

**国信证券股份有限公司**  
**2021 年年度报告**



**国信证券**  
GUOSEN SECURITIES

**2022 年 4 月**

## 第一节 重要提示、目录和释义

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

公司负责人张纳沙、主管会计工作负责人及会计机构负责人周中国声明：保证本年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本报告经公司第五届董事会第六次会议审议通过。所有董事均已出席了审议本报告的董事会会议。未有董事、监事、高级管理人员对本报告提出异议。

公司 2021 年度财务报告已经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了无保留意见的审计报告。

本报告中涉及的未来发展计划等前瞻性陈述属于计划性事项，不构成公司对投资者的实质性承诺，敬请投资者注意投资风险。

公司经营中面临的风险主要有市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险等，公司建立了完善的内部控制体系、合规管理体系和风险控制指标动态监管体系，确保公司经营在风险可测、可控、可承受的范围内开展。请投资者认真阅读本年度报告第四节“公司治理”，并特别注意上述风险因素。

经公司第五届董事会第六次会议审议通过的利润分配预案为：以 2021 年 12 月 31 日总股本 9,612,429,377 为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 5.00 元（含税），不进行送股或以公积金转增股本。

# 目录

第一节 重要提示、目录和释义.....	1
第二节 公司简介和主要财务指标.....	5
第三节 管理层讨论与分析.....	20
第四节 公司治理 .....	49
第五节 环境和社会责任.....	81
第六节 重要事项 .....	86
第七节 股份变动及股东情况.....	106
第八节 优先股相关情况.....	112
第九节 债券相关情况.....	113
第十节 财务报告 .....	121
第十一节 证券公司信息披露.....	122

## 备查文件目录

- (一) 载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签名并盖章的财务报表。
- (二) 载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件。
- (三) 报告期内公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

# 释义

释义项	指	释义内容
国信证券、公司、本公司	指	国信证券股份有限公司
董事会	指	国信证券股份有限公司董事会
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
中国保监会	指	原中国保险监督管理委员会
香港证监会	指	香港证券及期货事务监察委员会
深圳证监局	指	中国证券监督管理委员会深圳监管局
上海证监局	指	中国证券监督管理委员会上海监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
中证协	指	中国证券业协会
股转公司	指	全国中小企业股份转让系统有限责任公司
中登公司	指	中国证券登记结算有限责任公司
证金公司	指	中国证券金融股份有限公司
深圳市国资委	指	深圳市人民政府国有资产监督管理委员会
深投控	指	深圳市投资控股有限公司
华润信托	指	华润深国投信托有限公司
云南红塔	指	原云南红塔集团有限公司
云南合和	指	云南合和（集团）股份有限公司
中国一汽	指	中国第一汽车集团有限公司
一汽投资	指	一汽股权投资（天津）有限公司
北京城建	指	北京城建投资发展股份有限公司
国信弘盛	指	国信弘盛私募基金管理有限公司
国信期货	指	国信期货有限责任公司
国信香港	指	国信证券（香港）金融控股有限公司
国信资本	指	国信资本有限责任公司
鹏华基金	指	鹏华基金管理有限公司
REITs	指	基础设施证券投资基金
MSCI	指	明晟指数
QFII	指	合格境外机构投资者
RQFII	指	人民币合格境外机构投资者
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》	指	《国信证券股份有限公司章程》
报告期	指	2021 年
报告期末	指	2021 年 12 月 31 日
元	指	人民币元

2021 年年度报告中，部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异，这些差异是由于四舍五入造成的。

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司信息

股票简称	国信证券	股票代码	002736
变更后的股票简称	不适用		
股票上市证券交易所	深圳证券交易所		
公司的中文名称	国信证券股份有限公司		
公司的中文简称	国信证券		
公司的外文名称	GUOSEN SECURITIES CO., LTD.		
公司的外文名称缩写	GUOSEN SECURITIES		
公司的法定代表人	张纳沙		
公司的总经理	邓舸		
注册地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
注册地址的邮政编码	518001		
公司注册地址历史变更情况	不适用		
主要办公地址	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦		
主要办公地址的邮政编码	518046		
公司网址	<a href="http://www.guosen.com.cn">http://www.guosen.com.cn</a>		
电子信箱	ir@guosen.com.cn		
公司注册资本	96.12 亿元		
公司净资产	759.68 亿元		

### 二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	谌传立	蔡妮芬
联系地址	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 45 楼	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 45 楼
电话	0755-82130188	0755-82130188
传真	0755-82133453	0755-82133453
电子信箱	ir@guosen.com.cn	ir@guosen.com.cn

### 三、信息披露及备置地点

公司披露年度报告的证券交易所网站	深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> )
公司披露年度报告的媒体名称及网址	《证券时报》( <a href="http://www.stcn.com">http://www.stcn.com</a> ) 《中国证券报》( <a href="https://www.cs.com.cn">https://www.cs.com.cn</a> ) 《上海证券报》( <a href="https://www.cnstock.com">https://www.cnstock.com</a> ) 《证券日报》( <a href="http://www.zqrb.cn">http://www.zqrb.cn</a> )
公司年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 45 楼董事会办公室

#### 四、注册变更情况

统一社会信用代码	914403001922784445
公司上市以来主营业务的变化情况	公司的经营范围为：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；金融产品代销；为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管业务；股票期权做市。公司上市以来主营业务未发生变化。
历次控股股东的变更情况	公司控股股东为深投控，报告期内未发生变更。

#### 五、各单项业务资格

##### （一）报告期末，公司及控股子公司获取的各单项业务资格情况

##### 1. 经纪及财富管理业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2001年2月5日	网上证券委托业务资格	中国证监会
2	2002年8月6日	开放式证券投资基金代销业务资格	中国证监会
3	2005年8月22日	权证买入合格结算参与者	中登公司
4	2006年3月28日	中国证券登记结算有限责任公司结算参与者	中登公司
5	2008年2月1日	中国证券登记结算有限公司甲类结算参与者	中登公司
6	2008年5月13日	为国信期货提供中间介绍业务资格	中国证监会
7	2011年2月23日	向保险机构投资者提供交易单元	中国保监会
8	2011年5月20日	开展客户资金第三方存管客户多银行服务资格	深圳证监局
9	2011年9月16日	外币有价证券经纪业务、承销业务资格	国家外汇管理局
10	2012年12月21日	私募基金资产托管业务试点资格	中国证监会
11	2013年3月14日	代销金融产品业务资格	深圳证监局
12	2013年12月31日	证券投资基金托管资格	中国证监会
13	2014年3月11日	开展客户证券资金消费支付服务资格	中国证监会
14	2014年9月17日	开展互联网证券业务试点资格	中证协
15	2014年10月14日	A股交易单元的港股通业务交易权限	上交所
16	2015年1月16日	股票期权经纪业务、自营业务交易参与者资格	上交所
17	2015年1月16日	期权业务结算资格	中登公司
18	2015年1月22日	衍生品合约账户开户资格	中登公司
19	2015年4月21日	私募基金份额登记外包服务资格、估值核算外包服务资格	中国证券投资基金业协会
20	2016年11月3日	深港通下港股通业务交易权限	深交所
21	2019年3月26日	证券账户业务无纸化业务资格	中登公司
22	2021年6月2日	基金投资顾问业务试点资格	中国证监会
23	2021年11月30日	账务管理功能优化试点业务资格	中国证监会

**2. 投资银行业务**

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2004年	保荐机构资格	中国证监会
2	2005年10月31日	从事短期融资券承销业务资格	中国人民银行
3	2012年6月11日	中小企业私募债承销业务资格	中证协
4	2013年1月4日	银行间非金融企业债务融资工具主承销业务资格	中国银行间市场交易商协会
5	2013年3月21日	全国股转系统主办券商资格	股转公司
6	2013年5月8日	军工涉密业务咨询服务	国家国防科技工业局
7	2013年8月29日	浙江股权交易中心会员	中证协
8	2013年12月30日	新疆股权交易中心会员	中证协
9	2014年2月19日	海峡股权交易中心会员	中证协
10	2020年12月18日	非金融企业债务融资工具独立主承销商资质	中国银行间市场交易商协会

**3. 投资与交易业务**

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	1999年9月21日	进入银行间同业市场资格	中国人民银行
2	2007年7月10日	上交所固定收益证券综合电子平台交易商资格	上交所
3	2009年4月24日	从事债券质押式报价回购业务试点资格	中国证监会
4	2011年3月21日	自营业务参与股指期货交易资格	深圳证监局
5	2012年12月21日	柜台交易业务资格	中证协
6	2013年7月29日	柜台市场股票协议逆回购业务、场外期权柜台交易业务、柜台市场权益收益互换交易业务方案备案	中证协
7	2013年12月18日	期权全真模拟交易经纪业务	上交所
8	2013年12月18日	期权全真模拟交易自营业务	上交所
9	2013年12月18日	全真模拟交易做市商业业务	上交所
10	2014年5月21日	开展场外市场收益凭证业务试点资格	中证协
11	2014年5月23日	修改收益互换与场外期权业务方案的备案	中证协
12	2014年7月2日	作为主办券商从事做市业务的资格	股转公司
13	2015年2月6日	股票期权做市业务资格	中国证监会
14	2015年3月4日	非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务资格	北京金融资产交易所有限公司
15	2015年3月19日	债券交易净额清算业务资格	银行间市场清算所股份有限公司
16	2015年4月3日	标准债券远期集中清算业务资格	银行间市场清算所股份有限公司
17	2015年5月5日	非金融企业债务融资工具报价业务资格	中国银行间市场交易商协会
18	2016年3月1日	上证50ETF期权合约品种主做市商资格	上交所
19	2018年7月31日	场外期权业务二级交易商资格	中证协
20	2019年2月28日	信用衍生品业务资格	中国证监会
21	2019年3月22日	银行间债券市场尝试做市业务资格	全国银行间同业拆借中心
22	2019年4月8日	上交所信用保护合约核心交易商	上交所
23	2019年7月3日	深交所信用保护合约核心交易商	深交所
24	2019年12月11日	信用保护凭证创设机构	上交所
25	2019年12月11日	深交所沪深300ETF期权主做市商资格	深交所
26	2019年12月18日	中金所沪深300股指期货期权主做市商资格	中国金融期货交易所



27	2019年12月23日	上交所沪深300ETF期权主做市商资格	上交所
28	2020年4月8日	债券通报价机构	中国外汇交易中心
29	2021年6月29日	信用缓释工具一般交易商资格	银行间交易商协会

#### 4. 资产管理业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2002年6月23日	客户资产管理业务资格	中国证监会
2	2008年3月2日	合格境内机构投资者从事境外证券投资业务资格	中国证监会
3	2011年6月14日	资产管理业务参与股指期货交易资格	深圳证监局
4	2012年7月31日	开展现金管理产品试点	中国证监会
5	2013年3月5日	受托保险资金管理业务资格	中国保监会

#### 5. 资本中介业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2010年3月18日	融资融券业务资格	中国证监会
2	2012年5月22日	约定购回式证券交易业务试点资格	中国证监会
3	2012年5月29日	约定购回式证券交易权限	上交所
4	2012年8月29日	转融通业务试点资格	证金公司
5	2012年10月26日	上市公司股权激励行权融资业务试点资格	中国证监会
6	2013年1月12日	约定购回式证券交易权限	深交所
7	2013年2月25日	转融通证券出借交易权限	深交所
8	2013年2月27日	转融通证券出借交易权限	上交所
9	2013年6月21日	股票质押式回购交易权限	上交所
10	2013年6月21日	股票质押式回购交易权限	深交所
11	2014年5月30日	上市公司限制性股票融资业务资格	中国证监会
12	2019年7月18日	科创板转融券业务资格	证金公司
13	2020年8月19日	创业板转融券业务资格	证金公司

#### 6. 国信弘盛获取的单项业务资格

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2008年6月17日	开展直投业务资格	中国证监会
2	2012年9月19日	开展直投基金业务资格	中国证监会

#### 7. 国信期货获取的单项业务资格

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2007年12月10日	金融期货经纪业务资格	中国证监会
2	2008年2月14日	上海期货交易所会员资格	上海期货交易所
3	2008年12月19日	大连商品交易所会员资格	大连商品交易所
4	2008年3月5日	金融期货交易结算业务资格	中国证监会
5	2008年4月2日	中国金融期货交易所交易结算会员	中国金融期货交易所
6	2009年3月25日	郑州商品交易所的会员资格	郑州商品交易所
7	2010年3月12日	委托国信证券提供IB业务资格	中国证监会河南监管局

8	2012年1月29日	期货投资咨询业务资格	中国证监会
9	2013年2月1日	资产管理业务资格	中国证监会
10	2013年11月4日	为保险机构提供期货经纪服务资格的备案	中国保监会
11	2017年6月5日	上海国际能源交易中心会员资格	上海国际能源交易中心

#### 8. 国信香港及其控股子公司获取的单项业务资格

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2010年2月26日	第1类：证券交易（经纪公司）	香港证监会
2	2010年2月26日	第4类：就证券提供意见（经纪公司）	香港证监会
3	2010年3月15日	联交所参与者	香港联交所
4	2010年3月15日	香港结算参与者	香港中央结算有限公司
5	2010年6月29日	第4类：就证券提供意见（资管公司）	香港证监会
6	2010年6月29日	第9类：提供资产管理（资管公司）	香港证监会
7	2010年6月30日	第1类：证券交易（融资公司）（注2、3）	香港证监会
8	2010年6月30日	第6类：就机构融资提供意见（融资公司）（注2、3）	香港证监会
9	2011年3月14日	第2类：期货合约交易（经纪公司）	香港证监会
10	2011年3月14日	第5类：就期货合约提供意见（经纪公司）	香港证监会
11	2011年4月11日	期交所参与者	香港期货交易所有限公司
12	2011年4月11日	期货结算公司参与者	香港期货结算有限公司
13	2011年10月28日	第1类：证券交易（资管公司）	香港证监会
14	2016年12月5日	中华通交易所参与者	香港交易及结算所有限公司
15	2016年12月5日	中华通结算参与者	香港交易及结算所有限公司
16	2020年7月21日	经营证券期货业务许可证（国信香港）（注4）	中国证监会
17	2021年12月21日	经营证券期货业务许可证（资管公司）（注5）	中国证监会

注1：“经纪公司”指国信证券（香港）经纪有限公司；“资管公司”指国信证券（香港）资产管理有限公司；“融资公司”指国信证券（香港）融资有限公司。

注2：就第1类受规管活动而言，持牌人不得从事涉及企业融资以外的交易活动。

注3：持牌人不得持有客户资产。“持有”及“客户资产”的定义已在《证券及期货条例》的释义条文内界定。

注4：国信香港于2011年12月22日获取的《证券投资业务许可证》已经由《经营证券期货业务许可证》替代。

注5：资管公司于2013年9月29日获取的《合格境外机构投资者证券投资业务许可》已经由《经营证券期货业务许可证》替代。

#### （二）报告期内公司及控股子公司获取的单项业务资格情况

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2021年6月2日	基金投资顾问业务试点资格	中国证监会
2	2021年6月29日	信用缓释工具一般交易商	银行间交易商协会
3	2021年11月30日	账务管理功能优化试点业务资格	中国证监会

## 六、公司历史沿革

### （一）公司成立

公司前身深圳国投证券有限公司于1994年6月由深圳国际信托投资公司与中国国际企业合作公司共同出资设立，注册资本为10,000万元，深圳国际信托投资公司及中国国际企业合作公司各占注册资本的70%及30%。

### （二）第一次股权转让、增资及更名

1996年6月，中国国际企业合作公司将持有的公司30%股权转让给深圳市投资管理公司，本次股权转让后，公司的股东变更为深圳国际信托投资公司和深圳市投资管理公司，各占注册资本的70%及30%。

1997年6月，公司以扣除公益金后的公积金及未分配利润转增注册资本，并引入新投资者深圳市深业投资开发有限公司对公司增资。本次增资完成后，公司注册资本增加至80,000万元，股东变更为深圳国际信托投资公司、深圳市投资管理公司和深圳市深业投资开发有限公司，各占注册资本的51%、29%及20%。

1997年6月，公司名称变更为“国信证券有限公司”。

### （三）第二次股权转让、增资及更名

1999年4月，深圳市深业投资开发有限公司将持有公司20%股权转让给深圳市机场股份有限公司。

1999年7月，公司股东会决议，以可分配利润及公积金向原股东转增注册资本，并引入云南红塔实业有限责任公司、中国一汽和北京城建股份有限公司等3家新投资者，同时深圳国际信托投资公司和深圳市投资管理公司分别向深圳市机场股份有限公司转让部分股权。

2000年6月公司名称规范为“国信证券有限责任公司”，注册资本变更为200,000万元，股东为深圳国际信托投资公司、深圳市投资管理公司、深圳市机场股份有限公司、云南红塔实业有限责任公司、中国第一汽车集团有限公司和北京城建股份有限公司，各占注册资本的30%、20%、20%、20%、5.10%及4.90%。

### （四）第三次股权转让

2006年4月，深圳市机场股份有限公司将其持有公司的20%股权转让给深圳市机场（集团）有限公司。

### （五）第四次股权转让

2007年1月，深圳市机场（集团）有限公司将其持有公司20%的股权转让给深投控。

### （六）整体变更为股份有限公司

2008年3月，公司以2007年12月31日经审计的净资产折股变更为股份有限公司，注册资本变更为700,000万元，股东为深投控、华润信托、云南红塔、中国一汽和北京城建，持股比例分别为40%、30%、20%、5.10%及4.90%。

### （七）2014 年 12 月首次公开发行股票并上市

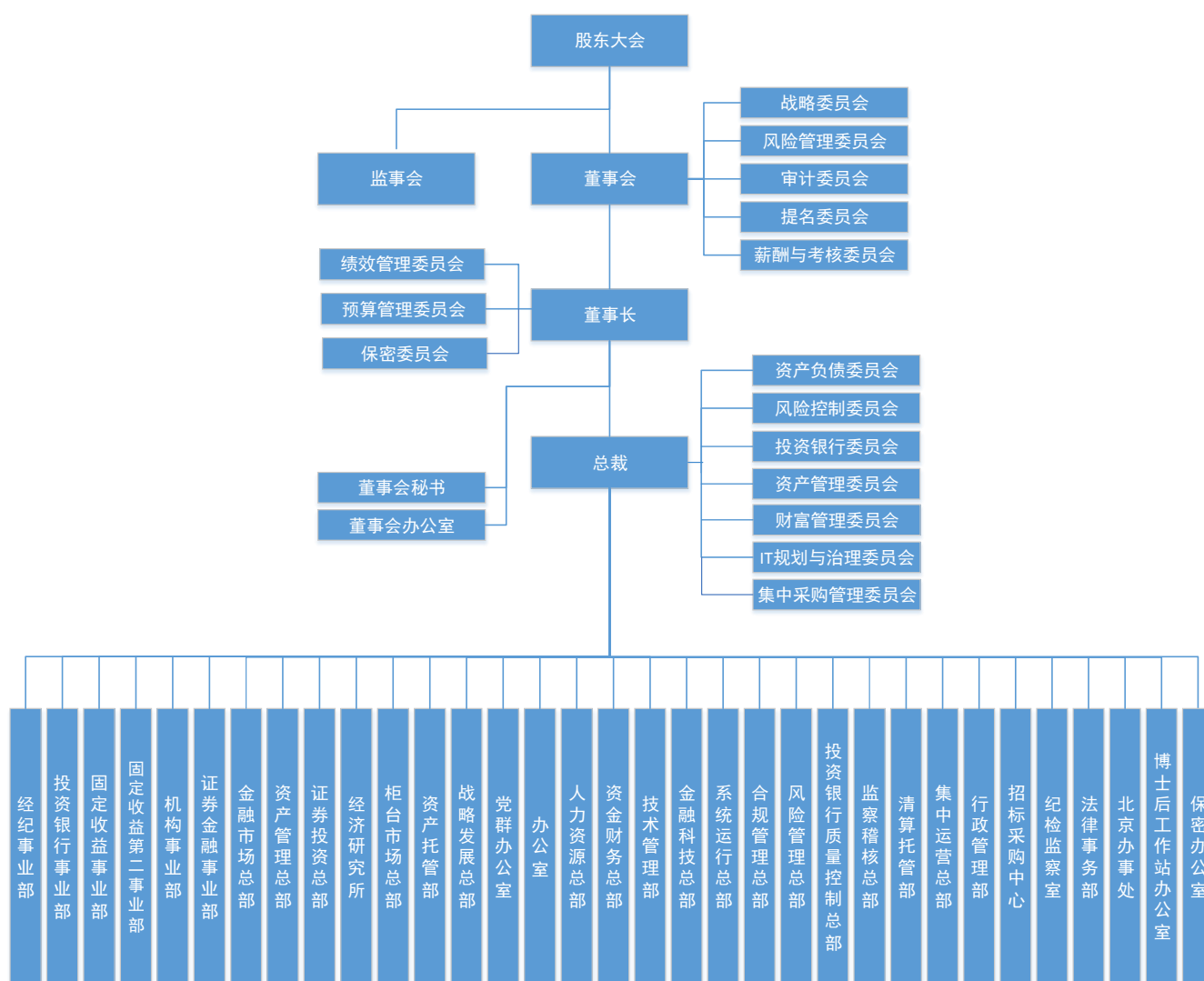
2014年12月10日，公司收到中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》（证监许可[2014]1335号），核准公司公开发行新股不超过12亿股。2014年12月29日，公司发行的12亿股人民币普通股股票在深交所上市交易。2015年3月4日，公司完成相关的工商变更登记及备案手续，注册资本由700,000万元变更为820,000万元。

### （八）2020 年 8 月非公开发行 A 股股票

经中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2020]471号）核准，公司向深投控、华润信托、云南合和、全国社会保障基金理事会等10名特定投资者非公开发行1,412,429,377股A股股票。2020年8月14日，新股在深交所上市。2020年11月12日，公司完成相关的工商变更登记及备案手续，注册资本由820,000万元变更为961,242.9377万元。

## 七、公司组织机构情况

### （一）公司组织机构



**(二) 境内外重要分公司**

序号	分公司名称	营业地址	成立日期	负责人
1	深圳分公司	深圳市南山区粤海街道海珠区海德三道126号卓越后海金融中心2504-2508	2013年4月12日	谢青
2	深圳互联网分公司	深圳市福田区福田街道福华一路125号国信金融大厦7层及裙楼1层东南角	2010年9月9日	王燕华
3	深圳科技园分公司	深圳市南山区粤海街道铜鼓路39号大冲商务中心(三期)4栋32A3BC1	2002年4月23日	周国柳
4	深圳前海分公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心T1写字楼170102A	2021年5月27日	吴文娟
5	深圳红岭分公司	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路6号免税商务大厦1601楼整层	2021年6月22日	谢庆伟
6	深圳深南分公司	深圳市福田区南园街道深南中路1099号平安银行大厦18、20楼	2014年9月2日	钱湘平
7	深圳泰九分公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道1258号卓越后海金融中心2503、2601-2612	2015年12月29日	魏辉
8	深圳振华分公司	深圳市福田区华强北街道华航社区华富路1018号中航中心21楼01-08单元	2014年9月9日	王厚伟
9	北京分公司	北京市海淀区三里河路13号1、10、11层	2000年7月5日	孙英
10	上海分公司	中国(上海)自由贸易试验区民生路1199弄1号楼1108室、1109室、1110室、1111室	2009年9月24日	黄巍
11	上海自贸试验区分公司	中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号1011-1012室	2015年5月6日	何嘉
12	天津分公司	天津市和平区小白楼街解放北路与哈尔滨道交口东北侧金之谷大厦1-102号、1-901号、1-902号、1-903号、1-904号	2012年7月25日	姜鹏
13	重庆分公司	重庆市江北区庆云路16号18-1至18-3、18-5至18-11	2014年7月4日	高莉
14	广州分公司	广州市天河区天河北路183-187号1901-1916室, 2002-2010室, 2011-2013室	2009年8月13日	陈奕辉
15	佛山禅城分公司	广东省佛山市禅城区季华六路三号一区2座24楼	2000年11月17日	殷红华
16	广东南海分公司	广东省佛山市南海区大沥镇竹基南路1号华亚国际金融大厦十三楼1303、1304、1305单元及一楼大堂南区(住所申报)	2006年8月14日	麻秋玲
17	珠海分公司	广东省珠海市香洲区拱北九洲大道西2021号富华里中心写字楼A座28层2801、02、03、04、05、06室	2014年7月15日	田赛
18	顺德分公司	广东省佛山市顺德区大良德和居委会国泰南路3号保利商贸中心1栋10层办公室1001-1003及1008-1012单元	2006年8月14日	林枫
19	中山分公司	广东省中山市东区中山五路2号紫马奔腾广场6座1层电梯旁房间、9层	2012年7月30日	黄文燊
20	肇庆分公司	广东省肇庆市端州四路8号凯德广场4楼01号之一	2014年8月27日	杨晓阳
21	东莞分公司	广东省东莞市南城区胜和路金盈大厦主附楼二楼	2010年3月4日	王凌
22	惠州分公司	惠州市文明一路9号富绅大厦24层01号01、02、03、04、05、10、11、12单元	2014年9月25日	朱林峰
23	浙江分公司	浙江省杭州市萧山区宁围街道诺德财富中心1幢102室、2901-2904室	2001年3月1日	章海波
24	金华分公司	浙江省义乌市国际商贸城金融商务区国信证券大厦(01-21地块房屋)1楼、19楼	2010年4月29日	叶玲
25	浙江互联网分公司	浙江省杭州市滨江区长河街道滨盛路1688号明豪大厦1002、1005室	2020年7月9日	王建维

26	杭州分公司	浙江省杭州市江干区万象城3幢901-902、908室	2009年8月13日	夏宁冰
27	绍兴分公司	浙江省绍兴市越城区解放大道713-1、越发大厦1803室	2014年7月21日	陈锋
28	温州分公司	浙江省温州市黎明东路黎富大厦三楼301西首、302室	2009年8月3日	殷俊
29	宁波分公司	浙江省宁波市海曙区厂堂街80号(8-2)-(8-5)室、88号(1-4)室	2014年7月31日	夏映
30	江苏分公司	南京市鼓楼区汉中路2号亚太商务楼第17层19层	2013年1月24日	张宁
31	苏州分公司	中国(江苏)自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区苏州中心广场58幢3401室内中的35层03号	2021年6月22日	朱猛
32	江苏苏南分公司	江苏省无锡市滨湖区万达广场A区梁溪路51号12楼	2014年8月6日	阎肃
33	广西分公司	广西省南宁市青秀区民族大道146号三祺广场2801、2803A单元	2014年8月5日	陈正鑫
34	福建分公司	厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场30层01-09室	2014年6月27日	陈茹娟
35	四川分公司	四川省成都市武侯区人民南路四段46号上善国际写字楼2栋22楼1号、2号、6号	2013年1月11日	刘应达
36	西南互联网分公司	中国(四川)自由贸易试验区成都高新区锦城大道539号B座1306号	2020年7月8日	段志
37	湖北分公司	湖北省武汉市江岸区沿江大道159号时代广场1座16-17层	1998年1月9日	文德军
38	湖南分公司	湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道茶子山东路102号浦发金融大厦第7层	2014年7月15日	朱勇
39	江西分公司	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1568号红谷凯旋商业办公综合楼及商业六101、901、902、904、906室	2014年8月7日	徐汉坤
40	山东分公司	山东省济南市历城区华信路3号鑫苑鑫中心7号楼历城金融大厦112-113、1801-1804、1811-1812	2009年8月25日	姜仁东
41	烟台分公司	山东省烟台市高新技术产业开发区科技大道69号创业大厦西塔2层	2014年9月10日	冯杨
42	青岛分公司	青岛市市南区香港中路68号华普大厦七层	2014年8月20日	王行岩
43	山西分公司	山西省太原市晋源区长兴南街8号环球金融中心29层	2014年8月11日	曹星
44	陕西分公司	陕西省西安市浐灞生态区东二环6589号陕西建工第五建设集团有限公司总部办公大楼20层-2层L2-16A	2012年4月27日	田健湘
45	辽宁分公司	沈阳市和平区南京南街52号鸿源大厦一楼大堂北侧、五楼	2007年1月5日	孟寰
46	大连分公司	辽宁省大连市沙河口区高尔基路737号3层1号	1997年7月15日	杨春生
47	吉林分公司	吉林省长春市朝阳区西安大路万达时代商务中心101号	2003年7月7日	王浩
48	河南分公司	河南省郑州市二七区民主路10号华润大厦20层2004室至2006室	2014年6月25日	鞠玮(代)
49	河北分公司	河北省石家庄市裕华区建设南大街59号1-2层	2014年9月1日	朱晓科
50	黑龙江分公司	哈尔滨市道里区群力新区景江西路1栋商业1-4层009号	2014年7月4日	郑少友
51	安徽分公司	安徽省合肥市包河区马鞍山路130号包河万达广场7号楼12层	2007年1月11日	代汉军
52	云南分公司	云南省昆明市西山区前卫西路润城小区A4块地2栋8层	2014年8月15日	盛红敏
53	新疆分公司	新疆乌鲁木齐市水磨沟区南湖东路77号第四层	2014年8月5日	李胜春
54	甘肃分公司	甘肃省兰州市城关区甘南路122号志诚首府写字楼13楼	2010年4月6日	陈兔明
55	海南分公司	海南省海口市龙华区世贸北路1号海岸壹号之佳景国际之第1层前左2垮和第4层前大半层	2010年3月15日	陈协明

56	内蒙古分公司	内蒙古呼和浩特市赛罕区大学东街68号印象北京1号楼18层1801号	2010年4月1日	贾少飞
57	贵州分公司	贵州省贵阳市观山湖区长岭北路6号东原财富广场一期1号楼1单元1层1室门面, 5层7-14号房	2015年6月10日	严江涛
58	宁夏分公司	宁夏银川市金凤区北京中路瑞银财富中心4号楼7层3号、4号、5号、6号办公室	2014年7月14日	王文生

### (三) 境内外控股子公司、参股公司

序号	公司名称	注册地址	设立时间	注册资本(万元)	持股比例	负责人
1	国信弘盛	深圳市罗湖区桂园街道红村社区红岭中路1012号国信证券1601	2008年8月8日	405,000	100.00%	袁超
2	国信期货	上海市虹口区东大名路358号2001、2002、2003、2005、2006、2007、2008、2009、2010、2013、2015、2016、2017室	1995年5月4日	200,000	100.00%	邓舸
3	国信香港	香港金钟道88号太古广场1座32楼3207-3212室	2008年11月13日	港币263,000	100.00%	谌传立
4	国信资本	深圳市龙华区民治街道北站社区汇隆商务中心2号楼3312	2019年6月18日	300,000	100.00%	周中国
5	鹏华基金	广东省深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	1998年12月22日	15,000	50.00%	何如
6	青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	山东省青岛市崂山区松岭路169号国际创新园B座17层B1、B2	2014年2月13日	10,000	20.00%	蒲晓煜
7	前海股交投资控股(深圳)有限公司	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	2011年11月15日	117,740	10.62%	胡继之
8	哈尔滨股权登记托管中心有限责任公司	黑龙江省哈尔滨市松北区滨北街2140号	1993年6月4日	260	7.69%	孙名扬
9	红塔创新投资股份有限公司	云南省昆明市二环西路398号高新科技信息中心主楼14层	2000年6月15日	90,000	2.50%	李双友
10	证通股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号1幢	2015年1月8日	251,875	1.99%	王关荣
11	深圳市雅都软件股份有限公司	广东省深圳市南山区高新南七道022号高新工业村T2-A栋402	1997年1月29日	3,261	1.86%	李毅
12	中证信用增进股份有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道金融街1号前海弘毅大厦8层B2单元	2015年5月27日	458,598	1.09%	牛冠兴
13	中证机构间报价系统股份有限公司	北京市西城区金融大街4号楼8-10层	2013年2月27日	755,024	0.66%	安青松

### (四) 证券营业部数量和分布情况

截至报告期末, 公司共设有184家证券营业部, 分布于全国111个城市和地区。具体情况如下:

省/直辖市	城市	营业部数量	省/直辖市	城市	营业部数量
北京	北京	11	浙江	杭州	5
上海	上海	8		嘉兴	1
天津	天津	3		绍兴	2
重庆	重庆	3		慈溪	1

广东	深圳	16		宁波	2
	广州	7		湖州	1
	佛山	7		金华	1
	东莞	2		乐清	1
	潮州	1		衢州	1
	河源	1		瑞安	1
	惠州	1		台州	1
	湛江	1		温岭	1
	江门	1			
	茂名	1		义乌	1
	汕尾	1	永康	1	
	揭阳	1			
	梅州	1	湖北	武汉	2
	清远	1		宜昌	1
	汕头	1		襄阳	1
	韶关	1		湖南	长沙
	四会	1	衡阳		1
	阳江	1	湘潭		1
	肇庆	1	岳阳		1
	中山	1	株洲		1
珠海	2				
江苏	南京	2	黑龙江	哈尔滨	1
	常州	1		大庆	1
	无锡	2		牡丹江	1
	江阴	1		齐齐哈尔	1
	南通	1	吉林	吉林	1
	苏州	1		通化	1
	太仓	1	辽宁	沈阳	1
	盐城	1		大连	2
宜兴	1	盘锦		1	
四川	成都	3	瓦房店	1	
	达州	1			
	德阳	1	山东	烟台	2
	乐山	1		济南	1
	绵阳	2		临沂	1
	南充	1		青岛	2
	泸州	1	安徽	合肥	1
	宜宾	1		芜湖	1
	遂宁	1		铜陵	1
自贡	1	江西	南昌	1	



福建	福州	3	广西	赣州	1
	厦门	2		上饶	1
	泉州	1		南宁	1
	三明	1		柳州	1
	漳州	1		昆明	1
陕西	西安	2	云南	大理	1
	宝鸡	1	曲靖	1	
	汉中	1	贵州	贵阳	1
	渭南	1	宁夏	银川	1
	延安	1	山西	太原	1
	榆林	1		大同	1
	咸阳	1		临汾	1
河南	郑州	2		长治	1
河北	石家庄	1	海南	海口	1
新疆	乌鲁木齐	1			

#### （五）其他分支机构数量与分布情况

公司子公司国信期货共设有20家分支机构，其中15家期货营业部，5家分公司，分布于全国17个中心城市。

## 八、其他有关资料

### （一）公司聘请的会计师事务所

会计师事务所名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所办公地址	浙江省杭州市西湖区西溪路128号6楼
签字会计师姓名	燕玉嵩、黄燕

### （二）公司聘请的报告期内履行持续督导职责的保荐机构

保荐机构名称	保荐机构办公地址	保荐代表人姓名	持续督导期间
中国银河证券股份有限公司	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦	乔娜、王建龙	2020年8月14日-2021年12月31日

### （三）公司聘请的履行持续督导职责的财务顾问

报告期内，公司未聘请履行持续督导职责的财务顾问。

## 九、主要会计数据和财务指标

### (一) 合并报表

单位：万元

项目	2021 年度	2020 年度	本年比上年增减	2019 年度
营业收入	2,381,803.70	1,878,407.12	26.80%	1,409,291.46
归属于上市公司股东的净利润	1,011,475.88	661,573.95	52.89%	491,018.72
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	985,006.41	681,228.79	44.59%	507,573.68
其他综合收益的税后净额	-98,977.31	21,378.62	-562.97%	60,497.49
经营活动产生的现金流量净额	-671,538.78	-347,227.66	不适用	2,864,181.40
基本每股收益（元/股）	0.97	0.72	34.72%	0.56
稀释每股收益（元/股）	0.97	0.72	34.72%	0.56
加权平均净资产收益率	12.71%	10.61%	上升 2.10 个百分点	9.46%
项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	本年末比上年末增减	2019 年 12 月 31 日
资产总额	36,230,144.23	30,275,587.63	19.67%	22,464,431.22
负债总额	26,537,452.29	22,183,140.69	19.63%	16,838,906.07
归属于上市公司股东的净资产	9,691,011.01	8,090,741.72	19.78%	5,620,908.87

### (二) 母公司

单位：万元

项目	2021 年度	2020 年度	本年比上年增减	2019 年度
营业收入	1,931,947.41	1,627,109.10	18.73%	1,223,470.75
净利润	868,009.57	655,551.84	32.41%	485,491.63
扣除非经常性损益的净利润	841,253.56	677,210.96	24.22%	503,131.49
其他综合收益的税后净额	-78,495.48	26,509.72	-396.10%	35,095.13
经营活动产生的现金流量净额	-674,971.17	-526,294.58	不适用	2,966,782.69
基本每股收益（元/股）	0.82	0.71	15.49%	0.56
稀释每股收益（元/股）	0.82	0.71	15.49%	0.56
加权平均净资产收益率	11.06%	10.75%	上升 0.31 个百分点	9.58%
项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	本年末比上年末增减	2019 年 12 月 31 日
资产总额	34,499,967.57	28,769,550.98	19.92%	20,932,163.20
负债总额	25,067,066.96	20,813,935.17	20.43%	15,445,489.23
所有者权益总额	9,432,900.61	7,955,615.80	18.57%	5,486,673.97

截至披露前一交易日的公司总股本（股）	9,612,429,377
支付的优先股股利	-
支付的永续债利息（万元）	46,500.00
用最新股本计算的全面摊薄每股收益（元/股）	0.97

## 十、境内外会计准则下会计数据差异

不适用。公司未按照国际会计准则编制2021年财务报告。

## 十一、分季度主要财务指标

### (一) 合并报表

单位：万元

项目	第一季度	第二季度	第三季度	第四季度
营业收入	425,152.71	606,918.89	667,553.79	682,178.31
归属于上市公司股东的净利润	168,483.83	310,494.90	300,998.63	231,498.52
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	166,946.43	309,779.72	301,761.52	206,518.74
经营活动产生的现金流量净额	-9,448.88	-216,679.11	-572,998.87	127,588.08

### (二) 母公司

单位：万元

项目	第一季度	第二季度	第三季度	第四季度
营业收入	347,868.07	488,187.22	573,301.25	522,590.87
净利润	152,472.09	240,561.14	262,468.71	212,507.63
扣除非经常性损益的净利润	151,452.09	239,884.17	263,243.06	186,674.24
经营活动产生的现金流量净额	-90,960.79	-121,582.48	-672,248.55	209,820.65

上述财务指标及其加总数与公司已披露季度报告、半年度报告相关财务指标不存在重大差异。

## 十二、非经常性损益项目及金额

单位：万元

项目	2021 年度	2020 年度	2019 年度	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）	-26.08	-21.22	-38.50	主要是处置固定资产损失。
计入当期损益的政府补助（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）	6,172.58	6,303.33	4,722.11	收到政府补贴。
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	32,898.73	-31,318.62	-22,776.88	预计的诉讼案件损失减少。
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-3,152.77	-1,338.36	-3,379.03	
减：所得税影响额	9,422.98	-6,720.04	-4,917.34	
合计	26,469.47	-19,654.84	-16,554.96	

公司属于证券业金融企业，证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司持有交易性金融工具、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有交易性金融工具、衍生金融工具、其他债权投资及其他权益工具投资产生的投资收益，处置交易性金融工具、衍生金融工具、其他债权投资及其他权益工具投资取得的投资收益不作为非经常性损益项目。

**十三、母公司净资本及有关风险控制指标**

单位：万元

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	本年末比上年末增减	预警标准	监管标准
核心净资本	5,596,776.01	5,292,319.94	5.75%	-	-
附属净资本	2,000,000.00	1,000,000.00	100.00%	-	-
净资本	7,596,776.01	6,292,319.94	20.73%	-	-
净资产	9,432,900.61	7,955,615.80	18.57%	-	-
各项风险资本准备之和	1,734,745.54	2,073,244.50	-16.33%	-	-
表内外资产总额	28,463,351.77	23,218,781.85	22.59%	-	-
风险覆盖率	437.92%	303.50%	上升 134.42 个百分点	≥120%	≥100%
资本杠杆率	19.66%	22.79%	下降 3.13 个百分点	≥9.6%	≥8%
流动性覆盖率	318.25%	298.11%	上升 20.14 个百分点	≥120%	≥100%
净稳定资金率	178.53%	166.34%	上升 12.19 个百分点	≥120%	≥100%
净资本/净资产	80.53%	79.09%	上升 1.44 个百分点	≥24%	≥20%
净资本/负债	41.08%	41.99%	下降 0.91 个百分点	≥9.6%	≥8%
净资产/负债	51.01%	53.10%	下降 2.09 个百分点	≥12%	≥10%
自营权益类证券及其衍生品/净资本	20.38%	27.83%	下降 7.45 个百分点	≤80%	≤100%
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	213.22%	186.69%	上升 26.53 个百分点	≤400%	≤500%

## 第三节 管理层讨论与分析

### 一、概述

2021年是党和国家历史上具有里程碑意义的一年，中国共产党迎来百年华诞，“两个一百年”历史交汇，全面建设社会主义现代化国家踏上新征程；2021年是见证资本市场历史的一年，上证综指、深成指及创业板指数连涨三年，科创板、创业板推行注册制改革、北交所设立，A股市场全年成交金额、IPO企业数量及募资总额等多项指标都刷新历史新高；2021年是公司历史上的重要一年，公司完成第五届董事会、监事会及经理层换届工作，“十四五”开局、改革创新及经营管理工作均取得了显著成效。

公司统筹疫情防控和业务发展，取得良好经营绩效：一是强改革稳经营，公司创下历史第二好的经营业绩，“十四五”实现良好开局；二是强长项补短板，收入结构持续优化；三是强治理促协同，整体金融服务能力显著增强；四是强规划保落实，完成“十四五”规划编制，引领公司高质量发展；五是强站位重服务，全力投身“双区”建设；六是强党建提能力，促进党建与业务深度融合。过去一年，公司坚定履行国有企业社会责任，在金融扶贫、支持公益、投资者教育保护、支援抗疫等方面加大资源投入和工作力度，全年投入2363万元开展公益帮扶项目，彰显负责任的国有金融企业社会形象。

2022年是“十四五”规划承上启下的关键之年，也是公司全面推动创新转型，实现高质量发展的关键之年。当前，全球经济整体复苏基础并不稳固，波动性大、脆弱性高、结构性失衡等特征非常明显；在需求收缩、供给冲击、预期转弱的“三重压力”下，中国经济工作坚持稳字当头、稳中求进，政策发力适当靠前，预计2022年中国宏观经济持续恢复发展的态势不会改变，长期向好的基本面不会改变。公司将把握机遇，积极进取，推动公司高质量发展再上新台阶：一是坚持和加强党的全面领导，持续强化政治能力提升；二是坚持战略引领，提升以客户为中心的综合服务能力；三是坚持推动管理提升，增强应对市场挑战的软实力；四是坚持价值创造导向，持续提升专业化能力；五是坚持合规风控底线，提升风险管控护航创新发展的能力；六是坚持强化科技创新基因，持续提升金融科技赋能业务发展能力；七是弘扬拼搏进取精神，提升公司人才队伍战斗力。未来公司将一如既往高度重视对股东的价值回报，维护全体股东的合法利益。

### 二、报告期内公司所处行业的情况

证券行业的经营业绩受资本市场变化影响较大，呈现明显的波动性和周期性特征。2021年末，上证指数收报3,639.78点，涨4.80%；深证成指报14,857.35点，涨2.67%。A股市场总成交超257万亿元，日均成交1.06万亿元，均超过2015年的牛市，创下历史新高。据中证协统计，2021年全行业140家证券公司实现营业收入5,024.10亿元，实现净利润1,911.19亿元。截至2021年末，证券行业总资产为10.59万亿元，净资产为2.57万亿元，较上年末分别增加19.07%、11.34%。

根据中证协公布的证券公司会员经营业绩排名，近年来，公司净资产、净资本、营业收入、净利润等

主要指标排名行业前列。报告期内，公司继续保持了行业领先的市场地位，各项主要业务均取得较好成绩。

公司在央行、中国证监会、沪深交易所、《中国证券报》《证券时报》等机构和权威财经媒体的各项评选中，荣获“金融科技发展奖三等奖”“优秀基础设施公募REITs中介机构”“公司债券优秀承销商”“十大金牛证券公司”“2021全能投行君鼎奖”“中国证券业全能财富经纪商君鼎奖”等100多个奖项。

### 三、报告期内公司从事的主要业务

公司向个人、机构客户提供全方位的金融产品和服务，并自营相关金融产品的投资与交易业务，主要业务如下：

经纪及财富管理业务，为个人和机构客户提供证券经纪和期货经纪服务，推广和销售证券及金融产品，提供资产托管、专业化研究和咨询等服务，赚取手续费、佣金及相关收入；提供融资融券、股票质押式回购、约定购回、行权融资等资本中介服务，赚取利息及相关收入。

投资银行业务，为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问、新三板挂牌推荐等金融服务，赚取承销费、保荐费、财务顾问费及相关收入。

投资与交易业务，从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募基金管理及另类投资业务等，赚取投资收益及相关收入。

资产管理业务，根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，集合、单一资产管理业务，资产证券化业务以及基金管理业务等，赚取管理费、业绩报酬及相关收入。

### 四、核心竞争力分析

公司自1994年成立以来，秉承“敢闯、敢试、敢为人先”的特区精神，依靠“国企体制、市场化机制”，从地方性单一经纪牌照公司，发展壮大成为拥有境内及香港市场证券业务全牌照的全国性大型综合类证券公司。目前，公司的核心竞争力主要包括：

#### （一）“双区”建设和综改试点中的区位优势

目前，深圳市处在“双区”建设、“双区”叠加、“双区”示范的重大战略机遇期，将在深化改革扩大开放、科技创新、基础设施互联互通建设、战略性新兴产业、金融创新、国际及港澳专业服务等九大领域大力推进体制机制创新。

国信证券的区位优势较为明显，也具备良好的业务专业能力和客户基础。国信证券利用多层次资本市场为深圳企业特别是科技创新型企业提供包括股权融资、债权融资、企业上市、并购重组、场外市场等专业服务，截至2021年末，国信证券为深圳地区企业累计提供98次股权融资服务，累计融资约688亿元；累计服务57家深圳地区企业发行债券309只，募集资金2,975亿元。2021年，国信证券为深圳各级国企发行债券63只、规模共计1,021亿元。

## （二）突出的市场化能力及业务创新能力

公司具有市场定位准确、客户服务能力强的优势，在经营中具备较强的前瞻性及市场敏感性，善于迅速把握市场机遇。公司是行业前八家创新试点证券公司之一，首创了“银证通”“金天利”等众多具有示范效应的业务模式。

当前，公司坚持一手抓传统优势业务转型，一手抓创新业务发展。经纪业务着力向财富管理转型，打造以客户为中心的服务体系，为高净值客户、机构客户提供定制化服务，串联起财富管理、资产管理、投资银行的服务链条，实现“全价值链财富管理”；增强资产研究和配置能力，更加注重客户资产增量、资产归集和配置服务质量，推动公司与客户共同成长。投行业务把握注册制全面有序铺开的历史性机遇，完善业务运营模式、提升专业服务能力，深入挖掘新兴行业、中小企业的投资价值，切实承担“市场的驱动者和价格的发现者”这一关键角色，发挥好直接融资功能。同时，公司着力推进业务改革创新，加快构建创新容错机制，鼓励各业务线密切关注行业发展动态改革创新。2021年，公司取得基金投资顾问业务试点资格及信用缓释工具一般交易商业务资格，正大力推动结售汇业务、跨境业务、贵金属自营业务、场外期权一级交易商等业务资格申请，大力推进业务、风控、金融科技三者高度融合，打造创新驱动发展新格局。

## （三）领先的金融科技水平

公司持续加大信息技术投入，加强金融科技战略布局，致力于以领先的科技能力驱动业务创新，赋能公司数字化转型，全面建设智慧化国信。《“蜂鸟”云原生智能研运一体化平台项目》荣获中国人民银行与中国证监会联合举办的2020年度金融科技发展奖三等奖；信创工程项目获得中国证监会2020年度信息技术应用创新“优秀”等级。多年来，公司各类信息系统持续保持高效稳定运行，得到了行业及客户的肯定。

公司以客户为中心，构建“金融科技+业务”深度融合机制，全面提升IT系统的功能及客户体验水平。在交易服务领域，公司不断革新交易科技平台，为机构投资者提供全链路、高智能、低延时的整体交易服务，机构极速交易业务的竞争力显著增强；深化金太阳等互联网渠道金融平台的个性化、智能化、专业化、一体化水平，为客户提供更优质的交易服务体验。在财富管理领域，公司构建了基金投顾交易体系，一站式线上理财平台满足客户多元化投资理财需求，大幅提升公募基金等理财产品销售金额，持续为财富管理业务赋能。公司大投行数字化、智能化建设工作全面铺开，深化科技赋能各业务条线的深度和广度，为大投行、固定收益、资产管理、资产托管、证券金融、期货做市等业务提质增效。在数据安全治理方面，公司积极探索数据治理与业务管理、技术实践的深入应用，在数据标准、数据质量、数据安全等方面进行融合打通，构建数据治理生态化体系，切实保障公司和客户数据的安全、合规、可靠，荣获第五届数据质量管理国际峰会（DQMIS）“数据质量卓越实践奖”。在运营管理方面，公司进一步落地人工智能、知识图谱、极速计算等技术在风控合规领域应用，构建了覆盖子公司的集团全面风险管理体系，深入业务条线各环节，为业务保驾护航；公司智慧数据中台作为数据分析能力的共享平台，提供统一的数据汇聚、海量计算、分析挖掘和数据服务能力，充分发挥数据价值，为经营管理、业务运营、客户服务赋能。

依托上交所金桥金融基地、深交所东莞南方中心及国信深圳总部所在地，公司实现了“两地三中心”的云计算数据中心布局，构建了混合云基础资源底座，全面支持云计算和云原生应用，应用上云比例行业

领先；数据中心提供了完整的基础网络服务和基础安全防护服务，具备行业领先的运维标准化、自动化和平台化能力，拥有完善的“监管控析”一体化运维工具平台体系和完备的IT服务运营管理体系，连续9年通过ISO20000服务管理体系国际认证。

#### （四）良好的内外部协同能力

近年来，公司着力打破牌照和部门分割局面，内部跨业务条线、跨部门的协同取得积极成效。经纪业务与资管业务、投行业务与国信资本、经纪业务与信息技术，各地分支机构与当地投行、固收、资管等业务的协同稳步推进，整体服务能力有所增强。近年来，公司加大了与国资国企的协同力度，成立了服务深圳“双区”建设和综改试点的领导小组及专项工作小组，大力提升对国资战略客户的服务能力和服务质量，公司与深圳市龙华区等多个行政区开展战略合作，与多家国企、金融机构建立了业务合作关系。

#### （五）切实有效的考核激励制度

多年来，国信证券依靠对业务部门的充分激励抢占市场份额，提升竞争实力。面对业务发展和行业竞争的新形势、客户对综合服务的更高要求，公司更加强调价值创造导向，优化考核激励机制，充分发挥业绩考核的指挥棒作用。一是突出规划引领，把部门年度绩效考核与“十四五”规划落实进度结合起来，确保“十四五”规划和国企改革三年行动方案按预定计划如期落实。二是精准考核，破解重点难点问题。既坚持公平公正的原则，也积极探索差异化施策，突出考核重点，对创新进行专项考核和扶持，鼓励业务部门开发引领市场的拳头产品和服务，擦亮国信“先人一步、快人一招”的招牌。加大对协同贡献的考核权重，充分发挥公司整体优势，以考核指挥棒引领公司提升整体作战能力。三是加强管理考核，强化对成本管控、流程管理、内部管理的考核，推动公司管理提升，补足管理短板。四是强化考核的正向激励，坚持考核向一线业务部门倾斜，持续优化员工薪酬结构，探索建立中长期激励机制，确保激励到位，增强干部员工队伍积极性和主动性，提升团队凝聚力和战斗力。

## 五、主营业务分析

### （一）概述

公司通过总部下设机构以及下属分公司、营业部从事证券经纪及财富管理、投资银行、投资与交易、资产管理等业务；通过全资子公司国信弘盛、国信期货、国信资本、国信香港分别开展私募基金、期货、另类投资和境外金融服务等业务。2021年度，公司实现营业收入238.18亿元，同比上升26.80%；实现归属于上市公司股东的净利润101.15亿元，同比上升52.89%；加权平均净资产收益率为12.71%，同比上升2.10个百分点，保持了行业领先的盈利能力。



## （二）收入与成本

### 1. 营业总收入构成

#### ➤ 按会计科目分类

单位：万元

项目	2021 年度		2020 年度		同比增减 幅度
	金额	占营业总收入比重	金额	占营业总收入比重	
手续费及佣金净收入	1,003,287.16	42.12%	897,698.09	47.79%	11.76%
投资收益	743,613.12	31.22%	489,351.19	26.05%	51.96%
利息净收入	241,062.39	10.12%	314,804.66	16.76%	-23.42%
其他业务收入	217,219.64	9.12%	167,933.89	8.94%	29.35%
公允价值变动收益（损失）	174,044.02	7.31%	6,709.12	0.36%	2,494.14%
其他收益	2,667.24	0.11%	2,530.35	0.13%	5.41%
汇兑损失	-63.79	0.00%	-598.96	-0.03%	不适用
资产处置收益	-26.08	0.00%	-21.22	0.00%	不适用
营业总收入合计	2,381,803.70	100.00%	1,878,407.12	100.00%	26.80%

2021年公司营业总收入同比增加50.34亿元，增幅为26.80%，主要是：

（1）投资收益74.36亿元，同比增加25.43亿元和51.96%，主要是金融工具投资收益增加；

（2）公允价值变动收益17.40亿元，同比增加16.73亿元和2,494.14%，主要是证券市场波动导致金融资产公允价值增加。

#### ➤ 按业务类型分类

##### （1）经纪及财富管理

公司经纪及财富管理业务主要包括：为个人和机构客户提供证券经纪和期货经纪服务，推广和销售证券及金融产品，提供资产托管、专业化研究和咨询等服务；提供融资融券、股票质押式回购、约定购回、行权融资等资本中介服务。报告期内，经纪及财富管理业务实现营业收入107.69亿元，同比上升7.70%。

##### ① 证券类零售业务

###### 市场环境

2021年，在流动性宽松和经济复苏的背景下，A股市场交易活跃，成交量刷新历史纪录。随着市场发展和对外开放步伐加快，券商传统通道业务竞争日益激烈，国内券商集中度日趋提升，“强者愈强”的马太效应日益凸显。与此同时，公募和私募基金规模高速扩张，高净值人群的资产配置需求呈爆发式增长，行业正加速向财富管理转型，对资产配置、金融科技的重视程度和投入不断提升。

###### 经营举措及业绩

2021年，公司始终秉持“以客户为中心”的发展理念，持续优化机构和高净值客户拓展与服务，倾力打造“鑫投顾”“国信智投”“国信优选”“国信私享”等自有财富管理品牌，稳步推进互联网金融，全力加速向财富管理转型。一是不断深化产品服务体系建设。随着基金投顾业务资格的落地，公司大力拓展

基金投顾合作渠道，自有型基金投顾业务“国信智投”正式上线；持续推动“鑫投顾”平台功能迭代，探索创新投顾服务模式；不断完善投顾培训体系，提高财富管理服务水平。二是持续提升量化交易服务水平。公司加强交易系统建设，为不同客户群体构建多层次量化交易产品服务体系，量化交易市场份额稳步提升；深化重点客户合作，上线上市公司综合服务平台。三是大力抓好高端专业服务。公司上线国信期权极速交易系统，打造面向专业机构客户的衍生品极速交易解决方案；打造“国信私享”定制业务品牌，满足高净值客户一站式财富管理需求。四是持续强化线上引流和服务。公司不断加强线上渠道拓展和管理，同时加大自有线上渠道建设，互联网业务发展成效显著。

截至2021年末，公司经纪业务客户数量达1,254万，同比增长17%；托管资产突破2.31万亿元。金太阳手机证券用户总数超过1,763万，同比增长18%；微信公众号用户数近240万，同比增长22%，活跃用户排名行业前三。

### **2022年展望**

2022年，公司将加快推动自有财富管理品牌建设，强化投顾服务优势，积极拓展基金投顾业务，全力打造人工投顾和智能投顾产品相结合的多层次投顾服务体系；持续推动交易技术升级与上市公司综合服务平台建设，全面提升高净值客户专业服务能力，满足其不断延伸的专业需求；推动网络金融实现跨越式发展，提升客户服务及运营管理效率。

## **② 证券类机构业务**

### **市场环境**

2021年，A股市场交投持续活跃，境内外各类机构投资者踊跃入市。截至2021年年末，公募基金整体规模达到25.56万亿元，同比增长28.51%。私募证券投资基金的规模亦增长较快。外资机构投资者加速布局国内资本市场。公募及私募、外资、保险、银行理财等各类机构投资者规模持续扩大，国内证券公司迎来重要发展机遇。

### **经营举措及业绩**

公司机构业务为客户提供跨业务、全周期服务，不断夯实财富管理能力。2021年度，公司机构业务实现交易单元席位佣金收入5.89亿元，同比增长44.73%。公司主要经营举措包括：一是加强高层互访，提升机构服务层次和频次，重点推动银行及理财子公司、公募基金、海外机构等客户合作。二是着重加强策略会、专家交流会、调研等机构客户营销活动策划及开展，保持线上线下机构投研交流热度，多维度满足客户投研需求，吸引新客户建立业务合作。三是精选优质产品，推动财富管理转型。公司加强与头部公募及私募基金管理人合作，引入代销北交所主题公募、公募REITs、MSCI等热点主题基金，并推出形式多样的基金营销活动提升投资人持有体验。四是通过机构、研究、投行、直接投资、融资融券、资产托管等业务条线的协同配合，有效拓展机构业务多维度收入。

### **2022年展望**

2022年，中国资本市场有望进一步加大开放力度，居民财富继续向资产管理机构聚拢，预计各类机构投资者资产规模将保持较快发展，对包含交易、研究、代销、衍生品等在内的证券类综合服务需求将不断

提升。公司将构建多元、优质的代销产品矩阵，大力拓展海外投行类、对冲基金类客户，提升投研服务质量，强化各业务间的协同配合形成整体合力，为财富管理转型夯实基础。

### ③ 研究业务

国信证券经济研究所拥有一支专业水平高的研究队伍，通过对国内外宏观经济、市场政策、产业政策，以及行业、上市公司等进行深入研究，对外服务公募、社保、保险、私募、银行理财子公司、资产管理公司及其他专业投资机构，对内为公司投行、经纪、固定收益、自营投资、资产管理、国际等各业务条线增值赋能，研究力量覆盖符合中国经济发展方向的战略性新兴产业、大消费行业以及宏观、策略、金融工程、固定收益等高价值领域，在总量、金融工程、金融、消费、科技、制造、海外、医药等行业的研究实力处于行业领先水平。国信证券经济研究所定期组织投资策略会、产业峰会、投资论坛等研究活动，致力于为专业机构投资者和上市公司搭建专业、高效的交流平台，提供综合金融服务。

### ④ 资本中介业务

#### 市场环境

2021年，受国内疫情防控向好、经济逐步复苏和A股交投活跃的影响，市场融资融券需求旺盛，年末融资融券余额为1.8万亿元，较2020年末增长13%。股票质押式回购业务规模持续下降，存量风险得到进一步化解。

#### 经营举措及业绩

在融资融券方面，公司加大政策力度、强化专业服务、跨部门协同拓展券源，以科技赋能不断优化客户服务体验和业务运营效率，并持续加强风险评估及管控措施，实现客户数量、业务规模、市场份额全面提升。报告期末，公司融资融券业务余额为639.5亿元，较2020年末增长24%，融资融券利息收入排名行业第九。在股票质押式回购方面，公司重新搭建以流动性为核心的制度体系，持续妥善化解风险项目。报告期末，公司自有资金出资的股票质押式回购业务余额为52.7亿元，较2020年末压降58%。此外，公司以客户需求为导向，不断优化约定购回、行权融资等资本中介业务综合服务体系。报告期末，公司约定购回、行权融资业务规模和利息收入均排名行业前列。

#### 2022 年展望

2022年，公司将围绕“服务实体经济”和“居民财富管理”挖掘市场多样化融资、融券需求，力争“促发展、谋创新、防风险”三者间的平衡；深耕现有客户，并不断增强量化交易客户、QFII、上市公司等机构客户的开发和服务能力，进一步优化客户结构；全面优化信息技术系统，科技赋能业务拓展、运营管理及风险管控；推动业务协同机制的建设，努力做优做强做大融资融券业务，审慎开展股票质押式回购增量业务，并持续探索资本中介业务产品及服务创新，提升业务核心竞争力。

### ⑤ 期货类经纪业务

#### 市场环境

2021年，受疫情冲击、供应链受阻、流动性宽松等多重因素影响，全球大宗商品价格波动加剧。国内期

期货市场继续保持良好发展态势，规模体量持续增长，新品种稳步增加，衍生品体系愈发完善，投资者机构化趋势明显。根据中国期货业协会公布数据，2021年国内期货市场全年成交75.14亿手和581.2万亿元，成交量创历史新高。

### **经营举措及业绩**

2021年，国信期货抓住市场机遇，期货经纪业务成交量达9,130.70万手，同比增长20%；交易额98,462.66亿元，同比增长22%；实现营业收入29.10亿元，同比增长30%，经营业绩创历史新高。国信期货持续夯实经纪业务，业务内涵更加丰富。大力推动高频量化业务的发展，部署多套极速交易环境及系统，自主研发上期交易柜台系统NANO。通过有效降低交易延迟，让客户做到了在市场上“快人一步”。同时，积极开拓资产管理、风险管理等创新业务，将传统期货经纪业务和创新业务有效结合，实现经营业绩的稳步提升。

### **2022年展望**

国信期货将聚焦衍生品市场业务，继续推进经纪业务升级转型。同时，围绕创新型衍生品业务、全价值链财富管理等业务主线，全力推动风险管理和资产管理业务的创新发展，形成新老业务互补互融、良性互动的格局。

## **⑥ 资产托管业务**

随着行业同质化竞争日渐激烈、托管费率不断降低，公司以做强做精托管主业吸引财富客群、以聚合综合金融服务提升总体收益、以为公司和客户实现双向价值创造为经营目标，聚焦跨越式发展，2021年实现资产托管及基金服务业务收入同比上涨17%，其中标准产品托管及基金服务业务规模同比增长超过20%。公司将继续围绕客户全生命周期，以托管业务为抓手，充分整合资源、扩大服务范围、增强客户黏性；积极开拓券商同业、银行、保险、第三方理财、期货公司等机构，并为优质私募管理人提供精细化服务。

### **(2) 投资银行**

公司投资银行业务主要是向企业客户提供金融服务，主要包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问和新三板挂牌推荐等业务。报告期内，公司投资银行业务实现营业收入20.66亿元，同比上升4.43%。

#### **① 股票承销保荐业务**

##### **市场环境**

2021年，随着北交所设立和股票发行注册制改革顺利推进，已形成从科创板到创业板、再到全市场的注册制改革布局。截至2021年底，沪深A股市场年内共发行股票项目1,088个，同比增长23%，募集资金15,730亿元，同比增长25%。其中，市场发行IPO项目483个，同比增长22%，IPO募集资金5,396亿元，同比增长15%；发行股权再融资项目605个，同比增长23%，募集资金10,334亿元，同比增长31%。

##### **经营举措及业绩**

2021年，公司不断提升保荐承销服务能力，夯实传统优势业务市场地位。报告期内，公司完成股票承销项目37.5个，同比增长40%，市场份额3.45%，行业排名第八，较上年上升两名；募集资金439.36亿元，

