

公司代码：600958

公司简称：东方证券

东方证券股份有限公司 2020 年年度报告

重要提示

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

二、公司全体董事出席董事会会议。

三、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人金文忠、主管会计工作负责人张建辉及会计机构负责人（会计主管人员）尤文杰声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司2020年利润分配预案：以2020年末的A股和H股总股本6,993,655,803股为基数，公司向股权登记日登记在册的A股和H股股东每10股派发现金股利人民币2.50元（含税），共计分配现金股利人民币1,748,413,950.75元。

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告可能包含前瞻性陈述，包括未来计划和发展战略。除历史事实陈述以外的所有声明均为或可视为前瞻性陈述。公司及其任何子公司均不承担因新数据而公开更新或修订任何前瞻性陈述的义务。敬请投资者注意此类投资风险，不要过度依赖前瞻性陈述。

七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露年度报告的真实性、准确性和完整性

否

十、 重大风险提示

公司的业务受整体经济及政治状况影响，如宏观经济及货币政策、金融及证券行业的法律法规、市场、商业及金融部门的涨跌趋势、货币及利率水平波动、长短期市场资金来源的可用性、融资成本等。作为一家证券公司，公司的业务直接受证券市场固有风险影响，包括市场波动、投资意愿变动、交易量波动、流动性变动及证券行业市场信誉或市场感知信誉。整体经济状况低迷和市场不利因素可能会在多方面对公司的业务开展、经营业绩、财务状况和发展前景造成重大不利影响，如客户对证券交易需求可能会减少，进而导致公司证券经纪收入下降；公司所持证券交易及投资金融资产的价值及回报以及公司资产管理产品的投资组合价值可能会受到市场波动的不利影响；公司面临的违约风险可能会加大，客户或对手方有可能不能履行其合同责任；公司的融资成本可能会由于流动性和资本市场限制而增加，并可能由此限制公司通过募集资金来发展业务的能力；公司可能无法有效制定公司的业务计划以及策略。

公司除了需要面对中国证券行业内部的激烈竞争以外，还需要面对来自商业银行、基金管理公司、保险公司、信托公司、期货公司及资产管理公司等其他金融机构的强烈冲击。公司若干个竞争对手相比公司可能有若干竞争优势，包括财务资源更加充足、品牌认知度更高、产品及服务组合更丰富及营业网点覆盖范围更广。若公司未能有效竞争，公司业务开展、财务状况、经营业绩及发展前景可能受到重大不利影响。

公司通过债券发行以及银行及其他外部融资为公司大部分的经营提供资金。如果公司因缺乏或无法使用内部资源或无法取得替代融资而未能及时偿付或偿还债务，公司的财务状况、流动资金及业务营运将会受到不利影响。即使公司有履行偿债责任，公司所借入的债务金额也可能在多方面对公司造成不利影响，如公司日后就营运资金、战略性投资、偿债需求或其他目的取得任何必须融资的能力受限；公司缺乏规划业务或回应业务变化的灵活性；与债务水平较低的竞争对手相比，公司处于不利的竞争地位；影响公司的信用评级并增加公司的融资成本；公司更易受到业务或经济整体下滑的影响；公司被迫面对以较高利率为公司的债务进行再融资的风险。

公司已在本报告中详细描述存在的市场风险、信用风险等，请参见经营情况的讨论与分析中关于公司未来发展的讨论与分析中可能面对的风险因素及对策的内容。

十一、 其他

适用 不适用

本报告的分析及阐述，未特别指明的，均以合并会计报表口径为基础。

目录

| | | |
|------|------------------------|-----|
| 第一节 | 释义..... | 5 |
| 第二节 | 公司简介和主要财务指标..... | 7 |
| 第三节 | 公司业务概要..... | 22 |
| 第四节 | 经营情况讨论与分析..... | 26 |
| 第五节 | 重要事项..... | 71 |
| 第六节 | 普通股股份变动及股东情况..... | 96 |
| 第七节 | 优先股相关情况..... | 107 |
| 第八节 | 董事、监事、高级管理人员和员工情况..... | 108 |
| 第九节 | 公司治理..... | 139 |
| 第十节 | 公司债券相关情况..... | 164 |
| 第十一节 | 财务报告..... | 172 |
| 第十二节 | 备查文件目录..... | 315 |
| 第十三节 | 证券公司信息披露..... | 316 |

第一节 释义

一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

| 常用词语释义 | | |
|-----------------|---|--------------------------------------|
| A 股 | 指 | 公司每股面值人民币 1 元的内资股，于上交所上市并进行交易 |
| 报告期 | 指 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 《标准守则》 | 指 | 《香港上市规则》附录十所载之《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》 |
| 东方投行 | 指 | 东方证券承销保荐有限公司，是公司全资子公司 |
| 东方金控 | 指 | 东方金融控股（香港）有限公司，是公司全资子公司 |
| 东证创投 | 指 | 上海东方证券创新投资有限公司，是公司全资子公司 |
| 东证期货 | 指 | 上海东证期货有限公司，是公司全资子公司 |
| 东证资本 | 指 | 上海东方证券资本投资有限公司，是公司全资子公司 |
| 东证资管 | 指 | 上海东方证券资产管理有限公司，是公司全资子公司 |
| 东证国际 | 指 | 东证国际金融集团有限公司，是东方金控全资子公司 |
| 董事会 | 指 | 东方证券董事会 |
| 董事 | 指 | 东方证券董事 |
| 公司/本公司/母公司/东方证券 | 指 | 东方证券股份有限公司 |
| 《公司法》 | 指 | 《中华人民共和国公司法》 |
| 《公司章程》 | 指 | 《东方证券股份有限公司章程》 |
| 汇添富基金 | 指 | 汇添富基金管理股份有限公司，是公司参股公司 |
| 花旗亚洲 | 指 | 花旗环球金融亚洲有限公司 |
| H 股 | 指 | 公司每股面值人民币 1 元的境外上市外资股，于香港联交所上市及以港元买卖 |
| IPO | 指 | 首次公开招股 |
| 集团/本集团/我们 | 指 | 东方证券股份有限公司及其子公司 |
| 监事 | 指 | 东方证券监事 |
| 监事会 | 指 | 东方证券监事会 |
| 《企业管治守则》 | 指 | 《香港上市规则》附录十四所载之《企业管治守则》及《企业管治报告》 |
| 上海海烟投资 | 指 | 上海海烟投资管理有限公司 |
| 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 |

| | | |
|----------------|---|---------------------------|
| 申能集团 | 指 | 申能（集团）有限公司 |
| 上证综指 | 指 | 上海证券综合指数 |
| 深证成指 | 指 | 深圳成分股指数 |
| 香港 | 指 | 中国香港特别行政区 |
| 香港联交所 | 指 | 香港联合交易所有限公司 |
| 香港证监会 | 指 | 香港证券与期货事务监察委员会 |
| 《香港上市规则》 | 指 | 香港联合交易所有限公司证券上市规则 |
| 新三板 | 指 | 全国中小企业股份转让系统 |
| 元、千元、万元、百万元、亿元 | 指 | 人民币元、千元、万元、百万元、亿元（特别注明除外） |
| 《证券法》 | 指 | 《中华人民共和国证券法》 |
| 《证券及期货条例》 | 指 | 香港法例第 571 章证券及期货条例 |
| 中国证监会 | 指 | 中国证券监督管理委员会 |
| 中债登 | 指 | 中央国债登记结算有限责任公司 |
| 中证登 | 指 | 中国证券登记结算有限责任公司 |

第二节 公司简介和主要财务指标

一、公司信息

| | |
|-----------|-----------------------------------|
| 公司的中文名称 | 东方证券股份有限公司 |
| 公司的中文简称 | 东方证券 |
| 公司的外文名称 | ORIENT SECURITIES COMPANY LIMITED |
| 公司的外文名称缩写 | DFZQ |
| 公司的法定代表人 | 金文忠 |
| 公司总经理 | 金文忠 |
| 公司授权代表 | 宋雪枫、金文忠 |
| 联席公司秘书 | 王如富、梁颖娴 |

公司注册资本和净资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| | 本报告期末 | 上年度末 |
|------|-------------------|-------------------|
| 注册资本 | 6,993,655,803.00 | 6,993,655,803.00 |
| 净资产 | 37,834,826,350.42 | 40,695,157,309.83 |

注：上年度末净资产已依据2020年1月中国证监会修订并颁布的《证券公司风险控制指标计算标准规定》的规定进行重述。

公司的经营范围：

证券经纪；融资融券；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券承销（限国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企业债务融资工具））；股票期权做市业务；证券投资基金托管。【依法须批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

公司的各单项业务资格情况

适用 不适用

| 序号 | 业务资质名称 | 核准机关及批准文号 |
|----|--|------------------------------|
| 1 | 经营证券期货业务许可证 | 中国证监会（编号：913100001322947763） |
| 2 | 进入全国银行间同业拆借市场和债券市场，从事拆借、购买债券、债券现券交易和债券回购业务资格 | 中国人民银行货币政策司（银货政[2000]108号） |
| 3 | 开展网上证券委托业务资格 | 中国证监会（证监信息字[2001]8号） |

| | | |
|----|------------------------------------|---|
| 4 | 开展开放式证券投资基金代销业务资格 | 中国证监会（证监基金字[2004]50号） |
| 5 | 开展“上证基金通”业务资格 | 上交所会员部（上交所[2005]） |
| 6 | 从事短期融资券承销业务资格 | 中国人民银行（银发[2005]275号） |
| 7 | 从事相关创新活动的试点证券公司 | 中国证券业协会（中国证券业协会从事相关创新活动证券公司评审公告第2号） |
| 8 | 代办股份转让主办券商业务资格 | 中国证券业协会（中证协函[2006]158号） |
| 9 | 报价转让业务资格 | 中国证券业协会（中证协函[2006]173号） |
| 10 | 上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格 | 上交所（上证会字[2007]45号） |
| 11 | 金融期货经纪业务资格的批复 | 中国证监会（证监期货字[2007]351号） |
| 12 | 中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与人资格 | 中证登（中国结算函字[2008]25号） |
| 13 | 金融期货交易结算业务资格 | 中国证监会（证监许可[2008]684号） |
| 14 | 直接投资业务试点资格 | 中国证监会（机构部部函[2009]475号） |
| 15 | 开展为期货公司提供中间介绍业务资格 | 中国证监会（沪证监机构字[2010]132号） |
| 16 | 设立全资子公司上海东方证券资产管理有限公司，开展证券资产管理业务资格 | 中国证监会（证监许可[2010]518号） |
| 17 | 经营证券期货业务许可证 | 中国证监会（编号：91310000555998513B） |
| 18 | 开展融资融券业务资格 | 中国证监会（证监许可[2010]764号） |
| 19 | 1号牌照-证券交易 | 香港证券及期货事务监察委员会（中央编号AVD362） |
| | 4号牌照-就证券提供意见 | |
| 20 | 9号牌照-提供资产管理 | 香港证券及期货事务监察委员会（中央编号AVH864） |
| 21 | 实施证券经纪人制度资格 | 中国证监会（沪证监机构字[2010]514号） |
| 22 | 2号牌照-期货合约交易 | 香港证券及期货事务监察委员会（中央编号AWD036） |
| 23 | 出资设立东方花旗证券有限公司，开展投资银行业务资格 | 中国证监会（证监许可[2011]2136号） |
| 24 | 从事债券质押式报价回购业务试点资格 | 中国证监会（机构部部函[2012]20号） |
| 25 | 向保险机构投资者提供综合服务资格 | 中国保险监督管理委员会（资金部函[2012]4号） |
| 26 | 开展约定购回式证券交易业务资格 | 中国证监会（机构部部函[2012]481号） |
| | | 上交所（上证会字[2012]167号） |
| | | 深交所（深证会[2013]15号） |
| 27 | 保险资金投资管理人资格 | 中国保险监督管理委员会公告 |
| 28 | 转融资业务试点及转融通业务资格 | 中国证券金融股份有限公司（中证金函[2012]149号、中证金函[2012]153号） |
| 29 | 资产管理业务资格 | 中国证监会（证监许可[2012]1501号） |
| 30 | 开展保险机构特殊机构业务资格 | 中国保险监督管理委员会（《关于开展保险机构特殊机构客户业务的通知》） |

| | | |
|----|--|---|
| 31 | 保荐机构资格 | 中国证监会（证监许可[2013]33号） |
| 32 | 经营证券期货业务许可证 | 中国证监会（编号：91310000132110914L） |
| 33 | 从事代销金融产品业务资格 | 上海证监局（沪证监机构字[2013]52号） |
| 34 | 作为主办券商在全国中小企业股份转让系统从事经纪业务资格 | 全国中小企业股份转让系统有限责任公司（股转系统函[2013]44号） |
| 35 | 开展有限合伙型私募基金综合托管业务 | 中国证监会（机构部部函[2013]174号） |
| 36 | 开展客户证券资金消费支付服务试点资格 | 中国证监会（机构部部函[2013]207号） |
| 37 | 证券投资业务许可证 | 中国证监会（RQF2013HKS015） |
| 38 | 公司股票质押式回购业务资格 | 上交所（上证会[2013]77号） |
| | | 深交所（深证会[2013]60号） |
| 39 | 开展代理证券质押登记业务资格 | 中证登（《代理证券质押登记业务资格确认函》） |
| 40 | 公开募集证券投资基金管理业务资格 | 中国证监会（证监许可[2013]1131号） |
| 41 | 权益类收益互换与场外期权业务资格 | 中国证券业协会（中证协函[2013]923号） |
| 42 | 参与转融券业务试点资格 | 中国证券金融股份有限公司（中证金函[2013]227号） |
| 43 | 外币有价证券经纪业务资格 | 国家外汇管理局上海分局（上海汇复[2014]15号） |
| 44 | 《证券业务外汇经营许可证》 | 国家外汇管理局（SC201102） |
| 45 | 作为主办券商在全国中小企业股份转让系统从事做市业务资格 | 全国中小企业股份转让系统有限责任公司（股转系统公告[2014]54号、股转系统函[2014]707号） |
| 46 | 机构间私募产品报价与服务系统第一批参与人资格 | 中证资本市场发展监测中心有限责任公司（报价系统参与人名单公告[第一批]） |
| 47 | 6号牌照-就机构融资提供意见 | 香港证券及期货事务监察委员会（中央编号BDN128） |
| 48 | 港股通业务交易权限 | 上交所（上证函[2014]626号） |
| 49 | 柜台市场试点资格 | 中国证券业协会（中证协函[2014]632号） |
| 50 | 黄金现货合约自营业务试点资格 | 中国证监会（基金机构监管部部函[2014]1876号） |
| 51 | 互联网证券业务试点 | 中国证券业协会（《关于互联网证券业务试点证券公司名单的公告》（第3号）） |
| 52 | 非金融企业债务融资工具主承销业务资质 | 中国银行间市场交易商协会（中国银行间市场交易商协会公告[2014]16号） |
| 53 | 上海证券交易所期权交易参与人资格，并开通股票期权经纪、自营业务交易权限；公司期权结算业务资格 | 上交所（上证函[2015]61号） |
| 54 | 开展客户保证金转账转入服务资格 | 中国证券登记结算公司（中国结算函字[2015]11号） |
| | | 中国证券投资者保护基金公司（证保函[2015]67号） |
| 55 | 股票期权做市业务资格 | 中国证监会（证监许可[2015]163号） |

| | | |
|----|---|------------------------------|
| 56 | 开展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（中市协备[2015]32号） |
| 57 | 证券投资基金销售业务资格 | 上海证监局（沪证监许可[2015]61号） |
| 58 | 报价系统做市业务试点公司资格 | 中证机构间报价系统股份有限公司 |
| 59 | 经营证券期货业务许可证，经营范围为证券（不含国债、政策性银行金融债、短期融资券及中期票据）承销与保荐 | 中国证监会（编号：913100007178330852） |
| 60 | 基金销售业务资格 | 中国证监会（编号：000000519） |
| 61 | 私募基金业务外包服务机构 | 中国基金业协会 |
| 62 | 短期融资券发行资格 | 中国证监会（机构部函[2015]3337号） |
| 63 | 放债人牌照 | 香港东区裁判法院（No. 0048/2016） |
| 64 | 深港通下港股通业务交易权限 | 深交所（深证会[2016]326号） |
| 65 | 银行间黄金询价业务资格 | 上海黄金交易所（上金交发[2017]81号） |
| 66 | 上海证券交易所股票期权交易参与者资格 | 上交所（上证函[2017]165号） |
| 67 | 深圳证券交易所质押式报价回购交易权限 | 深交所（深证会[2017]371号） |
| 68 | 上证 50ETF 期权主做市商资格 | 上交所（上证函[2018]430号） |
| 69 | 证券投资基金托管资格 | 中国证监会（证监许可[2018]1686号） |
| 70 | 从事证券承销业务资格（限国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企业债务融资工具）） | 上海证监局（沪证监许可[2019]8号） |
| 71 | 上交所上市基金主做市商业资格 | 上交所（上证函[2019]101号） |
| 72 | 信用衍生品业务资格（银行间市场信用风险缓释工具、交易所市场信用风险缓释工具及监管认可的其他信用衍生品卖出业务） | 中国证监会（机构部函[2019]463号） |
| 73 | 国债期货做市业务资格 | 中国证监会（机构部函[2019]1023号） |
| 74 | 互联网理财账户规范试点 | 中国证券业协会（中证协函[2019]185号） |
| 75 | 深交所股票期权业务交易权限 | 深交所（深证会[2019]470号） |
| 76 | 商品期权做市业务资格 | 中国证监会（机构部函[2019]3058号） |
| 77 | 股指期货做市业务资格 | 中国证监会（机构部函[2019]3067号） |
| 78 | 深交所沪深 300ETF 期权主做市商业资格 | 深交所（深证会[2019]483号） |
| 79 | 上交所沪深 300ETF 期权主做市商业资格 | 上交所（上证函[2019]2300号） |
| 80 | 结售汇业务经营资格 | 国家外汇管理局（汇复[2020]10号） |
| 81 | 代客外汇业务资格 | 国家外汇管理局（汇综便函[2020]482号） |

此外，公司还拥有中国证券业协会会员资格、上交所会员资格、深交所会员资格、中国国债协会会员资格、上海黄金交易所会员资格、中证登结算参与者资格及中国证券投资基金业协会会员资格。

二、联系人和联系方式

| | 董事会秘书 | 证券事务代表 |
|------|-------------------------|-----------------------------|
| 姓名 | 王如富 | 李婷婷 |
| 联系地址 | 中国上海市黄浦区中山南路119号11层 | 中国上海市黄浦区中山南路119号11层 |
| 电话 | +86-021-63325888 | +86-021-63325888 |
| 传真 | +86-021-63326010 | +86-021-63326010 |
| 电子信箱 | wangrf@orientsec.com.cn | litingting@orientsec.com.cn |

三、基本情况简介

| | |
|-------------|---|
| 公司注册地址 | 中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦 |
| 公司注册地址的邮政编码 | 200010 |
| 公司办公地址 | 中国上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦、中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12层、13层、22层、25-27层、29层、32层、36层、38层 |
| 公司办公地址的邮政编码 | 200010 |
| 香港营业地址 | 香港中环皇后大道中100号第28至29层 |
| 公司网址 | http://www.dfzq.com.cn |
| 电子信箱 | ir@orientsec.com.cn |

四、信息披露及备置地点

| | |
|---------------------|---|
| 公司选定的信息披露媒体名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 |
| 登载年度报告的中国证监会指定网站的网址 | http://www.sse.com.cn |
| 登载年度报告的香港联交所指定网站的网址 | http://www.hkexnews.hk |
| 公司年度报告备置地点 | 中国上海市黄浦区中山南路119号11层 |

五、公司股票简况

| 公司股票简况 | | | |
|--------|---------|------|--------|
| 股票种类 | 股票上市交易所 | 股票简称 | 股票代码 |
| A股 | 上交所 | 东方证券 | 600958 |
| H股 | 香港联交所 | 东方证券 | 03958 |

六、公司其他情况

(一) 公司历史沿革的情况，主要包括以前年度经历的改制重组、增资扩股等情况

适用 不适用

1997年12月10日，公司前身东方证券有限责任公司（以下简称“东方有限”）成立，取得了上海市工商行政管理局颁发的注册号为150050030000的《企业法人营业执照》，注册资本为人

人民币 10 亿元，注册地为中国上海市。中国人民银行于 1998 年 2 月 23 日以银复（1998）52 号文《关于设立东方证券有限责任公司的批复》同意成立东方证券有限责任公司，核准其公司章程。

2003 年 8 月 13 日，上海市人民政府以沪府体改审（2003）004 号文《关于同意设立东方证券股份有限公司的批复》批准东方有限变更为股份有限公司。2003 年 9 月 12 日，中国证监会以证监机构字（2003）184 号文《关于同意东方证券有限责任公司改制、增资扩股并更名的批复》同意东方有限改制为股份有限公司。东方有限原股东以 2002 年 12 月 31 日经审计的净资产按 1:1 比例折股，同时申能集团、上海烟草（集团）公司、文新报业集团等 10 家新老股东以货币增资人民币 10 亿元，整体变更成立股份有限公司。整体变更完成后，公司的注册资本为人民币 2,139,791,800.00 元。2003 年 10 月 8 日，上海市工商行政管理局向公司换发了《企业法人营业执照》。

为进一步提升公司规模，2007 年 5 月，经中国证监会证监机构字[2007]101 号文核准，公司进行了增资扩股，向全体股东按每 10 股配售 5 股的比例进行配售。本次增资扩股完成后，公司注册资本由人民币 2,139,791,800.00 元增至人民币 3,079,853,836.00 元。

2007 年 8 月，经中国证监会证监机构字[2007]187 号文核准，公司实施了每 10 股送 1 股红股的 2006 年度利润分配方案。本次未分配利润转增股本完成后，公司股本总额由人民币 3,079,853,836.00 元增至人民币 3,293,833,016.00 元。

2011 年 11 月，经中国证监会证监许可[2011]1769 号文核准，公司以向股东配股的方式增资扩股。本次配股完成后，公司的注册资本由人民币 3,293,833,016.00 元增至人民币 4,281,742,921.00 元。

2015 年 3 月，经中国证监会监许可[2015]305 号文批准，公司在上交所主板挂牌上市，公司的注册资本由人民币 4,281,742,921.00 元增至人民币 5,281,742,921.00 元。

2015 年 9 月，《关于公司发行 H 股股票并在香港上市的议案》经公司 2015 年第一次临时股东大会审议通过。2016 年 5 月，经中国证监会监许可[2016]1026 号文核准，公司拟发行不超过 10 亿股境外上市外资股。2016 年 6 月 2 日，香港联交所上市委员会举行上市聆讯，审议公司发行不超过 10 亿股境外上市外资股并在香港联交所主板上市的申请。2016 年 7 月 8 日，公司首次公开发行的 870,000,000 股 H 股以及售股股东将予出售的 87,000,000 股 H 股，共计 957,000,000 股境外上市外资股（H 股）在香港联交所主板挂牌上市并开始交易。2016 年 7 月，联席全球协调人（代表国际承销商）部分行使超额配售权并要求公司额外发行 63,709,090 股 H 股及售股股东因履行国有股减持义务将予出售的 6,370,910 股 H 股，共计 70,080,000 股 H 股于 2016 年 8 月 3 日在香港联交所主板上市并交易。至此，公司的注册资本由人民币 5,281,742,921.00 元增至人民币 6,215,452,011.00 元。

2017 年 12 月，经中国证监会证监许可[2017]1940 号文核准，公司完成非公开发行 A 股股票 778,203,792 股。本次非公开发行后，公司的注册资本由人民币 6,215,452,011.00 元增至人民币 6,993,655,803.00 元。

（二）公司组织机构情况

√适用 □不适用

1、公司组织机构

股东大会是公司的权力机构。董事会是公司的决策机构，对股东大会负责；董事会下设战略发展委员会、薪酬与提名委员会、审计委员会和合规与风险管理委员会四个专门委员会，各专门委员会对董事会负责。监事会是公司的内部监督机构，对股东大会负责，监事会下设监事会办公室。

公司实行董事会领导下的总裁负责制；总裁由董事会聘任或解聘，对董事会负责。董事会及各专门委员会下辖董事会办公室、战略发展总部、稽核总部、风险管理总部和合规法务管理总部。经营管理层下辖办公室、党委办公室、工会办事机构、纪律检查室、人力资源管理总部、计划财务管理总部、资金管理总部、营运管理总部、系统研发总部、系统运行总部、行政管理总部、财富管理业务总部、固定收益业务总部、证券投资业务总部、证券研究所、证券金融业务总部、金融衍生品业务总部、场外市场业务总部、托管业务总部、互联网金融总部等业务职能部门。

公司组织架构图详见本报告“附录一”。

2、公司全资子公司和主要参股公司

截至报告期末，公司全资子公司和主要参股公司包括：上海东证期货有限公司、上海东方证券资本投资有限公司、东方金融控股（香港）有限公司、上海东方证券资产管理有限公司、上海东方证券创新投资有限公司、东方证券承销保荐有限公司、汇添富基金管理股份有限公司。

3、公司全资子公司基本情况

（1）上海东证期货有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 500 号上海期货大厦 14 层

成立时间：1995 年 12 月 8 日

注册资本：人民币 230,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：卢大印

联系电话：+86-021-68400610

（2）上海东方证券资本投资有限公司

地址：中国上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 36 层

成立时间：2010 年 2 月 8 日

注册资本：人民币 400,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：金文忠

联系电话：+86-021-63325888

(3) 东方金融控股（香港）有限公司

地址：香港中环皇后大道中 100 号 28-29 楼

成立时间：2010 年 2 月 17 日

注册资本：港币 2,754,078,015 元

持股比例：100%

董事长：张建辉

联系电话：+852-35191188

(4) 上海东方证券资产管理有限公司

地址：中国上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层

成立时间：2010 年 6 月 8 日

注册资本：人民币 30,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：宋雪枫

联系电话：+86-021-63325888

(5) 上海东方证券创新投资有限公司

地址：中国上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 12 层

成立时间：2012 年 11 月 19 日

注册资本：人民币 580,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：张建辉

联系电话：+86-021-63325888

(6) 东方证券承销保荐有限公司

地址：中国上海市黄浦区中山南路 318 号 24 层

成立时间：2012 年 6 月 4 日

注册资本：人民币 80,000 万元

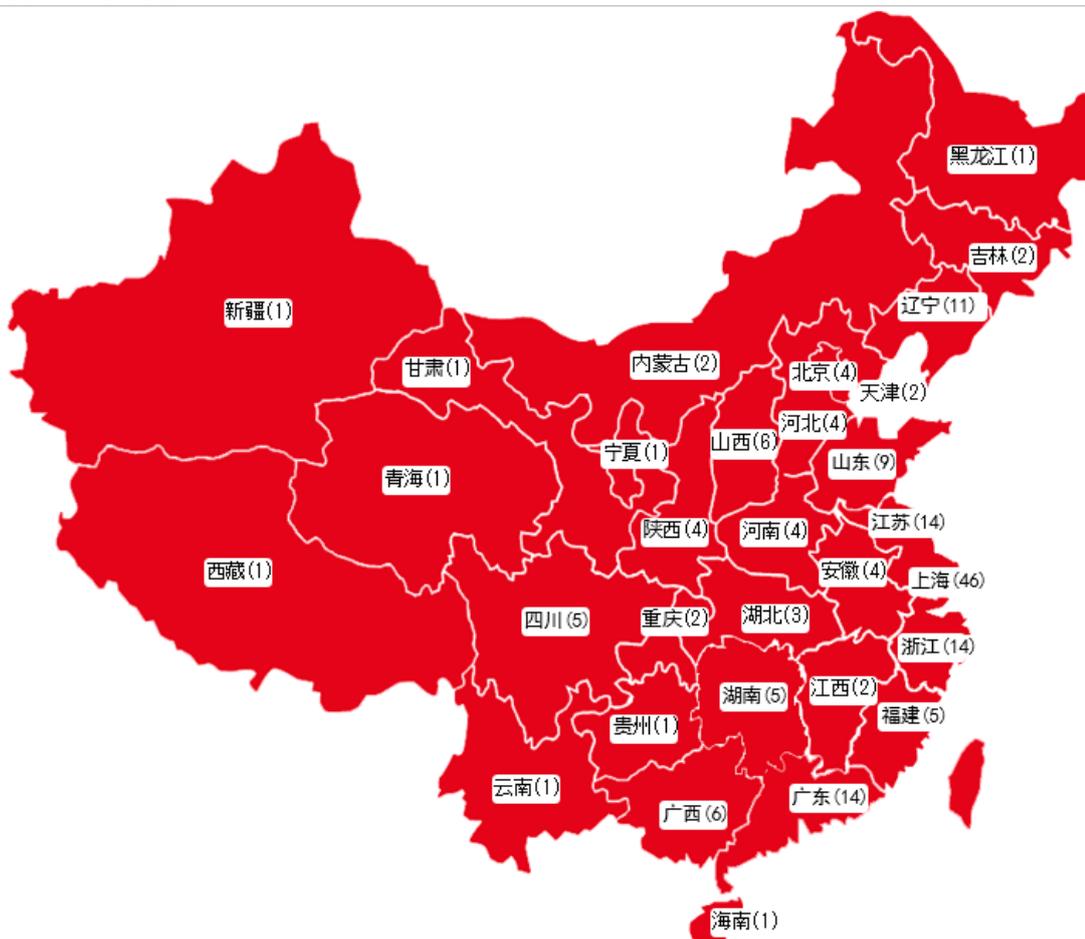
持股比例：100%

法定代表人：马骥

联系电话：+86-021-23153888

(三) 公司证券营业部的数量和分布情况

√适用 □不适用



截至报告期末，公司证券营业部总数达到 177 家。（详见本报告“附录二”）

(四) 其他分支机构数量与分布情况

√适用 □不适用

报告期内，公司全资子公司东证期货撤销 1 家期货营业部。截至报告期末，公司期货营业部总数 32 家，具体分布：上海市、浙江省杭州市各 3 家、北京市、浙江省宁波市各 2 家、重庆市、天津市、广东省深圳市、广东省广州市、广东省汕头市、辽宁省沈阳市、辽宁省大连市、河南省郑州市、湖南省长沙市、江苏省苏州市、江苏省无锡市、江苏省常州市、江苏省南通市、山西省太原市、山东省济南市、山东省青岛市、山东省东营市、四川省成都市、陕西省西安市、福建省厦门市、福建省泉州市、黑龙江省哈尔滨市各 1 家。（详见本报告“附录三”）

七、其他相关资料

| | | |
|-----------------|--------------|-------------------------|
| 公司聘请的会计师事务所（境内） | 名称 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
| | 办公地址 | 中国上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼 |
| | 签字会计师姓名 | 史曼、潘竹筠 |
| 公司聘请的会计师事务所（境外） | 名称 | 德勤·关黄陈方会计师行 |
| | 办公地址 | 香港金钟道 88 号太古广场一座 35 楼 |
| | 签字会计师姓名 | 马庆辉 |
| 首席风险官兼合规总监 | 杨斌 | |
| 中国内地法律顾问 | 国浩律师（上海）事务所 | |
| 香港法律顾问 | 高伟绅律师行 | |
| A 股股份登记处 | 中证登上海分公司 | |
| H 股股份登记处 | 香港中央证券登记有限公司 | |

八、近三年主要会计数据和财务指标

（一）主要会计数据

单位：元 币种：人民币

| 主要会计数据 | 2020年 | 2019年 | 本期比上年同期增减 (%) | 2018年 |
|-----------------------|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| 营业收入 | 23,133,946,765.29 | 19,052,097,313.75 | 21.42 | 10,303,490,892.44 |
| 归属于母公司股东的净利润 | 2,722,988,518.72 | 2,435,079,764.10 | 11.82 | 1,231,013,208.91 |
| 归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 2,662,488,437.45 | 2,371,410,961.44 | 12.27 | 1,179,836,507.58 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 28,195,640,212.74 | 10,385,033,926.77 | 171.50 | 5,719,680,134.58 |
| 其他综合收益 | -493,079,257.86 | 490,323,357.66 | -200.56 | -295,613,979.08 |
| | 2020年末 | 2019年末 | 本期末比上年同期末增减 (%) | 2018年末 |
| 资产总额 | 291,117,441,584.43 | 262,971,441,570.13 | 10.70 | 226,869,672,192.01 |
| 负债总额 | 230,886,297,555.25 | 208,959,804,837.29 | 10.49 | 174,597,219,851.88 |
| 归属于母公司股东的权益 | 60,202,850,867.31 | 53,965,516,313.13 | 11.56 | 51,739,478,771.67 |
| 所有者权益总额 | 60,231,144,029.18 | 54,011,636,732.84 | 11.52 | 52,272,452,340.13 |

(二) 主要财务指标

| 主要财务指标 | 2020年 | 2019年 | 本期比上年同期 增减(%) | 2018年 |
|-------------------------|-------|-------|------------------|-------|
| 基本每股收益(元/股) | 0.38 | 0.35 | 8.57 | 0.18 |
| 稀释每股收益(元/股) | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股) | 0.37 | 0.34 | 8.82 | 0.17 |
| 加权平均净资产收益率(%) | 4.85 | 4.61 | 增加0.24个百分点 | 2.37 |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%) | 4.74 | 4.49 | 增加0.25个百分点 | 2.28 |

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 本报告期末 | 上年度末 |
|----------------------|-------------------|-------------------|
| 净资本 | 37,834,826,350.42 | 40,695,157,309.83 |
| 净资产 | 55,664,052,007.07 | 50,586,895,965.40 |
| 风险覆盖率(%) | 229.94 | 253.68 |
| 资本杠杆率(%) | 11.95 | 12.33 |
| 流动性覆盖率(%) | 245.56 | 284.01 |
| 净稳定资金率(%) | 151.06 | 125.74 |
| 净资本/净资产(%) | 67.97 | 80.45 |
| 净资本/负债(%) | 25.76 | 27.00 |
| 净资产/负债(%) | 37.90 | 33.57 |
| 自营权益类证券及其衍生品/净资本(%) | 33.23 | 29.59 |
| 自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%) | 327.05 | 287.23 |

注：以上数据均系依据中国企业会计准则编制的财务信息为基础计算得出，上年度末净资本及风险控制指标数据均已依据 2020 年 1 月中国证监会修订并颁布的《证券公司风险控制指标计算标准规定》的规定进行重述。

九、境内外会计准则下会计数据差异

(一) 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

适用 不适用

(二) 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

适用 不适用

(三) 境内外会计准则差异的说明:

适用 不适用

十、2020 年分季度主要财务数据

单位: 元 币种: 人民币

| | 第一季度 (1-3 月份) | 第二季度 (4-6 月份) | 第三季度 (7-9 月份) | 第四季度 (10-12 月份) |
|-------------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|
| 营业收入 | 3,827,315,338.54 | 5,797,977,965.38 | 6,426,198,024.31 | 7,082,455,437.06 |
| 归属于上市公司股东的净利润 | 813,084,162.43 | 712,939,621.75 | 1,524,859,069.80 | -327,894,335.26 |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润 | 729,067,002.06 | 709,956,467.00 | 1,522,308,119.37 | -298,843,150.98 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 3,437,569,646.59 | 8,143,400,283.98 | 3,624,921,479.80 | 12,989,748,802.37 |

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

| 非经常性损益项目 | 2020 年金额 | 附注 (如适用) | 2019 年金额 | 2018 年金额 |
|--|----------------|-------------|----------------|----------------|
| 非流动资产处置损益 | -536,676.75 | | -187,362.49 | -50,822.74 |
| 计入当期损益的政府补助, 但与公司正常经营业务密切相关, 符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外 | 134,641,344.78 | 财政扶持 | 154,765,462.96 | 121,518,109.27 |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | -40,048,202.10 | | -51,668,565.86 | -47,668,996.28 |
| 少数股东权益影响额 | -1,625,000.00 | | -4,663,080.25 | 362,850.75 |
| 所得税影响额 | -31,931,384.66 | | -34,577,651.70 | -22,984,439.67 |
| 合计 | 60,500,081.27 | | 63,668,802.66 | 51,176,701.33 |

十二、 采用公允价值计量的项目

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目名称 | 期初余额 | 期末余额 | 当期变动 | 对当期利润的影响金额 |
|-------------|--------------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 66,901,093,485.91 | 72,701,117,042.70 | 5,800,023,556.79 | 5,426,436,284.13 |
| 2. 衍生金融工具 | -2,034,272,663.95 | -349,080,226.72 | 1,685,192,437.23 | -1,128,651,603.56 |
| 3. 其他债权投资 | 64,895,563,425.25 | 62,645,974,916.84 | -2,249,588,508.41 | 2,751,340,559.27 |
| 4. 其他权益工具投资 | 10,832,873,153.66 | 10,936,457,571.84 | 103,584,418.18 | 284,614,545.85 |
| 5. 交易性金融负债 | 12,630,960,595.06 | 14,576,073,144.23 | 1,945,112,549.17 | 225,514,737.24 |
| 合计 | 153,226,217,995.93 | 160,510,542,448.89 | 7,284,324,452.96 | 7,559,254,522.93 |

注：对当期利润的影响金额包括：（1）持有和处置上述项目取得的投资收益、利息净收入；（2）除其他债权投资、其他权益工具投资外的其他项目发生的公允价值变动损益；（3）其他债权投资发生的信用减值损失。且上述对当期利润的影响金额均为企业所得税前发生额。

十三、 其他

√适用 □不适用

按《证券公司年度报告内容与格式准则（2013年修订）》（中国证监会公告【2013】41号），公司合并财务报表和母公司财务报表主要项目会计数据。

（一）合并财务报表主要项目

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2020 年末 | 2019 年末 | 增减幅度 (%) |
|----------|--------------------|--------------------|----------|
| 货币资金 | 65,640,359,556.65 | 48,940,833,855.08 | 34.12 |
| 结算备付金 | 21,516,356,646.61 | 13,243,653,713.68 | 62.47 |
| 融出资金 | 21,171,919,414.06 | 13,214,262,240.75 | 60.22 |
| 衍生金融资产 | 155,876,469.76 | 609,102,138.41 | -74.41 |
| 存出保证金 | 2,183,089,694.77 | 1,642,894,348.47 | 32.88 |
| 合同资产 | 1,741,886.80 | 0.00 | 不适用 |
| 买入返售金融资产 | 14,460,425,371.36 | 24,206,541,982.29 | -40.26 |
| 投资性房地产 | 40,460,670.03 | 30,071,334.10 | 34.55 |
| 在建工程 | 65,838,524.98 | 50,034,280.51 | 31.59 |
| 递延所得税资产 | 1,455,922,066.16 | 760,993,782.62 | 91.32 |
| 资产总额 | 291,117,441,584.43 | 262,971,441,570.13 | 10.70 |
| 拆入资金 | 9,670,113,871.43 | 6,384,658,783.33 | 51.46 |
| 衍生金融负债 | 504,956,696.48 | 2,643,374,802.36 | -80.90 |
| 代理买卖证券款 | 66,642,671,158.50 | 40,179,178,362.34 | 65.86 |

| | | | |
|---------------|--------------------|--------------------|-----------------|
| 代理承销证券款 | 346,000,000.00 | 80,000,000.00 | 332.50 |
| 应付职工薪酬 | 2,608,008,552.75 | 1,601,085,895.75 | 62.89 |
| 应交税费 | 782,814,613.10 | 278,223,978.52 | 181.36 |
| 合同负债 | 404,123,622.43 | 208,113,569.43 | 94.18 |
| 负债总额 | 230,886,297,555.25 | 208,959,804,837.29 | 10.49 |
| 其他权益工具 | 5,000,000,000.00 | 0.00 | 不适用 |
| 其他综合收益 | 35,594,335.59 | 499,960,781.41 | -92.88 |
| 少数股东权益 | 28,293,161.87 | 46,120,419.71 | -38.65 |
| 股东权益总额 | 60,231,144,029.18 | 54,011,636,732.84 | 11.52 |
| 项目 | 2020 年度 | 2019 年度 | 增减幅度 (%) |
| 营业收入 | 23,133,946,765.29 | 19,052,097,313.75 | 21.42 |
| 手续费及佣金净收入 | 7,121,530,500.10 | 4,515,662,529.62 | 57.71 |
| 投资收益 | 5,011,629,307.14 | 3,414,721,885.19 | 46.77 |
| 公允价值变动收益 | 1,375,893,326.27 | 936,710,069.58 | 46.89 |
| 汇兑收益 | 208,302,301.95 | 12,163,513.10 | 1,612.52 |
| 税金及附加 | 96,943,406.88 | 71,338,550.08 | 35.89 |
| 业务及管理费 | 7,805,280,526.90 | 5,941,425,532.65 | 31.37 |
| 信用减值损失 | 3,885,132,441.16 | 1,044,458,050.46 | 271.98 |
| 所得税费用 | 64,599,989.34 | 375,791,852.54 | -82.81 |
| 净利润 | 2,721,763,792.52 | 2,478,738,856.26 | 9.80 |
| 归属于母公司股东的净利润 | 2,722,988,518.72 | 2,435,079,764.10 | 11.82 |
| 其他综合收益的税后净额 | -493,079,257.86 | 490,323,357.66 | -200.56 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 28,195,640,212.74 | 10,385,033,926.77 | 171.50 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -6,365,944,260.74 | 10,069,109,126.51 | -163.22 |

(二) 母公司财务报表主要项目

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2020 年末 | 2019 年末 | 增减幅度 (%) |
|----------|--------------------|--------------------|----------|
| 融出资金 | 20,945,414,325.69 | 12,924,954,996.12 | 62.05 |
| 衍生金融资产 | 140,085,973.58 | 575,515,312.04 | -75.66 |
| 存出保证金 | 1,368,644,580.82 | 1,039,478,872.81 | 31.67 |
| 应收款项 | 236,450,026.41 | 515,023,059.52 | -54.09 |
| 买入返售金融资产 | 14,114,676,723.43 | 23,189,665,726.78 | -39.13 |
| 投资性房地产 | 40,956,605.82 | 31,207,205.57 | 31.24 |
| 在建工程 | 49,090,408.01 | 32,053,112.19 | 53.15 |
| 递延所得税资产 | 1,118,921,115.03 | 483,544,028.25 | 131.40 |
| 其他资产 | 353,464,867.38 | 248,445,432.89 | 42.27 |
| 资产总额 | 228,615,067,514.28 | 219,895,034,595.44 | 3.97 |
| 拆入资金 | 9,670,113,871.43 | 6,384,658,783.33 | 51.46 |

| | | | |
|---------------|--------------------|--------------------|-----------------|
| 衍生金融负债 | 486,364,134.27 | 2,618,097,637.41 | -81.42 |
| 代理买卖证券款 | 26,064,505,023.18 | 18,598,949,938.01 | 40.14 |
| 应付职工薪酬 | 830,595,930.09 | 516,763,731.76 | 60.73 |
| 应交税费 | 198,279,717.43 | 85,429,345.37 | 132.10 |
| 应付款项 | 172,917,242.52 | 109,310,735.36 | 58.19 |
| 其他负债 | 779,855,226.10 | 151,648,228.15 | 414.25 |
| 负债总额 | 172,951,015,507.21 | 169,308,138,630.04 | 2.15 |
| 其他权益工具 | 4,995,754,716.98 | 0.00 | 不适用 |
| 其他综合收益 | 178,831,351.45 | 556,061,852.46 | -67.84 |
| 股东权益总额 | 55,664,052,007.07 | 50,586,895,965.40 | 10.04 |
| 项目 | 2020 年度 | 2019 年度 | 增减幅度 (%) |
| 营业收入 | 8,969,255,840.36 | 6,665,556,580.78 | 34.56 |
| 手续费及佣金净收入 | 2,656,628,626.17 | 1,592,126,440.69 | 66.86 |
| 投资收益 | 4,608,535,266.01 | 3,023,131,060.06 | 52.44 |
| 其他收益 | 12,763,415.59 | 8,080,945.90 | 57.94 |
| 公允价值变动收益 | 837,015,001.43 | 1,207,520,920.22 | -30.68 |
| 其他业务收入 | 6,515,228.49 | 12,998,760.56 | -49.88 |
| 税金及附加 | 69,439,586.25 | 53,020,705.81 | 30.97 |
| 信用减值损失 | 3,880,760,015.39 | 1,012,742,297.59 | 283.19 |
| 其他业务成本 | 3,345,442.25 | 7,398,535.68 | -54.78 |
| 营业外支出 | 26,108,304.38 | 49,806,065.67 | -47.58 |
| 所得税费用 | -439,043,409.75 | -9,012,590.14 | 不适用 |
| 净利润 | 1,536,393,008.19 | 2,402,072,996.16 | -36.04 |
| 其他综合收益的税后净额 | -405,943,313.05 | 591,247,889.22 | -168.66 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 6,799,915,266.31 | 2,151,582,536.41 | 216.04 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -5,398,515,728.84 | 11,525,512,201.27 | -146.84 |

第三节 公司业务概要

一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

公司是一家经中国证监会批准设立的提供证券、期货、资产管理、投行、投资咨询及证券研究等全方位、一站式金融服务的综合类证券公司。经过多年发展，公司形成了自营投资、资产管理、证券研究等优势业务的业内领先地位。

报告期内，公司主要从事以下五大类业务：

• 证券销售及交易

公司的证券销售及交易业务以自有资金开展，包括权益类投资及交易业务、固定收益类投资及交易业务、金融衍生品交易业务、创新投资及证券研究服务。

- 公司从事专业的权益类投资及交易业务和固定收益类投资及交易业务，投资及交易品种包括各类股票、基金、债券、衍生品等，同时积极布局 FICC 业务。
- 公司开展金融衍生品交易业务，灵活运用衍生品工具和量化交易策略，以期获取低风险的绝对收益。
- 公司通过全资子公司东证创投从事另类投资业务，投资产品包括股权投资、特殊资产投资、量化投资等。
- 公司向机构客户提供研究服务，客户通过公司进行基金分仓，并根据公司提供的研究服务质量确定向公司租用专用单元交易席位以及分配的交易量。

• 投资管理

公司为客户提供资产管理计划、券商公募证券投资基金产品及私募股权投资基金管理。

- 公司通过全资子公司东证资管开展资产管理业务，提供包括集合资产管理、单一资产管理、专项资产管理和公开募集证券投资基金在内的完整的资产管理业务产品线。
- 公司通过持股 35.412%且作为第一大股东的联营企业汇添富基金为客户开展基金管理业务。
- 公司通过全资子公司东证资本从事私募股权投资基金管理业务。

• 经纪及证券金融

公司开展证券经纪业务和期货经纪业务，并为客户提供融资融券业务、股票质押回购业务、场外交易及托管业务等服务。

- 公司的证券经纪业务主要是通过营业部接受客户的委托或按照客户指示代理客户买卖股票、基金及债券。
- 公司通过全资子公司东证期货开展期货经纪业务，东证期货是上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、上海国际能源交易中心会员及中国金融期货交易所全面结算会员，为客户提供商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、

基金销售等服务。

- 公司通过东证期货旗下全资子公司东证润和开展风险管理业务，通过期货、现货两个市场的仓单服务、基差贸易、场外期权帮助企业管理经营价格风险。
- 公司的融资融券业务主要是投资者向公司提供担保物，借入资金买入证券（融资交易）或借入证券并卖出（融券交易）。
- 公司的股票质押式回购交易业务是指符合条件的资金融入方将其持有的股票或其他证券质押给公司，从公司融入资金，并约定在未来返还资金、解除质押的交易。
- 公司为客户提供 OTC 金融产品，同时提供转让及做市报价等服务。
- 公司托管业务主要包括为私募基金、公募基金等各类资管机构提供资产托管和基金服务等。

● 投资银行

公司的投资银行业务主要通过公司固定收益业务总部和全资子公司东方投行进行。

- 公司提供股票承销与保荐服务，包括首次公开发行、非公开发行和配股等再融资项目的承销与保荐服务。
- 公司提供债券承销服务，包括公司债、企业债、国债、金融债等承销服务。
- 公司提供并购重组、新三板推荐挂牌及企业改制等相关的财务顾问服务。

● 管理本部及其他业务

公司的管理本部及其他业务主要包括总部资金业务及境外业务等。

- 总部资金业务主要包括总部融资业务和流动性储备管理。
- 公司通过全资子公司东方金控开展国际化业务，业务经营地位于香港。东方金控通过其全资子公司东证国际及各持牌公司经营由香港证监会按照《证券及期货条例》规管的经纪业务、资产管理业务、投资银行业务、保证金融资业务等。

2020 年，疫情因素叠加国际贸易摩擦，我国经济增长面临较多的不确定性，股市、债市表现均大幅波动。报告期内，证券行业实现营业收入人民币 4,489.79 亿元，较上年同期提升 24.41%；实现净利润人民币 1,575.34 亿元，较上年同期提升 27.98%。营业收入方面，证券行业实现代理买卖证券业务净收入（含席位租赁收入）人民币 1,161.10 亿元，同比增加 47.42%；投资银行业务净收入 672.11 亿元，同比增加 39.26%；资产管理业务净收入人民币 299.60 亿元，同比增加 8.88%。资本规模方面，证券行业资本实力稳步提升；截至报告期末，证券行业总资产为人民币 8.90 万亿元，净资产为人民币 2.31 万亿元，较年初分别增长 22.50%、14.10%。

报告期内，公司整体实力、行业地位保持稳定，财务状况良好。证券销售及交易业务积极把握市场机遇，投资管理业务保持行业领先地位，财富管理转型不断深化，投资银行、私募股权投资等业务发展稳中有进。公司严守风控底线，在证券公司分类评级中获评 A 类 A 级，连续 12 年获得 A 类 AA 级或 A 级券商评级。

报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

√适用 □不适用

详见本报告“第四节、二、（三）资产、负债情况分析”。

其中：境外资产 188.08（单位：亿元 币种：人民币），占总资产的比例为 6.46%。

二、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

公司核心竞争力体现在公司治理、人才队伍、优势业务、合规风控、党建文化等方面。

1、股东的大力支持和规范的公司治理

公司自成立以来，股东一直比较稳定，并在高管团队优化、市场化机制改革、资本运作等重大事项方面给予公司长期的大力支持。公司按照法律法规相关要求建立了规范的治理架构，特别是公司上市以来，进一步建立健全适应金融企业特点和 A+H 股上市规则的公司治理体系，有效发挥党委的领导核心和政治核心作用，确保股东大会、董事会、监事会和经营层各司其职、各尽其责，探索形成富有特色的治理机制。公司持续加强法人治理建设，按照最新党纪法规的要求修改公司章程，持续完善治理结构，保障了公司的规范运行。

2020 年，董事会、监事会、经营层等各司其职，切实做到既不缺位，又不越位，保障了公司有效治理，规范运行。

2、团结进取务实高效的高管团队和业务团队

公司领导班子团结进取，务实专业，稳定包容，敢于担当，从业经验丰富，服务公司年限长，对资本市场和证券行业规律拥有深刻的洞察。公司高管团队对企业发展有着正确的发展观、风险观和共同价值观，始终坚持求真务实，按照行业规律与市场规律办事，将公司发展作为共同的事业，不追求短期利益，不急功近利，相信长期的力量，注重高质量发展，坚守合规风控底线，重视党建与企业文化建设，追求企业长期可持续发展。公司拥有专业化、高素质、较稳定的业务团队，多年历练积累了丰富的市场经验，专业能力突出，领军人才、骨干人才不断成长。

2020 年公司进一步加强人才队伍建设：一是充实调整公司领导班子和高管团队，凝聚共识，主动作为，班子成员始终围绕公司发展主线开展工作；二是加强人才队伍的管理，优化绩效考核，新增“行业文化建设”指标，加大紧缺高端人才引进力度，调整人才盘点机制，修订《干部管理办法》，优化薪酬激励方案；三是人才结构进一步优化，员工队伍呈现高素质、年轻化、专业化特点，人员总量、岗位匹配、用工形式及人力成本之间结构更加均衡合理。

3、公司优势业务市场地位不断巩固发展

公司十分重视投研能力的培育，经过多年深耕，公司已在证券投资、固定收益、资产管理、基金管理投资领域建立起品牌效应和竞争优势。证券投资和资产管理业务秉承价值投资理念，中长期业绩优异，“东方红”品牌享誉市场；汇添富基金投资业绩优异，创新能力领先，多次获

得上海市金融创新成果奖；固定收益业务投资收益保持稳定，债券承销能力形成良好口碑，FICC 全业务链布局完善；私募股权基金管理业务业绩长期处于行业前列。

2020 年，公司优势业务巩固发展，东证资管行业地位继续领先，资产管理业务收入（协会统计口径）排名行业第一，产品长期业绩优异，荣获中国证券报“金牛奖”、中国基金报“英华奖”、证券时报“君鼎奖”等多个奖项；汇添富基金新基金发行规模超 2,000 亿元，发行 10 只百亿基金行业排名第一，非货币公募基金月均管理规模排名行业第二，资产管理总规模突破万亿元，“长三角一体化 ETF”获得上海金融创新奖；债券自营保持稳健，荣获“债券通优秀报价机构奖”；权益类投资在风险可控前提下获取稳健绝对受益。

4、合规风控工作切实发挥保驾护航作用

公司一直秉承合规创造价值理念，持续推进合规与风险管理文化建设，密切跟进法规和监管要求，不断完善全面风险管理体系，加强合规管理、风险管理与内部控制工作的融合，注重金融科技在合规与风险管理中的应用。近年来，公司全员合规和风控意识不断增强，全面风险管理体系不断优化，合规与风险管理的有效性不断提升。

2020 年，公司根据新《证券法》、风控指标新规等最新法规制度的要求，落实到合规与风险管理具体工作中，扎实推进证券基金行业文化建设工作，完善合规与风险管理各项制度；从严落实子公司合规管理工作，加强母公司的统一垂直管控，推进母子公司风控系统对接，全面开展集团风险并表管理工作；以风险为导向开展稽核工作，加强稽核质量控制，加大督促整改力度。合规与风险管理体系有效运行，全年未发生重大风险和违法违规事件，连续 12 年保持证券公司 A 类评级，合规风控工作切实发挥了为公司创新发展保驾护航的作用。

5、优秀的党建企业文化和市场化机制的有机结合

公司高度重视党建和企业文化建设工作，并将行业文化建设要求与公司的“党建和企业文化就是生产力”战略任务有效融合，扎实推进，创新探索，探索实践具有东方证券特色的党建和企业文化建设道路。同时，公司在经营管理中尊重人性，尊重人才发展规律，与时俱进的推进市场化机制，坚持不懈的营造良好氛围，致力于为员工创造幸福生活。公司始终注重推进市场化机制建设并不断优化创新，始终坚持加强党建工作和打造以人为本的优秀企业文化，营造企业良好的干事创业氛围，推进员工实现物质文明与精神文明的双丰收。

2020 年，党建文化工作积极推进，抓好市委巡视整改工作要求，修订完善公司党委中心组学习制度，组织落实先进组织和优秀个人评选，深入开展“四史”学习教育，切实做到“一史一学”，组织开展 2020 年度“幸福家园”主题实践活动；制定公司行业文化建设实施方案，优化文化建设考核指标，举办东方文化群英会，第八届“职工运动会”、工会年度劳动竞赛、“职工小家”创建活动有序开展。市场化机制建设也取得积极进展，在上市公司层面实施 H 股员工持股计划，财富管理业务总部事业部制继续深化。

第四节 经营情况讨论与分析

一、经营情况讨论与分析

2020 年，新冠疫情成为了经济发展与资本市场的最大变量，各国政府出台政策刺激经济来应对疫情带来的经济衰退，全球范围内流动性保持宽松，资本市场经历了大幅波动。其中，我国受益于严格的疫情管控措施，经济复苏势头良好，2020 年经历了不对称“V”形反转，全年 GDP 同比增速 2.3%。报告期内，受宏观环境、经济增长、国际关系等因素影响，A 股市场先抑后扬、整体向好，全年上证综指上涨 13.87%，深证成指上涨 38.73%，创业板指上涨 64.96%；交投活跃度亦有显著提升，2020 年沪深股票日均成交额 8,478.08 亿元，同比增加 63.05%；同时，债券市场先扬后抑，报告期内，10 年国债收益率变化不大，中债总全价指数下跌 0.16%。

公司秉承“稳增长，控风险，促改革”的经营策略，在做好疫情防控的同时，聚力经营发展。公司根据宏观政策及金融市场的变化，不断优化资产负债配置，大类资产收益良好。权益类自营业务抓住市场机遇，发挥投研优势，取得了较好的绝对收益。固定收益业务保持投资和销售双轮驱动核心竞争力，提升投研深度，投资规模和业绩保持行业领先。公司获得外汇结售汇业务资格，FICC 全业务链布局完成，由点及面形成做市、外汇、资本中介、黄金等业务良性协同。公司抓住发行改革机遇，服务实体经济能力提升，国债、国开债、农发债等利率债承销排名继续保持行业领先，信用债主承销商和分销业务快速增长。资产管理业务顺势而为扩大业务规模，东证资管管理规模接近 3,000 亿元，汇添富基金规模突破 1.1 万亿元。东方投行完成中金公司 IPO 等项目，东证国际携手东方投行完成泰格医药港股上市，为香港联交所年内最大的医药健康行业 IPO。财富管理业务发挥资产端优势，金融产品代销业务取得显著进步，多只产品销量创造公司及行业记录。东证期货客户权益规模超 400 亿元，较去年同期增长 77.8%，全年成交量市占率均保持行业第一。

报告期内，公司获评证券公司分类评价 A 类 A 级，全年未发生重大合规风险事件。公司在疫情防控领导小组的领导下，严格落实各项防疫要求，从组织管理、制度制定及管控执行，持续做到了严密有序的常态化管理，并且携手保险公司推出员工福利保障措施。公司持续完善法人治理，全方位开展新《证券法》及其配套法规宣导。公司加大金融科技投入，数字管理平稳起步，科技赋能转化加快，首批信创项目落地上线，首次获得国家发明专利授权，多项目获上海市高新技术成果转化奖。公司体制机制稳步优化，管理效能持续提升，强化廉洁风险防控，扎实开展行业文化建设工作，顺利实施 H 股员工持股计划，加大重点工作的督办力度，推进产业扶贫和 ESG 建设。

二、报告期内主要经营情况

公司实现营业收入人民币 231.34 亿元，其中证券销售及交易业务人民币 47.53 亿元，占比 19.97%；投资管理业务人民币 43.93 亿元，占比 18.46%；经纪及证券金融业务人民币 136.03 亿

元，占比 57.16%；投资银行业务人民币 16.28 亿元，占比 6.84%；管理本部及其他业务人民币-5.79 亿元。（分部业务营业收入、营业支出及其占比未考虑合并抵消因素，下同）

（一）主营业务分析

利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

| 科目 | 本期数 | 上年同期数 | 变动比例（%） |
|---------------|-------------------|-------------------|---------|
| 营业收入 | 23,133,946,765.29 | 19,052,097,313.75 | 21.42 |
| 营业成本 | 20,437,154,223.75 | 16,300,663,502.05 | 25.38 |
| 管理费用 | 7,805,280,526.90 | 5,941,425,532.65 | 31.37 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 28,195,640,212.74 | 10,385,033,926.77 | 171.50 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | 3,462,434,203.19 | -4,725,101,244.87 | 不适用 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -6,365,944,260.74 | 10,069,109,126.51 | -163.22 |
| 研发支出 | 383,102,247.12 | 293,835,215.12 | 30.38 |

1. 收入和成本分析

√适用 □不适用

报告期内，公司实现营业收入 231.34 亿元，同比增加 40.82 亿元，增幅 21.42%。营业收入变动的主要原因为：报告期内，公司证券自营、证券经纪、资产管理、投资银行等主要业务收入以及对汇添富基金的投资收益均实现了同比增长。其中：

手续费及佣金净收入 71.22 亿元，同比增加 26.06 亿元，增幅 57.71%，主要原因是证券经纪、资产管理、投资银行等主要业务手续费收入增加；

投资收益 50.12 亿元，同比增加 15.97 亿元，增幅 46.77%，主要原因是证券自营及对汇添富基金投资收益增加；

公允价值变动收益 13.76 亿元，同比增加 4.39 亿元，增幅 46.89%，主要原因是交易性金融负债公允价值变动收益增加；

汇兑收益 2.08 亿元，同比增加 1.96 亿元，增幅 1612.52%，主要原因是汇率变动影响；

利息净收入 7.79 亿元，同比减少 1.12 亿元，降幅 12.56%，主要原因是股票质押式回购业务规模减小，相应利息收入同比减少；

其他收益 0.18 亿元，同比减少 0.06 亿元，降幅 26.25%，主要原因是本期收到与收益相关的政府补助减少；

其他营业收入 86.21 亿元，同比减少 6.38 亿元，降幅 6.89%，主要原因是子公司大宗商品销售收入减少。

报告期内，公司营业成本 204.37 亿元，同比增加 41.36 亿元，增幅 25.38%，主要原因为：营业收入增加，与收入相关的主要运营成本相应增加；公司审慎评估股票质押项目等预期信用风险，计提减值准备增加。

利润表中变动超过 30%以上项目情况表

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 2020 年度 | 2019 年度 | 变动比例 (%) | 主要原因 |
|-------------|------------------|------------------|----------|-------------------|
| 手续费及佣金净收入 | 7,121,530,500.10 | 4,515,662,529.62 | 57.71 | 经纪、资管、投行等主要业务收入增加 |
| 投资收益 | 5,011,629,307.14 | 3,414,721,885.19 | 46.77 | 证券自营及对汇添富基金投资收益增加 |
| 公允价值变动收益 | 1,375,893,326.27 | 936,710,069.58 | 46.89 | 交易性金融负债公允价值变动收益增加 |
| 汇兑收益 | 208,302,301.95 | 12,163,513.10 | 1,612.52 | 汇率变动影响 |
| 资产处置收益 | -536,676.75 | -187,362.49 | 不适用 | 固定资产处置亏损增加 |
| 税金及附加 | 96,943,406.88 | 71,338,550.08 | 35.89 | 附加税增加 |
| 业务及管理费 | 7,805,280,526.90 | 5,941,425,532.65 | 31.37 | 收入增加导致业务相关的成本支出增加 |
| 信用减值损失 | 3,885,132,441.16 | 1,044,458,050.46 | 271.98 | 计提股票质押减值准备增加 |
| 所得税费用 | 64,599,989.34 | 375,791,852.54 | -82.81 | 递延所得税费用减少 |
| 其他综合收益的税后净额 | -493,079,257.86 | 490,323,357.66 | -200.56 | 主要是其他债权投资公允价值变动影响 |

(1). 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位：元 币种：人民币

| 主营业务分行业情况 | | | | | | |
|-----------|-------------------|-------------------|---------|---------------|---------------|---------------|
| 分行业 | 营业收入 | 营业成本 | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%) |
| 证券销售及交易 | 4,752,700,584.11 | 765,481,187.11 | 83.89 | 47.54 | 57.06 | 减少 0.98 个百分点 |
| 投资管理 | 4,393,061,645.79 | 2,040,308,399.58 | 53.56 | 51.11 | 55.00 | 减少 1.17 个百分点 |
| 经纪及证券金融 | 13,602,798,461.73 | 14,652,993,460.54 | -7.72 | 2.00 | 22.62 | 减少 18.11 个百分点 |
| 投资银行 | 1,627,838,932.64 | 934,704,025.33 | 42.58 | 62.27 | 48.26 | 增加 5.43 个百分点 |
| 管理本部及其他 | -579,325,552.49 | 2,127,770,576.60 | 不适用 | 不适用 | 7.53 | 不适用 |

| 主营业务分地区情况 | | | | | | |
|------------|-------------------|-------------------|---------|---------------|---------------|---------------|
| 分地区 | 营业收入 | 营业成本 | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%) |
| 上海 | 882,733,697.48 | 436,172,296.43 | 50.59 | 43.55 | 32.22 | 增加 4.23 个百分点 |
| 辽宁 | 132,512,314.12 | 83,788,193.15 | 36.77 | 27.95 | 10.09 | 增加 10.26 个百分点 |
| 广东 | 84,058,064.70 | 93,712,031.83 | -11.48 | 54.42 | 25.15 | 增加 26.08 个百分点 |
| 广西 | 71,375,198.17 | 47,737,586.08 | 33.12 | 38.53 | 14.88 | 增加 13.77 个百分点 |
| 浙江 | 60,636,378.36 | 75,492,895.47 | -24.50 | 52.10 | 51.11 | 增加 0.81 个百分点 |
| 其他地区分支机构 | 355,544,819.23 | 520,321,889.82 | -46.34 | 68.54 | 44.06 | 增加 24.87 个百分点 |
| 公司总部及境内子公司 | 21,840,342,447.09 | 19,030,124,497.96 | 12.87 | 17.86 | 25.47 | 减少 5.28 个百分点 |
| 境内小计 | 23,427,202,919.15 | 20,287,349,390.74 | 13.40 | 19.49 | 26.01 | 减少 4.48 个百分点 |
| 境外子公司 | 477,691,211.63 | 246,356,972.80 | 48.43 | -5.37 | -9.90 | 增加 2.59 个百分点 |
| 抵消 | -770,947,365.49 | -96,552,139.79 | 不适用 | 不适用 | 不适用 | 不适用 |
| 合计 | 23,133,946,765.29 | 20,437,154,223.75 | 11.66 | 21.42 | 25.38 | 减少 2.78 个百分点 |

