平均净资产收益率(%)	4.27	3.84	增加0.43个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	4.20	3.76	增加0.44个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

□适用 √不适用

## (三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
核心净资本	20,919,272,984.16	16,869,820,892.35
附属净资本	4,000,000,000.00	5,600,000,000.00
净资本	24,919,272,984.16	22,469,820,892.35
净资产	31,214,778,258.88	33,101,556,644.24
各项风险资本准备之和	9,705,776,128.77	9,726,469,996.51
表内外资产总额	104,691,914,219.25	108,447,768,859.78
风险覆盖率(%)	256.75	231.02
资本杠杆率(%)	21.45	17.34
流动性覆盖率(%)	155.68	181.40
净稳定资金率(%)	164.69	140.74



净资本/净资产 (%)	79.83	67.88
净资本/负债 (%)	35.96	33.24
净资产/负债 (%)	45.04	48.97
自营权益类证券及证券衍生品/ 净资本 (%)	30.06	31.68
自营非权益类证券及其衍生 品/净资本 (%)	177.05	207.22

注：报告期内，母公司净资本等各项风险控制指标均符合中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》的有关规定。

#### 八、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

#### 九、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	19,889,674.26	
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	17,385,417.55	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-8,344,230.07	
少数股东权益影响额	-193,968.50	
所得税影响额	-6,776,356.64	
<b>合计</b>	<b>21,960,536.60</b>	

#### 十、其他

适用 不适用

根据《证券公司年度报告内容与格式准则》要求，主要项目会计数据如下：

合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2020年6月30日	2019年12月31日	增减幅度
货币资金	39,839,246,122.10	30,916,047,553.27	28.86%
结算备付金	7,006,200,141.42	6,763,320,638.78	3.59%
其中：客户备付金	5,239,197,173.86	4,533,338,142.83	15.57%
融出资金	24,657,083,933.21	23,248,873,866.35	6.06%
存出保证金	7,391,484,771.92	5,904,321,055.36	25.19%
应收款项	748,083,492.80	682,845,873.86	9.55%
买入返售金融资产	10,882,498,894.42	12,572,663,170.37	-13.44%
交易性金融资产	34,016,242,777.49	33,342,840,435.15	2.02%
债权投资	4,279,309,718.71	4,238,796,066.65	0.96%
其他债权投资	15,388,370,806.71	18,522,040,228.79	-16.92%
其他权益工具投资	5,831,811,877.93	5,510,778,810.08	5.83%
长期股权投资	748,522,210.18	684,413,394.65	9.37%
投资性房地产	467,440,594.86	478,563,056.35	-2.32%
固定资产	906,476,104.55	922,585,745.39	-1.75%
无形资产	203,464,194.77	199,045,699.85	2.22%

递延所得税资产	865,471,931.41	912,312,812.39	-5.13%
其他资产	1,317,708,480.31	1,608,410,432.67	-18.07%
短期借款	4,835,545,025.65	3,505,844,122.80	37.93%
应付短期融资款	9,452,803,679.46	3,933,260,648.75	140.33%
拆入资金	2,616,054,024.46	3,576,357,727.96	-26.85%
卖出回购金融资产款	23,869,715,082.85	25,496,292,325.94	-6.38%
代理买卖证券款	41,622,529,820.35	33,494,472,707.20	24.27%
应付职工薪酬	1,801,255,979.40	1,886,590,611.06	-4.52%
应交税费	412,474,004.25	415,145,350.42	-0.64%
应付款项	715,845,707.87	372,940,587.24	91.95%
长期借款	274,170,072.60	342,501,181.02	-19.95%
应付债券	29,778,557,053.76	32,212,281,435.85	-7.56%
递延所得税负债	316,768,121.94	320,586,199.25	-1.19%
其他负债	5,674,378,850.11	5,648,706,681.13	0.45%
实收资本（或股本）	6,968,625,756.00	6,271,763,180.00	11.11%
其他权益工具		6,000,000,000.00	-100.00%
资本公积	13,084,983,314.73	10,857,565,036.70	20.51%
其他综合收益	-356,273,169.19	-429,340,321.18	
盈余公积	1,836,976,860.37	1,839,215,368.76	-0.12%
一般风险准备	4,848,071,661.71	4,823,677,831.72	0.51%
未分配利润	5,729,711,233.25	4,546,698,234.15	26.02%

项目	2020年半年度	2019年半年度	增减幅度
利息净收入	1,047,655,712.45	726,370,401.36	44.23%
手续费及佣金净收入	2,315,222,460.70	2,136,510,534.66	8.36%
投资收益	955,921,341.77	748,257,348.52	27.75%
公允价值变动收益	-142,094,265.59	580,770,431.91	-124.47%
其他业务收入	583,689,751.85	581,203,485.97	0.43%
业务及管理费	2,305,468,872.60	2,459,371,656.29	-6.26%
信用减值损失	136,749,851.87	233,160,346.95	-41.35%
其他业务成本	567,341,981.87	555,162,785.12	2.19%
所得税费用	338,098,099.23	311,055,516.64	8.69%
净利润	1,409,798,955.34	1,223,181,207.38	15.26%
其他综合收益的税后净额	37,877,472.94	314,584,547.52	-87.96%
综合收益总额	1,447,676,428.28	1,537,765,754.90	-5.86%

母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2020年6月30日	2019年12月31日	增减幅度
货币资金	32,830,184,500.51	24,255,923,383.28	35.35%

结算备付金	7,111,728,267.24	6,918,433,358.17	2.79%
融出资金	23,474,905,309.65	22,067,101,373.49	6.38%
存出保证金	2,108,432,186.53	2,198,713,113.45	-4.11%
应收款项	306,958,606.09	198,105,519.85	54.95%
买入返售金融资产	8,796,146,119.91	11,196,667,010.73	-21.44%
交易性金融资产	27,259,343,379.64	26,950,179,078.85	1.15%
其他债权投资	15,311,583,302.33	18,522,040,228.79	-17.33%
其他权益工具投资	7,669,008,085.40	7,308,610,637.77	4.93%
长期股权投资	6,437,702,785.03	5,788,748,524.18	11.21%
投资性房地产	12,972,135.94	22,109,185.15	-41.33%
固定资产	256,392,785.00	259,727,177.29	-1.28%
无形资产	148,571,415.24	147,642,114.57	0.63%
递延所得税资产	711,138,702.93	738,822,745.44	-3.75%
其他资产	691,135,578.00	645,065,297.19	7.14%
应付短期融资款	9,739,139,517.08	4,535,023,662.45	114.75%
拆入资金	2,028,533,403.82	3,017,622,384.62	-32.78%
卖出回购金融资产款	27,101,376,803.60	28,521,214,843.67	-4.98%
代理买卖证券款	32,699,910,000.09	26,566,508,275.40	23.09%
应付职工薪酬	1,465,782,750.61	1,474,231,886.12	-0.57%
应交税费	384,699,446.59	342,308,537.05	12.38%
应付款项	336,138,707.24	125,904,209.71	166.98%
应付债券	27,623,395,268.43	28,676,476,588.94	-3.67%
递延所得税负债	267,580,177.38	284,598,146.09	-5.98%
其他负债	324,609,289.97	488,375,291.57	-33.53%
实收资本（或股本）	6,968,625,756.00	6,271,763,180.00	11.11%
其他权益工具		6,000,000,000.00	-100.00%
资本公积	12,852,918,411.56	10,625,500,133.53	20.96%
其他综合收益	233,910,684.60	158,228,395.88	47.83%
盈余公积	1,839,142,662.34	1,841,381,170.73	-0.12%
一般风险准备	4,726,422,013.25	4,726,422,013.25	0.00%
未分配利润	4,593,758,731.13	3,478,261,750.85	32.07%

项目	2020年半年度	2019年半年度	增减幅度
利息净收入	810,490,254.50	578,244,539.65	40.16%
手续费及佣金净收入	1,983,514,398.82	1,783,979,270.69	11.18%

投资收益	703,661,552.43	379,782,658.23	85.28%
公允价值变动收益	-24,067,465.73	604,448,814.77	-103.98%
其他业务收入	59,165,471.72	82,189,759.01	-28.01%
业务及管理费	1,894,178,087.44	1,928,875,559.33	-1.80%
信用减值损失	80,880,915.76	147,850,023.53	-45.30%
所得税费用	283,926,197.64	255,170,190.01	11.27%
净利润	1,277,881,153.49	1,075,055,010.09	18.87%
其他综合收益的税后净额	53,859,607.12	455,008,554.83	-88.16%
综合收益总额	1,331,740,760.61	1,530,063,564.92	-12.96%

### 第三节 公司业务概要

#### 一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

##### （一）报告期内公司所从事的主要业务及经营模式

公司主要业务有财富管理业务、证券自营业务、投资银行业务、信用业务、托管和外包业务、研究业务、资产管理业务、期货业务、私募投资基金业务、另类投资业务和含香港市场在内的境外业务等。

财富管理业务秉承“以客户为中心”的核心服务理念，为零售客户及高净值客户，个人客户及机构客户提供全面的综合金融服务，包括以交易投顾及机构经纪为核心的交易服务、以资产配置为核心的全产品链服务、以全资本市场为主要依托的项目服务，满足客户日益增长的理财服务需求。

证券自营业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券及其衍生品、固定收益证券及其衍生品、商品衍生品投资，获取投资收益。

投资银行业务是为各类型企业和机构客户提供覆盖主板、科创板、中小板、创业板等股权融资，债券融资，新三板业务，资产证券化，并购重组，创新融资等全业务链的一揽子综合优质金融服务。

信用业务是为客户提供融资融券、股票质押式回购交易、约定购回式证券交易等证券融资类业务。

托管和外包业务：托管业务是公司担任托管人，按照法律法规的规定及合同协议的约定，对托管产品履行安全保管产品财产、办理清算交割、复核审查净值信息、开展投资监督等职责；外包业务是公司依据相关法律法规的规定，以及合同协议的约定，接受产品管理人委托，为产品管理人提供募集资金管理、注册登记、估值核算、数据支持等服务。

研究业务是为公募基金、私募基金、资产管理计划、银行理财等机构客户提供宏观经济、策略研究、行业研究、公司调研、金融工程等研究服务。

资产管理业务主要是通过控股子公司中泰资管及参股公司万家基金开展的业务，包括：

集合资产管理、单一资产管理、专项资产管理、基金管理及其他投资账户管理。

期货业务主要是通过控股子公司鲁证期货经营开展为客户提供与期货及衍生品有关的产品和服务，包括期货经纪、期货投资咨询、资产管理和商品交易及风险管理。

私募投资基金业务是通过全资子公司中泰资本开展的私募投资基金管理业务。

另类投资业务是通过全资子公司中泰创投开展的另类投资业务。

境外业务主要是通过全资子公司中泰国际在香港开展的证券及期货经纪、企业融资、资产管理、孖展、固定收益等业务。

## （二）公司所处行业情况说明

报告期内，面对新冠肺炎疫情，证券行业坚决贯彻习近平总书记重要指示精神和党中央、国务院决策部署，认真落实五部委通知及监管部门有关要求，统筹做好维护资本市场平稳运行和疫情防控工作，经受住了国内外疫情的冲击考验，国内证券市场整体平稳。

随着新《证券法》的实施及中国资本市场改革的深入推进，再融资新规、创业板注册制、新三板转板制度等逐步落地，券商基金投顾试点、投资者保护基金比例下调等政策陆续推出，证券行业迎来高质量发展的新机遇。有利的市场环境显著提高了证券行业的经营绩效，根据证券业协会对134家券商未经审计财务报表统计显示，证券行业2020年上半年度实现营业收入2,134.04亿元，同比增幅为19.26%；实现净利润831.47亿元，同比增长24.73%，有124家证券公司实现盈利。但在新的市场形势下，证券公司作为资本市场的核心中介，组织结构面临调整，战略转型需要不断深入，对证券公司的专业及综合金融服务能力提出了更高要求。

长期以来，公司以建设具有自主创新力、综合竞争力、品牌影响力，倍受社会认知，各种专业化证券业务协同发展的高质量现代投资银行为发展目标，立足于服务实体经济，以客户为中心，积极落实综合金融服务商战略、大客户战略、高端人才战略、创新驱动战略、国际化战略等经营战略，持续推进风控合规能力建设，公司综合实力稳步提升，在中国证监会组织的证券公司分类评价中，2010年至2017年连续八年获得A类A级及以上评价结果，其中2011年和2015年被评为A类AA级；2019年，公司被评为A类A级。

## 二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

适用 不适用

当期变动超过20%的主要资产变化，详见第四节 一、经营情况的讨论与分析（三）资产、负债情况分析。

其中：境外资产 12,097,102,095.13(单位：元 币种：人民币)，占总资产的比例为 7.82%。

### 三、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

公司秉持“中允行健，明德安泰”的经营哲学，倡导“合规风控至上、客户利益至上、人才价值至上、创新发展至上”的经营理念，立足于服务实体经济，以客户为中心，积极落实综合金融服务商战略、大客户战略、高端人才战略、创新驱动战略、国际化战略等经营战略，逐步形成了具有自身特色的核心竞争力，主要体现在：

一是专业的综合金融服务体系。公司始终坚持实施综合金融服务战略，业务牌照齐备，形成了集证券、基金、期货等为一体的综合性证券控股集团，能够为广大客户提供证券代理买卖、投资咨询、财务顾问、证券发行与承销、收购兼并、资产重组、资产管理、融资融券、金融产品代销、证券投资基金代销、期货中间介绍等全方位的专业化证券投融资服务。

二是不断优化的网络布局。截至报告期末，公司在全国 28 个省、市、自治区设有 42 家证券分公司、283 家证券营业部，在北京、上海、深圳、香港等经济发达城市设立了专业子公司和业务总部，地域上已逐步扩展至全国主要地区，在香港注册的全资子公司中泰国际，业务牌照齐全，跨境综合金融服务能力不断提升。

三是显著的区位优势。山东地处环渤海经济圈、新亚欧大陆桥经济带、沿黄经济区的叠加地带，经济总量长期位于全国前三位，资本市场服务需求巨大。当前，山东正在深入实施新旧动能转换重大工程，公司作为唯一一家山东省属券商，已成为山东现代金融产业发展的重要组成部分，在服务山东资本市场、促进实体经济转型升级方面有着其他券商难以比拟的政策优势和地缘优势。

四是持续增强的金融科技实力。公司高度重视金融科技发展，借助人工智能、大数据、云计算、生物识别等技术手段，全面推进数字化转型，推动各项业务与金融科技深度融合。公司持续完善极速交易柜台系统（简称“XTP 系统”），XTP 系统先后荣获“山东省新旧动能转换优秀金融产品奖”“中国计算机用户协会云鹰奖——最高成就奖”“《金融电子化》杂志开发创新突出贡献奖”等；积极打造 O2O 新零售服务模式，通过优化完善柜台业务集中运营、中泰齐富通 APP、齐富通答、中泰智投等平台功能，实现产品销售、业务受理、理财服务、投顾服务等传统业务的线上化和移动化，线上化水平保持在行业前列。

## 第四节 经营情况的讨论与分析

### 一、经营情况的讨论与分析

2020年上半年，疫情加速了全球产业链和贸易关系“断裂”的进程，加剧了包括我国在内的全球金融市场的波动幅度，但国内庞大的市场空间、强大的改革动力、充足的政策工具、显著的制度优势等诸多有利因素，为经济稳定发展奠定了良好基础，国内经济恢复较快。面对国内复杂的宏观环境和国际形势带来的挑战，公司坚守稳健经营，积极抢抓市场机遇，2020年6月3日，公司成功登陆资本市场，在上海证券交易所首次公开发行A股股票并上市，开启

了“二次创业”新征程。

### 主营业务分业务类型、分地区情况

#### 分业务情况

单位：元 币种：人民币

分行业	营业收入	营业支出	毛利率(%)	营业收入比去年同期增减(%)	营业支出比去年同期增减(%)	毛利率比去年同期增减(%)
证券经纪业务	1,588,920,056.52	926,939,154.76	41.66	13.86	-3.18	上升 10.27 百分点
证券投资业务	309,439,762.76	129,130,084.15	58.27	-27.13	-11.94	下降 7.20 百分点
投资银行业务	416,525,466.80	271,676,461.46	34.78	-8.08	-21.60	上升 11.25 百分点
期货业务	746,529,553.00	686,701,127.28	8.01	4.35	2.19	上升 1.95 百分点
资产管理业务	171,769,547.65	102,991,451.21	40.04	-34.98	-21.42	下降 10.34 百分点
信用业务	755,603,767.16	64,867,907.86	91.42	24.29	-47.86	上升 11.89 百分点
境外业务	220,289,738.68	239,776,893.39	-8.85	-35.68	-18.64	下降 22.81 百分点
总部及其他业务	593,140,170.69	623,449,657.18	-5.11	-3.80	2.74	下降 6.69 百分点

#### 分地区情况

单位：元 币种：人民币

分地区	营业收入	营业支出	毛利率(%)	营业收入比去年同期增减(%)	营业支出比去年同期增减(%)	毛利率比去年同期增减(%)
山东省	3,805,895,463.22	2,217,421,679.68	41.74	3.10	-4.54	上升 4.66 百分点
上海市	493,614,839.19	272,126,627.31	44.87	-4.64	8.59	下降 6.72 百分点
福建省	47,581,920.84	36,528,274.83	23.23	18.97	-2.92	上升 17.30 百分点
北京市	30,866,722.19	50,061,669.21	-62.19	49.65	-15.53	上升 125.13 百分点
浙江省	41,809,447.42	33,471,236.64	19.94	7.47	-20.86	上升 28.65 百分点
其他地区	382,449,670.40	435,923,249.62	-13.98	-25.17	-23.12	下降 3.04 百分点

#### 1、财富管理业务

2020 年上半年，证券市场整体平稳，二级市场股票市场交易有所改善，据沪深交易所公布数据，2020 年上半年市场股票基金交易额为 92.53 万亿元。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司共有 42 家证券分公司，283 家证券营业部，共服务客户 651.18 万户，比 2019 年底增加 13.56 万户。服务客户资产 8,389.11 亿元（不含未解禁限售股、OTC 市值），比 2019 年年底增加 928.67 亿元。报告期内，公司经纪业务发展水平稳步提升，根据沪深交易所公布数据，公司股票基金交易量为 5.65 万亿元，同比增加 2.17 万亿元，增幅为 62.20%；股基交易市场份额为 3.0530%，同比增加 0.6356 个百分点。

报告期内，为进一步深化财富管理改革，公司优化调整了经纪业务条线组织架构，将经纪业务管理委员会更名为财富管理委员会，下设经纪业务部、金融产品部、综合金融部、网络金融部。公司积极实施金融科技战略，推进公司进行全方位的数字化、智能化、平台化转型，不断完善齐富通 APP 功能，丰富各类线上服务产品线建设，提升流量变现价值；搭建公司级客户关系管理平台，开创线上投顾互联网营销服务新模式，促进证券经纪业务向财富管理模式的转型；加强智能客服建设，提升客户体验和服务效率；建立并推广以掌 e 通为核心的员工移动端智能营销服务平台，形成网络化、智能化、数字化的客户服务模式和营销模

式，提升精细化运营管理能力。下一步，公司将建立以“买方”客户为中心的服务理念，以实现经纪业务收入多元化、优化多层次客户服务体系、加强资源整合和业务协同以及建立客户导向和创新导向的经纪业务机制为目标，搭建“以交易投顾及机构经纪为核心的交易服务、以资产配置为核心的全产品链服务和以全资本市场为主要依托的项目服务”的综合金融服务体系，形成“一个中泰”的服务品牌，提升经纪业务核心竞争力。

## 2、证券自营业务

2020年上半年，A股市场在经历了第一季度的震荡下调后，于第二季度开始强劲反弹，截至6月30日收盘，上证综指下跌2.15%，深证成指上涨14.97%，创业板指数上涨35.6%；货币政策环境整体较为宽松，债券市场收益率总体下行，中证全债指数小幅上涨2.52%。

报告期内，公司积极应对市场变化，进行大类资产配置调整，在风险可测可控可承受的基础上获取了较好的投资收益。权益类投资方面，公司密切跟踪市场风险，加强研究分析，持续优化投资组合、丰富投资策略，做好风险防范和对冲，保持投资稳健性。固定收益投资方面，因债券市场受疫情冲击波动较大，收益率整体先下后上，但公司继续完善投研管理框架，加强市场研判能力，坚定多策略的发展思路，积极把握市场投资机会，并通过对冲操作管理利率风险、降低回撤，整体取得较好的投资业绩。衍生品投资方面，公司衍生品业务持续发展，在加强业务研究、丰富和优化业务策略的同时，推进系统平台建设和优化；上交所50ETF期权做市继续保持业务优势，上交所沪深300ETF期权、深交所沪深300ETF期权及中金所沪深300指数期权做市步入良性发展轨道；ETF基金做市业务也在不断推进。

## 3、投资银行业务

2020年上半年，科创板的持续扩容以及创业板注册制改革的落地继续推动IPO融资规模增长，再融资新政带来业务新机遇，股权融资整体回暖；货币市场利率中枢明显下行，债券发行量提升；新三板改革配套措施陆续推出，股转系统融资政策持续优化。

报告期内，公司主承销现金类非公开发行项目1单、可转债项目1单，承销规模合计4.92亿元；承销债券类项目172单，承销规模合计664.93亿元，其中主承销93单，承销规模合计532.22亿元；新三板推荐挂牌项目3单、定向发行股票项目11单，承销规模合计2.53亿元，持续督导新三板挂牌公司337家，其中创新层公司45家。

### （1）股票承销及保荐业务、并购重组业务

报告期内，公司投行业务“行业+区域”格局进一步深化，各类股权业务持续综合发展：公司IPO业务能力稳健提升，有较好的后续储备持续跟进；公司积极抓住再融资改革机遇，不断做强销售力量，正逐步树立起中泰股权销售市场品牌形象；公司并购重组业务取得良好进展，担任独立财务顾问的罗欣药业借壳东音股份上市项目，在《证券时报》主办的“2020中国区投资银行君鼎奖”评选中，荣获“2020中国区并购重组项目君鼎奖”。

### （2）债券发行承销业务



报告期内，公司在公司债、融资租赁、资产证券化等细分领域继续保持优势地位。在上海证券交易所举办的“2019 年度债券市场优秀参与机构与个人表彰大会”上，公司荣获“公司债券优秀承销商”、“债券信用风险化解处置优秀参与机构”和“公司债券综合创新奖”奖项。在深圳证券交易所举办的“2019 年度债券监管发展业务”的评选活动中，公司荣获“优秀固定收益业务创新机构奖”奖项。在《证券时报》主办的“2020 中国区投资银行君鼎奖”评选中，公司荣获“2020 中国区交易所债券投行君鼎奖”和“2020 中国区资产证券化融资团队君鼎奖”奖项。报告期，公司联席主承的“光明食品（集团）有限公司 2020 年公开发行短期公司债券（第一期）”成功发行，是全国首批公募短期公司债券。公司作为销售机构参与的“国君资管-中电投融和租赁 2019 年第一期绿色资产支持专项计划项目”是上交所首单融资租赁类主体+资产双绿色 ABS 产品；公司作为销售机构参与的“中泰-联易融-淮安控股供应链 1 期资产支持专项计划”是江苏首单 AA+基础设施类供应链 ABS；公司作为销售机构参与的“汇添富资本-泰富供应链 1 期资产支持专项计划”是江苏省首单建筑类国企供应链 ABS。

报告期内，公司积极贯彻落实党中央、财政部、中国证监会等的决策部署，完成 5 单疫情防控债券及 3 单疫情防控资产证券化项目的承销发行，募集资金用于发行人及其子公司抗击疫情的营运资金需求，并助力重灾区受疫情影响客户的生产经营发展，为疫情防控提供精准金融支持，为打赢疫情防控战贡献力量，带来了良好的市场影响。

### （3）新三板业务

报告期内，已有 2 家公开发行并在精选层挂牌项目（含 1 家联主）进入发行阶段，3 家已申报待审核。公司在新三板推荐挂牌项目数量、挂牌公司股票定向发行次数、持续督导挂牌公司数量以及创新层挂牌公司数量等方面，持续保持行业前列。公司积极贯彻落实监管要求，提高推荐挂牌项目立项标准，精选优质标的，从源头上提升挂牌公司质量，严格控制业务风险。同时，积极参与新三板深化改革，初步形成了保荐业务与推荐业务共同发展的局面，有利于同时发挥公司保荐业务和推荐业务两方面的经验和优势。

## 4、信用业务

截至 2020 年 6 月末，根据 Wind 统计，沪深市场融资融券余额 11,637.7 亿元，较上年末增长 14.2%。

报告期内，公司信用业务整体运行平稳。公司坚持逆周期管理思路，加强信用业务的前端审核，做详做细尽职调查，借助金融科技加强风险监控，组织人力物力做实贷后管理。同时拓宽渠道建设，丰富券源供给。公司秉承风控合规至上理念，严控信用业务项目质量，保障信用业务稳健发展。报告期内，公司融资融券余额整体上涨，维持担保比例维持在较高水平，股票质押业务规模持续缩减，自有资金股票质押平均履约保障比例整体提升，2020 年 6 月末达到 286.22%。截至报告期末，公司信用业务总规模 352.86 亿元：其中融资融券余额 250.82 亿元，较年初增加 24.56 亿元；股票质押待购回余额 102.04 亿元，较年初减少 27.44 亿元，自有资金融资规模为 73.41 亿元，以资管计划作为融资工具的融资规模为 28.63 亿元。

## 5、托管与外包业务

### (1) 托管业务

目前公司托管业务已经涵盖公募基金、私募基金、资产管理计划、银行理财等产品类型，为相关产品提供资产保管、投资清算、资金交收、估值核算、投资监督等全面、专业的托管服务。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司累计共托管 1,580 只产品，已清盘 774 只，尚在存续期内产品 806 只，存续产品净值总计 229.3 亿元。

### (2) 外包业务

目前公司外包业务已经涵盖私募基金、资产管理计划、信托计划、银行理财等产品类型，为管理人提供募集资金管控、份额登记、估值核算、数据支持等一站式后台运营支持服务。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司外包业务累计服务产品 1,626 只，已清盘 811 只，存续服务产品 815 只，存续产品净值总计 248.62 亿元。

## 6、研究业务

公司研究所由首席经济学家李迅雷领衔。截至 2020 年 6 月 30 日，对外发布研究报告 2,389 篇，在宏观、金融、金属、电力设备新能源等研究领域得到国内外投资者认可。研究所划分成总量组、大宗组、消费组、制造组、金融组、科技组六大团队，积极拓展社保、银行、保险、QFII 等领域客户；销售团队为客户提供专业的研究报告、路演和策略会等服务，为客户提供各类专家资源、产业调研及电话会议等研究服务支持。与此同时，公司研究所积极探索转型与创新，在 QFII 销售团队的支持下，加强海外研究服务，加快研究业务国际化进程，推动研究业务的海外品牌及影响力。

## 7、资产管理业务

### (1) 资产管理业务

2020 年上半年，公司控股子公司中泰资管资产管理规模 1,276 亿元，其中主动资产管理规模 940 亿元，占比 73%。

报告期内，中泰资管完成了管理层的更替交换，在起承转合时期，保持了业务的稳定和队伍的稳定。中泰资管通过扩大权益和多策略产品的业务比重，通过拓展直销和第三方渠道扩大线上客户的比重，保持了业务和渠道持续稳定。中泰资管继续布局公募基金产品线，加大产品创新力度，为客户提供多元化资产配置服务；继续发挥纾困基金作用，创新产品结构，积极支持实体企业发展。

### (2) 基金管理业务

截至 2020 年 6 月末，公司参股公司万家基金资金管理规模达到 1,421 亿元，较年初增长 17%。其中，主动权益规模 361 亿元，较年初增长 161%。

报告期内，万家基金紧跟市场形势，合计新拓机构客户 22 家，有效机构客户达 428 家。多单银行理财子公司业务落地，实现破冰。通过深耕主流平台，持续推进绩优老基金持续营

销，促进新基金非货币性转化。加深渠道营销力度，扩大客户营销范围，品牌知名度不断提高。

#### 8、期货业务

截至 2020 年 6 月 30 日，鲁证期货已拥有 27 家分支机构，包括上海分公司、武汉分公司、济南分公司、南京分公司以及山东省内的 10 家期货营业部和位于北京、上海、天津、浙江、广东等省市的 13 家期货营业部。

报告期内，鲁证期货在做好疫情防控工作的同时，进行了组织架构调整优化，狠抓合规风控体系建设，经营业绩持续好转：期货客户权益、成交额、手续费收入等主要业务指标扭转了下滑趋势，并呈现稳步上升势头；深入现货企业，成立深度服务机构客户区域工作小组、精品服务小组，坚持“走出去做研究”，产业服务水平持续提升；上线掌上营业厅，积极推进 APP 优化、投研服务、客户分级体系等工作，线上服务能力显著增强；场内期权市场份额位于市场前列，场外期权业务稳步发展，期权业务持续保持行业领先。

#### 9、私募投资基金业务

报告期内，中泰资本已完成青岛中泰海控新旧动能转换基金和齐鲁中泰定增 1 号私募股权基金的募集，募集规模共 7.25 亿元。截至报告期末，中泰资本连同子公司累计管理基金 20 只，管理基金实缴规模约 30 亿元。中泰资本与基金累计投资项目 118 个，投资领域涉及新能源、新材料、医养康美、高端装备制造、节能环保、文化传媒等多个行业，投资效果良好。

#### 10、另类投资业务

中泰创投目前聚焦于 PE 及 Pre-ipo 阶段的股权投资业务，辅以少量早期项目投资及固定收益投资，行业方面重点关注高端装备制造、新一代信息技术、新材料、节能环保等领域中符合国家战略、具备核心技术、行业地位领先的科技创新企业。截至 2020 年 6 月 30 日，中泰创投投资项目总计 22 个，合计投资金额 10.54 亿元，其中 2020 年上半年新增投资项目 4 个，合计投资金额 5.96 亿元。

报告期内，中泰创投将资本金投资业务定位为核心业务，提出了“以绝对收益为目标，探索和构建适合公司风险收益偏好的另类投资业务模式”。股权投资行业具有项目周期长、收益波动大的特点，但中泰创投近两年加速投资布局，发挥券商投资平台对于 PE 及 Pre-ipo 项目的专长，大力拓展优质项目来源、扩大投资数量及投资规模。2020 年上半年，在会审核及即将申报 IPO 项目显著增多，有望在中短期内形成投资收益。此外，中泰创投适度布局中早期项目，延长投资链条，对冲后期项目估值高企、受当期政策环境影响较大等问题，形成不同项目阶段合理分布的项目梯队，以实现滚动退出的良性循环。

#### 11、境外业务

2020 年上半年，恒生指数下跌 3,762 点，降幅约 13.3%，日均成交额 1,172 亿港元，同比上升约 20%。香港交易所新上市制度效果显现，推动医药、生物科技等新经济公司来港

上市以及美国上市中概股赴港二次上市，为券商带来新机遇。根据彭博数据，上半年香港市场 IPO 融资额约 118.99 亿美元，同比上升 29.91%；亚洲除日本 G3 货币债券融资额 1,692.5 亿美元，同比下降 7.76%。

截至 2020 年 6 月 30 日，中泰国际完成 3 个 IPO 项目的保荐业务、1 个反向收购项目通过上市聆讯、7 个 IPO 承销项目；完成 40 个债券类项目，融资额约 79.3 亿美元，同比上升 34.4 %；完成 2 个财务顾问项目。根据彭博数据，2020 年上半年，中泰国际股权承销项目数量在中资券商中排名第 10 位，债权承销项目数量在中资券商中排名第 5 位。此外，中泰国际品牌影响力不断提升，荣获《全球品牌杂志》(Global Brands Magazine) “2020 全球品牌奖”之“香港最佳跨国金融服务品牌”。

报告期内，中泰国际深入贯彻公司国际化战略，客户规模持续增长，各项业务能力显著增强，综合实力稳步提升。机构业务，重点把握赴港上市以及发行美元债的机遇，加强对机构客户的业务覆盖。证券业务，积极开辟线上业务，在网上开户及微信公众号等 IT 基础设施支持下，克服疫情导致的跨境人员流动限制，积极举办各类型在线活动及直播间栏目，发展新渠道，拓展服务客户。直投业务，成功投资了微医、喜马拉雅等具有市场影响力的项目，并借助中概股回归热潮成立了中泰国际私募令 IPO 打新基金。

## (一) 主营业务分析

### 1 财务报表相关科目变动分析表

单位:元 币种:人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	4,802,218,063.26	4,819,776,546.85	-0.36
营业成本	3,045,532,737.29	3,279,566,181.57	-7.14
经营活动产生的现金流量净额	6,339,807,671.68	9,918,958,113.04	-36.08
投资活动产生的现金流量净额	2,595,555,792.32	2,509,547,084.59	3.43
筹资活动产生的现金流量净额	429,474,425.19	-323,613,755.43	

**营业收入变动原因说明:**2020 年上半年，本集团实现营业收入 48.02 亿元，同比减少 0.18 亿元，降幅 0.36%。其中主要变动项目为：经纪业务手续费净收入同比增加 2.46 亿元，增幅 18.10%，受益于股市交投活跃交易量增加；利息净收入同比增加 3.21 亿元，增幅 44.23%，公司调整融资结构和融资期限减少了融资成本，以及债券投资的利息收益增加；投资收益同比增加 2.08 亿元，增幅 27.75%，主要是交易性金融资产增加的投资收益；公允价值变动损益同比减少 7.23 亿元，降幅 124.47%，主要是债券投资和衍生金融工具投资公允价值变动损益减少所致。

**营业成本变动原因说明:**2020 年上半年，本集团营业支出 30.46 亿元，同比减少 2.34 亿元，降幅 7.14%。主要是本期业务及管理费同比减少 1.54 亿元，降幅 6.26%；本期信用减值损失同比减少 0.96 亿元，降幅 41.35%。

**经营活动产生的现金流量净额变动原因说明:**经营活动产生的现金流量净额为 63.40 亿元。其中：现金流入 167.27 亿元，主要为代理买卖证券款净增加 81.28 亿元、收取利息、手续费

及佣金增加的现金 51.68 亿元和返售业务资金净减少额 16.68 亿元；现金流出 103.87 亿元，主要为支付给职工以及为职工支付的现金 16.22 亿元、回购业务资金净减少额 16.22 亿元、融出资金净增加额 13.80 亿元和支付利息、手续费及佣金的现金增加 13.01 亿元。

**投资活动产生的现金流量净额变动原因说明:**投资活动产生的现金流量净额为 25.96 亿元。

其中：现金流入 26.91 亿元，主要为收回投资收到的现金 21.17 亿元；现金流出 0.96 亿元，主要为购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 0.95 亿元。

**筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明:**

筹资活动产生的现金流量净额为 4.29 亿元。其中：现金流入 219.25 亿元，主要为发行债券收到现金 171.16 亿元及取得借款收到的现金 18.84 亿元；现金流出 214.95 亿元，主要为偿还债务支付 142.68 亿元、偿还计入权益的永续债 60 亿元和分配股利、利润或偿付利息支付的现金 12.27 亿元。

**利润表中变动幅度超过 30%的主要项目情况**

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数	变动幅度(%)	主要变动原因
利息净收入	1,047,655,712.45	726,370,401.36	44.23	公司调整融资结构和融资期限减少了融资成本，以及债券投资的利息收益增加，使得利息净收入同比增加
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-142,094,265.59	580,770,431.91	-124.47	由于证券市场波动和上年同期证券市场股指上涨因素影响，交易性及衍生金融工具浮动盈亏同比减少
其他收益	27,243,583.92	49,321,107.00	-44.76	政府补助及个税手续费返还同比减少
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-5,754,237.43	-2,667,538.98		汇率波动
资产处置收益（损失以“-”号填列）	20,333,715.59	10,776.41	188,587.29	处置两处房产使得资产处置收益同比增加
信用减值损失	136,749,851.87	233,160,346.95	-41.35	融出资金及买入返售金融资产减值准备计提减少所致
其他资产减值损失		-2,705,089.87		去年同期鲁证期货子公司鲁证经贸公司存货价值回升跌价准备冲回
营业外收入	2,515,974.95	1,870,252.90	34.53	收到诉讼补偿
营业外支出	11,304,246.35	7,843,894.16	44.12	新冠疫情捐款
其他综合收益的税后净额	37,877,472.94	314,584,547.52	-87.96	受证券市场波动影响，其他权益工具投资公允价值发生变动

## 2 其他

## (1) 公司利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

□适用 √不适用

## (2) 其他

□适用 √不适用

## (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

□适用 √不适用

## (三) 资产、负债情况分析

√适用 □不适用

## 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例(%)	上年同期期末数	上年同期期末数占总资产的比例(%)	本期期末金额较上年同期期末变动比例(%)	情况说明
货币资金	39,839,246,122.10	25.76	30,916,047,553.27	21.09	28.86	主要是客户资金银行存款增加
结算备付金	7,006,200,141.42	4.53	6,763,320,638.78	4.61	3.59	
融出资金	24,657,083,933.21	15.94	23,248,873,866.35	15.86	6.06	
衍生金融资产	90,886,225.93	0.06	99,279,168.26	0.07	-8.45	
存出保证金	7,391,484,771.92	4.78	5,904,321,055.36	4.03	25.19	主要是交易保证金增加
应收款项	748,083,492.80	0.48	682,845,873.86	0.47	9.55	
买入返售金融资产	10,882,498,894.42	7.04	12,572,663,170.37	8.58	-13.44	
交易性金融资产	34,016,242,777.49	22.00	33,342,840,435.15	22.74	2.02	
债权投资	4,279,309,718.71	2.77	4,238,796,066.65	2.89	0.96	
其他债权投资	15,388,370,806.71	9.95	18,522,040,228.79	12.63	-16.92	
其他权益工具投资	5,831,811,877.93	3.77	5,510,778,810.08	3.76	5.83	
长期股权投资	748,522,210.18	0.48	684,413,394.65	0.47	9.37	
投资性房地产	467,440,594.86	0.30	478,563,056.35	0.33	-2.32	
固定资产	906,476,104.55	0.59	922,585,745.39	0.63	-1.75	
在建工程	6,011,702.87	0.00	6,011,702.87	0.00	-	
无形资产	203,464,194.77	0.13	199,045,699.85	0.14	2.22	
递延所得税资产	865,471,931.41	0.56	912,312,812.39	0.62	-5.13	
其他资产	1,317,708,480.31	0.85	1,608,410,432.67	1.10	-18.07	
短期借款	4,835,545,025.65	3.98	3,505,844,122.80	3.14	37.93	主要是信用借款增加
应付短期融资款	9,452,803,679.46	7.79	3,933,260,648.75	3.52	140.33	主要是短期收益凭证增加

拆入资金	2,616,054,024.46	2.15	3,576,357,727.96	3.20	-26.85	主要是转融通融入资金减少
交易性金融负债	13,295,655.22	0.01	345,790,400.45	0.31	-96.15	主要是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减少
衍生金融负债	29,604,661.53	0.02	51,781,107.35	0.05	-42.83	主要是场外期权业务衍生金融负债减少
卖出回购金融资产款	23,869,715,082.85	19.66	25,496,292,325.94	22.84	-6.38	
代理买卖证券款	41,622,529,820.35	34.28	33,494,472,707.20	30.01	24.27	主要是普通经纪业务代理买卖证券款增加
代理承销证券款	864,177.93	0.00	2,754,987.94	0.00	-68.63	主要是代理承销债券款减少
应付职工薪酬	1,801,255,979.40	1.48	1,886,590,611.06	1.69	-4.52	
应交税费	412,474,004.25	0.34	415,145,350.42	0.37	-0.64	
应付款项	715,845,707.87	0.59	372,940,587.24	0.33	91.95	主要是清算款和股票收益互换客户保证金增加
预计负债	473,566.29	0.00	219,298.85	0.00	115.95	主要是未决诉讼或预计负债增加
长期借款	274,170,072.60	0.23	342,501,181.02	0.31	-19.95	
应付债券	29,778,557,053.76	24.53	32,212,281,435.85	28.86	-7.56	
递延收益	1,057,206.47	0.00	1,057,206.47	0.00	-	
递延所得税负债	316,768,121.94	0.26	320,586,199.25	0.29	-1.19	
其他负债	5,674,378,850.11	4.67	5,648,706,681.13	5.06	0.45	

#### 其他说明

##### (1) 资产状况

截至2020年6月30日，本集团资产总额1,546.46亿元，比上年末增加80.33亿元，增幅5.48%。主要变动情况是：货币资金、结算备付金及存出保证金增加106.53亿元，交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资等金融投资减少20.99亿元，融出资金增加14.08亿元，买入返售金融资产减少16.90亿元。公司资产流动性强，资产结构优良。

##### (2) 负债状况

截至2020年6月30日，本集团负债总额1,214.15亿元，比上年末增加98.09亿元，增幅8.79%。主要变动情况是：代理买卖证券款增加81.28亿元，短期借款、应付短期融资款增加68.49亿元，拆入资金、卖出回购金融资产减少25.86亿元，应付债券减少24.34亿元。负债结构合理，无到期未偿付债务，偿债能力强。

## 2. 截至报告期末主要资产受限情况

√适用 □不适用

具体参见“第十节 财务报告 六、合并财务报表项目注释 75 所有权或使用权受到限制的资产”的相关内容。

### 3. 其他说明

适用 不适用

## (四) 投资状况分析

### 1、 对外股权投资总体分析

适用 不适用

截至报告期末，本集团长期股权投资 7.49 亿元，与上年末相比增加 0.64 亿元，增幅为 9.37%，主要是对联营企业确认的投资收益所致。具体参见“第十节 财务报告 六、合并财务报表项目注释 17、长期股权投资”和“第十节 财务报告 九、在其他主体中的权益”。

#### (1) 重大的股权投资

适用 不适用

合营企业或联营企业名称	业务性质	持股比例(%)	权益法下确认的投资损益（元）	期末投资账面价值（元）
万家基金管理有限公司	基金募集、基金销售、资产管理等	49	46,131,078.04	457,645,585.97

#### (2) 重大的非股权投资

适用 不适用

#### (3) 以公允价值计量的金融资产

适用 不适用

项目名称	期初余额（元）	期末余额（元）	当期变动（元）	对当期利润的影响金额（元）
交易性金融资产	33,342,840,435.15	34,016,242,777.49	673,402,342.34	712,942,472.86
衍生金融资产	99,279,168.26	90,886,225.93	-8,392,942.33	13,241,361.09
其他债权投资	18,522,040,228.79	15,388,370,806.71	-3,133,669,422.08	446,453,704.51
其他权益工具投资	5,510,778,810.08	5,831,811,877.93	321,033,067.85	10,114,554.75

#### (五) 重大资产和股权出售

适用 不适用

#### (六) 主要控股参股公司分析

适用 不适用

##### (1) 鲁证期货



鲁证期货股份有限公司，注册资本为100,190.00万元人民币，公司持有63.10%的股权，经营范围为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。截至2020年6月30日，鲁证期货总资产1,083,191.18万元，净资产211,776.46万元，2020年上半年实现营业收入74,874.92万元，利润总额5,832.95万元，净利润3,955.02万元。

鲁证期货于2015年7月7日在香港联交所主板挂牌上市，股票简称“鲁证期货”，股票代码为01461。

#### (2) 中泰资本

中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司，注册资本为222,000.00万元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：受托资产管理、投资管理（不得从事信托、金融资产管理、证券资产管理及其他限制项目）；股权投资、受托管理股权投资基金（不得从事证券投资活动；不得以公开方式募集资金开展投资活动；不得从事公开募集基金管理业务）。截至2020年6月30日，中泰资本总资产213,525.96万元，净资产193,912.29万元，2020年上半年实现营业收入4,213.73万元，利润总额3,193.66万元，净利润2,539.37万元。

#### (3) 中泰创投

中泰创业投资（深圳）有限公司，注册资本为150,000.00万元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：创业投资业务。（法律、行政法规、国务院决定禁止的项目除外，限制的项目须取得许可后方可经营）。截至2020年6月30日，中泰创投总资产94,821.33万元，净资产77,904.09万元，2020年上半年实现营业收入426.54万元，利润总额12.58万元，净利润-50.63万元。