市场份额2.79%，行业排名第八。其中，完成IPO项目16.5个，行业排名第十；完成创业板IPO项目13个，行业排名第四，募集资金107.78亿元，行业排名第三；完成再融资项目21个，排名行业第七。公司完成的贝泰妮IPO项目，为中国化妆品行业市值第一，并荣获第十五届新财富“年度最佳IPO项目”奖项。同时，公司积极参与“双区”建设，服务深圳市属国企资本运作，助力国资国企做大做强。公司累计为大湾区企业完成保荐及承销项目10个，累计募集资金约77亿元，其中深圳地区7家，募资金额为58亿元；服务企业涵盖新一代信息技术、先进制造业以及现代服务业等战略新兴产业。公司作为保荐机构和主承销商，成功保荐深圳市属企业深城交登陆创业板，成为深圳本地第500家上市公司。目前，公司持续为19家深圳国企提供股权融资、财务顾问等资本运作服务。公司荣获第十五届新财富“本土最佳投行”“最佳IPO投行”等多个奖项。

公司高度重视民企纾困工作，支持上市公司及其大股东有效运用各类市场工具，推动以市场化方式缓解民营企业融资困境。截至2021年底，公司累计推进纾困项目11个，2个完成交易；与深投控等机构共同发起设立的“深圳投控共赢股权投资基金”已累计投资8个项目，累计投资金额42.98亿元。

报告期内，公司股票承销保荐业务的具体情况如下：

类别	2021 年度		2020 年度	
	主承销金额 (亿元)	承销家数	主承销金额 (亿元)	承销家数
首次公开发行	134.88	16.5	86.04	11.5
再融资发行	304.48	21	209.39	15.3
合计	439.36	37.5	295.43	26.8

注：联合主承销家数及金额以1/N计算

### 2022年展望

公司将认真落实2021年中央经济工作会议关于全面实施注册制、中国证监会关于全面深化资本市场改革的整体部署，坚持服务实体经济，大力支持科技创新；紧跟资本市场新情况新变化新特点，不断提升投资银行服务能力，把握资本市场改革机遇，打造积极稳健型综合服务投资银行。

## ② 债券承销业务

### 市场环境

在全球经济、政治形势日益严峻，国内经济逐步修复的背景下，债券市场监管政策基调整体趋严。2021年以来，监管层由点及面多举措发力，不同市场审核政策套利空间逐渐消除；债券审批将围绕鼓励创新、支持实体经济发展及绿色金融等方向开展。在国内经济迈向高质量发展的宏观背景下，预计债券市场发行规模将持续上升，资产证券化、基础设施公募REITs等创新品种将成为新的业务突破点。

### 经营举措及业绩

面对复杂的市场情况，公司精准把握市场动向，及时向发行人传递市场信息，在业务创新等方面取得较好成绩。一是紧抓“双区”建设机遇，加大深圳地区业务开拓。2021年，成功为深圳地区企业发行债券95只、规模共计约1,304亿元，同比增长162%。二是积极开展公募REITs业务，品牌影响力稳步提升。公司

担任独家财务顾问的红土盐田港REIT顺利发行；获评深交所“2021年度优秀基础设施公募REITs中介机构”。

三是把握债务融资工具独立主承销商资格机会，推动市场份额进一步提升。四是大力开拓绿色债、双创债、扶贫债业务。其中，“21广能G1”为深交所首批、广西首单碳中和债，“21创投K1”为全国首批、深交所首单科技创新债券。报告期内，公司债券承销情况具体如下：

类别	2021 年度		2020 年度	
	主承销金额 (亿元)	承销家数	主承销金额 (亿元)	承销家数
公司债	1,313.55	126.97	1,099.08	113.57
债务融资工具	509.32	83.50	419.30	56.17
资产支持证券	320.88	57.73	110.14	13.87
企业债	308.47	37.13	113.86	11.23
金融债	232.11	15.81	285.37	7.37
合计	2,684.33	321.14	2,027.75	202.21

注：联合主承销家数及金额以1/N计算

### 2022年展望

2022年，公司将继续坚持市场化、专业化及创新型发展方向，坚持以客户为中心，稳步提升服务水平和专业能力，打造差异化的核心竞争力。同时，进一步加快业务布局调整，积极应对城投债政策影响，确保债券承销业务稳步可持续发展。

### ③ 并购重组业务

2021年，并购重组市场总体持续低迷，并购交易数量、金额继续下降。坚守主业发展、回归并购本源已成为市场共识，基于产业逻辑的上市公司收购成为主流。2021年，中国证监会并购重组委共审核了46单并购重组项目，同比下降47%，其中40单通过，通过率86.96%。公司抓住注册制改革发展机遇，继续夯实并购重组业务基础，做好重点客户维护，积极拓展项目储备，妥善处置和防范业务风险。公司将进一步拓展TMT、高端装备制造、医药、新材料等行业优质标的储备，加大并购撮合力度，同时防控业务风险。

### ④ 北交所与新三板推荐业务

#### 市场环境

2021年是北交所和新三板改革发展极为重要的一年，北交所设立并于11月开市交易，市场服务中小企业和实体经济高质量发展的能力显著增强。截至2021年底，北交所上市公司82家，战略新兴产业、先进制造业、现代服务业等占比87%，经营业绩突出、创新能力较强；新三板挂牌公司6,932家，符合北交所上市财务条件的挂牌公司超过千家，市场服务创新型中小企业的聚集效应初步形成，服务创新驱动发展、经济转型升级等国家战略的功能更加凸显。

#### 经营举措及业绩

公司坚持做好新三板客户的服务、增值及创新业务的拓展，同时注重防范和化解风险；积极备战北交所企业公开发行与承销业务，服务北交所和新三板深化改革。报告期内，公司成为具备北交所首批会员资

格的券商，首批北交所上市公司中，由公司保荐的贝特瑞成为市值第一的北交所上市公司。截至2021年底，公司持续督导新三板项目82个，年内完成新三板定增项目2个，融资金额8,287万元。

### 2022 年展望

公司将继续把握北交所和新三板改革机遇，做好项目开发、储备和推荐，积极推动北交所项目申报；持续提升服务水平，促进中小企业和民营经济创新发展；加强对新三板企业的持续督导，做好存量项目的风险排查和处置工作，并持续开拓新的融资项目。

### ⑤ 境外投行业务

报告期内，子公司国信香港以联席全球协调人、联席账簿管理人、财务顾问、融资安排人等角色总共完成了24个境外资本市场项目，其中包括香港上市、上市前融资、上市公司顾问及美元债发行等多类型项目。国信香港充分利用其全牌照的优势及丰富的经验，积极为客户提供解决方案。面对当前市场环境的挑战，国信香港将以务实、灵活及多元化的策略，凝聚公司及国资协同的力量，发挥整体实力，争取在业务上取得更大的突破。

### (3) 投资与交易

公司的投资与交易业务主要是从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募基金管理及另类投资业务等。报告期内，公司投资与交易业务共实现营业收入74.16亿元，同比大幅上升89.70%。

#### ① 权益类投资业务

2021年，公司权益投资业务在面临市场巨大的结构分化时，精准把握市场机会，投资收益率优于股票型公募基金收益率中位数。公司实施以资产配置和多策略组合为支柱的投资模式，坚持以风险预算为出发点，力争实现中低风险绝对收益的目标。通过红利投资策略、定增投资策略、价值成长投资策略、公募基金组合投资策略、衍生品套利策略等多种策略有效分散投资风险、丰富收益来源、降低组合波动。未来，公司将发挥专业交易定价能力与风险管理能力，重点打造场外衍生品业务，挖掘新的盈利增长点。

#### ② 固定收益类投资业务

2021年债券市场呈慢牛态势。年初受市场预期影响，债券收益率快速上冲。在资金宽松、信用收缩推动下，3月起利率走低；7月中、12月初的超预期降准及降息，更推动债券市场收益率加速下行。年内信用债涨幅优于利率债，信用溢价达历史最低值。在债券市场牛市的背景下，公司把握市场机会，及时提高债券持仓、优化持仓结构，取得了较高的投资收益。

#### ③ 私募基金业务

2021年，中国私募基金行业增速有所恢复，新基金创设活跃，但募资市场逐渐开始两极分化，中小投资机构仍面临不同程度的“募资难”困境。子公司国信弘盛充分调动资源推进基金创投，加快基金投资和项目退出进度。报告期内，国信弘盛共完成15个项目投资，总投资金额9.7亿元；推进4个已上市项目的减持退出，减持金额超过10.7亿元。2021年度，国信弘盛实现营业收入8.6亿元，同比增长111%；净利润4.83亿元，同比增长104%；荣获“中国最佳券商私募子公司TOP10”“中国最佳私募股权投资机构TOP100”等多

个业内权威奖项，品牌价值持续提升。

#### ④ 另类投资业务

面对国内股权投资市场竞争加剧、头部机构资源集中的局面，子公司国信资本坚定夯实自身投资水平，不断提升开拓创新能力，经营业绩取得新突破。2021年，完成项目投资19个，投资金额8.14亿元，所投项目涵盖生物医药、新一代信息技术、高端智能制造等领域。报告期内，国信资本实现营业收入6.82亿元，净利润4.51亿元，同比增长139%和126%。国信资本将紧抓“双区”建设带来的历史机遇，围绕深圳市产业基础高级化、产业链现代化的相关需求，继续深耕股权投资业务和战略配售跟投业务，积极探索拓宽另类投资业务边界，构建长短期匹配、结构合理的投资组合。

#### (4) 资产管理

公司资产管理业务主要是根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合、单一资产管理业务，资产证券化业务以及基金管理业务等。报告期内，公司资产管理业务实现收入5.42亿元，同比上升36.65%。

#### 市场环境

随着资产管理新规过渡期结束，大资管行业的市场竞争日趋激烈，投研能力是资产管理机构实现差异化、取得竞争优势的核心因素。随着中国经济迈向高质量发展阶段，居民财富管理需求日益旺盛，房住不炒等政策持续推进，资产管理行业将迎来历史性发展机遇。

#### 经营举措及业绩

报告期内，公司认真做好宏观经济和行业发展研判，坚持“立足长远、聚焦投研”的总体思路，以主动管理为方向，打造“投研、市场、产品”三大支柱。投研方面，力争将固定收益构筑为业务基石，大力发展FOF等特色业务，着力打造权益投资品牌；市场方面，全面提升业务拓展能力，加强与各类外部机构合作，不断强化零售、机构和企业客户的服务能力；产品方面，建立涵盖市场主要投资策略的产品体系，在不同环境下根据客户需求提供定制化的投研策略服务。同时，公司积极推进大集合公募化改造工作，持续强化合规风控管理力度，全面提升内部管理效率，为资管业务健康发展提供坚实保障。

截至报告期末，公司实现资产管理净值规模为1,476.51亿元，较上年末上升1.02%，行业排名稳中有升，具体情况如下：

单位：亿元

类型	2021年12月31日	2020年12月31日	较上年末增减
集合资产管理业务	795.20	416.65	90.86%
单一资产管理业务	379.16	839.90	-54.86%
专项资产管理业务	302.15	205.00	47.39%
合计	1,476.51	1,461.54	1.02%

#### 2022 年展望

公司将坚持以客户为中心，持续提升投资业绩与客户服务能力。在继续巩固固定收益业务优势的基础上，稳步推动权益、FOF等业务发展；大力发展完成公募化改造的大集合产品，丰富产品类型，为资管业务



发展打开空间；根据零售、机构以及企业客户需求，提供定制化服务，增强客户黏性，提升资产管理业务的客户覆盖面和市场影响力。

### （5）其他业务

公司的其他业务主要是通过重要参股公司鹏华基金从事基金管理业务。鹏华基金始终坚持长期投资和价值投资的理念，2021年紧抓市场机遇，取得突出业绩，主要表现在：一是基金规模持续提升。截至2021年末，鹏华基金资产管理规模（不含子公司）首次跨越万亿大关，达10,293亿元，同比增长30%。其中，公募规模为7,705亿，同比增长2,086亿，增幅37%，稳居行业第一梯队。二是创新产品助推经济转型。2021年鹏华基金发行了新能源主题的主动管理基金和多只与碳中和相关的ETF产品，助力经济向绿色低碳转型；发行了首批同业存单指数基金并上报了首单清洁能源REITs，产品创新及服务实体经济能力显著提升。三是投资业绩表现出色。截至2021年末，鹏华基金三年和五年平均股票投资主动管理净值增长率分别为184.6%和166.8%，三年和五年平均债券投资主动管理净值增长率分别为15.5%和26.0%，投资业绩获得市场认可，连续两年蝉联“金牛基金管理公司”奖。

### 2. 已签订的重大销售合同、重大采购合同情况

不适用。

### 3. 营业成本构成

单位：万元

项目	2021 年度		2020 年度		同比增减幅度
	金额	占营业成本比重	金额	占营业成本比重	
业务及管理费	973,246.42	84.45%	736,973.84	72.60%	32.06%
其他业务成本	216,968.20	18.83%	165,166.75	16.27%	31.36%
税金及附加	14,335.40	1.24%	12,727.00	1.25%	12.64%
其他资产减值损失	9.63	0.00%	589.38	0.06%	-98.37%
信用减值损失	-52,145.06	-4.52%	99,651.22	9.82%	-152.33%
合计	1,152,414.58	100.00%	1,015,108.18	100.00%	13.53%

2021年公司营业支出同比增加13.73亿元，增幅13.53%，主要是：

- （1）业务及管理费97.32亿元，同比增加23.63亿元和32.06%，主要是职工薪酬增加；
- （2）其他业务成本21.70亿元，同比增加5.18亿元和31.36%，主要是大宗商品销售成本增加；
- （3）其他资产减值损失减少0.06亿元，主要是大宗商品跌价准备减少；
- （3）信用资产减值损失-5.21亿元，同比减少15.18亿元，主要是股票质押回购减值准备减少。

### 4. 报告期内合并范围是否发生变动

具体请参见第六节“七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明”。

## 5. 公司报告期内业务、产品或服务发生重大变化或调整有关情况

不适用。

### （三）费用

单位：万元

项目	2021 年度	2020 年度	同比增减幅度	重大变动说明
业务及管理费	973,246.42	736,973.84	32.06%	业务及管理费 97.32 亿元，同比增加 23.63 亿元和 32.06%，主要是职工薪酬增加。

### （四）研发投入

公司以数字化转型为抓手，发力金融科技赋能。以基金投顾为核心的财富管理业务数字化、智能化、能力提升项目群，证金业务统一管理平台、沪深两地双中心极速交易体系、全链条机构服务技术平台等一批“金融科技+业务”重点项目的落地，有效促进公司各项业务数字化转型取得新进展。报告期内，公司对信息系统建设的总投入为89,026.48万元，同比增长18.20%。

#### 1. 公司研发人员情况

项目	2021 年度	2020 年度	同比增减幅度
研发人员数量（人）	436	380	14.74%
研发人员数量占比	3.63%	3.15%	上升 0.48 个百分点
研发人员学历	-	-	-
大专	4	3	33.33%
本科	261	226	15.49%
硕士	169	149	13.42%
博士	2	2	-
研发人员年龄构成	-	-	-
30 岁以下	104	77	35.06%
30-40 岁	227	206	10.19%
40-50 岁	81	77	5.19%
50 岁以上	24	20	20.00%

报告期内，公司研发人员构成未发生重大变化。

#### 2. 公司研发投入情况

项目	2021 年度	2020 年度	同比增减幅度
研发投入金额（万元）	89,026.48	75,316.14	18.20%
研发投入占营业总收入比例	3.74%	4.01%	下降 0.27 个百分点
研发投入资本化的金额（万元）	-	-	-
资本化研发投入占研发投入的比例	-	-	-

报告期内，公司研发投入总额占营业总收入的比重较上年未发生显著变化。公司研发投入未进行资本化。

## （五）现金流

单位：万元

项目	2021 年度	2020 年度	同比增减幅度
经营活动现金流入小计	7,110,709.15	7,429,639.17	-4.29%
经营活动现金流出小计	7,782,247.93	7,776,866.83	0.07%
经营活动产生的现金流量净额	-671,538.78	-347,227.66	不适用
投资活动现金流入小计	114,704.81	29,222.24	292.53%
投资活动现金流出小计	73,986.93	111,987.71	-33.93%
投资活动产生的现金流量净额	40,717.88	-82,765.47	不适用
筹资活动现金流入小计	11,736,403.98	13,767,100.02	-14.75%
筹资活动现金流出小计	10,316,184.49	11,605,675.30	-11.11%
筹资活动产生的现金流量净额	1,420,219.49	2,161,424.72	-34.29%
现金及现金等价物净增加额	783,222.77	1,719,375.35	-54.45%

### 1. 相关数据同比发生重大变动的主要影响因素说明

报告期内，公司（合并）现金流量净额为78.32亿元。各项现金流量中，经营活动的现金流量净额为-67.15亿元，其中：现金流入711.07亿元，主要是回购业务资金净增加额344.30亿元、收取利息、手续费及佣金的现金189.18亿元、代理买卖证券收到的现金净额75.32亿元、其他权益工具投资净减少额42.99亿元；现金流出778.22亿元，主要是为交易目的而持有的金融资产净增加额362.40亿元、融出资金净增加额120.31亿元、支付给职工以及为职工支付的现金60.58亿元、支付利息、手续费及佣金的现金41.43亿元、其他债权投资净增加额37.79亿元及支付的各项税费37.48亿元。

投资活动的现金流量净额为4.07亿元，其中：投资活动现金流入11.47亿元，主要是收回投资所收到的现金8.63亿元、取得投资收益所收到的现金2.79亿元；投资活动现金流出7.40亿元，主要是购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金6.04亿元、投资所支付的现金1.36亿元。

筹资活动产生的现金流量净额为142.02亿元，其中：筹资活动现金流入1,173.64亿元，主要是发行债券收到的现金1,012.92亿元、吸收投资所收到的现金100.00亿元、取得借款收到的现金60.72亿元；筹资活动现金流出1,031.62亿元，主要是偿还债务及赎回永续次级债所支付的现金982.48亿元、分配股利、利润或偿付利息所支付的现金46.46亿元。

### 2. 报告期内公司经营活动产生的现金净流量与本年度净利润存在重大差异的原因说明

2021年公司实现净利润101.17亿元，与本年经营活动产生的现金流量净额有差异，主要是自营业务投资规模增加、回购业务资金净增加额、代理买卖证券收到的现金净额、融出资金净增加额等影响。

## 六、主营业务构成情况

### (一) 主营业务分业务情况

单位：万元

业务类别	营业总收入	营业支出	营业利润率	营业总收入 同比增减幅度	营业支出 同比增减幅度	营业利润率 比上年增减
经纪及财富管理	1,076,907.00	436,159.70	59.50%	7.70%	-8.80%	上升 7.32 个百分点
投资银行	206,637.69	133,222.54	35.53%	4.43%	11.36%	下降 4.01 个百分点
投资与交易	741,591.95	81,147.46	89.06%	89.70%	-6.74%	上升 11.32 个百分点
资产管理	54,169.74	25,165.95	53.54%	36.65%	50.88%	下降 4.38 个百分点
其他	302,497.31	476,718.93	不适用	20.99%	52.03%	不适用
合计	2,381,803.70	1,152,414.58	51.62%	26.80%	13.53%	上升 5.66 个百分点

报告期内，公司主营业务数据统计口径未发生调整。

### (二) 主营业务分地区情况

#### 1. 营业总收入地区分部情况

单位：万元

地区	2021 年度		2020 年度		营业总收入 同比增减幅度
	营业网点数量	营业总收入	营业网点数量	营业总收入	
广东	70	288,502.93	65	279,403.47	3.26%
浙江	30	68,657.79	28	67,733.68	1.36%
北京	13	57,503.64	12	58,809.85	-2.22%
上海	12	52,695.11	12	50,656.71	4.02%
四川	15	25,905.00	15	24,147.11	7.28%
湖北	6	20,180.19	6	19,277.11	4.68%
福建	11	19,832.72	10	20,404.18	-2.80%
江苏	14	18,925.71	13	18,615.17	1.67%
陕西	9	16,119.81	9	15,647.39	3.02%
山东	10	13,677.15	10	12,929.00	5.79%
湖南	7	10,426.20	6	10,310.71	1.12%
天津	4	7,649.00	4	7,534.75	1.52%
辽宁	8	7,495.58	8	8,069.80	-7.12%
云南	4	6,802.28	4	6,046.70	12.50%
河南	7	5,911.38	7	5,000.66	18.21%
安徽	5	5,428.91	5	4,664.36	16.39%
山西	5	4,191.71	5	4,244.80	-1.25%
重庆	4	3,515.18	4	3,680.59	-4.49%
黑龙江	5	3,438.32	5	3,540.09	-2.87%
江西	4	3,361.60	4	3,076.03	9.28%
海南	3	3,230.92	3	3,155.21	2.40%
吉林	3	2,461.44	3	2,732.10	-9.91%

广西	3	2,035.08	3	1,848.90	10.07%
河北	2	1,552.21	2	1,411.54	9.97%
内蒙古	1	1,493.20	1	1,259.47	18.56%
贵州	2	1,369.03	2	1,061.24	29.00%
甘肃	1	1,166.48	1	1,026.29	13.66%
宁夏	2	1,068.05	2	839.99	27.15%
新疆	2	960.80	2	1,004.42	-4.34%
公司总部及境内子公司	-	1,708,167.56	-	1,217,686.77	40.28%
境外小计	-	18,078.75	-	22,589.04	-19.97%
合计	262	2,381,803.70	251	1,878,407.12	26.80%

注：营业网点数量包括公司证券及期货营业网点。

## 2. 营业利润地区分部情况

单位：万元

地区	2021 年度		2020 年度		营业利润 同比增减幅度
	营业网点数量	营业利润	营业网点数量	营业利润	
广东	70	146,465.38	65	154,839.92	-5.41%
浙江	30	31,859.28	28	34,888.47	-8.68%
北京	13	29,846.14	12	34,987.83	-14.70%
上海	12	25,616.30	12	28,303.34	-9.49%
湖北	6	8,702.83	6	10,255.91	-15.14%
四川	15	8,399.62	15	9,612.37	-12.62%
江苏	14	7,483.60	13	8,418.49	-11.11%
陕西	9	7,249.70	9	8,585.44	-15.56%
福建	11	6,939.85	10	8,657.45	-19.84%
湖南	7	4,179.92	6	4,994.07	-16.30%
云南	4	3,475.03	4	3,030.34	14.67%
山东	10	2,553.25	10	3,880.16	-34.20%
河南	7	2,322.41	7	2,036.07	14.06%
辽宁	8	2,007.07	8	3,216.18	-37.59%
天津	4	1,944.40	4	2,311.74	-15.89%
安徽	5	1,776.40	5	1,676.50	5.96%
山西	5	1,117.21	5	1,333.15	-16.20%
江西	4	772.90	4	785.47	-1.60%
黑龙江	5	746.48	5	1,306.95	-42.88%
海南	3	554.04	3	795.01	-30.31%
吉林	3	264.58	3	691.43	-61.73%
河北	2	222.08	2	328.66	-32.43%
重庆	4	71.05	4	934.45	-92.40%
甘肃	1	59.81	1	26.88	122.49%
宁夏	2	55.34	2	79.58	-30.47%
内蒙古	1	2.82	1	130.38	-97.84%

广西	3	-95.14	3	-74.25	不适用
新疆	2	-131.14	2	73.85	-277.57%
贵州	2	-273.59	2	-477.82	不适用
公司总部及境内子公司	-	933,914.69	-	534,199.83	74.82%
境外小计	-	1,286.82	-	3,471.08	-62.93%
合计	262	1,229,389.12	251	863,298.94	42.41%

注：营业网点数量包括公司证券及期货营业网点。

## 七、非主要经营业务情况

不适用。

## 八、资产及负债状况分析

### （一）资产及负债构成重大变动情况

单位：万元

项目	2021 年末		2021 年初		占比增减 (百分点)
	金额	占总资产比例	金额	占总资产比例	
<b>资产：</b>					
货币资金	6,772,174.10	18.69%	6,590,702.42	21.74%	-3.05
结算备付金	1,708,782.40	4.72%	1,104,035.28	3.64%	1.08
交易性金融资产	15,231,212.33	42.04%	10,675,935.20	35.21%	6.83
其他债权投资	2,964,427.44	8.18%	2,474,098.25	8.16%	0.02
其他权益工具投资	718,602.23	1.98%	1,176,289.01	3.88%	-1.90
应收账款	143,259.57	0.40%	133,537.63	0.44%	-0.04
投资性房地产	28,843.73	0.08%	29,903.82	0.10%	-0.02
长期股权投资	356,133.96	0.98%	362,477.65	1.20%	-0.22
固定资产	267,989.94	0.74%	126,462.49	0.42%	0.32
在建工程	2,385.68	0.01%	102,445.60	0.34%	-0.33
使用权资产	45,979.73	0.13%	43,723.42	0.14%	-0.01
融出资金	6,197,331.18	17.11%	4,975,459.40	16.41%	0.70
衍生金融资产	5,796.69	0.02%	624.66	0.00%	0.02
买入返售金融资产	677,099.44	1.87%	1,618,047.05	5.34%	-3.47
存出保证金	758,757.23	2.09%	557,929.59	1.84%	0.25
无形资产	68,351.18	0.19%	66,568.90	0.22%	-0.03
商誉	1,026.02	0.00%	1,026.02	0.00%	0.00
递延所得税资产	235,291.45	0.65%	228,263.96	0.75%	-0.10
其他资产	46,699.92	0.13%	49,276.05	0.16%	-0.03
<b>负债：</b>					
拆入资金	445,679.80	1.23%	643,405.16	2.12%	-0.89
卖出回购金融资产款	9,652,492.95	26.64%	7,214,725.20	23.80%	2.84

短期借款	22,527.00	0.06%	34,596.85	0.11%	-0.05
合同负债	3,869.60	0.01%	1,161.71	0.00%	0.01
租赁负债	44,701.67	0.12%	41,111.32	0.14%	-0.02
应付短期融资款	1,980,003.28	5.47%	2,592,952.91	8.55%	-3.08
交易性金融负债	46,098.28	0.13%	5,192.00	0.02%	0.11
衍生金融负债	22,604.95	0.06%	33,144.65	0.11%	-0.05
代理买卖证券款	6,728,029.21	18.57%	5,974,626.52	19.71%	-1.14
代理承销证券款	2,700.00	0.01%	-	0.00%	0.01
应付职工薪酬	649,198.09	1.79%	464,900.58	1.53%	0.26
应交税费	83,117.91	0.23%	127,507.54	0.42%	-0.19
应付款项	527,497.91	1.46%	569,818.39	1.88%	-0.42
预计负债	19,365.83	0.05%	51,764.71	0.17%	-0.12
应付债券	5,100,248.75	14.08%	3,534,620.39	11.66%	2.42
递延收益	12,628.97	0.03%	12,976.55	0.04%	-0.01
递延所得税负债	69,669.21	0.19%	54,041.29	0.18%	0.01
其他负债	1,127,018.89	3.11%	867,813.70	2.86%	0.25

公司2021年末总资产3,623.01亿元，较年初增加591.33亿元和19.51%；剔除客户资金后的总资产2,950.21亿元，较年初增加515.99亿元和21.20%，其中货币资金及结算备付金95.56亿元、融出资金619.73亿元、交易性金融资产1,523.12亿元、买入返售金融资产67.71亿元、其他债权投资296.44亿元、其他权益工具投资71.86亿元，这七类资产合计占总资产（扣除客户资金）的90.65%，公司资产结构合理、具有较强的流动性。

公司2021年末负债总额2,653.75亿元，较年初增加431.31亿元和19.41%；扣除代理买卖证券款后，公司负债1,980.94亿元，其中：公司债507.12亿元，收益凭证27.97亿，短期借款2.25亿元，短期融资券172.93亿元，其余均为正常的经营性短期负债。公司2021年底资产负债率73.25%，剔除客户资金和代理买卖证券款后资产负债率67.15%。

公司不存在境外资产占比较高的情况。

## （二）以公允价值计量的资产和负债

单位：万元

项目	期初数	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	本期购买金额	本期出售金额	其他变动	期末数
<b>金融资产</b>								
1. 交易性金融资产	10,675,935.20	166,675.61	-	-	4,377,682.81	-	-	15,231,212.33
2. 衍生金融资产	624.66	5,172.03	-	-	-	-	-	5,796.69
3. 其他债权投资	2,474,098.25	-	-15,840.78	7,211.72	467,830.65	-	-	2,964,427.44
4. 其他权益工具投资	1,176,289.01	-	-24,463.12	-	-	380,536.39	-	718,602.23
合计	14,326,947.12	171,847.64	-40,303.89	7,211.72	4,845,513.46	380,536.39	-	18,920,038.68
<b>金融负债</b>	38,336.64	2,196.38	-	-	39,270.24	-	-	68,703.23

报告期内，公司主要资产计量属性未发生重大变化。

### （三）截至报告期末的资产权利受限情况

详见公司2021年度财务报表附注“五、合并财务报表项目注释”的“（四）其他 1. 所有权或使用权受到限制的资产”。

### （四）比较式财务报表中变动幅度超过 30%以上项目的情况

单位：万元

项目	2021 年末	2020 年末	同比增减幅度	变动原因
结算备付金	1,708,782.40	1,104,035.28	54.78%	主要是存放在清算机构的客户结算资金增加。
衍生金融资产	5,796.69	624.66	827.97%	主要是信用缓释工具、远期合约公允价值变动。
买入返售金融资产	677,099.44	1,618,047.05	-58.15%	主要是股票质押式回购规模下降。
存出保证金	758,757.23	557,929.59	36.00%	主要是交易保证金增加。
交易性金融资产	15,231,212.33	10,675,935.20	42.67%	主要是债券及基金投资规模增加。
其他权益工具投资	718,602.23	1,176,289.01	-38.91%	主要是投资规模减少。
固定资产	267,989.94	126,462.49	111.91%	主要是基建项目转入固定资产。
在建工程	2,385.68	102,445.60	-97.67%	主要是基建项目转入固定资产。
使用权资产	45,979.73	-	不适用	实施新租赁准则所致。
短期借款	22,527.00	34,596.85	-34.89%	主要是信用借款减少。
拆入资金	445,679.80	643,405.16	-30.73%	主要是银行及转融通拆入资金减少。
交易性金融负债	46,098.28	5,192.00	787.87%	主要是债券借贷增加。
衍生金融负债	22,604.95	33,144.65	-31.80%	主要是收益互换及股票期权公允价值变动。
卖出回购金融资产款	9,652,492.95	7,214,725.20	33.79%	主要是质押式回购规模增加。
代理承销证券款	2,700.00	-	不适用	收到定向增发认购保证金。
应付职工薪酬	649,198.09	464,900.58	39.64%	主要是应付短期薪酬增加。
应交税费	83,117.91	127,507.54	-34.81%	主要是应交企业所得税减少。
合同负债	3,869.60	1,161.71	233.09%	主要是大宗交易商品预收货款增加。
租赁负债	44,701.67	-	不适用	实施新租赁准则所致。
预计负债	19,365.83	51,764.71	-62.59%	主要是预计诉讼案件损失减少。
应付债券	5,100,248.75	3,534,620.39	44.29%	主要是公司债增加。
其他权益工具	2,000,000.00	1,000,000.00	100.00%	主要是发行的永续次级债券增加。
其他综合收益	-5,755.30	40,918.38	-114.07%	主要是其他权益工具投资及其他债权投资公允价值变动。
项目	2021 年度	2020 年度	同比增减幅度	变动原因
投资收益	743,613.12	489,351.19	51.96%	主要是金融工具投资收益增加。
公允价值变动收益（损失）	174,044.02	6,709.12	2,494.14%	证券市场波动导致金融工具公允价值变动增加。
汇兑损失	-63.79	-598.96	不适用	主要是汇率变动。
业务及管理费	973,246.42	736,973.84	32.06%	主要是计提的职工薪酬增加。
信用减值损失	-52,145.06	99,651.22	-152.33%	主要是融资业务信用减值损失减少。



其他资产减值损失	9.63	589.38	-98.37%	主要是计提的大宗商品跌价准备减少。
其他业务成本	216,968.20	165,166.75	31.36%	主要是大宗商品销售成本增加。
营业外支出	-29,274.10	33,031.77	-188.62%	主要是预计的诉讼案件损失减少。
所得税费用	251,743.70	172,532.24	45.91%	主要是利润总额增加所致。
其他综合收益的税后净额	-98,977.31	21,378.62	-562.97%	主要是其他权益工具投资及其他债权投资公允价值变动。
经营活动产生的现金流量净额	-671,538.78	-347,227.66	不适用	主要是客户资金流入减少。
投资活动产生的现金流量净额	40,717.88	-82,765.47	不适用	主要是收到股权投资分红及收回投资所收到的现金增加。
筹资活动产生的现金流量净额	1,420,219.49	2,161,424.72	-34.29%	主要是吸收投资所收到的现金减少。

## （五）融资渠道、长短期负债结构分析

### 1. 融资渠道

从融资方式来看，公司的融资渠道包括股权融资和债权融资两种方式。从融资期限来看，公司的短期融资渠道包括银行间市场同业拆借、债券回购、转融通、融资资产债权收益权转让与回购、债券借贷等，以及发行短期融资券、短期公司债券、收益凭证等；中长期融资渠道包括发行公司债券、次级债券、永续次级债券、融出资金债权资产证券化，以及发行股票、可转换公司债券等。

2021年，公司综合运用短期和中长期融资渠道筹措资金，包括开展同业拆借、债券回购、转融通、发行短期融资券、收益凭证、公司债券、永续次级债券等。

### 2. 负债结构

2021年末，公司总负债2,653.75亿元。扣除客户存放的交易结算资金后，自有负债1,980.94亿元，其中应付债券占比25.75%、应付短期融资款占比10.00%、卖出回购金融资产款占比48.73%、拆入资金（含转融通）占比2.25%、短期借款占比0.11%。截至报告期末，公司无到期未偿还的债务。

### 3. 流动性管理措施与政策

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。

报告期内，公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

（1）积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平；

（2）加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求；

（3）持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地；

（4）持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口；

- (5) 适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施；
- (6) 持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

#### 4. 融资能力分析

公司经营稳健，信誉良好，盈利能力和偿付能力较强。公司积极拓展融资渠道和交易对手，与各大国有商业银行、股份制商业银行等金融机构均保持良好的合作关系。截至2021年末，公司获得多家金融机构合计超过2,000亿元的综合授信，具备能够以合适的成本随时获得短期和长期资金的能力。

## 九、投资状况

### (一) 总体情况

单位：万元

报告期投资额	上年同期投资额	变动幅度
87,824.76	46,235.90	89.95%

### (二) 报告期内获取的重大的股权投资情况

不适用。

### (三) 报告期内正在进行的重大的非股权投资情况

单位：万元

项目名称	投资方式	是否为固定资产投资	本报告期投入金额	截至报告期末累计实际投入金额	资金来源	项目进度	项目收益情况	披露情况
国信金融大厦	自建	是	39,140.70	136,826.67	自有资金	100.00%	不适用	不适用

#### (四) 金融资产投资

##### 1. 证券投资情况

单位：万元

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
基金	000621	易方达现金增利货币 B	258,148.07	公允价值计量	93,630.53	-	-	240,000.00	80,000.00	4,517.54	258,148.07	交易性金融资产	自有
基金	003281	广发活期宝货币 B	253,776.65	公允价值计量	50,082.46	-	-	230,000.00	30,000.00	3,694.19	253,776.65	交易性金融资产	自有
其他	SSP378	财通证券资管智选 FOF8 号单一资产管理计划	247,812.45	公允价值计量	-	1,549.49	-	263,010.00	15,200.00	2.45	249,361.93	交易性金融资产	自有
其他	SQK773	五矿证券智信 1 号 FOF 单一资产管理计划	172,684.47	公允价值计量	-	16,307.32	-	187,330.00	15,667.25	1,021.73	188,991.79	交易性金融资产	自有
基金	009824	鹏华添利宝货币基金 B	164,189.69	公允价值计量	37,426.75	-0.18	-	148,932.10	23,118.92	2,433.43	164,190.31	交易性金融资产	自有
其他	931830	证券行业支持民企发展系列之国信证券 1 号集合资产管理计划	150,292.50	公允价值计量	156,568.62	-	4,107.64	-	-	-	160,670.53	其他权益工具投资	自有
其他	pa028888	工行随心 E	150,000.00	公允价值计量	-	55.34	-	750,000.00	600,000.00	3,186.71	150,055.34	交易性金融资产	自有
基金	510500	南方中证 500ETF	120,479.05	公允价值计量	92,862.52	18,100.13	-	31,575.63	743.78	18,102.09	141,796.47	交易性金融资产	自有
债券	210215	21 国开 15	126,817.26	公允价值计量	-	89.06	-	1,208,102.06	1,081,168.79	1,162.50	128,095.76	交易性金融资产	自有
债券	210210	21 国开 10	122,043.53	公允价值计量	-	551.11	-	2,830,640.18	2,707,084.69	1,371.03	124,926.52	交易性金融资产	自有
期末持有的其他证券投资			16,767,763.45	-	13,895,751.57	130,023.35	-44,411.53	122,676,115.83	119,593,401.91	786,842.51	17,100,025.31	-	-
合计			18,534,007.13	-	14,326,322.46	166,675.61	-40,303.89	128,565,705.80	124,146,385.35	822,334.17	18,920,038.68	-	-
证券投资审批董事会公告披露日期			不适用										
证券投资审批股东会公告披露日期			不适用										

## 2. 衍生品投资情况

不适用。

### (五) 募集资金使用情况

#### 1. 募集资金总体使用情况

单位：万元

募集年份	募集方式	募集资金总额	本期已使用募集资金总额	已累计使用募集资金总额	报告期内变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额比例	尚未使用募集资金总额	尚未使用募集资金用途及去向	闲置两年以上募集资金金额
2020 年	非公开发行股票	1,478,155.72	41,121.82	1,480,568.05	-	-	-	-	不适用	-
合计	-	1,478,155.72	41,121.82	1,480,568.05	-	-	-	-	不适用	-
<b>募集资金总体使用情况说明</b>										
公司于 2020 年 7 月非公开发行股票募集资金人民币 1,500,000 万元，扣除发行相关费用人民币 21,844.28 万元（不含增值税）后实际募集资金净额为人民币 1,478,155.72 万元。截至 2021 年 12 月 31 日，公司募集资金已使用完毕，募集资金专户已全部销户。										

#### 2. 募集资金承诺项目情况

单位：万元

承诺投资项目和超募资金投向	是否已变更项目（含部分变更）	募集资金承诺投资总额	调整后投资总额(1)	本报告期投入金额	截至期末累计投入金额(2)	截至期末投资进度(%) (3)=(2)/(1)	项目达到预定可使用状态日期	本报告期实现的效益	是否达到预计效益	项目可行性是否发生重大变化
<b>承诺投资项目</b>										
1. 向全资子公司增资	否	不超过 230,000 万元	230,000.00	33,492.00	224,102.00	97.44 <sup>注1</sup>	不适用	不适用	不适用	否
2. 投资与交易业务	否	不超过 600,000 万元	600,000.00	-	600,000.00	100.00	不适用	不适用	不适用	否
3. 资本中介业务	否	不超过 250,000 万元	250,000.00	-	250,000.00	100.00	不适用	不适用	不适用	否
4. 偿还债务	否	不超过 400,000 万元	398,155.72	-	398,155.72	100.00	不适用	不适用	不适用	否
5. 其他营运资金安排	否	不超过 20,000 万元	-	7,629.82 <sup>注2</sup>	8,310.33	-	不适用	不适用	不适用	否
承诺投资项目小计	-	不超过 1,500,000 万元	1,478,155.72	41,121.82	1,480,568.05	100.16	-	-	-	-
<b>超募资金投向</b>										
无	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
归还银行贷款（如有）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
补充流动资金（如有）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
超募资金投向小计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

合计	-	不超过 1,500,000 万元	1,478,155.72	41,121.82	1,480,568.05	100.16	-	-	-	-
未达到计划进度或预计收益的情况和原因 (分具体项目)	不适用。									
项目可行性发生重大变化的情况说明	公司不存在项目可行性发生重大变化的情况。									
超募资金的金额、用途及使用进展情况	公司不存在超募资金。									
募集资金投资项目实施地点变更情况	公司不存在募集资金投资项目实施地点变更的情况。									
募集资金投资项目实施方式调整情况	公司不存在募集资金投资项目实施方式调整的情况。									
募集资金投资项目先期投入及置换情况	<p>公司非公开发行方案经 2018 年第三次股东大会审议通过至募集资金到位前，公司已使用自筹资金先行向子公司国信期货有限责任公司增加注册资本人民币 140,000 万元。</p> <p>2020 年 8 月 24 日，公司召开的第四届董事会第二十九次会议和第四届监事会第十六次会议分别审议通过了《关于以募集资金置换预先投入募投项目自筹资金的议案》，公司独立董事就关于以募集资金置换预先投入募投项目自筹资金相关事宜发表独立意见，同意公司以募集资金置换已向全资子公司国信期货有限责任公司增资先行投入的自筹资金 140,000 万元。</p> <p>天健会计师事务所（特殊普通合伙）出具了《关于国信证券股份有限公司以自筹资金预先投入募投项目的鉴证报告》（天健审[2020]7-769 号）。保荐机构出具了《关于国信证券股份有限公司使用募集资金置换预先投入募投项目自筹资金的核查意见》，对公司本次使用募集资金置换预先投入募集资金投资项目自筹资金事项无异议。</p> <p>2020 年 8 月 25 日，公司完成以募集资金置换预先投入募投项目自筹资金 140,000 万元。</p>									
用闲置募集资金暂时补充流动资金情况	公司不存在用闲置募集资金暂时补充流动资金的情况。									
项目实施出现募集资金结余的金额及原因	<p>因人民币升值，向全资子公司增资项目实际投入较预计投入节约 5,898.00 万元，同时募集资金存放银行期间产生了利息收入净额，导致公司募集资金节余。</p> <p>2021 年 8 月 23 日，公司第四届董事会第三十七次会议和第四届监事会第二十三次会议分别审议通过了《关于非公开发行 A 股股票募投项目节余募集资金永久补充流动资金的议案》，公司独立董事就关于节余募集资金永久补充流动资金相关事宜发表独立意见，同意将节余募集资金永久补充流动资金。保荐机构出具了《关于国信证券股份有限公司非公开发行 A 股股票募投项目实施完毕并将节余募集资金永久补充流动资金的核查意见》，同意本公司将节余募集资金永久补充流动资金。</p>									
尚未使用的募集资金用途及去向	公司募集资金已使用完毕。									
募集资金使用及披露中存在的问题或其他情况	无。									

注 1：向全资子公司增资项目中包括以港币增资国信香港，该项目因人民币升值，实际投入较预期投入节约 5,898.00 万元。

注 2：本年度投入其他营运资金安排的资金来源为募集资金产生的利息及因汇率原因造成节余募集资金。

### 3. 募集资金变更项目情况

公司报告期不存在募集资金变更项目情况。

## 十、重大资产和股权出售

### （一）出售重大资产情况

不适用。

### （二）出售重大股权情况

不适用。

## 十一、主要控股参股公司分析

单位：万元

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	2021 年末总资产	2021 年末净资产	2021 年度营业总收入	2021 年度营业利润	2021 年度净利润
国信期货	子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询	200,000.00	1,658,052.02	324,560.92	291,008.45	40,814.02	31,056.89
国信弘盛	子公司	创业投资业务	405,000.00	364,551.98	333,443.52	85,966.27	67,228.46	48,281.91
国信香港	子公司	股票及期货经纪、投资银行、资产管理	港币 263,000.00	320,598.58	123,731.67	18,078.75	1,286.82	176.31
国信资本	子公司	股权投资	300,000.00	383,699.43	345,633.33	68,179.46	61,993.33	45,084.79
鹏华基金	参股公司	基金募集、基金销售、资产管理	15,000.00	695,071.62	374,347.15	443,677.83	137,387.94	100,764.78

报告期内，公司未新增子公司，处置子公司的情况如下：

公司名称	报告期内取得和处置子公司方式	对整体生产经营和业绩的影响
深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司	注销	无重大影响

## 十二、公司控制的结构化主体情况

公司合并的结构化主体包括公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。公司通过综合评估公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2021年12月31日，纳入公司财务报表合并范围的结构化主体共34个，合并的结构化主体的总资产为人民币688,769.60万元。公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产和其他权益工具投资的金额为人民币652,067.58万元。

## 十三、公司未来发展的展望

### （一）证券行业的发展趋势和竞争格局

#### 1. 证券行业发展趋势

当前我国经济稳中向好、长期向好的发展态势没有改变，资本市场正在发生积极的结构性变化，市场平稳健康发展具备坚实基础。中国证监会坚持“稳字当头、稳中求进”，全面贯彻新发展理念，服务构建新发展格局和高质量发展，把稳增长、防风险放到突出位置，继续全面深化改革开放，不断促进资本市场的高质量发展。站在新的历史起点上，证券行业坚持回归本源、提升市场效率、助力实体经济转型升级是必由之路。

##### （1）注册制促进券商提升专业服务能力

注册制是中国资本市场改革的重要方向之一，是一个循序渐进的发展过程。中国证监会强调，今年将进一步完善以信息披露为核心的注册制安排。注册制在信息披露机制、新股发行定价机制、中介责任定价机制方面，对券商的风险管理水平、研究定价能力等方面提出了更高的要求。注册制背景下，券商应当发挥发行人、投资者、其他中介机构等利益相关方的协调和平衡作用，做好信息传递、价格发现、综合服务等工作，为企业提供全生命周期、全价值链的综合金融服务，更好地服务新兴产业和创新企业，从而助力金融供给侧结构性改革。

##### （2）财富管理需求增长为券商带来更大机遇

中国经济发展质量不断提升，居民财富管理需求迅猛增长。随着权益类基金规模扩大，我国居民对权益市场的关注度和参与度不断加深，共同促进券商财富管理业务转型。券商拥有较强的权益市场研究实力、丰富的资本市场人才积累以及中高风险客户资源，发展财富管理业务也凸显出自身的亮点和优势。从通道中介转向专业金融服务机构，从金融产品代销转向产品设计、专业投资咨询与基金投顾，券商的财富管理业务发展在摸索中初见成效。基金投顾业务试点的推出，将引导投资者依靠专业机构服务能力，通过加大金融产品配置与保有，获得中长期投资收益，这为券商发展财富管理业务带来更大机遇。与此同时，券商金融科技投入不断增加，配合财富管理业务转型，将提升服务效率，优化服务水平。

##### （3）资本市场对外开放促进券商提升跨境金融服务能力

在国际化大背景下，资产定价全球化。券商作为连接实体经济和资本市场的桥梁，需要全面提升跨境金融服务能力，持续探索跨境金融创新，提升跨境业务的核心竞争力，应对国际竞争。资本市场对外开放的格局下，券商将继续在跨境投资渠道、投资产品供给、投资制度体系、资本流动和风险管理等方面优化与拓展，包括进一步丰富券商境外产品线、建立并完善跨境业务信息技术系统、引进优秀跨境业务专业人才、完善合规管理与风险管理机制等。

#### 2. 证券行业竞争格局

##### （1）证券行业整体差异化竞争格局较为稳定

目前，我国证券行业大、中、小型公司共存。2020年，中国证监会修订《证券公司分类监管规定》，

优化分类评价指标体系，从投资银行、资产管理、机构客户服务及交易、财富管理、盈利能力、信息技术投入等方面，优化调整业务发展状况评价指标，这体现了监管支持证券公司突出主业、做优做强、差异化、特色化发展的导向，进一步推动了证券行业形成差异化发展格局。

### （2）头部券商业务集中度不断提高

随着资本市场改革深化，证券行业业务转型加快，业务空间扩大。头部券商在资本实力、客户资源、研究能力、资产定价能力、风险管理能力等方面均有优势，业务竞争力不断增强，创新能力不断凸显，品牌影响力不断提升。

### （3）寻求特色化发展是中小券商的必然选择

在证券行业差异化发展背景下，中小券商发展机遇与挑战并存。对中小券商而言，需根据自己的比较优势，提升细分领域的专业能力，走出一条精品化、专业化的发展道路。近两年来，部分中小券商结合自身禀赋，寻求特色化发展，在投行、财富管理等业务上排名位居行业前列。

## （二）公司发展战略

当前，多层次资本市场改革有序推进，产品结构不断完善，资本市场服务实体经济能力不断提升，带动金融和实体经济良性循环，为证券行业提质增效注入新动能。在整体战略上，公司将坚持以客户为中心，全力实施“一个打造、两翼驱动、六大推进、八大支撑”（1、2、6、8）工程，服务经济高质量发展。“一个打造”，即目标是全力打造世界一流的综合型投资银行。“两翼驱动”，即将夯实资本硬实力与提升管理能力作为驱动公司发展的两翼；夯实资本硬实力就是要积极采用非公开发行股票、H股上市等方式，扩大资本规模和境内外影响力，为实现公司行业地位的跨越提供坚实支撑；提升管理能力就是要以加强管理体系和管理能力建设为主线，夯实管理基础，优化管理流程，推动管理创新，全面提升管理现代化水平，不断增强公司的核心竞争力。“六大推进”，即推进“全价值链财富管理”“积极稳健型投行服务”“多平台价值投资”“全方位研究服务”“金融科技驱动发展”“多渠道国际化发展”六大业务主线。“八大支撑”，即重点实施金融控股战略、非有机增长战略、客户服务战略、金融科技领先战略、内部管控战略、人才优先战略、深耕深圳本土战略、国资国企协同发展战略等八大战略支撑。

### （三）2022 年度公司经营计划

公司将紧扣国家和地区发展战略，认真落实上级安排部署，加快高质量发展步伐，按照“服务大局，强基固本，改革创新，稳中求进”的经营思路，推动新出台的公司“十四五”规划和各子规划全面落地，确保实现全年经营目标：一是大力发展直接融资，助力实体经济发展。通过股债权融资、REITs、创投、商品期货等金融工具，助力国家战略平稳落地。二是继续深耕深圳主场，积极服务“双区”建设。发挥地方国企功能，抢抓“双区”驱动、“双区”叠加、“双改”示范等重大历史机遇，强化服务城市、服务产业、服务民生的责任和担当，打造新时期先行示范区国资国企精彩范例。三是主动应对市场变化，稳步提升利润贡献。下大力巩固业务优势，通过“做厚家底”应对市场波动，实现自身经营业绩的“稳中有进”。四是不断推进战略协同，提升整体作战实效。推动相关制度尽快成熟细化，平台体系不断建立健全，努力取得更多协同实效。五是坚持强化科技创新基因，持续提升金融科技赋能业务发展能力。进一步加强关键技



术、关键系统的自研，加强和大湾区数字经济研究院及头部IT公司的合作，挖掘业务机会，形成金融科技与业务发展互促共赢的良好态势。六是切实防范业务风险，确保实现稳健经营。严格落实上级要求，把防范业务风险摆在更加突出的位置，以合规展业维护市场稳定大局。七是加大人才培养力度，打造能攻善战队伍。在持续完善薪酬激励制度的同时，大力强化人才队伍建设，为长远发展打下坚实基础。八是从严抓好疫情防控，做好各项安全管理工作。从细从严落实疫情防控、安全管理等工作要求，为经济社会稳定发展作出贡献。

#### （四）公司各业务线的创新及风险控制

##### 1. 报告期内业务创新情况

报告期内，公司正式获批基金投顾业务试点展业资格，与基金公司合作的平台型基金投顾业务正式上线，自有型和平台型基金投顾协同发展的业务布局基本形成。此外，公司还获取了“账户管理功能优化试点”“信用缓释工具一般交易商”等新业务资格，相关业务稳步推进，继续开创公司在新市场、新客户、新品种等方面的业务新局面。

##### 2. 业务创新的风险控制情况

公司将创新业务一并纳入多层次、全方位的内部控制和风险管理体系中，确保风险可控。公司制定并实施了《国信证券股份有限公司新产品新业务管理办法》，对创新业务的筹备、业务评估与决策、业务开展及后续管理进行要求。

在经营创新类业务时，公司始终坚持合法合规、制度先行、流程优先的原则，在业务开展之前制定一系列完备的管理制度、业务流程和风控制度，确保创新业务有条不紊地开展。事前，内控部门全面参与每项创新业务，业务筹备之初介入业务研讨，进行合规论证，商定业务方案，对风险予以识别分析；业务开展后，业务部门和内控部门各自独立进行持续监控和报告，确保各项风控措施落到实处。

#### 十四、报告期内接待调研、沟通、采访等活动

序号	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
1	2021年11月30日	公司	2021 深圳辖区上市公司投资者网上集体接待日活动	其他	公众投资者	公司经营情况	详见公司于 2021 年 12 月 1 日在深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> ) 披露的《投资者关系活动记录表》

## 第四节 公司治理

### 一、公司治理的基本状况

公司严格按照《公司法》《证券法》及中国证监会相关法规的要求，规范运作，持续致力于维护和提升公司良好的市场形象。公司不断完善公司治理结构，持续健全合规风控制度和内控管理体系，形成了股东大会、董事会、监事会和经营管理层相互分离、相互制衡的公司治理结构，各层级在各自职责、权限范围内，各司其职、各负其责，确保公司治理的规范有效。

#### （一）股东与股东大会

公司严格按照相关规定召集、召开股东大会，确保所有股东，特别是中小股东享有平等的地位，能够充分行使自己的权利。公司控股股东及实际控制人能够按照相关法律、法规及《公司章程》的规定行使其享有的权利，不存在超越股东大会直接或间接干预公司决策和经营活动的情形，没有占用公司资金，没有要求公司为其担保或为他人担保，在人员、资产、财务、机构和业务方面做到与公司明确分开。

#### （二）董事与董事会

公司董事会不断完善董事会议事规则，董事会会议的召集、召开及表决程序合法有效。公司建立了独立董事制度，董事会成员中现有三名独立董事，独立及客观地维护中小股东权益，在董事会进行决策时发挥监督制衡作用。

#### （三）监事和监事会

公司监事会不断完善监事会议事规则，监事会会议的召集、召开及表决程序合法有效。公司监事会向股东大会负责，本着对全体股东负责的精神，对公司财务以及公司董事会、高级管理人员履行职责的合法合规性进行了有效监督。

#### （四）经营管理层

公司经营管理层产生的程序符合《公司法》《公司章程》的规定，能够依照法律、法规和董事会的授权，依法合规经营，忠实勤勉，努力实现股东利益和社会效益的最大化。

#### （五）报告期内建立和完善的公司治理制度情况

报告期内，公司及时组织更新和修订了《公司章程》《股东大会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》《股东大会网络投票管理办法》，公司治理结构完善，与《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。

## 二、公司相对于控股股东、实际控制人在保证公司资产、人员、财务、机构、业务等方面的独立情况

公司与控股股东在资产、人员、财务、机构、业务等方面完全分开，具有独立完整的业务及自主经营能力。

### （一）公司资产独立完整情况

公司经营和办公场所独立，具备与经营有关的业务体系及相关资产，各种资产权属清晰、完整，不存在依赖控股股东的资产进行经营的情况；不存在资产、资金被控股股东占用而损害公司利益的情况。

### （二）公司人员独立完整情况

公司具有完善的人力资源管理体系、独立的职工薪酬制度及完整的职工培训计划，与控股股东完全分离。

公司董事、监事和高级管理人员的选聘符合《公司法》《证券法》及《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的有关规定，公司高级管理人员不存在在控股股东及其关联方任职的情形。

### （三）公司财务独立完整情况

公司按照《企业会计准则》《企业会计准则-应用指南》等规定建立了独立的财务会计核算体系，具有完善的财务管理制度体系，并且设立了独立的财务部门，配备了独立的财务会计人员，不存在财务会计人员在股东单位兼职的现象。

公司开设了独立的银行账户，办理了独立的税务登记，依法纳税，未与股东单位混合纳税。

截至2021年12月31日，公司不存在为股东单位及其他关联方提供担保的情况。

### （四）公司机构独立完整情况

公司具备完善的法人治理结构，股东大会、董事会、监事会、经营管理层职责明确，各机构严格按照《公司法》《公司章程》等规定高效运行。公司拥有独立、完善的组织架构，业务部门与职能部门，公司总部与分公司、营业部相互协调，工作有序开展。公司的办公机构和各项经营业务完全独立于股东及关联方，与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业间没有机构混同的情形。

### （五）公司业务独立完整情况

公司已获得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》，各项业务资质及经营许可文件齐备，具有独立完整的经营体系。公司业务与控股股东及其他关联方不存在同业竞争的情形，亦不受其控制与影响。

## 三、同业竞争情况

报告期内，公司控股股东除持有本公司股权外，未在中国境内或境外，直接或间接从事与公司相同或

相似并构成竞争关系的业务，亦未直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权，与公司不存在同业竞争。

公司控股股东深投控出具了《避免同业竞争及利益冲突的承诺及约束措施》，详见本报告第六节“一、承诺事项履行情况”。

#### 四、报告期内召开的年度股东大会和临时股东大会的有关情况

##### （一）本报告期股东大会情况

会议届次	会议类型	投资者参与比例	召开日期	披露日期	会议决议
2020 年度股东大会	年度	83.4253%	2021 年 4 月 26 日	2021 年 4 月 27 日	审议通过如下议案： 1. 2020 年度财务决算报告； 2. 2020 年度利润分配方案； 3. 2020 年度董事会工作报告； 4. 2020 年度监事会工作报告； 5. 2020 年年度报告及其摘要； 6. 关于 2020 年度关联交易及预计 2021 年度日常关联交易的议案； 7. 关于聘请 2021 年度审计机构及其报酬的议案； 8. 关于确定公司 2021 年度自营投资额度的议案； 9. 关于国信证券（香港）金融控股有限公司 2021 年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案； 10. 关于选举公司董事的议案。
2021 年第一次临时股东大会	临时	83.0020%	2021 年 9 月 3 日	2021 年 9 月 4 日	审议通过如下议案： 1. 关于修订公司章程及其附件的议案； 2. 关于修订公司股东大会网络投票管理办法的议案； 3. 关于选举国信证券股份有限公司第五届董事会董事的议案； 4. 关于选举国信证券股份有限公司第五届监事会股东代表监事的议案。

注：“投资者参与比例”是指出席会议的股东及股东授权委托代表所代表股份数量占公司所有表决权股份总数的比例。

##### （二）表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

不适用。

## 五、董事、监事和高级管理人员情况

### (一) 基本情况

姓名	职务	任职状态	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	期初持股数(股)	股票期权	被授予的限制性股票数量(股)	本期增持股数(股)	本期减持股数(股)	其他增减变动(股)	期末持股数(股)	股份增减变动的原因
张纳沙	董事长	现任	女	52	2021年4月26日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
邓舸	董事、总裁	现任	男	53	董事: 2020年6月15日 总裁: 2020年5月14日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
姚飞	董事	现任	男	54	2018年8月6日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
刘小腊	董事	现任	男	52	2017年10月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
李双友	董事	现任	男	53	2015年11月20日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
赵军	董事	现任	男	53	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
白涛	独立董事	现任	女	57	2016年12月23日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
郑学定	独立董事	现任	男	58	2017年12月21日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
金李	独立董事	现任	男	51	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
李保军	监事会主席	现任	男	58	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
张财广	监事	现任	男	59	2012年4月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
洪伟南	职工监事	现任	男	57	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
陈华	副总裁	现任	男	56	2017年7月10日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
谌传立	副总裁、董事会秘书	现任	男	58	副总裁: 2018年1月8日 董事会秘书: 2018年12月28日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
杜海江	副总裁	现任	男	51	2018年5月15日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
揭冠周	副总裁	现任	男	43	2021年4月26日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
成飞	副总裁	现任	男	38	2021年5月25日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
陈勇	合规总监	现任	男	57	2009年4月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-

袁超	首席营销官	现任	男	53	2021年11月23日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
曾信	首席风险官	现任	男	46	2017年7月31日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
周中国	财务负责人	现任	男	48	2018年1月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
刘汉西	首席信息官	现任	男	57	2021年11月23日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-	-	-
何如	原董事长	离任	男	58	2005年1月20日	2021年4月26日	-	-	-	-	-	-	-	-
蒋岳祥	原独立董事	离任	男	57	2014年7月11日	2021年9月3日	-	-	-	-	-	-	-	-
肖幼美	原独立董事	离任	女	67	2014年7月11日	2021年9月3日	-	-	-	-	-	-	-	-
何诚颖	原监事会主席、原职工监事	离任	男	59	2014年7月11日	2021年9月3日	-	-	-	-	-	-	-	-
冯小东	原监事	离任	男	55	2017年10月16日	2021年9月3日	-	-	-	-	-	-	-	-

### 1. 报告期是否存在任期内董事、监事离任和高级管理人员解聘的情况

报告期内，公司收到原董事长何如先生的《辞职报告及相关说明》，由于工作调整原因，何如先生申请辞去公司第四届董事会董事长、董事、董事会风险管理委员会主任委员、董事会战略委员会委员、董事会提名委员会委员以及其他在公司担任的一切职务，其辞职之后不再担任公司任何职务。

### 2. 公司董事、监事、高级管理人员变动情况

姓名	担任的职务	类型	日期	原因
张纳沙	董事长	选举	2021年4月26日	经公司2020年度股东大会审议通过，选举张纳沙女士为公司第四届董事会董事；经公司第四届董事会第三十四次会议审议通过，选举张纳沙女士担任公司第四届董事会董事长。
赵军	董事	选举	2021年9月3日	经公司2021年第一次临时股东大会审议通过，选举赵军先生为公司第五届董事会董事。
金李	独立董事	选举	2021年9月3日	经公司2021年第一次临时股东大会审议通过，选举金李先生为公司第五届董事会独立董事。
李保军	监事会主席	选举	2021年9月3日	经公司2021年第一次临时股东大会审议通过，选举李保军先生为公司第五届监事会监事；经公司第五届监事会第一次会议审议通过，选举李保军先生担任公司第五届监事会主席。
洪伟南	职工监事	选举	2021年9月3日	经公司职工代表大会审议通过，选举洪伟南先生为公司第五届监事会职工监事。
揭冠周	副总裁	聘任	2021年4月26日	经公司第四届董事会第三十四次会议审议通过，聘任揭冠周先生担任公司副总裁。
成飞	副总裁	聘任	2021年5月25日	经公司第四届董事会第三十五次会议审议通过，聘任成飞先生担任公司副总裁。
袁超	首席营销官	聘任	2021年11月23日	职务名称变更。
刘汉西	首席信息官	聘任	2021年11月23日	职务名称变更。
何如	原董事长	离任	2021年4月26日	工作调整。

蒋岳祥	原独立董事	离任	2021年9月3日	任期满离任。
肖幼美	原独立董事	离任	2021年9月3日	任期满离任。
何诚颖	原监事会主席、 原职工监事	离任	2021年9月3日	任期满离任。
冯小东	原监事	离任	2021年9月3日	任期满离任。

公司于2021年9月3日召开2021年第一次临时股东大会，选举张纳沙女士、邓舸先生、姚飞先生、刘小腊先生、李双友先生、赵军先生、白涛女士、郑学定先生、金李先生为公司第五届董事会董事；选举李保军先生、张财广先生为公司第五届监事会监事。同日召开的第五届董事会第一次会议，选举张纳沙女士担任公司第五届董事会董事长，并根据《公司章程》规定担任公司法定代表人；聘任谌传立先生担任公司董事会秘书。同日召开的第五届监事会第一次会议，选举李保军先生担任公司第五届监事会主席。

