

证券代码：002500

证券简称：山西证券

公告编号：定 2020—三季报

山西证券股份有限公司 2020 年第三季度报告正文

第一节 重要提示

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

公司负责人侯巍先生、主管会计工作负责人汤建雄先生及会计机构负责人张立德先生声明：保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

本报告已经公司第三届董事会第五十七次会议审议通过，会议应出席董事 8 名，实际出席董事 8 名（其中现场出席的有侯巍董事长、王怡里职工董事；杨增军董事、李华董事、夏贵所董事、容和平独立董事、朱海武独立董事电话参会；因工作原因，蒋岳祥独立董事书面委托朱海武独立董事出席会议并行使表决权）。

公司 2020 年第三季度财务报告未经会计师事务所审计。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

是 否

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减	
总资产（元）	67,611,223,990	55,695,777,181	21.39%	
归属于上市公司股东的净资产（元）	16,831,390,787	12,654,476,555	33.01%	
	本报告期	本报告期比上年同期增减	年初至报告期末	年初至报告期末比上年同期增减
营业总收入（元）	938,761,942	-22.75%	2,702,725,301	-37.89%
归属于上市公司股东的净利润（元）	211,246,325	164.46%	716,612,801	41.04%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润（元）	214,071,050	182.47%	712,399,376	42.09%
经营活动产生的现金流量净额（元）	-4,399,683,453	不适用	-2,178,392,477	-185.25%
基本每股收益（元/股）	0.0588	108.51%	0.2390	33.07%
稀释每股收益（元/股）	0.0588	108.51%	0.2390	33.07%
加权平均净资产收益率	1.26%	增长 0.63 个百分点	5.07%	增长 1.02 个百分点

注：公司本报告期及年初至报告期末营业总收入较上年同期均有所下降，主要是由于子公司大宗商品交易及风险管理业务规模减少所致。

截止披露前一交易日的公司总股本：

截止披露前一交易日的公司总股本（股）	3,589,771,547
--------------------	---------------

用最新股本计算的全面摊薄每股收益：

	本报告期	年初至报告期末
用最新股本计算的全面摊薄每股收益（元/股）	0.0588	0.1996

非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元

项目	年初至报告期末金额	说明
非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）	-79,743	-

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）	15,547,980	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-11,358,226	-
小计	4,110,011	-
减：所得税影响额	1,337,811	-
少数股东权益影响额（税后）	-1,441,225	-
合计	4,213,425	--

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的说明：

√ 适用 □ 不适用

项目	涉及金额（元）	原因
金融工具、长期股权投资的投资收益	1,293,162,949	由于证券投资业务为本公司的主营业务，因此持有以及处置金融工具、长期股权投资取得的投资收益不界定为非经常性损益。
交易性金融工具及衍生金融工具公允价值变动损益	-113,642,847	由于证券投资业务为本公司的主营业务，因此持有交易性金融工具及衍生金融工具产生的公允价值变动损益不界定为非经常性损益。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东和表决权恢复的优先股股东总数及前10名股东持股情况表

单位：股

报告期末普通股股东总数（户）	156,705					
前10名股东持股情况						
股东名称	股东性质	持股比例	持股数量	持有有限条件的股份数量	质押或冻结情况	
					股份状态	数量
山西金融投资控股集团有限公司	国有法人	31.34%	1,124,908,792	-	-	-
太原钢铁（集团）有限公司	国有法人	10.03%	359,958,616	-	-	-
山西国际电力集团有限公司	国有法人	5.55%	199,268,856	-	-	-
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	1.47%	52,805,220	-	-	-
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	基金、理财产品等	1.25%	45,030,681	-	-	-
中吉金投资管理有限公司—中吉金投—稳赢2号投资基金	基金、理财产品等	1.25%	44,788,100	-	-	-
香港中央结算有限公司	境外法人	1.05%	37,680,186	-	-	-