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

√适用 □不适用

(1) 证券销售及交易

公司的证券销售及交易业务以自有资金开展，包括自营交易（权益类投资及交易、固定收益类投资及交易、金融衍生品交易）、创新投资及证券研究服务。报告期内，证券销售及交易业务分部实现分部收入人民币 47.53 亿元，占比 19.97%。

自营交易

市场环境

2020 年是资本市场大幅波动的一年，疫情爆发冲击经济社会，全球各国均采取了大幅宽松的货币政策以对冲经济下滑。同时，国内一系列的制度创新，新《证券法》、创业板注册制改革、科创 50ETF 发行、退市新规等，有助于资本市场完善投融资功能、推动市场健康有序发展。

报告期内，股市经历剧烈震荡，全年上证指数上涨 13.87%，万得全 A 上涨 25.62%，恒生指数下跌 3.4%。受抗疫需求影响，上半年货币政策较为宽松，随着经济的探底回升，下半年货币政策

回归常态。报告期末，10 年国债收益率和 10 年国开收益率较去年末变化不大，中债总全价指数下跌 0.16%。

经营举措及业务发展

下表载列集团按资产类别划分的自营交易业务余额：

| (人民币百万元) | 截至 2020 年 12 月 31 日 | 截至 2019 年 12 月 31 日 |
|-------------------|---------------------|---------------------|
| 股票 | 7,472.66 | 6,948.16 |
| 基金 | 3,139.66 | 2,553.75 |
| 债券 | 83,051.22 | 87,906.29 |
| 其他 ^(注) | 2,328.19 | 933.75 |
| 总 计 | 95,991.73 | 98,341.95 |

注：主要包括使用自有资金对资产管理计划及财富管理产品进行的投资。

权益类自营投资方面。报告期内，公司发挥传统优势，深耕行业及个股研究，集中持有财务稳健且具有优质管理水平的龙头上市公司，取得了较好的绝对收益。公司实行严格的动态跟踪止损机制，在收益与回撤上取得了良好的平衡。此外，公司构建指定类高分红投资策略，并布局量化私募 FOF、量化策略自研投资，通过多元化投资提升收益的稳定性。

新三板业务方面。报告期内，公司持续优化新三板股票投资组合，推动优质企业 IPO 及精选层申报，新三板业务余额得到有效压缩。截至报告期末，公司持仓的多只新三板股票已通过 IPO 审核，预计将在 2021 年首次公开发行并上市。

FICC 业务方面。公司保持投资和销售双轮驱动核心竞争力，提升投研深度、加强系统建设，投资规模和业绩保持行业领先地位。

- 债券投资方面，公司在传统的息差收入基础上，更加重视交易。上半年货币政策宽松、收益率下行到低位，公司及时大幅减仓，兑现盈利；随着经济从底部回升，非常规货币政策逐步退出，公司正确判断利率走势及时进行配置，全年大幅跑赢指数。报告期内，公司银行间市场现券交易量同比增长 69.4%，交易规模名列证券公司前列，同时，受疫情影响，企业信用环境存在风险点，公司持续加强对信用风险的控制，信用债持仓占比有所下降。报告期内，公司获评银行间同业拆借中心“核心交易商”、“优秀债券市场交易商”、“优秀衍生品市场交易商”、中债登“结算 100 强-优秀自营商”等荣誉。
- 做市方面，报告期内，公司银行间市场现券做市成交量同比增长 58.9%，做市排名始终保持尝试做市机构前列，债券通交易排名保持行业前三，获评银行间同业拆借中心“对外开放贡献奖”、国家开发银行“2020 年银行间市场优秀做市商”等荣誉。中金所国债期货做市持续保持行业前三。
- 黄金和大宗商品业务方面，公司在多个交易所市场开展包括套利、趋势、套保、拆借、期权在内的各项自营交易业务，业务整体规模稳居券商前列。报告期内，公司黄金询价

交易量同比增长 230.3%；截至报告期末，黄金拆借余额同比增长 41.5%。同时，公司与银行合作开展全新的收益凭证业务模式，使得收益凭证融资成本大幅下降。报告期内，公司荣获上海黄金交易所“2019 年度荣获年度优秀特别会员奖”。

- 外汇业务方面，公司陆续获得银行间外汇市场结售汇业务会员资格、银行间外汇市场外币拆借会员资格，完成外汇交易基础设施建设，当前已常规化开展自营结售汇即期及衍生品交易，交易规模稳步上涨，交易策略逐渐丰富。
- 持续推进固定收益交易系统建设，获得银行间同业拆借中心“自动化交易创新奖”和“最佳技术奖”。

衍生品业务方面。报告期内，公司 Alpha 交易、智能交易和场外衍生品业务平稳发展、收益稳定，收益回撤比达到头部私募水平。其中，Alpha 业务稳中有进，量化选股、配置行业中性、对冲剥离系统性风险，获取了稳定的绝对收益。在智能交易领域，公司高频做市业务品种丰富，多个品种做市排名市场前列，并取得了较好的做市收益。场外衍生品方面，公司与主要金融机构开展场外期权交易，并积极申请新的牌照资格，致力于提升公司场外衍生品业务的盈利能力。报告期内，公司建设完成人工智能大数据平台、低延迟交易系统，实现金融科技赋能衍生品业务。

发展规划与展望

权益类自营投资方面。公司将在做好微观基本面研究的前提下，加大宏观研究和预判，以灵活的投资策略为主，在严控风险的前提下提高收益率，把握权益投资市场的机遇。

新三板业务方面。公司将在提高和夯实自身投研实力的同时，积极参与新三板改革，有序开展新三板精选层相关投资工作，发展混合做市业务，力争抓住改革机遇提高投资收益。

FICC 业务方面，公司将进一步拓宽投资视野，提升债券交易能力，完善系统化建设，推动固定收益业务销售交易和代客业务转型，推动 FICC 产业链完善，持续提升盈利能力。

金融衍生品业务方面。公司将不断提高投研能力，提升各业务收益率水平。包括：提升 Alpha 业务收益及稳定性；完善期权做市、基金做市和商品期货做市业务，提升收益率水平；发挥公司协同力量、积极开拓场外衍生品业务。同时，随着资本市场的逐步完善，未来更多衍生品标的的推出，将为公司业务带来更多的机会。

创新投资

公司通过全资子公司东证创投开展另类投资业务。东证创投业务主要涉及特殊资产收购与处置、股权投资、量化投资等方面。

市场环境

在特殊资产业务方面，不良资产市场的供给和需求同步扩大，资产端的价格有望持续走低；市场参与主体从“4+2”向“4+2+N”转型，债转股等处置手段登上舞台，知名外资机构纷纷参与。股权投资方面，以往以一、二级市场价差为主要投资逻辑的 Pre-IPO 纯财务投资机会和盈利空间将越来越少，产业资本的影响力将进一步提高；同时，随着多层次资本市场形成，退出的效率与

渠道不断增加。量化投资方面，优秀的外资资管机构进入，国内量化龙头涌现，行业发展高歌猛进，规模一路飙升。

经营举措及业务发展

考虑到量化投资、特殊资产业务和股权投资业务的投资年限分别为 0-1 年、1-2 年、3-5 年，风险也是由低到高，东证创投优化三类业务的资产配置，通过组合配置提升收益的稳定性，在报告期内取得了较好的业绩。

稳步推进特殊资产收购与处置业务。报告期内，东证创投特殊资产业务新增投资 14.59 亿元。截至报告期末，特殊资产业务存量项目 24 个，存量规模 27.21 亿元。

稳步开展股权投资业务。截至报告期末，公司股权业务项目存量个数 41 个，投资规模 13.26 亿，通过跟投制度提升风险管理效率。此外，东证创投积极参与公司科创板战略配售，累计跟投科创板合计 4 个、规模 1.59 亿元。

拓展量化对冲基金投资。公司与优秀的境内外量化机构合作，全年配置灵活调仓的量化私募基金，跟踪产品表现并适时调整投资方案；同时，对市场上优秀的管理人进行研究与尽调，优化投资效果。

发展规划与展望

未来，随着资产布局基本完成，东证创投将进入管理的精细化和业务的专业化阶段。

特殊资产业务中，东证创投将从资金提供者向处置运营方向发展，通过提高处置运营能力来提升 ROE 和资本回报，进而夯实核心竞争力。股权投资方面，将紧紧围绕国家规划、大力发展的方向进行资产布局，为实体经济发展助力，同时做好科创板跟投等工作。量化投资方面，公司将致力于寻找优质的管理人，降低产品投资的相关性，降低组合风险，提高收益率。

证券研究

市场环境

证券研究业务竞争日趋激烈，市场新进入者层出不穷，优质的研究实力是制胜关键。公司始终贯彻外部佣金与内部服务并重的战略，在竞争激烈的佣金分仓市场中稳扎稳打，实现了较好业绩；同时着力服务公司各业务部门，构建内部协同布局。

经营举措及业务发展

报告期内，证券研究所扎实做好基本面深度研究，已构建成熟完善的科创板研究体系。同时，创立并不断深化战略研究，力求在相关领域培育新的竞争优势。截至报告期末，公司证券研究业务共有研究岗位人员 80 人，具备分析师资格 67 人，具备投顾资格 24 人，共发布各类研究报告 2212 篇。

外部佣金方面，公司深耕公募市场，以机构客户为基础，努力提升市占率水平，同时增加客户覆盖面，积极开拓非公募客户。报告期内，研究所实现佣金收入人民币 5.40 亿元。其中，公募佣金（含专户、社保、年金席位）收入人民币 5.12 亿元，市占率为 2.94%，在核心公募基金客户

的研究排名持续提升；同时，新增公募客户 4 家，银行客户 1 家，私募及保险客户 35 家，全面覆盖新成立的银行理财子公司。

内部协同方面，证券研究业务积极转型，助力集团实现综合金融服务；利用核心研究能力探索企业客户的服务路径，为更广义的产业资本提供高价值服务；创立并不断深化战略研究，力求在相关领域培育新的竞争优势。

报告期内，在“2020 机构投资者·财新资本市场分析师成就奖”中，公司荣获大陆地区互联网行业第二名、技术/硬件行业第三名、技术/IT 服务及软件行业第三名，大陆地区最佳分析师团队第五名、最佳销售团队第三名。

发展规划与展望

未来，公司研究业务将切实把握好当前市场复苏契机，不断巩固和发挥自身的研究能力与优势，为客户提供更加全面和深入的研究服务，利用研究力量助力集团为企业综合金融解决方案。

(2) 投资管理

公司为客户提供资产管理计划、券商公募证券投资基金产品及私募股权投资业务。报告期内，投资管理业务实现分部收入人民币 43.93 亿元，占比 18.46%。

资产管理

公司主要通过全资子公司东证资管开展资产管理业务。

市场环境

2020 年受新冠疫情影响，资本市场波动加剧，权益市场跌宕起伏，呈现“结构牛”行情，板块差异明显；债券市场走出波澜壮阔的宽幅震荡行情，利率债收益率呈先下后上的“V”型走势。随着资管新规加速落地和金融开放不断深化，产品净值化转型加速，理财收益率总体下行以及在坚持房住不炒的政策环境下，资本市场已经成为居民配置资产的重要领域，为各类资管机构发展驶入快车道创造了前所未有的发展机遇。另一方面，资管行业竞争日趋激烈，行业的头部效应越发明显，主动管理先发优势类资管机构管理规模增长迅速，如何提升自身核心竞争力以应对激烈的行业竞争是一道长期发展课题。

经营举措及业务发展

东证资管始终坚持客户利益至上的原则，坚定开展长期价值投资实践，专注提升“专业投研+专业服务”双轮驱动的核心竞争力，长期投资业绩保持行业前列。为了更好地维护客户利益，东证资管在传递价值投资理念、引入长期资金和建立长期考核机制等方面进行了有益实践，帮助投资者实现财富长期保值增值并助力优质企业的健康发展与价值创造。

截至报告期末，东证资管受托资产管理规模人民币 2,985.48 亿元。2020 年，东证资管受托资产管理业务净收入行业排名第一位（数据来源：中国证券业协会）。自 2005 年至报告期末，东证资管主动管理权益类产品的平均年化回报率 26.50%，同期沪深 300 指数平均年化回报率为

12.02%。东证资管权益类基金近五年绝对收益率 125.26%，固定收益类基金近五年绝对收益率 27.60%，均排名行业第六位（数据来源：海通证券研究所金融产品研究中心），长期业绩保持领先优势。

下表载列公司按产品类型划分的资产管理规模：

| (人民币百万元) | 截至 2020 年 12 月 31 日 | 截至 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|---------------------|---------------------|
| 集合资产管理计划 | 59,251.52 | 48,466.07 |
| 单一资产管理计划 | 27,333.53 | 35,045.61 |
| 专项资产管理计划 | 12,332.00 | 15,955.69 |
| 券商公募基金 | 199,631.24 | 123,411.98 |
| 合 计 | 298,548.29 | 222,879.35 |

作为资产管理行业的领跑者，东证资管将始终立足资产管理行业本源，不断巩固和提升主动权益类、固收类业务，充分发挥核心业务优势，保持长期业绩领先；继续坚持以客户利益为先的发展理念，打造专业服务体系；同时做好核心竞争力的延伸，加快在养老业务、资产配置类产品、指数产品等领域的布局，丰富产品谱系，进一步夯实东方红品牌。

报告期内，东证资管荣获《上海证券报》第 17 届“金基金”奖之股票投资回报基金管理公司奖；《证券时报》第 15 届中国基金业明星基金奖“十大明星基金公司”、“五年持续回报明星基金公司”、“主动权益投资明星基金公司”；《中国基金报》中国基金业英华奖“最佳券商资管”、“最佳权益类券商资管”；《中国证券报》第 17 届基金业金牛奖“权益投资金牛基金公司”等在内的 41 项各类奖项。

发展规划与展望

未来，公司将积极抓住行业发展机遇，发挥主动管理优势、坚定价值投资理念，继续加强“专业投研+专业服务”双轮驱动核心竞争力建设，保持开放、进化的心态，不断夯实投资管理能力，坚持以客户为中心、以长期业绩为导向的可持续发展道路。公司将加大多元化发展布局，一方面继续完善公司产品线，拓宽公司投研能力圈，为广大投资者服务，另一方面进一步开拓巩固市场，持续优化客户结构。配合公司产品布局 and 战略发展，提升“东方红”品牌的知名度和美誉度。加快构建具有吸引力和市场竞争力的人才制度体系，为业务发展提供重要保障。全面加大金融科技投入，打造“数据+技术”双轮驱动的信息技术架构，加快服务线上化、数字化和智能化转型步伐。严守合规风控底线，实现与公司业务高质发展互促共进。

通过汇添富基金进行的基金管理

公司主要通过持股 35.412%且为第一大股东的联营企业汇添富基金开展基金管理业务。

市场环境

2020 年，伴随中国经济表现出极强的韧性，资本市场改革不断深化，对外开放继续提速，居民理财需求持续旺盛，资产管理行业迎来巨大的发展机遇，公募基金实现了爆发式增长。

经营举措及业务发展

报告期内，汇添富基金持续推进业务发展战略，按照 2020 年经营计划及“能力建设年”年号要求，全面增强投资管理、风险管理、客户服务和产品创新等核心能力。截至报告期末，汇添富公募基金管理规模为人民币 8,352 亿元，较年初增长 61%，剔除货币基金及短期理财债基后的公募规模为 5,574 亿元，较年初增长 93%。产品布局持续完善，构建了以客户为中心的多策略产品体系，布局多只具有市场影响力的主动权益、固收+、纯债产品，被动业务快速发展，基本面对冲策略形成品牌。各项业务全面发展，全渠道战略进一步推进，持续深化与养老金、银行、保险、理财子等机构的业务合作，电商业务取得长足发展，国际业务持续布局，继续推进第三支柱养老体系建设、ESG 责任投资等战略业务布局，合规与风险管理工作切实有效。

报告期内，汇添富基金中长期投资业绩保持优异。汇添富价值精选荣获《中国证券报》七年期开放式混合型持续优胜金牛基金，汇添富蓝筹稳健获《中国证券报》五年期开放式混合型持续优胜金牛基金和《证券时报》五年持续回报平衡混合型明星基金，汇添富消费行业获《中国证券报》三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和《证券时报》五年持续回报平衡混合型明星基金，汇添富中港策略基金获香港中资基金业协会&彭博 2020 离岸中资基金大奖中的最佳总收益（大中华区股票类）5 年期冠军，汇添富成长焦点获《证券时报》十年持续回报混合型明星基金。

报告期内，汇添富基金获得中国养老金融 50 人论坛最佳投资管理机构、《证券时报》文化建设基金君鼎奖等多项行业奖项；汇添富长三角一体化 ETF 荣获上海市政府 2019 年度上海金融创新奖。

发展规划与展望

伴随中国经济的转型升级，资本市场的结构性表现仍将继续，资产管理行业竞争愈加激烈。同时，居民理财需求加快释放、资本市场改革开放持续深化以及数字化技术实践加速落地，都将为行业发展注入持续动力。这其中，投资管理能力突出、综合实力领先的头部资产管理机构将在市场竞争中更具优势。

未来，汇添富基金将继续践行证券基金行业“合规、诚信、专业、稳健”的文化建设理念，秉持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，持续锤炼投资管理、风险管理、客户服务、产品创新四大核心能力，夯实基础，拥抱变革，努力打造中国最受认可的资产管理品牌。

私募股权投资

市场环境

2020 上半年，在全球疫情流行、经济下行压力剧增的大环境下，私募股权投资行业整体募资、投资均呈下降态势。2020 下半年，随着国内疫情的有效控制，行业整体回暖，募资规模和数量均

较上半年有所上升，但境外项目仍有所受阻。据清科数据统计，疫情给旅游、体育、饮食文化、传统教培、线下连锁零售行业带来冲击的同时，也给医疗健康、线上教育、线上消费、大数据和企业服务行业带来发展机遇。在此基础上，医疗健康、大数据和企业服务的投资热度明显上升，私募股权投资业务仍不乏发展机遇。

私募股权投资迎来发展的上升期。2019 年上交所新设科创板，12 月新证券法出台，明确将全面推行证券发行注册制度；2020 年 3 月 1 日新证券法正式实施、3 月 6 日创投基金减持特别规定；6 月 12 日证监会发布《创业板首次公开发行股票注册管理办法(试行)》等系列配套制度，均表现了监管层希望企业加强直接融资以及突出市场在资源配置中起决定作用的思路，增强了私募股权投资基金服务实体经济的信心，给予了更加多元化的退出投资的方式与渠道。

经营举措及业务发展

截至报告期末，东证资本在管基金 48 只，管理规模约 160.55 亿元；东证资本及其管理的基金累计投资项目 191 个，累计投资金额人民币 258.3 亿元，其中共有 54 个项目实现退出；在投资金额约 92.99 亿元，投资项目 137 个；储备项目 4 个。

东证资本持续关注科创板及创业板注册制对股权投资市场的影响，自科创板开板以来有 13 家企业申报了科创板 IPO（2020 年新申报 5 家），其中 7 家成功上市，2 家已通过上市委员会审议。报告期内，有 7 家标的企业申报了创业板 IPO，其中 1 家已完成上市、3 家已通过上市委员会审议。

报告期内，东证资本荣获 2019 投中榜“中国最佳私募股权投资机构 TOP50”、“中国最佳中资私募股权投资机构 TOP30”、“中国最佳券商私募基金子公司 TOP10”、“中国先进制造与高科技产业最佳先进制造领域投资机构 TOP20”，清科 2020 年“中国私募股权投资机构 100 强”、“中国证券公司投资机构 10 强”，第四届中国证券报金牛奖“券商股权投资年度优胜机构”等荣誉。

发展规划与展望

未来，在国内疫情常态化有效控制管理和全球疫情反复的大背景下，东证资本将努力把握第三次科技浪潮和国家战略机遇，挖掘优质企业，做好做强私募基金管理品牌。在符合所受监管规制的框架下，进一步优化运营管理、增强价值发现及投资能力、提升投后管理水平等将是东证资本不断探索和不懈努力的方向。

(3) 经纪及证券金融

公司经纪及证券金融板块主要包括证券经纪业务、期货经纪业务、大宗商品交易以及包括融资融券和股票质押式回购在内的证券金融业务等。报告期内，经纪及证券金融业务实现分部收入人民币 136.03 亿元，占比 57.16%。

证券经纪

公司经纪业务主要依托财富管理业务总部及下设分支机构开展。截至报告期末，公司共有证券分支机构 177 家，覆盖 87 个城市、31 个省自治区直辖市。

市场环境

2020 年，中国居民资产配置迎来拐点，不同年龄阶段和资产规模的人群释放出明显的财富管理需求。报告期内，股票市场交投活跃度提升，股基成交额达 220.45 万亿元，同比增长 61%。同时，随着金融市场双向开放，金融科技有效赋能证券公司财富管理业务转型，投资者专业化程度加深，理财产品代销规模大幅提升。

经营举措及业务发展

报告期内，面临复杂的外部市场环境，公司积极防控疫情，保障交易服务顺畅运行。根据证券业协会月度数据，2020 年，公司证券经纪业务净收入市占率 1.62%，行业排名第 20 名，证券经纪业务净收入同比增长 66%。基础业务稳步夯实，报告期内公司累计新增开户数 31.2 万户，同比提高 31%，新增资产 1,013 亿元，同比提高 133%。截至报告期末，公司客户数 184 万户，同比提高 19.8%；客户托管资产 7,301 亿元，同比提高 29%。

公司发挥资产端优势，金融产品代销业务取得显著进步，多只产品销量创造公司及行业记录。报告期内，受行情回暖与公募基金赚钱效应的影响，公募基金募集规模超过 3 万亿。公司聚焦财富管理风口，坚定主动权益类产品的代销方向，并在东证资管、汇添富基金之外，拓宽合作渠道，与业内更多的优质管理人建立了深度的合作关系。报告期内，公司权益类产品销售规模 278 亿元，同比增长 256%，权益类产品保有规模 475 亿，同比增长 100%。根据证券业协会月度数据，代理销售金融产品净收入 3.9 亿，同比增长 269%，行业排名第 12 位。其中，公司独家定制的朱雀基金匠心一年持有期基金销售 23.64 亿元，创造了多项代销纪录。

下表载列所示期间集团代理销售金融产品的种类及金额（包括场外交易（OTC）产品）：

| （人民币百万元） | 2020 年 1-12 月 | 2019 年 1-12 月 |
|------------|----------------|----------------|
| 公募基金 | 166,267 | 104,841 |
| 券商集合理财产品 | 0 | 86 |
| 信托计划 | 3,477 | 3,116 |
| 私募基金产品 | 3,547 | 422 |
| 其他金融产品 | 8,610 | 25,403 |
| 合 计 | 181,901 | 133,868 |

创新高净值客户服务模式，开展私人财富业务。报告期内，公司聚焦客户分层管理，完成上海、杭州私人财富中心筹建，针对高净值客户正式推出私人财富服务，为高净值客户提供财富规划、资产管理、顾问咨询、家族财产传承等个性化综合金融服务，提升高净值客户的服务粘性和贡献度。

重点发展机构业务。一方面，公司落实以量化交易为重点的机构经纪业务的定位，为客户提供从策略生成到交易执行、软硬件配置等一系列优化支持服务，在公募、信托、银行、保险、量化私募等重点客户群体中树立了良好的口碑，成为量化交易领域中的主流券商之一。另一方面，

伴随金融市场双向开放，公司重视服务于外资机构，满足其资讯、投研、交易对接等需求，已成功开发贝莱德、威廉欧奈尔、安本标准、路博迈、喜马拉雅资本等 WFOE 客户。

互联网金融方面。报告期内，公司以数据为驱动，运用金融科技手段，持续优化统一移动门户东方赢家 APP，实现全品类高端产品的在线销售，助力客户资产配置和公司财富管理转型；推出智能资讯服务，升级“东方天玑”智能服务体系，个性化匹配客户需求，客户服务获得感持续提升；打造东方赢家期权、东方私行等专业服务类移动终端，为客户在期权和全球资产配置等方面提供专业化服务。截至报告期末，公司在互联网及手机平台拥有活跃经纪客户 55 万余人，报告期内，股基交易额人民币 4.17 万亿元；通过互联网及手机移动终端进行交易的客户数占总客户数 98%，线上交易额占比 85%，线上新增开户数占同期全部开户数 99%。

报告期内，公司获得证监会“国家级投教基地”授牌，获评《证券时报》2020 中国区“全能证券经纪商君鼎奖”、“零售证券经纪商君鼎奖”、“证券经纪人团队君鼎奖”，获评《每日经济新闻》2020 金鼎奖“年度最具财富管理综合实力券商”；东方赢家 APP 荣膺《证券时报》2020 中国证券业“综合服务 APP 君鼎奖”、“理财服务 APP 君鼎奖”两项大奖。

发展规划与展望

未来，公司将通过人才体系、薪酬绩效等深化改革措施提升业务活力和潜力；坚定推进财富管理转型，积极把握行业发展与政策机遇，扩大模式优势和品牌价值；推进私人财富业务，探索实践超高净值客户服务模式；优化机构服务体系，拓展合作空间；完善买方投顾运营能力和培训体系，提升综合业务收入；加强金融科技的应用，通过优化服务平台建设，建立客户分层管理和服务体系，促进财富管理业务数字化、智能化转型发展。

期货经纪

公司通过全资子公司东证期货开展期货经纪业务。

市场环境

2020 年，受到新型冠状病毒疫情冲击，全球大宗商品和各类金总资产价格波动加剧，国际环境日趋复杂，受此影响，期货市场风险管理功能发挥日趋凸显，市场发展突飞猛进，新品种上市速度加快，全市场衍生品数量突破 90 只，客户权益规模屡创新高，已接近 9,000 亿元。

经营举措及业务发展

报告期内，跟随市场发展，东证期货保证金规模创出新高，分类评价重回 A 类 AA 级，十多条业务线逐步开花结果。截至报告期末，公司客户权益规模超过 400 亿元，较上年同期增长 77.8%；新增机构客户同比增长 31.9%；机构客户权益规模同比增长 86.3%，在客户权益规模中占比达到 85%，成交量市占率保持行业第一。资产管理业务规模破百亿元，金融产品销售额稳步提升，累计销售公募及私募产品金额较上年同比增长 151%，东证赢家期货 APP 月活数据位居前列。

国内五大期货交易所官网公布的会员成交排名数据显示，东证期货在 2020 年以 11.56 亿手成交量占据榜首，同比大增 69.8%，是全国唯一一个成交量超过 10 亿手的期货公司。取得这一排名，

离不开东证期货通过技术、研究双核心竞争力累积多年优势，信息技术系统和研究实力在行业保持领先地位，并在机构业务领域深耕多年，品牌形象逐步推广。报告期内，由东证衍生品研究院倾力打造的金融衍生品数据综合管理系统开发完成并获得计算机软件著作权；同时，为发展公司金融科技实力，东证期货在 2020 年参股杭州数行科技有限公司，拟进一步通过优秀的大数据挖掘分析技术服务于客户。

东证期货通过旗下全资子公司东证润和开展风险管理业务，通过期货、现货两个市场的仓单服务、基差贸易、场外期权帮助企业管理经营价格风险。截至报告期末，东证润和共获得 28 个期货及期权品种做市资质，包括 21 个期货做市品种，7 个期权做市品种，其中上期所期权品种做市质量均排名前三；报告期内，东证期货已完成现货业务管理系统及场外衍生品业务管理系统测试。

报告期内，东证期货荣获上海期货交易所、上海国际能源交易中心、大连商品交易所、郑州商品交易所等多家机构颁发的优秀会员奖项，荣获证券时报“2020 中国优秀期货公司君鼎奖”、IAMAC 推介“最受险资欢迎期货公司”、2020 中国期货创新发展论坛“中国最佳期货公司”等奖项。

发展规划与展望

未来，预计期货市场新品种上市将保持增速，投资者机构化、业务多元化、国际化加速等发展特征将日趋显著，市场整体服务实体经济的能力将进一步提升。东证期货将秉承稳健经营、创新发展的宗旨，坚持以金融科技助力衍生品发展为主线，通过大数据、云计算、人工智能、区块链等金融科技手段打造研究和技术两大核心竞争力，坚持市场化、国际化、集团化发展方向，朝着建设一流衍生品服务商的目标继续前行。

证券金融

市场环境

随着资本市场全面深化改革，政策红利频出，叠加流动性宽松、市场活跃度明显提升等因素，融资融券业务迎来新的发展机遇。截至报告期末，全市场融资融券余额 16,190.08 亿元，较年初增长 58.84%，其中融券余额从年初的 137.8 亿元大幅增长至 1,369.84 亿元，增幅近 900%。

报告期内，受严监管态势持续、退市新规下市场加速出清、减持新规下业务流动性受限等因素影响，全市场股票质押融资余额稳步收缩，根据证券业协会统计，截至报告期末，全市场自有出资股票质押规模 3,009.21 亿元，较年初下降 30.2%。

经营举措及业务发展

融资融券业务方面。公司积极把握机遇，调整和优化业务结构、精细业务管理，全年业务规模明显增加。截至报告期末，公司融资融券余额 225.64 亿元，较年初增长 75.56%，高出市场增幅近 17 个百分点，市占率从年初的 1.26% 提升至 1.39%，维持担保比例高于市场平均水平。其中，融资余额 206.72 亿元，较年初增幅 63.36%；融券余额 18.92 亿元，较年初增幅 855.56%。公司积极拓展融券券源，与公募基金、同业券商、集团单位、股东单位等机构建立了良好的合作关系。

股票质押业务方面。公司坚持落实“控风险、降规模”的指导思想，持续推进分策清退及风险化解工作。截至报告期末，公司股票质押业务待购回余额 153.62 亿元，均为自有资金出资，全年压缩业务规模超过 50 亿元，风险得到有效释放。

发展规划与展望

未来，公司将抓住资本市场全面深化改革机遇，积极发展优势业务，一方面通过扩大优质券源储备、优化客户结构、完善分层服务体系等，打造融资融券业务新的盈利点和发展优势；另一方面，在业务发展中增强风险意识，进一步提升风险管理水平，推动业务稳健增长。

其他业务

场外业务

2020 年，市场环境波动加剧，确保不发生系统性金融风险依然是全年监管的主基调。在柜台市场方面，市场环境并不明朗，监管仍以防控风险为主，业务范围和品种仍受到较大限制。

公司场外业务紧跟监管政策及市场环境的变化，充分发挥柜台市场平台功能优势，赋能公司财富管理。报告期内，公司深耕产品研究，丰富和优化柜台产品体系，强化产品严选和风险跟踪；做大做强交易业务，服务和满足多层次客户需求；发挥柜台市场功能，深化系统建设，加强集团内合作和营业部服务。报告期内，公司柜台市场累计业务总规模为人民币 447.52 亿元：其中发行销售（含认购与申购）规模为人民币 430.97 亿元，同比增长 49.22%；交易业务规模 4.22 亿，同比增长 85.09%。同时，公司场外业务发展立足 OTC 平台，积极推进业务创新的孵化，包括落地员工持股计划，探索财富管理新产品等。

未来，公司场外市场业务总部围绕“做深基础、做厚中台、构建生态”的“中台战略”，加强产品中台管理、深化集团协同、服务财富管理。

托管业务

报告期内，资管行业发展稳中有升，公募基金、私募基金总规模持续攀升，利好托管行业发展。与此同时，证监会新增核准多家境内外机构的公募基金托管业务资格，具有公募托管资格的机构增至 56 家，行业竞争更加激烈，马太效应日益凸显。

报告期内，公司持续推进“智慧托管”运营管理及服务体系建设，有效扩宽客户服务内容，提升运作效率；进一步加强对重点客户的服务，建成公募基金、银行间债券交易、信托外包、期货资管、量化私募等多种服务体系，实现了对托管产品托管人、券商两种结算模式的支持。报告期内，公司业务规模、产品数量及客户数量分别较年初增长 68.00%、44.58%、23.97%，业务发展迈上新的台阶。报告期内，公司获评上海股权投资协会“2019 年度最佳私募基金服务机构”奖、每日经济新闻 2020 中国金鼎奖“2020 年度最具影响力托管券商”奖。

未来，公司将以客户为中心，加强系统建设、优化服务流程、提升品牌价值、深化集团协同，为机构客户提供更为综合、全面、优质的服务。

(4) 投资银行

公司主要通过全资子公司东方投行及公司固定收益业务总部从事投资银行业务。东方投行主要从事股票和公司债券的承销与保荐、企业债和资产支持证券的承销、并购重组、新三板推荐挂牌及企业改制等相关的财务顾问服务；固定收益业务总部主要从事国债、金融债等承销服务。报告期内，投资银行业务实现分部收入人民币 16.28 亿元，占比 6.84%。

股票承销

市场环境

报告期内，随着新《证券法》正式落地，股权资本市场迎来新机遇。科创板注册制日趋成熟，创业板注册制正式落地，再融资新规为实体企业带来更多资本市场融资机会。根据 Wind 数据，2020 年度全市场 IPO 融资规模 4,699.63 亿元，上市家数 396 家，同比大幅增长 95.07%；增发（含资产部分）融资规模 8,327.62 亿元，融资家数 361 家，同比增长 43.82%。

经营举措及业务发展

2020 年，东方花旗完成股权变更并更名为东方投行，成为东方证券全资子公司。报告期内，东方投行抓住科创板、创业板注册制推出的良好机遇，结合多年中外合资经营发展经验成果，充分发挥集团公司资源优势，迅速在 IPO 等方面打开局面。报告期内，东方投行完成股权融资项目 21 个，同比增长 90.91%，主承销金额人民币 170.82 亿元，同比增长 57.04%。

公司 IPO 项目承销 11 家，同比增长 266.67%；承销规模总计 102.35 亿元，同比提升超过 500%，中金公司、三友医疗、立昂微等具有市场影响力的行业标杆项目获得广泛认可，公司科创板及创业板项目储备及申报数量也呈现良好的增长势头。再融资方面，2020 年公司再融资项目共 10 家，承销规模 68.47 亿元，其中不乏宁波银行、闻泰科技、均胜电子等行业代表项目。

同时，东方投行严格把关项目质量控制和风险控制，2020 年度公司保荐 IPO 项目过会 16 家，过会率 100%，其中 15 个项目集中在下半年过会，且不存在取消审核或暂缓表决情况，审核数量超过 15 家的保荐机构中，仅 5 家机构满足以上条件。

报告期内，东方投行荣获《证券时报》“2020 中国区创业板投行君鼎奖”、“2020 中国区资产证券化团队君鼎奖”、2020 中国区创业板项目君鼎奖（康龙化成 IPO 项目）、《第一财经》“2020 年新锐投行 Top 10”等荣誉。

下表载列公司担任主承销商的各类股权融资交易明细：

| (人民币百万元) | 2020 年 1-12 月 | 2019 年 1-12 月 |
|----------------|---------------|---------------|
| 首次公开发行： | | |
| 发行次数 | 11 | 3 |
| 主承销金额 | 10,234.94 | 1,584.48 |

| | | |
|-------------|-----------|-----------|
| 再融资: | | |
| 发行次数 | 10 | 8 |
| 主承销金额 | 6,847.14 | 9,293.07 |
| 合计: | | |
| 发行次数 | 21 | 11 |
| 主承销金额 | 17,082.08 | 10,877.55 |

发展规划与展望

未来，东方投行将积极把握市场和政策机遇，助力更多实体企业获得直接融资的渠道；认真落实各项规则要求，切实履行中介机构责任，做好资本市场“看门人”，为推动全行业高质量发展做出贡献。同时，为应对注册制的改革方向，东方投行将加强医药医疗、互联网服务、电子、高端装备制造等行业团队建设，打造基于行业的客户覆盖与项目执行能力以及和东方证券一、二级资源联动。

债券承销

市场环境

2020 年，新冠疫情导致全球经济下滑，货币政策走向宽松，中国 10 年国债收益率创 10 年新低，其后“V”形反转。在此背景下，2020 年债市收益率整体呈现“V”形走势，1-4 月宽货币政策加码对冲疫情影响，债市收益率持续下行；5 月开始货币政策逐步回归中性，债市经历牛熊转换，在此过程中，信用债收益率主要跟随流动性环境波动，年底“永煤违约事件”冲击市场情绪，更加剧信用利差大幅走扩，至今仍处于持续修复的阶段。

一级市场方面，债券发行量大幅提升，2020 年各类债券发行共 56.80 万亿元，同比增长 25%；信用债共发行 19.06 万亿元，增幅达 28%。受财政赤字影响，2020 年利率债发行增速远超往年，叠加万亿抗疫特别国债，国债全年发行量超过 7 万亿元。

经营举措及业务发展

报告期内，公司债券承销业务主承销项目 184 个，主承销总金额人民币 1,322.02 亿元。

报告期内，东方投行债券业务大力引进了承揽承做人才，业务上采取了优势区域进一步深耕、新增区域加强培育的策略，债券承销规模和收入都实现较好增长，服务了更多优质客户，包括浦发银行、交通银行、上海地产、上海国资、中航租赁、珠海华发、厦港控股等，承销了市场首单旅游专项企业债，成功发行了 REITS、RMBS、疫情防控债等创新品种，全力支持实体经济发展。2020 年，在债券市场违约案例增加的环境下，东方投行债券承销项目维持“零违约”。报告期内，东方投行在上海证券交易所会员评优中荣获“保荐承销服务奖”。

报告期内，公司利率债销售业务继续巩固行业优势，信用债分销业务稳中有进。记账式国债承销、国开行和农发行金融债承销均排名券商前两位；积极参与地方政府债的承销，在上海和深圳证券交易所地方债承销排名继续保持同行业第二。荣获由中央国债登记结算公司评选的年度中国债券市场“优秀承销商”和“地方债非银类承销商杰出贡献机构”称号；获得国家开发银行金融债承销“银行间市场卓越承销商”、“交易所市场优秀承销商”等奖项；获得中国农业发展银行金融债承销“优秀承销商”和“交易所金融债券优秀承销商”等多个奖项。

2020 年，公司债务融资工具主承销规模 275.49 亿元，同比增长达 80%。公司债融业务同业排名第 10 名，其中公司在扶贫票据、绿色债务融资工具、资产支持商业票据承销方面取得了较好的成绩，券商同业排名分列第 4、第 5、第 6 名。公司债融业务荣获“2020 年中国区债券融资团队君鼎奖”、“2020 年中国区债券项目君鼎奖”。

下表载列公司担任主承销商的各类债券承销明细：

| (人民币百万元) | 2020 年 1-12 月 | 2019 年 1-12 月 |
|---------------------|---------------|---------------|
| 公司债券： | | |
| 主承销次数 | 86 | 44 |
| 主承销金额 | 65,681 | 35,271 |
| 企业债券： | | |
| 主承销次数 | 11 | 15 |
| 主承销金额 | 7,573 | 9,400 |
| 金融债： | | |
| 主承销次数 | 17 | 23 |
| 主承销金额 | 24,903 | 13,710 |
| 资产支持证券： | | |
| 主承销次数 | 14 | 14 |
| 主承销金额 | 7,170 | 14,745 |
| 非金融企业债务融资工具： | | |
| 主承销次数 | 56 | 33 |
| 主承销金额 | 26,875 | 14,452 |
| 合计： | | |
| 主承销次数 | 184 | 129 |
| 主承销金额 | 132,202 | 87,578 |

发展规划与展望

未来，公司将紧抓资本市场改革发展和上海国际金融中心建设等战略机遇期的窗口，坚持“稳增长，控风险，促改革”的经营策略，为债券承销规模跻身头部梯队而努力。

深化集团协同。进一步巩固集团内公司的协作，借助集团公司牌照资源和广泛的分支机构，发挥协同优势，获取更多客户，提高公司债、企业债、ABS、美元债、金融债、非金融企业债务融资工具等产品的承销规模和收入。

加强债券品种创新力度。在专项企业债、基金债、公募 REITs、非标转标业务等创新品种上加强拓展力度，提高创新品种承销规模。

强化区域深耕和创新服务。充分利用债券业务各区域现有政府资源，借助集团优势，强化区域深耕，创新性提供多样化综合产品来服务地方政府和国有企业，包括债券、股权、资管、直投、基金等，增加收入来源和规模。

财务顾问

市场环境

2020 年，并购重组类业务总体呈现出过会率低、审核趋严的趋势。其中，疫情导致的各类旅行限制、隔离政策使跨境并购项目的执行变得更加困难，同时企业业绩受到疫情影响也影响其收购能力及意愿，增加了交易的不确定性。

经营举措及业务发展

2020 年，东方投行并购业务有序开展，完成并购及资产重组项目 4 个，交易规模总额约 272,436.30 万元；公司完成了博深股份、纳思达、上海凤凰 3 家行政审核并购重组项目，以及 1 家跨境并购项目（斐控泰克收购 ficonTEC 80% 股权）。东方投行在行政审批类并购重组交易中担任独立财务顾问的执行能力出众，2020 年并购重组过会率继续保持 100%，过会家数排名行业第 7 位，过会金额排名行业第 13 位。

发展规划与展望

未来，东方投行将着力打造在通信及半导体、先进制造类、汽车、医疗、消费品等领域具有领先优势的业务品牌，注重集团内部协同，积极对潜在并购项目进行承揽。同时考虑到国内优质标的稀缺以及溢价趋高，东方投行将主动引导实力买家放眼全球，大力发展跨境并购。

(5) 管理本部及其他

公司管理本部及其他业务主要包括总部资金业务、境外业务及金融科技等。报告期内，管理本部及其他业务实现分部收入人民币-5.79 亿元。

资金业务

市场环境

2020 年，我国货币市场上半年为“稳增长”的逆周期调节阶段，随后转向为“精准导向”的总量边际收紧阶段与稳健中性阶段。由于政策边际收紧，回购利率反映的流动性分层开始显现。信用债违约使得银行与非银之间的流动性分化更明显，为证券公司的流动性管理带来了更大的挑战。

经营举措及业务发展

报告期内，公司以完善流动性风险管理体系和加强融资精细化管理为目标，持续优化储备资产结构以提升流动性的安全边际，实现资金安全性、流动性和收益性的有效统一。在货币市场加剧波动的环境下，公司实现资金平稳跨季，始终确保流动性指标满足监管要求。截至报告期末，母公司流动性覆盖率和净稳定资金率分别为 245.56%和 151.06%，远高于 120%的监管预警值。

发展规划与展望

未来，公司将持续完善流动性管理体系，不断优化内部资金转移定价，强化集团整体流动性管理框架；同时稳步推进公司债务融资工具的集中统筹管理，持续优化债务结构，兼顾流动性安全边际及经济效益。

境外业务

市场环境

2020 年，国际政治经济形势复杂多变，香港金融市场受到新冠疫情、石油价格争端、中美贸易战等因素的叠加冲击恒生指数全年下跌约 3%，市场行情和业务开展受到较大影响。

经营举措及业务发展

公司主要通过全资子公司东方金控、东证国际及其子公司开展相关境外业务。其中，东证国际作为集团国际化业务平台，通过各香港证监会持牌全资子公司开展证券经纪、期货经纪、资产管理、投资银行、融资融券等业务。面对复杂的外部环境，东证国际稳步推进各项经营管理工作，有效防范和化解重大风险，保住基本盘，提升资本实力，进一步夯实国际化业务长期发展基础。

经纪业务方面，东证国际全新上线东方环球财富 APP，以金融科技助推财富管理转型，初步搭建“三位一体”机构交易生态圈。截至报告期末，客户总量已突破 23 万户，同比增长 760%，港交所排名提升 26 位。资产管理业务方面，东证国际布局多元化产品线，管理规模再创新高。截至报告期末，公司资产管理总规模约为 146 亿港元，居在港中资券商前三位，同比增长约 51%。年内成功落地东方红明烨权益类基金系列的首只产品并完成首轮募资，持续拓展东方红品牌境外市场影响力。固定收益业务方面，东证国际通过严格的风险管理和积极的市场操作，有效化解年初国际金融市场流动性危机，稳步提升投资收益。报告期内，东证国际投行业务实力逐步增强，高收益中资美元债承销额保持在港中资券商第三名，参与完成万国数据中概股回归、泰格医药 IPO 等项目。

报告期内，东证国际荣获第十届中国证券金紫荆“最佳中资券商”、《财资》(The Asset)“亚洲地区 G3 债券最佳投资机构”榜单等奖项，“东方红增利基金”荣获投资洞见与委托(Insight & Mandate)平台“最佳离岸人民币基金(5 年)奖项”。在彭博与香港中资基金业协会 2020 年离岸中资基金大奖中，“全球睿选 1 号基金”荣获“最佳总回报——大中华区权益类(1 年)冠军”，“博时-东方红大中华债券基金”荣获“最佳总回报——大中华区固定收益(1 年)亚军”。

发展规划与展望

未来，东证国际将坚持稳增长、控风险、补短板、促改革的工作总基调，做大做强优势业务，着力发展潜力业务，补足增强短板业务。保持买方业务优势，扩大资产管理规模，加快推动经纪业务向财富管理转型，丰富“三位一体”机构交易生态；加强直投、投行与股权资本市场紧密协作，提升卖方债券融资业务实力，完善投行业务链；做大基于票据的金融市场业务，探索做市和策略交易。

金融科技

市场环境

“金融+科技”已经从技术革命转变为引领业务高质量发展与体系化服务的战略引擎，以数字化转型为基础，以科技引领业务，成为提升证券公司核心竞争力的关键工具。当前，券商积极应对金融科技浪潮，拥抱时代机遇，利用自身优势推进金融科技赋能业务、深化数字化转型。

经营举措及业务发展

公司重视在金融科技领域的布局，运用云计算、大数据和人工智能等手段，将数字化综合金融服务体验辐射至所有客户和全体员工，全面覆盖客户服务、投资决策、风控决策等业务需求。

公司积极推进金融科技产品自主研发，全方位提升公司核心竞争力。报告期内，公司推出东方睿系列品牌，发布新一代分布式极速机构交易系统，用户数与交易量显著增长；全自研打造超级投资管理平台，不断扩大业务接入与应用范围；持续优化东方赢家 APP，在助力产品销售、财富管理转型及夯实基础服务方面成果显著；建设完善东方展业平台，助推营业部工作数字化转型；打造东方证券人工智能平台—东方大脑，构建包含 AI 基础平台、中台层和应用层的整体架构，支撑业务智能化转型。

探索实践数字化转型，将金融科技应用到全面业务条线。持续建设多个能力中心，构建金融数据中台，推进集团级风控体系建设，启动 IT 数字化管理项目，助推数字化转型落地。推出智慧营运协作平台，“营云”平台和智能化资金结算平台，为营运业务在大数据上的应用推上一个新台阶。

报告期内，公司在人工智能、套利系统方面的开发成果荣获 2020 年上海市高新技术成果转化奖，“证券异常交易监控与定位”项目获得 2019 年度证券期货业金融科技研究发展中心（深圳）课题一等奖，“基于分布式架构的新一代机构交易服务平台”荣获第七届证券期货科学技术奖三等奖，“FICC 业务智能化交易平台”荣获第七届证券期货科学技术优秀奖。

发展规划与展望

未来，公司将持续加大金融科技创新力度，提升人工智能等创新技术实力，支撑公司数字化与智能化应用。加大自主研发力度，形成科技与业务的双轮驱动与深度融合；持续开展数据治理，建设集团级数据中台，推进集团风控体系建设。推进 IT 数字化管理，落实共享中台，推进架构转型。建设智慧运维体系，构建一体化信息安全防护能力。

(2). 成本分析表

单位：元 币种：人民币

| 成本构成项目 | 本年金额 | 本期占成本比例 (%) | 上年金额 | 上年占成本比例 (%) |
|--------|------------------|-------------|------------------|-------------|
| 税金及附加 | 96,943,406.88 | 0.47 | 71,338,550.08 | 0.44 |
| 业务及管理费 | 7,805,280,526.90 | 38.19 | 5,941,425,532.65 | 36.45 |
| 信用减值损失 | 3,885,132,441.16 | 19.01 | 1,044,458,050.46 | 6.41 |
| 其他业务成本 | 8,649,797,848.81 | 42.32 | 9,243,441,368.86 | 56.71 |

成本分析其他情况说明：

报告期内，税金及附加 0.97 亿元，同比增加 0.26 亿元，增幅 35.89%，主要原因是城建税等附加税增加；业务及管理费 78.05 亿元，同比增加 18.64 亿元，增幅 31.37%，主要原因是营业收入增加，导致业务相关的成本支出增加；信用减值损失 38.85 亿元，同比增加 28.41 亿元，增幅 271.98%，主要原因是计提股票质押减值准备增加；其他营业成本 86.50 亿元，同比减少 5.94 亿元，降幅 6.42%，主要原因是子公司大宗商品销售成本减少。

2. 费用

适用 不适用

详见“第十一节、七、64 业务及管理费”。

3. 研发投入

研发投入情况表

适用 不适用

单位：元

| | |
|---------------------|----------------|
| 本期费用化研发投入 | 288,363,057.00 |
| 本期资本化研发投入 | 94,739,190.12 |
| 研发投入合计 | 383,102,247.12 |
| 研发投入总额占营业收入比例 (%) | 1.66 |
| 公司研发人员的数量 | 215 |
| 研发人员数量占公司总人数的比例 (%) | 3.39 |
| 研发投入资本化的比重 (%) | 24.73 |

情况说明

适用 不适用

4. 现金流

适用 不适用

(1) 经营活动产生的现金流量净额为 281.96 亿元, 其中: 现金流入 545.13 亿元, 占现金流入总量的 37.28%, 主要是代理买卖证券收到的现金净额 264.63 亿元, 收取利息、手续费及佣金的现金 106.29 亿元, 拆入资金净增加现金 32.85 亿元, 交易性金融负债净增加额 16.71 亿元; 现金流出 263.17 亿元, 占现金流出总量的 21.76%, 主要是融出资金净增加额 79.58 亿元, 支付给职工以及为职工支付的现金 40.56 亿元, 支付利息、手续费及佣金的现金 23.61 亿元。

(2) 投资活动产生的现金流量净额为 34.62 亿元, 其中: 现金流入 69.75 亿元, 占现金流入总量的 4.77%, 主要是取得投资收益收到的现金 38.53 亿元, 其他债权投资净减少额 19.37 亿元; 现金流出 35.13 亿元, 占现金流出总量的 2.90%, 主要是其他交易性金融资产净增加额 22.19 亿元, 投资支付的现金 6.73 亿元。

(3) 筹资活动产生的现金流量净额为-63.66 亿元, 其中: 现金流入 847.29 亿元, 占现金流入总量的 57.95%, 主要是发行债券及短期融资款收到的现金 778.02 亿元, 吸收投资收到的现金 50.00 亿元; 现金流出 910.95 亿元, 占现金流出总量的 75.33%, 主要是偿还债务支付的现金 858.99 亿元, 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 43.85 亿元。

(二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

(三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

1. 资产及负债状况

单位: 元

| 项目名称 | 本期期末数 | 本期期末数占总资产的比例 (%) | 上期期末数 | 上期期末数占总资产的比例 (%) | 本期期末金额较上期期末变动比例 (%) | 情况说明 |
|--------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|---------------------|-------------------|
| 货币资金 | 65,640,359,556.65 | 22.55 | 48,940,833,855.08 | 18.61 | 34.12 | 客户货币资金增加 |
| 结算备付金 | 21,516,356,646.61 | 7.39 | 13,243,653,713.68 | 5.04 | 62.47 | 客户及公司自有备付金增加 |
| 融出资金 | 21,171,919,414.06 | 7.27 | 13,214,262,240.75 | 5.02 | 60.22 | 融资业务规模增加 |
| 衍生金融资产 | 155,876,469.76 | 0.05 | 609,102,138.41 | 0.23 | -74.41 | 衍生工具公允价值变动形成的资产减少 |
| 存出保证金 | 2,183,089,694.77 | 0.75 | 1,642,894,348.47 | 0.62 | 32.88 | 主要是履约保证金增加 |
| 应收款项 | 874,405,553.22 | 0.30 | 1,019,919,667.42 | 0.39 | -14.27 | 主要是应收清算款项减少 |
| 合同资产 | 1,741,886.80 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 不适用 | 子公司投行业务手续费 |

| | | | | | | |
|-----------|-------------------|-------|-------------------|-------|--------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产 | 14,460,425,371.36 | 4.97 | 24,206,541,982.29 | 9.21 | -40.26 | 主要是股票质押规模减少 |
| 交易性金融资产 | 72,701,117,042.70 | 24.97 | 66,901,093,485.91 | 25.44 | 8.67 | 交易性证券投资规模增加 |
| 债权投资 | 6,243,897,149.81 | 2.14 | 7,193,554,228.81 | 2.74 | -13.20 | 以摊余成本计量的债券投资规模减少 |
| 其他债权投资 | 62,645,974,916.84 | 21.52 | 64,895,563,425.25 | 24.68 | -3.47 | 以公允价计量且其变动计入其他综合收益的债券投资规模减少 |
| 其他权益工具投资 | 10,936,457,571.84 | 3.76 | 10,832,873,153.66 | 4.12 | 0.96 | |
| 长期股权投资 | 5,771,193,948.89 | 1.98 | 4,453,754,152.13 | 1.69 | 29.58 | 主要是子公司对外追加投资及权益法下确认投资损益 |
| 投资性房地产 | 40,460,670.03 | 0.01 | 30,071,334.10 | 0.01 | 34.55 | 本年新增出租房产 |
| 固定资产 | 2,019,601,972.64 | 0.69 | 2,040,273,431.66 | 0.78 | -1.01 | 固定资产计提折旧大于新增投入 |
| 在建工程 | 65,838,524.98 | 0.02 | 50,034,280.51 | 0.02 | 31.59 | 主要是新建网络设备项目投入 |
| 使用权资产 | 847,354,948.02 | 0.29 | 1,002,749,135.63 | 0.38 | -15.50 | 本年计提折旧大于新增金额 |
| 无形资产 | 215,313,094.34 | 0.07 | 168,519,080.82 | 0.06 | 27.77 | 本年新增投入大于摊销 |
| 商誉 | 32,135,375.10 | 0.01 | 32,135,375.10 | 0.01 | - | |
| 递延所得税资产 | 1,455,922,066.16 | 0.50 | 760,993,782.62 | 0.29 | 91.32 | 可抵扣暂时性差异增加 |
| 其他资产 | 2,137,999,709.85 | 0.73 | 1,732,618,757.83 | 0.66 | 23.40 | 主要是子公司预付款项增加 |
| 短期借款 | 579,732,185.45 | 0.20 | 640,153,529.20 | 0.24 | -9.44 | 子公司对外借款减少 |
| 应付短期融资款 | 16,255,485,786.37 | 5.58 | 16,113,199,559.50 | 6.13 | 0.88 | 应付短期收益凭证规模增加 |
| 拆入资金 | 9,670,113,871.43 | 3.32 | 6,384,658,783.33 | 2.43 | 51.46 | 同业拆入资金增加 |
| 交易性金融负债 | 14,576,073,144.23 | 5.01 | 12,630,960,595.06 | 4.80 | 15.40 | 主要是卖空贵金属规模增加 |
| 衍生金融负债 | 504,956,696.48 | 0.17 | 2,643,374,802.36 | 1.01 | -80.90 | 主要是商品期权规模减少 |
| 卖出回购金融资产款 | 52,860,883,439.73 | 18.16 | 57,478,062,865.93 | 21.86 | -8.03 | 主要是债券正回购规模减少 |
| 代理买卖证券款 | 66,642,671,158.50 | 22.89 | 40,179,178,362.34 | 15.28 | 65.86 | 经纪业务客户交易结算资金增加 |
| 代理承销证券款 | 346,000,000.00 | 0.12 | 80,000,000.00 | 0.03 | 332.50 | 子公司代理承销债券款增加 |

| | | | | | | |
|---------|-------------------|-------|-------------------|-------|--------|----------------|
| 应付职工薪酬 | 2,608,008,552.75 | 0.90 | 1,601,085,895.75 | 0.61 | 62.89 | 计提职工薪酬增加 |
| 应交税费 | 782,814,613.10 | 0.27 | 278,223,978.52 | 0.11 | 181.36 | 主要是应交企业所得税增加 |
| 应付款项 | 576,584,579.01 | 0.20 | 480,101,048.74 | 0.18 | 20.10 | 应付清算款项增加 |
| 合同负债 | 404,123,622.43 | 0.14 | 208,113,569.43 | 0.08 | 94.18 | 子公司预收大宗商品交易款增加 |
| 应付债券 | 62,265,473,497.68 | 21.39 | 67,309,198,769.40 | 25.60 | -7.49 | 应付次级债券规模减少 |
| 租赁负债 | 856,910,328.86 | 0.29 | 995,005,231.20 | 0.38 | -13.88 | 应付经营场所租赁款减少 |
| 递延所得税负债 | 20,179,387.19 | 0.01 | 19,031,249.53 | 0.01 | 6.03 | 应纳税暂时性差异增加 |
| 其他负债 | 1,936,286,692.04 | 0.67 | 1,919,456,597.00 | 0.73 | 0.88 | 主要是应付履约保证金增加 |

其他说明

1) 资产情况分析

截至报告期末，公司总资产 2,911.17 亿元，较上年末增加 281.46 亿元，增幅 10.70%。公司资产中，货币资金、结算备付金及存出保证金 893.40 亿元，较上年末增加 255.12 亿元，占总资产的 30.69%；各项金融投资及衍生金融资产 1,526.83 亿元，较上年末增加 22.51 亿元，占总资产的 52.45%；融出资金、买入返售金融资产及应收款 365.07 亿元，较上年末减少 19.34 亿元，占总资产的 12.54%；长期股权投资、固定资产及其他 125.88 亿元，较上年末增加 23.16 亿元，占总资产的 4.32%。报告期内，公司资产规模稳定，结构合理，流动性充足。

2) 负债情况分析

截至报告期末，公司总负债 2,308.86 亿元，较上年末增加 219.26 亿元，增幅 10.49%。扣除代理买卖证券款和代理承销证券款后，资产负债率为 73.13%，较上年末减少 2.62 个百分点。公司负债中，短期借款、应付短期融资款、拆入资金及卖出回购金融资产款 793.66 亿元，较上年末减少 12.50 亿元，占总负债的 34.37%；交易性金融负债和衍生金融负债 150.81 亿元，较上年末减少 1.93 亿元，占总负债的 6.53%；代理买卖证券款和代理承销证券款 669.89 亿元，较上年末增加 267.29 亿元，占总负债的 29.01%；应付债券 622.65 亿元，较上年末减少 50.44 亿元，占总负债的 26.97%；应付薪酬、税金及其他 71.85 亿元，较上年末增加 16.84 亿元，占总负债的 3.11%。

2. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

3. 其他说明

适用 不适用

(四) 行业经营性信息分析

√适用 □不适用

1、报告期内公司营业部、子公司新设和处置情况

(1) 向子公司增资情况

①报告期内，公司向全资子公司东证创投增资人民币 8 亿元，并已完成工商变更登记，至此东证创投注册资本由人民币 50 亿元变更为人民币 58 亿元。上述事宜已经公司总裁办公会议审议通过。（公告编号 2020-036）

②报告期内，公司向全资子公司东方金控增资人民币 5 亿元（按实际拨付增资款项时人民币兑港币汇率折算为港币 554,078,015.00 元），并已完成在香港公司注册处的股本信息变更，东方金控实缴股本由港币 22 亿元变更为港币 2,754,078,015.00 元。上述事宜已经公司总裁办公会议审议通过。（公告编号 2020-062）

(2) 公司新设证券营业部情况

报告期内，公司完成 9 家证券营业部的设立工作，公司证券营业部总数达到 177 家。新设营业部情况详见下表：

| 序号 | 营业部名称 | 地址 | 获得许可证日期 |
|----|-----------------------|---|------------------|
| 1 | 东方证券股份有限公司东营府前大街证券营业部 | 中国山东省东营市开发区府前大街 128 号华利国际金融广场 A 座 22 楼 | 2020 年 5 月 19 日 |
| 2 | 东方证券股份有限公司杭州市心北路证券营业部 | 中国浙江省杭州市萧山区宁围街道市心北路 2028、2030、2032 号, 东方至尊国际中心 1 幢 1001 室 | 2020 年 10 月 9 日 |
| 3 | 东方证券股份有限公司保定瑞祥大街证券营业部 | 中国河北省保定市莲池区瑞祥大街 1988 号云溪九城商业中心 9 号楼 | 2020 年 12 月 7 日 |
| 4 | 东方证券股份有限公司晋城红星东街证券营业部 | 中国山西省晋城市城区红星东街泰富新居 C 座底商 1、2 层 3 户 | 2020 年 12 月 8 日 |
| 5 | 东方证券股份有限公司运城河东东街证券营业部 | 中国山西省运城市盐湖区河东东街 195 号汇鑫大厦 1 楼 | 2020 年 12 月 9 日 |
| 6 | 东方证券股份有限公司大同御河西路证券营业部 | 中国山西省大同市平城区御河西路御锦源二期小区外围商铺 2384 号 | 2020 年 12 月 11 日 |
| 7 | 东方证券股份有限公司廊坊艺术大道证券营业部 | 中国河北省廊坊市广阳区艺术大道 409 号（孔雀汇景轩 28 幢 1 单元 1 层 101 号） | 2020 年 12 月 11 日 |
| 8 | 东方证券股份有限公司青岛延吉路证券营业部 | 中国山东省青岛市市北区延吉路 76 号 6 号楼 76-41 | 2020 年 12 月 16 日 |
| 9 | 东方证券股份有限公司温州汤家桥路证券营业部 | 中国浙江省温州市鹿城区南汇街道汤家桥路 439 号 | 2020 年 12 月 18 日 |

(3) 公司证券营业部迁址情况

①东方证券股份有限公司北京安苑路证券营业部同城迁址，营业部从中国北京市朝阳区安苑路小关北路 5 号迁至中国北京市朝阳区北辰东路 8 号院 27 号楼 2 层 202 号、203 号, 3 层 301 号，营业部名称变更为东方证券股份有限公司北京安立路证券营业部。

②东方证券股份有限公司沈阳惠工街证券营业部同城迁址，营业部从中国辽宁省沈阳市沈河区惠工街 167 号 CD 座 1-3 层迁至中国辽宁省沈阳市沈河区市府大路 423 号 2 门、3 门，营业部名称变更为东方证券股份有限公司沈阳市府大路证券营业部。

③东方证券股份有限公司郑州商务公园证券营业部同城迁址，营业部从中国河南省郑州市郑东新区商务中央公园 2 号 1 号楼 18 层 1801 号迁至中国河南省郑州市金水区黄河路 109 号院，营业部名称变更为东方证券股份有限公司郑州黄河路证券营业部。

④东方证券股份有限公司莆田荔城中大道证券营业部同城迁址，营业部从中国福建省莆田市城厢区龙桥街道荔城中大道 2299 号 1-3 楼迁至中国福建省莆田市荔城区镇海街道胜利北街 1102 号、1106 号 1-2 楼，营业部名称变更为东方证券股份有限公司莆田胜利北街证券营业部。

⑤东方证券股份有限公司拉萨金珠西路证券营业部同城迁址，营业部从中国西藏自治区拉萨市金珠西路 158 号迁至中国西藏自治区拉萨市金珠西路 123 号，营业部名称不变。