#### (4) 中泰国际

中泰金融国际有限公司，注册资本为179,098.3375万港元，为公司全资子公司，经营范围为：证券经纪、期货、机构融资、资产管理。截至2020年6月30日，中泰国际总资产1,209,710.21万元，净资产162,255.45万元，2020年上半年实现营业收入22,028.97万元，利润总额-1,961.80万元，净利润-2,120.87万元。

#### (5) 中泰资管

中泰证券（上海）资产管理有限公司，注册资本为16,666.00万元人民币，公司持有60%的股权，经营范围为：证券资产管理和公开募集证券投资基金管理业务。截至2020年6月30日，中泰资管总资产97,366.49万元，净资产52,999.29万元，2020年上半年实现营业收入19,777.96万元，利润总额3,760.93万元，净利润2,859.53万元。

#### (6) 中泰物业

齐鲁中泰物业有限公司，注册资本为82,834.71万元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：物业管理服务，房屋修缮服务，汽车租赁服务；房屋出售及出租；保洁服务；搬家服务；绿化工程、市内外装饰工程施工；美容美发；服装清洗；康乐健身及家政服务；蔬菜、水果、日用百货、办公用品的批发零售。截至2020年6月30日，中泰物业总资产117,468.36

万元，净资产89,959.03万元，2020年上半年实现营业收入3,296.04万元，利润总额550.19万元，净利润411.05万元。

#### (7) 万家基金

万家基金管理有限公司，注册资本为30,000.00万元人民币，公司持有49%股权，为公司参股子公司，经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2020年6月30日，万家基金总资产154,018.71万元，净资产106,370.69万元，2020年上半年实现营业收入50,225.21万元，利润总额12,900.57万元，净利润9,677.05万元。

#### (8) 齐鲁股权

齐鲁股权交易中心有限公司，注册资本为22,500.00万元人民币，经营范围为：为非上市公司股权、债权、资产支持证券的登记、托管、挂牌、鉴证、交易、过户、结算提供场所、设施和服务，为企业融资、并购及其他资本运作提供服务，省交易场所监管部门批准的其他业务，提供与前述业务相关的咨询、培训、信息服务，企业推介，财务顾问，投资管理。截至2020年6月30日，齐鲁股权总资产41,651.69万元，净资产30,048.94万元，2020年上半年实现营业收入3,664.11万元，利润总额1,047.02万元，净利润784.22万元。

### (七) 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

本集团对担任结构化主体的管理人，且持有产品份额的结构化主体，在综合考虑对其拥有的投资决策权及可变回报的敞口等因素后，认定对部分资产管理计划拥有控制权，并将其纳入合并范围。截至2020年6月30日，本集团合并了35只结构化主体，其归属于本集团的权益为7,299,362,048.20元。

具体参见“第十节 财务报告 九、在其他主体中的权益 1、在子公司中的权益（1）企业集团的构成”项下的纳入合并报表范围的结构化主体。

## 二、其他披露事项

### (一) 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生大幅度变动的警示及说明

适用 不适用

### (二) 可能面对的风险

适用 不适用

#### 1. 合规风险

合规风险是指因公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规、监管规定和自律规则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。

公司建立董事会及其风险管理委员会、经营管理层、合规总监、合规管理总部、各单位

合规管理人员的合规管理组织体系。报告期内，公司严格落实《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》及《证券公司合规管理实施指引》，在制度建设、合规人员配备及履职保障、业务流程梳理、数字化转型等多方面优化合规管理体系，切实推进合规管理全流程覆盖。通过合规审查与咨询、合规检查与监测、合规宣导与培训等手段，对公司经营管理中的合规风险进行识别、评估和监控，强化业务合规管控机制。

公司合规管理总部通过工作联系函、现场督导、约谈等方式，督促各部门认真整改经营管理中出现的不规范事项或风险隐患；密切跟踪最新监管政策，定期印发监管案例学习资料、发布业务风险点和监管红线清单、举办专题培训传递最新监管政策和动态，为公司各单位合规展业提供支持；坚持监管导向、问题导向，结合行业多发问题和监管关注重点，组织开展合规检查，持续跟踪整改落实情况，强化业务管理，防范合规风险；加强信息技术合规管理，初步构建数字化的合规管理体系；定期对工作人员的证券投资行为等进行监测、处理；持续优化信息隔离墙管理机制，完善新版信息隔离墙管理系统，防控内幕信息及未公开信息的不当流动和使用；牵头组织完善客户投诉举报处理机制，履行客户投诉处理的协调、督办、核查、责任认定与报告等；完善子公司分类合规管理方式，修订子公司合规管理办法，加强对子公司合规考核，建立健全子公司风险监控机制。公司审计稽核部牵头组织对公司合规管理的有效性进行评估，并就评估发现的问题督促相关单位落实整改。

## 2.洗钱与恐怖融资风险

公司面临的洗钱、恐怖融资和扩散融资风险是指公司的产品或服务被不法分子利用从事洗钱、恐怖融资、扩散融资等活动的可能性。

公司严格按照反洗钱法律、法规，采取相关措施，控制洗钱及恐怖融资风险。公司已制定较为完备的反洗钱内部控制制度体系，其中包含洗钱风险管理基本制度、反洗钱内部控制制度以及其他多项反洗钱专项制度，并在公司全面风险管理、重大事项报告、合规绩效考核、员工违规违纪处罚等保障制度中涵盖反洗钱相关内容。公司建立了以公司董事会负责、监事会督导、总部反洗钱工作领导小组统筹领导、合规管理总部组织实施，相关业务部门和分支机构反洗钱工作领导小组落实执行的反洗钱组织架构体系。2019年下半年，公司制定并发布了《中泰证券股份有限公司洗钱风险管理基本制度》，明确董事会、监事会、高管层、业务部门及职能管理部门的反洗钱职责，提出了公司洗钱风险管理的工作内容、工作要求、检查审计、绩效考核等，并将公司各业务子公司纳入管理范畴。2020年上半年，公司重新修订了《中泰证券股份有限公司反洗钱内部控制制度》《中泰证券股份有限公司洗钱风险评估和分类管理实施办法》，对公司洗钱风险管理工作开展做了进一步全面、细化要求；公司严格按照反洗钱法律法规要求，认真组织开展了洗钱风险自评估工作。同时，公司积极配合中国人民银行济南分行开展反洗钱分类评级工作，并在2017、2018、2019连续三年获评“AA”级。

## 3.信用风险

信用风险是指由于融资方、交易对手或发行人等违约导致公司可能面临损失的风险。报告期内，公司面临的信用风险主要集中在融资融券业务、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务、债券投资交易业务、场外衍生品业务等方面。

公司主要采取信用评估、交易对手管理、尽职调查、限额管理、盯市管理等方式控制信用风险。

**信用评估：**在融资类业务中，公司建立客户准入与适当性管理机制，制定客户信用等级评价体系，全面了解客户资信水平、风险承受能力等情况，综合确定客户信用等级及授信额度；在债券投资交易和场外衍生品业务中，需要对标的债券、交易对手进行必要的尽职调查和内部评级，区分不同的风险等级；对质押标的债券，参考外部和内部评级，建立准入标准，合理确定债券质押率。公司建立了定量与定性相结合的内部评级模型，根据内部实际情况及管理需要确定了内部评级覆盖的业务范围，并建立与自身业务复杂程度和风险指标体系相适应的内部评级管理工具、方法和标准。

**交易对手管理：**在债券投资交易和场外衍生品业务中，公司根据交易对手所属行业建立定量与定性相结合的内部评级体系，优先选择管理规范、资信状况良好的大型客户开展交易，并根据内部评级风险等级分配相应额度，对于内部评级较低的交易对手审慎严格控制额度上限；在融资类业务中，公司建立客户准入和征信标准，通过对客户的资产情况、投资经验、资信状况等进行评价，严格执行信用授信和后续管理，建立信用业务黑名单机制等。

**尽职调查：**公司根据各类业务的特点建立了尽职调查要求与规范，在开展具有信用风险的业务前，需要根据制度要求对融资方、交易对手及标的证券等进行尽职调查和有效评估，必要时提交尽职调查报告、分析报告，符合公司准入标准并审核通过后可以实施项目。

**限额管理：**对于债券投资交易，公司根据交易对手、现券、质押券的评级建立额度、集中度管理机制，并确立了与业务规模相匹配的分级授权审批机制；对于衍生品交易，建立与内部评级相挂钩的交易对手额度管理机制，并通过设定追保比例、止损限额等措施管理信用风险；对于融资类业务，设定了业务规模、集中度指标，对单一客户、单一证券实行前端规模控制和监控，并通过设定担保比例、补仓平仓损失指标，以及适时调整监控指标与阈值等措施进行信用风险管控。

**盯市管理：**公司持续强化盯市通知服务工作管控，落实多重盯市制度，相关部门每日独立安排专人进行风险监控指标、标的证券及客户舆情风险的盯市，盯市内容各有侧重，互为补充，同时公司建立了良好的沟通协作机制和健全的风险应急处置预案，在发生风险时根据公司相关制度执行对内和对外的风险报告程序，并及时采取风险应急处置措施。

公司在开展各类信用类业务的过程中，严格控制业务规模并稳步提升整体信用风险管理水平，当前公司总体信用风险在可承受范围内。

#### 4.市场风险

市场风险是指公司的持仓组合由于相关市场价格或波动率的不利变化而导致损失的风

险。公司的持仓组合主要来自于自营投资、做市业务以及其他投资活动等。公司面临的市场风险主要类别如下：①权益类风险：主要来自于公司自营证券投资和做市类业务持仓组合在股票、股票组合、股指期货、期权等权益类证券的价格及波动率变化上的风险敞口；②利率类风险：主要来自于公司固定收益类投资组合（包括债券、利率互换和国债期货等）在收益率曲线结构、利率波动性及信用利差等变化上的风险敞口；③商品类风险：主要来自于公司自营持仓组合在商品现货、期货价格及波动率变化上的风险敞口；④汇率类风险：主要来自于公司在外汇汇率即期、远期价格及波动率变化上的风险敞口。

公司建立了完善的市场风险管理体系，通过风控前置、限额管理、风险分析等手段对市场风险进行分析和控制。

风控前置：公司业务部门制定适当的市场风险控制措施，主动识别、控制市场风险，对发生的市场风险事件进行核查、分析、报告和处理，定期或不定期开展风险排查工作。公司业务系统或业务管理系统设置风险管理模块，在业务处理过程中由系统自动执行检查和监控措施，实现部分限额指标的前端控制，提升风险管理效率。

限额管理：公司建立了较为完善的市场风险限额管理体系，由公司董事会、经营管理层、风险管理部、相关业务部门等构成集中统一管理、分级授权实施的管理架构。公司设定各业务规模、敞口、集中度等关键风险指标，通过风险管理系统进行动态监测，分析、评估各业务市场风险情况，对超限情况及时通知、警示业务部门、管理层采取降低敞口或对冲等措施控制风险。通过设置止损限额及市场风险总量 VaR 有效控制公司自营业务亏损过大的情况。

风险分析：公司建立了完善的市场风险计量模型库，实现市场风险量化分析。公司 VaR 风险计量模型覆盖了权益价格风险、利率风险、商品价格风险、汇率风险等风险类型，通过回溯测试等方法对 VaR 计量模型的准确性进行持续检验并不断改善。公司 RNIV 风险计量模型已覆盖新三板做市业务风险。公司通过敏感性分析、压力测试等工具定期或不定期对公司在极端情况下可能承担的损失，确保公司在市场风险可控、可承受的情况下开展各项业务。

风险报告：公司建立了市场风险分析报告机制，通过日报、月报等定期报告及不定期报告反映风险识别和应对方案。公司风险管理部定期或不定期出具公司市场风险分析报告，为业务决策提供建议。

截至报告期末，公司持仓投资组合一天 95% 市场风险 VaR 为 4,822.85 万元，占公司净资本的 0.19%；其中，公司权益类投资组合一天 95% 市场风险 VaR 为 4,372.55 万元；公司场外衍生品业务一天 95% 市场风险 VaR 为 152.68 万元；公司场内期权做市和期权自营业务的 delta 敏感度为 16.68 万元；公司固定收益类投资组合 DV01 敏感度为 467.42 万元。2020 年上半年公司权益类投资规模整体保持稳定、风险敞口可控，非权益类投资久期相对稳定，公司自营投资、做市业务市场风险可控、可承受。

## 5.操作风险

操作风险是指由于不完善或有问题的内部操作流程设计、员工相关事项和信息技术系统，以及外部事件而导致直接或间接损失的风险，包括法律风险，不包括策略风险和声誉风险。操作风险存在于公司各机构、各业务条线、各类业务及工作流程中。

公司选择适当的方法开展操作风险基础管理工作，包括风险与控制自我评估（RCSA）、损失数据收集（LDC）、关键风险指标（KRI）、操作风险状况分析报告等。公司利用风险与控制自我评估（RCSA）工具识别关键风险点和控制措施，并对控制效果进行评估；利用风险日报等方式定期或不定期收集内外部损失数据（风险事件），汇总各类风险事件并进行分析归类、入库整理；制定 7 项公司级关键风险指标（KRI），实现对系统、人员、流程等关键风险因素的后端趋势监测；建立畅通的操作风险报告机制，对于操作风险与控制自我评估、关键风险指标、操作风险状况分析等实行定期报告制度，对于重大操作风险隐患或事件，按照公司重大事项报告管理要求执行报告程序；利用非相关性原理将操作风险损失限额分解至各业务条线、分支机构、子公司，提升损失限额精细化管理水平；风险管理部对各单位报备的操作风险数据进行汇总、分类、分析、评估，并对各单位数据报送情况提出考核意见。

报告期内，公司通过线上培训、现场检查等多种形式宣导全员操作风险防控理念，持续推动操作风险三大基础管理工具、操作风险管理系统在集团层面的落地应用，利用操作风险基础管理工具组织开展操作风险日常管理工作及 RCSA 梳理、操作风险状况分析等年度常规工作，期间未发生对公司经营造成重大影响的操作风险事件。

## 6.流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。公司可能面临流动性风险的事件和因素包括：现金流紧张、融资成本持续高企、融资渠道受阻、债务集中到期难以兑付等。

在日间流动性管理方面，一是建立了现金流预测和分析框架，运用现金流缺口、敏感性分析、压力测试等管理工具，能够计量、监测和控制不同情景下未来不同时间段的现金流缺口；二是按照审慎原则确定优质流动性资产规模和构成，保持多层次、充足的优质流动性资产储备，定期测试优质流动性资产的变现能力，以确保公司在压力情景下能够及时获得充足资金满足流动性需求。

在中长期流动性风险管控方面，公司不断优化资产负债结构，从源头上强化对流动性风险的管理。一方面，在融资负债统一归口管理的基础上积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构，保持资产负债期限始终处于合理配比；另一方面，公司及时完善负债规划，通过调整到期融资集中度等手段，避免因融资渠道过于单一或债务集中到期的偿付风险，使负债结构和到期日分布更趋合理。

公司重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持畅通的融资渠道，如有需要，可通过资金拆借、债券回购、短期融资券、短期公司债、公司债、

次级债、收益凭证、资产证券化及其他符合法律及监管规定的方式进行融资，以解决资金需求。

报告期内，公司保持了充足的流动性资产储备，流动性覆盖率和净稳定资金率均符合监管标准及监管预警标准。

### 7. 声誉风险

声誉风险是指由于公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价，从而造成公司声誉损失的风险。声誉事件是指引发公司声誉风险的相关行为或事件。公司建立健全声誉风险管理体系，实现日常声誉风险管理和对声誉事件的妥善处置，是公司全面风险管理体系的有机组成部分。

公司制定了《中泰证券股份有限公司声誉风险管理办法》《中泰证券股份有限公司舆论引导及管理办法》《中泰证券股份有限公司突发事件维稳工作应急预案》，遵循预防第一、积极主动、全局利益、及时报告、全员参与原则，从风险监测、风险预警、风险识别、风险评估、风险报告和风险处置六个方面对声誉风险进行全方位和全过程管理。公司声誉风险归口管理部门企业文化部设立声誉风险管理岗，每日监测互联网、广播、报刊等各类媒体的舆情动态，做好声誉风险因素的搜集、整理、分析和舆情研判工作，并及时向部门负责人、合规风控管理人员报告日常舆情监测中发现的苗头性问题。对于可能导致公司声誉损失的报道，会同相关部门采取必要措施予以防范、处理，经评估后纳入公司风险日报。

### (三) 其他披露事项

√适用 □不适用

#### 1、公司分支机构受到人行行政处罚

2019年5月31日至8月30日，中国人民银行南宁中心支行反洗钱处对公司广西分公司执行反洗钱规定的情况进行了执法检查，并指出分公司存在未按规定开展客户风险等级管理工作的情况。2020年5月6日，公司广西分公司因部分自然人客户风险等级计分不准确、部分自然人客户未按照规定开展客户风险等级定期审核，中国人民银行南宁中心支行向广西分公司出具了《行政处罚决定书》，对分公司处以人民币20万元罚款，对分公司总经理谭轲处以人民币1.75万元罚款。针对前期检查发现的问题，公司督导广西分公司对检查发现的问题进行了逐一整改。广西分公司已于2019年10月9日就整改落实情况向人民银行南宁中心支行报送了专项整改报告。截至2019年12月31日，所涉事项均已整改完毕。公司已就相关整改落实情况及时上报山东证监局和人民银行济南分行，并按规定对广西分公司进行了绩效考核。

#### 2、营业网点变更情况

报告期内，公司新设1家证券分公司，完成了11家证券营业部的迁址并撤销1家证券营业部。报告期内，鲁证期货完成了5家期货营业部的迁址。

##### (1) 新设分公司

2020 年上半年，公司新设 1 家证券分公司，为浙江分公司，地址为浙江省杭州市江干区荣安大厦 2502B 室。

(2) 迁址营业部

序号	迁址前分支机构名称	迁址后分支机构名称	迁址后分支机构地址
1	栖霞霞光路证券营业部	栖霞霞光路证券营业部	山东省烟台市栖霞市庄园街道霞光路 218 号一楼北首及二、三楼
2	清远北江二路证券营业部	清远静福路证券营业部	广东省清远市新城静福路 27 号朝南国际商务中心首层商铺 20-21 号
3	东营永安路证券营业部	东营仙河神州路证券营业部	山东省东营市河口区仙河镇神州路 21 号 1-3、1-4
4	淄博中润大道证券营业部	淄博中润大道证券营业部	山东省淄博市高新区中润大道 39 号久宏大厦三层
5	济南民生大街证券营业部	济南泺源大街证券营业部	山东省济南市历下区泺源大街 5 号 1 层西侧
6	邹平黄山三路证券营业部	滨州邹平鹤伴一路证券营业部	山东省滨州市邹平市鹤伴一路 888 号（城南新区锦绣华城 5 号楼 105 铺）
7	哈尔滨中山路证券营业部	哈尔滨中山路证券营业部	哈尔滨市香坊区中山路 162-1 号
8	齐齐哈尔龙华路证券营业部	齐齐哈尔龙华路证券营业部	黑龙江省齐齐哈尔市铁锋区龙华路和平厂北校区 5 号楼 21 号（1-2 层）
9	云南分公司	云南分公司	云南省昆明市盘龙区人民东路香博商厦商业广场 1 栋 2 层
10	昆明拓东路证券营业部	昆明人民东路证券营业部	云南省昆明市盘龙区人民东路香博商厦商业广场 1 栋 1-2 层
11	苏州干将西路证券营业部	苏州苏雅路证券营业部	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区苏雅路 158 号 1 幢 202 室
鲁证期货迁址营业部信息如下：			
12	临沂营业部	临沂营业部	临沂市兰山区柳青街道沂蒙路与智圣路交汇 IFC 国际金融中心 602
13	北京营业部	北京营业部	北京市西城区新街口北大街 3 号 3 层 301-L304
14	德州营业部	德州营业部	山东省德州市德城区湖滨中大道 1186 号三楼
15	沈阳营业部	沈阳营业部	辽宁省沈阳市沈河区友好街 10 号东北世贸广场 I 区（新地中心 1 号楼）18 层（电梯楼层 21 层）02 单



			元
16	无锡营业部	无锡营业部	江苏省无锡市梁溪区清扬路 118 号-3002

## (3) 撤销营业部

2020 年上半年，公司撤销 1 家证券营业部，为东营仙河鄱阳湖路证券营业部，地址为山东省东营市仙河镇鄱阳湖路 1 号。

## 第五节 重要事项

### 一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期
2020 年第一次临时股东大会	2020 年 1 月 9 日	--	--
2020 年第二次临时股东大会	2020 年 3 月 5 日	--	--
2020 年第三次临时股东大会	2020 年 4 月 20 日	--	--
2019 年度股东大会	2020 年 5 月 20 日	--	--
2020 年第四次临时股东大会	2020 年 5 月 11 日	--	--

股东大会情况说明

适用 不适用

### 二、利润分配或资本公积金转增预案

#### (一) 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增	否
---------	---

### 三、承诺事项履行情况

#### (一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

适用 不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与首次公开	股份	莱钢	关于股	自 A 股	是	是	不适用	不 适

发行相关的承诺	限售	集团、矿集团、济集团、鲁集团、新集团、山东省国有资产投控有限公司	东持股期限的承诺	上市之日起36个月				用
	股份限售	山东省财资团有限公司	关于东持股期限的承诺	自A股上市之日起36个月	是	是	不适用	不适用
	股份限售	其余34家发起人东	关于东持股期限的承诺	自A股上市之日起12个月	是	是	不适用	不适用
	其他	控股股东、公司及体事、级理人	稳定股价预案	自A股上市后3年内	是	是	不适用	不适用
	其他	山钢集团、莱钢集团、济钢集团	避免同业竞争	长期有效	否	是	不适用	不适用
	其他	山钢集团、莱钢集团、济钢集团	规范关联交易	长期有效	否	是	不适用	不适用
	其他	莱钢	公司上	股票锁	是	是	不适用	不 适

		集团	市前持股 5% 以上股东的持股意向及减持意向	定期满后两年内				用
	其他	兖矿集团、济钢集团	公司上市前持股 5% 以上股东的持股意向及减持意向	股票锁定期满后两年内	是	是	不适用	不适用
	其他	公司全体董事、高级管理人员	对公司填补回报措施能够得到切实履行作出的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
	其他	控股股东、公司及体董事、高级管理人员	虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
	其他	公司及体董事、高级管理人员	关于信息披露与投资者教育的专项承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
	其他	公司及体董事、高级管理人员	关于承诺履行的约束措施	长期有效	否	是	不适用	不适用

**四、聘任、解聘会计师事务所情况**

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

公司对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

适用 不适用

公司对上年年度报告中的财务报告被注册会计师出具“非标准审计报告”的说明

适用 不适用**五、破产重整相关事项**适用 不适用**六、重大诉讼、仲裁事项**本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司未发生《上海证券交易所股票上市规则》中要求披露的涉案金额超过人民币 1,000 万元且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的重大诉讼、仲裁事项。

公司在 2020 年 4 月 28 日公开披露的《中泰证券股份有限公司首次公开发行股票招股说明书》（以下简称《招股说明书》）中已披露诉讼、仲裁进展情况如下：

## 1. 公司作为被告的重要诉讼或仲裁案件进展情况

金山实业有抵押优先贷款票据买卖纠纷案，该案已在 2020 年 4 月 28 日公开披露的《中泰证券股份有限公司首次公开发行股票招股说明书》中披露。由于金山实业提供的文件证据不充分，中泰金融投资于 2020 年 5 月 14 日存入《传票》，要求香港特别行政区高等法院命令金山实业追加提供文件证据，该《传票》尚在审理中。截至 2020 年 6 月 30 日，该案尚在审理中。

## 2. 公司及控股子公司作为原告（不含中泰资管）的重要诉讼或仲裁进展情况

序号	案件名称	原告/申请人	被告/被申请人	标的金额	判决结果	案件进展	备注
1	王某某、谭某某融资融券交易纠纷案	中泰证券	王某某、谭某某	4,787.42 万元	公司胜诉	执行完结	基本案情见 2020 年 4 月 28 日公开披露的《招股说明书》
2	“15 华信债”公司债券兑付纠纷案	中泰证券	上海华信国际集团有限公司	18,896.40 万元	公司胜诉	公司债权申报完毕并已确认，被申请人华信集团破产程序进行中	
3	聚信量化网络侵权责任纠纷案	中泰证券	北京聚信量化科技有限公司	1,514.17 万元	一审仅支持第 1 项诉讼请求，公司不服提起上诉，二	二审已结案，尚未申请执行	

					审改判支持公司关于被告返还资金、赔偿利息的诉讼请求。	
4	乌海洪远融资租赁合同纠纷案	宏润（上海）融资租赁有限公司	乌海洪远新能源科技有限公司（简称“乌海洪远”）、神雾科技集团股份有限公司、北京华福工程有限公司、吴某某	10,189.03 万元	法院同意了宏润（上海）融资租赁有限公司提出的保全申请并裁定同意追加乌海市富海资产管理有限公司为被执行人，富海公司目前就该判决上诉至浦东新区人民法院	尚未判决
5	林某某股票质押式回购纠纷案	中泰证券	林某某	13,679.83 万元	公司胜诉	仲裁结案，尚未申请执行，裁决书确认已收回部分本金
6	王某某股票质押式回购纠纷案	中泰证券	王某某	9,682.69 万元	公司撤回仲裁申请	仲裁结案，和解，款项已收回。
7	武某股票质押式回购纠纷案	中泰证券	武某	5,375.27 万元	公司撤回仲裁申请	仲裁结案，和解，款项已收回
8	北京光耀东方股票质押式回购纠纷案	中泰证券	北京光耀东方商业管理有限公司	9,101.89 万元	已裁决	仲裁结案，申请执行中
9	王某某股票质押式回购纠纷案	中泰证券	王某某	31,055.37 万元	公司胜诉	仲裁结案，尚未申请执行

《招股说明书》中已披露的李某股票质押式回购纠纷案、北京三才聚股票质押式回购纠纷案、大连承运股票质押式回购纠纷案、黄某某股票质押式回购纠纷案、上海力珩股票质押式回购纠纷案、田某某融资融券交易纠纷案、皇月国际项目贷款违约纠纷案、镇江兆和项目贷款违约纠纷案、高源投资有限公司抵押保证融资案、湖北久顺股权投资纠纷案、大民种业股权投资纠纷案、容大高科股权投资纠纷案、刘某股票质押式回购纠纷案、国购投资公司债券交易纠纷案尚未取得新的进展。

上述诉讼或仲裁是公司作为原告（不含中泰资管）为维护自身的利益而主动采取的措施，且公司已按照企业会计准则的要求对相关资产充分计提了减值准备，该等诉讼或仲裁事项不会对公司生产经营、财务状况造成重大不利影响。

### 3.公司控股子公司中泰资管代表资管计划提起的重要诉讼、仲裁进展情况

序号	案件名称	原告/申请人	被告/被申请人	标的金额	判决结果	案件进展	备注
----	------	--------	---------	------	------	------	----

1	安徽外经集团债券兑付纠纷案	中泰资管	安徽省外经建设(集团)有限公司	5,713.20 万元	中泰资管要求被告支付债券本金、利息等诉讼请求得到一审法院支持	被告提出上诉	基本案情见2020年4月28日公开披露的《招股说明书》
		中泰资管	安徽省外经建设(集团)有限公司	5,284.00 万元	中泰资管要求被告支付债券本金、利息等诉讼请求得到一审法院支持	被告提出上诉	
		中泰资管	安徽省外经建设(集团)有限公司	5,244.00 万元	中泰资管要求被告支付债券本金、利息等诉讼请求得到一审法院支持	被告提出上诉	

《招股说明书》中已披露的庄某股票质押式回购纠纷案、蒋某某股票质押式回购纠纷执行案、罗某股票质押式回购纠纷案、“17 沪华信 SCP003”超短期融资券兑付纠纷案、“16 申信 01”公司债券兑付纠纷案、“15 金鸿债”公司债券兑付纠纷案、“15 华阳经贸 MTN001”中期票据兑付纠纷案（涉案金额 1,052.40 万元的案件）、“17 华业资本 CP001 债券”短期融资券兑付纠纷案、“17 印纪娱乐 MTN001”中期票据兑付纠纷案、西王集团债券兑付纠纷案，因已取得生效裁判、法院裁定终结执行、法院裁定被告进入破产程序等使诉讼、仲裁程序结束，该等案件均系代表资管产品提起的处置程序，不会对报告期内公司的生产经营和财务状况产生重大不利影响。

《招股说明书》中已披露的“15 华阳经贸 MTN001”中期票据兑付纠纷案（涉案金额 8,419.21 万元的案件）、沈某某股票质押式回购纠纷案、“17 康得新 MTN001 债券”中期票据兑付纠纷案、安徽外经集团债券兑付纠纷案（涉案金额 1,058.00 万元的案件）、东旭光电债券兑付纠纷案尚未取得最新进展。

**报告期内，公司新增重要诉讼、仲裁情况主要如下：**

## 1.公司及其控股子公司作为原告（不含中泰资管）的重要诉讼或仲裁情况如下：

序号	案件名称	原告/申请人	被告/被申请人	标的金额	基本案情	主要诉讼请求	判决结果	案件进展
1	公司诉华泰汽车、张某某债券交易纠纷案	中泰证券	华泰汽车集团有限公司、张某某	1,790 万元	公司购买华泰汽车的债券，张某某对该债券提供个人无限连带责任担保。因华泰汽车债券交易纠纷涉多起诉讼，表明华泰汽车丧失偿债能力，将不履行或不能履行兑付本息的义务，构成预期违约，张某某作为保证人应当承担连带清偿责任。	1、华泰汽车支付本金；2、华泰汽车支付利息损失；3、张某某对华泰汽车的上述债务承担连带清偿责任。	已立案，尚未开庭	一审中
2	北京裕源大通科技股份有限公司保理违约纠纷案	宏润（上海）融资租赁有限公司	北京裕源大通科技股份有限公司；北京合信沃德电子科技有限公司；孙玉静；北京汉铭信通科技公司	4,830.75 万元	宏润（上海）融资租赁有限公司向被告提供保理服务，裕源大通未能按保理合同规定按期全额偿还融资保理款，上海宏润提起诉讼。	判令被告支付保理回购价款、逾期违约金、律师费、保全保险费、诉讼费；原告对被告出质给原告的北京裕源大通科技股份有限公司股份行使质权；担保人对北京裕源大通科技股份有限公司的债务承担连带清偿责任。	尚未开庭	尚未开庭
3	上海良玉科技发展股份有限公司保理违约纠纷案	宏润（上海）融资租赁有限公司	上海良玉科技发展股份有限公司、钟韶华、严佳、严祥德、王宏莲、严磊	1,710.18 万元	宏润（上海）融资租赁有限公司向被告提供保理服务，良玉科技未能按保理合同规定按期全额偿还融资保理款，上海宏润提起诉讼	判令被告支付回购款、逾期违约金、律师费等；判令原告有权依法处置被告抵押给原告房产；判令被告对被告上海良玉科技发展股份有限公司的债务承担连带清偿责任。	双方达成调解方案，后因对方未能按照调解书约定支付款项，上海宏润请求法院按民事调解书裁定执行房	正在执行中

		公 司					产	
--	--	--------	--	--	--	--	---	--

上述诉讼是公司作为原告（不含中泰资管）为维护自身的利益而主动采取的措施，且公司已按照企业会计准则的要求对相关资产充分计提了减值准备，该等诉讼或仲裁事项不会对公司生产经营、财务状况造成重大不利影响。

2.公司控股子公司中泰资管代表资管计划提起的诉讼、仲裁情况

序号	案件名称	原告 / 申请人	被告/ 被申请人	标的金额	基本案情	主要诉讼请求	判决结果	案件进展	备注
1	东旭集团债券兑付纠纷案	中泰资管	东旭集团有限公司	2,038.10 万元	中泰资管管理的产品持有“17 东旭 01”公司债券。2020 年 3 月 9 日，被申请人发布《东旭集团有限公司公开发行的 2017 年公司债券（品种一）2020 年付息及回售风险提示性公告》，确认不能按期兑付申请人选择回售的债券本金以及到期利息。截至 2020 年 6 月 30 日，被申请人仍未履行其兑付义务。	被告向中泰资管偿付本金、利息、违约金	尚未裁决	已受理	中泰资管未持有相关资产管理计划份额。该案不会对报告期内公司的生产经营和财务状况产生重大不利影响。

七、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况

适用 不适用

八、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

九、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

(一) 相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

(二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用



员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

## 十、重大关联交易

### (一) 与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

### (二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

### (三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

**(四) 关联债权债务往来**

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

**(五) 其他重大关联交易**

适用 不适用

**(六) 其他**

适用 不适用

**十一、 重大合同及其履行情况**

1 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

2 担保情况

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）													
担保方	担保方与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期（协议签署日）	担保起始日	担保到期日	担保类型	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	是否存在反担保	是否为关联方担保	关联关系
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）						0							
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）						0							
公司对子公司的担保情况													
报告期内对子公司担保发生额合计						20.41							
报告期末对子公司担保余额合计（B）						66.09							
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）													
担保总额（A+B）						66.09							
担保总额占公司净资产的比例（%）						19.89							
其中：													

为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额 (C)	0
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额 (D)	43.34
担保总额超过净资产50%部分的金额 (E)	0
上述三项担保金额合计 (C+D+E)	43.34
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	
担保情况说明	<p>1、公司对子公司的担保</p> <p>2016年8月16日,经公司第一届董事会第二十次会议审议,同意公司向控股子公司中泰证券(上海)资产管理有限公司增加10亿元的净资本担保,净资本担保规模由原来的不超过5.5亿元,增至不超过15.5亿元。截至2020年6月30日,公司为中泰证券(上海)资产管理有限公司提供净资本担保余额为8.5亿元。2019年2月18日,经公司2019年第二次临时股东大会审议,同意公司通过内保外贷业务为中泰金融国际有限公司融资,融资规模调整至不超过人民币10亿元。截至2020年6月30日,公司通过内保外贷方式协助中泰国际境外融资9.45亿元人民币。</p> <p>2、子公司的担保</p> <p>报告期内,中泰国际及子公司存在担保事项,相关担保为对其下属子公司以及下属子公司对其母公司提供,均为满足业务开展而进行的,主要为:融资担保以及与交易对手方签署国际衍生品框架协议(ISDA协议)、全球总回购协议(GMRA协议)等。截至2020年6月30日,上述担保金额约合人民币48.14亿元。</p>

### 3 其他重大合同

适用 不适用

## 十二、上市公司扶贫工作情况

适用 不适用

### 1. 精准扶贫规划

适用 不适用

多年来,公司始终把兼济天下、回馈社会作为义不容辞的社会责任。尤其2016年以来,中泰证券坚持以习近平总书记扶贫开发重要战略思想为指导,认真贯彻落实党中央、国务院决策部署和中国证监会、中国证券业协会要求,积极履行社会责任,努力投身国家脱贫攻坚战。为更好地汇集公司资源和各方面力量,更好地履行扶危济困、扶弱济贫的社会责任,公司于2016年筹建设立了山东中泰慈善基金会(以下简称基金会),创建了公司公益事业集中统一平台,在助力公司积极主动履行社会责任、打赢脱贫攻坚战方面发挥了重要作用。2017年12月,公司制定了《中

泰证券股份有限公司精准扶贫攻坚方案（2018-2020）》，提出了对贫困地区的十大帮扶举措和阶段实施计划，进一步明晰各单位工作职责、工作内容，做好经费支持，健全制度保障，强化责任意识，为公司精准扶贫工作提供了指引和制度保障。

公司始终保持昂扬斗志决战脱贫攻坚，以高度的责任感、使命感和紧迫感，充分发挥自身人才优势、智力优势、资源优势 and 资本优势，着力推动金融扶贫和产业扶贫紧密衔接，以贫困地区实体经济需求为导向，通过积极实施“七个一”工程，打好“金融扶贫、产业扶贫、智力扶贫、消费扶贫、慈善扶贫”组合拳，逐步构建由单点到系统的扶贫工作长效机制，努力实现为企业输血、产业造血、扶教启智、消费支持、慈善互助的扶贫目标，为实现全面脱贫全面建成小康社会贡献自身力量。同时，围绕乡村振兴战略，强化基础设施和公共服务支撑，以只争朝夕的精神全力以赴做好精准扶贫和乡村振兴的有机衔接工作。

## 2. 报告期内精准扶贫概要

√适用 □不适用

截至 2020 年 6 月 30 日，公司与新疆喀什疏勒县、宁夏原州区等 12 个国家级贫困县区签订结对帮扶协议，与宁夏瑞春杂粮、江西铁木真装饰等 10 余个贫困县企业签订财务顾问协议。公司积极与帮扶县、帮扶企业沟通，对接帮扶需求、深入探讨扶贫攻坚和成果巩固措施。

公司充分发挥在股权融资、债券融资、并购重组、新三板挂牌等方面的专业优势，积极协助贫困地区企业通过资本市场融资，2020 年上半年，为栾川县企业融资 4 亿元；积极开展资本市场相关培训，根据企业需求提供咨询顾问服务，为政府和企业提供智力支持。

公司围绕产业扶贫，增强发展“内生动力”，基金会出资 100 万元用于赫章中泰葡萄产业园项目；同时推动原有产业项目进度。

公司积极开展“志智双扶 技能雏鹰奖学金”项目，基金会出资 100 万元，帮扶 500 名品学兼优的贫困学子完成学业，提升贫困人口脱贫战斗力。

公司积极响应国家号召，开展消费扶贫，完成云南省勐海县、安徽省舒城县等地农副产品采购。与安徽兰花茶业打造双方共赢、可持续发展的品牌战略合作伙伴关系，出资 100 万元用于兰花茶业产品外包装设计及印制、在舒城茶园树立“中泰证券消费扶贫基地”等。

公司支持基础设施建设，加快脱贫攻坚步伐，基金会出资 13 万元帮扶石阡县坪山乡大坪村烂田组打杵岩河人行桥项目，切实解决群众实际困难，降低生产、生活难度。

2020 年上半年，公司控股子公司鲁证期货向国家级重点贫困县湖北省红安县、英山县、罗田县捐款共计 30 万元，专项用于以上三县的新型冠状病毒肺炎疫情防控和救治。同时，鲁证期货与

以上三县分别签署结对帮扶协议，在实施慈善扶贫、专业扶贫、消费扶贫等领域开展合作，全方位支持当地脱贫攻坚，推动当地经济社会健康发展。

### 3. 精准扶贫成效

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

指 标	数量及开展情况
一、总体情况	
其中：1.资金	343
2.物资折款	/
3.帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	/
二、分项投入	
1.产业发展脱贫	
其中：1.1 产业扶贫项目类型	√ 农林产业扶贫 □ 旅游扶贫 □ 电商扶贫 □ 资产收益扶贫 □ 科技扶贫 □ 其他
1.2 产业扶贫项目个数（个）	1
1.3 产业扶贫项目投入金额	100
1.4 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	/
4.教育脱贫	
其中：4.1 资助贫困学生投入金额	100
4.2 资助贫困学生人数（人）	500
4.3 改善贫困地区教育资源投入金额	/
7.兜底保障	
其中：7.1 帮助“三留守”人员投入金额	/
7.2 帮助“三留守”人员数（人）	/
7.3 帮助贫困残疾人投入金额	/
7.4 帮助贫困残疾人数（人）	1
9.其他项目	
其中：9.1.项目个数（个）	3
9.2.投入金额	143
9.3.帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人）	/
9.4.其他项目说明	安徽省舒城兰花茶业战略合作项目 100 万元；贵州省石阡县坪山乡大坪村烂田组打杵岩河人行桥建设 13 万元；向国家级重点贫困县湖北省红安县、英山县、罗田县捐款 30 万元用于新型冠状病毒肺炎疫情疫情防控和救治。

#### 4. 履行精准扶贫社会责任的阶段性进展情况

√适用 □不适用

2020年上半年，公司多维度、多举措推进脱贫攻坚工作，结对帮扶的原州区、疏勒县、平塘县、柞水县、修水县、临泉县6个县区陆续脱贫摘帽。

##### (1) 金融扶贫方面

2020年上半年，公司依托网点布局优势，克服疫情影响，通过多种方式为帮扶政府和企业提供及时、专业、有针对性的金融服务。成功发行“2020年栾川县天业投资有限公司公司债券（第一期）（品种二）”，募集资金4亿元，发行期限为7年期，主体评级为AA，债项评级为AAA，票面利率6.50%。栾川县连续多年被评为国家级贫困县，是国家及地方政府扶贫攻坚的主战场，本期债券募集资金主要用于当地棚户区改造项目建设，有利于改善贫困居民的生活和工作条件。继续推动贵州红星、平塘三天旅游公司、修水县投资集团、贵州恒力源集团等企业的融资工作；继续向江西铁木真、贵州创奇环保等企业提供关于股权调整、财务梳理及股份制改造咨询服务；配合地方政府做好政企对接，做好企业宣讲，普及新三板新政策和资本市场基础知识等。

##### (2) 产业扶贫方面

①赫章中泰葡萄产业园项目。赫章县是52个挂牌督战贫困县之一。2020年4月，公司出资100万元在赫章县六曲河镇援建中泰葡萄产业园项目。6月9日，举办产业园揭牌仪式。该产业园以自然环境为依托，以传统风俗为内容，积极吸纳当地居民用工，有效推动周边村落开展民俗表演、地方特色饮食、民宿等乡村旅游项目，预期可以推动产业发展、生态保护与建设、文化传承与发展等县域脱贫攻坚工作，同时呼应了国家乡村振兴战略规划的定位和要求。

②宿松丑橘栽培示范基地项目。2020年4月，公司出资帮扶的趾凤乡龙溪村建设210亩丑橘栽培示范基地项目正式启动，吸纳贫困户固定务工30人、季节性务工120人，辐射带动农户和村集体增收。

##### (3) 用技能扶贫提升贫困人口脱贫战斗力

2020年上半年，公司开展“志智双扶 技能雏鹰奖学金”（二期）项目，面向龙里县、临泉县、舒城县、修水县、赫章县5个国家级贫困县的职业技能培训学校、技工学校设立奖学金，按照2000元/人定向帮扶500名符合条件的品学兼优的贫困学子，以期取得“培训一人、脱贫一户”的帮扶效果。6月9日，第二期雏鹰技能奖学金捐赠仪式在赫章中等职业学校举行，150名建档立卡贫困家庭优秀学子参加。

##### (4) 以消费扶贫为手段促进产业发展

公司把消费扶贫作为结对帮扶工作的重要抓手、作为产业扶贫的市场牵引。2020年上半年，

公司从国家级贫困县云南省勐海县、安徽省舒城县、宁夏固原原州区总计采购价值 748.72 万元的农副产品。

公司扶持安徽兰花茶业至今，万佛山牌舒城小兰花品牌影响力逐步增强，被评为安徽著名商标、安徽老字号，中国百强品牌企业。2020 年，公司与安徽兰花茶业签署《品牌战略合作框架协议》，缔结战略合作关系，打造双方共赢、可持续发展的品牌战略合作伙伴关系。公司出资 100 万元，用于兰花茶业产品外包装设计及印制、在舒城茶园树立“中泰证券消费扶贫基地”标识牌等费用。

2020 年上半年，公司控股子公司鲁证期货购买新疆麦盖提县、黑龙江省桦川县扶贫产品 40.4 万元；鲁证期货大连营业部购买贫困地区产品 1.0054 万元。鲁证期货帮助贫困地区内蒙古通辽市开鲁县众诚粮食购销有限责任公司销售玉米 1,500 吨，销售金额共计 202.77 万元。

#### （5）专业扶贫方面

鲁证期货在黑龙江省桦川县玉米“保险+期货”县域全覆盖项目顺利赔付，项目实现赔付金额 8,787.31 万元，赔付率高达 376%。项目覆盖全县玉米种植面积 32.75 万亩，折合现货量 18.34 万吨，为 2,555 户玉米种植农户提供了 952 元/亩的收入保障，实现了县域范围内“愿保尽保”。试点项目总保费 2,338.13 万元（大商所支持 70%、桦川县政府及农户共同承担 30%），保险保障金额达 3.12 亿元。该项目是鲁证期货继 2018 年在桦川县实施“保险+期货+基差贸易”县域全覆盖试点以来，在该县首次开展的县域范围玉米收入险试点，项目产生的良好效果切实帮助桦川县实现了真脱贫、不返贫，体现了“保险+期货”助力贫困地区夯实脱贫成果的有效性。