## （二）任职情况

### 1. 公司现任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历以及目前在公司的主要职责

#### （1）董事

**张纳沙女士**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1969年12月，硕士。张纳沙女士曾任深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副主任、党委委员，深圳市龙华区委常委、区政府党组副书记、副区长等职务。现任公司党委书记、董事长，兼任中国证券业协会副会长，深圳市证券业协会会长，深圳证券交易所会员理事代表、上诉复核委员会主任委员。2021年4月起任公司董事、董事长。

**邓舸先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年9月，硕士。邓舸先生曾任国务院港澳事务办公室香港政务司中英联合联络小组处副主任科员、办证处主任科员、司法协助处主任科员，中国证券监督管理委员会上市公司监管部公司治理监管处主任科员、助理调研员、政策法规处副处长、监管二处调研员、并购重组委工作处处长、中国证监会新闻发言人、上市公司监管部副主任等职务。2020年5月加入公司，现任公司董事、总裁，兼任国信期货有限责任公司董事长、中国证券业协会风险管理委员会主任委员，上海证券交易所债券发展委员会主任委员，深圳证券交易所创业板股票发行规范委员会副主任委员，深圳市证券业协会经纪业务专业委员会主任委员。2020年6月起任公司董事。

**姚飞先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1967年9月，博士，教授级经济师。姚飞先生曾任大庆石油管理局技术开发实业公司职员，大庆石油管理局经济研究所助工、经济师，大庆石油管理局经济研究所国际贸易研究室副主任、企业管理处办公室副主任、经营管理处经济研究室负责人、股权管理科负责人、科长、财务资产部经理助理、兼任资本运营室主任、投资管理部筹备组副组长、资本运营部副经理、财务资产部副经理、兼任内控体系建设委员会办公室主任，中油资产管理有限公司综合管理部经理兼财务部经理、副总经理、党委委员并兼任昆仑信托有限责任公司副总裁、海通昆仑股权投资管理（上海）有限公司董事长、黑龙江龙煤矿业集团股份有限公司监事、深圳市丝路发展基金投资管理有限公司董事长、深圳市天使投资引导基金管理有限公司董事长等职务；现任深圳市投资控股有限公司党委委员、副总经理，兼任深圳资产管理有限公司董事长、总经理、党总支书记、深圳担保集团有限公司董事、深圳市投控资本

有限公司董事长、深圳市怡亚通供应链股份有限公司董事、华润深国投信托有限公司董事、深圳投控湾区股权投资基金合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人委派代表、中国北欧投资控股有限公司董事、中国国有资本风险投资基金股份有限公司董事。2018年8月起任公司董事。

**刘小腊先生**，中国国籍，无境外居留权，出生于1970年1月，博士研究生。刘小腊先生曾任招商银行股份有限公司资金交易部总经理、资产管理部总经理兼同业金融综合管理部总经理、同业金融总部常务副总经理兼资产管理部总经理、佛山分行党委书记，珠海华润银行股份有限公司常务副行长，华润深国投信托有限公司党委副书记等职务。现任华润深国投信托有限公司党委书记、董事、总经理，兼任深圳红树林创业投资有限公司董事长。2017年10月起任公司董事。

**李双友先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年12月，大学学历，高级会计师。李双友先生曾任玉溪卷烟厂计财统计科科长，云南红塔集团有限公司计划财务科科长、副总经理、党委书记、董事；现任云南合和（集团）股份有限公司党委委员、副总经理，兼任云南红塔银行股份有限公司董事、云南白药集团股份有限公司董事、昆药集团股份有限公司副董事长、华泰保险集团股份有限公司董事、红塔创新投资股份有限公司董事长、华能澜沧江水电股份有限公司副董事长、一汽红塔云南汽车制造有限公司董事、中维资本控股股份有限公司董事、红塔证券股份有限公司董事、云南红塔特铜新材料股份有限公司董事长、云南合和印务管理有限公司董事长。2015年11月起任公司董事。

**赵军先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年12月，硕士研究生。赵军先生曾任全国社会保障基金理事会境外投资部副主任；现任全国社会保障基金理事会养老金管理部副主任。2021年9月起任公司董事。

**白涛女士**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1965年3月，博士。白涛女士曾任中信律师事务所律师、北京市通商律师事务所合伙人及律师；现任北京市君合律师事务所合伙人及律师，北京首都开发股份有限公司独立董事，博彦科技股份有限公司独立董事。2016年12月起任公司独立董事。

**郑学定先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1963年6月，硕士。郑学定先生曾任深圳市注册会计师协会秘书长，开元信德会计师事务所合伙人、大华会计师事务所深圳分所合伙人、赣州龙邦材料科技有限公司董事长。现任赣州龙邦材料科技有限公司董事，兼任国银金融租赁股份有限公司独立董事，甬兴证券有限公司独立董事。2017年12月起任公司独立董事。

**金李先生**，中国国籍，无境外永久居留权，出生于1970年12月，博士。金李先生历任复旦大学国际金融系教员，哈佛商学院金融学助理教授，哈佛商学院金融学副教授，牛津大学金融学终身教职正教授；现任北京大学经济与管理学部副主任，北京大学国家金融研究中心主任，北京大学光华管理学院金融系讲席教授，南方科技大学代理副校长，中国人民政治协商会议全国委员会委员、经济委员会委员，九三学社常委、经济委员会副主任，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司独立董事、大成基金管理有限公司独立董事，顺丰控股股份有限公司独立董事，中信百信银行股份有限公司独立董事。2021年9月起任公司独立董事。



## （2）监事

**李保军先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年1月，本科。李保军先生曾任中共深圳市纪律检查委员会副秘书长、光明新区党工委委员、纪工委书记、深圳市纪委委员等职务。2017年11月加入公司，现任深圳市纪委监委驻国信证券纪检监察组组长，公司党委委员。2021年9月起任公司监事、监事会主席。

**张财广先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1962年7月，博士、会计师。张财广先生曾任北京城建投资发展股份有限公司投资证券部经理、经理助理兼北京城建中稷实业发展有限公司常务副总裁等职务；现任北京城建投资发展股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，北京上市公司协会监事，深圳市中科招商创业投资有限公司董事，南微医学科技股份有限公司董事，二十一世纪空间技术应用股份有限公司董事，北京城建（芜湖）股权投资管理有限公司董事长，北京城建三期开发建设合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人代表，北京市中科远东创业投资有限公司董事长。2012年4月起任公司监事。

**洪伟南先生**，中国国籍，无境外永久居留权，出生于1964年9月，硕士，审计师。洪伟南先生曾任深圳国际信托投资公司深圳红岭中路证券营业部员工、证券发行科经理；深圳国投证券有限公司发行部副经理、投资银行一部总经理；国信证券投资银行总部副总经理，国信财务顾问有限公司副总经理，国信证券深圳红岭中路证券营业部发展科经理，国信证券稽核审计部高级经理、监察稽核总部高级经理、主任审计师、稽核总监、副总经理、总经理等职务。现任公司职工监事、监察稽核总部总经理，工会常委，工会经费审查委员会主任。2021年9月起任公司职工监事。

## （3）高级管理人员

**邓舸先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年9月，硕士。邓舸先生曾任国务院港澳事务办公室香港政务司中英联合联络小组处副主任科员、办证处主任科员、司法协助处主任科员，中国证券监督管理委员会上市公司监管部公司治理监管处主任科员、助理调研员、政策法规处副处长、监管二处调研员、并购重组委工作处处长、中国证监会新闻发言人、上市公司监管部副主任等职务。2020年5月加入公司，现任公司董事、总裁，兼任国信期货有限责任公司董事长、中国证券业协会风险管理委员会主任委员，上海证券交易所债券发展委员会主任委员，深圳证券交易所创业板股票发行规范委员会副主任委员，深圳市证券业协会经纪业务专业委员会主任委员。

**陈华先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1965年10月，大学本科，高级审计师。陈华先生曾任审计署驻武汉特派员办事处科员、副主任科员、主任科员、副处长，审计署外资司副处长（主持工作）、处长，审计署驻武汉特派员办事处法制处处长，深圳市审计局总审计师、党组成员，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副主任、党委委员等职务。2017年7月加入公司，现任公司副总裁。

**谌传立先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年2月，硕士，高级工程师。谌传立先生曾任深圳证监局（证管办）科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长、上市公司监管二处处长，中国证监会第六届创业板发审委委员，深圳证监局稽查二处处长等职务。2017年12月加入公司，现任公司副总裁兼董事会秘书、投资银行事业部总裁，兼任国信证券（香港）金融控股有限公司董事长、上海证券交易所第

五届上市委员会委员。

**杜海江先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1971年2月，大学本科。杜海江先生2001年3月加入公司，历任杭州萧然东路证券营业部电子商务部经理、杭州保俶路证券营业部总经理助理、浙江营销中心总经理、浙江管理总部总经理、杭州分公司总经理、浙江分公司总经理、浙江金融资产交易中心董事等职务。现任公司副总裁、经纪事业部总裁，兼任鹏华基金管理有限公司董事、中国证券业协会证券经纪业委员会副主任委员。

**揭冠周先生**，中国国籍，美国永久居留权，出生于1978年10月，博士。揭冠周先生曾任美国富国银行固定收益部执行总经理、资深证券银行家，美国美银美林全球银行及资本市场部执行总经理、资深量化金融分析师等职务。2021年4月加入公司，现任公司副总裁。

**成飞先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1983年9月，硕士。成飞先生曾任国泰君安证券固定收益证券总部助理研究员、资产管理总部研究员、投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部副总经理、总经理、公司总裁助理、公司副总裁等职务。2021年5月加入公司，现任公司副总裁兼资产管理总部总经理。

**陈勇先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年10月，博士。陈勇先生曾任君安证券有限责任公司投资发展部业务经理、法律部部门负责人，国泰君安证券股份有限公司法律事务部副总经理，联合证券有限责任公司董事会秘书等职务；2006年11月加入公司，历任法律事务部总经理、董事会办公室主任、合规管理总部总经理、首席风险官等职务；现任公司合规总监，兼任广东省律师业协会常务理事、中国证券业协会自律处分和内审委员会副主任、中国证券业协会合规管理与廉洁从业委员会秘书长、上海证券交易所复核委员会委员、深圳国际仲裁院仲裁员。

**袁超先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1969年2月，硕士。袁超先生曾任美国纽约瑞士信贷第一波士顿公司固定收益部金融衍生品风险管理经理，美国纽约巴克莱银行美元金融衍生品交易部金融衍生品交易员、美国纽约摩尔对冲基金管理公司风险管理部副总裁，美国芝加哥堡垒对冲基金管理公司风险管理部副总裁，鹏华基金管理有限公司总经理助理，人保资本投资管理有限公司党委书记、董事长、总裁等职务；2015年7月加入公司，曾任公司首席投资官、资产管理总部总经理，现任公司首席营销官，兼任国信弘盛私募基金管理有限公司董事长。

**曾信先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1975年6月，硕士。曾信先生曾任大鹏证券融资服务公司上海行业组副组长、执行副董事。2005年2月加入公司，历任投资银行事业部业务十一部副总经理、业务十二部总经理助理、内核办公室副主任、内核办公室主任兼投资银行业务内核负责人、内核总部副总经理（主持工作）、内核总部总经理等职务；现任公司首席风险官、投资银行质量控制总部总经理、投资银行业务内核负责人，兼任中国证券业协会风险管理委员会秘书长。

**周中国先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1973年12月，硕士，高级会计师，注册会计师。周中国先生曾任深圳华为技术有限公司定价中心经理助理。2000年7月加入公司，历任资金财务总部业务经理，深圳金地证券服务部财务经理，资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理，人力资源总部副总经理、人力资源总部总经理等职务。现任公司财务负责人兼资金财务总部总经理、国信资本有限责任公

公司董事长、鹏华基金管理有限公司董事、中国证券业协会财务会计委员会委员。

**刘汉西先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年10月，大学本科。刘汉西先生曾任国家经委经济信息中心系统处工程师、国家物资部中国物资信息中心数据库处主任科员。1994年6月加入公司，历任电脑部副总经理、经纪管理总部电子商务部总经理、电子商务总部副总经理、信息技术中心总经理、信息技术总部技术总监、总裁助理兼信息技术总部总经理、厦门两岸股权交易中心有限公司董事；现任公司首席信息官、系统运行总部总经理、技术管理部总经理，兼任证通股份有限公司监事、中国证券业协会信息技术专业委员会副主任委员。

## 2. 在股东单位任职情况

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务	任期期间	在股东单位是否领取报酬津贴
姚飞	深圳市投资控股有限公司	副总经理	2017年2月至今	是
刘小腊	华润深国投信托有限公司	党委书记、董事、总经理	2017年5月至今	是
李双友	云南合和（集团）股份有限公司	副总经理	2015年1月至今	是
赵军	全国社会保障基金理事会	养老金管理部副主任	2021年5月至今	是
张财广	北京城建投资发展股份有限公司	董事、副总经理、董事会秘书	2009年6月至今	是

## 3. 在其他单位任职情况

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务	任期期间	在其他单位是否领取报酬津贴
姚飞	深圳资产管理有限公司	董事长、总经理、党总支书记	2020年4月至今	否
	深圳担保集团有限公司	董事	2017年9月至今	否
	深圳市投控资本有限公司	董事长	2019年12月至今	否
	深圳市怡亚通供应链股份有限公司	董事	2018年9月至今	否
	深圳投控湾区股权投资基金合伙企业（有限合伙）	执行事务合伙人委派代表	2018年5月至今	否
	华润深国投信托有限公司	董事	2019年12月至今	否
	中国北欧投资控股有限公司	董事	2017年10月至今	否
	中国国有资本风险投资基金股份有限公司	董事	2021年9月至今	否
刘小腊	深圳红树林创业投资有限公司	董事长	2017年5月至今	否
李双友	云南红塔银行股份有限公司	董事	2006年5月至今	否
	云南白药集团股份有限公司	董事	2012年4月至今	否
	昆药集团股份有限公司	副董事长	2015年7月至今	否
	华泰保险集团股份有限公司	董事	2014年7月至今	否
	红塔创新投资股份有限公司	董事长	2009年2月至今	否
	华能澜沧江水电股份有限公司	副董事长	2018年2月至今	否
	一汽红塔云南汽车制造有限公司	董事	2016年5月至今	否
	中维资本控股股份有限公司	董事	2018年8月至今	否

	红塔证券股份有限公司	董事	2019年9月至今	否
	云南红塔特铜新材料股份有限公司	董事长	2020年9月至今	否
	云南合和印务管理有限公司	董事长	2021年12月至今	否
白涛	北京市君合律师事务所	合伙人/律师	2002年4月至今	是
	北京首都开发股份有限公司	独立董事	2016年12月至今	是
	博彦科技股份有限公司	独立董事	2017年3月至今	是
郑学定	赣州龙邦材料科技有限公司	董事	2018年8月至今	是
	国银金融租赁股份有限公司	独立董事	2016年6月至今	是
	甬兴证券有限公司	独立董事	2020年3月至今	是
金李	中国平安保险(集团)股份有限公司	独立董事	2021年8月至今	是
	大成基金管理有限公司	独立董事	2016年10月至今	是
	顺丰控股股份有限公司	独立董事	2017年1月至今	是
	中信百信银行股份有限公司	独立董事	2017年5月至今	是
张财广	深圳市中科招商创业投资有限公司	董事	2018年5月至今	否
	南微医学科技股份有限公司	董事	2018年7月至今	否
	北京城建(芜湖)股权投资管理有限公司	董事长	2018年4月至今	否
	北京城建三期开发建设合伙企业(有限合伙)	执行事务合伙人代表	2016年8月至今	否
	二十一世纪空间技术应用股份有限公司	董事	2021年4月至今	否
	北京市中科远东创业投资有限公司	董事长	2020年9月至今	否

#### 4. 公司现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员近三年证券监管机构处罚的情况

无。

### (三) 董事、监事、高级管理人员报酬情况

#### 1. 董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序、确定依据、实际支付情况

公司董事、监事、高级管理人员的薪酬根据外部相关规定及公司内部薪酬管理相关制度的有关规定执行。其中，董事、监事的薪酬由股东大会审议确定，高级管理人员薪酬由董事会审议确定。

公司董事、监事、高级管理人员薪酬标准和发放方式根据外部相关规定及公司内部薪酬管理相关制度的有关规定执行。公司董事会负责对高级管理人员进行绩效考核以及薪酬分配。公司高级管理人员薪酬事项经过薪酬与考核委员会出具书面意见后提交董事会审议，并由独立董事发表独立意见。

根据《国信证券股份有限公司董事监事薪酬与考核管理办法》，公司外部董事、监事津贴按月发放，无递延发放安排。公司内部董事、监事会主席、职工监事的薪酬，根据其在公司担任的具体职务，按照公司有关制度执行。张纳沙董事长、邓舸总裁为公司内部董事，李保军为监事会主席，洪伟南为职工监事。公司高级管理人员2021年度奖金仅进行了适度预发，尚未正式结算。公司将按照有关规定，在履行相关程序后，再行结算发放。董事、监事、高级管理人员报酬的实际支付情况详见下表。

**2. 公司报告期内董事、监事和高级管理人员报酬情况**

单位：万元

姓名	职务	性别	年龄	任职状态	从公司获得的税前报酬总额	是否在公司关联方获取报酬
张纳沙	董事长	女	52	现任	369.65	否
邓舸	董事、总裁	男	53	现任	539.52	否
姚飞	董事	男	54	现任	14.29	是
刘小腊	董事	男	52	现任	-	是
李双友	董事	男	53	现任	-	是
赵军	董事	男	53	现任	-	否
白涛	独立董事	女	57	现任	28.57	是
郑学定	独立董事	男	58	现任	28.57	是
金李	独立董事	男	51	现任	9.52	否
李保军	监事会主席	男	58	现任	141.03	否
张财广	监事	男	59	现任	-	是
洪伟南	职工监事	男	57	现任	60.19	否
陈华	副总裁	男	56	现任	451.88	否
谌传立	副总裁、董事会秘书	男	58	现任	484.23	否
杜海江	副总裁	男	51	现任	499.53	否
揭冠周	副总裁	男	43	现任	290.40	否
成飞	副总裁	男	38	现任	231.45	否
陈勇	合规总监	男	57	现任	457.55	否
袁超	首席营销官	男	53	现任	392.97	否
曾信	首席风险官	男	46	现任	456.04	否
周中国	财务负责人	男	48	现任	456.11	否
刘汉西	首席信息官	男	57	现任	452.54	否
何如	原董事长	男	58	离任	179.96	否
蒋岳祥	原独立董事	男	57	离任	21.43	否
肖幼美	原独立董事	女	67	离任	21.43	否
何诚颖	原监事会主席、原职工监事	男	59	离任	205.68	否
冯小东	原监事	男	55	离任	14.29	否
合计	-	-	-	-	5,806.83	-

注：公司高级管理人员 2021 年度奖金仅进行了适度预发，尚未正式结算。公司将按照有关规定，在履行相关程序后，再行结算发放。

**六、报告期内召开的董事会会议、监事会会议的有关情况**
**(一) 本报告期董事会情况**

会议届次	召开日期	披露日期	会议决议
第四届董事会第三十三次会议	2021 年 4 月 1 日	2021 年 4 月 2 日	审议通过如下议案： 1. 2020 年度经营工作报告；

			<ol style="list-style-type: none"> <li>2. 2020 年度财务决算报告；</li> <li>3. 2020 年度利润分配方案；</li> <li>4. 关于 2020 年度战略重点工作、风险控制情况和重大风险事项考核评价的议案；</li> <li>5. 关于确定 2021 年度战略重点工作目标的议案；</li> <li>6. 2020 年年度报告及其摘要；</li> <li>7. 2020 年度董事会工作报告；</li> <li>8. 2020 年度独立董事工作报告；</li> <li>9. 2020 年度董事履职考核和薪酬情况专项说明；</li> <li>10. 2020 年度合规报告；</li> <li>11. 2020 年度风险管理报告；</li> <li>12. 关于确定 2021 年度公司风险偏好和风险容忍度的议案；</li> <li>13. 2020 年度内部审计工作报告；</li> <li>14. 2020 年度内部控制评价报告；</li> <li>15. 重大关联交易 2020 年度专项审计工作报告；</li> <li>16. 2020 年度合规管理有效性评估报告；</li> <li>17. 2020 年度高级管理人员履职情况、绩效考核和薪酬情况专项说明；</li> <li>18. 2020 年度合规总监考核报告；</li> <li>19. 关于 2020 年度关联交易及预计 2021 年度日常关联交易的议案；</li> <li>20. 关于聘请 2021 年度审计机构及其报酬的议案；</li> <li>21. 2020 年度流动性风险管理报告；</li> <li>22. 2020 年度廉洁从业工作报告；</li> <li>23. 2020 年度社会责任报告；</li> <li>24. 关于公司 2020 年度募集资金存放与使用情况的专项报告的议案；</li> <li>25. 关于向商业银行申请 2021 年度综合授信额度的议案；</li> <li>26. 关于公司 2020 年信息技术建设与管理绩效总结报告与 2021 年工作计划的议案；</li> <li>27. 关于国信香港 2021 年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案；</li> <li>28. 关于国信香港向国信证券（香港）经纪有限公司增资 2 亿港元的议案；</li> <li>29. 关于提名公司董事候选人的议案；</li> <li>30. 关于向鹏华基金管理有限公司推荐董事、监事候选人的议案；</li> <li>31. 关于审议《公司治理自查报告及整改计划》的议案；</li> <li>32. 关于提议召开 2020 年度股东大会的议案。</li> </ol> <p>此外，董事会审阅了如下议题：2021 年度财务预算方案，2020 年度董事会审计委员会履职情况报告，2020 年度内部控制审计报告，2020 年度反洗钱工作报告，上市公司治理专项自查清单答复稿，国信证券关于发布证券研究报告相关问题整改的报告；集体学习了 2020 年监管新规动态。</p>
第四届董事会第三十四次会议	2021 年 4 月 26 日	2021 年 4 月 27 日	<p>审议通过如下议案：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 关于选举董事长并任命公司法定代表人的议案；</li> <li>2. 关于调整公司第四届董事会专门委员会成员的议案；</li> <li>3. 关于聘任公司副总裁的议案；</li> <li>4. 2021 年第一季度报告；</li> <li>5. 2021 年第一季度风险管理报告；</li> <li>6. 2021 年第一季度流动性风险管理报告；</li> <li>7. 2021 年第一季度内部审计工作报告。</li> </ol> <p>此外，董事会审阅了 2021 年第一季度董事会审计委员会履职情况报告及关于华泽钴镍股民索赔诉讼案二审判决情况的报告。</p>

第四届董事会第三十五次会议	2021 年 5 月 25 日	2021 年 5 月 26 日	审议通过如下议案： 1. 关于向证通股份有限公司推荐监事人选的议案； 2. 关于向国信资本有限责任公司委派监事的议案； 3. 关于聘任公司副总裁的议案。
第四届董事会第三十六次会议	2021 年 8 月 16 日	2021 年 8 月 17 日	审议通过如下议案： 1. 关于修订公司章程及其附件的议案； 2. 关于修订公司股东大会网络投票管理办法的议案； 3. 关于提名第五届董事会董事候选人的议案； 4. 关于提议召开 2021 年第一次临时股东大会的议案。
第四届董事会第三十七次会议	2021 年 8 月 23 日	2021 年 8 月 24 日	审议通过如下议案： 1. 国信证券 2021 年半年度经营工作报告； 2. 关于审议公司 2021 年半年度报告及其摘要的议案； 3. 关于审议公司 2021 年半年度合规报告的议案； 4. 关于审议公司 2021 年半年度风险管理报告的议案； 5. 关于审议公司 2021 年半年度流动性风险管理报告的议案； 6. 关于审议公司 2021 年半年度内部审计工作报告的议案； 7. 董事会审计委员会 2021 年度半年度履职情况报告； 8. 关于审议公司 2021 年上半年募集资金存放与使用情况专项报告的议案； 9. 关于非公开发行 A 股股票募投项目实施完毕并将节余募集资金永久补充流动资金的议案； 10. 关于公司东莞数据中心 Block1 模块机房设备更新替换立项的议案。 此外，审阅了公司 2021 年半年度反洗钱工作报告，集体学习了 2021 年上半年监管新规动态。
第五届董事会第一次会议	2021 年 9 月 3 日	2021 年 9 月 4 日	审议通过如下议案： 1. 关于选举董事长并任命公司法定代表人的议案； 2. 关于公司第五届董事会专门委员会组建方案的议案； 3. 关于聘任公司董事会秘书的议案； 4. 关于聘任公司证券事务代表的议案。
第五届董事会第二次会议	2021 年 10 月 29 日	2021 年 10 月 30 日	审议通过如下议案： 1. 2021 年第三季度报告； 2. 2021 年第三季度风险管理报告； 3. 2021 年第三季度流动性风险管理报告； 4. 2021 年第三季度内部审计工作报告； 5. 关于授权总裁办公会办理分支机构新设和撤销有关事宜的议案。 此外，听取了 2021 年前三季度经营工作报告，董事会审计委员会 2021 年第三季度履职情况报告，2020 年度投资后评价工作报告。
第五届董事会第三次会议	2021 年 11 月 23 日	2021 年 11 月 24 日	审议通过如下议案： 1. 关于审议《国信证券股份有限公司全面推行经理层成员任期制和契约化管理工作方案》的议案； 2. 关于修订《国信证券股份有限公司经理层成员岗位聘任协议》的议案； 3. 关于聘任公司总裁和合规总监的议案； 4. 关于聘任公司副总裁和其他高级管理人员的议案； 5. 关于聘任公司内部审计部门负责人的议案； 6. 关于向国信证券（香港）金融控股有限公司推荐行政总裁人选的议案； 7. 关于向国信弘盛私募基金管理有限公司委派董事的议案； 8. 关于设立战略发展总部的议案； 9. 关于信息技术条线组织架构调整的议案；

			10. 关于审议《国信弘盛私募基金管理有限公司自有资金直接投资项目规范整改方案》的议案。
第五届董事会第四次会议	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 3 日	审议通过如下议案： 1. 关于公司 2021 年度有关薪酬事项的议案； 2. 关于审议《国信证券股份有限公司副总经理薪酬确认书》的议案； 3. 关于审议公司《洗钱和恐怖融资风险管理制度》（2021 年修订稿）的议案。 此外，审阅了洗钱和恐怖融资风险自评估报告，关于非公开发行保荐机构中国银河证券 2021 年度督导培训的议案。

## （二）董事出席董事会及股东大会的情况

董事出席董事会及股东大会的情况							
董事姓名	本报告期应参加董事会次数	现场出席董事会次数	以通讯方式参加董事会次数	委托出席董事会次数	缺席董事会次数	是否连续两次未亲自参加董事会会议	出席股东大会次数
张纳沙	8	8	-	-	-	否	1
邓舸	9	8	1	-	-	否	2
姚飞	9	1	8	-	-	否	2
刘小腊	9	2	7	-	-	否	2
李双友	9	2	7	-	-	否	2
赵军	4	-	4	-	-	否	-
白涛	9	1	8	-	-	否	2
郑学定	9	4	5	-	-	否	2
金李	4	1	3	-	-	否	-
何如	1	1	-	-	-	否	1
肖幼美	5	5	-	-	-	否	2
蒋岳祥	5	1	4	-	-	否	2

报告期内，不存在董事连续两次未亲自出席董事会的情况。

## （三）董事对公司有关事项提出异议的情况

报告期内，董事对公司有关事项未提出异议。

## （四）董事履行职责的其他说明

### 1. 董事对公司有关建议是否被采纳

报告期内，董事对公司有关建议已被采纳。

### 2. 董事对公司有关建议被采纳或未被采纳的说明

经第四届董事会审计委员会 2021 年第四次会议审议通过的《国信证券股份有限公司 2021 年半年度内部审计工作报告》，采纳董事提出的重要意见和建议，以列表形式反映相关问题。



**七、董事会下设专门委员会在报告期内的情况**

委员会名称	成员情况	召开会议次数	召开日期	会议内容	提出的重要意见和建议	其他履行职责的情况	异议事项具体情况(如有)
审计委员会	肖幼美、姚飞、郑学定	第四届董事会审计委员会 2021 年第一次会议	2021 年 2 月 3 日	审议通过如下议案： 1. 2020 年度内部审计工作报告； 2. 2021 年度内部审计工作计划。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。建议加强内外审协作，提高审计工作效能；内部审计工作要重点关注风险大、问题多的领域，以及复杂、创新性的、监管重点关注的或者涉及政策转变的领域；建议内部审计工作报告以列表形式反馈问题，提升审计工作智能化水平。	听取关于 2020 年度外部审计工作方案的汇报。	无
	肖幼美、姚飞、郑学定	第四届董事会审计委员会 2021 年第二次会议	2021 年 3 月 18 日	审议通过如下议案： 1. 2020 年度财务报告（经审计）； 2. 2020 年度财务决算报告； 3. 2020 年度利润分配方案； 4. 2021 年度财务预算方案； 5. 关于聘请 2021 年度审计机构及其报酬的议案； 6. 关于 2020 年度关联交易及预计 2021 年度日常关联交易的议案； 7. 公司重大关联交易 2020 年度专项审计报告； 8. 2020 年度内部控制评价报告； 9. 2020 年度募集资金存放及使用情况检查报告； 10. 2020 年度募集资金存放与使用情况的专项报告； 11. 天健会计师事务所 2020 年度审计工作总结； 12. 2020 年度内部控制审计报告； 13. 2020 年年度报告； 14. 2020 年度董事会审计委员会履职情况报告。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取天健会计师事务所 2020 年度审计工作情况总结。	无
	肖幼美、姚飞、郑学定	第四届董事会审计委员会 2021 年第三次会议	2021 年 4 月 19 日	审议通过如下议案： 1. 2021 年第一季度报告； 2. 2021 年第一季度内部审计工作报告； 3. 2021 年第一季度募集资金存放及使用情况检查报告；	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无

				4. 2021 年第一季度董事会审计委员会履职情况报告。			
	肖幼美、姚飞、郑学定	第四届董事会审计委员会 2021 年第四次次会议	2021 年 8 月 10 日	审议通过如下议案： 1. 2021 年半年度报告及其摘要（含财务报告）； 2. 2021 年半年度内部审计工作报告； 3. 2021 年半年度董事会审计委员会履职情况报告； 4. 2021 年第二季度募集资金存放及使用情况检查报告； 5. 2021 年上半年募集资金存放与使用情况的专项报告。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取天健会计师事务所 2021 年半年度审阅工作总结。	无
	郑学定、姚飞、赵军、白涛、金李	第五届董事会审计委员会 2021 年第一次会议	2021 年 10 月 25 日	审议通过如下议案： 1. 2021 年第三季度报告； 2. 2021 年第三季度内部审计工作报告； 3. 2021 年第三季度募集资金存放及使用情况检查报告的议案； 4. 董事会审计委员会 2021 年第三季度履职情况报告。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无
风险管理委员会	何如、姚飞、刘小腊、郑学定	第四届董事会风险管理委员会 2021 年第一次会议	2021 年 4 月 1 日	审议通过如下议案： 1. 2020 年度合规报告； 2. 2020 年度合规管理有效性评估报告； 3. 2020 年度风险管理报告； 4. 2020 年度流动性风险管理报告； 5. 2020 年度廉洁从业工作报告。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取公司 2020 年度反洗钱工作报告。	无
	何如、姚飞、刘小腊、郑学定	第四届董事会风险管理委员会 2021 年第二次会议	2021 年 4 月 26 日	审议通过如下议案： 1. 2021 年第一季度风险管理报告； 2. 2021 年第一季度流动性风险管理报告。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取关于华泽钴镍股民索赔二审判决情况的报告。	无
	邓舸、姚飞、刘小腊、郑学定	第四届董事会风险管理委员会 2021 年第三次会议	2021 年 4 月 26 日	审议通过如下议案： 关于选举风险管理委员会主任委员的议案。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无
	邓舸、姚飞、刘小腊、郑学定	第四届董事会风险管理委员会 2021 年第四次会议	2021 年 8 月 23 日	审议通过如下议案： 1. 关于审议公司 2021 年半年度合规报告的议案； 2. 关于审议公司 2021 年半年度风险管理报告的议案； 3. 关于审议公司 2021 年半年度流动性风险管理报告的议案。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取公司 2021 年半年度反洗钱工作报告的议案。	无
	邓舸、姚飞、刘小腊、	第五届董事会风险管理委员会 2021 年第一	2021 年 10 月 29 日	审议通过如下议案： 1. 2021 年第三季度风险管理报告；	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意	无	无

	郑学定	次会议		2. 2021 年第三季度流动性风险管理报告。	见和建议。		
提名委员会	白涛、何如、肖幼美	第四届董事会提名委员会 2021 年第一次会议	2021 年 3 月 26 日	审议通过如下议案： 关于提名公司董事候选人的议案。	提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查董事候选人资格条件并提出建议。	无
	白涛、何如、肖幼美	第四届董事会提名委员会 2021 年第二次会议	2021 年 4 月 21 日	审议通过如下议案： 关于提名公司副总裁的议案。	提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查高级管理人员候选人资格条件并提出建议。	无
	白涛、张纳沙、肖幼美	第四届董事会提名委员会 2021 年第三次会议	2021 年 4 月 21 日	审议通过如下议案： 关于提名公司副总裁的议案。	提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查高级管理人员候选人资格条件并提出建议。	无
	白涛、张纳沙、肖幼美	第四届董事会提名委员会 2021 年第四次会议	2021 年 8 月 9 日	审议通过如下议案： 关于第五届董事会董事候选人资格审查的议案。	提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查董事候选人资格条件并提出建议。	无
	金李、张纳沙、郑学定	第五届董事会提名委员会 2021 年第一次会议	2021 年 9 月 3 日	审议通过如下议案： 关于提名公司董事会秘书的议案。	提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查高级管理人员候选人资格条件并提出建议。	无
	金李、张纳沙、郑学定	第五届董事会提名委员会 2021 年第二次会议	2021 年 11 月 18 日	审议通过如下议案： 关于公司高级管理人员候选人资格审查的议案。	提名委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查高级管理人员候选人资格条件并提出建议。	无
薪酬与考核委员会	郑学定、肖幼美、蒋岳祥	第四届董事会薪酬与考核委员会 2021 年第一次会议	2021 年 3 月 18 日	审议通过如下议案： 1. 2020 年度高级管理人员履职情况报告； 2. 2020 年度高级管理人员履职考核和薪酬情况专项说明； 3. 2020 年度合规总监考核报告； 4. 关于 2020 年度战略重点工作、风险控制情况和重大风险事项考核评价的议案； 5. 关于确定 2021 年度战略重点工作目标的议案； 6. 2020 年度独立董事工作报告； 7. 2020 年度董事履职考核和薪酬情况专项说明。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查董事、高级管理人员的履职履行情况，并对其进行年度绩效考核。	无
	白涛、郑学定、金李	第五届董事会薪酬与考核委员会 2021 年第一次会议	2021 年 11 月 18 日	审议通过如下议案： 1. 关于审议《国信证券股份有限公司全面推行经理层成员任期制和契约化管理工作方案》的议案； 2. 关于修订《国信证券股份有限公司经理层成员岗位聘任	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。建议经营班子任期履职报告对上一任期的经	审查公司经理层成员任期制和契约化管理方案。	无

				协议》的议案； 3. 国信证券经营班子任期履职情况报告。	验进行提炼总结。		
白涛、 郑学定、 金李	第五届董事会 薪酬与考核委员会 2021 年第二次会议	2021 年 12 月 28 日		审议通过如下议案： 1. 关于公司 2021 年度有关薪酬事项的议案； 2. 关于审议《国信证券股份有限公司副总经理薪酬确认书》的议案。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查公司 2021 年度薪酬方案。	无
白涛、 郑学定、 金李	第五届董事会 薪酬与考核委员会 2021 年第三次会议	2021 年 12 月 31 日		审议通过如下议案： 关于公司 2021 年度高级管理人员有关薪酬事项的议案。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查公司高级管理人员 2021 年度薪酬事项。	无

## 八、监事会工作情况

报告期内，监事会对监督事项无异议。

## 九、公司员工情况

### （一）员工数量、专业构成及教育程度

单位：人

母公司在职员工的数量	11,394
子公司在职员工的数量	609
在职员工的数量合计	12,003
当期领取薪酬员工总人数	12,003
母公司及子公司需承担费用的离退休职工人数	-
<b>专业构成</b>	
<b>类别</b>	<b>人数</b>
经纪业务	9,453
投资银行	1,001
资产管理	165
投资与交易	180
研究	134
资金财务	138
信息技术	479
法律、合规、风控、稽核	241
其他	212
合计	12,003
<b>教育程度</b>	
<b>类别</b>	<b>人数</b>
博士	72
硕士	3,012
本科	8,092

大专及以下	827
合计	12,003

注：上述员工情况包含公司内退人员 6 人，公司无额外需要承担费用的离退休员工。

## （二）薪酬政策

公司严格遵守《劳动法》《劳动合同法》等法律法规，建立了完善的人力资源管理制度和流程，规范用工，切实保护员工的权益。

公司遵循市场化原则，坚持激励与约束并重的薪酬理念，建立具备市场竞争力的薪酬机制。

## （三）培训计划

公司坚持以打造学习型组织为总体目标，根据公司业务发展和选人用人工作实际，不断完善多层次、复合型人才培养体系。以“发展组织能力”为主轴，组织国信大讲堂、扬帆计划、外派培训、互学E线上平台等多种培训学习模式，持续打造具有国信特色的全程培养体系，切实全面提升员工的综合素质和业务能力，为公司实现战略发展目标持续提供务实有效的人才培养支持。

2021年，公司创新推出4期“国信大讲堂--高管课堂”专题学习活动，由公司高管进行主题授课，发挥领导带头作用，进一步深化各级管理人员对公司“十四五”发展战略的理解和把握；公司坚持以“线上+线下”混合式培训模式，组织开展3期“扬帆计划”，助力新员工快速融入公司、认同文化，提高职业素质和职业技能，提升企业认同感和归属感；认真选派管理人员及骨干员工参加上级主管部门、监管部门等机构举办的学习活动61场，全面提升各项工作能力和水平。公司持续深化“互学E”线上学习平台应用，不断完善内部知识管理体系，强化组织学习氛围，着力为全体员工的持续成长发展提供丰富的学习资源和基础保障。

## （四）劳务外包情况

公司不存在劳务外包数量较大的情况。

## 十、委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况

报告期内，公司仅与1名证券经纪人保留代理关系，并按照正式员工标准进行管理，但该经纪人已于2021年5月13与我司取消代理关系。截至报告期末，公司已无证券经纪人。

## 十一、公司利润分配及资本公积金转增股本情况

### （一）报告期内利润分配政策，特别是现金分红政策的制定、执行或调整情况

#### 1. 公司股利分配的原则

公司重视对投资者的合理投资回报，保护投资者合法权益，制定持续、稳定、科学的利润分配政策，其中，在制定现金分红政策时，公司将结合所处行业特点、发展阶段和自身经营模式、盈利水平、资金需

求等因素，选择有利于投资者分享公司成长和发展结果、取得合理投资回报的现金分红政策。

## 2. 公司股利分配政策的具体内容和条件

公司实行同股同利的股利分配政策。公司可以采取现金、股票、或者现金和股票相结合的方式分配股利，但应优先采用现金分红的利润分配方式。公司应保持利润分配政策的连续性和稳定性，在具备现金分红条件的情况下，公司将积极采取现金分红政策。在具备利润分配的条件下，公司原则上每年度进行一次利润分配。经董事会和股东大会审议决定，公司可以进行中期利润分配。公司进行现金分红应同时具备以下条件：（1）公司该年度实现的可供现金分配的利润为正值且累计未分配利润为正值；（2）未来十二个月内公司无重大投资计划或重大现金支出等特殊状况发生；（3）公司现金分红方案实施后公司各项风险控制指标符合监管部门规定。在具备上述现金分红条件的情况下，公司每年以现金方式分配的利润不少于当年实现的可供现金分配利润的百分之二十，且在任何三个连续年度内以现金方式累计分配的利润不少于该三年实现的年均可分配利润的百分之三十。若现金充裕，经董事会和股东大会审议决定，公司可根据实际情况提高现金分红比例。公司可根据需要采取股票股利的方式进行利润分配。公司采取股票方式分配股利的条件为：（1）公司经营情况良好；（2）因公司股票价格与公司股本规模不匹配或者公司有重大投资计划或重大现金支出、公司具有成长性、每股净资产的摊薄等真实合理因素，以股票方式分配股利有利于公司和股东整体利益；（3）公司的现金分红符合有关法律法规及《公司章程》的规定。

现金分红政策的专项说明	
是否符合公司章程的规定或股东大会决议的要求：	是
分红标准和比例是否明确和清晰：	是
相关的决策程序和机制是否完备：	是
独立董事是否履职尽责并发挥了应有的作用：	是
中小股东是否有充分表达意见和诉求的机会，其合法权益是否得到了充分保护：	是
现金分红政策进行调整或变更的，条件及程序是否合规、透明：	是

### 1. 公司报告期内盈利且母公司可供股东分配利润为正但未提出现金红利分配预案

不适用。

### 2. 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

每 10 股送红股数（股）	-
每 10 股派息数（元）（含税）	5.00
每 10 股转增数（股）	-
分配预案的股本基数（股）	9,612,429,377
现金分红金额（元）（含税）	4,806,214,688.50
以其他方式（如回购股份）现金分红金额（元）	-
现金分红总额（含其他方式）（元）	4,806,214,688.50
可分配利润（元）	23,774,461,305.23
现金分红总额（含其他方式）占利润分配总额的比例	100%
<b>本次现金分红情况</b>	

以 2021 年末总股本 9,612,429,377 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 5.00 元（含税），共派送现金红利 4,806,214,688.50 元，尚未分配的利润 20,179,449,668.99 元转入下一年度。

#### 利润分配或资本公积金转增预案的详细情况说明

经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，母公司 2021 年度实现净利润 8,680,095,658.47 元。根据《公司法》《证券法》《金融企业财务规则》及《公司章程》等有关规定，分别提取 10% 的一般风险准备金、10% 的交易风险准备金共计 1,736,019,131.70 元；计提永续次级债券利息 911,500,000.00 元；根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，按照公募基金托管费收入的 2.5% 提取一般风险准备金 229,059.13 元；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，按不低于大集合资产管理业务管理费收入的 10% 计提一般风险准备金 14,524,920.56 元。进行上述利润分配事项后，本年度实现可供投资者分配的利润为 6,017,822,547.08 元。

加上年初未分配利润 21,809,406,974.74 元，减去 2021 年度指定的非交易性权益工具处置转出未分配利润 630,706,407.62 元，减去公司 2021 年已实施的 2020 年度利润分配方案分配的股利 2,210,858,756.71 元，年末累计可供投资者分配的利润 24,985,664,357.49 元。根据相关规定，可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得向股东进行现金分配，年末累计可供分配利润中公允价值变动损益（税后）为 1,211,203,052.26 元，因此，公司 2021 年末可供投资者现金分红部分为 23,774,461,305.23 元。

从公司发展和股东利益等综合因素考虑，公司 2021 年度利润分配方案如下：以 2021 年末总股本 9,612,429,377 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 5.00 元（含税），共派送现金红利 4,806,214,688.50 元，尚未分配的利润 20,179,449,668.99 元转入下一年度。

## 十二、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

报告期内，公司无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

## 十三、报告期内的内部控制制度建设及实施情况

### （一）内部控制建设及实施情况

报告期内，公司根据《公司法》《证券法》《企业内部控制基本规范》及其应用指引、《证券公司内部控制指引》等法律、法规及规章制度，持续推进内部控制制度和体系的建设和完善，涵盖业务开展的事前、事中、事后等过程，在公司治理、业务经营、财务会计、信息披露、关联交易、重大投资、募集资金使用、对外担保等方面形成完善的内控机制，并保持持续有效运行。

公司内部控制与经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，关注重点领域和关键环节，合理保证制度设计的健全及执行的有效性，同时，针对存在问题及时完善和改进控制策略与管理措施，保障经营活动的合法合规及风险可控，客户资产及自有资产的安全，财务报告及相关信息的真实、完整及准确。

公司内控工作体系主要由公司风险管理总部、合规管理总部、投资银行质量控制总部、监察稽核总部、法律事务部等部门，以及公司业务部门、管理部门、经纪业务分支机构、子公司的合规风险管理组织及其履职人员所组成。公司内部控制部门及业务管理部门按照有效制衡、协同配合的原则，对业务开展发挥监督、保障等作用。

公司全面落实信息隔离墙制度，对存在冲突的相关业务部门按规定保持独立运作。

公司开展新业务时，依照法律法规和监管要求，全面评估风险，完善管理制度，优化操作流程，确保主要风险保持可控、可测、可承受。公司各项业务在合规运营的前提下持续、稳定、健康地发展。

报告期内，公司内部控制体系在完整性、合规性、有效性等方面不存在重大缺陷。

## （二）报告期内发现的内部控制重大缺陷的具体情况

无。

## 十四、公司报告期内对子公司的管理控制情况

公司已建立完备的子公司管理制度，包括《国信证券股份有限公司子公司管理办法》《国信证券股份有限公司子公司合规管理工作指引》《国信证券股份有限公司子公司风险管理工作指引》《国信证券股份有限公司子公司财务管理办法》《国信证券股份有限公司内部审计制度》，将子公司管理纳入公司统一财务管理和内部审计体系以及统一合规、风险管理体系，从合规、风控、财务、审计等方面对子公司进行有效管控。

报告期内，公司不存在新增子公司的情况。

## 十五、内部控制自我评价报告或内部控制审计报告

### （一）内控自我评价报告

内部控制评价报告全文披露日期	2022 年 4 月 19 日	
内部控制评价报告全文披露索引	详见 2022 年 4 月 19 日刊登于深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> ) 的《2021 年度内部控制评价报告》	
纳入评价范围单位资产总额占公司合并财务报表资产总额的比例	100%	
纳入评价范围单位营业收入占公司合并财务报表营业收入的比例	100%	
<b>缺陷认定标准</b>		
<b>类别</b>	<b>财务报告</b>	<b>非财务报告</b>
定性标准	1. 重大缺陷 A. 董事、监事和高级管理人员的舞弊行为； B. 注册会计师已发现，未被内部控制所识别的当期财务报告的严重错报； C. 对财务报告的内部监督为无效。 2. 重要缺陷 A. 没有依照公认会计准则选择和应用会计政策； B. 没有建立和执行反舞弊机制，导致或者未能及时发现关键岗位的舞弊行为； C. 对期末财务报告的内部控制存在缺陷，不能合理保证财务报表的真实、完整。 3. 一般缺陷 未构成重大缺陷、重要缺陷的其他控制缺陷。	1. 重大缺陷 A. 业务经营和内部管理违反法律法规，并且造成严重后果； B. 中高层管理人员流失严重； C. 内部控制系统性地严重失效； D. 重要的分公司、子公司缺乏内部控制建设，管理散乱； E. 在内部控制过程中发现的重大或者重要缺陷没有获得整改； F. 对信息披露的内部控制严重失效，导致被监管部门予以严重处罚。 2. 重要缺陷 A. 关键岗位或者关键技能人员流失严重； B. 主要业务存在严重的制度缺陷和执行偏差。 3. 一般缺陷 未构成重大缺陷、重要缺陷的其他控制缺陷。
定量标准	1. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过税前利润的 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现	1. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过税前利润的 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现



	利润波动趋势下行时，为超过营业收入的 2%)，并且反映为严重偏离公司内部控制目标的，则为重大缺陷； 2. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过税前利润的 3%但小于 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入 1%但小于 2%），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的，则为重要缺陷； 3. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果小于税前利润的 3%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为小于营业收入的 1%），则为一般缺陷。	利润波动趋势下行时，为超过营业收入的 2%)，并且反映为严重偏离公司内部控制目标的，则为重大缺陷； 2. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过税前利润的 3%但小于 5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入 1%但小于 2%），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的，则为重要缺陷； 3. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果小于税前利润的 3%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为小于营业收入的 1%），则为一般缺陷。
财务报告重大缺陷数量（个）	无	
非财务报告重大缺陷数量（个）	无	
财务报告重要缺陷数量（个）	无	
非财务报告重要缺陷数量（个）	无	

## （二）内部控制审计报告

内部控制审计报告中的审议意见段	
国信证券于 2021 年 12 月 31 日按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。	
内控审计报告披露情况	披露
内部控制审计报告全文披露日期	2022 年 4 月 19 日
内部控制审计报告全文披露索引	详见 2022 年 4 月 19 日刊登于深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> ) 的内部控制审计报告（天健审[2022]7-187 号）
内控审计报告意见类型	标准无保留意见
非财务报告是否存在重大缺陷	否

会计师事务所未出具非标准意见的内部控制审计报告，出具的内部控制审计报告与董事会的内部控制自我评价报告意见一致。

## 十六、动态风险控制指标监控和补足机制建立情况

### （一）公司动态的风险控制指标监控机制建立情况

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常实时监控与分析，及时向监管部门报告风险指标变动及超预警、超标情况；按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等；将新开展业务及时纳入风控系统；对实时监控系统的有效性、准确性进行校对及维护。

### （二）风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

公司每年于年初就未来一年业务状况对母公司和集团进行综合性的压力测试，考察风险控制指标承压情况。另外，为做好事前业务规模风险控制，保证公司净资本和流动性风险控制指标任一时点均在安全标准之内，公司设定涵盖多项业务及投资决策的压力测试情景库，并根据风控指标和公司业务状况每半年更

新一次。2021年公司共开展了一次集团年度综合压力测试、一次母公司年度综合压力测试及数次专项压力测试。压力测试结果显示公司各项风控指标在压力情景下处于安全范围内，整体风险可承受。

### （三）资本补足机制

公司正积极按照制定的资本补足规划，有计划地推动公司各类债券发行，积极研究创新债务融资工具，丰富融资方式，以支持业务创新发展并确保净资本等各项风险控制指标持续符合监管要求。

### （四）报告期内风险控制指标达标情况

2021年，公司以净资本和流动性为核心的风险控制指标整体运行良好。报告期末，母公司净资产为943.29亿元，较上年末增加147.73亿元；净资本为759.68亿元，较上年末增加130.45亿元；各项风险资本准备之和为173.47亿元，较上年末减少33.85亿元。风险覆盖率为437.92%，较上年末增加134.42个百分点；资本杠杆率为19.66%，较上年末减少3.13个百分点；流动性覆盖率为318.25%，较上年末增加20.14个百分点；净稳定资金率为178.53%，较上年末增加12.19个百分点。公司各项风险控制指标均符合监管要求。

## 十七、风险管理情况

### （一）全面风险管理概况

报告期内，公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》和《证券公司全面风险管理规范》等监管文件要求，不断提升风险管理工作的专业性，加大合规风控体系建设投入，持续完善全面风险管理工作。在风险计量方面，引入“经济资本”有效计量和评估公司总体风险水平。在限额管理方面，从业务层级精细到投资策略层级，增加压力测试限额防范极端风险。在内部评级方面，采取优化内部评级模型、负面清单管理和授信管理等措施，为公司和客户避免了投资损失。公司定期开展各项风险排查和专项检查，独立研判重大风险；推进风险管理系统建设、数据治理和信息技术风险管理；子公司风险垂直管理不断深入，持续完善并表管理内规制度体系，公司层面制定发布了《子公司风险管理工作指引》《子公司风险管理负责人管理办法》，并向各子公司派出风险管理负责人及监事等，整体达到并表监管各项要求。公司注重培育风险管理文化，不断加大风险管理人财物投入，持续扩大风险管理专业队伍。

#### 1. 风险管理组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

##### （1）董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

##### （2）经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

### （3）独立的风险管理机构

公司风险管理总部、合规管理总部、监察稽核总部等部门作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的全面风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，起草公司整体的风险偏好和容忍度方案，合理配置风险限额。对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行检查和考评。资金运营部、信息技术部门、党群办公室分别牵头开展流动性风险管理、信息技术风险管理、声誉风险管理工作。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对内部控制制度的完整性、合理性及其实施的有效性进行检查和评估。

### （4）业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

## 2. 风险管理机制

### （1）全方位的风险管理机制

为推动公司风险管理体系的有效运作，确保公司各项业务经营活动在合规运作及风险可测、可控、可承受的前提下开展，公司制定并实施了涵盖各项业务运营和管理的一整套规章制度，明确了风险管理的目标、原则、组织构架、授权体系、相关职责、基本程序等，并通过事前审核、事中监控、事后检查的一系列执行机制，实现了对公司各项业务的合法性、合规性、风险程度的全方位和系统化的监控、预警、报告和处理。

### （2）风险管理量化指标体系建设

公司自上而下建立了风险偏好、风险容忍度和风险限额的风险管理量化指标体系。公司董事会负责审批公司风险偏好和风险容忍度（含重大风险限额）。根据董事会确定的风险容忍度，公司建立覆盖“集团-部门及子公司-业务-投资策略”的多层次的风险限额体系，引导资源向风险收益比高的业务配置，有效提升公司风险管理水平和企业价值。

### （3）压力测试机制

根据《证券公司压力测试指引》，公司制订了《压力测试管理办法》和《压力测试情景库》，明确压力测试触发情景的定性定量标准、压力测试频率、压力测试方案确定、压力测试数据收集方法、压力测试结果分析与反馈、压力测试相关资料的保存与管理均进行了规范，通过建立常规化的压力测试机制有效评估压力情况下公司风险控制指标、各类型风险限额指标的状况。

#### （4）专业人才

公司风险管理总部、各业务部门配备了熟悉证券业务与风险管理技能的专业人员，并提供相应的资源支持。积极引进风险管理高层次人才，不断提升团队专业化水平。

#### （5）系统建设

公司十分重视风险管理系统建设，持续推进各类风险管理信息系统的开发和升级工作，建立并完善与业务复杂程度及风险指标体系相适应的风险管理信息系统，逐步实现对各类风险的准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。报告期内，公司完成了客户风险信息管理平台、市场风险管理系统四期、信用风险管理系统四期建设，推进风险数据库建设以及风险数据治理，开展信息技术风险管理、业务连续性体系建设和交易运维管理等。公司将继续加强底层系统建设和集团层面数据治理工作，进一步贯彻和落实全面风险管理以及并表监管的要求。

### 3. 风险管理指标体系

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常实时监控与分析，并按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等。

公司积极开展并表监管试点申报工作，建立并表口径下的风险控制指标管理体系，进一步提升集团公司层面风险管理能力。

#### （二）公司面临的风险因素及对策

##### 1. 市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益投资业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司在已构建的四级风险管理架构下，制定了市场风险管理的具体流程，涵盖公司董事会、资产负债委员会、风险控制委员会、风险管理总部及各业务部门，各组织分工明确，各负其责。

公司根据董事会每年审议通过的整体市场风险限额，综合考虑各业务的风险收益特征和相关性等因素，将风险限额细化并分配至各业务部门及相关策略。风险限额主要包括投资规模、损失比例、风险价值(VaR)、

压力测试限额等指标。风险管理总部通过市场风险管理系统等专业的风险管理工具和方法对风险限额进行每日监控，当指标达到预警限额时，风险管理总部对触发预警限额部门进行预警提示，并要求其在规定时间内进行反馈，说明触发预警限额原因和后续的调整计划；当指标突破风险限额时，风险管理总部对超限部门进行提示，要求超限部门在规定时间内进行反馈，说明超限原因和后续调整计划，并要求超限部门在反馈期间原则上不能继续增加风险敞口。风险管理总部会持续监督业务部门风险应对措施落实情况，并与业务部门沟通讨论风险信息 and 可能出现的极端压力情景。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，在已有限额指标的基础上，根据各业务的特点，新增部分既满足业务发展又能有效控制风险暴露程度的限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和VaR限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母限额并进行日常监控。另外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过VaR等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

## 2. 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

- (1) 具有债权性质的债券等投资交易业务；
- (2) 融资融券、约定购回和股票质押式回购等资本中介业务；
- (3) 场外衍生品业务；
- (4) 存放银行的活期存款及定期存款；
- (5) 其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、舆情监控、信用风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务的主要信用风险为发行人违约导致损失的风险。公司通过建立内评系统并采用定性定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、持续监控报告发行人资信状况、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理。

融资融券、股票质押式回购交易等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的

风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理，并适时进行逆周期调节；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为289.55%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为199.65%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为351.41%。

衍生品交易业务存在交易对手于约定日期未履行支付义务的信用风险。对此，公司对交易对手进行评级并授信；寻求资质好的担保方项目进行交易；利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等措施进行风险缓释；明确违约事件、提前终止事件的处理流程等措施。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中登公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

### 3. 操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格遵守监管要求，落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理流程相关风险；三是运用关键风险指标开展日常监控，及时预警、处置风险，并加强业务风险检查；四是持续完善风险事件收集机制，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是积极开展风险管理文化宣导，以案例分析、现场培训等多种形式组织公司各部门风险教育培训。

### 4. 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。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司流动性风险管理组织架构包括董事会、经理层、资金运营部、风险管理总部及相关部门等，公司董事会承担流动性风险管理的最终责任，资金运营部是公司流动性风险管理的负责部门，统筹公司资金来源与融资管理。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措

施包括但不限于：（1）积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平。（2）加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。（3）持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。（4）持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。（5）适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施。（6）持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

### （三）合规风控及信息技术投入情况

公司高度重视合规管理和风险控制，不断完善合规管理体系和制度建设，持续提升全面风险管理的能力与水平。2021年，公司合规风控投入为4.72亿元，同比增长33.33%，主要包括合规风控人员薪酬、日常运营支出及相关系统建设投入等。

公司以“创新驱动、科技引领、打造世界一流投行信息技术”为战略愿景，金融科技驱动经纪、投行、投资、资本中介、资管等业务数字化转型成效不断显现，信息技术品牌影响力持续提升。2021年，公司信息技术投入为8.90亿元，同比增长18.20%，主要包括信息系统建设投入、信息技术日常支出及人员薪酬等。

## 十八、合规管理体系建设情况和稽核部门稽核情况

### （一）合规管理体系建设情况

报告期内，公司以持续提高合规管理有效性为目标，不断完善合规管理体系和制度建设。为跟进落实监管规则，制定、修订了多项公司层面的合规内控管理制度，包括《国信证券股份有限公司经纪类客户证券交易行为管理工作细则》《国信证券股份有限公司分支机构场外配资监控工作管理规定》《国信证券股份有限公司发布证券研究报告业务合规管理办法》《国信证券股份有限公司投资银行类业务合规管理办法》《国信证券股份有限公司公募基金投资顾问业务合规管理办法》等。为进一步落实中国人民银行关于反洗钱的要求，公司修订完善了《国信证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险自评估制度》《国信证券股份有限公司大额和可疑交易报告管理办法》等反洗钱内控制度。

报告期内，公司持续加强各业务合规管理工作，推动落实各项监管要求。对重点监管规则，组织相关部门进行研究，开展合规培训，及时组织修订相关合规管理制度，督促相关部门完善业务管理制度和流程。公司制定或修订了资管业务、投资银行类业务、融资融券业务、资产托管业务、公募基金投资顾问业务等业务内控管理制度，进一步加强对相关业务条线的合规管理。

报告期内，公司高度重视子公司的合规管理工作，通过合规审查、合规咨询、合规检查等措施，有效防范、控制子公司合规管理风险。

报告期内，公司为及时发现和化解风险，开展了多次合规检查，检查事项主要包括场外配资、客户交易行为管理、反洗钱、适当性管理、员工执业行为、研究业务、保荐业务、资产托管业务、债券发行业务及资产证券化业务等。

报告期内，公司根据日常业务需要及合规风险预防重点，开展了《民法典》《刑法修正案（十一）》《证券行业文化建设十要素》《关于上市公司内幕信息知情人登记管理制度的规定》解读、研究业务新规解读、投资银行业务监管新规解读、客户交易行为管理、投资者适当性管理、员工执业行为管理、反洗钱、资产托管业务、股票质押式回购业务等多场合规培训。

## （二）稽核审计部门的履职情况

公司稽核审计部门作为公司内控监督体系的主要组成部分，独立发挥检查、评价、反映、督导等职能，对公司内部控制制度的建立和实施、公司财务信息的真实性和完整性等情况进行检查监督，对发现问题及时进行反映并提出整改意见，对整改落实情况进行跟踪及督导。

报告期内，公司稽核审计部门按照监管规定及公司要求，高质高效地完成稽核审计任务，通过例行审计、离任审计、离岗稽核、专项审计、联合检查、委托审计等方式，保持对公司总部部门、经纪业务分支机构、控股子公司的审计覆盖，以加强风险控制、保障合规经营、改进内部管理为导向，以发现问题、督导整改为目标，完善对公司重要部门的审计监督，强化对重要领域及重要事项的独立核查，保持对重要岗位及关键人员在履职行为、职业操作、廉洁从业等方面的深入审查，履行在公司治理方面的检查监督职责，持续推进公司内部控制体系建设。

公司稽核审计部门严格遵循审计程序和质量标准，独立、客观地审查和评价业务经营及内部控制的真实性、合规性、有效性，推进公司完善制度及提升效率。

## 十九、董事会关于内部控制责任的声明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并且如实披露内部控制评价报告是公司董事会的责任。公司监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。公司经营管理层负责组织领导内部控制的日常运行。公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证内部控制评价报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并且对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

公司内部控制的目标是合理保证经营管理合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果，促进实现发展战略。由于内部控制存在的固有局限性，故仅能为实现上述目标提供合理保证。此外，由于情况的变化可能导致内部控制变得不恰当，或者对控制政策和程序遵循的程度降低，根据内部控制评价结果推测未来内部控制的有效性具有一定的风险。

## 二十、建立财务报告内部控制的依据

公司重视与财务报告相关内部控制制度的建设和完善，根据《会计法》《企业会计准则》及相关财务制度的要求，在业务核算、成本费用支出、财务管理、会计信息系统管理等方面建立了相应的管理制度。

公司采取了建立适当的财务会计组织架构、配备合格的财务会计专业人员、使用规范的财务会计管理系统、选用恰当的会计政策和合理的会计估计等控制措施，保证公司编制的财务报告符合会计准则的要求，



能够真实、准确、完整地反映公司财务状况、经营成果等有关信息。

公司财务报告由公司法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名盖章，并且聘请会计师事务所出具独立审计报告。

报告期内，公司财务报告相关内部控制制度健全，运行情况良好。根据公司财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定标准，于内部控制评价报告基准日，公司不存在财务报告内部控制的重大缺陷及重要缺陷。

董事会认为，公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求，在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

## 二十一、上市公司治理专项行动自查问题整改情况

报告期内，根据中国证监会《关于开展上市公司治理专项行动的公告》（证监会公告[2020]69号）的要求，公司对照上市公司治理专项自查清单，认真梳理查摆存在问题。具体如下：