⑥东方证券股份有限公司上海闵行区古龙路证券营业部同城迁址，营业部从中国上海市闵行区古龙路 218 号迁至中国上海市徐汇区宜山路 700 号 85 幢 2 楼 201 单元，营业部名称变更为东方证券股份有限公司上海徐汇区宜山路证券营业部。

⑦东方证券股份有限公司上海浦东新区耀华路证券营业部同城迁址，营业部从中国上海市浦东新区耀华路 58 号 1 层、4-6 层迁至中国上海市浦东新区耀华路 488 号 1 楼 107 室、16 楼，营业部名称不变。

⑧东方证券股份有限公司南充文化路证券营业部同城迁址，营业部从中国四川省南充市顺庆区文化路 1 号宇豪酒店 5 楼 501 号迁至中国四川省南充市顺庆区红光路 83 号一层、三层，营业部名称变更为东方证券股份有限公司南充红光路证券营业部。

⑨东方证券股份有限公司上海长宁区遵义路证券营业部同城迁址，营业部从中国上海市长宁区遵义路 567 号迁至中国上海市长宁区遵义南路 88 号 101 室，营业部名称不变。

⑩东方证券股份有限公司上海浦东新区富特西三路证券营业部同城迁址，营业部从中国上海市浦东新区外高桥富特西三路 77 号 10 栋 936 室迁至中国上海市浦东新区启帆路 515 号南楼 B 座 1517 室，营业部名称变更为东方证券股份有限公司上海浦东新区启帆路证券营业部。

⑪东方证券股份有限公司上海青浦区华徐公路证券营业部同城迁址，营业部从中国上海市青浦区华徐公路 999 号迁至中国上海市闵行区苏虹路 29、33 号 109、206 室，营业部名称变更为东方证券股份有限公司上海闵行区苏虹路证券营业部。

⑫东方证券股份有限公司上海松江区沪亭北路证券营业部同城迁址，营业部从中国上海市松江区沪亭北路 199 弄 1 号 901-8 室、901-9 室、901-10 室迁至中国上海市松江区沪亭北路 199 弄 1 号 901-8 室、901-9 室、901-10 室、5 号 127 室，营业部名称不变。

⑬东方证券股份有限公司烟台迎春大街证券营业部同城迁址，营业部从中国山东省烟台市莱山区迎春大街 170 号金贸中心 18 层迁至中国山东省烟台市莱山区迎春大街 171 号内 102 号，营业部名称不变。

(4) 公司期货营业部迁址情况

① 上海东证期货有限公司上海新闻路营业部同城迁址，营业部从中国上海市静安区新闻路 1418 号 1 幢 407 室迁至中国（上海）自由贸易试验区福山路 458 号 1107 室，营业部名称变更为上海东证期货有限公司上海福山路营业部。

② 上海东证期货有限公司北京安苑路营业部同城迁址，营业部从中国北京市朝阳区小关北里 45 号世纪嘉园 5 号楼 6 层迁至中国北京市朝阳区北辰东路 8 号院 27 号楼 3 层 302、303 号，营业部名称变更为上海东证期货有限公司北京安立路营业部。

③ 上海东证期货有限公司广州营业部同城迁址，营业部从中国广东省广州市天河区体育西路 191 号中石化大厦 B 塔 2721、2722 房迁至中国广州市天河区天河北路 365 号之一 2304 房，营业部名称不变。

④ 上海东证期货有限公司东营营业部同城迁址，营业部从中国山东省东营市东营区府前大街 53 号 1 幢 902 室迁至中国山东省东营市东营区府前大街 53 号国贸大厦 1 幢 903 室，营业部名称不变。

⑤ 上海东证期货有限公司重庆营业部同城迁址，营业部从中国重庆市南岸区南坪西路 36 号嘉发中心写字楼 26-5 迁至中国重庆市江北区庆云路 2 号 4-3，营业部名称不变。

2、账户规范情况专项说明

公司严格按照中国证监会、中国证券登记结算有限公司关于账户管理相关要求推进账户管理工作，进一步完善健全账户规范管理的长效机制，并对已实施另库存放的不合格、小额休眠、风险处置休眠账户实施进一步的账户规范清理。2020 年年度公司各营业部共规范另库不合格资金账户 27 户、另库不合格证券账户 14 户；另库小额休眠资金账户激活 1,997 户、另库小额休眠证券账户激活 3,567 户；另库风险处置资金账户激活 33 户、另库风险处置证券账户激活 34 户。

截至报告期末，公司客户资金账户 2,335,603 户、证券账户共计 3,898,569 户，其中合格资金账户 1,841,366 户、证券账户 3,321,747 户；其中另库不合格资金账户 10,285 户、另库不合格证券账户 1,211 户；其中另库小额休眠资金账户 450,314 户、另库小额休眠证券账户 561,224 户；其中风险处置资金账户 33,638 户、证券账户 14,387 户。

3、创新业务开展情况及其风险控制情况

(1) 创新业务开展情况分析

公司始终重视创新业务，并将“创新收入占比”这一指标作为战略规划的一个重要指标。2020 年度，公司创新业务扎实深入开展，并取得了较好的成效：

1) 公司“创新收入占比”继续保持高位。经过多年培育，创新业务为公司培育了新的收入来源和利润增长点。2020 年，公司“创新收入占比”为 32.3%，指标持续达到战略规划的要求，也为公司全年业绩增长提供了强力支撑。

2) 创新业务为公司再获荣誉。2020 年度, 公司多项创新业务获奖, 为公司获得了荣誉, 如汇添富基金“长三角一体化 ETF——金融创新服务国家战略”获上海金融创新成果奖三等奖; 在上海市国资委组织的 2020 年度“金融服务实体经济”案例征集活动中, 公司 5 个项目成功入选; 在上海市金融业联合会组织的上海金融业改革发展优秀研究成果评选中, 一项获得三等奖, 两项获入围奖。在“2020 年上海市企业管理现代化创新成果”评审中, 公司有 3 项成果获得二等奖、2 项成果获得三等奖。

3) 创新业务资格更加完善。作为一家综合类证券公司, 公司各项业务资格与牌照齐全, 并在部分创新业务领域取得先发优势。2020 年度, 公司获得结售汇业务经营资格、科创板转融券等创新业务资格。创新业务资格更加完备, 为公司创新发展提供了更加广阔的空间。

(2) 针对业务创新的风险控制情况

随着公司发展战略的推进, 报告期内, 各项创新业务稳步发展。公司结合实际情况, 紧跟业务创新, 重点加强业务风险的审核, 主要采取了如下措施:

1) 组织架构方面, 风险管理总部加强与业务部门的沟通, 跟踪监控创新业务, 主动开展风险识别和评估工作, 由业务部门、分支机构及子公司作为第一道防线, 风险管理职能部门作为第二道防线, 风险监督管理部门作为第三道防线, 共同防范业务风险。

2) 管理流程方面, 公司进一步完善创新业务的风险管理同步机制, 密切跟进公司各项创新业务的合规与风险管理相关工作, 建立创新业务评估审查机制, 跟进创新业务所涉及的框架设计、创新申报、业务开展等全过程。

3) 风险识别与评估方面, 公司切实履行创新产品风险审查职责, 对场外期权、内嵌期权的收益凭证等产品中的期权定价、对冲策略以及回测结果做出独立的专业风险审查意见, 同时不断完善压力测试机制, 有力保证复杂金融衍生产品业务的顺利开展。

4) 风险报告方面, 公司将创新业务的风险计量与开展情况纳入全面风险管理报告体系, 认真总结创新业务的风险管理经验。

5) 系统建设方面, 公司将创新业务纳入全面风险管理系统建设, 公司创新业务稳健开展, 风险可测可控可承受。

4、公司风险控制指标和净资本补足机制建立情况

(1) 风险控制指标动态监控机制的建立情况

公司根据监管要求和自身风险管理的需要, 建立健全了风险控制指标监控、预警和报告机制, 有效保障在风险可测、可控、可承受前提下开展各项业务。同时根据市场、业务发展、技术、监管环境的变化持续优化风险控制指标体系, 完善动态监控系统, 使之能够同步覆盖公司开展的各项业务活动。2020年初, 证监会发布《证券公司风险控制指标计算标准规定》(2020年修订), 于6月1日正式施行, 公司及时制定新旧规过渡方案并有序实施, 提前完成动态监控系统的升级改建等新规配套落地工作, 持续保障风险控制指标报送的及时性和准确性。同时, 测算评估新规对

各项业务的潜在影响并适度调整业务结构，确保各项风控指标的平稳过渡。

公司设有各业务条线和总量指标的风险监控岗，岗位分工明确、职责清晰，以各项业务监控系统和风险控制指标动态监控系统为工作平台，对相关风险控制指标的异动、触警等情况进行动态监控和预警，定期和不定期编写风险管理报告，并跟踪所涉及风险事项的整改落实。

（2）资本补足机制

公司根据监管部门的风控要求及自身的风险承受能力，建立了资本补足机制，对各项业务的规模、结构进行动态调整，同时根据业务发展需要适时补充或提高净资本。

公司每年初制订资产负债配置计划及风险偏好和限额方案，风险管理部门等相关职能部门负责对风险控制指标进行监测和报告，一旦发生有风险控制指标触及预警标准的情况，公司将根据预警级别采取相应风险处置措施，包括严格控制风险资本消耗较高的投资品种或业务规模、调整金融资产投资结构、利用风险对冲工具降低风险敞口等方式，以及通过发行长期次级债等多种融资渠道及时补足净资本。

（3）压力测试机制的建立情况

公司建立了压力测试机制，确保在压力情景下风险可测、可控、可承受，保障公司可持续经营。公司在制度中明确，在重大对外投资或收购、重大对外担保、重大固定资产投资、利润分配或其他资本性支出、证券公司分类评价结果负向调整、负债集中到期或赎回等可能导致净资本和流动性等风险控制指标发生明显不利变化或接近预警线、确定重大业务规模、开展重大创新业务等情况时需开展专项或综合压力测试，并根据分析测试结果提出业务规模调整等相关建议，为管理层决策提供依据。

报告期内，依据中国证券业协会《证券公司压力测试指引》的要求，从组织保障、制度建设和系统支持等多方面入手，结合市场环境变化和公司业务发展情况，不断优化压力测试机制。全年多次实施综合压力测试和专项压力测试，提高公司应对极端情况和事件的能力。综合压力测试的对象包括但不限于净资本和流动性等风险控制指标和整体财务指标；专项压力测试的对象根据专项压力测试的目的予以选择。

（4）报告期内风险控制指标达标情况

报告期内，公司净资本与流动性相关的主要风险控制指标持续符合《证券公司风险控制指标管理办法》及其配套规则所规定的监管标准，且具备一定的安全边际。

5、融资情况说明

（1）公司融资渠道

从融资方式来看，公司通常使用的融资渠道有股权融资和债权融资两种方式；从融资期限来看，公司通常通过资金拆借、债券回购和发行短期融资券、短期收益凭证、短期收益权融资、转融通融入资金等方式，解决短期的资金需求；通过发行或借入长期次级债、发行公司债券、发行长期收益凭证、长期收益权融资、股权融资等方式，解决中长期的资金需求。

(2) 融资能力分析

公司规范经营，信誉良好，具备较强的融资能力和偿付能力，与各大金融机构保持良好的合作关系，可以采取各类经主管部门注册、批准或报备的方式进行融资。

报告期内，公司尝试了多种形式的债权融资，包括信用拆借、债券回购、收益凭证、短期融资券、次级债券、公司债券。公司各项债务融资工具发行的具体情况详见本报告“第六节、二、证券发行与上市情况”。

(3) 公司负债结构

参见“第四节、二、（三）资产、负债情况分析”。

(4) 公司为维护流动性水平所采取的措施和相关管理政策

公司一贯坚持资金的统一管理和运作，持续加强资金管理体系的建设，统一管理公司的资金调配。同时，根据可变现能力分层配置流动性资产储备，不断提升公司抗击各种流动性冲击的能力。

公司严格执行资金集中管理和集体决策流程，资金管理总部作为流动性风险的职能部门，负责自有资金的计划、融资、调度、投资和定价等，在防范流动性风险的前提下优化公司资金使用的效率和收益。

报告期内，公司积极拓展各类长短期融资渠道，强化对负债的管理，提高表内外负债品种、期限、融资市场、交易对手和融资抵押品等的分散化程度。公司不断优化债务结构，满足日常运营所需资金，降低融资成本。公司重视与各大商业银行等融资对手方保持良好的合作关系，有充足的银行授信额度，具备较强的短期和中长期融资能力。

公司不断完善流动性风险管理监测体系，从风险敞口、现金流等方面着手强化监测手段，提高日常监测有效性，实现流动性风险覆盖率、净稳定资金率前置性管理。着重加强日间流动性风险管理，确保具有充足的日间流动性头寸，满足正常及压力情景下的支付结算需求。报告期内，公司维持较充足的流动性资产储备，流动性风险监管指标持续符合规定。

(五) 投资状况分析

1、 对外股权投资总体分析

适用 不适用

报告期末，集团长期股权投资 57.71 亿元，较上年末增加 13.17 亿元，增幅 29.58%。主要变动原因为：报告期内子公司对外投资净增加 5.40 亿元，联营企业宣告发放的现金股利或利润 4.70 亿元，权益法下确认的投资收益及其他收益变动 12.47 亿元。子公司投资参见“第十一节、七、（十七）长期股权投资”。

(1) 重大的股权投资
 适用 不适用

单位：万元 币种：人民币

| 所持对象名称 | 占该公司 股权比例 | 年末账面价值 | 本年损益 | 本年所有者 权益变动 |
|---------------|--------------|------------|-----------|---------------|
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 35.412% | 258,581.01 | 90,585.74 | -835.70 |

注：本年损益指该项投资对报告期公司净利润的影响。

本年所有者权益变动不包括报告期损益的影响。

(2) 重大的非股权投资
 适用 不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产
 适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 年末投资成本 | 年末账面价值 | 本年购入或 出售的净额 | 本年公允价值变动 | 本年投资收益 |
|------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|
| 1、交易性金融资产 | 70,250,421,733.94 | 72,701,117,042.70 | 4,560,052,296.72 | 1,363,919,737.85 | 4,062,516,546.28 |
| 2、其他债权投资 | 61,340,029,273.03 | 62,645,974,916.84 | -1,581,881,879.92 | -702,533,409.86 | 363,353,690.57 |
| 3、其他权益工具投资 | 11,229,618,178.63 | 10,936,457,571.84 | 129,768,598.70 | -26,184,180.52 | 284,614,545.85 |
| 4、衍生金融工具 | -181,325,775.97 | -349,080,226.72 | 2,299,010,736.26 | -315,035,880.01 | -813,615,723.55 |

(六) 重大资产和股权出售
 适用 不适用

(七) 主要控股参股公司分析
 适用 不适用

(1) 上海东证期货有限公司，注册资本人民币 23 亿元，公司持有 100% 的股权。截至 2020 年 12 月 31 日，上海东证期货有限公司总资产人民币 4,515,893.95 万元，净资产人民币 334,814.25 万元；2020 年实现营业收入人民币 958,352.92 万元，净利润人民币 19,179.36 万元。

主营业务：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理，基金销售。

(2) 上海东方证券资本投资有限公司，注册资本人民币 40 亿元，公司持有 100% 的股权。截至 2020 年 12 月 31 日，上海东方证券资本投资有限公司总资产人民币 497,577.38 万元，净资产人民币 480,069.56 万元；2020 年实现营业收入（主营业务收入）人民币 61,497.68 万元，主营业务利润人民币 41,443.26 万元，净利润人民币 36,064.53 万元。

主营业务：设立直投资基金，对企业进行股权投资，或投资于与股权投资相关的其他投资基金；为客户提供与股权投资相关的财务顾问服务；经中国证监会认证可开展的其他业务。

(3) **上海东方证券资产管理有限公司**，注册资本人民币 3 亿元，公司持有 100%的股权。截至 2020 年 12 月 31 日，上海东方证券资产管理有限公司总资产人民币 431,793.54 万元，净资产人民币 252,451.57 万元；2020 年实现营业收入（主营业务收入）人民币 286,157.15 万元，主营业务利润人民币 101,775.36 万元，净利润人民币 80,992.37 万元。

主营业务：证券资产管理业务、公开募集证券投资基金管理业务。

(4) **东方证券承销保荐有限公司**，注册资本人民币 8 亿元，公司持有 100%的股权。截至 2020 年 12 月 31 日，东方证券承销保荐有限公司总资产人民币 259,919.08 万元，净资产人民币 155,108.32 万元；2020 年实现营业收入人民币 103,617.57 万元，净利润人民币 7,940.23 万元。

主营业务：证券（不含国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企业债务融资工具））承销与保荐；中国证监会批准的其他业务。

(5) **上海东方证券创新投资有限公司**，注册资本人民币 58 亿元，公司持有 100%股权。截至 2020 年 12 月 31 日，上海东方证券创新投资有限公司总资产人民币 638,798.80 万元，净资产人民币 605,672.74 万元；2020 年实现营业收入人民币 36,169.40 万元，净利润人民币 20,613.62 万元。

主营业务：创业投资，金融产品投资，投资管理和投资咨询。

(6) **东方金融控股（香港）有限公司**，注册资本港币 27.54 亿元，公司持有 100%的股权。截至 2020 年 12 月 31 日，东方金融控股（香港）有限公司总资产港币 1,898,056.98 万元，净资产港币 251,982.69 万元；2020 年实现营业收入港币 53,328.11 万元，净利润港币 23,481.38 万元。

主营业务：投资控股，通过设立不同子（孙）公司分别经营由香港证监会按照《证券及期货条例》规管的经纪业务、企业融资和资产管理等业务。

(7) **汇添富基金管理股份有限公司**，注册资本人民币 13,272.4224 万元，公司持有 35.412%的股权。截至 2020 年 12 月 31 日，汇添富基金管理股份有限公司总资产人民币 1,098,006.71 万元，净资产人民币 744,898.99 万元；2020 年实现营业收入（主营业务收入）人民币 664,303.76 万元，主营业务利润人民币 332,123.85 万元，净利润人民币 256,638.28 万元。

主营业务：基金募集，基金销售，资产管理，经中国证监会许可的其他业务。

(八) 公司募集资金情况

经中国证监会核准，公司于 2016 年 7 月 8 日于香港联交所发行境外上市外资股(H 股)股票，并于 2016 年 8 月 3 日行使超额配售权。H 股募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审验，并出具德师报(验)字(16)第 1082 号验资报告。根据验资报告内容，公司本次公开发行境外上市外资股(H 股)933,709,090 股，售股股东已出售 93,370,910 股 H 股，共计 1,027,080,000 股，每股面值为人民币 1 元，每股 H 股为港币 8.15 元，以港币现金缴纳，共计港币 8,370,702,000.00

元，在扣除交易费及其他费用总计港币 145,045,025.30 元后，港币 8,225,656,974.70 元已存入 H 股募集资金账户，以实际资金划至上述账户日中国人民银行公布的港币兑人民币汇率中间价折合人民币 7,083,154,510.65 元(包含已取得的利息收入)。此等募集资金在扣除划转给社保基金会的募集款及其他发行费用后，公司 H 股募集资金净额为港币 7,417,133,357.56 元。

截至报告期末，公司 H 股募集资金使用情况如下：港币 25.60 亿元用于进一步发展公司经纪及证券金融业务，港币 22.25 亿元用于发展公司的境外业务，港币 10.97 亿元用于扩大公司投资管理业务，港币 7.32 亿元用于发展公司证券销售及交易业务，港币 2.40 亿元用于资本性支出，港币 4.16 亿元用于营运资金及其他；公司累计使用 H 股募集资金港币 72.70 亿元。除上述资金使用外，公司所募款项剩余资金约港币 1.54 亿元(含募集资金利息及汇兑损益)尚未使用，公司将于未来三年内根据公司发展战略和实际使用需求将剩余募集资金用于资本性支出。(已使用人民币 H 股募集资金汇率按实际结汇汇率计算，未使用人民币 H 股募集资金汇率按照期末汇率计算。)

截至报告期末，公司上述募集资金计划投向与招股说明书、相关公告及通函披露的内容一致，没有发生变更。公司将根据实际业务需求，本着股东利益最大化的原则，在合理的时间安排使用。

(九) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

对于结构化主体是否纳入合并范围，公司综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报或承担的风险敞口等因素，认定将 24 个结构化主体纳入合并报表范围。本年新增 8 个结构化主体纳入合并报表范围。

本期纳入合并范围的结构化主体情况如下：

单位：元 币种：人民币

| 纳入合并范围的结构化主体 | 本年末或本年 |
|--------------|------------------|
| 资产总额 | 8,128,768,200.92 |
| 负债总额 | 760,871,460.62 |
| 净资产总额 | 7,367,896,740.30 |
| 营业收入 | 114,105,519.79 |
| 净利润 | 62,684,315.25 |

三、公司关于公司未来发展的讨论与分析

(一) 行业格局和趋势

√适用 □不适用

集中度提升

金融业是资本密集型行业，素有“大而不倒”的说法，头部机构具有较强的竞争优势及抗风险能力，同时也能显著增强对客户资源、优秀人才、优质资金的吸引力。国内证券行业近年来集中度明显提升，竞争越来越激烈，头部效应越来越强，未来，中国市场份额将持续向领先大型券商集中。从监管导向来看，监管层明确提出积极推动打造航母级证券公司，支持行业做优做强，

提高行业国际竞争力。头部券商在牌照获取、新业务准入、资本扩充、人才吸引、品牌打造等方面将获得更多监管支持，做大做强、争创一流将成为大中型券商的主赛道。

差异化发展

证券公司即将进入精细分类阶段，需要根据自身的资源禀赋明确战略定位、选取差异化的发展路径，未来或出现“大型全能券商+特色精品券商”错位竞争、互补发展的行业格局。优质头部券商人才储备充足、风控能力领先，具备“大格局”、“大视野”，将在各条业务线上保持领先态势，当好领头羊，做好排头兵。中小券商资源有限，面对不断加大的数字化系统和风控合规投入，对所有业务投入扩张的“小而全”模式无以为继，必须坚持差异化、专业化、特色化发展，通过业务聚焦、客户聚焦、区域聚焦、渠道聚焦等发展策略，做出特色、做出强项、做出专长、做出精品。

综合金融服务

机构投资者将成为资本市场主力军，机构投资者的发展壮大将重塑资本市场结构，机构投资者综合化、多元化的综合金融服务需求显著增加，对证券公司业务专业度和产品服务的丰富多样性提出了更高要求，领先大型券商凭借资本实力、服务能力和机构客户基础，在发力机构交易服务业务的转型过程中占据先机。同时，客户专业能力、议价能力持续提升，客户资源的竞争必将日趋白热化，真正打破牌照分割的壁垒、构建以客户为中心的服务体系，依托多元化的产品和服务，将综合金融服务覆盖客户的全生命周期，将成为现代投资银行构建差异化竞争优势、取得行业领先地位的核心基石之一。

金融科技赋能

基于移动互联网和人工智能的金融科技，不断地塑造证券行业发展的基础和格局。金融科技从服务业务向引领业务和赋能业务转变，基于大数据分析为客户匹配更精准的产品和服务，实现存量挖潜和增量获客，快速响应客户需求，大幅度改造和提升客户体验；利用数字化渠道改善与企业、机构客户的联系和互动方式，改变交易模式，提升投资决策、风险定价、产品设计的智能化水平，催生财富管理的新业态，引导行业从传统的通道收费型模式向注重专业服务、深化客户关系和利用网络服务等多元化模式转化。金融科技也将助力证券行业中后台的集约化、智能化运营，成为部分券商实现弯道超车的转型机会，用科技和互联网思维打破原有金融流程，使科技元素逐步注入经营发展全流程、全流域，并以此打造新的护城河。

国际化布局

从政策层面看，以证券业放开外资限制为标志的资本市场对外开放，外资控股券商批量设立，将在证券行业引发“鲑鱼效应”。国内券商将会直面外资从服务理念、商业模式到服务体系和产品体系的全面竞争，但外资也会带来整个市场理念和风格的转变，带来新的商业模式，推动行业结构优化调整，在专业化道路上越走越远。从市场层面看，随着资本市场国际化进程加快，境内投资者跨境配置资产和全球财富管理需求日益旺盛，境外投资者对中国资本市场的参与度提升、在中国的投融资需求大幅增长。市场和客户的国际化发展将推动证券公司国际化进程大大加速，为满

足客户全球综合金融服务需求，证券公司的发展格局逐渐从以境内为主转向境内外联动发展，积极拓展跨境业务，各项业务的跨境一体化联动发展也将日益深入。

(二) 公司发展战略

适用 不适用

2021年是公司2021-2024年战略规划实施的开局之年。根据公司新战略规划，公司以“为实体经济、社会财富管理提供优质综合金融服务；为员工创造美好生活；为股东、员工、社会实现物质与精神的双重回报”为使命，以“成为具有国内一流核心竞争力，为客户提供综合金融服务的现代投资银行”为愿景，坚持“客户至上、以人为本、专业服务、开拓创新”的核心价值观，秉承“团结、进取、务实、高效”的企业精神，努力实现新一轮战略发展目标。

公司2021-2024年规划期发展的战略目标是：坚持一流现代投资银行的专业化、高质量发展，努力提升核心竞争力，在规模实力和经营效益上力争接近行业第一梯队水平，为资本市场改革发展和上海国际金融中心建设贡献更大力量。并将业务转型有效推进、客户数量和质量显著提升、经营效益不断提升、数字化转型加快、人才队伍年轻化和专业化、合规与风险管理有效等作为具体目标。

围绕以上战略目标，公司将“以数字化、集团化、国际化为动力，推动高质量发展”作为战略驱动，将“聚焦三大客户体系，构建四大业务集群，提升六大管理效能，系统部署，重点突破”作为总体战略框架。规划期内，以客户为中心，重构聚焦三类客户的服务体系；以综合金融服务为导向，构建四大业务集群；以提升管理效能为目标，完善六大管理支持体系。通过以上措施，积极推进公司新一轮战略目标的实现。

(三) 经营计划

适用 不适用

2021年，公司将继续秉持“稳增长、控风险，促改革”的经营策略，围绕“两提升”提升投行业务行业地位、提速财富管理转型发展，“两稳固”稳固资产管理优势地位、巩固自营投资业绩回报，“一突破”深化业务和科技的融合，加快数字化转型突破，寻求资本补充、推进机制改革、深化人才战略、全面风险管理、金融科技赋能，提升ROE水平和经营管理水平。

公司认真贯彻党的十九届五中全会精神，践行行业文化建设新要求，提升公司社会责任品牌影响力；继续加快股权质押风险资产处置进度，稳步推进风险资产出清工作；加快市场化改革步伐，优化经营班子市场化考核机制，优化绩效管理体系，完善公司治理机制，提高决策效率；抓住市场机遇补充资本，提高公司资本实力，加强公司流动性管理，优化资产负债配置，提高净资本使用效能；资产管理业务抓住市场投资风格机构化的机遇，稳固行业位置，发挥品牌辐射效应，积极开展集团协同，带动其他业务发展；大自营业务优化资产配置结构，科学规划资产配置；投行业务借助资本市场深化改革、注册制的大机遇下，牵引集团其他业务联动，实现集团化发展；以机构交易服务为抓手，探索实践机构客户的综合金融服务模式，提速财富管理转型。

(四) 可能面对的风险（包括落实全面风险管理以及合规风控、信息技术投入情况）

√适用 □不适用

1、公司面临的主要风险及应对措施

公司业务经营活动面临的风险主要有：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、洗钱及恐怖融资风险及声誉风险等，具体来讲，主要表现及应对措施如下：

(1) 市场风险

市场风险是指公司持有的组合因市场的不利变动而导致损失的风险。市场风险可分为证券资产价格风险、利率风险、汇率风险和商品价格风险等，分别是指由证券资产价格、利率、汇率和商品价格等波动给公司带来的风险。

公司建立覆盖全集团的资产负债配置及风险限额体系，反映公司整体市场风险偏好和风险承受能力。在公司整体业务授权框架下，各项业务实行分层级的风险限额授权，对各项业务及产品实施有效控制，确保风险水平在公司设定的风险偏好之内。公司各业务部门、各分支机构、各子公司是市场风险管理的第一道防线，公司风险管理职能部门负责统筹公司的市场风险管理工作。

公司运用逐日盯市、集中度分析及定量风险模型对业务规模、风险敞口等进行管理，建立动态止损机制，通过敏感性分析寻找影响投资组合收益的关键因素，并通过情景分析、压力测试等方法评估投资组合对于极端市场波动的承受能力。

公司密切关注宏观经济指标和趋势，重大经济政策动向，评估宏观因素变化可能给投资带来的系统性风险，定期监测市场风险控制指标，对投资策略进行调整，建立重大事项处置决策、执行及责任机构，制定各种可预期极端情况下的应急预案，并根据严重程度对重大事项进行分级和管理。

① 证券资产价格风险

公司具有传统优势的权益类自营业务投资规模相对较大，由于其盈利及风险状况与市场景气程度高度相关，因此公司的市场风险主要集中于此。

2020年，全球遭受新冠肺炎疫情冲击，世界经济陷入深度衰退。中国政府率先出击，持续统筹疫情防控和经济社会发展，使得疫情防控工作在最短的时间内取得重大战略成果，同时有序推进企业复工复产，使用灵活适度的货币政策支持实体经济，并持续推动扩大内需和对外开放，使得中国成为2020年唯一实现经济正增长的国家。在此背景下，上证综指年末收盘于3473.07点，较上年同期的3050.12点上涨13.87%，深证成指涨幅为38.73%。

为监控市场变化情况对权益类证券价值的影响，公司每日跟踪持仓变化情况，通过实施多元化投资策略，适时调整仓位，并运用股指期货、股票期权等权益类衍生工具进行对冲，控制市场风险敞口；同时，公司通过对行业和单票的分散投资，加大对投资集中度风险的控制。

此外，公司审慎控制各类复杂金融衍生品业务规模，严格执行场外期权等高风险衍生品的产品定价、对冲策略和回测结果的模型风险审查工作流程，严控市场风险。公司衍生品业务主要以

低风险套利业务为主，因此面对的市场风险暴露相对较小。

②利率风险

公司资产中有关利率风险的部分主要包括债券投资和货币性存款等相对低风险业务。

2020年，面对新冠疫情带来的经济断崖式下行，全球掀起降息潮，主要经济体施行超常规的宽松货币政策。央行通过下调存款准备金率、不断调整MLF和LPR利率等措施，维持流动性合理充裕。随着国内疫情逐步得到有效控制，结构性存款监管套利问题加剧，货币政策开始回归常态，再加上年末信用债违约事件高发影响，使得全年收益率先降后升，全年呈“V”形走势且波动幅度较大。公司债券持仓规模与上年基本持平，公司占总持仓市值80.74%的券种集中分布于久期0年至5年的区间内。债券组合加权平均久期由上一年末的3.26年增加至3.38年；截至报告期末，基点价值为人民币2,957.97万元左右，较上一年末有所减少。

基于对利率及债券市场的分析判断，公司固定收益类证券自营业务投资规模平稳上升，投资组合久期控制有力，整体资产受利率波动变化影响较小。同时，使用利率互换、国债期货等投资品种，对冲可能的利率风险。

③汇率风险

2020年，全球经济衰退，主要经济体货币政策不断，外汇波动增加，前半年离岸人民币兑美元汇率先是跌破7.17，后半年人民币持续走强升至6.50关口。公司境外业务扩展，外币债券发行规模增加，整体汇率风险逐步显现。

公司加强了对外汇市场的研究，跟踪境外资产价格变动，监控汇率风险敞口，并通过合理利用汇率类衍生品进行对冲、缓释，有效管理汇率风险。

④风险价值

风险价值（VaR）是在一定置信水平下，持仓投资组合在未来某一段时间内由于市场价格变动导致的可能损失。公司采用置信区间95%、持有期1天的VaR来衡量公司金融产品投资组合的市场风险状况。2020年，公司权益类投资组合的VaR值因市场环境及持仓配置等因素呈现出一定程度的波动。截至报告期末，公司总体市场风险在95%置信区间下VaR为人民币1.43亿元。

（2）信用风险

信用风险主要指债务人或交易对手未能履行合同所规定的义务或信用质量发生变化，给公司造成损失的可能性。一是直接信用风险，即由于发行人未能履行约定契约中的义务而造成的风险；二是交易对手风险，即在衍生品交易或证券融资交易中由于交易对手方及融资方违约造成的风险；三是结算风险，即在交易的清算交收过程中的违约行为，简言之是公司履行交付行为而交易对手方违约。

公司围绕净资本管理与风险承受度，分层次、分模块，统筹管理规模、交易对手、风险敞口等风控指标，从品种、模型、对冲等角度出发，对信用风险敞口进行精细化管理，有效控制信用风险。

从业务实践角度，公司建立了针对债券发行主体、交易对手方、融资类业务客户的信用风险

管理体系，加强了对其资质和风险的评估工作，通过合同审查、交易及舆情监控等形式进行信用风险管理，重点关注交易过程中的可能违约环节，制定风险处置应急预案。在债券投资及信用风险相关的交易对手业务中，加强对债务发行主体及交易对手的基本面分析，相应地建立了公司信用风险内部评级体系，并通过信用风险管理系统实现了内部评级、统一授信管理、投资品集中度管理、质押债券管理、违约客户管理、压力测试、监控预警及风险报告等功能，加强信用风险管控，提升信用风险管理能力；在衍生品交易中，公司对交易对手设定保证金比例和交易规则限制，通过每日盯市、追保、强制平仓等手段来控制交易对手的信用风险敞口；在证券金融业务中，建立了客户的信用等级评定、授信管理、担保品管理、监控报告等机制，并通过强制平仓机制、司法途径等处置风险项目。

（3）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司依照《证券公司流动性风险管理指引》等监管规定和自身风险管理需要，持续完善流动性风险管理系统和内部管理制度体系，设置专岗负责对公司流动性风险进行动态监控、预警、分析和报告。在日常流动性头寸管理方面，储备充足的优质流动性资产，每日进行现金流缺口监测，保障公司业务的顺利开展和到期负债的顺利偿付。公司每年年初审慎确定流动性风险偏好的定性原则和定量指标，并建立了不定期调整机制，对流动性风险实施限额管理，并实施限额执行情况的监测与报告。定期进行流动性压力测试和应急演练，不断更新和完善应急处理方案。报告期内，结合《证券公司风险控制指标计算标准规定》要求升级完善流动性风险管理系统，调整流动性风险控制指标的计量口径，通过信息系统对流动性风险实施有效的识别、计量、监测和控制，保障公司流动性覆盖率、净稳定资金率持续满足监管要求。报告期内公司加强子公司流动性风险统筹力度，提高子公司的流动性风险管理能力并探索建立集团间的流动性风险管理体系。

（4）操作风险

操作风险是指由不完善或有问题的内部程序、员工和信息科技系统，以及外部事件所造成损失的风险。

操作风险管理层面，公司已在内控流程基础上细化梳理了操作流程，识别了流程中的操作风险，并按照管理需要对风险进行了分类管理；根据风险的影响程度和发生可能性等建立操作风险评估模型，对识别的操作风险进行分析计量并进行等级评价，确定重点关注和优先控制的风险；建立关键风险指标监测机制，实现对重点关注操作风险的量化监测管理；建立了操作风险损失事件上报机制，实现公司内部操作风险事件上报及行业操作风险事件收集管理；完成开发操作风险管理系统，实现对操作风险的识别、评估、监测、计量和报告等管理。公司已完成子公司的操作风险管理实施工作，与母公司保持集团化协同。

（5）洗钱及恐怖融资风险

洗钱风险是指金融机构的产品或服务被不法分子利用从事洗钱活动，进而对公司在法律、声

誉、合规和经营等方面造成不利影响的风险。

为有效落实中国人民银行《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》的各项要求，2020年1月，公司董事会审议通过《东方证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法》，明确了董事会、监事会、经营层、业务部门及职能管理部门的反洗钱职责，提出公司洗钱风险管理的目标、洗钱风险管理文化建设目标、洗钱风险管理原则、策略和程序等，在集团层面开展洗钱风险统一管理工作。公司持续进行反洗钱客户信息治理工作，不断优化完善反洗钱系统功能，开展反洗钱宣传培训，自发主动地评估洗钱风险。公司经过认真评选，外聘第三方咨询机构开展集团层面的洗钱风险评估和差距分析工作。面对反洗钱标准不断提高、处罚日益严格的监管环境，公司还进一步加强了人员配备和系统建设投入，提高了反洗钱工作水平和效率。

（6）声誉风险

声誉风险主要是指公司经营、管理及其他行为或外部事件导致对公司声誉产生负面评价的风险。

报告期内，公司未面临影响公司声誉的重大舆情事件，个别敏感事件也得到高效妥善处理。公司的声誉风险的管理主要是：

1、进一步加强舆情监测，对主要搜索引擎、近300家主流媒体、1000余家主流财经及地方都市网站、1500余家主流财经微博、近300家主流财经微信公众号以及10余家境外媒体进行全方位、全天候7*24小时监测，及时了解公司舆情环境，为有效预防声誉风险打下坚实基础。

2、在OA内网上线声誉风险事件报备流程，进一步完善敏感舆情报备制度。

3、升级完善声誉风险舆情月报，增加了公司主动传播内容、负面舆情管理情况、同业舆情对比及解读等，以便更为全面的了解公司所面临的舆论环境，为做好声誉风险管理打下坚实的基础。

4、为增强全员声誉风险意识，在全公司完成了一次关于声誉风险管理的全员培训，效果良好。

2、公司全面落实风险管理情况

公司始终贯彻“全员合规，风控为本”的风险管理理念，着力实现风险管理、合规管理与内部控制三者间的有机融合与衔接，构建了较为完善的、内生性的全面风险管理体系和有效的内部控制机制，并贯穿于决策、执行、监督、反馈等各个环节，切实保障了公司总体风险可测可控可承受。

公司建立了清晰合理的风险管理组织架构。公司构筑了由各业务部门、分支机构及子公司，相关职能管理部门以及风险监督管理部门组成的严密有效的全面风险管理“三道防线”，明确了董事会、监事会、经营层及各子公司、各职能部门等的职责分工，保障风险管理体系有效运行。

公司高度重视风险管理制度体系建设。公司以《东方证券全面风险管理基本制度》为基础，制订了市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、声誉风险等在内的专项风险管理制度，在各项业务类制度中明确风险管理要求，通过制订操作规范及细则保障各项风险管理要求的具体落地。同时，为科学引导和合理配置公司资源，公司每年根据市场情况、公司战略及行业发展情况，编制资产负债配置、风险限额方案，结合动态调整机制以适应公司业务发展。

公司建立了风险识别与评估、风险监测与计量、风险分析与应对的风险管理机制，采取定性和定量相结合的风险计量方法，提升对各类风险的专业化管理能力。通过搭建风险管理驾驶舱、全面风险管理系统、风控指标动态管理系统和各类专项风险管理信息系统，不断推进风险管理工作中信息技术的实践应用。贯彻全面风险管理多视角的风险审查机制，对开展的各项新业务、新产品进行严格审核，对日常业务运行中的各重要风险环节进行动态监控。通过敏感性分析及压力测试，动态监测、评估公司经营过程中的各类别风险状况及风险承受能力。通过多种途径加强风险应对机制建设和风险抵御能力，着力风险应对与处置工作的预判性，有效管控各类风险。建立畅通的风险信息沟通机制，确保相关信息传递与反馈的及时、准确、完整。

结合行业文化建设的要求，加强风险管理文化与公司企业文化、党建廉政建设的联动作用，通过多途径夯实公司全体员工的风险管理意识，提升风险管理水平。公司持续加大对风险管理人员的培养和引进力度，风险管理数量持续满足监管要求。公司坚持将风险管理工作与绩效考核、责任追究机制有机结合，明确绩效考核标准，有力保障公司各项业务的开展符合监管要求。

3、公司合规风控及信息技术投入情况

公司高度重视合规风控管理信息系统建设，构建主动有效的全面风险管理体系，持续完善合规风险制度建设，不断提升合规风险管理水平，搭建集团化合规和风险管理体系，保障经营业务的合法合规。公司合规风控投入主要包括合规风控相关系统购置和开发支出、合规风控部门日常运营费用以及合规风控人员投入等。报告期内，公司合规风控投入总额为人民币20,596.32万元。

公司投入大量资源提升公司信息技术、以提供安全、稳定及个性化的服务，为公司的业务发展保驾护航。公司的信息技术投入（按照证券公司信息系统建设投入指标统计口径）主要包括：IT投入固定资产和无形资产的折旧摊销费用、IT日常运营费用、机房租赁或折旧费用、IT线路租赁、IT自主研发费用以及IT人员投入等。报告期内，公司信息技术投入总额为人民币53,566.12万元。

(五)其他

适用 不适用

1、公司董事、监事及高管情况

报告期内公司董事、监事及高管的构成、变动详情以及简历详情请参见本报告“第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况”。

2、优先认购权安排

根据中国法律及《公司章程》的规定，公司股东并无优先认股权。

3、公众持股量的充足性

于本年报付印前之最后可行日期，根据已公开资料以及就董事所知悉，董事相信公司的公众持股量符合《香港上市规则》第8.08条及香港联交所豁免的对公众持股比例的要求。

4、董事在与本公司构成竞争的业务所占之权益

公司非执行董事陈斌先生（已于 2020 年 3 月离任）自 2014 年 12 月起至 2020 年 3 月止担任海通证券股份有限公司的非执行董事，公司非执行董事周东辉先生自 2020 年 6 月起至今担任海通证券股份有限公司的非执行董事，公司非执行董事许建国先生（已于 2021 年 3 月离任）自 2016 年 10 月起至今担任海通证券股份有限公司的非执行董事。由于海通证券股份有限公司的经营范围包括证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券自营、融资融券、证券承销、证券投资基金代销、股票期权做市等，海通证券股份有限公司已经或可能与公司某些业务直接或间接构成竞争。除此以外，公司无其他任何董事在与公司直接或间接构成或可能构成竞争的业务中有任何权益。

5、董事、监事服务合约

公司所有董事和监事，均未与公司或公司附属公司订立任何在一年内不能终止，或除法定补偿外还须支付任何补偿方可终止的服务合约。

6、董事、监事在重大交易、安排及合约中的权益

公司或附属公司均未订立任何令公司董事或监事或董事或监事有关连的实体于报告期内直接或间接享有重大权益的重大交易、安排或合约。

7、购股权计划

公司没有设置购股权计划。

8、主要客户及供应商

公司为多个行业中的各类机构和个人客户提供服务。公司的客户包括大型国有企业、跨国企业、中小企业、高净值客户和零售客户，主要客户位于中国。日臻完善的海外网络布局，将有利于公司开展境外服务，拓展客户来源。2020 年，公司前五大客户产生的收入占集团总收入的比例不超过 5%。

鉴于公司业务性质，公司无主要供应商。

9、与员工、客户及供货商及有重要关系人士的关系

有关公司的员工薪酬及培训计划详细资料请参阅本报告“第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况”。有关本公司与主要客户及供货商的关系请参阅本报告“第四节、三、（五）、8、主要客户及供货商”。

10、利润分配方案

有关公司的利润分配预案，请参见本报告“第五节、一、普通股利润分配或资本公积金转增预案”。

11、税项减免

(1) A 股股东

根据中国财政部、国家税务总局、中国证监会《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2015]101号）及《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85号）的规定，对于公司个人股东，持股期限（个人从公开发行和转让市场取得上市公司股票之日起至转让交割该股票之日前一日的持有时间）在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额，实际税负为20%；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额，实际税负为10%；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上市公司派发股息红利时，对个人持股1年以内（含1年）的，上市公司暂不扣缴个人所得税；待个人转让股票时，证券登记结算公司根据其持股期限计算应纳税额，公司通过证券登记结算公司另行代扣代缴。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照财税[2012]85号文的规定计征个人所得税。

对于合格境外机构投资者（QFII），根据国家税务总局《关于中国居民企业向QFII支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函2009[47]号）的规定，上市公司按10%的税率统一代扣代缴企业所得税。如QFII股东取得的股息红利收入需要享受税收协定（安排）待遇的，可按照规定在取得股息红利后自行向主管税务机关提出退税申请。

根据中国财政部、国家税务总局、中国证监会《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税[2014]81号）的规定，对香港市场投资者（包括企业和个人）投资上交所上市A股取得的股息红利所得，在香港中央结算有限公司不具备向中国结算提供投资者的身份及持股时间等明细数据的条件之前，暂不执行按持股时间实行差别化征税政策，由上市公司按照10%的税率代扣所得税，并向其主管税务机关办理扣缴申报。对于香港投资者中属于其他国家税收居民且其所在国与中国签订的税收协定规定股息红利所得税率低于10%的，企业或个人可以自行或委托代扣代缴义务人，向上市公司主管税务机关提出享受税收协定待遇的申请，主管税务机关审核后，应按已征税款和根据税收协定税率计算的应纳税款的差额予以退税。

对于机构投资者，其股息、红利所得由其自行缴纳。

(2) H 股股东

根据《国家税务总局关于国税发[1993]045号文件废止后有关个人所得税征管问题的通知》（国税函[2011]348号）的规定，境外居民个人股东从境内非外商投资企业在香港发行股票取得的股息红利所得，应按照“利息、股息、红利所得”项目，由扣缴义务人依法代扣代缴个人所得税。境内非外商投资企业在香港发行股票，其境外居民个人股东根据其居民身份所属国家与中国签署的税收协定及内地和香港（澳门）间税收安排的规定，享受相关税收优惠。根据相关税收协定及税收安排规定的相关股息税率一般为10%，为简化税收征管，在香港发行股票的境内非外商投资企业派发股息红利时，一般可按10%税率扣缴个人所得税，无需办理申请事宜。对股息税率不属10%的情况，按以下规定办理：1）低于10%税率的协定国家居民，扣缴义务人可代为办理享

受有关协定待遇申请，经主管税务机关审核批准后，对多扣缴税款予以退还；2) 高于 10% 低于 20% 税率的协定国家居民，扣缴义务人派发股息红利时应按协定实际税率扣缴个人所得税，无需办理申请审批事宜；3) 没有税收协定国家居民及其他情况，扣缴义务人派发股息红利时应按 20% 扣缴个人所得税。

根据国家税务总局《关于中国居民企业向境外 H 股非居民企业股东派发股息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函[2008]897 号）的规定，中国居民企业向境外 H 股非居民企业股东派发 2008 年及以后年度股息时，统一按 10% 的税率代扣代缴企业所得税。

根据中国财政部、国家税务总局、中国证监会《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税[2014]81 号）的规定，对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，H 股公司不代扣股息红利所得税款，由企业自行申报缴纳。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

根据中国财政部、国家税务总局、中国证监会《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税[2016]127 号）的相关规定，对内地个人投资者通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，比照个人投资者征税。H 股公司对内地企业投资者不代扣股息红利所得税款，应纳税款由企业自行申报缴纳。

建议公司股东向彼等的税务顾问咨询有关拥有及处置公司股份所涉及的中国、香港及其他国家（地区）税务影响的意见。

12、重要合约

报告期内，公司无控股股东，公司或其任何附属公司不存在《香港上市规则》附录十六项下的与控股股东或其附属公司之间所订立的重要合约，亦没有控股股东或其附属公司向本公司或其附属公司提供服务的重要合约。

13、管理合约

报告期内，公司没有任何仍然生效的合约（与公司的任何董事、监事或任何全职雇员所订立的服务合约除外），而任何个人或实体据此承担公司的全部或任何重大部份业务的管理及行政。

14、获准许弥偿条文

董事之获准许的弥偿条文现时并于报告期内生效。公司已就董事、监事和高级管理人员可能的法律行动及责任作出适当的投保安排。

15、股票挂钩协议

报告期内，公司概无新订或已有股票挂钩协议。

16、股本与股票及债券发行

有关公司截至 2020 年 12 月 31 日的股本与股票及债券发行的情况，请参见本报告“第六节、一、普通股股本变动情况”、“第六节、二、证券发行与上市情况”、“第七节 优先股相关情况”及“第十节 公司债券相关情况”。

17、环境政策及表现

有关公司的环境政策及表现，请参见本报告“第五节、十七、积极履行社会责任的工作情况”。

18、遵守相关法律法规

有关公司遵守对公司有重大影响的有关法律法规的情况，请参见本报告“第九节、公司治理”。

19、审阅年度业绩

公司董事会审计委员会已审阅公司截至 2020 年 12 月 31 日止年度的经审计的年度财务报表及年度报告，未对公司所采纳的会计政策及常规提出异议。

20、期后事项

除本报告所披露外，于财政年度结算日后截至本报告日期，本公司并无发生其他重大事项。

四、公司因不适用准则规定或国家秘密、商业秘密等特殊原因，未按准则披露的情况和原因说明
适用 不适用

第五节 重要事项

一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

(一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

适用 不适用

公司严格按照《公司章程》第二百四十五条的规定，按照“同股同权、同股同利”的原则，根据各股东持有的公司股份比例进行分配。公司实行持续、稳定的利润分配政策，重视对投资者的合理投资回报并兼顾公司的长期发展。

公司在《公司章程》中明确制定了公司的利润分配政策：“公司结合所处发展阶段、资金需求等因素，选择有利于股东分享公司成长和发展成果、取得合理投资回报的考量下，采取现金或股票方式分配股利，并优先采取现金分红的方式。原则上，公司一般在盈利年度进行年度现金分红，并且在符合利润分配原则，满足现金分红条件的前提下，公司也可以进行中期现金分红。公司利润分配不得超过累计可分配利润的范围，单一年度以现金方式分配的利润不少于当年度实现的可分配利润的30%。”

董事会拟定的利润分配方案须经全体董事过半数通过，独立董事应对利润分配方案发表独立意见，并提交股东大会审议决定。对于按照既定的现金分红政策或最低现金分红比例确定当年利润分配方案的，股东大会审议利润分配方案时，须经出席股东大会会议的股东（包括股东代理人）所持表决权的1/2以上表决通过。公司在特殊情况下无法按照既定的现金分红政策或最低现金分红比例确定当年利润分配方案的，应当在定期报告中披露具体原因以及独立董事的明确意见，并对公司留存收益的用途及预计投资收益等事项进行专项说明。公司当年利润分配方案应当经出席股东大会的股东（包括股东代理人）所持表决权的2/3以上通过，并且相关股东大会会议审议时应当为股东提供网络投票便利条件。监事会应对董事会执行现金分红政策和股东回报规划以及是否履行相应决策程序和信息披露等情况进行监督。

公司根据行业监管政策、自身经营情况、投资规划和长期发展的需要，或者由于外部经营环境或者自身经营状况发生较大变化而需调整利润分配政策的，调整后的利润分配政策不得违反相关法律、法规以及中国证监会和证券交易所的有关规定，有关调整利润分配政策议案由董事会根据公司经营情况和相关规定及政策拟定，并提交股东大会审议。董事会拟定调整利润分配政策议案过程中，应当充分听取独立董事的意见，进行详细论证。董事会拟定的调整利润分配政策的议案须经全体董事过半数通过，独立董事应发表独立意见。监事会应对董事会调整利润分配政策的行为进行监督。调整利润分配政策的议案须经出席股东大会会议的股东（包括股东代理人）所持表决权的2/3以上表决通过，并且相关股东大会会议审议时应为股东提供网络投票便利条件。

公司2019年度利润分配方案已于2020年6月29日实施完毕。以公司总股本6,993,655,803股为基数，每10股派发现金股利人民币1.50元（含税），分配现金股利人民币1,049,048,370.45元。

(二) 公司近三年（含报告期）的普通股股利分配方案或预案、资本公积金转增股本方案或预案

单位：元 币种：人民币

| 分红年度 | 每 10 股送红股数 (股) | 每 10 股派息数 (元) (含税) | 每 10 股转增数 (股) | 现金分红的数额 (含税) | 分红年度合并报表中归属于母公司所有者的净利润 | 占合并报表中归属于母公司所有者的净利润的比率 (%) |
|--------|----------------|--------------------|---------------|------------------|------------------------|----------------------------|
| 2020 年 | 0 | 2.50 | 0 | 1,748,413,950.75 | 2,722,988,518.72 | 64.21 |
| 2019 年 | 0 | 1.50 | 0 | 1,049,048,370.45 | 2,435,079,764.10 | 43.08 |
| 2018 年 | 0 | 1.00 | 0 | 699,365,580.30 | 1,231,013,208.91 | 56.81 |

经审计,集团 2020 年度合并报表中归属于母公司所有者的净利润为人民币 2,722,988,518.72 元, 母公司 2020 年度净利润为人民币 1,536,393,008.19 元。

根据《公司法》、《证券法》、《金融企业财务规则》、中国证监会《上市公司监管指引第 3 号—上市公司现金分红》、《上海证券交易所上市公司现金分红指引》以及《公司章程》的有关规定, 结合公司业务发展的实际需求, 公司拟定了 2020 年度利润分配方案, 具体如下: 2020 年初公司未分配利润为人民币 4,766,558,982.91 元, 加上 2020 年度公司实现的净利润人民币 1,536,393,008.19 元, 减去本年实施的 2019 年度现金分红人民币 1,049,048,370.45 元, 减去 2020 年度所有者权益内部结转对未分配利润人民币 28,712,812.04 元, 减去计提的永续次级债利息支出 83,287,671.23 元, 2020 年度公司可供分配利润为人民币 5,141,903,137.38 元。公司以 2020 年实现的净利润为基数分别提取 10% 的法定盈余公积金、5% 的任意盈余公积金、10% 的一般风险准备金、10% 的交易风险准备金以及按照公募基金托管费收入的 2.5% 提取托管业务风险准备金共计人民币 537,742,438.69 元。扣除上述提取后, 公司 2020 年末可供投资者分配的利润为人民币 4,604,160,698.69 元。

综合公司长远发展和投资者利益等因素统筹考虑, 拟定 2020 年度利润分配方案如下:

1、公司 2020 年度利润分配采用现金分红的方式, 以 2020 年 12 月 31 日总股本 6,993,655,803 股为基数, 向 2020 年度现金红利派发股权登记日登记在册的 A 股股东和 H 股股东每 10 股派发现金红利人民币 2.50 元 (含税), 共计派发现金红利人民币 1,748,413,950.75 元, 占合并报表 2020 年归属于母公司净利润的 64.21%。

2、现金红利以人民币计值和宣布, 以人民币向 A 股股东支付, 以港币向 H 股股东支付。港币实际派发金额按照公司 2020 年度股东大会召开日前五个工作日中国人民银行公布的人民币兑换港币平均基准汇率计算。

公司 2020 年度利润分配议案经 2020 年年度股东大会审议通过后, 将于该次股东大会召开之日起二个月内进行 2020 年度现金股利分配。

公司将适时公布 2020 年年度股东大会的召开日及为决定有权出席应届年度股东大会并于会上投票的股东名单而暂停办理股份过户登记的时间。公司将就本次 H 股股息派发的基准日及暂停股东过户登记日期另行通知。

(三) 以现金方式回购股份计入现金分红的情况

适用 不适用

(四) 报告期内盈利且母公司可供普通股股东分配利润为正，但未提出普通股现金利润分配方案预案的，公司应当详细披露原因以及未分配利润的用途和使用计划

适用 不适用

二、承诺事项履行情况

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

适用 不适用

| 承诺背景 | 承诺类型 | 承诺方 | 承诺内容 | 承诺时间及期限 | 是否有履行期限 | 是否及时严格履行 | 如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因 | 如未能及时履行应说明下一步计划 |
|--------------|--------|--------|---|---------------------------|---------|----------|----------------------|-----------------|
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决同业竞争 | 申能集团 | 已向本公司出具《避免同业竞争承诺函》，承诺申能集团及其直接、间接控制的公司、企业不以任何形式从事与本公司及其子公司构成竞争或可能构成竞争的业务和经营。 | 在本公司公开发行 A 股股票并上市后。 | 是 | 是 | / | / |
| 与再融资相关的承诺 | 股份限售 | 申能集团 | 承诺自新增持本公司股票在证券交易所上市交易之日起 48 个月不转让或者委托他人管理已直接和间接持有的本公司股份，也不由本公司回购该部分股份。 | 在本公司非公开发行 A 股股票并上市后 48 个月 | 是 | 是 | / | / |
| 与再融资相关的承诺 | 股份限售 | 上海海烟投资 | 承诺自新增持本公司股票在证券交易所上市交易之日起 36 个月不转让或者委托他人管理已直接和间接持有的本公司股份，也不由本公司回购该部分股份。 | 在本公司非公开发行 A 股股票并上市后 36 个月 | 是 | 是 | / | / |

(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，公司就资产或项目是否达到原盈利预测及其原因作出说明

已达到 未达到 不适用

(三) 业绩承诺的完成情况及其对商誉减值测试的影响

适用 不适用

三、报告期内资金被占用情况及清欠进展情况
 适用 不适用

四、公司对会计师事务所“非标准意见审计报告”的说明
 适用 不适用

五、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明
(一) 公司对会计政策、会计估计变更原因及影响的分析说明
 适用 不适用

(二) 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明
 适用 不适用

(三) 与前任会计师事务所进行的沟通情况
 适用 不适用

(四) 其他说明
 适用 不适用

六、聘任、解聘会计师事务所情况

单位：万元 币种：人民币

| | 现聘任 |
|--------------|--------------------|
| 境内会计师事务所名称 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 境内会计师事务所报酬 | 119 |
| 境内会计师事务所审计年限 | 4 |
| 境外会计师事务所名称 | 德勤·关黄陈方会计师行 |
| 境外会计师事务所报酬 | 119 |
| 境外会计师事务所审计年限 | 5 |

| | 名称 | 报酬 |
|--------------|--------------------|----|
| 内部控制审计会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 42 |

聘任、解聘会计师事务所的情况说明
 适用 不适用

报告期内，经公司 2019 年度股东大会审议通过，公司续聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2020 年度境内审计机构，负责根据中国企业会计准则等提供相关的境内审计服务，聘期一年，2020 年度财务及专项监管报告审计费用 119 万元；续聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2020 年度内部控制审计机构，内部控制审计费用 42 万元。公司续聘德勤·关黄陈方会计师行为公司 2020 年度境外审计机构，负责根据国际财务报告准则提供相关的审计及审

阅服务，聘期一年，2020 年度财务报告审计费用 119 万元，半年度审阅费用 60 万元。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为集团内子公司提供审计服务费用合计 125.33 万元。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

报告期内，公司未改聘会计师事务所，亦未出现董事会不同意审计委员会对甄选、委任外聘审计师事宜的意见。

| 过往三年公司聘任的会计师事务所 | 2020 年度 | 2019 年度 | 2018 年度 |
|-----------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 境内会计师事务所名称 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 境外会计师事务所名称 | 德勤·关黄陈方会计师行 | 德勤·关黄陈方会计师行 | 德勤·关黄陈方会计师行 |