#### （6）支持基础设施建设加快脱贫攻坚步伐

2020 年 5 月，公司与新华社驻贵州省石阡县扶贫工作队携手帮扶石阡县坪山乡大坪村烂田组打杵岩河人行桥项目。该县大坪村烂田组打杵岩河，河宽 26 米，河对面涉及烂田组耕地面积达 130 亩，日常需要蹚水过河，雨季无法通行，严重影响村民农业生产及茶园、果树管理。经勘察，规划出资 13 万元在该地建造一座长 26 米、宽 1.8 的人行桥，切实解决群众实际困难，降低生产、生活难度，助力脱贫攻坚。该项工作正在有序推进中。

#### （7）主动谋划衔接乡村振兴工作

继续推进山东省临沂市城南村乡村振兴暨新时代文明实践站项目。2020 年上半年陆续完成城南村新时代文明实践站全面提升改造，突出新时代文明实践站功能，成立 30 人的志愿者服务队伍，完成文明实践站大讲堂、青年之家、妇女之家、农科驿站、农家书屋、学雷锋志愿服务站、电商平台、党建活动室、爱心超市、明德学堂等建设，做到政策制度上墙、室内宣传主题到位；完成

中泰证券特色产业园建设，形象牌、宣传栏搭建到位，2个早熟蒜薹试验大棚的早熟蒜薹已种植成功并上市，给村集体创收3.2万元。

(8) 充分做好脱贫攻坚舆论宣传

2020年是脱贫攻坚工作的收官之年。公司积极总结归纳帮扶成果，营造良好的脱贫攻坚舆论氛围。按照山东省国资委要求完成省属企业脱贫攻坚亮点宣传报道，完成《山东脱贫攻坚年鉴（2019）》文稿等。与发现之旅 筑梦新时代栏目组合作，参与“决胜脱贫攻坚 我们在行动”系列专题报道，通过电视语言多角度、全方位、深层次展示和讲述公司在决胜决战脱贫攻坚工作中的行动与担当。

## 5. 后续精准扶贫计划

适用 不适用

(1) 公司将继续按照党和国家要求，在中国证监会、中国证券业协会“一司一县”和“一县一企”帮扶倡议的指导下，结合《中泰证券精准扶贫攻坚方案》，积极实施“七个一”精准扶贫工程，继续在金融扶贫、产业扶贫、技能扶贫、消费扶贫等方面发力，高标准高质量助力帮扶对象完成脱贫攻坚任务。

(2) 坚决贯彻落实摘帽不摘政策、摘帽不摘帮扶、摘帽不摘责任、摘帽不摘监管的要求，继续加强已摘帽帮扶县的帮扶力度，继续挖掘贫困地区金融扶贫项目，继续不遗余力地推进产业扶贫的落地落实，巩固脱贫成果，切实帮助结对县提升脱贫成效。

(3) 积极主动做好脱贫攻坚工作和乡村振兴工作的有机衔接，做好公司内部政策衔接，形成长效机制，长期注重解决相对贫困问题与乡村振兴齐推进。结合各地实际，尤其是现有经济条件和产业基础，发展有特色、可持续的产业，注重增强扶贫产业的可持续性；构建现代农业产业体系，注重把非贫困人口纳入产业体系，探索走出一条现代农业产业发展新路。

(4) 加大宣传力度，营造舆论氛围。认真总结扶贫事业中的典型经验，生动报道公司在脱贫攻坚工作中的丰富实践和先进典型，表彰作出突出贡献的部门和个人，在公司内外营造良好的慈善氛围。

## 十三、 可转换公司债券情况

适用 不适用



**十四、 环境信息情况****(一) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其重要子公司的环保情况说明**

□适用 √不适用

**(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明**

□适用 √不适用

**(三) 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明**

□适用 √不适用

**(四) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明**

□适用 √不适用

**十五、 其他重大事项的说明****(一) 与上一会计期间相比，会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况、原因及其影响**

√适用 □不适用

本集团自 2020 年 1 月 1 日起首次执行财政部于 2017 年修订并发布的《企业会计准则第 14 号—收入》（以下简称“新收入准则”）。新收入准则要求首次执行该准则的累积影响数调整首次执行当年初（即 2020 年 1 月 1 日）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。新收入准则的采用对本集团 2020 年 1 月 1 日的财务报表未产生重大影响。

具体参见“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 44、重要会计政策和会计估计的变更”。

**(二) 报告期内发生重大会计差错更正需追溯重述的情况、更正金额、原因及其影响**

□适用 √不适用

**(三) 其他**

□适用 √不适用

**第六节 普通股股份变动及股东情况****一、股本变动情况****(一) 股份变动情况表****1、 股份变动情况表**

单位：股

	本次变动前		本次变动增减（+，-）					本次变动后	
	数量	比例（%）	发行新股	送股	公积	其他	小计	数量	比例（%）

					金 转 股				
一、有限 售条件股 份	6,271,763,180	100						6,271,763,180	90
1、国家持 股						17,214,400	17,214,400	17,214,400	0.25
2、国有法 人持股	4,844,650,630	77.25						4,844,650,630	69.52
3、其他内 资持股	1,427,112,550	22.75				-17,214,400	-17,214,400	1,409,898,150	20.23
其中：境 内非国有 法人持股	1,427,112,550	22.75				-17,214,400	-17,214,400	1,409,898,150	20.23
境内自然 人持股									
4、外资持 股									
其中：境 外法人持 股									
境外自然 人持股									
二、无限 售条件流 通股份			696,862,576				696,862,576	696,862,576	10
1、人民币 普通股			696,862,576				696,862,576	696,862,576	10
2、境内上 市的外资 股									
3、境外上 市的外资 股									
4、其他									
三、股份 总数	6,271,763,180	100	696,862,576				696,862,576	6,968,625,756	100

## 2、股份变动情况说明

√适用 □不适用

经中国证监会证监许可[2020]736 号文核准，公司于 2020 年 5 月 20 日公开发行 69,686,2576

万股人民币普通股新股，全部为无限售条件流通股。公司发行的人民币普通股于 2020 年 6 月 3 日起正式在上海证券交易所上市交易。公司总股本由 627,176.318 万股增至 696,862.5756 万股。

2020 年 6 月 3 日，德州市德信资产管理有限公司所持公司 1,721.44 万股有限售条件股份被司法机关以非交易过户方式过户至德州市财政局。

### 3、报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）

适用 不适用

### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

## (二) 限售股份变动情况

适用 不适用

### 二、股东情况

#### (一) 股东总数:

截止报告期末普通股股东总数(户)	213,075
截止报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0

#### (二) 截止报告期末前十名股东、前十名流通股股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内 增减	期末持股数 量	比例 (%)	持有有限售 条件股份数 量	质押或冻结情况		股东 性质
					股 份 状 态	数 量	
莱芜钢铁集团有限 公司	0	2,879,559,900	41.32	2,879,559,900	无		国有法人
兖矿集团有限公司	0	458,091,900	6.57	458,091,900	无		国有法人
济钢集团有限公司	0	351,729,000	5.05	351,729,000	无		国有法人
山东省鲁信投资控 股集团有限公司	0	277,566,330	3.98	277,566,330	无		国有法人
新汶矿业集团有限 责任公司	0	241,737,300	3.47	241,737,300	无		国有法人
济南西城投资发展 有限公司	0	241,737,300	3.47	241,737,300	无		国有法人
山东永通实业有限 公司	0	203,366,300	2.92	203,366,300	质 押	134,400,000	境内非国有 法人

上海禹佐投资管理 中心（有限合伙）	0	183,415,900	2.63	183,415,900	质 押	119,600,000	境内非国有 法人
宁波美舜投资管理 中心（有限合伙）	0	152,523,400	2.19	152,523,400	无		境内非国有 法人
上海弘康实业投资 有限公司	0	122,021,900	1.75	122,021,900	无		境内非国有 法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
杨成	3,200,087	人民币普 通股	3,200,087				
赵伟	3,200,000	人民币普 通股	3,200,000				
深圳青亚商业保理有限公 司	2,805,200	人民币普 通股	2,805,200				
中国工商银行股份有限公 司—申万菱信中证申万证 券行业指数分级证券投资 基金	2,039,104	人民币普 通股	2,039,104				
陈留杭	1,410,900	人民币普 通股	1,410,900				
庄强	1,334,000	人民币普 通股	1,334,000				
黄玮	1,257,800	人民币普 通股	1,257,800				
福建晋江红昌资产管理有 限公司—红昌海丝1号私 募证券投资基金	1,251,896	人民币普 通股	1,251,896				
广东英蓝资产管理有限公 司—英蓝精英1号私募证 券投资基金	1,210,000	人民币普 通股	1,210,000				
钟优汉	1,202,600	人民币普 通股	1,202,600				

上述股东关联关系或一致行动的说明	截至报告期末，莱芜钢铁集团有限公司是山东钢铁集团有限公司的控股子公司，持有本公司 41.32% 的股份；济钢集团有限公司是山东钢铁集团有限公司全资子公司，持有本公司 5.05% 的股份。山东永通实业有限公司持有本公司 2.92% 的股份，本公司董事刘锋及其配偶林旭燕通过其控制的永锋集团有限公司间接控股山东永通实业有限公司；上海禹佐投资管理中心（有限合伙）持有本公司 2.63% 的股份，本公司董事刘锋为其有限合伙人，刘锋及其配偶林旭燕分别间接和直接持有其普通合伙人山东诚业发展有限公司的股权，刘锋及其配偶林旭燕可对上海禹佐投资管理中心（有限合伙）施加重大影响。除前述情况外，公司未发现上述其他股东之间存在包括持股和任职在内的关联关系或《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形。
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用

## 前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

√ 适用 □ 不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	莱芜钢铁集团有限公司	2,879,559,900	2023年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定36个月
2	兖矿集团有限公司	458,091,900	2023年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定36个月
3	济钢集团有限公司	351,729,000	2023年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定36个月
4	山东省鲁信投资控股集团有限公司	277,566,330	2023年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定36个月
5	新汶矿业集团有限责任公司	241,737,300	2023年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定36个月
6	济南西城投资发展有限公司	241,737,300	2021年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定12个月
7	山东永通实业有限公司	203,366,300	2021年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定12个月

8	上海禹佐投资管理中心（有限合伙）	183,415,900	2021年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定12个月
9	宁波美舜投资管理中心（有限合伙）	152,523,400	2021年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定12个月
10	上海弘康实业投资有限公司	122,021,900	2021年6月3日	0	自公司股票上市之日起锁定12个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		截至报告期末，莱芜钢铁集团有限公司是山东钢铁集团有限公司的控股子公司，持有本公司41.32%的股份；济钢集团有限公司是山东钢铁集团有限公司全资子公司，持有本公司5.05%的股份。山东永通实业有限公司持有本公司2.92%的股份，本公司董事刘锋及其配偶林旭燕通过其控制的永锋集团有限公司间接控股山东永通实业有限公司；上海禹佐投资管理中心（有限合伙）持有本公司2.63%的股份，本公司董事刘锋为其有限合伙人，刘锋及其配偶林旭燕分别间接和直接持有其普通合伙人山东诚业发展有限公司的股权，刘锋及其配偶林旭燕可对上海禹佐投资管理中心（有限合伙）施加重大影响。除前述情况外，公司未发现上述其他股东之间存在包括持股和任职在内的关联关系或《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形。			

**(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前10名股东**

□适用 √不适用

**三、控股股东或实际控制人变更情况**

□适用 √不适用

**第七节 优先股相关情况**

□适用 √不适用

**第八节 董事、监事、高级管理人员情况****一、持股变动情况****(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况**

□适用 √不适用

**(二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况**

□适用 √不适用

**二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况**

√适用 □不适用

姓名	担任的职务	变动情形
徐亮天	董事	离任
曹孟博	董事	选举

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

适用 不适用

2019年12月25日，公司第二届董事会收到徐亮天先生的辞职报告，徐亮天先生因工作变动原因，申请辞去董事职务。自2019年12月25日起，徐亮天先生不再担任公司董事。2019年12月25日，公司召开第二届董事会第十八次会议，同意曹孟博先生为公司第二届董事会非职工董事候选人，并提请公司股东大会进行选举。2020年1月9日，公司2020年第一次临时股东大会审议通过了《关于选举公司第二届董事会成员的议案》，选举曹孟博先生为公司第二届董事会非职工董事。

### 三、其他说明

适用 不适用

## 第九节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、 公司债券基本情况

单位:亿元 币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率(%)	还本付息方式	交易场所
齐鲁证券有限公司2015年公司债券	15 齐鲁债	122450	2015-8-28	2020-8-28	24.59	4.50	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司公开发行2018年公司债券(第一期)	18 中泰 01	155089	2018-12-12	2021-12-12	30.00	3.95	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司公开发行2019年公司债券(第一期)	19 中泰 01	155433	2019-8-8	2022-8-8	9.00	3.57	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司公开发行2019年公司债券(第二期)	19 中泰 02	163053	2019-12-9	2022-12-9	20.00	3.56	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司公开发行2020年公司债券(第一期)(疫	20 中泰 01	163626	2020-6-19	2023-6-19	15.00	3.27	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	上海证券交易所



情防控 债)							本金的兑付 一起支付	
-----------	--	--	--	--	--	--	---------------	--

## 公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

截至本报告出具日，“15 齐鲁债”、“18 中泰 01”、“19 中泰 01”均按时、足额兑付利息。“19 中泰 02”、“20 中泰 01”尚未到第一个付息日。

2014 年齐鲁证券有限公司债券于 2020 年 1 月 29 日到期，公司按时足额兑付剩余全部本金（人民币 8.58 亿元）及本年度利息。

## 公司债券其他情况的说明

√适用 □不适用

## (一) 非公开发行公司债券

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
中泰证券股份有限公司非公开发行 2017 年公司债券（第一期）	17 中泰 F1	145777	2017-9-13	2020-9-13	30.00	5.00	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券（第一期）	18 中泰 F1	150126	2018-2-6	2021-2-6	20.00	5.80	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券（第二期）	18 中泰 F2	150344	2018-4-26	2021-4-26	20.00	5.10	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	上海证券交易所
中泰证券股份有限公司非公	20 中泰 F1	166236	2020-3-17	2022-3-17	16.00	3.08	采用单利按年计息，不	上海证

开发行 2020年公 司债券 (第一期)							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	券交 易所
-------------------------------	--	--	--	--	--	--	---	----------

## (二) 次级债券

单位:亿元 币种:人民币

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券 余额	利率 (%)	还本付息 方式	交易 场所
中泰证 券股 份有 限公 司非 公开 发行 2019 年次 级债 券(第 一期)	19中泰C1	151130	2019-1-24	2022-1-24	20.00	4.14	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	上海 证券 交易 所
中泰证 券股 份有 限公 司非 公开 发行 2019 年次 级债 券(第 二期)	19中泰C2	151229	2019-3-11	2022-3-11	20.00	4.30	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	上海 证券 交易 所
中泰证 券股 份有 限公 司非 公开 发行 2019 年次 级债 券(第 三期)	19中泰C3	151594	2019-5-28	2022-5-28	40.00	4.30	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	上海 证券 交易 所

## (三) 境外债券

单位:亿元 币种:美元

债券名称	简称	代码	发行日	到期日	债券 余额	利 率 (%)	还 本 付 息 方 式	交 易 场 所
中泰国际 [w1] *		XS166 849535	2017/8/25	2020/8/24	3.00	4.25	半年付	香

(*正式名称为 ZTSECB 41/4 08/24/20 or Zhongtai International Bond 2017 (BVI) Company Limited 300,000,000 美元 4.25% 担保债券 于 2020 到期)		8					息, 到期还本	港交易所
中泰国际发行 2020 年 9 月 10 日到期 票面利率为 5.90% 的私募债			2020/3/10	2020/9/10	0.07	5.90	到期还本付息	香港交易所
中泰国际发行 2020 年 9 月 17 日到期 票面利率为 5.80% 的私募债			2020/3/17	2020/9/17	0.20	5.80	到期还本付息	香港交易所
中泰国际发行 2020 年 9 月 18 日到期 票面利率为 6.00% 的私募债			2020/3/18	2020/9/18	0.50	6.00	到期还本付息	香港交易所

截至本报告出具日,“17 中泰 F1”、“18 中泰 F1”、“18 中泰 F2”、“19 中泰 C1”、“19 中泰 C2”、“19 中泰 C3”以及中泰金融国际有限公司发行的代码为 XS1668495358 的美元债均按时、足额兑付利息。“20 中泰 F1”尚未到第一个付息日。另中泰金融国际有限公司发行的三期私募债尚未到兑付日。

## 二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

债券受托管理人 (15 齐鲁债、17 中泰 F1、18 中泰 F1、18 中泰 F2、19 中泰 C1、19 中泰 C2、19 中泰 C3)	名称	中信建投证券股份有限公司
	办公地址	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
	联系人	魏晓辉、李一睿
	联系电话	010-65608490、021-68801551
债券受托管理人 (18 中泰 01、19 中泰 01、19 中泰 02)	名称	渤海证券股份有限公司
	办公地址	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
	联系人	魏利军
	联系电话	022-23861685
债券受托管理人 (20 中泰 F1、20 中泰 01)	名称	国信证券股份有限公司
	办公地址	广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦
	联系人	郭睿
	联系电话	010-88005006

资信评级机构 (15 齐鲁债、18 中泰 01、19 中泰 01、19 中泰 02)	名称	中诚信证券评估有限公司
	办公地址	上海市黄浦区西藏南路 760 号安基大厦 24 楼
资信评级机构 (20 中泰 01)	名称	中诚信国际信用评级有限责任公司
	办公地址	北京市东城区朝阳门内大街南竹杆胡同 2 号银河 SOHO6 楼
债券受托管理人 (代码 XS1668495358 境外美元债)	名称	纽约梅隆银行
	办公地址	香港皇后大道东一号太古广场第三座二十四楼
	联系人	陈立行
	联系电话	(852) 2840 6636

其他说明：

适用 不适用

### 三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

#### (一) 15 齐鲁债

上述债券募集资金账户已于发行前设立，募集资金账户运作规范。截至 2020 年 6 月 30 日，募集资金已按募集说明书约定的用途使用完毕，全部用于补充公司营运资金，以满足开展融资融券等创新业务、投资固定收益类产品以及公司日常资金需求。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### (二) 17 中泰 F1、18 中泰 F1、18 中泰 F2

上述债券募集资金账户已于发行前设立，募集资金账户运作规范。截至 2020 年 6 月 30 日，募集资金已按募集说明书约定的用途使用完毕，全部用于补充公司营运资金，以满足开展融资融券、股票质押回购等业务、投资固定收益类产品以及公司日常资金需求。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### (三) 18 中泰 01、19 中泰 01、19 中泰 02

上述债券募集资金账户已于发行前设立，募集资金账户运作规范。截至 2020 年 6 月 30 日，“18 中泰 01”、“19 中泰 01”募集资金已按募集说明书约定的用途使用完毕，全部用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要；或用于调整公司负债结构和改善财务结构。公司将根据未来证券市场走势和公司的业务发展规划灵活、审慎地运用资金，积极拓展创新业务，根据实际业务需要灵活使用资金，主要用途包括但不限于支持业务拓展，优化收入结构和优化公司的负债结构，进一步增强公司的盈利能力和市场竞争力，19 中泰 02 募集资金尚未使用完毕。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### (四) 19 中泰 C1、19 中泰 C2、19 中泰 C3

上述债券募集资金账户已于发行前设立，募集资金账户运作规范。截至 2020 年 6 月 30 日，募集资金已按募集说明书约定的用途使用完毕，全部用于偿还到期、赎回或回售的债务融资工具，拟偿还的债务融资工具包括但不限于收益凭证、转融通、同业拆借、公司债券、债券回购等，且

公司已按照《证券公司次级债管理规定》（中国证监会公告[2017]16号）规定的比例将本期次级债券计入公司净资本。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

（五）20 中泰 F1

上述债券募集资金账户已于发行前设立，募集资金账户运作规范。截至 2020 年 6 月 30 日，募集资金尚未使用完毕，已使用募集资金已按照募集说明书中约定的用途用于偿还到期收益凭证和拆借资金。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

（六）20 中泰 01

上述债券募集资金账户已于发行前设立，募集资金账户运作规范。截至 2020 年 6 月 30 日，募集资金尚未使用完毕，已使用募集资金已按照募集说明书中约定的用途用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，用于支持疫情防控相关业务；或用于调整公司负债结构和改善财务结构。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

（七）境外债券

截至 2020 年 6 月 30 日，上述债券募集资金已使用完毕，募集资金已按照募集说明书约定的用途使用。募集资金使用与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

#### 四、公司债券评级情况

√适用 □不适用

中诚信国际信用评级有限责任公司于 2020 年 6 月 23 日对“15 齐鲁债”、“18 中泰 01”、“19 中泰 01”和“19 中泰 02”出具跟踪评级报告，主体评级 AAA 级别，公司债项评级 AAA 级别，评级展望为稳定，与上一次评级结果相比无变化。

报告期内，公司于全国银行间债券市场发行短期融资券，经中诚信国际信用评级有限责任公司综合评定，公司的主体评级亦为 AAA，评级展望为稳定，不存在评级差异的情况。

#### 五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

√适用 □不适用

根据募集说明书的约定，公司偿债保障措施包括制定《债券持有人会议规则》、设立专门的偿付工作小组、制定并严格执行资金管理计划、通过外部融资渠道保障偿债、充分发挥债券受托人的作用、严格履行信息披露义务以及发行人偿债保障的承诺等内容。报告期内，公司偿债计划及其他偿债保障措施均未发生变更，按时、足额支付债券利息和/或本金，偿债账户运作规范，与募集说明书的相关承诺保持一致。

#### 六、公司债券持有人会议召开情况

□适用 √不适用

#### 七、公司债券受托管理人履职情况

√适用 □不适用

中信建投证券股份有限公司担任公司“15 齐鲁债、17 中泰 F1、18 中泰 F1、18 中泰 F2、19

中泰 C1、19 中泰 C2、19 中泰 C3”的债券受托管理人。2020 年 6 月 22 日，在上交所网站披露了《中泰证券股份有限公司公司债券 2019 年度受托管理事务报告》。报告期内，中信建投证券股份有限公司严格按照《债券受托管理协议》约定履行受托管理人职责，为保护本期债券投资者的利益发挥了积极作用，履职时未发生利益冲突情形。

国信证券股份有限公司担任公司“20 中泰 F1、20 中泰 01”的债券受托管理人。报告期内，国信证券股份有限公司严格按照《债券受托管理协议》约定履行受托管理人职责，为保护本期债券投资者的利益发挥了积极作用，履职时未发生利益冲突情形。

渤海证券股份有限公司担任公司“18 中泰 01、19 中泰 01、19 中泰 02”的债券受托管理人。2020 年 6 月 29 日，在上交所网站披露了《中泰证券股份有限公司受托管理事务报告(2019 年度)》。报告期内，渤海证券股份有限公司严格按照《债券受托管理协议》约定履行受托管理人职责，为保护本期债券投资者的利益发挥了积极作用，履职时未发生利益冲突情形。

#### 八、截至报告期末和上年末（或本报告期和上年同期）下列会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)	变动原因
流动比率	1.90	2.02	-5.94	
速动比率	1.90	2.01	-5.47	
资产负债率(%)	70.60	69.05	上升 1.55 个百分点	
贷款偿还率(%)	100.00	100.00		
	本报告期 (1-6 月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)	变动原因
EBITDA 利息保障倍数	2.50	2.09	19.62	
利息偿付率(%)	100.00	100.00		

#### 九、关于逾期债项的说明

□适用 √不适用

#### 十、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用 □不适用

报告期内，公司完成了 1 期公司债券兑付工作、1 期次级债券兑付工作、1 期永续次级债券兑付工作、2 期非公开发行公司债券付息工作和 3 期次级债券付息工作。具体情况如下：

债券类型	债券简称	起息日	到期日	发行规模 (人民币亿元)	付息兑付情况
公司债券	14 齐鲁债	2015/1/29	2020/1/29	30	已足额按时兑付
次级债券	15 齐鲁 01	2015/4/23	2020/4/23	40	已足额按时兑付
永续次级债券	15 齐鲁 Y1	2015/5/28	2020/5/28	60	已足额按时兑付
非公开发行公司债券	18 中泰 F1	2018/2/6	2021/2/6	20	已足额按时付息
	18 中泰 F2	2018/4/26	2021/4/26	20	已足额按时付息
次级债券	19 中泰 C1	2019/1/24	2022/1/24	20	已足额按时付息
	19 中泰 C2	2019/3/11	2022/3/11	20	已足额按时付息

	19 中泰 C3	2019/5/28	2022/5/28	40	已足额按时付息
--	----------	-----------	-----------	----	---------

此外，2020 年上半年，对于尚在存续期的短期融资券、收益凭证等其他债务融资工具，公司均已按时、足额支付各项融资的本金和/或利息。对于中泰金融国际有限公司发行的三期私募债尚未到期兑付。

注：2020 年 7 月 1 日至本报告出具日，对于尚在存续期内的债券等债务融资工具，公司亦均已按时、足额支付各项融资的本金和/或利息。

#### 十一、 公司报告期内的银行授信情况

适用 不适用

截至报告期末，公司获得外部授信规模近 1500 亿元，未使用授信额度 1200 多亿元。

#### 十二、 公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

适用 不适用

#### 十三、 公司发生重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用 不适用

## 第十节 财务报告

### 一、 审计报告

适用 不适用

### 二、 财务报表

合并资产负债表  
2020 年 6 月 30 日

编制单位：中泰证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	六 . 1	39,839,246,122.10	30,916,047,553.27
其中：客户资金存款		31,906,218,189.84	26,166,973,136.69
结算备付金	六 . 2	7,006,200,141.42	6,763,320,638.78
其中：客户备付金		5,239,197,173.86	4,533,338,142.83
贵金属			
拆出资金			
融出资金	六 . 5	24,657,083,933.21	23,248,873,866.35
衍生金融资产	六 . 6	90,886,225.93	99,279,168.26
存出保证金	六 . 7	7,391,484,771.92	5,904,321,055.36
应收款项	六 . 8	748,083,492.80	682,845,873.86
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	六 . 11	10,882,498,894.42	12,572,663,170.37
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	六 . 13	34,016,242,777.49	33,342,840,435.15

债权投资	六·14	4,279,309,718.71	4,238,796,066.65
其他债权投资	六·15	15,388,370,806.71	18,522,040,228.79
其他权益工具投资	六·16	5,831,811,877.93	5,510,778,810.08
长期股权投资	六·17	748,522,210.18	684,413,394.65
投资性房地产	六·18	467,440,594.86	478,563,056.35
固定资产	六·19	906,476,104.55	922,585,745.39
在建工程	六·20	6,011,702.87	6,011,702.87
无形资产	六·22	203,464,194.77	199,045,699.85
商誉			
递延所得税资产	六·24	865,471,931.41	912,312,812.39
其他资产	六·25	1,317,708,480.31	1,608,410,432.67
资产总计		154,646,313,981.59	146,613,149,711.09
<b>负债：</b>			
短期借款	六·29	4,835,545,025.65	3,505,844,122.80
应付短期融资款	六·30	9,452,803,679.46	3,933,260,648.75
拆入资金	六·31	2,616,054,024.46	3,576,357,727.96
交易性金融负债	六·32	13,295,655.22	345,790,400.45
衍生金融负债	六·6	29,604,661.53	51,781,107.35
卖出回购金融资产款	六·33	23,869,715,082.85	25,496,292,325.94
代理买卖证券款	六·34	41,622,529,820.35	33,494,472,707.20
代理承销证券款	六·35	864,177.93	2,754,987.94
应付职工薪酬	六·36	1,801,255,979.40	1,886,590,611.06
应交税费	六·37	412,474,004.25	415,145,350.42
应付款项	六·38	715,845,707.87	372,940,587.24
合同负债			
持有待售负债			
预计负债	六·41	473,566.29	219,298.85
长期借款	六·42	274,170,072.60	342,501,181.02
应付债券	六·43	29,778,557,053.76	32,212,281,435.85
其中：优先股			
永续债			
递延收益	六·45	1,057,206.47	1,057,206.47
递延所得税负债	六·24	316,768,121.94	320,586,199.25
其他负债	六·46	5,674,378,850.11	5,648,706,681.13
负债合计		121,415,392,690.14	111,606,582,579.68
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	六·47	6,968,625,756.00	6,271,763,180.00
其他权益工具	六·48		6,000,000,000.00
其中：优先股			
永续债			6,000,000,000.00
资本公积	六·49	13,084,983,314.73	10,857,565,036.70
减：库存股			
其他综合收益	六·51	-356,273,169.19	-429,340,321.18
盈余公积	六·52	1,836,976,860.37	1,839,215,368.76
一般风险准备	六·53	4,848,071,661.71	4,823,677,831.72
未分配利润	六·54	5,729,711,233.25	4,546,698,234.15
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		32,112,095,656.87	33,909,579,330.15



少数股东权益		1,118,825,634.58	1,096,987,801.26
所有者权益（或股东权益）合计		33,230,921,291.45	35,006,567,131.41
负债和所有者权益（或股东权益）总计		154,646,313,981.59	146,613,149,711.09

法定代表人：李玮

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

## 母公司资产负债表

2020年6月30日

编制单位：中泰证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年6月30日	2019年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金		32,830,184,500.51	24,255,923,383.28
其中：客户资金存款		27,449,991,340.86	21,962,634,476.48
结算备付金		7,111,728,267.24	6,918,433,358.17
其中：客户备付金		5,239,197,173.86	4,533,338,142.83
贵金属			
拆出资金			
融出资金		23,474,905,309.65	22,067,101,373.49
衍生金融资产		86,077,988.98	44,886,178.50
存出保证金		2,108,432,186.53	2,198,713,113.45
应收款项		306,958,606.09	198,105,519.85
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产		8,796,146,119.91	11,196,667,010.73
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产		27,259,343,379.64	26,950,179,078.85
债权投资			
其他债权投资		15,311,583,302.33	18,522,040,228.79
其他权益工具投资		7,669,008,085.40	7,308,610,637.77
长期股权投资	十八.1	6,437,702,785.03	5,788,748,524.18
投资性房地产		12,972,135.94	22,109,185.15
固定资产		256,392,785.00	259,727,177.29
在建工程			
无形资产		148,571,415.24	147,642,114.57
商誉			
递延所得税资产		711,138,702.93	738,822,745.44
其他资产		691,135,578.00	645,065,297.19
资产总计		133,212,281,148.42	127,262,774,926.70
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款		9,739,139,517.08	4,535,023,662.45
拆入资金		2,028,533,403.82	3,017,622,384.62
交易性金融负债			122,439,240.00

衍生金融负债		25,061,019.41	5,238,711.52
卖出回购金融资产款		27,101,376,803.60	28,521,214,843.67
代理买卖证券款		32,699,910,000.09	26,566,508,275.40
代理承销证券款			
应付职工薪酬	十八.2	1,465,782,750.61	1,474,231,886.12
应交税费		384,699,446.59	342,308,537.05
应付款项		336,138,707.24	125,904,209.71
合同负债			
持有待售负债			
预计负债		219,298.85	219,298.85
长期借款			
应付债券		27,623,395,268.43	28,676,476,588.94
其中：优先股			
永续债			
递延收益		1,057,206.47	1,057,206.47
递延所得税负债		267,580,177.38	284,598,146.09
其他负债		324,609,289.97	488,375,291.57
负债合计		101,997,502,889.54	94,161,218,282.46
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		6,968,625,756.00	6,271,763,180.00
其他权益工具			6,000,000,000.00
其中：优先股			
永续债			6,000,000,000.00
资本公积		12,852,918,411.56	10,625,500,133.53
减：库存股			
其他综合收益		233,910,684.60	158,228,395.88
盈余公积		1,839,142,662.34	1,841,381,170.73
一般风险准备		4,726,422,013.25	4,726,422,013.25
未分配利润		4,593,758,731.13	3,478,261,750.85
所有者权益（或股东权益）合计		31,214,778,258.88	33,101,556,644.24
负债和所有者权益（或股东权益）总计		133,212,281,148.42	127,262,774,926.70

法定代表人：李玮

主管会计工作负责人：袁西存 会计机构负责人：刘健

合并利润表  
2020年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年半年度	2019年半年度
一、营业总收入		4,802,218,063.26	4,819,776,546.85
利息净收入	六.55	1,047,655,712.45	726,370,401.36
其中：利息收入		2,369,969,303.16	2,324,816,014.05
利息支出		1,322,313,590.71	1,598,445,612.69
手续费及佣金净收入	六.56	2,315,222,460.70	2,136,510,534.66
其中：经纪业务手续费净收入		1,602,780,314.64	1,357,172,076.35
投资银行业务手续费净收入		477,612,811.84	512,995,702.77

资产管理业务手续费净收入		150,247,506.93	200,573,491.02
投资收益（损失以“-”号填列）	六 . 57	955,921,341.77	748,257,348.52
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		48,166,925.70	30,122,939.54
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	六 . 59	27,243,583.92	49,321,107.00
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	六 . 60	-142,094,265.59	580,770,431.91
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,754,237.43	-2,667,538.98
其他业务收入	六 . 61	583,689,751.85	581,203,485.97
资产处置收益（损失以“-”号填列）	六 . 62	20,333,715.59	10,776.41
二、营业总支出		3,045,532,737.29	3,279,566,181.57
税金及附加	六 . 63	35,972,030.95	34,576,483.08
业务及管理费	六 . 64	2,305,468,872.60	2,459,371,656.29
信用减值损失	六 . 65	136,749,851.87	233,160,346.95
其他资产减值损失	六 . 66		-2,705,089.87
其他业务成本	六 . 67	567,341,981.87	555,162,785.12
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		1,756,685,325.97	1,540,210,365.28
加：营业外收入	六 . 68	2,515,974.95	1,870,252.90
减：营业外支出	六 . 69	11,304,246.35	7,843,894.16
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,747,897,054.57	1,534,236,724.02
减：所得税费用	六 . 70	338,098,099.23	311,055,516.64
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,409,798,955.34	1,223,181,207.38
（一）按经营持续性分类			
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		1,409,798,955.34	1,223,181,207.38
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）		1,383,125,268.50	1,188,514,204.21
2.少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		26,673,686.84	34,667,003.17
六、其他综合收益的税后净额	六 . 71	37,877,472.94	314,584,547.52
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		37,910,204.19	314,986,639.77
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		27,501,051.92	320,828,087.94
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		5,417,950.99	
3.其他权益工具投资公允价值变动		22,083,100.93	320,828,087.94
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		10,409,152.27	-5,841,448.17
1.权益法下可转损益的其他综合收益			-19,208,291.11
2.其他债权投资公允价值变动		-36,150,381.44	-17,040,380.74
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		25,633,468.04	22,272,488.22
5.现金流量套期储备			
6.外币财务报表折算差额		20,926,065.67	8,134,735.46
7.其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		-32,731.25	-402,092.25
七、综合收益总额		1,447,676,428.28	1,537,765,754.90
归属于母公司所有者的综合收益总额		1,421,035,472.69	1,503,500,843.98
归属于少数股东的综合收益总额		26,640,955.59	34,264,910.92
八、每股收益：			
(一)基本每股收益(元/股)		0.19	0.16
(二)稀释每股收益(元/股)		0.19	0.16

法定代表人：李玮

主管会计工作负责人：袁西存 会计机构负责人：刘健

母公司利润表  
2020年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年半年度	2019年半年度
一、营业总收入		3,574,470,860.55	3,437,551,734.75
利息净收入	十八.3	810,490,254.50	578,244,539.65
其中：利息收入		1,941,132,325.40	1,983,942,753.35
利息支出		1,130,642,070.90	1,405,698,213.70
手续费及佣金净收入	十八.4	1,983,514,398.82	1,783,979,270.69
其中：经纪业务手续费净收入		1,505,137,545.23	1,288,226,495.40
投资银行业务手续费净收入		415,406,441.57	455,036,495.22
资产管理业务手续费净收入			
投资收益（损失以“-”号填列）	十八.5	703,661,552.43	379,782,658.23
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		48,954,260.85	19,381,863.18
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		21,118,242.99	8,853,584.91
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	十八.6	-24,067,465.73	604,448,814.77
汇兑收益（损失以“-”号填列）		255,026.64	36,025.89
其他业务收入		59,165,471.72	82,189,759.01
资产处置收益（损失以“-”号填列）		20,333,379.18	17,081.60

二、营业总支出		2,003,173,666.81	2,103,016,831.06
税金及附加		27,442,676.05	25,620,618.29
业务及管理费	十八.7	1,894,178,087.44	1,928,875,559.33
信用减值损失		80,880,915.76	147,850,023.53
其他资产减值损失			
其他业务成本		671,987.56	670,629.91
三、营业利润（亏损以“－”号填列）		1,571,297,193.74	1,334,534,903.69
加：营业外收入		1,303,037.94	1,764,493.30
减：营业外支出		10,792,880.55	6,074,196.89
四、利润总额（亏损总额以“－”号填列）		1,561,807,351.13	1,330,225,200.10
减：所得税费用		283,926,197.64	255,170,190.01
五、净利润（净亏损以“－”号填列）		1,277,881,153.49	1,075,055,010.09
（一）持续经营净利润（净亏损以“－”号填列）		1,277,881,153.49	1,075,055,010.09
（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		53,859,607.12	455,008,554.83
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		64,376,520.52	450,732,180.68
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		64,376,520.52	450,732,180.68
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		-10,516,913.40	4,276,374.15
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		-36,150,381.44	-18,021,569.50
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		25,633,468.04	22,297,943.65
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		1,331,740,760.61	1,530,063,564.92
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)			
（二）稀释每股收益(元/股)			

法定代表人：李玮

主管会计工作负责人：袁西存 会计机构负责人：刘健

合并现金流量表  
2020年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年半年度	2019年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		153,736,698.69	
收取利息、手续费及佣金的现金		5,168,360,013.02	4,883,894,428.24
返售业务资金净减少额		1,667,755,575.01	3,392,519,422.37
代理买卖证券收到的现金净额		8,128,057,113.15	8,857,763,859.97
代理承销证券收到的现金净额			860,658,176.10
收到其他与经营活动有关的现金	六·72	1,609,135,668.24	2,846,676,174.52
经营活动现金流入小计		16,727,045,068.11	20,841,512,061.20
为交易目的而持有的金融资产净增加额			419,208,360.45
向其他金融机构拆入资金净减少额		971,214,722.70	996,831,858.63
回购业务资金净减少额		1,621,696,926.81	1,270,901,025.92
融出资金净增加额		1,380,267,809.28	1,783,568,052.75
代理承销证券支付的现金净额		1,890,810.01	
支付利息、手续费及佣金的现金		1,301,113,538.78	801,908,494.98
支付给职工及为职工支付的现金		1,622,210,503.01	1,480,845,154.77
支付的各项税费		618,004,340.41	668,948,733.19
支付其他与经营活动有关的现金	六·72	2,870,838,745.43	3,500,342,267.47
经营活动现金流出小计		10,387,237,396.43	10,922,553,948.16
经营活动产生的现金流量净额		6,339,807,671.68	9,918,958,113.04
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		2,116,531,836.81	2,026,406,818.53
取得投资收益收到的现金		540,423,132.78	542,593,463.94
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		34,381,806.62	944,113.52
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		2,691,336,776.21	2,569,944,395.99
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		95,239,863.89	50,724,175.27
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	六·72	541,120.00	9,673,136.13
投资活动现金流出小计		95,780,983.89	60,397,311.40
投资活动产生的现金流量净额		2,595,555,792.32	2,509,547,084.59

<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		2,924,280,854.03	
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		1,884,286,291.26	3,029,015,719.75
发行债券收到的现金		17,116,031,918.06	10,945,799,520.48
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		21,924,599,063.35	13,974,815,240.23
偿还债务支付的现金		14,268,030,270.10	12,792,607,269.89
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,227,094,368.06	1,485,417,730.77
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		4,803,122.27	
支付其他与筹资活动有关的现金	六·72	6,000,000,000.00	20,403,995.00
筹资活动现金流出小计		21,495,124,638.16	14,298,428,995.66
筹资活动产生的现金流量净额		429,474,425.19	-323,613,755.43
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-20,645,326.83	25,937,134.64
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		9,344,192,562.36	12,130,828,576.84
加：期初现金及现金等价物余额		36,994,295,233.36	30,813,274,515.71
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		46,338,487,795.72	42,944,103,092.55

法定代表人：李玮

主管会计工作负责人：袁西存 会计机构负责人：刘健

母公司现金流量表  
2020年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2020年半年度	2019年半年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		123,478,865.39	
收取利息、手续费及佣金的现金		4,404,403,117.38	4,073,733,215.48
返售业务资金净减少额		2,367,796,075.46	4,495,895,413.47
代理买卖证券收到的现金净额		6,132,172,539.41	7,598,013,100.86
收到其他与经营活动有关的现金		313,583,987.95	56,071,188.93
经营活动现金流入小计		13,341,434,585.59	16,223,712,918.74
为交易目的而持有的金融资产净增加额			2,102,092,166.97
向其他金融机构拆入资金净减少额		1,000,000,000.00	1,000,000,000.00
回购业务资金净减少额		1,406,327,819.67	416,407,602.74
融出资金净增加额		1,379,861,678.59	1,889,584,764.86

支付利息、手续费及佣金的现金		1,083,072,357.92	493,460,779.96
支付给职工及为职工支付的现金		1,275,637,972.77	1,161,302,737.35
支付的各项税费		438,424,456.37	446,978,341.29
支付其他与经营活动有关的现金		805,771,457.62	1,289,070,482.16
经营活动现金流出小计		7,389,095,742.94	8,798,896,875.33
经营活动产生的现金流量净额		5,952,338,842.65	7,424,816,043.41
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		2,262,064,752.24	2,072,217,741.85
取得投资收益收到的现金		495,291,543.78	374,633,950.23
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		34,252,612.47	466,511.96
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		2,791,608,908.49	2,447,318,204.04
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		86,795,843.19	44,627,754.89
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		86,795,843.19	44,627,754.89
投资活动产生的现金流量净额		2,704,813,065.30	2,402,690,449.15
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		2,924,280,854.03	
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		17,116,031,918.06	9,591,636,518.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		20,040,312,772.09	9,591,636,518.00
偿还债务支付的现金		12,819,061,509.00	8,472,445,777.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,214,195,316.06	1,319,636,817.32
支付其他与筹资活动有关的现金		6,000,000,000.00	
筹资活动现金流出小计		20,033,256,825.06	9,792,082,594.32
筹资活动产生的现金流量净额		7,055,947.03	-200,446,076.32
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		255,026.64	36,019.93
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		8,664,462,881.62	9,627,096,436.17
加：期初现金及现金等价物余额		31,144,630,542.24	23,679,795,569.18
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		39,809,093,423.86	33,306,892,005.35

法定代表人：李玮 主管会计工作负责人：袁西存 会计机构负责人：刘健



合并所有者权益变动表  
2020年1—6月

单位:元 币种:人民币

项目	2020年半年度									
	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(或股本)	其他权益工具 永续债	资本公积	减： 库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
一、上年期末余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,857,565,036.70		-429,340,321.18	1,839,215,368.76	4,823,677,831.72	4,546,698,234.15	1,096,987,801.26	35,006,567,131.41
加：会计政策变更										
前期差错更正										
其他										
二、本年期初余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,857,565,036.70		-429,340,321.18	1,839,215,368.76	4,823,677,831.72	4,546,698,234.15	1,096,987,801.26	35,006,567,131.41
三、本期增减变动金额(减少以“－”号填列)	696,862,576.00	-6,000,000,000.00	2,227,418,278.03		73,067,151.99	-2,238,508.39	24,393,829.99	1,183,012,999.10	21,837,833.32	-1,775,645,839.96
(一)综合收益总额					37,910,204.19			1,383,125,268.50	26,640,955.59	1,447,676,428.28
(二)所有者投入和减少资本	696,862,576.00	-6,000,000,000.00	2,227,418,278.03							-3,075,719,145.97
1.所有者投入的普通股	696,862,576.00		2,227,418,278.03							2,924,280,854.03
2.其他权益工具持有者投入资本		-6,000,000,000.00								-6,000,000,000.00
3.股份支付计入所有者权益的金额										
4.其他										
(三)利润分配							24,393,829.99	-167,193,829.99	-4,803,122.27	-147,603,122.27
1.提取盈余公积										
2.提取一般风险准备							24,393,829.99	-24,393,829.99		
3.对所有者(或股东)的分配								-142,800,000.00	-4,803,122.27	-147,603,122.27
4.其他										
(四)所有者权益内部结转					35,156,947.80	-2,238,508.39		-32,918,439.41		
1.资本公积转增资本(或股本)										
2.盈余公积转增资本(或股本)										