### 1. 董事会到期未及时换届

自查问题：公司于2017年12月21日召开2017年第三次临时股东大会选举成立公司第四届董事会，任期为三年，任期到期未及时换届。

整改情况：公司于2021年9月3日召开2021年第一次临时股东大会，选举成立公司第五届董事会。

### 2. 独立董事连续任职超过六年

自查问题：公司两位独立董事自2014年7月起开始任职，连续任职超过六年。

整改情况：公司于2021年9月3日召开2021年第一次临时股东大会，选举产生第五届董事会独立董事，两位连续任职超过六年的独立董事届满离任。

## 第五节 环境和社会责任

### 一、重大环保问题

#### （一）基本情况

公司及子公司为金融类企业，不属于环境保护部门公布的重点排污单位。报告期内，公司未因环境问题受到行政处罚。

#### （二）报告期内，公司为减少碳排放所采取的措施及效果

2021年，公司充分发挥资本市场作用，支持绿色金融发展，助力“碳达峰”“碳中和”战略目标实现；同时，积极践行节能环保理念，持续降低能耗，实现绿色经营。

##### 1. 发挥金融专业作用，促进绿色经济发展

公司于2021年全力落实国家“双碳”战略，积极参与政策规划设计与产业研究，全方位、多途径满足各级政府及企业的绿色金融需求，不断开发和优化绿色金融产品，为科技创新、清洁能源与节能环保等相关产业搭建专业、高效、优质的服务平台。股权融资服务方面，完成绿色金融股权融资项目15个，募集资金共计约147亿元，为绿色环保型企业发展提供了重要的资金支持；债权融资服务方面，公司大力开拓绿色债券业务，为污染防治低碳环保等绿色项目提供融资服务，2021年成功发行绿色债券16只、发行规模共计249亿元，其中碳中和债3只，发行规模共计17亿元，其中部分募集资金用于绿色产业项目；研究支持方面，公司成功举办“2021新能源产业峰会”，共同交流探讨“碳达峰、碳中和”战略目标下新能源产业的发展方向与路径，加深了相关行业对国家“双碳”战略和新能源产业的认知，为绿色经济发展提供了研究助力。

##### 2. 树立绿色经营理念，践行低碳节能环保

公司在日常经营中积极倡导并践行低碳、节能、环保理念，节约用水、用电、用纸，提高信息化办公水平，降低能源消耗。一是做好垃圾分类，专业治污保洁。公司积极响应政府要求，认真做好垃圾减量分类和治污保洁专业化管理工作；公司食堂一次性餐具均使用可降解材料，扎实践行环保理念。二是打造绿色办公环境，注重节能环保。公司在国信金融大厦的建设和装修中践行节能环保理念，从细节入手打造绿色办公环境。其中，空调系统采用冰蓄冷节能设计，充分利用夜间电网低谷电能进行制冰，白天在用电高峰期融冰放冷，调荷避峰，空调末端采用VAV变风量系统并设计计费系统，根据现场人员需求自动有偿供冷，实现高效节能；大楼幕墙系统采用双层节能隔热玻璃，较好地节省了空调负荷；灯光照明系统采用LED灯管并且智能控制，有效节能；使用绿色环保材料，对全部使用材料进行环保检测，不采用不符合环保要求的材料，切实保障办公环境质量。三是倡导绿色出行，降低能源消耗。公司提倡勤俭节约，加强后勤管理，认真执行公务车配备标准，规范购置公务车；严格执行公务车辆使用管理预约登记制度，集中管理、专人驾驶、统一调配，集体公务活动安排合乘汽车，落实低碳环保、绿色出行。

## 二、社会责任情况

作为一家上市证券公司，国信证券主动承担金融企业与上市公司的双重社会责任，秉承“合规自律、专业务实、诚信稳健、和谐担当”的文化理念和“创造价值、成就你我、服务社会”的价值观念，在经济、社会、环境等各方面积极履行企业社会责任。

新冠肺炎疫情发生以来，公司充分发挥金融专业优势，加强金融保障，做好金融支持，彰显金融担当，不断加大对受疫情影响较大企业的支持力度；立足自身落实常态化防控措施，切实保障员工健康和公司经营稳定；组织号召总部及各地分支机构员工全力支援所在地区抗疫工作，积极履行国有金融企业的社会责任。国信证券抗疫志愿者以实际行动践行初心使命，守护城市安全，携手筑就一道道坚固的抗疫防线。

详细情况请参见公司于2022年4月19日在深交所网站 (<http://www.szse.cn>) 披露的《2021年度社会责任报告》。

## 三、巩固拓展脱贫攻坚成果、助力推进乡村振兴的情况

2021年是我国巩固脱贫攻坚成果、接续推进乡村振兴的关键之年。公司围绕脱贫攻坚与乡村振兴战略衔接工作，按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路制定精准帮扶规划，认真贯彻落实各项部署要求，通过金融帮扶、产业扶持、教育发展、消费认购、民生建设等多种方式，为巩固拓展脱贫攻坚成果，接续推进乡村振兴新发展作出积极贡献。

2021年，公司与新疆麦盖提县、塔什库尔干县、英吉沙县，贵州三都水族自治县、织金县、道真县，云南龙陵县及内蒙古兴和县共8个县进行结对帮扶，顺利完成广东省河源市龙川县山池村对口帮扶收尾工作，并派出3名党员干部赴广东省汕尾市海丰县大湖镇开展驻镇帮扶。报告期内，公司累计实施91个公益帮扶项目，投入公益帮扶资金合计2,498.88万元，获得由政府、媒体颁发的“2021年最具社会责任感券商”“年度社会责任贡献奖”“消费帮扶爱心单位”等在内的5个奖项。

### （一）发挥专业优势，实施金融帮扶

公司将金融帮扶理念与帮扶地区实际相结合，充分发挥资本中介作用，创新金融帮扶模式，有效发挥金融专长，支持帮扶地区企业利用资本市场资源培育自我发展能力。

股权融资方面，公司积极响应国家发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚及乡村振兴战略的倡议，持续服务5年，成功助力注册地位于脱贫县江西省广昌县的江西志特新材料股份有限公司实现利润近10倍增长，并于2021年4月首发登陆创业板市场，募集资金4.33亿元，有力促进企业主营业务发展。截至2021年12月，公司还有其他正在服务的帮扶地区拟上市企业IPO项目4个，服务县区分布在贵州、西藏、重庆等地。债权融资方面，公司成功为四川、江西、浙江等地区企业发行乡村振兴债券3支，累计融资28亿元，协助帮扶地区企业解决融资问题，积极促进地方经济发展，助力乡村振兴。公司在河南、云南、甘肃等地共开展15个“保险+期货”项目，充分利用期货行业风险管理专长，分散农业生产者的价格风险，稳定农民基本收益，实现产业精准帮扶，2021年项目数量为2020年的2倍，承保货值共计超3.6亿元，为2020年的近3倍。此外，公司采用“线上+线下”方式在云南、河南等地共开展5场金融防诈骗知识培训，累计培训农户206人次，通

过系列案例剖析等方式，增强帮扶地区农户面对金融诈骗的警惕性和防范技能。

## （二）开展多元帮扶，保障社会民生

公司积极响应党中央国务院、广东省委省政府、深圳市委市政府及监管机构号召，在结对帮扶8县1村1镇的基础上，进一步从援疆、支边、启智、敬老、济困、医疗等方面开展公益慈善活动。

### 1. 深耕教育帮扶，助推帮扶地区教育事业发展

公司一贯重视教育帮扶工作，积极发挥教育帮扶在巩固脱贫攻坚成果，接续推进乡村振兴工作中的重要作用，加强对帮扶地区的教育投入。受新冠疫情影响，新疆麦盖提县普通话教师短缺的问题仍旧突出。公司积极践行公益精神，在保障员工健康安全的前提下，全年派出两批共12名员工志愿者赴新疆麦盖提县开展支教活动。以先进的教育教学理念和扎实的业务知识，推动提高当地普通话教学水平，提升教学质量，支持教育事业的发展，进一步促进民族团结。此外，公司还开展了贵州三都水族自治县“春晖助学基金”资助项目、新疆塔县特殊困难家庭学生资助项目、新疆麦盖提县教师国语教育培训项目等7个教育帮扶项目，投入公益帮扶资金940万元，积极助力帮扶地区改善教育教学条件，提升教育水平。

### 2. 开展产业帮扶，促进帮扶地区发展增收

针对部分帮扶地区农副产品缺少规模化、产业化条件及经营管理层面智力支持的情况，公司积极开展产业帮扶促进增收。公司向云南省耿马傣族佤族自治县、甘肃省秦安县、陕西省延长县各捐赠产业帮扶资金30万元，共计捐赠90万元，加大当地苹果产业、橡胶产业精准帮扶力度，助推村级集体经济发展，促进帮扶农户稳定增收；向内蒙古兴和县捐赠120万元，支持兴和县兴胜庄村绿色种养循环农业和“产、加、销”一体化拓展示范项目，依托兴胜庄村开展的适度规模肉牛肉羊养殖，探索推进“为养而种、以养定种”绿色循环发展模式，推动当地农业高质量发展。

### 3. 开展消费帮扶，助力脱贫地区特色产品销售

公司结合脱贫地区资源优势，着力从拓宽销售渠道、发展特色农业、支持企业生产等方面开展消费帮扶工作，有效助力脱贫地区特色产业发展。公司全年共计采购脱贫地区特色产品829.51万元，积极助力广东河源、湛江，广西河池、百色，新疆乌鲁木齐、喀什等11省15地特色产品销售，采购品类覆盖饮用水、禽蛋、坚果、菌类、肉类、蔬菜等50余种优质产品，持续加大消费帮扶力度，有效助力帮扶地区特色产业发展。

### 4. 开展民生帮扶，支持济老扶弱

针对部分帮扶地区民生建设需求，公司全年共投入资金519.37万元，重点开展了“贵州三都县塘党村卫生室建设项目”“贵州三都县社会福利中心孤残儿童活动场所建设项目”“新疆塔县爱心超市物资采购项目”“新疆塔县幸福大院托老所物资捐赠项目”“中华儿慈会微笑专项基金-脑瘫儿童救助项目”“山西隰县灾后重建项目”等多项民生帮扶项目，持续深化对口帮扶，助力各帮扶地区短板弱项建设。

**(三) 精准帮扶成效及其他公益捐赠情况**

单位：万元

指标	数量/开展情况
<b>一、总体情况</b>	
其中：1. 资金	2,495.27
2. 物资折款	3.61
<b>二、分项投入</b>	
1. 产业发展帮扶	
其中：1.1 产业发展帮扶项目类型（注1）	农林产业扶持等产业发展帮扶项目
1.2 产业发展帮扶项目个数	7
1.3 产业发展帮扶项目投入金额	210
2. 教育帮扶	
其中：2.1 资助困难学生投入金额	60
2.2 改善帮扶地区教育资源投入金额	880
3. 健康帮扶	
其中：3.1 帮扶地区医疗卫生资源投入金额（注2）	36.7
4. 消费帮扶	
其中：4.1 项目类型（注3）	认购农副产品
4.2 投入金额	829.51
5. 其他项目	
其中：5.1 项目类型（注4）	其他民生、公益项目
5.2 投入金额	482.67
<b>三、所获奖项</b>	
2021年9月，公司在《中国经营报》2021年“CSR竞争力——中国企业社会责任”评选中，获得“年度社会责任贡献奖”。 2021年9月，公司驻河源市龙川县岩镇镇山池村扶贫工作队入选深圳市对口支援工作领导小组评选的2019-2020深圳市脱贫攻坚工作突出贡献集体。 2021年9月，在由中共深圳市委农村工作领导小组办公室、深圳市乡村振兴和协作交流局、深圳市市场监督管理局、深圳市商务局、深圳市总工会共同举办的“城乡共庆共享丰收节 赋予乡村振兴圳能量”为主题的中国农民丰收节·深圳金秋消费帮扶季活动中，公司入选“深圳市第四批消费帮扶爱心单位”名单，并获得“消费帮扶爱心单位”称号。 2021年11月，在《每日经济新闻》主办的第十二届“2021金鼎奖颁奖盛典（公募、券商）”评选中，获得“最具社会责任感券商”奖项。 2021年12月，在《中国证券报》主办的“2021中国证券业金牛奖”评选中，获得“证券公司社会责任奖”。	

注1：公司开展的产业发展帮扶项目为云南省耿马傣族佤族自治县橡胶产业发展项目、陕西省延长县苹果产业发展项目、甘肃省秦安县苹果产业发展项目、内蒙古兴和县兴胜庄村“母羊银行升级项目”“安格斯肉牛养殖示范项目”“燕麦秸秆饲料化利用和青贮玉米饲料发酵项目”“畜禽粪污资源化利用项目”。

注2：公司帮扶地区医疗卫生资源投入指的是为贵州三都县塘党村卫生室建设项目投入金额。

注3：公司开展的消费帮扶项目主要包括认购公司结对帮扶的新疆麦盖提县、广东省河源市山池村农副产品，认购深圳市对口帮扶地区广西河池、百色特色农副产品及采购其他脱贫地区的农副产品。

注4：公司开展的其他公益项目主要包括改善乡村基础设施建设，救助自然灾害造成的损害，关心关爱老人、帮扶孤儿与特殊家庭未成年人等公益项目。

#### （四）后续计划

作为资本市场的建设者和国民经济发展的参与者、推动者，公司将持续按照党和国家关于实施乡村振兴战略，加快推进农业农村现代化的要求，把巩固拓展脱贫攻坚成果、全面推进乡村振兴作为崇高的政治责任，主动承担起国有金融企业与上市公司的双重社会责任。公司将继续按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路开展公益帮扶工作，从帮扶地区实际入手，结合乡村振兴战略，聚焦长远发展，实施更具实效性、延续性、成长性的帮扶项目，不断增强帮扶地区自我发展能力，激活内生动能，进一步巩固和拓展脱贫攻坚成果，致力推动共同富裕。

## 第六节 重要事项

### 一、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履行完毕及截至报告期末尚未履行完毕的承诺事项

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
股改承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
资产重组时所作承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
首次公开发行或再融资时所作承诺	深投控	避免同业竞争的承诺 (首次公开发行)	作为公司控股股东, 深投控已向公司出具《避免同业竞争及利益冲突的承诺及约束措施》, 承诺: 1. 不在中国境内或境外, 直接或间接从事与公司相同或相似并构成竞争关系的业务, 亦不会直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权; 2. 保证国信证券在资产、业务、财务、人员、机构等方面的独立性, 并保证不会利用股东地位促使国信证券股东大会、董事会、监事会、管理层等机构或人员做出损害国信证券及其他股东合法权益的决定或行为; 3. 保证不会发生显失公平的关联交易或者通过关联交易损害国信证券及其他股东的合法权益; 4. 深投控将促使深投控控制的其他企业按照与深投控同样的标准遵守以上承诺事项。	2014 年 4 月 15 日	长期	严格履行
		股份限售的承诺 (首次公开发行)	如深投控在锁定期满后的两年内减持所持有的国信证券首次公开发行 A 股股票前已发行股份的, 则减持价格不低于发行价, 且每年的减持股份数量不超过深投控持有的国信证券首次公开发行 A 股股票前已发行股份数量的 5%。自国信证券上市之日起至深投控减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的, 则深投控减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。在锁定期满两年后, 如深投控因各种原因需要减持所持有的国信证券首次公开发行 A 股股票前已发行股份, 深投控将严格遵守中国法律法规关于控股股东持股及股份变动的有关规定, 规范诚信履行控股股东的义务, 并在确定减持时间、方式和价格时充分考虑国信证券股价稳定和中小投资者合法权益。如深投控减持国信证券 A 股股票的, 深投控将在减持前 4 个交易日通知国信证券, 并在减持前 3 个交易日公告。	2014 年 4 月 16 日	长期	严格履行
		其他承诺 (首次公开发行)	如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定, 国信证券首次公开发行股票招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏, 导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的, 深投控将依法购回已转让的原限售股份。深投控将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效之日起 10 个工作日内制定购回已转让的原限售股份的具体方案, 并在	2014 年 12 月 17 日	长期	严格履行

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
			该方案取得有权机构批准（如需要）后依法实施。深投控购回已转让的原限售股份的价格按照市场情况确定，但每股购回价格将不低于国信证券首次公开发行股票时的发行价并加算同期银行活期存款利息（若需购回的股票有派息、送股、资本公积金转增股本等除权、除息事项的，购回的股份将包括已转让的原限售股份及其派生股份，发行价格将相应进行除权、除息调整）。如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并致使投资者在证券交易中遭受损失的，深投控将依法赔偿投资者损失。深投控将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效后，本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则，按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的或者致使投资者在证券交易中遭受损失的，并因此触发国信证券回购首次公开发行的全部新股的义务、责任的，或者触发国信证券实际控制人、董事、监事和高级管理人员的赔偿义务、责任的，深投控保证在国信证券股东大会上与上述回购、赔偿有关的议案投赞成票，并将依法督促国信证券及其实际控制人、董事、监事和高级管理人员履行其相关义务和承担相关责任。			
	深投控	切实履行填补即期回报措施的承诺（再融资）	深投控承诺不越权干预公司的经营管理活动，不侵占公司利益。	2018 年 11 月 27 日	长期	严格履行
		股份锁定的承诺（再融资）	承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日（2020 年 8 月 14 日）起 60 个月内不进行转让。	2020 年 7 月 24 日	60 个月	严格履行
	华润信托	规范关联交易的承诺（首次公开发行）	作为公司第二大股东，华润信托已向公司出具了《关于规范关联交易的承诺函》，承诺：1. 不利用股东地位及与公司之间的关联关系损害公司和其他股东的利益；2. 在与公司发生关联交易时，将按照公平合理和正常的商业交易条件进行，将不会要求或接受公司给予比在任何一项市场公平交易中第三者更优惠的条件；3. 将严格和善意地履行与公司签订的各种关联交易协议，不会向公司谋求任何超出上述规定以外的利益或收益。	2014 年 7 月 22 日	长期	严格履行
		股份限售的承诺（首次公开发行）	如华润信托在锁定期满后两年后需要减持的，可以任意价格自由减持任何数量的股份。华润信托将在减持前 4 个交易日通知国信证券，并在减持前 3 个交易日公告。自国信证券上市之日起至华润信托减持期间如华润信托有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的，则华润信托减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。	2014 年 4 月 16 日	长期	严格履行
		股份锁定的承诺（再融资）	承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日（2020 年 8 月 14 日）起 36 个月内不进行转让。	2020 年 7 月 24 日	36 个月	严格履行
	云南合和	股份限售的承诺（首次公开发行）	如云南合和在锁定期满两年后需要减持的，可以任意价格自由减持。云南合和将在减持前 4 个交易日通知国信证券，并在减持前 3 个交易日公告。自国信证券上市之日起至云南合和减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的，则云南合和减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。	2014 年 4 月 16 日	长期	严格履行



承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
		股份锁定的承诺 (再融资)	承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日(2020年8月14日)起36个月内不进行转让。	2020年7月23日	36个月	严格履行
	一汽投资	股份限售的承诺 (首次公开发行)	如在锁定期满两年后需要减持的,可以任意价格自由减持。一汽投资将在减持前4个交易日通知国信证券,并在减持前3个交易日公告。自国信证券上市之日起至一汽投资减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的,则一汽投资减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。	2014年4月24日	长期	严格履行
	国信证券及董事、监事、高级管理人员	其他承诺	<p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定,国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的,国信证券将依法回购首次公开发行的全部新股。国信证券将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效之日起10个工作日内制订回购全部新股的方案,并按照有关法律法规和国信证券章程的规定提交董事会审议,董事会在审议通过后及时提交股东大会审议。国信证券回购股份的价格按照市场情况确定,但每股回购价格将不低于首次公开发行股票时的发行价并加算同期银行活期存款利息之和(若国信证券在首次公开发行股票后有派息、送股、资本公积金转增股本等除权、除息事项的,则回购的股份将包括首次公开发行的全部新股及其派生股份,发行价格将相应进行除权、除息调整)。国信证券将按照届时有效的法律法规及股东大会决议实施回购方案。如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定,国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并致使投资者在证券交易中遭受损失的,国信证券将依法赔偿投资者损失。国信证券将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效后,本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则,按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。</p> <p>国信证券全体董事、监事和高级管理人员对首次公开发行股票的招股说明书作出如下声明和承诺:</p> <p>“本人确认发行人首次公开发行股票的招股说明书不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。</p> <p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定,发行人首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并致使投资者在证券交易中遭受损失的,本人将依法赔偿投资者损失。本人将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效后,本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则,按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。”</p>	2014年4月16日	长期	严格履行

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
	国信证券全体董事、高级管理人员	切实履行填补即期回报措施承诺(再融资)	公司全体董事、高级管理人员承诺： “1、本人承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益； 2、本人承诺对个人的职务消费行为进行约束； 3、本人承诺不动用公司资产从事与履行职责无关的投资、消费活动； 4、本人承诺由董事会或薪酬委员会制订的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 5、若公司后续推出股权激励计划，本人承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 6、自本承诺出具日至公司非公开发行股票实施完毕前，若中国证监会作出关于填补回报措施及其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足中国证监会该等规定时，本人承诺届时将按照中国证监会的最新规定出具补充承诺。”	2018年11月26日	长期	严格履行
股权激励承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
其他对公司中小股东所作承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
承诺是否按时履行	是					
如承诺超期未履行完毕的，应当详细说明未完成履行的具体原因及下一步的工作计划	不适用					

(二) 公司资产或项目存在盈利预测，且报告期仍处在盈利预测期间，公司就资产或项目达到原盈利预测及其原因做出说明

不适用。

## 二、控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

报告期内，不存在控股股东及其关联方非经营性占用公司资金的情形。

## 三、违规对外担保情况

报告期内，公司不存在违规对外担保情况。

#### 四、董事会对最近一期“非标准审计报告”相关情况的说明

不适用。

#### 五、董事会、监事会、独立董事（如有）对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

不适用。

#### 六、与上年度财务报告相比，会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的情况说明

报告期内，公司无重大会计差错更正的情况。因企业会计准则变化引起的会计政策变更如下：

（一）公司自2021年1月1日（以下称首次执行日）起执行经修订的《企业会计准则第21号——租赁》（以下简称新租赁准则）。

1. 对公司作为承租人的租赁合同，公司根据首次执行日执行新租赁准则与原准则的累计影响数调整本报告期初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。具体处理如下：

对于首次执行日前的经营租赁，公司在首次执行日根据剩余租赁付款额按首次执行日公司增量借款利率折现的现值计量租赁负债，按照与租赁负债相等的金额，并根据预付租金进行必要调整计量使用权资产。

在首次执行日，公司按照2021年度财务报表附注“三、重要会计政策及会计估计”的“（二十三）部分长期资产减值”的规定，对使用权资产进行减值测试并进行相应会计处理。

（1）执行新租赁准则对公司2021年1月1日财务报表的主要影响如下：

单位：万元

项目	资产负债表		
	2020年12月31日	新租赁准则调整影响	2021年1月1日
使用权资产	-	43,723.42	43,723.42
其他资产	51,780.70	-2,504.64	49,276.05
租赁负债	-	41,111.32	41,111.32
其他负债	867,706.23	107.47	867,813.70

（2）公司2020年度财务报表中披露的重大经营租赁中尚未支付的最低租赁付款额为43,983.07万元，将其按首次执行日增量借款利率折现的现值为41,111.32万元，折现后的金额与首次执行日计入资产负债表的与原经营租赁相关的租赁负债的差额为0元。

首次执行日计入资产负债表的租赁负债所采用的公司增量借款利率的加权平均值为3.67%/3.83%。

（3）对2021年1月1日前的经营租赁采用的简化处理

- ① 对于首次执行日后12个月内完成的租赁合同，公司采用简化方法，不确认使用权资产和租赁负债；
- ② 公司在计量租赁负债时，对于具有相似特征的租赁合同采用同一折现率；
- ③ 使用权资产的计量不包含初始直接费用；
- ④ 公司根据首次执行日前续租选择权或终止租赁选择权的实际行权及其他最新情况确定租赁期；

⑤ 作为使用权资产减值测试的替代，公司根据《企业会计准则第13号——或有事项》评估包含租赁的合同在首次执行日前是否为亏损合同，并根据首次执行日前计入资产负债表日的亏损准备金额调整使用权资产；

⑥ 首次执行日前发生租赁变更的，公司根据租赁变更的最终安排进行会计处理。

上述简化处理对公司财务报表无显著影响。

2. 对首次执行日前已存在的低价值资产经营租赁合同，公司采用简化方法，不确认使用权资产和租赁负债，自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

3. 对公司作为出租人的租赁合同，自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

（二）公司自2021年1月26日起执行财政部于同日颁布的《企业会计准则解释第14号》，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

## 七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明

### （一）合并范围减少情况

报告期内，子公司深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司完成注销。

### （二）纳入合并范围的结构化主体变动情况

公司纳入合并范围的结构化主体主要包括公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。公司综合评估公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使公司面临可变回报的影响重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。公司2021年度新增24个结构化主体纳入合并报表范围，21个结构化主体清算或持有份额比例下降丧失控制权不再纳入合并报表范围。

## 八、聘任、解聘会计师事务所情况

### （一）现聘任的会计师事务所情况

境内会计师事务所名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬（注）	133.80 万元
境内会计师事务所审计服务的连续年限	3 年
境内会计师事务所注册会计师姓名	燕玉嵩、黄燕
境内会计师事务所注册会计师审计服务的连续年限	燕玉嵩 1 年、黄燕 3 年

注：为公司年度审计费用，未包括子公司的相关费用。

### （二）聘请内部控制审计会计师事务所、财务顾问或保荐人情况

公司聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司2021年度内部控制审计会计师事务所，审计费用为人民币40万元。

## 九、年度报告披露后面临退市情况

不适用。

## 十、公司破产重整，兼并、分立以及子公司、分公司、营业部新设和处置等重大情况

### （一）破产重整相关事项

不适用。

### （二）公司兼并或分立情况

不适用。

### （三）子公司、分公司、营业部新设和处置情况

截至报告期末，公司共设有4家全资子公司，相关情况具体请参见第三节“十一、主要控股参股公司分析”；公司共设有58家分公司，184家证券营业部，分布于全国118个中心城市和地区，相关变化情况具体请参见第六节“十六、其他重大事项的说明”。

### （四）重大的资产处置、收购、置换、剥离情况

不适用。

### （五）重组其他公司情况

不适用。

## 十一、重大诉讼、仲裁事项

### （一）重大诉讼仲裁事项

报告期内，公司不存在涉及金额占公司最近一期经审计净资产绝对值10%以上且绝对金额超过1,000万元的重大诉讼、仲裁事项。

### （二）其他诉讼仲裁事项

自报告期初至本报告披露日，公司新增或前期已披露并发生新进展的、涉案金额超过人民币1,000万元的与公司经营业务相关的诉讼、仲裁事项，具体如下：

#### 1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称“华泽钴镍”）部分投资者因证券虚假陈述造成相关投资损失的民事赔偿事宜，分别向成都市中级人民法院（以下简称“成都中院”）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿损失及承担诉讼费用，并要求华泽钴镍董事等人员及

相关中介机构承担连带赔偿责任。公司自2018年10月31日起陆续收到相关案件材料，部分案件分别于2019年8月1日、2019年10月10日和2020年8月7日等一审开庭审理。成都中院对部分案件作出一审判决后，部分案件当事人提起上诉。四川省高级人民法院（以下简称“四川高院”）于2020年7月7日对3起案件二审开庭审理，公司于2021年4月收到3起案件二审判决，其中，1起案件判决公司等对华泽钴镍赔付义务0.33万元承担连带赔偿责任，2起案件判决驳回原告诉讼请求。2021年12月27日，公司收到最高人民法院驳回3名原告再审申请的裁定。2022年2月7日，公司收到四川高院对1起案件的二审判决，判决公司等对华泽钴镍赔付义务1.29万元承担连带赔偿责任。2022年3月至4月，公司收到成都中院的执行通知，要求公司等履行支付义务合计2,059.73万元。截至本报告披露日，涉及公司的诉讼案件合计2,449起，涉案标的额合计91,555万元，公司另收到部分案件的撤诉裁定。

## 2. 海口农商行与刚泰集团及公司债券交易纠纷案

刚泰集团公开发行2016年公司债券（第二期）（以下简称“16刚集02”），发行规模为5亿元，起息日期为2016年11月3日，期限为3年，附第2年末投资者回售选择权，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为5亿元。2018年11月3日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。“16刚集02”投资者海口农村商业银行股份有限公司向海南省高级人民法院提起诉讼，要求刚泰集团支付本金、利息、复利及相关费用合计人民币1.07亿元，并要求公司承担连带赔偿责任。因刚泰集团进入破产程序，目前案件中止审理。

## 3. 公司与刚泰集团债券交易纠纷案

刚泰集团有限公司（以下简称“刚泰集团”）公开发行2016年公司债券（第一期），发行规模为5亿元，起息日期为2016年9月26日，期限为3年，附第2年末投资者回售选择权，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为5亿元。2018年9月26日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。2019年1月25日，公司作为授权代表向深圳国际仲裁院提起仲裁，要求刚泰集团支付债券本金、利息、逾期利息等费用合计人民币5.37亿元。2019年7月17日，本案开庭审理。2019年10月29日，深圳国际仲裁院作出裁决，公司胜诉。2020年1月4日，公司向上海金融法院申请强制执行。2020年5月8日，上海金融法院作出终结本次执行裁定。2020年11月25日，上海市第三中级人民法院裁定受理刚泰集团破产清算案。

## 4. 公司管理的资产管理计划与康得新集团公司债券交易纠纷案

康得新复合材料集团股份有限公司（以下简称“康得新集团”）2018年度第一期超短期融资券“18康得新SCP001”未按时兑付本金及利息。根据委托人的指令及相关法律法规，公司作为资产管理计划管理人，于2019年7月31日向深圳市罗湖区人民法院代两项资产管理计划提起诉讼，要求康得新集团兑付债券本金、利息及违约金等相关费用合计6,247.5万元，案件的最终诉讼结果由委托人承担。2020年5月9日，公司收到胜诉判决。案件已进入强制执行程序，2020年10月，执行案件由深圳市罗湖区法院移交至江苏省张家港市人民法院处理。2021年12月15日，苏州市中级人民法院公告受理康得新集团破产重整一案，公司向破产管

理人申报债权，并跟进破产重整事宜。

#### 5. 公司与腾邦集团股票质押式回购交易纠纷案

2016年9月29日、2017年8月25日，腾邦集团有限公司（以下简称“腾邦集团”）分别与公司签署《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易，将其所持有的5,010万股腾邦国际股票（证券代码：300178）质押给公司，融资人民币3.17亿元。腾邦集团未能按期偿还本息，其质押的腾邦国际股票已跌破平仓线并被司法冻结，已构成多重违约。2019年8月1日，公司向深圳国际仲裁院提起仲裁，要求腾邦集团偿还未付本金、利息及违约金等合计人民币3.29亿元。2020年5月31日，本案开庭审理。2020年8月19日，公司收到胜诉裁决。2021年3月，腾邦集团收到深圳市中级人民法院《决定书》，决定对腾邦集团启动预重整程序。2021年12月，深圳市中级人民法院裁定不予受理对腾邦集团的破产重整申请，申请人已向广东省高级人民法院提起上诉。

#### 6. 公司与余某股票质押式回购交易纠纷案

2017年，公司为浙江聚力文化发展股份有限公司（以下简称“聚力文化”）大股东余某承做3笔股票质押业务。该业务由余某持有的约6,643万股聚力文化（证券代码：002247）股票作质押担保，由聚力控股集团有限公司作连带责任保证担保。后因余某及聚力控股集团有限公司未能按时偿还本金及利息，公司于2019年8月向深圳国际仲裁院递交了仲裁申请材料并立案，要求余某、聚力控股支付本金、利息及罚息等合计4.47亿元。2020年9月，深圳国际仲裁院对本案作出裁决，支持了公司仲裁请求。2021年10月，该案质押物成功拍卖，共回收款项约1.19亿元。目前，公司正通过其他途径、方式继续追偿。

#### 7. 公司与吴某等8人基金合同纠纷案

2016年11月，委托人吴某等8人与基金管理人上海东楷创业投资管理有限公司（以下简称“东楷创业”）、基金托管人国信证券签订了《中航神舟电力专项私募基金基金合同》，吴某等8人出资认购了该基金份额。2019年12月，吴某等8人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为东楷创业未披露基金信息、擅自变更投资对象及延期，已经构成根本违约，要求解除合同及东楷创业返还本金、利息等合计1,476.68万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于2020年12月9日开庭，2021年8月12日，仲裁院作出裁决，公司不承担任何责任。

#### 8. 公司与刘某等2人基金合同纠纷案

2018年6月，委托人刘某等2人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称“天和盈泰”）、基金托管人国信证券签订了《天和盈泰天山一号私募投资基金合同》，刘某等2人出资认购了该基金份额。2019年12月，刘某等2人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计2,204万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于2021年7月9日开庭审理，尚未裁决。

## 9. 公司与钟某股票质押式回购交易纠纷案

北京金一文化发展股份有限公司（以下简称“金一文化”）董事长钟某，于2016年6月22日以其持有的1,600万股金一文化股票（证券代码：002721）质押给公司，融资人民币1亿元。金一文化股票因价格跌破平仓线构成违约。公司于2020年1月22日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求钟某偿还本金、利息及违约金等合计10,590万元。案件已于2020年6月29日开庭，因双方无法达成调解协议，仲裁院于7月23日作出生效裁决，支持我方全部仲裁请求。由于钟某在法定履行期内未履行付款义务，公司已于2020年8月6日向北京市第一中级人民法院提出强制执行申请。案件进入执行程序后，通过司法拍卖涉案股票回款5,131.8万元，目前该案尚未执行完毕。

## 10. 公司与藏格投资、四川永鸿股票质押式回购交易纠纷案

2016年7-8月，西藏藏格创业投资集团有限公司（以下简称“藏格投资”）、四川省永鸿实业有限公司（以下简称“四川永鸿”）分别与公司签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易。藏格投资、四川永鸿将其所持有的藏格矿业股票（证券代码：000408）合计约27,817万股质押给公司，融资人民币合计22亿元；其中包含向公司作为管理人的资产管理计划融资5.5亿元。因藏格投资、四川永鸿未能按期偿还本息，其质押的藏格矿业股票已跌破平仓线，已构成多重违约。公司于2020年5月向深圳市福田区人民法院提起相关司法程序。2020年8月18日，公司收到法院作出的支持公司申请的生效裁定。2021年3月，本案件进入执行程序，截至2021年末，案件已执行结案。

## 11. 公司与张某基金合同纠纷案

2017年2月，委托人张某与基金管理人上海钜澎资产管理有限公司（以下简称“钜澎公司”）、基金托管人国信证券签订了《钜澎大观稳赢优先私募基金2号基金合同》，张某出资认购了该基金份额。2020年2月，张某向上海国际仲裁中心提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期未兑付，是因钜澎公司虚假宣传、违反投资者适当性、未进行信息披露等违约行为造成，国信证券对上述行为未尽监督义务，张某要求解除合同及钜澎公司、国信证券返还本息等合计1,602万元。案件已于2020年7月21日开庭，2021年9月17日，仲裁院作出裁决，公司不承担任何责任。

## 12. 公司与何某股票质押式回购交易纠纷案

杭州联络互动信息科技股份有限公司实际控制人何某以其持有的2.86亿股联络互动（证券代码：002280）质押给公司，合计融资8.8亿元。因何某未能按期偿还本息，其质押的联络互动股票价格已跌破平仓线，已构成多重违约。公司于2020年6月30日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求何某偿还本金、利息、违约金等合计9.9亿元，并向湖南省汝城县人民法院提出仲裁财产保全申请。目前，何某名下的财产已被采取保全措施，案件于2020年12月8日开庭，仲裁院于2021年3月31日作出裁决，要求何某向国信证券支付本金、利息、违约金及仲裁费用约10亿元。因何某怠于履行清偿义务，国信证券于2021年5月向浙江省杭州市中级人民法院申请强制执行。执行期间，何某向广东省深圳市中级人民法院申请撤销上述仲裁裁决。该案已于2021



年6月25日开庭，深圳市中级人民法院于7月3日作出裁定，驳回何某的申请。案件恢复执行后，进入司法拍卖涉案股票阶段。期间，何某与公司达成将部分案涉股票转让后优先清偿欠款的协议。2021年12月下旬，何某以每股3.55元的价格将案涉7,680万股股票转让给第三方，第三方代为清偿欠款本金2.10亿元。目前，该案尚未执行完毕。

### 13. 公司与新疆嘉酿投资有限公司融资融券纠纷案

2018年公司为新疆嘉酿投资有限公司（以下简称“新疆嘉酿”）承做融资融券业务。由于新疆嘉酿信用账户维持担保比例跌破并长期低于平仓线，构成违约。公司于2020年9月16日向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求新疆嘉酿偿还本金、利息、违约金合计人民币14,582万元。案件已于2021年8月4日开庭，公司于2021年12月收到胜诉判决。债务人随后向广东省高级人民法院上诉，目前案件正处于二审阶段。

### 14. 公司与许某等 13 人基金合同纠纷案

2015年12月，委托人许某等13人与基金管理人北京华建融信资产管理有限公司（以下简称“华建公司”）、基金托管人国信证券签订了《华建1号基础设施建设专项基金基金合同》，许某等13人出资认购了该基金份额。2021年1-2月，许某等13人陆续向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为华建公司不公平对待投资者、擅自变更委托贷款发放对象，国信证券未尽投资监督义务，已经构成违约，要求华建公司返还本金、利息等合计2,900.5万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件已于2021年3月起陆续安排开庭，2021年11月，上述案件陆续收到裁决书，仲裁庭裁决我司承担3%的补充赔偿责任。

### 15. 公司与浙江亚厦幕墙有限公司建设工程施工合同纠纷

2013年4月，公司与浙江亚厦幕墙有限公司（以下简称“亚厦公司”）签订了《国信证券大厦（义乌）幕墙工程施工合同》（以下简称“施工合同”），合同总价款5,369.35万元。该工程项目于2014年4月25日开工，并于2016年11月13日竣工，公司已累计支付工程款4,456.26万元。在尾款结算过程中，因双方对减少的工程款是否可以提取30%的奖励，一直存在分歧，导致工程尾款迟迟无法结算。亚厦公司于2021年5月起诉公司，要求公司支付工程尾款、变更（增加）工程的造价、优化奖励、现场签证费、利息等费用，合计1,031.82万元。2021年8月2日，该案件在浙江省义乌市人民法院开庭审理，后一审判决公司向亚厦公司支付629.39万元。公司不服该判决，已向浙江省金华市中级人民法院提起上诉，二审已于2022年1月19日开庭，目前尚未判决。

### 16. 公司与杭州福安实业有限公司基金合同纠纷案

2017年10月，委托人杭州福安实业有限公司与基金管理人上海拉曼资产管理中心（有限合伙）、基金托管人国信证券股份有限公司签订了《海银拉曼1号债券私募投资基金基金合同》，杭州福安实业有限公司出资认购了该基金份额。2021年5月，杭州福安实业有限公司向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为管理人利用证券账户进行利益输送、关联交易，管理人的内部人员利用内幕消息提前赎回退出，上述行为严重损害了投资者利益；托管人国信证券对上述行为未尽到托管监督职责。要求管理人上海拉曼资产管理中心（有限

合伙)、托管人国信证券共同返还投资本金、赔偿投资利息等合计1,479万元。2021年8月10日,该案件在上海仲裁委员会开庭审理,目前尚未裁决。

### 17. 公司与陈某某股票质押式回购交易纠纷案

2016年8月,陈某某及其一致行动人分别与公司签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议,与公司开展股票质押式回购交易,将其所持有的ST柏龙股票(原“柏堡龙”,证券代码:002776)合计约1.69亿股质押给公司,合计融资6.29亿元。因陈某某及其一致行动人履约保障比例跌破警戒线未按时补仓,且未能按期偿还本息,已构成违约,公司于2021年3月向深圳国际仲裁院提起仲裁。2022年1月,公司收到深圳国际仲裁院作出的支持公司仲裁请求的生效裁决。

### 18. 公司与邹平市供电公司保证合同纠纷案

公司以“邹平电力购售电合同债权资产支持专项计划”管理人的名义在深圳市中级人民法院立案起诉邹平市供电公司(以下简称“邹平供电”),请求法院确认专项计划中《担保函》合法有效,邹平供电向我司支付16.42亿元。法院于2021年6月、8月两次组织开庭审理。2022年1月6日,公司收到深圳市中级人民法院送达的(2020)粤民初4632号民事判决书,判决被告邹平供电于判决生效之日起十五日内支付款项7.05亿元。2022年1月17日,公司收到被告邹平供电公司上诉状。

### 19. 亿阳信通投资者与亿阳信通及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年1月及2月,亿阳信通股份有限公司(以下简称“亿阳信通”)投资者姜某等3人分别向北京金融法院、哈尔滨市中级人民法院对亿阳信通及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼,要求亿阳信通赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用合计2,401.72万元,并要求亿阳信通相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

### 20. 国信金阳与青岛交运仓储合同纠纷案

国信期货全资子公司国信金阳资本管理有限公司(以下简称“国信金阳”)与青岛交运国际物流发展有限公司(以下简称“青岛交运”)签订《仓储保管合同》,合同约定由青岛交运为国信金阳购入的一批天然橡胶提供仓储保管服务。由于青岛交运存在不配合提货的行为已构成违约,国信金阳于2020年8月向青岛市中级人民法院提起诉讼,要求其返还案涉橡胶或赔偿损失合计3,460.36万元。青岛市中级人民法院于2022年2月14日送达一审判决,判令被告青岛交运赔偿国信金阳的损失合计2,768.03万元并负担相应比例的诉讼费用。目前双方均已提起上诉,该一审判决尚未生效。

## 十二、处罚及整改情况

2021年1月8日,上海证监局作出《关于对国信期货有限责任公司采取责令改正监管措施的决定》(沪证监决[2021]第4号)。因国信期货2020年5月7日夜盘发生东莞电信、联通互联网接入异常,影响小部分使用手机进行交易的客户下单(后续经公司排查处理后恢复正常),国信期货在前述事件发生后未按规定向

上海证监局报告，上海证监局决定对国信期货采取责令改正的监管措施。

整改措施：国信期货进一步加强交易站点建设，完善系统监控，优化应急和报告流程，不断提高公司应急管理水平和。同时，加强对员工的培训和宣导，强化对相关法律法规的学习和掌握。

### 十三、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

报告期内，公司及控股股东、实际控制人不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

### 十四、重大关联交易

公司严格按照《深圳证券交易所股票上市规则》《国信证券股份有限公司关联交易管理制度》和《国信证券股份有限公司信息披露管理制度》等要求开展关联交易。公司的关联交易遵循诚实信用、平等自愿、等价有偿、公开、公平、公允的原则。报告期内，公司对2021年度关联交易进行了检查，未发现公司在关联交易管理制度建设、决策程序和信息披露等方面存在不符合现行相关法律法规、规章制度的情况。

报告期内，公司不存在与某一关联方累计关联交易总额在3,000万元以上且占公司报告期末净资产值5%以上的关联交易。公司根据企业会计准则披露的关联交易情况详见公司2021年度财务报表附注“十一、关联方及关联交易”。

#### （一）与日常经营相关的关联交易

公司与日常经营相关的关联交易，主要是由于公司向关联方提供证券、期货和金融服务，与关联方开展证券和金融产品交易，承租关联方房屋、通信管道、及接受关联方物业管理服务等。公司2021年度日常关联交易根据2020年度股东大会审议通过的《关于2020年度关联交易及预计2021年度日常关联交易的议案》执行。公司2021年度预计日常关联交易事项在报告期内的执行情况详见公司于2022年4月19日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的《2022年度日常关联交易预计公告》。

#### （二）资产或股权收购、出售发生的关联交易

报告期内，公司未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

#### （三）共同对外投资的关联交易

报告期内，子公司国信资本与关联法人深圳市天使投资引导基金管理有限公司、深圳市天使投资引导基金有限公司、深圳市高新投集团有限公司及其他合伙人共同投资设立深圳市天使一号创业投资合伙企业（有限合伙）。基金组织形式采用有限合伙制，基金总规模为30,000万元，其中深圳市天使投资引导基金管理有限公司（作为普通合伙人和基金管理人）认缴出资300万元，国信资本（作为有限合伙人）、深圳市天使投资引导基金有限公司（作为有限合伙人）、深圳市高新投集团有限公司（作为有限合伙人）分别认缴出资3,000万元、9,950万元、2,000万元。具体情况如下：

共同投资方	关联关系	被投资企业的名称	被投资企业的主营业务	被投资企业的注册资本	被投资企业的本期末总资产	被投资企业的本期末净资产	被投资企业的本期净利润
深圳市天使投资引导基金管理有限公司	受同一方控制的关联法人	深圳市天使一号创业投资合伙企业(有限合伙)	创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务。	30,000.00	15,004.20	14,978.22	-21.78
深圳市天使投资引导基金有限公司	受同一方控制的关联法人						
深圳市高新投集团有限公司	受同一方控制的关联法人						
被投资企业的重大在建项目的进展情况（如有）		无。					

#### （四）关联债权债务往来

报告期内，公司与关联方不存在非经营性债权债务往来。

#### （五）与存在关联关系的财务公司的往来情况

公司不存在有关联关系的财务公司。

#### （六）公司控股的财务公司与关联方的往来情况

公司不存在控股的财务公司。

#### （七）其他重大关联交易

报告期内，公司无其他重大关联交易。

### 十五、重大合同及其履行情况

#### （一）托管、承包、租赁事项情况

报告期内，公司不存在重大托管、承包、租赁的情况。

#### （二）担保情况

单位：万港元

公司及其子公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）										
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期	实际担保金额	担保类型	担保物（如有）	反担保情况（如有）	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
无	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用

公司与子公司之间担保情况										
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期	实际担保金额	担保类型	担保物(如有)	反担保情况(如有)	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
无	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
子公司对子公司的担保情况										
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期	实际担保金额	担保类型	担保物(如有)	反担保情况(如有)	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
国信证券(香港)经纪有限公司	2021年4月2日	25,000	2015年3月23日、2017年7月10日	3,500	一般保证	无	无	自协议签署之日起,至被担保人履行完毕责任为止。	否	否
国信证券(香港)金融产品有限公司	2021年4月2日	20,000	2015年3月23日、2015年6月30日、2017年7月10日、2018年8月2日、2018年7月28日、2019年4月23日	16,500	一般保证	无	无	自协议签署之日起,至被担保人履行完毕责任为止。	否	否
报告期内审批对子公司担保额度合计			45,000	报告期内对子公司担保实际发生额合计			-			
报告期末已审批的对子公司担保额度合计			45,000	报告期末对子公司实际担保余额合计			20,000			
公司担保总额										
报告期内审批担保额度合计			45,000	报告期内担保实际发生额合计			-			
报告期末已审批的担保额度合计			45,000	报告期末实际担保余额合计			20,000			
实际担保总额占公司净资产的比例				0.17%						
其中:										
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额(1)				-						
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(2)				20,000						
担保总额超过净资产50%部分的金额(3)				-						
上述三项担保金额合计(1+2+3)				20,000						
对未到期担保,报告期内已发生担保责任或可能承担连带清偿责任的情况说明							不适用			
违反规定程序对外提供担保的说明							不适用			

公司不存在采用复合方式担保的情况。

### (三) 委托他人进行现金资产管理情况

#### 1. 委托理财情况

不适用。

## 2. 委托贷款情况

报告期内，公司不存在委托贷款。

### （四）其他重大合同

报告期内，公司不存在其他重大合同。

## 十六、其他重大事项的说明

### （一）公司董事长、法定代表人的变更情况

公司于2021年4月26日召开2020年度股东大会，选举张纳沙女士为公司第四届董事会董事；并于同日召开第四届董事会第三十四次会议，审议通过《关于选举董事长并任命公司法定代表人的议案》，选举张纳沙女士为公司第四届董事会董事长，并由其根据《公司章程》规定担任公司法定代表人，任期为自董事会审议通过之日起至第四届董事会履职期限届满之日止。具体内容详见公司于2021年4月27日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的相关信息。

### （二）公司董事会及监事会换届情况

2021年9月3日，公司召开2021年第一次临时股东大会，选举张纳沙女士、邓舸先生、姚飞先生、刘小腊先生、李双友先生、赵军先生为第五届董事会非独立董事，白涛女士、郑学定先生、金李先生为第五届董事会独立董事；选举李保军先生、张财广先生为第五届监事会股东代表监事，与公司职工监事洪伟南先生共同组成第五届监事会。同日，公司召开第五届董事会第一次会议，选举张纳沙女士为第五届董事会董事长，并由其根据《公司章程》规定担任公司法定代表人；召开第五届监事会第一次会议，选举李保军先生为第五届监事会主席。

### （三）公司主要办公地址的变更情况

公司于2022年1月22日将主要办公地址搬迁至深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦。具体内容详见公司于2022年1月22日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的相关信息。

### （四）证券营业网点的情况

截至报告期末，公司共设有58家分公司，184家证券营业部，分布于全国118个中心城市和地区。报告期内，公司营业网点的新设和变更情况如下：

#### 1. 营业网点新设

报告期内，公司完成3家分公司、6家证券营业部的筹建，并获得《经营证券期货业务许可证》，具体情况如下：

序号	营业网点名称	营业地址	《经营证券期货业务许可证》 获取时间
1	深圳金田路证券营业部	深圳市福田区福田街道福山社区福华三路与金田路交界处东南侧卓越世纪中心、皇岗商务中心 1 号楼 5103、5104、1 楼 101	2021 年 5 月 24 日
2	中山小榄广源中路证券营业部	广东省中山市小榄镇广源中路 18 号 112 卡、113 卡、114 卡	2021 年 6 月 17 日
3	深圳前海分公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 170102A	2021 年 6 月 23 日
4	苏州分公司	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区苏州中心广场 58 幢 3401 室内中的 35 层 03 号	2021 年 7 月 8 日
5	福州五四路证券营业部	福建省福州市鼓楼区鼓东街道五四路 118 号闽侨大厦 28 层 02 单元	2021 年 7 月 27 日
6	深圳红岭分公司	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 6 号免税商务大厦 1601 楼整层	2021 年 7 月 30 日
7	长沙星沙开元东路证券营业部	湖南省长沙县星沙街道东六路 266 号华润置地广场一期 12 栋 114	2021 年 8 月 12 日
8	深圳海德三道证券营业部	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1126 号卓越前海金融中心 2504 单元	2021 年 8 月 12 日
9	北京甘家口证券营业部	北京市海淀区三里河路 13 号 10 层	2021 年 9 月 18 日

## 2. 营业网点变更

序号	变更类型	变更后	变更前
1	迁址	江西分公司 地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1568 号红谷凯旋商业办公综合楼及商业六 101、901、902、904、906 室	江西分公司 地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1568 号红谷凯旋商业办公综合楼及商业六 701 室 702 室(第 7 层)
2		南昌八一大道证券营业部 地址：江西省南昌市西湖区八一大道 142 号中侧 1-2 层	南昌八一大道证券营业部 地址：南昌市西湖区八一大道 102 号
3		深圳罗湖人民南路证券营业部 地址：深圳市罗湖区南湖街道嘉北社区人民南路 3002 号国际贸易中心大厦 B06-01	深圳罗湖人民南路证券营业部 地址：深圳市罗湖区人民南路国际贸易中心大厦 B5-西 A
4		广东南海分公司 地址：广东省佛山市南海区大沥镇竹基南路 1 号华亚国际金融大厦十三楼 1303、1304、1305 单元及一楼大堂南区（住所申报）	广东南海分公司 地址：广东省佛山市南海区大沥桂和路水头路段 38 号华亚广场十五楼
5		振华分公司 地址：深圳市福田区华强北街道华航社区华富路 1018 号中航中心 21 楼 01-08 单元	振华分公司 地址：深圳市福田区华富路 1018 号中航中心 11 楼 01、08 单元
6		自贡丹桂南大街证券营业部 地址：四川省自贡市自流井区丹桂南大街 6 号宏丰·财富名都 1 栋 2 层 03-05 铺	自贡丹桂南大街证券营业部 地址：自贡市自流井区自贡丹桂南大街 119 号
7		惠州分公司 地址：惠州市文明一路 9 号富绅大厦 24 层 01 号 01、02、03、04、05、10、11、12 单元	惠州分公司 地址：广东省惠州市江北文明一路三号中信城市时代大厦 1 单元 11 楼 03 号、12 号楼 03 号
8		深圳龙岗龙城大道证券营业部	深圳龙岗龙城大道证券营业部

		地址：深圳市龙岗区龙城街道尚景社区龙城大道 89 号西门正中时代大厦 A 栋 1605、1606、1607	地址：深圳市龙岗区龙城街道尚景社区龙城大道 89 号西门正中时代大厦 A 栋 1902-03
9		武汉光谷大道证券营业部 地址：武汉东湖新技术开发区光谷大道 41 号现代·国际设计城二期 B-1 栋 1 层研发 1-5 号、7 号一半、8 号（自贸区武汉片区）	武汉光谷大道证券营业部 地址：武汉市东湖新技术开发区关南科技工业园现代·国际设计城三期第 9 幢 15 层 8 号 02
10		深圳互联网分公司 地址：深圳市福田区福田街道福华一路 125 号国信金融大厦 7 层及裙楼 1 层东南角	深圳互联网分公司 地址：深圳市罗湖区桂园街道红岭中路 1010 号国际信托大厦 2 楼 1 号
11		佛山南海大道证券营业部 地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 50 号首层自编 102、103 号室、第四层	佛山南海大道证券营业部 地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 50 号第三层、第四层
12		杭州迎宾路证券营业部 地址：浙江省杭州市余杭区南苑街道金鑫大厦 405 室-2	杭州南大街证券营业部 地址：浙江省杭州市余杭区南苑街道八方杰座大厦 1 幢 1-1 室东
13		大庆龙政路证券营业部 地址：黑龙江省大庆市龙凤区龙政路 12 号	大庆火炬新街证券营业部 地址：黑龙江大庆市高新区火炬新街 36 号
14		江阴朝阳路证券营业部 地址：江苏省江阴市朝阳路 79-1 号	江阴澄江中路证券营业部 地址：江苏省江阴市澄江中路 159 号 D117、D115-1
15		广州昌岗东路证券营业部 地址：广州市海珠区昌岗东路 257 号之一 1804 室 1805 室 1806 室	广州新港西路证券营业部 地址：广州市海珠区新港西路 135 号中大科技综合楼一层
16		无锡人民东路证券营业部 地址：江苏省无锡市梁溪区人民东路 335-107、112 号（光华时代广场）	无锡东环路证券营业部 地址：无锡市惠山区玉祁镇东环路 63 号玉祁科技创业服务中心 1 楼 101、111 室
17		永康五洲路证券营业部 地址：浙江省金华市永康市东城街道总部中心金州大厦一楼东侧	永康城东路证券营业部 地址：浙江省金华市永康市东城街道城东路 25 号
18	迁址并更名	惠州开城大道证券营业部 地址：广东省惠州市惠阳区开城大道 130 号新球大厦 A01、A02（部分）	惠州承修二路证券营业部 地址：广东省惠州市惠阳区承修二路 4 号邮政综合楼二、三层
19		深圳宝安兴华一路证券营业部 地址：深圳市宝安区新安街道海旺社区 85 区兴华一路（延伸段）21 号天御豪庭 3 栋 301-3	深圳宝安海秀路证券营业部 地址：深圳市宝安区新安街道海旺社区 N26 区海秀路 2021 号荣超滨海大厦 B 座 1308、1309、1310 单元
20		罗湖宝安北路证券营业部 地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区宝安北路 1007 号 HALO 广场三期 6 层 612-615 单元	深圳振华路证券营业部 地址：广东省深圳市福田区振华路 112 号 7 至 8 楼
21		佛山南海永胜西路证券营业部 地址：佛山市南海区桂城永胜西路 22 号新凯广场一座 2 楼 209、211 商铺	佛山南海广佛路证券营业部 地址：广东省佛山市南海区大沥镇广佛路通发大厦首层西北面大堂、三楼部分场地（自编之一）
22		常州劳动西路证券营业部 地址：常州市天宁区新世界花园 11-8 号	常州龙锦路证券营业部 地址：常州市新北区龙锦路 1590 号 5 号楼 907-908 室
23		汉中北团结街证券营业部 地址：陕西省汉中市汉台区北团结街与莲湖路十字东北角华建新城商住楼 1 层 Y1-12 号铺	汉中劳动东路证券营业部 地址：陕西省汉中市汉台区劳动东路航空大厦 5 楼
24		温岭中华路证券营业部	温岭三星大道证券营业部



		地址：浙江省温岭市城西街道中华路 712 号 201 室-01	地址：浙江省台州市温岭市太平街道三星大道 213、215、217、219 号
25		深圳科技园分公司 地址：深圳市南山区粤海街道铜鼓路 39 号大冲商务中心（三期）4 栋 32A3BC1	深圳福中分公司 地址：广东省深圳市福田区福中一路 1016 号地铁大厦三楼
26		温州分公司 温州市鹿城区南汇街道温州大道 2088 号悦尚大厦 1 幢 106 号、1 幢 701 室、707 室	温州黎明东路证券营业部 地址：浙江省温州市黎明东路黎富大厦三楼 301 西首、302 室
27	更名	金华分公司 地址：浙江省义乌市国际商贸城金融商务区国信证券大厦（01-21 地块房屋）1 楼、19 楼	浙江第二分公司 地址：浙江省义乌市国际商贸城金融商务区国信证券大厦（01-21 地块房屋）1 楼、19 楼
28		黑龙江分公司 地址：哈尔滨市道里区群力新区景江西路 1 栋商业 1-4 层 009 号	哈尔滨国民街证券营业部 地址：哈尔滨市道里区群力新区景江西路 1 栋商业 1-4 层 009 号
29		哈尔滨南极街证券营业部 地址：哈尔滨市道外区荣耀上城 F 栋 1-2 层 F5、F6 号	黑龙江分公司 地址：哈尔滨市道外区荣耀上城 F 栋 1-2 层 F5、F6 号

### （五）账户规范情况

公司严格执行中国人民银行、中国证监会、证券登记结算机构及公司内部的各项账户管理规定。在证券账户及资金账户开销户各环节，严格落实账户实名制管理，认真履行客户身份识别、税收居民身份识别等要求，实施相应的风险控制措施，杜绝新增不合格账户；明确各类特殊个人、机构或产品开户的要求，确保各类账户开户规范；进一步优化手机、VTM及柜台操作系统中的关键控制节点；建立健全证券账户开立及使用环节实名制的管理机制，有效防范账户业务风险。

报告期内，公司持续推进不合格账户、风险处置账户、纯资金账户等账户规范工作。截至2021年末，公司不合格证券账户3,890户，比去年同期减少44户；不合格资金账户30,230户，比去年同期减少72户；休眠证券账户608,941户，比去年同期减少747户；休眠资金账户551,934户，比去年同期减少605户；风险处置证券账户1,179户，风险处置资金账户33户；司法冻结证券账户614户，司法冻结资金账户328户。

## 十七、公司子公司重大事项

### （一）国信期货

2021年1月29日，经国信期货第八届董事会第一次会议审议通过，选举邓舸先生担任国信期货第八届董事会董事长，续聘余晓东先生担任国信期货总经理。

报告期内，国信期货新设2家分支机构，并获得《经营证券期货业务许可证》，具体情况如下：

序号	营业网点名称	地址	《经营证券期货业务许可证》获取时间
1	国信期货温州万源路营业部	浙江省温州市鹿城区万源路 356 号万麓园 2 幢 608 室	2021 年 6 月 2 日
2	国信期货舟山营业部	中国（浙江）自由贸易试验区舟山市定海区千岛街道定沈路 619 号舟山港航国际大厦 A 幢 8 楼 801-2 室	2021 年 6 月 8 日

## （二）国信香港

2021年7月28日，公司以非公开发行A股股票募集资金向国信香港划付增资款港币4亿元。同日，国信香港在香港公司注册处完成注册资本变更手续，注册资本由港币22.3亿元增至港币26.3亿元。

2021年11月24日，国信香港董事会聘任朱国强先生担任国信香港行政总裁。

## （三）国信资本

2021年9月29日，经深圳市市场监督管理局核准，国信资本住所变更为“深圳市龙华区民治街道北站社区汇隆商务中心2号楼3312”，相关工商变更登记手续已完成，并取得了新的营业执照。

## （四）国信弘盛

2021年11月23日，公司第五届董事会第三次会议审议通过《关于审议〈国信弘盛私募基金管理有限公司自有资金直接投资项目规范整改方案〉的议案》，同意国信弘盛在2021年12月30日前，将《国信弘盛私募基金管理有限公司自有资金直接投资项目规范整改方案》所列范围内的自有资金投资项目，按不超过2021年10月31日资产账面净值125,229.37万元，实质性转移给国信资本。截至目前，相关划转工作已基本完成。

2022年3月30日，经深圳市市场监督管理局核准，国信弘盛住所变更为“深圳市罗湖区桂园街道红村社区红岭中路1012号国信证券1601”，相关工商变更登记手续已完成，并取得了新的营业执照。

## 十八、报告期内各单项业务资格的变化情况

详见本报告第二节“五、各单项业务资格”。

## 第七节 股份变动及股东情况

### 一、股份变动情况

#### (一) 股份变动情况

单位：股

项目	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	公积金转股	其他	小计	数量	比例
<b>一、有限售条件股份</b>	1,412,429,377	14.69%	-	-	-	-627,118,644	-627,118,644	785,310,733	8.17%
1. 国家持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 国有法人持股	1,392,660,074	14.49%	-	-	-	-607,349,341	-607,349,341	785,310,733	8.17%
3. 其他内资持股	19,769,303	0.21%	-	-	-	-19,769,303	-19,769,303	-	-
其中：境内法人持股	19,769,303	0.21%	-	-	-	-19,769,303	-19,769,303	-	-
4. 外资持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>二、无限售条件股份</b>	8,200,000,000	85.31%	-	-	-	627,118,644	627,118,644	8,827,118,644	91.83%
1. 人民币普通股	8,200,000,000	85.31%	-	-	-	627,118,644	627,118,644	8,827,118,644	91.83%
2. 境内上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 境外上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>三、股份总数</b>	9,612,429,377	100.00%	-	-	-	-	-	9,612,429,377	100.00%

#### 1. 股份变动的原因

2021年2月18日，公司2020年非公开发行的627,118,644股普通股解除限售条件上市流通。详见公司于2021年2月10日在深交所网站(<http://www.szse.cn>)发布的《关于非公开发行股份解除限售上市流通的提示性公告》。

#### 2. 股份变动的批准情况

不适用。

#### 3. 股份变动的过户情况

不适用。

4. 股份变动对最近一年和最近一期基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产等财务指标的影响

不适用。

**5. 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容**

不适用。

**(二) 限售股份变动情况**

单位：股

股东名称	期初限售股数	本期增加限售股数	本期解除限售股数	期末限售股数	限售原因	解除限售日期
深投控	473,587,570	-	-	473,587,570	根据中国证监会《证券公司行政许可审核工作指引第10号——证券公司增资扩股和股权变更》(以下简称《第10号指引》)第十四条,深投控作为公司控股股东,其认购的公司非公开发行的473,587,570股股票自持股日起60个月内不得转让。限售期为自2020年8月14日起的60个月。	2025年8月14日
云南合和	236,864,406	-	-	236,864,406	根据《第10号指引》第十四条,云南合和作为持股5%以上的股东(非控股股东或实际控制人控制的股东),其认购的公司非公开发行的236,864,406股股票自持股日起36个月内不得转让。	2023年8月14日
华润信托	74,858,757	-	-	74,858,757	根据《第10号指引》第十四条,华润信托作为持股5%以上的股东(非控股股东或实际控制人控制的股东),其认购的公司非公开发行的74,858,757股股票自持股日起36个月内不得转让。	2023年8月14日
全国社会保障基金理事会	456,690,209	-	456,690,209	-	根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》(2020年2月14日修正),上市公司非公开发行股票自发行结束之日起,六个月内不得转让。	2021年2月18日
中国华融资产管理股份有限公司	47,080,979	-	47,080,979	-		
中国国际金融股份有限公司	37,664,783	-	37,664,783	-		
中信建投证券股份有限公司	26,365,348	-	26,365,348	-		
万和证券股份有限公司	19,774,011	-	19,774,011	-		
厦门国贸资产运营集团有限公司	19,774,011	-	19,774,011	-		
东海证券股份有限公司	19,769,303	-	19,769,303	-		
合计	1,412,429,377	-	627,118,644	785,310,733		