郑州热力集团有限公司	国有法人	0.96%	34,321,745	-	-	-
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	基金、理财产品等	0.67%	23,926,510	-	-	-
山西省科技基金发展有限公司	国有法人	0.62%	22,100,000	-	-	-
前 10 名无限售条件股东持股情况						
股东名称	持有无限售条件股份数量	股份种类				
		股份种类	数量			
山西金融投资控股集团有限公司	1,124,908,792	人民币普通股	1,124,908,792			
太原钢铁（集团）有限公司	359,958,616	人民币普通股	359,958,616			
山西国际电力集团有限公司	199,268,856	人民币普通股	199,268,856			
中央汇金资产管理有限责任公司	52,805,220	人民币普通股	52,805,220			
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	45,030,681	人民币普通股	45,030,681			
中吉金投资资产管理有限公司—中吉金投—稳赢 2 号投资基金	44,788,100	人民币普通股	44,788,100			
香港中央结算有限公司	37,680,186	人民币普通股	37,680,186			
郑州热力集团有限公司	34,321,745	人民币普通股	34,321,745			
中国建设银行股份有限公司—华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	23,926,510	人民币普通股	23,926,510			
山西省科技基金发展有限公司	22,100,000	人民币普通股	22,100,000			
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中，太原钢铁（集团）有限公司、山西国际电力集团有限公司及山西省科技基金发展有限公司受同一主体控制，存在关联关系；未知其他股东之间是否存在关联关系或一致行动。					
前 10 名股东参与融资融券业务情况说明	截止 2020 年 9 月 30 日，公司股东太原钢铁（集团）有限公司进行融资融券业务，出借持有的公司股份 7,310,000 股。					

公司前 10 名普通股股东、前 10 名无限售条件普通股股东在报告期内是否进行约定购回交易

是 否

2、公司优先股股东总数及前 10 名优先股股东持股情况表

适用 不适用

第三节 重要事项

一、报告期主要财务数据、财务指标发生变动的情况及原因

√ 适用 □ 不适用

单位：人民币元

项目	2020年9月30日	2019年12月31日	较上年末增减	变动原因
结算备付金	3,691,971,649	2,620,361,716	40.90%	在登记公司存款增加
衍生金融资产	7,611,991	18,351,897	-58.52%	衍生金融资产规模减少
交易性金融资产	29,756,630,733	22,247,491,671	33.75%	交易性金融资产规模增加
其他债权投资	738,442,672	1,165,745,108	-36.65%	公司持有债券规模减少
应付短期融资款	6,788,068,562	4,323,301,803	57.01%	发行收益凭证规模增加
交易性金融负债	588,442,750	2,132,321,710	-72.40%	交易性金融负债规模减少
衍生金融负债	133,182,888	19,615,860	578.96%	衍生金融负债规模增加
卖出回购金融资产款	17,641,796,926	12,200,643,294	44.60%	正回购业务规模增加
应交税费	168,269,962	93,071,311	80.80%	应交企业所得税增加
应付款项	144,640,173	25,186,640	474.27%	应付手续费及佣金支出增加
递延所得税负债	18,746,389	33,049,056	-43.28%	金融资产公允价值变动影响
其他负债	771,132,810	1,405,958,569	-45.15%	应付结构化主体其他受益人款项减少
资本公积	9,723,419,390	6,713,296,178	44.84%	配股募集资金影响
其他综合收益	-77,060,694	-54,799,201	不适用	其他债权投资公允价值变动及外币报表折算差额影响
项目	2020年1-9月	2019年1-9月	同比增减	变动原因
经纪业务手续费净收入	531,607,892	408,054,267	30.28%	受市场行情影响
投资银行业务手续费净收入	483,696,778	282,572,164	71.18%	受投行业务行情影响
利息净收入	26,846,100	-95,747,304	不适用	报告期应付收益凭证及卖出回购金融资产款利息支出减少