中泰证券股份有限公司

3. 盈余公积弥补亏损										
4. 设定受益计划变动额结转留存收益										
5. 其他综合收益结转留存收益					35,156,947.80	-2,238,508.39		-32,918,439.41		
6. 其他										
四、本期末余额	6,968,625,756.00		13,084,983,314.73		-356,273,169.19	1,836,976,860.37	4,848,071,661.71	5,729,711,233.25	1,118,825,634.58	33,230,921,291.45

项目	2019年半年度									
	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(或股本)	其他权益工具 永续债	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、上年期末余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,855,162,839.67		-1,508,241,954.00	1,643,951,591.46	4,378,752,865.03	3,945,354,653.48	1,177,158,523.48	32,763,901,699.12
加：会计政策变更					105,292,575.06	-44,199,737.80		26,436,440.86	-58,743.95	87,470,534.17
前期差错更正										
其他										
二、本年期初余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,855,162,839.67		-1,402,949,378.94	1,599,751,853.66	4,378,752,865.03	3,971,791,094.34	1,177,099,779.53	32,851,372,233.29
三、本期增减变动金额(减少以“－”号填列)					868,536,500.44	-56,461,842.40	5,509,344.61	508,883,964.62	4,033,356.83	1,330,501,324.10
(一)综合收益总额					314,986,639.77			1,188,514,204.21	34,264,910.92	1,537,765,754.90
(二)所有者投入和减少资本									-4,900,000.00	-4,900,000.00
1.所有者投入的普通股									-4,900,000.00	-4,900,000.00
2.其他权益工具持有者投入资本										
3.股份支付计入所有者权益的金额										
4.其他										
(三)利润分配							5,509,344.61	-182,542,221.32	-25,331,554.09	-202,364,430.80
1.提取盈余公积										
2.提取一般风险准备							5,509,344.61	-5,509,344.61		
3.对所有者(或股东)的分配								-177,032,876.71	-25,331,554.09	-202,364,430.80
4.其他										
(四)所有者权益内部结转					553,549,860.67	-56,461,842.40		-497,088,018.27		
1.资本公积转增资本(或股本)										
2.盈余公积转增资										

本（或股本）										
3. 盈余公积弥补亏损										
4. 设定受益计划变动额结转留存收益										
5. 其他综合收益结转留存收益				563,323,389.01	-56,461,842.40			-506,861,546.61		
6. 其他				-9,773,528.34				9,773,528.34		
四、本期期末余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,855,162,839.67	-534,412,878.50	1,543,290,011.26	4,384,262,209.64	4,480,675,058.96	1,181,133,136.36		34,181,873,557.39

法定代表人：李玮

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

母公司所有者权益变动表  
2020年1—6月

单位：元 币种：人民币

项目	2020年半年度								
	实收资本(或股本)	其他权益工具	资本公积	减：库存股	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
		永续债							
一、上年期末余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,625,500,133.53		158,228,395.88	1,841,381,170.73	4,726,422,013.25	3,478,261,750.85	33,101,556,644.24
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,625,500,133.53		158,228,395.88	1,841,381,170.73	4,726,422,013.25	3,478,261,750.85	33,101,556,644.24
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	696,862,576.00	-6,000,000,000.00	2,227,418,278.03		75,682,288.72	-2,238,508.39		1,115,496,980.28	-1,886,778,385.36
（一）综合收益总额					53,859,607.12			1,277,881,153.49	1,331,740,760.61
（二）所有者投入和减少资本	696,862,576.00	-6,000,000,000.00	2,227,418,278.03						-3,075,719,145.97
1. 所有者投入的普通股	696,862,576.00		2,227,418,278.03						2,924,280,854.03
2. 其他权益工具持有者投入资本		-6,000,000,000.00							-6,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额									
4. 其他									
（三）利润分配								-142,800,000.00	-142,800,000.00
1. 提取盈余公积									
2. 提取一般风险准备									
3. 对所有者（或股东）的分配								-142,800,000.00	-142,800,000.00
4. 其他									
（四）所有者权益内部结转					21,822,681.60	-2,238,508.39		-19,584,173.21	
1. 资本公积转增资本（或股本）									

中泰证券股份有限公司

2. 盈余公积转增资本（或股本）									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 设定受益计划变动额结转留存收益									
5. 其他综合收益结转留存收益					21,822,681.60	-2,238,508.39		-19,584,173.21	
6. 其他									
四、本期期末余额	6,968,625,756.00		12,852,918,411.56		233,910,684.60	1,839,142,662.34	4,726,422,013.25	4,593,758,731.13	31,214,778,258.88

项目	2019 年半年度								
	实收资本(或股本)	其他权益工具 永续债	资本公积	减：库存股	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
一、上年期末余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,623,883,948.11		-1,582,597,104.83	1,646,117,393.43	4,300,145,360.66	3,519,108,818.66	30,778,421,596.03
加：会计政策变更					538,765,751.19	-44,199,737.80		-397,797,640.18	96,768,373.21
前期差错更正									
其他									
二、本年期初余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,623,883,948.11		-1,043,831,353.64	1,601,917,655.63	4,300,145,360.66	3,121,311,178.48	30,875,189,969.24
三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列）					1,025,477,404.98	-56,461,842.40		384,015,125.63	1,353,030,688.21
（一）综合收益总额					455,008,554.83			1,075,055,010.09	1,530,063,564.92
（二）所有者投入和减少资本									
1. 所有者投入的普通股									
2. 其他权益工具持有者投入资本									
3. 股份支付计入所有者权益的金额									
4. 其他									
（三）利润分配								-177,032,876.71	-177,032,876.71
1. 提取盈余公积									
2. 提取一般风险准备									
3. 对所有者（或股东）的分配								-177,032,876.71	-177,032,876.71
4. 其他									
（四）所有者权益内部结转					570,468,850.15	-56,461,842.40		-514,007,007.75	
1. 资本公积转增资本（或股本）									
2. 盈余公积转增资本（或股本）									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 设定受益计划变动额结转留存收益									
5. 其他综合收益结转留存收益					564,618,424.02	-56,461,842.40		-508,156,581.62	
6. 其他					5,850,426.13			-5,850,426.13	
四、本期期末余额	6,271,763,180.00	6,000,000,000.00	10,623,883,948.11		-18,353,948.66	1,545,455,813.23	4,300,145,360.66	3,505,326,304.11	32,228,220,657.45

法定代表人：李玮 主管会计工作负责人：袁西存 会计机构负责人：刘健

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

√适用 □不适用

中泰证券股份有限公司（以下简称公司或本公司，在包含子公司时统称本集团），前身为齐鲁证券有限公司，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以《关于同意山东省齐鲁证券经纪有限公司筹建的批复》（证监机构字[2001]11号）批准，于2001年5月15日由山东省齐鲁资产管理有限公司、山东省国际信托投资有限公司、泰安市基金投资担保经营有限公司、济宁市投资中心、德州市德信资产管理有限公司、山东省齐鲁投资管理有限公司、威海市财政局、淄博市财政局、烟台市财政局共9家单位联合组建成立的山东省齐鲁证券经纪有限公司。

2004年10月，中国证监会以《关于同意山东省齐鲁证券经纪有限公司增资扩股、更名的批复》（证监机构字[2004]137号）同意本公司注册资本由5.12亿元增至8.12亿元，同意本公司更名为“齐鲁证券有限公司”，核准莱芜钢铁集团有限公司（以下简称“莱钢集团”）的股东资格及对本公司的3亿元出资额。本公司变更后的注册资本业经中和正信会计师事务所有限公司以中和正信会验字（2004）第2-145号验资报告审验。2004年12月9日，本公司完成了企业法人营业执照的变更登记。

2006年4月，中国证监会以《关于齐鲁证券有限公司股权变更的批复》（证监机构字[2006]69号）批准莱钢集团分别受让山东省齐鲁资产管理有限公司持有的本公司16,663.95万元股权（占出资总额的20.52%）、山东省国际信托投资有限公司持有的本公司10,543.12万元股权（占出资总额的12.98%）、威海市财政局持有的本公司3,000.00万元股权（占出资总额的3.69%）、德州市德信资产管理有限公司持有的本公司1,760.70万元股权（占出资总额的2.17%）；批准威海市丰润资产经营管理有限公司受让威海市财政局持有的本公司1,789.40万元股权（占出资总额的2.20%）；批准淄博市城市资产运营有限公司受让淄博市财政局持有的本公司2,944.12万元股权（占出资总额的3.60%）；批准烟台市电力开发有限公司（现更名为烟台蓝天投资控股有限公司）受让烟台市财政局持有的本公司1,273.98万元股权（占出资总额的1.57%）。

2006年12月，中国证监会以《关于齐鲁证券有限公司增资扩股的批复》（证监机构字[2006]310号）批准莱钢集团、中国建银投资有限责任公司、济南钢铁集团总公司、兖矿集团有限公司和新汶矿业集团有限责任公司等5家公司向本公司增资14亿元人民币，公司注册资本由8.12亿元增加至22.12亿元。本公司变更后的注册资本业经大信会计师事务所有限公司以大信验字（2006）第0049号验资报告审验。2006年12月30日，本公司完成了企业法人营业执照的变更登记。2007年1月25日，公司换取了中国证监会颁发的编号为Z19037000的《经营证券业务许可证》。

2007年1月9日，根据中国证监会办公厅批复的《天同证券有限责任公司证券类资产转让方案》（证监办函[2006]297号），本公司与天同证券有限责任公司清算组（以下简称“天同证券清算组”）签订《天同证券有限责任公司证券类资产转让合同书》，受让原天同证券有限责任公司（以下简称“原天同证券”）全部证券类资产，具体包括原天同证券经纪业务总部、电脑总部、登记结算总部、57家证券营业部和20家证券服务部的实物资产及必需的交易席位和经纪业务在用且证照齐全的部分房产等。

2008年3月25日，中国证监会以《关于核准齐鲁证券有限公司变更注册资本的批复》（证监许可[2008]345号）核准公司增加注册资本300,000.00万元，新增注册资本由莱钢集团等27个法人单位认缴，变更注册资本后，公司股东为莱钢集团等33个法人单位，注册资本增至521,224.57万元。公司新增的注册资本业经中和正信会计师事务所有限公司以中和正信验字（2008）第2-009号验资报告审验。2008年4月28日，本公司完成了企业法人营业执照的变更登记。

2008年4月1日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券股权变更事项无异议的函》（鲁证监函[2008]35号）批准淄博市华联矿业有限责任公司（现更名为山东华联矿业股份有限公司）受让山东省齐鲁投资管理有限公司持有公司1,500.36万元股权（占注册资本0.2879%）。

2009年8月12日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东的无异议函》（鲁证监函[2009]46号）批准威海市人民政府国有资产监督管理委员会受让威海市丰润资产经营管理有限公司持有公司2,089.40万元股权（占注册资本0.4009%）。

2010年7月13日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东的意见的函》（鲁证监函[2010]61号）批准济南均土源投资有限公司受让莱钢集团所持本公司1,000万股，占注册资本的0.1919%。本次股权转让后，公司股东由33个法人单位变更为34个法人单位。

2011年11月30日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东的无异议函》（鲁证监函[2011]96号和97号）批准烟台蓝天投资控股有限公司和蓬莱市茂源建筑工程有限公司分别受让山东省东西结合信用担保有限公司所持本公司1,000万元股权（占注册资本的0.1919%）和2,000万元股权（占注册资本的0.3837%）。

2011年12月7日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东的无异议函》（鲁证监函[2011]104号）批准联合创业集团有限公司受让联合创业担保有限公司所持本公司2,500万元股权（占注册资本的0.4796%）。

2012年1月17日，根据中国证监会山东监管局《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东的无异议函》的批复，中扶华夏投资担保有限公司受让山东省东方国际贸易股份有限公司所持本公司500万元股权（占注册资本的0.0959%）。

2012年12月10日，根据中国证监会山东监管局鲁证监函[2012]168号《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东的无异议函》的批复，上海禹佐投资管理中心受让北京国科新业科技开发有限公司所持本公司12,000万元股权（占注册资本的2.3023%）。

2013年12月23日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有5%以下股权股东无异议的函》批准山东省宏恩投资有限公司受让山东省东方国际贸易股份有限公司所持本公司5,800万元股权（占注册资本1.1128%）、苏州金安九鼎创业投资中心（有限合伙）受让山东省东方国际贸易股份有限公司所持本公司3,400万元股权（占注册资本0.6532%）、山东天宝翔基机械有限公司受让山东省东方国际贸易股份有限公司所持本公司1,768万元股权（占注册资本0.3392%）、江苏鸿汇国际集团畜产进出口股份有限公司受让山东省东方国际贸易股份有限公司所持本公司500万元股权（占注册资本0.0959%）、中扶华夏投资担保有限公司受让山东省东方国际

贸易股份有限公司所持本公司 32 万元股权（占注册资本 0.0061%）。

2014 年 9 月 22 日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有 5% 以下股权股东无异议的函》批准山东省鲁信投资控股集团有限公司受让青岛展冠投资有限公司所持本公司 5,000 万元股权（占注册资本的 0.9593%）。

2014 年 12 月 26 日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更持有 5% 以下股权股东无异议的函》批准杭州美顺投资管理中心受让德邦控股集团有限公司所持本公司 15,000 万元股权（占注册资本的 2.8778%）。

2015 年 3 月 11 日，中国证监会山东监管局以《关于齐鲁证券有限公司变更股东无异议的函》（鲁证监函[2015]29 号）批准济南西城投资发展有限公司、山东永通实业有限公司各受让中国建设银行投资有限责任公司持有的 20,000 万元股权（占注册资本的 3.8371%），2015 年 3 月 18 日已完成工商变更登记。

2015 年 4 月，威海市国有资产管理办公室将持有的本公司 2,089.40 万元的出资全部转让给威海市国有资本运营有限公司，2015 年 5 月 18 日，已完成工商变更登记。

2015 年 6 月，南山集团有限公司将持有的本公司 4,900 万元的出资转让给烟台市广信投资发展有限责任公司，并于 2015 年 6 月办理完成工商变更登记。

2015 年 9 月，根据莱芜钢铁集团有限公司、兖矿集团有限公司、济钢集团有限公司等 40 家股东签订的《中泰证券股份有限公司发起人协议书》及公司章程约定，经山东省人民政府国有资产监督管理委员会《关于齐鲁证券有限公司整体变更为股份有限公司暨更名有关问题的批复》（鲁国资收益字[2015]43 号）批准，齐鲁证券有限公司整体变更为中泰证券股份有限公司，将齐鲁证券有限公司截至 2014 年 12 月 31 日止经信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）审计后的扣除 2014 年度分红款人民币 564,623,670.00 元后的净资产 13,202,735,991.36 元按 1:0.4014 比例折合成 5,300,000,000 股股份（每股面值 1 元），此次变更注册资本业经信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）以 XYZH/2015JNA30108 号审验报告审验，于 2015 年 9 月 9 日取得山东省工商行政管理局颁发的 370000018067809 号《营业执照》。整体变更后注册资本为人民币 5,300,000,000.00 元，实收资本为人民币 5,300,000,000.00 元。

根据公司 2015 年 9 月 6 日召开的 2015 年第一次临时股东大会决议（中泰证券股决字[2015]1 号），公司申请增加注册资本人民币 971,763,180.00 元，变更后的注册资本为人民币 6,271,763,180.00 元，此次变更业经信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）以 XYZH/2015JNA30150 号审验报告审验，于 2015 年 9 月 30 日取得山东省工商行政管理局颁发的统一社会信用代码为 91370000729246347A 号的《营业执照》。

2019 年 1 月 18 日，济南仲裁委员会作出《裁决书》（（2018）济仲裁字第 2996 号），裁决登记在山东省融资担保有限公司名下的中泰证券 3,000 万股股份及投资收益的实际所有人为山东省融资担保有限公司的控股股东山东省财金投资集团有限公司。为执行仲裁裁决，2019 年 3 月 28 日，山东省融资担保有限公司与山东省财金投资集团有限公司就上述事宜签署了《股份转让协议》，将所持中泰证券 3,000 万股股份转让给山东省财金投资集团有限公司，公司股东进行了变更。由



于原先该 3,000 万股股份的出资资金系由山东省财金投资集团有限公司提供给山东省融资担保有限公司，本次股东变更不支付对价。

2020 年 4 月 17 日，经中国证监会核准（证监许可[2020]736 号），公司获准向社会公开发行人民币普通股（A 股）股票 696,862,576.00 股，每股面值 1 元。公司股票已于 2020 年 6 月 3 日在上海证券交易所挂牌交易，变更后股本为 6,968,625,756.00 元。此次变更注册资本业经信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）以 XYZH/2020JNA30702 号审验报告审验。

截至 2020 年 6 月 30 日，本集团员工合计为 7,530 人，其中本公司高级管理人员 9 人。

公司属金融行业，经营范围包括：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；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；股票期权做市；证券投资基金托管。

公司住所：济南市市中区经七路 86 号

公司总部地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

## 2. 合并财务报表范围

√适用 不适用

公司合并财务报表范围包括直接或间接控制的子公司和结构化主体。

详见本附注“八、合并范围的变动”及本附注“九、在其他主体中的权益”相关内容。

## 四、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

本集团财务报表以持续经营为编制基础。

### 2. 持续经营

√适用 不适用

本集团自本报告期末至少 12 个月内具备持续经营能力，无影响持续经营能力的重大事项。

## 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

√适用 不适用

本集团根据实际经营特点制定的具体会计政策和会计估计包括营业周期、金融工具确认和计量、融资融券业务会计核算、买入返售与卖出回购业务计量、固定资产分类及折旧方法、无形资产摊销、收入确认和计量等。

### 1. 遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集团的财务状况、经营成果、所有者权益变动和现金流量等有关信息。

2. 会计期间

本集团会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

3. 营业周期

√适用 □不适用

本集团以 12 个月为营业周期，营业周期起止日为 1 月 1 日至 12 月 31 日。

4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本公司及本集团子公司选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。本集团的部分子公司采用本公司记账本位币以外的货币作为记账本位币，在编制本财务报表时，这些子公司的外币财务报表按照附注五、9 进行了折算。

5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

√适用 □不适用

(1) 同一控制下的企业合并

参与合并的企业在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制，且该控制并非暂时性的，为同一控制下的企业合并。

公司在同一控制下的企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额计量，取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

公司为同一控制下的企业合并发生的审计评估费、法律咨询费等各项直接相关费用，于发生时计入当期损益。为企业合并发行的债券或承担其他债务支付的手续费、佣金等，计入所发行债券及其他债务的初始计量金额。企业合并中发行权益性证券发生的手续费、佣金等费用，抵减权益性证券溢价收入，溢价收入不足冲减的，冲减留存收益。

同一控制下的企业合并形成母子公司关系的，公司编制合并日的合并资产负债表、合并利润表和合并现金流量表。因被合并方采用的会计政策与公司不一致的，在合并日按照公司会计政策对被合并方的财务报表相关项目进行调整，以调整后的账面价值计量。合并利润表包括参与合并各方自合并当期期初至合并日所发生的收入、费用和利润。被合并方在合并前实现的净利润，在合并利润表中单列项目反映。合并现金流量表包括参与合并各方自合并当期期初至合并日的现金流量。

(2) 非同一控制下的企业合并

参与合并的企业在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制，为非同一控制下的企业合并。

非同一控制下的企业合并下，公司在购买日对作为企业合并对价付出的资产、发生或承担的负债按照公允价值计量，公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉。合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益。

公司为非同一控制下的企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

非同一控制下的企业合并形成母子公司关系的，公司设置备查簿，记录企业合并中取得的子公司各项可辨认资产、负债及或有负债等在购买日的公允价值。编制合并财务报表时，以购买日确定的各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整。

## 6. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

### (3) 合并范围的确定原则

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。

### (4) 合并财务报表所采用的会计方法

本集团合并财务报表按照《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》及相关规定的要求编制，合并时合并范围内的所有重大内部交易和往来业务已抵销。子公司的股东权益中不属于母公司所拥有的部分作为“少数股东权益”在合并财务报表中股东权益项下单独列示。子公司当期净损益中属于少数股东权益的份额，在合并利润表中净利润项目下以“少数股东损益”项目列示。少数股东分担的子公司的亏损超过了少数股东在该子公司期初股东权益中所享有的份额，其余仍冲减少数股东权益。

子公司与本公司采用的会计政策不一致的，在编制合并财务报表时，按照本公司的会计政策对子公司财务报表进行必要的调整。

对于非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其个别财务报表进行调整；对于同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并财务报表时，视同合并后形成的报告主体自最终控制方开始实施控制时一直是一体化存续下来的，对合并资产负债表的期初数进行调整，同时对比较报表的相关项目进行调整。

对于购买子公司少数股权或因处置部分股权投资但没有丧失对该子公司控制权的交易，作为

权益性交易核算，调整归属于母公司股东权益和少数股东权益的账面价值以反映其在子公司中相关权益的变化。少数股东权益的调整额与支付/收到对价的公允价值之间的差额调整资本公积，资本公积不足冲减的，调整留存收益。

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，剩余股权按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原子公司自购买日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益，在丧失控制权时转为当期投资收益。

7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

8. 现金及现金等价物的确定标准

现金等价物是指企业持有的期限短（一般指从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

(1) 外币交易

本集团外币交易按交易发生日的即期汇率（或实际情况）将外币金额折算为人民币金额。于资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额除了为购建或生产符合资本化条件的资产而借入的外币专门借款产生的汇兑差额按资本化的原则处理外，直接计入当期损益。

(2) 外币财务报表的折算

外币资产负债表中资产、负债类项目采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益类项目除“未分配利润”外，均按业务发生时的即期汇率折算；利润表中的收入与费用项目，采用交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折算。上述折算产生的外币报表折算差额，在其他综合收益项目中列示。外币现金流量采用现金流量发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折算。汇率变动对现金的影响额，在现金流量表中单独列示。

10. 金融工具

金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

适用 不适用

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

(1) 金融资产

### 1) 金融资产分类、确认依据和计量方法

本集团根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流特征，将金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集团将同时符合下列条件的金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产：①管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标。②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。此类金融资产按照公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额；以摊余成本进行后续计量。除被指定为被套期项目的，按照实际利率法摊销初始金额与到期金额之间的差额，其摊销、减值、汇兑损益以及终止确认时产生的利得或损失，计入当期损益。

本集团将同时符合下列条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产：①管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标。②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。此类金融资产按照公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额。除被指定为被套期项目的，此类金融资产，除信用减值损失或利得、汇兑损益和按照实际利率法计算的该金融资产利息之外，所产生的其他利得或损失，均计入其他综合收益；金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失应当从其他综合收益中转出，计入当期损益。

本集团按照实际利率法确认利息收入。利息收入根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定，但下列情况除外：①对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。②对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。

本集团将非交易性权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。该指定一经作出，不得撤销。本集团指定的以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资，按照公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额；除了获得股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益外，其他相关的利得和损失（包括汇兑损益）均计入其他综合收益，且后续不得转入当期损益。当其终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

除上述分类为以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产之外的金融资产。本集团将其分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。此类金融资产按照公允价值进行初始计量，相关交易费用直接计入当期损益。此类金融资产的利得或损失，计入当期损益。

本集团在非同一控制下的企业合并中确认的或有对价构成金融资产的，该金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

## 2) 金融资产转移的确认依据和计量方法

本集团将满足下列条件之一的金融资产予以终止确认：①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；②金融资产发生转移，本集团转移了金融资产所有权上几乎所有风险和报酬；③金融资产发生转移，本集团既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且未保留对该金融资产控制的。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产的账面价值，与因转移而收到的对价及原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付）之和的差额计入当期损益。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将因转移而收到的对价及应分摊至终止确认部分的原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付）之和，与分摊的前述金融资产整体账面价值的差额计入当期损益。

## (2) 金融负债

### 1) 金融负债分类、确认依据和计量方法

本集团的金融负债于初始确认时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和其他金融负债。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债和初始确认时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。按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融负债相关的股利和利息支出计入当期损益。

其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。除下列各项外，本集团将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债：①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。②不符合终止确认条件的金融资产转移或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。③不属于以上①或②情形的财务担保合同，以及不属于以上①情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

本集团将在非同一控制下的企业合并中作为购买方确认的或有对价形成金融负债的，按照以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。

## 2) 金融负债终止确认条件

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。本集团与债权人之间签订协议，以承担新金融负债方式替换现存金融负债，且新金融负债与现存金融负债的合同条款实质上不同的，终止确认现存金融负债，并同时确认新金融负债。本集团对现存金融负债全部或部分的合同条款作出实质性修改的，终止确认现存金融负债或其一部分，同时将修改条款后的金融负债确认为一项新金融负债。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### (3) 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

本集团以主要市场的价格计量金融资产和金融负债的公允价值，不存在主要市场的，以最有利市场的价格计量金融资产和金融负债的公允价值，并且采用当时适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。公允价值计量所使用的输入值分为三个层次，即第一层次输入值是计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本集团对权益工具的投资以公允价值计量。但在有限情况下，如果用以确定公允价值的近期信息不足，或者公允价值的可能估计金额分布范围很广，而成本代表了该范围内对公允价值的最佳估计的，该成本可代表其在该分布范围内对公允价值的恰当估计。

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

#### 1) 存在活跃市场的金融工具公允价值

对于存在活跃市场的金融工具，本集团采用活跃市场中的报价确定其公允价值；活跃市场中的报价是指易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格，按照下述原则确定：

A、在活跃市场上，本集团已持有的金融资产或拟承担的金融负债的报价，为市场中的现行出价；拟购入的金融资产或已承担的金融负债的报价，为市场中的现行要价。

B、金融资产和金融负债没有现行出价或要价，采用最近交易的市场报价或经调整的最近交易的市场报价，除非存在明确的证据表明该市场报价不是公允价值。

C、非公开发行有明确锁定期的股票等投资的公允价值，如果估值日股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，按以下公式

确定该股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(DI-Dr) / DI$$

其中：FV 为估值日该股票的价值；C 为该股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

DI 为该股票锁定期所含的交易所的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数（不含估值日当天）。

2) 对于不存在活跃市场的金融工具，本集团采用估值技术确定其公允价值。在估值技术的应用中，公司优先使用相关可观察输入值，只有在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。具体估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具当前的公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

#### （4）金融资产和金融负债的抵销

本集团的金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件时，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：（1）本集团具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；（2）本集团计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### （5）金融负债与权益工具的区分及相关处理方法

本集团按照以下原则区分金融负债与权益工具：（1）如果本集团不能无条件地避免以交付现金或其他金融资产来履行一项合同义务，则该合同义务符合金融负债的定义。有些金融工具虽然没有明确地包含交付现金或其他金融资产义务的条款和条件，但有可能通过其他条款和条件间接地形成合同义务。（2）如果一项金融工具须用或可用本集团自身权益工具进行结算，需要考虑用于结算该工具的本集团自身权益工具，是作为现金或其他金融资产的替代品，还是为了使该工具持有方享有在发行方扣除所有负债后的资产中的剩余权益。如果是前者，该工具是发行方的金融负债；如果是后者，该工具是发行方的权益工具。在某些情况下，一项金融工具合同规定本集团须用或可用自身权益工具结算该金融工具，其中合同权利或合同义务的金额等于可获取或需交付的自身权益工具的数量乘以其结算时的公允价值，则无论该合同权利或义务的金额是固定的，还是完全或部分地基于除本集团自身权益工具的市场价格以外的变量（例如利率、某种商品的价格或某项金融工具的价格）的变动而变动，该合同分类为金融负债。

本集团在合并报表中对金融工具（或其组成部分）进行分类时，考虑了集团成员和金融工具持有方之间达成的所有条款和条件。如果集团作为一个整体由于该工具而承担了交付现金、其他



金融资产或者以其他导致该工具成为金融负债的方式进行结算的义务，则该工具应当分类为金融负债。

金融工具或其组成部分属于金融负债的，相关利息、股利（或股息）、利得或损失，以及赎回或再融资产生的利得或损失等，本集团计入当期损益。

金融工具或其组成部分属于权益工具的，其发行（含再融资）、回购、出售或注销时，本集团作为权益的变动处理，不确认权益工具的公允价值变动。

#### （6）金融工具的减值

本集团以预期信用损失为基础，进行减值会计处理并确认损失准备的金融工具有：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资、租赁应收款、合同资产以及符合条件的贷款承诺和财务担保合同等。

对于不含重大融资成分的应收款项以及合同资产，本集团运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本集团按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于本集团购买或源生的已发生信用减值的金融资产，应按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

##### 1) 减值阶段的划分

本集团基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行调整：

- 第 1 阶段：如果该金融工具的信用风险较低或自初始确认后并未显著增加，本集团按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备；

- 第 2 阶段：如果该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；

- 第 3 阶段：对于已发生信用减值的金融工具，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

上述三阶段的划分，适用于购买或源生时未发生信用减值的金融工具。对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，应当仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。对于符合准则规定条件且如适用公司已做出相应会计政策选择的应收款项，应当始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

## 2) 对信用风险显著增加的评估

本集团在每个资产负债表日，评估信用风险自初始确认后是否显著增加。

通过比较金融工具在初始确认时所确定的预计存续期间内的违约概率和该工具在资产负债表日所确定的预计存续期内的违约概率，来判定金融工具信用风险是否显著增加。

在评估信用风险是否显著增加时，考虑以下事项，包括但不限于：

- ①可获得有关过去事项、当前状况及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；
- ②宏观经济状况、债务人经营和财务情况、内部实际违约率和预期违约概率、外部信用评级和内部信用评级、逾期情况、外部市场定价等信息；
- ③金融工具预计存续期内违约风险的相对变化，而非违约风险变动的绝对值。

## 3) 已发生信用减值的依据

本集团根据金融资产的特点，针对具有相同风险特征的金融资产界定存在发生信用减值证据的情形。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- ①发行方或债务人发生重大财务困难；
- ②债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- ③债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- ④债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- ⑤发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；
- ⑥以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实；
- ⑦其他表明金融资产已发生信用减值的情形。

金融资产发生信用减值，有可能是多个事件的共同作用所致，未必是可单独识别的事件所致。

## 4) 预期信用风险三阶段的具体划分标准

A、分类为以摊余成本计量的金融资产（债权投资）、分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（其他债权投资）信用风险三阶段划分如下：

第一阶段：债券投资的信用风险较低。情况如下：

①投资境外债券的评级在国际外部评级 **BBB-**以上（含），投资境内债券的评级在国内外部评级 **AA** 以上（含）；

②公司可基于内部评级定义较低信用风险的标准。

此外，国债、中央银行票据、政策性金融债、同业存单四类债券由于信用风险极低，预期信用损失可视为零。

第二阶段：债券投资的信用风险显著增加。以下情况表明持有债券信用风险显著增加：

①宏观经济环境的重大不利变化；

②发行人所处行业环境或政策、地域环境的重大不利变化；

③初始确认时评级在 **BBB-**以上（含）的境外债券的评级发生下调，且下调后等级在 **BBB-**以下（不含）；初始确认时评级在 **AA** 以上（含）的境内债券的评级发生下调，且下调后等级在 **AA** 以下（不含）；

④初始确认时评级在 **BBB-**以下的境外债券的评级发生下调；初始确认时评级在 **AA** 以下的境内债券的评级发生下调；

⑤发行人合并报表口径主要经营或财务指标发生重大不利变化，如息税折旧及摊销前利润（**EBITDA**）利息保障倍数、经营活动现金流量净额、净利润、资产负债率、速动比率、总资产报酬率、**EBITDA** 全部债务比等；

⑥发行人控股股东、实际控制人发生重大不利变化；

⑦发行人治理结构特别是董事长、总经理等主要领导发生重要不利变化；

⑧发行人合并报表或母公司口径有息负债及或有负债余额增长较快，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

⑨发行人及其主要子公司的主要资产发生抵押、质押、司法查封或冻结等权利受限的重大情形；

⑩发行人未按规定或约定履行信息披露义务或募集说明书相关承诺，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

⑪发行人未按核准用途使用债券募集资金，或未按约定用途使用债券募集资金且未履行规定或约定的变更程序，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

⑫发行人内部评级下调，下调幅度可根据实际情况确定；

⑬增信措施的有效性发生重大不利变化；

⑭发行人、增信机构被列为失信被执行人、环保或安全生产领域失信单位等信用惩戒对象或发生其他可能影响偿债能力的重大情况；

⑮增信机构在其他债务中拖延、拒绝承担增信责任的重大情况；

⑯发行人、增信机构或实际控制人受到刑事处罚、行政处罚、被采取行政监管措施或涉嫌违法犯罪的情况，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

⑰债券信用利差和价格的重大不利变化。

第三阶段：已发生信用减值的债券。当发生如下情形之一时，应被定义为存在客观减值证据：

①发行人发生重大财务困难；

②发行人不能按期偿付本金或利息；

③发行人不能履行回售义务；

④发行人丧失清偿能力、被法院指定管理人或已开始相关的诉讼程序；

⑤发行人很可能破产或进行其他财务重组；

⑥发行人的其他债券违约；

⑦其他可视情况认定为违约的情况。

对于上款 1 至 3 可给予不超过 30 天的宽限期。

**B、融资类业务（融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务）信用风险三阶段划分如下：**

**第一阶段：**融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务信用风险较低。当维持担保比例/履约保障比例不低于 120%时，通常表明其信用风险较低。

**第二阶段：**融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务信用风险显著增加。

①融资融券维持担保比例 120% 以下；

②约定购回履约保障比例 120% 以下；

③股票质押履约保证比例 120% 以下；

④担保品处于停牌状态，存在退市风险；

⑤担保品处于停牌状态，发生影响担保品价格发生重大变化的情况，如上市公司经营业绩重大不利变化，发生重大负面新闻、上市公司以及高管、实际控制人发生重要不利变化（如被立案调查、发生重大纠纷等）；

⑥股票质押客户的主要资产发生司法查封或冻结；

⑦股票质押客户未按约定的资金用途使用资金；

⑧股票质押客户被列为失信被执行人；

⑨股票质押客户受到刑事、行政处罚、涉嫌违法犯罪的情况；

⑩股票质押客户征信发生不利变化等；

⑪被动展期、本金或利息逾期 30 天以上。

第三阶段：融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务已发生信用减值。

①融资融券维持担保比例 100% 以下，尚未平仓处置完毕；

②约定购回、股票质押回购履约保障比例 100% 以下；

③已平仓，发生亏损；

④股票质押客户发生重大财务困难；

⑤股票质押客户未按合同约定偿还本金和利息 90 天以上；

⑥股票质押客户丧失清偿能力，被法院指定管理人或已开始相关的诉讼程序；

⑦股票质押客户很可能破产或进行其他财务重组；

## 5) 金融工具减值计量

A、对于债券投资业务使用债项层面的违约概率/违约损失率方法，即：

其中：

$$ECL = \sum_{i=1} PD_i \times LGD_i \times EAD_i \times DF_i$$

① $PD_i$  为当前时点估计的未来第  $i$  年违约概率；

② $LGD_i$  为当前时点估计的未来第  $i$  年违约的损失率；

③ $EAD_i$  为当前时点估计的未来第  $i$  年违约的风险暴露；

④DFi 为违约损失折现到当前时点的折算因子

#### B、融出资金、买入返售金融资产

处于信用风险第一、第二阶段的 预期信用损失=基数\*损失率；处于信用风险第三阶段的 按预计归还现金流单笔计算减值。预期信用损失=计提基数-（担保品价值\*预期折扣+已收到的还款金额+补充抵押物\*预期折扣+其他处置方案\*预期折扣）。

#### C、应收款项预期信用损失的计量

因融资融券、约定购回交易业务、股票质押式回购交易业务根据合同约定经强制平仓处置操作完成后形成的应收款项由于信用风险较高,按照预期回收情况计算预期信用损失；

因证券清算形成的应收款项、证券公司作为管理人或者托管人应收的管理费和托管费、业绩报酬和席位佣金等由于信用风险不重大，不计提减值准备；

其他已发生信用风险的应收款项应单独进行减值测试，通过预估其未来现金流量现值或预估其坏账损失率计提坏账准备。

其中，信用风险已经发生的情景包括但不限于以下情况：

①债务人违反了合同条款，且在 90 天内仍未履行合同义务；

②债务人发生严重财务困难，影响融资人履约能力；

③债务人经营不善，很可能破产或进行其他不利的财务重组等；

④公司出于经济或合同等方面因素的考虑，对发生财务困难的债务人做出了在任何其他情况下都不会做出的让步。

#### 6) 金融工具减值的账务处理

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资，在其他综合收益中确认其损失准备，并将减值损失或利得计入当期损益，且不应减少该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本集团在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，本集团在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。在每个资产负债表日，本集团将整个存续

期内预期信用损失的变动金额作为减值损失或利得计入当期损益。

11. 贵金属

适用 不适用

12. 应收款项

应收款项的预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节“五、重要会计政策及会计估计 10.金融工具”。

13. 应收款项融资

适用 不适用

14. 合同资产

(1). 合同资产的确认方法及标准

适用 不适用

合同资产，是指本集团已向客户转让商品而有权收取对价的权利，且该权利取决于时间流逝之外的其他因素。如本集团向客户销售两项可明确区分的商品，因已交付其中一项商品而有权收取款项，但收取该款项还取决于交付另一项商品的，本集团将该收款权利作为合同资产。

(2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

合同资产的预期信用损失的确定方法，详见本节“五、重要会计政策及会计估计 10.金融工具”。

会计处理方法，本集团在资产负债表日计算合同资产预期信用损失，如果该预期信用损失大于当前合同资产减值准备的账面金额，本集团将其差额确认为减值损失，借记“信用减值损失”，贷记“合同资产减值准备”。相反，本集团将差额确认为减值利得，做相反的会计分录。

本集团实际发生信用损失，认定相关合同资产无法收回，经批准予以核销的，根据批准的核销金额，借记“合同资产减值准备”，贷记“合同资产”。若核销金额大于已计提的损失准备，按其差额借记“信用减值损失”。

15. 持有待售资产

适用 不适用

本集团将同时符合下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售：（1）根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；（2）出售极可能发生，即已经就一项出售计划作出决议且获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。有关规定要求相关权力机构或者监管部门批准后方可出售的需要获得相关批准。本集团将非流动资产或处置组首次划分为持有待售类别前，按照相关会计准则规定计量非流动资产或处置组中各项资产和负债的账面价值。初始计量或在资产负债表日重新计量持有待售的非流动资产或处置组时，其账面价值高于公

允价值减去出售费用后的净额的，将账面价值减记至公允价值减去出售费用后的净额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提持有待售资产减值准备。

#### 16. 债权投资

债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

详见本节“五、重要会计政策及会计估计 10.金融工具”。

#### 17. 其他债权投资

其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

详见本节“五、重要会计政策及会计估计 10.金融工具”。

#### 18. 长期股权投资

√适用 □不适用

公司长期股权投资指对被投资方实施控制、重大影响的权益性投资，包括子公司和联营企业，以及对能够共同控制的合营企业的权益性投资。

##### (1) 长期股权投资的初始计量

###### 1) 企业合并形成的长期股权投资

对同一控制下的企业合并采用权益结合法确定合并成本。公司以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式以及以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的现金、转让的非现金资产或承担债务账面价值以及所发行股份面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。合并发生的各项直接相关费用，于发生时计入当期损益。

对非同一控制下的企业合并采用购买法确定合并成本。公司可以在购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值作为合并成本。采用吸收合并时，合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；采用控股合并时，合并成本大于在合并中取得的各项可辨认资产、负债公允价值份额的，不调整长期股权投资初始成本，在编制合并财务报表时将其差额确认为合并资产负债表中的商誉；合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益。为进行控股合并发生的各项直接相关费用计入当期损益。

###### 2) 其他方式取得的长期股权投资

以支付现金方式取得的长期股权投资，按照实际支付的购买价款作为初始投资成本。

以发行权益性证券取得的长期股权投资，按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。



投资者投入的长期股权投资，按照投资合同或协议约定的价值（扣除已宣告但尚未发放的现金股利或利润）作为初始投资成本，但合同或协议约定价值不公允的除外。

具备商业实质非货币性资产交换换入的长期股权投资，以换出资产的公允价值为基础确定其初始投资成本。

通过债务重组取得的长期股权投资，其初始投资成本按照公允价值为基础确定。

## （2）确定对被投资单位具有控制、共同控制、重大影响的依据

控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。共同控制，是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。重大影响是指对一个企业的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。在确定能否对被投资单位实施控制或施加重大影响时，已考虑投资企业和其他方持有的被投资单位当期可转换公司债券、当期可执行认股权证等潜在表决权因素。

## （3）长期股权投资的后续计量及收益确认

公司能够对被投资单位施加重大影响或共同控制的，初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的差额，不调整长期股权投资的初始投资成本；初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额应当计入当期损益，同时调整长期股权投资的成本。

公司对子公司的长期股权投资，采用成本法核算，编制合并财务报表时按照权益法进行调整。

对被投资单位具有共同控制或重大影响的长期股权投资，采用权益法核算。

采用权益法核算时，按照享有或分担的被投资单位实现的净损益及其他综合收益的份额，分别确认投资收益和其他综合收益，同时调整长期股权投资的账面价值；本公司按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算享有的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。在确认应享有被投资单位净损益及其他综合收益的份额时，以取得投资时被投资单位各项可辨认资产等的公允价值为基础，并按照本公司的会计政策及会计期间，对被投资单位的净损益及其他综合收益进行调整，并相应确认投资收益和其他综合收益。对于本公司与联营企业之间发生的未实现内部交易损益按照持股比例计算属于本公司的部分予以抵销，在此基础上确认投资损益。但本公司与被投资单位发生的未实现内部交易损失，属于所转让资产减值损失的，不予以抵销。

在确认应分担被投资单位发生权益法下在公司确认应分担被投资单位发生的亏损时，按照以下顺序进行处理：首先，冲减长期股权投资的账面价值。其次，长期股权投资的账面价值不足以冲减的，以其他实质上构成（应明确认定标准）对被投资单位净投资的长期权益账面价值为限继续确认投资损失，冲减长期应收项目等的账面价值。最后，经过上述处理，按照投资合同或协议

约定企业仍承担额外义务的，按预计承担的义务确认预计负债，计入当期投资损失。被投资单位以后期间实现盈利的，公司在扣除未确认的亏损分担额后，按与上述相反的顺序处理，减记已确认预计负债的账面余额、恢复其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益及长期股权投资的账面价值，同时确认投资收益。

## 19. 投资性房地产

### (1). 如果采用成本计量模式的 折旧或摊销方法

本集团投资性房地产包括已出租的土地使用权和已出租的房屋建筑物。

本集团投资性房地产按其成本作为入账价值，外购投资性房地产的成本包括购买价款、相关税费和可直接归属于该资产的其他支出；自行建造投资性房地产的成本，由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成。

本集团对投资性房地产采用成本模式进行后续计量，出租的房屋建筑物的后续计量比照同类固定资产的折旧方法；土地使用权比照同类无形资产的年限摊销。

当投资性房地产的用途改变为自用时，则自改变之日起，将该投资性房地产转换为固定资产或无形资产。自用房地产的用途改变为赚取租金或资本增值时，则自改变之日起，将固定资产或无形资产转换为投资性房地产。发生转换时，以转换前的账面价值作为转换后的入账价值。

当投资性房地产被处置，或者永久退出使用且预计不能从其处置中取得经济利益时，终止确认该项投资性房地产。投资性房地产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的金额计入当期损益。

## 20. 固定资产

### (1). 确认条件

适用 不适用

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用寿命超过一个会计年度的有形资产。固定资产仅在与有关的经济利益很可能流入本集团，且其成本能够可靠地计量时才予以确认。固定资产按成本并考虑预计弃置费用因素的影响进行初始计量。