七、面临暂停上市风险的情况

（一）导致暂停上市的原因

适用 不适用

（二）公司拟采取的应对措施

适用 不适用

八、面临终止上市的情况和原因

适用 不适用

九、破产重整相关事项

适用 不适用

十、重大诉讼、仲裁事项

本年度公司有重大诉讼、仲裁事项 本年度公司无重大诉讼、仲裁事项

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

公司主要诉讼及仲裁（占公司诉讼及仲裁总额 90% 以上）情况如下：

| 起诉方 | 应诉方 | 诉讼仲裁类型 | 案由 | 涉案金额 | 案件进展 |
|-----|-----|--------|----|------|------|
| | | | | | |

| | | | | | |
|------|--------------------------------|----|--|---|--|
| 东方证券 | 大连长富瑞华集团有限公司 | 诉讼 | 大连长富瑞华集团有限公司（以下简称“长富瑞华”）于 2014 年 6 月以其持有的“大连控股“（600747）限售股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待 偿 还 本 金 80,000 万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 公司于 2017 年 6 月申请强制执行并获受理，7 月辽宁高院作出裁定，将本案指定大连中院管辖。2018 年 1 月，大连中院从质押证券首封法院取得处置权。后于 2019 年 8 月进入司法拍卖程序，在司法评估期间，质押证券于 12 月退市，并存在第三方债权人对债务人申请破产被辽宁高院指定大连中院受理。该破产申请人及债务人均对本案司法拍卖提出异议，要求中止执行。2020 年 3 月大连中院驳回执行异议。大控退市至新三板挂牌，经向主办券商太平洋证券申请，管理人同意提前处置质押股权，于 6 月第一次拍卖，流拍。7 月召开第一次债权人会议并获得管理人对公司债权审定结果。目前等待破产程序推进及质押股票上司法冻结及所有轮候冻结解除办理进展。 |
| 东方证券 | 上海郁泰登硕投资中心（有限合伙）及保证人上海阜兴实业有限公司 | 诉讼 | 上海郁泰登硕投资中心（有限合伙）于 2016 年 9 月以其持有的“坚瑞沃能”（300116）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由上海阜兴实业集团有限公司提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。 | 待 偿 还 本 金 17,000 万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 公司于 2018 年 8 月在上海第二中级人民法院获执行立案，并于同年 9 月就质押证券完成首封冻结。2019 年 9 月进入执行阶段，公司通过司法委托二级市场抛售的方式处置了部分质押股份，收回部分执行款；其余质押股份经 2020 年 1 月司法拍卖流拍后，现已由法院作出以股抵债裁定，以股抵债手续已办理完成。3 月上海二中院因处理“阜兴系”其他案件冻结公司本案执行回款累计过户股票已抛售数量对应抵债价值累计资金约 6541 万元以及剩余未抛售的过户股票约 481 万股。经与法院多轮沟通，待刑事案件审结后根据相关法律文书处理。同时，公司就处置质押股票不足偿付部分向保证人上海郁泰投资管理有限公司于上海金融法院提起保证人之诉。 |
| 东方证券 | 林文洪及其配偶 | 诉讼 | 林文洪于 2014 年 3 月起以其持有的“冠福股份”（002102）流通股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待 偿 还 本 金 5,091 万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019 年 7 月向上海金融法院起诉并完成诉讼保全。于 2020 年 1 月正式开庭。3 月公司收到一审判决书，法院支持我公司除未实际发生的律师费部分及保全担保费外其他所有诉请，对方未上诉。4 月公司申请强制执行。10 月首封法院杭州上城法院将质押股票处置权移送至上海金融法院。11 月上海金融法院裁定司法拍卖处置，目前等待发布司法拍卖公告。 |

| | | | | | |
|------|-----------------------------|----|---|--|--|
| 东方证券 | 林文智、其配偶以及第三笔交易保证人福建同孚实业有限公司 | 诉讼 | 林文智于2014年9月起以其持有的“冠福股份”(002102)流通股与公司陆续开展了三笔股票质押式回购交易。其中一笔交易由福建同孚实业有限公司提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。 | 待偿还本金12,687万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019年7月就三笔交易向上海金融法院合并起诉并完成诉讼保全。后上海金融法院拟针对上述三笔交易分拆两案,于2020年1月就涉本金9,087万元的交易案件正式开庭,3月3日收到一审判决书,法院支持我公司除未实际发生的律师费部分及保全担保费外其他所有诉请。对方未上诉,4月申请执行立案。法院于10月先行取得上海青浦法院首封的3836265股处置权,经12月司法拍卖以671万元成交,目前等待法院向公司划付。剩余质押股票因商请移送期间首封法院发送变化,目前等待最新生效的首封法院上海浦东法院、杭州下城区法院回复是否移送。 另,上海金融法院移送黄浦法院的案件于3月立案,于8月正式开庭。11月法院作出一审判决,支持公司除未实际发生的律师费部分及保全担保费外其他所有诉请。 |
| 东方证券 | 北京市梧桐翔宇投资有限公司 | 诉讼 | 北京市梧桐翔宇投资有限公司于2016年8月以其持有的“德奥通航”(002260)流通股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待偿还本金12,367.08万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019年7月获诉讼立案,定于2020年2月第一次开庭。受疫情影响,延期至4月完成第一次开庭。5月公司收到一审胜诉判决,对方未上诉。7月公司申请执行立案。9月质押股票首封法院杭州中院向上海金融法院移送处置权。 |
| 东方证券 | 林文昌 | 诉讼 | 林文昌于2016年6月起以其持有的“冠福股份”(002102)限售股与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待偿还本金28,310万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019年9月泉州中院正式受理立案,并完成执行保全。2020年3月泉州中院取得质押股票处置权。10月法院及公证处分别反馈收到被执行人关于驳回执行以及撤销执行证书的异议申请。11月法院及公证处均对该异议申请予以书面驳回。12月被执行人就驳回裁定向福建高院申请复议。 |
| 东方证券 | 张庆文 | 诉讼 | 张庆文于2015年12月起以其持有的邦讯技术(300312)流通股与公司开展股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待偿还本金18,581.01万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019年10月获法院执行立案。2020年3月法院收到深圳首封的1000万股股票处置权,公司向法院申请恢复1000万股股票执行。4月北京一中院收到上海一中院同意移送处置权的函。6月公司与法院沟通拍卖方案。10月、11月两次流拍。后因债务人与公司沟通和解事宜,目前处在与债务人协调沟通中。 |
| 东方 | 戴芙蓉 | 诉讼 | 戴芙蓉于2015年9 | 待偿还本金 | 分两个司法案件处理: |

| | | | | | |
|------|----------------------------------|----|---|--|---|
| 证券 | | | 月起以其持有的邦讯技术(300312)流通股与公司开展股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 15,000 万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 其中,诉讼案件于 2019 年 9 月正式立案,但被告提起管辖权异议,黄浦法院予以驳回后被告上诉至上海金融法院,2020 年 1 月上海金融法院出具驳回被告管辖权异议的终审裁定。5 月正式开庭。6 月公司收到一审胜诉判决,除尚未实际支付的律师费及保全担保费,所有诉请得到支持。6 月被告提出上诉。12 月公司收到二审判决,维持原判。待申请执行立案。 执行案件于 2019 年 10 月获北京一中院执行立案,2020 年 4 月,北京一中院收到上海一中院同意移送处置权的函。6 月公司与法院沟通拍卖方案。10 月、11 月两次流拍。后因债务人与公司沟通和解事宜,目前处在与债务人协调沟通中。 |
| 东方证券 | 徐蕾蕾 | 诉讼 | 徐蕾蕾于 2016 年 11 月起以其持有的“皇氏集团”(002329)股份与公司开展股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待偿还本金 11,903.08 万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019 年 10 月获北京三中院执行立案,12 月与被执行人达成执行和解协议,但因其未按协议还款,公司于 2020 年 1 月申请恢复执行。9 月再次开庭,目前等待判决。公司执行案件需待首封案件审结后推进。 |
| 东方证券 | 贾全臣法定继承人黄秀珍、王文琪、贾晓钰及交易保证人贾晓钰、王晶晶 | 诉讼 | 贾全臣(已故)于 2016 年 9 月以其持有的“青岛中程”(300208)流通股与公司开展了股票质押式回购交易,后贾晓钰、王晶晶对该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。贾全臣在到期日之前去世,未能到期购回,构成违约且质押股票被司法冻结。公司向其财产继承人王文琪、贾晓钰以及保证人主张债权。 | 待偿还本金 11,500 万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019 年 10 月底获诉讼立案。于 2020 年 4 月第一次开庭。被告律师联系法官要求延期,法官要求其先行提供授权材料。同月,该律师提供部分继承材料。6 月被告表示不放弃继承,但希望引入第三方达成调解方案。8 月公司与被告于法院达成调解,并制作民事调解书。后因被告方未能履行调解书,公司申请强制执行,并已于上海金融法院立案执行。 |

| | | | | | |
|------|----------------------------|----|---|---|--|
| 东方证券 | 北京东方君盛投资有限公司及保证人冯彪、高忠霖及其配偶 | 诉讼 | 北京东方君盛投资有限公司（以下简称“东方君盛”）2017年9月起以其持有的“海南椰岛”（600238）流通股与公司开展股票质押式回购交易，并由冯彪、高忠霖提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。 | 待偿还本金42,500万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019年11月获诉讼立案，完成诉讼保全，3月下旬法院就东方君盛、冯彪提出管辖权异议的裁定，驳回异议。4月异议人对驳回提出上诉，原定开庭取消。金融法院移送案卷。5月高院系统收案。6月公司收到管辖权异议二审裁定，维持原裁定。后上海金融法院公告送达传票并于11月开庭，目前等待一审判决。 |
| 东方证券 | 深圳市老虎汇资产管理有限公司及保证人冯彪及其配偶 | 诉讼 | 深圳市老虎汇资产管理有限公司（以下简称“老虎汇”）2017年2月以其持有的“嘉应制药”（002198）流通股与公司开展了股票质押式回购交易，并由实控人冯彪提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。 | 待偿还本金47,000万元及应付未付利息、延期利息、罚息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用 | 2019年11月获诉讼立案，完成诉讼保全，老虎汇及冯彪提起管辖权异议。2020年3月，公司收到法院出具的管辖权异议裁定，驳回异议。被告对此提出上诉，原定开庭取消。4月金融法院收到移送案卷。8月公司收到上海高院关于管辖权异议二审裁定，维持原裁定。后上海金融法院公告送达传票并定于2021年1月开庭。 |
| 东方证券 | 科迪食品集团股份有限公司及保证人张清海 | 诉讼 | 科迪食品集团股份有限公司2015年12月以其持有的“科迪乳业”（002770）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由公司实控人张清海提供无条件的、不可撤销的连带责任保证。上述交易现已违约。 | 待偿还本金23186万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020年5月于上海金融法院一并向保证人张清海，完成诉讼立案。6月法院做出保全裁定。10月一审开庭，目前等待一审裁决。 |
| 东方证券 | 上海淮茂股权投资基金管理合伙企业（有限合伙） | 诉讼 | 上海淮茂股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）2016年1月以其持有的“刚泰控股”（600687）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由上海鼎柏股权投资基金管理合伙企业（有限合伙）为该笔交易提供无条件的、不 | 待偿还本金41591.74万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020年4月向上海金融法院申请强制执行。6月底获正式受理案号。8月上海金融法院取得质押股票处置权。11月因上市公司面临面值退市，法院出具二级市场抛售处置裁定书及协执，在遵守减持规定的前提下，累计抛售14,887,153股，扣除执行费、手续费等后法院于12月向我司划付受偿款11,601,009.78元。剩余质押股票已由法院裁定并发布公告定于2021年1月通过其与上交所的新大宗司法处置平台处置。 |

| | | | | | |
|------|----------------------------|----|---|---|--|
| | | | 可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。 | | |
| 东方证券 | 霖灏投资（上海）有限公司及保证人陈仲华、季俊及其配偶 | 诉讼 | 霖灏投资（上海）有限公司 2016 年 8 月以其持有的“华谊嘉信”（300071）限售股与公司开展了股票质押式回购交易，并由法定代表人陈仲华、股东季俊为该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。 | 待偿还本金 10,900 万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020 年 6 月于上海金融法院诉讼立案，并完成诉讼保全、对质押股票首封冻结。9 月正式开庭，达成调解并由法院制作民事调解书。后因债务人未履行民事调解书，目前公司准备向上海金融法院申请强制执行。 |
| 东方证券 | 山东东方海洋集团有限公司 | 诉讼 | 山东东方海洋集团有限公司 2017 年 10 月起以其持有的“东方海洋”（002086）与公司开展了股票质押式回购交易，并由车轼、宋政华、车志远为该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。 | 待偿还本金 17530 万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020 年 7 月于上海金融法院诉讼立案。12 月一审开庭审理。目前等待一审判决。 |
| 东方证券 | 汕头市澄海区沪美蓄电池有限公司 | 诉讼 | 汕头市澄海区沪美蓄电池有限公司 2016 年 5 月起以其持有的“猛狮科技”（002684）与公司开展了股票质押式回购交易，并由陈再喜、陈银卿、陈乐伍、林少军、广东猛狮工业集团有限公司为该笔交易提供无条件的、不可撤销的连带责任担保。上述交易现已违约。 | 待偿还本金 56930 万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020 年 8 月于上海金融法院诉讼立案。并定于 2021 年 2 月一审开庭。 |

| | | | | | |
|------|----------------|----|---|---|---|
| 东方证券 | 南通元鼎投资有限公司 | 诉讼 | 南通元鼎投资有限公司 2016 年 10 月以其持有的“刚泰控股”（600687）与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待偿还本金 30633.12 万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020 年 8 月由南通中院受理强制执行公证债权文书申请并立案，并由南通中院首先查封冻结质押股票。11 月因上市公司面临面值退市，法院出具二级市场抛售处置裁定书及协执，在遵守减持规定的前提下，累计抛售 14,887,098 股，扣除执行费、手续费等后法院拟于 2021 年 1 月向我司划付受偿款 13,151,670.43 元。剩余质押股票已由法院裁定并发布公告定于 2021 年 1 月司法拍卖。 |
| 东方证券 | 旭森国际控股（集团）有限公司 | 诉讼 | 旭森国际控股（集团）有限公司于 2016 年 9 月起以其持有的“商赢环球”（600146）股份与公司开展了股票质押式回购交易。上述交易现已违约。 | 待偿还本金 23870 万元及应付未付利息、延期利息、违约金及其他因实现债权产生的相关费用。 | 2020 年 12 月由上海金融法院受理强制执行债权文书申请并立案。被执行人提出异议，要求不予执行。目前等待执行异议审理。 |

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

适用 不适用

报告期内，公司及其董事、监事、高级管理人员不存在被有权机关调查，被司法机关或纪检部门采取强制措施，被移送司法机关或追究刑事责任，被中国证监会立案调查或行政处罚、被市场禁入、被认定为不适当人选，被环保、安监、税务等其他行政管理部门给予重大行政处罚，以及被证券交易所公开谴责的情形。

十二、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

适用 不适用

公司第一大股东为申能集团。报告期内，公司诚信状况良好，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。

十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

（一）相关激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

（二）临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

为建立和完善员工与公司的利益共享机制，提高员工的凝聚力和公司竞争力，吸引和保留优秀人才，促进公司长期、持续、健康发展，促进公司、股东和员工三方的利益最大化，公司于2020年实施了H股员工持股计划。

公司第四届董事会第二十次会议、第四届监事会第十五次会议，2020年第一次临时股东大会审议通过了《关于〈东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）〉及摘要的议案》、《关于授权董事会全权办理公司员工持股计划相关事宜的议案》。2020年7月7日，公司召开第三届职工代表大会第四次全体会议，审议通过了《东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）》及其摘要。公司本次员工持股计划实际参与人数为3,588人，募集资金总额为人民币316,657,000元，其中公司董事、监事和高级管理人员认购金额占本次员工持股计划总额的8.27%。（公告编号：2020-45、46、51、53）

2020年7月23日，公司通过网络投票的方式召开了公司员工持股计划第一次持有人会议，会议审议通过了《关于选举东方证券股份有限公司员工持股计划管理委员会委员的议案》及《关于授权东方证券股份有限公司员工持股计划管理委员会办理本次员工持股计划相关事宜的议案》。（公告编号：2020-056）

公司H股员工持股计划已于2020年12月24日完成标的股票的全部购买及登记过户工作，“东方证券员工持股计划1号单一资产管理计划”及“东方证券员工持股计划2号单一资产管理计划”在二级市场累计买入公司H股股票65,906,800股，占公司总股本的比例为0.942%，占公司H股股本的比例为6.417%，成交金额合计为人民币3.0亿元，剩余资金用于流动性管理。

根据《东方证券股份有限公司员工持股计划》，公司H股员工持股计划所获标的股票的锁定期为12个月，自公司公告最后一笔标的股票完成登记过户之日起算，即2020年12月25日至2021年12月24日。

公司将严格遵守市场交易规则，持续关注公司员工持股计划的实施进展情况，并按照相关规定及时履行信息披露义务。

其他激励措施

适用 不适用

十四、重大关联交易

（一）与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

√适用 □不适用

1.1 集团与申能集团及其相关企业发生的持续关联/连交易

兹提述公司日期为 2019 年 6 月 3 日内容有关持续连交易的公告。截至本报告日期,申能集团持有公司已发行股本约 25.27%,根据《香港上市规则》第 14A.07(1)条,申能集团及其相关企业为公司的关连人士。报告期内,公司严格按照 2019 年年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2020 年度日常关联交易的议案》、第四届董事会第四次会议审议通过的《关于与申能(集团)有限公司签署〈关连交易框架协议〉的议案》、第四届董事会第十二次会议审议通过的《关于与申能(集团)有限公司签署〈关连交易框架协议之补充协议〉的议案》开展关联/连交易,相关执行情况如下表:

单位:万元 币种:人民币

| 交易类别 | 交易项目 | 相关业务或事项简介 | 关联/连方 | 预计金额 | 实际金额 |
|-----------|-----------|---------------------------------|------------|-----------|----------|
| 证券和金融产品服务 | 手续费及佣金收入 | 公司向其提供代理买卖证券、期货等服务,收取手续费及佣金等。 | 申能集团及其相关企业 | 15,000.00 | 48.31 |
| | 客户保证金利息支出 | 公司向其提供代理买卖证券、期货等服务,支付客户资金存款利息等。 | | 2,500.00 | 17.38 |
| 采购商品和接受劳务 | 业务及管理费 | 公司接受其提供的物业、供应燃气等服务。 | | 5,000.00 | 1,942.93 |

注:公司 2020 年与申能集团及其相关企业发生的关联/连交易金额占公司同类型业务比重较小。

1.2 集团与其他关联方发生的关联交易

报告期内,公司严格按照 2019 年年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2020 年度日常关联交易的议案》约定的年度交易金额上限开展关联交易,相关执行情况如下表:

单位:万元 币种:人民币

| 交易类别 | 交易项目 | 相关业务或事项简介 | 关联方 | 预计金额 | 实际金额 |
|-----------|----------|--------------------------------------|-----------------|----------------------|--------|
| 证券和金融产品服务 | 手续费及佣金收入 | 公司向关联方提供代理买卖证券、期货、财务咨询等服务,收取手续费及佣金等。 | 长城基金管理有限公司 | 因交易量难以预计,以实际发生数计算。 | 346.16 |
| | | | 东方国际集团上海投资有限公司 | | 0.85 |
| | | | 上海东方证券心得益彰公益基金会 | | 0.80 |
| | | | 关联/连自然人 | | 38.92 |
| | 承销费收入 | 公司向其提供证券承销服务,收取证券承销费用。 | 上海建工集团股份有限公司 | 因证券承销量难以预计,以实际发生数计算。 | 82.00 |
| | | | 浙江省能源集团有限公司 | | 21.83 |
| | | | 上海新华发行集团有限公司 | | 2.70 |

| | | | | | |
|-----------------|---------------------------------|-----------------------------------|------------------------------|--------------------------------|----------|
| 利息收入 | 公司持有关联方发行的债券而获得相应期间的利息收入。 | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 因持有债券的规模及期间难以预计，以实际发生数计算。 | 483.76 | |
| | | 上海新华发行集团有限公司 | | 317.86 | |
| | | 上海上报资产管理有限公司 | | 154.29 | |
| | | 绿地控股集团有限公司 | | 45.72 | |
| | 投资收益 | 公司购买关联方发行的证券、基金、保险等产品而取得的投资收益。 | 上海建工集团股份有限公司 | 因购买证券及各类产品的规模、收益难以预计，以实际发生数计算。 | 775.83 |
| | | | 中国长城科技集团股份有限公司 | | 8.83 |
| | | | 长城基金管理有限公司 | | 662.27 |
| | | | 烟台张裕葡萄酒股份有限公司 | | 2.02 |
| | | | 江苏金融租赁股份有限公司 | | 1.22 |
| | | | 上海金桥出口加工区开发股份有限公司 | | (0.32) |
| | | | 绿地控股集团有限公司 | | (13.78) |
| | | | 海通证券股份有限公司 | | (89.87) |
| | | | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | | (117.21) |
| | 客户保证金利息支出 | 公司向关联方提供代理买卖证券、期货等服务，支付客户资金存款利息等。 | 绿地控股集团有限公司 | 因客户资金规模难以预计，以实际发生数计算。 | 63.33 |
| | | | 上海建工集团股份有限公司 | | 6.82 |
| 上海东方证券心得益彰公益基金会 | | | 0.23 | | |
| 中国长城科技集团股份有限公司 | | | 0.13 | | |
| 东方国际集团上海投资有限公司 | | | 0.08 | | |
| 关联/连自然人 | | | 1.40 | | |
| 保险支出 | 公司向其购买董监高责任险等保险。 | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 因购买保险的险种、时间、金额难以预计，以实际发生数计算。 | 63.02 | |
| 证券和金融产品交易 | 公司认购、申购关联方发行的股票、债券、基金、产品等的期末余额。 | 上海建工集团股份有限公司 | 因业务的发生及规模的不确定性，以实际发生数计算。 | 16,006.73 | |
| | | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | | 10,000.00 | |
| | | 上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司 | | 5,800.00 | |
| | | 上海新华发行集团有限公司 | | 5,000.00 | |
| | | 上海上报资产管理有限公司 | | 4,000.00 | |
| | | 长城基金管理有限公司 | | 3,456.86 | |
| | | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | | 1,977.25 | |
| | | 海通证券股份有限公司 | | 1,517.86 | |
| | | 中国长城科技集团股份有限公司 | | 31.47 | |
| | | 绿地控股集团有限公司 | | 21.42 | |
| | | 江苏金融租赁股份有限公司 | | 3.43 | |
| | | 烟台张裕葡萄酒股份有限公司 | | 3.10 | |
| | | 上海金桥出口加工区开发股份有限公司 | | 1.75 | |

注：

(1) 存在控制关系且已纳入公司合并会计报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

(2) 公司 2020 年与其他关联方发生的关联交易金额占公司同类型业务比重较小。

(3) 关联/连自然人包括：直接或者间接持有上市公司 5%以上股份的自然人；公司董事、监事及高级管理人员；上述人士的关系密切的家庭成员等。上述交易的适用百分比率均低于《香港上市规则》第 14A.76(1)条所述之最低豁免水平，因此上述交易已完全获豁免遵守《香港上市规则》第 14A 章的所有申报、年度审核、公告、通函及独立股东批准规定。

1.3 关联/连交易的交易类别和定价政策

集团预计与关联/连方开展证券和金融产品、中介服务等交易，具体交易类别及定价政策如下：

1.3.1 证券和金融产品务

证券和金融产品务包括但不限于以下服务：证券、期货经纪；出租交易席位；证券金融产品销售；证券金融业务；受托资产管理；投资咨询；证券承销；财务顾问；及资产托管服务。

证券和金融产品务的定价原则乃根据相关服务费用应按照适用的相关法律及法规的要求，并参考当时市场费率后由双方协商确定。具体而言：

1) 证券、期货经纪服务 — 市场上该等服务的佣金率通常具透明度及标准化，佣金率参照类似证券或期货行业的现行市场费率经公平磋商后厘定；费用（视乎情况而定）将参考（其中包括）市场上独立第三方客户之经纪交易费用、利率及佣金及预期经纪交易之总金额而厘定。就期货经纪而言，每手单边佣金根据(i)期货合约类别；(ii)买卖所在的期货交易所；及(iii)买卖是否于香港日间或夜间进行而有所不同。就经纪相关服务而言，费用（视乎情况而定）将参考预期成本厘定。

2) 证券金融产品销售服务 — 厘定服务费的因素包括市场价格、行业惯例及涉及金融产品销售的总额，并参考集团为类似类型及产品属性的产品销售收取的收费水平；

3) 受托资产管理服务 — 该等服务市场费率在市场上一般具透明度，主要参照包括现行市场费率、代售产品金额或受托资产规模及提供指定服务的复杂性等因素，经公平协商而厘定；

4) 投资咨询服务 — 该等服务费参照类似类型及规模的交易现行市场收费水平，由相关业务单位经参考各方之服务成本后，经公平协商而厘定；

5) 证券承销服务 — 证券承销服务市场竞争激烈，市场佣金通常具透明度及标准化。承销佣金经公平协商而厘定，并且考虑多项因素，包括当时市场条件、拟发行规模、近期类似性质和规模发行的一般市场佣金率，以及集团向独立第三方收取的费率。证券承销市场高度竞争，且承销佣金率通常具透明度及标准化，集团可基于市场定价；

6) 财务顾问服务 — 厘定财务顾问费用及其他服务费用考虑的因素包括交易性质及规模与当时市场情况。投资银行服务收费在市场中一般具透明度，集团可基于市场定价；

7) 资产托管服务 — 该等服务费参照类似类型及规模的交易的现行市场收费水平，经公平协商而厘定。

1.3.2 证券和金融产品交易

证券和金融产品交易包括但不限于以下交易：与关联/连方在银行间市场进行买入返售或卖出回购交易；与关联/连方在银行间市场进行债券自营交易；与关联/连方进行收益权转让交易；认购关联/连方发行的债券、基金、理财产品或信托计划等；及关联/连方认购集团发行的债券、基金、理财产品等。

各类证券及金融产品交易的费率在整个市场相当透明及标准化。就相关产品交易所收取的佣金及收费应参照现行市场费率，或按类似产品或交易类型一般适用于独立对手方的市场费率按公平协商确定。证券和金融产品的场内交易，以该类型证券和金融产品当时适用的市场价格或市场费率进行；证券和金融产品的场外及其他交易，以该类型证券和金融产品当时适用的市场价格或市场费率经双方协商进行；如无该类型证券和金融产品当时适用的市场价格或市场费率，该交易的价格或费率应适用双方依据公平市场交易原则协商确定的价格或费率。例如，倘在银行间债券市场及中国交易所债券市场进行交易，则分别按银行间债券市场及中国交易所债券市场所报价格；倘在证券交易所进行交易，则按相关证券交易所的现行市价进行交易；对于金融机构间借贷，则按银行间借贷市场所报现行利率进行交易。该等交易的定价须受中国严格监管且须遵守适用中国法律及法规的规定。

倘由集团认购关联/连方推出的证券和金融产品，及由关联/连方认购集团推出的证券和金融产品，认购价与其他投资者认购时的认购价相同。该认购价由推出证券和金融产品的金融机构经考虑所投资资产/业务基本情况后厘定。

1.3.3 采购商品和接受劳务

采购商品和接受劳务包括接受申能集团及其联系人经营范围内的服务，包括但不限于以下交易：采购煤气、天然气、燃气表灶、燃气设备用具、燃气厨房设备，接受燃气输配、燃气工程规划、设计施工等配套服务。

采购商品和接受劳务定价原则乃按照适用的相关法律及法规的要求，并参考当时市场价格后由双方在各方日常业务过程中，按一般商业条款经公平协商确定。集团与申能集团及其联系人已就有关定价机制原则上达成共识，将由下列方式厘定价格：(i) 倘存在政府定价指引，则以政府指示性价格为准；或(ii) 倘无任何目前适用的政府定价指引，则采纳专卖政府机关先前颁布的政府指示性价格作为基本价格，并通过参照申能集团及其联系人的采购或服务成本价格调整基本价格；上述第(ii)项经上述调整后，应为公平合理的价格。

1.4 关联/连交易（包括持续关连交易）的内部控制措施

1) 拟进行的证券和金融产品交易、证券和金融产品交易以及采购商品和接受劳务之交易的条款（包括定价条款）应与独立第三方就类似服务提供/获提供的条款相似，并应受独立第三方适用的相同内部甄选、审批及监督程序以及定价政策所规限。

2) 于确认与关联/连方所进行交易的定价前, 集团将参照向两名或以上独立第三方就同时间类似数量交易的定价或彼等提供产品或服务的报价, 以确定相关交易的定价及条款是否公平、合理, 且不逊于独立第三方所报者(或不优于向独立第三方提供者)(视情况而定)。倘未能就特定交易获得上述由或向独立第三方所报定价, 相关关联/连交易将需要作独立考虑, 并经由相关业务的投资决策小组批准, 以确保定价对集团公平合理。

3) 在向客户(包括关联/连方及独立第三方)提供或销售同一批次的证券或金融产品时, 集团会向所有客户提出相同的定价条款, 并且不会向关联/连方客户给予优惠条款。

4) 厘定价格之前, 持续关连交易的定价建议及补充材料将提交予相关内部部门以供审批。相关内部部门将进行资格审查及尽职调查, 评估某一特定交易的定价是否符合集团的相关政策及程序以及价格是否公平合理, 并将在适当情况下授予批准。内部审核部门及财务部门负责审查持续关连交易是否符合上述定价政策并监控该等交易的付款。

5) 有关关联/连交易的任何文件及记录均须妥为保存及存置。

6) 公司已按照《香港上市规则》制订内部指引, 规定了关联/连交易审批程序。

公司独立非执行董事及核数师会每年审阅公司的持续关联/连交易, 董事会(包括独立非执行董事)已确认上述交易的条款属公平合理, 乃在集团的日常业务中按一般商务条款或更佳条款进行且符合公司及股东的整体利益。公司核数师已审阅上述持续性关连交易, 并向董事会发出函件确认: (1) 彼等并未知悉任何事宜, 致使彼等认为已披露持续关连交易未经董事会批准; (2) 就涉及集团提供货品或服务的交易而言, 彼等并未知悉任何事宜, 致使彼等认为该等交易于所有重大方面未遵守公司的定价政策; (3) 彼等并未知悉任何事宜, 致使彼等认为该等交易于所有重大方面未根据规管该等交易的相关协议订立; (4) 就各持续关连交易的总额而言, 彼等并未知悉任何事宜, 致使彼等认为已披露持续关连交易已超过公司设定的年度上限。

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露, 但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

兹提述公司日期为2018年12月16日、2019年1月8日、2019年5月30日、2019年12月3日以及2020年4月22日内容有关收购东方花旗证券有限公司(以下简称“东方花旗”)部分股权的公告。

由于东方花旗为公司的附属公司并由公司持有66.67%股权, 花旗亚洲持有东方花旗33.33%股权, 为其主要股东。根据《香港上市规则》第14A.07(1)条, 花旗亚洲为公司附属公司层面的关连人士。根据香港上市规则第14A.101条, 由于(1)花旗亚洲为公司附属公司层面的关连人士; (2)

董事会已批准收购事项；以及(3)董事（包括独立非执行董事）认为收购事项的条款属公平合理、乃在公司的日常业务中按一般商业条款或更佳条款进行，收购事项符合公司及股东的整体利益，故根据《香港上市规则》第14A章，收购事项须遵守申报及公告规定，并获豁免遵守通函、独立财务意见及独立股东批准的规定。

2019年1月，公司董事会审议通过了《关于收购东方花旗证券有限公司部分股权暨关联/连交易的议案》，同意公司收购花旗环球金融亚洲有限公司（以下简称“花旗亚洲”）持有的东方花旗全部33.33%股权。

2019年5月30日，东方证券与花旗亚洲签订《关于东方花旗证券有限公司注册资本中33.33%股权的股权转让协议》（以下简称“《转让协议》”）。《转让协议》约定花旗亚洲以人民币475,583,890.59元（按截至2018年12月31日东方花旗经审计的净资产值人民币142,675.17万元乘以股权比例33.33%计算）的价格将东方花旗33.33%股份转让给东方证券。东方证券将根据《转让协议》的要求以美元资金一次性支付交易对价。

2019年12月，公司收到上海证监局《关于东方花旗证券有限公股东变更的无异议函》（沪证监机构字[2019]465号），上海证监局对公司受让花旗亚洲所持东方花旗33.3%股权原则上无异议。

2020年4月，公司收购东方花旗33.33%股权及东方花旗更名事宜已完成工商变更登记，并领取了上海市市场监督管理局换发的新营业执照，东方花旗的企业名称变更为东方证券承销保荐有限公司。东方证券承销保荐有限公司成为公司的全资子公司。

公司确认就上述关连交易已符合《香港上市规则》第14A章的规定。除上文所披露者外，报告期内，本公司无根据《香港上市规则》第14A章规定需要披露的其他关连交易。报告期内，有关会计准则下的关联方交易情况可参见合并财务报表附注十三，除上述披露外，该等关联方交易并不构成《香港上市规则》第14A章规定需要披露的关连交易。

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、 涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来
1、 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项
 适用 不适用

2、 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项
 适用 不适用

3、 临时公告未披露的事项
 适用 不适用

(五) 其他
 适用 不适用

十五、 重大合同及其履行情况
(一) 托管、承包、租赁事项
1、 托管情况
 适用 不适用

2、 承包情况
 适用 不适用

3、 租赁情况
 适用 不适用

(二) 担保情况
 适用 不适用

单位: 亿元 币种: 人民币

| 公司对外担保情况（不包括对子公司的担保） | |
|------------------------------------|--------|
| 报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保） | |
| 报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保） | |
| 公司及其子公司对子公司的担保情况 | |
| 报告期内对子公司担保发生额合计 | 30.64 |
| 报告期末对子公司担保余额合计（B） | 100.02 |
| 公司担保总额情况（包括对子公司的担保） | |
| 担保总额（A+B） | 100.02 |
| 担保总额占公司净资产的比例（%） | 16.61 |
| 其中： | |
| 为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C） | |
| 直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D） | 100.02 |

| | |
|-----------------------|--|
| 担保总额超过净资产50%部分的金额 (E) | |
| 上述三项担保金额合计 (C+D+E) | 100.02 |
| 未到期担保可能承担连带清偿责任说明 | |
| 担保情况说明 | 报告期内,公司及其全资子公司存在对下属子公司融资类担保金额为人民币20.85亿元,非融资类担保金额为人民币9.79亿元。 |

注:公司美元担保金额按2020年12月末人民币兑美元即期汇率(1美元=6.5249人民币)折算,港元担保金额按2020年12月末人民币兑港元即期汇率(1港元=0.84164人民币)折算。

(三) 其他重大合同

适用 不适用

十六、其他重大事项的说明

适用 不适用

公司计提大额减值准备事项

根据《企业会计准则》相关规定和公司会计政策,为了更加真实公允地反映公司2020年度的财务状况以及2020年度的经营成果,经公司及下属子公司对有关资产进行预期信用损失的评估,公司2020年度共计提减值准备为人民币38.85亿元。其中,买入返售金融资产计提减值准备为人民币36.96亿元。详情请查阅公司公告(2020-066)、(2021-006)及合并财务报表项目注释11。

十七、积极履行社会责任的工作情况

(一) 上市公司扶贫工作情况

适用 不适用

一、精准扶贫规划

(一) 基本方略和总体目标

公司积极响应国家号召和证券行业指引,深入贯彻落实相关文件精神,践行精准扶贫工作。报告期内,公司持续积极落实证券行业“一司一县”、“一县一企”等倡议,同时积极响应上海市“双一百”村企结对精准扶贫行动等号召,找准精准扶贫发力点,履行社会责任,围绕产业扶贫、金融扶贫、教育扶贫、消费扶贫、公益扶贫等多个方面开展扶贫工作。

(二) 主要策略

1) 结合贫困县资源禀赋,因地制宜进行产业帮扶。在充分进行实地调研,了解各个贫困县特色资源的基础上,公司因地制宜地进行产业帮扶。目前,公司以湖北五峰、内蒙古莫旗等地为重点项目落地区域,着力帮助当地发展茶叶、菇娘果等特色产业,积极探索建立长效脱贫机制,以点带面地稳步推进结对帮扶县脱贫工作,做到重点突出、点面结合。

2) 坚持以产业扶贫为主,以消费渠道推动贫困县实现“造血”功能。公司在各项扶贫工作中,

重点坚持能为贫困县实现可持续发展的产业扶贫模式，并已取得初步成效。公司持续以产业扶贫为主，通过整合集团资源及互联网资源，包括联手知名电商网站、特色产业内知名企业等方式，共同促进贫困县当地特色产业发展，旨在长久地为贫困县实现产业“造血”功能。

3) 为贫困地区提供人才保障。公司在扶贫工作中坚持“扶贫先扶智”的工作思路，持续通过教育扶贫、金融知识讲座、职业技能培训等多种方式，为贫困县提供智力支持和输送相关人才，旨在帮助贫困县在实现脱贫后，继续保持稳定健康发展。

4) 充分利用金融企业优势，创新精准扶贫新模式。公司持续发挥金融企业优势，通过“保险+期货”扶贫等方式帮助众多贫困县农户化解农产品价格波动风险，并充分整合并利用相关资源，创新精准扶贫模式，旨在为精准脱贫提供更多具有参考意义和可复制性的案例。

5) 强化扶贫项目过程管理，推动精准扶贫工作顺利落地。公司内部成立扶贫工作领导小组，确立每年精准扶贫的重点工作，并通过与结对帮扶贫困县日常工作联系机制、实地走访调研、事中事后反馈机制等，做好扶贫项目过程管理，保障扶贫项目顺利开展，确保扶贫项目落实到位。

二、年度精准扶贫概要

在中国证监会和中国证券业协会的指导和倡议下，公司积极响应国家号召和行业指引，扎实推进精准扶贫工作。截至 2020 年年末，公司及旗下子公司先后与内蒙古莫旗、吉林省通榆县、山西省静乐县、四川省沐川县、湖北省五峰县、宁夏盐池县、陕西省延长县、甘肃省秦安县、云南省景谷县、云南省澜沧县、云南省孟连县、江西省南康市、云南省富宁县、黑龙江省绥滨县、新疆麦盖提、河南省桐柏县、黑龙江省林甸县、云南省西畴县等 18 个国家级贫困县签署了结对帮扶协议，开展精准扶贫工作。

报告期内，公司在扶贫方面投入资金共计 2,013.49 万元，开展扶贫项目共计 23 个。其中，产业扶贫项目 5 个，投入扶贫资金 784.23 万元；金融扶贫项目 6 个，投入扶贫资金 934.19 万元；教育扶贫项目 2 个，投入扶贫资金 72.60 万元；消费扶贫项目 3 个，投入资金 10.99 万元；公益扶贫项目 7 个，投入扶贫资金 211.48 万元。

1. 持续实施湖北五峰“东方红精选明前春茶”“东方红宜红茶”产业扶贫项目

2017 年 9 月，公司与湖北五峰土家族自治县人民政府签订了精准扶贫结对帮扶协议。公司经过多次实地调研后发现，五峰县位于北纬 30 度的鄂西边陲，有着得天独厚的地貌环境，当地山高、雨多、雾厚，昼夜温差大，非常适合茶叶的生长。同时五峰县近半耕地种茶，全县三分之二人口从事茶叶产业，茶叶产业的发展对当地脱贫攻坚至关重要。为此，公司于 2018 年首次实施了“东方红宜红茶”产业扶贫项目，并取得了较好的成效。

报告期内，为进一步促进五峰茶叶产业发展，公司在当地持续开展了特色茶叶产业扶贫工作，并持续实施了“东方红精选明前春茶”“东方红宜红茶”产业扶贫项目。公司结合各方资源，共同推动“东方红精选明前春茶”“东方红宜红茶”项目顺利落地实施。其中，公司聘请了专业的插画设计师，结合五峰当地特有的珍稀动物、植物元素为当地茶叶设计了春茶独特的外包装，并以“打

开美好”为主题设计了宜红茶外包装，从而进一步推广五峰当地风土人情，并广受好评；同时，公司借助旗下资产管理“东方红”品牌的影响力，打造“东方红精选明前春茶”“东方红宜红茶”品牌，通过品牌的打造建立持久的市场竞争力和溢价能力。

2. 积极在云南省富宁县开展村企结对帮扶工作

2018年，公司积极响应上海市“双一百”村企结对精准扶贫行动号召，对口帮扶云南省富宁县，并进一步与富宁县谷拉乡平蒙村签订村企结对帮扶协议。

报告期内，公司持续在云南省富宁县推进精准扶贫工作。公司前期出资援建的谷拉乡平蒙村1条进村道路硬化项目已实施完成并投入使用；新增援建的1条进村道路硬化项目已实施完成并投入使用，此外公司还援建LED太阳能路灯项目及当地特色产业扶贫项目，有效方便了当地村民出行及促进村内经济发展。

3. 稳步推进内蒙古莫旗“东方菇娘”产业扶贫

2017年以来，公司在结对帮扶县之一的内蒙古莫旗，选择当地特色产业菇娘作为产业扶贫的重点，成功打造了“东方菇娘”品牌。报告期内，公司继续从促进当地产业链升级的角度出发，顺利推进实施了内蒙古莫旗“东方菇娘”产业扶贫项目。

报告期内，公司连续第四年完成实施了“东方菇娘”产业项目，公司在当地援建的仓储转运基地项目顺利运行，有效地优化了当地菇娘果收果、存储、晾晒等环节，直接提升了产品质量，并方便了当地果农进行售卖；持续为莫旗菇娘果推广及传播设计整体方案，进一步提高产品知名度；完善与本来生活网合作机制，借助集团优势和直播电商渠道优势，加大对菇娘产品的推广、销售力度，惠及当地更多贫困农户。

4. 持续推进教育扶贫项目

报告期内，公司在内蒙古莫旗持续开展的教育扶贫工作顺利落地。公司通过学生申请、学校及当地扶贫办审核的方式来确定需要帮扶学生的具体人数，持续进行贫困生资助项目，并将扶贫资金精准发放至建档立卡贫困生家庭中，资助贫困高中生顺利完成学业。报告期内，公司共计为内蒙古莫旗尼尔基第一中学242名贫困学生提供资助，资助金额合计为72.60万元。公司已先后在莫旗尼尔基第一中学开展了八期扶贫资助项目，惠及贫困学生约820人次，合计资助金额超过240万元。

三、精准扶贫成效

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币

| 指 标 | 数量及开展情况 |
|---------------------|----------|
| 一、总体情况 | |
| 其中：1. 资金 | 2,013.49 |
| 2. 物资折款 | 0 |
| 3. 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人） | 728 |
| 二、分项投入 | |

| | |
|--|---|
| 1. 产业发展脱贫 | |
| 其中：1.1 产业扶贫项目类型 | <input checked="" type="checkbox"/> 农林产业扶贫 <input type="checkbox"/> 旅游扶贫 <input checked="" type="checkbox"/> 电商扶贫 <input type="checkbox"/> 资产收益扶贫 <input type="checkbox"/> 科技扶贫 <input checked="" type="checkbox"/> 其他 |
| 1.2 产业扶贫项目个数（个） | 5 |
| 1.3 产业扶贫项目投入金额 | 784.23 |
| 1.4 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人） | |
| 2. 转移就业脱贫 | |
| 其中：2.1 职业技能培训投入金额 | |
| 2.2 职业技能培训人数（人/次） | |
| 2.3 帮助建档立卡贫困户实现就业人数(人) | 248 |
| 3. 易地搬迁脱贫 | |
| 其中：3.1 帮助搬迁户就业人数（人） | |
| 4. 教育脱贫 | |
| 其中：4.1 资助贫困学生投入金额 | 72.60 |
| 4.2 资助贫困学生人数（人） | 242 |
| 4.3 改善贫困地区教育资源投入金额 | |
| 5. 健康扶贫 | |
| 其中：5.1 贫困地区医疗卫生资源投入金额 | |
| 6. 生态保护扶贫 | |
| 其中：6.1 项目名称 | <input type="checkbox"/> 开展生态保护与建设 <input type="checkbox"/> 建立生态保护补偿方式 <input type="checkbox"/> 设立生态公益岗位 <input type="checkbox"/> 其他 |
| 6.2 投入金额 | |
| 7. 兜底保障 | |
| 其中：7.1 帮助“三留守”人员投入金额 | |
| 7.2 帮助“三留守”人员数（人） | |
| 7.3 帮助贫困残疾人投入金额 | |
| 7.4 帮助贫困残疾人数（人） | |
| 8. 社会扶贫 | |
| 其中：8.1 东西部扶贫协作投入金额 | |
| 8.2 定点扶贫工作投入金额 | |
| 8.3 扶贫公益基金 | |
| 9. 其他项目 | |
| 其中：9.1 项目个数（个） | 16 |
| 9.2 投入金额 | 1,156.66 |
| 9.3 帮助建档立卡贫困人口脱贫数（人） | |
| 9.4 其他项目说明 | 包括金融扶贫、消费扶贫及公益扶贫等 |
| 三、所获奖项（内容、级别） | |
| 2020年9月，公司荣获中国经营报“年度社会责任贡献奖”； 2020年11月，公司在MSCI ESG评级中连续三年保持BBB级； 2020年12月，公司获评新浪财经“责任投资最佳证券公司”； 2020年12月，公司荣获财联社“中国企业ESG最佳案例奖”。 | |

四、后续精准扶贫计划

1. 推进重点产业扶贫项目

公司结合其产业资源禀赋，已因地制宜地开展了多个产业扶贫项目，包括内蒙古莫旗东方菇娘项目、湖北五峰东茶叶产业项目等等，并已取得较好的扶贫成效。未来，公司计划继续坚持产业扶贫为主的思路，适时推进在多个贫困县已开展的重点产业扶贫项目，助力当地产业可持续发展的目标，助力贫困地区人民实现美好生活。

2. 积极做好“双一百”结对帮扶工作

公司积极响应上海市国资委“百企帮百村”活动号召，对接帮扶云南文山州富宁县谷拉乡平蒙村。公司持续以“三带两转”，即带人、带物、带产业，转观念和转村貌为工作重点，着力解决当地贫困群众关心的急难愁问题，确保精准扶贫工作达到预期效果，助力富宁县及对口贫困村可持续发展。

3. 持续做好各项公益扶贫工作

根据实地调研及贫困县实际需求情况，公司及旗下子公司开展了包括援建基础设施、捐赠办公物资、为小学生捐赠学习及生活物品等在内的各项公益扶贫项目，有效地完善和充实了公司的精准扶贫工作。未来，公司计划继续借助旗下心得益彰公益基金会等力量，持续做好各项公益扶贫工作。

(二) 社会责任工作情况

适用 不适用

有关公司的环境政策及表现、公司遵守对该公司有重大影响的有关法律及规例的情况及公司与其雇员、顾客及供应商的重要关系的说明，请参见公司于 2021 年 3 月 30 日在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 以及公司网站 (<http://www.dfzq.com.cn>) 披露的《2020 年东方证券环境、社会责任及管治报告》。

(三) 环境信息情况

1. 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其重要子公司的环保情况说明

适用 不适用

2. 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

适用 不适用

3. 重点排污单位之外的公司未披露环境信息的原因说明

适用 不适用

4. 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

(四) 其他说明

适用 不适用

公司所处的行业是金融证券业，主要经营业务为证券经纪；融资融券；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券承销（限国债、地方债等政府债、政策性银行金融债、银行间市场交易商协会主管的融资品种（包括但不限于非金融企业债务融资工具））；股票期权做市业务；证券投资基金托管。

在低碳经济的背景下，公司始终倡导与推行“绿色办公，低碳生活”的理念，寻求节能、环保、高效的管理模式，将绿色环保的理念融入公司的经营管理中。

在节能减排方面，公司自建中山南路数据中心不断创新节能举措，通过采用室内微模块行级制冷、冷通道封闭以及使用高效的模块化不间断电源等方式，提高能源使用率；鼓励使用公共交通及同行共同用车，严格管控公司自有车辆出行；鼓励使用电话视频会议系统进行线上沟通，减少现场会议数量，降低因差旅出行产生的碳排放。在节约水资源方面，公司卫生间安装感应龙头，防止忘记关水现象；定期及时地巡检、维修用水设备，消除跑冒滴漏现象。在纸张管理方面，公司所有通知利用 OA 系统公布，推进无纸化办公；社会责任报告印刷使用通过森林管理委员会(FSC)认证的纸张，保障纸张来源于可持续发展的、合法的且允许采伐的森林资源，助力环境可持续发展。

在环保理念宣导方面，2020 年公司举办“这一刻，我们一起爱地球”环保主题活动，向全体员工发起环保倡议。公司通过举办环保主题摄影展、鼓励员工参与“咖啡渣回收”计划、“旧衣回收”环保计划等，倡导员工保护自然生态，以实际行动减少资源浪费。

此外，作为绿色金融的践行者，公司积极倡导绿色发展理念，通过债券发行、企业挂牌等手段为绿色环保企业的业务发展、产业升级、战略布局提供全方位的服务，助力绿色金融成为我国经济转型与发展的新引擎。

报告期内，公司不存在因违反环保方面的法律法规而受到处罚的情况。

十八、可转换公司债券情况

适用 不适用

第六节 普通股股份变动及股东情况

一、普通股股本变动情况

(一) 普通股股份变动情况表

1、普通股股份变动情况表

单位：股

| | 本次变动前 | | 本次变动增减（+，-） | | | | | 本次变动后 | |
|--------------|---------------|--------|-------------|----|-------|-------------|-------------|---------------|--------|
| | 数量 | 比例（%） | 发行新股 | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 | 数量 | 比例（%） |
| 一、有限售条件股份 | 289,215,263 | 4.14 | - | - | - | -59,215,263 | -59,215,263 | 230,000,000 | 3.29 |
| 1、国家持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 2、国有法人持股 | 289,215,263 | 4.14 | - | - | - | -59,215,263 | -59,215,263 | 230,000,000 | 3.29 |
| 3、其他内资持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其中：境内非国有法人持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 境内自然人持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 4、外资持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其中：境外法人持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 境外自然人持股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 二、无限售条件流通股 | 6,704,440,540 | 95.86 | - | - | - | 59,215,263 | 59,215,263 | 6,763,655,803 | 96.71 |
| 1、人民币普通股 | 5,677,360,540 | 81.18 | | | | 59,215,263 | 59,215,263 | 5,736,575,803 | 82.03 |
| 2、境内上市的外资股 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 3、境外上市的外资股 | 1,027,080,000 | 14.68 | - | - | - | - | - | 1,027,080,000 | 14.68 |
| 4、其他 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 三、普通股股份总数 | 6,993,655,803 | 100.00 | - | - | - | - | - | 6,993,655,803 | 100.00 |

2、普通股股份变动情况说明

 适用 不适用

报告期内，公司普通股股份总数、A股及H股股数均未发生增减变动。

上海海烟投资管理有限公司所持有的 59,215,263 股非公开发行限售股股票于 2020 年 12 月 28 日限售期届满并上市流通，截至报告期末，公司无限售条件流通股为 6,763,655,803 股，占总股份比例为 96.71%，有限售条件流通股为 230,000,000 股，占总股份比例为 3.29%（相关限售股上市流通公告详见 2020 年 12 月 22 日披露的公告 2020-090）。

3、普通股股份变动对最近一年和最近一期每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）

 适用 不适用

4、 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

(二) 限售股份变动情况

适用 不适用

单位：股

| 股东名称 | 年初限售股数 | 本年解除限售股数 | 本年增加限售股数 | 年末限售股数 | 限售原因 | 解除限售日期 |
|--------------|-------------|------------|----------|-------------|-----------|-------------|
| 申能(集团)有限公司 | 230,000,000 | - | - | 230,000,000 | 非公开发行股份限售 | 2021年12月28日 |
| 上海海烟投资管理有限公司 | 59,215,263 | 59,215,263 | - | - | 非公开发行股份限售 | 2020年12月28日 |
| 合计 | 289,215,263 | 59,215,263 | - | 230,000,000 | / | / |

二、 证券发行与上市情况

(一) 截至报告期内证券发行情况

适用 不适用

单位：亿股 币种：人民币

| 股票及其衍生证券的种类 | 发行日期 | 发行价格(或利率) | 发行数量 | 上市日期 | 获准上市交易数量 | 交易终止日期 |
|----------------------|------------|-----------|------|------------|----------|------------|
| 普通股股票类 | | | | | | |
| A股 | 2015-03-11 | 10.03元 | 10 | 2015-03-23 | 10 | / |
| H股 | 2016-06-22 | 港币8.15元 | 9.57 | 2016-07-08 | 9.57 | / |
| H股(超额配售) | 2016-07-28 | 港币8.15元 | 0.70 | 2016-08-03 | 0.70 | / |
| A股(非公开发行) | 2017-12-28 | 14.21元 | 7.78 | 2017-12-29 | 7.78 | / |
| 可转换公司债券、分离交易可转债、公司债类 | | | | | | |
| 证券公司债券 | 2015-11-26 | 3.90% | 120 | 2015-12-18 | 120 | 2020-11-26 |
| 证券公司债券 | 2017-06-09 | 5.30% | 40 | 2017-07-19 | 40 | 2020-06-09 |
| 证券公司债券 | 2017-06-09 | 5.50% | 10 | 2017-07-19 | 10 | 2022-06-09 |
| 证券公司债券 | 2017-08-03 | 4.98% | 40 | 2017-08-15 | 40 | 2027-08-03 |
| 证券公司债券 | 2019-11-25 | 3.50% | 49 | 2019-11-28 | 49 | 2022-11-25 |
| 证券公司债券 | 2020-03-24 | 2.70% | 20 | 2020-03-30 | 20 | 2021-03-24 |
| 证券公司债券 | 2020-03-24 | 2.95% | 30 | 2020-03-30 | 30 | 2022-03-24 |
| 证券公司债券 | 2020-06-18 | 3.45% | 40 | 2020-06-24 | 40 | 2023-06-18 |
| 证券公司债券 | 2020-08-19 | 3.50% | 40 | 2020-08-26 | 40 | 2023-08-19 |
| 证券公司债券 | 2020-09-28 | 3.75% | 35 | 2020-10-12 | 35 | 2023-09-28 |
| 证券公司债券 | 2020-11-04 | 3.65% | 35 | 2020-11-10 | 35 | 2023-11-04 |
| 次级债券 | 2016-11-14 | 3.45% | 40 | 2016-11-25 | 40 | 2021-11-14 |
| 次级债券 | 2017-04-26 | 4.90% | 15 | 2017-05-11 | 15 | 2020-04-26 |

| | | | | | | |
|--------|------------|-------------------|-----|------------|-----|------------|
| 次级债券 | 2017-04-26 | 5.10% | 15 | 2017-05-11 | 15 | 2022-04-26 |
| 次级债券 | 2017-05-15 | 5.15% | 15 | 2017-05-31 | 15 | 2020-05-15 |
| 次级债券 | 2017-05-15 | 5.35% | 15 | 2017-05-31 | 15 | 2022-05-15 |
| 次级债券 | 2018-07-12 | 5.18% | 64 | 2018-07-20 | 64 | 2020-07-12 |
| 次级债券 | 2019-03-19 | 4.20% | 60 | 2019-03-26 | 60 | 2022-03-19 |
| 次级债券 | 2019-06-14 | 4.20% | 40 | 2019-06-20 | 40 | 2022-06-14 |
| 永续次级债券 | 2020-08-26 | 4.75% | 50 | 2020-09-07 | 50 | / |
| 短期融资券 | 2019-10-25 | 3.02% | 40 | 2019-10-28 | 40 | 2020-01-22 |
| 短期融资券 | 2019-12-03 | 3.07% | 25 | 2019-12-04 | 25 | 2020-03-02 |
| 短期融资券 | 2020-01-20 | 2.78% | 40 | 2020-01-21 | 40 | 2020-04-17 |
| 短期融资券 | 2020-03-19 | 2.12% | 35 | 2020-03-20 | 35 | 2020-06-17 |
| 短期融资券 | 2020-06-03 | 1.58% | 30 | 2020-06-04 | 30 | 2020-08-31 |
| 短期融资券 | 2020-07-07 | 1.90% | 30 | 2020-07-08 | 30 | 2020-09-30 |
| 短期融资券 | 2020-07-28 | 2.60% | 35 | 2020-07-29 | 35 | 2020-10-23 |
| 短期融资券 | 2020-10-20 | 2.88% | 30 | 2020-10-21 | 30 | 2021-01-15 |
| 美元债 | 2017-11-30 | 3.625% | 5 | 2017-12-01 | 5 | 2022-11-30 |
| 美元债 | 2018-03-22 | 3.625% | 2.5 | 2018-07-23 | 2.5 | 2022-11-30 |
| 美元债 | 2019-08-20 | 6M LIBOR+1.25% | 3 | 2019-08-21 | 3 | 2022-08-20 |
| 美元债 | 2019-09-18 | 4.03% | 1.6 | 未上市 | 不适用 | 2020-09-15 |
| 欧元债 | 2019-08-20 | 0.625% | 2 | 2019-08-21 | 2 | 2022-08-20 |
| 新币债 | 2019-09-27 | 2.90% | 2 | 2019-09-30 | 2 | 2022-09-27 |
| 美元债 | 2020-10-13 | 2.40% | 1.6 | 未上市 | 不适用 | 2023-10-13 |

注：上述表格中的美元债、欧元债、新币债的发行数量和上市交易数量均以美元、欧元、新币列示。

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

√适用 □不适用

1、境内债务融资工具

2020年3月27日，公司第四届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》，并经2020年5月15日召开的2019年年度股东大会审议通过，境内债务融资工具待偿还余额合计不超过上一年度经审计净资产（母公司）的200%，授权有效期至2023年5月15日。

公司向中国人民银行申请并取得了《中国人民银行关于核定东方证券股份有限公司短期融资券最高待偿还余额的通知》（银发[2019]50号）。根据该通知，中国人民银行核定公司待偿还短期融资券的最高余额167亿元，自该通知印发之日起持续有效；在此范围内，公司可自主确定每期短期融资券的发行规模。

2020年1月20日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年第一期短期融资券。发行期限88天，发行规模为人民币40亿元，最终票面利率2.78%（公告编号：2020-003）。

2020年3月19日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年第二期短期融资券。发行期限90天，发行规模为人民币35亿元，最终票面利率2.12%（公告编号：2020-015）。

2020年6月3日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年第三期短期融资券。发行期限89天，发行规模为人民币30亿元，最终票面利率1.58%（公告编号：2020-041）。

2020年7月7日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年第四期短期融资券。发行期限85天，发行规模为人民币30亿元，最终票面利率1.90%（公告编号：2020-052）。

2020年7月28日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年第五期短期融资券。发行期限87天，发行规模为人民币35亿元，最终票面利率2.60%（公告编号：2020-058）。

2020年10月20日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年第六期短期融资券。发行期限87天，发行规模为人民币30亿元，最终票面利率2.88%（公告编号：2020-076）。

公司向上交所申请并取得了《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》（上证函[2020]160号）。该批复核准公司向合格投资者非公开发行总额不超过200亿元的公司债券，发行后可在上海证券交易所办理挂牌转让，上述额度将于2021年12月到期。

2020年3月24日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年非公开发行公司债券（第一期），品种一发行期限1年，发行规模为人民币20亿，票面利率2.70%，品种二发行期限2年，发行规模为人民币30亿，票面利率2.95%（公告编号：2020-17）。

2020年6月18日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年非公开发行公司债券（第二期），发行期限3年，发行规模为人民币40亿，票面利率3.45%。

公司向证监会申请并取得了《关于同意东方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[2020]1329号）。该批复同意公司向专业投资者公开发行总额不超过200亿元的公司债券，发行后可在上海证券交易所办理上市交易，上述额度将于2022年12月到期。

2020年8月19日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期），发行期限3年，发行规模为人民币40亿，票面利率3.50%。

2020年9月28日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第二期），发行期限3年，发行规模为人民币35亿，票面利率3.75%。

2020年11月4日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第三期），发行期限3年，发行规模为人民币35亿，票面利率3.65%。

公司向证监会申请并取得了《关于东方证券股份有限公司发行永续次级债券有关意见的复函》（机构部函[2020]1577号）。该批复核准公司公开发行总额不超过80亿元的永续次级债券，发行后可在上海证券交易所办理上市交易。

2020年8月26日，公司完成发行东方证券股份有限公司2020年公开发行永续次级债券（第一期），发行期限3年，发行规模为人民币50亿，票面利率4.75%。

公司向上交所申请并取得了《关于对东方证券股份有限公司非公开发行次级公司债券挂牌转让无异议的函》（上证函[2020]1843号）。该批复核准公司向专业投资者非公开发行总额不超过

140亿元的次级公司债券，发行后可在上海证券交易所办理挂牌转让，上述额度将于2021年12月到期。

公司向证监会申请并取得了《关于同意东方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[2020]2673号）。该批复同意公司向专业投资者公开发行总额不超过170亿元的短期公司债券，发行后可在上海证券交易所办理上市交易，上述额度将于2022年12月到期，首期发行应于2021年12月底前完成。

2、境外债务融资工具

2019年3月28日，公司第四届董事会第十次会议审议通过《关于公司发行境外债务融资工具一般性授权的议案》，并经2019年5月28日召开的公司2018年年度股东大会审议通过，授权公司或公司的境外全资附属公司或公司在境外设立的直接或间接全资附属离岸公司作为境外债务融资工具的发行主体，一次或多次或多期、公开或非公开发行境外债务融资工具，规模为发行后待偿还余额上限合计不超过人民币200亿元，授权有效期至2022年5月28日。

2020年10月13日，公司间接持股的境外全资子公司 Orient HongSheng Limited 完成非公开发行 1.6 亿美元债券，到期日为 2023 年 10 月 13 日，票面利率 2.40%，东方金融控股（香港）有限公司作为担保人为其提供全额本息担保（公告编号：2020-073）。

(二) 公司普通股股份总数及股东结构变动及公司资产和负债结构的变动情况

适用 不适用

报告期内，公司普通股股份总数、A 股及 H 股股数均未发生增减变动，上海海烟投资管理有限公司所持有的 59,215,263 股非公开发行限售股限售期届满并上市流通。截至报告期末，公司无限售条件流通股为 6,763,655,803 股，占总股份比例为 96.71%，有限售条件流通股为 230,000,000 股，占总股份比例为 3.29%。公司资产和负债结构变动情况详见本报告“第四节、二、（三）资产、负债情况分析”。

(三) 现存的内部职工股情况

适用 不适用

三、股东和实际控制人情况

(一) 股东总数

| | |
|-------------------------|---------|
| 截止报告期末普通股股东总数(户) | 146,509 |
| 年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户) | 149,809 |

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

单位:股

| 前十名股东持股情况 | | | | | | | |
|-----------------------|-------------------|---------------|---------------|---------------------|-------------|----|-------------|
| 股东名称 (全称) | 报告期内 增减 | 期末持股数量 | 比例 (%) | 持有有限售 条件股份数 量 | 质押或 冻结情况 | | 股东 性质 |
| | | | | | 股份 状态 | 数量 | |
| 申能(集团)有限公司 | 0 | 1,767,522,422 | 25.27 | 230,000,000 | 无 | - | 国有法人 |
| 香港中央结算(代理人)有限公司 | 1,150 | 1,026,968,730 | 14.68 | - | 无 | - | 境外法人 |
| 上海海烟投资管理有限 公司 | 0 | 345,486,596 | 4.94 | - | 无 | - | 国有法人 |
| 上海报业集团 | -3,998,900 | 237,744,006 | 3.40 | - | 无 | - | 国有法人 |
| 中国证券金融股份有限 公司 | 0 | 209,110,425 | 2.99 | - | 无 | - | 未知 |
| 浙能资本控股有限公司 | 0 | 208,700,000 | 2.98 | - | 无 | - | 国有法人 |
| 中国邮政集团有限公司 | 0 | 178,743,236 | 2.56 | - | 无 | - | 国有法人 |
| 香港中央结算有限公司 | 55,560,310 | 136,286,073 | 1.95 | - | 无 | - | 境外法人 |
| 上海建工集团股份有限 公司 | 0 | 133,523,008 | 1.91 | - | 无 | - | 国有法人 |
| 上海金桥出口加工区开 发股份有限公司 | -5,520,882 | 133,140,504 | 1.90 | - | 无 | - | 境内非国 有法人 |
| 前十名无限售条件股东持股情况 | | | | | | | |
| 股东名称 | 持有无限售条件 流通股的数量 | 股份种类及数量 | | | | | |
| | | 种类 | 数量 | | | | |
| 申能(集团)有限公司 | 1,537,522,422 | 人民币普通股 | 1,537,522,422 | | | | |
| 香港中央结算(代理人)有限公司 | 1,026,968,730 | 境外上市外资股 | 1,026,968,730 | | | | |
| 上海海烟投资管理有限 公司 | 345,486,596 | 人民币普通股 | 345,486,596 | | | | |
| 上海报业集团 | 237,744,006 | 人民币普通股 | 237,744,006 | | | | |
| 中国证券金融股份有限 公司 | 209,110,425 | 人民币普通股 | 209,110,425 | | | | |
| 浙能资本控股有限公司 | 208,700,000 | 人民币普通股 | 208,700,000 | | | | |
| 中国邮政集团有限公司 | 178,743,236 | 人民币普通股 | 178,743,236 | | | | |
| 香港中央结算有限公司 | 136,286,073 | 人民币普通股 | 136,286,073 | | | | |
| 上海建工集团股份有限 公司 | 133,523,008 | 人民币普通股 | 133,523,008 | | | | |
| 上海金桥出口加工区开 发股份有限公司 | 133,140,504 | 人民币普通股 | 133,140,504 | | | | |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | 不适用 | | | | | | |

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

 适用 不适用

单位：股

| 序号 | 有限售条件 股东名称 | 持有的有限售 条件股份数量 | 有限售条件股份可上市交易情况 | | 限售条件 |
|------------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|----------|
| | | | 可上市交易时间 | 新增可上市交 易股份数量 | |
| 1 | 申能（集团） 有限公司 | 230,000,000 | 2021年12月28日 | - | 限售期为48个月 |
| 上述股东关联关系或一致行动的说明 | | | | 不适用 | |

(三) 战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

 适用 不适用

(四) 主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

于 2020 年 12 月 31 日，据公司及董事合理查询所深知，以下主要股东及其他人士（公司董事、监事及最高行政人员除外）于公司股份及相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 2 及 3 分部须向公司披露并根据《证券及期货条例》第 336 条规定须于备存之登记册所登记的权益及淡仓：

| 股东姓名/名称 | 股份类别 | 权益性质 | 股份数目 <small>(附注 1)</small> | 占公司已发行类别总股本之概约百分比 (%) <small>(附注 2)</small> | 约占公司已发行总股本之概约百分比 (%) <small>(附注 2)</small> |
|--|------|--------|----------------------------|---|--|
| 申能（集团）有限公司 | A 股 | 实益拥有人 | 1,767,522,422 (L) | 29.62 | 25.27 |
| 中国烟草总公司 <small>(附注 3)</small> | A 股 | 受控法团权益 | 345,486,596 (L) | 5.79 | 4.94 |
| 上海烟草集团有限责任公司 <small>(附注 3)</small> | A 股 | 受控法团权益 | 345,486,596 (L) | 5.79 | 4.94 |
| 上海海烟投资管理有限公司 <small>(附注 3)</small> | A 股 | 实益拥有人 | 345,486,596 (L) | 5.79 | 4.94 |
| 祝立家 <small>(附注 4)</small> | H 股 | 受控法团权益 | 94,940,800 (L) | 9.24 | 1.36 |
| 孙红艳 <small>(附注 4)</small> | H 股 | 受控法团权益 | 94,940,800 (L) | 9.24 | 1.36 |
| 红佳金融有限公司 <small>(附注 4)</small> | H 股 | 受控法团权益 | 94,940,800 (L) | 9.24 | 1.36 |
| Kaiser Century Investments Limited <small>(附注 4)</small> | H 股 | 实益拥有人 | 94,940,800 (L) | 9.24 | 1.36 |
| Raise Sino Investments Limited <small>(附注 5)</small> | H 股 | 实益拥有人 | 113,737,200 (L) | 11.07 | 1.63 |
| 交通银行股份有限公司 <small>(附注 6)</small> | H 股 | 受控法团权益 | 93,991,600 (L) | 9.15 | 1.34 |

| | | | | | |
|--|-----|--------|-----------------|-------|------|
| Bank of Communications (Nominee) Company Limited (附注 6) | H 股 | 受控法团权益 | 93,991,600 (L) | 9.15 | 1.34 |
| 交银国际资产管理有限公司 (附注 6) | H 股 | 受控法团权益 | 93,991,600 (L) | 9.15 | 1.34 |
| 交银国际控股有限公司 (附注 6) | H 股 | 受控法团权益 | 93,991,600 (L) | 9.15 | 1.34 |
| BOCOM International Global Investment Limited (附注 6) | H 股 | 实益拥有人 | 93,991,600 (L) | 9.15 | 1.34 |
| 上海宁泉资产管理有限公司 | H 股 | 投资经理 | 103,350,800 (L) | 10.06 | 1.48 |
| 汇添富基金管理股份有限公司 (代表汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划、汇添富-东方证券员工持股计划 2 号单一资产管理计划) (附注 7) | H 股 | 资产管理人 | 61,838,400 (L) | 6.02 | 0.88 |

附注:

1. (L) 代表好仓。
2. 于 2020 年 12 月 31 日, 公司已发行股份共 6,993,655,803 股, 其中包括 A 股 5,966,575,803 股及 H 股 1,027,080,000 股。
3. 上海海烟投资管理有限公司由上海烟草集团有限责任公司全资拥有, 而上海烟草集团有限责任公司由中国烟草总公司全资拥有。因此, 根据《证券及期货条例》, 中国烟草总公司及上海烟草集团有限责任公司分别被视为于上海海烟投资管理有限公司所持有本公司股份中拥有权益。
4. Kaiser Century Investments Limited 由红佳金融有限公司拥有全部权益。红佳金融有限公司由祝立家先生及其配偶孙红艳女士各自拥有 50% 权益。因此, 根据《证券及期货条例》, 祝立家先生、孙红艳女士及红佳金融有限公司分别被视为于 Kaiser Century Investments Limited 所持有本公司股份中拥有权益。
5. Raise Sino Investments Limited 由 Chu Lam Yiu 拥有全部权益。
6. BOCOM International Global Investment Limited 由交银国际资产管理有限公司全资拥有。交银国际资产管理有限公司由交银国际控股有限公司全资拥有, 而交银国际控股有限公司由 Bank of Communications (Nominee) Company Limited 全资拥有。Bank of Communications (Nominee) Company Limited 由交通银行股份有限公司全资拥有。因此, 根据《证券及期货条例》, 交通银行股份有限公司、Bank of Communications (Nominee) Company

Limited、交银国际控股有限公司及交银国际资产管理有限公司分别被视为于 BOCOM International Global Investment Limited 所持有本公司股份中拥有权益。

7. 根据本公司员工持股计划，汇添富基金管理股份有限公司（以资产管理人身份）透过汇添富 - 东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划及汇添富 - 东方证券员工持股计划 2 号单一资产管理计划购买及持有本公司股份。

除上文披露者外，于 2020 年 12 月 31 日，概无其他主要股东或人士于公司股份或相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第 336 条规定须予备存之登记册所记录之任何权益或淡仓。

(五) 董事、监事及最高行政人员于本公司及相联法团的股份、相关股份或债权证之权益及淡仓

于 2020 年 12 月 31 日，就公司所获得的资料及据董事所知，公司董事、监事及最高行政人员在公司或其相联法团（定义见《证券及期货条例》第 XV 部分）的股份、相关股份或债权证中概无拥有任何根据《证券及期货条例》第 XV 部及第 7 及 8 分部须通知公司及香港联交所的权益及淡仓（包括根据《证券及期货条例》的该等条文被当作或视为拥有的权益或淡仓），或根据《证券及期货条例》第 352 条规定须在存置之权益登记册中记录，或根据《标准守则》的规定需要通知公司和香港联交所之权益或淡仓。

四、控股股东及实际控制人情况

(一) 控股股东情况

1 法人

适用 不适用

2 自然人

适用 不适用

3 公司不存在控股股东情况的特别说明

适用 不适用

截至报告期末，公司第一大股东申能集团持股 25.27%。香港中央结算（代理人）有限公司所持股份为 H 股非登记股东所有。

4 报告期内控股股东变更情况索引及日期

适用 不适用

5 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用

(二) 实际控制人情况

1 法人

适用 不适用

2 自然人

适用 不适用

3 公司不存在实际控制人情况的特别说明

适用 不适用

截至报告期末，公司第一大股东申能集团持股 25.27%。公司不存在实际控制人。

4 报告期内实际控制人变更情况索引及日期

适用 不适用

5 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图

适用 不适用

6 实际控制人通过信托或其他资产管理方式控制公司

适用 不适用

(三) 控股股东及实际控制人其他情况介绍

适用 不适用

五、其他持股在百分之十以上的法人股东

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 法人 股东 名称 | 单位负责 人或法定 代表人 | 成立日期 | 组织机构代码 | 注册 资本 | 主要经营业务或 管理活动等情况 |
|----------------|--|------------------|--------------------|----------|---|
| 申能 集团 | 黄迪南 | 1996 年 11 月 18 日 | 913100001322718147 | 200 | 从事电力、能源基础产业的投资开发和管理，天然气资源的投资，城市燃气管网的投资，房地产、高科技产业投资管理，实业投资，资产经营，国内贸易（除专项规定）。【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】 |
| 情况 说明 | 1、截至报告期末，申能集团对公司的持股比例为 25.27%。 2、香港中央结算（代理人）有限公司所持股份为 H 股非登记股东所有。 | | | | |

六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

七、回购、出售或赎回本公司之证券

报告期内，公司及附属公司没有回购、出售或赎回公司证券。惟代表本公司或附属公司的客户以代理人身份而进行买卖者除外。

第七节 优先股相关情况

适用 不适用

第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

一、持股变动情况及报酬情况

(一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动及报酬情况

√适用 □不适用

单位：股

| 姓名 | 职务(注) | 性别 | 年龄 | 任期 起始日期 | 任期 终止日期 | 年初 持股数 | 年末 持股数 | 年度内股份 增减变动量 | 增减变动 原因 | 报告期内从 公司获得的 税前报酬总 额(万元) | 是否在公司 关联方 获取报酬 |
|-----|---------|----|--------|------------|------------|-----------|-----------|----------------|------------|----------------------------------|----------------------|
| 宋雪枫 | 党委书记 | 男 | 1970 年 | 2020-09-09 | / | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| | 执行董事 | | | 2021-03-05 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 金文忠 | 党委副书记 | 男 | 1964 年 | 2010-09-08 | / | 0 | 0 | 0 | 无 | 311.74 | 否 |
| | 执行董事 | | | 2010-09-27 | 2024-03-04 | | | | | | |
| | 董事长 | | | 2021-03-05 | 2024-03-04 | | | | | | |
| | 总裁 | | | 2010-09-27 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 俞雪纯 | 非执行董事 | 男 | 1964 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 刘 炜 | 非执行董事 | 男 | 1973 年 | 2018-03-14 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 周东辉 | 非执行董事 | 男 | 1969 年 | 2020-05-15 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 程 峰 | 非执行董事 | 男 | 1971 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 任志祥 | 非执行董事 | 男 | 1969 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 朱 静 | 职工董事 | 女 | 1969 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 许志明 | 独立非执行董事 | 男 | 1961 年 | 2016-07-08 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 16.00 | 否 |
| 靳庆鲁 | 独立非执行董事 | 男 | 1972 年 | 2017-10-16 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 19.00 | 否 |
| 吴 弘 | 独立非执行董事 | 男 | 1956 年 | 2020-12-08 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 1.58 | 否 |
| 冯兴东 | 独立非执行董事 | 男 | 1977 年 | 2020-12-08 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 1.33 | 否 |

| | | | | | | | | | | | |
|-------------|--------|---|--------|------------|------------|---|---|----|---|--------|---|
| 张 芊 | 监事会主席 | 男 | 1974 年 | 2018-03-06 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| | 股东代表监事 | | | 2018-05-23 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 杜卫华 | 党委副书记 | 男 | 1964 年 | 2020-01-10 | / | 0 | 0 | 0 | 无 | 288.56 | 否 |
| | 职工董事 | | | 2018-03-06 | 2020-02-14 | | | | | | |
| | 副总裁 | | | 2015-08-13 | 2020-02-14 | | | | | | |
| | 监事会副主席 | | | 2020-02-19 | 2024-03-04 | | | | | | |
| | 职工代表监事 | | | 2020-02-14 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 吴俊豪 | 非执行董事 | 男 | 1965 年 | 2011-03-29 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| | 股东代表监事 | | | 2021-03-05 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 张 健 | 股东代表监事 | 男 | 1965 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 沈广军 | 股东代表监事 | 男 | 1979 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 佟 洁 | 股东代表监事 | 女 | 1968 年 | 2018-03-06 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 夏立军 | 独立监事 | 男 | 1976 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 阮 斐 | 职工代表监事 | 女 | 1971 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 丁 艳 | 职工代表监事 | 女 | 1979 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 舒 宏 | 副总裁 | 男 | 1967 年 | 2014-04-16 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 00 | 无 | 288.56 | 否 |
| | 首席信息官 | | | 2019-06-13 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 张建辉 | 副总裁 | 男 | 1968 年 | 2015-07-24 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 288.56 | 否 |
| | 财务总监 | | | 2012-01-11 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 鲁伟铭 | 副总裁 | 男 | 1971 年 | 2020-09-11 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 717.70 | 否 |
| | 总裁助理 | | | 2018-11-22 | 2020-09-11 | | | | | | |
| 杨 斌 | 副总裁 | 男 | 1972 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 435.00 | 否 |
| | 首席风险官 | | | 2015-05-08 | 2024-03-04 | | | | | | |
| | 合规总监 | | | 2015-05-08 | 2024-03-04 | | | | | | |
| 徐海宁 | 副总裁 | 女 | 1970 年 | 2021-03-05 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 507.00 | 否 |
| | 总裁助理 | | | 2018-11-22 | 2021-03-05 | | | | | | |
| 王如富 | 董事会秘书 | 男 | 1973 年 | 2016-11-28 | 2024-03-04 | 0 | 0 | 0 | 无 | 280.12 | 否 |
| 潘鑫军 (离任) | 党委书记 | 男 | 1961 年 | 2010-01-06 | 2020-09-09 | 0 | 0 | 0 | 无 | 295.74 | 否 |
| | 执行董事 | | | 2010-01-28 | 2020-10-16 | | | | | | |
| | 董事长 | | | 2010-01-28 | 2020-10-16 | | | | | | |

| | | | | | | | | | | | |
|-------------|---------|---|-------|------------|------------|---|---|---|---|--------|---|
| 陈斌 (离任) | 非执行董事 | 男 | 1981年 | 2014-10-29 | 2020-03-27 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 李翔 (离任) | 非执行董事 | 男 | 1971年 | 2014-10-29 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 夏晶寒 (离任) | 非执行董事 | 女 | 1969年 | 2018-03-12 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 许建国 (离任) | 非执行董事 | 男 | 1964年 | 2016-11-08 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 陈晓波 (离任) | 职工董事 | 男 | 1973年 | 2020-03-05 | 2020-11-18 | 0 | 0 | 0 | 无 | 260.45 | 否 |
| 徐国祥 (离任) | 独立非执行董事 | 男 | 1960年 | 2014-10-29 | 2020-12-08 | 0 | 0 | 0 | 无 | 16.00 | 否 |
| 陶修明 (离任) | 独立非执行董事 | 男 | 1964年 | 2014-10-29 | 2020-12-08 | 0 | 0 | 0 | 无 | 16.00 | 否 |
| 尉安宁 (离任) | 独立非执行董事 | 男 | 1963年 | 2014-10-29 | 2020-12-08 | 0 | 0 | 0 | 无 | 19.00 | 否 |
| 何炫 (离任) | 独立非执行董事 | 男 | 1982年 | 2020-12-08 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 1.33 | 否 |
| 李宾 (离任) | 党委副书记 | 男 | 1959年 | 2014-03-14 | 2020-01-10 | 0 | 0 | 0 | 无 | 6.40 | 否 |
| | 监事会副主席 | | | 2014-11-21 | 2020-02-14 | | | | | | |
| | 职工代表监事 | | | 2014-11-21 | 2020-02-14 | | | | | | |
| 黄来芳 (离任) | 股东代表监事 | 女 | 1969年 | 2018-03-06 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 刘文彬 (离任) | 股东代表监事 | 男 | 1975年 | 2011-03-29 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 尹克定 (离任) | 股东代表监事 | 男 | 1964年 | 2014-10-30 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 是 |
| 吴正奎 (离任) | 股东代表监事 | 男 | 1974年 | 2012-03-19 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 0 | 否 |
| 周文武 (离任) | 职工代表监事 | 男 | 1961年 | 2015-08-11 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 266.12 | 否 |

| | | | | | | | | | | | |
|-------------|--------|---|--------|------------|------------|---|---|---|---|----------|---|
| 姚远 (离任) | 职工代表监事 | 男 | 1973 年 | 2014-10-29 | 2021-03-05 | 0 | 0 | 0 | 无 | 356.79 | 否 |
| 杨玉成 (离任) | 副总裁 | 男 | 1965 年 | 2009-08-18 | 2020-05-18 | 0 | 0 | 0 | 无 | 235.28 | 否 |
| 合计 | / | / | / | / | / | | | | / | 4,628.26 | / |

注：

1、公司 2021 年第一次临时股东大会于 2021 年 3 月 5 日召开，会议选举产生第五届董事会非职工董事和监事会非职工代表监事，与 2021 年 2 月 9 日召开的职工代表大会选举产生的职工董事和职工代表监事共同组成公司第五届董事会和监事会。公司第五届董事会由执行董事宋雪枫先生、金文忠先生，非执行董事俞雪纯先生、刘炜先生、周东辉先生、程峰先生、任志祥先生，职工董事朱静女士，独立非执行董事许志明先生、靳庆鲁先生、吴弘先生和冯兴东先生组成；公司第五届监事会由股东代表监事张芊先生、吴俊豪先生、张健先生、沈广军先生、佟洁女士，独立监事夏立军先生，职工代表监事杜卫华先生、阮斐女士及丁艳女士组成。公司第五届董事会于 2021 年 3 月 5 日召开第一次会议，会议选举金文忠先生为公司第五届董事会董事长、总裁，选举公司第五届董事会专门委员会委员及主任委员并聘任了公司新一届高级管理人员；公司第五届监事会于 2021 年 3 月 5 日召开第一次会议，会议选举张芊先生为公司监事会主席，选举杜卫华先生为公司监事会副主席。

2、报告期内，公司内部董事、监事和高级管理人员报告期内从公司取得的报酬，包含 2020 年度发放的工资、2019 年度绩效奖金以及 2016-2018 年度任期激励按规定在 2020 年发放的部分。

3、报告期内，公司董事、监事和高级管理人员均未直接持有公司股份、期权（通过资管计划间接持有公司 H 股情况详见本报告“第五节、十三、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响”），公司未实施股权激励计划。

4、公司报告期内及期后发生的董事、监事及高级管理人员的变动情况请详见本章节四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况。

| 姓名 | 主要工作经历 |
|-----|--|
| 宋雪枫 | 1970 年生，中共党员，管理学博士研究生，正高级经济师、注册会计师。现任公司党委书记、执行董事，申能（集团）有限公司党委委员、副总裁，上海申能能创能源发展有限公司董事长，国家中小企业发展基金有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司董事长。曾任申能股份有限公司财务部主管，2001 年 3 月至 2008 年 5 月担任申能股份有限公司财务部副经理、经理，2005 年 3 月至 2011 年 4 月担任申能股份有限公司总经理助理兼财务部经理、总会计师兼财务部经理、副总经理兼总会计师，2011 年 5 月至 2020 年 6 月担任申能股份有限公司监事 |

| | |
|-----|---|
| | 长（2010年11月至2011年11月挂职任四川自贡市市长助理），2012年1月至2014年8月担任申能（集团）有限公司总经理助理，2014年8月起担任申能（集团）有限公司副总裁，2016年12月起担任申能（集团）有限公司党委委员，2020年9月起担任公司党委书记，2021年3月起担任公司执行董事。 |
| 金文忠 | 1964年生，中共党员，经济学硕士研究生，经济师。现任公司党委副书记、董事长、总裁，上海东方证券资本投资有限公司董事长，上海东证期货有限公司董事，东方证券承销保荐有限公司董事长，上海东方证券创新投资有限公司董事。1992年1月至1995年9月担任万国证券发行部副经理、研究所副所长、总裁助理，1995年10月至1997年12月担任野村证券企业现代化委员会项目室副主任，1997年12月至2010年9月担任公司党委委员、副总经理，2016年3月至2017年3月兼任证券投资业务总部总经理，2010年9月起担任公司党委副书记、执行董事、总裁，2020年10月起代为履行董事长、法定代表人职责，2021年3月起担任公司董事长。 |
| 俞雪纯 | 1964年生，中共党员，工学学士，高级工程师。现任公司非执行董事，申能（集团）有限公司副总经济师、战略发展部总经理、职工监事，申能香港控股有限公司总经理，申能股份有限公司监事会主席，上海新世纪资信评估投资服务有限公司董事。曾任上海电气自动化研究所、上海南洋国际实业股份有限公司工程师，1995年11月至2005年4月担任申能股份有限公司市场部副主管、办公室主任、办公室副主任，2005年5月至2020年3月担任申能（集团）有限公司办公室副主任、资产管理部副经理、资产管理部经理、办公室主任，2012年9月起担任申能（集团）有限公司职工监事，2020年3月起担任申能（集团）有限公司副总经济师、战略发展部总经理。 |
| 刘 炜 | 1973年生，中共党员，法律硕士。现任公司非执行董事，申能（集团）有限公司纪委委员、党委组织部部长、人力资源部总经理，申能集团商务服务有限公司监事，上海申能诚毅股权投资有限公司董事。1996年7月至2001年12月担任上海市黄浦区人民法院执行庭书记员（科员）、经济庭书记员、经济庭助理审判员、办公室助理审判员（副科级），2001年12月至2013年5月担任上海市高级人民法院办公室助理审判员（副科级）、办公室助理审判员（正科级）、办公室综合科副科长、办公室院长办公室主任、审判员（副处级）、办公室副主任，2013年5月至2017年9月担任上海市委组织部办公室副主任、综合干部处副处长、调研员；2017年9月起担任申能（集团）有限公司人力资源部总经理，2020年5月起担任申能（集团）有限公司纪委委员，2020年12月起担任申能（集团）有限公司党委组织部部长。 |
| 周东辉 | 1969年生，中共党员，会计学本科，高级会计师。现任公司非执行董事，上海海烟投资管理有限公司董事、总经理，海通证券股份有限公司董事，中国太平洋保险（集团）股份有限公司董事。1991年7月至2000年9月担任上海烟草（集团）公司财务处科员、副科长，2000年9月至2008年9月担任中国烟草上海进出口有限责任公司财务部副经理、经理，2008年9月至2011年4月担任上海烟草（集团）公司投资管理处副处长，2010年8月至2011年4月担任上海海烟投资管理有限公司副总经理，2011年4月至2015年2月担任上海烟草集团有限责任公司财务处副处长、资金管理中心副主任，2015年2月至2015年7月担任上海烟草集团有限责任公司投资管理处常务副处长、上海海烟投资管理有限公司常务副总经理，2015年7月至2016年9月担任上海烟草集团有限责任公司投资管理处处长兼上海海烟投资管理有限公司董事、总经理，2016年9月起担任上海海烟投资管理有限公司董事、总经理。 |
| 程 峰 | 1971年生，中共党员，工商管理硕士。现任公司非执行董事，上海报业集团党委委员、副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长、上海 |

| | |
|-----|---|
| | <p>东方报业有限公司董事长、上海瑞力投资基金管理有限公司董事长、上海文化产权交易所股份有限公司董事长、上海新华传媒股份有限公司常务副董事长、上海东方明珠房地产有限公司董事、上海房地产时报社有限公司执行董事、汇添富基金管理股份有限公司董事、上海解放传媒信息发展有限公司执行董事、上海文汇新民实业股份有限公司执行董事、上海上报传悦置业发展有限公司董事长、上海申闻实业有限公司执行董事、上海东方票务有限公司董事长、上海上报实业有限公司董事长、上海界面财联社科技股份有限公司监事会主席、上海瑞壹投资管理有限公司董事长、上海瑞力金融信息服务有限公司董事长。1995年3月至2001年2月担任上海市外经贸委外经处科员、团委干事、委员、团委副书记、团委副书记（主持工作）、团委书记，2001年2月至2002年6月担任上海机械进出口（集团）有限公司副总裁，2002年6月至2005年4月担任上海市外经贸委技术进口处副处长、科技发展与技术贸易处副处长（主持工作）、处长，2005年4月至2009年6月担任上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任、行政管理总部总经理，2009年6月至2013年3月担任上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理、党委书记、董事长，2013年3月至2013年10月担任上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长，2013年10月起担任上海报业集团党委委员、副总经理。</p> |
| 任志祥 | <p>1969年生，中共党员，经济学博士。现任公司非执行董事，浙能资本控股有限公司党委副书记、董事兼总经理，浙江富浙投资有限公司董事，浙商财产保险股份有限公司副董事长，浙商银行股份有限公司董事。1995年8月至2001年8月担任浙江省水利水电工程局办公室办事员、工程师、团委书记，2004年6月至2007年2月担任浙江省国际信托投资有限责任公司投资银行部高级研究员、副总经理，2007年2月至2010年10月担任浙江省能源集团有限公司资产经营部高级主管，2010年10月至2019年10月担任浙江省能源集团有限公司战略管理与法律部主任经济师、副主任、主任，2019年10月起担任浙能资本控股有限公司党委副书记、总经理，2020年6月起担任浙能资本控股有限公司董事。</p> |
| 朱 静 | <p>1969年生，中共党员，经济学硕士。现任公司职工董事、战略发展总部总经理，东方金融控股（香港）有限公司董事、总经理，上海东证期货有限公司董事，东证国际金融集团有限公司董事，诚泰融资租赁（上海）有限公司监事会主席，长城基金管理有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司监事。1992年7月至1995年5月担任西安矿山机械厂职员；1995年5月至1999年2月担任上海财通国际投资管理有限公司证券管理部经理、副总经理；1999年3月至2015年1月担任公司经纪业务总部职员、业务规划董事、运行资深主管、总经理助理，营运管理总部总经理助理、副总经理，董事会办公室副主任；2015年2月起担任公司战略发展总部总经理。</p> |
| 许志明 | <p>1961年生，经济学博士。现任公司独立非执行董事，宽带资本创始合伙人，东凌集团有限公司董事，广州东凌实业投资集团有限公司董事，北京联航合众传媒科技有限公司董事，北京宝轩文化传媒有限公司董事。1986年12月至1999年8月历任中国国际信托投资公司国际研究所研究员、野村国际（香港）有限公司企业财务部联席总监及资本市场部联席总监、英国国民西敏银行董事兼大中华区投资银行部主管、美国波士顿银行董事兼大中华区企业融资部主管，1999年8月至2001年12月担任华润创业有限公司执行董事、华润北京置地有限公司执行董事、华润励致有限公司董事总经理兼首席运营官，2002年1月至2005年5月担任TOM集团有限公司高级顾问、TOM在线有限公司执行董事兼首席运营官，2006年3月起担任宽带资本创始合伙人。</p> |
| 靳庆鲁 | <p>1972年生，中共党员，会计学博士。现任公司独立非执行董事，上海财经大学会计学院院长、会计学教授、博士生导师。2005年6月至2011</p> |

| | |
|-----|---|
| | <p>年 6 月担任上海财经大学会计学院会计学助教授，2011 年 7 月至 2012 年 6 月担任上海财经大学会计学院会计学副教授，2012 年 7 月起担任上海财经大学会计学院会计学教授，2014 年 2 月至 2018 年 11 月担任上海财经大学会计与财务研究院副院长，2015 年 4 月至 2018 年 11 月担任上海财经大学会计学院副院长，2016 年 1 月至 2018 年 11 月担任上海财经大学会计改革与发展协同创新中心主任，2018 年 11 月起担任上海财经大学会计学院院长。</p> |
| 吴 弘 | <p>1956 年生，中共党员，法学学士。现任公司独立非执行董事，华东政法大学教授、博士生导师。上海浦东发展银行股份有限公司独立董事，浙江泰隆商业银行股份有限公司独立董事，西部利得基金管理有限公司独立董事，上海浦东发展集团财务有限责任公司独立董事。1984 年 7 月起任职华东政法大学，曾任华东政法大学经济法学院院长，中国银行法研究会副会长、中国商法学研究会常务理事、上海市法学会金融法研究会会长、上海金融法制研究会副会长、上海国际商务法律研究会副会长、历任国家司法考试命题委员会委员、上海市人大常委会立法咨询专家、上海市消费者权益保护委员会委员等。</p> |
| 冯兴东 | <p>1977 年生，中共党员，统计学博士研究生。现任公司独立非执行董事，上海财经大学统计与管理学院院长、统计学教授、博士生导师。2011 年 6 月至 2015 年 6 月担任上海财经大学统计与管理学院统计学助理教授、统计学副教授，2015 年 7 月起担任上海财经大学统计与管理学院教授、博士生导师，2019 年 11 月起担任上海财经大学统计与管理学院院长。</p> |
| 张 芊 | <p>1974 年生，中共党员，工商管理硕士，经济师。现任公司股东代表监事、监事会主席，申能(集团)有限公司党委委员、副总裁，上海申能能源服务有限公司董事长，成都市新申创业投资有限公司董事。1996 年 7 月加入申能(集团)有限公司，2001 年 1 月至 2004 年 10 月担任申能(集团)有限公司综合管理部副主管、主管，2004 年 10 月至 2006 年 1 月担任上海申能资产管理有限公司金融资产部副经理、经理，2006 年 1 月至 2007 年 2 月担任申能集团财务有限公司筹备组副组长，2007 年 2 月至 2009 年 8 月担任申能集团财务有限公司副总经理，2009 年 8 月至 2016 年 7 月担任申能集团财务有限公司党支部书记，总经理，2015 年 9 月起担任申能(集团)有限公司副总裁，2020 年 5 月起担任申能(集团)有限公司党委委员。</p> |
| 杜卫华 | <p>1964 年生，中共党员，经济学硕士研究生，副教授。现任公司党委副书记、纪委书记、监事会副主席、职工代表监事、工会主席，上海东方证券资本投资有限公司监事，上海东方证券创新投资有限公司监事，上海东证期货有限公司监事，上海东方证券心得益彰公益基金会理事长。1984 年 7 月至 1998 年 6 月担任上海财经大学金融学院教师；1998 年 6 月至 2017 年 5 月担任公司营业部经理，经纪业务总部总经理助理、副总经理，营运管理总部总经理，人力资源管理总部总经理；2012 年 1 月至 2015 年 8 月担任公司总裁助理、职工代表监事；2015 年 8 月至 2020 年 2 月担任公司副总裁；2018 年 3 月至 2020 年 2 月担任公司职工董事；2020 年 1 月起担任公司党委副书记、纪委书记；2020 年 2 月起担任公司监事会副主席、职工代表监事。</p> |
| 吴俊豪 | <p>1965 年生，中共党员，管理学硕士研究生，经济师。现任公司股东代表监事，申能(集团)有限公司金融管理部总经理，上海申能诚毅股权投资有限公司监事长，上海诚毅新能源创业投资有限公司董事，成都市新申创业投资有限公司董事，上海诚毅投资管理有限公司监事，中国太平洋保险(集团)股份有限公司董事，中国太平洋人寿保险股份有限公司董事，中国太平洋财产保险股份有限公司董事，中国光大银行股</p> |

| | |
|-----|---|
| | 份有限公司监事。曾任上海新资源投资咨询公司常务副总经理，上海百利通投资公司副总经理，2003 年 9 月至 2006 年 1 月担任上海申能资产管理有限公司副主管，2006 年 1 月至 2011 年 4 月担任申能（集团）有限公司资产管理部副主管、主管、高级主管、金融管理部副经理（主持工作），2011 年 4 月起担任申能（集团）有限公司金融管理部经理。 |
| 张 健 | 1965 年生，中共党员，工商管理硕士研究生。现任公司股东代表监事，中国邮政集团有限公司上海市分公司副总经理、党委委员。1984 年 7 月至 2004 年 7 月担任南通邮电局科员、副科长、副局长等职务，2004 年 7 月至 2007 年 11 月担任泰州邮政局副局长、高会，2007 年 11 月至 2008 年 3 月担任南通邮政局副局长、工会主席，2008 年 3 月至 2008 年 12 月担任泰州邮政局局长，2008 年 12 月至 2011 年 6 月担任泰州邮政局局长、党委书记，2011 年 6 月至 2014 年 2 月担任南通邮政局局长、党委书记，2014 年 2 月至 2015 年 6 月担任江苏省邮政公司南通市分公司总经理、党委书记，2015 年 6 月至 2016 年 2 月担任中国邮政集团公司南通市分公司总经理、党委书记，2016 年 2 月起担任中国邮政集团有限公司上海市分公司副总经理、党委委员。 |
| 沈广军 | 1979 年生，中共党员，会计学硕士研究生。现任公司股东代表监事，上海建工集团股份有限公司副总会计师，上海建工集团投资有限公司副总经理。2004 年 4 月 2017 年 5 月担任上海市市政工程设计研究总院(集团)有限公司资产财务部职员、经理助理、副经理、总经理，2017 年 5 月至 2018 年 2 月担任上海市市政工程设计研究总院(集团)有限公司副总会计师、资产财务部总经理，2018 年 2 月至 2019 年 6 月担任上海市市政工程设计研究总院(集团)有限公司总裁助理（院长助理）、副总会计师（主持工作）、资产财务部总经理，2019 年 6 月至 2021 年 3 月担任上海建工集团股份有限公司海外事业部总会会计师，2021 年 3 月起担任上海建工集团股份有限公司副总会计师。 |
| 佟 洁 | 1968 年生，财务会计本科。现任公司股东代表监事，上海金桥出口加工区开发股份有限公司财务总监，上海新金桥广场实业有限公司董事。1988 年 12 月至 2001 年 12 月担任中国第一拖拉机工程机械集团有限公司审计主管，2001 年 12 月至 2008 年 12 月担任中邦集团有限公司内审主管、财务部副经理、资本运营部副经理、财务部经理，2008 年 12 月至 2009 年 8 月担任旭辉集团有限公司高级审计经理，2009 年 8 月至 2016 年 5 月担任上海市浦东新区国资委董事监事管理中心外派专职监事，2016 年 5 月起担任上海金桥出口加工区开发股份有限公司财务总监。 |
| 夏立军 | 1976 年生，中共党员，会计学博士研究生，注册会计师。现任公司独立监事，上海交通大学安泰经济与管理学院教授、博士生导师、会计系主任，教育部会计学专业教学指导委员会委员、中国会计学会高等工科院校分会副会长、中国会计学会会计教育分会常务理事、中国审计学会理事、上海市会计学会常务理事、上海市成本研究会副会长，东方财富信息股份有限公司独立董事，浙江盛泰服装集团股份有限公司独立董事、上海三友医疗器械股份有限公司独立董事、华泰保兴基金管理有限公司独立董事、深圳惠泰医疗器械股份有限公司独立董事、上海同济科技实业股份有限公司独立董事、维信诺科技股份有限公司独立董事、上海巴财信息科技有限公司执行董事。2006 年 7 月至 2011 年 3 月担任上海财经大学会计学院讲师、硕士生导师、教授、博士生导师，2011 年 3 月起担任上海交通大学安泰经济与管理学院教授、博士生导师、会计系主任。 |
| 阮 斐 | 1971 年生，中共党员，金融学硕士研究生，高级会计师，高级经济师。现任公司职工代表监事，监事会秘书、监事会办公室主任、纪律检查室主任。1997 年 1 月至 1998 年 6 月担任中国华源集团有限公司发展研究总部研究员，1998 年 6 月至 2005 年 3 月担任公司证券研究所研究员， |

| | |
|-----|--|
| | 2005年3月至2012年3月担任公司办公室主任助理、办公室副主任，2012年3月起担任公司监事会秘书、监事会办公室主任，2012年12月起担任公司纪律检查室主任。 |
| 丁 艳 | 1979年生，中共党员，经济法学硕士，理学硕士研究生，经济师。现任公司职工代表监事，稽核总部副总经理（主持工作），东方证券承销保荐有限公司监事。2001年8月至2005年8月担任中国人民银行上海分行银行管理处、办公室科员、副主任科员，2005年8月至2017年1月担任中国人民银行上海总部综合管理部秘书处、金融服务二部反洗钱处副主任科员、主任科员、科长，2017年1月至2020年4月担任公司稽核总部总经理助理、副总经理，2020年4月起担任公司稽核总部副总经理（主持工作）。 |
| 舒 宏 | 1967年生，中共党员，工商管理学硕士，工程师。现任公司副总裁、首席信息官，东方证券承销保荐有限公司首席信息官。1993年1月至1998年10月担任申银万国证券股份有限公司电脑网络中心开发部经理，1998年10月至2004年3月担任东方证券有限责任公司信息技术中心负责人、总经理，2001年12月至2014年4月担任公司总裁助理兼信息技术中心总经理、总裁助理兼经纪业务总部总经理、信息技术总监兼总裁助理、营运总监兼总裁助理、营运总监；2014年4月起担任公司副总裁，2019年6月起担任公司首席信息官。 |
| 张建辉 | 1968年生，中共党员，经济学硕士、工商管理学硕士，会计师，经济师。现任公司副总裁、财务总监、资金管理总部总经理、上海东方证券创新投资有限公司董事长，东方金融控股(香港)有限公司董事长，东证国际金融集团有限公司董事长，上海东方证券资本投资有限公司董事，中证信用增进股份有限公司监事，上海诚毅新能源创业投资有限公司监事。1994年3月至1998年3月担任上海浦东发展银行主办科员；1998年3月至2003年7月担任东方证券有限责任公司资金财务管理总部总经理助理；2003年7月至2015年6月历任公司辽宁管理总部副总经理、总经理，资金财务管理总部副总经理（主持工作）、总经理；2015年6月至2019年8月担任公司计划财务总部总经理；2014年5月起担任公司财务总监；2015年7月起担任公司副总裁；2020年8月起担任公司资金管理总部总经理。 |
| 鲁伟铭 | 1971年生，中共党员，经济学硕士，经济师。现任公司副总裁、固定收益业务总部总经理、金融衍生品业务总部总经理、上海东方证券资本投资有限公司董事。1994年7月至1998年3月担任中国国泰证券有限公司交易部业务员、交易部经营处项目经理；1998年3月至2014年10月历任公司交易总部证券投资部职员、副总经理，证券投资业务总部业务董事，固定收益业务总部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）；2014年10月起担任公司固定收益业务总部总经理；2017年9月至2020年9月担任公司总裁助理；2020年9月起担任公司副总裁；2021年1月起担任公司金融衍生品业务总部总经理。 |
| 杨 斌 | 1972年生，中共党员，经济学硕士。现任公司副总裁、首席风险官、合规总监、合规法务管理总部总经理，上海东证期货有限公司董事，上海东方证券创新投资有限公司董事，东方金融控股(香港)有限公司董事，东方证券承销保荐有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司董事，长城基金管理有限公司监事。1997年7月至1998年7月担任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科员；1998年7月至2004年3月担任上海证管办稽查处、稽查局案件审理处副主任科员、主任科员；2004年3月至2007年2月担任上海证监局稽查一处、机构二处主任科员；2007年2月至2015年5月担任上海证监局机构一处副处长、期货监管处处长、法制处处长；2015年6月起担任公司首席风险官；2015年7月起担任公司合规总监；2017年8月至2020年4月担任公司稽核总部总经理；2020年6月起担任公司合规法务管理总部总经理； |

| | |
|-------------|---|
| | 2021 年 3 月起担任公司副总裁。 |
| 徐海宁 | 1970 年生，工商管理学博士，会计师。现任公司副总裁、财富管理业务总部总经理。1990 年 7 月至 1997 年 12 月担任地质矿产部海洋地质综合研究大队财务科科长、计财科副科长；1997 年 12 月至 2001 年 10 月担任上海海地建设工程（集团）有限公司财务部经理、副总会计师；2002 年 3 月至 2007 年 5 月担任通商控股有限公司副总裁；2007 年 5 月至 2008 年 12 月担任上海广和投资有限公司总经理、董事长；2010 年 6 月至 2011 年 1 月担任上海海航大新华置业有限公司副总经理；2011 年 1 月至 2011 年 8 月担任大新华物流控股（集团）有限公司总经理；2011 年 8 月至 2011 年 12 月担任上海大新华投资管理有限公司总经理；2011 年 12 月至 2012 年 10 月担任上海九龙山股份有限公司董事、常务副总裁；2012 年 10 月至 2014 年 10 月担任公司销售交易总部副总经理（主持工作）；2014 年 10 月起担任公司财富管理业务总部（原销售交易总部）总经理；2017 年 9 月至 2021 年 3 月担任公司总裁助理；2021 年 3 月起担任公司副总裁。 |
| 王如富 | 1973 年生，中共党员，工学硕士研究生，注册会计师。现任公司董事会秘书、联席公司秘书、董事会办公室主任，汇添富基金管理股份有限公司监事，上海诚毅新能源创业投资有限公司董事。2002 年 8 月至 2004 年 4 月担任申银万国证券计划统筹总部综合计划专员、发展协调办公室战略管理专员，2004 年 5 月至 2005 年 10 月担任金信证券规划发展部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），2005 年 10 月至 2008 年 3 月担任公司研究所证券市场战略资深研究员，2008 年 3 月至 2016 年 11 月担任董事会办公室资深主管、主任助理、副主任、主任（兼证券事务代表）；2014 年 10 月起担任公司董事会办公室主任，2016 年 11 月起担任公司董事会秘书，2019 年 11 月起兼任联席公司秘书。 |
| 潘鑫军 (离任) | 1961 年生，中共党员，工商管理硕士，正高级经济师。1984 年 6 月至 1986 年 1 月担任中国工商银行上海分行长宁区办事处愚园路企业分理处代理支部书记、支部书记，1985 年 3 月至 1988 年 10 月担任工商银行上海分行整党办公室联络员、长宁区办事处愚园路企业分理处党支部书记、组织处副主任科员，1988 年 11 月至 2003 年 1 月担任工商银行上海分行长宁区办事处工会主席、副主任、支行行长、党委书记，2003 年 1 月至 2010 年 1 月担任公司党委副书记、总经理，2010 年 1 月至 2010 年 9 月担任公司党委书记、董事长兼总经理，2010 年 9 月至 2020 年 9 月担任公司党委书记、执行董事、董事长，2010 年 9 月至 2020 年 10 月担任公司执行董事、董事长。 |
| 陈 斌 (离任) | 1981 年生，中共党员，经济学硕士研究生。现任上海烟草集团浦东烟草糖酒有限公司副总经理。2003 年 7 月至 2010 年 1 月担任上海烟草（集团）公司投资管理处科员，2010 年 1 月至 2016 年 10 月担任上海烟草（集团）公司投资管理处科长助理、科长、处长助理，2014 年 4 月至 2017 年 2 月担任上海海烟投资管理有限公司总经理助理，2017 年 2 月至 2019 年 7 月担任上海海烟投资管理有限公司副总经理，2019 年 7 月起担任上海烟草集团浦东烟草糖酒有限公司副总经理，2014 年 10 月至 2020 年 3 月担任公司非执行董事。 |
| 李 翔 (离任) | 1971 年生，中共党员，文学学士。现任上海报业集团党委委员、副总经理，上海新华发行集团有限公司党委书记、董事长，上海新华传媒股份有限公司党委书记、董事，上海对外信息服务有限公司董事，上海东方明珠房地产有限公司董事，上海上报资产管理有限公司董事，上海阅客信息科技有限公司董事，上海东方报业有限公司董事，上海邮政全日送物流配送有限公司董事，上海东杰广告传媒有限公司董事，上海新闻晚报传媒有限公司董事长，上海新融资产管理有限公司执行董事，上海新华金融投资有限公司执行董事，上海新华传媒交流中心有限公司执行董事，上海新融文化产业服务有限公司执行董事，上海怡成房产有限公司执行董事，上海解放置业有限公司董事长，华夏城视网 |

| | |
|-------------|--|
| | <p>络电视股份有限公司董事。1995年7月至2008年1月担任文汇报经济部记者、副主任、专刊部主任，2008年1月至2013年10月担任文汇报新民联合报业集团经济管理部副主任、主任，2013年10月至2017年5月担任上海报业集团经营管理办公室主任，2017年6月至2017年10月担任上海新华传媒股份有限公司党委书记、总裁，2017年11月起担任上海报业集团党委委员、副总经理，2014年10月至2021年3月担任公司非执行董事。</p> |
| 夏晶寒 (离任) | <p>1969年生，中共党员，经济学硕士。现任浙能资本控股有限公司党委书记、董事长，浙江省能源集团有限公司总法律顾问，浙江浙能资产经营管理有限公司董事长，浙能股权投资基金管理有限公司执行董事，浙江浙能碳资产管理有限公司董事长。1990年8月至2003年6月担任浙江省发展计划委员会财金处科员、副主任科员、主任科员、副处长，2003年6月至2010年9月担任浙江东南发电股份有限公司党委委员、副总经理、董事会秘书，2010年2月至2016年12月担任浙江省能源集团有限公司战略研究与法律事务部主任，2014年4月起担任浙江省能源集团有限公司总法律顾问，2016年11月起担任浙能资本控股有限公司党委书记、董事长，2018年3月至2021年3月担任公司非执行董事。</p> |
| 许建国 (离任) | <p>1964年生，中共党员，会计学硕士。现任上海电气(集团)总公司财务预算部部长、综合管理部部长，上海海立(集团)股份有限公司监事长，上海人寿保险股份有限公司董事，上海电气集团财务有限责任公司董事，海通证券股份有限公司董事，上海微电子装备(集团)股份有限公司董事，上海亥雅实业有限公司董事长，上海开亥实业有限公司董事长，上海电气集团香港有限公司董事，天津钢管制造有限公司董事，上海电气集团恒联企业发展有限公司董事，上海电气集团钢管有限公司监事。1984年7月至2001年12月任职上海电缆厂，2002年1月至2004年3月任职上海电气(集团)总公司，2004年4月至2005年9月担任上海电气资产管理有限公司资产财务部高级主管，2005年9月至2008年8月担任上海电气资产管理有限公司管理一部财务经理助理，2006年3月至2008年8月兼任上海力达重工制造有限公司财务总监，2008年8月至2009年12月担任上海电气资产管理有限公司资产财务部副部长，2009年12月至2013年4月担任上海电气(集团)总公司财务预算部副部长，2013年4月起担任上海电气(集团)总公司财务预算部部长，2018年8月起担任上海电气(集团)总公司综合管理部部长，2016年11月至2021年3月担任公司非执行董事。</p> |
| 陈晓波 (离任) | <p>1973年生，中共党员，经济学学士。现任公司党委办公室主任。1995年7月至1998年3月担任上海浦东发展银行信托证券部科员，1998年3月至2003年11月担任公司办公室秘书、主任助理，2003年11月至2012年3月担任公司党委办公室(原党群工作部)副主任，2012年3月起担任公司党委办公室主任，2020年3月至2020年11月担任公司职工董事。</p> |
| 徐国祥 (离任) | <p>1960年生，中共党员，经济学博士，教授。现任上海财经大学应用统计研究中心主任，上海财经大学统计与管理学院教授，泸州老窖股份有限公司独立董事，紫泉能源技术股份有限公司独立董事，智昌科技集团股份有限公司独立董事，大众交通(集团)股份有限公司监事，上海新通联包装股份有限公司监事。曾任上海海运学院管理系讲师，1986年1月至2003年5月担任上海财经大学统计学系讲师、副教授、教授、系主任，2003年6月起担任上海财经大学应用统计研究中心主任、上海财经大学统计与管理学院教授，2014年8月至2020年12月担任公司独立非执行董事。</p> |
| 陶修明 | <p>1964年生，中共党员，法学博士研究生。现任北京君泽君律师事务所创始合伙人暨管委会主任，北京厚健投资有限公司执行董事，泰康资产</p> |

| | |
|-------------|--|
| (离任) | 管理有限责任公司独立董事。1989年7月至1992年4月在中国法律咨询中心及天平律师事务所任职，1992年4月至1994年12月在中国社会科学院法学研究所国际法研究室任职，1995年7月起任北京君泽君律师事务所合伙人，2014年10月至2020年12月担任公司独立非执行董事。 |
| 尉安宁 (离任) | 1963年生，经济学博士。现任上海谷旺投资管理有限公司执行董事兼总经理，华宝基金管理有限公司独立董事，大成食品（亚洲）有限公司执行董事及董事会主席，宁波谷旺投资管理有限公司执行董事，佳禾食品工业股份有限公司的独立董事，海程邦达供应链管理股份有限公司独立董事。曾任宁夏广播电视大学（银川）经济学统计学讲师，中国社会科学院经济研究所发展经济研究室主任、助理研究员，世界银行农业自然资源局农业经济学家，1998年2月至2003年1月担任荷兰合作银行东北亚区董事、农业食品工商业主管，2003年2月至2006年6月担任新希望集团常务副总裁，2007年1月至2010年7月担任比利时富通银行中国业务发展主管、中国区CEO、上海分行行长，2010年8月至2012年8月担任山东亚太中慧集团董事长，2010年9月起担任上海谷旺投资管理有限公司执行董事及总经理，2014年10月至2020年12月担任公司独立非执行董事。 |
| 何炫 (离任) | 1982年生，中共党员，高级管理人员工商管理硕士。现任公司独立非执行董事，贵州省证券业协会常务副会长、友山基金管理有限公司董事长、贵州融创投资咨询有限公司执行董事兼总经理、贵州友山物业管理有限公司执行董事。2004年7月至2005年7月担任上海市社会保险基金管理中心稽核员，2006年7月至2010年12月担任华创证券有限公司上海长海路营业部高级经理、副总经理，2011年11月起担任友山基金管理有限公司筹备组组长、董事长。 |
| 李宾 (离任) | 1959年生，中共党员，经济管理本科，中级经济师、中级政工师。1978年2月至1981年1月担任北京空军39583部队机械员，1981年7月至1988年9月担任上海建筑机械厂团委干事、副书记、书记、人事科干部、装配车间党支部书记，1988年9月至1996年8月担任上海市石油化工设备公司总经理办公室主任、党委办公室主任，1996年8月至2000年7月担任上海市物价局人事处主任科员，2000年7月至2011年4月担任中共上海市金融工作委员会办公室主任科员、副主任、机关党委副书记、纪委书记、主任，2011年4月至2014年3月担任中共上海市金融工作委员会干部人事处（人力资源处、老干部处）处长，2014年3月至2020年1月担任公司党委副书记、纪委书记，2014年11月至2020年2月担任公司监事会副主席，2015年4月至2020年4月担任上海东方证券心得益彰基金会理事长。 |
| 黄来芳 (离任) | 1969年生，工商管理硕士研究生，高级经济师。现任中国邮政集团公司上海市分公司党委委员、副总经理、工会主席、上海邮政博物馆馆长，中国邮政集团公司上海市寄递事业部副总经理，上海捷时达邮政专递有限公司董事长。2006年7月至2009年1月担任上海市邮政（局）公司宝山区（邮政）局计财科科长，2009年1月至2010年11月担任上海市邮政公司宝山区邮政局副局长，2010年11月至2012年3月担任上海市邮政公司宝山区邮政局局长，2012年3月至2013年4月担任上海市邮政公司宝山区邮政局局长兼党委书记，2013年4月至2013年9月担任上海市邮政公司市场经营部经理兼宝山区邮政局局长、党委书记，2013年9月至2014年4月担任上海市邮政公司市场经营部经理兼宝山区邮政局局长，2014年4月至2014年7月担任上海市邮政公司市场经营部总经理兼宝山区分公司总经理，2014年7月至2015年5月担任上海市邮政公司市场部总经理，2015年5月至2016年2月担任中国邮政集团公司上海市分公司市场部总经理（2015年10月至2016年1月参加中共中国邮政党校2015年秋季青年干部培训班学习），2016年2月起担任中国邮政集团公司上海市分公司党委委员、副总经理，2016年 |

| | |
|-------------|--|
| | 6月起兼任中国邮政集团公司上海市分公司工会主席，2016年9月起兼任上海邮政博物馆馆长，2018年9月起兼任中国邮政集团公司上海市寄递事业部副总经理，2019年1月起兼任上海捷时达邮政专递有限公司董事长。 |
| 刘文彬 (离任) | 1975年生，中共党员，会计硕士，高级会计师。现任文思海辉技术有限公司高级副总裁、首席财务官。2000年6月至2006年9月担任长城信息产业股份有限公司子公司会计、财务经理；2006年10月至2017年1月任长城信息产业股份有限公司财务部副部长、财务部长、副总会计师、财务总监，2017年2月至2020年1月期间担任中国长城科技集团股份有限公司财务总监。2020年2月起担任文思海辉技术有限公司高级副总裁、首席财务官。 |
| 尹克定 (离任) | 1964年生，中共党员，经济学本科学士，高级会计师。现任上海建工集团股份有限公司总会计师，上海建工昆山中环建设有限公司董事长，上海市政工程设计研究总院（集团）有限公司董事，上海建工房产有限公司董事，上海浦东中银富登村镇银行有限责任公司董事。1987年7月至2001年7月担任上海建工（集团）总公司海外事业部财务主管，2001年7月至2004年6月担任香港建设控股有限公司财务总监，2004年6月至2005年1月担任上海建工（集团）总公司财务处副处长，2005年1月至2009年1月担任上海建工（集团）总公司南方公司总会计师，2010年1月至2011年10月担任上海第二建筑有限公司总会计师，2011年10月至2012年12月担任上海建工集团股份有限公司副总会计师，2012年12月起担任上海建工集团股份有限公司总会计师。 |
| 吴正奎 (离任) | 1974年生，中共党员，会计学硕士，会计师。现任绿地控股集团有限公司财务部副总经理，绿地能源集团有限公司董事，绿地金融投资控股集团有限公司监事，上海云峰（集团）有限公司董事，江苏省建筑工程集团有限公司董事，河南绿地中原置业发展有限公司副董事长，上海新绿复兴城市开发有限公司董事，上海新华金融投资有限公司监事，上海新华传媒交流中心有限公司监事，上海绿地股权投资管理有限公司监事，南京国资绿地金融中心有限公司董事，上海绿地盛帆城市投资资产管理有限公司监事，绿地控股集团（上海）国际投资有限公司监事，绿地创新投资有限公司监事，上海绿地融资担保有限公司监事，上海绿地集团（昆山）材料有限公司监事，交大绿地科技创新有限公司董事，绿地丝路交通投资有限公司董事，上海新华发行（集团）有限公司财务总监，天津市建工集团（控股）有限公司董事，上海绿地交通投资有限公司监事，绿地城市投资集团有限公司监事，绿地香港控股有限公司执行董事，上海都市建筑设计有限公司董事，中民外滩房地产开发有限公司董事，锦州银行股份有限公司监事。1998年9月至1999年12月任江苏天能集团职员，2000年1月至2001年2月担任昆山市南方化工厂会计，2002年1月至2003年12月担任上海绿地建筑工程有限公司财务部经理，2004年1月起担任绿地控股集团有限公司财务部经理、总经理助理、财务部副总经理。 |
| 周文武 (离任) | 1961年生，中共党员，经济学本科学士。现任公司工会办事机构主任、工会副主席、退管会副主任，黄浦区总工会兼职副主席。1988年6月至1992年9月担任上海招商国际旅游公司财务部副经理、经理，1992年10月至1997年1月担任上海市金桥出口加工区联合发展公司财务部襄理，1997年2月至1998年10月担任上海中电理曼实业有限公司总会计师，1998年11月至2000年10月担任上海生物技术工业园医药销售有限公司财务部经理，2000年11月至2014年12月担任公司辽宁管理总部专员、资金财务管理总部总经理助理、资金财务管理总部副总经理，2014年11月起担任公司工会副主席，2015年2月起担任退管会副主任，2016年4月起担任黄浦区总工会兼职副主席。 |

| | |
|-------------|---|
| 姚 远 (离任) | 1973 年生，中共党员，会计学本科，注册会计师。现任公司证券金融业务总部总经理。1993 年 9 月至 1998 年 3 月担任上海浦东发展银行杨浦证券营业部财务，1998 年 3 月至 2014 年 12 月担任公司稽核总部主办、主管、高级主管、资深主管、总经理助理、副总经理，2014 年 12 月至 2017 年 3 月担任公司合规法务管理总部副总经理（主持工作），2017 年 3 月至 2020 年 4 月担任公司合规法务管理总部兼风险管理总部总经理，2020 年 5 月至 2020 年 6 月担任公司合规法务管理总部总经理，2020 年 6 月起担任公司证券金融业务总部总经理。 |
| 杨玉成 (离任) | 1965 年生，中共党员，经济学硕士，正高级经济师。曾任公司副总裁，东方金融控股（香港）有限公司董事长，东方花旗证券有限公司监事会主席，长城基金管理有限公司董事。1987 年 8 月至 1993 年 7 月担任上海财经大学财政系教师，1993 年 8 月至 1999 年 1 月担任君安证券有限公司证券投资部总经理助理，1999 年 2 月至 2001 年 7 月担任上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，2001 年 10 月至 2004 年 8 月担任上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，2004 年 5 月至 2007 年 3 月担任公司财务总监、副总经理，2007 年 2 月至 2009 年 7 月担任申能集团财务有限公司董事、总经理，2012 年 1 月至 2016 年 11 月兼任董事会秘书，2018 年 4 月至 2019 年 11 月兼任联席公司秘书，2009 年 7 月至 2020 年 5 月担任公司副总裁。 |

其它情况说明

 适用 不适用

(二) 董事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况
 适用 不适用

二、现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员的任职情况
(一) 在股东单位任职情况
 适用 不适用

| 任职人员姓名 | 股东单位名称 | 在股东单位担任的职务 | 任期起始日期 | 任期终止日期 |
|--------|------------|----------------|-------------|--------|
| 宋雪枫 | 申能（集团）有限公司 | 副总裁 | 2014 年 8 月 | 至今 |
| | | 党委委员 | 2016 年 12 月 | 至今 |
| 俞雪纯 | 申能（集团）有限公司 | 副总经济师、战略管理部总经理 | 2020 年 3 月 | 至今 |
| | | 职工监事 | 2012 年 9 月 | 至今 |
| 刘 炜 | 申能（集团）有限公司 | 人力资源部总经理 | 2017 年 9 月 | 至今 |

| | | | | |
|--------------|-------------------|----------------|----------|---------|
| | | 纪委委员 | 2020年5月 | 至今 |
| | | 党委组织部部长 | 2020年12月 | 至今 |
| 周东辉 | 上海海烟投资管理有限公司 | 董事、总经理 | 2015年7月 | 至今 |
| 程峰 | 上海报业集团 | 党委委员、副总经理 | 2013年10月 | 至今 |
| 任志祥 | 浙能资本控股有限公司 | 党委副书记、总经理 | 2019年10月 | 至今 |
| 张芋 | 申能(集团)有限公司 | 副总裁 | 2015年9月 | 至今 |
| | | 党委委员 | 2020年5月 | 至今 |
| 吴俊豪 | 申能(集团)有限公司 | 金融管理部总经理 | 2011年4月 | 至今 |
| 张健 | 中国邮政集团公司上海市分公司 | 党委委员、副总经理 | 2016年2月 | 至今 |
| 沈广军 | 上海建工集团股份有限公司 | 海外事业部总会计师 | 2019年6月 | 2021年3月 |
| | | 副总会计师 | 2021年3月 | 至今 |
| 佟洁 | 上海金桥出口加工区开发股份有限公司 | 财务总监 | 2016年5月 | 至今 |
| 李翔(已离任) | 上海报业集团 | 党委委员、副总经理 | 2017年11月 | 至今 |
| 夏晶寒(已离任) | 浙能资本控股有限公司 | 党委书记、董事长 | 2016年11月 | 至今 |
| 许建国(已离任) | 上海电气(集团)总公司 | 财务预算部部长 | 2013年4月 | 至今 |
| | | 综合管理部部长 | 2018年8月 | 至今 |
| 黄来芳(已离任) | 中国邮政集团有限公司上海市分公司 | 党委委员、副总经理、工会主席 | 2016年2月 | 至今 |
| 尹克定(已离任) | 上海建工集团股份有限公司 | 总会计师 | 2012年12月 | 至今 |
| 在股东单位任职情况的说明 | | 无 | | |