## 二、证券发行与上市情况

### （一）报告期内证券发行（不含优先股）情况

不适用。

### （二）公司股份总数及股东结构的变动、公司资产和负债结构的变动情况说明

不适用。

### （三）现存的内部职工股情况

不适用。

## 三、股东和实际控制人情况

### （一）公司股东数量及持股情况

单位：股

报告期末普通股股东总数	115,463 户	年度报告披露日前上一月末普通股股东总数	114,185 户	报告期末表决权恢复的优先股股东总数	-	年度报告披露日前上一月末表决权恢复的优先股股东总数	-
<b>前 10 名股东持股情况</b>							
股东名称	股东性质	持股比例	报告期末持股数量	报告期内增减变动情况	持有有限售条件的股份数量	持有无限售条件的股份数量	质押、标记或冻结情况
深投控	国有法人	33.53%	3,223,114,384	-	473,587,570	2,749,526,814	无
华润信托	国有法人	21.38%	2,054,886,867	12,547,000	74,858,757	1,980,028,110	无
云南合和	国有法人	16.77%	1,611,627,813	-	236,864,406	1,374,763,407	无
全国社会保障基金理事会	国有法人	4.75%	456,690,209	-	-	456,690,209	无
北京城建	国有法人	2.94%	282,550,000	-58,450,000	-	282,550,000	无
一汽投资	国有法人	2.67%	256,579,219	-	-	256,579,219	无
香港中央结算有限公司	境外法人	0.84%	80,779,463	25,730,846	-	80,779,463	无
中国证券金融股份有限公司	国有法人	0.78%	75,086,423	-	-	75,086,423	无
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	其他	0.60%	57,467,192	-5,670,361	-	57,467,192	无
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	0.50%	48,429,503	-1,047,597	-	48,429,503	无
战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东的情况	全国社会保障基金理事会因认购公司非公开发行 A 股股票 456,690,209 股，认购股数占公司发行后总股本的 4.75%，于 2020 年 8 月成为公司前 10 名股东。全国社会保障基金理事会所持股份限售期为自新股上市首日后的 6 个月，其所						

	持股票已于 2021 年 2 月 18 日上市流通。		
上述股东关联关系或一致行动的说明	公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49% 的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。		
上述股东涉及委托/受托表决权、放弃表决权情况的说明	不适用。		
前 10 名股东中存在回购专户的特别说明	无。		
其他情况说明	公司第二大股东华润信托以其持有的公司无限售流通股与证金公司开展转融通证券出借交易。截至 2021 年末，华润信托已开展的尚在出借期限内交易合计出借股数为 82,111,000 股，较 2020 年年末尚在出借期限内的出借股数 94,664,000 股减少 12,553,000 股。		
<b>前 10 名无限售条件股东持股情况</b>			
股东名称	报告期末持有无限售条件股份数量	股份种类	
		股份种类	数量
深投控	2,749,526,814	人民币普通股	2,749,526,814
华润信托	1,980,028,110	人民币普通股	1,980,028,110
云南合和	1,374,763,407	人民币普通股	1,374,763,407
全国社会保障基金理事会	456,690,209	人民币普通股	456,690,209
北京城建	282,550,000	人民币普通股	282,550,000
一汽投资	256,579,219	人民币普通股	256,579,219
香港中央结算有限公司	80,779,463	人民币普通股	80,779,463
中国证券金融股份有限公司	75,086,423	人民币普通股	75,086,423
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	57,467,192	人民币普通股	57,467,192
中央汇金资产管理有限责任公司	48,429,503	人民币普通股	48,429,503
前 10 名无限售流通股股东之间，以及前 10 名无限售流通股股东和前 10 名股东之间关联关系或一致行动的说明	公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49% 的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。		
前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明	公司前 10 名普通股股东未参与融资融券业务。		

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未进行约定购回交易。

## （二）持股 10%（含 10%）以上的前 5 名股东情况

### 1. 法人

股东名称	法定代表人	总经理	成立日期	统一社会信用代码	注册资本 (万元)	主营业务
深投控	何建锋	王文杰	2004 年 10 月 13 日	914403007675664218	2,800,900	银行、证券、保险、基金、担保等金融和类金融股权的投资与并购；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营业务；开展战略性新兴产业领域投资与服务；通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理；市国资委授权开展的其他业务。
华润信托	刘小腊	刘小腊	1982 年 8 月 24 日	914403001921759713	1,100,000	资金信托；动产信托；不动产信托；有价证券信托；其他财产或财产权信托；作为投资基金或者基金管理公司的发起人从

						事投资基金业务；经营企业资产的重组、购并及项目融资、公司理财、财务顾问等业务；受托经营国务院有关部门批准的证券承销业务；办理居间、咨询、资信调查等业务；代保管及保管箱业务；以存放同业、拆放同业、贷款、租赁、投资方式运用固有财产；以固有财产为他人提供担保；从事同业拆借；法律法规规定或中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。
云南合和	景峰	毕凤林	2014 年 12 月 31 日	915300003253027445	600,000	实业投资、项目投资及对所投资项目进行管理。

## 2. 自然人

报告期内持股10%（含10%）以上的前5名股东无自然人。

### （三）公司控股股东情况

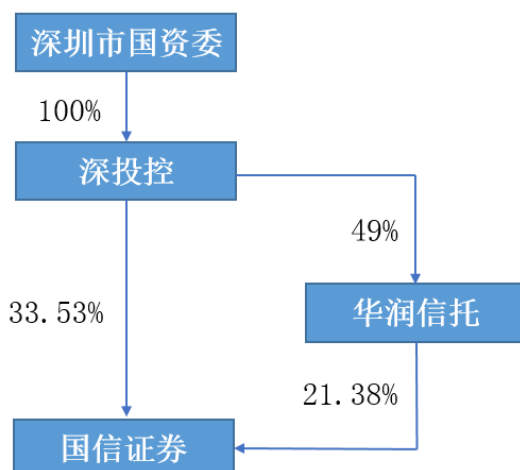
控股股东名称	控股股东性质	控股股东类型	法定代表人/单位负责人	成立日期	统一社会信用代码	主要经营业务
深投控	地方国有控股	法人	何建锋	2004 年 10 月 13 日	914403007675664218	银行、证券、保险、基金、担保等金融和类金融股权投资的投资与并购；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营业务；开展战略性新兴产业领域投资与服务；通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理；市国资委授权开展的其他业务。
控股股东报告期内控股和参股其他境内外上市公司的情况	湾区发展（0737.HK），持股比例 71.83%；深深房（000029.SZ），持股比例 63.55%；深物业（000011.SZ），持股比例 56.96%；深高速（600548.SH），持股比例 51.56%；深纺织（000045.SZ），持股比例 46.21%；深圳国际（0152.HK），持股比例 43.48%；深赛格（000058.SZ），持股比例 24.30%；深水规院（301038），持股比例 37.50%；英飞拓（002528.SZ），持股比例 26.35%；力合科创（002243.SZ），持股比例 24.98%；怡亚通（002183.SZ），持股比例 23.17%；天音控股（000829.SZ），持股比例 19.03%；国泰君安（601211.SH，2611.HK），持股比例 8.00%；深天地 A（000023.SZ），持股比例 6.91%；中国平安（601318.SH），持股比例 5.27%；铁汉生态（300197.SZ），持股比例 4.04%；深能源（000027.SZ），持股比例 0.14%；交通银行（601328.SH），持股比例 0.01%。					

报告期内，公司控股股东未发生变更。

### （四）公司实际控制人及其一致行动人

实际控制人名称	实际控制人性质	实际控制人类型	法定代表人/单位负责人	成立日期	统一社会信用代码	主要经营业务
深圳市国资委	地方国资管理机构	法人	王勇健	2004 年 7 月 30 日	11440300K317280672	不适用。
实际控制人报告期内控制的其他境内外上市公司的股权情况	不适用。					

报告期内，公司实际控制人未发生变更。截至报告期末，公司与实际控制人之间的产权及控制关系图如下：



实际控制人未通过信托或其他资产管理方式控制公司。

**（五）公司控股股东或第一大股东及其一致行动人累计质押股份数量占其所持公司股份数量比例达到 80%**

不适用。

**（六）其他持股在 10%以上的法人股东**

公司无其他持股在10%以上的法人股东。

**（七）控股股东、实际控制人、重组方及其他承诺主体股份限制减持情况**

公司控股股东深投控，股东华润信托、云南合和、一汽投资等承诺主体已作出相关股份限售、不减持承诺，详见本报告第六节“一、承诺事项履行情况”。

#### 四、股份回购在报告期的具体实施情况

**（一）股份回购的实施进展情况**

不适用。

**（二）采用集中竞价交易方式减持回购股份的实施进展情况**

不适用。



## 第八节 优先股相关情况

公司未发行优先股。

## 第九节 债券相关情况

### 一、企业债券

报告期内，公司不存在企业债券。

### 二、公司债券

#### (一) 公司债券基本信息

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司 2018 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）	18 国信 03	112740	2018 年 8 月 3 日	2018 年 8 月 8 日	2021 年 8 月 8 日	-	3.97	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2018 年非公开发行公司债券（第三期）	18 国信 04	114408	2018 年 11 月 16 日	2018 年 11 月 19 日	2021 年 11 月 19 日	-	4.15	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第一期）	19 国信 01	114429	2019 年 3 月 7 日	2019 年 3 月 11 日	2022 年 3 月 11 日	-	4.05	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第二期）	19 国信 02	114457	2019 年 4 月 3 日	2019 年 4 月 8 日	2022 年 4 月 8 日	-	4.00	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第三期）	19 国信 03	114512	2019 年 7 月 3 日	2019 年 7 月 4 日	2022 年 7 月 4 日	40	4.00	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第一期）	20 国信 01	114650	2020 年 1 月 9 日	2020 年 1 月 13 日	2023 年 1 月 13 日	30	3.60	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第二期）	20 国信 02	114673	2020 年 2 月 27 日	2020 年 3 月 2 日	2023 年 3 月 2 日	50	3.17	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行永续次级债券（第一期）	20 国信 Y1	115117	2020 年 7 月 9 日	2020 年 7 月 13 日	2025 年 7 月 13 日	50	4.50	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司非公开发行 2020 年永续次级债券（第二期）	20 国信 Y2	115119	2020 年 9 月 15 日	2020 年 9 月 17 日	2025 年 9 月 17 日	50	4.80	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）	20 国信 03	149325	2020 年 12 月 9 日	2020 年 12 月 14 日	2021 年 12 月 24 日	-	3.35	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	20 国信 04	149326	2020 年 12 月 9 日	2020 年 12 月 14 日	2022 年 12 月 14 日	25	3.60	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）	20 国信 05	149334	2020 年 12 月 17 日	2020 年 12 月 22 日	2021 年 12 月 27 日	-	3.15	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）	20 国信 06	149335	2020 年 12 月 17 日	2020 年 12 月 22 日	2023 年 12 月 22 日	20	3.70	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）	21 国信 01	149374	2021 年 1 月 27 日	2021 年 2 月 1 日	2022 年 2 月 11 日	-	3.15	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	21 国信 02	149375	2021 年 1 月 27 日	2021 年 2 月 1 日	2024 年 2 月 1 日	20	3.64	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第一期）	21 国信 Y1	115123	2021 年 4 月 8 日	2021 年 4 月 12 日	2026 年 4 月 12 日	50	4.55	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第二期）	21 国信 Y2	115124	2021 年 4 月 22 日	2021 年 4 月 26 日	2026 年 4 月 26 日	50	4.38	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种一）	21 国信 03	149535	2021 年 7 月 2 日	2021 年 7 月 6 日	2024 年 7 月 6 日	20	3.35	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	21 国信 04	149536	2021 年 7 月 2 日	2021 年 7 月 6 日	2026 年 7 月 6 日	30	3.68	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	21 国信 05	149557	2021 年 7 月 19 日	2021 年 7 月 21 日	2024 年 7 月 21 日	24	3.16	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	21 国信 06	149558	2021 年 7 月 19 日	2021 年 7 月 21 日	2026 年 7 月 21 日	33	3.48	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	21 国信 07	149544	2021 年 9 月 13 日	2021 年 9 月 15 日	2024 年 9 月 15 日	27	3.09	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种一)	21 国信 10	149673	2021 年 10 月 20 日	2021 年 10 月 22 日	2024 年 10 月 22 日	40	3.28	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种二)	21 国信 11	149674	2021 年 10 月 20 日	2021 年 10 月 22 日	2026 年 10 月 22 日	10	3.63	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	21 国信 12	149709	2021 年 11 月 19 日	2021 年 11 月 23 日	2024 年 11 月 23 日	30	3.09	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	21 国信 13	149710	2021 年 11 月 19 日	2021 年 11 月 23 日	2026 年 11 月 23 日	20	3.43	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	22 国信 01	149775	2022 年 1 月 7 日	2022 年 1 月 11 日	2025 年 1 月 11 日	30	2.92	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	22 国信 02	149776	2022 年 1 月 7 日	2022 年 1 月 11 日	2027 年 1 月 11 日	10	3.28	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	22 国信 03	149807	2022 年 2 月 22 日	2022 年 2 月 24 日	2025 年 2 月 24 日	5	2.95	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	22 国信 04	149849	2022 年 3 月 23 日	2022 年 3 月 25 日	2025 年 3 月 25 日	21	3.17	采用单利按年计息, 不计复利。每年付息一次, 最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第一期)	22 国信 D1	149872	2022 年 4 月 1 日	2022 年 4 月 6 日	2023 年 4 月 6 日	30	2.58	到期一次还本付息	深交所
投资者适当性安排(如有)	上述债券面向拥有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的合格 A 股证券账户的专业投资者(法律、法规禁止购买者除外)公开发行。								
公司债券上市或转让的交易场所	深交所								
是否存在终止上市交易的风险(如有)和应对措施	不适用。								

公司不存在逾期未偿还债券。

## (二) 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

不适用。

## (三) 中介机构的情况

中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	中介机构联系人	联系电话
广发证券股份有限公司	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦	-	祝磊	020-66338888
中泰证券股份有限公司	北京市东城区朝阳门北大街 9 号泓晟国际中心 17 层	-	廖青云、李越	010-59013962
中国银河证券股份有限公司	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦	-	陈曲、邓小霞	010-80927231
中信证券股份有限公司	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座	-	冯源、张陈灵	0755-23835062
国泰君安证券股份有限公司	上海市静安区新闻路 669 博华广场 33 楼	-	戴蕴乐	13761888977
联合资信评估股份有限公司	北京市朝阳区建外大街 2 号院 2 号楼 17 层	-	张帆、陈凝	010-85679696
中诚信国际信用评级有限责任公司	北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101	-	张璐、高阳	010-66428877

天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼	张云鹤、谢军、 崔永强、黄燕	黄燕	020-37600380
北京市天元律师事务所	北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 B 座 10 层	-	支毅、敖华芳、 曾雪荧	010-57763888
北京德恒律师事务所	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层	-	罗元清、龚东旭	0755-88286488
广东信达律师事务所	广东省深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 11、12 楼	-	石之恒、叶子	0755-88265288

报告期内上述机构未发生变化。

#### (四) 募集资金使用情况

债券名称	募集资金 总金额 (亿元)	已使用金额 (亿元)	未使用金额 (亿元)	募集资金 专项账户 运作情况 (如有)	募集资金违 规使用的整 改情况 (如有)	是否与募集说明 书承诺的用途、 使用计划及其他 约定一致
国信证券股份有限公司 2018 年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)	37	37	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2018 年非公开发行公司债券(第三期)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第一期)	15	15	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第二期)	35	35	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第三期)	40	40	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第一期)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第二期)	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	25	25	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	25	25	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	24	24	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	33	33	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	27	27	-	无	无	是

债券名称	募集资金 总金额 (亿元)	已使用金额 (亿元)	未使用金额 (亿元)	募集资金 专项账户 运作情况 (如有)	募集资金违 规使用的整 改情况 (如有)	是否与募集说明 书承诺的用途、 使用计划及其他 约定一致
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种一）	40	40	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）（品种二）	10	10	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第六期）（品种一）	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第六期）（品种二）	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	10	10	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）	5	5	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）	21	21	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行永续次级债券（第一期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司非公开发行 2020 年永续次级债券（第二期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第一期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第二期）	50	50	-	无	无	是

报告期内，公司募集资金未用于建设项目，未变更上述债券募集资金用途。

#### （五）报告期内信用评级结果调整情况

无。

#### （六）担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行情况和变化情况及对债券投资者权益的影响

不适用。

### 三、非金融企业债务融资工具

报告期内，公司不存在非金融企业债务融资工具。

### 四、可转换公司债券

报告期内，公司不存在可转换公司债券。

## 五、报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

不适用。

## 六、报告期末除债券外的有息债务逾期情况

不适用。

## 七、报告期内是否有违反规章制度的情况

报告期内，公司无违反法律法规、公司章程、信息披露事务管理制度规定的情况以及债券募集说明书约定或承诺的情况。

## 八、截至报告期末公司近两年的主要会计数据和财务指标

单位：万元

项目	本报告期末	上年末	本报告期末比上年末增减
流动比率	1.96	1.81	8.29%
资产负债率	67.15%	66.70%	上升 0.45 个百分点
速动比率	1.96	1.81	8.29%
项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
扣除非经常性损益后净利润	985,236.05	681,483.45	44.57%
EBITDA 全部债务比	10.44%	8.74%	上升 1.70 个百分点
利息保障倍数	3.59	3.29	9.12%
现金利息保障倍数	0.13	0.54	-75.93%
EBITDA 利息保障倍数	3.69	3.37	9.50%
贷款偿还率	100.00%	100.00%	-
利息偿付率	100.00%	100.00%	-

## 九、公司其他债务融资工具

### (一) 短期融资券

债券简称	起息日	到期日	发行规模(亿元)	利率(%)	付息兑付情况
20国信证券CP012	2020年10月14日	2021年1月12日	30	2.80	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP013	2020年10月28日	2021年1月26日	30	3.12	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP014	2020年11月25日	2021年2月23日	35	3.33	已按时兑付本金及利息
20国信证券CP015	2020年12月14日	2021年3月12日	35	2.94	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP001	2021年1月7日	2021年4月7日	35	2.53	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP002	2021年1月28日	2021年4月28日	35	2.89	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP003	2021年2月8日	2021年5月7日	40	3.03	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP004	2021年3月11日	2021年6月9日	40	2.67	已按时兑付本金及利息



21国信证券CP005	2021年4月12日	2021年7月9日	40	2.65	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP006	2021年5月17日	2021年8月13日	35	2.42	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP007	2021年6月15日	2021年9月10日	40	2.49	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP008	2021年7月15日	2021年10月13日	40	2.39	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP009	2021年8月5日	2021年10月29日	40	2.36	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP010	2021年8月25日	2021年11月23日	40	2.35	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP011	2021年9月1日	2021年12月1日	40	2.40	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP012	2021年9月8日	2022年9月8日	20	2.70	未到付息日
21国信证券CP013	2021年10月13日	2022年1月12日	7	2.55	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP014	2021年10月13日	2022年4月12日	30	2.70	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP015	2021年10月21日	2022年1月20日	10	2.60	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP016	2021年10月21日	2022年4月21日	20	2.77	未到付息日
21国信证券CP017	2021年11月1日	2022年11月1日	45	2.86	未到付息日
21国信证券CP018	2021年11月4日	2022年3月4日	20	2.65	已按时兑付本金及利息
21国信证券CP019	2021年11月4日	2022年5月10日	20	2.73	未到付息日
22国信证券CP001	2022年2月10日	2023年2月10日	30	2.50	未到付息日
22国信证券CP002	2022年2月15日	2022年6月15日	10	2.33	未到付息日
22国信证券CP003	2022年2月17日	2022年6月17日	25	2.32	未到付息日
22国信证券CP004	2022年2月21日	2023年2月21日	15	2.49	未到付息日
22国信证券CP005	2022年3月1日	2022年8月5日	17	2.45	未到付息日
22国信证券CP006	2022年3月1日	2023年3月1日	23	2.58	未到付息日
22国信证券CP007	2022年3月7日	2022年9月14日	15	2.47	未到付息日
22国信证券CP008	2022年3月14日	2022年6月14日	15	2.40	未到付息日
22国信证券CP009	2022年4月12日	2022年11月11日	15	2.40	未到付息日
22国信证券CP010	2022年4月12日	2023年4月12日	15	2.52	未到付息日

## （二）收益凭证

报告期内，公司累计发行889期收益凭证，募集资金132亿元，均按时兑付本金及利息。收益凭证期末存量规模为28亿元。

## 第十节 财务报告

### 一、审计报告

审计意见类型	无保留审计意见
审计报告签署日期	2022 年 4 月 18 日
审计机构名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
审计报告文号	天健审[2022]7-186 号
注册会计师姓名	燕玉嵩、黄燕

审计报告正文附后。

### 二、财务报表

公司财务报表及附注附后。

## 第十一节 证券公司信息披露

### 一、报告期内公司重大行政许可事项的相关情况

序号	发文日期	批复文件	文号
1	2021 年 2 月 4 日	中国证监会《关于同意国信证券股份有限公司向专业投资者公开发行次级债券注册的批复》	证监许可[2021]416 号
2	2021 年 6 月 2 日	中国证监会《关于国信证券股份有限公司试点开展基金投资顾问业务有关事项的复函》	机构部函[2021]1680 号
3	2021 年 6 月 9 日	中国证监会《关于同意国信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》	证监许可[2021]1976 号
4	2021 年 11 月 30 日	中国证监会《关于国信证券股份有限公司申请开展账户管理功能优化试点业务的监管意见书》	机构部函[2021]3752 号
5	2021 年 12 月 22 日	中国证监会《关于同意国信证券股份有限公司向专业投资者公开发行短期公司债券注册的批复》	证监许可[2021]3998 号

### 二、监管部门对公司的分类结果

根据中国证监会《证券公司分类监管规定》，公司近三年分类评价情况为：

	2021 年	2020 年	2019 年
分类评价	AA	AA	AA



法定代表人： / (Signature) /

董事会批准报送日期：2022年4月18日

国信证券股份有限公司  
2021年度合并审计报告

# 目 录

一、审计报告	第 1-6 页
二、财务报表	第 7-16 页
(一) 合并资产负债表	第 7 页
(二) 母公司资产负债表	第 8 页
(三) 合并利润表	第 9 页
(四) 母公司利润表	第 10 页
(五) 合并现金流量表	第 11 页
(六) 母公司现金流量表	第 12 页
(七) 合并所有者权益变动表	第 13-14 页
(八) 母公司所有者权益变动表	第 15-16 页
三、财务报表附注	第 17-154 页

# 审计报告

天健审〔2022〕7-186号

国信证券股份有限公司全体股东：

## 一、 审计意见

我们审计了国信证券股份有限公司（以下简称国信证券）财务报表，包括2021年12月31日的合并及母公司资产负债表，2021年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表，以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国信证券2021年12月31日的合并及母公司财务状况，以及2021年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

## 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国信证券，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 三、 关键审计事项

关键审计事项是我们根据职业判断，认为对本期财务报表审计最为重要的事项。这些事项的应对以对财务报表整体进行审计并形成审计意见为背景，我们不

对这些事项单独发表意见。

## （一）融出资金及买入返售金融资产的减值

### 1. 事项描述

详见财务报表附注三(十)和五(一)3、7。

截至2021年12月31日，国信证券融出资金及买入返售金融资产账面价值合计人民币687.44亿元，占总资产的18.97%；减值准备合计为人民币14.63亿元。

国信证券管理层（以下简称管理层）运用预期信用损失模型确定融出资金及买入返售金融资产减值准备的过程中涉及较多关键参数和假设的应用，包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露等，这些参数的选取和假设的应用涉及管理层的判断。

由于上述金融资产金额重大，预期信用损失模型涉及较多参数和假设，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

### 2. 审计应对

针对融出资金、买入返售金融资产减值，我们实施的审计程序主要包括：

（1）了解与金融工具投资审批、投后管理、信用评级、质押品管理以及金融工具减值准备计提相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

（2）对预期信用损失模型及相关参数和假设的合理性进行评估，包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露等，并评估其中所涉及的关键管理层判断的合理性；

（3）选取样本，检查预期信用损失模型的主要输入值是否正确，包括信用风险敞口和损失率等；

（4）对于已发生信用减值的金融资产，抽取样本，检查管理层基于相关债务人的财务信息以及担保物的最新评估价值计算的预期信用损失是否适当；

（5）检查与融出资金及买入返售金融资产减值准备相关的信息是否已在财务报表中作出恰当列报。

## （二）金融工具公允价值的计量

## 1. 事项描述

详见财务报表附注三(十)和附注十。

截至 2021 年 12 月 31 日, 国信证券公允价值属于第二层次的金融资产账面价值计人民币 1,659.67 亿元、属于第三层次的金融资产账面价值计人民币 71.44 亿元, 该等金融资产账面价值合计人民币 1,731.12 亿元; 公允价值属于第二层次、第三层次的金融负债账面价值合计人民币 5.88 亿元。

管理层对该等金融资产及金融负债的估值以市场数据和估值模型为基础, 估值模型通常需要大量可观察或不可观察的输入值, 输入值的确定涉及管理层的重大判断和估计。

由于该等金融资产和金融负债的估值较为复杂, 且该等金融资产和金融负债对财务报表的影响重大, 因此我们将该事项确定为关键审计事项。

## 2. 审计应对

针对金融工具公允价值的计量, 我们实施的审计程序主要包括:

(1) 了解与金融工具公允价值计量相关的关键内部控制, 评价这些控制的设计, 确定其是否得到执行, 并测试相关内部控制的运行有效性;

(2) 针对公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具, 抽取样本检查合同, 了解合同条款并识别与金融工具估值相关的条款;

(3) 评价国信证券用于公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具的估值模型, 并抽取样本检查估值结果是否正确;

(4) 评价财务报表附注中的相关披露是否符合企业会计准则披露要求, 恰当反映了金融工具的估值风险。

## (三) 结构化主体合并的判断

### 1. 事项描述

详见财务报表附注八(一)2。

截至 2021 年 12 月 31 日, 国信证券纳入合并财务报表合并范围的结构化主体总资产计人民币 68.88 亿元。

国信证券投资了若干结构化主体, 包括资产管理计划、信托计划和有限合伙企业等。国信证券对结构化主体合并的判断主要是从是否对结构化主体拥有权力、



通过参与结构化主体的相关活动而享有可变回报、并且有能力运用对结构化主体的权力影响其回报三要素进行分析。管理层通过综合评估其持有的份额相应享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬，其由此获取的可变回报的影响是否重大，判断是否对结构化主体形成控制，进而确定是否纳入财务报表的合并范围。

由于对结构化主体是否形成控制涉及管理层的重大判断，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

## 2. 审计应对

针对结构化主体合并事项的判断，我们实施的审计程序主要包括：

(1) 了解相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

(2) 获取结构化主体相关合同，从国信证券对结构化产品拥有的权力、结构化主体享有的可变回报以及运用权力影响回报金额的能力等方面评价管理层做出的判断是否合理；

(3) 选取样本复核国信证券在结构化主体中享有的收益情况，检查国信证券运用对结构化主体的权力影响其回报金额；

(4) 评价国信证券是否已按照企业会计准则的要求对已合并的结构化主体予以恰当列报。

## 四、其他信息

管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报

告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## **五、管理层和治理层对财务报表的责任**

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估国信证券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

国信证券治理层（以下简称治理层）负责监督国信证券的财务报告过程。

## **六、注册会计师对财务报表审计的责任**

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。

（三）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审

计证据,就可能导致对国信证券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致国信证券不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

(六) 就国信证券中实体或业务活动的财务信息获取充分、适当的审计证据,以对财务报表发表审计意见。我们负责指导、监督和执行集团审计,并对审计意见承担全部责任。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们还就已遵守与独立性相关的职业道德要求向治理层提供声明,并与治理层沟通可能被合理认为影响我们独立性的所有关系和其他事项,以及相关的防范措施(如适用)。

从与治理层沟通过的事项中,我们确定哪些事项对本期财务报表审计最为重要,因而构成关键审计事项。我们在审计报告中描述这些事项,除非法律法规禁止公开披露这些事项,或在极少数情形下,如果合理预期在审计报告中沟通某事项造成的负面后果超过在公众利益方面产生的益处,我们确定不应在审计报告中沟通该事项。

天健会计师事务所(特殊普通合伙)



中国注册会计师:  
(项目合伙人)


中国注册会计师:


二〇二二年四月十八日



# 合并资产负债表

2021年12月31日

会证01表

单位:人民币元

编制单位: 天风证券股份有限公司

资产	注释号	期末数	上年年末数	负债和所有者权益	注释号	期末数	上年年末数
资产:				负债:			
货币资金	1	67,721,741,037.30	65,907,024,176.35	短期借款	21	225,270,000.00	345,968,514.70
其中: 客户货币存款		61,981,079,320.72	56,956,760,965.48	应付短期融资款	22	19,800,032,805.99	25,929,529,064.64
结算备付金	2	17,087,824,020.77	11,040,352,801.73	拆入资金	23	4,456,797,971.98	6,431,051,598.96
其中: 客户备付金		13,271,519,488.47	8,493,814,481.23	交易性金融负债	24	460,982,751.10	51,919,972.78
贵金属				衍生金融负债	4	226,049,508.29	331,446,474.45
拆出资金				卖出回购金融负债	25	96,324,929,451.62	72,147,251,985.41
融出资金	3	61,973,311,849.43	49,754,594,021.25	代理买卖证券款	26	67,280,292,116.73	59,746,265,229.99
衍生金融资产	4	57,966,861.36	6,246,609.85	代理承销证券款		27,000,000.00	
存出保证金	5	7,587,572,329.43	5,679,295,902.00	应付职工薪酬	27	6,491,980,890.61	4,049,005,797.72
应收款项	6	1,432,595,710.21	1,335,376,311.05	应交税费	28	831,179,119.44	1,275,075,398.54
应收款项融资				应付款项	29	5,274,979,125.00	5,698,183,925.04
合同资产				合同负债		38,695,953.33	11,617,118.12
买入返售金融资产	7	6,770,994,407.11	16,180,470,538.38	持有待售负债			
持有待售资产				预计负债	30	193,658,275.07	517,647,128.86
金融投资:				长期借款			
交易性金融资产	8	152,312,123,275.04	106,759,351,951.46	应付债券	31	51,002,487,491.65	35,346,203,901.79
债权投资				其中: 优先股			
其他债权投资	9	29,614,274,446.31	24,740,982,476.30	永续债			
其他权益工具投资	10	7,186,022,265.21	11,762,890,145.34	租赁负债	32	147,016,739.86	
长期股权投资	11	3,561,339,626.20	3,624,776,475.45	递延收益	33	126,289,655.52	129,765,517.56
投资性房地产	12	288,437,302.31	299,038,217.57	递延所得税负债	18	696,692,082.18	540,412,928.09
固定资产	13	2,679,899,426.29	1,264,624,891.45	其他负债	34	11,270,188,929.29	8,677,062,307.45
在建工程	14	23,856,786.53	1,024,455,983.69	负债合计		265,374,522,867.68	221,831,406,864.10
使用权资产	15	459,797,270.46		所有者权益:			
无形资产	16	683,511,764.96	665,688,976.68	股本	35	9,612,429,377.00	9,612,429,377.00
其中: 交易席位费		29,752,745.38	29,752,745.38	其他权益工具	36	20,000,000,000.00	10,000,000,000.00
商誉	17	10,260,249.61	10,260,249.61	其中: 优先股			
递延所得税资产	18	2,352,914,177.11	2,282,630,643.88	永续债		20,000,000,000.00	10,000,000,000.00
其他资产	19	466,999,213.28	517,806,955.80	资本公积	37	20,155,672,569.84	20,155,606,605.47
				减: 库存股			
				其他综合收益	38	-57,553,022.01	409,183,804.50
				盈余公积	39	4,867,817,456.10	4,867,817,456.10
				一般风险准备	40	14,748,272,660.25	12,997,499,548.86
				未分配利润	41	27,583,471,105.99	22,864,880,451.81
				归属于母公司所有者权益合计		96,910,110,147.17	80,907,417,243.74
				少数股东权益		16,809,304.09	17,052,300.00
				所有者权益合计		96,926,919,451.26	80,924,469,443.74
资产总计		362,301,442,318.92	302,755,876,307.84	负债和所有者权益总计		362,301,442,318.92	302,755,876,307.84

法定代表人:

*(Handwritten signature)*

主管会计工作的负责人:

*(Handwritten signature)*

会计机构负责人:

*(Handwritten signature)*





# 公司资产负债表

2021年12月31日

会计01表

单位:人民币元

编制单位: 国信证券股份有限公司

资产	注释号	期末数	上年年末数	负债和所有者权益	注释号	期末数	上年年末数
资产:				负债:			
货币资金		57,278,391,282.14	57,228,193,612.65	短期借款			
其中: 客户资金存款		53,362,210,016.47	50,439,566,770.32	应付短期融资款		19,800,032,805.99	25,929,529,064.64
结算备付金		16,125,066,699.89	10,334,219,307.11	拆入资金		4,456,797,971.98	6,434,051,598.96
其中: 客户备付金		11,987,961,729.38	7,545,594,168.34	交易性金融负债		295,918,604.98	
贵金属				衍生金融负债		224,145,498.63	331,446,474.45
拆出资金				卖出回购金融资产款		96,524,929,451.62	72,082,115,069.40
融出资金		61,589,558,853.70	40,339,266,002.65	代理买卖证券款		65,706,354,303.07	58,303,223,718.23
衍生金融资产		27,794,294.99	6,246,609.95	代理承销证券款		27,000,000.00	
存出保证金		2,918,235,647.08	2,430,628,577.70	应付职工薪酬	2	6,130,416,109.62	4,456,056,077.62
应收款项		1,204,642,509.49	1,048,552,018.19	应交税费		667,451,942.94	1,199,830,890.30
应收款项融资				应付款项		3,688,333,863.70	2,956,169,165.38
合同资产				合同负债			
买入返售金融资产		6,705,815,751.94	15,740,434,532.50	持有待售负债			
持有待售资产				预计负债		185,482,275.07	517,647,128.86
金融投资:				长期借款			
交易性金融资产		142,789,934,508.61	96,894,811,743.20	应付债券		51,002,487,491.65	35,346,203,901.79
债权投资				其中: 优先股			
其他债权投资		29,644,274,446.31	24,740,982,476.30	永续债			
其他权益工具投资		9,336,723,718.55	14,218,399,187.50	租赁负债		386,086,403.74	
长期股权投资	1	10,772,737,983.91	10,108,022,987.39	递延收益		126,289,655.52	129,765,517.56
投资性房地产		308,015,431.32	300,893,516.89	递延所得税负债		444,214,710.51	181,133,997.87
固定资产		2,628,663,982.14	1,228,814,139.79	其他负债		1,004,728,484.13	272,179,129.73
在建工程		23,856,786.53	1,024,455,963.69	负债合计		250,670,689,575.15	208,139,351,734.79
使用权资产		398,952,605.83		所有者权益:			
无形资产		673,390,769.71	655,521,164.26	股本		9,612,429,377.00	9,612,429,377.00
其中: 交易席位费		29,752,745.38	29,752,745.38	其他权益工具		20,000,000,000.00	10,000,000,000.00
商誉				其中: 优先股			
递延所得税资产		2,198,255,042.86	1,945,332,425.95	永续债		20,000,000,000.00	10,000,000,000.00
其他资产		375,365,156.94	450,735,496.36	资本公积		20,155,290,373.72	20,155,224,409.35
				减: 库存股			
				其他综合收益		-40,488,129.77	113,780,261.14
				盈余公积		4,867,817,456.10	4,867,817,456.10
				一般风险准备		14,748,272,660.25	12,997,499,548.86
				未分配利润		24,985,664,357.49	21,809,406,974.74
				所有者权益合计		94,329,006,094.79	79,556,158,027.19
资产总计		344,999,675,669.94	287,695,509,761.98	负债和所有者权益总计		344,999,675,669.94	287,695,509,761.98

法定代表人:

*Handwritten signature*

主管会计工作的负责人:

*Handwritten signature*

会计机构负责人:

*Handwritten signature*





# 合并利润表

2021年度

会证02表

单位：人民币元

编制单位：国信证券股份有限公司

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、营业总收入		23,818,037,003.89	18,784,071,244.98
利息净收入	1	2,410,623,946.47	3,148,046,602.97
其中：利息收入		7,521,117,559.58	6,986,525,882.21
利息支出		5,110,493,613.11	3,838,479,279.24
手续费及佣金净收入	2	10,032,871,608.65	8,976,980,866.40
其中：经纪业务手续费净收入		7,194,547,317.39	6,423,741,727.13
投资银行业务手续费净收入		1,979,271,263.30	1,892,311,349.05
资产管理业务手续费净收入		242,758,990.76	275,790,905.60
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	3	7,436,131,228.53	4,893,511,932.71
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		879,545,654.36	517,520,674.47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			
净敞口套期收益			
其他收益	4	26,672,382.03	25,303,517.77
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5	1,740,440,175.39	67,091,213.94
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-637,899.25	-5,989,611.63
其他业务收入	6	2,172,196,369.91	1,679,338,938.36
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-260,807.84	-212,215.54
二、营业总支出	7	11,524,145,787.29	10,151,081,828.36
税金及附加		143,353,979.51	127,269,955.99
业务及管理费	8	9,732,464,216.38	7,369,738,398.99
信用减值损失	9	-521,450,633.96	996,512,179.82
其他资产减值损失	10	96,261.07	5,893,797.90
其他业务成本	11	2,169,681,964.29	1,651,667,495.66
三、营业利润（亏损总额以“-”号填列）		12,293,891,216.60	8,632,989,416.62
加：营业外收入	12	47,859,922.67	40,936,763.90
减：营业外支出	13	-292,741,019.70	330,317,690.43
四、利润总额（净亏损以“-”号填列）		12,634,492,158.97	8,343,608,490.09
减：所得税费用	14	2,517,436,992.87	1,725,322,402.28
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,117,055,166.10	6,618,286,087.81
（一）按经营持续性分类：			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		10,117,055,166.10	6,618,286,087.81
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. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”号填列）		10,114,758,795.89	6,615,739,471.11
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		2,296,370.21	2,546,616.70
六、其他综合收益的税后净额	15	-989,773,100.12	213,786,241.25
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-989,773,100.12	213,786,241.25
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-1,101,664,269.57	337,178,143.07
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		-1,101,664,269.57	337,178,143.07
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		111,891,169.45	-123,391,901.82
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-37,259,514.75	9,345,518.85
2. 其他债权投资公允价值变动		117,990,781.13	-308,098,942.35
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用减值准备		49,397,654.52	202,640,896.27
5. 现金流量套期储备		15,537,974.68	
6. 外币财务报表折算差额		-33,775,729.13	-27,279,374.59
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		9,127,282,065.98	6,832,072,329.06
归属于母公司所有者的综合收益总额		9,124,985,695.77	6,829,525,712.36
归属于少数股东的综合收益总额		2,296,370.21	2,546,616.70
八、每股收益：			
（一）基本每股收益		0.97	0.72
（二）稀释每股收益		0.97	0.72

法定代表人：

主管会计工作的负责人：

会计机构负责人：

11/20/21 (Handwritten signature) (Handwritten signature) (Handwritten signature)



# 母 公 司 利 润 表

2021年度

会证02表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	注释号	本期数	上年同期数
一、营业总收入		19,319,474,142.84	16,271,091,003.37
利息净收入	1	2,217,114,146.24	2,967,076,217.65
其中：利息收入		7,245,046,397.74	6,669,735,466.47
利息支出		5,027,932,251.50	3,702,659,248.82
手续费及佣金净收入	2	9,199,816,671.79	8,514,704,201.02
其中：经纪业务手续费净收入		6,698,357,083.32	6,111,962,854.04
投资银行业务手续费净收入		1,958,519,029.91	1,847,347,273.76
资产管理业务手续费净收入		215,252,820.65	257,489,192.55
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	3	6,600,415,580.21	4,887,575,609.68
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		510,891,840.34	330,650,400.18
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			
净敞口套期收益			
其他收益		25,995,834.40	24,451,316.47
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4	1,240,226,559.72	-149,745,598.34
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,920,246.58	-7,361,762.45
其他业务收入		39,178,485.21	34,598,334.41
资产处置收益（损失以“-”号填列）		-352,888.15	-207,315.07
二、营业总支出		8,931,905,311.24	7,928,119,714.94
税金及附加		134,569,352.30	121,880,046.30
业务及管理费	5	9,003,513,900.86	6,828,036,518.73
信用减值损失		-217,538,746.30	967,096,812.91
其他资产减值损失			
其他业务成本		11,360,804.38	11,106,337.00
三、营业利润（亏损总额以“-”号填列）		10,387,568,831.60	8,342,971,288.43
加：营业外收入		39,708,225.69	12,398,385.64
减：营业外支出		-302,705,506.55	325,767,943.12
四、利润总额（净亏损以“-”号填列）		10,729,982,563.84	8,029,601,730.95
减：所得税费用		2,049,886,905.37	1,474,083,345.50
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,680,095,658.47	6,555,518,385.45
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		8,680,095,658.47	6,555,518,385.45
（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		-784,954,798.53	265,097,159.73
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-950,239,595.44	383,938,356.01
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		-950,239,595.44	383,938,356.01
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		165,284,796.91	-118,841,196.28
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-2,103,641.74	-13,383,150.20
2. 其他债权投资公允价值变动		117,990,784.13	-308,098,942.35
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用减值准备		49,397,654.52	202,640,896.27
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		7,895,140,859.94	6,820,615,545.18

法定代表人：

*王*

主管会计工作的负责人：

*王*

会计机构负责人：

*王*

# 合并现金流量表

2021年度


会证03表

单位：人民币元

编制单位：国信证券股份有限公司

项目	注释号	本期数	上年同期数
<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			
其他权益工具投资净减少额		4,298,995,275.24	
收取利息、手续费及佣金的现金		18,917,863,890.58	17,263,686,641.52
拆入资金净增加额			1,120,000,000.00
回购业务资金净增加额		34,429,984,709.98	37,229,653,639.60
代理买卖证券收到的现金净额		7,532,458,629.50	13,156,178,075.12
代理承销证券收到的现金净额		27,000,000.00	
收到其他与经营活动有关的现金	1	5,900,788,965.09	5,526,873,373.12
经营活动现金流入小计		71,107,091,470.39	74,296,391,729.36
为交易目的而持有的金融资产净增加额		36,239,559,355.89	40,036,665,085.28
其他债权投资净增加额		3,778,655,061.81	6,397,094,054.08
拆入资金净减少额		1,975,000,000.00	
融出资金净增加额		12,030,664,789.79	12,091,497,422.23
其他权益工具投资净增加额			1,282,030,858.71
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		4,143,227,241.92	3,066,186,345.19
支付给职工以及为职工支付的现金		6,057,685,882.62	4,842,008,898.50
支付的各项税费		3,748,188,377.98	2,745,497,204.62
支付其他与经营活动有关的现金	2	9,849,498,590.69	7,307,688,411.93
经营活动现金流出小计		77,822,479,300.70	77,768,668,280.54
经营活动产生的现金流量净额	4	-6,715,387,830.31	-3,472,276,551.18
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		862,693,692.50	288,577,793.30
取得投资收益收到的现金		279,059,166.45	1,892,452.18
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		5,295,248.64	1,752,120.34
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		1,147,048,107.59	292,222,365.82
投资支付的现金		135,963,905.72	360,558,962.25
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		603,905,378.52	740,071,085.24
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			19,247,067.16
投资活动现金流出小计		739,869,284.24	1,119,877,114.65
投资活动产生的现金流量净额		407,178,823.35	-827,654,748.83
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		10,000,000,000.00	24,787,735,832.80
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		6,071,868,755.90	7,421,652,363.67
发行债券收到的现金		101,292,171,000.00	105,461,612,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		117,364,039,755.90	137,671,000,196.47
偿还债务支付的现金		98,248,279,667.24	106,846,820,354.53
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		4,646,344,379.57	4,167,775,185.46
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		1,127,000.00	2,740,794.37
支付其他与筹资活动有关的现金	3	267,220,827.47	5,042,157,418.01
筹资活动现金流出小计		103,161,844,874.28	116,056,752,958.00
筹资活动产生的现金流量净额		14,202,194,881.62	21,614,247,238.47
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-61,758,223.12	-120,562,417.62
五、现金及现金等价物净增加额	4	7,832,227,651.54	17,193,753,490.84
加：期初现金及现金等价物余额	4	76,782,025,659.57	59,588,272,168.73
六、期末现金及现金等价物余额	4	84,614,253,311.11	76,782,025,659.57

法定代表人：  主管会计工作的负责人：

会计机构负责人： 





# 母公司现金流量表

2021年度

会证03表

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
<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			
其他权益工具投资净减少额		4,323,355,275.24	
收取利息、手续费及佣金的现金		17,807,336,647.42	16,535,850,408.23
拆入资金净增加额			1,120,000,000.00
回购业务资金净增加额		33,794,379,235.80	36,525,798,994.86
代理承销证券收到的现金净额		27,000,000.00	
代理买卖证券收到的现金净额		7,401,562,329.60	12,768,740,527.47
收到其他与经营活动有关的现金		158,300,585.33	1,822,025,619.95
经营活动现金流入小计		63,511,934,073.39	68,772,415,550.51
为交易目的而持有的金融资产净增加额		36,224,141,721.08	42,452,306,132.47
其他债权投资净增加额		3,778,655,061.81	6,397,094,054.08
其他权益工具投资净增加额			1,282,030,858.71
拆入资金净减少额		1,975,000,000.00	
融出资金净增加额		12,062,127,530.74	11,925,012,074.70
返售业务资金净增加额			
支付利息、手续费及佣金的现金		4,089,516,919.22	3,011,520,253.16
支付给职工以及为职工支付的现金		5,749,722,042.14	4,598,353,463.97
支付的各项税费		3,431,588,257.04	2,562,470,947.52
支付其他与经营活动有关的现金		2,950,894,279.56	1,806,573,580.28
经营活动现金流出小计		70,261,645,811.59	74,035,361,364.89
经营活动产生的现金流量净额		-6,749,711,738.20	-5,262,945,814.38
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		2,783,081,030.19	976,866,941.25
取得投资收益收到的现金		279,059,166.45	731,892,452.18
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		5,064,946.84	1,719,955.85
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		3,067,205,143.48	1,710,479,349.28
投资支付的现金		4,229,564,044.50	2,012,910,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		587,938,494.31	722,565,699.55
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		4,817,502,538.81	2,735,475,699.55
投资活动产生的现金流量净额		-1,750,297,395.33	-1,024,996,350.27
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金		10,000,000,000.00	24,787,735,832.80
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		101,292,171,000.00	105,461,612,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		111,292,171,000.00	130,249,347,832.80
偿还债务支付的现金		92,066,721,000.00	99,513,542,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		4,640,639,397.55	4,155,377,545.77
支付其他与筹资活动有关的现金		236,492,426.06	5,038,178,618.01
筹资活动现金流出小计		96,943,852,823.61	108,737,098,163.78
筹资活动产生的现金流量净额		14,348,318,176.39	21,512,249,669.02
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-2,920,246.58	-7,361,762.45
五、现金及现金等价物净增加额		5,845,388,796.28	15,216,945,741.92
加：期初现金及现金等价物余额		67,434,912,009.10	52,217,966,267.18
六、期末现金及现金等价物余额		73,280,300,805.38	67,434,912,009.10

法定代表人：/ /

主管会计工作的负责人：/ /

会计机构负责人：/ /

# 合并所有者权益变动表

2021年度

单位：人民币元

编制单位：国信证券股份有限公司	母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	股本		资本公积		盈余公积	其他综合收益	库存股	其他权益工具	未分配利润	一般风险准备		
	优先股	普通股	其他	其他	其他	其他	其他					
一、上年年末余额	9,612,423,377.00	10,000,000,000.00	10,000,000,000.00	20,155,608,605.47	4,867,817,456.10	499,183,894.30			22,864,860,451.81	17,032,200.00	80,994,163,453.74	
加：会计政策变更												
前期差错更正												
同一控制下企业合并												
其他												
二、本年初余额	9,612,423,377.00	10,000,000,000.00	10,000,000,000.00	20,155,608,605.47	4,867,817,456.10	499,183,894.30			22,864,860,451.81	17,032,200.00	80,994,163,453.74	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）				65,964.37		-466,746,826.51			4,716,590,454.18	-242,695.01	16,002,450,007.52	
（一）综合收益总额						-389,773,100.12			10,114,728,755.89	2,295,370.21	9,127,290,045.98	
（二）所有者投入和减少资本										-1,544,066.08	9,998,455,933.72	
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												
1. 其他												
（三）利润分配												
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												
4. 其他												
（四）所有者权益内部结转												
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												
6. 其他												
（五）其他												
四、本期末余额	9,612,423,377.00	10,000,000,000.00	10,000,000,000.00	20,155,674,569.84	4,867,817,456.10	-77,562,932.01			27,581,450,905.99	16,308,301.09	96,925,919,151.29	



法定代表人：17 → 1009

主管会计工作的负责人：1210

会计机构负责人：1211



# 合并所有者权益变动表

2021年度

单位：人民币元

项目	上年同期数										所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益										
	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	少数股东权益		
一、上年年末余额	8,200,000.00	5,000,000.00	6,769,233,170.81		326,029,483.28	4,212,265,617.55	11,674,053,401.33	20,027,506,956.75	46,162,822.45	58,255,251,512.17	
加：会计政策变更											
前期差错更正											
同一控制下企业合并											
其他											
二、本年年初余额	8,200,000.00	5,000,000.00	6,769,233,170.81		326,029,483.28	4,212,265,617.55	11,674,053,401.33	20,027,506,956.75	46,162,822.45	58,255,251,512.17	
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	1,412,429,377.00	5,000,000.00	13,386,373,434.06		83,154,321.22	655,551,838.55	1,323,446,057.53	2,837,373,495.06	-29,110,622.45	24,609,217,901.57	
（一）综合收益总额					213,786,311.25			6,615,739,171.11		6,829,072,329.06	
（二）所有者投入和减少资本	1,412,429,377.00	5,000,000.00	13,369,127,837.79								
1. 所有者投入的普通股	1,412,429,377.00		13,369,127,837.79								
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						655,551,838.55	1,323,446,057.53	-3,508,957,895.08	-2,710,794.37	-1,822,740,794.37	
1. 提取盈余公积						655,551,838.55		-655,551,838.55			
2. 提取一般风险准备							1,323,446,057.53	-1,323,446,057.53			
3. 对所有者（或股东）的分配								-1,810,000,000.00	-2,710,794.37	-1,812,710,794.37	
4. 其他								-290,000,000.00		-290,000,000.00	
（四）所有者权益内部结转					-130,631,920.03			130,631,920.03			
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					-130,631,920.03			130,631,920.03			
6. 其他											
（五）其他			17,245,596.37							17,245,596.37	
四、本期末余额	9,612,429,377.00	10,000,000,000.00	20,155,606,605.47		409,183,803.50	4,867,817,456.10	12,997,499,458.86	22,841,860,451.81	17,632,200.00	80,923,493,413.74	

法定代表人：118m7 主管会计工作的负责人：RPU 审计机构负责人：PML



# 母公司所有者权益变动表

2021年度

会计报表  
单位：人民币元

编制单位：国盛证券股份有限公司	本期数									
	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
		优先股	永续债							
一、上年年末余额	9,612,429,977.00		10,000,000,000.00	20,155,224,409.35		113,780,261.11	4,867,817,456.10	12,897,499,548.86	21,809,106,974.71	79,556,158,027.19
加：会计政策变更										
前期差错更正										
其他										
二、本年年初余额	9,612,429,977.00		10,000,000,000.00	20,155,224,409.35		113,780,261.11	4,867,817,456.10	12,897,499,548.86	21,809,106,974.71	79,556,158,027.19
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)			10,000,000,000.00	65,961.37		-151,248,390.91		1,750,773,111.39	3,176,257,382.75	14,772,818,067.60
(一) 综合收益总额						-784,951,798.63			8,680,095,638.47	7,895,140,839.84
(二) 所有者投入和减少资本			10,000,000,000.00							10,000,000,000.00
1. 所有者投入的普通股										
2. 其他权益工具持有者投入资本			10,000,000,000.00							10,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额										
4. 其他										
(三) 利润分配								1,750,773,111.39	-1,873,131,888.10	-3,122,358,756.71
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备								1,750,773,111.39	-1,750,773,111.39	
3. 对所有者(或股东)的分派									-2,10,858,756.71	-2,210,858,756.71
4. 其他									-911,500,000.00	-911,500,000.00
(四) 所有者权益内部结转						630,706,407.62			-630,706,407.62	
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						630,706,407.62			-630,706,407.62	
6. 其他										
(五) 其他				65,961.37						65,961.37
四、本年年末余额	9,612,429,977.00		20,000,000,000.00	20,155,290,370.72		-10,168,128.77	4,867,817,156.10	11,798,272,660.25	21,985,661,357.49	94,329,006,091.79

法定代表人：

主管会计工作的负责人：

会计机构负责人：



# 母公司所有者权益变动表

2021年度

单位：人民币元



项目	上年年初数				上年末数				所有者权益合计
	股本	资本公积	其他权益工具	其他	股本	资本公积	其他权益工具	其他	
一、上年年末余额	8,200,000.00	6,768,850.97	5,000,000.00		8,200,000.00	6,768,850.97	5,000,000.00		19,977,701.97
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年年初余额	8,200,000.00	6,768,850.97	5,000,000.00		8,200,000.00	6,768,850.97	5,000,000.00		19,977,701.97
三、本年年末余额(减少以“-”号填列)	1,412,429.37	13,369,127.83	5,000,000.00		1,412,429.37	13,369,127.83	5,000,000.00		29,791,587.20
(一) 综合收益总额									
(二) 所有者投入和减少资本	1,412,429.37				1,412,429.37				
1. 所有者投入的普通股	1,412,429.37				1,412,429.37				
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									
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									
4. 其他									
(四) 所有者权益内部结转									
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									
6. 其他									
(五) 其他									
四、本年年末余额	9,612,429.37	20,155,221.40	10,000,000.00		9,612,429.37	20,155,221.40	10,000,000.00		39,767,650.77

法定代表人： *Carrie* 主管会计工作的负责人： *王* 会计机构负责人： *王*



# 国信证券股份有限公司

## 财务报表附注

2021 年度

金额单位：人民币元

### 一、公司基本情况

国信证券股份有限公司（以下简称公司或本公司）系经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准，由国信证券有限责任公司整体改制设立，于 2008 年 3 月 25 日在深圳市工商行政管理局登记注册，总部位于广东省深圳市。公司现持有统一社会信用代码为 914403001922784445 的营业执照，注册资本为人民币 9,612,429,377.00 元，股本总数 9,612,429,377 股（每股面值 1 元）。其中，有限售条件的 A 股流通股份 785,310,733 股；无限售条件的 A 股流通股份 8,827,118,644 股。公司股票已于 2014 年 12 月 29 日在深圳证券交易所挂牌交易。

本公司主要经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；金融产品代销等。

本公司的母公司为深圳市投资控股有限公司（以下简称深圳投控公司）。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司拥有 15 家子公司（含全资子公司），58 家分公司，184 家证券营业部；拥有员工 12,003 人，其中关键高级管理人员 13 人。

本财务报表业经公司 2022 年 4 月 18 日第五届第六次董事会批准对外报出。

本公司将国信弘盛私募基金管理有限公司（以下简称国信弘盛公司）、国信期货有限责任公司（以下简称国信期货公司）、国信证券（香港）金融控股有限公司（以下简称国信香港公司）、国信资本有限责任公司（以下简称国信资本公司）等 15 家子公司纳入本期合并财务报表范围，情况详见本财务报表附注七和八之说明。

### 二、财务报表的编制基础

#### （一）编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

## （二）持续经营能力评价

本公司不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况。

## 三、重要会计政策及会计估计

重要提示：本公司根据实际生产经营特点针对金融工具减值、收入确认、买入返售及卖出回购金融资产、融资融券业务的核算、转融通业务等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

### （一）遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了企业的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

### （二）会计期间

会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### （三）记账本位币

本公司及境内子公司采用人民币为记账本位币，国信香港公司等境外子公司从事境外经营，选择其经营所处的主要经济环境中的货币为记账本位币。

### （四）非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日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；如果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，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍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，其差额计入当期损益。

### （五）合并财务报表的编制方法

母公司将其控制的所有子公司纳入合并财务报表的合并范围。合并财务报表以母公司及其子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，由母公司按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》编制。

### （六）合营安排分类及共同经营会计处理方法

1. 合营安排分为共同经营和合营企业。
2. 当公司为共同经营的合营方时，确认与共同经营中利益份额相关的下列项目：
  - （1）确认单独所持有的资产，以及按持有份额确认共同持有的资产；

- (2) 确认单独所承担的负债，以及按持有份额确认共同承担的负债；
- (3) 确认出售公司享有的共同经营产出份额所产生的收入；
- (4) 按公司持有份额确认共同经营因出售资产所产生的收入；
- (5) 确认单独所发生的费用，以及按公司持有份额确认共同经营发生的费用。

#### (七) 现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、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。

#### (八) 外币业务和外币报表折算

##### 1. 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，计入当期损益；以历史成本计量的外币非货币性项目仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其人民币金额；以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，差额计入当期损益或其他综合收益。

##### 2. 外币财务报表折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用交易发生日的即期汇率折算；利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，计入其他综合收益。

#### (九) 客户交易结算资金

公司收到的客户交易结算资金存放在存管银行的专门账户上，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。公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为资产及负债，公司代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时，按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等相关费用确认为手续费支出，按规定向客户收取的手续费，在与客户办理买卖证券款项清算时确认为手续费收入。

#### (十) 金融工具

##### 1. 金融资产和金融负债的分类



金融资产在初始确认时划分为以下三类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下四类：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；(2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；(3) 不属于上述(1)或(2)的财务担保合同，以及不属于上述(1)并以低于市场利率贷款的贷款承诺；(4) 以摊余成本计量的金融负债。

## 2. 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

### (1) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第14号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

### (2) 金融资产的后续计量方法

#### 1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

#### 2) 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

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将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，计入当期损益。

#### 3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将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。

#### 4) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量,产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益,除非该金融资产属于套期关系的一部分。

### (3) 金融负债的后续计量方法

#### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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公允价值变动金额计入其他综合收益,除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失(包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动)计入当期损益,除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时,将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。

#### 2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第23号——金融资产转移》相关规定进行计量。

3) 不属于上述1)或2)的财务担保合同,以及不属于上述1)并以低于市场利率贷款的贷款承诺

在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量:①按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额;②初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

#### 4) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失,在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

### (4) 金融资产和金融负债的终止确认

#### 1) 当满足下列条件之一时,终止确认金融资产:

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止;

② 金融资产已转移,且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除时,相应终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

#### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：(1) 未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；(2) 保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：(1) 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；(2) 因转移金融资产而收到的对价，与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为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)之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：(1) 终止确认部分的账面价值；(2) 终止确认部分的对价，与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为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)之和。

#### 4. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

(1) 第一层次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；

(2) 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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

(3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

#### 5. 金融工具减值

#### (1) 金融工具减值计量和会计处理

公司以预期信用损失为基础，对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、合同资产、租赁应收款、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以外的贷款承诺、不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债或不属于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债的财务担保合同进行减值处理并确认损失准备。

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，是指公司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，对于公司购买或源生的已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，公司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。

对于由《企业会计准则第14号——收入》规范的交易形成，且不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，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。

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，公司按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，公司按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

公司利用可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

于资产负债表日，若公司判断金融工具只具有较低的信用风险，则假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

公司判断金融工具是否已违约，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。如果金融工具逾期超过30天，则公司将其界定为违约。

公司判断金融工具已发生信用减值的依据，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，公司将该金融资产界定为已发生信用减值：

- 1) 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 2) 债务人发生重大财务困难；
- 3) 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- 4) 债务人很可能破产或存在其他财务重组等事项；
- 5) 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；
- 6) 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 7) 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别。

公司以单项金融工具或金融工具组合为基础评估预期信用风险和计量预期信用损失。当以金融工具组合为基础时，公司以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组合。

公司在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，公司在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

(2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
融出资金——融资融券业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、预期信用损失率和前瞻性信息计算预期信用损失。
买入返售金融资产——约定购回、行权融资和小微通	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、预期信用损失率和前瞻性信息计算预期信用损失。
融出资金——孖展业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。
融出资金——限制性股票融资业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。
买入返售金融资产——股票质押回购业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他债权投资——国债、政策性金融债、央票	风险特征	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他债权投资——信用债以及地方政府债	风险特征	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他应收款——应收往来款组合	款项性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他应收款——应收押	款项性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来12个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。

项 目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
金保证金组合		额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。

(3) 按组合计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
应收款项——账龄组合	应收款账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
应收款项——特定款项组合	款项性质	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
合同资产——账龄组合	合同账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
合同资产——特定款项组合	款项性质	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。

6. 金融资产和金融负债的抵销

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的，公司以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：(1) 公司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) 公司计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，公司不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

(十一) 合同成本

与合同成本有关的资产包括合同取得成本和合同履约成本。

公司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。如果合同取得成本的摊销期限不超过一年，在发生时直接计入当期损益。

公司为履行合同发生的成本，不适用存货、固定资产或无形资产等相关准则的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：

1. 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；
2. 该成本增加了公司未来用于履行履约义务的资源；
3. 该成本预期能够收回。

公司对于与合同成本有关的资产采用与该资产相关的商品或服务收入确认相同的基础进行摊销，计入当期损益。

如果与合同成本有关的资产的账面价值高于因转让与该资产相关的商品或服务预期能

够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本，公司对超出部分计提减值准备，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，使得转让该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本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。

#### （十二）证券承销业务

公司证券承销的方式包括余额包销和代销。在余额包销方式下，对发行期结束后未售出的证券按约定的发行价格转为交易性金融资产等。

公司将发行相关的费用计入当期损益。

#### （十三）买入返售与卖出回购款项

买入返售交易是指按照合同或协议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”项目列示。

卖出回购交易是指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”项目列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内，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实际利率确认。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收支。

#### （十四）客户资产管理

公司客户资产管理业务分为定向资产管理业务、集合资产管理业务、专项资产管理业务。

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。对集合资产管理业务产品的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表内反映，在财务报表附注中列示，详见本财务报表附注五（四）4之说明。

#### （十五）融资融券业务

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。公司发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

融资业务，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理。公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。

融券业务，融出的证券按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》有关规定，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。

公司根据借出资金及违约概率情况，合理预计未来可能发生的损失，充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

#### （十六）转融通业务

公司通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；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，不将其计入资产负债表。

#### （十七）长期股权投资

##### 1. 共同控制、重大影响的判断

按照相关约定对某项安排存在共有的控制，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，认定为共同控制。对被投资单位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，认定为重大影响。

##### 2. 投资成本的确定

（1）同一控制下的企业合并形成的，合并方以支付现金、转让非现金资产、承担债务或发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照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其初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价的账面价值或发行股份的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。

公司通过多次交易分步实现同一控制下企业合并形成的长期股权投资，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，在合并日，根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额确定初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价



值之和的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

(2) 非同一控制下的企业合并形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

公司通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

1) 在个别财务报表中，按照原持有的股权投资的账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

2) 在合并财务报表中，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益等的，与其相关的其他综合收益等转为购买日所属当期收益。但由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

(3) 除企业合并形成以外的：以支付现金取得的，按照实际支付的购买价款作为其初始投资成本；以发行权益性证券取得的，按照发行权益性证券的公允价值作为其初始投资成本；以债务重组方式取得的，按《企业会计准则第 12 号——债务重组》确定其初始投资成本；以非货币性资产交换取得的，按《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》确定其初始投资成本。