与固定资产有关的后续支出，如果与该固定资产有关的经济利益很可能流入且其成本能可靠地计量，则计入固定资产成本，并终止确认被替换部分的账面价值。除此以外的其他后续支出，在发生时计入当期损益。

### (2). 折旧方法

适用 不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	平均年限法	15-30	3%-5%	2.71%-6.47%
电子设备	平均年限法	3-5	3%-5%	19.00%-32.33%

办公设备	平均年限法	5	3%-5%	19.00%-19.40%
其他设备	平均年限法	5-11	3%-5%	8.64%-19.40%

(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法

适用 不适用

21. 在建工程

适用 不适用

在建工程按实际发生的成本计量。自营建筑工程按直接材料、直接工资、直接施工费等计量；出包建筑工程按应支付的工程价款等计量；设备安装工程按所安装设备的价值、安装费用、工程试运转等所发生的支出等确定工程成本。在建工程成本还包括应当资本化的借款费用和汇兑损益。

在建工程在达到预定可使用状态之日起，根据工程预算、造价或工程实际成本等，按估计的价值结转固定资产，次月起开始计提折旧，待办理了竣工决算手续后再对固定资产原值差异进行调整。

22. 借款费用

适用 不适用

借款费用包括借款利息、折价或溢价的摊销、辅助费用以及因外币借款而发生的汇兑差额等。可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的借款费用，在资产支出已经发生、借款费用已经发生、为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或生产活动已经开始时，开始资本化；当购建或生产符合资本化条件的资产达到预定可使用或可销售状态时，停止资本化。其余借款费用在发生当期确认为费用。

专门借款当期实际发生的利息费用，扣除尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额予以资本化；一般借款根据累计资产支出超过专门借款部分的资产支出加权平均数乘以所占用一般借款的资本化率，确定资本化金额。资本化率根据一般借款加权平均利率计算确定。

符合资本化条件的资产，是指需要经过相当长时间（通常指1年以上）的购建或者生产活动才能达到预定可使用或者可销售状态的固定资产、投资性房地产和存货等资产。

如果符合资本化条件的资产在购建或者生产过程中发生非正常中断、且中断时间连续超过3个月，暂停借款费用的资本化，直至资产的购建或生产活动重新开始。

23. 使用权资产

适用 不适用

24. 无形资产

(1). 计价方法、使用寿命、减值测试

适用 不适用

(1) 无形资产的确认条件

无形资产仅在与有关的经济利益很可能流入本集团，且其成本能够可靠地计量时才予以确认，并以成本进行初始计量。但企业合并中取得的无形资产，其公允价值能够可靠地计量的，即单独确认为无形资产并按照公允价值计量。无形资产按照其能为本集团带来经济利益的期限确定使用寿命，无法预见其为本集团带来经济利益期限的作为使用寿命不确定的无形资产。

(2) 无形资产使用寿命及摊销

1) 使用寿命有限的无形资产的使用寿命估计情况

每年末，对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核，如发生变更则作为会计估计变更处理。

2) 使用寿命不确定的无形资产的判断依据

每年末，对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。

3) 无形资产的摊销

对于使用寿命有限的无形资产，在为企业带来经济利益的期限内按直线法摊销；无法预见无形资产为企业带来经济利益期限的，视为使用寿命不确定的无形资产，不予摊销。

4) 无形资产的减值测试

详见本节“五、重要会计政策及会计估计 25. 长期资产减值”。

(2). 内部研究开发支出会计政策

适用 不适用

25. 长期资产减值

适用 不适用

本集团于每一资产负债表日对长期股权投资、固定资产、在建工程、使用寿命有限的无形资产等项目进行检查，当存在下列迹象时，表明资产可能发生了减值，本集团将进行减值测试。对商誉和使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年末均进行减值测试。难以对单项资产的可收回金额进行测试的，以该资产所属的资产组或资产组组合为基础测试。

减值测试后，若该资产的账面价值超过其可收回金额，其差额确认为减值损失，上述资产的减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。资产的可收回金额是指资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

出现减值的迹象如下：

(1)资产的市价当期大幅度下跌，其跌幅明显高于因时间的推移或者正常使用而预计的下跌；

(2) 企业经营所处的经济、技术或者法律等环境以及资产所处的市场在当期或者将在近期发生重大变化，从而对企业产生不利影响；

(3) 市场利率或者其他市场投资报酬率在当期已经提高，从而影响企业计算资产预计未来现金流量现值的折现率，导致资产可收回金额大幅度降低；

(4) 有证据表明资产已经陈旧过时或者其实体已经损坏；

(5) 资产已经或者将被闲置、终止使用或者计划提前处置；

(6) 企业内部报告的证据表明资产的经济绩效已经低于或者将低于预期，如资产所创造的净现金流量或者实现的营业利润（或者亏损）远远低于（或者高于）预计金额等；

(7) 其他表明资产可能已经发生减值的迹象。

## 26. 长期待摊费用

适用  不适用

本集团的长期待摊费用是指已经支出，但应由当期及以后各期承担的摊销期限在 1 年以上（不含 1 年）的经营租入固定资产改良和其他费用，该等费用在受益期内平均摊销。如果长期待摊费用项目不能使以后会计期间受益，则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

## 27. 附回购条件的资产转让

适用  不适用

### (1) 买入返售金融资产

买入返售交易按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括债券及票据），合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售按买入返售相关资产时实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”列示。

### (2) 卖出回购金融资产款

卖出回购交易按照合同或协议，以一定的价格将相关的资产（包括债券和票据）出售给交易对手，到合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购按卖出回购相关资产时实际收到的款项入账，在资产负债表“卖出回购金融资产款”列示。卖出的金融产品仍按原分类列于本集团的资产负债表内，并按照相关的会计政策核算。

买入返售及卖出回购的利息收支，在返售或回购期间内以合同或协议利率确认。

## 28. 合同负债

合同负债的确认方法

适用  不适用

合同负债反映本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品的义务。本集团在向客户转让商品之前，客户已经支付了合同对价或本集团已经取得了无条件收取合同对价权利的，在客户实际支付款项与到期应支付款项孰早时点，按照已收或应收的金额确认合同负债。

(1)、短期薪酬的会计处理方法

29. 职工薪酬

√适用 □不适用

短期薪酬主要包括职工工资、奖金、津贴和补贴、职工福利费、医疗保险费、生育保险费、工伤保险费、住房公积金、工会经费和职工教育经费、非货币性福利、短期利润分享计划及其他短期薪酬，在职工提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并按照受益对象计入当期损益或相关资产成本。

(2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

离职后福利主要包括基本养老保险费、失业保险等，按照公司承担的风险和义务，分类为设定提存计划。对于设定提存计划根据在资产负债表日为换取职工在会计期间提供的服务而向单独主体缴存的提存金确认为负债，并按照受益对象计入当期损益或相关资产成本。

(3)、辞退福利的会计处理方法

√适用 □不适用

在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，在本集团不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时，和本集团确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本两者孰早日，确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益。但辞退福利预期在年度报告期结束后十二个月不能完全支付的，按照其他长期职工薪酬处理。

(4)、其他长期职工福利的会计处理方法

√适用 □不适用

职工内部退休计划采用上述辞退福利相同的原则处理。本集团将自职工停止提供服务日至正常退休日的期间拟支付的内退人员工资和缴纳的社会保险费等，在符合预计负债确认条件时，计入当期损益（辞退福利）。

30. 预计负债

√适用 □不适用

(1) 预计负债确认标准

与或有事项相关的义务同时符合以下条件时，确认为预计负债：1) 该义务是企业承担的现时义务；2) 该义务履行很可能导致经济利益流出企业；3) 该义务金额可以可靠地计量。

## (2) 预计负债的计量方法

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量，如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同，最佳估计数按照该范围内的中间值确定；如涉及多个项目，按照各种可能结果及相关概率计算确定最佳估计数。

资产负债表日应当对预计负债账面价值进行复核，有确凿证据表明该账面价值不能真实反映当前最佳估计数，应当按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

## 31. 租赁负债

适用 不适用

## 32. 股份支付

适用 不适用

## 33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

归类为债务工具的优先股、永续债，按其公允价值扣除交易费用后的金额进行初始计量，并采用实际利率法按摊余成本进行后续计量，其利息支出或股利分配按照借款费用进行处理，其回购或赎回产生的利得或损失计入当期损益。

归类为权益工具的优先股、永续债，在发行时收到的对价扣除交易费用后增加所有者权益，其利息支出或股利分配按照利润分配进行处理，回购或注销作为权益变动处理。

## 34. 回购本公司股份

适用 不适用

## 35. 收入

## (1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。

合同中包含两项或多项履约义务的，本集团在合同开始时，按照个单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务，按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。

交易价格是本集团因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项。本集团确认的交易价格不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。预期将退还给客户的款项作为负债不计入交易价格。合同中存在重大融资成分的，本集团按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，本集团预计

客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

满足下列条件之一时，本集团属于在某一时段内履行履约义务；否则，属于在某一时点履行履约义务：

1. 客户在本集团履约的同时即取得并消耗本集团履约所带来的经济利益。

2. 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品。

3. 在本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，本集团在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，本集团已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。

对于在某一时点履行的履约义务，本集团在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品或服务控制权时，本集团考虑下列迹象：

1. 本集团就该商品或服务享有现时收款权利。

2. 本集团已将该商品的法定所有权转移给客户。

3. 本集团已将该商品的实物转移给客户。

4. 本集团已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户。

5. 客户已接受该商品或服务。

本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值。本集团拥有的无条件向客户收取对价的权利作为应收款项列示。本集团已收货应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务作为合同负债列示。

具体如下：

#### (1) 手续费及佣金收入

代理客户买卖证券的手续费收入，在证券买卖交易日确认收入。代兑付证券的手续费收入，于代兑付证券业务基本完成，与委托方结算时确认收入。

证券承销收入，于本公司完成承销合同中的履约义务时确认收入。

受托客户资产管理业务收入，于受托管理合同到期，与委托单位结算时，按照合同规定的比



例计算应由公司享受的收益或承担的损失，确认为当期的收益或损失。如合同规定按约定比例收取管理费的，则分期确认管理费收益。

## (2) 利息收入

在相关的收入能够可靠计量，相关的经济利益能够收到时，按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。

买入返售金融资产在当期到期返售的，按返售价格与买入价格的差额确认为当期收入；在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期收入。

## (3) 投资收益

公司将处置交易性金融资产时其公允价值与初始入账金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。处置其他债权投资时，取得的价款与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额的和与该金融资产账面价值的差额，计入投资收益。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分派的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

## (4) 其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入，包括大宗商品交易收入及投资性房地产取得的租金收入，大宗商品交易收入于本集团已履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品控制权时确认收入。其他收入在服务提供时，按照权责发生制确认收入。

(2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况  
适用 不适用

36. 合同成本  
适用 不适用

### (1) 与合同成本有关的资产金额的确定方法

本集团与合同成本有关的资产包括合同履约成本和合同取得成本。

合同履约成本，即本集团为履行合同发生的成本，不属于其他企业会计准则规范范围且同时满足下列条件的，作为合同履约成本确认为一项资产：该成本与一份当前或预期取得的合同直接相关，包括直接人工、直接材料、制造费用（或类似费用）、明确由客户承担的成本以及仅因该合同而发生的其他成本；该成本增加了本集团未来用于履行履约义务的资源；该成本预期能够收回。

合同取得成本，即本集团为取得合同发生的增量成本预期能够收回的，作为合同取得成本确

认为一项资产；该资产摊销期限不超过一年的，在发生时计入当期损益。增量成本，是指本集团不取得合同就不会发生的成本（如销售佣金等）。本集团为取得合同发生的、除预期能够收回的增量成本之外的其他支出（如无论是否取得合同均会发生的差旅费等），在发生时计入当期损益，但是，明确由客户承担的除外。

#### （2）与合同成本有关的资产的摊销

本集团与合同成本有关的资产采用与该资产相关的商品收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。

#### （3）与合同成本有关的资产的减值

本集团在确定与合同成本有关的资产的减值损失时，首先对按照其他相关企业会计准则确认的、与合同有关的其他资产确定减值损失；然后根据其账面价值高于本集团因转让与该资产相关的商品预期能够取得的剩余对价以及为转让该相关商品估计将要发生的成本这两项差额的，超出部分应当计提减值准备，并确认为资产减值损失。

以前期间减值的因素之后发生变化，使得前述差额高于该资产账面价值的，转回原已计提的资产减值准备，并计入当期损益，但转回后的资产账面价值不应超过假定不计提减值准备情况下该资产在转回日的账面价值。

### 37. 利润分配

适用 不适用

根据公司章程规定，本公司分配当年税后利润时，应当提取利润的 10%作为公司的法定公积金，公司的法定公积金累计额为公司注册资本的 50%以上时，可以不再提取。公司的法定公积金不足以弥补以前年度亏损的，在提取法定公积金之前，应先用当年利润弥补亏损。公司从税后利润中提取法定公积金、一般风险准备金、交易风险准备金后，经股东大会决议，可以提取任意公积金。公司弥补亏损和提取上述公积金、准备金后所余税后利润，按股东持有的股份比例分配，但章程规定不按持股比例分配的除外。公司持有的本公司股份不参与分配利润。

### 38. 政府补助

本集团的政府补助包括与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。其中，与资产相关的政府补助，是指本集团取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助；与收益相关的政府补助，是指除与资产相关的政府补助之外的政府补助。如果政府文件中未明确规定补助对象，本集团按照上述区分原则进行判断，难以区分的，整体归类为与收益相关的政府补助。

政府补助为货币性资产的，按照实际收到的金额计量，对于按照固定的定额标准拨付的补助，或对年末有确凿证据表明能够符合财政扶持政策规定的相关条件且预计能够收到财政扶持资金时，按照应收的金额计量；政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量，公允价值不能可靠

取得的，按照名义金额(1元)计量。

(1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

与资产相关的政府补助，确认为递延收益，确认为递延收益的与资产相关的政府补助，在相关资产使用寿命内按照平均分配，计入当期损益。

相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

(2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

√适用 □不适用

与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间计入当期损益或冲减相关成本。与日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用。与日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

39. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

本集团递延所得税资产和递延所得税负债根据资产和负债的计税基础与其账面价值的差额（暂时性差异）计算确认。对于按照税法规定能够于以后年度抵减应纳税所得额的可抵扣亏损和税款抵减，视同暂时性差异确认相应的递延所得税资产。于资产负债表日，递延所得税资产和递延所得税负债，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量。

本集团以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限，确认由可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产。对已确认的递延所得税资产，当预计到未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产时，应当减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，减记的金额予以转回。

40. 租赁

(1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

本集团作为经营租赁承租方的租金在租赁期内的各个期间按直线法计入相关资产成本或当期损益。

(2)、融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

本集团作为融资租赁承租方时，在租赁开始日，按租赁开始日租赁资产的公允价值与最低租赁付款额的现值两者中较低者，作为融资租入固定资产的入账价值，将最低租赁付款额作为长期

应付款的入账价值，将两者的差额记录为未确认融资费用。

(3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

41. 融资融券业务

适用 不适用

融资融券业务是指公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

公司融出的证券，不终止确认该证券，并确认相应利息收入。

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

42. 资产证券化业务

适用 不适用

43. 客户交易结算资金

本集团收到的客户交易结算资金存放于存管银行的专门账户，与自有资金分开管理；为代理客户证券交易而进行资金清算与交收的款项存入交易所指定的清算代理机构，在结算备付金中核算。本集团在收到代理客户买卖证券款时确认为一项资产和一项负债。在与清算代理机构清算时，本集团按规定将缴纳的开户费、转托管费以及资金第三方存管费等相关费用确认为手续费及佣金支出；在与客户办理买卖证券款项清算时，本集团按规定将向客户收取的手续费确认为手续费及佣金收入。

44. 转融通业务

本集团通过证券金融公司转融通业务融入的资金，在资产负债表内确认为资产，同时对出借方确认一项负债，在“拆入资金”科目下列示；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由公司享有或承担，公司不将其计入资产负债表，在财务报表附注中披露公司转融通融入的证券期末市值和转融通融入后拆借给客户的证券期末市值，未融出证券期末市值等。

45. 关联方

本集团主要关联方包括：母公司及实际控制人、子公司、母公司及实际控制人控制的其他企业、对公司实施共同控制和施加重大影响的投资方、合营企业、联营企业等。关联方交易的类型主要包括：代理销售金融产品、提供中间介绍业务、承销公司债券、办公场所的租赁和提供物业

管理服务等。

#### 46. 分部报告

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

分部间转移价格参照市场价格确定，共同费用除无法合理分配的部分外按照收入比例在不同的分部之间分配。

主要分部报告形式，包括分部营业收入、分部营业支出、分部营业利润（亏损）、分部利润总额、分部资产总额、分部负债总额等。

#### 47. 其他重要的会计政策和会计估计

√适用 □不适用

编制财务报表时，本集团管理层需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本公司管理层对估计涉及的关键假设和不确定性因素的判断进行持续评估。会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

下列会计估计及关键假设存在导致未来期间的资产及负债账面价值发生重大调整的重要风险。

##### （1）金融资产减值准备

本公司以预期信用损失为基础，对债权投资、其他债权投资、开展融资类业务（含融资融券、约定购回、股票质押回购等）形成的资产，以及货币市场拆出（借出）资金或证券、应收款项、合同资产和应收融资租赁款等进行减值处理并确认损失准备。

本公司基于上述金融资产的分类与性质，结合自身风险管理实践及减值指引的相关要求，以概率加权平均为基础，综合考虑货币时间价值和在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息，建立预期信用损失模型计量上述金融工具的减值损失。预期信用损失模型的相关假设、参数、数据来源和计量程序均需本公司作出专业的判断，这些相关因素假设的变化会对金融工具的预期信用损失计算结果产生影响。

本公司采用预期信用损失模型对金融资产的减值进行评估，应用预期信用损失模型需要做出重大判断和估计如违约概率、违约损失率及信用风险是否显著增加，需考虑所有合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。在做出该等判断和估计时，本公司根据历史还款数据结合经济政策、宏观经济指标、行业风险等因素推断债务人信用风险的预期变动。

##### （2）除金融资产之外的非流动资产减值

本集团于资产负债表日对除金融资产之外的非流动资产判断是否存在可能发生减值的迹象。在进行减值测试时，当资产或资产组的账面价值高于可收回金额，表明发生了减值。预计未来现金流量现值时，管理层必须估计该项资产或资产组的预计未来现金流量，并选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

### (3) 金融工具的公允价值

对于缺乏活跃市场的金融工具，本集团运用估值方法确定其公允价值。估值方法包括参照在市场中具有完全信息且有买卖意愿的经济主体之间进行公平交易时确定的交易价格，参考市场上另一类似金融工具的公允价值，或运用现金流量折现分析及期权定价模型进行估算。估值方法在最大程度上利用可观察市场信息，然而，当可观察市场信息无法获得时，管理层将对估值方法中包括的重大不可观察信息作出估计。

### (4) 所得税及递延所得税

本集团需要对某些交易未来的税务处理作出判断以确认所得税。本集团根据有关税收法规，谨慎判断交易对应的所得税影响并相应地计提所得税。递延所得税资产只会在有可能有未来应纳税利润并可用作抵销有关暂时性差异时才可确认。对此需要就某些交易的税务处理作出重大判断，并需要就是否有足够的未来应纳税利润以抵销递延所得税资产的可能性作出重大的估计。

### (5) 合并范围的确定

评估本集团是否作为投资者控制被投资企业时须考虑所有事实及情况。控制的定义包含以下三项要素：1) 拥有对被投资者的权力；2) 通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；3) 有能力运用对被投资者的权力影响其回报的金额。倘若有事实及情况显示上述一项或多项要素发生了变化，则本集团需要重新评估其是否对被投资企业构成控制。

对于本集团管理并投资的结构化主体，本集团会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。若本集团对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

## 48. 重要会计政策和会计估计的变更

### (1)、重要会计政策变更

√适用 □不适用

会计政策变更的内容和原因	审批程序	备注(受重要影响的报表项目名称和金额)
财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，该准则于 2018 年 1 月 1 日起施行。本公司在编制 2020 年半年报时已采用上述准则。	中泰证券董决字  [2020]11 号	无

## (2)、重要会计估计变更

□适用 √不适用

## (3)、2020年起首次执行新收入准则调整首次执行当年年初财务报表相关情况

√适用 □不适用

## 合并资产负债表

单位:元 币种:人民币

项目	2019年12月31日	2020年1月1日	调整数
<b>资产:</b>			
货币资金	30,916,047,553.27	30,916,047,553.27	
其中:客户资金存款	26,166,973,136.69	26,166,973,136.69	
结算备付金	6,763,320,638.78	6,763,320,638.78	
其中:客户备付金	4,533,338,142.83	4,533,338,142.83	
贵金属			
拆出资金			
融出资金	23,248,873,866.35	23,248,873,866.35	
衍生金融资产	99,279,168.26	99,279,168.26	
存出保证金	5,904,321,055.36	5,904,321,055.36	
应收款项	682,845,873.86	682,845,873.86	
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	12,572,663,170.37	12,572,663,170.37	
持有待售资产			
<b>金融投资:</b>			
交易性金融资产	33,342,840,435.15	33,342,840,435.15	
债权投资	4,238,796,066.65	4,238,796,066.65	
其他债权投资	18,522,040,228.79	18,522,040,228.79	
其他权益工具投资	5,510,778,810.08	5,510,778,810.08	
长期股权投资	684,413,394.65	684,413,394.65	
投资性房地产	478,563,056.35	478,563,056.35	
固定资产	922,585,745.39	922,585,745.39	
在建工程	6,011,702.87	6,011,702.87	
无形资产	199,045,699.85	199,045,699.85	
商誉			
递延所得税资产	912,312,812.39	912,312,812.39	
其他资产	1,608,410,432.67	1,608,410,432.67	
资产总计	146,613,149,711.09	146,613,149,711.09	
<b>负债:</b>			
短期借款	3,505,844,122.80	3,505,844,122.80	
应付短期融资款	3,933,260,648.75	3,933,260,648.75	
拆入资金	3,576,357,727.96	3,576,357,727.96	
交易性金融负债	345,790,400.45	345,790,400.45	
衍生金融负债	51,781,107.35	51,781,107.35	
卖出回购金融资产款	25,496,292,325.94	25,496,292,325.94	
代理买卖证券款	33,494,472,707.20	33,494,472,707.20	
代理承销证券款	2,754,987.94	2,754,987.94	
应付职工薪酬	1,886,590,611.06	1,886,590,611.06	
应交税费	415,145,350.42	415,145,350.42	

应付款项	372,940,587.24	372,940,587.24	
合同负债			
持有待售负债			
预计负债	219,298.85	219,298.85	
长期借款	342,501,181.02	342,501,181.02	
应付债券	32,212,281,435.85	32,212,281,435.85	
其中：优先股			
永续债			
递延收益	1,057,206.47	1,057,206.47	
递延所得税负债	320,586,199.25	320,586,199.25	
其他负债	5,648,706,681.13	5,648,706,681.13	
负债合计	111,606,582,579.68	111,606,582,579.68	
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	6,271,763,180.00	6,271,763,180.00	
其他权益工具	6,000,000,000.00	6,000,000,000.00	
其中：优先股			
永续债	6,000,000,000.00	6,000,000,000.00	
资本公积	10,857,565,036.70	10,857,565,036.70	
减：库存股			
其他综合收益	-429,340,321.18	-429,340,321.18	
盈余公积	1,839,215,368.76	1,839,215,368.76	
一般风险准备	4,823,677,831.72	4,823,677,831.72	
未分配利润	4,546,698,234.15	4,546,698,234.15	
归属于母公司所有者权益（或 股东权益）合计	33,909,579,330.15	33,909,579,330.15	
少数股东权益	1,096,987,801.26	1,096,987,801.26	
所有者权益（或股东权益） 合计	35,006,567,131.41	35,006,567,131.41	
负债和所有者权益（或股东 权益）总计	146,613,149,711.09	146,613,149,711.09	

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

### 母公司资产负债表

单位：元 币种：人民币

项目	2019年12月31日	2020年1月1日	调整数
<b>资产：</b>			
货币资金	24,255,923,383.28	24,255,923,383.28	
其中：客户资金存款	21,962,634,476.48	21,962,634,476.48	
结算备付金	6,918,433,358.17	6,918,433,358.17	
其中：客户备付金	4,533,338,142.83	4,533,338,142.83	
贵金属			
拆出资金			
融出资金	22,067,101,373.49	22,067,101,373.49	
衍生金融资产	44,886,178.50	44,886,178.50	
存出保证金	2,198,713,113.45	2,198,713,113.45	
应收款项	198,105,519.85	198,105,519.85	



应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	11,196,667,010.73	11,196,667,010.73	
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	26,950,179,078.85	26,950,179,078.85	
债权投资			
其他债权投资	18,522,040,228.79	18,522,040,228.79	
其他权益工具投资	7,308,610,637.77	7,308,610,637.77	
长期股权投资	5,788,748,524.18	5,788,748,524.18	
投资性房地产	22,109,185.15	22,109,185.15	
固定资产	259,727,177.29	259,727,177.29	
在建工程			
无形资产	147,642,114.57	147,642,114.57	
商誉			
递延所得税资产	738,822,745.44	738,822,745.44	
其他资产	645,065,297.19	645,065,297.19	
资产总计	127,262,774,926.70	127,262,774,926.70	
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款	4,535,023,662.45	4,535,023,662.45	
拆入资金	3,017,622,384.62	3,017,622,384.62	
交易性金融负债	122,439,240.00	122,439,240.00	
衍生金融负债	5,238,711.52	5,238,711.52	
卖出回购金融资产款	28,521,214,843.67	28,521,214,843.67	
代理买卖证券款	26,566,508,275.40	26,566,508,275.40	
代理承销证券款			
应付职工薪酬	1,474,231,886.12	1,474,231,886.12	
应交税费	342,308,537.05	342,308,537.05	
应付款项	125,904,209.71	125,904,209.71	
合同负债			
持有待售负债			
预计负债	219,298.85	219,298.85	
长期借款			
应付债券	28,676,476,588.94	28,676,476,588.94	
其中：优先股			
永续债			
递延收益	1,057,206.47	1,057,206.47	
递延所得税负债	284,598,146.09	284,598,146.09	
其他负债	488,375,291.57	488,375,291.57	
负债合计	94,161,218,282.46	94,161,218,282.46	
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	6,271,763,180.00	6,271,763,180.00	
其他权益工具	6,000,000,000.00	6,000,000,000.00	
其中：优先股			
永续债	6,000,000,000.00	6,000,000,000.00	
资本公积	10,625,500,133.53	10,625,500,133.53	
减：库存股			

其他综合收益	158,228,395.88	158,228,395.88	
盈余公积	1,841,381,170.73	1,841,381,170.73	
一般风险准备	4,726,422,013.25	4,726,422,013.25	
未分配利润	3,478,261,750.85	3,478,261,750.85	
所有者权益（或股东权益）合计	33,101,556,644.24	33,101,556,644.24	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	127,262,774,926.70	127,262,774,926.70	

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

(4)、2020年起首次执行新收入准则追溯调整前期比较数据的说明

适用 不适用

49. 其他

适用 不适用

50. 主要税种及税率

主要税种及税率情况

适用 不适用

税种	计税依据	税率
增值税	应纳增值税额（应纳税额按应纳税销售额乘以适用税率扣除当期允许抵扣的进项税后的余额计算）	6%、5%、3%、13%、9%、2%、7.7%
城市维护建设税	应缴流转税额	7%、5%
教育费附加	应缴流转税额	3%
地方教育费附加	应缴流转税额	2%、1%
企业所得税	应纳税所得额	25%、16.5%、24.16%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

适用 不适用

纳税主体名称	所得税税率（%）
公司及所属境内子公司的企业所得税税率	25%
本公司设立于香港的子公司	16.5%
本公司设立于瑞士的子公司	24.16%

51. 税收优惠

适用 不适用

52. 其他

适用 不适用

六、合并财务报表项目注释

1、货币资金

适用 不适用

单位：元

项目	期末	期初
----	----	----

	外币金额	折算率	折人民币 金额	外币金额	折算率	折人民币 金额
现金：	/	/	328,699.96	/	/	69,716.12
人民币	/	/	160,990.12	/	/	69,513.49
美元	23,654.18	7.07950	167,459.77			
港币	273.77	0.91344	250.07	226.20	0.89578	202.63
其他						
银行存款：	/	/	39,839,516,638.48	/	/	30,905,947,162.99
其中：自有 资金	/	/	7,933,298,448.64	/	/	4,738,974,026.30
人民币	/	/	6,839,586,473.75	/	/	3,667,612,283.68
美元	72,634,127.33	7.07950	514,213,304.43	22,587,225.38	6.97620	157,573,001.70
港币	614,685,800.07	0.91344	561,478,597.21	973,879,630.77	0.89578	872,381,895.65
其他			18,020,073.25			41,406,845.27
客户资金	/	/	31,906,218,189.84	/	/	26,166,973,136.69
人民币	/	/	30,943,979,257.07	/	/	25,217,081,985.48
美元	33,923,784.03	7.07950	240,163,429.04	19,019,377.29	6.97620	132,682,979.85
港币	790,494,753.43	0.91344	722,069,527.58	888,840,557.66	0.89578	796,205,594.74
其他			5,976.15			21,002,576.62
其他货币资 金：	/	/		/	/	10,629,890.50
人民币	/	/		/	/	10,629,890.50
美元						
港币						
其他						
减：减值准 备			599,216.34			599,216.34
合计	/	/	39,839,246,122.10	/	/	30,916,047,553.27

其中，融资融券业务：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币 金额	外币金额	折算率	折人民币 金额
自有信用资金	/	/	86,328,469.93	/	/	220,998,335.58
人民币	/	/	86,328,469.93	/	/	220,998,335.58
美元						
港元						
客户信用资金	/	/	3,695,397,628.91	/	/	2,632,132,447.14
人民币	/	/	3,695,397,628.91	/	/	2,632,132,447.14
美元						
港元						
合计	/	/	3,781,726,098.84	/	/	2,853,130,782.72

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

√适用 □不适用

截至报告期末，子公司中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司因诉讼被冻结货币资金 5,397,373.73 元，子公司鲁证期货股份有限公司因诉讼被冻结货币资金 6,000,000.00 元，使用受限制。

货币资金的说明：

□适用 √不适用

2、 结算备付金  
适用 不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
公司自有备付金：	/	/	1,767,002,967.56	/	/	2,229,982,495.95
人民币	/	/	1,767,002,967.56	/	/	2,229,982,495.95
美元						
港元						
公司信用备付金：	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
美元						
港元						
客户普通备付金：	/	/	4,471,712,801.13	/	/	3,956,793,016.52
人民币	/	/	4,415,606,939.90	/	/	3,895,789,198.52
美元	5,326,666.31	7.07950	37,710,134.14	6,254,240.74	6.97620	43,630,834.25
港元	20,138,955.04	0.91344	18,395,727.09	19,394,252.77	0.89578	17,372,983.75
客户信用备付金：	/	/	767,484,372.73	/	/	576,545,126.31
人民币	/	/	767,484,372.73	/	/	576,545,126.31
美元						
港元						
合计	/	/	7,006,200,141.42	/	/	6,763,320,638.78

结算备付金的说明：

截至期末，本集团无使用受限的结算备付金。

3、 贵金属  
适用 不适用

4、 拆出资金  
适用 不适用

5、 融出资金  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	23,663,981,055.25	22,243,521,663.24
其中：个人	21,792,938,133.42	19,994,028,698.06
机构	1,871,042,921.83	2,249,492,965.18
减：减值准备	189,075,745.60	176,420,289.75
账面价值小计	23,474,905,309.65	22,067,101,373.49
境外	1,365,671,696.62	1,356,822,455.26
其中：个人	845,632,803.07	646,056,270.67
机构	520,038,893.55	710,766,184.59
减：减值准备	183,493,073.06	175,049,962.40

账面价值小计	1,182,178,623.56	1,181,772,492.86
账面价值合计	24,657,083,933.21	23,248,873,866.35

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	3,997,088,188.60	3,057,083,447.14
债券	114,468,229.44	101,089,023.20
股票	76,032,927,342.80	70,725,738,353.12
基金	2,256,637,245.42	963,335,589.40
合计	82,401,121,006.26	74,847,246,412.86

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

截至期末，第一阶段的融出资金账面余额为 24,351,821,595.10 元，第二阶段的融出资金账面余额为 110,598,093.64 元，第三阶段的融出资金账面余额为 567,233,063.13 元，相关预期信用损失减值准备情况详见本节“六、合并财务报表项目注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

融出资金的说明：

适用 不适用

本集团的担保物不存在逾期情况。

截至期末，融出资金受限情况见本节“六、合并财务报表项目注释 75、所有权或使用权受到限制的资产汇总表”。

6、衍生金融工具  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末			期初		
	非套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
资产		负债	资产		负债	
利率衍生工具（按类别列示）	56,360,000,000.00	62,118.51		33,320,000,000.00		
利率互换业务	56,360,000,000.00	62,118.51		33,320,000,000.00		
权益衍生工具（按类别列示）	3,067,109,584.22	75,139,458.85		1,727,020,792.97	38,125,175.57	819,872.96
股指期货业务	967,178,060.00			938,290,376.87		
权益互换业务	2,099,931,524.22	75,139,458.85		788,730,416.10	38,125,175.57	819,872.96
信用衍生工具（按类别列示）	74,750,000.00	2,613,482.34		84,750,000.00	3,135,712.96	
其他衍生工具（按类别列示）	14,806,286,419.90	13,071,166.23	29,604,661.53	17,572,642,097.86	58,018,279.73	50,961,234.39
场内期权业务	2,709,914,500.00	8,262,929.28	13,128,843.38	2,381,858,711.40	25,690,575.50	21,686,679.10
场外期权业务	9,355,246,253.95	1,121,831.71	14,797,426.84	8,040,696,239.95	24,099,178.76	27,875,813.57
场内商品期货合约	319,726,410.00			4,434,296,985.23		
场外商品期货合约				59,296,560.20		595,600.25
场内金融期货合约	378,780,307.90	3,439,093.25	287,993.52			

中泰证券股份有限公司

国债期货	2,027,960,498.41		10,181.20	2,418,050,529.02	50,031.43	37,491.47
远期合约				238,443,072.06	8,178,494.04	765,650.00
收益互换合同	14,658,449.64	247,311.99	1,380,216.59			
合计	74,308,146,004.12	90,886,225.93	29,604,661.53	52,704,412,890.83	99,279,168.26	51,781,107.35

已抵销的衍生金融工具：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	抵销前总额	抵销金额	抵销后净额
场内商品期货合约	1,458,550.08	-1,458,550.08	
股指期货合约	-54,641,366.25	54,641,366.25	
国债期货合约	-3,666,900.00	3,666,900.00	
利率互换	-116,785,498.66	116,785,498.66	
合计	-173,635,214.83	173,635,214.83	

7、存出保证金

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末账面余额			期初账面余额		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
交易保证金	/	/	5,994,560,188.92	/	/	4,004,542,599.53
其中：人民币	/	/	5,992,687,568.92	/	/	3,953,348,266.36
美元	200,000.00	7.07950	1,415,900.00	200,000.00	6.97620	1,395,240.00
港元	500,000.00	0.91344	456,720.00	55,592,995.12	0.89578	49,799,093.17
信用保证金	/	/	593,849,788.87	/	/	863,764,311.65
其中：人民币	/	/	588,578,320.98	/	/	863,764,311.65
美元						
港元	5,771,006.18	0.91344	5,271,467.89			
履约保证金	/	/	803,074,794.13	/	/	1,031,896,444.18
其中：人民币	/	/	759,222,851.70	/	/	1,027,760,022.87
美元	6,194,214.62	7.07950	43,851,942.43			
港元				4,617,675.44	0.89578	4,136,421.31
其他保证金						4,117,700.00
其中：人民币						
美元						
港币				4,596,776.00	0.89578	4,117,700.00
合计	/	/	7,391,484,771.92	/	/	5,904,321,055.36

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的存出保证金余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

8、应收款项

(1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收清算款	26,498,330.18	180,956,540.82
应收资产管理费	23,004,525.25	32,766,476.47
应收手续费及佣金	208,038,337.67	122,308,387.20
应收经纪及交易商	95,220,800.84	180,861,173.02
应收客户交易款	38,018,519.43	55,611,053.80
应收客户款	174,455,336.04	206,470,000.00



应收融资融券客户款	85,091,669.00	91,310,235.60
应收场外期权客户资金	7,880,296.80	26,612,984.95
应收金融资产转让款	303,873,780.83	
其他	5,667,275.65	17,053,600.06
合计	967,748,871.69	913,950,451.92
减：坏账准备(按简化模型计提)	219,665,378.89	231,104,578.06
减：坏账准备(按一般模型计提)		
应收款项账面价值	748,083,492.80	682,845,873.86

(2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	占账面 余额合 计比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	占账面 余额合 计比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内	865,780,085.44	89.46	127,465,174.65	14.72	800,267,994.16	87.57	130,493,368.71	16.31
1-2年	78,055,652.00	8.07	68,527,069.99	87.79	104,053,075.41	11.38	92,400,356.23	88.80
2-3年	17,930,047.77	1.85	17,930,047.77	100.00	1,219,075.82	0.13	690,767.08	56.66
3年以上	5,983,086.48	0.62	5,743,086.48	95.99	8,410,306.53	0.92	7,520,086.04	89.42
合计	967,748,871.69	100.00	219,665,378.89	—	913,950,451.92	100.00	231,104,578.06	—

(3) 按计提坏账列示  
 √适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备:								
单项计提坏账准备	841,417,922.59	86.95	210,941,604.24	25.07	749,099,238.77	81.96	217,030,625.62	28.97
单项计小计	841,417,922.59	86.95	210,941,604.24	25.07	749,099,238.77	81.96	217,030,625.62	28.97
组合计提坏账准备:								
其中: 1年以内	117,836,267.09	12.17	5,890,838.25	5.00	144,953,697.16	15.87	7,247,684.86	5.00
1-2年	6,604,682.01	0.68	1,320,936.40	20.00	14,565,898.98	1.59	2,913,179.80	20.00
2-3年					880,514.56	0.10	352,205.82	40.00
3-4年	1,220,000.00	0.13	976,000.00	80.00	3,781,102.45	0.41	3,024,881.96	80.00
4-5年	670,000.00	0.07	536,000.00	80.00	670,000.00	0.07	536,000.00	80.00
5年以上								
组合小计	126,330,949.10	13.05	8,723,774.65	6.91	164,851,213.15	18.04	14,073,952.44	8.54
合计	967,748,871.69	100.00	219,665,378.89	—	913,950,451.92	100.00	231,104,578.06	—

(4) 截至期末, 本集团应收款项前五名合计金额为 480,890,701.60 元, 占应收款项总额的比例为 49.69%, 明细如下:

单位: 元 币种: 人民币

单位名称	金额	账龄	占应收款项总额的比例 (%)	款项性质
Fine Mean Investments Limited	213,742,863.07	1 年以内	22.09	应收金融资产转让款
李某	121,770,000.00	1-2 年	12.58	应收客户款
Champsword Limited	65,859,003.27	1 年以内	6.81	应收金融资产转让款
上海力珩投资中心(有限合伙)	42,575,235.21	1-2 年	4.40	应收客户款
野村证券	36,943,600.05	1 年以内	3.82	应收经纪及交易商
合计	480,890,701.60		49.69	

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明:

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明:

适用 不适用

**9、 应收款项融资**

适用 不适用

**10、 合同资产**

(1). 合同资产情况

适用 不适用

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

适用 不适用

(3). 本期合同资产计提减值准备情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

**11、 买入返售金融资产**

(1) 按业务类别

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	8,395,147,776.92	10,460,249,930.63
债券质押式回购	2,547,104,292.12	2,107,701,083.35
债券买断式回购	40,103,723.54	29,696,900.00
其他		30,255,658.33
减: 减值准备	99,856,898.16	55,240,401.94
账面价值合计	10,882,498,894.42	12,572,663,170.37

## (2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票	8,395,147,776.92	10,460,249,930.63
债券	2,587,208,015.66	2,137,397,983.35
其他		30,255,658.33
减：减值准备	99,856,898.16	55,240,401.94
买入返售金融资产账面价值	10,882,498,894.42	12,572,663,170.37

## (3) 担保物金额

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票质押式回购	26,626,440,623.60	27,770,519,452.98
债券质押式回购	2,781,959,638.40	2,365,381,365.10
债券买断式回购	97,952,179.89	57,432,156.76
标准仓单		33,518,464.58
合计	29,506,352,441.89	30,226,851,439.42
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	97,952,179.89	57,432,156.76
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	97,952,179.89	54,239,679.79

## (4) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

√适用 □不适用

## 1) 债券质押式回购按剩余期限分类

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	2,547,104,292.12	2,107,701,083.35
一个月至三个月内		
三个月至一年内		
一年以上		
合计	2,547,104,292.12	2,107,701,083.35

## 2) 股票质押式回购按剩余期限分类

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	1,527,261,777.45	1,393,180,242.55
一个月至三个月内	1,404,690,000.00	1,393,201,848.50
三个月至六个月内	2,761,110,000.00	2,915,527,327.55
六个月至一年内	1,786,340,000.00	3,249,250,000.00
一年以上	915,745,999.47	1,509,090,512.03
合计	8,395,147,776.92	10,460,249,930.63

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

阶段	期末账面余额	期末减值准备余额	期末账面价值
第一阶段	10,239,073,851.25	6,736,119.84	10,232,337,731.41
第二阶段			
第三阶段	743,281,941.33	93,120,778.32	650,161,163.01
合计	10,982,355,792.58	99,856,898.16	10,882,498,894.42

(续)

阶段	期初账面余额	期初减值准备余额	期初账面价值
第一阶段	11,686,442,993.23	10,035,282.66	11,676,407,710.57
第二阶段			
第三阶段	941,460,579.08	45,205,119.28	896,255,459.80
合计	12,627,903,572.31	55,240,401.94	12,572,663,170.37

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

买入返售金融资产的说明：

适用 不适用

12、持有待售资产

适用 不适用

13、交易性金融资产

√适用 □不适用

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

期末余额						
类别	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	初始成本合计
债券	26,145,211,891.27		26,145,211,891.27	25,919,685,617.09		25,919,685,617.09
公募基金	1,261,356,008.33		1,261,356,008.33	1,209,046,921.16		1,209,046,921.16
股票	2,395,917,366.57		2,395,917,366.57	2,151,137,542.18		2,151,137,542.18
银行理财产品	761,197,475.59		761,197,475.59	760,000,000.00		760,000,000.00
券商资管产品	1,762,192,949.72		1,762,192,949.72	1,794,645,774.06		1,794,645,774.06
信托计划	141,897,570.17		141,897,570.17	147,757,367.38		147,757,367.38
其他	1,548,469,515.84		1,548,469,515.84	1,515,991,078.70		1,515,991,078.70
合计	34,016,242,777.49		34,016,242,777.49	33,498,264,300.57		33,498,264,300.57
期初余额						
类别	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	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	初始成本合计
债券	24,610,853,138.29		24,610,853,138.29	24,660,849,185.26		24,660,849,185.26
公募基金	3,344,418,894.67		3,344,418,894.67	3,291,178,632.68		3,291,178,632.68
股票	2,707,803,206.11		2,707,803,206.11	2,637,945,923.76		2,637,945,923.76
银行理财产品	365,930,323.43		365,930,323.43	341,600,166.52		341,600,166.52
券商资管产品	1,414,476,068.50		1,414,476,068.50	1,457,362,794.90		1,457,362,794.90
信托计划	195,487,786.00		195,487,786.00	197,853,008.00		197,853,008.00
其他	703,871,018.15		703,871,018.15	684,930,033.10		684,930,033.10
合计	33,342,840,435.15		33,342,840,435.15	33,271,719,744.22		33,271,719,744.22

## (2) 交易性金融资产中已融出证券情况

项目	期末公允价值	期初公允价值
股票	11,944,098.08	21,051,041.45
基金	414,263,511.28	260,821,255.02
合计	426,207,609.36	281,872,296.47