(二) 在其他单位任职情况

√适用 □不适用

| 任职人员姓名 | 其他单位名称 | 在其他单位担任的职务 | 任期起始日期 | 任期终止日期 |
|--------|----------------|------------|----------|--------|
| 宋雪枫 | 上海申能能创能源发展有限公司 | 董事长 | 2017年10月 | 至今 |
| | 国家中小企业发展基金有限公司 | 董事 | 2020年6月 | 至今 |

| | | | | |
|-----|-------------------|-------|-------------|-------------|
| | 上海东方证券资产管理有限公司 | 董事长 | 2020 年 12 月 | 至今 |
| 金文忠 | 上海东方证券资本投资有限公司 | 董事长 | 2012 年 3 月 | 至今 |
| | 东方证券承销保荐有限公司 | 董事长 | 2020 年 9 月 | 至今 |
| | 上海东方证券创新投资有限公司 | 董事 | 2012 年 11 月 | 至今 |
| | 上海东证期货有限公司 | 董事长 | 2014 年 12 月 | 2020 年 11 月 |
| | 上海东证期货有限公司 | 董事 | 2014 年 12 月 | 至今 |
| | 东方金融控股(香港)有限公司 | 董事长 | 2020 年 6 月 | 2021 年 1 月 |
| | 上海东方证券资产管理有限公司 | 董事 | 2010 年 7 月 | 2020 年 12 月 |
| 俞雪纯 | 申能香港控股有限公司 | 总经理 | 2020 年 7 月 | 至今 |
| | 申能股份有限公司 | 监事会主席 | 2020 年 6 月 | 至今 |
| | 上海新世纪资信评估投资服务有限公司 | 董事 | 2010 年 7 月 | 至今 |
| 刘 炜 | 申能集团商务服务有限公司 | 监事 | 2020 年 6 月 | 至今 |
| | 上海申能诚毅股权投资有限公司 | 董事 | 2020 年 11 月 | 至今 |
| 周东辉 | 上海烟草机械有限责任公司 | 副董事长 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 上海捷强烟草糖酒(集团)有限公司 | 副董事长 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 上海得强实业有限公司 | 副董事长 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 上海高扬国际烟草有限公司 | 董事 | 2017 年 7 月 | 至今 |
| | 中国烟草上海进出口有限责任公司 | 董事 | 2016 年 10 月 | 至今 |
| | 上海烟草集团黄浦烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2019 年 8 月 | 至今 |
| | 上海烟草集团徐汇烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2016 年 5 月 | 至今 |
| | 上海烟草集团虹口烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2016 年 5 月 | 至今 |
| | 上海烟草集团杨浦烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 上海烟草集团闵行烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 上海烟草集团宝山烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2016 年 5 月 | 至今 |

| | | | | |
|-----|----------------------|--------|----------|----|
| | 上海烟草集团浦东烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海烟草集团松江烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海烟草集团青浦烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海烟草集团崇明烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海白玉兰烟草材料有限公司 | 董事 | 2019年8月 | 至今 |
| | 上海王宝和大酒店有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海烟草集团房地产开发经营有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海海烟烟草糖酒有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 上海烟草集团苏州中华园大饭店有限责任公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 深圳新型烟草制品有限公司 | 董事 | 2018年5月 | 至今 |
| | 中维资本控股股份有限公司 | 监事 | 2016年2月 | 至今 |
| | 中国航发商用航空发动机有限责任公司 | 监事 | 2015年3月 | 至今 |
| | 海通证券股份有限公司 | 董事 | 2020年6月 | 至今 |
| | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 董事 | 2021年1月 | 至今 |
| 程 峰 | 上海上报资产管理有限公司 | 董事长 | 2014年2月 | 至今 |
| | 上海东方报业有限公司 | 董事长 | 2017年4月 | 至今 |
| | 上海瑞力投资基金管理有限公司 | 董事长 | 2015年5月 | 至今 |
| | 上海文化产权交易所股份有限公司 | 董事长 | 2016年4月 | 至今 |
| | 上海新华传媒股份有限公司 | 常务副董事长 | 2017年9月 | 至今 |
| | 上海东方明珠房地产有限公司 | 董事 | 2014年10月 | 至今 |
| | 上海房地产时报社有限公司 | 执行董事 | 2016年2月 | 至今 |
| | 汇添富基金管理股份有限公司 | 董事 | 2016年11月 | 至今 |
| | 上海解放传媒信息发展有限公司 | 执行董事 | 2016年4月 | 至今 |
| | 上海文汇新民实业有限公司 | 执行董事 | 2014年9月 | 至今 |

| | | | | |
|-----|-----------------|-------|----------|---------|
| | 上海上报传悦置业发展有限公司 | 董事长 | 2014年8月 | 至今 |
| | 上海申闻实业有限公司 | 执行董事 | 2015年4月 | 至今 |
| | 上海东方票务有限公司 | 董事长 | 2016年2月 | 至今 |
| | 上海上报实业有限公司 | 董事长 | 2020年10月 | 至今 |
| | 上海界面财联社科技股份有限公司 | 监事会主席 | 2016年11月 | 至今 |
| | 上海瑞壹投资管理有限公司 | 董事长 | 2016年10月 | 至今 |
| | 上海瑞力金融信息服务有限公司 | 董事长 | 2015年11月 | 至今 |
| 任志祥 | 浙江富浙投资有限公司 | 董事 | 2019年11月 | 至今 |
| | 浙商财产保险股份有限公司 | 副董事长 | 2021年1月 | 至今 |
| | 浙商银行股份有限公司 | 董事 | 2020年12月 | 至今 |
| 朱 静 | 东方金融控股（香港）有限公司 | 董事 | 2015年8月 | 至今 |
| | 东方金融控股（香港）有限公司 | 总经理 | 2019年4月 | 至今 |
| | 上海东证期货有限公司 | 董事 | 2016年2月 | 至今 |
| | 东证国际金融集团有限公司 | 董事 | 2018年8月 | 至今 |
| | 诚泰融资租赁（上海）有限公司 | 监事会主席 | 2019年2月 | 至今 |
| | 长城基金管理有限公司 | 董事 | 2020年6月 | 至今 |
| | 上海东方证券资产管理有限公司 | 监事 | 2020年8月 | 至今 |
| 许志明 | 宽带资本 | 创始合伙人 | 2006年3月 | 至今 |
| | 东凌集团有限公司 | 董事 | 2015年9月 | 至今 |
| | 广州东凌实业投资集团有限公司 | 董事 | 2015年9月 | 至今 |
| | 北京联航合众传媒科技有限公司 | 董事 | 2007年11月 | 至今 |
| | 北京宝轩文化传媒有限公司 | 董事 | 2007年12月 | 至今 |
| 靳庆鲁 | 上海财经大学会计学院 | 院长 | 2018年11月 | 至今 |
| | 上海洗霸科技股份有限公司 | 独立董事 | 2017年10月 | 2020年9月 |

| | | | | |
|-----|-------------------|------|-------------|-------------|
| 吴 弘 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 独立董事 | 2020 年 12 月 | 至今 |
| | 上海浦东发展集团财务有限责任公司 | 独立董事 | 2010 年 5 月 | 至今 |
| | 浙江泰隆商业银行股份有限公司 | 独立董事 | 2016 年 11 月 | 至今 |
| | 西部利得基金管理有限公司 | 独立董事 | 2020 年 12 月 | 至今 |
| 冯兴东 | 上海财经大学统计与管理学院 | 院长 | 2019 年 11 月 | 至今 |
| 张 芊 | 上海久联集团有限公司 | 董事长 | 2015 年 10 月 | 2020 年 12 月 |
| | 成都市新申创业投资有限公司 | 董事 | 2011 年 4 月 | 至今 |
| | 上海申能能源服务有限公司 | 董事长 | 2019 年 11 月 | 至今 |
| | 上海申欣环保实业有限公司 | 董事长 | 2019 年 2 月 | 2020 年 4 月 |
| 杜卫华 | 上海东方证券资本投资有限公司 | 董事 | 2011 年 9 月 | 2020 年 6 月 |
| | 上海东方证券创新投资有限公司 | 董事 | 2012 年 11 月 | 2020 年 6 月 |
| | 上海东方证券资产管理有限公司 | 董事 | 2016 年 4 月 | 2020 年 3 月 |
| | 上海东方证券资本投资有限公司 | 监事 | 2020 年 6 月 | 至今 |
| | 上海东方证券创新投资有限公司 | 监事 | 2020 年 6 月 | 至今 |
| | 上海东证期货有限公司 | 监事 | 2020 年 9 月 | 至今 |
| | 上海东方证券心得益彰公益基金会 | 理事长 | 2020 年 4 月 | 至今 |
| 吴俊豪 | 中国太平洋保险（集团）股份有限公司 | 董事 | 2012 年 7 月 | 至今 |
| | 中国太平洋人寿保险股份有限公司 | 董事 | 2012 年 7 月 | 至今 |
| | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 董事 | 2012 年 7 月 | 至今 |
| | 上海诚毅新能源创业投资有限公司 | 董事 | 2010 年 10 月 | 至今 |
| | 成都市新申创业投资有限公司 | 董事 | 2011 年 4 月 | 至今 |
| | 中国光大银行股份有限公司 | 监事 | 2009 年 11 月 | 至今 |
| | 上海诚毅投资管理有限公司 | 监事 | 2010 年 10 月 | 至今 |
| | 上海申能融资租赁有限公司 | 监事长 | 2016 年 12 月 | 2021 年 1 月 |

| | | | | |
|-----|-----------------|----------------|-------------|----|
| | 上海申能诚毅股权投资有限公司 | 监事长 | 2016 年 12 月 | 至今 |
| 沈广军 | 上海建工集团投资有限公司 | 副总经理 | 2021 年 3 月 | 至今 |
| 佟 洁 | 上海新金桥广场实业有限公司 | 董事 | 2017 年 1 月 | 至今 |
| 夏立军 | 上海交通大学安泰经济与管理学院 | 教授、博士生导师、会计系主任 | 2011 年 3 月 | 至今 |
| | 华泰保兴基金管理有限公司 | 独立董事 | 2016 年 7 月 | 至今 |
| | 浙江盛泰服装集团股份有限公司 | 独立董事 | 2018 年 10 月 | 至今 |
| | 上海三友医疗器械股份有限公司 | 独立董事 | 2019 年 7 月 | 至今 |
| | 深圳惠泰医疗器械股份有限公司 | 独立董事 | 2019 年 11 月 | 至今 |
| | 东方财富信息股份有限公司 | 独立董事 | 2020 年 1 月 | 至今 |
| | 上海同济科技实业股份有限公司 | 独立董事 | 2020 年 4 月 | 至今 |
| | 维信诺科技股份有限公司 | 独立董事 | 2020 年 5 月 | 至今 |
| | 上海巴财信息科技有限公司 | 执行董事 | 2018 年 4 月 | 至今 |
| 舒 宏 | 上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司 | 董事 | 2009 年 1 月 | 至今 |
| | 东方证券承销保荐有限公司 | 首席信息官 | 2019 年 12 月 | 至今 |
| 张建辉 | 上海东方证券创新投资有限公司 | 董事长 | 2016 年 7 月 | 至今 |
| | 东方金融控股(香港)有限公司 | 董事长 | 2021 年 1 月 | 至今 |
| | 东证国际金融集团有限公司 | 董事长 | 2018 年 8 月 | 至今 |
| | 上海东方证券资本投资有限公司 | 董事 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 中证信用增进股份有限公司 | 监事 | 2015 年 5 月 | 至今 |
| | 上海诚毅新能源创业投资有限公司 | 监事 | 2010 年 10 月 | 至今 |
| 鲁伟铭 | 上海东方证券资本投资有限公司 | 董事 | 2020 年 6 月 | 至今 |
| 杨 斌 | 上海东证期货有限公司 | 董事 | 2015 年 8 月 | 至今 |
| | 上海东方证券创新投资有限公司 | 董事 | 2020 年 10 月 | 至今 |
| | 东方金融控股(香港)有限公司 | 董事 | 2018 年 8 月 | 至今 |

| | | | | |
|------------|------------------|------------|-------------|------------|
| | 东方证券承销保荐有限公司 | 董事 | 2015 年 10 月 | 至今 |
| | 上海东方证券资产管理有限公司 | 董事 | 2018 年 3 月 | 至今 |
| | 长城基金管理有限公司 | 监事 | 2017 年 2 月 | 至今 |
| 王如富 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 监事 | 2015 年 9 月 | 至今 |
| | 上海诚毅新能源创业投资有限公司 | 董事 | 2015 年 3 月 | 至今 |
| 潘鑫军（离任） | 东方证券承销保荐有限公司 | 董事长 | 2012 年 6 月 | 2020 年 9 月 |
| | 上海东方证券资产管理有限公司 | 董事长 | 2018 年 3 月 | 2020 年 9 月 |
| 陈 斌（离任） | 上海烟草集团浦东烟草糖酒有限公司 | 副总经理 | 2019 年 7 月 | 至今 |
| | 海通证券股份有限公司 | 董事 | 2014 年 12 月 | 2020 年 3 月 |
| 李 翔（离任） | 上海新华发行集团有限公司 | 党委书记、董事长 | 2014 年 5 月 | 至今 |
| | 上海新华传媒股份有限公司 | 党委书记、董事 | 2017 年 6 月 | 至今 |
| | 上海对外信息服务热线有限公司 | 董事 | 2009 年 7 月 | 至今 |
| | 上海东方明珠房地产有限公司 | 董事 | 2015 年 7 月 | 至今 |
| | 上海上报资产管理有限公司 | 董事 | 2015 年 9 月 | 至今 |
| | 上海阅客信息科技有限公司 | 董事 | 2016 年 5 月 | 至今 |
| | 上海东方报业有限公司 | 董事 | 2016 年 7 月 | 至今 |
| | 上海邮政全日送物流配送有限公司 | 董事 | 2016 年 6 月 | 至今 |
| | 上海东杰广告传媒有限公司 | 董事 | 2016 年 6 月 | 至今 |
| | 上海新闻晚报传媒有限公司 | 董事长 | 2017 年 11 月 | 至今 |
| | 上海新融资产管理有限公司 | 执行董事 | 2018 年 1 月 | 至今 |
| | 上海新华金融投资有限公司 | 执行董事 | 2018 年 1 月 | 至今 |
| | 上海新华传媒交流中心有限公司 | 执行董事 | 2018 年 1 月 | 至今 |
| | 上海新融文化产业服务有限公司 | 执行董事 | 2018 年 1 月 | 至今 |
| 上海怡成房产有限公司 | 执行董事 | 2018 年 1 月 | 至今 | |

| | | | | |
|---------|-------------------|-------|-------------|----|
| | 上海解放置业有限公司 | 董事长 | 2018 年 1 月 | 至今 |
| | 华夏城视网络电视股份有限公司 | 董事 | 2018 年 9 月 | 至今 |
| 夏晶寒（离任） | 浙江省能源集团有限公司 | 总法律顾问 | 2014 年 4 月 | 至今 |
| | 浙江浙能资产经营管理有限公司 | 董事长 | 2014 年 6 月 | 至今 |
| | 浙能股权投资基金管理有限公司 | 执行董事 | 2017 年 6 月 | 至今 |
| | 浙江浙能碳资产管理有限公司 | 董事长 | 2017 年 7 月 | 至今 |
| 许建国（离任） | 上海海立（集团）股份有限公司 | 监事长 | 2017 年 12 月 | 至今 |
| | 上海人寿保险股份有限公司 | 董事 | 2015 年 3 月 | 至今 |
| | 上海电气集团财务有限责任公司 | 董事 | 2013 年 4 月 | 至今 |
| | 海通证券股份有限公司 | 董事 | 2016 年 10 月 | 至今 |
| | 上海微电子装备（集团）股份有限公司 | 董事 | 2016 年 6 月 | 至今 |
| | 上海亥雅实业有限公司 | 董事长 | 2019 年 3 月 | 至今 |
| | 上海开亥实业有限公司 | 董事长 | 2019 年 6 月 | 至今 |
| | 上海电气集团香港有限公司 | 董事 | 2019 年 9 月 | 至今 |
| | 天津钢管制造有限公司 | 董事 | 2020 年 3 月 | 至今 |
| | 上海电气集团恒联企业发展有限公司 | 董事 | 2020 年 6 月 | 至今 |
| | 上海电气集团钢管有限公司 | 监事 | 2019 年 10 月 | 至今 |
| 徐国祥（离任） | 上海财经大学应用统计研究中心 | 主任 | 2003 年 6 月 | 至今 |
| | 大众交通（集团）股份有限公司 | 监事 | 2006 年 4 月 | 至今 |
| | 上海新通联包装股份有限公司 | 监事 | 2011 年 11 月 | 至今 |
| | 泸州老窖股份有限公司 | 独立董事 | 2015 年 6 月 | 至今 |
| | 紫泉能源技术股份有限公司 | 独立董事 | 2019 年 10 月 | 至今 |
| | 智昌科技集团股份有限公司 | 独立董事 | 2021 年 1 月 | 至今 |
| 陶修明（离任） | 北京君泽君律师事务所 | 合伙人 | 1995 年 7 月 | 至今 |

| | | | | |
|---------|--------------------|-------------|----------|----------|
| | 北京厚健投资有限公司 | 执行董事 | 2014年3月 | 至今 |
| | 泰康资产管理有限责任公司 | 独立董事 | 2014年8月 | 至今 |
| 尉安宁（离任） | 上海谷旺投资管理有限公司 | 执行董事、总经理 | 2010年9月 | 至今 |
| | 华宝基金管理有限公司 | 独立董事 | 2015年9月 | 至今 |
| | 大成食品（亚洲）有限公司 | 独立董事 | 2014年10月 | 2020年3月 |
| | 大成食品（亚洲）有限公司 | 执行董事及董事会主席 | 2020年3月 | 至今 |
| | 宁夏谷旺投资管理有限公司 | 执行董事 | 2014年5月 | 2020年6月 |
| | 烟台张裕葡萄酒股份有限公司 | 董事 | 2017年6月 | 2020年5月 |
| | 宁波谷旺投资管理有限公司 | 执行董事 | 2015年4月 | 至今 |
| | 江苏金融租赁股份有限公司 | 董事 | 2017年11月 | 2020年11月 |
| | 海程邦达供应链管理股份有限公司 | 独立董事 | 2020年4月 | 至今 |
| | 陕西石羊农业科技股份有限公司 | 董事 | 2018年5月 | 2020年1月 |
| | 佳禾食品工业股份有限公司 | 独立董事 | 2018年12月 | 至今 |
| 何 炫（离任） | 友山基金管理有限公司 | 董事长 | 2013年3月 | 至今 |
| | 贵州融创投资咨询有限公司 | 执行董事、总经理 | 2010年3月 | 至今 |
| | 贵州友山物业管理有限公司 | 执行董事 | 2015年1月 | 至今 |
| 李 宾（离任） | 上海东方证券心得益彰公益基金会 | 理事长 | 2015年4月 | 2020年4月 |
| 黄来芳（离任） | 上海邮政博物馆 | 馆长 | 2016年9月 | 至今 |
| | 中国邮政集团有限公司上海市寄递事业部 | 副总经理 | 2018年9月 | 至今 |
| | 上海捷时达邮政专递有限公司 | 董事长 | 2019年1月 | 至今 |
| 刘文彬（离任） | 中国长城科技集团股份有限公司 | 财务总监 | 2017年2月 | 2020年1月 |
| | 文思海辉技术有限公司 | 高级副总裁、首席财务官 | 2020年2月 | 至今 |
| 尹克定（离任） | 上海浦东中银富登村镇银行有限责任公司 | 董事 | 2014年1月 | 至今 |
| | 上海建工房产有限公司 | 董事 | 2014年4月 | 至今 |

| | | | | |
|--------------|----------------------|---------|----------|----|
| | 上海市政工程设计研究总院（集团）有限公司 | 董事 | 2014年8月 | 至今 |
| | 上海建工昆山中环建设有限公司 | 董事长 | 2016年7月 | 至今 |
| 吴正奎（离任） | 绿地控股集团有限公司 | 财务部副总经理 | 2012年3月 | 至今 |
| | 绿地能源集团有限公司 | 董事 | 2009年12月 | 至今 |
| | 绿地金融投资控股集团有限公司 | 监事 | 2011年4月 | 至今 |
| | 上海云峰（集团）有限公司 | 董事 | 2008年1月 | 至今 |
| | 江苏省建筑工程集团有限公司 | 董事 | 2016年3月 | 至今 |
| | 河南绿地中原置业发展有限公司 | 副董事长 | 2006年8月 | 至今 |
| | 上海新绿复兴城市开发有限公司 | 董事 | 2013年3月 | 至今 |
| | 上海新华金融投资有限公司 | 监事 | 2005年2月 | 至今 |
| | 上海新华传媒交流中心有限公司 | 监事 | 2007年2月 | 至今 |
| | 上海绿地股权投资管理有限公司 | 监事 | 2011年11月 | 至今 |
| | 南京国资绿地金融中心有限公司 | 董事 | 2009年9月 | 至今 |
| | 上海绿地盛帆城市投资资产管理有限公司 | 监事 | 2016年1月 | 至今 |
| | 绿地控股集团（上海）国际投资有限公司 | 监事 | 2014年1月 | 至今 |
| | 绿地创新投资有限公司 | 监事 | 2016年3月 | 至今 |
| | 上海绿地融资担保有限公司 | 监事 | 2012年2月 | 至今 |
| | 上海绿地集团（昆山）材料有限公司 | 监事 | 2004年1月 | 至今 |
| | 交大绿地科技创新有限公司 | 董事 | 2017年9月 | 至今 |
| | 绿地丝路交通投资有限公司 | 董事 | 2017年12月 | 至今 |
| | 上海新华发行集团有限公司 | 财务总监 | 2007年1月 | 至今 |
| | 天津市建工集团(控股)有限公司 | 董事 | 2018年10月 | 至今 |
| 上海绿地交通投资有限公司 | 监事 | 2016年1月 | 至今 | |
| 绿地城市投资集团有限公司 | 监事 | 2016年1月 | 至今 | |

| | | | | |
|--------------|----------------|-------|----------|---------|
| | 绿地香港控股有限公司 | 执行董事 | 2013年8月 | 至今 |
| | 锦州银行股份有限公司 | 监事 | 2019年10月 | 至今 |
| | 上海都市建筑设计有限公司 | 董事 | 2019年7月 | 至今 |
| | 中民外滩房地产开发有限公司 | 董事 | 2019年2月 | 至今 |
| 周文武（离任） | 黄浦区总工会 | 兼职副主席 | 2016年4月 | 至今 |
| 姚 远（离任） | 上海东方证券资本投资有限公司 | 监事 | 2015年8月 | 2020年6月 |
| | 上海东证期货有限公司 | 监事 | 2016年3月 | 2020年6月 |
| | 东证国际金融集团 | 董事 | 2019年4月 | 2020年9月 |
| 杨玉成（离任） | 东方金融控股（香港）有限公司 | 董事长 | 2018年8月 | 2020年6月 |
| | 长城基金管理有限公司 | 董事 | 2014年9月 | 2020年6月 |
| 在其他单位任职情况的说明 | | 无 | | |

三、董事、监事、高级管理人员报酬情况

√适用 □不适用

| | |
|---------------------|---|
| 董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序 | <p>公司非执行董事（除职工董事）、股东代表监事及独立监事不在公司领取报酬。公司独立非执行董事津贴由董事会拟定，报股东大会决定。公司法定代表人（董事长）、总裁、副总裁级领导班子成员薪酬由基本薪酬、绩效薪酬和任期激励构成。基本薪酬须报董事会薪酬与提名委员会批准；绩效薪酬与其个人年度绩效考核结果挂钩，经董事会薪酬与提名委员会批准后，由董事长负责实施；任期激励与其个人任期考核结果挂钩，经董事会薪酬与提名委员会批准后，由董事长负责实施。其他经营班子成员的薪酬绩效管理按公司有关规定执行。</p> |
| 董事、监事、高级管理人员报酬确定依据 | <p>公司独立非执行董事津贴参照同行业上市公司水平确定；在公司领取薪酬的公司执行董事、职工董事、职工代表监事和高级管理人员的报酬由公司薪酬考核体系确定。为进一步推进公司市场化体制机制建设，公司试行职业经理人薪酬分配制度，公司董事长、总裁、副总裁、副总裁级领导班子成员薪酬结构和水平按照公司《推进职业经理人薪酬分配制度改革实施方案》有关规定执行。</p> |

| | |
|-----------------------------|-------------------------------------|
| 董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况 | 详见“现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动及报酬情况”。 |
| 报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计 | 4,628.26 万元 |

四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

√适用 □不适用

| 姓名 | 担任的职务 | 变动情形 | 变动原因 |
|----------|----------|------|--|
| 宋雪枫 | 执行董事 | 选举 | 2021 年 3 月，公司召开 2021 年第一次临时股东大会，会议选举产生第五届董事会非职工董事，与 2021 年 2 月召开的职工代表大会选举产生的职工董事共同组成公司第五届董事会。公司第五届董事会由执行董事宋雪枫先生、金文忠先生，非执行董事俞雪纯先生、刘炜先生、周东辉先生、程峰先生、任志祥先生，职工董事朱静女士，独立非执行董事许志明先生、靳庆鲁先生、吴弘先生和冯兴东先生组成。同日，公司召开第五届董事会第一次会议，会议选举金文忠先生为公司第五届董事会董事长，聘任金文忠先生为公司总裁。 |
| 金文忠 | 执行董事、董事长 | 选举 | |
| | 总裁 | 聘任 | |
| 俞雪纯 | 非执行董事 | 选举 | |
| 程 峰 | 非执行董事 | 选举 | |
| 任志祥 | 非执行董事 | 选举 | |
| 朱 静 | 职工董事 | 选举 | |
| 金文忠 | 执行董事、董事长 | 选举 | 2020 年 10 月，公司董事共同推举执行董事金文忠先生代为履行董事长、法定代表人职责，直至公司选举的新任董事长开始履职之日止。 |
| 周东辉 | 非执行董事 | 选举 | 2020 年 5 月，公司召开 2019 年年度股东大会，选举周东辉先生为公司第四届董事会非执行董事。 |
| 吴 弘 | 独立非执行董事 | 选举 | 2020 年 12 月，公司召开 2020 年第二次临时股东大会，选举吴弘先生为公司第四届董事会独立非执行董事。 |
| 冯兴东 | 独立非执行董事 | 选举 | 2020 年 12 月，公司召开 2020 年第二次临时股东大会，选举冯兴东先生为公司第四届董事会独立非执行董事。 |
| 潘鑫军（已离任） | 董事长、执行董事 | 离任 | 2020 年 10 月，潘鑫军先生因个人原因申请辞去公司第四届董事会董事长、执行董事等职务。 |
| 陈 斌（已离任） | 非执行董事 | 离任 | 2020 年 3 月，陈斌先生因工作调整原因，辞去公司非执行董事及薪酬与提名委员会委员职务。 |
| 李 翔（已离任） | 非执行董事 | 离任 | 2021 年 3 月，公司第四届董事会任期届满。 |

| | | | |
|----------|---------------|----|--|
| 夏晶寒（已离任） | 非执行董事 | 离任 | |
| 许建国（已离任） | 非执行董事 | 离任 | |
| 陈晓波（已离任） | 职工董事 | 选举 | 2020 年 2 月，公司召开第三届职工代表大会第七次联席会议选举陈晓波先生为公司职工董事，并于 2020 年 3 月正式履职。 |
| | | 离任 | 2020 年 11 月，陈晓波先生因个人原因，辞去公司职工董事职务。 |
| 徐国祥（已离任） | 独立非执行董事 | 离任 | 2020 年 8 月，徐国祥先生因个人任期已满，申请辞去公司第四届董事会独立非执行董事、董事会薪酬与提名委员会委员和审计委员会委员职务。2020 年 12 月，公司 2020 年第二次临时股东大会选举产生新的独立非执行董事，徐国祥先生不再履职。 |
| 陶修明（已离任） | 独立非执行董事 | 离任 | 2020 年 10 月，陶修明先生因个人任期已满，申请辞去公司第四届董事会独立非执行董事和董事会合规与风险管理委员会委员职务。2020 年 12 月，公司 2020 年第二次临时股东大会选举产生新的独立非执行董事，陶修明先生不再履职。 |
| 尉安宁（已离任） | 独立非执行董事 | 离任 | 2020 年 10 月，尉安宁先生因个人任期已满，申请辞去公司第四届董事会独立非执行董事、董事会薪酬与提名委员会主任委员和审计委员会委员职务。2020 年 12 月，公司 2020 年第二次临时股东大会选举产生新的独立非执行董事，尉安宁先生不再履职。 |
| 何炫（已离任） | 独立非执行董事 | 选举 | 2020 年 12 月，公司召开 2020 年第二次临时股东大会，选举何炫先生为公司第四届独立非执行董事。 |
| | | 离任 | 2021 年 3 月，公司第四届董事会任期届满。 |
| 杜卫华 | 职工代表监事、监事会副主席 | 选举 | 2020 年 2 月，公司召开第三届职工代表大会第七次联席会议选举杜卫华先生为公司职工代表监事；同月，公司第四届监事会第十二次会议选举杜卫华先生为公司监事会副主席。 |
| | 职工董事、副总裁 | 离任 | 2020 年 2 月，杜卫华先生因工作调整原因，辞去公司职工董事及副总裁职务。 |
| 吴俊豪 | 非执行董事 | 离任 | 2021 年 3 月，公司第四届董事会任期届满。 |
| | 股东代表监事 | 选举 | 2021 年 3 月，公司召开 2021 年第一次临时股东大会，会议选举产生第五届监事会非职工代表监事，与 2021 年 2 月召开的职工代表大会选举产生的职工代表监事共同组成公司第五届监事会。公司第五届监事会由股东代表监事张芊先生、吴俊豪先生、张健先生、沈广军先生、佟洁女士，独立监事夏立军先生，职工代表监事杜卫华先生、阮斐女士及丁艳女士组成。同日，公司第五届监事会召开第一次会议，会议选举张芊先生为公司监事会主席，选举杜卫华先生为公司监事会副主席。 |
| 张 健 | 股东代表监事 | 选举 | |
| 沈广军 | 股东代表监事 | 选举 | |
| 夏立军 | 独立监事 | 选举 | |
| 阮 斐 | 职工代表监事 | 选举 | |

| | | | |
|----------|----------------|----|---|
| 丁 艳 | 职工代表监事 | 选举 | |
| 李 宾（已离任） | 职工代表监事、监事会副主席 | 离任 | 2020 年 2 月，李宾先生因年龄原因不再担任公司职工代表监事、监事会副主席等职务。 |
| 黄来芳（已离任） | 股东代表监事 | 离任 | 2021 年 3 月，第四届监事会任期届满。 |
| 刘文彬（已离任） | 股东代表监事 | 离任 | |
| 尹克定（已离任） | 股东代表监事 | 离任 | |
| 吴正奎（已离任） | 股东代表监事 | 离任 | |
| 周文武（已离任） | 职工代表监事 | 离任 | |
| 姚 远（已离任） | 职工代表监事 | 离任 | |
| 鲁伟铭 | 副总裁 | 聘任 | 2020 年 9 月，公司第四届董事会第二十二次会议聘任鲁伟铭先生为公司副总裁。 |
| 杨 斌 | 副总裁、首席风险官、合规总监 | 聘任 | 2021 年 3 月，公司第五届董事会第一次会议，聘任公司第五届高级管理人员。 |
| 徐海宁 | 副总裁 | 聘任 | |
| 杨玉成（已离任） | 副总裁 | 离任 | 2020 年 5 月，杨玉成先生因个人工作变动原因，辞去公司副总裁等职务。 |

五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

适用 不适用

六、母公司和主要子公司的员工情况

(一) 员工情况

| | |
|------------------------|--------|
| 母公司在职员工的数量 | 4,409 |
| 主要子公司在职员工的数量 | 1,930 |
| 在职员工的数量合计 | 6,339 |
| 母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数 | 0 |
| 专业构成 | |
| 专业构成类别 | 专业构成人数 |
| 管理人员 | 506 |
| 研究人员 | 176 |
| 投资银行人员 | 494 |
| 经纪业务人员 | 3,462 |
| 资产管理人员 | 298 |
| 投资业务人员 | 318 |
| 财务人员 | 265 |
| 信息技术人员 | 463 |
| 其他人员 | 357 |
| 合计 | 6,339 |
| 教育程度 | |
| 教育程度类别 | 数量(人) |
| 博士 | 94 |
| 硕士 | 2,218 |
| 大学本科 | 3,678 |
| 大学专科 | 291 |
| 中专 | 27 |
| 高中及以下 | 31 |
| 合计 | 6,339 |

(二) 薪酬政策

适用 不适用

公司重视人才的吸引、激励、培养和使用，实行岗位工资制和绩效奖金相结合的工资制度，薪酬水平与岗位价值、地区市场水平和绩效评估结果挂钩，做到了“效率优先、兼顾公平”。根据适用的中国法律法规，公司与每位员工签订劳动合同，建立劳动关系。劳动合同内容包含关于合同期限、工作时间和休息休假、劳动报酬和保险福利、劳动保护和劳动条件、合同变更及解除等条款。

依据适用的中国法律法规，公司为员工建立各项社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险、生育保险）、住房公积金，并按时足额缴纳上述社会保险费和住房公积金。同时依据

适用的国家法规，公司于 2006 年建立企业年金制度和补充医疗保险制度，为员工提供补充养老和补充医疗保障。

(三) 培训计划

√适用 □不适用

报告期内，公司培训工作围绕公司战略目标，以“提升员工技能、赋能潜才优才、助推业务发展、传导核心价值观”为使命，加大各类人才培养投入，积极落实各项培训项目。2020 年，公司共组织举办各类面授内训 300 场，涉及人数达 1.3 万人次；推荐员工参加各类监管部门、专业机构举办的 96 个培训班，涉及人数达 261 人次；推进网络培训 137 余场，涉及人数达 10 万余人次。公司持续关注各类人才培养，完成各类重点培训项目。

2021 年，公司将继续完善多层次、多元化的培训体系，根据人才培养及员工职业发展需要，融合线上线下学习模式，打造优质精品培训项目，优化网络学习平台，提高培训学习覆盖率，提升培训整体实效。一是持续加强对中高层管理人员、分支机构负责人、后备人才等干部人才队伍的定制化培训产品；二是匹配员工不同职业阶段，优化专业类、通用类技能培训精品系列课程配置和开发；三是结合各部门需求，加大内部个性化课程开发力度，创新培训交流形式，帮助相关部门员工更好掌握职业技能。

(四) 劳务外包情况

√适用 □不适用

| | |
|-------------|---------------|
| 劳务外包的工时总数 | 1,104,961 |
| 劳务外包支付的报酬总额 | 96,161,985.03 |

七、其他

√适用 □不适用

公司委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况

公司对经纪人管理采用委托代理的管理模式，截至报告期末，公司在职经纪人 985 人。

1、公司经纪人管理组织体系是通过整合公司资源，建立证券经纪人管理平台和证券经纪人队伍，培养证券经纪人营销服务能力，提高投资者服务水平，实现风险有效控制，促进公司经纪业务健康稳定发展。

2、经纪人与公司签订委托代理合同，在公司授权范围内，代理公司从事客户招揽和客户服务等活动的公司以外的自然人，委托代理合同一年一签。

3、证券经纪人接受公司管理，公司证券经纪人管理以合规管理为基础，充分尊重证券经纪人合理的职业发展诉求和合法权益。

4、证券经纪人在公司授权范围内从事客户招揽和客户服务工作，严格遵守国家的法律、行政法规、监管机构和行政管理部門的规定、自律规则以及职业道德，遵守公司有关规章制度。

5、**证券经纪人培训**：证券经纪人根据证券行业协会要求开展培训学习工作，经纪人入职开展执业前培训时间不少于 60 小时，其中合规培训不少于 20 小时；认真完成每年度后续执业培训学习工作并通过协会年检；完成公司合规、反洗钱以及员工执业、信息安全资料学习和考试，相关培训记录和测评结果汇总归档并按要求上报；不定期开展相关在线课程的岗位培训，涉及从业资格、营销管理知识及产品类、风控类培训等。

第九节 公司治理

一、公司治理相关情况说明

√适用 □不适用

（一）公司治理情况

作为在中国大陆和香港两地上市的公众公司，公司严格按照境内外上市地的法律、法规及规范性文件的要求，规范运作，不断致力于维护和提升公司良好的市场形象。公司严格依照《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》、《上市公司治理准则》、《企业管治守则》等相关法律法规以及公司《公司章程》的规定，按照建立现代企业制度的目标，健全和完善公司法人治理结构、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各司其职、各负其责、协调运作、有效制衡的上市公司治理结构，确保了公司的稳健经营和规范运作。公司治理科学、规范、透明。公司“三会”（股东大会、董事会、监事会）的召集、召开及表决程序规范合法有效，信息披露真实、准确、完整、及时、公平。

报告期内，根据新《证券法》及相关监管要求，公司进一步修订完善了《公司章程》、《公司股东大会会议事规则》、《公司董事会议事规则》、《公司监事会会议事规则》《公司独立董事制度》、《公司董事、监事和高级管理人员持有本公司股份及其变动管理办法》、《公司董事会秘书工作规则》、《公司投资者关系管理办法》以及其他内部规章制度，并获得公司董事会和股东大会审议批准。通过以上制度的不断完善，公司治理结构不断规范，公司治理水平不断提高。

报告期内，公司董事长因个人原因辞职，后经全体董事推举由公司总裁代行董事长职责，导致公司遵循了《企业管治守则》中除 A.2.1 条之外的所有其他守则条文；鉴于公司作出重大决策之时，董事会框架下仍有其他五名独立非执行董事和六名非执行董事共同决策，董事会下设各专门委员会及独立非执行董事均能积极发挥专业和监督职能，能够有效处理因董事长兼任总裁可能存在的潜在管治问题，因此公司达到了《企业管治守则》中所列明的绝大多数建议最佳常规条文的要求。

报告期内，公司召开股东大会会议 3 次，董事会会议 8 次，监事会会议 6 次，召开合规与风险管理委员会会议 5 次、薪酬与提名委员会会议 4 次，审计委员会会议 5 次，共计 31 次会议。

（二）内幕信息知情人登记管理制度的制定与实施情况

报告期内，公司严格遵照执行《内幕信息知情人登记管理及保密制度》的各项有关处理及发布内幕消息的程序和内部控制措施，加强内幕信息保密工作，认真履行内幕信息知情人登记管理及保密义务，能够真实、准确和完整记录内幕信息在公开前的商议筹划、论证咨询、合同订立等阶段及报告、传递、编制、审核、决议、披露等各环节所有内幕信息知情人名单，并按照规定要求填写内幕信息知情人档案与重大事项进程备忘录，有效防范内幕信息知情人进行内幕交易，认真做好公司信息披露工作。

（三）企业管治政策以及就企业管治而言董事会的职责

公司严格遵照《香港上市规则》，以《企业管治守则》中所列的所有原则作为企业管治政策。就企业管治职能而言，董事会的职权范围包括：

- 1、制定及检讨公司的企业管治政策及常规；
- 2、检讨及监察董事及高级管理人员的培训及持续专业发展；
- 3、检讨及监察公司在遵守法律及监管规定方面的政策及常规；
- 4、制定、检讨及监察雇员及董事的操守准则及合规手册（如有）；
- 5、检讨公司遵守《企业管治守则》的情况及在《企业管治报告》内的披露。

公司治理与中国证监会相关规定的要求是否存在重大差异；如有重大差异，应当说明原因

适用 不适用

二、股东大会情况简介

| 会议届次 | 召开日期 | 决议刊登的指定网站的查询索引 | 决议刊登的披露日期 |
|-----------------|-----------------|---|-----------------|
| 2019 年年度股东大会 | 2020 年 5 月 15 日 | http://www.sse.com.cn | 2020 年 5 月 16 日 |
| 2020 年第一次临时股东大会 | 2020 年 7 月 13 日 | http://www.sse.com.cn | 2020 年 7 月 14 日 |
| 2020 年第二次临时股东大会 | 2020 年 12 月 8 日 | http://www.sse.com.cn | 2020 年 12 月 9 日 |

股东大会情况说明

适用 不适用

股东是公司的投资者，公司重视股东权利，在《公司章程》中详细规定了公司股东的权利及实现权利的方式；公司重视与股东的沟通，以便增强股东对公司的了解，保护股东知情权；公司亦重视对股东的合理投资回报、分红政策，保护股东收益权。

按照《公司章程》的规定股东大会依法行使下列职权：决定公司经营方针和投资计划；选举和更换非由职工代表担任的董事、监事，决定有关董事、监事的报酬事项；审议批准公司的年度财务预决算方案；审议批准公司的利润分配方案；对公司增加或者减少股本和发行任何类型股票、认购证和其他类似证券、发行公司债券和聘用、解聘或者不再续聘会计师事务所作出决议；审议批准重大关联交易事项；修改《公司章程》等。

报告期内，公司于 2020 年 5 月 15 日在中国上海市中山南路 119 号 15 楼会议室召开了 2019 年年度股东大会，会议审议通过了 12 项普通决议议案：《公司 2019 年度董事会工作报告》、《公司 2019 年度监事会工作报告》、《公司 2019 年度财务决算报告》、《公司 2019 年度利润分配方案》、《公司 2019 年年度报告》、《关于公司 2020 年度自营规模的议案》、《关于以融资类业务债权资产开展资产证券化业务的议案》、《关于预计公司 2020 年度日常关联交易的议案》、《关于预计公司 2020 年度对外担保的议案》、《关于聘请 2020 年度会计师事务所的议案》、《关于选举公司非执行董事的议案》、《关于公司未来三年股东回报规划（2020-2022）的议案》；审议通过了 3 项特别决议议案《关于公司发行境外债务融资工具一般性授权的议案》、《关于修订〈

公司章程>部分条款的议案》、《关于授予董事会增发公司 A 股、H 股股份一般性授权的议案》；会议听取了《公司 2019 年度独立董事述职报告》。相关决议结果于会议当日刊登在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 以及公司网站 (<http://www.dfzq.com.cn>)，于 2020 年 5 月 16 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》。

报告期内，公司于 2020 年 7 月 13 日在中国上海市中山南路 119 号 15 楼会议室召开了 2020 年第一次临时股东大会，会议审议通过了 2 项普通决议议案：《关于〈东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）〉及摘要的议案》、《关于授权董事会全权办理公司员工持股计划相关事宜的议案》。相关决议结果于会议当日刊登在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 以及公司网站 (<http://www.dfzq.com.cn>)，于 2020 年 7 月 14 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》。

报告期内，公司于 2020 年 12 月 8 日在中国上海市中山南路 119 号 15 楼会议室召开了 2020 年第二次临时股东大会，会议审议通过了 5 项普通决议议案：《关于选举公司独立非执行董事的议案》、《关于修改〈公司独立董事制度〉的议案》、《关于修改〈公司股东大会议事规则〉的议案》、《关于修改〈公司董事会议事规则〉的议案》、《关于修改〈公司监事会议事规则〉的议案》；审议通过了 1 项特别决议议案：《关于修改〈公司章程〉部分条款的议案》。相关决议结果于会议当日刊登在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 以及公司网站 (<http://www.dfzq.com.cn>)，于 2020 年 12 月 9 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》。

公司没有表决权恢复的优先股股东，因而报告期内不存在表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会、召集和主持股东大会、提交股东大会临时提案的情况。

三、董事履行职责情况

公司董事会按照《公司章程》的规定行使其职权，以公司及股东的最大利益为原则，向股东大会报告工作，执行股东大会的决议，对股东大会负责。

截至报告期末，公司第四届董事会时任董事 12 名；2021 年 3 月 5 日公司第五届董事会完成换届，截至本报告出具之日，公司现任董事 12 名；董事于本报告日期的简历详见本报告“第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况”。董事及高级管理人员与其他董事或高级管理人员不存在任何关系（包括财政、业务、家族或其他重大或相关关系）。董事会结构科学，每名董事均具备与本集团业务运营及发展有关的丰富知识、经验及才能。所有董事深知其共同及个别对股东所负之责任。

自公司上市以来，董事会一直符合《香港上市规则》有关委任至少三名独立非执行董事、且所委任的独立非执行董事必须占董事会成员人数至少三分之一的要求，公司独立非执行董事的资格完全符合《香港上市规则》第 3.10（1）及（2）条，第 3.10（A）条的规定。此外，公司已收

到每名独立非执行董事根据《香港上市规则》第 3.13 条就其各自的独立性出具的年度确认书。因此，公司认为每名独立非执行董事均具备《香港上市规则》要求的独立性。

(一) 董事参加董事会和股东大会的情况

| 董事姓名 | 是否独立董事 | 参加董事会情况 | | | | | | 参加股东大会情况 出席股东大会的次数 |
|------|--------|------------|--------|-----------|--------|------|---------------|-----------------------|
| | | 本年应参加董事会次数 | 亲自出席次数 | 以通讯方式参加次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | 是否连续两次未亲自参加会议 | |
| 金文忠 | 否 | 8 | 8 | 5 | 0 | 0 | 否 | 3 |
| 刘炜 | 否 | 8 | 8 | 5 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 吴俊豪 | 否 | 8 | 8 | 5 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 周东辉 | 否 | 5 | 5 | 3 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 李翔 | 否 | 8 | 7 | 5 | 1 | 0 | 否 | 0 |
| 夏晶寒 | 否 | 8 | 6 | 5 | 2 | 0 | 否 | 0 |
| 许建国 | 否 | 8 | 8 | 5 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 许志明 | 是 | 8 | 8 | 5 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 靳庆鲁 | 是 | 8 | 7 | 5 | 1 | 0 | 否 | 0 |
| 吴弘 | 是 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 冯兴东 | 是 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 何炫 | 是 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 潘鑫军 | 否 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 否 | 2 |
| 陈斌 | 否 | 2 | 2 | 1 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 杜卫华 | 否 | 1 | 1 | 1 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 陈晓波 | 否 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 否 | 1 |
| 徐国祥 | 是 | 7 | 7 | 4 | 0 | 0 | 否 | 2 |
| 陶修明 | 是 | 7 | 7 | 4 | 0 | 0 | 否 | 0 |
| 尉安宁 | 是 | 7 | 7 | 4 | 0 | 0 | 否 | 1 |

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

适用 不适用

| | |
|----------------|---|
| 年内召开董事会会议次数 | 8 |
| 其中：现场会议次数 | 3 |
| 通讯方式召开会议次数 | 5 |
| 现场结合通讯方式召开会议次数 | 0 |

全体董事对董事会审议议案的表决结果均为同意，无弃权和反对。

报告期内，董事会共召开 8 次会议，具体如下：

1、2020 年 1 月 14 日，第四届董事会第十七次会议以通讯表决方式召开，会议审议通过了《关于制定〈东方证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法〉的议案》。

2、2020年3月27日，第四届董事会第十八次会议以现场、视频相结合的方式召开，会议审议通过了《公司2019年度董事会工作报告》、《公司2019年度经营工作报告》、《公司2019年度财务决算报告》、《公司2019年度利润分配方案》、《公司2019年年度报告》、《公司2019年度风险控制指标执行情况的报告》、《关于公司2019年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》、《关于公司2020年度资产负债配置、业务规模及风险控制计划的议案》、《关于公司2020年度自营规模的议案》、《关于公司发行境内债务融资工具一般性授权的议案》、《关于以融资类业务债权资产开展资产证券化业务的议案》、《公司2019年度合规报告》、《公司2019年度风险管理工作报告》、《公司2019年度内部控制评价报告》、《公司2019年度反洗钱工作报告》、《公司2019年度反洗钱工作专项稽核报告》、《公司2019年度信息技术管理专项报告》、《关于公司2019年度社会责任报告的议案》、《关于公司2019年度关联交易审计的议案》、《关于预计公司2020年度日常关联交易的议案》、《关于预计公司2020年度对外担保的议案》、《关于聘请2020年度会计师事务所的议案》、《关于修改〈公司章程〉部分条款的议案》、《关于选举公司非执行董事的议案》、《关于选举公司董事会专门委员会委员的议案》、《关于提请股东大会授予董事会增发公司A股、H股股份一般性授权的议案》、《关于公司未来三年股东回报规划（2020-2022）的议案》、《关于召开公司2019年度股东大会的议案》。会议听取了《公司2019年度独立董事述职报告》和《公司董事会审计委员会2019年度履职报告》。

3、2020年4月29日，第四届董事会第十九次会议以通讯表决方式召开，会议审议通过了《公司2020年第一季度报告》。

4、2020年6月17日，第四届董事会第二十次会议以现场会议方式召开，会议审议通过了《关于〈东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）〉及摘要的议案》、《关于提请公司股东大会授权董事会全权办理公司员工持股计划相关事宜的议案》、《关于召开公司2020年第一次临时股东大会的议案》。

5、2020年8月28日，第四届董事会第二十一次会议以现场会议方式召开，会议审议通过了《东方证券股份有限公司2020年半年度报告》、《公司2020年中期净资本风险控制指标执行情况的报告》、《关于计提资产减值准备的议案》、《公司2020年中期合规报告》、《公司2020年中期风险管理工作报告》、《关于修订〈东方证券股份有限公司内部控制管理办法〉的议案》。会议听取了《2020年上半年度公司经营工作报告》。

6、2020年9月10日，第四届董事会第二十二次会议以通讯表决方式召开，会议审议通过了《关于聘任公司副总裁的议案》、《关于为东方证券承销保荐有限公司提供流动性担保的议案》。

7、2020年10月29日，第四届董事会第二十三次会议以通讯表决方式召开，会议审议通过了《公司2020年第三季度报告》、《关于选举公司独立非执行董事的议案》、《关于撤销北京办事处的议案》、《关于修改〈公司章程〉部分条款的议案》、《关于修改〈公司股东大会议事规则〉的议案》、《关于修改〈公司董事会议事规则〉的议案》、《关于修改〈公司独立董事制度〉的议案》、《关于修改〈公司董事、监事和高级管理人员持有本公司股份及其变动管理办法〉的议案》、《关

于修改〈公司董事会秘书工作规则〉的议案》、《关于修改〈公司投资者关系管理办法〉的议案》、《关于修改〈公司全面风险管理基本制度〉的议案》、《关于召开公司 2020 年第二次临时股东大会的议案》。

8、2020 年 12 月 14 日，第四届董事会第二十四次会议以通讯表决方式召开，会议审议通过了《关于选举公司董事会专门委员会委员的议案》。

(二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

适用 不适用

(三) 其他

适用 不适用

董事会与经营管理层

董事会和管理层的权力和职责已在《公司章程》中进行了明确规定，以确保为良好的公司管治和内部控制提供充分的平衡和制约机制。

董事会负责决定公司的经营计划和投资方案，决定公司内部管理机构的设置，制定公司的基本管理制度，对公司的其他重大业务和行政事项作出决议并对管理层进行监督。

公司管理层，在总裁（同时亦为执行董事）的领导下，负责执行董事会作出的各项决议，组织公司的日常经营管理。

1、董事长及总裁

公司董事长和总裁（即《香港上市规则》条文下之行政总裁）职务分别由不同人士担任，以确保各自职责的独立性、可问责性以及权力和授权的分布平衡。由于潘鑫军先生于 2020 年 10 月辞任公司董事长，经全体董事推举由总裁金文忠先生代行董事长职责，且公司 2021 年 3 月 5 日完成换届选举后，金文忠先生为公司董事长兼总裁。公司董事会审议通过的《董事会议事规则》和《总裁工作细则》已分别对董事长和总裁的职责分工进行了明确的界定，并且未来公司作出重大决策时，第五届董事会框架下将由其他执行董事、非执行董事、独立非执行董事及职工董事等十余人共同决策，同时董事会下设各专门委员会及独立非执行董事均将继续积极发挥专业和监督职能，将有效处理因董事长兼任总裁可能存在的潜在管治问题。

董事长领导董事会确定公司的整体发展战略，确保董事会有效运转，履行法定职责，并及时就所有重要的适当事项进行讨论；确保公司制定良好的企业管治常规及程序；确保董事会行事符合公司及全体股东的最佳利益。总裁主要负责公司的日常运营管理，包括组织实施董事会决议、进行日常决策等。

2、委任及重选董事

根据《公司章程》的规定，董事由股东大会选举或更换，每届任期不得超过三年，可连选连任。公司已就新董事的委任执行了一套有效的程序，具体见本报告“第九节、四、（二）、3. 薪

酬与提名委员会”。在《公司章程》规定的人数范围内，按照拟选任的人数，董事候选人可由董事会提名，单独或合并持有公司百分之三以上股份的股东也可以提名董事候选人，并由股东大会选举通过。

3、非执行董事的任期

公司的非执行董事均于股东大会或职工代表大会上推选，任期为三年，可于重选及重新委任时续期。

4、董事薪酬

具体见本报告“第八节、三、董事、监事、高级管理人员报酬情况”。

5、董事培训

公司高度重视董事的持续培训，以确保他们对本公司的运作及业务有适当的理解，确保他们了解中国证监会、上交所、香港联交所以及《公司章程》等相关法律及监管规定所赋予的职责。

报告期内，董事除了参加当地监管部门组织的定期培训，完成持续培训的要求之外，公司董事会办公室定期编辑发送《董事会简报》、《合规与风险管理综合报告》等，协助董事及时了解掌握最新的政策法规和经典案例，并建立多层次的信息沟通机制，搭建信息交流平台，加强董事、监事和管理层之间的信息共享及沟通，提高了董事的履职能力。除此以外，董事的具体培训情况如下：

| 董事姓名 | 日期 | 持续时间 | 组织者 | 内容 | 培训地 |
|--------|-----------------------|------|----------------|--|-----|
| 全体董事 | 2020年1月7日 | 1天 | 公司 | 解读新修订的《证券法》专题讲座 | 上海 |
| 全体董事 | 2020年3月10日 | / | 公司 | 证券公司2019年度经营情况分析 | / |
| 全体董事 | 2020年4月14日 | / | 公司 | 资本市场改革开放背景下证券业发展前景分析、宏观经济与资本市场形势分析报告-2020年第一季度首席经济学家例会 | / |
| 靳庆鲁 | 2020年6月17-24日 | 8天 | 上交所 | 2020年上市公司第一期独立董事后续培训 | 线上 |
| 徐国祥 | 2020年8月18-24日 | 7天 | 上交所 | 2020年上市公司第二期独立董事后续培训 | 线上 |
| 全体董事 | 2020年8月28日 | / | 公司 | 公司2020年半年度报告速读及上市券商财务信息排名情况 | / |
| 全体董事 | 2020年11月3日 | / | 公司 | 从上市公司角度看证券法 | / |
| 全体董事 | 2020年11月5日 | 1天 | 公司 | 新《证券法》专题讲座（董监高专场） | 上海 |
| 全体董事 | 2020年11月9日 | / | 公司 | 证券业2020年三季度报综述 | / |
| 全体董事 | 2020年11月20日 | / | 公司 | 新《证券法》修订要点及对资本市场的影响 | / |
| 冯兴东、何炫 | 2020年10月20日-22日 | 3天 | 上交所 | 第七十三期独立董事资格培训 | 线上 |
| 冯兴东、何炫 | 2020年12月18日-2021年1月8日 | 21天 | 上海证监局、上海上市公司协会 | 上海辖区2020年第一期第二批上市公司董事、监事线上培训班 | 线上 |

四、董事会下设专门委员会在报告期内履行职责时所提出的重要意见和建议，存在异议事项的，应当披露具体情况

√适用 □不适用

（一）董事会下设专门委员会及其成员情况

公司第四届董事会下设四个专门委员会，截至本报告期末的各委员会及其成员如下：

- 1、战略发展委员会：金文忠、吴俊豪、许志明；
- 2、合规与风险管理委员会：金文忠、李翔、夏晶寒、吴弘；
- 3、薪酬与提名委员会：吴弘（主任委员）、刘炜、周东辉、靳庆鲁、何炫；
- 4、审计委员会：靳庆鲁（主任委员）、吴俊豪、许建国、冯兴东、何炫。

截至本报告出具之日，根据公司于 2021 年 3 月 5 日召开的 2021 年第一次临时股东大会及第五届董事会第一次会议，公司第五届董事会下设四个专门委员会，各委员会及其成员如下：

- 1、战略发展委员会：宋雪枫（主任委员）、金文忠、程峰、许志明、朱静；
- 2、合规与风险管理委员会：金文忠（主任委员）、俞雪纯、程峰、任志祥、吴弘；
- 3、薪酬与提名委员会：吴弘（主任委员）、刘炜、周东辉、靳庆鲁、冯兴东；
- 4、审计委员会：靳庆鲁（主任委员）、俞雪纯、周东辉、冯兴东。

公司于 2021 年 3 月 5 日完成第五届董事会换届，考虑到各位独立非执行董事背景及其在董事会其他委员会任职之情况，公司尚在考虑合适的独立非执行董事人选进入审计委员会。因此，公司暂未能符合香港上市规则第 3.21 条关于审计委员会中独立非执行董事占大多数的要求。公司将按照香港上市规则第 3.23 条相关要求，于规定时限内委任合适的独立非执行董事加入审计委员会。公司将适时就该等委任另行刊发公告。

（二）各专门委员会职责及召开会议情况

1、战略发展委员会

战略发展委员会的主要职责是：对公司长期发展战略规划进行研究并提出建议；对须经董事会批准的重大投资融资方案进行研究并提出建议；对须经董事会批准的重大资本运作、资产经营项目进行研究并提出建议；对其他影响公司发展的重大事项进行研究并提出建议；对以上事项的实施进行检查；董事会确定的其他职责和公司股票上市地上市规则或监管规则要求的其他职责。

报告期内，公司未召开战略发展委员会会议。

2、合规与风险管理委员会

合规与风险管理委员会的主要职责是：对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理制度、机构设置及其职责进行审议并提出意见；监督、评价公司的合规管理和风险管理工作，检讨及监察公司在遵守法律及监管规定方面的政策及常规；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对公司总体和各项业务的风险容忍度及规模进行审议，对与风险容忍度相匹配的资产配置机制进行评估；对公司

经营活动中的风险和相关措施的有效性进行检查和评价，与管理层讨论风险管理制度，确保管理层已履行职责建立有效的风险管理制度；主动或应董事会的委派，就有关风险管理事宜的重要调查结果及管理层对调查结果的回应进行研究；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见；制定及检讨公司的企业管治政策及常规，并向董事会提出建议；检讨及监察董事及高级管理人员的培训及持续专业发展；制定、检讨及监察雇员及董事的操守准则及合规手册（如有）；检讨公司遵守《香港上市规则》附录十四《企业管治守则》的情况及在《企业管治报告》内的披露；《公司章程》规定的或董事会授权的其他事宜。

报告期内，合规与风险管理委员会共召开 5 次会议，具体如下：

2020 年 1 月 14 日，第四届董事会合规与风险管理委员会召开 2020 年第一次会议，会议审议通过了《关于制定〈东方证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法〉的议案》。

2020 年 3 月 26 日，第四届董事会合规与风险管理委员会召开 2020 年第二次会议，会议审议通过了《公司 2019 年度风险控制指标执行情况的报告》、《关于公司 2020 年度资产负债配置、业务规模及风险控制计划的议案》、《关于公司 2020 年度自营规模的议案》、《公司 2019 年度合规报告》、《公司 2019 年度风险管理工作报告》、《公司 2019 年度合规管理有效性评估报告》和《公司 2019 年度全面风险管理评估工作报告》，并对合规总监 2019 年度绩效进行了考评。

2020 年 8 月 28 日，第四届董事会合规与风险管理委员会召开 2020 年第三次会议，会议审议通过了《公司 2020 年中期净资本风险控制指标执行情况的报告》、《公司 2020 年中期合规报告》、《公司 2020 年中期风险管理工作报告》和《关于修订〈东方证券股份有限公司内部控制管理办法〉的议案》。

2020 年 10 月 29 日，第四届董事会合规与风险管理委员会召开 2020 年第四次会议，会议审议通过了《关于修改〈公司全面风险管理基本制度〉的议案》。

2020 年 12 月 14 日，第四届董事会合规与风险管理委员会召开 2020 年第五次会议，会议审议通过了《东方证券股份有限公司 2020 年度合规管理有效性评估工作方案》和《东方证券股份有限公司 2020 年度全面风险管理评估工作方案》。

报告期内，第四届董事会合规与风险管理委员会委员出席情况：

| 姓名 | 实际出席会议次数 / 应出席会议次数 |
|-----|--------------------|
| 金文忠 | 5 / 5 |
| 李翔 | 4 / 5 |
| 夏晶寒 | 4 / 5 |
| 吴弘 | 1 / 1 |
| 潘鑫军 | 3 / 3 |
| 陶修明 | 4 / 4 |

3、薪酬与提名委员会

薪酬与提名委员会的主要职责是：至少每年检讨董事会的架构、人数及组成（包括技能、知识及经验方面），并就任何为配合公司策略而拟对董事会作出的变动提出建议。

董事会多元化政策

薪酬与提名委员会制定并审阅董事会多元化政策，并将每年讨论并协议预期目标，以落实董事会的多元化并将向董事会建议有关目标以供采纳。薪酬与提名委员会在考虑董事会成员组合时，应确保董事会中执行与非执行董事（包括独立非执行董事）的组合保持均衡，同时应从多个方面考虑董事会成员多元化，包括但不限于董事的性别、年龄、文化教育背景及专业经验。于报告期内，薪酬与提名委员会已考虑董事会多元化政策并认为目前董事会的组成符合上述多元化的要求。

董事提名政策

根据《公司章程》第一百四十条的规定，董事会、单独或合并持有公司 3%以上股份的股东，可以向股东大会提名非独立董事候选人；董事会、监事会、单独或者合并持有公司已发行股份 1%以上的股东可以向股东大会提名独立董事候选人。有关提名董事候选人的意图以及候选人表明愿意接受提名的书面通知，应当在股东大会召开七天前发给公司（该 7 日通知期的开始日应当在不早于指定进行该项选举的开会通知发出第二天及其结束日不迟于股东大会召开 7 日前）。有关之提名及接受提名期限应不少于 7 日。

薪酬与提名委员会在研究董事、总裁及其他高级管理人员的选任时，薪酬与提名委员会积极与公司有关部门进行交流，研究公司需求情况，并形成书面材料；薪酬与提名委员会可在公司、控股（参股）企业内部以及人才市场等广泛搜寻人选；搜集初选人的职业、学历、职称、详细的工作经历、全部兼职等情况，形成书面材料；征求被提名人对提名的同意，否则不能将其作为提名人选；召集委员会会议，对初选人员进行资格审查；在选举新的董事和聘任新的总裁及其他高级管理人员前一至两个月，向董事会提出董事候选人和新聘总裁及其他高级管理人员人选的建议和相关材料；根据董事会决定和反馈意见进行的后续工作。

薪酬与提名委员会对董事、高级管理人员的选择标准和程序进行审议并提出意见，搜寻合格的董事和高级管理人员人选，对董事和高级管理人员人选的资格条件进行审查并提出建议；就董事委任或重新委任以及董事（尤其是主席及总裁）继任计划向董事会提出建议；审查独立董事的独立性；根据公司高级管理人员管理岗位的主要范围、职责、重要性以及其他相关企业相关岗位的薪酬水平，研究、审议董事、高级管理人员的绩效考核与薪酬管理制度。

绩效考核与薪酬管理政策

绩效考核与薪酬管理制度主要包括但不限于绩效评价标准、程序及主要评价体系，奖励和惩罚的主要方案和制度等。就公司董事及高级管理人员的全体绩效考核与薪酬管理制度及架构，及就设立正规而具透明度的程序制定薪酬政策，向董事会提出建议；因应董事会所订企业方针及目标而检讨及批准管理层的薪酬建议；向董事会建议各执行董事及高级管理人员的薪酬待遇。该薪酬待遇包括非金钱利益、退休金权利及赔偿金额（包括丧失或终止职务或委任的赔偿）；就各非

执行董事的薪酬向董事会提出建议；考虑同类公司支付的薪酬、须付出的时间及职责以及集团内其他职位的雇用条件；审查及批准向执行董事及高级管理人员就其丧失或终止职务或委任而须支付的赔偿，以确保该等赔偿与合约条款一致；若未能与合约条款一致，赔偿亦须公平合理，不致过多；审查及批准因董事行为失当而解雇或罢免有关董事所涉及的赔偿安排，以确保该等安排与合约条款一致；若未能与合约条款一致，有关赔偿亦须合理适当；确保任何董事或其任何联系人（定义见《香港上市规则》）不得参与厘定他自己的薪酬；对公司董事、监事（非职工监事）、总裁和其他高级管理人员的履行职责情况进行考核并提出建议；对公司总裁和其他高级管理人员薪酬和考核制度的执行情况进行检查；《公司章程》规定的或董事会授权的其他事宜。

报告期内，薪酬与提名委员会共召开 4 次会议，具体如下：

2020 年 3 月 27 日，第四届董事会薪酬与提名委员会召开 2020 年第一次会议，会议审议通过了《关于公司领导班子成员三年任期（2019-2021）经营业绩考核目标的议案》及首席风险官兼合规总监考核结果。

2020 年 6 月 17 日，第四届董事会薪酬与提名委员会召开 2020 年第二次会议，会议审议通过了《关于〈东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）〉及其摘要的议案》、《关于提请公司股东大会授权董事会全权办理公司员工持股计划相关事宜的议案》、《关于公司及领导班子成员 2020 年度经营业绩考核目标的议案》。

2020 年 9 月 10 日，第四届董事会薪酬与提名委员会召开 2020 年第三次会议，会议审议通过了《关于聘任公司副总裁的议案》。

2020 年 10 月 29 日，第四届董事会薪酬与提名委员会召开 2020 年第四次会议，会议审议通过了《关于选举公司独立非执行董事的议案》。

报告期内，第四届董事会薪酬与提名委员会委员出席情况：

| 姓 名 | 实际出席会议次数 / 应出席会议次数 |
|-----------|--------------------|
| 吴 弘（主任委员） | 0 / 0 |
| 刘 炜 | 3 / 4 |
| 周东辉 | 3 / 3 |
| 靳庆鲁 | 3 / 4 |
| 何 炫 | 0 / 0 |
| 尉安宁 | 4 / 4 |
| 陈 斌 | 1 / 1 |
| 徐国祥 | 4 / 4 |

4、审计委员会

审计委员会的主要职责是：向董事会提议聘请、重新聘请或者更换外部审计机构，批准外部审计机构的薪酬及聘用条款，处理任何有关该外部审计机构辞职或辞退该外部审计机构的问题，监督外部审计机构的执业行为；按适用的标准检讨及监察外部审计机构是否独立客观及审计程序

是否有效；审计委员会应于审计工作开始前先与外部审计机构讨论审计性质及范围及有关申报责任；就外部审计机构提供非审计服务制定政策，并予以执行。就此规定而言，外部审计机构包括与负责审计的公司处于同一控制权、所有权或管理权之下的任何机构，或一个合理知悉所有有关资料的第三方，在合理情况下会断定该机构属于该负责外部审计机构的本土或国际业务的一部分的任何机构。审计委员会应就任何须采取行动或改善的事项向董事会报告并提出建议；担任公司与外部审计机构之间的代表，负责监察二者之间的关系；监督年度审计工作，就审计后的财务报告信息的真实性、准确性和完整性作出判断，提交董事会审议；监察公司的财务报表以及年度报告及账目、半年度报告及季度报告的完整性，并审阅报表及报告所载有关财务申报的重大意见；审查和评价公司财务监控及内控制度；监督、评价公司的内部稽核和审计制度、会计政策及其实施；与管理层讨论内部监控系统，确保管理层已履行职责建立有效的内部监控系统。讨论内容应包括公司在会计及财务汇报职能方面的资源、员工资历及经验是否足够，以及员工所接受的培训课程及有关预算是否充足；主动或应董事会的委派，就有关内部监控事宜的重要调查结果及管理层对调查结果的响应进行研究；负责组织内部审计与外部审计之间的沟通，确保内部审计机构和外部审计机构的工作得到协调；确保内部审计机构在公司内部有足够资源运作，并且有适当的地位；以及检讨及监察其成效；审查集团的财务及会计政策及操作；审查外部审计机构给予管理层的《审核情况说明函件》、外部审计机构就会计纪录、财务账目或监控系统向管理层提出的任何重大疑问及管理层作出的回应；确保董事会及时响应于外部审计机构给予管理层的《审核情况说明函件》中提出的事宜；审查公司设定的以下安排：公司雇员可暗中就财务汇报、内部监控或其他方面可能发生的不正当行为提出关注。审计委员会应确保有适当安排，让公司对此等事宜作出公平独立的调查及采取适当行动；公司关联交易控制和日常管理；就前述事宜向董事会汇报；《公司章程》规定的或董事会授权的其他事项。

报告期内，审计委员会共召开 5 次会议，具体如下：

2020 年 3 月 27 日，第四届董事会审计委员会召开 2020 年第一次会议，审议通过了《公司 2019 年年度报告》、《关于公司 2019 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》、《公司 2019 年度内部控制评价报告》、《关于公司 2019 年度关联交易审计的议案》、《关于预计公司 2020 年度日常关联交易的议案》、《关于聘请 2020 年度会计师事务所的议案》、《公司 2019 年度审计及审计结果的报告》及《关于确认〈公司 2019 年年度关联人名单〉的议案》。听取了《公司董事会审计委员会 2019 年度履职报告》和《公司 2019 年度稽核工作报告》。

2020 年 4 月 29 日，第四届董事会审计委员会召开 2020 年第二次会议，审议通过了《公司 2020 年第一季度报告》。

2020 年 8 月 28 日，第四届董事会审计委员会召开 2020 年第三次会议，审议通过了《公司 2020 年半年度报告》、《关于计提资产减值准备的议案》及《关于确认〈公司 2020 年半年度关联人名单〉的议案》。听取了《2020 年 IFRS 中期审阅总结汇报》。

2020 年 10 月 29 日，第四届董事会审计委员会召开 2020 年第四次会议，审议通过了《公司 2020 年第三季度报告》。

2020 年 12 月 15 日，第四届董事会审计委员会召开 2020 年第五次会议，审议通过了《公司 2020 年度 A+H 审计计划》和《公司 2020 年度内部控制评价工作方案》。

报告期内，第四届董事会审计委员会委员出席情况：

| 姓 名 | 实际出席会议次数 / 应出席会议次数 |
|-----------|--------------------|
| 靳庆鲁（主任委员） | 5 / 5 |
| 吴俊豪 | 5 / 5 |
| 许建国 | 3 / 5 |
| 冯兴东 | 1 / 1 |
| 何 炫 | 1 / 1 |
| 徐国祥 | 4 / 4 |
| 尉安宁 | 4 / 4 |

五、监事会发现公司存在风险的说明

适用 不适用

报告期内，公司全体监事遵守法律法规及《公司章程》的有关规定，依法合规、诚实守信、勤勉尽责地履行了职责。监事们积极出席监事会议，对公司的财务、合规与风险管理情况进行有效监督，及时提出意见和建议，推动了公司的持续健康发展。

（一）监事参加监事会情况

报告期内公司监事会共召开了 6 次会议，全体监事均亲自出席或委托出席，具体与会情况见下表：

| 监事姓名 | 职务 | 参加监事会情况 | | | | | 表决情况 |
|------------|-------------------|---------|--------|-----------|--------|------|--------|
| | | 应参加次数 | 亲自出席次数 | 以通讯方式参加次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | |
| 张 芊 | 监事会主席、 股东代表监事 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 同意所有议案 |
| 杜卫华 | 监事会副主席、 职工代表监事 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 同意所有议案 |
| 黄来芳 | 股东代表监事 | 6 | 5 | 3 | 1 | 0 | 同意所有议案 |
| 佟 洁 | 股东代表监事 | 6 | 5 | 3 | 1 | 0 | 同意所有议案 |
| 刘文彬 | 股东代表监事 | 6 | 4 | 3 | 2 | 0 | 同意所有议案 |
| 尹克定 | 股东代表监事 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 同意所有议案 |
| 周文武 | 职工代表监事 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 同意所有议案 |
| 姚 远 | 职工代表监事 | 6 | 6 | 3 | 0 | 0 | 同意所有议案 |
| 年内召开监事会次数 | | | 6 | | | | |
| 其中：现场召开次数 | | | 3 | | | | |
| 通讯方式召开会议次数 | | | 3 | | | | |

(二) 监事会召开情况

2020 年 2 月 19 日，第四届监事会第十二次会议以通讯方式召开，审议通过了《关于选举公司监事会副主席的议案》。

2020 年 3 月 27 日，第四届监事会第十三次会议以现场方式召开，审议通过了《公司 2019 年度监事会工作报告》、《公司 2019 年度财务工作报告》、《公司 2019 年度利润分配方案》、《关于公司 2019 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》、《公司 2019 年度合规报告》、《公司 2019 年度风险管理工作报告》、《公司 2019 年度反洗钱工作报告》、《公司 2019 年度反洗钱工作专项稽核报告》、《公司 2019 年度内部控制评价报告》、《公司 2019 年度合规管理有效性评估报告》、《关于公司 2019 年度关联交易审计的议案》、《关于预计公司 2020 年度日常关联交易的议案》、《关于预计公司 2020 年度对外担保的议案》、《公司 2019 年年度报告》、《公司 2019 年度董事履职评价报告》、《公司 2019 年度监事履职评价报告》、《公司 2019 年度高管人员履职评价报告》。