### 3. 后续计量及损益确认方法

对被投资单位实施控制的长期股权投资采用成本法核算；对联营企业和合营企业的长期股权投资，采用权益法核算。

#### (十八) 投资性房地产

1. 投资性房地产包括已出租的建筑物。

2. 投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。房屋及建筑物预计可使用年限及残值率分别为：

类别	折旧方法	折旧年限(年)	残值率(%)	年折旧率(%)
房屋及建筑物	年限平均法	30-50	5	1.9- 3.17

#### (十九) 固定资产

1. 固定资产确认条件

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

## 2. 各类固定资产的折旧方法

类别	折旧方法	折旧年限(年)	残值率(%)	年折旧率(%)
房屋及建筑物	年限平均法	30-50	5	1.9- 3.17
交通工具	年限平均法	10	5	9.5
电子设备	年限平均法	3-5	5	19-31.67
办公设备及其他	年限平均法	5	5	19

### (二十) 在建工程

1. 在建工程同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量则予以确认。在建工程按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的实际成本计量。

2. 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

### (二十一) 借款费用

#### 1. 借款费用资本化的确认原则

公司发生的借款费用，可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或者生产的，予以资本化，计入相关资产成本；其他借款费用，在发生时确认为费用，计入当期损益。

#### 2. 借款费用资本化期间

(1) 当借款费用同时满足下列条件时，开始资本化：1) 资产支出已经发生；2) 借款费用已经发生；3) 为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

(2) 若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，并且中断时间连续超过 3 个月，暂停借款费用的资本化；中断期间发生的借款费用确认为当期费用，直至资产的购建或者生产活动重新开始。

(3) 当所购建或者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，借款费用停止资本化。

#### 3. 借款费用资本化金额

为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入专门借款的，以专门借款当期实际发生的利息费用（包括按照实际利率法确定的折价或溢价的摊销），减去将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，确定应予资本化的利息金额；为购建或者生产符合资本化条件的资产占用了一般借款的，根据累计资产支出超过专门借款的资产支出加权平均数乘以占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。

## （二十二）无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、计算机软件及交易席位费等，按成本进行初始计量。

2. 使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销，无法可靠确定预期实现方式的，采用直线法摊销。具体年限如下：

（1）计算机软件按 5 年摊销；

（2）土地使用权，按照房地产证上的土地使用年限摊销；

本公司将交易席位费视为使用寿命不确定的无形资产。使用寿命不确定的无形资产不摊销，公司在每个会计期间均对该无形资产的使用寿命进行复核。对使用寿命不确定的无形资产，使用寿命不确定的判断依据是：是否在不确定的期间内为企业产生现金流量。

## （二十三）部分长期资产减值

对长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、使用权资产和使用寿命有限的无形资产等长期资产，在资产负债表日有迹象表明发生减值的，估计其可收回金额。对因企业合并所形成的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，每年都进行减值测试。商誉结合与其相关的资产组或者资产组组合进行减值测试。

若上述长期资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额确认资产减值准备并计入当期损益。

## （二十四）长期待摊费用

长期待摊费用核算已经支出，摊销期限在 1 年以上（不含 1 年）的各项费用。长期待摊费用按实际发生额入账，在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的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。

## （二十五）职工薪酬

1. 职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

## 2. 短期薪酬的会计处理方法

在职工为公司提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

## 3. 离职后福利的会计处理方法

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

(1) 在职工为公司提供服务的会计期间，根据设定提存计划计算的应缴存金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

1) 根据预期累计福利单位法，采用无偏且相互一致的精算假设对有关人口统计变量和财务变量等作出估计，计量设定受益计划所产生的义务，并确定相关义务的所属期间。同时，对设定受益计划所产生的义务予以折现，以确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本；

2) 设定受益计划存在资产的，将设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。设定受益计划存在盈余的，以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产；

3) 期末，将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分，其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

## 4. 辞退福利的会计处理方法

向职工提供的辞退福利，在下列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：(1) 公司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；(2) 公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

## 5. 其他长期职工福利的会计处理方法

向职工提供的其他长期福利，符合设定提存计划条件的，按照设定提存计划的有关规定进行会计处理；除此之外的其他长期福利，按照设定受益计划的有关规定进行会计处理，为简化相关会计处理，将其产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动等组成项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

## （二十六）预计负债

1. 因对外提供担保、诉讼事项、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务，履行该义务很可能导致经济利益流出公司，且该义务的金额能够可靠的计量时，公司将该项义务确认为预计负债。

2. 公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

## （二十七）永续债等其他金融工具

根据金融工具相关准则、《金融负债与权益工具的区分及相关会计处理规定》（财会〔2014〕13号）和《永续债相关会计处理的规定》（财会〔2019〕2号），对发行的永续债，公司依据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融资产、金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该等金融工具或其组成部分分类为金融资产、金融负债或权益工具。

在资产负债表日，对于归类为权益工具的金融工具，其利息支出或股利分配作为公司的利润分配，其回购、注销等作为权益的变动处理；对于归类为金融负债的金融工具，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等计入当期损益。

## （二十八）收入

### 1. 收入确认原则

于合同开始日，公司对合同进行评估，识别合同所包含的各单项履约义务，并确定各单项履约义务是在某一时段内履行，还是在某一时点履行。

满足下列条件之一时，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）客户在公司履约的同时即取得并消耗公司履约所带来的经济利益；（2）客户能够控制公司履约过程中在建商品或服务；（3）公司履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且公司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，公司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，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，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控制权时，公司考虑下列迹象：（1）公司就该商品享有现时收款权利，即客户就该商品负有现时付款义务；（2）公司已将该商品的法定所有权转移给客户，即客户已拥有该商品的法定所有权；（3）公司已将该商品实

物转移给客户，即客户已实物占有该商品；(4) 公司已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户，即客户已取得该商品所有权上的主要风险和报酬；(5) 客户已接受该商品；(6) 其他表明客户已取得商品控制权的迹象。

## 2. 收入计量原则

(1) 公司按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。交易价格是公司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以及预期将退还给客户的款项。

(2) 合同中存在可变对价的，公司按照期望值或最可能发生金额确定可变对价的最佳估计数，但包含可变对价的交易价格，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。

(3) 合同中存在重大融资成分的，公司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，公司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。

(4) 合同中包含两项或多项履约义务的，公司于合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品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。

## 3. 收入确认的具体方法

### (1) 手续费及佣金收入

与交易相关的经济利益能够流入公司，相关的收入能够可靠计量且满足下列各项经营活动的特定收入确认标准时，确认相关的手续费及佣金收入。

#### 1) 经纪业务收入

代理买卖证券手续费收入、期货经纪业务手续费收入在交易日确认收入。

#### 2) 投资银行业务收入

证券承销业务收入，按承销方式分别确认收入：① 采用全额包销方式的，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认收入；② 采用余额包销、代销方式的，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认。

保荐业务和财务顾问业务按照提供劳务收入的确认条件，在保荐服务和财务顾问服务完成且取得收款证据时确认为收入。

#### 3) 资产管理和基金管理业务收入

受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入，在资产管理合同或基金到期或者定期与委托单位结算收益或损失时，按合同规定收益分成方式和比例计算的应该享有的收益或承担的损失，确认为当期损益。

#### 4) 投资咨询业务收入

投资咨询业务收入按照提供劳务收入的确认条件，在投资咨询服务完成且取得收款证据时确认为收入。

#### (2) 利息收入

对于所有以摊余成本计量的金融工具及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产中计息的金融工具，利息收入以实际利率计量。实际利率是指按金融工具的预计存续期间将其预计未来现金流入或流出折现至该金融资产账面余额或金融负债摊余成本的利率。实际利率的计算需要考虑金融工具的合同条款(例如提前还款权)并且包括所有归属于实际利率组成部分的费用和所有交易成本，但不包括预期信用损失。

公司根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入并列报为“利息收入”，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，按照该金融资产的摊余成本(即，账面余额扣除预期信用损失准备之后的净额)和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，并且这一改善在客观上可与应用上述规定之后发生的某一事件相联系，转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

#### (3) 让渡资产使用权的收入

公司在同时满足相关的经济利益很可能流入、收入金额能够可靠计量时，确认让渡资产使用权的收入。

#### (二十九) 政府补助

1. 政府补助在同时满足下列条件时予以确认：(1) 公司能够满足政府补助所附的条件；(2) 公司能够收到政府补助。政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。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，按照名义金额计量。

#### 2. 与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

政府文件规定用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政

府补助。政府文件不明确的，以取得该补助必须具备的基本条件为基础进行判断，以购建或其他方式形成长期资产为基本条件的作为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关的政府补助确认为递延收益的，在相关资产使用寿命内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。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。

### 3. 与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助，难以区分与资产相关或与收益相关的，整体归类为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的，确认为递延收益，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；用于补偿已发生的相关成本费用或损失的，直接计入当期损益或冲减相关成本。

4. 与公司日常经营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。与公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

### (三十) 合同资产、合同负债

公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中列示合同资产或合同负债。公司将同一合同下的合同资产和合同负债相互抵销后以净额列示。

公司将拥有的、无条件(即，仅取决于时间流逝)向客户收取对价的权利作为应收款项列示，将已向客户转让商品而有权收取对价的权利(该权利取决于时间流逝之外的其他因素)作为合同资产列示。

公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品的义务作为合同负债列示。

### (三十一) 递延所得税资产、递延所得税负债

1. 根据资产、负债的账面价值与其计税基础之间的差额(未作为资产和负债确认的项目按照税法规定可以确定其计税基础的，该计税基础与其账面数之间的差额)，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计算确认递延所得税资产或递延所得税负债。

2. 确认递延所得税资产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。资产负债表日，有确凿证据表明未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异的，确认以前会计期间未确认的递延所得税资产。

3. 资产负债表日，对递延所得税资产的账面价值进行复核，如果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的利益，则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，转回减记的金额。

4. 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益，但不包括下列情况产生的所得税：（1）企业合并；（2）直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

## （三十二）租赁

### 1. 公司作为承租人

在租赁期开始日，公司将租赁期不超过 12 个月，且不包含购买选择权的租赁认定为短期租赁；将单项租赁资产为全新资产时价值较低的租赁认定为低价值资产租赁。公司转租或预期转租租赁资产的，原租赁不认定为低价值资产租赁。

对于所有短期租赁和低价值资产租赁，公司在租赁期内各个期间按照直线法将租赁付款额计入相关资产成本或当期损益。

除上述采用简化处理的短期租赁和低价值资产租赁外，在租赁期开始日，公司对租赁确认使用权资产和租赁负债。

#### （1）使用权资产

使用权资产按照成本进行初始计量，该成本包括：1) 租赁负债的初始计量金额；2) 在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；3) 承租人发生的初始直接费用；4) 承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。

公司按照直线法对使用权资产计提折旧。能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，公司在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，公司在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。

#### （2）租赁负债

在租赁开始日，公司将尚未支付的租赁付款额的现值确认为租赁负债。计算租赁付款额现值时采用租赁内含利率作为折现率，无法确定租赁内含利率的，采用公司增量借款利率作为折现率。租赁付款额与其现值之间的差额作为未确认融资费用，在租赁期各个期间内按照确认租赁付款额现值的折现率确认利息费用，并计入当期损益。未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额于实际发生时计入当期损益。

租赁期开始日后，当实质固定付款额发生变动、担保余值预计的应付金额发生变化、用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动、购买选择权、续租选择权或终止选择权的评估结

果或实际行权情况发生变化时，公司按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值，如使用权资产账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，将剩余金额计入当期损益。

## 2. 公司作为出租人

公司的租赁均为经营租赁。

公司在租赁期内各个期间按照直线法将租赁收款额确认为租金收入，发生的初始直接费用予以资本化并按照与租金收入确认相同的基础进行分摊，分期计入当期损益。公司取得的与经营租赁有关的未计入租赁收款额的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

### (三十三) 一般风险准备金和交易风险准备金

公司按当年实现净利润的 10%分别计提一般风险准备金和交易风险准备金。根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，每月按照不低于公募基金托管费收入的 2.5%提取一般风险准备金；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，每月按照不低于大集合资产管理业务管理费收入的 10%计提一般风险准备金。

### (三十四) 分部报告

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，本公司的经营分部是指同时满足下列条件的组成部分：

1. 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
2. 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；
3. 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。

### (三十五) 其他重要的会计政策和会计估计

采用套期会计的依据、会计处理方法

(1) 套期包括公允价值套期/现金流量套期。

(2) 对于满足下列条件的套期，运用套期会计方法进行处理：1) 套期关系仅由符合条件的套期工具和被套期工具组成；2) 在套期开始时，公司正式指定了套期工具和被套期项目，并准备了关于套期关系和公司从事套期的风险管理策略和风险管理目标的书面文件；3) 该套期关系符合套期有效性要求。

套期同时满足下列条件时，公司认定套期关系符合套期有效性要求：1) 被套期项目和套期工具之间存在经济关系；2) 被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用

风险的影响不占主导地位；3) 套期关系的套期比率等于公司实际套期的被套期项目数量与对其进行套期的套期工具实际数量之比，但不反映被套期项目和套期工具相对权重的失衡。

公司在套期开始日及以后期间持续地对套期关系是否符合套期有效性要求进行评估。套期关系由于套期比率的原因而不再符合套期有效性要求，但指定该套期关系的风险管理目标没有改变的，公司进行套期关系再平衡。

### (3) 套期会计处理

#### 1) 公允价值套期

① 套期工具产生的利得或损失计入当期损益。如果套期工具是对选择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（或其组成部分）进行套期的，套期工具产生的利得或损失计入其他综合收益。

② 被套期项目因风险敞口形成的利得或损失计入当期损益，同时调整未以公允价值计量的已确认被套期项目的账面价值。被套期项目为按照《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》第十八条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（或其组成部分）的，其因被套期风险敞口形成的利得或损失计入当期损益，其账面价值已经按公允价值计量，不再调整；被套期项目为公司选择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（或其组成部分）的，其因被套期风险敞口形成的利得或损失计入其他综合收益，其账面价值已经按公允价值计量，不再调整。

被套期项目为尚未确认的确定承诺（或其组成部分）的，其在套期关系指定后因被套期风险引起的公允价值累计变动额确认为一项资产或负债，相关的利得或损失计入各相关期间损益。当履行确定承诺而取得资产或承担负债时，调整该资产或负债的初始确认金额，以包括已确认的被套期项目的公允价值累计变动额。

被套期项目为以摊余成本计量的金融工具（或其组成部分）的，公司对被套期项目账面价值所作的调整按照开始摊销日重新计算的实际利率进行摊销，并计入当期损益。被套期项目为按照《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》第十八条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（或其组成部分）的，按照相同的方式对累计已确认的套期利得或损失进行摊销，并计入当期损益，但不调整金融资产（或其组成部分）的账面价值。

#### 2) 现金流量套期

① 套期工具利得或损失中属于有效套期的部分，作为现金流量套期储备，计入其他综

合收益，无效部分计入当期损益。现金流量套期储备的金额按照以下两项的绝对额中较低者确认：A. 套期工具自套期开始的累计利得或损失；B. 被套期项目自套期开始的预计未来现金流量现值的累计变动额。

② 被套期项目为预期交易，且该预期交易使公司随后确认一项非金融资产或非金融负债的，或者非金融资产和非金融负债的预期交易形成一项适用于公允价值套期会计的确定承诺时，将原在其他综合收益中确认的现金流量套期储备金额转出，计入该资产或负债的初始确认金额。

③ 其他现金流量套期，原计入其他综合收益的现金流量套期储备金额，在被套期预期交易影响损益的相同期间转出，计入当期损益。

### (三十六) 重要会计政策变更说明

#### 企业会计准则变化引起的会计政策变更

1. 本公司自 2021 年 1 月 1 日（以下称首次执行日）起执行经修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》（以下简称新租赁准则）。

(1) 对本公司作为承租人的租赁合同，公司根据首次执行日执行新租赁准则与原准则的累计影响数调整本报告期期初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。具体处理如下：

对于首次执行日前的经营租赁，公司在首次执行日根据剩余租赁付款额按首次执行日公司增量借款利率折现的现值计量租赁负债，按照与租赁负债相等的金额，并根据预付租金进行必要调整计量使用权资产。

在首次执行日，公司按照本财务报表附注三（二十三）的规定，对使用权资产进行减值测试并进行相应会计处理。

1) 执行新租赁准则对公司 2021 年 1 月 1 日财务报表的主要影响如下：

项 目	资产负债表		
	2020 年 12 月 31 日	新租赁准则 调整影响	2021 年 1 月 1 日
使用权资产		437,234,238.75	437,234,238.75
其他资产	517,806,955.80	-25,046,427.21	492,760,528.59
租赁负债		411,113,159.86	411,113,159.86
其他负债	8,677,062,307.45	1,074,651.68	8,678,136,959.13

2) 本公司 2020 年度财务报表中披露的重大经营租赁中尚未支付的最低租赁付款额为

439,830,748.62元，将其按首次执行日增量借款利率折现的现值为411,113,159.86元，折现后的金额与首次执行日计入资产负债表的与原经营租赁相关的租赁负债的差额为0元。

首次执行日计入资产负债表的租赁负债所采用的公司增量借款利率的加权平均值为3.67%/3.83%。

3) 对2021年1月1日前的经营租赁采用的简化处理

A. 对于首次执行日后12个月内完成的租赁合同，公司采用简化方法，不确认使用权资产和租赁负债；

B. 公司在计量租赁负债时，对于具有相似特征的租赁合同采用同一折现率；

C. 使用权资产的计量不包含初始直接费用；

D. 公司根据首次执行日前续租选择权或终止租赁选择权的实际行权及其他最新情况确定租赁期；

E. 作为使用权资产减值测试的替代，公司根据《企业会计准则第13号——或有事项》评估包含租赁的合同在首次执行日前是否为亏损合同，并根据首次执行日前计入资产负债表日的亏损准备金额调整使用权资产；

F. 首次执行日前发生租赁变更的，公司根据租赁变更的最终安排进行会计处理。

上述简化处理对公司财务报表无显著影响。

(2) 对首次执行日前已存在的低价值资产经营租赁合同，公司采用简化方法，不确认使用权资产和租赁负债，自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

(3) 对公司作为出租人的租赁合同，自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

2. 公司自2021年1月26日起执行财政部于2021年度颁布的《企业会计准则解释第14号》，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

3. 公司自2021年12月31日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第15号》“关于资金集中管理相关列报”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

## 四、税项

### (一) 主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	3%、6%、9%和13%

税 种	计 税 依 据	税 率
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%、20%、16.5%

不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

纳税主体名称	所得税税率
国信香港公司	16.5%
国信证券（香港）经纪有限公司	16.5%
国信证券（香港）融资有限公司	16.5%
国信证券（香港）资产管理有限公司	16.5%
国信（香港）金融产品有限公司	16.5%
深圳市国信运通基金管理有限公司	20%
深圳市国信众创基金管理有限公司	20%
国信咨询服务（深圳）有限公司（以下简称国信咨询公司）	20%
除上述以外的其他纳税主体	25%

（二）税收优惠

1. 增值税税收优惠

根据《财政部 国家税务总局关于将铁路运输和邮政业纳入营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2013〕106号）、《国家税务总局关于发布〈营业税改征增值税跨境应税行为增值税免税管理办法（试行）〉的公告》（国家税务总局公告2016年第29号），国信咨询公司从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免税优惠政策，国信咨询公司于2014年完成跨境应税服务增值税优惠税收备案登记，自2014年11月1日起至2017年8月31日止享受增值税减免税优惠政策，国信咨询公司于优惠期限到期前申请应税服务增值税优惠备案并完成备案登记，从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免税优惠政策延长至2022年3月31日。

2. 企业所得税税收优惠

根据财政部、国家税务总局《关于实施小微企业普惠性税收减免政策的通知》（财税〔2019〕13号）和《关于实施小微企业和个体工商户所得税优惠政策的公告》（财政部 税务总局公

告 2021 年第 12 号)，国信咨询公司、深圳市国信运通基金管理有限公司、深圳市国信众创基金管理有限公司的年应纳税所得额不超过 100 万元的部分，减按 12.5% 计入应纳税所得额，按 20% 的税率缴纳企业所得税；对年应纳税所得额超过 100 万元到不超过 300 万元的部分，减按 50% 计入应纳税所得额，按 20% 的税率缴纳企业所得税。

### (三) 其他说明

根据《国家税务总局关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的公告》（国家税务总局公告 2012 年第 57 号），本公司先汇总公司本部和下属分支机构应纳税所得额，其中 50% 应纳税所得额在本部预缴，50% 应纳税所得额按经营收入、职工工资薪酬费用和资产总额三因素计算各所属分支机构应分摊所得税额的比例。本公司所属分支机构按分摊的当期应纳税所得额和各自适用税率计缴企业所得税。

## 五、合并财务报表项目注释

说明：本财务报表附注的期初数指财务报表上年年末数按新租赁准则调整后的 2021 年 1 月 1 日的数据。

### (一) 合并资产负债表项目注释

#### 1. 货币资金

##### (1) 类别明细

项 目	期末数	期初数
库存现金	111,697.21	267,811.78
银行存款	67,713,455,838.53	65,906,231,647.87
其中：自有资金存款	5,731,776,517.81	8,949,470,682.39
客户资金存款	61,981,679,320.72	56,956,760,965.48
其他货币资金	8,173,501.56	524,716.70
合 计	67,721,741,037.30	65,907,024,176.35
其中：存放在境外的款项总额	2,236,699,324.88	2,190,397,950.15

##### (2) 币种明细

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
库存现金：						

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
人民币			48,238.01			166,366.90
美元	2,203.00	6.3757	14,045.67	7,752.00	6.5249	50,581.02
港元	60,437.30	0.8176	49,413.53	60,437.09	0.8416	50,863.86
小 计			111,697.21			267,811.78

银行存款：

其中：自有资金存款						
人民币			4,944,098,868.59			8,067,258,062.45
美元	48,250,675.02	6.3757	307,631,828.73	26,522,527.57	6.5249	173,056,840.14
港元	584,089,589.23	0.8176	477,551,648.15	839,331,296.00	0.8416	706,381,218.71
欧元	345,467.48	7.2197	2,494,171.57	345,739.60	8.0250	2,774,560.29
英镑	0.09	8.6064	0.77	0.09	8.8903	0.80
小 计			5,731,776,517.81			8,949,470,682.39
客户资金存款						
人民币			59,866,030,319.50			55,111,601,086.69
美元	128,751,768.11	6.3757	820,882,647.94	77,407,910.05	6.5249	505,078,872.31
港元	1,583,618,338.15	0.8176	1,294,766,353.28	1,592,301,576.17	0.8416	1,340,081,006.48
小 计			61,981,679,320.72			56,956,760,965.48
银行存款小计			67,713,455,838.53			65,906,231,647.87

其他货币资金：

人民币			8,173,501.56			524,716.70
合 计			67,721,741,037.30			65,907,024,176.35

(3) 融资融券业务信用资金明细情况

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
自有信用资金：						
人民币			231,063.10			999,213.88
客户信用资金：						



项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
人民币			5,017,759,448.14			4,904,819,092.61
美元	12,010,303.05	6.3757	76,574,089.16	7,273,339.97	6.5249	47,457,815.97
港元	419,609,694.05	0.8176	343,072,885.86	466,547,751.20	0.8416	392,646,587.41
小 计			5,437,406,423.16			5,344,923,495.99
总 计			5,437,637,486.26			5,345,922,709.87

(4) 其他说明

2021年12月31日，本公司使用受限的货币资金为人民币82,630,050.90元（期初本公司使用受限的货币资金为人民币90,247,267.12元）。

2. 结算备付金

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
公司自有备付金：						
人民币			3,816,304,532.30			2,546,538,320.50
公司备付金总计			3,816,304,532.30			2,546,538,320.50
客户普通备付金：						
人民币			10,940,968,569.26			6,843,008,232.23
美元	5,132,181.34	6.3757	32,721,248.57	4,444,050.44	6.5249	28,996,984.72
港币	597,080,821.79	0.8176	488,173,279.90	66,647,084.69	0.8416	56,090,186.47
小 计			11,461,863,097.73			6,928,095,403.42
客户信用备付金：						
人民币			1,809,656,390.74			1,565,719,077.81
客户备付金总计			13,271,519,488.47			8,493,814,481.23
合 计			17,087,824,020.77			11,040,352,801.73

3. 融出资金

(1) 明细情况——按类别

项 目	期末数	期初数
境内		
其中：个人	56,670,011,963.68	45,685,303,634.57
机构	5,104,200,709.88	3,891,562,579.67
减：减值准备	184,653,819.86	237,600,211.59
账面价值小计	61,589,558,853.70	49,339,266,002.65
境外		
其中：个人	366,046,066.69	402,113,266.72
机构	18,707,590.78	13,875,153.71
减：减值准备	1,000,661.74	660,401.83
账面价值小计	383,752,995.73	415,328,018.60
合 计	61,973,311,849.43	49,754,594,021.25

(2) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
股票	203,029,348,589.90	161,658,563,858.56
资金	6,938,863,758.76	6,160,261,335.81
基金	4,538,000,091.87	4,527,142,215.89
债券	188,259,177.65	334,740,486.78
合 计	214,694,471,618.18	172,680,707,897.04

注：担保物包含融出资金、融出证券、孖展融资及限制性股票融资的担保物

(3) 减值准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小 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)	
期初数	163,293,170.93		74,967,442.49	238,260,613.42
本期计提	12,617,213.51		-59,343,614.21	-46,726,400.70
本期转销			5,859,119.24	5,859,119.24
其他	-20,611.88			-20,611.88
期末数	175,889,772.56		9,764,709.04	185,654,481.60

#### 4. 衍生金融资产、衍生金融负债

##### (1) 明细情况

项 目	期末数			期初数		
	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						
利率互换	96,800,000,000.00		508,848.58	41,890,000,000.00	6,246,609.85	
利率期权	210,000,000.00		67,674.49			
小 计	97,010,000,000.00		576,523.07	41,890,000,000.00	6,246,609.85	
权益衍生工具						
收益互换	7,786,021,581.72		118,207,886.15	792,480,789.20		186,580,043.48
收益凭证	2,588,811,000.00		26,255.62	13,940,395,000.00		1,557,519.28
股指期货	5,341,983,231.94			2,345,862,557.47		
股票期权	533,419,598.00		33,621,508.46	594,380,760.00		71,626,751.69
股指期权	414,180,000.00		65,016,000.00	281,700,000.00		71,682,160.00
小 计	16,664,415,411.66		216,871,650.23	17,954,819,106.67		331,446,474.45
其他衍生工具						
商品期货	2,994,375.00			52,936,826.58		
信用缓释工具	1,348,000,000.00	27,794,294.99				
场外期权	3,029,100,783.47		6,876,198.99			
远期合约	292,695,000.00	30,172,566.37	1,725,136.00			
小 计	4,672,790,158.47	57,966,861.36	8,601,334.99	52,936,826.58		
合 计	118,347,205,570.13	57,966,861.36	226,049,508.29	59,897,755,933.25	6,246,609.85	331,446,474.45

##### (2) 股指期货合约和商品期货合约

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本公司于2021年12月31日所持有的股指期货合约和商品期货合约产生的持仓损益，衍生金融负债项下的股指期货合约和商品期货合约与相关的股指期货暂收暂付款和商品期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额列示，2021年12月31日抵销后的净额为人民币零元，公允价值变动损失为人民币52,869,917.70元(期初本公司股指期货合约和商品期货合约公允价值变动损失为人民

币 15,850,004.79 元)。

5. 存出保证金

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
交易保证金：						
人民币			6,091,233,351.00			4,359,338,227.98
美元	270,000.00	6.3757	1,721,439.00	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港币	18,122,623.88	0.8176	14,817,057.28	24,031,275.96	0.8416	20,224,721.85
小 计			6,107,771,847.28			4,381,324,672.83
信用保证金：						
人民币			1,479,800,482.15			1,197,971,229.17
合 计			7,587,572,329.43			5,579,295,902.00

6. 应收款项

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应收逾期融资款	1,112,678,810.23	849,024,137.38
应收清算款项	612,562,580.41	356,138,480.80
应收手续费及佣金	556,943,910.26	566,913,722.84
应收代垫款项	192,920,040.68	195,912,783.11
应收利率互换款项	141,605,363.90	80,721,000.90
应收融资融券客户款	103,365,026.41	59,241,830.86
应收大宗商品销售款	55,862,524.73	57,006,754.39
应收结算担保金	48,804,430.10	25,791,213.77
应收违约债券	30,000,000.00	183,915,327.13
应收期货交易款	27,299,447.90	82,645,692.59
收益互换预付金	1,599,952.00	195,006,833.00
其他	44,089,837.39	20,942,033.99

项 目	期末数	期初数
减：坏账准备（按简化模型计提）	1,495,136,213.80	1,337,883,499.71
合 计	1,432,595,710.21	1,335,376,311.05

(2) 账龄分析

项 目	期末数		期初数	
	金额	比例（%）	金额	比例（%）
1年以内	1,930,248,452.02	65.93	1,597,095,068.06	59.74
1-2年	44,660,359.34	1.53	323,278,373.59	12.09
2-3年	253,081,383.44	8.64	46,987,609.60	1.76
3年以上	699,741,729.21	23.90	705,898,759.51	26.41
合 计	2,927,731,924.01	100.00	2,673,259,810.76	100.00

(3) 坏账准备计提明细情况

1) 类别明细情况

种 类	期末数			
	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				
—应收逾期融资款	1,112,678,810.23	38.00	1,112,678,810.23	100.00
—应收违约债券	30,000,000.00	1.02	30,000,000.00	100.00
—应收代垫款项	192,920,040.68	6.59	192,013,485.01	99.53
—应收融资融券款	103,365,026.41	3.53	103,335,322.52	99.97
—其他	39,440,697.11	1.35	39,440,697.11	100.00
小 计	1,478,404,574.43	50.50	1,477,468,314.87	99.94
组合计提坏账准备				
账龄组合	411,445,981.26	14.05	17,667,898.93	4.29
特定款项组合	1,037,881,368.32	35.45		
小 计	1,449,327,349.58	49.50	17,667,898.93	1.22
合 计	2,927,731,924.01	100.00	1,495,136,213.80	51.07

(续上表)

种类	期初数			
	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				
—应收逾期融资款	849,024,137.38	31.76	849,024,137.38	100.00
—应收违约债券	183,915,327.13	6.88	183,915,327.13	100.00
—应收代垫款项	195,912,783.11	7.33	192,013,485.01	98.01
—应收融资融券款	59,241,830.86	2.22	59,241,830.86	100.00
—其他	39,686,077.78	1.48	39,545,594.26	99.65
小计	1,327,780,156.26	49.67	1,323,740,374.64	99.70
组合计提坏账准备				
账龄组合	423,114,592.65	15.83	14,143,125.07	3.34
特定款项组合	922,365,061.85	34.50		
小计	1,345,479,654.50	50.33	14,143,125.07	1.05
合计	2,673,259,810.76	100.00	1,337,883,499.71	50.05

## 2) 按账龄组合计提坏账准备的应收账款

账龄	期末数		坏账准备	期初数		坏账准备
	账面金额	比例(%)		账面金额	比例(%)	
1年以内	320,308,126.28	77.85	1,535,381.65	299,060,820.09	70.68	1,390,252.16
1至2年	22,389,258.25	5.44	1,119,462.91	63,118,000.60	14.92	3,155,900.03
2至3年	28,560,287.80	6.94	2,856,028.78	43,940,920.04	10.38	4,394,092.00
3年以上	40,188,308.93	9.77	12,157,025.59	16,994,851.92	4.02	5,202,880.88
合计	411,445,981.26	100.00	17,667,898.93	423,114,592.65	100.00	14,143,125.07

## (4) 应收款项金额前五名情况

项目	款项性质	期末余额[注4]	账龄	占应收款项总额的比例(%)
客户A	[注1]	278,747,120.97	1年以内	9.52
客户B	[注2]	205,943,924.02	3年以上	7.03

项 目	款项性质	期末余额[注 4]	账龄	占应收款项总额的比例 (%)
客户 C	[注 3]	192,013,485.01	2-3 年	6.56
客户 D	[注 1]	186,292,000.00	1-2 年	6.36
客户 E	[注 2]	151,199,010.46	3 年以上	5.16
合 计		1,014,195,540.46		34.64

[注 1]系股票质押回购业务逾期本金

[注 2]系国信香港公司开展的融资业务逾期本金及利息

[注 3]系垫付的和解款

[注 4]期末余额前五名应收账款相应计提的坏账准备期末余额汇总金额为人民币 1,014,195,540.46 元

(5) 应收款项坏账准备变动情况

详见本财务报表附注五(一)20 之说明。

(6) 报告期应收款项中应收持本公司 5% (含 5%) 以上有表决权股份的股东单位的款项及关联方的款项

详见本财务报表附注十一(三)之说明。

## 7. 买入返售金融资产

(1) 明细情况——按业务类别

项 目	期末数	期初数
股票质押式回购	5,323,601,200.41	13,561,770,850.63
债券质押式回购	2,465,447,560.67	4,262,108,430.32
行权融资	206,344,832.53	269,674,887.92
约定购回式回购	53,361,074.64	238,380,246.28
减：减值准备	1,277,760,261.14	2,151,463,876.77
合 计	6,770,994,407.11	16,180,470,538.38

(2) 明细情况——按金融资产种类

项 目	期末数	期初数
股票	5,376,962,275.05	13,800,151,096.91
债券	2,465,447,560.67	4,262,108,430.32

项 目	期末数	期初数
其他	206,344,832.53	269,674,887.92
减：减值准备	1,277,760,261.14	2,151,463,876.77
合 计	6,770,994,407.11	16,180,470,538.38

(3) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
担保物	19,215,968,525.23	36,039,466,161.10
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物		
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		

注：上述担保物不包括交易所质押式逆回购交易取得的担保物的公允价值

(4) 约定购回融出资金

剩余期限	期末数	期初数
1 个月内	4,942,345.20	3,924,986.90
1 个月至 3 个月内	4,395,675.77	10,604,207.59
3 个月至 1 年内	44,023,053.67	223,851,051.79
1 年以上		
小 计	53,361,074.64	238,380,246.28

(5) 股票质押式回购融出资金

剩余期限	期末数	期初数
1 个月内	3,116,244,891.39	5,227,516,421.55
1 个月至 3 个月内	367,588,762.09	1,950,957,965.64
3 个月至 1 年内	1,712,954,333.82	6,002,154,217.42
1 年以上	126,813,213.11	381,142,246.02
小 计	5,323,601,200.41	13,561,770,850.63

(6) 减值准备变动情况

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小计
	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)	
期初数	7,398,172.86	13,283,700.15	2,130,782,003.76	2,151,463,876.77



项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小计
	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)	
期初数在本期	——	——	——	
--转入第二阶段				
--转入第三阶段	-24,161.77	-3,564,837.04	3,588,998.81	
--转回第一阶段	9,718,863.11	-9,718,863.11		
本期计提	-10,907,600.08		-862,796,015.55	-873,703,615.63
本期转回				
期末数	6,185,274.12		1,271,574,987.02	1,277,760,261.14

## 8. 交易性金融资产

### (1) 明细情况

项 目	期末数					
	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	公允价值小计	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	初始成本小计
债券	107,281,729,196.51		107,281,729,196.51	105,712,535,595.09		105,712,535,595.09
公募基金	23,109,626,726.13		23,109,626,726.13	22,781,999,082.92		22,781,999,082.92
股票	4,917,854,505.12		4,917,854,505.12	4,017,891,492.21		4,017,891,492.21
银行理财产品	2,359,071,808.45		2,359,071,808.45	2,344,000,000.00		2,344,000,000.00
券商资管产品	6,100,221,051.49		6,100,221,051.49	5,886,466,002.59		5,886,466,002.59
信托计划	264,276,340.84		264,276,340.84	223,834,630.85		223,834,630.85
私募基金及专户	7,234,125,344.83		7,234,125,344.83	6,652,621,606.30		6,652,621,606.30
其他股权投资	1,044,318,301.67		1,044,318,301.67	984,730,748.87		984,730,748.87
其他	900,000.00		900,000.00	900,000.00		900,000.00
合 计	152,312,123,275.04		152,312,123,275.04	148,604,979,158.83		148,604,979,158.83

(续上表)

项 目	期初数					
	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	公允价值小计	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	初始成本小计
债券	83,951,389,433.91		83,951,389,433.91	83,254,149,029.22		83,254,149,029.22
公募基金	11,222,256,425.96		11,222,256,425.96	11,089,465,088.04		11,089,465,088.04
股票	4,604,326,146.89		4,604,326,146.89	3,857,503,507.15		3,857,503,507.15
银行理财产品	693,390,655.82		693,390,655.82	689,620,000.00		689,620,000.00
券商资管产品	1,086,465,480.30		1,086,465,480.30	1,081,660,000.01		1,081,660,000.01
信托计划	228,355,790.56		228,355,790.56	197,716,330.85		197,716,330.85
私募基金及专户	3,623,810,171.98		3,623,810,171.98	3,294,010,969.96		3,294,010,969.96
其他股权投资	1,303,948,477.26		1,303,948,477.26	1,318,616,751.81		1,318,616,751.81
其他	45,409,368.78		45,409,368.78	45,409,368.78		45,409,368.78
合 计	106,759,351,951.46		106,759,351,951.46	104,828,151,045.82		104,828,151,045.82

(2) 其他说明

1) 2021年12月31日,本公司为回购交易设定质押或过户的债券的公允价值计人民币81,688,145,536.95元,为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币6,887,277,973.05元,为期货业务充抵保证金设定质押的债券的公允价值计人民币3,177,687,945.14元。

2) 2021年12月31日,本公司持有的限售股的公允价值计人民币2,554,100,076.31元。

3) 本公司作为管理人以自有资金参与的集合资产管理计划截至2021年12月31日的公允价值计人民币10,011,699.80元为有限赔偿责任份额,一旦集合计划出现亏损,本公司将以持有的份额为限对集合计划的亏损进行弥补。同时,本公司持有的有限赔偿责任份额退出受到合同约定的限制。

9. 其他债权投资

(1) 明细情况

项 目	期末数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	2,186,178,919.14	27,505,011.89	9,375,271.06	2,223,059,202.09	
地方债	16,795,265,515.27	260,767,274.25	125,841,657.65	17,181,874,447.17	4,932,049.44
金融债	2,041,339,495.49	43,482,602.14	16,358,518.65	2,101,180,616.28	
企业债	5,729,765,601.05	118,449,496.22	-332,425,426.87	5,515,789,670.40	364,485,960.37
中期票据	2,042,327,698.24	40,097,123.30	13,755,401.76	2,096,180,223.30	8,201,764.81
次级债	30,001,837.47	1,080,780.82	43,042.53	31,125,660.82	66,741.89
非公开定向债务融资工具	320,104,842.81	6,265,945.20	4,057,947.19	330,428,735.20	2,653,811.73
其他	159,454,805.93	595,271.05	4,585,814.07	164,635,891.05	8,655,949.14
合计	29,304,438,715.40	498,243,504.87	-158,407,773.96	29,644,274,446.31	388,996,277.38

(续上表)

项 目	期初数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	1,308,015,677.04	20,057,913.21	820,705.93	1,328,894,296.18	
地方债	9,598,270,548.86	144,107,893.35	-34,535,675.23	9,707,842,766.98	9,764,940.59
金融债	1,969,163,571.37	38,913,312.58	7,551,356.54	2,015,628,240.49	15,881.69
企业债	9,637,996,253.61	188,263,093.93	-281,365,831.01	9,544,893,516.53	309,392,110.95
中期票据	1,604,687,171.26	31,748,564.62	-5,705,851.26	1,630,729,884.62	3,021,352.41
次级债	30,010,424.91	1,080,780.82	-65,564.91	31,025,640.82	50,506.53
非公开定向债务融资工具	280,988,539.53	5,289,616.43	-2,616,889.53	283,661,266.43	579,588.71
其他	197,000,000.00	1,117,934.25	188,930.00	198,306,864.25	308,357.05
合计	24,626,132,186.58	430,579,109.19	-315,728,819.47	24,740,982,476.30	323,132,737.93

注：2021年12月31日，本公司为回购交易设定质押的债券的公允价值计人民币22,338,297,570.73元，为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币420,484,702.34元，为期货业务充抵保证金设定质押的债券的公允价值计人民币607,199,961.51元。

(2) 减值准备变动情况

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小计
	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)	
期初数	41,195,787.93		281,936,950.00	323,132,737.93
期初数在本期	---	---	---	
--转入第二阶段	-308,758.51	308,758.51		
--转入第三阶段				
本期计提	-5,143,002.17	77,260,234.74		72,117,232.57
本期转销	6,253,693.12			6,253,693.12
期末数	29,490,334.13	77,568,993.25	281,936,950.00	388,996,277.38

#### 10. 其他权益工具投资

##### (1) 明细情况

项目	期末数		
	初始成本	公允价值	本期确认的 股利收入
非交易性权益工具	7,430,653,430.96	7,186,022,265.21	1,217,035,075.24

(续上表)

项目	期初数		
	初始成本	公允价值	本期确认的 股利收入
非交易性权益工具	11,236,017,316.50	11,762,890,145.34	302,071,971.62

##### (2) 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资的原因

本公司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,主要包括以融出证券为目的持有的证券投资、策略投资持有的证券投资。

上述其他权益工具投资包含本公司以融出证券为目的持有的证券投资,2021年12月31日该部分非交易性权益工具成本计人民币249,418,329.97元,公允价值计人民币362,679,933.97元。

上述其他权益工具投资包含本公司策略投资持有的证券投资,2021年12月31日该部分非交易性权益工具成本计人民币7,181,235,100.99元,公允价值计人民币6,823,342,331.24元。

(3) 本期终止确认的其他权益工具投资

1) 明细情况

项 目	终止确认时公允价值	本期股利收入	终止确认时从其他综合收益转入留存收益的累计利得和损失
股票	11,895,891,063.83	906,809,434.10	-697,381,698.16
小 计	11,895,891,063.83	906,809,434.10	-697,381,698.16

2) 处置权益工具投资的原因

其他权益工具投资处置的原因主要系本公司根据融券客户的需求调整融券证券持仓和投资策略调整所致。

(4) 其他说明

2021年12月31日，本公司持有的限售股的公允价值计人民币222,053,033.73元。

11. 长期股权投资

(1) 分类情况

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	减值	账面价值	账面余额	减值	账面价值
对联营企业投资	2,963,816,037.14		2,963,816,037.14	3,091,438,255.26		3,091,438,255.26
对合营企业投资	597,523,589.06		597,523,589.06	533,338,220.19		533,338,220.19
合 计	3,561,339,626.20		3,561,339,626.20	3,624,776,475.45		3,624,776,475.45

## (2) 明细情况

被投资单位	期初数	本期增减变动								期末数	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		
联营企业：											
鹏华基金管理有限公司（鹏华基金公司）	1,528,525,598.64			505,652,607.89			178,000,000.00			1,856,178,206.53	
前海股交投资控股（深圳）有限公司	207,928,631.73			3,013,737.10	-2,103,641.74	65,964.37	1,059,166.45			207,845,525.01	
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	29,288,610.60			2,225,495.35						31,514,105.95	
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金（有限合伙）	405,055,982.91		375,047,867.21	188,285,536.28						218,293,651.98	
常州高新投创业投资有限公司	75,127,546.90	14,113,037.72		38,091,964.28	-35,155,873.01					92,176,675.89	
深圳市前海弘泰基金管理有限公司	9,221,979.00			214,712.92						9,436,691.92	
深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司	4,508,905.43			-17.96						4,508,887.47	
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	327,794,579.61		264,279,866.51	15,508,953.16						79,023,666.26	
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	33,388,041.00		663,039.03	-1,773,396.25						30,951,605.72	

被投资单位	期初数	本期增减变动								期末数	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		
南京华文弘盛文化产业创业 投资基金合伙企业（有限合 伙）	56,558,447.65			-809,671.74						55,748,775.91	
深圳弘盛道格体育投资合伙 企业（有限合伙）	39,814,564.03		32,084,260.79	-361,057.95						7,369,245.29	
深圳市中亚亿百投资企业（有 限合伙）	14,647,046.50		17,625,228.47	2,978,181.97							
国信弘盛（珠海）能源产业基 金（有限合伙）	234,120,000.00		117,060,000.00							117,060,000.00	
厦门弘盛联发智能技术产业 股权投资基金合伙企业（有限 合伙）	71,410,590.73		25,352,286.73	17,447,020.90						63,505,324.90	
深圳市五色检测技术服务有 限公司	2,691,674.40			-191,026.69						2,500,647.71	
华润宝塔股权投资（延安）有 限公司	947,841.43			-333,438.52						614,402.91	
华润（延安）新产业经济投资 合伙企业（有限合伙）	1,000,483.56			-124,317.63						876,165.93	
深圳市国信亿合新兴产业私 募股权投资基金合伙企业（有 限合伙）	3,003,284.03	64,270,000.00		384,498.38						67,657,782.41	
国铁盛芯（青岛）股权投资企 业	46,404,447.11			14,142.78						46,418,589.89	

被投资单位	期初数	本期增减变动								期末数	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		
业（有限合伙）											
国铁盛和（青岛）私募股权投资 基金合伙企业（有限合伙）		20,580,868.00		14,555,217.46						35,136,085.46	
深圳市天使一号创业投资合 伙企业（有限合伙）		15,000,000.00								15,000,000.00	
盈科值得普泽（平潭）股权投 资合伙企业（有限合伙）		5,000,000.00								5,000,000.00	
深圳市创东方长辉投资企业 （有限合伙）		17,000,000.00								17,000,000.00	
小 计	3,091,438,255.26	135,963,905.72	832,112,548.74	784,779,141.73	-37,259,514.75	65,964.37	179,059,166.45			2,963,816,037.14	
合营企业：											
深圳市国信大族壹号机器人 产业投资基金（有限合伙）	48,464,626.44		266,544.73	-4,479,695.32						43,718,386.39	
深圳市国信蓝思基金管理有 限公司	7,577,413.20			1,876,620.40						9,454,033.60	
深圳市国信蓝思壹号投资基 金合伙企业（有限合伙）	18,395,677.97		18,847,475.36	81,077,565.91						80,625,768.52	
张家港弘盛产业资本母基金 合伙企业（有限合伙）	417,128,717.26			15,282,665.91						432,411,383.17	
珠海国信运通股权投资基金 （有限合伙）	31,646,397.19		11,271,568.12	-184,628.33						20,190,200.74	



被投资单位	期初数	本期增减变动								期末数	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		
珠海联发安科股权投资基金合伙企业（有限合伙）	10,125,388.13		195,555.55	1,193,984.06						11,123,816.64	
小 计	533,338,220.19		30,581,143.76	94,766,512.63						597,523,589.06	
合 计	3,624,776,475.45	135,963,905.72	862,693,692.50	879,545,654.36	-37,259,514.75	65,964.37	179,059,166.45			3,561,339,626.20	

12. 投资性房地产

项 目	房屋及建筑物	合 计
账面原值		
期初数	359,257,802.01	359,257,802.01
本期增加金额		
1) 外购		
2) 固定资产转入		
本期减少金额		
1) 处置		
2) 其他转出		
期末数	359,257,802.01	359,257,802.01
累计折旧和累计摊销		
期初数	60,219,584.44	60,219,584.44
本期增加金额	10,600,915.26	10,600,915.26
1) 计提或摊销	10,600,915.26	10,600,915.26
2) 固定资产转入		
本期减少金额		
1) 处置		
2) 其他转出		
期末数	70,820,499.70	70,820,499.70
账面价值		
期末账面价值	288,437,302.31	288,437,302.31
期初账面价值	299,038,217.57	299,038,217.57

13. 固定资产

(1) 账面价值

项 目	期末数	期初数
固定资产原价	3,791,881,295.16	2,297,254,751.28
减：累计折旧	1,111,981,868.87	1,032,629,859.83

项 目	期末数	期初数
固定资产减值准备		
加：固定资产清理		
固定资产合计	2,679,899,426.29	1,264,624,891.45

(2) 固定资产增减变动表

项 目	房屋及建筑物	交通工具	电子设备	办公设备及其他	合 计
账面原值					
期初数	1,222,880,117.15	81,819,939.24	964,657,684.69	27,897,010.20	2,297,254,751.28
本期增加金额	1,447,720,647.55	9,434,505.30	125,919,196.83	5,793,157.17	1,588,867,506.85
1) 购置		9,434,505.30	75,890,795.23	5,793,157.17	91,118,457.70
2) 在建工程转入	1,447,720,647.55		50,028,401.60		1,497,749,049.15
3) 外币报表折算差额					
本期减少金额		7,759,261.67	83,884,930.13	2,596,771.17	94,240,962.97
1) 处置或报废		7,726,857.49	83,062,180.71	2,590,880.04	93,379,918.24
2) 转入投资性房地产					
3) 其他		32,404.18	822,749.42	5,891.13	861,044.73
期末数	2,670,600,764.70	83,495,182.87	1,006,691,951.39	31,093,396.20	3,791,881,295.16
累计折旧					
期初数	383,729,635.40	56,874,501.04	573,936,330.50	18,089,392.89	1,032,629,859.83
本期增加金额	29,166,576.72	5,321,424.16	131,202,997.05	2,451,067.47	168,142,065.40
1) 计提	29,166,576.72	5,321,424.16	131,202,997.05	2,451,067.47	168,142,065.40
2) 外币报表折算差额					
本期减少金额		7,316,880.07	79,129,115.86	2,344,060.43	88,790,056.36
1) 处置或报废		7,287,778.29	78,532,297.95	2,341,759.86	88,161,836.10
2) 转入投资性房地产					
3) 其他		29,101.78	596,817.91	2,300.57	628,220.26
期末数	412,896,212.12	54,879,045.13	626,010,211.69	18,196,399.93	1,111,981,868.87
减值准备					

项 目	房屋及建筑物	交通工具	电子设备	办公设备及其他	合 计
期初数					
本期增加金额					
本期减少金额					
期末数					
账面价值					
期末账面价值	2,257,704,552.58	28,616,137.74	380,681,739.70	12,896,996.27	2,679,899,426.29
期初账面价值	839,150,481.75	24,945,438.20	390,721,354.19	9,807,617.31	1,264,624,891.45

(3) 未办妥产权证书的固定资产的情况

项 目	账面价值	未办妥产权证书原因
深圳市福田区红树福苑小区20套人才房	4,824,136.09	人才安居住房为有限产权，仅有购房合同，不予办理房产证
深圳市南山区松坪村三期4套人才房	1,044,521.13	
深圳市罗湖区莲馨家园6套人才房	4,126,711.58	
深圳市福田区信托花园8栋202房	454,890.11	因历史原因未办理房产证
绵阳中大财富广场20-22层商品房	20,831,616.40	因开发商涉及诉讼
国信金融大厦	1,122,795,025.05	正在办理中
小 计	1,154,076,900.36	

14. 在建工程

(1) 明细情况

工程名称	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
国信金融大厦项目（深圳）				976,859,698.90		976,859,698.90
国信金融大厦机房装修项目	12,938,016.90		12,938,016.90	41,789,798.67		41,789,798.67
机房设备建设	6,926,823.40		6,926,823.40	4,809,407.50		4,809,407.50
分支机构装修项目	1,993,659.02		1,993,659.02	997,058.62		997,058.62
其他项目	1,998,287.21		1,998,287.21			
合 计	23,856,786.53		23,856,786.53	1,024,455,963.69		1,024,455,963.69

## (2) 重要在建工程项目本期变动情况

工程名称	预算数 (万元)	期初数	本期增加	转入固定资产	其他减少	期末数
国信金融大厦项目(深圳)	134,690	976,859,698.90	391,406,988.37	1,368,266,687.27		
小计	134,690	976,859,698.90	391,406,988.37	1,368,266,687.27		

(续上表)

工程名称	工程累计投入 占预算比例(%)	工程进度(%)	利息资本 化累计金额	本期利息 资本化金额	本期利息资本 化率(%)	资金来源
国信金融大厦项目(深圳)	101.59	100.00				自筹
小计						

## 15. 使用权资产

项目	房屋及建筑物	合计
成本		
期初数	437,234,238.75	437,234,238.75
本期增加金额	197,273,096.10	197,273,096.10
本期减少金额	25,043,609.20	25,043,609.20
期末数	609,463,725.65	609,463,725.65
累计折旧		
期初数		
本期增加金额	165,721,990.38	165,721,990.38
(1) 计提	165,721,990.38	165,721,990.38
本期减少金额	16,055,535.19	16,055,535.19
期末数	149,666,455.19	149,666,455.19
减值准备		
期初数		
本期增加金额		
(1) 计提		
本期减少金额		

项 目	房屋及建筑物	合 计
期末数		
账面价值		
期末账面价值	459,797,270.46	459,797,270.46
期初账面价值[注]	437,234,238.75	437,234,238.75

[注]期初数与上期期末余额(2020年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十六)1之说明

#### 16. 无形资产

项 目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合 计
账面原值					
期初数	598,127,957.00	497,231,298.65	66,577,562.50	9,155,202.59	1,171,092,020.74
本期增加金额		98,903,692.25			98,903,692.25
(1) 购置		98,903,692.25			98,903,692.25
本期减少金额		8,419,607.70		39,503.88	8,459,111.58
(1) 处置		8,419,607.70		39,500.00	8,459,107.70
(2) 外币报表折算差额				3.88	3.88
期末数	598,127,957.00	587,715,383.20	66,577,562.50	9,115,698.71	1,261,536,601.41
累计摊销					
期初数	150,175,602.00	315,784,555.66	36,824,817.12	2,614,583.17	505,399,557.95
本期增加金额	12,128,889.84	68,644,021.60		248,166.19	81,021,077.63
(1) 计提	12,128,889.84	68,644,021.60		248,166.19	81,021,077.63
本期减少金额		8,359,783.98		39,501.26	8,399,285.24
(1) 处置		8,129,967.05		39,500.00	8,169,467.05
(2) 外币报表折算差额		229,816.93		1.26	229,818.19
期末数	162,304,491.84	376,068,793.28	36,824,817.12	2,823,248.10	578,021,350.34
减值准备					
期初数		3,486.11			3,486.11

项 目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合 计
本期增加金额					
本期减少金额					
期末数		3,486.11			3,486.11
账面价值					
期末账面价值	435,823,465.16	211,643,103.81	29,752,745.38	6,292,450.61	683,511,764.96
期初账面价值	447,952,355.00	181,443,256.88	29,752,745.38	6,540,619.42	665,688,976.68

## 17. 商誉

### (1) 商誉账面原值

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初数	本期企业合并形成	本期减少		期末数
			处置	其他	
收购证券营业部	22,135,974.26				22,135,974.26
收购子公司	10,260,249.61				10,260,249.61
其中：国信期货公司	10,260,249.61				10,260,249.61
合 计	32,396,223.87				32,396,223.87

### (2) 商誉减值准备

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初数	本期增加		本期减少		期末数
		计提	其他	处置	其他	
收购证券营业部	22,135,974.26					22,135,974.26
小 计	22,135,974.26					22,135,974.26

### (3) 商誉减值测试过程

#### 1) 收购证券营业部

本公司收购民安证券有限责任公司（以下简称民安证券）17家营业部计提的商誉减值。本公司于2006年1月收购民安证券17家营业部，收购对价与民安证券17家营业部净资产账面价值的差额12,501,991.26元计入商誉。其余9,633,983.00元系本公司历年收购其他证券营业部形成的商誉。

2008年本公司对上述商誉余额进行减值测试，计提商誉减值准备22,135,974.26元。

#### 2) 收购国信期货公司

本公司于2007年8月收购国信期货公司，收购对价与国信期货公司净资产账面价值的

差额 10,260,249.61 计入商誉。

目前国内商品期货市场呈现出快速发展的趋势，市场的影响力越来越大，上市品种越来越丰富，相关的资金正不断地进入期货市场，套期保值的能力被越来越多的投资者所接受。在未来较长的时间内，商品期货的发展依然延续。随着期货新品种的不断推出，期货市场的发展空间巨大。国信期货公司业已取得商品期货及金融期货的业务资格，预计国信期货公司的可收回金额高于其账面价值，本公司由此判断该商誉不存在减值迹象。

#### 18. 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

项 目	期末数		期初数	
	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
计提未付的应付职工薪酬	6,065,627,821.21	1,516,406,955.31	4,237,197,216.55	1,059,207,708.46
资产减值准备	2,303,050,239.40	575,762,559.85	2,819,996,171.95	704,999,043.01
金融工具公允价值变动	675,083,538.94	168,770,884.68	1,424,593,066.45	356,148,266.61
预计负债	185,482,275.07	46,370,568.77	517,647,128.86	129,411,782.22
递延收益	126,289,655.52	31,572,414.00	129,765,517.56	32,441,379.48
其他	56,124,378.00	14,031,094.50	1,725,856.40	431,464.10
合 计	9,411,657,908.14	2,352,914,477.11	9,130,924,957.77	2,282,639,643.88

##### (2) 未经抵销的递延所得税负债

项 目	期末数		期初数	
	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
金融工具公允价值变动	2,483,084,919.74	620,771,230.02	1,742,500,805.40	435,572,172.01
合营/联营企业损益变动	303,683,408.60	75,920,852.16	419,363,024.32	104,840,756.08
合 计	2,786,768,328.34	696,692,082.18	2,161,863,829.72	540,412,928.09

##### (3) 未确认递延所得税资产明细

项 目	期末数	期初数
可抵扣暂时性差异	706,827,257.85	974,693,550.17



项 目	期末数	期初数
可抵扣亏损	504,421,707.32	506,284,400.18
小 计	1,211,248,965.17	1,480,977,950.35

(4) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

未确认递延所得税资产的可抵扣亏损系本公司之子公司国信香港公司尚在可补亏年度内的亏损额，预计该公司短期难以补亏，故未确认递延所得税资产，且该亏损额无抵扣时间限制。

## 19. 其他资产

### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数[注]
长期待摊费用	142,692,230.12	113,128,634.77
预付款项	124,158,407.79	99,245,735.08
其他应收款	88,545,790.21	88,607,761.68
待认证进项税	88,191,193.46	65,621,447.74
预缴税金	8,188,393.17	3,969,134.59
应收股利	7,714,252.26	105,578,219.05
待抵扣进项税	6,108,946.27	15,209,595.68
期货会员资格	1,400,000.00	1,400,000.00
合 计	466,999,213.28	492,760,528.59

[注]期初数与上期期末余额(2020年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十六)1之说明

### (2) 其他应收款

#### 1) 类别明细情况

种 类	期末数				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	7,300,000.00	7.24	7,300,000.00	100.00	
按组合计提坏账准备	93,595,668.98	92.76	5,049,878.77	5.40	88,545,790.21
其中: 应收往来款组合	28,242,175.85	27.99	5,049,878.77	17.88	23,192,297.08

种类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
应收押金保证金组合	65,353,493.13	64.77			65,353,493.13
合计	100,895,668.98	100.00	12,349,878.77	12.24	88,545,790.21

(续上表)

种类	期初数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	7,300,000.00	7.25	7,300,000.00	100.00	
按组合计提坏账准备	93,385,855.13	92.75	4,778,093.45	5.12	88,607,761.68
其中: 应收往来款组合	32,751,815.11	32.53	4,778,093.45	14.59	27,973,721.66
应收押金保证金组合	60,634,040.02	60.22			60,634,040.02
合计	100,685,855.13	100.00	12,078,093.45	12.00	88,607,761.68

2) 期末单项计提坏账准备的其他应收款

其他应收款内容	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
中国华兴(集团)公司	7,300,000.00	7,300,000.00	100.00	处于关停状态

3) 按组合计提坏账准备的其他应收款

种类	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)
应收押金保证金	65,353,493.13	69.83		
应收往来款组合	28,242,175.85	30.17	5,049,878.77	17.88
其中: 1年以内	2,873,134.72	3.07	14,365.67	0.50
1至2年	9,697,023.40	10.36	484,851.17	5.00
2至3年	754,716.96	0.80	75,471.70	10.00
3年以上	14,917,300.77	15.94	4,475,190.23	30.00
合计	93,595,668.98	100.00	5,049,878.77	5.40

(续上表)

种 类	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
应收押金保证金	60,634,040.02	64.93		
应收往来款组合	32,751,815.11	35.07	4,778,093.45	14.59
其中：1年以内	15,555,751.45	16.66	161,074.86	1.04
1至2年	754,816.96	0.81	37,740.85	5.00
2至3年	1,765,481.37	1.89	176,548.14	10.00
3年以上	14,675,765.33	15.71	4,402,729.60	30.00
合 计	93,385,855.13	100.00	4,778,093.45	5.12

4) 坏账准备变动情况

项 目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小 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)	
期初数	4,778,093.45		7,300,000.00	12,078,093.45
本期计提	271,785.32			271,785.32
本期转回				
期末数	5,049,878.77		7,300,000.00	12,349,878.77

(3) 长期待摊费用

项 目	期初数	本期增加	本期摊销	其他减少	期末数	其他减少 的原因
办公家私	14,710,148.13	10,244,683.90	6,391,292.27	11,672.63	18,551,867.13	报废
装修费及 其他	98,418,486.64	73,723,974.69	46,445,422.71	1,556,675.63	124,140,362.99	报废
合 计	113,128,634.77	83,968,658.59	52,836,714.98	1,568,348.26	142,692,230.12	

20. 资产减值准备明细

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期计提	本期减少		外币报表折算差 额	期末数
			转回	转销/核销		
融出资金减值准备	238,260,613.42	-46,726,400.70		5,859,119.24	-20,611.88	185,654,481.60
应收款项坏账准备	1,337,883,499.71	326,590,364.48		153,912,327.13	-15,425,323.26	1,495,136,213.80
买入返售金融资产减值准备	2,151,463,876.77	-873,703,615.63				1,277,760,261.14
其他债权投资减值准备	323,132,737.93	72,117,232.57		6,253,693.12		388,996,277.38
其他应收款坏账准备	12,078,093.45	271,785.32				12,349,878.77
金融工具及其他项目信用减值准备小计	4,062,818,821.28	-521,450,633.96		166,025,139.49	-15,445,935.14	3,359,897,112.69
商誉减值准备	22,135,974.26					22,135,974.26
大宗商品跌价准备		96,261.07		96,261.07		
无形资产减值准备	3,486.11					3,486.11
其他资产减值准备小计	22,139,460.37	96,261.07		96,261.07		22,139,460.37
合 计	4,084,958,281.65	-521,354,372.89		166,121,400.56	-15,445,935.14	3,382,036,573.06

## (2) 金融工具及其他项目预期信用损失准备

项 目	期末数			小计
	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）	
买入返售金融资产减值准备	6,185,274.12		1,271,574,987.02	1,277,760,261.14
应收款项坏账准备（简化模型）		17,667,898.93	1,477,468,314.87	1,495,136,213.80
融出资金减值准备	175,889,772.56		9,764,709.04	185,654,481.60
其他债权投资减值准备	29,490,334.13	77,568,993.25	281,936,950.00	388,996,277.38
其他应收款减值准备（一般模型）	5,049,878.77		7,300,000.00	12,349,878.77
合 计	216,615,259.58	95,236,892.18	3,048,044,960.93	3,359,897,112.69