利润表	投资收益	1,293,162,949	932,748,496	38.64%	受市场行情影响, 自营投资收益增加
	公允价值变动收益	-113,642,847	161,448,794	-170.39%	证券市场波动导致相关金融资产的公允价值变动
	汇兑收益	-3,997,314	-12,207,815	不适用	汇率变动影响
	其他业务收入	335,146,904	2,535,115,602	-86.78%	大宗商品交易及风险管理业务规模减少
	其他收益	15,547,980	9,218,939	68.65%	与日常经营相关的政府补助增加
	资产处置(损失)/收益	-79,743	1,226,716	-106.50%	固定资产处置损失
	其他资产减值损失	411,152	12,098,340	-96.60%	存货价格上升, 冲回减值损失影响
	其他业务成本	349,914,861	2,503,149,001	-86.02%	大宗商品交易及风险管理业务规模减少
	营业外收入	3,741,294	1,568,584	138.51%	非日常经营活动产生的收入增加
	营业外支出	15,099,520	3,032,943	397.85%	非日常经营活动产生的支出及捐赠支出增加
	所得税费用	249,768,753	180,068,286	38.71%	报告期利润增加影响
	其他权益工具投资公允价值变动	9,870,209	-130,273,920	不适用	证券市场波动导致持仓权益工具的价格波动
	其他债权投资公允价值变动	-19,100,710	-11,982,473	不适用	证券市场波动导致持仓其他债权投资的价格波动
	其他债权投资信用损失准备	4,375,788	33,005,009	-86.74%	其他债权投资预期信用损失减少
	外币财务报表折算差额	-17,406,780	26,031,433	-166.87%	汇率变动影响
	归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	712,433	-354,736	不适用	子公司金融工具公允价值变动影响
	项目	2020年1-9月	2019年1-9月	同比增减	变动原因
现金流量表	经营活动产生的现金流量净额	-2,178,392,477	2,555,343,368	-185.25%	报告期内, 交易性金融资产增加, 交易性金融负债减少
	投资活动产生的现金流量净额	-535,083,074	-198,544,801	不适用	报告期内, 子公司购买大额存单
	筹资活动产生的现金流量净额	5,606,183,234	-742,832,745	不适用	报告期内, 完成配股, 偿还债券及收益凭证规模减少
	汇率变动对现金的影响	-16,389,783	24,432,845	-167.08%	汇率变动影响