公司于 2020 年 4 月 29 日以通讯方式召开第四届监事会第十四次会议，审议通过了《公司 2020 年第一季度报告》。

公司于 2020 年 6 月 17 日以现场方式召开第四届监事会第十五次会议，审议通过了《关于〈东方证券股份有限公司员工持股计划（草案）〉及摘要的议案》。

公司于 2020 年 8 月 28 日以现场方式召开第四届监事会第十六次会议，审议通过了《公司 2020 年半年度报告》、《公司 2020 年中期合规报告》、《公司 2020 年中期风险管理工作报告》、《关于计提资产减值准备的议案》，听取了《公司 2020 年中期监事会工作报告》、《公司 2020 年中期财务工作报告》。

公司于 2020 年 10 月 29 日以通讯方式召开第四届监事会第十七次会议，审议通过了《公司 2020 年第三季度报告》、《关于修改〈公司监事会议事规则〉的议案》。

六、公司就其与控股股东在业务、人员、资产、机构、财务等方面存在的不能保证独立性、不能保持自主经营能力的情况说明

适用 不适用

公司无控股股东，截至报告期末，公司第一大股东申能集团持股 25.27%。公司与股东单位在业务、人员、资产、机构、财务等方面完全分开，董事会、监事会及各职能部门均能独立运作，具有独立完整的业务和自主经营能力。

(一) 业务独立情况

公司按照《公司法》和《公司章程》的规定，根据中国证监会核准的经营范围依法自主独立地开展业务，公司已取得了经营证券业务所需的相关业务许可，具有独立完整的业务体系和自主

经营能力，业务运营不受股东单位及关联方控制和影响，能独立面向市场参与竞争，不存在股东单位及关联方违反公司运作程序，干预公司内部管理和经营决策的行为。

（二） 人员独立情况

公司设有专门的人力资源管理总部，拥有独立完整的劳动、人事及工资管理体系。公司通过法定程序聘任了董事、监事和高级管理人员，公司高级管理人员未在股东单位及下属企业担任除董事、监事以外的任何职务，也未在与公司业务相同或相近的其他企业任职。公司股东没有超越股东大会、董事会的职权任免公司董事、监事和高级管理人员。董事、监事和高级管理人员的聘任均严格按照《公司法》、《证券法》和《公司章程》的规定，通过合法程序进行。公司建立了完善的劳动用工、人事管理、工资管理和社会保障制度，且全体员工均依法与公司签订《劳动合同》，公司拥有独立的劳动用工权力，不存在受股东干涉的情况。

（三） 资产独立情况

公司具有开展证券业务所必备的独立完整的资产，不存在股东单位及关联方占用公司资产以及损害公司、公司其他股东、公司客户合法权益的情况。公司依法独立经营管理公司资产，拥有业务经营所需的特许经营权、房产、经营设备以及商标。

（四） 机构独立情况

公司建立了完善的法人治理结构，设有股东大会、董事会、监事会、经营层以及相关经营管理部门，“三会一层”运作良好，依法行使各自职权。公司拥有独立完整的证券业务经营、管理体系，独立自主地开展业务经营，组织机构的设置和运行符合中国证监会的有关要求。现有的办公机构和经营场所与股东单位完全分开，不存在机构混同的情况，也不存在股东单位直接干预公司经营活动的情形。

（五） 财务独立情况

公司设立了专门的财务部门，建立了专门的财务核算体系和财务管理制度。公司按照决策程序进行财务决策，不存在股东单位及关联方干预公司资金使用的情况。公司由董事会任命财务总监，并配备了专职财务人员，在银行单独开立账户，不存在与股东单位及关联方共用账户的情况。公司作为独立纳税人，依法按财税制度规定缴纳各类税款。

存在同业竞争的，公司相应的解决措施、工作进度及后续工作计划

适用 不适用

七、报告期内对高级管理人员的考评机制，以及激励机制的建立、实施情况

适用 不适用

报告期内，公司高级管理人员坚持“创新、转型、发展”的总思路，顺应行业发展新形势，带领干部员工奋发图强、团结进取，进一步加快资本补充和人才建设，进一步完善体制、机制建设，推进业务转型，加强合规风控工作，公司各项业务发展以及考核指标取得了显著成绩。报告

期内，公司加大年轻干部的引进、培养、提拔和使用力度，进一步优化干部队伍结构；实施干部任期考察，严格干部履职监督；加大干部培训培养力度，提升中高层干部领导力。

公司对高级管理人员职责范围内的工作明确业绩目标，在每个会计年度结束后，公司对高级管理人员都进行年度绩效考评。

八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

公司内部控制自我评价报告的具体内容详见公司于 2021 年 3 月 30 日在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 披露的《东方证券股份有限公司 2020 年度内部控制评价报告》。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

九、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

公司聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对公司内部控制进行了审计，并出具了无保留意见的内部控制审计报告。

公司内部控制审计报告的具体内容详见公司于 2021 年 3 月 30 日在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 披露的《东方证券股份有限公司内部控制审计报告》。

是否披露内部控制审计报告：是

内部控制审计报告意见类型：标准的无保留意见

十、内部控制责任声明及风险管理及内部控制制度建设情况

(一) 董事会声明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施风险管理及内部控制系统，评价该等制度的有效性，并如实披露内部控制评价报告是公司董事会的责任。监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。经理层负责组织领导企业内部控制的日常运行。公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并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。公司的该等风险管理及内部控制系统只合理而非绝对保证可防范重大不实陈述或损失，因为其目的均

旨在管理，而非消除未能达成业务目标的风险。

(二) 风险管理及内部控制机构设置情况

公司建立了科学、高效的内部控制架构体系，董事会、监事会、经理层、职能管理部门和业务经营部门在整个内部控制架构体系中，分工明确、各司其职。

公司董事会对公司内部控制有效性负责。董事会下设合规与风险管理委员会、审计委员会等专门委员会，总体监督内部控制的有效实施和内部控制自我评价。合规总监负责执行合规管理的战略和政策，并向董事会提交合规报告。公司监事会负责对董事会建立与实施内部控制进行监督。公司经营层负责组织领导公司内部控制的日常运行。

内部控制管理职能部门主要包括合规法务管理总部、风险管理总部、稽核总部、战略发展总部、纪律检查室、系统研发总部、系统运行总部及人力资源管理总部等部门，负责内部控制工作的具体实施并评估各项内控制度的健全有效性。公司各职能部门、分支机构及子公司为内部控制实施单位，指定专人负责本单位内部控制体系的完善和评价等相关工作。

(三) 风险管理及内部控制制度的建立健全情况

报告期内，公司在上一年度工作的基础上，结合公司内部控制评价工作，对公司治理、主营业务及合规风控等方面的制度进行了全面梳理和完善，制定、修订了一批内部规章制度，旨在进一步健全内部控制，规范业务流程，确保内部控制覆盖公司各业务环节及管理事项的决策、执行和监督全过程。

公司已采纳多项政策及程序，以评估及审慎地提高本集团风险管理及内部监控系统的成效。报告期内，公司依据各级监管机关发布的新规，并结合证券行业文化建设、廉洁从业管理等相关要求，对内部控制制度进行更新和完善，共签发制度 110 余项，其中公司级及以上制度 70 余项，部门级制度 40 余项。主要包括：《公司章程》、《东方证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法》、《东方证券股份有限公司内部控制管理办法（2020 年修订）》、《东方证券股份有限公司全面风险管理基本制度（2020 年修订）》、《东方证券股份有限公司固定资产管理办法》、《东方证券股份有限公司档案管理办法》、《东方证券股份有限公司行政印章管理细则》等。

(四) 建立财务报告内部控制的依据

依据中国财政部、中国证监会、中国审计署、中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会联合发布的《企业内部控制基本规范》及《企业内部控制配套指引》、中国证监会发布的《证券公司内部控制指引》和上交所发布的《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等文件，公司建立健全财务报告内部控制体系。

报告期内，公司严格按照《公司法》、《会计法》、《企业会计准则》、《会计工作基础规范》、《金融企业财务规则》、《企业内部控制基本规范》等相关法律法规的规定，结合行业特点及公司实际情况，对公司财务会计管理制度进行了梳理和完善。公司编制的财务报告符合会计准则的要求，并能够真实、准确、完整地反映公司财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

公司监事会以及外部审计机构等依据《公司章程》和相关规定对公司财务进行有效地检查监督，并对公司财务报告发表专业的审计意见。

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，能够保障财务报告质量，确保财务信息的高度可靠性。

(五) 风险管理及内部控制体系的运行情况

截至 2020 年底，公司已建立了全面覆盖公司各部门、分支机构及子公司的内部控制体系。公司根据《企业内部控制基本规范》、《企业内部控制评价指引》、《证券公司内部控制指引》、《上海证券交易所上市公司内部控制指引》以及《证券投资基金经营机构债券投资交易业务内控指引》、《证券公司投资银行类业务内部控制指引》等相关法律法规的要求，对各部门、分支机构及子公司的业务流程进行了全面梳理，并定期根据外部法律法规、公司制度及业务开展情况进行更新，识别风险并编制风险清单，评估内部控制措施的有效性，编制内部控制手册，通过对标现有政策、制度及风险清单等查找内部控制缺陷，制定内控缺陷整改方案，督促各单位对内控缺陷进行分析和整改落实，并对内部控制运行情况组织实施评价工作。

(六) 风险管理及内部控制评价结论

公司已根据《企业内部控制基本规范》、《企业内部控制评价指引》、《证券公司内部控制指引》以及《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等相关法律法规的要求，对公司截至 2020 年 12 月 31 日的内部控制设计与运行的有效性进行了自我评价，并出具 2020 年度《内部控制评价报告》。董事会合规与风险管理委员会对本集团的风险管理及内部监控系统是否足够和有效作出分析及独立评估。报告期内，根据公司财务报告内部控制重大缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日，不存在财务报告内部控制重大缺陷，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。

根据公司非财务报告内部控制重大缺陷认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司未发现非财务报告内部控制重大缺陷。

自内部控制评价报告报告基准日至内部控制评价报告报告发出日之间未发生对评价结论产生实质性影响的内部控制的重大变化。

(七) 董事会关于 2021 年度内部控制的工作计划

为保证公司内部控制与公司经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，公司将在 2021 年结合自身发展需求，根据《企业内部控制基本规范》及其配套指引的要求，对内部控制管理进行不断地调整和完善；继续加强内部控制规范的宣传和培训，持续提升公司内部控制及风险管理水平。

十一、 公司合规管理体系建设情况

报告期内，在公司的统一部署下，在首席风险官兼合规总监的带领下，合规法务管理总部紧密围绕董事会、监事会下发的《监督建议书》的指导要求，顺利开展各项合规管理工作，合规管理体系运行基本有效，全年未发生重大违法违规事件，未受到任何行政监管措施及以上的处理。中国证监会对公司分类评价结果为 A 类 A 级；人民银行上海分行对公司 2019 年度反洗钱工作进行分类评级，结果为 BBB 级，排名上海辖区综合类券商第一。

1、公司合规管理理念。

公司所倡导的合规管理理念主要有：全员合规；合规从管理层做起；合规创造价值；合规是公司的生存基础。

2、公司合规管理原则。

公司通过建立和执行合规管理制度，建立合规管理机制，确保合规管理体系的有效性、全面性、独立性及强制性。

3、合规管理组织架构及职责。

为保障公司依法经营，合规运作，增强公司自我约束能力，实现公司持续规范稳健发展，公司根据《证券公司监督管理条例》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、《证券公司合规管理实施指引》等相关法律法规、自律规则的规定，坚持有效性、独立性、全面性及强制性的原则，构建了较为完善的合规管理体系。

在公司合规管理组织架构中，公司各层级的合规管理职责为：

董事会负责决定本公司的合规管理目标，对公司合规管理的有效性承担最终责任。其具体职责包括：审议批准合规管理的基本制度；审议批准年度合规报告；决定解聘对发生重大合规风险负有主要责任或者领导责任的高级管理人员；决定聘任、解聘、考核合规总监，决定其薪酬待遇；建立与合规总监的直接沟通机制；评估合规管理有效性，督促解决合规管理中存在的问题；公司章程规定的其他合规管理职责等。

为保障合规管理的专业化，董事会设合规与风险管理委员会，其合规管理职责包括：对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见；董事会确定的其他职责和公司股票上市地上市规则或监管规则要求的其他职责等。

公司监事会对公司合规管理的有效性承担监督责任。其具体职责包括：对董事、高级管理人员履行合规管理职责的情况进行监督；对发生重大合规风险负有主要责任或者领导责任的董事、高级管理人员提出罢免的建议；公司章程规定的其他合规管理职责等。

公司高级管理人员负责落实合规管理目标，健全合规管理机制，落实日常经营管理的合规管理工作。其具体职责包括：建立健全合规管理组织架构，遵守合规管理程序，配备充足、适当的合规管理人员，并为其履行职责提供充分的人力、物力、财力、技术支持和保障；组织起草、制

定以及贯彻执行公司规章制度，并监督其实施；主动在日常经营过程中倡导合规经营理念，积极培育公司合规文化，认真履行合规管理职责，主动落实合规管理要求；充分重视公司合规管理的有效性，发现存在问题时要求各部门、各分支机构、各层级子公司及其工作人员及时改进；督导、提醒公司其他高级管理人员以及各部门、各分支机构、各层级子公司负责人认真履行合规管理职责，落实合规管理要求；支持合规总监、合规法务管理总部以及各部门、各分支机构、各层级子公司合规管理人员的工作，督促各部门、各分支机构、各层级子公司为合规管理人员履职提供有效保障；支持各部门、各分支机构、各层级子公司及其合规管理人员按照公司制度规定，向公司及合规法务管理总部报告合规风险事项；支持合规总监及合规法务管理总部按照监管要求和公司制度规定，向董事会、监管部门报告合规风险事项；在其职责范围内的经营决策过程中，充分听取合规总监、合规法务管理总部及各部门、各分支机构、各层级子公司合规管理人员的合规意见，并给予充分关注；督促公司各部门、各分支机构、各层级子公司就合规风险事项开展自查或配合公司调查，严格按照公司规定进行合规问责，并落实整改措施；公司章程规定或者董事会确定的其他合规管理职责等。

公司各部门、各分支机构及各子公司的负责人负责落实本单位的合规管理目标，并应当加强对本单位工作人员执业行为合规性的监督管理，对本单位合规运营承担责任。其具体职责包括：在本单位组织贯彻执行公司各项规章制度，组织起草、制定与本单位职责相关的规章制度，并监督其实施；建立并完善本单位的合规管理制度与机制，将各项经营活动的合规性要求嵌入业务管理制度与操作流程中；在本单位主动倡导合规经营理念，积极培育公司合规文化；积极配合合规总监及合规法务管理总部的工作，认真听取并落实合规总监及合规法务管理总部提出的合规管理意见；为本单位配备合格合规管理人员，避免分配与其履行合规职责相冲突的工作；支持本单位合规管理人员的工作，为本单位合规管理人员提供履职保障，包括但不限于参与本单位重要会议、查阅本单位各类业务与管理文档、充分尊重其独立发表合规专业意见的权利等；在业务开展前应当充分论证业务的合法合规性，充分听取本单位合规管理人员的合规审查意见，有效评估业务的合规风险，主动避免开展存在合规风险的业务；发现与本单位业务相关的合规风险事项时，及时按公司制度规定进行报告，提出整改措施，并督促整改落实等。

公司全体工作人员应当遵守与其执业行为有关的法律、法规和准则，主动识别、控制其执业行为的合规风险，并对其自身经营活动范围内所有业务事项和执业行为的合规性承担直接责任，履行下列合规管理职责：主动了解、掌握和遵守相关法律、法规和准则；积极参加公司安排的合规培训和合规宣导活动；根据公司要求，签署并信守相关合规承诺；在执业过程中充分关注执业行为的合法合规性；在业务开展过程中主动识别和防范业务合规风险；发现违法违规行或者合规风险隐患时，应当主动按照公司规定及时报告；出现合规风险事项时，积极配合公司调查，并接受公司问责，落实整改要求等。

为保障合规管理的有效开展，公司根据规定设立了合规总监，合规总监是公司的合规负责人，是公司高级管理人员，直接向董事会负责，对本公司及其工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督和检查。

为保障合规总监独立开展工作，公司还规定合规总监不得兼任业务部门负责人及具有业务职能的分支机构负责人，不得分管业务部门及具有业务职能的分支机构，不得在下属子公司兼任具有业务经营性质的职务等与合规管理职责相冲突的职务。合规总监职责主要包括：（一）组织拟定合规管理的基本制度和其他合规管理制度，督导下属各单位实施；外部法律法规和准则发生变动时，及时建议董事会或高级管理人员并督导有关部门，评估其对合规管理的影响，修改、完善有关制度和业务流程。（二）对公司内部规章制度、重大决策、新产品和新业务方案等进行合规审查，并出具书面合规审查意见；对公司报送中国证监会及其派出机构、自律组织的有关申请材料或报告，应上述机构要求进行合规审查，并签署合规审查意见；申请材料或报告中基本事实和业务数据的真实性、准确性及完整性应由其他相关高级管理人员负责；公司不采纳合规总监的合规审查意见的，应将有关事项提交董事会决定。（三）对公司及其工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行监督，并按照中国证监会及其派出机构、自律组织的要求和公司规定进行定期、不定期的检查。（四）协助董事会和高级管理人员建立和执行信息隔离墙、利益冲突管理和反洗钱制度。（五）为公司高级管理人员、下属各单位提供合规咨询。（六）组织对公司高级管理人员、下属各单位及员工进行合规培训。（七）指导和督促公司有关部门处理涉及公司和员工违法违规行为的投诉和举报。（八）按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营合法合规情况和合规管理工作开展情况；发现公司存在违法违规行或合规风险隐患的，应当依照公司章程规定及时向董事会、经营管理主要负责人报告，提出处理意见，并督促整改。应当同时督促公司及时向中国证监会相关派出机构报告；公司未及时报告的，应当直接向中国证监会相关派出机构报告；有关行为违反行业规范和自律规则的，还应当向有关自律组织报告。（九）及时处理中国证监会及其派出机构、自律组织要求调查的事项，配合中国证监会及其派出机构、自律组织对公司的检查和调查，跟踪和评估监管意见和监管要求的落实情况。（十）将出具的合规审查意见、提供的合规咨询意见、签署的公司文件、合规检查工作底稿等与履行职责有关的文件、资料存档备查，并对履行职责的情况作出记录。（十一）其他与合规管理工作不冲突的职责。

公司还设合规部门配合合规总监工作，公司合规部门为合规法务管理总部。合规法务管理总部是配合合规总监履行合规管理职责的职能部门，负责公司的合规管理和法务管理。合规法务管理总部负责人应当由合规总监提名。合规法务管理总部对合规总监负责，按照公司规定和合规总监的安排履行合规管理职责。合规法务管理总部不得承担业务、财务、信息技术等与合规管理职责相冲突的其他职责。

公司在各部门和分支机构设立专职或兼职的合规与风控专员岗，负责制定并细化本单位的内部控制流程、对本部门各项业务活动进行合规审核、落实合规管理工作，并协助合规法务管理总

部开展工作，保障将合规管理覆盖到经营管理和员工执业行为的全过程。合规与风控专员岗由其所在单位一定职级以上人员担任，并具有履职胜任能力。

稽核总部将合规管理的有效性纳入内部审计范畴，对公司和所属各部门、分支机构、全资及控股子公司的合规管理情况进行独立稽核和评价，提出合理稽核意见，促进公司提高合规管理水平。对于内部审计发现的问题，相关责任单位应当及时落实整改。公司应将稽核结果纳入考核与问责范围，对于存在严重违规问题或因整改不力造成一定后果的单位或个人，应当实施责任追究。

4、公司合规管理制度体系

公司根据中国证监会《证券公司监督管理条例》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》、中国证券业协会《证券公司合规管理实施指引》等法律法规和自律规则的要求，根据公司的实际情况，对公司各层级合规管理职责、履职保障、运行机制等进行了规定。

2020 年度，公司对标新《证券法》及其配套文件等最新监管要求，全面开展制度对标、修订工作。根据《证券法》及有关配套文件的新要求、新变化，并结合落实行业文化建设的要求，合规部组织全公司共 25 个部门开展制度对标工作，要求全面梳理本部门相关制度与流程，及时完成制度修订和新增工作。经各部门梳理对标制度共 661 项，其中拟修订制度 145 项，拟废止制度 54 项，并拟新增制度 24 项，均已制定具体改进计划。

此外，公司在制定修订各项制度时，将合规管理的各项要求融入到各项业务流程。根据规定，公司制定或修订各项制度需要经过合规部门审核，为各项制度的规范性提供了保障。2020 年度，公司共对 162 项公司级、部门级各项新定及修订的制度进行了合规与法律审查，并完成制度入库 109 项，实现了各项制度的与时俱进。

5、合规报告体系

公司建立健全合规报告制度，在分支机构、子公司、业务部门、合规法务管理总部、经营层、董事会之间建立畅通的合规信息沟通机制，确保相关信息传递与反馈的及时、准确、完整。

各部门、分支机构、子公司按照公司规定，向合规总监及公司合规法务管理总部报告本单位的经营管理合法合规情况和合规管理工作开展情况。合规总监按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理合法合规情况和合规管理工作开展情况；按照中国证监会及其派出机构、自律组织的要求，及时报告相关事项。合规总监发现公司存在违法违规行为或合规风险隐患，按规定及时向董事会、监事会、经营管理层、监管机构及行业自律组织报告。

公司合规管理基本制度对公司各层级合规报告路径进行了规定。当前，公司建立了包括日报、月报、年报、临时报告、专项报告等在内的完整的报告体系，主要包括：

年报及半年报方面，根据规定，公司在报送年度报告的同时向监管机构报送上一年度的公司年度合规报告。年度合规报告按规定内容和格式撰写，由董事会审议通过并经董事签署意见。同时，合规报告还报公司监事会，以便公司监事更好地了解公司合规管理工作开展情况。半年报方面，公司于每半年度结束后撰写半年度合规报告，并报公司董事会、监事会审议通过。

月报方面，合规部门各业务条线都有合规与风险管理监控月报，分别报送合规总监、被监控部门及其分管领导。合规部门还通过合规管理综合月报向公司主要领导汇报每月风险事项及合规与风险管理工作开展情况。各部门合规与风控专员岗也建立了合规与风险管理月报制度。

日报方面，合规部门主要业务条线建立有工作日报，每日记录各项阈值与主要合规点。相关业务部门的合规与风控专员岗也建立了相应的日报制度。

对于一些特殊事项，公司通过临时报告与专项报告的形式及时报告。

十二、 公司合规稽核部门检查稽核情况

报告期内，公司稽核总部紧密围绕公司战略规划，坚持风险导向，严控稽核质量，挖掘稽核检查深度，强化协同联动、整改落实，努力提升稽核工作价值。

报告期内，稽核总部共完成 177 个稽核项目，包括 11 个业务及管理总部常规稽核项目、6 个子公司常规稽核项目、73 个营业部常规稽核项目；32 个离任稽核项目；52 个领导干部任期经济责任审计项目；3 个专项稽核项目。同时，牵头组织完成公司年度内部控制评价、合规管理有效性评估和全面风险管理评估工作和洗钱风险评估工作。

报告期内，稽核总部严格按照规范的程序和要求开展内部审计，在实现稽核全覆盖的同时突出稽核重点，关注公司主要部门、子公司及分支机构经营活动及内部控制的真实性、合法性和有效性，持续跟进并督促稽核工作中所发现问题的整改落实，加强对稽核检查结果的总结、分析和运用，做到对风险多发易发苗头的发现、揭示和提醒，在提高公司经营管理水平、夯实合规基础、完善内部控制、实现全面风险管理等方面起到了积极的促进作用。

十三、 其他

适用 不适用

(一) 公司秘书

截至报告期末，王如富先生与梁颖娴女士为公司联席公司秘书，梁颖娴女士为方圆企业服务集团（香港）有限公司的总监，本公司与梁颖娴女士之间的内部之主要联络人为本公司联席公司秘书王如富先生。根据《香港上市规则》第 3.29 条的要求，报告期内，王如富先生及梁颖娴女士均接受了超过 15 个小时之相关专业培训。

(二) 遵守证券交易则

本公司已采纳《标准守则》作为所有董事及监事进行本公司证券交易的行为守则。根据对董事及监事的专门查询后，所有董事及监事均确认：报告期内，各董事及监事均已严格遵守《标准守则》所订之标准。本公司亦就有关雇员（定义见《香港上市规则》）买卖公司证券交易事宜设定指引，指引内容不比《标准守则》宽松。本公司并没有发现有关雇员违反指引。

董事会将不时检查本公司的公司治理及运作，以符合《香港上市规则》有关规定并保障股东的利益。

(三) 内部监控

公司内部控制审计报告的具体内容详见公司于 2021 年 3 月 30 日在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 上披露的《东方证券股份有限公司 2020 年度内部控制审计报告》。

(四) 董事及核数师就账目之责任

董事会已确认其承担编制本集团截至 2020 年 12 月 31 日止年度报告的责任。

董事会负责就年度及中期报告、股价敏感资料及其他根据《香港上市规则》及其他监管规定所需披露事项，呈报清晰及明确的评估。管理层已向董事会提供有关必要的解释及资料，以便董事会就本集团的财务数据及状况作出知情评估，以供董事会审批。

公司并无面临可能对本公司持续经营业务之能力产生重大疑虑的重大不确定事件或情况。另外，公司已就董事、监事和高级管理人员可能的法律行动及责任作出适当的投保安排。

(五) 与股东的沟通

股东大会是公司的最高权力机构，股东通过股东大会行使权力。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。在《公司章程》的制度约束下，公司有序运行并保持健康稳定的发展，切实保护了公司及股东的利益。

公司高度重视股东的意见和建议，积极、主动、规范地开展各类投资者关系活动，与股东保持沟通，及时满足股东的合理需求。同时，公司通过公司网站 (<http://www.dfzq.com.cn>) 发布本公司的公告、财务数据及其他有关数据，作为促进与股东有效沟通的渠道，股东如有任何查询，可通过邮件、热线电话以及直接致函至本公司办公地址，公司会及时以适当方式处理相关查询。

董事会欢迎股东提出意见，并鼓励股东出席股东大会以直接向董事会或管理层提出其可能持有的任何疑虑。董事长及各委员会主任和管理层通常会出席年度股东大会及其他股东大会，以回答股东所提出的问题。

股东可以根据《公司章程》列明的程序召开股东大会并在股东大会上提出提案，《公司章程》已公布在上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)、香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 和公司网站 (<http://www.dfzq.com.cn>)。

公司 2020 年年度股东大会将安排董事会回答股东提问。

有关投票表决的详细程序及以投票方式、表决的决议议案将刊登于上交所网站 (A 股)，或载于股东通函内 (H 股)。

(六) 投资者关系活动

规范专业化的投资者关系管理既是上市公司的应尽义务，也是树立品牌形象与体现企业价值的有效手段。公司高度重视投资者关系管理的相关工作，并将投资者关系的维护与管理作为未来公司资本战略最重要的部署之一。公司不断完善投资者关系管理长效机制，建立 IR 工作体系、工作制度、工作流程；公司通过专设投资者热线、电子邮箱、公司网站、“东方证券投资者关系平

台” 微信公众号、电话会议、现场接待、网上互动、投资者见面会、业绩发布会、业绩路演及上交所推出的 E 互动平台等多种载体加强与投资者的沟通。

2020 年公司接待机构、分析师现场及线上调研 11 次，参加上市公司协会或券商策略交流会等投资者活动 17 次，举办线上业绩发布会 3 次，接听投资者热线电话并回答投资者提问，通过上证 E 互动耐心解答各类投资者的相关问题 75 个，及时与投资者进行互动问答，并于“东方证券投资者关系平台”公众号发布公司经营情况相关推送 46 篇，多维度提升投资者对公司的认同度，推进投资者与公司的协同发展。报告期内，在由证券时报社主办、中证中小投资者服务中心担任指导单位的“第 11 届中国上市公司投资者关系天马奖”中，公司荣获“最佳投资者关系公司奖”。

(七) 《公司章程》变更

经公司 2018 年年度股东大会审议通过，根据最新修订的《公司法》、《上市公司治理准则》等法律法规及规范性文件的规定，结合公司实际情况及经营管理的需要，公司对《公司章程》部分条款进行若干修订。详情请参阅公司日期为 2019 年 3 月 28 日、2019 年 5 月 28 日、2020 年 5 月 8 日的公告。

经公司 2019 年年度股东大会审议通过，根据 2019 年新颁布的《证券公司股权管理规定》、新修改的《上市公司章程指引》及《国务院关于调整适用在境外上市公司召开股东大会通知期限等事项规定的批复》等规定，结合公司实际及监管部门要求，公司对《公司章程》部分条款进行若干修订。详情请参阅 2020 年 3 月 28 日及 2020 年 5 月 16 日的公司公告。

经公司 2020 年第二次临时股东大会审议通过，根据 2020 年 3 月 1 日生效的《中华人民共和国证券法》及证监会《关于取消或调整证券公司部分行政审批项目等事项的公告》（证监会公告[2020]18 号）等规定，并结合公司经营管理的实际情况，公司对《公司章程》部分条款进行若干修订。详情请参阅 2020 年 10 月 30 日及 2020 年 12 月 9 日的公司公告。

第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

一、公司债券基本情况

单位:亿元 币种:人民币

| 债券名称 | 简称 | 代码 | 发行日 | 到期日 | 债券余额 | 利率(%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|---|----------|--------|------------------|------------------|------|-------|------------------|------|
| 东方证券股份有限公司 2017 年非公开发行公司债券(第一期)(品种二) | 17 东证 02 | 145577 | 2017 年 6 月 9 日 | 2022 年 6 月 9 日 | 10 | 5.50 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2017 年公开发行公司债券 | 17 东方债 | 143233 | 2017 年 8 月 3 日 | 2027 年 8 月 3 日 | 40 | 4.98 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第一期) | 19 东方债 | 163024 | 2019 年 11 月 25 日 | 2022 年 11 月 25 日 | 49 | 3.50 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第一期)(品种一) | 20 东证 01 | 166372 | 2020 年 3 月 24 日 | 2021 年 3 月 24 日 | 20 | 2.70 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第一期)(品种二) | 20 东证 02 | 166373 | 2020 年 3 月 24 日 | 2022 年 3 月 24 日 | 30 | 2.95 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第二期) | 20 东证 03 | 167010 | 2020 年 6 月 18 日 | 2023 年 6 月 18 日 | 40 | 3.45 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第一期) | 20 东债 01 | 163927 | 2020 年 8 月 19 日 | 2023 年 8 月 19 日 | 40 | 3.50 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第二期) | 20 东债 02 | 175182 | 2020 年 9 月 28 日 | 2023 年 9 月 28 日 | 35 | 3.75 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第三期) | 20 东债 03 | 175350 | 2020 年 11 月 4 日 | 2023 年 11 月 4 日 | 35 | 3.65 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |

公司债券付息兑付情况

√适用 □不适用

报告期内, 公司按照募集说明书约定按时足额支付公司债券利息。

公司于 2020 年 6 月 9 日完成东方证券股份有限公司 2017 年非公开发行公司债券(第一期)(品种一)本息兑付和摘牌。

公司于 2020 年 11 月 26 日完成东方证券股份有限公司公开发行 2015 年公司债券本息兑付和摘牌。

公司债券其他情况的说明

√适用 □不适用

单位:亿元 币种:人民币

| 债券名称 | 简称 | 代码 | 发行日 | 到期日 | 债券余额 | 利率(%) | 还本付息方式 | 交易场所 |
|------|----|----|-----|-----|------|-------|--------|------|
|------|----|----|-----|-----|------|-------|--------|------|

| | | | | | | | | |
|----------------------------------|-------------------|--------|------------------|------------------|-------|---------------|-------------------|----------------|
| 东方证券股份有限公司 2016 年次级债券(第一期) | 16 东证次 | 145159 | 2016 年 11 月 14 日 | 2021 年 11 月 14 日 | 40 | 3.45 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2017 年次级债券(第一期)(品种二) | 17 东次 02 | 145514 | 2017 年 4 月 26 日 | 2022 年 4 月 26 日 | 15 | 5.10 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2017 年次级债券(第二期)(品种二) | 17 东次 04 | 145554 | 2017 年 5 月 15 日 | 2022 年 5 月 15 日 | 15 | 5.35 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期) | 19 东次 01 | 151278 | 2019 年 3 月 19 日 | 2022 年 3 月 19 日 | 60 | 4.20 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第二期) | 19 东次 02 | 151683 | 2019 年 6 月 14 日 | 2022 年 6 月 14 日 | 40 | 4.20 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 上交所 |
| 金融债 | 东方证券 FRN B2022 | 5645 | 2019 年 8 月 20 日 | 2022 年 8 月 20 日 | 3 亿美元 | 6M LIBOR+1.25 | 单利按半年付息, 到期一次还本付息 | 香港联交所 |
| 金融债 | 东方证券 0.625% B2022 | 5646 | 2019 年 8 月 20 日 | 2022 年 8 月 20 日 | 2 亿欧元 | 0.625 | 单利按年付息, 到期一次还本付息 | 香港联交所 |
| 金融债 | 东方证券 2.9% N2022 | PFNB | 2019 年 9 月 27 日 | 2022 年 9 月 27 日 | 2 亿新币 | 2.90 | 单利按半年付息, 到期一次还本付息 | 新加坡证券交易所、香港联交所 |
| 东方证券股份有限公司 2020 年公开发行永续次级债券(第一期) | 20 东证 Y1 | 175032 | 2020 年 8 月 26 日 | - ¹ | 50 | 4.75 | 单利按年付息, 预计每年付息一次 | 上交所 |

报告期内, 公司按照募集说明书约定按时足额支付次级债券和境外债券利息。

公司于 2020 年 4 月 27 日完成东方证券股份有限公司 2017 年次级债券(第一期)(品种一)本息兑付和摘牌。

公司于 2020 年 5 月 15 日完成东方证券股份有限公司 2017 年次级债券(第二期)(品种一)本息兑付和摘牌。

公司于 2020 年 7 月 12 日完成东方证券股份有限公司 2018 年非公开发行次级债券(第一期)本息兑付和摘牌。

二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

| | | |
|---------|------|----------------------------------|
| 债券受托管理人 | 名称 | 光大证券股份有限公司 |
| | 办公地址 | 中国上海市静安区新闻路 1508 号 |
| | 联系人 | 周平 |
| | 联系电话 | 86-021-22169999 |
| 债券受托管理人 | 名称 | 东莞证券股份有限公司 |
| | 办公地址 | 中国上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 25 楼 |

¹ 以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期。在每个重定价周期末, 发行人有权选择将本期债券期限延长 1 个重定价周期(即延续 5 年), 或全额兑付本期债券。

| | | |
|--------|------|-------------------------------------|
| | 联系人 | 赵一芝 |
| | 联系电话 | 86-021-50155120 |
| 资信评级机构 | 名称 | 中诚信国际信用评级有限责任公司 |
| | 办公地址 | 中国北京市东城区朝阳门内大街南竹竿胡同 2 号银河 SOHO 6 号楼 |

其他说明：

适用 不适用

光大证券股份有限公司为公司 2015 年公司债券的债券受托管理人，东莞证券股份有限公司为公司 2017 年非公开发行公司债券、2017 年公开发行公司债券、2018 年非公开发行公司债券、2019 年公开发行公司债券、2020 年非公开发行公司债券、2020 年公开发行公司债券（面向专业投资者）的债券受托管理人。

三、公司债券募集资金使用情况

适用 不适用

（一）15 东证债

公司于 2015 年 11 月 26 日公开发行 5 年期公司债券，发行规模为人民币 120 亿元。根据该期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行相关费用后的资金净额全部用于补充公司营运资金，以扩大公司的业务规模，提升公司的市场竞争力和抗风险能力。

该期债券募集资金已汇入募集说明书中公司指定的募集资金专项账户，并用于补充公司营运资金，与募集说明书承诺的用途及其他约定一致。德勤华永会计师事务所对募集资金到位情况出具编号为“德师报（验）字（15）第 1759 号”的验资报告。

（二）17 东证 01、17 东证 02

公司于 2017 年 6 月 9 日非公开发行人民币 50 亿元的公司债券。“17 东证 01”期限为 3 年期，发行规模为人民币 40 亿元，“17 东证 02”期限为 5 年期，发行规模为人民币 10 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行费用后，用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，调整公司债务结构，以扩大公司的业务规模，提升公司的市场竞争力和抗风险能力。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（三）17 东方债

公司于 2017 年 8 月 3 日公开发行 10 年期公司债券，发行规模为人民币 40 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行相关费用后的资金净额全部用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，调整公司债务结构，以扩大公司的业务规模，提升公司的市场竞争力和抗风险能力。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（四）19 东方债

公司于 2019 年 11 月 25 日公开发行 3 年期公司债券，发行规模为人民币 49 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行相关费用后的资金净额全部用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，调整公司债务结构。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（五）20 东证 01、20 东证 02

公司于 2020 年 3 月 24 日非公开发行人民币 50 亿元的公司债券。“20 东证 01”期限为 1 年期，发行规模为人民币 20 亿元，“20 东证 02”期限为 2 年期，发行规模为人民币 30 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行费用后，用于偿还到期或回售的债务融资工具，优化公司债务结构。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（六）20 东证 03

公司于 2020 年 6 月 18 日非公开发行 3 年期的公司债券，发行规模为人民币 40 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行费用后，用于偿还到期或回售的债务融资工具，优化公司债务结构。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（七）20 东债 01

公司于 2020 年 8 月 19 日公开发行 3 年期公司债券，发行规模为人民币 40 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行相关费用后的资金净额全部用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，调整公司债务结构。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（八）20 东债 02

公司于 2020 年 9 月 28 日公开发行 3 年期公司债券，发行规模为人民币 35 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行相关费用后的资金净额全部用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，调整公司债务结构。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

（九）20 东债 03

公司于 2020 年 11 月 4 日公开发行 3 年期公司债券，发行规模为人民币 35 亿元。根据本期债券募集说明书的相关内容，发行人将募集资金扣除发行相关费用后的资金净额全部用于补充公司营运资金，满足公司业务运营需要，调整公司债务结构。

公司严格按照相关法律法规及募集说明书披露的用途使用资金。

四、公司债券评级情况

√适用 □不适用

报告期内，中诚信国际信用评级有限责任公司对公司已发行公司债券“15 东证债”、“17 东方债”、“19 东方债”的信用状况进行了跟踪评级，并出具了《东方证券股份有限公司 2020

年度跟踪评级报告》（信评委函字[2020]跟踪 0337 号），维持公司债券“15 东证债”、“17 东方债”、“19 东方债”的信用等级为 AAA，维持本次发债主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。

报告期内，中诚信证券评估有限公司对公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第一期)“20 东债 01”的信用状况进行了评级，并出具了《东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)信用评级报告》（信评委函字[2020]1561D 号），评定公司债券“20 东债 01”的信用等级为 AAA，评定本次发债主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。

报告期内，中诚信证券评估有限公司对公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第二期)“20 东债 02”的信用状况进行了评级，并出具了《东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第二期)信用评级报告》（信评委函字[2020]3582D 号），评定公司债券“20 东债 02”的信用等级为 AAA，评定本次发债主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。

报告期内，中诚信证券评估有限公司对公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第三期)“20 东债 03”的信用状况进行了评级，并出具了《东方证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第三期)信用评级报告》（信评委函字[2020]4117D 号），评定公司债券“20 东债 03”的信用等级为 AAA，评定本次发债主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定。

五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

√适用 □不适用

报告期内，公司不存在债券增信机制。

偿债计划及其他相关情况

（一）利息支付

1、存续期内每年支付一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。“20 东债 03”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 11 月 4 日，“20 东债 02”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 9 月 28 日，“20 东债 01”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 8 月 19 日，“20 东证 03”的付息日为 2021 年至 2023 年每年的 6 月 18 日，“20 东证 02”的付息日为 2021 年至 2022 年每年的 3 月 24 日，“20 东证 01”的付息日为 2021 年的 3 月 24 日，“19 东方债”的付息日为 2020 年至 2022 年每年的 11 月 25 日，“17 东方债”的付息日为 2018 年至 2027 年每年的 8 月 3 日，“17 东证 02”的付息日为 2018 年至 2022 年每年的 6 月 9 日，“17 东证 01”的付息日为 2018 年至 2020 年每年的 6 月 9 日，“15 东证债”的付息日为 2016 年至 2020 年每年的 11 月 26 日（如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间不另计利息）。

2、债券利息的支付通过登记机构和有关机构办理。利息支付的具体事项将按照国家有关规定，由发行人在中国证监会指定媒体上发布的付息公告中加以说明。

3、根据国家税收法律、法规，投资者投资本次债券应缴纳的有关税金由投资者自行承担。

（二）本金的偿付

1、债券到期一次还本。“20东债03”的本金兑付日为2023年11月4日，“20东债02”的本金兑付日为2023年9月28日，“20东债01”的本金兑付日为2023年8月19日，“20东证03”的本金兑付日为2023年6月18日，“20东证02”的本金兑付日为2022年3月24日，“20东证01”的本金兑付日为2021年3月24日，“19东方债”的本金兑付日为2022年11月25日，“17东方债”的本金兑付日为2027年8月3日，“17东证02”的本金兑付日为2022年6月9日，“17东证01”的本金兑付日为2020年6月9日，“15东证债”的本金兑付日为2020年11月26日（如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第1个工作日，顺延期间不另计利息）。

2、债券本金的偿付通过债券登记机构和有关机构办理。本金偿付的具体事项将按照国家有关规定，由发行人在中国证监会指定媒体上发布的兑付公告中加以说明。

六、公司债券持有人会议召开情况

适用 不适用

七、公司债券受托管理人履职情况

适用 不适用

“20东债03”于2020年11月4日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“20东债02”于2020年9月28日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“20东债01”于2020年8月19日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“20东证03”于2020年6月18日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“20东证02”于2020年3月24日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“20东证01”于2020年3月24日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“19东方债”于2019年11月25日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期

内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“17东方债”于2017年8月3日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“17东证01、17东证02”于2017年6月9日完成发行，债券受托管理人东莞证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

“15东证债”于2015年11月26日完成发行，债券受托管理人光大证券股份有限公司在本期债券存续期间对公司履行债券募集说明书约定义务的情况进行了持续跟踪和监督，并于债券存续期内每年六月三十日前出具上一年度的债券受托管理事务报告。

八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

| 主要指标 | 2020 年 | 2019 年 | 本期比上年 同期增减 (%) | 变动原因 |
|---------------|------------------|------------------|-------------------|-----------------|
| 息税折旧摊销前利润 | 8,114,161,157.85 | 8,530,806,419.88 | -4.88 | 主要是利润总额减少 |
| 流动比率 | 1.31 | 1.31 | - | |
| 速动比率 | 1.31 | 1.31 | - | |
| 资产负债率 (%) | 73.13 | 75.75 | 减少 2.62 个百分点 | 主要是发行永续次级债券 |
| EBITDA 全部债务比 | 0.05 | 0.05 | - | |
| 利息保障倍数 | 1.60 | 1.56 | 2.56 | 主要是公司自有负债利息支出减少 |
| 现金利息保障倍数 | 9.96 | 4.04 | 146.53 | 主要是经营现金净流入增加 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 1.74 | 1.67 | 4.19 | 主要是公司自有负债利息支出减少 |
| 贷款偿还率 (%) | 100.00 | 100.00 | - | |
| 利息偿付率 (%) | 100.00 | 100.00 | - | |

注：资产负债率=（负债总额-代理买卖证券款-代理承销证券款）/（资产总额-代理买卖证券款-代理承销证券款）

九、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

√适用 □不适用

报告期内，公司其他债务融资工具包括证券公司短期融资券、拆入资金、卖出回购金融资产款、收益凭证等，各项融资工具均按期偿还本息，未发生逾期违约情况。

十、公司报告期内的银行授信情况

适用 不适用

截至报告期末，公司共获得 111 家银行的授信，额度合计人民币 4,433 亿元，其中大型国有银行及股份制商业银行授信总额为人民币 2,112 亿元，城农商行授信总额为人民币 2,321 亿元。报告期内，公司与各类银行均保持着良好的合作关系，具备较强的短期和中长期融资能力。

十一、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

适用 不适用

报告期内，公司严格执行公司债券募集说明书相关约定或承诺，募集资金投向与募集说明书的约定一致；严格履行信息披露责任，按期兑付债券利息，保障投资者的合法权益。报告期内，公司已发行债券兑付兑息不存在违约情况；公司经营稳定，盈利情况良好，未发现可能导致未来出现不能按期偿付情况的风险。

十二、公司发生的重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

适用 不适用

第十一节 财务报告

审计报告

德师报(审)字(21)第 P01428 号
(第 1 页, 共 5 页)

东方证券股份有限公司全体股东:

一、 审计意见

我们审计了东方证券股份有限公司(以下简称“东方证券”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表、2020 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东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,公允反映了东方证券 2020 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况以及 2020 年度的合并及母公司经营成果和合并及母公司现金流量。

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,我们独立于东方证券,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。我们确定下列事项是需要在审计报告中沟通的关键审计事项。

(一) 融出资金和买入返售金融资产预期信用损失的计量

1、 事项描述

东方证券融出资金、买入返售金融资产及其预期信用损失金额重大,在计量时管理层需作出重大判断和估计,因此我们将该事项认定为关键审计事项。

如财务报表附注四所述,东方证券管理层在计量预期信用损失时需作出重大判断和估计,包括确定信用风险是否显著增加和金融资产是否已发生信用减值、选择适当的模型和假设以及确定关键参数,包括违约概率、违约损失率和前瞻性信息等。

如财务报表附注七、3 所述,截至 2020 年 12 月 31 日,东方证券融出资金的原值为人民币 21,219 百万元,其减值准备余额为人民币 47 百万元。

审计报告 - 续

德师报(审)字(21)第 P01428 号
(第 2 页, 共 5 页)

三、关键审计事项 - 续

(一) 融出资金和买入返售金融资产预期信用损失的计量 - 续

如财务报表附注七、6 所述, 截至 2020 年 12 月 31 日, 东方证券买入返售金融资产的原值为人民币 19,494 百万元, 其减值准备余额为人民币 5,034 百万元。

2、 审计应对

对于上述事项, 我们实施了以下主要审计程序:

- 评价和测试管理层确认融出资金和买入返售金融资产预期信用损失计提相关的关键内部控制;
- 评估管理层所使用的模型及其关键假设和参数的适当性, 特别是违约概率、违约损失率以及前瞻性信息;
- 评估管理层在确定信用风险是否显著增加和金融资产是否已发生信用减值时所作出的判断, 并采用抽样的方法检查管理层判断的应用;
- 采用抽样的方法, 检查预期信用损失模型中管理层所使用的主要数据, 包括违约概率和违约损失率;
- 对已发生信用减值的资产采用抽样的方法, 评估管理层基于借款人和担保人财务信息、最新抵押物价值及其他相关因素的预计未来现金流计提的减值准备的合理性;
- 检查管理层对融出资金和买入返售金融资产预期信用损失的计算过程。

(二) 结构化主体的合并

1、 事项描述

确定是否将结构化主体纳入合并财务报表范围涉及管理层的重大判断, 且对合并财务报表产生重大影响, 因此我们将该事项认定为关键审计事项。

如财务报表附注四所述, 对于东方证券担任管理人的集合资产管理计划和基金, 东方证券管理层评估其持有的份额、管理人报酬和信用增级对这些集合资产管理计划和基金所产生的可变回报的风险敞口是否重大, 是否具备运用权力影响其可变回报的能力, 从而判断东方证券是否为主要责任人。如果东方证券担任的角色为主要责任人, 则需要将这些集合资产管理计划和基金纳入合并范围。

如财务报表附注六、1 所述, 截至 2020 年 12 月 31 日, 纳入合并财务报表合并范围的结构化主体的净资产合计为人民币 7,368 百万元。

审计报告 - 续

德师报(审)字(21)第 P01428 号
(第 3 页, 共 5 页)

三、 关键审计事项 - 续

(二) 结构化主体的合并 - 续

2、 审计应对

如财务报表附注九、2 所述,截至 2020 年 12 月 31 日,本集团管理的未纳入合并财务报表合并范围的结构化主体的净资产合计为人民币 328,845 百万元。

对于上述事项,我们实施了以下主要审计程序:

- 评价和测试管理层确定结构化主体是否纳入合并范围相关的关键内部控制;
- 采用抽样的方法,对本年新取得的、或者持有份额或条款发生变化的结构化主体,通过查阅投资协议以及其他相关交易文件,检查管理层对合并评估过程中所使用的信息的适当性;
- 采用抽样的方法,评估管理层确定重大的结构化主体是否应纳入合并范围时所作的重大判断及结论。

四、 其他信息

东方证券管理层对其他信息负责。其他信息包括东方证券 2020 年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

东方证券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,管理层负责评估东方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,除非管理层计划清算东方证券、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督东方证券的财务报告过程。

审计报告 - 续

德师报(审)字(21)第 P01428 号
(第 4 页, 共 5 页)

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：

- (1) 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。
- (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。
- (3) 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。
- (4) 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，就可能对东方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东方证券不能持续经营。
- (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、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。
- (6) 就东方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。

审计报告 - 续

德师报(审)字(21)第 P01428 号
(第 5 页, 共 5 页)

六、 注册会计师对财务报表审计的责任 - 续

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。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

中国·上海

中国注册会计师: 史曼

(项目合伙人)

中国注册会计师: 潘竹筠

2021 年 3 月 30 日

合并及母公司资产负债表
2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 合并 | | | 公司 | | |
|-------------|-----|---------------------------|---------------------------|-----|---------------------------|---------------------------|
| | 附注七 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 附注八 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
| 资产： | | | | | | |
| 货币资金 | 1 | 65,640,359,556.65 | 48,940,833,855.08 | | 30,827,925,102.87 | 27,584,528,645.46 |
| 其中：客户存款 | | 48,384,423,234.76 | 29,749,885,413.76 | | 22,343,282,321.26 | 15,328,726,447.66 |
| 结算备付金 | 2 | 21,516,356,646.61 | 13,243,653,713.68 | | 6,665,101,639.08 | 5,964,640,336.28 |
| 其中：客户备付金 | | 18,591,394,862.89 | 10,832,489,059.97 | | 3,820,176,412.38 | 3,624,212,744.79 |
| 融出资金 | 3 | 21,171,919,414.06 | 13,214,262,240.75 | | 20,945,414,325.69 | 12,924,954,996.12 |
| 衍生金融资产 | 4 | 155,876,469.76 | 609,102,138.41 | | 140,085,973.58 | 575,515,312.04 |
| 应收款项 | 5 | 874,405,553.22 | 1,019,919,667.42 | | 236,450,026.41 | 515,023,059.52 |
| 合同资产 | | 1,741,886.80 | - | | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6 | 14,460,425,371.36 | 24,206,541,982.29 | | 14,114,676,723.43 | 23,189,665,726.78 |
| 金融投资： | | | | | | |
| 交易性金融资产 | 7 | 72,701,117,042.70 | 66,901,093,485.91 | | 51,976,489,033.63 | 45,611,235,174.41 |
| 债权投资 | 8 | 6,243,897,149.81 | 7,193,554,228.81 | | 6,243,897,149.81 | 7,193,554,228.81 |
| 其他债权投资 | 9 | 62,645,974,916.84 | 64,895,563,425.25 | | 62,645,974,916.84 | 64,895,563,425.25 |
| 其他权益工具投资 | 10 | 10,936,457,571.84 | 10,832,873,153.66 | | 10,868,377,303.52 | 10,796,863,763.79 |
| 存出保证金 | 12 | 2,183,089,694.77 | 1,642,894,348.47 | | 1,368,644,580.82 | 1,039,478,872.81 |
| 长期股权投资 | 13 | 5,771,193,948.89 | 4,453,754,152.13 | 1 | 18,359,113,837.35 | 16,052,295,287.16 |
| 使用权资产 | 14 | 847,354,948.02 | 1,002,749,135.63 | | 520,743,257.64 | 600,692,065.06 |
| 投资性房地产 | 15 | 40,460,670.03 | 30,071,334.10 | | 40,956,605.82 | 31,207,205.57 |
| 固定资产 | 16 | 2,019,601,972.64 | 2,040,273,431.66 | | 1,955,354,902.22 | 2,003,468,158.30 |
| 在建工程 | 17 | 65,838,524.98 | 50,034,280.51 | | 49,090,408.01 | 32,053,112.19 |
| 无形资产 | 18 | 215,313,094.34 | 168,519,080.82 | | 165,438,139.67 | 133,358,159.27 |
| 商誉 | 19 | 32,135,375.10 | 32,135,375.10 | | 18,947,605.48 | 18,947,605.48 |
| 递延所得税资产 | 20 | 1,455,922,066.16 | 760,993,782.62 | | 1,118,921,115.03 | 483,544,028.25 |
| 其他资产 | 21 | 2,137,999,709.85 | 1,732,618,757.83 | | 353,464,867.38 | 248,445,432.89 |
| 资产总计 | | 291,117,441,584.43 | 262,971,441,570.13 | | 228,615,067,514.28 | 219,895,034,595.44 |

(续)

合并及母公司资产负债表
 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 负债和所有者权益 | 合并 | | | 公司 | | |
|-------------------|-----|---------------------------|---------------------------|-----|---------------------------|---------------------------|
| | 附注七 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 附注八 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | | | | |
| 短期借款 | 23 | 579,732,185.45 | 640,153,529.20 | | - | - |
| 应付短期融资款 | 24 | 16,255,485,786.37 | 16,113,199,559.50 | | 16,255,099,446.23 | 14,988,990,739.57 |
| 拆入资金 | 25 | 9,670,113,871.43 | 6,384,658,783.33 | | 9,670,113,871.43 | 6,384,658,783.33 |
| 交易性金融负债 | 26 | 14,576,073,144.23 | 12,630,960,595.06 | | 12,277,620,007.87 | 11,190,368,847.52 |
| 衍生金融负债 | 4 | 504,956,696.48 | 2,643,374,802.36 | | 486,364,134.27 | 2,618,097,637.41 |
| 卖出回购金融资产款 | 27 | 52,860,883,439.73 | 57,478,062,865.93 | | 49,352,916,474.90 | 51,950,254,756.90 |
| 代理买卖证券款 | 28 | 66,642,671,158.50 | 40,179,178,362.34 | | 26,064,505,023.18 | 18,598,949,938.01 |
| 代理承销证券款 | 29 | 346,000,000.00 | 80,000,000.00 | | - | - |
| 应付职工薪酬 | 30 | 2,608,008,552.75 | 1,601,085,895.75 | | 830,595,930.09 | 516,763,731.76 |
| 应交税费 | 31 | 782,814,613.10 | 278,223,978.52 | | 198,279,717.43 | 85,429,345.37 |
| 应付款项 | 32 | 576,584,579.01 | 480,101,048.74 | | 172,917,242.52 | 109,310,735.36 |
| 合同负债 | 33 | 404,123,622.43 | 208,113,569.43 | | - | - |
| 租赁负债 | 34 | 856,910,328.86 | 995,005,231.20 | | 516,618,322.33 | 591,193,431.56 |
| 应付债券 | 35 | 62,265,473,497.68 | 67,309,198,769.40 | | 56,346,130,110.86 | 62,122,472,455.10 |
| 递延所得税负债 | 20 | 20,179,387.19 | 19,031,249.53 | | - | - |
| 其他负债 | 36 | 1,936,286,692.04 | 1,919,456,597.00 | | 779,855,226.10 | 151,648,228.15 |
| 负债合计 | | 230,886,297,555.25 | 208,959,804,837.29 | | 172,951,015,507.21 | 169,308,138,630.04 |
| 所有者权益： | | | | | | |
| 股本 | 37 | 6,993,655,803.00 | 6,993,655,803.00 | | 6,993,655,803.00 | 6,993,655,803.00 |
| 其他权益工具 | 38 | 5,000,000,000.00 | - | | 4,995,754,716.98 | - |
| 资本公积 | 39 | 28,311,403,655.40 | 28,254,929,991.63 | | 28,157,008,370.79 | 28,157,008,370.79 |
| 其他综合收益 | 40 | 35,594,335.59 | 499,960,781.41 | | 178,831,351.45 | 556,061,852.46 |
| 盈余公积 | 41 | 3,676,148,380.92 | 3,445,689,429.69 | | 3,676,148,380.92 | 3,445,689,429.69 |
| 一般风险准备 | 42 | 8,691,097,190.12 | 7,997,676,253.44 | | 6,975,205,014.01 | 6,667,921,526.55 |
| 未分配利润 | 43 | 7,494,951,502.28 | 6,773,604,053.96 | | 4,687,448,369.92 | 4,766,558,982.91 |
| 归属于母公司所有者 权益合计 | | 60,202,850,867.31 | 53,965,516,313.13 | | 55,664,052,007.07 | 50,586,895,965.40 |
| 少数股东权益 | | 28,293,161.87 | 46,120,419.71 | | - | - |
| 所有者权益合计 | | 60,231,144,029.18 | 54,011,636,732.84 | | 55,664,052,007.07 | 50,586,895,965.40 |
| 负债和所有者权益总计 | | 291,117,441,584.43 | 262,971,441,570.13 | | 228,615,067,514.28 | 219,895,034,595.44 |

附注为财务报表的组成部分

第 177 页至第 313 页的财务报告由下列负责人签署：

法定代表人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

合并及母公司利润表
 2020 年 12 月 31 日止年度

单位：人民币元

| 项目 | 合并 | | | 公司 | | |
|-----------------------|-----|--------------------------|--------------------------|-----|-------------------------|-------------------------|
| | 附注七 | 本年发生额 | 上年发生额 | 附注八 | 本年发生额 | 上年发生额 |
| 一、营业总收入 | | 23,133,946,765.29 | 19,052,097,313.75 | | 8,969,255,840.36 | 6,665,556,580.78 |
| 手续费及佣金净收入 | 44 | 7,121,530,500.10 | 4,515,662,529.62 | 2 | 2,656,628,626.17 | 1,592,126,440.69 |
| 其中： | | | | | | |
| 经纪业务手续费净收入 | | 2,620,602,246.03 | 1,545,590,313.83 | | 2,099,138,101.94 | 1,264,678,341.59 |
| 投资银行业务手续费净收入 | | 1,581,795,683.49 | 1,050,011,888.59 | | 591,699,112.91 | 334,978,274.22 |
| 资产管理业务手续费净收入 | | 2,465,477,690.65 | 1,800,229,825.31 | | - | - |
| 利息净收入 | 45 | 778,772,618.91 | 890,621,995.87 | 3 | 705,808,093.65 | 843,274,733.74 |
| 其中： | | | | | | |
| 利息收入 | | 5,538,183,458.65 | 6,086,094,907.54 | | 5,109,033,383.02 | 5,605,711,699.80 |
| 利息支出 | | 4,759,410,839.74 | 5,195,472,911.67 | | 4,403,225,289.37 | 4,762,436,966.06 |
| 投资收益 | 46 | 5,011,629,307.14 | 3,414,721,885.19 | 4 | 4,608,535,266.01 | 3,023,131,060.06 |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | | 1,212,458,017.28 | 591,070,224.75 | | 905,857,438.59 | 443,762,875.74 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认收益 | | 859,420.43 | - | | 859,420.43 | - |
| 公允价值变动收益 | 47 | 1,375,893,326.27 | 936,710,069.58 | | 837,015,001.43 | 1,207,520,920.22 |
| 其他收益 | | 17,528,470.48 | 23,767,187.04 | | 12,763,415.59 | 8,080,945.90 |
| 汇兑收益/(损失) | | 208,302,301.95 | 12,163,513.10 | | 142,532,996.20 | (21,376,364.01) |
| 资产处置损失 | | (536,676.75) | (187,362.49) | | (542,787.18) | (199,916.38) |
| 其他业务收入 | 48 | 8,620,826,917.19 | 9,258,637,495.84 | | 6,515,228.49 | 12,998,760.56 |
| 二、营业总支出 | | 20,437,154,223.75 | 16,300,663,502.05 | | 7,882,845,687.55 | 4,256,662,942.43 |
| 税金及附加 | 49 | 96,943,406.88 | 71,338,550.08 | | 69,439,586.25 | 53,020,705.81 |
| 业务及管理费 | 50 | 7,805,280,526.90 | 5,941,425,532.65 | | 3,929,300,643.66 | 3,183,501,403.35 |
| 信用减值损失 | 51 | 3,885,132,441.16 | 1,044,458,050.46 | | 3,880,760,015.39 | 1,012,742,297.59 |
| 其他业务成本 | 48 | 8,649,797,848.81 | 9,243,441,368.86 | | 3,345,442.25 | 7,398,535.68 |
| 三、营业利润 | | 2,696,792,541.54 | 2,751,433,811.70 | | 1,086,410,152.81 | 2,408,893,638.35 |
| 加：营业外收入 | 52 | 133,759,263.77 | 159,009,087.75 | | 37,047,750.01 | 33,972,833.34 |
| 减：营业外支出 | 53 | 44,188,023.45 | 55,912,190.65 | | 26,108,304.38 | 49,806,065.67 |
| 四、利润总额 | | 2,786,363,781.86 | 2,854,530,708.80 | | 1,097,349,598.44 | 2,393,060,406.02 |
| 减：所得税费用 | 54 | 64,599,989.34 | 375,791,852.54 | | (439,043,409.75) | (9,012,590.14) |
| 五、净利润 | | 2,721,763,792.52 | 2,478,738,856.26 | | 1,536,393,008.19 | 2,402,072,996.16 |
| (一)按所有权归属分类： | | | | | | |
| 1.归属于母公司所有者的净利润 | | 2,722,988,518.72 | 2,435,079,764.10 | | | |
| 2.少数股东损益 | | (1,224,726.20) | 43,659,092.16 | | | |
| (二)按经营持续性分类： | | | | | | |
| 1.持续经营净利润 | | 2,721,763,792.52 | 2,478,738,856.26 | | 1,536,393,008.19 | 2,402,072,996.16 |
| 六、其他综合收益的税后净额 | 40 | (493,079,257.86) | 490,323,357.66 | | (405,943,313.05) | 591,247,889.22 |
| 归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额 | | (493,079,257.86) | 490,323,357.66 | | (405,943,313.05) | 591,247,889.22 |
| (一)以后不能重分类进损益的其他综合收益 | | (48,350,947.43) | 54,015,258.85 | | (72,406,310.25) | 151,967,215.61 |
| 1.其他权益工具投资公允价值变动 | | (48,350,947.43) | 54,015,258.85 | | (72,406,310.25) | 151,967,215.61 |
| (二)以后将重分类进损益的其他综合收益 | | (444,728,310.43) | 436,308,098.81 | | (333,537,002.80) | 439,280,673.61 |
| 1.权益法下可转损益的其他综合收益 | | (9,681,676.27) | (8,523,909.69) | | (8,357,018.46) | 1,951,965.89 |
| 2.其他债权投资公允价值变动 | | (436,061,634.75) | 421,056,784.92 | | (436,061,634.75) | 421,056,784.92 |
| 3.其他债权投资信用减值准备 | | 110,881,650.41 | 16,271,922.80 | | 110,881,650.41 | 16,271,922.80 |
| 4.外币财务报表折算差额 | | (109,866,649.82) | 7,503,300.78 | | | |
| 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 | | 2,228,684,534.66 | 2,969,062,213.92 | | 1,130,449,695.14 | 2,993,320,885.38 |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额 | | 2,229,909,260.86 | 2,925,403,121.76 | | | |
| 归属于少数股东的综合收益总额 | | (1,224,726.20) | 43,659,092.16 | | | |
| 八、每股收益： | 55 | | | | | |
| (一)基本每股收益 | | 0.38 | 0.35 | | | |