## 21. 短期借款

项 目	期末数	期初数
信用借款	225,270,000.00	345,968,514.70
合 计	225,270,000.00	345,968,514.70

## 22. 应付短期融资款

项 目	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率	期初数	本期增加	本期减少	期末数
20 国信 CP012	3,000,000,000.00	2020/10/14	90 天	3,000,000,000.00	2.80%	3,018,180,821.92	2,531,506.85	3,020,712,328.77	
20 国信 CP013	3,000,000,000.00	2020/10/28	90 天	3,000,000,000.00	3.12%	3,016,721,917.81	6,357,534.24	3,023,079,452.05	
20 国信 CP014	3,500,000,000.00	2020/11/25	90 天	3,500,000,000.00	3.33%	3,511,814,657.53	16,923,698.63	3,528,738,356.16	
20 国信 CP015	3,500,000,000.00	2020/12/14	88 天	3,500,000,000.00	2.94%	3,505,074,520.55	19,734,246.57	3,524,808,767.12	
21 国信 CP001	3,500,000,000.00	2021/1/7	90 天	3,500,000,000.00	2.53%		3,521,834,246.58	3,521,834,246.58	
21 国信 CP002	3,500,000,000.00	2021/1/28	90 天	3,500,000,000.00	2.89%		3,524,941,095.89	3,524,941,095.89	
21 国信 CP003	4,000,000,000.00	2021/2/8	88 天	4,000,000,000.00	3.03%		4,029,220,821.92	4,029,220,821.92	
21 国信 CP004	4,000,000,000.00	2021/3/11	90 天	4,000,000,000.00	2.67%		4,026,334,246.58	4,026,334,246.58	
21 国信 CP005	4,000,000,000.00	2021/4/12	88 天	4,000,000,000.00	2.65%		4,025,556,164.38	4,025,556,164.38	
21 国信 CP006	3,500,000,000.00	2021/5/17	88 天	3,500,000,000.00	2.42%		3,520,420,821.92	3,520,420,821.92	
21 国信 CP007	4,000,000,000.00	2021/6/15	87 天	4,000,000,000.00	2.49%		4,023,740,273.97	4,023,740,273.97	
21 国信 CP008	4,000,000,000.00	2021/7/15	90 天	4,000,000,000.00	2.39%		4,023,572,602.74	4,023,572,602.74	
21 国信 CP009	4,000,000,000.00	2021/8/5	85 天	4,000,000,000.00	2.36%		4,021,983,561.64	4,021,983,561.64	
21 国信 CP010	4,000,000,000.00	2021/8/25	90 天	4,000,000,000.00	2.35%		4,023,178,082.19	4,023,178,082.19	
21 国信 CP011	4,000,000,000.00	2021/9/1	91 天	4,000,000,000.00	2.40%		4,023,934,246.58	4,023,934,246.58	

项 目	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率	期初数	本期增加	本期减少	期末数
21 国信 CP012	2,000,000,000.00	2021/9/8	365 天	2,000,000,000.00	2.70%		2,017,013,698.63		2,017,013,698.63
21 国信 CP013	700,000,000.00	2021/10/13	91 天	700,000,000.00	2.55%		703,912,328.77		703,912,328.77
21 国信 CP014	3,000,000,000.00	2021/10/13	181 天	3,000,000,000.00	2.70%		3,017,753,424.66		3,017,753,424.66
21 国信 CP015	1,000,000,000.00	2021/10/21	91 天	1,000,000,000.00	2.60%		1,005,128,767.12		1,005,128,767.12
21 国信 CP016	2,000,000,000.00	2021/10/21	182 天	2,000,000,000.00	2.77%		2,010,928,219.18		2,010,928,219.18
21 国信 CP017	4,500,000,000.00	2021/11/1	365 天	4,500,000,000.00	2.86%		4,521,508,767.12		4,521,508,767.12
21 国信 CP018	2,000,000,000.00	2021/11/4	120 天	2,000,000,000.00	2.65%		2,008,421,917.81		2,008,421,917.81
21 国信 CP019	2,000,000,000.00	2021/11/4	187 天	2,000,000,000.00	2.73%		2,008,676,164.38		2,008,676,164.38
收益凭证[注]	25,727,407,000.00			25,727,407,000.00		12,877,737,146.83	13,205,620,508.40	23,576,668,136.91	2,506,689,518.32
合 计	98,427,407,000.00			98,427,407,000.00		25,929,529,064.64	73,309,226,946.75	79,438,723,205.40	19,800,032,805.99

[注]本公司 2021 年度共发行 889 期收益凭证，其中一年期以下 670 期，一年期以上 219 期；一年期以下收益凭证未到期产品共 215 期，固定收益率为 1.00%至 10.00%；一年期以上收益凭证未到期产品共 219 期，固定收益率为 3.00%

23. 拆入资金

(1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
银行拆入资金	2,445,382,847.23	3,421,379,888.88
转融通拆入资金	2,011,415,124.75	3,012,671,710.08
合 计	4,456,797,971.98	6,434,051,598.96

(2) 转融通拆入资金

剩余期限	期末数		期初数	
	金额	利率区间	金额	利率区间
1个月以内				
1至3个月	2,011,415,124.75	2.80%	3,012,671,710.08	2.80%
3至12个月				
1年以上				
合 计	2,011,415,124.75		3,012,671,710.08	

24. 交易性金融负债

项 目	期末数		
	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
债券借贷	295,918,604.98		295,918,604.98
第三方在结构化主体中享有的权益	98,547,262.54		98,547,262.54
融入证券	66,516,883.58		66,516,883.58
合 计	460,982,751.10		460,982,751.10

(续上表)

项 目	期初数		
	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
债券借贷			



项 目	期初数		
	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
第三方在结构化主体中享有的权益	51,919,972.78		51,919,972.78
融入证券			
合 计	51,919,972.78		51,919,972.78

## 25. 卖出回购金融资产款

### (1) 明细情况——按业务类型

项 目	期末数	期初数
质押式卖出回购	89,875,041,390.31	66,344,733,349.62
质押式报价回购	5,570,191,067.94	5,502,151,969.46
买断式卖出回购	1,079,696,993.37	
融资融券收益权回购		300,366,666.33
合 计	96,524,929,451.62	72,147,251,985.41

### (2) 明细情况——按金融资产种类

项 目	期末数	期初数
债券	96,524,929,451.62	71,846,885,319.08
融资融券收益权		300,366,666.33
合 计	96,524,929,451.62	72,147,251,985.41

### (3) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
债券	110,816,570,630.53	88,867,640,585.40
融资融券收益权		306,108,305.20
合 计	110,816,570,630.53	89,173,748,890.60

### (4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

剩余期限	期末数	利率区间	期初数	利率区间
1 个月内	5,433,779,726.84	1.70%-8.18%	5,415,029,813.08	1.55%-6.08%

剩余期限	期末数	利率区间	期初数	利率区间
1个月至3个月内	97,898,161.37		65,445,671.20	
3个月至1年内	38,513,179.73		21,676,485.18	
1年以上				
小计	5,570,191,067.94		5,502,151,969.46	

26. 代理买卖证券款

(1) 明细情况

项目	期末数	期初数
普通经纪业务		
其中：个人	46,100,495,089.51	42,098,929,285.40
机构	13,886,430,348.17	10,754,202,626.48
小计	59,986,925,437.68	52,853,131,911.88
信用业务		
其中：个人	5,356,899,623.33	5,603,097,763.67
机构	1,936,467,055.72	1,290,035,554.44
小计	7,293,366,679.05	6,893,133,318.11
合计	67,280,292,116.73	59,746,265,229.99

(2) 分币种列示

项目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
人民币			64,626,383,704.04			57,835,596,544.70
美元	135,945,859.87	6.3757	866,750,018.77	79,291,771.50	6.5249	517,370,879.99
港币	2,185,859,092.40	0.8176	1,787,158,393.92	1,655,534,464.38	0.8416	1,393,297,805.30
合计			67,280,292,116.73			59,746,265,229.99

27. 应付职工薪酬

(1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	4,645,230,619.12	7,446,431,933.47	5,604,621,866.05	6,487,040,686.54
离职后福利—设定提存计划	3,775,178.60	539,050,828.22	537,885,802.75	4,940,204.07
合 计	4,649,005,797.72	7,985,482,761.69	6,142,507,668.80	6,491,980,890.61

(2) 短期薪酬明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	4,328,883,673.16	6,780,584,410.55	4,943,536,258.15	6,165,931,825.56
职工福利费		90,389,641.41	90,389,641.41	
社会保险费	890,475.43	164,483,438.08	164,132,705.83	1,241,207.68
其中：医疗保险费	774,636.28	151,913,552.66	151,587,308.21	1,100,880.73
工伤保险费	39,854.96	3,101,760.08	3,094,552.94	47,062.10
生育保险费	75,984.19	9,468,125.34	9,450,844.68	93,264.85
住房公积金	259,707.63	252,842,707.56	252,714,376.96	388,038.23
工会经费和职工教育经费	315,196,162.90	145,345,363.97	141,062,511.80	319,479,015.07
其他短期薪酬	600.00	12,786,371.90	12,786,371.90	600.00
小 计	4,645,230,619.12	7,446,431,933.47	5,604,621,866.05	6,487,040,686.54

(3) 设定提存计划明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	1,784,501.81	313,923,668.88	313,300,534.36	2,407,636.33
失业保险费	31,128.62	5,907,098.67	5,886,400.01	51,827.28
补充养老保险(企业年金)	1,959,548.17	219,220,060.67	218,698,868.38	2,480,740.46
小 计	3,775,178.60	539,050,828.22	537,885,802.75	4,940,204.07

28. 应交税费

项 目	期末数	期初数
企业所得税	408,924,985.41	894,224,709.63

项 目	期末数	期初数
代扣代缴税金	299,288,182.76	279,259,679.47
其中：代扣代缴个人所得税	141,616,600.34	79,563,064.05
增值税	106,262,284.25	87,275,601.53
城市维护建设税	7,477,263.02	6,208,572.13
教育费附加及地方教育附加	5,347,036.98	4,432,994.59
房产税	2,598,475.34	2,185,624.26
其他	1,280,891.68	1,488,216.93
合 计	831,179,119.44	1,275,075,398.54

#### 29. 应付款项

项 目	期末数	期初数
待交付清算款	3,186,971,188.37	2,657,291,466.98
收益互换业务相关款项	1,821,175,304.98	131,040,000.00
应付投行手续费支出	48,645,713.61	51,761,882.92
应付投资者保护基金	54,917,741.78	43,513,793.32
应付资管产品增值税及附加	46,567,356.66	41,880,216.63
应付大宗商品货款	24,119,060.58	26,495,327.28
应付银行三方存管费	16,805,926.97	13,691,863.34
应付外单位往来款	16,629,908.59	20,977,094.33
银行中间业务费	6,335,789.47	6,726,173.70
应付场外业务结算款	5,541,067.05	79,021.80
应付资管计划 A 份额净值		2,526,714,577.98
应付资管产品认购款		88,642,758.77
应付股票借贷保证金		21,695,984.64
应付股票质押保证金		15,647,929.62
应付赎回款		11,492,917.48
应付债券发行费用		10,000,000.00
其他	47,270,066.94	30,532,916.25
合 计	5,274,979,125.00	5,698,183,925.04

30. 预计负债

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
未决诉讼[注]	517,647,128.86	62,329,112.36	394,493,966.15	185,482,275.07
行政罚款		8,176,000.00		8,176,000.00
合 计	517,647,128.86	70,505,112.36	394,493,966.15	193,658,275.07

[注]本公司对多起涉诉案件进行审慎判断,并根据相关裁决书,本年度计提预计负债-332,164,853.79元

31. 应付债券

类 型	债券名称	面值	起息日期	债券 期限	发行金额	票面 利率	期初数	本期增加	本期减少	期末余额
公司债	18 国信 03	3,700,000,000.00	2018/8/8	3 年	3,700,000,000.00	3.97%	3,758,481,901.04	88,408,098.96	3,846,890,000.00	
公司债	18 国信 04	3,000,000,000.00	2018/11/19	3 年	3,000,000,000.00	4.15%	3,014,470,582.46	110,029,417.54	3,124,500,000.00	
公司债	19 国信 01	1,500,000,000.00	2019/3/11	3 年	1,500,000,000.00	4.05%	1,549,128,174.72	60,867,924.48	60,750,000.00	1,549,246,099.20
公司债	19 国信 02	3,500,000,000.00	2019/4/8	3 年	3,500,000,000.00	4.00%	3,602,450,574.02	140,275,157.24	140,000,000.00	3,602,725,731.26
公司债	19 国信 03	4,000,000,000.00	2019/7/4	3 年	4,000,000,000.00	4.00%	4,078,870,767.63	160,314,465.39	160,000,000.00	4,079,185,233.02
公司债	20 国信 01	3,000,000,000.00	2020/1/13	3 年	3,000,000,000.00	3.60%	3,096,911,846.59	111,763,883.60	108,000,000.00	3,100,675,730.19
公司债	20 国信 02	5,000,000,000.00	2020/3/2	3 年	5,000,000,000.00	3.17%	5,118,818,371.05	164,789,308.12	158,500,000.00	5,125,107,679.17
公司债	20 国信 03	2,500,000,000.00	2020/12/14	375 天	2,500,000,000.00	3.35%	2,501,195,363.61	84,849,156.39	2,586,044,520.00	
公司债	20 国信 04	2,500,000,000.00	2020/12/14	2 年	2,500,000,000.00	3.60%	2,498,465,647.85	93,116,195.56	90,000,000.00	2,501,581,843.41
公司债	20 国信 05	3,000,000,000.00	2020/12/22	370 天	3,000,000,000.00	3.15%	3,002,589,041.10	99,551,960.60	3,102,141,001.70	
公司债	20 国信 06	2,000,000,000.00	2020/12/22	3 年	2,000,000,000.00	3.70%	2,002,027,397.26	78,173,813.60	86,521,440.82	1,993,679,770.04
公司债	21 国信 01	3,000,000,000.00	2021/2/1	375 天	3,000,000,000.00	3.15%		3,096,851,331.13	11,320,754.71	3,085,530,576.42
公司债	21 国信 02	2,000,000,000.00	2021/2/1	3 年	2,000,000,000.00	3.64%		2,068,923,066.01	7,547,169.81	2,061,375,896.20
公司债	21 国信 03	2,000,000,000.00	2021/7/6	3 年	2,000,000,000.00	3.35%		2,033,850,582.91	5,958,291.96	2,027,892,290.95
公司债	21 国信 04	3,000,000,000.00	2021/7/6	5 年	3,000,000,000.00	3.68%		3,055,630,942.82	14,895,729.87	3,040,735,212.95

类 型	债券名称	面值	起息日期	债券 期限	发行金额	票面 利率	期初数	本期增加	本期减少	期末余额
公司债	21 国信 05	2,400,000,000.00	2021/7/21	3 年	2,400,000,000.00	3.16%		2,434,076,054.79		2,434,076,054.79
公司债	21 国信 06	3,300,000,000.00	2021/7/21	5 年	3,300,000,000.00	3.48%		3,351,599,342.47		3,351,599,342.47
公司债	21 国信 07	2,700,000,000.00	2021/9/15	3 年	2,700,000,000.00	3.09%		2,724,686,136.99		2,724,686,136.99
公司债	21 国信 10	4,000,000,000.00	2021/10/22	3 年	4,000,000,000.00	3.28%		4,026,514,144.55	11,916,583.92	4,014,597,560.63
公司债	21 国信 11	1,000,000,000.00	2021/10/22	5 年	1,000,000,000.00	3.63%		1,007,309,358.07	4,965,243.30	1,002,344,114.77
公司债	21 国信 12	3,000,000,000.00	2021/11/23	3 年	3,000,000,000.00	3.09%		3,009,904,931.51		3,009,904,931.51
公司债	21 国信 13	2,000,000,000.00	2021/11/23	5 年	2,000,000,000.00	3.43%		2,007,329,863.01		2,007,329,863.01
收益凭证	[注]	1,405,159,000.00			1,405,159,000.00		1,122,794,234.46	310,760,920.31	1,143,341,730.10	290,213,424.67
合 计		63,505,159,000.00			63,505,159,000.00		35,346,203,901.79	30,319,576,056.05	14,663,292,466.19	51,002,487,491.65

[注]详见本财务报表附注五(一)22 应付短期融资款[注]之说明，期末一年期以上收益凭证未到期产品共 219 期，固定收益率为 3.00%

### 32. 租赁负债

项 目	期末数	期初数[注]
尚未支付的租赁付款额	474,596,201.70	439,830,748.62
减：未确认融资费用	27,579,461.84	28,717,588.76
合 计	447,016,739.86	411,113,159.86

[注]期初数与上期期末余额(2020年12月31日)差异详见本财务报表附注三(三十六)1之说明

### 33. 递延收益

#### (1) 明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数	形成原因
政府补助	129,765,517.56		3,475,862.04	126,289,655.52	[注]
合 计	129,765,517.56		3,475,862.04	126,289,655.52	

[注]系本公司2010年度收到的深圳市人民政府的金融发展专项资金。根据深圳市人民政府发布的《深圳市人民政府关于印发深圳市支持金融业发展若干规定的通知》及《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》，本公司于2010年度收到深圳市人民政府金融发展专项资金计人民币168,000,000.00元，截至2021年12月31日，本公司按照剩余土地使用年限摊销累计结转计人民币41,710,344.48元。根据《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》的相关规定，本公司取得该项金融发展专项资金的前提是承诺10年内不迁离深圳

#### (2) 政府补助明细情况

项 目	期初数	本期新增 补助金额	本期计入当期损 益[注]	期末数	与资产相关/ 与收益相关
购地补偿款	129,765,517.56		3,475,862.04	126,289,655.52	与资产相关
小 计	129,765,517.56		3,475,862.04	126,289,655.52	

[注]政府补助本期计入当期损益情况详见本财务报表附注五(四)2之说明

### 34. 其他负债

项 目	期末数	期初数[注 1]
应付货币保证金[注 2]	10,029,318,538.62	6,796,767,228.35
其他应付款	545,312,326.04	271,646,714.80



项 目	期末数	期初数[注 1]
应付股利[注 3]	446,500,000.00	
期货风险准备金	115,136,712.17	94,121,360.64
应付质押保证金[注 2]	106,006,080.00	1,505,313,512.00
应付利息	18,599,556.90	6,907,416.21
代理兑付债券款	323,800.00	323,800.00
其他	8,991,915.56	3,056,927.13
合 计	11,270,188,929.29	8,678,136,959.13

[注 1]期初数与上期期末余额（2020 年 12 月 31 日）差异详见本财务报表附注三（三十六）1 之说明

[注 2]系本公司之子公司国信期货公司应付个人及法人的客户保证金

[注 3]系应付本公司发行的永续次级债利息

### 35. 股本

项 目	期初数	本期增减变动（减少以“—”表示）					期末数
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	9,612,429,377.00						9,612,429,377.00

### 36. 其他权益工具

#### (1) 期末发行在外的永续债基本情况

经本公司第三届董事会第四十四次会议审议通过，并经公司 2017 年第一次临时股东大会审议通过《关于公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，公司可以一次或多次或多期发行境内债务融资工具和境外债务融资工具，公司境内外公司债务融资工具规模合计不超过人民币 800 亿元。根据中国证监会出具的《关于国信证券股份有限公司非公开发行永续次级债券有关意见的复函》（机构部函〔2020〕1372 号），中国证监会对本公司非公开发行永续次级债券无异议。

2020 年 7 月 13 日，本公司完成了 2020 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.50%；2020 年 9 月 17 日，本公司完成了 2020 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.80%；2021 年 4 月 12 日，本公司完成 2021 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.55%；2021 年 4 月 26 日，本公司完成 2021 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.38%。

本公司发行的上述永续次级债券，于本公司依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在本公司依据发行条款的约定赎回时到期；以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期，第 5 个和其后每个付息日发行人都可无条件行使续期选择权；在第 5 个和其后每个付息日，本公司有权按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回本息。上述永续次级债券采用浮动利率形式，单利按年计息，前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起，每 5 年重置一次票面利率；如果本公司不行使赎回权，则从第 2 个重定价周期（即第 6 个计息年度）开始票面利率调整为当期基准利率加上基本利差再加上 300 个基点（当期基准利率+基本利差+300BP）。

除非发生强制付息事件，上述永续次级债的每个付息日发行人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至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；递延支付的金额将按照当期执行的利率计算复息。在下个利息支付日，若本公司继续选择延后支付，则上述递延支付的金额产生的复息将加入已经递延的所有利息及其孳息中继续计算利息。强制付息事件包括：付息日前 12 个月，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红，（2）减少注册资本。

2021 年度，本公司宣告分配永续次级债券利息合计人民币 911,500,000.00 元。

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况

项 目	期初数		本期增加		本期减少		期末数	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
2020 年永续次级债券（第一期）		5,000,000,000.00						5,000,000,000.00
2020 年永续次级债券（第二期）		5,000,000,000.00						5,000,000,000.00
2021 年永续次级债券（第一期）				5,000,000,000.00				5,000,000,000.00
2021 年永续次级债券（第二期）				5,000,000,000.00				5,000,000,000.00
合 计		10,000,000,000.00		10,000,000,000.00				20,000,000,000.00

37. 资本公积

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
股本溢价	20,051,541,942.88			20,051,541,942.88
其他资本公积[注]	104,064,662.59	65,964.37		104,130,626.96
合 计	20,155,606,605.47	65,964.37		20,155,672,569.84

[注]其他资本公积本期变动主要是联营企业资本公积变动所致

## 38. 其他综合收益

项 目	期初数	本期发生额				减：其他综合收益 结转留存收益	期末数
		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	税后归属于母公司		
不能重分类进损益的 其他综合收益	395,154,621.58	-1,468,885,692.75	-367,221,423.18		-1,101,664,269.57	-523,036,273.61	-183,473,374.38
其中：其他权益工具投资 公允价值变动	395,154,621.58	-1,468,885,692.75	-367,221,423.18		-1,101,664,269.57	-523,036,273.61	-183,473,374.38
以后将重分类进损益的 其他综合收益	14,029,182.92	208,669,920.89	55,796,146.22	40,982,605.22	111,891,169.45		125,920,352.37
其中：权益法下在被投资 单位以后将重分类 进损益的其他综合收 益中享有的份额	32,255,021.43	-2,103,641.74		35,155,873.01	-37,259,514.75		-5,004,493.32
其他债权投资公允价 值变动	-236,796,614.60	147,595,610.28	39,330,261.38	-9,725,435.23	117,990,784.13		-118,805,830.47
其他债权投资信用减 值准备	242,349,553.42	81,415,706.80	16,465,884.84	15,552,167.44	49,397,654.52		291,747,207.94
现金流量套期储备		15,537,974.68			15,537,974.68		15,537,974.68
外币财务报表折算差 额	-23,778,777.33	-33,775,729.13			-33,775,729.13		-57,554,506.46
合 计	409,183,804.50	-1,260,215,771.86	-311,425,276.96	40,982,605.22	-989,773,100.12	-523,036,273.61	-57,553,022.01

39. 盈余公积

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	4,867,817,456.10			4,867,817,456.10
合 计	4,867,817,456.10			4,867,817,456.10

40. 一般风险准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
一般风险准备	6,601,448,721.87	882,763,545.54		7,484,212,267.41
交易风险准备	6,396,050,826.99	868,009,565.85		7,264,060,392.84
合 计	12,997,499,548.86	1,750,773,111.39		14,748,272,660.25

41. 未分配利润

项 目	本期数	上年同期数
调整前上期末未分配利润	22,864,880,451.81	20,027,506,956.75
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	22,864,880,451.81	20,027,506,956.75
加：本期归属于母公司所有者的净利润	10,114,758,795.89	6,615,739,471.11
减：提取法定盈余公积		655,551,838.55
提取一般风险准备	1,750,773,111.39	1,323,446,057.53
应付普通股股利	2,210,858,756.71	1,640,000,000.00
永续次级债券利息支出	911,500,000.00	290,000,000.00
其他综合收益结转留存收益	523,036,273.61	-130,631,920.03
期末未分配利润	27,583,471,105.99	22,864,880,451.81

(二) 合并利润表项目注释

1. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	7,521,117,559.58	6,986,525,882.21
货币资金及结算备付金利息收入	1,573,102,707.44	1,469,985,540.17

项 目	本期数	上年同期数
融资融券利息收入	4,324,662,728.90	3,347,192,757.24
买入返售金融资产利息收入	636,645,258.99	1,476,170,070.14
其中：约定购回利息收入	10,916,361.85	6,285,463.16
股权质押回购利息收入	552,371,335.85	1,421,611,652.18
其他债权投资利息收入	927,007,817.12	672,325,731.52
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	59,699,047.13	20,851,783.14
利息支出	5,110,493,613.11	3,838,479,279.24
短期借款利息支出	6,389,681.11	9,612,288.15
应付短期融资券利息支出	708,233,614.09	626,835,081.71
拆入资金利息支出	239,095,545.27	188,981,556.30
其中：转融通利息支出	215,017,411.93	178,928,318.52
卖出回购金融资产利息支出	2,123,281,449.68	1,275,231,295.28
其中：报价回购利息支出	95,198,314.69	98,122,360.24
代理买卖证券款利息支出	234,864,950.60	197,068,461.62
应付债券利息支出	1,633,356,056.05	1,363,546,309.83
其中：次级债券利息支出		22,735,437.16
份额 A 持有人利息支出	63,195,326.07	116,502,455.96
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	102,076,990.24	60,701,830.39
利息净收入	2,410,623,946.47	3,148,046,602.97

## 2. 手续费及佣金净收入

### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
证券经纪业务净收入	6,769,738,627.24	6,189,693,803.63
证券经纪业务收入	8,058,799,916.42	7,286,730,799.35
代理买卖证券业务	6,518,518,926.05	6,171,343,470.35
交易单元席位租赁	589,436,292.57	407,277,783.26

项 目	本期数	上年同期数
代销金融产品业务	950,844,697.80	708,109,545.74
证券经纪业务支出	1,289,061,289.18	1,097,036,995.72
代理买卖证券业务	1,289,061,289.18	1,097,036,995.72
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
期货经纪业务净收入	424,808,690.15	234,047,923.50
期货经纪业务收入	426,465,955.46	235,334,582.39
期货经纪业务支出	1,657,265.31	1,286,658.89
投资银行业务净收入	1,979,271,263.30	1,892,311,349.05
投资银行业务收入	2,029,901,846.80	1,932,825,466.51
证券承销业务	1,826,134,336.02	1,637,178,763.09
证券保荐业务	119,245,943.15	214,123,407.18
财务顾问业务	84,521,567.63	81,523,296.24
投资银行业务支出	50,630,583.50	40,514,117.46
证券承销业务	50,573,979.73	40,514,117.46
证券保荐业务		
财务顾问业务	56,603.77	
资产管理业务净收入	242,758,990.76	275,790,905.60
资产管理业务收入	249,425,243.26	285,026,397.80
资产管理业务支出	6,666,252.50	9,235,492.20
基金管理业务净收入	271,799,325.87	76,122,827.06
基金管理业务收入	292,363,152.68	89,070,531.22
基金管理业务支出	20,563,826.81	12,947,704.16
投资咨询业务净收入	66,143,147.54	34,688,262.57
投资咨询业务收入	66,143,147.54	34,688,262.57
投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	278,351,563.79	274,325,794.99
其他手续费及佣金收入	281,274,912.85	274,325,794.99

项 目	本期数	上年同期数
其他手续费及佣金支出	2,923,349.06	
合 计	10,032,871,608.65	8,976,980,866.40
其中：手续费及佣金收入总计	11,404,374,175.01	10,138,001,834.83
手续费及佣金支出总计	1,371,502,566.36	1,161,020,968.43

(2) 财务顾问业务净收入

项 目	本期数	上年同期数
并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司	19,464,150.97	26,391,509.43
并购重组财务顾问业务净收入——其他	2,490,566.05	
其他财务顾问业务净收入	62,510,246.84	55,131,786.81
小 计	84,464,963.86	81,523,296.24

(3) 代理销售金融产品情况

项 目	本期数		上年同期数	
	销售总金额	代销收入	销售总金额	代销收入
基金	67,494,208,119.00	638,669,543.30	59,439,665,524.58	581,991,159.68
其他金融产品	18,436,406,281.60	312,175,154.50	9,082,720,497.72	126,118,386.06
合 计	85,930,614,400.60	950,844,697.80	68,522,386,022.30	708,109,545.74

(4) 资产管理业务开展及收入明细情况

项 目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	72	112	69
期末客户数量	70,261	112	568
其中：个人客户	70,116	40	30
机构客户	145	72	538
期初受托资金	29,948,023,696.84	86,080,073,935.24	19,724,497,636.10
其中：自有资金投入	3,569,786,044.58		
个人客户	14,923,871,450.78	6,842,881,778.25	183,224,112.08
机构客户	11,454,366,201.48	79,237,192,156.99	19,541,273,524.02
期末受托资金	69,165,128,146.59	39,496,278,094.42	29,932,914,990.98

项 目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
其中：自有资金投入	2,084,727,377.99		
个人客户	10,370,809,760.25	7,179,788,084.45	197,654,288.48
机构客户	56,709,591,008.35	32,316,490,009.97	29,735,260,702.50
期末主要受托资产初始成本	73,680,438,188.90	39,388,854,602.52	30,160,448,142.18
其中：股票	1,141,133,090.76	12,150,120,396.16	204,060,456.14
国债	25,233,800.00		
其他债券	51,112,453,160.04	4,543,505,264.78	9,120,249.94
基金	5,807,997,901.96	270,206,862.87	63,482,572.49
其他	15,593,620,236.14	22,425,022,078.71	29,883,784,863.61
本期资产管理业务净收入	160,518,705.57	77,490,869.68	4,749,415.51

### 3. 投资收益

#### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	879,545,654.36	517,520,674.47
处置长期股权投资产生的投资收益		335,254.33
金融工具投资收益	6,748,692,564.38	4,562,503,360.17
其中：持有期间取得的收益	5,536,794,655.29	3,326,112,175.77
—交易性金融工具	4,319,759,580.05	3,024,040,204.15
—其他权益工具投资	1,217,035,075.24	302,071,971.62
—衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	1,211,897,909.09	1,236,391,184.40
—交易性金融工具	1,729,547,065.05	1,122,371,099.82
—其他债权投资	40,308,045.57	109,769,959.74
—衍生金融工具	-557,957,201.53	4,250,124.84
其他	-192,106,990.21	-186,847,356.26
合 计	7,436,131,228.53	4,893,511,932.71



## (2) 按权益法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
联营企业：			
鹏华基金公司	505,652,607.89	323,099,977.75	被投资单位净利润变化
前海股交投资控股（深圳）有限公司	3,013,737.10	4,467,107.29	被投资单位净利润变化
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	2,225,495.35	3,083,315.14	被投资单位净利润变化
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金（有限合伙）	188,285,536.28	76,078,391.27	被投资单位净利润变化
常州高新投创业投资有限公司	38,091,964.28	5,190,055.28	被投资单位净利润变化
深圳市前海弘泰基金管理有限公司	214,712.92	-84,205.30	被投资单位净利润变化
深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司	-17.96	-73.92	被投资单位净利润变化
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	15,508,953.16	59,280,213.87	被投资单位净利润变化
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	-1,773,396.25	-6,136,059.98	被投资单位净利润变化
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	-809,671.74	8,528,607.99	被投资单位净利润变化
深圳弘盛道格体育投资合伙企业（有限合伙）	-361,057.95	-744,080.36	被投资单位净利润变化
深圳市中亚亿百投资企业（有限合伙）	2,978,181.97	-963.42	被投资单位净利润变化
国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙）		-12,539,361.98	被投资单位净利润变化
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	17,447,020.90	12,045,984.44	被投资单位净利润变化
深圳市五色检测技术服务有限公司	-191,026.69	-234,651.38	被投资单位净利润变化
华润宝塔股权投资（延安）有限公司	-333,438.52	-388,654.73	被投资单位净利润变化
华润（延安）新产业经济投资合伙企业（有限合伙）	-124,317.63	483.56	被投资单位净利润变化
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	384,498.38	3,284.03	被投资单位净利润变化
国铁盛芯（青岛）股权投资企业（有限合伙）	14,142.78	-29,515.14	被投资单位净利润变化

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
国铁盛和（青岛）私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	14,555,217.46		被投资单位净利润变化
小 计	784,779,141.73	471,619,854.41	
合营企业：			
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金（有限合伙）	-4,479,695.32	21,558,137.27	被投资单位净利润变化
深圳市国信蓝思基金管理有限公司	1,876,620.40	362,168.19	被投资单位净利润变化
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙）	81,077,565.91	10,829,516.33	被投资单位净利润变化
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	15,282,665.91	14,419,882.53	被投资单位净利润变化
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	-184,628.33	-1,269,272.39	被投资单位净利润变化
珠海联发安科股权投资基金合伙企业（有限合伙）	1,193,984.06	388.13	被投资单位净利润变化
小 计	94,766,512.63	45,900,820.06	
合 计	879,545,654.36	517,520,674.47	

(3) 交易性金融工具投资收益

交易性金融工具		本期数	上年同期数
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	4,319,759,580.05	3,024,040,204.15
	处置期间收益	1,731,998,016.55	1,122,260,069.73
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		
	处置期间收益		
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		
	处置期间收益	-2,450,951.50	111,030.09
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		
	处置期间收益		
小 计		6,049,306,645.10	4,146,411,303.97

#### 4. 其他收益

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
与资产相关的政府补助[注]	3,475,862.04	3,475,862.04	3,475,862.04
与收益相关的政府补助[注]	1,482,416.61	2,196,097.50	1,482,416.61
代扣个人所得税手续费返还	21,714,103.38	19,631,558.23	
合 计	26,672,382.03	25,303,517.77	4,958,278.65

[注]本期计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注五(四)2之说明

#### 5. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
交易性金融资产	1,666,756,136.08	263,968,156.01
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	-14,006,599.26	1,442,306.02
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	87,690,638.57	-198,319,248.09
合 计	1,740,440,175.39	67,091,213.94

#### 6. 其他业务收入

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品销售收入	2,135,187,160.34	1,626,301,358.99
房租收入	32,299,753.35	39,806,979.57
其他	4,709,456.22	13,230,599.80
合 计	2,172,196,369.91	1,679,338,938.36

#### 7. 税金及附加

项 目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	71,384,788.43	64,028,549.97
教育费附加及地方教育附加	51,064,027.10	45,733,105.88

项 目	本期数	上年同期数
房产税	16,678,229.63	14,530,370.70
印花税	3,349,773.96	2,053,538.92
土地使用税	389,937.99	319,558.33
车船税	172,071.47	188,626.65
其他	315,150.93	416,205.54
合 计	143,353,979.51	127,269,955.99

#### 8. 业务及管理费

项 目	本期数	上年同期数
职工费用	7,981,407,495.97	5,912,903,199.71
通讯费	211,680,913.82	217,805,015.91
固定资产折旧费	168,139,315.72	139,411,322.94
使用权资产折旧费	165,721,990.38	——
电子设备运转费	151,156,634.60	122,124,596.69
交易所席位年费	111,480,529.78	85,770,503.88
业务宣传费	96,862,874.55	72,376,248.90
差旅费	96,011,753.15	81,603,418.78
投资者保护基金支出	92,273,463.62	77,649,956.33
业务活动费	87,409,277.20	55,024,142.59
无形资产摊销	81,021,077.63	70,984,300.64
咨询费	61,444,698.25	49,666,957.83
长期待摊费用摊销	52,836,714.98	50,331,670.32
其他	375,017,476.73	434,087,064.47
合 计	9,732,464,216.38	7,369,738,398.99

#### 9. 信用减值损失

项 目	本期数	上年同期数
买入返售金融资产坏账准备	-873,703,615.63	299,973,839.90

项 目	本期数	上年同期数
应收款项坏账损失	326,590,364.48	273,398,259.71
其他债权投资减值损失	72,117,232.57	287,256,147.99
融出资金坏账准备	-46,726,400.70	134,696,682.49
其他应收款减值损失	271,785.32	1,187,249.73
合 计	-521,450,633.96	996,512,179.82

10. 其他资产减值损失

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品跌价准备	96,261.07	5,893,797.90
合 计	96,261.07	5,893,797.90

11. 其他业务成本

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品销售成本	2,138,065,697.50	1,629,138,677.58
投资性房地产折旧	10,600,915.26	11,025,104.32
其他	21,015,351.53	11,503,713.76
合 计	2,169,681,964.29	1,651,667,495.66

12. 营业外收入

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
政府补助[注]	43,141,407.56	37,188,856.06	43,141,407.56
违约赔偿收入	4,549,716.05	2,440,409.01	4,549,716.05
非流动资产毁损报废利得		62,732.24	
其他	168,799.06	1,244,766.59	168,799.06
合 计	47,859,922.67	40,936,763.90	47,859,922.67

[注]本期计入营业外收入的政府补助情况详见本财务报表附注五(四)2之说明

13. 营业外支出

项 目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
非常损失[注]	-329,233,274.59	306,042,092.73	-329,233,274.59
对外捐赠	16,700,777.65	21,460,485.38	16,700,777.65
罚款支出	8,178,300.00	648.00	8,178,300.00
其他	11,613,177.24	2,814,464.32	11,613,177.24
合 计	-292,741,019.70	330,317,690.43	-292,741,019.70

[注]其中计人民币-332,164,853.79元详见本财务报表附注五(一)30[注]之说明

14. 所得税费用

(1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	2,294,352,819.60	2,160,440,774.51
递延所得税费用	223,084,173.27	-435,118,372.23
合 计	2,517,436,992.87	1,725,322,402.28

(2) 会计利润与所得税费用调整过程

项 目	本期数	上年同期数
利润总额	12,634,492,158.97	8,343,608,490.09
按母公司税率计算的所得税费用	3,158,623,039.74	2,085,902,122.52
子公司适用不同税率的影响	-1,024,766.70	-3,696,755.44
调整以前期间所得税的影响	5,655,270.01	-253,506.48
非应税收入的影响	-606,193,549.48	-328,607,264.94
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	88,454,321.43	37,814,823.29
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-20,031,022.56	-4,699,745.04
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	5,290,282.92	7,479,623.13
其他	-113,336,582.49	-68,616,894.76
所得税费用	2,517,436,992.87	1,725,322,402.28

15. 其他综合收益的税后净额

其他综合收益的税后净额详见本财务报表附注五(一)38之说明。

(三) 合并现金流量表项目注释

1. 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
应付货币保证金净增加额	3,232,551,310.27	1,231,720,191.86
大宗商品销售收到的现金	2,449,226,493.37	1,888,121,432.51
收到政府补助	58,249,905.82	59,557,392.36
应收期货交易款净减少额	55,346,244.69	
租赁收入	37,088,840.86	40,077,975.49
代扣代缴手续费收入	21,714,103.38	19,631,558.23
清算资金交收金额净增加		1,704,288,885.77
应付质押保证金净增加额		499,298,072.00
收到股票质押保证金		15,647,929.62
代收承销佣金		13,100,000.00
其他	46,612,066.70	55,429,935.28
合 计	5,900,788,965.09	5,526,873,373.12

2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
购买大宗商品支付的现金	2,423,402,468.02	1,913,494,745.37
资产管理计划优先级参与人款项净减少额	2,317,874,492.38	2,665,493,760.21
存出保证金净增加额	2,008,505,669.98	1,204,152,437.89
应付质押保证金净减少额	1,399,307,432.00	
现金支付的业务及管理费	1,338,504,179.42	1,253,937,272.31
清算资金交收金额净减少	213,116,018.19	
代扣代缴税费收到现金净减少金额	28,867,333.66	113,112,088.38

项 目	本期数	上年同期数
应收结算担保金净增加	23,013,216.33	15,725,213.77
支付股票借贷保证金净额	21,695,984.64	9,474,059.13
捐赠支出	16,700,777.65	21,460,485.38
罚款支出	8,178,300.00	16,800,648.00
使用受限的货币资金增加额		32,577,047.22
应收期货交易款净增加额		26,128,328.97
其他	50,332,718.42	35,332,325.30
合 计	9,849,498,590.69	7,307,688,411.93

### 3. 支付其他与筹资活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
支付租赁费	177,220,827.47	
支付发行费用	90,000,000.00	38,178,618.01
永续次级债到期支付本金		5,000,000,000.00
子公司少数股东退资支付的现金		3,978,800.00
合 计	267,220,827.47	5,042,157,418.01

### 4. 现金流量表补充资料

#### (1) 现金流量表补充资料

补充资料	本期数	上年同期数
1) 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	10,117,055,166.10	6,618,286,087.81
加: 资产减值准备	-521,354,372.89	996,371,072.32
固定资产、使用权资产及投资性房地产折旧	344,462,221.36	150,436,427.26
无形资产摊销	81,021,077.63	70,984,300.64
长期待摊费用摊销	52,836,714.98	50,331,670.32
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减:收益)	260,807.84	212,215.54



补充资料	本期数	上年同期数
公允价值变动损失（减：收益）	-1,740,440,175.39	-67,091,213.94
利息支出	2,366,863,081.80	1,999,822,256.20
汇兑损失（减：收益）	637,899.25	5,989,611.63
投资损失（减：收益）	-879,545,654.36	-517,855,928.80
递延所得税资产减少（减：增加）	-48,735,303.21	-496,949,853.17
递延所得税负债增加（减：减少）	287,997,361.32	129,990,984.03
交易性金融资产减少（减：增加）	-43,717,008,021.17	-43,954,990,331.49
交易性金融负债增加（减：减少）	395,794,790.24	-228,465,898.49
其他权益工具投资减少（减：增加）	3,805,363,885.54	-1,758,361,155.57
其他债权投资减少（减：增加）	-4,745,970,924.50	-7,179,189,745.34
衍生金融资产减少（减：增加）	-26,435,856.09	2,920,397.36
衍生金融负债增加（减：减少）	-21,297,219.26	77,121,721.79
买入返售金融资产减少（减：增加）	10,283,179,746.90	7,292,246,270.33
卖出回购金融资产款增加（减：减少）	24,437,759,153.31	30,324,122,604.94
融出资金减少（减：增加）	-12,166,111,696.36	-12,181,223,489.52
代理买卖证券款增加（减：减少）	7,534,026,886.74	13,158,807,768.99
经营性应收项目的减少（减：增加）	-2,501,312,143.98	-2,004,242,174.04
经营性应付项目的增加（减：减少）	-54,435,256.11	4,038,449,850.02
经营活动产生的现金流量净额	-6,715,387,830.31	-3,472,276,551.18
2) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
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		
3) 现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	84,614,253,311.11	76,782,025,659.57
减：现金的期初余额	76,782,025,659.57	59,588,272,168.73
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		

补充资料	本期数	上年同期数
现金及现金等价物净增加额	7,832,227,651.54	17,193,753,490.84

(2) 现金和现金等价物的构成

项 目	期末数	期初数
1) 现金	84,614,253,311.11	76,782,025,659.57
其中：库存现金	111,697.21	267,811.78
可随时用于支付的银行存款	67,532,854,030.58	65,745,906,553.20
可随时用于支付的其他货币资金	2,174,748.36	524,197.65
可用于支付的结算备付金	17,079,112,834.96	11,035,327,096.94
2) 现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
3) 期末现金及现金等价物余额	84,614,253,311.11	76,782,025,659.57

(四) 其他

1. 所有权或使用权受到限制的资产

项 目	期末账面价值	受限原因
货币资金	82,630,050.90	风险准备金、司法冻结等
交易性金融资产	81,688,145,536.95	为回购业务设定质押或过户
交易性金融资产	6,887,277,973.05	为债券借贷业务设定质押
交易性金融资产	3,177,687,945.14	为期货业务充抵保证金设定质押
交易性金融资产	2,554,100,076.31	限售股
交易性金融资产	10,011,699.80	持有的份额退出受到合同约定的限制
交易性金融资产	1,469,097,357.77	融出证券
其他债权投资	22,338,297,570.73	为回购业务设定质押
其他债权投资	420,484,702.34	为债券借贷业务设定质押
其他债权投资	607,199,961.51	为期货业务充抵保证金设定质押
其他权益工具投资	305,638,318.80	融出证券
其他权益工具投资	222,053,033.73	限售股
合 计	119,762,624,227.03	

2. 政府补助

(1) 明细情况

1) 与资产相关的政府补助

总额法

项 目	期初递延收益	本期新增补助	本期摊销	期末递延收益	本期摊销列报项目	说明
购地补贴	129,765,517.56		3,475,862.04	126,289,655.52	其他收益	
小 计	129,765,517.56		3,475,862.04	126,289,655.52		

2) 与收益相关，且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

项 目	金额	列报项目	说明
总部经济发展贡献奖	20,000,000.00	营业外收入	深府规[2021]5号
产业扶持资金	11,480,000.00	营业外收入	《黄浦区支持金融业发展的实施细则》
金融机构绩效奖励	5,850,000.00	营业外收入	沪府发〔2009〕40号
期货市场建设特殊贡献奖励	1,800,000.00	营业外收入	大金局发〔2020〕72号
金融业发展专项资金补贴（入驻补贴）	900,000.00	营业外收入	成都市武侯区国有资产监督管理局和金融工作局〔2021〕102号
金融机构落户奖励	500,000.00	营业外收入	绵涪府发〔2017〕21号
产业财政扶持	365,000.00	营业外收入	浦财扶陆〔2018〕第00197号
产业财政扶持	300,000.00	营业外收入	赣财金指〔2021〕14号
产业财政扶持	166,200.00	营业外收入	穗天府规〔2020〕3号
生育津贴	9,267,608.35	业务及管理费	
房租补贴	2,201,763.50	业务及管理费	
稳岗补贴	2,156,709.80	业务及管理费	
承销业务补贴	500,000.00	其他收益	
其他与经营活动相关的政府补助	982,416.61	其他收益	
其他与经营活动无关的政府补助	1,780,207.56	营业外收入	
小 计	58,249,905.82		

(2) 本期计入当期损益的政府补助金额为 61,725,767.86 元。

### 3. 金融工具计量基础

#### (1) 金融资产计量基础分类表

项 目	期末数			
	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
		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	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
货币资金	67,721,741,037.30			
结算备付金	17,087,824,020.77			
融出资金	61,973,311,849.43			
衍生金融资产				57,966,861.36
存出保证金	7,587,572,329.43			
应收款项	1,432,595,710.21			
买入返售金融资产	6,770,994,407.11			
交易性金融资产				152,312,123,275.04
其他债权投资		29,644,274,446.31		
其他权益工具投资			7,186,022,265.21	
其他资产	220,418,450.26			
合 计	162,794,457,804.51	29,644,274,446.31	7,186,022,265.21	152,370,090,136.40

(续上表)

项 目	期初数			
	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
		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	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
货币资金	65,907,024,176.35			
结算备付金	11,040,352,801.73			

项 目	期初数			
	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
		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	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
融出资金	49,754,594,021.25			
衍生金融资产				6,246,609.85
存出保证金	5,579,295,902.00			
应收款项	1,335,376,311.05			
买入返售金融资产	16,180,470,538.38			
交易性金融资产				106,759,351,951.46
其他债权投资		24,740,982,476.30		
其他权益工具投资			11,762,890,145.34	
其他资产	293,431,715.81			
合 计	150,090,545,466.57	24,740,982,476.30	11,762,890,145.34	106,765,598,561.31

(2) 金融负债计量基础分类表

项 目	期末数			
	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	225,270,000.00			
应付短期融资款	19,800,032,805.99			
拆入资金	4,456,797,971.98			
交易性金融负债		460,982,751.10		
衍生金融负债		226,049,508.29		
卖出回购金融资产款	96,524,929,451.62			
代理买卖证券款	67,280,292,116.73			

项 目	期末数			
	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
代理承销证券款	27,000,000.00			
应付款项	5,274,979,125.00			
租赁负债	447,016,739.86			
应付债券	51,002,487,491.65			
其他负债	10,703,287,629.13			
合 计	255,742,093,331.96	687,032,259.39		

(续上表)

项 目	期初数			
	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	345,968,514.70			
应付短期融资款	25,929,529,064.64			
拆入资金	6,434,051,598.96			
交易性金融负债		51,919,972.78		
衍生金融负债		331,446,474.45		
卖出回购金融资产款	72,147,251,985.41			
代理买卖证券款	59,746,265,229.99			
应付款项	5,698,183,925.04			
租赁负债	411,113,159.86			
应付债券	35,346,203,901.79			
其他负债	8,582,743,209.11			
合 计	214,641,310,589.50	383,366,447.23		

#### 4. 受托客户资产管理业务

资产项目	期末数	期初数	负债项目	期末数	期初数
受托管理资金存款	3,137,241,435.10	2,657,180,380.77	受托管理资金	147,650,950,049.47	146,154,462,416.05
客户结算备付金	602,042,007.42	251,927,699.30	应付款项	780,444,272.18	771,213,534.84
存出保证金	28,012,680.03	224,880,821.20			
应收款项	736,514,031.05	753,583,997.72			
受托投资	143,927,584,168.05	143,038,103,051.90			
其中：投资成本	143,203,743,719.21	135,759,997,131.59			
已实现未结转损益	723,840,448.84	7,278,105,920.31			
合计	148,431,394,321.65	146,925,675,950.89	合计	148,431,394,321.65	146,925,675,950.89

#### 5. 融资融券业务

##### (1) 融券业务明细情况

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	3,099,488,484.02	3,016,963,932.23
其中：其他权益工具投资	305,638,318.80	679,082,122.28
交易性金融资产	1,469,097,357.77	1,040,309,580.11
转融通融入证券	1,324,752,807.45	1,297,572,229.84
转融通融入证券总额	4,024,240,655.96	2,709,853,033.00

##### (2) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

项目	期末公允价值	期初公允价值
股票	201,470,302,657.08	160,079,008,498.63
资金	6,938,862,194.25	6,159,999,130.00
基金	4,538,000,091.87	4,527,142,215.89
债券	188,259,177.65	334,740,486.78
合计	213,135,424,120.85	171,100,890,331.30

## 六、母公司财务报表项目注释

### (一) 母公司资产负债表项目注释

#### 1. 长期股权投资

##### (1) 明细情况

项 目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	8,677,200,146.42		8,677,200,146.42	8,342,280,146.42		8,342,280,146.42
对联营、合营企业投资	2,095,537,837.49		2,095,537,837.49	1,765,742,840.97		1,765,742,840.97
合 计	10,772,737,983.91		10,772,737,983.91	10,108,022,987.39		10,108,022,987.39

##### (2) 对子公司投资

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	期末数	本期计提减值准备	减值准备期末数
国信期货公司	1,890,915,346.42			1,890,915,346.42		
国信弘盛公司	3,050,000,000.00		1,206,180,534.70	1,843,819,465.30		
国信香港公司	1,901,364,800.00	334,920,000.00		2,236,284,800.00		
国信资本公司	1,500,000,000.00	1,206,180,534.70		2,706,180,534.70		
小 计	8,342,280,146.42	1,541,100,534.70	1,206,180,534.70	8,677,200,146.42		

##### (3) 对联营、合营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		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
联营企业					
鹏华基金公司	1,528,525,598.64			505,652,607.89	
前海股交投资控股(深圳)有限公司	207,928,631.73			3,013,737.10	-2,103,641.74
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	29,288,610.60			2,225,495.35	
合 计	1,765,742,840.97			510,891,840.34	-2,103,641.74



(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备 期末余额
	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		
联营企业						
鹏华基金公司		178,000,000.00			1,856,178,206.53	
前海股交投资控股(深圳)有限公司	65,964.37	1,059,166.45			207,845,525.01	
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司					31,514,105.95	
合计	65,964.37	179,059,166.45			2,095,537,837.49	

## 2. 应付职工薪酬

## (1) 明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	4,454,470,995.31	6,989,907,828.71	5,315,870,638.90	6,128,508,185.12
离职后福利—设定提存计划	1,585,082.31	517,197,240.68	516,874,398.49	1,907,924.50
合计	4,456,056,077.62	7,507,105,069.39	5,832,745,037.39	6,130,416,109.62

## (2) 短期薪酬明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	4,147,308,010.54	6,356,109,603.62	4,682,475,867.80	5,820,941,746.36
职工福利费		85,255,678.30	85,255,678.30	
社会保险费	741,983.05	157,588,130.83	157,267,503.76	1,062,610.12
其中：医疗保险费	640,709.68	145,631,986.14	145,332,145.75	940,550.07
工伤保险费	39,786.56	2,969,204.63	2,964,955.60	44,035.59
生育保险费	61,486.81	8,986,940.06	8,970,402.41	78,024.46
住房公积金	97,783.23	241,823,594.37	241,702,001.77	219,375.83
工会经费和职工教育经费	306,322,618.49	138,481,940.06	138,520,705.74	306,283,852.81
其他	600.00	10,648,881.53	10,648,881.53	600.00
小计	4,454,470,995.31	6,989,907,828.71	5,315,870,638.90	6,128,508,185.12

## (3) 设定提存计划明细情况

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	1,488,105.14	299,268,736.92	298,892,265.04	1,864,577.02
失业保险费	31,100.97	5,677,590.30	5,665,343.79	43,347.48
企业年金缴费	65,876.20	212,250,913.46	212,316,789.66	
小 计	1,585,082.31	517,197,240.68	516,874,398.49	1,907,924.50

## (二) 母公司利润表项目注释

## 1. 利息净收入

项 目	本期数	上年同期数
利息收入	7,245,046,397.74	6,669,735,466.47
货币资金及结算备付金利息收入	1,357,443,653.17	1,280,744,156.65
拆出资金利息收入		
融资融券利息收入	4,267,543,346.14	3,301,775,729.73
买入返售金融资产利息收入	634,105,556.73	1,394,038,065.43
其中：约定购回利息收入	10,916,361.85	6,285,463.16
股权质押回购利息收入	552,371,335.85	1,341,921,267.81
债权投资利息收入		
其他债权投资利息收入	927,007,817.12	672,325,731.52
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	58,946,024.58	20,851,783.14
利息支出	5,027,932,251.50	3,702,659,248.82
短期借款利息支出	1,381,213.43	171,423.49
应付短期融资券利息支出	708,233,614.09	626,835,081.71
拆入资金利息支出	239,095,545.27	188,981,556.30
其中：转融通利息支出	215,017,411.93	178,928,318.52
卖出回购金融资产利息支出	2,119,377,759.21	1,266,409,633.07
其中：报价回购利息支出	95,198,314.69	98,122,360.24
代理买卖证券款利息支出	234,864,950.60	197,068,461.62

项 目	本期数	上年同期数
应付债券利息支出	1,633,356,056.05	1,363,546,309.83
其中：次级债券利息支出		22,735,437.16
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	91,623,112.85	59,646,782.80
利息净收入	2,217,114,146.24	2,967,076,217.65

## 2. 手续费及佣金净收入

### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
证券经纪业务净收入	6,698,357,083.32	6,111,962,854.04
证券经纪业务收入	7,981,439,699.40	7,203,780,953.79
代理买卖证券业务	6,441,158,709.03	6,088,393,624.79
交易单元席位租赁	589,436,292.57	407,277,783.26
代销金融产品业务	950,844,697.80	708,109,545.74
证券经纪业务支出	1,283,082,616.08	1,091,818,099.75
代理买卖证券业务	1,283,082,616.08	1,091,818,099.75
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
投资银行业务净收入	1,958,519,029.91	1,847,347,273.76
投资银行业务收入	2,009,149,613.41	1,887,793,316.49
证券承销业务	1,810,712,464.71	1,596,994,598.19
证券保荐业务	118,136,640.22	210,524,981.06
财务顾问业务	80,300,508.48	80,273,737.24
投资银行业务支出	50,630,583.50	40,446,042.73
证券承销业务	50,573,979.73	40,446,042.73
证券保荐业务		
财务顾问业务	56,603.77	
资产管理业务净收入	215,252,820.65	257,489,192.55

项 目	本期数	上年同期数
资产管理业务收入	265,935,512.70	319,894,755.77
资产管理业务支出	50,682,692.05	62,405,563.22
投资咨询业务	49,669,866.70	23,457,849.82
投资咨询业务收入	49,669,866.70	23,457,849.82
投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	278,017,871.21	274,447,030.85
其他手续费及佣金收入	280,941,220.27	274,447,030.85
其他手续费及佣金支出	2,923,349.06	
合 计	9,199,816,671.79	8,514,704,201.02
其中：手续费及佣金收入总计	10,587,135,912.48	9,709,373,906.72
手续费及佣金支出总计	1,387,319,240.69	1,194,669,705.70

(2) 财务顾问业务净收入

项 目	本期数	上年同期数
并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司	19,464,150.97	26,391,509.43
并购重组财务顾问业务净收入——其他	2,490,566.05	
其他财务顾问业务净收入	58,289,187.69	53,882,227.81
小 计	80,243,904.71	80,273,737.24

(3) 代理销售金融产品情况

项 目	期末数		期初数	
	销售总金额	代销收入	销售总金额	代销收入
基金	67,494,208,119.00	638,669,543.30	59,439,665,524.58	581,991,159.68
其他金融产品	18,436,406,281.60	312,175,154.50	9,082,720,497.72	126,118,386.06
合 计	85,930,614,400.60	950,844,697.80	68,522,386,022.30	708,109,545.74

(4) 资产管理业务开展及收入明细情况

项 目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	64	110	35
期末客户数量	70,084	110	534
其中：个人客户	69,942	40	

项 目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
机构客户	142	70	534
期初受托资金	29,823,962,558.02	86,080,073,935.24	19,535,033,159.81
其中：自有资金投入	3,569,786,044.58		
个人客户	14,805,810,311.96	6,842,881,778.25	
机构客户	11,448,366,201.48	79,237,192,156.99	19,535,033,159.81
期末受托资金	68,808,357,303.33	39,476,278,094.42	29,618,155,000.00
其中：自有资金投入	2,084,727,377.99		
个人客户	10,040,038,916.99	7,174,788,084.45	
机构客户	56,683,591,008.35	32,301,490,009.97	29,618,155,000.00
期末主要受托资产初始成本	73,331,798,322.64	39,195,859,525.59	29,883,784,863.61
其中：股票	1,141,133,090.76	12,150,120,396.16	
国债	25,233,800.00		
其他债券	51,112,453,160.04	4,543,505,264.78	
基金	5,803,613,223.39	270,206,862.87	
其他	15,249,365,048.45	22,232,027,001.78	29,883,784,863.61
本期资产管理业务净收入	146,478,715.56	65,096,922.35	3,677,182.74

### 3. 投资收益

#### (1) 明细情况

项 目	本期数	上年同期数
成本法核算的长期股权投资收益		730,000,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	510,891,840.34	330,650,400.18
金融工具投资收益	6,098,535,863.34	4,011,769,597.28
其中：持有期间取得的收益	5,318,618,588.59	3,031,102,064.89
—交易性金融工具	4,101,583,513.35	2,729,030,093.27
—其他权益工具投资	1,217,035,075.24	302,071,971.62
处置金融工具取得的收益	779,917,274.75	980,667,532.39
—交易性金融工具	1,230,009,003.81	934,745,073.36

项 目	本期数	上年同期数
一其他债权投资	40,308,045.57	109,769,959.74
一衍生金融工具	-490,399,774.63	-63,847,500.71
其他	-9,012,123.47	-184,844,387.78
合 计	6,600,415,580.21	4,887,575,609.68

(2) 按权益法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
鹏华基金公司	505,652,607.89	323,099,977.75	被投资单位净利润变化
前海股交投资控股（深圳）有限公司	3,013,737.10	4,467,107.29	被投资单位净利润变化
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	2,225,495.35	3,083,315.14	被投资单位净利润变化
小 计	510,891,840.34	330,650,400.18	

(3) 交易性金融工具投资收益

交易性金融工具		本期数	上年同期数
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	4,101,583,513.35	2,729,030,093.27
	处置期间收益	1,233,584,259.52	943,585,262.61
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		
	处置期间收益	-3,575,255.71	-8,840,189.25
小 计		5,331,592,517.16	3,663,775,166.63

4. 公允价值变动收益

项 目	本期数	上年同期数
交易性金融资产	1,200,493,749.14	48,907,198.31
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	-2,112,974.29	543,160.00
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	41,845,784.87	-199,195,956.65
合 计	1,240,226,559.72	-149,745,598.34

## 5. 业务及管理费

项 目	本期数	上年同期数
职工薪酬	7,503,029,803.67	5,570,482,292.56
通讯费	199,243,817.93	206,036,354.93
固定资产折旧费	156,203,971.15	128,695,586.32
使用权资产折旧费	136,686,828.85	——
电子设备运转费	124,638,542.23	99,090,117.23
交易所席位年费	109,072,200.27	83,313,577.34
业务宣传费	94,499,337.97	71,357,594.20
差旅费	91,175,066.39	77,905,767.78
投资者保护基金支出	91,158,796.16	76,736,577.19
无形资产摊销	76,799,762.63	66,687,601.79
租赁费	37,919,939.44	158,624,358.62
其他	383,085,834.17	289,106,690.77
合 计	9,003,513,900.86	6,828,036,518.73

## 七、合并范围的变更

### (一) 其他原因的合并范围减少

公司名称	股权处置方式	股权处置时点	处置日净资产	期初至处置日净利润
深圳市国信弘盛股权投资基金管理有限公司	注销	2021年12月		180,102,576.31

### (二) 纳入合并范围的结构化主体变动情况

本公司纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。本公司综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使本公司面临可变回报的影响重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。本公司2021年度新增24个结构化主体纳入合并报表范围，21个结构化主体清算或持有份额比例下降丧失控制权不再纳入合并报表范围。

## 八、在其他主体中的权益

### (一) 在重要子公司中的权益

#### 1. 子公司的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例/表决权比例(%)		取得方式
				直接	间接	
国信弘盛公司	深圳	深圳	股权投资基金管理	100.00		自行设立
国信香港公司	香港	香港	金融控股公司	100.00		自行设立
国信资本公司	深圳	深圳	科创板跟投; 创业投资	100.00		自行设立
国信期货公司	上海	上海	期货经纪、期货投资咨询、资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
国信证券(香港)经纪有限公司[注1]	香港	香港	证券及期货经纪业务		100.00	自行设立
国信证券(香港)融资有限公司[注1]	香港	香港	投资银行		100.00	自行设立
国信证券(香港)资产管理有限公司[注1]	香港	香港	资产管理		100.00	自行设立
国信咨询公司[注1]	深圳	深圳	提供咨询和支持服务		100.00	自行设立
国信(香港)金融产品有限公司[注1]	香港	香港	金融产品		100.00	自行设立
国信海外(深圳)股权投资基金管理有限公司[注2][注5]	深圳	深圳	股权投资; 受托管理股权投资;		100.00	自行设立
国信金阳资本管理有限公司[注4]	上海	上海	现货和期货交易		100.00	自行设立
深圳市国信大族机器人产业投资基金管理有限公司[注3]	深圳	深圳	受托管理股权投资基金		51.00	自行设立
深圳市国信众创基金管理有限公司[注3]	深圳	深圳	受托管理股权投资基金		51.00	自行设立
深圳市国信运通基金管理有限公司[注3]	深圳	深圳	受托管理股权投资基金		51.00	自行设立
华文弘盛基金管理(珠海)有限公司[注3]	深圳	珠海	受托管理股权投资基金		51.00	自行设立

[注1] 国信香港公司的下设子公司

[注2] 国信证券(香港)资产管理有限公司的下设子公司



[注 3]国信弘盛公司的下设子公司

[注 4]国信期货公司的下设子公司

[注 5]国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司已于 2021 年 11 月 30 日完成工商注销，截至 2021 年 12 月 31 日未完成清算分配