注：融出证券担保情况详见本节“六、合并财务报表项目注释 5、融出资金”。

## (3) 存在限售期的交易性金融资产情况

证券名称	限售解禁日	期末公允价值
证券 A	待定	77,811,600.00
证券 B	待定	47,520,000.00
证券 C	2022-1-5	29,142,501.65
合计		154,474,101.65

对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的描述性说明

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

存在承诺条件的交易性金融资产情况见本节“六、合并财务报表项目注释 75、所有权或使用权受到限制的资产汇总表”。

## 14、 债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额				期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
国债								
地方债								
金融债								
企业债	4,229,968,419.48	52,611,896.78	3,270,597.55	4,279,309,718.71	4,208,681,096.60	33,322,336.50	3,207,366.45	4,238,796,066.65
其他								
合计	4,229,968,419.48	52,611,896.78	3,270,597.55	4,279,309,718.71	4,208,681,096.60	33,322,336.50	3,207,366.45	4,238,796,066.65

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

参见本节“六、合并财务报表项目注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

对本期发生损失准备变动的债权投资余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

其他说明：

存在承诺条件的债权投资情况见本节“六、合并财务报表项目注释 75、所有权或使用权受到限制的资产汇总表”。



15、其他债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债										
地方债	4,144,352,727.73	91,396,626.41	21,511,268.27	4,257,260,622.41	456,592.97	4,011,462,408.99	52,332,260.00	39,801,535.01	4,103,596,204.00	443,747.86
金融债						5,088,338,414.08	107,358,068.68	29,266,040.42	5,224,962,523.18	498,447.67
企业债	5,714,637,680.59	119,216,198.87	14,918,291.84	5,848,772,171.30	137,440,091.49	4,355,812,684.68	110,777,015.88	-7,700,081.96	4,458,889,618.60	131,451,291.95
其他	5,180,488,951.57	142,474,721.00	-40,625,659.57	5,282,338,013.00	139,359,929.18	4,638,687,853.34	113,267,114.01	-17,363,084.34	4,734,591,883.01	119,229,658.12
合计	15,039,479,359.89	353,087,546.28	-4,196,099.46	15,388,370,806.71	277,256,613.64	18,094,301,361.09	383,734,458.57	44,004,409.13	18,522,040,228.79	251,623,145.60

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

参见本节“六、合并财务报表项目注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

其他说明：

存在承诺条件的其他债权投资情况见本节“六、合并财务报表项目注释 75、所有权或使用权受到限制的资产汇总表”。

## 16、其他权益工具投资

## (1). 按项目披露

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
证金公司专户资金	3,434,400,000.00	3,417,769,409.21		3,434,400,000.00	3,521,864,834.75	225,471,667.18	非交易目的持有
非交易性权益工具	3,141,978,752.99	2,414,042,468.72	10,114,554.75	2,936,354,316.53	1,988,913,975.33	39,596,311.63	非交易目的持有
合计	6,576,378,752.99	5,831,811,877.93	10,114,554.75	6,370,754,316.53	5,510,778,810.08	265,067,978.81	/

截至期末，本集团将部分权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资，指定原因为非交易性目的持有，主要包括对中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）的专户投资、以战略为目的持有的股票及股权投资，以融出证券为目的持有的基金投资。证金公司专户投资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。

## (2). 本期终止确认的其他权益工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期终止确认时的公允价值	本期股利收入	终止确认时的累计利得或损失本期从其他综合收益转入留存收益的金额	处置该项投资的原因
股票	1,383,158,352.13		-30,820,898.51	战略调整
其他	75,592,252.08		-4,336,049.29	战略调整
合计	1,458,750,604.21		-35,156,947.80	/

## (3). 存在限售期的其他权益工具投资情况

单位：元 币种：人民币

证券名称	限售解禁日	期末公允价值
证券 D	2020-7-21	57,712,960.00
合计		57,712,960.00

## (4). 其他权益工具投资中已融出证券情况

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
基金	542,963,412.68	240,901,742.62
合计	542,963,412.68	240,901,742.62

其他说明：

√适用 □不适用

存在承诺条件的其他权益工具投资情况见本节“六、合并财务报表项目注释 75、所有权或使用权受到限制的资产汇总表”。

融出证券的担保情况见本节“六、合并财务报表项目注释 5、融出资金”。

## 17、长期股权投资

√适用 □不适用

## (1). 按类别列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
按成本法核算长期股权投资		
按权益法核算长期股权投资	748,522,210.18	684,413,394.65
其中：对联营企业的投资	748,522,210.18	684,413,394.65
长期股权投资合计	748,522,210.18	684,413,394.65
减：长期股权投资减值准备		
长期股权投资净值	748,522,210.18	684,413,394.65

## (2). 按权益法核算的长期股权投资

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	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损益	其他综合收益调整	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		
一、合营企业											
小计											
二、联营企业											
万家基金管理有限公司	411,514,507.93			46,131,078.04						457,645,585.97	
齐鲁股权交易中心有限公司	105,142,772.33			2,823,182.81						107,965,955.14	
日照大宗商品交易中心有限公司	27,634,490.46			2,433,898.59						30,068,389.05	
上海鲁证锋通经贸有限公司	18,618,873.55			-106,709.70						18,512,163.85	
山东交易市场清算所有限公司	11,536,900.58			-970,857.04						10,566,043.54	
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	11,429,311.66			-138,373.96						11,290,937.70	
深圳市沧金投资合伙企业（有限合伙）	29,998,109.40			0.07						29,998,109.47	
山东中泰天使创业投资基金企业（有限合伙）	5,482,684.80			-377,542.87	5,383,546.89					10,488,688.82	
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	37,944,312.66			-670,809.21	-167.64					37,273,335.81	
山东中泰齐东信息产业发 展投资中心（有限合伙）	11,790,873.00			-430,545.65	58,510.58					11,418,837.93	
深圳市沧鑫投资合伙企业（有限合伙）	99,995.32			-2.22						99,993.10	
山东红牛金融服务有限公司	0.00									0.00	
威海中泰齐东蓝色并购投	10,364,516.26			76,280.70						10,440,796.96	

中泰证券股份有限公司

资中心（有限合伙）										
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	2,856,046.70			-602,673.86						2,253,372.84
青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业（有限合伙）		10,500,000.00								10,500,000.00
小计	684,413,394.65	10,500,000.00		48,166,925.70	5,441,889.83					748,522,210.18
合计	684,413,394.65	10,500,000.00		48,166,925.70	5,441,889.83					748,522,210.18

其他说明

联营企业的重要会计政策、会计估计与公司的会计政策、会计估计无重大差异。

## 18、投资性房地产

## 投资性房地产计量模式

## (1). 采用成本计量模式的投资性房地产

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	土地使用权	在建工程	合计
一、账面原值				
1.期初余额	554,040,223.83			554,040,223.83
2.本期增加金额				
(1) 外购				
(2) 存货\固定资产\在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3.本期减少金额	8,856,559.92			8,856,559.92
(1) 处置	8,856,559.92			8,856,559.92
(2) 其他转出				
4.期末余额	545,183,663.91			545,183,663.91
二、累计折旧和累计摊销				
1.期初余额	75,477,167.48			75,477,167.48
2.本期增加金额	8,342,952.10			8,342,952.10
(1) 计提或摊销	8,342,952.10			8,342,952.10
3.本期减少金额	6,077,050.53			6,077,050.53
(1) 处置	6,077,050.53			6,077,050.53
(2) 其他转出				
4.期末余额	77,743,069.05			77,743,069.05
三、减值准备				
1.期初余额				
2.本期增加金额				
(1) 计提				
3、本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4.期末余额				
四、账面价值				
1.期末账面价值	467,440,594.86			467,440,594.86
2.期初账面价值	478,563,056.35			478,563,056.35

## (2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
烟台南大街 104 号、105 号	17,585,483.00	正在确权诉讼中
德州解放南路 18 号	2,014,825.88	因土地纠纷尚未解决，正在解决办理
合计	19,600,308.88	

## 其他说明

□适用 √不适用

## 19、固定资产

## (1). 账面价值

单位：元 币种：人民币

项目	期末金额	期初金额
固定资产原值	2,007,123,153.85	1,994,195,686.20
减：累计折旧	1,100,647,049.30	1,071,609,940.81
固定资产减值准备		
固定资产账面价值合计	906,476,104.55	922,585,745.39

## (2). 固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	电子设备	办公设备	其他	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	1,069,464,051.38	698,922,642.68	112,513,154.96	113,295,837.18	1,994,195,686.20
2. 本年增加金额		44,325,004.53	1,707,411.28	1,025,369.95	47,057,785.76
(1) 购置		44,325,004.53	1,707,411.28	1,025,369.95	47,057,785.76
(2) 在建工程转入					
(3) 其他					
3. 本年减少金额	19,860,911.70	11,770,466.40	805,776.54	1,941,393.86	34,378,548.50
(1) 处置或报废	19,860,911.70	11,770,466.40	805,776.54	1,941,393.86	34,378,548.50
(2) 转为投资性房地产					
(3) 其他					
4. 外币报表折算差额		149,254.01	20,613.93	78,362.45	248,230.39
5. 期末余额	1,049,603,139.68	731,626,434.82	113,435,403.63	112,458,175.72	2,007,123,153.85
二、累计折旧					
1. 期初余额	344,663,738.61	544,573,154.86	90,655,444.84	91,717,602.50	1,071,609,940.81
2. 本年增加金额	3,504,413.98	40,367,813.45	3,288,587.79	3,112,915.23	50,273,730.45
(1) 计提	3,504,413.98	40,367,813.45	3,288,587.79	3,112,915.23	50,273,730.45
(2) 其他					
3. 本年减少金额	6,927,305.43	11,863,688.33	764,620.35	1,825,794.58	21,381,408.69
(1) 处置或报废	6,927,305.43	11,863,688.33	764,620.35	1,825,794.58	21,381,408.69
(2) 转为投资性房地产					
(3) 其他					
4. 外币报表折算差额		81,892.91	15,399.09	47,494.73	144,786.73
5. 期末余额	341,240,847.16	573,159,172.89	93,194,811.37	93,052,217.88	1,100,647,049.30
三、减值准备					
1. 期初余额					
2. 本年增加金额					
(1) 计提					



(2) 企业合并增加					
3. 本年减少金额					
(1) 处置或报废					
4. 外币报表折算差额					
5. 期末余额					
四、账面价值					
1. 期末账面价值	708,362,292.52	158,467,261.93	20,240,592.26	19,405,957.84	906,476,104.55
2. 期初账面价值	724,800,312.77	154,349,487.82	21,857,710.12	21,578,234.68	922,585,745.39

(3). 暂时闲置的固定资产情况

适用 不适用

(4). 通过融资租赁租入的固定资产情况

适用 不适用

(5). 通过经营租赁租出的固定资产

适用 不适用

(6). 未办妥产权证书的固定资产情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

截至期末，资产担保情况见本节“六、合并财务报表项目注释 75、所有权或使用权受到限制的资产汇总表”。

**20、在建工程**

(1). 在建工程情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
财富中心	6,011,702.87		6,011,702.87	6,011,702.87		6,011,702.87
合计	6,011,702.87		6,011,702.87	6,011,702.87		6,011,702.87

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

适用 不适用

(3). 本期计提在建工程减值准备情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

21、使用权资产

适用 不适用

22、无形资产

(1). 无形资产情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	土地使用权	软件	交易席位费	商标使用权	其他	合计
一、账面原值						
1.期初余额	58,968,314.18	519,447,410.15	44,692,394.38	2,622,200.00	141,200.00	625,871,518.71
2.本期增加金额		35,554,646.66				35,554,646.66
(1)购置		35,554,646.66				35,554,646.66
(2)内部研发						
(3)企业合并增加						
3.本期减少金额						
(1)处置						
4.外币报表折算差额		387,799.96	17,660.00			405,459.96
5.期末余额	58,968,314.18	555,389,856.77	44,710,054.38	2,622,200.00	141,200.00	661,831,625.33
二、累计摊销						
1.期初余额	22,354,424.72	357,984,333.19	43,796,614.38	2,622,200.00	68,246.57	426,825,818.86
2.本期增加金额	192,714.06	31,195,433.55			14,119.98	31,402,267.59
(1)计提	192,714.06	31,195,433.55			14,119.98	31,402,267.59
3.本期减少金额						

(1)处置						
4.外币报表折算差额		139,344.11				139,344.11
5.期末余额	22,547,138.78	389,319,110.85	43,796,614.38	2,622,200.00	82,366.55	458,367,430.56
三、减值准备						
1.期初余额						
2.本期增加金额						
(1) 计提						
3.本期减少金额						
(1)处置						
4.期末余额						
四、账面价值						
1.期末账面价值	36,421,175.40	166,070,745.92	913,440.00		58,833.45	203,464,194.77
2.期初账面价值	36,613,889.46	161,463,076.96	895,780.00		72,953.43	199,045,699.85

(2). 未办妥产权证书的土地使用权情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

**23、商誉**

(1). 商誉账面原值

适用 不适用

(2). 商誉减值准备

适用 不适用

(3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息

适用 不适用

(4). 说明商誉减值测试过程、关键参数（例如预计未来现金流量现值时的预测期增长率、稳定期增长率、利润率、折现率、预测期等，如适用）及商誉减值损失的确认方法

适用 不适用

(5). 商誉减值测试的影响

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

**24、递延所得税资产/ 递延所得税负债**

(1). 未经抵销的递延所得税资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	1,346,400,194.83	336,600,048.72	1,424,626,032.58	356,156,508.14
坏账准备	336,889,671.76	84,222,417.94	340,232,637.94	85,058,159.50
其他权益工具投资公允价值变动	410,915,916.18	102,728,979.06	464,239,295.32	116,059,823.84
其他债权投资减值准备	277,256,613.64	69,314,153.41	251,623,145.60	62,905,786.40
融资融券减值准备	189,075,745.60	47,268,936.40	176,420,289.75	44,105,072.44
其他	901,349,583.42	225,337,395.88	1,024,996,963.72	252,535,871.42
合计	3,461,887,725.43	865,471,931.41	3,682,138,364.91	916,821,221.74

(2). 未经抵销的递延所得税负债

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
预提利息收入	951,912,271.36	238,084,344.28	992,556,904.07	248,139,226.04
其他债权投资公允价值变动			67,646,063.73	16,905,851.70
结构化主体并表	313,133,772.87	78,283,514.65	203,868,389.50	50,967,097.39
其他	1,601,052.04	400,263.01	36,329,733.87	9,082,433.47
合计	1,266,647,096.27	316,768,121.94	1,300,401,091.17	325,094,608.60

(3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产		865,471,931.41	4,508,409.35	912,312,812.39
递延所得税负债		316,768,121.94	4,508,409.35	320,586,199.25

(4). 未确认递延所得税资产明细

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣亏损	14,172,318.26	1,911,892.39
坏账准备	1,483,560.52	1,354,015.30
融出资金减值准备	183,493,073.06	175,049,962.40
债权投资减值准备	3,270,597.55	3,207,366.45
应收利息及其他资产减值准备	211,295,733.12	153,787,270.69
合计	413,715,282.51	335,310,507.23

(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

年份	期末金额	期初金额	备注
2021年			
2022年			
2023年			
2024年		27,410.68	
无到期日	14,172,318.26	1,884,481.71	
合计	14,172,318.26	1,911,892.39	/

其他说明：

□适用 √不适用

25、其他资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
应收利息	49,193,763.99	61,662,063.25
应收股利	24,813,072.43	8,042,126.76
其他应收款	292,736,070.61	177,392,248.84
长期待摊费用	67,168,838.94	79,074,728.85
待摊费用	72,992,142.02	68,979,948.69
预付济南高新控股购房款	366,000,000.00	366,000,000.00
其他预付款项	45,093,134.17	114,469,264.97

项目融资款	13,701,595.69	13,436,700.00
存货	24,864,559.20	307,723,641.63
会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00
融资租赁及保理业务应收款	232,809,504.09	340,987,027.96
待抵扣进项税	3,301,941.71	36,601,086.51
预缴所得税	9,355,443.14	49,190.42
其他	114,278,414.32	32,592,404.79
合计	1,317,708,480.31	1,608,410,432.67

其他应收款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

款项性质	期末账面余额	期初账面余额
质押券兑息	31,349,302.00	2,331,000.00
借款	48,561,323.16	48,561,323.16
押金	34,855,825.88	34,765,096.55
预付款项	124,307,091.46	79,308,176.40
其他	172,634,176.00	122,908,727.91
合计	411,707,718.50	287,874,324.02

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

√适用 □不适用

参见本节“六、合并财务报表项目注释 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

其他资产的说明：

(1). 其他资产-其他应收款

1)

按明细列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
其他应收款余额	411,707,718.50	287,874,324.02
减：坏账准备	118,971,647.89	110,482,075.18
其他应收款账面价值	292,736,070.61	177,392,248.84

2) 按账龄分析

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
1 年以内	256,506,001.30	62.30	1,061,226.40	0.41
1-2 年	27,945,874.88	6.79	4,777,079.75	17.09
2-3 年	13,555,787.78	3.29	5,421,515.11	39.99

3-4 年	63,225,652.33	15.36	59,652,786.50	94.35
4-5 年	12,076,810.38	2.93	9,661,448.30	80.00
5 年以上	38,397,591.83	9.33	38,397,591.83	100.00
合计	411,707,718.50	100.00	118,971,647.89	—

(续)

项目	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
1 年以内	154,474,456.37	53.67	5,054,329.53	3.27
1-2 年	19,782,080.86	6.87	3,956,016.17	20.00
2-3 年	14,580,472.57	5.06	5,512,189.03	37.81
3-4 年	68,439,242.24	23.77	67,085,017.65	98.02
4-5 年	6,908,029.59	2.40	5,526,423.67	80.00
5 年以上	23,690,042.39	8.23	23,348,099.13	98.56
合计	287,874,324.02	100.00	110,482,075.18	—

## 3) 按种类分析

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备	210,189,943.47	51.05	61,668,119.30	29.34
组合计提坏账准备	201,517,775.03	48.95	57,303,528.59	28.44
其中：1 年以内	117,668,870.38	28.59	5,883,443.52	5.00
1-2 年	23,885,398.75	5.80	4,777,079.75	20.00
2-3 年	13,553,787.78	3.29	5,421,515.11	40.00
3-4 年	13,864,329.17	3.37	11,091,463.34	80.00
4-5 年	12,076,810.38	2.93	9,661,448.30	80.00
5 年以上	20,468,578.57	4.97	20,468,578.57	100.00
合计	411,707,718.50	100.00	118,971,647.89	—

(续)

项目	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备	125,272,433.85	43.52	62,121,744.58	49.59
组合计提坏账准备	162,601,890.17	56.48	48,360,330.60	29.74
其中：1年以内	92,014,085.08	31.96	4,600,704.25	5.00
1-2年	19,780,080.86	6.87	3,956,016.17	20.00
2-3年	13,780,472.57	4.79	5,512,189.03	40.00
3-4年	6,771,122.94	2.35	5,416,898.35	80.00
4-5年	6,908,029.59	2.40	5,526,423.67	80.00
5年以上	23,348,099.13	8.11	23,348,099.13	100.00
合计	287,874,324.02	100.00	110,482,075.18	—

4) 截至期末，本集团其他应收款前 5 名合计金额为 124,354,475.34 元，占其他应收款的比例为 30.20%，明细如下：

单位：元 币种：人民币

单位名称	金额	账龄	占其他应收款项总额的比例 (%)	款项性质
北京百瑞文化传媒有限公司	48,561,323.16	3-4年	11.80	借款
中国证券登记结算有限公司	31,349,302.00	1年以内	7.61	清算款
Zhongtai Taifeng Multi-Strategy SPC-Zhongtai-Hungsing Selected IPO Fund SP	18,268,800.00	1年以内	4.44	暂付款
北京聚信量化科技有限公司	13,106,796.14	3-4年	3.18	暂付款
大连商品交易所	13,068,254.04	1年以内	3.17	期货和保险业务扶持资金、办会支持资金
合计	124,354,475.34		30.20	

(2). 其他资产-长期待摊费用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	本期增加	本期摊销	本期其他减少	期末金额
固定资产改良支出	52,448,182.90	5,900,254.99	13,929,515.53		44,418,922.36
其他	26,626,545.95	5,114,363.75	8,990,993.12		22,749,916.58
合计	79,074,728.85	11,014,618.74	22,920,508.65		67,168,838.94



## (3). 应收利息的减值准备情况

项目	期末余额	期初余额
应收利息余额	97,450,911.94	110,179,802.82
减：减值准备	48,257,147.95	48,517,739.57
应收利息账面价值	49,193,763.99	61,662,063.25

重要的逾期利息明细如下：

单位：元 币种：人民币

融资单位	期末余额	计提减值金额	逾期天数	减值判断依据	减值计提依据
北京百瑞文化传媒有限公司	11,654,717.56	11,654,717.56	182 天	债务人发生逾期	债务人经营异常、通过登记的住所或者经营场所无法联系
皇月国际有限公司	10,482,457.49	10,482,457.49	超过 3 年	债务人发生重大财务困难	法律文件及其抵押冻结资产价值
Moselle Worldwide Limited 和 China Fortune Investment Holdings Limited	10,482,457.49	10,482,457.49	超过 3 年	债务人逾期	债务重组协议
合计	32,619,632.54	32,619,632.54			

## 26、 融券业务情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	969,171,022.04	522,774,039.09
—交易性金融资产	426,207,609.36	281,872,296.47
—其他权益工具投资	542,963,412.68	240,901,742.62
—转融通融入证券		
转融通融入证券总额	866,099,640.05	59,484,271.00

融券业务违约情况：

√适用 □不适用

截至期末，公司融券业务均未发生违约。

## 27、资产减值准备变动表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少		汇率影响	期末余额
			转回	转/核销		
货币资金减值准备	599,216.34					599,216.34
融出资金减值准备	351,470,252.15	17,603,742.64			3,494,823.87	372,568,818.66
应收款项坏账准备	231,104,578.06	-11,403,830.45		164,913.94	129,545.22	219,665,378.89
买入返售金融资产减值准备	55,240,401.94	44,616,496.22				99,856,898.16
债权投资减值准备	3,207,366.45				63,231.10	3,270,597.55
其他债权投资减值准备	251,623,145.60	26,845,015.60		1,211,547.56		277,256,613.64
其他应收款坏账准备	110,482,075.18	8,489,542.30			30.41	118,971,647.89
其他资产（除其他应收款）减值准备	182,985,316.48	50,598,885.56			3,439,280.13	237,023,482.17
金融工具及其他项目信用减值准备小计	1,186,712,352.20	136,749,851.87		1,376,461.50	7,126,910.73	1,329,212,653.30
长期股权投资减值准备						
投资性房地产减值准备						
固定资产减值准备						
在建工程减值准备						
无形资产减值准备						
商誉减值准备						
其他资产减值准备小计						
合计	1,186,712,352.20	136,749,851.87		1,376,461.50	7,126,910.73	1,329,212,653.30

## 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

金融工具类别	期末余额			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
货币资金减值准备	599,216.34			599,216.34
融出资金减值准备	25,632,687.42	1,010,675.71	345,925,455.53	372,568,818.66
应收款项坏账准备(简化模型)	/	8,723,774.65	210,941,604.24	219,665,378.89
买入返售金融资产减值准备	6,736,119.84		93,120,778.32	99,856,898.16
债权投资减值准备	3,270,597.55			3,270,597.55
其他债权投资减值准备	1,642,107.88		275,614,505.76	277,256,613.64
其他应收款坏账准备	5,432,607.00	49,968,882.87	63,570,158.02	118,971,647.89
其他资产(除其他应收款)减值准备	1,665,706.76		235,357,775.41	237,023,482.17
合计	44,979,042.79	59,703,333.23	1,224,530,277.28	1,329,212,653.30
金融工具类别	期初余额			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
货币资金减值准备	599,216.34			599,216.34
融出资金减值准备	24,170,589.41	991,136.12	326,308,526.62	351,470,252.15
应收款项坏账准备(简化模型)	/	14,073,952.44	217,030,625.62	231,104,578.06
买入返售金融资产减值准备	10,035,282.66		45,205,119.28	55,240,401.94
债权投资减值准备	3,207,366.45			3,207,366.45
其他债权投资减值准备	1,905,184.20		249,717,961.40	251,623,145.60
其他应收款坏账准备	3,130,724.78	92,342,515.54	15,008,834.86	110,482,075.18
其他资产(除其他应收款)减值准备	139,601.67	11,654,717.56	171,190,997.25	182,985,316.48
合计	43,187,965.51	119,062,321.66	1,024,462,065.03	1,186,712,352.20

## 29、短期借款

(1). 短期借款分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款		
抵押借款	91,344,000.00	

信用借款	4,744,201,025.65	2,336,285,179.05
保证+质押借款		21,168,983.75
保证借款		1,148,389,960.00
合计	4,835,545,025.65	3,505,844,122.80

(2). 已逾期未偿还的短期借款情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

30、应付短期融资款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率(%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
短期收益凭证	8,505,109,203.00	2019-7-8~2020-6-30	14~365	8,505,109,203.00	2.30~7.00/固定利率	914,645,854.23	8,573,160,702.77	5,105,431,553.62	4,382,375,003.38
中泰证券股份有限公司 2019年度第二期短期融资券	3,000,000,000.00	2019-10-17	91	3,000,000,000.00	2.98	3,018,614,794.52	3,613,074.33	3,022,227,868.85	
中泰证券股份有限公司 2020年度第一期短期融资券	3,000,000,000.00	2020-4-3	90	3,000,000,000.00	1.59		3,011,528,219.18		3,011,528,219.18
中泰证券股份有限公司 2020年度第二期短期融资券	1,500,000,000.00	2020-4-22	90	1,500,000,000.00	1.50		1,504,315,068.49		1,504,315,068.49
私募票据	49,556,500.00	2020-3-10	184	49,556,500.00	5.90		50,468,292.08		50,468,292.08
私募票据	141,590,000.00	2020-3-17	184	141,590,000.00	5.80		143,991,314.41		143,991,314.41
私募票据	353,975,000.00	2020-3-18	184	353,975,000.00	6.00		360,125,781.92		360,125,781.92
合计	/	/	/	16,550,230,703.00	/	3,933,260,648.75	13,647,202,453.18	8,127,659,422.47	9,452,803,679.46

## 31、拆入资金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
银行拆入资金		
转融通融入资金	2,028,533,403.82	3,017,622,384.62
其他	587,520,620.64	558,735,343.34
合计	2,616,054,024.46	3,576,357,727.96

转融通融入资金：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

剩余期限	期末		期初	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1个月以内	1,015,762,893.41	3.25%	503,970,119.78	3.55%
1至3个月	1,012,770,510.41	3.25%		
3至12个月			2,513,652,264.84	3.25%
1年以上				
合计	2,028,533,403.82	/	3,017,622,384.62	/

## 32、交易性金融负债

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	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	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	合计	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	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	合计
债券	8,059,562.30		8,059,562.30	345,533,249.36		345,533,249.36
合作套保业务客户资金				257,151.09		257,151.09
其他	778,901.85	4,457,191.07	5,236,092.92			
合计	8,838,464.15	4,457,191.07	13,295,655.22	345,790,400.45		345,790,400.45

对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的描述性说明：

√适用 □不适用

子公司中泰国际发行的结构性票据，其公允价值取决于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 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且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入其他综合收益

□适用 √不适用

(3) 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且自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入当期损益

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

## 33、卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
质押式报价回购	91,328,000.00	
买断式卖出回购	469,531,686.46	584,439,330.37
质押式卖出回购	23,308,855,396.39	24,403,669,433.93
资产收益权转让		508,183,561.64
其他质押式回购		
合计	23,869,715,082.85	25,496,292,325.94

(2) 按金融资产种类  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	23,869,715,082.85	24,988,108,764.30
资产收益权转让		508,183,561.64
合计	23,869,715,082.85	25,496,292,325.94

(3) 担保物金额  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	27,900,643,758.91	28,173,414,139.27
信用业务债权收益权		551,712,255.60
标准仓单		
合计	27,900,643,758.91	28,725,126,394.87

(4) 报价回购融入资金按剩余期限分类  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	利率区间	期初账面余额	利率区间
一个月内	89,336,000.00	2.20%-3.00%		
一个月至三个月内				
三个月至一年内	1,992,000.00			
一年以上				
合计	91,328,000.00			

卖出回购金融资产款的说明：

适用 不适用

34、代理买卖证券款  
适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
普通经纪业务		

其中：个人	29,099,006,826.56	24,908,451,398.42
机构	7,697,436,930.69	5,150,551,651.18
小计	36,796,443,757.25	30,059,003,049.60
信用业务		
其中：个人	4,070,623,433.31	3,115,034,408.67
机构	755,462,629.79	320,435,248.93
小计	4,826,086,063.10	3,435,469,657.60
合计	41,622,529,820.35	33,494,472,707.20

35、代理承销证券款

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票		
债券	864,177.93	2,754,987.94
其中：国债		
金融债券		
企业债券	864,177.93	2,754,987.94
其他有价证券		
合计	864,177.93	2,754,987.94

36、应付职工薪酬

(1). 应付职工薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,734,912,105.82	1,583,781,435.79	1,649,491,305.10	1,669,202,236.51
二、离职后福利-设定提存计划	1,037,820.30	45,567,137.78	45,752,778.73	852,179.35
三、辞退福利	150,640,684.94	700,300.06	20,139,421.46	131,201,563.54
合计	1,886,590,611.06	1,630,048,873.63	1,715,383,505.29	1,801,255,979.40

(2). 短期薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,420,937,738.95	1,413,250,757.53	1,488,475,267.89	1,345,713,228.59
二、职工福利费		10,235,531.43	10,017,633.62	217,897.81
三、社会保险费	247,302.86	35,209,869.19	35,310,925.92	146,246.13
其中：医疗保险费	222,795.26	33,527,802.93	33,619,724.96	130,873.23
工伤保险费	6,089.78	430,489.57	431,805.52	4,773.83
生育保险费	18,417.82	1,251,576.69	1,259,395.44	10,599.07
四、住房公积金	79,535.75	67,296,645.73	67,244,756.82	131,424.66
五、工会经费和职工教育经费	313,647,528.26	57,414,490.24	48,068,579.18	322,993,439.32
六、短期带薪缺勤				
七、其他短期薪酬		374,141.67	374,141.67	
合计	1,734,912,105.82	1,583,781,435.79	1,649,491,305.10	1,669,202,236.51



## (3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	1,021,785.58	43,885,162.90	44,062,251.67	844,696.81
2、失业保险费	16,034.72	1,681,974.88	1,690,527.06	7,482.54
合计	1,037,820.30	45,567,137.78	45,752,778.73	852,179.35

## (4). 辞退福利

项目	年初余额	本年增加	本年减少	年末余额
辞退福利	150,640,684.94	700,300.06	20,139,421.46	131,201,563.54
合计	150,640,684.94	700,300.06	20,139,421.46	131,201,563.54

其他说明:

□适用 √不适用

## 37、 应交税费

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末余额	期初余额
增值税	26,296,289.44	36,294,357.73
企业所得税	207,776,307.61	168,158,112.16
城市维护建设税	6,309,984.98	6,158,461.00
教育费附加及地方教育费附加	4,521,549.28	4,709,643.13
个人所得税	104,684,237.42	33,242,929.10
代扣代缴限售股所得税	54,220,437.02	160,249,463.58
其他	8,665,198.50	6,332,383.72
合计	412,474,004.25	415,145,350.42

## 38、 应付款项

## (1). 应付款项列示

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末余额	期初余额
客户现金股利	18,691,358.58	13,917,338.03
资金三方存管费	17,384,574.21	19,168,995.82
应付资管产品管理费或佣金	95,171,153.60	39,895,656.19
经纪人佣金	12,414,684.66	19,271,152.97
清算款	163,023,800.43	8,062,061.39
应付场外期权客户资金	99,326,799.51	175,012,778.40
股票收益互换客户保证金	173,524,629.69	51,334,052.00
其他	136,308,707.19	46,278,552.44
合计	715,845,707.87	372,940,587.24

## (2). 应付票据

□适用 √不适用

其他说明：

适用 不适用

**39、合同负债**

(1). 合同负债情况

适用 不适用

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

**40、持有待售负债**

适用 不适用

**41、预计负债**

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因及经济利益流出不确定性的说明
未决诉讼	219,298.85	254,267.44		473,566.29	未决诉讼
合计	219,298.85	254,267.44		473,566.29	/

**42、长期借款**

(1). 长期借款分类

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款		30,455,691.00
抵押借款	264,450,069.54	284,455,478.44
保证+质押借款	9,720,003.06	27,590,011.58
信用借款		
合计	274,170,072.60	342,501,181.02

其他说明，包括利率区间：

适用 不适用

本集团的长期借款利率区间为 4%至 7%。本集团以位于济南经七路证券大厦 86 号济房权证中字第 296343-296345、296347-296349、296352-296363 号 18 个房产提供 3 亿元最高额抵押担保，账面价值为 260,446,739.04 元。

43、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	债券名称	面值	起息日期	到期日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)
长期收益凭证	长期收益凭证		2019-1-2~2019-12-20	2020-1-3~2021-12-21	366~733 天	600,955,943.00	3.65~4.20
长期收益凭证	长期收益凭证		2019-4-4~2019-12-30	2020-4-3~2020-12-29	366~369 天	76,530,000.00	浮动利率
长期收益凭证	长期收益凭证		2020-1-6~2020-6-22	2021-4-13~2022-6-20	366~735 天	28,425,278.00	3.10~4.10
长期收益凭证	长期收益凭证		2020-1-6~2020-6-22	2021-1-6~2021-6-23	366~370 天	133,963,394.00	浮动利率
次级债	齐鲁证券有限公司 2015 年第一期次级债券	100.00	2015-4-23	2020-4-23	5 年	3,100,000,000.00	5.90
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券（第一期）	100.00	2019-1-24	2022-1-24	3 年	2,000,000,000.00	4.14
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券（第二期）	100.00	2019-3-11	2022-3-11	3 年	2,000,000,000.00	4.30
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券（第三期）	100.00	2019-5-28	2022-5-28	3 年	4,000,000,000.00	4.30
公司债	2014 年齐鲁证券有限公司债券	100.00	2015-1-29	2020-1-29	5 年	857,889,000.00	5.20
公司债	齐鲁证券有限公司 2015 年公司债券	100.00	2015-8-28	2020-8-28	5 年	2,459,000,000.00	4.50
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2017 年公司债券（第一期）	100.00	2017-9-13	2020-9-13	3 年	3,000,000,000.00	5.00
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券（第一期）	100.00	2018-2-6	2021-2-6	3 年	2,000,000,000.00	5.80
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券（第二期）	100.00	2018-4-26	2021-4-26	3 年	2,000,000,000.00	5.10
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券（第一期）	100.00	2018-12-12	2021-12-12	3 年	3,000,000,000.00	3.95
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券（第一期）	100.00	2019-8-8	2022-8-8	3 年	900,000,000.00	3.57
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券（第二期）	100.00	2019-12-9	2022-12-9	3 年	2,000,000,000.00	3.56
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2020 年公司债券（第一期）	100.00	2020-3-17	2022-3-17	2 年	1,600,000,000.00	3.08
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第一期）（疫情防控债）	100.00	2020-6-19	2023-6-19	3 年	1,500,000,000.00	3.27

中泰证券股份有限公司

公司债	ZHONGTAI INT'L BOND 2017 (BVI) CO LTD. 4.25% GUAR. B2020	100.00	2017-8-25	2020-8-24	3 年	2,092,860,000.00	4.25
公司债	Zhongtai Intl Finance (BVI) co ltd. 5.4% 24mar2020, USD (XS1946330336)	100.00	2019-3-26	2020-3-24	364 天	1,395,240,000.00	5.40

(续上表)

债券类型	债券名称	期初余额	本期增加	溢折价摊销	本期偿还	汇率影响	期末余额
长期收益凭证	长期收益凭证	610,271,214.18	16,946,224.84		113,112,922.18		514,104,516.84
长期收益凭证	长期收益凭证	78,459,939.26			78,459,939.26		
长期收益凭证	长期收益凭证		28,775,370.68				28,775,370.68
长期收益凭证	长期收益凭证		135,577,567.18				135,577,567.18
次级债	齐鲁证券有限公司 2015 年第一期次级债券	3,227,278,356.16	55,621,643.84		3,282,900,000.00		
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券 (第一期)	2,074,982,961.55	41,286,575.35	626,635.45	82,800,000.00		2,034,096,172.35
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券 (第二期)	2,066,984,581.16	42,882,191.78	626,635.45	86,000,000.00		2,024,493,408.39
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券 (第三期)	4,096,675,881.84	85,764,383.56	1,253,270.90	172,000,000.00		4,011,693,536.30
公司债	2014 年齐鲁证券有限公司债券	899,191,622.10	3,299,934.67	7,671.23	902,499,228.00		
公司债	齐鲁证券有限公司 2015 年公司债券	2,497,501,876.71	55,175,917.81				2,552,677,794.52
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2017 年公司债券 (第一期)	3,043,878,182.93	74,794,520.55	939,953.17			3,119,612,656.65
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券 (第一期)	2,103,088,101.19	57,841,095.89	664,233.58	116,000,000.00		2,045,593,430.66
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券 (第二期)	2,068,103,889.61	50,860,273.97	664,233.58	102,000,000.00		2,017,628,397.16
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券 (第一期)	3,000,977,381.51	59,087,671.24	1,409,929.76			3,061,474,982.51
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券 (第一期)	909,168,364.82	16,020,986.30	704,964.88			925,894,316.00
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行	1,999,914,235.92	35,502,465.76	774,828.47			2,036,191,530.15

中泰证券股份有限公司

	2019 年公司债券（第二期）						
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2020 年公司债券(第一期)		1,613,911,452.05	57,534.25			1,613,968,986.30
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第一期）（疫情防控债）		1,500,712,602.74	900,000.00			1,501,612,602.74
公司债	ZHONGTAI INT'L BOND 2017 (BVI) CO LTD. 4.25% GUAR. B2020	2,110,228,210.18	30,739,708.34			14,193,866.81	2,155,161,785.33
公司债	Zhongtai Intl Finance (BVI) co ltd. 5.4% 24mar2020, USD (XS1946330336)	1,425,576,636.73			1,415,900,000.00	-9,676,636.73	
合计		32,212,281,435.85	3,904,800,586.55	8,629,890.72	6,351,672,089.44	4,517,230.08	29,778,557,053.76

## 44、租赁负债

□适用 √不适用

## 45、递延收益

√适用 □不适用

单位：元 币种人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因
政府补助	1,057,206.47			1,057,206.47	国资监管信息系统补助
合计	1,057,206.47			1,057,206.47	/

涉及政府补助的项目：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

负债项目	期初余额	本期新增补助金额	本期计入营业外收入金额	本期计入其他收益金额	其他变动	期末余额	与资产相关/与收益相关
国资监管信息系统补助	1,057,206.47					1,057,206.47	与资产相关

其他说明：

□适用 √不适用

## 46、其他负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	450,657,916.99	338,762,505.41
应付股利	14,235,270.00	228,435,270.00
预提费用	84,876,336.79	24,746,659.81
期货风险准备金	109,404,602.81	105,473,959.80
其他主体中其他持有人权益	4,888,059,581.69	4,719,653,345.10
预收款项	13,996,339.10	15,153,509.81
应付债券借贷利息	3,024,317.92	1,678,164.39
其他	110,124,484.81	214,803,266.81
合计	5,674,378,850.11	5,648,706,681.13

其他应付款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
资管产品保证金	199,836,992.30	56,360,043.30
交易所会员年费	46,537,538.44	
党组织工作经费	43,265,127.41	31,873,121.69
经纪人风险准备金	22,805,458.40	23,115,954.09

应付工会组织款项	5,679.80	1,293,451.90
应拨付休眠账户基金		5,517,439.75
其他	138,207,120.64	220,602,494.68
合计	450,657,916.99	338,762,505.41

## 47、股本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	6,271,763,180.00	696,862,576.00				696,862,576.00	6,968,625,756.00

其他说明：

2020年4月17日，经中国证监会核准（证监许可[2020]736号），公司获准向社会公开发行人民币普通股（A股）股票696,862,576.00股，每股面值1元。2020年5月20日，公司通过向社会公开发行人民币普通股696,862,576.00股，发行价格人民币4.38元，募集资金合计3,052,258,082.88元。上述募集资金扣除承销费用、保荐费用以及累计发生的其他相关发行费用后，募集资金净额人民币2,924,280,854.03元。其中增加股本为人民币696,862,576.00元，增加资本公积为人民币2,227,418,278.03元。

## 48、其他权益工具

(1) 其他金融工具划分至其他权益工具的基本情况（划分依据、主要条款和股利或利息的设定机制等）

√适用 □不适用

经中国证监会批准，公司于2015年5月28日发行齐鲁证券有限公司2015年第一期永续次级债（15齐鲁Y1），面值总额为人民币60亿元，债券面值为100元；15齐鲁Y1无到期日，但本公司有权于永续债第5个和其后每个付息日按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回该债券。永续债票面利率在前5个计息年度内保持不变。如本公司未行使赎回权，自第6个计息年度起，永续债每5年重置一次票面利率，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。当期基准利率为票面利率重置日前5个工作日中国债券信息网上公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中代偿期为5年的国债收益率算术平均值。

除非发生强制付息事件，债券的每个付息日，本公司可自行选择将当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息推迟到下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制。强制付息事件是指付息日前12个月，公司向普通股股东分红或减少注册资本。当发生强制付息事件时，本公司不得递延当期利息及已经递延的所有利息及其孳息。

公司发行的永续债合同明确规定，本期债券设置发行人续期选择权，不设投资者回售选择权；除非发行人结业、倒闭或清算，投资者不能要求发行人加速偿还本期债券的本金，发行方清算时永续债劣后于发行方发行的普通债券和其他债务，故将发行的永续债列为权益工具。

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

发行在外的金融工具	期初	本期增加	本期减少	期末
	账面价值	账面价值	账面价值	账面价值
永续次级债	6,000,000,000.00		6,000,000,000.00	
合计	6,000,000,000.00		6,000,000,000.00	

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

√适用 □不适用

永续次级债的本期减少系公司于 2020 年 5 月 26 日兑付全部本金。

其他说明：

□适用 √不适用

49、资本公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价（股本溢价）	10,855,948,851.28	2,227,418,278.03		13,083,367,129.31
其他资本公积	1,616,185.42			1,616,185.42
合计	10,857,565,036.70	2,227,418,278.03		13,084,983,314.73

其他说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期增加原因见本节“六、合并财务报表项目注释 47、股本”。

50、库存股

□适用 √不适用



51、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期发生金额						税后归属于少数股东	期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司		
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-762,117,072.40	33,581,608.37	6,056,617.61		-35,156,947.80	62,681,938.56	62,657,999.72	23,938.84	-699,459,072.68
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益	-51,284,351.31	5,441,889.83				5,441,889.83	5,417,950.99	23,938.84	-45,866,400.32
其他权益工具投资公允价值变动	-710,832,721.09	28,139,718.54	6,056,617.61		-35,156,947.80	57,240,048.73	57,240,048.73		-653,592,672.36
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	332,776,751.22	-299,416.05	-11,863,445.79	1,211,547.56		10,352,482.18	10,409,152.27	-56,670.09	343,185,903.49
其中：权益法下可转损益的其他综合收益									
其他债权投资公允价值变动	33,003,306.85	-48,200,508.59	-12,050,127.15			-36,150,381.44	-36,150,381.44		-3,147,074.59
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用减值准备	251,623,145.60	26,845,015.60		1,211,547.56		25,633,468.04	25,633,468.04		277,256,613.64
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	48,150,298.77	21,056,076.94	186,681.36			20,869,395.58	20,926,065.67	-56,670.09	69,076,364.44
其他综合收益合计	-429,340,321.18	33,282,192.32	-5,806,828.18	1,211,547.56	-35,156,947.80	73,034,420.74	73,067,151.99	-32,731.25	-356,273,169.19

项目	期初余额	上期发生金额						税后归属于少数股东	期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司		