二、重要事项进展情况及影响和解决方案的分析说明

序号	重要事项概述	披露日期	临时报告披露 网站查询索引
1	<p>债券相关事项</p> <p>公司分别于2020年8月4日和8月28日收到中国证券监督管理委员会出具的《关于同意山西证券股份有限公司向专业投资者公开发行人公司债券注册的批复》（证监许可【2020】1606号）、《关于同意山西证券股份有限公司向专业投资者公开发行人次级公司债券注册的批复》（证监许可【2020】1924号）（详见公司公告：临2020-069、临2020-076）。</p> <p>报告期内，公司成功发行“山西证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）”，并于 2020 年 9 月 8 日起在深圳证券交易所集中竞价系统和综合协议交易平台双边挂牌交易，面向专业投资者交易（详见公司《2020 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）发行公告》、《2020 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）募集说明书》、《2020 年面向专业投资者公开发行人公司债券信用评级报告》、《2020 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）发行结果公告》、《2020 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）在深圳证券交易所上市的公告》等公告）。</p>	2020.08.06 2020.08.29	
2	<p>公司 2019 年度配股公开发行人事项</p> <p>根据相关规定及公司股东大会对董事会的授权，2020 年 7 月 3 日公司与晋商银行股份有限公司太原南中环支行及保荐机构中信证券股份有限公司签订了《募集资金三方监管协议》（详见公司公告：临 2020-063）。</p> <p>经深圳证券交易所同意，公司本次配股共计配售 761,046,394 股人民币普通股于 2020 年 7 月 10 日起上市。本次配股发行完成后，公司股权分布仍符合《深圳证券交易所股票上市规则》规定的上市条件。公司本次配股发行前总股本为 2,828,725,153 股，本次配股新增上市股份 761,046,394 股，公司本次配股完成后总股本为 3,589,771,547 股（详见公司公告：临 2020-065）。</p> <p>根据公司第三届董事会第四十次会议决议、2018 年度股东大会决议、2020 年第三次临时股东大会决议及本次配股发行结果，公司对《山西证券股份有限公司章程》涉及公司注册资本、股份总数等相应条款进行了修订（详见公司公告：临 2020-068）。</p> <p>本次配股完成后，持有公司股份 5%以上股东山西国际电力集团有限公司在持股数量不变的情况下持有公司股份的比例变动超过 1%（详见公司公告：临 2020-066）。</p>	2020.07.04 2020.07.08 2020.07.15	巨潮资讯网 (http://www.cninfo.com.cn)
3	<p>公司处置分支机构事项</p> <p>为进一步优化营业网点布局，公司决定撤销济宁吴泰闸路证券营业部、金华八一南街证券营业部、太原长治路证券营业部、太原晋祠路证券营业部。公司将按照《中华人民共和国证券法》和《关于取消或调整证券公司部分行政审批项目等事项的公告》（证监会公告[2020]18号）等相关规定要求，妥善处理分支机构客户资产，结清分支机构业务并终止经营活动，办理工商注销等相关手续，并向上述证券营业部所在地中国证监会派出机构备案。（详见公司公告：临 2020-045、临 2020-081、临 2020-082）。</p> <p>截至本报告披露日，撤销上述营业部的相关事项正有序进行中。</p>	2020.05.06 2020.10.15 2020.10.20	
4	<p>股东股份质押事项</p>	2020.06.19	

	<p>2020年6月,公司接到控股股东山西金融投资控股集团有限公司(以下简称“山西金控”)书面通知,其将所持有本公司的部分股份质押。山西金控直接持有公司股份865,314,455股,占公司总股本的30.59%,本次质押430,000,000股,占其所持公司股份的49.69%(详见公司公告:临2020-059)。</p> <p>2020年9月,公司接到控股股东山西金控通知,上述质押股份解除质押(具体详见公司公告:临2020-077、临2020-078)。</p>	<p>2020.09.18</p> <p>2020.09.22</p>	
5	<p>股东权益变动事项</p> <p>山西省国有资本运营有限公司拟将持有的太原钢铁(集团)有限公司(以下简称“太钢集团”)51%股权无偿划转至中国宝武钢铁集团有限公司(以下简称“中国宝武”),中国宝武取得太钢集团51.00%的股权,从而间接取得山西证券367,268,616股股份,占山西证券总股本的比例为10.23%(详见公司公告:临2020-075、《简式权益变动报告书》)。</p> <p>公司于2020年9月收到太钢集团转来的国务院国资委《关于太原钢铁(集团)有限公司国有股权无偿划转有关事项的批复》(国资产权【2020】519号),国务院国资委同意上述划转(详见公司公告:临2020-079)。</p>	<p>2020.08.25</p> <p>2020.10.09</p>	
6	<p>新增借款事项</p> <p>公司2019年末经审计净资产为132.16亿元,借款余额为284.71亿元。截至2020年9月30日,公司借款余额为367.31亿元,累计新增借款82.60亿元,累计新增借款占上年末净资产比例为62.50%。</p> <p>上述新增借款符合相关法律法规的规定,属于公司正常经营活动范围。公司财务状况稳健,目前所有债务均按时还本付息,上述新增借款事项不会对公司经营情况和偿债能力产生不利影响(详见公司公告:临2020-080及公司债券受托管理事务临时报告)。</p>	<p>2020.10.15</p> <p>2020.10.20</p>	