## 2. 对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据

本公司在评估控制时，需考虑：1) 投资方对被投资方的权利；2) 参与被投资方的相关活动而享有的可变回报；3) 有能力运用对被投资方的权利影响其回报的金额。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需要考虑本公司之决策行为是以主要责任人的身份进行还是以代理人的身份进行。考虑的因素通常包括本公司对结构化主体的决策权范围、其他方享有的实质性权利、本公司的报酬水平以及本公司持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。对于本公司担任资产管理方的资产管理计划，本公司会持续评估因管理该资产管理计划而获得的薪酬水平和面临的可变回报风险程度是否表明本公司为该资产管理计划的主要责任人。如本公司为该资产管理计划的主要责任人，应将上述资产管理计划纳入合并范围。

本公司合并的结构化主体包括本公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和本公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。本公司通过综合评估本公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2021 年 12 月 31 日，纳入本公司财务报表合并范围的结构化主体共 34 个，合并的结构化主体的总资产为人民币 6,887,696,024.73 元。本公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产和其他权益工具投资的金额为人民币 6,520,675,752.59 元。

## (二) 在合营企业或联营企业中的权益

### 1. 重要的合营企业或联营企业

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	
鹏华基金公司	深圳	深圳	基金管理	50.00		权益法
深圳市国信弘盛股权投资	深圳	深圳	私募股		28.58	权益法

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	
资基金（有限合伙）			股权投资			
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金（有限合伙）	北京	北京	私募股权投资		25.00	权益法

## 2. 重要联营企业的主要财务信息

项 目	期末数/本期数			期初数/上年同期数		
	鹏华基金公司	深圳市国信弘盛股权投资 投资基金（有限合伙）	北京航天科工军民融 合科技成果转化创业 投资基金（有限合伙）	鹏华基金公司	深圳市国信弘盛股权 投资基金（有限合伙）	北京航天科工军民融 合科技成果转化创业 投资基金（有限合伙）
资产	6,950,716,202.10	300,214,429.15	1,026,073,396.90	5,504,451,851.71	1,373,749,062.27	1,926,227,635.62
负债	3,207,244,679.02	25,413,349.47	-3,238,889.25	2,412,628,116.19	228,549,385.85	-105,275.82
少数股东权益	21,072,483.36			34,772,538.24		
归属于母公司所有者权益	3,722,399,039.72	274,801,079.68	1,029,312,286.15	3,057,051,197.28	1,145,199,676.42	1,926,332,911.44
按持股比例计算的净资产份额	1,861,199,519.86	78,527,901.75	218,293,651.98	1,528,525,598.64	327,298,067.52	481,583,227.86
调整事项	-5,021,313.33	495,764.51				
对联营企业权益投资的账面价值	1,856,178,206.53	79,023,666.26	218,293,651.98	1,528,525,598.64	327,794,579.61	405,055,982.91
营业总收入	4,436,778,313.94	661,456.91	926,755,709.18	3,064,774,938.24	232,540,118.24	494,044,706.50
净利润	1,007,647,787.56	-114,896.27	613,310,108.63	588,867,889.83	230,720,834.08	486,069,868.53
终止经营的净利润						
其他综合收益						
综合收益总额	1,007,647,787.56	-114,896.27	613,310,108.63	588,867,889.83	230,720,834.08	486,069,868.53
本期收到的来自联营企业的股利	178,000,000.00					

3. 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

项 目	期末数/本期数	期初数/上年同期数
合营企业		
投资账面价值合计	597,523,589.06	533,338,220.19
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	94,766,512.63	45,900,820.06
其他综合收益		
综合收益总额	94,766,512.63	45,900,820.06
联营企业		
投资账面价值合计	810,320,512.37	830,062,094.10
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	75,332,044.40	13,161,271.52
其他综合收益	-37,259,514.75	23,354,853.39
综合收益总额	38,072,529.65	36,516,124.91

(三) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本公司未纳入合并财务报表范围的结构化主体主要包括本公司发起设立的资产管理计划和第三方机构发起设立的资产管理计划、基金等结构化主体。

1. 在本公司发起设立的资产管理计划和投资基金中的权益

本公司发起设立的资产管理计划和投资基金的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

期末本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项 目	财务报表 列报项目	账面价值		最大损失敞口	
		期末数	期初数	期末数	期初数
券商资管产品	交易性金 融资产	92,230,091.68	973,548,654.55	92,230,091.68	973,548,654.55

本期本公司从由本公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的资产管理计划及投资基

金中获取的管理费及业绩报酬为人民币 514,558,316.63 元。

## 2. 在第三方机构发起设立的资产管理计划中享有的权益

本公司直接持有的第三方机构发起设立的结构化主体，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括证券公司资产管理计划、基金专户产品和信托产品等。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

期末本公司通过直接持有第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项 目	财务报表 列报项目	账面价值		最大损失敞口	
		期末数	期初数	期末数	期初数
基金	交易性金 融资产	23,109,626,726.13	11,222,256,425.96	23,109,626,726.13	11,222,256,425.96
银行理财 产品	交易性金 融资产	2,359,071,808.45	693,390,655.82	2,359,071,808.45	693,390,655.82
券商理财 产品	交易性金 融资产	6,007,990,959.81	112,916,825.75	6,007,990,959.81	112,916,825.75
信托计划	交易性金 融资产	264,276,340.84	228,355,790.56	264,276,340.84	228,355,790.56
私募基金 及专户	交易性金 融资产	7,234,125,344.83	3,623,810,171.98	7,234,125,344.83	3,623,810,171.98

## 九、与金融工具相关的风险

### (一) 风险管理政策及组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

#### 1. 董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

#### 2. 经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

### 3. 独立的风险管理机构

公司风险管理总部、合规管理总部、监察稽核总部等部门作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的全面风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，起草公司整体的风险偏好和容忍度方案，合理配置风险限额。对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行检查和考评。资金运营部、信息技术部门、党群办公室分别牵头开展流动性风险管理、信息技术风险管理、声誉风险管理工作。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对各业务领域、部门和主要岗位的内部控制制度执行情况履行管理、检查、反馈和督导等职责。

### 4. 业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

## (二) 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

1. 具有债权性质的债券等交易业务；
2. 融资融券、约定购回和股票质押式回购等资本中介业务；
3. 场外衍生品业务；
4. 存放银行的活期存款及定期存款；
5. 其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、舆情监控、信用

风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务的主要信用风险为发行人违约导致损失的风险。公司通过建立内评系统并采用定性与定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、持续监控报告发行人资信状况、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理。融资融券、股票质押式回购交易等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理，并适时进行逆周期调节；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 289.55%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 199.65%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 351.41%。

衍生品交易业务存在交易对手于约定日期未履行支付义务的信用风险。对此，公司对交易对手进行评级并授信；寻求资质好的担保方项目进行交易；利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等措施进行风险缓释；明确违约事件、提前终止事件的处理流程等措施。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

若不考虑担保品或其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面余额。本公司最大信用风险敞口列示如下：

项 目	期末数	期初数
货币资金	67,721,741,037.30	65,907,024,176.35
结算备付金	17,087,824,020.77	11,040,352,801.73
存出保证金	7,587,572,329.43	5,579,295,902.00
融出资金	61,973,311,849.43	49,754,594,021.25
衍生金融资产	57,966,861.36	6,246,609.85
交易性金融资产[注 1]	108,960,116,031.28	85,228,282,014.02
其他债权投资	29,644,274,446.31	24,740,982,476.30

其他权益工具投资[注 2]	305,638,318.80	679,082,122.28
买入返售金融资产	6,770,994,407.11	16,180,470,538.38
应收款项	1,432,595,710.21	1,335,376,311.05
其他资产	220,418,450.26	318,478,143.02
合 计	301,762,453,462.26	260,770,185,116.23

[注 1]交易性金融资产为债券投资、融出证券业务下融出给客户的证券以及向证金公司借出的证券

[注 2]其他权益工具投资为融出证券业务下融出给客户的证券

### (三) 操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面造成负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格遵守监管要求，落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理流程相关风险；三是运用关键风险指标开展日常监控，及时预警、处置风险，并加强业务风险检查；四是持续完善风险事件收集机制，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是积极开展风险管理文化宣导，以案例分析、现场培训等多种形式组织公司各部门风险教育培训。

### (四) 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。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司流动性风险管理组织架构包括董事会、经理层、资金运营部、风险管理总部及相关职能部门等，公司董事会承担流动性风险管理的最终责任，资金运营部是公司流动性风险管理的负责部门，统筹公司资金来源与融资管理。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化



的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

1. 积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平。

2. 加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。

3. 持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。

4. 持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。

5. 适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施。

6. 持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

2021年12月31日，本公司各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

项 目	即期	小于3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	合 计
短期借款		225,697,500.00				225,697,500.00
应付短期融资款		6,015,030,194.65	14,026,983,949.08			20,042,014,143.73
拆入资金		4,460,230,729.17				4,460,230,729.17
交易性金融负债		295,918,604.98	79,849,769.26	85,214,376.86		460,982,751.10
衍生金融负债	66,844,516.29	38,124,135.73	5,254,974.33	115,825,881.94		226,049,508.29
应付款项	3,136,129,427.81	278,296,919.76	1,860,552,777.43			5,274,979,125.00
卖出回购金融资产款		96,535,879,677.97	39,001,430.01			96,574,881,107.98
代理买卖证券款	67,280,292,116.73					67,280,292,116.73
代理承销证券款	27,000,000.00					27,000,000.00
应付债券		5,032,169,640.76	11,499,010,233.30	38,110,792,049.60		54,641,971,923.66
租赁负债		43,322,160.02	285,101,602.80	144,678,482.32	1,493,956.56	474,596,201.70
其他金融负债	10,135,324,618.62					10,135,324,618.62
合 计	80,645,590,679.45	112,924,669,563.04	27,795,754,736.21	38,456,510,790.72	1,493,956.56	259,824,019,725.98

## （五）市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益投资业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司在已构建的四级风险管理架构下，制定了市场风险管理的具体流程，涵盖公司董事会、资产负债委员会、风险控制委员会、风险管理总部及各业务部门，各组织分工明确，各负其责。

公司根据董事会每年审议通过的整体市场风险限额，综合考虑各业务的风险收益特征和相关性等因素，将风险限额细化并分配至各业务部门及相关策略。风险限额主要包括投资规模、损失比例、风险价值（VaR）、压力测试限额等指标。风险管理总部通过市场风险管理系统等专业的风险管理工具和方法对风险限额进行每日监控，当指标达到预警限额时，风险管理总部对触发预警限额部门进行预警提示，并要求其在规定时间内进行反馈，说明触发预警限额原因和后续的调整计划；当指标突破风险限额时，风险管理总部对超限部门进行提示，要求超限部门在规定时间内进行反馈，说明超限原因和后续调整计划，并要求超限部门在反馈期间原则上不能继续增加风险敞口。风险管理总部会持续监督业务部门风险应对措施落实情况，并与业务部门沟通讨论风险信息 and 可能出现的极端压力情景。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，在已有限额指标的基础上，根据各业务的特点，新增部分既满足业务发展又能有效控制风险暴露程度的限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和 VaR 限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母限额并进行日常监控。此外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过 VaR 等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR 值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR 模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

母公司和集团以期末为基期的 VaR 值（1 天，99%）分析概况如下：

单位：万元

VaR	母公司层面	合并层面
权益类市场风险	33,659	38,486
利率类市场风险	10,102	10,241
商品类市场风险		
外汇类市场风险	229	229
整体风险值	35,305	39,979

价格敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，股票、基金、可转换债券、衍生品等资产类型的价格增加或减少对集团和公司综合收益的影响。假设以 2021 年 12 月 31 日为基期，在其他变量固定的情况下市场权益类及商品价格发生变动，且不考虑管理层为市场价格变化而可能采取的风险管理活动，价格敏感性分析如下：

金额单位：人民币万元

价格变动对综合收益影响	母公司层面	合并层面
股票、基金、商品价格上浮 10%	139,514	158,100
股票、基金、商品价格下跌 10%	-131,587	-149,389

下表汇总了本公司涉及的市场风险敞口：

项 目	期末数	期初数
股票	12,103,876,770.33	9,460,184,184.09
公募基金	23,109,626,726.13	11,222,256,425.96
债券	136,926,003,642.82	108,692,371,910.21
券商资管产品	6,100,221,051.49	1,086,465,480.30
银行理财产品	2,359,071,808.45	693,390,655.82
信托计划	264,276,340.84	228,355,790.56
其他股权投资	1,044,318,301.67	1,303,948,477.26

项 目	期末数	期初数
其他	7,235,025,344.83	10,576,251,648.90
合 计	189,142,419,986.56	143,263,224,573.10

利率敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，市场整体利率平行变动对集团和公司综合收益的影响。假设以2021年12月31日为基期，在其他变量固定的情况下市场整体利率发生平行变动，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，利率敏感性分析如下：

金额单位：人民币万元

收益率曲线变动对综合收益影响	母公司层面	合并层面
上升100个基点	-264,268	-265,588
下降100个基点	286,137	287,466

下表汇总了本公司涉及利率风险的金融资产或金融负债：

1. 期末数

项 目	1 个月以内	1 至 3 个月	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	非生息	合计
<b>金融资产</b>							
货币资金	61,380,778,997.02	1,101,711,467.21	5,135,280,000.00			103,970,573.07	67,721,741,037.30
结算备付金	17,071,532,526.84					16,291,493.93	17,087,824,020.77
融出资金	383,752,995.73	60,576,093,609.99				1,013,465,243.71	61,973,311,849.43
交易性金融资产	2,540,663,438.66	3,002,679,044.59	33,433,980,588.44	60,083,182,576.93	11,332,071,978.57	41,919,545,647.85	152,312,123,275.04
衍生金融资产						57,966,861.36	57,966,861.36
买入返售金融资产	2,465,178,655.17	250,272,930.12	3,990,149,575.90			65,393,245.92	6,770,994,407.11
存出保证金	7,580,372,879.29	28,321.29	3,491,255.05	1,389,072.49		2,290,801.31	7,587,572,329.43
其他权益工具投资			305,638,318.80			6,880,383,946.41	7,186,022,265.21
其他债权投资	70,042,620.00	407,928,509.28	3,616,534,501.93	19,368,523,584.59	5,683,001,725.64	498,243,504.87	29,644,274,446.31
小 计	91,492,322,112.71	65,338,713,882.48	46,485,074,240.12	79,453,095,234.01	17,015,073,704.21	50,557,551,318.43	350,341,830,491.96
<b>金融负债</b>							
短期借款	225,000,000.00					270,000.00	225,270,000.00
应付短期融资款	1,752,935,000.00	4,192,570,000.00	13,733,239,000.00			121,288,805.99	19,800,032,805.99
拆入资金	2,445,000,000.00	2,000,000,000.00				11,797,971.98	4,456,797,971.98
交易性金融负债		294,314,660.00	65,028,486.13			101,639,604.97	460,982,751.10
衍生金融负债	3,738,588.31	21,688,905.71	30,098,704.31	103,014,624.25	-8,237.86	67,516,923.57	226,049,508.29
应付款项	1,503,009,464.00					3,771,969,661.00	5,274,979,125.00

项目	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	非生息	合计
卖出回购金融资产	94,527,035,013.83	1,891,753,000.00	38,548,000.00			67,593,437.79	96,524,929,451.62
代理买卖证券款	67,271,352,340.48					8,939,776.25	67,280,292,116.73
代理承销证券款						27,000,000.00	27,000,000.00
应付债券	25,022,000.00	4,511,417,000.00	10,246,977,000.00	35,403,685,000.00		815,386,491.65	51,002,487,491.65
租赁负债	16,456,966.17	22,861,650.27	275,345,263.39	130,901,536.28	1,451,323.75		447,016,739.86
其他金融负债	10,135,324,618.62						10,135,324,618.62
小计	177,904,873,991.41	12,934,605,215.98	24,389,236,453.83	35,637,601,160.53	1,443,085.89	4,993,402,673.20	255,861,162,580.84
净头寸	-86,412,551,878.70	52,404,108,666.50	22,095,837,786.29	43,815,494,073.48	17,013,630,618.32	45,564,148,645.23	94,480,667,911.12

## 2. 期初数

项目	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	非生息	合计
<b>金融资产</b>							
货币资金	61,565,702,114.45	1,521,246,774.46	2,750,000,000.00			70,075,287.44	65,907,024,176.35
结算备付金	11,032,280,427.42					8,072,374.31	11,040,352,801.73
融出资金	415,328,018.60	48,495,358,267.54	9,864,469.59			834,043,265.52	49,754,594,021.25
交易性金融资产	76,970,554,006.93	623,182,856.00	2,723,849,896.36	2,794,041,799.31	140,791,949.00	23,506,931,443.86	106,759,351,951.46
衍生金融资产			-2,839,751.22	11,686,688.43		-2,600,327.36	6,246,609.85
买入返售金融资产	4,261,345,936.86	494,977,138.85	11,242,157,000.42			181,990,462.25	16,180,470,538.38
存出保证金	5,562,397,093.77		14,586,001.85			2,312,806.38	5,579,295,902.00
其他权益工具投资			679,082,122.28			11,083,808,023.06	11,762,890,145.34

项 目	1 个月以内	1 至 3 个月	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	非生息	合计
其他债权投资	338,445,095.50	551,444,542.66	6,111,995,739.12	16,282,309,165.11	1,026,208,824.72	430,579,109.19	24,740,982,476.30
小 计	160,146,052,693.53	51,686,209,579.51	23,528,695,478.40	19,088,037,652.85	1,167,000,773.72	36,115,212,444.65	291,731,208,622.66
<b>金融负债</b>							
短期借款	345,897,600.00					70,914.70	345,968,514.70
应付短期融资款	6,014,684,000.00	15,144,399,000.00	4,662,373,000.00			108,073,064.64	25,929,529,064.64
拆入资金	3,420,000,000.00	3,000,000,000.00				14,051,598.96	6,434,051,598.96
交易性金融负债						51,919,972.78	51,919,972.78
衍生金融负债	3,048,748.56	39,886,098.01	216,829,467.88			71,682,160.00	331,446,474.45
应付款项	955,028,955.48	752,961,400.47	839,543,713.44			3,150,649,855.65	5,698,183,925.04
卖出回购金融资产款	72,013,629,527.50	71,106,000.00	24,155,000.00			38,361,457.91	72,147,251,985.41
代理买卖证券款	59,738,893,710.98					7,371,519.01	59,746,265,229.99
应付债券	9,641,000.00	8,061,000.00	13,300,356,000.00	21,500,881,000.00		527,264,901.79	35,346,203,901.79
租赁负债	11,233,704.44	17,735,826.95	99,612,069.97	277,200,891.10	5,330,667.40		411,113,159.86
其他金融负债	8,302,080,740.35						8,302,080,740.35
小 计	150,814,137,987.31	19,034,149,325.43	19,142,869,251.29	21,778,081,891.10	5,330,667.40	3,969,445,445.44	214,744,014,567.97
净头寸	9,331,914,706.22	32,652,060,254.08	4,385,826,227.11	-2,690,044,238.25	1,161,670,106.32	32,145,766,999.21	76,987,194,054.69

## 十、公允价值的披露

### (一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

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
持续的公允价值计量				
1. 交易性金融资产	9,124,664,159.67	136,265,234,823.22	6,922,224,292.15	152,312,123,275.04
(1) 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	9,124,664,159.67	136,265,234,823.22	6,922,224,292.15	152,312,123,275.04
债务工具投资	3,977,541,608.12	101,854,750,207.15	1,449,437,381.24	107,281,729,196.51
权益工具投资	5,147,122,551.55	34,410,484,616.07	5,472,786,910.91	45,030,394,078.53
(2) 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				
债务工具投资				
2. 衍生金融资产		57,966,861.36		57,966,861.36
3. 其他债权投资		29,644,274,446.31		29,644,274,446.31
4. 其他权益工具投资	6,963,969,231.48		222,053,033.73	7,186,022,265.21
持续以公允价值计量的资产总额	16,088,633,391.15	165,967,476,130.89	7,144,277,325.88	189,200,386,847.92
5. 交易性金融负债		440,948,516.60	20,034,234.50	460,982,751.10
(1) 交易性金融负债		440,948,516.60	20,034,234.50	460,982,751.10
(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				
6. 衍生金融负债	98,637,508.46	127,411,999.83		226,049,508.29
持续以公允价值计量的负债总额	98,637,508.46	568,360,516.43	20,034,234.50	687,032,259.39

### (二) 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

对于存在活跃市场的金融资产或金融负债，本公司采用活跃市场中的报价确定其公允价值。

### (三) 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

债券投资的公允价值是采用第三方估值机构估值系统的报价，第三方估值机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。



所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。场外期权、收益互换、收益凭证的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

(四) 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

项 目	2021年12月31日 公允价值	估值技术	重大不可观 察输入值	对公允价值的 影响
流通受限的上市公司股票	2,776,153,110.04	期权定价模型	波动率	波动率越高，公允价值越低
非活跃市场的股票/非上市公司股权	1,044,318,301.67	市值折扣法/协议转让价格/净资产调整法等	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
理财产品、私募债、可交债等	3,343,840,148.67	现金流量折现法/期权定价模型	风险调整折现率/波动率	风险调整折现率/波动率越高，公允价值越低
合 计	7,164,311,560.38			

(五) 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

项 目	期初余额	转入第三层次	转出第三层次	当年利得或损失总额	
				计入损益	计入其他综合收益
交易性金融资产	5,628,356,548.53	27,991,527.90	2,491,743,315.19	1,159,570,875.45	
其他权益工具投资	388,454,672.77		367,669,312.77		44,267,707.43
交易性金融负债	20,031,532.62			2,701.88	
合 计	6,036,842,753.92	27,991,527.90	2,859,412,627.96	1,159,573,577.33	44,267,707.43

(续上表)

项 目	购买、发行、出售和结算				期末余额	对于在报告期末持有的资产，计入损益的当期未实现利得或损失的变动
	购买	发行	出售	结算		
交易性金融资产	4,859,561,156.11		2,261,512,500.65		6,922,224,292.15	833,890,591.63
其他权益工具投资	156,999,966.30				222,053,033.73	
交易性金融负债					20,034,234.50	2,701.88
合 计	5,016,561,122.41		2,261,512,500.65		7,164,311,560.38	833,893,293.51

(六) 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

2021 年度，本公司公允价值计量的项目由第三层次转出主要是限售股解禁所致。

(七) 本期发生的估值技术变更及变更原因

2021 年度，本公司公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

(八) 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

本公司管理层认为，于 2021 年 12 月 31 日除应付短期融资款、应付债券外，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。截至 2021 年 12 月 31 日，本公司所持有的应付短期融资款账面价值为人民币 19,800,032,805.99 元，公允价值为人民币 20,135,051,218.32 元；本公司所持有的应付债券账面价值为人民币 51,002,487,491.65 元，公允价值为人民币 51,441,840,324.67 元。

## 十一、关联方及关联交易

(一) 关联方情况

1. 本公司的母公司情况

(1) 本公司的母公司

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本 (万元)	母公司对 本公司的 持股比例 (%)	母公司对 本公司的 表决权比 例(%)
深圳投控公司	深圳	通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理	2,800,900	33.53	33.53

(2) 本公司最终控制方是深圳市人民政府国有资产监督管理委员会。

2. 本公司的子公司情况详见本财务报表附注八(一)之说明。

3. 本公司的合营和联营企业情况

本公司重要的合营或联营企业详见本财务报表附注八(二)之说明。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：

合营或联营企业名称	与本公司关系
鹏华基金公司	本公司之联营企业
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有限合伙)	本公司之联营企业

合营或联营企业名称	与本公司关系
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	本公司之联营企业
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之合营企业
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	本公司之合营企业
深圳弘盛道格体育投资合伙企业（有限合伙）	本公司之合营企业
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金（有限合伙）	本公司之合营企业

#### 4. 本公司的其他关联方情况

其他关联方名称	与本公司关系
华润深国投信托有限公司（以下简称华润深国投公司）	持有本公司 5%以上股份的法人
云南合和（集团）股份有限公司	持有本公司 5%以上股份的法人
深圳市建筑设计研究总院有限公司	受同一方控制
深圳市通产集团有限公司	受同一方控制
深圳市环保科技集团有限公司	受同一方控制
深圳市投控资本有限公司	受同一方控制
深圳音乐厅运营管理有限责任公司	受同一方控制
深圳国际控股有限公司	受同一方控制
深圳市保安服务有限公司	受同一方控制
深圳市体育中心运营管理有限公司	受同一方控制
深圳担保集团有限公司	受同一方控制
深圳市高新投集团有限公司	受同一方控制
深圳英飞拓科技股份有限公司	受同一方控制

其他关联方名称	与本公司关系
深圳大剧院运营管理有限责任公司	受同一方控制
深圳市天使投资引导基金管理有限公司	受同一方控制
深圳市天使投资引导基金有限公司	受同一方控制
国任财产保险股份有限公司	受同一方控制
南方基金管理股份有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
深圳市燃气集团股份有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
深圳清研投资控股有限公司	深圳投控公司高管担任该公司董事
深圳市地铁集团有限公司	深圳投控公司监事担任该公司董事
深圳市特发集团有限公司	深圳投控公司高管担任该公司董事
国泰君安证券股份有限公司	深圳投控公司董事及监事担任该公司董事
深圳市明达资产管理有限公司	公司高管之亲属担任该公司董事
北京城建投资发展股份有限公司	公司监事担任该公司董事
云南红塔银行股份有限公司	公司董事担任该公司董事
红塔证券股份有限公司	公司董事担任该公司董事
云南白药集团股份有限公司	公司董事担任该公司董事
北京城建投资发展股份有限公司	公司监事担任该公司董事
深圳投控共赢股权投资基金合伙企业	深投控董事担任执行事务合伙人委派代表
深圳市信息管线有限公司	过去 12 个月曾受同一方控制
深圳市荔园酒店有限公司	过去 12 个月曾受同一方控制
深圳银湖会议中心（酒店）有限公司	过去 12 个月曾受同一方控制
深圳市国贸科技园服务有限公司	过去 12 个月曾受同一方控制
深圳市盐田港集团有限公司	深圳投控公司监事过去 12 个月曾在该公司担任董事
前海再保险股份有限公司	2021 年 1 月结束“深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事”关联关系
深圳市创新投资集团有限公司	2021 年 5 月结束“深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事”关联关系

其他关联方名称	与本公司关系
安信证券股份有限公司	2021年6月结束“深圳投控公司董事过去12个月曾在该公司担任董事”关联关系
深圳市资本运营集团有限公司	2021年7月结束“深圳投控公司董事过去12个月曾在该公司担任董事”关联关系

## (二) 关联交易情况

### 1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

#### (1) 佣金收入

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
华润深国投公司	证券代理买卖交易佣金	18,671,148.99	22,693,180.17
云南白药集团股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	463,690.23	426,866.32
深圳市明达资产管理有限公司	证券代理买卖交易佣金	94,431.95	
北京城建投资发展股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	76,343.46	29,507.93
关联自然人	证券代理买卖交易佣金	55,932.90	79,526.29
深圳市高新投集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	17,826.24	
深圳市特发集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	6,669.79	
深圳市通产集团有限公司	证券代理买卖交易佣金		103,417.06
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	证券代理买卖交易佣金		101,867.11
深圳投控公司	证券代理买卖交易佣金	19.92	62,434.42
深圳投控共赢股权投资基金合伙企业	证券代理买卖交易佣金	285,661.60	10,743.93
鹏华基金公司	席位佣金收入	101,222,143.26	57,626,336.34
南方基金管理股份有限公司	席位佣金收入	24,593,872.19	17,439,603.66
合 计		145,487,740.53	98,573,483.23

#### (2) 提供咨询服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
安信证券股份有限公司	咨询服务费		283,018.87
国泰君安证券股份有限公司	咨询服务费		235,849.06
合 计			518,867.93

## (3) 提供顾问服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
华润深国投公司	投资顾问收入	6,229,505.90	6,611,736.34
深圳市通产集团有限公司	财务顾问收入	1,226,415.09	330,188.68
深圳投控公司	财务顾问收入	990,566.04	2,301,886.79
深圳国际控股有限公司	财务顾问收入	400,000.00	
深圳市体育中心运营管理有限公司	财务顾问收入	377,358.49	
深圳市投控资本有限公司	财务顾问收入	358,490.57	970,754.72
深圳市资本运营集团有限公司	财务顾问收入	183,962.26	
深圳英飞拓科技股份有限公司	财务顾问收入	94,339.62	
深圳市燃气集团股份有限公司	财务顾问收入		567,924.53
深圳弘盛道格体育投资合伙企业(有限合伙)	财务顾问收入		807,634.88
深圳市人民政府国有资产监督管理委员会	财务顾问收入		231,132.08
深圳市环保科技集团有限公司	财务顾问收入		179,245.28
深圳清研投资控股有限公司	财务顾问收入		94,339.62
合 计		9,860,637.97	12,094,842.92

## (4) 提供金融产品代销服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鹏华基金公司	代销金融产品收入	73,868,800.62	142,357,932.58
南方基金管理股份有限公司	代销金融产品收入	24,166,245.42	39,809,489.73
华润深国投公司	代销金融产品收入	2,875,638.23	970,254.16
合 计		100,910,684.27	183,137,676.47

## (5) 提供资产管理服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	基金管理收入	233,980,887.41	35,386,375.53
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有限合伙)	基金管理收入	20,539,248.39	22,641,508.78
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业(有限合伙)	基金管理收入	17,329,783.03	

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	基金管理服务	9,622,641.53	17,872,738.50
深圳投控公司	资产管理收入	4,536,055.83	4,726,868.30
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	3,515,120.10	3,773,584.84
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	2,830,188.70	5,351,066.99
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	2,278,170.37	
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金（有限合伙）	基金管理收入	772,277.22	
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	511,760.12	2,837,942.54
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	300,596.34	1,207,314.04
北京城建投资发展股份有限公司	资产管理收入		468,341.57
合 计		296,216,729.04	94,265,741.09

(6) 提供承销保荐服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳投控公司	债券承销收入	7,469,150.94	5,947,169.81
深圳担保集团有限公司	债券承销收入	3,773,584.91	
深圳市盐田港集团有限公司	债券承销收入	1,796,226.41	
北京城建投资发展股份有限公司	债券承销收入	589,622.64	
深圳市地铁集团有限公司	债券承销收入	532,485.85	
国任财产保险股份有限公司	债券承销收入	389,971.30	
国泰君安证券股份有限公司	债券分销收入	299,056.60	2,650,943.40
深圳市创新投资集团有限公司	债券承销收入	141,509.43	188,679.25
深圳市人才安居集团有限公司	债券承销收入		3,160,377.36
深圳市特发集团有限公司	债券承销收入		754,716.98
安信证券股份有限公司	债券分销收入		12,735.85
深圳市资本运营集团有限公司	债券受托管理收入	188,679.25	94,339.62
合 计		15,180,287.33	12,808,962.27

(7) 收取利息

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
关联自然人	融出资金利息	12,142.60	27,784.45
合计		12,142.60	27,784.45

(8) 接受其他劳务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市国际招标有限公司	招标代理费	816,956.34	3,226,818.23
深圳市国贸科技园服务有限公司	物业管理费等	1,448,069.61	1,462,095.69
国任财产保险股份有限公司	保险费	547,169.81	
深圳市荔园酒店有限公司	会议费、住宿费	359,079.88	236,291.54
深圳银湖会议中心（酒店）有限公司	会议费	58,415.69	
深圳大剧院运营管理有限责任公司	场地租赁费	18,867.92	
国泰君安证券股份有限公司	债券分销费		104,716.98
红塔证券股份有限公司	非公开发行承销费用支出		28,301,886.79
深圳音乐厅运营管理有限责任公司	文艺演出门票		1,460,290.00
深圳市建筑设计研究总院有限公司	设计费		977,358.49
安信证券股份有限公司	债券分销支出		46,226.42
深圳市保安服务有限公司	保安服务费		5,800.00
合计		3,248,559.25	35,821,484.14

(9) 卖出回购交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
南方基金管理股份有限公司	卖出回购利息支出	16,811,703.59	10,069,997.45
华润深国投公司	卖出回购利息支出	4,605,953.34	2,196,280.96
国泰君安证券股份有限公司	卖出回购利息支出	4,314,362.94	309,993.70
安信证券股份有限公司	卖出回购利息支出	94,528.77	110,298.21
云南红塔银行股份有限公司	卖出回购利息支出	49,863.01	
红塔证券股份有限公司	卖出回购利息支出	23,424.66	
合计		25,899,836.31	12,686,570.32

2. 关联租赁情况-公司承租情况



## 2021 年度

出租方名称	租赁资产种类	简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额	支付的租金（不包括简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额）	增加的使用权资产	确认的利息支出
华润深国投公司	房屋租赁	9,771,516.58	1,256,482.88	1,456,346.62	26,235.09
深圳投控公司	房屋租赁	6,397,777.17			
深圳市地铁集团有限公司	房屋租赁		5,033,915.55		285,851.10
深圳市信息管线有限公司	通信管道租赁	731,126.00			

## 2020 年度

出租方名称	租赁资产种类	确认的租赁费
华润深国投公司	房屋租赁	10,803,490.03
深圳投控公司	房屋租赁	6,397,777.17
深圳市信息管线有限公司	通信管道租赁	1,080,796.07

## 3. 关键管理人员报酬

单位：万元

项目	本期数	上年同期数
关键管理人员报酬	5,608.55	5,102.99
合计	5,608.55	5,102.99

## 4. 其他关联交易

## (1) 自营交易

单位：万元

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
南方基金管理股份有限公司	自营交易	1,440,656.72	3,084,287.62
国泰君安证券股份有限公司	自营交易	847,992.43	44,059,946.50
华润深国投公司	自营交易	412,330.09	40,445.72
安信证券股份有限公司	自营交易	180,108.66	25,414,317.53
红塔证券股份有限公司	自营交易	75,515.42	681,172.45
鹏华基金公司	自营交易	47,954.10	

云南红塔银行股份有限公司	自营交易		5,110.01
前海再保险股份有限公司	自营交易		4,123.51
合 计		3,004,557.42	73,289,403.34

## (2) 债券销售、分销业务

单位：万元

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	本公司认购关联方承销的债券规模	59,922.39	165,035.00
安信证券股份有限公司	本公司认购/申购关联方承销的债券规模		27,000.00
国泰君安证券股份有限公司	本公司分销关联方承销的债券规模	1,034,000.00	792,000.00
南方基金管理股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	174,100.00	105,100.00
安信证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	18,000.00	38,000.00
安信证券股份有限公司	本公司分销关联方承销的债券规模	3,000.00	
华润深国投公司	分销本公司承销的债券规模	192,650.00	36,000.00
国泰君安证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	75,000.00	78,000.00
红塔证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模		70,000.00
南方基金管理股份有限公司	认购本公司承销的资产管理计划规模		12,000.00
华润深国投公司	认购本公司承销的资产管理计划规模		12,000.00
深圳市盐田港集团有限公司	认购关联方发行的债券	9,000.00	
深圳市人才安居集团有限公司	认购关联方发行的债券		49,000.00
南方基金管理股份有限公司	认购本公司发行的债券规模	2,000.00	
合 计		1,567,672.39	1,384,135.00

## (3) 持有关联方发行的产品或债券

关联方	期末数/本期数			期初数/上年同期数		
	份额/数量	市值	投资收益/公允价值变动损益	份额/数量	市值	投资收益/公允价值变动损益
南方基金管理股份有限公司	1,648,924,133.41	2,970,222,928.61	244,402,578.40	1,150,312,258.38	1,227,072,515.50	27,917,974.24
鹏华基金公司	2,961,485,636.95	3,079,813,786.35	47,946,232.88	1,551,548,992.60	1,591,784,755.54	26,302,380.04
华润深国投公司			427,892.81	15,410,000.00	17,074,952.19	

合 计	4,610,409,770.36	6,050,036,714.96	292,776,704.09	2,717,271,250.98	2,835,932,223.23	54,220,354.28
-----	------------------	------------------	----------------	------------------	------------------	---------------

#### (4) 共同投资

2021年，本公司之子公司国信资本与深圳市高新投集团有限公司、深圳市天使投资引导基金管理有限公司、深圳市天使投资引导基金有限公司及其他合伙人共同投资设立深圳市天使一号创业投资合伙企业（有限合伙）。基金组织形式采用有限合伙制，基金总规模为300,000,000.00元，其中深圳市天使投资引导基金管理有限公司（作为普通合伙人和基金管理人）认缴出资3,000,000.00元，深圳市高新投集团有限公司（作为有限合伙人）、国信资本（作为有限合伙人）、深圳市天使投资引导基金有限公司（作为有限合伙人）分别认缴出资20,000,000.00元、30,000,000.00元、99,500,000.00元。

根据《深圳市天使一号创业投资合伙企业（有限合伙）合伙协议》，截至2021年12月31日，天使一号直投基金实缴出资总额为150,000,000.00元，其中深圳市天使投资引导基金管理有限公司实缴1,500,000.00元，深圳市高新投集团有限公司实缴10,000,000.00元，国信资本实缴15,000,000.00元、深圳市天使投资引导基金有限公司实缴49,750,000.00元。

### (三) 关联方应收应付款项

#### 1. 应收关联方款项

项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	鹏华基金公司	29,828,053.41		19,797,817.60	
应收款项	张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	29,145,102.74		18,945,102.74	
应收款项	深圳投控公司	9,819,422.32		5,011,203.14	
应收款项	南方基金管理股份有限公司	6,537,916.60		8,224,200.75	
应收款项	深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	3,550,684.93		3,008,219.18	
应收款项	深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	2,146,542.79			
应收款项	华润深国投公司	2,002,462.49		1,573,238.30	
应收款项	深圳市国贸科技园服务有限公司	226,299.42		226,299.42	

项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）			5,672,131.15	
应收款项	深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）			5,550,282.81	
应收款项	珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）			4,758,050.66	
其他应收款	深圳联合产权交易所股份有限公司			220,000.00	
小计		83,256,484.70		72,986,545.75	
融出资金	关联自然人	25,820.97		225,712.94	
小计		25,820.97		225,712.94	
合计		83,282,305.67		73,212,258.69	

## 2. 应付关联方款项

项目名称	关联方	期末数	期初数
卖出回购金融资产	南方基金管理股份有限公司	1,623,605,659.32	1,215,092,555.89
卖出回购金融资产	国泰君安证券股份有限公司	398,974,038.14	
卖出回购金融资产	华润深国投信托有限公司	526,803,355.62	
合计		2,549,383,053.08	1,215,092,555.89

## 十二、承诺及或有事项

### （一）重要承诺事项

已签订的正在或准备履行的大额发包合同

项目	期末数	期初数
大额发包合同		219,354,125.05
合计		219,354,125.05

### （二）或有事项

截至2021年12月31日，本公司作为被告涉诉金额较大的未决诉讼、未决仲裁如下：

#### 1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称华泽钴镍）部分投资者因证券虚假陈述造成

相关投资损失的民事赔偿事宜，分别向成都市中级人民法院（以下简称成都中院）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿损失及承担诉讼费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。公司自 2018 年 10 月 31 日起陆续收到相关案件材料，部分案件分别于 2019 年 8 月 1 日、2019 年 10 月 10 日和 2020 年 8 月 7 日等一审开庭审理。成都中院对部分案件作出一审判决后，相关当事人提起上诉。四川省高级人民法院（以下简称四川高院）于 2020 年 7 月 7 日对 3 起案件二审开庭审理，公司于 2021 年 4 月收到 3 起案件二审判决，其中，1 起案件判决公司等对华泽钴镍赔付义务 3,288.49 元承担连带赔偿责任，2 起案件判决驳回原告诉讼请求。2021 年 12 月 27 日，公司收到最高人民法院驳回 3 名原告再审申请的裁定。2022 年 2 月 7 日，公司收到四川高院对 1 起案件的二审判决，判决公司等对华泽钴镍赔付义务 12,868.88 元承担连带赔偿责任。2022 年 3 月至 4 月，公司收到成都中院的执行通知，要求公司等履行支付义务合计 2,059.73 万元。截至目前，涉及公司的诉讼案件合计 2,449 起，涉案标的额合计 91,555 万元，公司另收到部分案件的撤诉裁定。

#### 2. 海口农商行与刚泰集团及公司债券交易纠纷案

刚泰集团有限公司（以下简称刚泰集团）公开发行 2016 年公司债券（第二期）（以下简称 16 刚集 02），发行规模为 500,000,000 元，期限为 3 年，附第 2 年末投资者回售选择权，起息日期为 2016 年 11 月 3 日，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为 500,000,000 元。2018 年 11 月 3 日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。16 刚集 02 投资者海口农村商业银行股份有限公司向海南省高级人民法院提起诉讼，要求刚泰集团支付本金、利息、复利及相关费用合计人民币 10,709.95 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。因刚泰集团进入破产程序，目前案件中止审理。

#### 3. 公司与刘某等 2 人基金合同纠纷案

2018 年 6 月，委托人刘某等 2 人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称天和盈泰）及基金托管人本公司签订了《天和盈泰天山一号私募投资基金合同》，刘某等 2 人出资认购了该基金份额。2019 年 12 月，刘某等 2 人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计 2,204 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于 2021 年 7 月 9 日开庭，截至目前尚未裁决。

#### 4. 公司与浙江亚厦幕墙有限公司建设工程施工合同纠纷

2013年4月，本公司与浙江亚厦幕墙有限公司（以下简称亚厦公司）签订了《国信证券大厦（义乌）幕墙工程施工合同》（以下简称施工合同），合同总价款5,369.35万元。该工程项目于2014年4月25日开工，并于2016年11月13日竣工，本公司已累计支付工程款4,456.26万元。在尾款结算过程中，因双方对减少的工程款是否可以提取30%的奖励，一直存在分歧，导致工程尾款迟迟无法结算。亚厦公司于2021年5月起诉本公司，要求本公司支付工程尾款、变更（增加）工程的造价、优化奖励、现场签证费、利息等费用，合计1,031.82万元。2021年8月2日，该案件在浙江省义乌市人民法院开庭审理，一审判决公司向亚厦公司支付629.39万元。公司不服该判决，已向浙江省金华市中级人民法院提起上诉，二审已于2022年1月19日开庭，目前尚未判决。

#### 5. 公司与杭州福安实业有限公司基金合同纠纷案

2017年10月，委托人杭州福安实业有限公司与基金管理人上海拉曼资产管理中心（有限合伙）（以下简称拉曼资管中心）、基金托管人本公司签订了《海银拉曼1号债券私募投资基金基金合同》，杭州福安实业有限公司出资认购了该基金份额。2021年4月，杭州福安实业有限公司向上海仲裁委员会提起仲裁，认为拉曼资管中心利用证券账户进行利益输送、关联交易，管理人的内部人员利用内幕消息提前赎回退出，上述行为严重损害了投资者利益，托管人本公司对上述行为未尽到托管监督职责。要求拉曼资管中心和本公司共同返还投资本金、赔偿投资利息等合计1,479.73万元。2021年8月10日，该案件在上海仲裁委员会开庭审理，目前尚未裁决。

#### 6. 亿阳信通投资者与亿阳信通及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

投资者郭某等3人向北京金融法院等提起诉讼，要求亿阳信通股份有限公司（以下简称亿阳信通）承担因证券虚假陈述给其造成的损失合计2,401.72万元，并要求本公司作为保荐机构承担连带赔偿责任。目前案件尚未开庭。

### 十三、资产负债表日后事项

#### （一）资产负债表日后利润分配情况

拟分配的利润或股利	以2021年末总股本9,612,429,377股为基数，向全体股东每10股派发现金股利5元（含税）
经审议批准宣告发放的利润或股利	尚需提交股东大会审议

#### （二）其他资产负债表日后事项说明

序号	日期	事项说明
1	2022年1月11日	国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）发行结束，品种一：债券简称22国信01，实际发行规模30亿元人民币，票面利率2.92%，期限为3年；品种二：债券简称22国信02，实际发行规模10亿元人民币，票面利率3.28%，期限为5年。
2	2022年1月12日	国信证券股份有限公司2021年度第十三期短期融资券兑付合计人民币704,450,273.97元。
3	2022年1月20日	国信证券股份有限公司2021年度第十五期短期融资券兑付合计人民币1,006,482,191.78元。
4	2022年2月10日	国信证券股份有限公司2022年度第一期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP001，实际发行规模30亿元人民币，票面利率2.5%，期限为365天。
5	2022年2月11日	国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）兑付合计人民币3,097,089,039.00元
6	2022年2月15日	国信证券股份有限公司2022年度第二期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP002，实际发行规模10亿元人民币，票面利率2.33%，期限为120天。
7	2022年2月17日	国信证券股份有限公司2022年度第三期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP003，实际发行规模25亿元人民币，票面利率2.32%，期限为120天。
8	2022年2月21日	国信证券股份有限公司2022年度第四期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP004，实际发行规模15亿元人民币，票面利率2.49%，期限为365天。
9	2022年2月24日	国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）发行结束，债券简称22国信03，实际发行规模5亿元人民币，票面利率2.95%，期限为3年。
10	2022年3月1日	国信证券股份有限公司2022年度第五期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP005，实际发行规模17亿元人民币，票面利率2.45%，期限为157天。
11	2022年3月1日	国信证券股份有限公司2022年度第六期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP006，实际发行规模23亿元人民币，票面利率2.58%，期限为365天。
12	2022年3月4日	国信证券股份有限公司2021年度第十八期短期融资券兑付合计人民币2,017,424,657.53元。
13	2022年3月7日	国信证券股份有限公司2022年度第七期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP007，实际发行规模15亿元人民币，票面利率2.47%，期限为191天。
14	2022年3月11日	国信证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券（第一期）兑付合计人民币1,560,750,000.00元。
15	2022年3月14日	国信证券股份有限公司2022年度第八期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP008，实际发行规模15亿元人民币，票面利率2.4%，期限为92天。
16	2022年3月25日	国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）发行结束，债券简称22国信04，实际发行规模21亿元人民币，票面利率3.17%，期限为3年。
17	2022年4月6日	国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）发行结束，实际发行规模30亿元人民币，票面利率2.58%，期限为1年。
18	2022年4月8日	国信证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券（第二期）兑付合计人民币3,640,000,000.00元。
19	2022年4月12日	国信证券股份有限公司2021年度第十四期短期融资券兑付合计人民币3,040,167,123.29元。

序号	日期	事项说明
20	2022年4月12日	国信证券股份有限公司2022年度第九期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP009，实际发行规模15亿元人民币，票面利率2.4%，期限为213天。
21	2022年4月12日	国信证券股份有限公司2022年度第十期短期融资券发行结束，债券简称22国信证券CP010，实际发行规模15亿元人民币，票面利率2.52%，期限为365天。

#### 十四、其他重要事项

##### (一) 年金计划

本公司依据相关政策建立了企业年金计划，按照参与企业年金职工当年度工资总额及规定的计提比例确定企业年金缴费总额，并为符合年金方案条件的员工缴纳企业年金。

本公司企业年金计划于2012年12月正式成立。该年金计划受托管理人和账户管理人为泰康养老保险股份有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司，投资管理人为泰康资产管理有限责任公司。

根据本公司与泰康养老保险股份有限公司签订的《企业年金计划受托管理合同》，在合同存续期内，受托人根据法律法规规定制定企业年金基金投资政策。

##### (二) 分部信息

###### 1. 本公司确定报告分部考虑的因素

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定业务分部，划分为5个业务分部：经纪及财富管理业务分部；投资银行业务分部；投资与交易业务分部；资产管理业务分部；其他分部。每个业务分部为单独的业务分部，提供不同的劳务。本公司的管理层定期审阅这些分部的经营成果，以决定向其配置资源。本公司各个业务分部提供的主要服务分别如下：

(1) 经纪及财富管理业务分部，主要包括：向个人及机构投资者提供证券经纪、期货经纪、代销金融产品、资产托管、投资咨询、融资融券及其他资本中介等服务。

(2) 投资银行业务分部，主要包括：为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组、新三板推荐等金融服务。

(3) 投资与交易业务分部，主要包括：从事权益类、固定收益类、另类投资类、衍生类产品及其他金融产品的交易和做市业务。

(4) 资产管理业务分部，主要包括：根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务以及基金管理业务等。

(5) 其他分部，主要包括：以上分部业务之外的其他业务以及公司总部运营。



## 2. 各报告分部利润（亏损）、资产及负债信息

### (1) 2021 年度

项 目	经纪及财富管理	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
1) 营业收入	10,769,070,008.12	2,066,376,925.27	7,415,919,537.19	541,697,431.80	3,024,973,101.51	23,818,037,003.89
手续费及佣金净收入	7,453,084,295.93	2,065,624,065.84		538,219,075.80	-24,055,828.92	10,032,871,608.65
投资收益（损失）			6,925,239,388.19		510,891,840.34	7,436,131,228.53
其他收入	3,315,985,712.19	752,859.43	490,680,149.00	3,478,356.00	2,538,137,090.09	6,349,034,166.71
2) 营业支出	4,361,596,961.94	1,332,225,410.75	811,474,623.17	251,659,521.03	4,767,189,270.40	11,524,145,787.29
业务及管理费	4,863,867,699.24	1,317,502,333.56	696,816,530.40	248,131,301.55	2,606,146,351.63	9,732,464,216.38
3) 营业利润	6,407,473,046.18	734,151,514.52	6,604,444,914.02	290,037,910.77	-1,742,216,168.89	12,293,891,216.60
4) 利润总额	6,345,260,262.88	1,131,251,876.74	6,604,423,604.85	290,037,910.77	-1,736,481,496.27	12,634,492,158.97
5) 资产总额	156,709,162,072.74	1,522,965,330.44	198,330,096,927.57	293,945,851.07	5,445,272,137.10	362,301,442,318.92
递延所得税资产						2,352,914,477.11
6) 负债总额	150,646,111,984.03	854,777,977.31	107,515,648,556.95	189,578,354.65	6,168,405,994.72	265,374,522,867.66
递延所得税负债						696,692,082.18
7) 补充信息						
① 折旧与摊销费用	247,276,032.92	37,430,123.72	13,321,923.31	3,093,114.46	177,198,819.56	478,320,013.97
② 资本性支出	153,373,527.30	7,724,591.82	3,830,529.75	6,503,479.70	599,708,551.96	771,140,680.53
③ 信用减值损失	-597,456,933.92		75,721,166.93		285,133.03	-521,450,633.96
④ 其他资产减值损失					96,261.07	96,261.07

## (2) 2020 年度

项 目	经纪及财富管理	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
1) 营业收入	9,999,475,605.14	1,978,658,202.27	3,909,242,588.13	396,417,260.73	2,500,277,588.71	18,784,071,244.98
手续费及佣金净收入	6,643,485,395.13	1,977,533,450.60		392,109,980.18	-36,147,959.51	8,976,980,866.40
投资收益（损失）			4,562,890,516.37		330,621,416.34	4,893,511,932.71
其他收入	3,355,990,210.01	1,124,751.67	-653,647,928.24	4,307,280.55	2,205,804,131.88	4,913,578,445.87
2) 营业支出	4,782,197,367.86	1,196,323,919.86	870,159,498.24	166,799,813.56	3,135,601,228.84	10,151,081,828.36
业务及管理费	4,073,593,553.81	1,182,409,420.36	471,262,181.10	164,394,413.90	1,478,078,829.82	7,369,738,398.99
3) 营业利润	5,217,278,237.28	782,334,282.41	3,039,083,089.89	229,617,447.17	-635,323,640.13	8,632,989,416.62
4) 利润总额	5,233,333,431.29	783,837,615.75	3,038,767,585.23	229,617,447.17	-941,947,589.35	8,343,608,490.09
5) 资产总额	140,671,867,881.37	1,205,101,438.97	155,276,539,162.59	599,069,167.99	5,003,298,656.92	302,755,876,307.84
递延所得税资产						2,282,639,643.88
6) 负债总额	131,911,554,480.54	862,550,620.76	81,810,940,904.32	127,027,188.21	7,119,333,670.27	221,831,406,864.10
递延所得税负债						540,412,928.09
7) 补充信息						
① 折旧与摊销费用	93,028,288.20	37,961,940.34	6,992,851.20	2,743,204.61	131,026,113.87	271,752,398.22
② 资本性支出	95,762,529.02	3,902,984.75	2,038,529.44	3,799,875.08	511,429,846.11	616,933,764.40
③ 信用减值损失	628,150,180.01		373,620,371.21		-5,258,371.40	996,512,179.82
④ 其他资产减值损失					5,893,797.90	5,893,797.90

(三) 租赁

1. 公司作为承租人

(1) 使用权资产相关信息详见本财务报表附注五(一)15之说明；

(2) 公司对短期租赁和低价值资产租赁的会计政策详见本财务报表附注三(三十二)之说明。计入当期损益的短期租赁费用和低价值资产租赁费用金额如下：

项 目	本期数	上年同期数
短期租赁费用	37,381,631.64	
低价值资产租赁费用（短期租赁除外）	2,262,154.35	
合 计	39,643,785.99	

(3) 与租赁相关的当期损益及现金流

项 目	本期数	上年同期数
租赁负债的利息费用	20,264,943.98	
与租赁相关的总现金流出	177,220,827.47	

(4) 租赁负债的到期期限分析和相应流动性风险管理详见本财务报表附注九(四)之说明。

2. 公司作为出租人

(1) 经营租赁

1) 租赁收入

项 目	本期数	上年同期数
租赁收入	32,299,753.35	39,806,979.57
其中：未纳入租赁收款额计量的可变租赁付款额相关收入		

2) 经营租赁资产

项 目	期末数	上年年末数
投资性房地产	288,437,302.31	299,038,217.57
小 计	288,437,302.31	299,038,217.57

3) 根据与承租人签订的租赁合同，不可撤销租赁未来将收到的未折现租赁收款额

剩余期限	期末数	上年年末数
1年以内	21,508,134.82	2,299,499.19
1-2年	15,308,884.93	1,555,396.19

剩余期限	期末数	上年年末数
2-3 年	10,804,111.53	1,369,043.05
3-4 年	8,380,196.40	102,430.71
4-5 年	3,324,332.90	
5 年以后	181,796.40	
合 计	59,507,456.98	5,326,369.14

(四) 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

1. 出具告慰函

本公司于 2021 年 10 月就国信香港公司融资事项向渣打银行（香港）有限公司出具告慰函，本公司确认知晓渣打银行（香港）有限公司、其关联方（包括总行及分行）（合称“银行”）现时提供予本公司之一个或多个子公司（“子公司”）以及将来会提供予子公司的一切融资，且我司知晓子公司与银行会在现时以及将来进行外汇交易和金融衍生产品交易（“交易”），我司确认该等安排符合我司批准程序，并且鉴于银行提供和/或继续提供前述融资、给与子公司任何信贷或其他融资、或进行和/或继续进行交易或其他交易，我司向银行保证，不允许子公司在完全清偿其对银行之负债、或履行其对银行之义务之前，进行清算（无论自愿清算或强制清算）或与其债权人达成任何债务重组协议或安排。子公司将作为一项持续经营始终存续。我司确认，本告慰函将适用于银行今后可能向子公司提供之全新的或额外新增的任何融资或交易。我司确认，我司将尽最大努力督促子公司及时偿还其在一切实融资和交易项下的债务。我司亦确认，在未收到银行书面同意或确保子公司对银行之负债完全清偿或确保履行其对银行之义务前，不得处置任何我司持有的子公司股权以致导致我司持有的子公司股权减为少数及非控股之股权。本函适用于香港特别行政区法律。

本公司于 2015 年 9 月 29 日就国信香港公司融资事项向大新银行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司 100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会大新银行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对大新银行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对大新银行应尽义务的行动，对将影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会大新银行；本公司和国信香港公司将向大新银行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供大新银行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对大新银行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于 2019 年 1 月就国信证券（香港）经纪有限公司的融资事项向民生银行香港分

行出具安慰函，主要内容为本公司继续维持拥有国信证券（香港）经纪有限公司 100%股本权益及控制权，将督促国信证券（香港）经纪有限公司业务运作正常，将促使并监督国信证券（香港）经纪有限公司按照银行的要求及时履行并偿付相关债务。安慰函将一直维持有效，直至国信证券（香港）经纪有限公司在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于 2020 年 7 月就国信香港公司的融资事项向南洋商业银行有限公司出具了承诺函，主要内容为国信证券继续直接或间接地拥有及持有国信香港的全部股份，并且维持对国信香港的最终管理控制权；就合理认为会影响国信香港持续性经营的情况实时通知银行，并督促国信香港履行还款责任。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于 2019 年 8 月就国信香港公司的融资事项向上海银行（香港）出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港 100%股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港按照银行的要求及时履行并偿付相关债务。安慰函将一直维持有效，直至国信香港在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于 2020 年 10 月就国信香港公司的融资事项向招商永隆银行有限公司出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港 100%股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港公司按照银行的要求及时履行并偿付相关债务；安慰函将一直维持有效，直至国信香港公司在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效；函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于 2021 年 4 月就国信证券（香港）经纪有限公司融资事项向中国信托商业银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信证券（香港）经纪有限公司 100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会中国信托商业银行香港分行；本公司将关注国信证券（香港）经纪有限公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对中国信托商业银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信证券（香港）经纪有限公司无法经营或无法履行对中国信托商业银行香港分行应尽义务的行动，对将影响国信证券（香港）经纪有限公司持续经营的情况，本公司将知会中国信托商业银行香港分行；本公司和国信证券（香港）经纪有限公司将向中国信托商业银行香港分行提供经审计的财务报表，国信证券（香港）经纪有限公司还将在合理情况下提供中国信托商业银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信证券（香港）经纪有限公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信证券（香港）经纪有限公司履行对中国信托商业银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

## 2. 国信香港公司为全资子公司提供担保

截至 2021 年 12 月 31 日，国信香港公司为其全资子公司的常规业务提供的担保金额计港币 20,000 万元。

## 3. 债券借贷

本公司借入债券的类别及公允价值具体如下：

债券类别	期末公允价值	期初公允价值
国债	9,978,653,220.00	5,388,454,460.00
地方政府债	4,049,963,210.00	3,634,043,930.00
金融债		20,113,660.00
合计	14,028,616,430.00	9,042,612,050.00

注：本公司通过借入方式取得的债券为卖出回购业务而设定质押的期末公允价值计人民币 6,790,127,522.85 元，用于期货业务充抵保证金而设定质押的期末公允价值计人民币 4,980,395,136.35 元，用于出售的期末公允价值计人民币 294,314,660.00 元

## 十五、其他补充资料

### (一) 非经常性损益

项目	金额	说明
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	-260,807.84	
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助（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）	61,725,767.86	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		

项 目	金 额	说 明
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	328,987,272.69	
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-31,527,737.88	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
小 计	358,924,494.83	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“－”表示）	94,229,809.39	
少数股东权益影响额(税后)		
归属于母公司所有者的非经常性损益净额	264,694,685.44	

(二) 净资产收益率及每股收益

报告期利润	加权平均净资产收益率(%)	每股收益(元/股)	
		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	12.71	0.97	0.97
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	12.35	0.94	0.94





# 会计师事务所 执业证书

名称：天健会计师事务所（特殊普通合伙）

首席合伙人：胡少先

主任会计师：

经营场所：浙江省杭州市西溪路128号6楼

组织形式：特殊普通合伙

执业证书编号：330000001

批准执业文号：浙财会〔2011〕25号

批准执业日期：1998年11月21日设立，2011年5月28日改制



证书序号：0007666

## 说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批，准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的，应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止或执业许可注销的，应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



发证机关：

2019年12月25日

中华人民共和国财政部制

仅为国信证券股份有限公司2021年度合并审计报告之目的而提供文件的复印件，仅用于说明天健会计师事务所（特殊普通合伙）具有执业资质未经本所书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方传送或披露。





# 营业执照

(副本)

统一社会信用代码

913300005793421213 (1/3)

扫描二维码登录“国家企业信用信息公示系统”了解更多登记、备案、许可、监管信息



名称 天健会计师事务所(特殊普通合伙)

类型 特殊普通合伙企业

执行事务合伙人 胡少先

经营范围 审计企业会计报表、出具审计报告；验证企业资本，出具验资报告；办理企业合并、分立、清算事宜中的审计业务，出具有关报告；基本建设年度决算审计；代理记账；会计咨询、税务咨询、管理咨询、会计培训；信息系统审计；法律、法规规定的其他业务。(依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动)

成立日期 2011年07月18日

合伙期限 2011年07月18日至长期

主要经营场所 浙江省杭州市西湖区西溪路128号6楼

登记机关

2022年3月1日



国家企业信用信息公示系统网址: <http://www.gsxt.gov.cn>

2022年3月1日至6月30日通过

国家企业信用信息公示系统报送公示年度报告。

国家市场监督管理总局监制

仅为国信证券股份有限公司2021年度合并审计报告之目的而提供文件的复印件，仅用于说明天健会计师事务所(特殊普通合伙)合法经营未经本所书面同意，此文件不得用作任何其他用途，亦不得向第三方传送或披露。

证书编号:  
No. of Certificate 110101300477

批准注册协会:  
Authorized Institute of CPAs 深圳市注册会计师协会

发证日期: 2014 年 12 月 3 日  
Date of Issuance /y /m /d

4

姓名 燕玉嵩  
Full name

性别 男  
Sex

出生日期 1986-02-20  
Date of birth

工作单位 瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)深圳分所  
Working unit

身份证号 70902196602205516  
Identity card No.



注册会计师工作单位变更事项登记  
Registration of the Change of Working Unit by a CPA

同意调出  
Agree the holder to be transferred from

瑞华会计师事务所 事务所  
CPAs  
(特普) 深圳分所  
转出协会盖章  
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs  
2019年 12月 1日  
/y /m /d

同意调入  
Agree the holder to be transferred to

天健会计师事务所 事务所  
CPAs  
广东分所  
转入协会盖章  
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs  
2019年 12月 1日  
/y /m /d

10

QR Code

燕玉嵩(110101300477), 已通过广东省注册会计师协会2020年任职资格检查。通过文号: 粤注协〔2020〕132号。

Barcode  
110101300477

QR Code

燕玉嵩(110101300477), 已通过广东省注册会计师协会2021年任职资格检查。通过文号: 粤注协〔2021〕268号。

Barcode  
110101300477

9

021005

仅为国信证券股份有限公司2021年度合并审计报告之目的而提供文件的复印件, 仅用于说明燕玉嵩是中国注册会计师, 未经燕玉嵩本人书面同意, 此文件不得用作任何其他用途, 亦不得向第三方传送或披露。

证书编号:  
No. of Certificate 110101301656

批准注册协会:  
Authorized Institute of CPAs  
深圳市注册会计师协会

发证日期:  
Date of Issuance 2017 年 03 月 08 日

姓名: 黄燕  
Full name: 黄燕

性别: 女  
Sex: 女

出生日期: 1983-10-02  
Date of birth: 1983-10-02

工作单位: 瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)深圳分所  
Working unit: 瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)深圳分所

身份证号码: 44030419831002027  
Identity card No.: 44030419831002027



注册会计师工作单位变更事项登记  
Registration of the Change of Working Unit by a CPA

同意调出  
Agree the holder to be transferred from

瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)深圳分所  
CPAs  
转出协会盖章  
Stamp of the transfer-out Institute of CPAs  
2017 年 12 月 31 日

同意调入  
Agree the holder to be transferred to

天健会计师事务所  
CPAs  
转入协会盖章  
Stamp of the transfer-in Institute of CPAs  
2019 年 12 月 31 日

黄燕(110101301656), 已通过广东省注册会计师协会2020年任职资格检查, 通过文号: 粤注协〔2020〕132号。



110101301656

黄燕(110101301656), 已通过广东省注册会计师协会2021年任职资格检查, 通过文号: 粤注协〔2021〕268号。



110101301656

仅为国信证券股份有限公司2021年度合并审计报告之目的而提供文件的复印件, 仅用于说明黄燕是中国注册会计师, 未经黄燕本人书面同意, 此文件不得用作任何其他用途, 亦不得向第三方传送或披露。