中泰证券股份有限公司

一、不能重分类进损益的其他综合收益	-1,641,357,849.28	451,552,131.61	130,556,731.47			-563,323,389.01	884,318,789.15	884,151,476.95	167,312.20	-757,206,372.33
其中：重新计量设定受益计划变动额										
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	-1,641,357,849.28	451,552,131.61	130,556,731.47			-563,323,389.01	884,318,789.15	884,151,476.95	167,312.20	-757,206,372.33
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	238,408,470.34	45,619,890.11	-6,007,189.81	58,037,932.54		9,773,528.34	-16,184,380.96	-15,614,976.51	-569,404.45	222,793,493.83
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	10,554,464.58	-19,701,243.66				9,773,528.34	-29,474,772.00	-28,981,819.45	-492,952.55	-18,427,354.87
其他债权投资公允价值变动	28,060,365.78	7,879,530.69	-6,007,189.81	30,927,101.24			-17,040,380.74	-17,040,380.74		11,019,985.04
金融资产重分类计入其他综合收益的金额										
其他债权投资信用减值准备	193,337,066.83	49,383,319.52		27,110,831.30			22,272,488.22	22,272,488.22		215,609,555.05
现金流量套期储备										
外币财务报表折算差额	6,456,573.15	8,058,283.56					8,058,283.56	8,134,735.46	-76,451.90	14,591,308.61
其他综合收益合计	-1,402,949,378.94	497,172,021.72	124,549,541.66	58,037,932.54		-553,549,860.67	868,134,408.19	868,536,500.44	-402,092.25	-534,412,878.50

## 52、 盈余公积

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	1,189,015,129.86		2,238,508.39	1,186,776,621.47
任意盈余公积	650,200,238.90			650,200,238.90
合计	1,839,215,368.76		2,238,508.39	1,836,976,860.37

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

法定盈余公积的本期减少系出售其他权益工具投资结转留存收益所致。

## 53、 一般风险准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	2,525,486,848.98	4,426,406.25	10		2,529,913,255.23
交易风险准备	2,298,190,982.74	19,967,423.74	10		2,318,158,406.48
合计	4,823,677,831.72	24,393,829.99			4,848,071,661.71

一般风险准备的说明

一般风险准备按照公募基金管理费收入的 10%计提，交易风险准备按照资管子公司净利润的 10%计提。

## 54、 未分配利润

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上年度
调整前上期末未分配利润	4,546,698,234.15	3,945,354,653.48
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		26,436,440.86
调整后期初未分配利润	4,546,698,234.15	3,971,791,094.34
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,383,125,268.50	2,249,463,067.12
减：提取法定盈余公积		202,988,882.19
提取任意盈余公积		101,494,441.09
提取一般风险准备	24,393,829.99	241,936,084.50
应付普通股股利		202,988,882.19
转作股本的普通股股利		
分配永续次级债利息	142,800,000.00	357,000,000.00
其他综合收益结转留存收益	32,918,439.41	578,506,208.29
其他		-10,358,570.95
期末未分配利润	5,729,711,233.25	4,546,698,234.15

## 55、 利息净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	2,369,969,303.16	2,324,816,014.05
其中：货币资金及结算备付金利息收入	528,059,318.10	451,236,927.78
拆出资金利息收入		
融出资金利息收入	878,069,647.52	796,480,705.63
买入返售金融资产利息收入	399,366,660.14	609,414,959.59
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	311,761,916.12	521,324,932.02
债权投资利息收入	168,629,624.77	133,452,616.87
其他债权投资利息收入	394,515,008.50	331,424,742.52
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	1,329,044.13	2,806,061.66
利息支出	1,322,313,590.71	1,598,445,612.69
其中：短期借款利息支出	82,894,597.60	73,918,490.63
应付短期融资款利息支出	103,304,980.45	103,479,035.65
拆入资金利息支出	67,856,050.20	54,037,425.38
其中：转融通利息支出	60,445,973.19	45,988,809.57
卖出回购金融资产款利息支出	302,960,854.52	408,184,038.81
其中：报价回购利息支出	1,760,295.45	
代理买卖证券款利息支出	78,792,549.66	65,133,899.94
长期借款利息支出	8,256,960.58	17,147,419.15
应付债券利息支出	670,638,006.88	849,250,027.84
其中：次级债券利息支出	228,061,336.33	503,953,328.15
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出		
其他利息支出	7,609,590.82	27,295,275.29
利息净收入	1,047,655,712.45	726,370,401.36

## 56、手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1.证券经纪业务净收入	1,518,341,295.64	1,299,863,380.36
证券经纪业务收入	2,148,668,429.85	1,709,837,190.77
其中：代理买卖证券业务	1,841,399,575.26	1,542,323,843.10
交易单元席位租赁	257,650,182.62	136,947,198.57
代销金融产品业务	49,618,671.97	30,566,149.10
证券经纪业务支出	630,327,134.21	409,973,810.41
其中：代理买卖证券业务	598,408,550.83	389,721,766.18
交易单元席位租赁	28,074,810.40	18,029,842.95
代销金融产品业务	3,843,772.98	2,222,201.28
2.期货经纪业务净收入	84,439,019.00	57,308,695.99
期货经纪业务收入	188,932,845.50	183,034,618.14

期货经纪业务支出	104,493,826.50	125,725,922.15
3.投资银行业务净收入	477,612,811.84	512,995,702.77
投资银行业务收入	479,149,707.57	542,756,558.48
其中：证券承销业务	382,035,757.40	384,615,520.83
证券保荐业务	7,641,509.42	4,569,341.42
财务顾问业务	89,472,440.75	153,571,696.23
投资银行业务支出	1,536,895.73	29,760,855.71
其中：证券承销业务	451,990.18	29,760,855.71
证券保荐业务	990,565.93	
财务顾问业务	94,339.62	
4.资产管理业务净收入	150,247,506.93	200,573,491.02
资产管理业务收入	150,247,506.93	200,573,491.02
资产管理业务支出		
5.基金管理业务净收入	17,252,903.17	24,970,735.52
基金管理业务收入	17,252,903.17	24,970,735.52
基金管理业务支出		
6.投资咨询业务净收入	55,230,914.02	32,764,391.37
投资咨询业务收入	55,230,914.02	32,774,898.16
投资咨询业务支出		10,506.79
7.其他手续费及佣金净收入	12,098,010.10	8,034,137.63
其他手续费及佣金收入	23,197,812.46	21,481,160.14
其他手续费及佣金支出	11,099,802.36	13,447,022.51
合计	2,315,222,460.70	2,136,510,534.66
其中：手续费及佣金收入	3,062,680,119.50	2,715,428,652.23
手续费及佣金支出	747,457,658.80	578,918,117.57

(2) 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	13,349,056.60	10,943,396.22
并购重组财务顾问业务净收入--其他	2,688,679.25	
其他财务顾问业务净收入	73,340,365.28	142,628,300.01

(3) 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	99,317,953,498.22	45,774,884.36	76,498,904,514.12	28,609,635.47
银行理财产品				
信托			418,590,000.00	1,956,513.63
其他	20,156,319.70	3,843,787.61		
合计	99,338,109,817.92	49,618,671.97	76,917,494,514.12	30,566,149.10

(4) 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	60	154	3
期末客户数量	115,769	154	13
其中：个人客户	115,423	19	
机构客户	346	135	13
期初受托资金	32,812,321,748.46	87,788,740,597.46	465,000,000.00
其中：自有资金投入	223,244,535.19		
个人客户	22,988,941,464.87	1,408,382,040.72	
机构客户	9,600,135,748.40	86,380,358,556.74	465,000,000.00
期末受托资金	28,963,290,910.92	81,457,126,826.40	1,541,000,000.00
其中：自有资金投入	522,244,515.19		
个人客户	20,911,975,512.39	1,385,627,737.35	
机构客户	7,529,070,883.34	80,071,499,089.05	1,541,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	26,141,863,702.88	97,948,126,036.49	1,541,000,000.00
其中：股票	5,038,414,062.52	2,766,000,304.14	
国债	255,037,710.58	520,504,340.00	
其他债券	18,742,141,357.40	77,951,978,298.01	
基金	451,179,682.33	3,093,343,368.19	
资产支持证券		2,025,111,447.95	
期货	4,541,757.15	20,398,420.30	
信托计划		396,480,000.00	
专项资产管理计划			
银行承兑汇票			
资产收益权			1,541,000,000.00
协议或定期存款	486,408,227.50		
其他投资	1,164,140,905.40	11,174,309,857.90	
当期资产管理业务净收入	91,962,705.51	57,952,725.83	332,075.59

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

## 57、投资收益

(1) 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	48,166,925.70	30,122,939.54
处置长期股权投资产生的投资收益		-1,344,836.19
金融工具投资收益	907,754,416.07	719,479,245.17
其中：持有期间取得的收益	629,219,057.80	652,041,910.83
— 交易性金融工具	568,771,004.51	589,790,575.79
— 其他权益工具投资	10,114,554.75	23,291,462.04
— 衍生金融工具	50,333,498.54	38,959,873.00
处置金融工具取得的收益	278,535,358.27	67,437,334.34
— 交易性金融工具	162,281,139.69	-14,606,289.67
— 其他债权投资	51,938,696.01	78,593,868.10
— 债权投资		-216,460.83
— 衍生金融工具	64,315,522.57	3,666,216.74

其他		
合计	955,921,341.77	748,257,348.52

(2) 交易性金融工具投资收益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	567,593,565.09	596,125,606.98
	处置取得收益	148,441,972.13	-14,304,019.67
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	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	1,177,439.42	-6,335,031.19
	处置取得收益	13,839,167.56	-302,270.00
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	持有期间收益		

58、净敞口套期收益

□适用 √不适用

59、其他收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助	17,385,417.55	46,071,220.39
个税手续费返还	9,858,166.37	3,249,886.61
合计	27,243,583.92	49,321,107.00

60、公允价值变动收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	-18,109,671.34	648,949,010.80
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	-22,576,934.23	-1,314,927.84
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	-184,435.86	
衍生金融工具	-101,407,660.02	-66,863,651.05
其他		
合计	-142,094,265.59	580,770,431.91

61、其他业务收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
租赁收入	14,359,596.36	26,701,309.86

期现结合业务现货销售收入	530,745,497.19	545,435,518.91
其他收入	38,584,658.30	9,066,657.20
合计	583,689,751.85	581,203,485.97

## 62、资产处置收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
处置固定资产收益	20,333,715.59	10,776.41
合计	20,333,715.59	10,776.41

其他说明：

□适用 √不适用

## 63、税金及附加

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准
城市维护建设税	15,713,423.90	14,694,504.52	7%、5%
教育费附加	11,259,600.09	10,359,659.42	3%、2%、1%
水利建设基金	935,074.51	921,425.63	1%、0.5%
房产税	7,035,280.77	7,049,771.29	按实际缴纳
土地使用税	426,000.89	427,356.33	按实际缴纳
车船使用税	11,830.99	11,150.00	按实际缴纳
印花税	588,411.99	1,112,615.89	按实际缴纳
其他	2,407.81		按实际缴纳
合计	35,972,030.95	34,576,483.08	/

## 64、业务及管理费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	1,630,048,873.63	1,773,884,126.69
租赁费	148,423,602.95	141,383,850.82
折旧费	50,273,730.45	61,209,072.06
交易所会员年费	46,955,142.21	18,054,027.85
电子设备运转费	46,187,487.19	36,764,653.69
咨询信息费	40,819,087.99	46,745,454.02
无形资产摊销	31,402,267.59	28,872,324.75
通讯费	27,675,853.76	26,603,098.00
广告费	25,045,547.82	13,159,088.11
长期待摊费用摊销	22,920,508.65	23,716,284.35
业务招待费	18,906,760.24	26,926,210.65
投资者保护基金	18,747,899.34	34,428,878.47
物业管理费	17,588,653.91	19,359,897.77
差旅费	13,949,090.94	37,873,780.17



安全防范费	3,802,732.65	4,038,052.76
其他	162,721,633.28	166,352,856.13
合计	2,305,468,872.60	2,459,371,656.29

65、信用减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
应收款项/其他应收款坏账损失	-2,914,288.15	18,663,025.70
买入返售金融资产减值损失	44,616,496.22	115,692,339.70
融出资金减值损失	17,603,742.64	28,392,550.16
债权投资减值损失		-1,052,893.76
其他债权投资减值损失	26,845,015.60	49,383,319.52
其他资产减值损失	50,598,885.56	22,082,005.63
合计	136,749,851.87	233,160,346.95

66、其他资产减值损失

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
存货跌价损失		-2,705,089.87
合计		-2,705,089.87

67、其他业务成本

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
投资性房地产折旧额	8,342,952.10	8,910,149.68
期现结合业务现货销售成本	557,885,737.36	545,945,630.43
其他	1,113,292.41	307,005.01
合计	567,341,981.87	555,162,785.12

68、营业外收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得合计	171.52		171.52
其中：固定资产处置利得	171.52		171.52
无形资产处置利得			
债务重组利得			
非货币性资产交换利得			
接受捐赠			
政府补助			
其他	2,515,803.43	1,870,252.90	2,515,803.43
合计	2,515,974.95	1,870,252.90	2,515,974.95

计入当期损益的政府补助

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

69、营业外支出

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	444,212.85	324,958.83	444,212.85
其中：固定资产处置损失	444,212.85	324,958.83	444,212.85
无形资产处置损失			
债务重组损失			
非货币性资产交换损失			
对外捐赠	10,312,000.00	6,013,400.00	10,312,000.00
预计负债			
其他	548,033.50	1,505,535.33	548,033.50
合计	11,304,246.35	7,843,894.16	11,304,246.35

70、所得税费用

(1) 所得税费用表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	287,144,958.94	344,602,320.40
递延所得税费用	50,953,140.29	-33,546,803.76
合计	338,098,099.23	311,055,516.64

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	1,747,897,054.57
按法定/适用税率计算的所得税费用	436,974,417.52
子公司适用不同税率的影响	2,775,122.82
调整以前期间所得税的影响	8,603,938.63
非应税收入的影响	-120,725,833.18
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	23,095,783.21
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-3,084,805.83
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	26,159,476.06
前期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	
永续次级债利息抵税的影响	-35,700,000.00

所得税费用	338,098,099.23
-------	----------------

其他说明：

适用 不适用

## 71、其他综合收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额					
	本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	合计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东
一、以后不能重分类进损益的其他综合收益	33,581,608.37	6,056,617.61		27,524,990.76	27,501,051.92	23,938.84
重新计量设定受益计划变动额						
权益法下不能转损益的其他综合收益	5,441,889.83			5,441,889.83	5,417,950.99	23,938.84
其他权益工具投资公允价值变动	28,139,718.54	6,056,617.61		22,083,100.93	22,083,100.93	
企业自身信用风险公允价值变动						
二、以后将重分类进损益的其他综合收益	-299,416.05	-11,863,445.79	1,211,547.56	10,352,482.18	10,409,152.27	-56,670.09
权益法下可转损益的其他综合收益						
其他债权投资公允价值变动	-48,200,508.59	-12,050,127.15		-36,150,381.44	-36,150,381.44	
金融资产重分类计入其他综合收益的金额						
其他债权投资信用减值准备	26,845,015.60		1,211,547.56	25,633,468.04	25,633,468.04	
现金流量套期储备						
外币财务报表折算差额	21,056,076.94	186,681.36		20,869,395.58	20,926,065.67	-56,670.09
合计	33,282,192.32	-5,806,828.18	1,211,547.56	37,877,472.94	37,910,204.19	-32,731.25

(续)

项目	上期发生额					
	本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	合计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东
一、以后不能重分类进损益的其他综合收益	451,552,131.61	130,556,731.47		320,995,400.14	320,828,087.94	167,312.20
重新计量设定受益计划变动额						
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	451,552,131.61	130,556,731.47		320,995,400.14	320,828,087.94	167,312.20
企业自身信用风险公允价值变动						
二、以后将重分类进损益的其他综合收益	45,619,890.11	-6,007,189.81	58,037,932.54	-6,410,852.62	-5,841,448.17	-569,404.45
权益法下可转损益的其他综合收益	-19,701,243.66			-19,701,243.66	-19,208,291.11	-492,952.55
其他债权投资公允价值变动	7,879,530.69	-6,007,189.81	30,927,101.24	-17,040,380.74	-17,040,380.74	
金融资产重分类计入其他综合收益的金额						
其他债权投资信用减值准备	49,383,319.52		27,110,831.30	22,272,488.22	22,272,488.22	
现金流量套期储备						
外币财务报表折算差额	8,058,283.56			8,058,283.56	8,134,735.46	-76,451.90
合计	497,172,021.72	124,549,541.66	58,037,932.54	314,584,547.52	314,986,639.77	-402,092.25

## 72、现金流量表项目

(1). 收到的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
期现业务收到的货款	569,246,332.37	886,967,714.43
其他业务收入	50,501,600.92	35,278,851.51
营业外收入、其他收益	28,484,334.17	50,562,912.11
结构化主体其他持有人资金		1,313,010,319.83
股票收益互换客户保证金	122,190,577.69	
融资租赁	52,703,152.43	162,478,089.02
其他	786,009,670.66	398,378,287.62
合计	1,609,135,668.24	2,846,676,174.52

(2). 支付的其他与经营活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付的保证金	1,146,092,980.95	1,908,299,983.42
支付的咨询信息费	37,342,784.52	43,715,645.05
房屋租赁费	187,064,753.31	166,094,409.73
投资者保护基金	917,533.78	42,902,526.10
期现业务支付的货款	498,001,285.92	647,219,418.99
支付的招待费	18,906,760.24	26,926,210.65
支付的办公用品费	6,915,067.29	7,883,010.49
支付的代扣代缴限售股所得税	104,115,771.05	3,279,502.35
结构化主体其他持有人资金	101,883,362.88	121,449,589.44
其他	769,598,445.49	532,571,971.25
合计	2,870,838,745.43	3,500,342,267.47

(3). 收到的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

(4). 支付的其他与投资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
投资支付的费用	541,120.00	
出售子公司产生现金净额		9,673,136.13
合计	541,120.00	9,673,136.13

(5). 收到的其他与筹资活动有关的现金

□适用 √不适用

(6). 支付的其他与筹资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
偿还永续次级债本金	6,000,000,000.00	
少数股东收回投资		20,403,995.00
合计	6,000,000,000.00	20,403,995.00

## 73、现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>		
净利润	1,409,798,955.34	1,223,181,207.38
加：资产减值准备		-2,705,089.87
信用减值损失	136,749,851.87	233,160,346.95
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	70,141,395.03	70,119,221.74
无形资产摊销	30,937,939.71	28,872,324.75
长期待摊费用摊销	22,771,508.67	23,716,284.35
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”号填列)	-20,333,715.59	-10,776.41
固定资产报废损失(收益以“-”号填列)	354,234.43	324,958.83
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	142,094,265.59	-580,770,431.91
利息支出	769,199,642.07	1,045,274,317.71
汇兑损失	5,754,237.43	2,667,538.98
投资损失(收益以“-”号填列)	-540,423,132.78	-622,785,172.33
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	46,840,880.98	24,836,175.35
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	-2,760,870.84	-58,382,979.11
交易性金融资产等的减少(增加以“-”号填列)	-226,544,556.35	-1,834,856,113.30
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-2,995,491,638.89	1,431,617,547.60
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	7,490,718,675.01	8,934,698,752.33
其他		
经营活动产生的现金流量净额	6,339,807,671.68	9,918,958,113.04
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b>		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况：</b>		
现金的期末余额	46,338,487,795.72	42,944,103,092.55
减：现金的期初余额	36,994,295,233.36	30,813,274,515.71

加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	9,344,192,562.36	12,130,828,576.84

(2) 本期支付的取得子公司的现金净额

适用 不适用

(3) 本期收到的处置子公司的现金净额

适用 不适用

(4) 现金和现金等价物的构成

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	46,338,487,795.72	36,994,295,233.36
其中：库存现金	328,699.96	69,716.12
可随时用于支付的银行存款	39,331,958,954.34	30,220,274,987.96
可随时用于支付的其他货币资金		10,629,890.50
结算备付金	7,006,200,141.42	6,763,320,638.78
拆放同业款项		
二、现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	46,338,487,795.72	36,994,295,233.36
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

其他说明：

适用 不适用

74、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

适用 不适用

75、所有权或使用权受到限制的资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	11,397,373.73	司法冻结
交易性金融资产（债券）	14,636,530,019.84	质押用于回购融资
交易性金融资产（股票）	1,002,368,067.92	转融通担保
交易性金融资产（股票）	154,474,101.65	处于限售期
交易性金融资产（债券）	932,489,762.00	债券借贷业务质押



债权投资	327,190,013.69	卖出回购交易质押
债权投资	923,734,168.46	因拆入资金质押
其他债权投资	9,210,900,926.03	卖出回购交易质押
其他债权投资	1,466,217,889.37	债券借贷业务质押
其他权益工具投资	341,845,961.68	转融通担保
其他权益工具投资	57,712,960.00	处于限售期
固定资产	260,446,739.04	因借款抵押
融出资金	3,614,051,235.55	因资产证券化受限
融资租赁及保理业务应收款	26,481,493.76	因借款质押
合计	32,965,840,712.72	

## 76、外币货币性项目

## (1). 外币货币性项目：

√适用 □不适用

## 1) 境外经营实体的主要项目折算汇率

项目	期末	期初
美元	7.07950	6.97620
港币	0.91344	0.89578

## 2) 主要外币货币性项目

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			2,056,118,617.50
其中：美元	106,581,565.54	7.07950	754,544,193.24
港币	1,405,180,827.27	0.91344	1,283,548,374.86
其他			18,026,049.40
结算备付金			56,105,861.23
其中：美元	5,326,666.31	7.07950	37,710,134.14
港币	20,138,955.04	0.91344	18,395,727.09
存出保证金			50,996,030.32
其中：美元	6,394,214.62	7.07950	45,267,842.43
港币	6,271,006.18	0.91344	5,728,187.89
短期借款			4,835,543,503.81
其中：美元	90,024,534.88	7.07950	637,328,694.68
港币	4,596,048,792.62	0.91344	4,198,214,809.13
应付债券			2,155,161,107.06
其中：美元	304,422,785.09	7.07950	2,155,161,107.06
港币			

## (2). 境外经营实体说明，包括对于重要的境外经营实体，应披露其境外主要经营地、记账本位币及选择依据，记账本位币发生变化的还应披露原因。

√适用 □不适用

本公司的子公司中泰金融国际有限公司及其多个子公司主要在香港展业，记账本位币为港

币。

77、套期

适用 不适用

78、政府补助

1. 政府补助基本情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
政府奖励款	2,192,000.00	其他收益	2,192,000.00
财政扶持资金	1,282,000.00	其他收益	1,282,000.00
财政补贴	11,529,070.69	其他收益	11,529,070.69
企业发展基金	1,141,861.18	其他收益	1,141,861.18
增值税免征额	195,570.51	其他收益	195,570.51
其他	1,044,915.17	其他收益	1,044,915.17

2. 政府补助退回情况

适用 不适用

79、其他

适用 不适用

七、资产证券化业务的会计处理

适用 不适用

1 公司不具有控制权但实质上承担其风险的特殊目的主体情况

适用 不适用

八、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

适用 不适用

2、同一控制下企业合并

适用 不适用

3、反向购买

适用 不适用

一揽子交易

适用 不适用

非一揽子交易

适用 不适用

4、处置子公司

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

是否存在通过多次交易分步处置对子公司投资且在本期丧失控制权的情形

适用 不适用

5、其他原因的合并范围变动

说明其他原因导致的合并范围变动（如，新设子公司、清算子公司等）及其相关情况：  
适用 不适用

本集团本年度新设子公司中泰金融日本株式会社（Japan）。

6、其他

适用 不适用

本集团本期纳入合并范围的结构化主体共 4 个，明细见下表。

合并上述结构化主体对本集团本期的财务状况、经营成果和现金流量影响并不重大。

截至期末，上述结构化主体归属于本集团的权益为 298,872,725.63 元，具体情况如下：

单位：元 币种：人民币

结构化主体名称	至期末归属本集团权益
中泰资管 8113 号单一资产管理计划	19,941,188.10
财通基金中泰金融市场委定增 1 号单一资产管理计划	9,999,384.61
华夏基金-稳态 1 号单一资产管理计划	218,871,744.86
中泰资管 16 号单一资产管理计划	50,060,408.06
<b>合计</b>	<b>298,872,725.63</b>

九、在其他主体中的权益

1、在子公司中的权益

(1). 企业集团的构成

适用 不适用

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		取得方式
				直接	间接	
鲁证期货股份有限公司	济南	济南	期货经纪	63.10		设立
中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司	深圳	深圳	投资管理	100		设立
中泰创业投资（深圳）有限公司	深圳	深圳	投资管理	100		设立
齐鲁中泰物业有限公司	莱芜	莱芜	物业管理	100		设立
中泰证券（上海）资产管理有限公司	上海	上海	资产管理	60		设立
中泰金融国际有限公司	香港	香港	金融	100		设立
莱芜中泰股权投资基金（有限合伙）	莱芜	莱芜	投资		20	设立
齐鲁中泰资本管理有限公司	济南	济南	投资		60	设立
深圳市沧水投资合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	投资		95	设立
深圳市沧乐投资合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	投资		99.99	设立

深圳市聚合润邦投资合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	投资		49	设立
莱芜中泰安盈创业投资基金（有限合伙）	莱芜	莱芜	投资		20	设立
中泰国际证券有限公司	香港	香港	金融		100	设立
中泰国际期货有限公司	香港	香港	期货经纪		100	设立
中泰金融投资有限公司	香港	香港	金融		100	设立
中泰国际融资有限公司	香港	香港	金融		100	设立
中泰国际资产管理有限公司	香港	香港	资产管理		100	设立
中泰国际优越理财有限公司	香港	香港	金融		100	设立
中泰国际金融产品有限公司	香港	香港	金融		100	设立
中泰国际控股（海外）有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
中泰国际金融有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
中泰国际金融股份有限公司	开曼群岛	开曼群岛	金融		100	设立
中泰环球投资有限公司	香港	香港	投资		100	设立
中泰国际管理有限公司	香港	香港	金融		100	设立
Zhongtai Innovation Capital Management Limited	开曼群岛	开曼群岛	金融		100	设立
宏润（上海）融资租赁有限公司	上海	上海	融资租赁		100	设立
上海逸道资产管理有限公司	上海	上海	资产管理		100	设立
中泰金控国际控股有限公司	上海	上海	金融		100	设立
中泰金融投资管理咨询（深圳）有限公司	深圳	深圳	投资管理		100	设立
中泰国际金融服务有限公司	香港	香港	金融		100	设立
Zhongtai International Holdings (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	金融		100	设立
Zhongtai International Securities (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	金融		100	设立
Zhongtai International Asset Management (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	金融		100	设立
Zhongtai International Investment Management (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	投资管理		100	设立
中泰国际财务（英属维尔京群岛）有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
中泰国际战略投资有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
中泰国际资本投资有限	英属维尔	英属维尔	金融		100	设立

公司	京群岛	京群岛				
中泰国际并购投资有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
Zhongtai International Structured Solutions Limited	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
Zhongtai International Bond 2017(BVI) Company Limited	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
中泰国际投资集团有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100	设立
中泰金融日本株式会社 (Japan)	日本	日本	金融		100	设立
鲁证资本管理有限公司	深圳	深圳	商贸		100	设立
鲁证信息技术有限公司	济南	济南	技术服务		100	设立
中泰汇融（香港）有限公司	香港	香港	期货交易		100	设立
鲁证国际控股有限公司	香港	香港	金融		100	设立
鲁证国际期货有限公司	香港	香港	期货		100	设立
Jinova Limited	瑞士日内瓦	瑞士日内瓦	金融		96.60	设立

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

公司对担任结构化主体的管理人，且持有产品份额的结构化主体，综合考虑公司拥有的投资决策权、可变回报的敞口及运用投资决策权影响可变回报等因素。若本集团通过投资合同等安排同时对该类结构化主体拥有权力、通过参与该结构化主体的相关活动而享有可变回报以及有能力运用本集团对该类结构化主体的权力影响可变回报，则本集团认为能够控制该类结构化主体，并将此类结构化主体纳入合并财务报表范围。

截至期末，本集团将符合条件的 35 只结构化主体纳入合并范围，上述结构化主体归属于本集团的权益为 7,299,362,048.20 元，其他权益持有人的权益在合并报表以其他负债列示金额为 4,720,871,335.72 元。

(2). 重要的非全资子公司

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	少数股东持股比例 (%)	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
鲁证期货	36.90	14,610,869.82		781,503,847.71
中泰资管	40.00	11,438,126.98		211,997,173.61

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明:

□适用 √不适用

其他说明:

□适用 √不适用

(3). 重要非全资子公司的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	期末余额		期初余额	
	资产合计	负债合计	资产合计	负债合计
鲁证期货	10,831,911,789.93	8,714,147,161.05	8,980,899,007.55	6,903,244,581.56
中泰资管	973,664,874.61	443,671,940.59	896,452,405.95	15,397,509.36

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
鲁证期货	748,749,229.74	39,550,158.80	40,110,202.89	80,846,589.60	715,375,292.44	23,481,246.83	23,274,073.01	988,185,590.63
中泰资管	197,779,573.14	28,595,317.44	28,595,317.44	148,728,573.24	278,925,755.12	61,247,527.16	61,247,527.16	11,118,289.45

(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制:

适用 不适用

(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持:

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

适用 不适用

3、在合营企业或联营企业中的权益

适用 不适用

(1). 重要的合营企业或联营企业

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
万家基金管理 有限公司	上海	上海市	基金募集、基金销售、资产管理等	49.00		权益法

(2). 重要合营企业的主要财务信息

适用 不适用

(3). 重要联营企业的主要财务信息

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
	万家基金管理有限公司	万家基金管理有限公司
资产合计	1,540,187,115.05	1,545,393,905.01
负债合计	476,480,231.41	575,788,763.36
少数股东权益	132,405,101.03	129,779,615.26
归属于母公司股东权益	931,301,782.61	839,825,526.39
按持股比例计算的净资产份额	457,645,585.97	411,514,507.93
调整事项		
--商誉		
--内部交易未实现利润		
--其他		
对联营企业权益投资的账面价值	457,645,585.97	411,514,507.93
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值		
营业收入	502,252,055.12	327,529,100.11
净利润	96,770,542.97	59,668,195.90
终止经营的净利润		
其他综合收益		
综合收益总额	96,770,542.97	59,668,195.90
本年度收到的来自联营企业的股利		



## (4). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
合营企业：		
投资账面价值合计		
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润		
--其他综合收益		
--综合收益总额		
联营企业：		
投资账面价值合计	290,876,624.21	272,898,886.72
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	2,035,847.66	13,849,520.14
--其他综合收益	5,417,950.99	-18,543,464.48
--综合收益总额	7,453,798.65	-4,693,944.34

## (5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明：

√适用 □不适用

联营企业不存在向本公司转移资金的能力存在重大限制的情况。

## (6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损

□适用 √不适用

## (7). 与合营企业投资相关的未确认承诺

□适用 √不适用

## (8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

□适用 √不适用

## 4、重要的共同经营

□适用 √不适用

## 5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

√适用 □不适用

截至期末，本集团未纳入合并财务报表范围的结构化主体主要为本集团管理的集合资产管理计划，其资产总额约人民币 288.61 亿元。这些集合资产管理计划根据合同约定投资于各类许可的金融产品。

截至期末，本集团在上述集合资产管理计划中的投资之账面价值 7.83 亿元，并将其分类为交易性金融资产。上述集合资产管理计划投资的最大损失敞口与其账面价值相近。

本期本集团从由本集团发起设立但未纳入合并财务报表范围的、且资产负债表日在该结

构化主体中没有权益的集合资产管理计划中获取的管理费收入为 3,474.37 万元。

6、其他

适用 不适用

十、与金融工具相关的风险

适用 不适用

与金融工具相关的风险情况请参见本节“十七、风险管理”。

## 十一、公允价值的披露

## 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
(一) 交易性金融资产	10,631,071,937.20	20,385,945,984.77	2,999,224,855.52	34,016,242,777.49
1.以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	10,631,071,937.20	20,385,945,984.77	2,999,224,855.52	34,016,242,777.49
(1) 债务工具投资	7,909,433,433.90	18,356,887,713.39	1,780,892,711.57	28,047,213,858.86
(2) 权益工具投资	2,721,638,503.30	2,029,058,271.38	1,218,332,143.95	5,969,028,918.63
2.指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(二) 其他债权投资	8,511,117,545.58	6,827,253,261.13	50,000,000.00	15,388,370,806.71
(三) 其他权益工具投资	1,170,633,835.42	3,970,287,394.43	690,890,648.08	5,831,811,877.93
(四) 衍生金融资产	78,640,669.15	11,126,379.04	1,119,177.74	90,886,225.93
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	<b>20,391,463,987.35</b>	<b>31,194,613,019.37</b>	<b>3,741,234,681.34</b>	<b>55,327,311,688.06</b>
(六) 交易性金融负债	8,059,562.60	5,236,092.62		13,295,655.22
1.以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	8,059,562.60	778,901.85		8,838,464.45
其中:发行的交易性债券	8,059,562.60	778,901.85		8,838,464.45
2.指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债		4,457,190.77		4,457,190.77
(七) 衍生金融负债	298,175.13	28,184,135.36	1,122,351.04	29,604,661.53
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	<b>8,357,737.73</b>	<b>33,420,227.98</b>	<b>1,122,351.04</b>	<b>42,900,316.75</b>
<b>二、非持续的公允价值计量</b>				
(一) 持有待售资产				
<b>非持续以公允价值计量的资产总额</b>				
<b>非持续以公允价值计量的负债总额</b>				

## 2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

√适用 □不适用

输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

## 3、持续和非持续第二层次公允价值计量项目,采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

√适用 □不适用

输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

4、持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息  
√适用 □不适用

输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

5、持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息  
√适用 □不适用

输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析  
 √适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	转入第三层级	转出第三层级	当期利得或损失总额		购买、发行、出售、结算				期末余额
				计入当期损益	计入其他综合收益	购买	发行	出售	结算	
交易性金融资产	2,657,119,234.69		25,953,200.00	-58,485,411.15		983,166,759.33		369,442,096.46	10,095,640.62	3,176,309,645.79
衍生金融资产	715,175.24			404,002.50						1,119,177.74
其他债权投资	50,000,000.00			4,250,000.00					4,250,000.00	50,000,000.00
其他权益工具投资	626,307,251.33	34,593,664.07	2,250,000.00		35,958,899.30	36,280,000.00		39,999,166.62		690,890,648.08
衍生金融负债	1,309,349.09			-186,998.05						1,122,351.04

7、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

√适用 □不适用

限售股解禁后由第三层次转换为第一层次。

8、本期内发生的估值技术变更及变更原因

□适用 √不适用

9、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

√适用 □不适用

本集团不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、应收款项、存出保证金、其他资产（金融资产）、短期借款、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、代理承销证券款、应付款项、长期借款、其他负债（金融负债）等。

下表列示了本集团应付债券的账面价值以及相应的公允价值：

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值		公允价值	
	期末金额	期初金额	期末金额	期初金额
应付债券	29,778,557,053.76	32,212,281,435.85	29,684,452,351.49	32,012,447,178.91
合计	29,778,557,053.76	32,212,281,435.85	29,684,452,351.49	32,012,447,178.91

10、其他

□适用 √不适用

十二、关联方及关联交易

1、本企业的母公司情况

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例(%)	母公司对本企业的表决权比例(%)
莱钢集团	济南市钢城区	黑色金属冶炼、销售	513,254.59	41.32	41.32

本企业的母公司情况的说明：

截至期末，莱钢集团持有本公司有表决权股份占公司总股份的 41.32%，为本公司的母公司，莱钢集团为山东钢铁集团有限公司的控股子公司，山东钢铁集团有限公司 70%股权归山东省国资

委所有。

本企业最终控制方是山东省国资委。

## 2、本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

适用 不适用

本公司子公司情况请参见本节“九、在其他主体中的权益 1、在子公司中的权益”相关内容。

## 3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

适用 不适用

本公司合营和联营企业情况请参见本节“九、在其他主体中的权益 3、在合营企业或联营企业中的权益”相关内容。

本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

适用 不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
万家基金管理有限公司	联营企业
万家共赢资产管理有限公司	联营企业
齐鲁股权交易中心有限公司	联营企业
山东中泰齐东信息产业发展投资中心（有限合伙）	联营企业
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	联营企业
山东中泰天使创业投资基金企业（有限合伙）	联营企业
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	联营企业
威海中泰齐东蓝色并购投资中心（有限合伙）	联营企业
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金（有限合伙）	联营企业

其他说明：

适用 不适用

## 4、其他关联方情况

适用 不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
济钢集团有限公司	持股 5%以上的股东
兖矿集团有限公司	持股 5%以上的股东
山东晨鸣纸业集团股份有限公司	控股股东的母公司的董事任职董事的单位
山东国铭球墨铸管科技有限公司	控股股东的母公司的董事任职董事的单位
山东省交通工业集团控股有限公司	控股股东的母公司的董事任职董事的单位
山东土地发展集团有限公司	控股股东的母公司的董事任职董事的单位
山东钢铁集团财务有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东金岭铁矿有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山钢金融控股（深圳）有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东钢铁集团矿业有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东钢铁集团国际贸易有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东钢铁集团淄博张钢有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东冶金机械厂有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东耐火材料集团有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司

山东钢铁集团房地产有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
莱芜钢铁集团银山型钢有限公司	控股股东控制的其他公司
山东莱钢建设有限公司	控股股东控制的其他公司
莱芜钢铁集团淄博锚链有限公司	控股股东控制的其他公司
山东莱钢铁源炉料有限公司	控股股东控制的其他公司
莱芜市钢城区鲁中小额贷款有限公司	控股股东控制的其他公司
山东莱钢永锋钢铁有限公司	控股股东控制的其他公司
莱钢集团矿山建设有限公司	控股股东控制的其他公司
山东鲁碧建材有限公司	控股股东控制的其他公司
山东莱钢物流发展有限公司	控股股东控制的其他公司
山东省冶金设计院股份有限公司	控股股东控制的其他公司
莱钢集团烟台钢管有限公司	控股股东控制的其他公司
莱芜钢铁集团泰东实业有限公司	控股股东控制的其他公司
莱芜钢铁集团金鼎实业有限公司	控股股东控制的其他公司
莱钢集团蓝天商旅车业有限公司	控股股东控制的其他公司
山东创研股权投资管理股份有限公司	控股股东控制的其他公司
山东鲁冶项目管理有限公司	控股股东控制的其他公司
永锋集团有限公司	公司董事控制的公司
山东永通实业有限公司	公司董事控制的公司
齐河众鑫投资有限公司	公司董事控制的公司
济南灏兴投资管理有限公司	公司董事控制的公司
莱商银行股份有限公司	公司董事担任董事的公司
德州银行股份有限公司	公司董事担任董事的公司
上海金谷裕丰投资有限公司	公司董事担任董事长的公司
东平铁路有限责任公司	公司董事担任董事长的公司
融世华融资租赁有限公司	公司原董事担任董事的公司
山东省鲁信投资控股集团有限公司	公司董事长担任董事长的公司
济南西城投资发展有限公司	公司监事担任董事长的公司
山东西进融资担保有限公司	公司监事担任董事长的公司
日照大宗商品交易中心有限公司	联营企业
上海鲁证锋通经贸有限公司	联营企业
深圳市沧金投资合伙企业（有限合伙）	联营企业
深圳市沧鑫投资合伙企业（有限合伙）	联营企业
山东红牛金融服务有限公司	联营企业
山东交易市场清算所有限公司	联营企业
青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业（有限合伙）	联营企业
李玮，范奎杰，孟庆建，刘锋，侯祥银，时英，郑伟，陈晓莉，王思远，安铁，王丽敏，崔建忠，毕玉国，孙培国，钟金龙，刘珂滨，张晖，袁西存，李恒第，陈肖鸿，满洪杰，曹灶强，范天云，何振江，黄永刚，曹孟博，程龙	公司董事、监事及高级管理人员
苏艳芹，李传恺等人	公司董事、监事及高级管理人员的近亲属
王庆山，孙日东等人	控股股东的董事、监事、高级管理人员及其近亲属
侯军，陶登奎等人	控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其近亲属

其他说明：



适用 不适用

5、关联交易情况

(1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

适用 不适用

出售商品/提供劳务情况表

适用 不适用

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明：

适用 不适用

(2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况

本公司受托管理/承包情况表：

适用 不适用

关联托管/承包情况说明：

适用 不适用

本公司委托管理/出包情况表：

适用 不适用

关联管理/出包情况说明：

适用 不适用

(3). 关联租赁情况

本公司作为出租方：

适用 不适用

本公司作为承租方：

适用 不适用

关联租赁情况说明

适用 不适用

(4). 关联担保情况

本公司作为担保方

适用 不适用

本公司作为被担保方

适用 不适用

关联担保情况说明

适用 不适用

(5). 关联方资金拆借

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

关联方	拆借金额	起始日	到期日	说明
拆入				
莱商银行股份有限公司	3 亿元	2018 年 12 月 25 日	2028 年 12 月 25 日	已还款 3600 万元

(6). 关联方资产转让、债务重组情况

适用 不适用

(7). 关键管理人员报酬

适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	2,200.91	2,547.66

## (8). 其他关联交易

√适用 □不适用

## 1) 提供代理买卖证券服务、向其收取佣金及手续费并支付客户资金存款利息

单位：元 币种：人民币

关联方	2020年6月30日	2020年1-6月	
	资金余额	佣金总额	利息支出
永锋集团有限公司	1,275.01		2.26
东平铁路有限责任公司	4,075.97		7.21
德州银行股份有限公司	1,010.71		1,010.71
济南西城投资发展有限公司	8,906.50		8,907.75
山东西进融资担保有限公司	966.83		988.72
融世华融资租赁有限公司	27.69		0.04
山东永通实业有限公司			0.04
万家基金管理有限公司	369,018.59	2,522.82	490.89
齐鲁股权交易中心有限公司	934.19	31,816.94	7,785.80
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	645.48		0.71
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	617,406.02		1,091.02
山东中泰齐东信息产业发展投资中心（有限合伙）	195,698.53		345.82
威海中泰齐东蓝色并购投资中心（有限合伙）	104.73		0.18
中泰华信股权投资管理股份有限公司	1,024.37	25,357.53	229.68
山东交易市场清算所有限公司	15.19		0.02
兖矿集团有限公司	4,042,027.39		1,859.88
山东钢铁集团有限公司	1,638.74		2.90
莱芜钢铁集团有限公司	27,098.33		47.88
济钢集团有限公司	148.48		0.26
山东金岭铁矿有限公司	77.30		0.14
山钢金融控股（深圳）有限公司	0.02	1,290.24	157.04
山钢金控资产管理（深圳）有限公司	0.04		

关联方	2020年6月30日	2020年1-6月	
	资金余额	佣金总额	利息支出
山东晨鸣纸业集团股份有限公司	34,002.69		60.09
山东钢铁集团房地产有限公司	7,480.81	17,872.71	7,480.81
齐河众鑫投资有限公司	765,698.79		1,353.06
山东莱钢永锋钢铁有限公司	4,075.97		7.21
上海金谷裕丰投资有限公司	793.73	9,934.31	47.73
山东省鲁信投资控股集团有限公司	66,068,674.23	14,040.00	131,649.04
山东钢铁集团财务有限公司	1,049.30		1.86
山东省新力冶金实业有限公司	41.12		0.06
济南灏兴投资管理有限公司	58,364.08	1,408.84	140.33
公司的董事、监事、高级管理人员	265,490.87	3,034.63	869.06
公司董事、监事、高级管理人员的近亲属	3,849,414.00	52,398.25	6,672.76
控股股东的董事、监事、高级管理人员及其近亲属	860,788.88	24,886.34	1,294.98
控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其近亲属	448,967.76	17,429.99	693.76
合计	77,636,942.34	201,992.60	173,199.70

(续)

关联方	2019年12月31日	2019年1-6月	
	资金余额	佣金总额	利息支出
永锋集团有限公司	1,272.75		2.24
济南西城投资发展有限公司	1,408.75		1,406.47
山东西进融资担保有限公司		4,890.00	2,469.88
融世华融资租赁有限公司	27.65		0.04
鲁信科技股份有限公司	959.69	7,155.96	15,383.13
山东永通实业有限公司	143.73		0.26
山东省国际信托股份有限公司	300.00	262,861.90	52,320.42
万家基金管理有限公司	0.18		0.18
齐鲁股权交易中心有限公司	12,564.13	47,856.98	73,340.81
威海市中泰齐东投资中心(有限合伙)	323.23		780.55
山东中泰齐东世华节能投资中心(有限合伙)	616,315.00		1,087.16