股份回购的实施进展情况

适用 不适用

采用集中竞价方式减持回购股份的实施进展情况

适用 不适用

三、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超期未履行完毕的承诺事项

适用 不适用

公司报告期不存在公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内超期未履行完毕的承诺事项。

四、金融资产投资

1、证券投资情况

适用 不适用

单位:元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
国开债	200210	20 国开 10	5,111,677,804	公允价值	-	-12,911,134	-	129,511,653,467	124,399,975,664	-90,421,033	5,146,500,600	交易性金融资产	自有
国债	209941	20 贴现国债 41	1,292,846,100	公允价值	-	-87,100	-	1,292,846,100	-	2,150,664	1,295,151,000	交易性金融资产	自有
资管计划	szfof	山西证券 FOF 单一资管计划	500,000,000	公允价值	501,723,174	-	-	9,020,540	-	-	510,743,713	交易性金融资产	自有
其他债券	114022	16 富力 11	419,641,763	公允价值	370,539,830	-	-	419,641,763	-	23,152,612	445,544,400	交易性金融资产	自有
银行理财	XTL1901	添利宝 2 号	410,000,000	公允价值	-	-	-	1,046,000,000	636,000,000	8,600,417	410,000,000	交易性金融资产	自有
国债	209942	20 贴现国债 42	397,641,384	公允价值	-	78,616	-	994,103,460	596,462,076	1,056,245	398,323,600	其他债权投资	自有
货币基金	001176	山西证券日日添利 B	276,505,592	公允价值	276,505,592	-	-	342,443,540	278,312,027	2,513,724	340,637,105	交易性金融资产	自有
国开债	200212	20 国开 12	308,882,688	公允价值	-	-929,928	-	8,344,205,592	8,035,322,904	3,590,877	310,193,750	交易性金融资产	自有
银行理财	BJ02PLUS	易加益 2 号 PLUS	300,000,000	公允价值	-	4,196,548	-	340,000,000	40,000,000	91,178	304,196,548	交易性金融资产	自有
公司债券	175119	20 万达 01	300,000,000	公允价值	-	-	-	300,000,000	-	1,018,760	299,958,900	交易性金融资产	自有
期末持有的其他证券投资			20,855,818,573	--	22,503,841,933	-103,989,849	-21,549,060	2,949,851,748,349	2,951,199,046,405	1,227,766,658	21,273,874,612	--	--
合计			30,173,013,904	--	23,652,610,529	-113,642,847	-21,549,060	3,092,451,662,811	3,085,185,119,076	1,179,520,102	30,735,124,228	--	--
证券投资审批董事会公告披露日期			2020 年 4 月 28 日										

证券投资审批股东会公告披露日期	无
-----------------	---

2、衍生品投资情况

适用 不适用

五、募集资金投资项目进展情况

适用 不适用

报告期内，公司面向专业投资者公开发行 2020 年公司债券（第一期）募集资金总额 14.97 亿元，已累计使用 14.97 亿元，全部用于偿还公司债务。

报告期内，公司 2020 年配股募集资金 37.57 亿元，已累计使用 37.57 亿元。其中，用于债券自营业务资金 20 亿元，用于资本中介业务资金 12.57 亿元，向子公司增资 5.00 亿元。

六、对 2020 年度经营业绩的预计

适用 不适用

七、日常经营重大合同

适用 不适用

八、委托理财

适用 不适用

公司报告期不存在委托理财。

九、违规对外担保情况

适用 不适用

公司报告期无违规对外担保情况。

十、控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

适用 不适用

公司报告期不存在控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金。

十一、报告期内接待调研、沟通、采访等活动登记表

接待时间	接待地点	接待方式	接待对象类型	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料	调研的基本情况索引
2020.07.01-2020.09.30	公司	电话沟通	个人	投资者	公司经营情况、行业状况及公司公告内容	-