关联方	2019年12月31日	2019年1-6月	
	资金余额	佣金总额	利息支出
山东中泰齐东信息产业发展投资中心(有限合伙)	195,352.71		222.50
威海中泰齐东蓝色并购投资中心(有限合伙)	104.55	51,859.90	1,912.61
兖矿集团有限公司	256.03		615.93
山东钢铁集团有限公司	1,635.84		2.88
山东省新力冶金实业有限公司			0.06
莱芜钢铁集团有限公司	27,050.45		47.72
济钢集团有限公司	148.22		0.26
山东金岭铁矿有限公司	77.16	1,344.19	77.02
山钢金融控股(深圳)有限公司		14,210.24	2,926.09
山钢金控资产管理(深圳)有限公司	0.04		
济南市市中区鲁银小额贷款有限责任公司		18,633.69	3,958.98
山东晨鸣纸业集团股份有限公司	33,942.60		59.87
莱芜钢铁集团鲁南矿业有限公司	130.33		0.22
莱商银行股份有限公司	5,442.35	82,526.38	3,013.39
齐河众鑫投资有限公司	764,345.73		1,345.77
山东莱钢永锋钢铁有限公司	4,068.76		7.17
上海金谷裕丰投资有限公司	130.02	9,476.54	84.50
山东省鲁信投资控股集团有限公司	80,276,918.89	44,370.81	199,429.12
山东钢铁集团财务有限公司	1,047.44		2,923.54
济南灏兴投资管理有限公司	215.43		
公司的董事、监事、高级管理人员	314,866.21	5,767.80	280.62
公司董事、监事、高级管理人员的近亲属	3,515,407.87	18,630.58	2,767.81
控股股东的董事、监事、高级管理人员及其近亲属	437,445.00	16,142.29	946.80
控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其近亲属	214,095.02	10,204.27	466.86
合计	86,425,995.76	595,931.53	367,880.86

注：公司的董事长、职工代表董事、监事会主席、职工监事及高级管理人员未开立股票账户。

2) 提供期货交易服务

关联方	2020年6月30日	2020年1-6月
	资金余额	佣金总额

山东莱钢永锋钢铁有限公司	6,918,301.17	175,039.76
山东钢铁股份有限公司	2,910,645.93	
上海鲁证锋通经贸有限公司	15,369,895.21	204,794.72
莱芜钢铁集团鲁南矿业有限公司	1,200.00	
合计	25,200,042.31	379,834.48

(续)

关联方	2019年12月31日	2019年1-6月
	资金余额	佣金总额
山东莱钢永锋钢铁有限公司	1,672,703.60	
山东钢铁股份有限公司	2,910,645.93	
上海鲁证锋通经贸有限公司	11,957,749.93	457,456.06
莱芜钢铁集团鲁南矿业有限公司	1,200.00	
山东创诚实业有限公司	5,097.29	37,016.51
山东永通实业有限公司	12,373.02	104,750.92
合计	16,559,769.77	599,223.49

## 3) 与关联方发生的财务顾问费、席位佣金费、承销费

关联方	关联交易内容	2020年1-6月	2019年1-6月
山东莱钢永锋钢铁有限公司	采购现货的成本	15,635,219.85	42,117,096.85
山东永锋国际贸易有限公司	销售现货的收入		737,547.23
山东钢铁股份有限公司	采购现货的成本		172,983.50
万家基金管理有限公司	财务顾问收入		259,991.26
万家基金管理有限公司	席位佣金收入	20,241,646.50	6,757,992.86
万家基金管理有限公司	尾随佣金收入	815,743.87	8,491,133.09
万家基金管理有限公司	销售服务费	8,766,765.35	6,511,600.23
万家基金管理有限公司	手续费	10,757,256.54	2,048,554.81
万家基金管理有限公司	投资咨询收入	2,399,898.17	1,419,000.00
山东钢铁集团有限公司	承销收入	2,075,471.70	1,132,075.47
鲁银投资集团股份有限公司	财务顾问收入		2,547,169.81
山东钢铁股份有限公司	承销收入		2,830,188.68
兖矿集团有限公司	财务顾问收入		849,056.60
山东中泰齐东信息产业发展投资中心(有限合伙)	管理费收入	1,876,482.05	2,191,780.78
威海市中泰齐东投资中心(有限合伙)	管理费收入	478,502.94	810,795.38
山东中泰天使创业投资基金企业(有限合伙)	管理费收入	1,642,249.52	2,353,152.84

关联方	关联交易内容	2020年1-6月	2019年1-6月
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	管理费收入	562,944.63	1,006,135.43
威海中泰齐东蓝色并购投资中心（有限合伙）	管理费收入		1,869,413.25
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金（有限合伙）	管理费收入	617,601.45	
山东西进股权投资基金管理有限公司	投资咨询支出		891,858.92
合计		65,869,782.57	84,997,526.99

## 4) 申购关联方发行的票据、基金产品及产生的投资收益

## 申购关联方发行的票据、基金产品

关联方	2019年12月31日	申购金额	赎回金额	2020年6月30日
山东钢铁集团有限公司	656,466,237.82		111,336,117.82	545,130,120.00
莱芜钢铁集团有限公司	60,823,556.72	24,736,258.34	2,860,808.94	82,699,006.12
山东钢铁股份有限公司	52,316,028.45	363,971.55	2,040.20	52,677,959.80
山东钢铁集团房地产有限公司	6,084,006.49	441,713.02	411,941.31	6,113,778.20
山钢金融控股（深圳）有限公司	153,448,040.76			153,448,040.76
万家基金管理有限公司	416,242,162.27	371,727,913.01	695,713,845.08	92,256,230.20
合计	1,345,380,032.51	397,269,855.92	810,324,753.35	932,325,135.08

## 申购关联方发行的票据、基金产品产生的投资收益

关联方	2020年1-6月	2019年1-6月
山东钢铁集团有限公司	1,980,134.54	372,499.11
万家基金管理有限公司	2,795,267.37	3,552,999.49
合计	4,775,401.91	3,925,498.60

## 申购关联方发行的债券产生的利息收入

关联方	2020年1-6月	2019年1-6月
山东钢铁集团有限公司	8,709,851.04	
合计	8,709,851.04	

## 5) 存放关联方款项及向关联方收取利息收入

## 存放关联方款项余额

关联方	2020年6月30日	2019年12月31日
莱商银行股份有限公司	527,939,067.75	574,424,122.44
合计	527,939,067.75	574,424,122.44

存放关联方款项产生利息收入

关联方	2020年1-6月	2019年1-6月
莱商银行股份有限公司	8,337,402.54	8,668,380.11
合计	8,337,402.54	8,668,380.11

## 6、关联方应收应付款项

### (1). 应收项目

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	万家基金管理有限公司	10,099,662.72	1,125,110.44	10,099,662.72	1,125,110.44
应收款项	鲁银投资集团股份有限公司			2,700,000.00	135,000.00
应收款项	万家共赢资产管理有限公司	9,127,972.21	511,626.58		
其他应收款	齐鲁股权交易中心有限公司	80,000.00	16,000.00	80,000.00	16,000.00
其他应收款	山东中泰天使创业投资基金企业(有限合伙)	6,478,084.50	698,055.53	4,737,300.00	236,865.00
其他应收款	深圳市沧金投资合伙企业(有限合伙)	10,000.00	2,000.00	10,000.00	1,000.00
其他应收款	山东永锋国际贸易有限公司	35,660.00			
其他应收款	上海鲁证锋通经贸有限公司	480,480.00			
预付账款	山东莱钢永锋钢铁有限公司	725,982.15		217.31	

### (2). 应付项目

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	山东西进股权投资基金管理有限公司		3,350,630.20
其他应付款	威海中泰齐东蓝色并购投资中心(有限合伙)	450,554.81	450,554.81
其他应付款	荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金合伙企业(有限合伙)	701,473.21	

## 7、关联方承诺

适用 不适用

8、其他

适用 不适用

十三、 股份支付

1、 股份支付总体情况

适用 不适用

2、 以权益结算的股份支付情况

适用 不适用

3、 以现金结算的股份支付情况

适用 不适用

4、 股份支付的修改、终止情况

适用 不适用

5、 其他

适用 不适用

十四、 承诺及或有事项

1、 重要承诺事项

适用 不适用

2、 或有事项

(1). 资产负债表日存在的重要或有事项

适用 不适用

(2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：

适用 不适用

3、 其他

适用 不适用

十五、 资产负债表日后事项

1、 重要的非调整事项

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	内容	对财务状况和经营成果的影响数	无法估计影响数的原因
股票和债券的发行	中泰国际财务（英属维尔京群岛）有限公司2020年8月5日定价发行2023年8月12日到期的票面利率3.85%的3年期金额为3亿美元的境外债券。 2020年7月28日，公司已完成中泰证券股份有限公司公开发行2020年公司债券（第二期）（代码：163767，简称：20中泰02）		



	的发行工作，发行规模 15 亿元，债券期限 2 年，债券票面利率为 3.35%		
--	---	--	--

## 2、利润分配情况

适用 不适用

## 3、销售退回

适用 不适用

## 4、其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

2020年8月3日，公司第二届董事会第三十一次会议审议通过了《关于聘任中泰证券股份有限公司合规总监、总法律顾问的议案》，同意聘任亓兵先生为公司合规总监、总法律顾问，任期自本次董事会审议通过之日起至本届董事会任期届满为止。孙培国先生不再担任公司合规总监、总法律顾问职务。

## 十六、风险管理

## 1、风险管理政策及组织架构

## (1). 风险管理政策

适用 不适用

公司制定并持续完善各类风险管理制度，明确风险管理目标、原则、组织架构、授权体系、相关职责、基本程序，针对不同风险类型制定风险识别、评估、监测、应对、报告方法和流程，并通过评估、稽核、检查和绩效考核等手段保证风险管理制度的贯彻落实。

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，主要包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制。

公司董事会、经理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的各类风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。

## (2). 风险治理组织架构

适用 不适用

公司建立了包括董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司在内的多层次、相互衔接、有效制衡的全面风险管理组织架构。公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任；监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改；经理层负责组织开展公司日常全面风险管理工作，对公司全面风险管理的有效性承担主要责任；首席风险官代表公司经理层推动公司全面风险管理工作；风险管理部负责监测、分析、评估、报告公司整体风险水平，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作；各部门、分支机构及子公司负责人及时识别、评估、应对、

报告本单位风险，承担本单位风险管理有效性的直接责任；合规管理总部、法律事务部、资金运营管理部、企业文化部分别是合规风险、法律风险、流动性风险、声誉风险的归口管理部门。公司每一名员工均对风险管理有效性承担勤勉尽责、审慎防范、及时报告的责任。

#### （1）董事会及其风险管理委员会

公司董事会主要负责推进公司风险管理文化建设，审议批准公司全面风险管理基本制度，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等。

董事会风险管理委员会在董事会的授权下，对公司日常经营中的各类重大风险事项进行审议，提出完善全面风险管理体系的建议。

#### （2）经理层

公司经理层负责组织开展公司日常全面风险管理工作，执行董事会审议通过的风险管理策略，制定风险管理制度并适时调整，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额具体执行方案等。

#### （3）首席风险官

公司首席风险官代表公司经理层组织、协调、落实公司经营层面的全面风险管理工作。首席风险官不兼任或者分管与其职责相冲突的职务或部门。公司为首席风险官提供履职所必须的知情权、保障其履职的独立性。

#### （4）风险管理部门

风险管理部在首席风险官领导下推动公司全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。合规管理总部、法律事务部、资金运营管理部、企业文化部分别是合规风险、法律风险、流动性风险、声誉风险的归口管理部门，负责牵头组织、推动相关风险管理工作。

审计稽核部负责对公司全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价。

## 2、信用风险

√适用 □不适用

信用风险是指由于融资方、交易对手或发行人等违约导致公司可能面临损失的风险。报告期内，公司面临的信用风险主要集中在融资融券业务、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务、债券投资交易业务、场外衍生品业务等方面。

公司建立了内部评级管理制度，针对不同行业属性建立内部评级模型，同时实行定期、不定期调整机制，根据评级主体的财务预警、舆情预警进行评级分析与不定期调整。公司根据业务发

展及管理需要确定了内部评级覆盖的业务范围，并建立了与自身业务复杂程度和风险指标体系相适应的内部评级管理工具、方法和标准。

在融资融券、约定购回式证券交易及股票质押式回购交易等融资类业务方面，信用风险主要涉及客户提供虚假资料、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、交易行为违反监管规定、提供的担保物资产涉及法律纠纷等。公司通过制定和实施严格的制度和措施，主要从尽职调查、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等环节对涉及的信用风险进行控制。公司建立了较为严格的客户准入门槛、尽职调查标准，制定了客户信用等级评价体系，持续优化客户信用情况、资产状况、投资经验等方面的量化评估，严控授信上限，同时建立了多层级的业务授权管理体系；公司持续强化盯市通知服务工作管控，对各项风险控制指标进行监控、主动预警，落实多重盯市制度，同时密切跟踪融资方、标的证券等舆情变化，发现风险时及时与客户沟通，最大限度减少违约情形发生；公司通过贷后回访、黑名单管理等强化客户资质后续管理，加强对客户信用风险的预判和督促提醒，定期评估业务整体状况以及部分高风险项目情况并相应制定处置方案，维护公司债权安全。

在债券投资业务方面，公司通过制定交易对手、债券现券尽职调查标准、评级准入标准、限额管理方案，建立了与业务复杂度相适应的分级授权审批机制，实现业务风险的事前管理；公司建立了持仓债券与存续交易对手的舆情管理机制，密切关注发行主体、担保方、交易对手的评级、资质变化，对于高集中度行业的同一集团控制的主体进行集中度的合并计算，注重分散投资，优先投资管理规范、资信状况良好的资产。此外，公司不断深化内部评级在债券投资交易中的应用，包括但不限于准入管理、预警管理、风险计量等方面。

在场外衍生品业务方面，公司从客户尽职调查、内部评级、准入管理、限额管理、合同管理、风险应对与处置等方面建立了相应的管理制度与流程，对存续期内的交易对手和合约进行逐日盯市，并综合运用担保品、集中度管理、净额结算、保证等方式缓释与控制信用风险。

截至期末，本集团无对外担保，因此，在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，本集团资产负债表日最大信用风险敞口为本集团金融资产的账面金额减去相应的减值准备。本集团最大信用风险敞口列示如下：

项目名称	期末余额	期初余额
货币资金	39,839,246,122.10	30,916,047,553.27
结算备付金	7,006,200,141.42	6,763,320,638.78
融出资金	24,657,083,933.21	23,248,873,866.35
交易性金融资产	28,810,499,886.75	26,586,812,484.34
存出保证金	7,391,484,771.92	5,904,321,055.36
衍生金融资产	90,886,225.93	99,279,168.26
买入返售金融资产	10,882,498,894.42	12,572,663,170.37
应收款项	748,083,492.80	682,845,873.86

项目名称	期末余额	期初余额
其他债权投资	15,388,370,806.71	18,522,040,228.79
其他资产	708,716,073.22	610,097,409.50
债权投资	4,279,309,718.71	4,238,796,066.65
最大风险敞口合计	139,802,380,067.19	106,896,223,649.18

本集团金融资产包括货币资金、结算备付金、交易性金融资产、衍生金融资产、买入返售金融资产、存出保证金、债权投资、其他债权投资、应收款项、融出资金等，资产负债表日公司（合并口径）最大信用风险敞口为 1,398.02 亿元，母公司最大信用风险敞口为 1,151.96 亿元。

### 3、流动风险

√适用 □不适用

公司面临的流动性风险主要为无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。在业务经营中，若受宏观政策、市场情况变化、经营不力、信誉度下降等因素的影响，或因资产负债结构不匹配，资产周转速度过低，本集团将可能面临现金流紧张、融资成本持续高企、融资渠道受阻、债务集中到期难以兑付等。

为防范流动性风险，公司采取的措施为：

（1）在融资负债统一归口管理的基础上积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构，保持资产负债期限始终处于合理配比；

（2）及时完善负债规划，通过调整到期融资集中度等手段，避免因融资渠道过于单一或债务集中到期导致的偿付风险，使负债结构和到期日分布更趋合理；

（3）按照审慎原则确定优质流动性资产规模和构成，保持多层次的充足的优质流动性资产储备，定期测试优质流动性资产的变现能力，以确保公司在压力情景下能够及时获得充足资金满足流动性需求；

（4）建立现金流预测和分析框架，运用现金流缺口、敏感性分析、压力测试等管理工具，能够计量、监测和控制不同情景下未来不同时间段的现金流缺口；

（5）重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持畅通的融资渠道，如有需要，可通过资金拆借、债券回购、短期融资券、短期公司债、公司债、次级债、收益凭证、资产证券化及其他符合法律及监管规定的方式进行融资，以解决资金需求。

报告期内，公司保持了充足的流动性资产储备，流动性覆盖率和净稳定资金率均符合监管标准及监管预警标准。

## 4、市场风险

√适用 □不适用

市场风险是指公司的持仓组合由于相关市场价格或波动率的不利变化而导致损失的风险。包括权益类风险、利率类风险、商品类风险和汇率类风险等方面。

## (1) 权益类风险

权益类风险主要指因权益类证券市场价格、波动率发生变化致使公司承受损失的风险。该类风险主要来自于公司自营证券投资和做市类业务持仓组合在股票、股票组合、股指期货、期权等权益类证券的价格及波动率变化上的风险敞口。

为监控相关风险因素的影响，公司密切关注相关资产的价格波动、波动率变化，每日跟踪相应持仓的规模、敞口、希腊字母及 VaR 的变化情况，对各类证券品种的投资规模进行限额管理，合理利用各种套期保值工具，采取多种措施，有效控制权益类业务的市场风险。

## (2) 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值因市场利率不利变动而发生损失的风险。公司持有的具有利率敏感性的各类金融工具因市场利率不利变动导致公允价值变动的风险是利率风险的主要来源。公司持有的利率敏感性资产主要指银行存款、结算备付金、存出保证金、融出资金、交易性金融资产等，利率敏感性负债主要为短期借款、应付短期融资款、拆入资金、代理买卖证券款等。

公司通过设定规模、敞口等限额控制利率风险并通过久期、凸性、DV01 等指标衡量利率风险。公司利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具，采用敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，期末持有的各类金融工具公允价值变动对收入总额和股东权益产生的影响。

假设市场整体利率平行移动 100 个基点，且不考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动，公司利率敏感性分析如下：

利率变化	对利润总额的影响		对其他综合收益的影响	
	期末金额	期初金额	期末金额	期初金额
市场利率平行上升 100 个基点	-356,134,566.26	-518,534,134.10	-230,070,000.00	-217,030,000.00
市场利率平行下降 100 个基点	356,134,566.26	518,534,134.10	230,070,000.00	217,030,000.00

## (3) 商品类风险

商品类风险是因商品类资产市场价格、波动率发生变化致使公司承受损失的风险。该类风险

主要来自于公司自营持仓在商品现货、期货价格及波动率变化上的风险敞口。

为监控相关风险因素的影响，公司密切关注相关资产的市场供需情况、波动率变化，对各类投资品种进行规模控制，减少单纯投机策略完善套期保值策略，有效控制商品类业务的市场风险。

#### (4) 汇率风险

汇率风险是指公司进行的外币业务因外汇汇率变动所产生的风险。公司面临的汇率风险主要与境外子公司的净投资及公司的经营活动(当收支以不同于公司记账本位币的外币结算时)有关。

截至期末，公司境外外币资产、负债主要为全资子公司中泰国际所持有的资产和负债，占公司总资产和总负债的比例分别为 7.82%、8.63%，由于外币在公司资产、负债结构中占比较低，因此公司面临的汇率风险不重大。

截至期末，公司境内不是以记账本位币计价的货币资金、结算备付金、存出保证金等外币资产，占整体资产的比重并不重大，因此公司面临的汇率风险不重大。

### 十七、 其他重要事项

#### 1、 前期会计差错更正

(1). 追溯重述法

适用 不适用

(2). 未来适用法

适用 不适用

#### 2、 债务重组

适用 不适用

#### 3、 资产置换

(1). 非货币性资产交换

适用 不适用

(2). 其他资产置换

适用 不适用

#### 4、 年金计划

适用 不适用

#### 5、 终止经营

适用 不适用

## 6、分部信息

### (1). 报告分部的确定依据与会计政策

适用 不适用

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集团的报告分部按照业务类型的不同，主要划分为：证券经纪业务分部、证券投资业务分部、投资银行业务分部、期货业务分部、资产管理业务分部、信用业务分部、境外业务以及总部及其他业务分部。

按营业利润来源于不同的地区划分为：山东省分部、上海市分部、福建省分部、北京市分部、浙江省分部以及其他地区分部。

### (2). 报告分部的财务信息

适用 不适用

2020年1-6月（按业务）

单位：元 币种：人民币

项目	证券经纪业务	证券投资业务	投资银行业务	期货业务	资产管理业务	信用业务	境外业务	总部及其他业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	1,588,920,056.52	309,439,762.76	416,525,466.80	746,529,553.00	171,769,547.65	755,603,767.16	220,289,738.68	593,140,170.69		4,802,218,063.26
手续费及佣金净收入	1,258,797,412.45	238,835.09	415,403,480.77	83,559,278.70	159,013,304.21	-60.00	87,785,399.55	310,424,809.93		2,315,222,460.70
投资收益		656,062,142.84		80,676,013.69	9,559,185.48		57,784,236.54	151,839,763.22		955,921,341.77
公允价值变动收益		-225,069,434.15		-21,286,301.47	826,784.44	173,587,205.98	-2,515,470.26	-67,637,050.13		-142,094,265.59
其他收入	330,122,644.07	-121,791,781.02	1,121,986.03	603,580,562.08	2,370,273.52	582,016,621.18	77,235,572.85	198,512,647.67		1,673,168,526.38
二、营业支出	926,939,154.76	129,130,084.15	271,676,461.46	686,701,127.28	102,991,451.21	64,867,907.86	239,776,893.39	623,449,657.18		3,045,532,737.29
三、营业利润	661,980,901.76	180,309,678.61	144,849,005.34	59,828,425.72	68,778,096.44	690,735,859.30	-19,487,154.71	-30,309,486.49		1,756,685,325.97
四、资产总额	91,891,721,624.70	48,049,390,427.24	2,003,896,853.32	10,831,911,789.93	973,664,874.61	34,472,411,587.11	12,097,102,095.13	44,260,083,698.12	89,933,868,968.57	154,646,313,981.59
五、负债总额	69,517,637,249.16	42,022,397,068.83	282,105,247.49	8,714,147,161.05	443,671,940.59	21,063,893,937.97	10,474,547,638.49	43,122,006,220.11	74,225,013,773.55	121,415,392,690.14
六、补充信息										
1、折旧和摊销费用	27,763,932.60	1,001,942.96	784,513.13	7,828,586.64	2,178,109.29		6,927,300.55	77,979,786.10		124,464,171.27
2、资本性支出	20,455,181.41	596,046.98	809,066.96	973,439.19	1,625,495.37		5,791,337.14	64,989,296.84		95,239,863.89

2020年1-6月（按地区）

项目	山东省	上海市	福建省	北京市	浙江省	其他地区	抵销	合计
一、营业收入	3,805,895,463.22	493,614,839.19	47,581,920.84	30,866,722.19	41,809,447.42	382,449,670.40		4,802,218,063.26
手续费及佣金净收入	1,662,085,916.32	314,459,769.27	45,536,831.46	24,886,520.25	44,032,850.81	224,220,572.59		2,315,222,460.70
投资收益	791,836,835.02	30,853,313.55				133,231,193.20		955,921,341.77
公允价值变动收益	-92,622,471.37	-1,063,116.76		224,773.65		-48,633,451.11		-142,094,265.59
其他收入	1,444,595,183.25	149,364,873.13	2,045,089.38	5,755,428.29	-2,223,403.39	73,631,355.72		1,673,168,526.38
二、营业支出	2,217,421,679.68	272,126,627.31	36,528,274.83	50,061,669.21	33,471,236.64	435,923,249.62		3,045,532,737.29



中泰证券股份有限公司

项目	山东省	上海市	福建省	北京市	浙江省	其他地区	抵销	合计
三、营业利润	1,588,473,783.54	221,488,211.88	11,053,646.01	-19,194,947.02	8,338,210.78	-53,473,579.22		1,756,685,325.97
四、资产总额	201,421,721,718.05	13,901,698,472.80	2,424,402,227.86	1,695,522,224.18	2,360,618,981.54	22,776,219,325.73	89,933,868,968.57	154,646,313,981.59
五、负债总额	167,019,023,188.47	5,602,791,259.22	1,568,603,846.42	1,592,487,312.14	1,858,525,758.70	17,998,975,098.74	74,225,013,773.55	121,415,392,690.14
六、补充信息								
1、折旧和摊销费用	98,034,029.75	5,879,145.97	757,351.45	929,838.40	667,705.37	18,196,100.33		124,464,171.27
2、资本性支出	80,338,487.21	5,260,815.65	758,580.43	105,065.01	3,470.86	8,773,444.73		95,239,863.89

2019年1-6月（按业务）

项目	证券经纪业务	证券投资业务	投资银行业务	期货业务	资产管理业务	信用业务	境外业务	总部及其他业务	抵销	合计
一、营业收入	1,395,458,110.40	424,647,831.61	453,121,158.99	715,375,292.44	264,159,331.65	607,925,898.22	342,499,106.49	616,589,817.05		4,819,776,546.85
手续费及佣金净收入	1,147,825,439.75	-4,962,501.64	449,063,709.20	53,991,656.25	212,447,084.85	-10.00	81,116,786.35	197,028,369.90		2,136,510,534.66
投资收益		336,504,896.20		62,063,449.12	9,785,607.71		127,893,782.92	212,009,612.57		748,257,348.52
公允价值变动收益		350,826,507.42		-33,179,484.24	555,372.22	132,389,680.21	86,836,919.44	43,341,436.86		580,770,431.91
其他收入	247,632,670.65	-257,721,070.37	4,057,449.79	632,499,671.31	41,371,266.87	475,536,228.01	46,651,617.78	164,210,397.72		1,354,238,231.76
二、营业支出	957,397,519.96	146,637,493.97	346,521,703.37	671,991,391.74	131,067,528.70	124,412,875.32	294,698,859.15	606,838,809.36		3,279,566,181.57
三、营业利润	438,060,590.44	278,010,337.64	106,599,455.62	43,383,900.70	133,091,802.95	483,513,022.90	47,800,247.34	9,751,007.69		1,540,210,365.28
四、资产总额	81,038,690,290.06	47,178,486,191.13	1,641,320,773.66	9,473,183,700.07	919,016,681.71	35,175,490,894.15	13,725,405,344.75	46,533,844,126.67	85,667,244,009.57	150,018,193,992.63
五、负债总额	58,952,960,912.11	42,329,350,592.23	201,948,569.96	7,371,149,367.29	435,365,153.59	24,277,449,256.09	12,081,046,408.29	44,311,505,591.30	74,124,455,415.62	115,836,320,435.24
六、补充信息										
1、折旧和摊销费用	29,205,283.93	1,430,506.74	849,325.65	6,071,638.03	2,564,227.09		5,764,076.70	76,822,772.70		122,707,830.84
2、资本性支出	15,996,310.37	491,282.30	1,575,089.22	1,986,570.15	1,234,215.92		2,814,934.72	26,625,772.59		50,724,175.27

2019年1-6月（按地区）

中泰证券股份有限公司

项目	山东省	上海市	福建省	北京市	浙江省	其他地区	抵销	合计
一、营业收入	3,691,533,731.39	517,625,533.43	39,996,549.29	20,626,017.06	38,901,705.98	511,093,009.70		4,819,776,546.85
手续费及佣金净收入	1,557,399,278.72	276,275,327.53	38,922,314.25	21,713,081.75	40,359,741.04	201,840,791.37		2,136,510,534.66
投资收益	452,782,510.67	123,802,973.14				171,671,864.71		748,257,348.52
公允价值变动收益	450,014,439.86	38,260,804.96				92,495,187.09		580,770,431.91
其他收入	1,231,337,502.14	79,286,427.80	1,074,235.04	-1,087,064.69	-1,458,035.06	45,085,166.53		1,354,238,231.76
二、营业支出	2,322,786,403.80	250,601,610.90	37,626,783.49	59,262,743.66	42,291,791.13	566,996,848.59		3,279,566,181.57
三、营业利润	1,368,747,327.59	267,023,922.53	2,369,765.80	-38,636,726.60	-3,390,085.15	-55,903,838.89		1,540,210,365.28
四、资产总额	198,923,760,678.58	10,284,644,180.74	2,068,090,655.94	1,188,984,213.48	2,078,907,643.71	21,141,050,629.75	85,667,244,009.57	150,018,193,992.63
五、负债总额	163,758,457,533.88	4,216,884,862.58	1,217,963,859.03	1,241,390,278.86	1,584,915,359.05	17,941,163,957.46	74,124,455,415.62	115,836,320,435.24
六、补充信息								
1、折旧和摊销费用	95,896,674.31	5,578,356.88	756,241.61	2,033,804.01	1,235,999.71	17,206,754.32		122,707,830.84
2、资本性支出	36,820,524.42	4,942,783.85	367,039.33	88,874.68	583,551.90	7,921,401.09		50,724,175.27

(3). 公司无报告分部的，或者不能披露各报告分部的资产总额和负债总额的，应说明原因  
适用 不适用

(4). 其他说明  
适用 不适用

**7、 租赁**

适用 不适用

**8、 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具**

适用 不适用

## 9、以公允价值计量的资产和负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末金额
金融资产					
1、交易性金融资产（不含衍生金融资产）	33,342,840,435.15	-18,033,770.14			34,016,242,777.49
2、衍生金融资产	99,279,168.26	-101,407,660.02			90,886,225.93
3、其他债权投资	18,522,040,228.79		-3,147,074.59	26,845,015.60	15,388,370,806.71
4、其他权益工具投资	5,510,778,810.08		-653,592,672.36		5,831,811,877.93
金融资产小计	57,474,938,642.28	-119,441,430.16	-656,739,746.95	26,845,015.60	55,327,311,688.06
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	57,474,938,642.28	-119,441,430.16	-656,739,746.95	26,845,015.60	55,327,311,688.06
金融负债	397,571,507.80	-22,576,934.23			42,900,316.75

10、金融工具项目计量基础分类表

(1). 金融资产计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则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	按照《套期会计》准则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
货币资金	39,839,246,122.10					
结算备付金	7,006,200,141.42					
融出资金	24,657,083,933.21					
衍生金融资产				90,886,225.93		
存出保证金	7,391,484,771.92					
应收款项	748,083,492.80					
买入返售金融资产	10,882,498,894.42					
交易性金融资产				34,016,242,777.49		
债权投资	4,279,309,718.71					
其他债权投资		15,388,370,806.71				
其他权益工具投资		5,831,811,877.93				
其他金融资产	615,400,878.82					
合计	95,419,307,953.40	21,220,182,684.64		34,107,129,003.42		
期初账面价值						
金融资产项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期	按照《金融工具确认和计	按照《套期会计》准则指定为以公

			入其他综合收益的非交易性权益工具投资	损益的金融资产	量》准则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	允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	30,916,047,553.27					
结算备付金	6,763,320,638.78					
融出资金	23,248,873,866.35					
衍生金融资产				99,279,168.26		
存出保证金	5,904,321,055.36					
应收款项	682,845,873.86					
买入返售金融资产	12,572,663,170.37					
交易性金融资产				33,342,840,435.15		
债权投资	4,238,796,066.65					
其他债权投资		18,522,040,228.79				
其他权益工具投资		5,510,778,810.08				
其他金融资产	606,939,496.26					
合计	84,933,807,720.90	24,032,819,038.87		33,442,119,603.41		

(2). 金融负债计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则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	按照《套期会计》准则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
短期借款	4,835,545,025.65			
应付短期融资款	9,452,803,679.46			
拆入资金	2,616,054,024.46			
交易性金融负债		8,838,464.15	4,457,191.07	

衍生金融负债		29,604,661.53		
卖出回购金融资产款	23,869,715,082.85			
代理买卖证券款	41,622,529,820.35			
代理承销证券款	864,177.93			
应付款项	715,845,707.87			
长期借款	274,170,072.60			
应付债券	29,778,557,053.76			
其他金融负债	5,575,506,174.22			
合计	118,741,590,819.15	38,443,125.68	4,457,191.07	
期初账面价值				
金融负债项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则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	按照《套期会计》准则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
短期借款	3,505,844,122.80			
应付短期融资款	3,933,260,648.75			
拆入资金	3,576,357,727.96			
交易性金融负债		345,790,400.45		
衍生金融负债		51,781,107.35		
卖出回购金融资产款	25,496,292,325.94			
代理买卖证券款	33,494,472,707.20			
代理承销证券款	2,754,987.94			
应付款项	372,940,587.24			
长期借款	342,501,181.02			
应付债券	32,212,281,435.85			
其他金融负债	5,608,806,511.51			
合计	108,545,512,236.21	397,571,507.80		

## 11、外币金融资产和金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末金额
金融资产					
1、交易性金融资产	3,782,373,365.26	-6,669,032.41			3,640,956,777.79
2、衍生金融资产	1,717,467.82	2,221,529.89			4,808,236.95
3、贷款和应收款	4,090,263,894.68			54,749,435.10	4,074,615,437.90
4、债权投资	4,238,796,066.65				4,279,309,718.71
5、其他债权投资					76,787,504.38
6、其他权益工具投资	68,745,740.32		-31,654,406.69		62,355,068.16
金融资产小计	12,181,896,534.73	-4,447,502.52	-31,654,406.69	54,749,435.10	12,138,832,743.89
金融负债	10,459,288,477.48	240,826.25			10,507,387,702.56

## 12、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

□适用 √不适用

## 13、其他

□适用 √不适用



十八、 母公司财务报表主要项目注释

1、 长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	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损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备		
一、合营企业										
小计										
二、联营企业										
万家基金管理有限公司	411,514,507.93			46,131,078.04						457,645,585.97
齐鲁股权交易中心有限公司	105,142,772.33			2,823,182.81						107,965,955.14
小计	516,657,280.26			48,954,260.85						565,611,541.11
三、对子公司的投资										
鲁证期货股份有限公司	634,962,543.80									634,962,543.80
中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司	1,996,000,000.00									1,996,000,000.00
中泰金融国际有限公司	1,441,591,000.00									1,441,591,000.00
中泰证券（上海）资产管理有限公司	100,000,000.00									100,000,000.00
齐鲁中泰物业有限公司	809,617,700.12									809,617,700.12
中泰创业投资（深圳）有限公司	289,920,000.00	600,000,000.00								889,920,000.00
小计	5,272,091,243.92	600,000,000.00								5,872,091,243.92
合计	5,788,748,524.18	600,000,000.00		48,954,260.85						6,437,702,785.03

2、应付职工薪酬

(1). 应付职工薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,323,341,522.05	1,316,586,109.52	1,305,445,357.70	1,334,482,273.87
二、离职后福利-设定提存计划	249,679.13	40,900,942.59	41,051,708.52	98,913.20
三、辞退福利	150,640,684.94	578,501.07	20,017,622.47	131,201,563.54
四、一年内到期的其他福利				
合计	1,474,231,886.12	1,358,065,553.18	1,366,514,688.69	1,465,782,750.61

(2). 短期薪酬列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,043,835,637.35	1,164,451,076.37	1,161,488,785.14	1,046,797,928.58
二、职工福利费		7,368,919.56	7,367,487.68	1,431.88
三、社会保险费	173,219.97	31,194,077.99	31,273,758.79	93,539.17
其中：医疗保险费	157,826.42	29,702,445.43	29,767,730.11	92,541.74
工伤保险费	4,281.09	403,100.01	406,432.94	948.16
生育保险费	11,112.46	1,088,532.55	1,099,595.74	49.27
四、住房公积金	51,162.00	61,186,666.52	61,161,624.52	76,204.00
五、工会经费和职工教育经费	279,281,502.73	52,385,369.08	44,153,701.57	287,513,170.24
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	1,323,341,522.05	1,316,586,109.52	1,305,445,357.70	1,334,482,273.87

(3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	240,487.82	39,299,181.05	39,443,440.73	96,228.14
2、失业保险费	9,191.31	1,601,761.54	1,608,267.79	2,685.06
3、企业年金缴费				
合计	249,679.13	40,900,942.59	41,051,708.52	98,913.20

其他说明：

□适用 √不适用

3、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	1,941,132,325.40	1,983,942,753.35
其中：货币资金及结算备付金利息	417,757,268.38	340,502,481.68

收入		
拆出资金利息收入		
融出资金利息收入	826,176,851.98	736,118,533.55
买入返售金融资产利息收入	336,080,785.71	579,526,602.19
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	311,761,916.12	495,238,743.53
债权投资利息收入		
其他债权投资利息收入	360,460,066.20	327,795,135.93
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	657,353.13	
利息支出	1,130,642,070.90	1,405,698,213.70
其中：短期借款利息支出		
应付短期融资款利息支出	94,589,285.77	103,710,141.87
拆入资金利息支出	60,830,195.41	46,386,837.35
其中：转融通利息支出	60,445,973.19	45,988,809.57
卖出回购金融资产利息支出	297,866,999.50	419,851,679.07
其中：报价回购利息支出	1,760,295.45	
代理买卖证券款利息支出	55,616,695.06	50,725,363.11
长期借款利息支出		
应付债券利息支出	614,696,372.65	777,862,831.18
其中：次级债券利息支出	228,061,336.33	503,953,328.15
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出		
其他利息支出	7,042,522.51	7,161,361.12
利息净收入	810,490,254.50	578,244,539.65

## 4、手续费及佣金净收入

## (1). 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1.证券经纪业务净收入	1,505,137,545.23	1,288,226,495.40
证券经纪业务收入	2,130,634,121.79	1,690,915,454.33
其中：代理买卖证券业务	1,827,209,054.81	1,523,402,106.66
交易单元席位租赁	257,650,182.62	136,947,198.57
代销金融产品业务	45,774,884.36	30,566,149.10
证券经纪业务支出	625,496,576.56	402,688,958.93
其中：代理买卖证券业务	596,610,451.39	382,436,914.70
交易单元席位租赁	28,074,810.40	18,029,842.95
代销金融产品业务	811,314.77	2,222,201.28
2.期货经纪业务净收入		
期货经纪业务收入		
期货经纪业务支出		
3.投资银行业务净收入	415,406,441.57	455,036,495.22
投资银行业务收入	416,943,337.30	465,934,434.48
其中：证券承销业务	341,900,291.66	328,697,484.65
证券保荐业务	7,641,509.42	4,569,341.42

财务顾问业务	67,401,536.22	132,667,608.41
投资银行业务支出	1,536,895.73	10,897,939.26
其中：证券承销业务	451,990.18	10,897,939.26
证券保荐业务	990,565.93	
财务顾问业务	94,339.62	
4.资产管理业务净收入		
资产管理业务收入		
资产管理业务支出		
5.基金管理业务净收入		
基金管理业务收入		
基金管理业务支出		
6.投资咨询业务净收入	55,253,144.02	32,754,957.41
投资咨询业务收入	55,253,144.02	32,765,464.20
投资咨询业务支出		10,506.79
7.其他手续费及佣金净收入	7,717,268.00	7,961,322.66
其他手续费及佣金收入	18,798,089.66	21,035,405.44
其他手续费及佣金支出	11,080,821.66	13,074,082.78
合计	1,983,514,398.82	1,783,979,270.69
其中：手续费及佣金收入	2,621,628,692.77	2,210,650,758.45
手续费及佣金支出	638,114,293.95	426,671,487.76

(2). 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	13,349,056.60	10,943,396.22
并购重组财务顾问业务净收入--其他	2,688,679.25	
其他财务顾问业务净收入	51,269,460.75	121,724,212.19

(3). 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	99,317,953,498.22	45,774,884.36	76,498,904,514.12	28,609,635.47
银行理财产品				
信托			418,590,000.00	1,956,513.63
合计	99,317,953,498.22	45,774,884.36	76,917,494,514.12	30,566,149.10

(4). 资产管理业务

□适用 √不适用

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

5. 投资收益

(1). 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益		34,769,684.28
权益法核算的长期股权投资收益	48,954,260.85	19,381,863.18
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	654,707,291.58	325,631,110.77
其中：持有期间取得的收益	432,662,737.60	453,578,060.03
— 交易性金融工具	427,069,292.85	437,816,135.73
— 其他权益工具投资	5,593,444.75	15,761,924.30
— 衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	222,044,553.98	-127,946,949.26
— 交易性金融工具	112,746,093.57	-193,002,169.49
— 其他债权投资	51,938,696.01	76,344,568.14
— 债权投资		
— 衍生金融工具	57,359,764.40	-11,289,347.91
其他		
合计	703,661,552.43	379,782,658.23

## (2). 交易性金融工具投资收益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	427,069,292.85	444,151,166.92
	处置取得收益	97,316,876.40	-192,699,899.49
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	持有期间收益		
	处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		-6,335,031.19
	处置取得收益	15,429,217.17	-302,270.00
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	持有期间收益		
	处置取得收益		

## 6、公允价值变动收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	105,921,575.86	646,886,159.32
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	-23,207,610.00	-2,020,870.00
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	-106,781,431.59	-40,416,474.55

其他		
合计	-24,067,465.73	604,448,814.77

## 7、业务及管理费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	1,358,065,553.18	1,401,845,869.19
租赁费	139,614,682.90	144,954,243.56
交易所会员年费	46,874,142.21	17,995,114.14
电子设备运转费	42,108,062.01	34,162,495.82
折旧费	41,896,009.26	39,917,562.87
无形资产摊销	28,310,401.68	25,677,745.80
咨询信息费	25,510,024.15	18,241,722.50
通讯费	21,445,301.96	21,419,602.18
广告费	18,986,025.53	12,181,083.56
投资者保护基金	17,830,365.56	34,275,233.36
长期待摊费用摊销	16,808,795.20	19,189,054.66
物业管理费	14,850,912.15	16,499,090.89
业务招待费	14,113,035.32	21,180,683.77
差旅费	11,034,811.49	25,077,287.63
安全防范费	3,677,172.45	4,038,052.76
其他	93,052,792.39	92,220,716.64
合计	1,894,178,087.44	1,928,875,559.33

## 8、其他

□适用 √不适用

## 十九、补充资料

### 1、当期非经常性损益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	19,889,674.26	
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	17,385,417.55	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-8,344,230.07	
所得税影响额	-6,776,356.64	
少数股东权益影响额	-193,968.50	
合计	21,960,536.60	

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

□适用 √不适用

### 2、净资产收益率及每股收益

√适用 □不适用

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	每股收益	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	4.27	0.19	0.19
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	4.20	0.19	0.19

本公司不存在稀释性潜在普通股，故本公司稀释每股收益等于基本每股收益。

### 3、境内外会计准则下会计数据差异

□适用 √不适用

### 4、其他

□适用 √不适用

## 第十一节 备查文件目录

备查文件目录	载有法定代表人签名的半年度报告文本
	载有法定代表人、主管会计机构负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报告原文。

董事长：李玮

董事会批准报送日期：2020年8月27日

### 修订信息

□适用 √不适用

## 第十二节 证券公司信息披露

### 一、公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

行政许可批复时间	行政许可批复名称	行政许可批复文号
2020年1月22日	关于核准中泰证券股份有限公司设立浙江分公司等6家分支机构的批复	鲁证监许可【2020】2号
2020年4月17日	关于核准中泰证券股份有限公司首次公开发行股票批复	证监许可【2020】736号
2020年6月1日	关于中泰证券股份有限公司人民币普通股股票上市交易的通知	上海证券交易所自律监管决定书【2020】149号
2020年5月6日	关于中泰证券股份有限公司香港子公司设立日本子公司的复函	机构部函[2020]1000号

2020年6月17日	关于对中泰证券股份有限公司为境外子公司提供跨境担保有关意见的复函	机构部函[2020]1414号
------------	----------------------------------	-----------------

## 二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 不适用

公司 2019 年分类评价结果为 A 类 A 级