附注为财务报表的组成部分

合并及母公司现金流量表
2020 年 12 月 31 日止年度

单位：人民币元

| 项目 | 附注七 | 合并 | | 公司 | | |
|---------------------------|--------|---------------------------|---------------------------|-------|---------------------------|---------------------------|
| | | 本年发生额 | 上年发生额 | 附注八 | 本年发生额 | 上年发生额 |
| 一、经营活动产生的现金流量： | | | | | | |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额 | | 1,023,347,015.27 | - | | - | - |
| 交易性金融负债净增加额 | | 1,670,671,226.41 | 5,345,385,863.69 | | 990,151,893.19 | 5,743,668,818.23 |
| 拆入资金净增加额 | | 3,285,455,088.10 | - | | 3,285,455,088.10 | - |
| 回购业务资金净增加额 | | 1,448,795,222.36 | 11,371,383,829.86 | | 2,797,804,270.17 | 10,318,401,331.70 |
| 代理买卖证券收到的现金净额 | | 26,463,492,796.16 | 8,120,113,672.32 | | 7,465,555,085.17 | 3,748,839,312.06 |
| 代理承销款收到的现金净额 | | 266,000,000.00 | 80,000,000.00 | | - | - |
| 收取利息、手续费及佣金的现金 | | 10,628,666,953.61 | 7,715,338,408.49 | | 5,700,643,698.93 | 4,323,284,392.69 |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | 56.(1) | 9,726,362,256.97 | 10,035,342,904.23 | | 1,057,449,706.72 | 227,993,304.71 |
| 经营活动现金流入小计 | | 54,512,790,558.88 | 42,667,564,678.59 | | 21,297,059,742.28 | 24,362,187,159.39 |
| 拆入资金净减少额 | | - | 4,642,408,577.68 | | - | 4,642,408,577.68 |
| 融出资金净增加额 | | 7,958,344,272.00 | 2,907,232,116.32 | | 8,017,523,329.41 | 2,979,397,384.29 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额 | | - | 6,039,576,587.19 | | 675,752,706.39 | 8,850,428,266.99 |
| 支付利息、手续费及佣金的现金 | | 2,360,738,788.28 | 2,280,875,220.36 | | 2,228,778,313.04 | 2,234,653,849.40 |
| 支付给职工以及为职工支付的现金 | | 4,056,021,309.05 | 3,302,787,090.79 | | 2,277,189,552.27 | 1,782,888,469.11 |
| 支付的各项税费 | | 238,795,707.56 | 672,409,349.66 | | 30,194,668.34 | 63,266,606.89 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | 56.(2) | 11,703,250,269.25 | 12,437,241,809.82 | | 1,267,705,906.52 | 1,657,561,468.62 |
| 经营活动现金流出小计 | | 26,317,150,346.14 | 32,282,530,751.82 | | 14,497,144,475.97 | 2,210,604,622.98 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 57.(1) | 28,195,640,212.74 | 10,385,033,926.77 | 5.(1) | 6,799,915,266.31 | 2,151,582,536.41 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | | | | |
| 收回投资收到的现金 | | 279,504,780.69 | 539,586,177.18 | | - | - |
| 取得投资收益收到的现金 | | 3,853,315,579.23 | 3,945,878,626.74 | | 4,390,247,911.16 | 4,619,998,637.11 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | 13,115,278.07 | 2,952,542.13 | | 4,229,780.62 | 941,116.90 |
| 其他债权投资净减少额 | | 1,936,725,841.26 | - | | 1,936,725,841.26 | - |
| 债权投资净减少额 | | 892,302,838.65 | 686,748,900.00 | | 892,302,838.65 | 686,748,900.00 |
| 处置子公司收到的现金 | | - | 1,417,642.21 | | - | - |
| 投资活动现金流入小计 | | 6,974,964,317.90 | 5,176,583,888.26 | | 7,223,506,371.69 | 5,307,688,654.01 |
| 投资支付的现金 | | 672,812,568.49 | 449,465,000.00 | | 1,852,923,415.70 | 2,088,040,000.00 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | | 449,310,789.66 | 298,154,341.97 | | 322,452,837.59 | 220,384,169.10 |
| 使用权资产预付租金支付的现金 | | 3,347,112.09 | 5,907,280.72 | | 1,121,066.18 | 2,641,543.89 |
| 其他交易性金融资产净增加额 | | 2,219,007,296.38 | 5,738,906,307.54 | | 2,390,893,437.31 | 1,604,529,008.73 |
| 其他债权投资净增加额 | | - | 1,963,532,271.64 | | - | 1,963,532,271.64 |
| 其他权益工具投资净增加额 | | 168,052,348.09 | 1,445,719,931.26 | | 139,342,474.73 | 1,480,307,474.55 |
| 投资活动现金流出小计 | | 3,512,530,114.71 | 9,901,685,133.13 | | 4,706,733,231.51 | 7,359,434,467.91 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | 3,462,434,203.19 | (4,725,101,244.87) | | 2,516,773,140.18 | (2,051,745,813.90) |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | 5,000,000,000.00 | 1,530,000.00 | | 4,995,754,716.98 | - |
| 其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金 | | - | 1,530,000.00 | | - | - |
| 取得借款收到的现金 | | 1,927,799,867.92 | 3,375,435,647.44 | | 601,706,873.68 | 2,738,471,313.44 |
| 发行债券及短期融资款收到的现金 | | 77,801,515,891.59 | 66,746,196,248.15 | | 76,764,443,225.24 | 62,355,165,965.22 |
| 筹资活动现金流入小计 | | 84,729,315,759.51 | 70,123,161,895.59 | | 82,361,904,815.90 | 65,093,637,278.66 |
| 偿还债务支付的现金 | | 85,899,273,124.66 | 55,462,504,685.95 | | 83,425,033,762.79 | 49,556,711,053.84 |
| 少数股东撤资支付的现金 | | 475,583,890.59 | 30,943,207.68 | | - | - |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | | 4,384,541,165.81 | 4,269,628,094.45 | | 4,120,627,037.67 | 3,807,923,654.62 |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润 | | 4,674,493.19 | 23,086,249.83 | | - | - |
| 租赁负债本金支付额 | | 300,192,049.00 | 262,056,524.42 | | 193,244,763.95 | 184,011,535.46 |
| 租赁负债利息支付额 | | 35,669,790.19 | 28,920,256.58 | | 21,514,980.33 | 19,478,833.47 |
| 筹资活动现金流出小计 | | 91,095,260,020.25 | 60,054,052,769.08 | | 87,760,420,544.74 | 53,568,125,077.39 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | (6,365,944,260.74) | 10,069,109,126.51 | | (5,398,515,728.84) | 11,525,512,201.27 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | | (378,885,253.19) | 131,459,997.94 | | 432,292.64 | (21,376,364.01) |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | 57.(1) | 24,913,244,902.00 | 15,860,501,806.35 | 5.(2) | 3,918,604,970.29 | 11,603,972,559.77 |
| 加：年初现金及现金等价物余额 | 57.(2) | 61,940,172,286.80 | 46,079,670,480.45 | 5.(2) | 33,351,673,065.35 | 21,747,700,505.58 |
| 六、年末现金及现金等价物余额 | 57.(2) | 86,853,417,188.80 | 61,940,172,286.80 | 5.(2) | 37,270,278,035.64 | 33,351,673,065.35 |

合并所有者权益变动表
2020 年 12 月 31 日止年度

单位：人民币元

| 本金额 | | | | | | | | | |
|----------------------|------------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| 归属于母公司所有者权益 | | | | | | | | | |
| 项目 | 股本 | 其他权益工具 | 资本公积 | 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 | 所有者权益合计 |
| | | 永续债 | | | | | | | |
| 一、2020 年 1 月 1 日余额 | 6,993,655,803.00 | - | 28,254,929,991.63 | 499,960,781.41 | 3,445,689,429.69 | 7,997,676,253.44 | 6,773,604,053.96 | 46,120,419.71 | 54,011,636,732.84 |
| 二、本年增减变动金额 | - | 5,000,000,000.00 | 56,473,663.77 | (464,366,445.82) | 230,458,951.23 | 693,420,936.68 | 721,347,448.32 | (17,827,257.84) | 6,219,507,296.34 |
| (一)综合收益总额 | - | - | - | (493,079,257.86) | - | - | 2,722,988,518.72 | (1,224,726.20) | 2,228,684,534.66 |
| (二)股东投入和减少资本 | - | 5,000,000,000.00 | 44,545,625.32 | - | - | - | - | - | 5,044,545,625.32 |
| 1. 股东投入资本 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本 | - | 5,000,000,000.00 | - | - | - | - | - | - | 5,000,000,000.00 |
| 3. 其他 | - | - | 44,545,625.32 | - | - | - | - | - | 44,545,625.32 |
| (三)利润分配 | - | - | - | - | 230,458,951.23 | 693,420,936.68 | (1,972,928,258.36) | (4,674,493.19) | (1,053,722,863.64) |
| 1. 提取盈余公积 | - | - | - | - | 230,458,951.23 | - | (230,458,951.23) | - | - |
| 2. 提取一般风险准备 | - | - | - | - | - | 693,420,936.68 | (693,420,936.68) | - | - |
| 3. 对股东的分配 | - | - | - | - | - | - | (1,049,048,370.45) | (4,674,493.19) | (1,053,722,863.64) |
| (四) 股东权益内部结转 | - | - | 11,928,038.45 | 28,712,812.04 | - | - | (28,712,812.04) | (11,928,038.45) | - |
| 1. 其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | 28,712,812.04 | - | - | (28,712,812.04) | - | - |
| 2. 其他 | - | - | 11,928,038.45 | - | - | - | - | (11,928,038.45) | - |
| 三、2020 年 12 月 31 日余额 | 6,993,655,803.00 | 5,000,000,000.00 | 28,311,403,655.40 | 35,594,335.59 | 3,676,148,380.92 | 8,691,097,190.12 | 7,494,951,502.28 | 28,293,161.87 | 60,231,144,029.18 |

(续)

合并所有者权益变动表 - 续
2020 年 12 月 31 日止年度

单位：人民币元

| 项目 | 上年金额 | | | | | | | 少数股东权益 | 所有者权益合计 |
|----------------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|------------------|-------------------|---------|
| | 股本 | 资本公积 | 其他综合收益 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 归属于母公司所有者权益 | | |
| 一、2019 年 1 月 1 日余额 | 6,993,655,803.00 | 28,254,929,991.63 | (198,814,876.12) | 3,085,378,480.26 | 7,061,605,129.67 | 6,542,724,243.23 | 532,973,568.46 | 52,272,452,340.13 | |
| 二、本年增减变动金额 | - | - | 698,775,657.53 | 360,310,949.43 | 936,071,123.77 | 230,879,810.73 | (486,853,148.75) | 1,739,184,392.71 | |
| (一)综合收益总额 | - | - | 490,323,357.66 | - | - | 2,435,079,764.10 | 43,659,092.16 | 2,969,062,213.92 | |
| (二)股东投入和减少资本 | - | - | - | - | - | - | (509,897,098.27) | (509,897,098.27) | |
| 1. 股东投入资本 | - | - | - | - | - | - | 1,530,000.00 | 1,530,000.00 | |
| 2. 其他 | - | - | - | - | - | - | (511,427,098.27) | (511,427,098.27) | |
| (三)利润分配 | - | - | - | 360,310,949.43 | 936,071,123.77 | (1,995,747,653.50) | (20,615,142.64) | (719,980,722.94) | |
| 1. 提取盈余公积 | - | - | - | 360,310,949.43 | - | (360,310,949.43) | - | - | |
| 2. 提取一般风险准备 | - | - | - | - | 936,071,123.77 | (936,071,123.77) | - | - | |
| 3. 对股东的分配 | - | - | - | - | - | (699,365,580.30) | (23,086,249.83) | (722,451,830.13) | |
| 4. 其他 | - | - | - | - | - | - | 2,471,107.19 | 2,471,107.19 | |
| (四) 股东权益内部结转 | - | - | 208,452,299.87 | - | - | (208,452,299.87) | - | - | |
| 1. 其他综合收益结转留存收益 | - | - | 208,452,299.87 | - | - | (208,452,299.87) | - | - | |
| 三、2019 年 12 月 31 日余额 | 6,993,655,803.00 | 28,254,929,991.63 | 499,960,781.41 | 3,445,689,429.69 | 7,997,676,253.44 | 6,773,604,053.96 | 46,120,419.71 | 54,011,636,732.84 | |

公司所有者权益变动表
2020 年 12 月 31 日止年度

单位：人民币元

| 本年金额 | | | | | | | | |
|----------------------|------------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|--------------------|--------------------|
| 项目 | 股本 | 其他权益工具 | 资本公积 | 其他综合收益 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| | | 永续债 | | | | | | |
| 一、2020 年 1 月 1 日余额 | 6,993,655,803.00 | - | 28,157,008,370.79 | 556,061,852.46 | 3,445,689,429.69 | 6,667,921,526.55 | 4,766,558,982.91 | 50,586,895,965.40 |
| 二、本年增减变动金额 | - | 4,995,754,716.98 | - | (377,230,501.01) | 230,458,951.23 | 307,283,487.46 | (79,110,612.99) | 5,077,156,041.67 |
| (一)综合收益总额 | - | - | - | (405,943,313.05) | - | - | 1,536,393,008.19 | 1,130,449,695.14 |
| (二)股东投入和减少资本 | - | 4,995,754,716.98 | - | - | - | - | - | 4,995,754,716.98 |
| 1. 其他权益工具持有者投入资本 | - | 4,995,754,716.98 | - | - | - | - | - | 4,995,754,716.98 |
| (三)利润分配 | - | - | - | - | 230,458,951.23 | 307,283,487.46 | (1,586,790,809.14) | (1,049,048,370.45) |
| 1. 提取盈余公积 | - | - | - | - | 230,458,951.23 | - | (230,458,951.23) | - |
| 2. 提取一般风险准备 | - | - | - | - | - | 307,283,487.46 | (307,283,487.46) | - |
| 3. 对股东的分配 | - | - | - | - | - | - | (1,049,048,370.45) | (1,049,048,370.45) |
| (四)股东权益内部结转 | - | - | - | 28,712,812.04 | - | - | (28,712,812.04) | - |
| 1. 其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | 28,712,812.04 | - | - | (28,712,812.04) | - |
| 三、2020 年 12 月 31 日余额 | 6,993,655,803.00 | 4,995,754,716.98 | 28,157,008,370.79 | 178,831,351.45 | 3,676,148,380.92 | 6,975,205,014.01 | 4,687,448,369.92 | 55,664,052,007.07 |

(续)

公司所有者权益变动表 - 续
2020 年 12 月 31 日止年度

单位：人民币元

| 项目 | 上年金额 | | | | | | |
|----------------------|------------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------|--------------------|-------------------|
| | 股本 | 资本公积 | 其他综合收益 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、2019 年 1 月 1 日余额 | 6,993,655,803.00 | 28,157,008,370.79 | (40,911,922.62) | 3,085,378,480.26 | 6,043,382,547.55 | 4,054,427,381.34 | 48,292,940,660.32 |
| 二、本年增减变动金额 | - | - | 596,973,775.08 | 360,310,949.43 | 624,538,979.00 | 712,131,601.57 | 2,293,955,305.08 |
| (一)综合收益总额 | - | - | 591,247,889.22 | - | - | 2,402,072,996.16 | 2,993,320,885.38 |
| (二)利润分配 | - | - | - | 360,310,949.43 | 624,538,979.00 | (1,684,215,508.73) | (699,365,580.30) |
| 1. 提取盈余公积 | - | - | - | 360,310,949.43 | - | (360,310,949.43) | - |
| 2. 提取一般风险准备 | - | - | - | - | 624,538,979.00 | (624,538,979.00) | - |
| 3. 对股东的分配 | - | - | - | - | - | (699,365,580.30) | (699,365,580.30) |
| (三)股东权益内部结转 | - | - | 5,725,885.86 | - | - | (5,725,885.86) | - |
| 1. 其他综合收益结转留存收益 | - | - | 5,725,885.86 | - | - | (5,725,885.86) | - |
| 三、2019 年 12 月 31 日余额 | 6,993,655,803.00 | 28,157,008,370.79 | 556,061,852.46 | 3,445,689,429.69 | 6,667,921,526.55 | 4,766,558,982.91 | 50,586,895,965.40 |

附注为财务报表的组成部分

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

公司基本情况

1、 公司概况

东方证券股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)前身东方证券有限责任公司系由申能(集团)有限公司、上海外滩房屋置换有限公司作为发起人股东,联合上海市财政局及 12 家大型企业集团,通过收购抚顺证券公司及受让上海浦东发展银行和上海城市合作银行(现上海银行)所属证券经营机构,并以增资方式设立的有限责任公司。中国人民银行 1997 年 10 月 18 日以银复[1997]400 号文《关于抚顺证券公司更名、迁址和增资改制的批复》和 1998 年 2 月 23 日银复[1998]52 号文《关于设立东方证券有限责任公司的批复》批准同意。1998 年 3 月 3 日由中国人民银行颁发 J11312900062 号《中华人民共和国金融机构法人许可证》,1997 年 12 月 11 日由上海市工商行政管理局颁发法人营业执照,注册号为 150050030000,注册资本为人民币 10 亿元。

2003 年 8 月 13 日经上海市人民政府以沪府体改审(2003)004 号《关于同意设立东方证券股份有限公司的批复》和 2003 年 9 月 12 日中国证券监督管理委员会以证监机构字[2003]184 号文《关于同意东方证券有限责任公司改制、增资扩股并更名的批复》批准同意,公司变更为股份有限公司,以 2002 年 12 月 31 日净资产 113,979.18 万元折股,并以货币资金增资 100,000.00 万元,变更后股份总额为 213,979.18 万元。

经过历次增资,公司股票于 2015 年 3 月 23 日在上海证券交易所上市,股票代码为 600958。公司股票于 2016 年 7 月 8 日在香港联合交易所上市,股票代码为 03958。

根据公司 2017 年第三届董事会第二十五次会议、第三届董事会第二十六次会议、第三届董事会第三十次会议、第三届董事会第三十二次会议、2017 年第一次临时股东大会、2017 年第一次 A 股类别股东大会及 2017 年第一次 H 股类别股东大会决议,同时经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1940 号文核准,公司非公开发行人民币普通股(A 股)股票 778,203,792 股。此次非公开发行股份增加注册资本计人民币 778,203,792.00 元,变更后的注册资本为人民币 6,993,655,803.00 元。

截至 2020 年 12 月 31 日,公司经批准设立了 177 家营业部。本公司之子公司的基本情况参见附注六。

公司统一社会信用代码为 913100001322947763,注册地为“中国上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦”。公司总部住所位于上海市中山南路 119 号,法定代表人金文忠。

2、 公司及子公司(以下简称“本集团”)经营范围

证券经纪;融资融券;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券自营;证券投资基金代销;为期货公司提供中间介绍业务;代销金融产品;证券承销与保荐;股票期权做市业务;证券投资基金托管;证券资产管理业务;公开募集证券投资基金管理业务;商品期货经纪,金融期货经纪,期货投资咨询;金融产品投资,证券投资,投资管理和投资咨询;使用自有资金或设立直投资基金,对企业进行股权投资或债权投资,或

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

一、 公司基本情况 - 续

2、 公司及子公司(以下简称“本集团”)经营范围 - 续

投资于与股权投资、债权投资相关的其他投资基金；为客户提供与股权投资、债权投资相关的财务顾问服务等。(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。)

二、 财务报表的编制基础

编制基础

本集团执行财政部颁布的企业会计准则及相关规定。此外，本集团还按照《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号—财务报告的一般规定(2014 年修订)》披露有关财务信息。

记账基础和计价原则

本集团会计核算以权责发生制为记账基础。除某些金融工具以公允价值计量外，本财务报表以历史成本作为计量基础。资产如果发生减值，则按照相关规定计提相应的减值准备。

在历史成本计量下，资产按照购置时支付的现金或者现金等价物的金额或者所付出的对价的公允价值计量。负债按照因承担现时义务而实际收到的款项或者资产的金额，或者承担现时义务的合同金额，或者按照日常活动中为偿还负债预期需要支付的现金或者现金等价物的金额计量。

公允价值是市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。无论公允价值是可观察到的还是采用估值技术估计的，在本财务报表中计量和披露的公允价值均在此基础上予以确定。

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

- 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。
- 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

持续经营

本集团对自 2020 年 12 月 31 日起 12 个月的持续经营能力进行了评价，未发现对持续经营能力产生重大怀疑的事项和情况。因此，本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

三、重要会计政策和会计估计

1、遵循企业会计准则的声明

本公司编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本公司于 2020 年 12 月 31 日的公司及合并财务状况以及 2020 年度的公司及合并经营成果、公司及合并股东权益变动和公司及合并现金流量。

2、会计期间

本集团的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

3、记账本位币

人民币为本公司及境内子公司经营所处的主要经济环境中的货币，本公司及境内子公司以人民币为记账本位币。本公司之境外子公司根据其经营所处的主要经济环境中的货币确定港币为记账本位币。本公司编制本财务报表时所采用的货币为人民币。

4、同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

企业合并分为同一控制下的企业合并和非同一控制下的企业合并。本集团的重大企业合并均为非同一控制下的企业合并。

非同一控制下的企业合并及商誉

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

合并成本指购买方为取得被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债和发行的权益性工具的公允价值。通过多次交易分步实现非同一控制下的企业合并的，合并成本为购买日支付的对价与购买日之前已经持有的被购买方的股权在购买日的公允价值之和。购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益。

购买方在合并中所取得的被购买方符合确认条件的可辨认资产、负债及或有负债在购买日以公允价值计量。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，作为一项资产确认为商誉并按成本进行初始计量。合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，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，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，计入当期损益。因企业合并形成的商誉在合并财务报表中单独列报，并按照成本扣除累计减值准备后的金额计量。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

5、合并财务报表的编制方法

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制是指投资方拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。一旦相关事实和情况的变化导致上述控制定义涉及的相关要素发生了变化，本集团将进行重新评估。

子公司的合并起始于本集团获得对该子公司的控制权时，终止于本集团丧失对该子公司的控制权时。

对于本集团处置的子公司，处置日(丧失控制权的日期)前的经营成果和现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

对于通过非同一控制下的企业合并取得的子公司，其自购买日(取得控制权的日期)起的经营成果及现金流量已经适当地包括在合并利润表和合并现金流量表中。

子公司采用的主要会计政策和会计期间按照本公司统一规定的会计政策和会计期间厘定。

本公司与子公司及子公司相互之间发生的内部交易对合并财务报表的影响于合并时抵销。

子公司所有者权益中不属于母公司的份额作为少数股东权益，在合并资产负债表中股东权益项目下以“少数股东权益”项目列示。子公司当期净损益中属于少数股东权益的份额，在合并利润表中净利润项目下以“少数股东损益”项目列示。

少数股东分担的子公司的亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额，其余部分仍冲减少数股东权益。

对于购买子公司少数股权或因处置部分股权投资但没有丧失对该子公司控制权的交易，作为权益性交易核算，调整归属于母公司所有者权益和少数股东权益的账面价值以反映其在子公司中相关权益的变化。少数股东权益的调整额与支付/收到对价的公允价值之间的差额调整资本公积，资本公积不足冲减的，调整留存收益。

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

6、现金及现金等价物的确定标准

现金是指本集团库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指本集团持有的期限短(一般指从购买日起三个月内到期)、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

7、 外币业务和外币报表折算

7.1 外币业务

外币交易在初始确认时，采用交易发生日的即期汇率折算。

于资产负债表日，外币货币性项目采用该日即期汇率折算为人民币，因该日的即期汇率与初始确认时或者前一资产负债表日即期汇率不同而产生的汇兑差额，除：(1)符合资本化条件的外币专门借款的汇兑差额在资本化期间予以资本化计入相关资产的成本；(2)为了规避外汇风险进行套期的套期工具的汇兑差额按套期会计方法处理；(3) 分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的货币性项目除摊余成本之外的其他账面余额变动产生的汇兑差额计入其他综合收益外，均计入当期损益。

编制合并财务报表涉及境外经营的，如有实质上构成对境外经营净投资的外币货币性项目，因汇率变动而产生的汇兑差额，列入其他综合收益的“外币报表折算差额”项目；处置境外经营时，计入处置当期损益。

以历史成本计量的外币非货币性项目仍以交易发生日的即期汇率折算的记账本位币金额计量。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，折算后的记账本位币金额与原记账本位币金额的差额，作为公允价值变动(含汇率变动)处理，计入当期损益或确认为其他综合收益。

7.2 外币财务报表折算

为编制合并财务报表，境外经营的外币财务报表按以下方法折算为人民币报表：资产负债表中的所有资产、负债类项目按资产负债表日的即期汇率折算；股东权益项目按发生时的即期汇率折算；利润表中的所有项目及反映利润分配发生额的项目按交易发生日的即期汇率折算；年初未分配利润为上一年折算后的年末未分配利润；年末未分配利润按折算后的利润分配各项目计算列示；折算后资产类项目与负债类项目和股东权益类项目合计数的差额确认为其他综合收益并计入股东权益。

外币现金流量以及境外子公司的现金流量，采用与现金流量发生日即期汇率近似的汇率折算，汇率变动对现金及现金等价物的影响额，作为调节项目，在现金流量表中以“汇率变动对现金及现金等价物的影响”单独列示。

年初数和上年实际数按照上年财务报表折算后的数额列示。

在处置本集团在境外经营的全部所有者权益或因处置部分股权投资或其他原因丧失了对境外经营控制权时，将资产负债表中股东权益项目下列示的、与该境外经营相关的归属于母公司所有者权益的外币报表折算差额，全部转入处置当期损益。

在处置部分股权投资或其他原因导致持有境外经营权益比例降低但不丧失对境外经营控制权时，与该境外经营处置部分相关的外币报表折算差额将归属于少数股东权益，不转入当期损益。在处置境外经营为联营企业或合营企业的部分股权时，与该境外经营相关的外币报表折算差额，按处置该境外经营的比例转入处置当期损益。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

8、 金融工具

本集团在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。

对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。

金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关的交易费用直接计入损益；对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。当本集团按照《企业会计准则第 14 号—收入》（“收入准则”）确认的未包含重大融资成分应收款项或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的，初始确认的应收款项则按照收入准则定义的交易价格进行初始计量。

实际利率法是指计算金融资产或金融负债的摊余成本以及将利息收入或利息费用分摊计入各会计期间的方法。实际利率，是指将金融资产或金融负债在预计存续期的估计未来现金流量，折现为该金融资产账面余额或该金融负债摊余成本所使用的利率。在确定实际利率时，在考虑金融资产或金融负债所有合同条款（如提前还款、展期、看涨期权或其他类似期权等）的基础上估计预期现金流量，但不考虑预期信用损失。

金融资产或金融负债的摊余成本是以该金融资产或金融负债的初始确认金额扣除已偿还的本金，加上或减去采用实际利率法将该初始确认金额与到期日金额之间的差额进行摊销形成的累计摊销额，再扣除累计计提的损失准备（仅适用于金融资产）。

8.1 金融资产的分类、确认和计量

初始确认后，本集团对不同类别的金融资产，分别以摊余成本、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益或以公允价值计量且其变动计入当期损益进行后续计量。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本集团管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本集团将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金、应收款项和债权投资等。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本集团管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标的，则该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，此类金融资产为其他债权投资。

初始确认时，本集团可以单项金融资产为基础，不可撤销地将非同一控制下的企业合并中确认的或有对价以外的非交易性权益工具指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。此类金融资产作为其他权益工具投资列示。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

8、 金融工具 - 续

8.1 金融资产的分类、确认和计量 - 续

金融资产满足下列条件之一的，表明本集团持有该金融资产的目的是交易性的：

- 取得相关金融资产的目的，主要是为了近期出售或回购。
- 相关金融资产在初始确认时属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式。
- 相关金融资产属于衍生工具。但符合财务担保合同定义的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括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和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，列示于交易性金融资产。

- 不符合分类为以摊余成本计量的金融资产或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条件的金融资产均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益，除衍生金融资产单独列示外，列示于交易性金融资产。
- 在初始确认时，为消除或显著减少会计错配，以及符合条件的包含嵌入衍生工具的混合合同，本集团可将金融资产不可撤销地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。

8.1.1 以摊余成本计量的金融资产

以摊余成本计量的金融资产采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量，发生减值时或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本集团对分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法确认利息收入。除下列情况外，本集团根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

- 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；
- 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。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如债务人的信用评级被上调，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。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

8、金融工具 - 续

8.1 金融资产的分类、确认和计量 - 续

8.1.2 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

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产相关的减值损失或利得、采用实际利率法计算的利息收入及汇兑损益计入当期损益，除此以外该金融资产的公允价值变动均计入其他综合收益。该金融资产计入各期损益的金额与视同其一直按摊余成本计量而计入各期损益的金额相等。该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

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的公允价值变动在其他综合收益中进行确认，该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本集团持有该等非交易性权益工具投资期间，在本集团收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本集团，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。

8.1.3 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

8.2 金融工具减值

本集团对分类为以摊余成本计量的金融工具、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工具、应收款项等以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

本集团对由收入准则规范的交易形成的未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的合同中的融资成分的合同资产与应收款项按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

对于其他金融工具，除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本集团在每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本集团按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本集团按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，除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外，作为减值损失或利得计入当期损益。对于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，本集团在其他综合收益中确认其信用损失准备，并将减值损失或利得计入当期损益，且不减少该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

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

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

8、 金融工具 - 续

8.2 金融工具减值 - 续

8.2.1 信用风险显著增加

本集团利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，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。

本集团在评估信用风险是否显著增加时会考虑如下因素：

- 同一金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险的外部市场指标是否发生显著变化；
- 金融工具外部信用评级实际或预期是否发生显著变化；
- 预期将导致债务人履行其偿债义务的能力发生显著变化的业务、财务或经济状况的不利变化；
- 债务人经营成果实际或预期是否发生显著变化；
- 债务人所处的监管、经济或技术环境是否发生显著不利变化将重大影响债务人履行其偿债义务的能力；
- 作为债务抵押的担保物价值或第三方提供的担保或信用增级质量是否发生显著变化；
- 实际或预期增信措施有效性发生重大不利变化；
- 债务人预期表现和还款行为是否发生显著变化。

于资产负债表日，若本集团判断金融工具只具有较低的信用风险，则本集团假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

8.2.2 已发生信用减值的金融资产

当本集团预期对金融资产未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或债务人发生重大财务困难；
- 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失；
- 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。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

8、金融工具 - 续

8.2 金融工具减值 - 续

8.2.3 预期信用损失的确定

本集团对部分应收款项在单项资产的基础上确定其信用损失，其余应收款项在组合基础上采用减值矩阵确定相关金融工具的信用损失。本集团以共同风险特征为依据，将金融工具分为不同组别。本集团采用的共同信用风险特征包括：金融工具类型、信用风险评级、担保物类型、初始确认日期、剩余合同期限、债务人所处行业、担保品相对于金融资产的价值等。

本集团按照下列方法确定相关金融工具的预期信用损失：

- 对于金融资产，信用损失为本集团应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值；
- 对于未提用的贷款承诺，信用损失为在贷款承诺持有人提用相应贷款的情况下，本集团应收取的合同现金流量与预期收取的现金流量之间差额的现值。本集团对贷款承诺预期信用损失的估计，与其对该贷款承诺提用情况的预期保持一致；
- 对于资产负债表日已发生信用减值但并非购买或源生已发生信用减值的金融资产，信用损失为该金融资产账面余额与按原实际利率折现的估计未来现金流量的现值之间的差额。

本集团计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额；货币时间价值；在资产负债表日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

8.2.4 减记金融资产

当本集团不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回的，直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。

8.3 金融资产的转移

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本集团既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

8、 金融工具 - 续

8.3 金融资产的转移 - 续

若本集团既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。本集团按照下列方式对相关负债进行计量：

- 被转移金融资产以摊余成本计量的，相关负债的账面价值等于继续涉入被转移金融资产的账面价值减去本集团保留的权利(如果本集团因金融资产转移保留了相关权利)的摊余成本并加上本集团承担的义务(如果本集团因金融资产转移承担了相关义务)的摊余成本，相关负债不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。
- 被转移金融资产以公允价值计量的，相关负债的账面价值等于继续涉入被转移金融资产的账面价值减去本集团保留的权利(如果本集团因金融资产转移保留了相关权利)的公允价值并加上本集团承担的义务(如果本集团因金融资产转移承担了相关义务)的公允价值，该权利和义务的公允价值应为按独立基础计量时的公允价值。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，针对分类为以摊余成本计量的金融资产与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，将所转移金融资产在终止确认日的账面价值及因转移而收到的对价与原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和的差额计入当期损益。针对被本集团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，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。

金融资产部分转移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，并将终止确认部分收到的对价和原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额之和与终止确认部分在终止确认日的账面价值之差额计入当期损益或留存收益。

金融资产整体转移未满足终止确认条件的，本集团继续确认所转移的金融资产整体，因资产转移而收到的对价在收到时确认为负债。

8.4 负债和权益的分类

本集团根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，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。

8.4.1 金融负债的分类、确认及计量

金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

8、 金融工具 - 续

8.4 负债和权益的分类 - 续

8.4.1 金融负债的分类、确认及计量 - 续

8.4.1.1 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债(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。其中，除衍生金融负债单独列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债列示为交易性金融负债。

金融负债满足下列条件之一，表明本集团承担该金融负债的目的是交易性的：

- 承担相关金融负债的目的，主要是为了近期出售或回购。
- 相关金融负债在初始确认时属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式。
- 相关金融负债属于衍生工具。但符合财务担保合同定义的衍生工具以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外。

本集团将符合下列条件之一的金融负债，在初始确认时可以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：(1)该指定可以消除或显著减少会计错配；(2)根据本集团正式书面文件载明的风险管理或投资策略，该金融负债所在的金融负债组合或金融资产和金融负债组合以公允价值为基础进行管理和业绩评价并在企业内部以此为基础向关键管理人员报告；(3)符合条件的包含嵌入衍生工具的混合合同。

交易性金融负债采用公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融负债相关的股利或利息支出计入当期损益。

被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，该负债由本集团自身信用风险变动引起的公允价值变动应当计入其他综合收益，且终止确认该负债时，计入其他综合收益的自身信用风险变动引起的其公允价值累计变动额转入留存收益。其余公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融负债相关的股利或利息支出计入当期损益。若按上述方式对该等金融负债的自身信用风险变动的影响进行处理会造成或扩大损益中的会计错配的，本集团将该金融负债的全部利得或损失(包括企业自身信用风险变动的影响金额)计入当期损益。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

8、金融工具 - 续

8.4 负债和权益的分类 - 续

8.4.1 金融负债的分类、确认及计量 - 续

8.4.1.2 其他金融负债

除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、财务担保合同及贷款承诺外的其他金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，按摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益。

本集团与交易对手方修改或重新议定合同，未导致按摊余成本进行后续计量的金融负债终止确认，但导致合同现金流量发生变化的，本集团重新计算该金融负债的账面价值，并将相关利得或损失计入当期损益。重新计算的该金融负债的账面价值，本集团根据将重新议定或修改的合同现金流量按金融负债的原实际利率折现的现值确定。对于修改或重新议定合同所产生的所有成本或费用，本集团调整修改后的金融负债的账面价值，并在修改后金融负债的剩余期限内进行摊销。

8.4.2 金融负债的终止确认

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。本集团(借入方)与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，本集团终止确认原金融负债，并同时确认新金融负债。

金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

8.4.3 权益工具

权益工具是指能证明拥有本集团在扣除所有负债后的资产中的剩余权益的合同。本集团发行(含再融资)、回购、出售或注销权益工具作为权益的变动处理。本集团不确认权益工具的公允价值变动。与权益性交易相关的交易费用从权益中扣减。

本集团对权益工具持有方的分配作为利润分配处理，发放的股票股利不影响股东权益总额。

本集团发行的永续债等金融工具，同时符合以下条件的，作为权益工具：

(1)该金融工具不包括交付现金或其他金融资产给其他方，或在潜在不利条件下与其他方交换金融资产或金融负债的合同义务；

(2)将来须用或可用企业自身权益工具结算该金融工具的，如该金融工具为非衍生工具，不包括交付可变数量的自身权益工具进行结算的合同义务；如为衍生工具，本集团只能通过以固定数量的自身权益工具交换固定金额的现金或其他金融资产结算该金融工具。

归类为权益工具的永续债等金融工具，利息支出或股利分配作为本集团的利润分配，其回购、注销等作为权益的变动处理，相关交易费用从权益中扣减。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

8、 金融工具 - 续

8.5 衍生工具与嵌入衍生工具

衍生金融工具，包括货币互换合同、利率互换合同及期权合同等。衍生工具于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量。

对于嵌入衍生工具与主合同构成的混合合同，若主合同属于金融资产的，本集团不从该混合合同中分拆嵌入衍生工具，而将该混合合同作为一个整体适用关于金融资产分类的会计准则规定。

若混合合同包含的主合同不属于金融资产，且同时符合下列条件的，本集团将嵌入衍生工具从混合工具中分拆，作为单独的衍生金融工具处理。

- (1) 嵌入衍生工具的经济特征和风险与主合同的经济特征及风险不紧密相关。
- (2) 与该嵌入衍生工具具有相同条款的单独工具符合衍生工具的定义。
- (3) 该混合合同不是以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。

嵌入衍生工具从混合合同中分拆的，本集团按照适用的会计准则规定对混合合同的主合同进行会计处理。本集团无法根据嵌入衍生工具的条款和条件对嵌入衍生工具的公允价值进行可靠计量的，该嵌入衍生工具的公允价值根据混合合同公允价值和主合同公允价值之间的差额确定。使用了上述方法后，该嵌入衍生工具在取得日或后续资产负债表日的公允价值仍然无法单独计量的，本集团将该混合合同整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。

8.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集团具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的，同时本集团计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

9、 长期股权投资

9.1 共同控制、重大影响的判断标准

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

9.2 初始投资成本的确定

对于同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的现金、转让的非现金资产以及所承担债务账面价值之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本，按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

对于非同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，在购买日按照合并成本作为长期股权投资的初始投资成本。

合并方或购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益。

除企业合并形成的长期股权投资外其他方式取得的长期股权投资，按成本进行初始计量。对于因追加投资能够对被投资单位实施重大影响或实施共同控制但不构成控制的，长期股权投资成本为按照《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》确定的原持有股权投资的公允价值加上新增投资成本之和。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

9、 长期股权投资 - 续

9.3 后续计量及损益确认方法

9.3.1 成本法核算的长期股权投资

公司财务报表采用成本法核算对子公司的长期股权投资。子公司是指本集团能够对其实施控制的被投资单位。

采用成本法核算的长期股权投资按初始投资成本计量。追加或收回投资调整长期股权投资的成本。当期投资收益按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认。

9.3.2 权益法核算的长期股权投资

本集团对联营企业和合营企业的投资采用权益法核算。联营企业是指本集团能够对其施加重大影响的被投资单位，合营企业是指本集团仅对该安排的净资产享有权利的合营安排。

采用权益法核算时，长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，不调整长期股权投资的初始投资成本；初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资的成本。

采用权益法核算时，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资收益和其他综合收益，同时调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应享有的部分，相应减少长期股权投资的账面价值；对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入资本公积。在确认应享有被投资单位净损益的份额时，以取得投资时被投资单位各项可辨认资产等的公允价值为基础，对被投资单位的净利润进行调整后确认。被投资单位采用的会计政策及会计期间与本公司不一致的，按照本公司的会计政策及会计期间对被投资单位的财务报表进行调整，并据以确认投资收益和其他综合收益。对于本集团与联营企业及合营企业之间发生的交易，投出或出售的资产不构成业务的，未实现内部交易损益按照享有的比例计算归属于本集团的部分予以抵销，在此基础上确认投资损益。但本集团与被投资单位发生的未实现内部交易损失，属于所转让资产减值损失的，不予以抵销。

在确认应分担被投资单位发生的净亏损时，以长期股权投资的账面价值和其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限。此外，如本集团对被投资单位负有承担额外损失的义务，则按预计承担的义务确认预计负债，计入当期投资损失。被投资单位以后期间实现净利润的，本集团在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

9、 长期股权投资 - 续

9.3 后续计量及损益确认方法 — 续

9.3.3 处置长期股权投资

处置长期股权投资时，其账面价值与实际取得价款的差额，计入当期损益。采用权益法核算的长期股权投资，处置后的剩余股权仍采用权益法核算的，原采用权益法核算而确认的其他综合收益采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理，并按比例结转当期损益；因被投资方除净损益、其他综合收益和利润分配以外的其他所有者权益变动而确认的所有者权益，按比例结转入当期损益。

10、 投资性房地产

投资性房地产是指为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产。本集团的投资性房地产为已出租的建筑物。

投资性房地产按成本进行初始计量。与投资性房地产有关的后续支出，如果与该资产有关的经济利益很可能流入且其成本能可靠地计量，则计入投资性房地产成本。其他后续支出，在发生时计入当期损益。

本集团采用成本模式对投资性房地产进行后续计量，并按照与房屋建筑物或土地使用权一致的政策进行折旧或摊销。

投资性房地产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

11、 固定资产

11.1 固定资产确认条件

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

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

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

11、 固定资产 - 续

11.2 各类固定资产的折旧方法

固定资产从达到预定可使用状态的次月起，采用年限平均法在使用寿命内计提折旧。各类固定资产的使用寿命、预计净残值和年折旧率如下：

| <u>类别</u> | <u>使用年限</u> | <u>预计净残值率</u> | <u>年折旧率</u> % |
|-----------|-------------|---------------|------------------|
| 房屋及建筑物 | 30 年 | 3% | 3.23 |
| 机器设备 | 3-10 年 | 3% | 9.70-32.33 |
| 运输设备 | 6 年 | 3% | 16.17 |
| 其他设备 | 5 年 | 3% | 19.40 |

预计净残值是指假定固定资产预计使用寿命已满并处于使用寿命终了时的预期状态，本集团目前从该项资产处置中获得的扣除预计处置费用后的金额。

11.3 其他说明

本集团至少于年度终了对固定资产的使用寿命、预计净残值和折旧方法进行复核，如发生改变则作为会计估计变更处理。

当固定资产处于处置状态或预期通过使用或处置不能产生经济利益时，终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

12、 在建工程

在建工程按实际成本计量，实际成本包括在建期间发生的各项工程支出、工程达到预定可使用状态前的资本化的借款费用以及其他相关费用等。在建工程不计提折旧。在建工程在达到预定可使用状态后结转为固定资产。

13、 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借款费用，在资产支出已经发生、借款费用已经发生、为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或生产活动已经开始时，开始资本化；构建或者生产的符合资本化条件的资产达到预定可使用状态或者可销售状态时，停止资本化。其余借款费用在发生当期确认为费用。

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

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

三、重要会计政策和会计估计 - 续

14、无形资产

14.1 无形资产

无形资产包括交易席位费、计算机软件等。

无形资产按成本进行初始计量。使用寿命有限的无形资产自可供使用时起，对其原值减去预计净残值和已计提的减值准备累计金额在其预计使用寿命内采用直线法分期平均摊销。使用寿命不确定的无形资产不予摊销。使用寿命有限的软件的摊销期限为 3 年。交易席位费能为本集团带来经济利益的具体期限并不确定，故作为使用寿命不确定的无形资产。

年末，对使用寿命有限的无形资产的使用寿命和摊销方法进行复核，必要时进行调整。

14.2 内部研究开发支出

研究阶段的支出，于发生时计入当期损益。

开发阶段的支出同时满足下列条件的，确认为无形资产，不能满足下述条件的开发阶段的支出计入当期损益：

- (1) 完成该无形资产以使其能够使用或出售在技术上具有可行性；
- (2) 具有完成该无形资产并使用或出售的意图；
- (3) 无形资产产生经济利益的方式，包括能够证明运用该无形资产生产的产品存在市场或
无形资产自身存在市场，无形资产将在内部使用的，能够证明其有用性；
- (4) 有足够的技术、财务资源和其他资源支持，以完成该无形资产的开发，并有能力使用或出售该无形资产；
- (5) 归属于该无形资产开发阶段的支出能够可靠地计量。

无法区分研究阶段支出和开发阶段支出的，将发生的研发支出全部计入当期损益。

15、长期待摊费用

长期待摊费用为已经发生但应由本年和以后各期负担的分摊期限在一年以上的各项费用。长期待摊费用在预计受益期间分期平均摊销。

16、长期资产减值

本集团在每一个资产负债表日检查长期股权投资、采用成本法计量的投资性房地产、固定资产、在建工程及使用寿命确定的无形资产是否存在可能发生减值的迹象。如果该等资产存在减值迹象，则估计其可收回金额。使用寿命不确定的无形资产和尚未达到可使用状态的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

估计资产的可收回金额以单项资产为基础，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，则以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。可收回金额为资产或者资产组的公允价值减去处置费用后的净额与其预计未来现金流量的现值两者之中的较高者。如果资产的可收回金额低于其账面价值，按其差额计提资产减值准备，并计入当期损益。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

16、长期资产减值 - 续

商誉至少在每年年度终了进行减值测试。对商誉进行减值测试时，结合与其相关的资产组或者资产组组合进行。即，自购买日起将商誉的账面价值按照合理的方法分摊到能够从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合，如包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额首先抵减分摊到该资产组或资产组组合的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

17、附回购条件的资产交易

17.1 买入返售金融资产

根据协议承诺将于未来某确定日期按确定价格返售的金融资产不在资产负债表内予以确认。买入该等资产所支付的成本，在资产负债表中作为买入返售金融资产列示。买入价与返售价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息收入。

17.2 卖出回购金融资产款

根据协议承诺将于未来某确定日期按确定价格回购的已售出的金融资产不在资产负债表内予以终止确认。出售该等资产所得的款项，在资产负债表中作为卖出回购金融资产款列示。售价与回购价之间的差额在协议期内按实际利率法确认，计入利息支出。

17.3 债券借贷

公司根据债券借贷协议，以自持的债券作为质押债券，从其他金融机构借入其他债券，同时约定在未来某一时点归还所借入的标的债券，且向债券融出方支付借贷费用，并由债券融出方返还相应质押债券。持有期间债券利息归债券融出方所有。借入的债券不在资产负债表内确认。如果该类债券出售给第三方，则将偿还标的债券的义务确认为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

18、融资融券业务

融资融券业务，是指本集团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。本集团发生的融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

本集团对融出的资金，确认应收债权，在资产负债表中列示为融出资金，并确认相应利息收入；用于融出的证券，在初始确认时分类为交易性金融资产或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，已融出的证券，不终止确认该证券，但确认相应手续费收入。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

18、融资融券业务资产 - 续

为融资业务向中国证券金融股份有限公司借入的资金，在资产负债表中作为拆入资金列示，按摊余成本乘以实际利率确认利息支出。本集团对于融入的证券，由于其主要收益或风险不由本集团享有或承担，不确认该证券，确认相应手续费支出。

19、职工薪酬

19.1 短期薪酬的会计处理方法

本集团在职工为其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。本集团发生的职工福利费，在实际发生时根据实际发生额计入当期损益或相关资产成本。职工福利费为非货币性福利的，按照公允价值计量。

本集团为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金，以及本集团按规定提取的工会经费和职工教育经费，在职工为本集团提供服务的会计期间，根据规定的计提基础和计提比例计算确定相应的职工薪酬金额，确认相应负债，并计入当期损益或相关资产成本。

19.2 离职后福利的会计处理方法

离职后福利全部为设定提存计划。

本集团在职工为其提供服务的会计期间，将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。

19.3 辞退福利的会计处理方法

本集团向职工提供辞退福利的，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：本集团不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；本集团确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

20、预计负债

当与或有事项相关的义务是本集团承担的现时义务，且履行该义务很可能导致经济利益流出，以及该义务的金额能够可靠地计量，则确认为预计负债。

在资产负债表日，考虑与或有事项有关的风险、不确定性和货币时间价值等因素，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计量。如果货币时间价值影响重大，则以预计未来现金流出折现后的金额确定最佳估计数。

如果清偿预计负债所需支出全部或部分预期由第三方补偿的，补偿金额在基本确定能够收到时，作为资产单独确认，且确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

21、收入

本集团在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务控制权时，按照分摊至该项履约义务的交易价格确认收入。履约义务，是指合同中本集团向客户转让可明确区分商品或服务的承诺。交易价格，是指本集团因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，但不包含代第三方收取的款项以及本集团预期将退还给客户的款项。

满足下列条件之一的，属于在某一时间段内履行的履约义务，本集团按照履约进度，在一段时间内确认收入：(1)客户在本集团履约的同时即取得并消耗所带来的经济利益；(2)客户能够控制本集团履约过程中在建的商品；(3)本集团履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本集团在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。否则，本集团在客户取得相关商品或服务控制权的时点确认收入。

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

合同资产，是指本集团已向客户转让商品或服务而有权收取对价的权利，且该权利取决于时间流逝之外的其他因素。本集团拥有的无条件(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单独列示。

合同负债，是指本集团已收或应收客户对价而应向客户转让商品或服务的义务。

本集团根据在向客户转让商品或服务前是否拥有对该商品或服务的控制权，来判断从事交易时本集团的身份是主要责任人还是代理人。本集团在向客户转让商品或者服务前能够控制该商品或服务的，本集团为主要责任人，按照已收或应收对价总额确认收入；否则，本集团对代理人，按照预期有权收取的佣金或手续费的金额确认收入，该金额按照既定的佣金金额或比例等确定。

本集团具体主要收入如下：

(1) 手续费及佣金收入

- 代理客户买卖证券的手续费收入，在代理买卖证券交易日确认为收入。
- 在余额包销及代销方式下，在承销业务提供的相关服务完成时确认收入。
- 受托投资管理的收益按合同规定收取的管理费收入以及其他应由本集团享有的收益，按权责发生制原则确认。

(2) 利息收入

根据相关本金及实际利率按权责发生制原则确认。

(3) 其他业务收入以合同到期结算时或提供服务时确认为收入。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

22、政府补助

政府补助是指本集团从政府无偿取得货币性资产和非货币性资产。政府补助在能够满足政府补助所附条件且能够收到时予以确认。

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；公允价值不能够可靠取得的，按照名义金额计量。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值/确认为递延收益，并在相关资产的使用寿命内平均分配分期计入当期损益。

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和损失的，确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益/冲减相关成本；用于补偿已经发生的相关成本费用和损失的，直接计入当期损益/冲减相关成本。

与本集团日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益/冲减相关成本费用。与本集团日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

23、所得税

所得税费用包括当期所得税和递延所得税。

23.1 当期所得税

资产负债表日，对于当期和以前期间形成的当期所得税负债(或资产)，以按照税法规定计算的预期应交纳(或返还)的所得税金额计量。

23.2 递延所得税资产及递延所得税负债

对于某些资产、负债项目的账面价值与其计税基础之间的差额，以及未作为资产和负债确认但按照税法规定可以确定其计税基础的项目的账面价值与计税基础之间的差额产生的暂时性差异，采用资产负债表债务法确认递延所得税资产及递延所得税负债。

一般情况下所有暂时性差异均确认相关的递延所得税。但对于可抵扣暂时性差异，本集团以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限，确认相关的递延所得税资产。此外，与商誉的初始确认相关的，以及与既不是企业合并、发生时也不影响会计利润和应纳税所得额(或可抵扣亏损)的交易中产生的资产或负债的初始确认有关的暂时性差异，不予确认有关的递延所得税资产或负债。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

23、 所得税 - 续

23.2 递延所得税资产及递延所得税负债 - 续

对于能够结转以后年度的可抵扣亏损及税款抵减，以很可能获得用来抵扣可抵扣亏损和税款抵减的未来应纳税所得额为限，确认相应的递延所得税资产。

本集团确认与子公司、联营企业及合营企业投资相关的应纳税暂时性差异产生的递延所得税负债，除非本集团能够控制暂时性差异转回的时间，而且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。对于与子公司、联营企业及合营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，只有当暂时性差异在可预见的未来很可能转回，且未来很可能获得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额时，本集团才确认递延所得税资产。

资产负债表日，对于递延所得税资产和递延所得税负债，根据税法规定，按照预期收回相关资产或清偿相关负债期间的适用税率计量。

除与直接计入其他综合收益或股东权益的交易和事项相关的当期所得税和递延所得税计入其他综合收益或股东权益，以及企业合并产生的递延所得税调整商誉的账面价值外，其余当期所得税和递延所得税费用或收益计入当期损益。

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，减记的金额予以转回。

23.3 所得税的抵销

当拥有以净额结算的法定权利，且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行时，本集团当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列报。

当拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利，且递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债时，本集团递延所得税资产及递延所得税负债以抵销后的净额列报。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

24、 租赁

租赁，是指在一定期间内，出租人将资产的使用权让与承租人以获取对价的合同。

对于首次执行日后签订或变更的合同，在合同开始/变更日，本集团评估该合同是否为租赁或者包含租赁。除非合同条款和条件发生变化，本集团不重新评估合同是否为租赁或者包含租赁。

24.1 本集团作为承租人

24.1.1 租赁的分拆

合同中同时包含一项或多项租赁和非租赁部分的，本集团将各项单独租赁和非租赁部分进行分拆，按照各租赁部分单独价格及非租赁部分的单独价格之和的相对比例分摊合同对价。

为便于实务操作，如果本集团能够合理预期将具有类似特征的租赁作为一个组合进行会计处理与对该组合中的各单项租赁分别进行会计处理相比不会对财务报表产生显著的影响，本集团将具有类似特征的租赁作为一个组合进行会计处理。

24.1.2 使用权资产

除短期租赁和低价值资产租赁外，本集团在租赁期开始日对租赁确认使用权资产。租赁期开始日，是指出租人提供租赁资产使其可供本集团使用的起始日期。

使用权资产按照成本进行初始计量。该成本包括：

- 租赁负债的初始计量金额；
- 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；
- 本集团发生的初始直接费用；
- 本集团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。

本集团参照《企业会计准则第 4 号—固定资产》有关折旧规定，对使用权资产计提折旧。本集团能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，使用权资产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，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。

本集团按照《企业会计准则第 8 号—资产减值》的规定来确定使用权资产是否已发生减值，并对已识别的减值损失进行会计处理。

三、重要会计政策和会计估计 - 续

24、租赁 - 续

24.1 本集团作为承租人 - 续

24.1.3 租赁负债

除短期租赁和低价值资产租赁外，本集团在租赁期开始日按照该日尚未支付的租赁付款额的现值对租赁负债进行初始计量。在计算租赁付款额的现值时，本集团采用租赁内含利率作为折现率，无法确定租赁内含利率的，采用增量借款利率作为折现率。

租赁付款额是指本集团向出租人支付的与在租赁期内使用租赁资产的权利相关的款项，包括：

- 固定付款额及实质固定付款额，存在租赁激励的，扣除租赁激励相关金额；
- 取决于指数或比率的可变租赁付款额；
- 本集团合理确定将行使的购买选择权的行权价格；
- 租赁期反映出本集团将行使终止租赁选择权的，行使终止租赁选择权需支付的款项；
- 根据本集团提供的担保余值预计应支付的款项。

租赁期开始日后，本集团按照固定的周期性利率计算租赁负债在租赁期内各期间的利息费用，并计入当期损益或相关资产成本。

在租赁期开始日后，发生下列情形的，本集团重新计量租赁负债，并调整相应的使用权资产，若使用权资产的账面价值已调减至零，但租赁负债仍需进一步调减的，本集团将差额计入当期损益：

- 因租赁期变化或购买选择权的评估结果发生变化的，本集团按变动后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债；
- 根据担保余值预计的应付金额或者用于确定租赁付款额的指数或者比例发生变动，本集团按照变动后的租赁付款额和原折现率计算的现值重新计量租赁负债。租赁付款额的变动源自浮动利率变动的，使用修订后的折现率。

24.1.4 短期租赁和低价值资产租赁

本集团对房屋及建筑物及机器设备的短期租赁以及低价值资产租赁，选择不确认使用权资产和租赁负债。短期租赁，是指在租赁期开始日，租赁期不超过 12 个月且不包含购买选择权的租赁。低价值资产租赁，是指单项租赁资产为全新资产时价值较低的租赁。本集团将短期租赁和低价值资产租赁的租赁付款额，在租赁期内各个期间按照直线法计入当期损益。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

24、 租赁 - 续

24.1 本集团作为承租人 - 续

24.1.5 租赁变更

租赁发生变更且同时符合下列条件的，本集团将该租赁变更作为一项单独租赁进行会计处理：

- 该租赁变更通过增加一项或多项租赁资产的使用权而扩大了租赁范围；
- 增加的对价与租赁范围扩大部分的单独价格按该合同情况调整后的金额相当。

租赁变更未作为一项单独租赁进行会计处理的，在租赁变更生效日，本集团重新分摊变更后合同的对价，重新确定租赁期，并按照变更后租赁付款额和修订后的折现率计算的现值重新计量租赁负债。

租赁变更导致租赁范围缩小或租赁期缩短的，本集团相应调减使用权资产的账面价值，并将部分终止或完全终止租赁的相关利得或损失计入当期损益。其他租赁变更导致租赁负债重新计量的，本集团相应调整使用权资产的账面价值。

24.2 本集团作为出租人

24.2.1 租赁的分拆

合同中同时包含租赁和非租赁部分的，本集团根据《企业会计准则第 14 号—收入》关于交易价格分摊的规定分摊合同对价，分摊的基础为租赁部分和非租赁部分各自的单独价格。

24.2.2 租赁的分类

实质上转移了与租赁资产所有权有关的几乎全部风险和报酬的租赁为融资租赁。融资租赁以外的其他租赁为经营租赁。

24.2.2.1 本集团作为出租人记录经营租赁业务

在租赁期内各个期间，本集团采用直线法，将经营租赁的租赁收款额确认为租金收入。本集团发生的与经营租赁有关的初始直接费用于发生时予以资本化，在租赁期内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。

本集团取得的与经营租赁有关的未计入租赁收款额的可变租赁收款额，在实际发生时计入当期损益。

三、 重要会计政策和会计估计 - 续

24、 租赁 - 续

24.2 本集团作为出租人 - 续

24.2.3 转租赁

本集团作为转租出租人，将原租赁及转租赁合同作为两个合同单独核算。本集团基于原租赁产生的使用权资产，而不是原租赁的标的资产，对转租赁进行分类。

24.2.4 租赁变更

经营租赁发生变更的，本集团自变更生效日起将其作为一项新租赁进行会计处理，与变更前租赁有关的预收或应收租赁收款额视为新租赁的收款额。

25、 债务重组

25.1 作为债权人记录债务重组义务

以资产清偿债务方式进行债务重组的，本集团初始确认受让的金融资产以外的资产时，以成本计量，其中抵债资产的成本，包括放弃债权的公允价值和可直接归属于该资产的税金等其他成本。放弃债权的公允价值与账面价值之间的差额，计入当期损益。

四、 运用会计政策过程中所作的重要判断和会计估计所采用的关键假设和不确定因素

本集团在运用附注三所描述的会计政策过程中，本集团需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些判断、估计和假设是基于本集团管理层过去的历史经验，并在考虑其他相关因素的基础上作出的。实际的结果可能与本集团的估计存在差异。

本集团对前述判断、估计和假设在持续经营的基础上进行定期复核，会计估计的变更仅影响变更当期的，其影响数在变更当期予以确认；既影响变更当期又影响未来期间的，其影响数在变更当期和未来期间予以确认。

- 运用会计政策过程中所作的重要判断

合并范围的确定

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

对于本集团担任管理人的集合资产管理计划和基金，本集团会评估其持有的份额连同管理人报酬和信用增级对这些集合资产管理计划和基金所产生的可变回报的风险敞口是否足够重大，从而表明本集团是主要责任人。如果本集团担任主要责任人的角色，则需要将这些集合资产管理计划和基金纳入合并范围。

确定金融资产的分类

金融资产的分类和计量取决于金融资产的合同条款是否规定了在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，以及业务模式的测试结果。本集团确认业务模式时主要考虑如何对金融资产组进行管理，以达到特定业务目标。该评估涵盖能够反映所有相关证据的判断，包括如何评估和计量金融资产业绩、影响金融资产业绩的风险、以及如何管理金融资产及相关业务管理人员如何获得报酬。本集团通过监控到期前终止确认的、以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以了解其处置的原因，以及这些原因是否与持有金融资产业务目标保持一致。

四、 运用会计政策过程中所作的重要判断和会计估计所采用的关键假设和不确定因素 - 续

- 会计估计中采用的关键假设和不确定因素

资产负债表日，会计估计中很可能导致未来期间资产、负债账面价值作出重大调整的关键假设和不确定性主要有：

金融资产的公允价值

本集团对没有活跃交易市场的金融资产，通过各种估值方法确定其公允价值。本集团使用的估值方法包括相同或相似资产的最近成交价和现金流贴现模型分析等。当本集团采用估值技术对公允价值进行评估时，会在最大程度上利用可观察市场数据；当可观察的市场数据无法获得时，将对估值方法中的重大不可观察信息做出估计。本集团需对诸如自身和交易对手的信用风险、市场波动率和相关性等方面进行估计，这些相关因素假设的变化会对金融资产的公允价值产生影响。

融出资金和买入返售金融资产的减值

本集团对融出资金和买入返售金融资产评估预期信用损失。本集团在融出资金和买入返售金融资产的预期信用损失计量过程中运用重大的会计判断和估计。

信用风险的显著增加：预期信用损失模型中减值准备的确认为第一阶段资产采用 12 个月内的预期信用损失，第二阶段或第三阶段资产采用整个存续期内的预期信用损失。当初始确认后信用风险显著增加时，资产进入第二阶段；当已发生信用减值时，资产进入第三阶段。在评估资产的信用风险是否显著增加和金融资产是否已发生信用减值时，本集团会考虑定性和定量的合理且有依据的前瞻性信息。

建立具有相似信用风险特征的资产组：当预期信用损失在组合的基础上计量时，金融工具是基于相似的风险特征而组合在一起的。本集团持续评估这些金融工具是否继续保持具有相似的信用风险特征，用以确保一旦信用风险特征发生变化，金融工具将被适当地重分类。这可能会导致新建资产组合或将资产重分类至某个现存资产组合，从而更好地反映这类资产的类似信用风险特征。当信用风险显著增加时，资产从第一阶段转入第二阶段。同时也发生在当资产仍评估为 12 个月内或整个存续期内的预期信用损失时，由于资产组的信用风险不同而导致预期信用损失的金额不同。

模型和假设的使用：本集团采用不同的模型和假设来评估预期信用损失。本集团通过判断来确定每类金融资产的最适用模型，以及确定这些模型所使用的假设，包括信用风险的关键驱动因素相关的假设。

前瞻性信息：在评估预期信用损失时，本集团使用了合理且有依据的前瞻性信息，这些信息基于对不同经济驱动因素的未来走势的假设，以及这些经济驱动因素如何相互影响的假设。

四、 运用会计政策过程中所作的重要判断和会计估计所采用的关键假设和不确定因素 - 续

- 会计估计中采用的关键假设和不确定因素 - 续

融出资金和买入返售金融资产的减值 - 续

违约率：违约率是计量预期信用损失的重要输入值。违约率是对未来一定时期内发生违约的可能性的估计，其计算涉及历史数据、假设和对未来情况的预期。

违约损失率：违约损失率是对违约产生的损失的估计。它基于合同现金流与借款人预期收到的现金流之间的差异，且考虑了抵押品产生的现金流和整体信用增级。

有关上述会计估计详见附注十一、(二) 信用风险。

所得税以及递延所得税

本集团在正常的经营活动中，有部分交易其最终的税务处理和计算存在一定的不确定性。如果这些税务事项的最终认定结果同最初入账的金额存在差异，则该差异将对其最终认定期间的当期所得税和递延所得税产生影响。

本集团递延所得税资产的确认主要取决于是否有足够的应纳税暂时性差异可供利用的情况或取得其他确凿的证据表明其于未来期间能够取得足够的应纳税所得额。当有客观证据表明本集团于可抵扣暂时性差异转回的未来期间能够产生足够的应纳税所得额，则本集团以很可能取得的应纳税所得额为限，确认相关的递延所得税资产。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

五、 税项

1、 所得税

本公司及设立于中国大陆的子公司企业所得税税率为 25%。本集团设立于香港地区的子公司所得税按照 2018 年 3 月 28 日由香港立法会签署生效的《2017 年税务(修订)(第 7 号)条例草案》的要求,实体的首 200 万元利润将按 8.25%课税,而超过 200 万元利润则按 16.5%课税。(2019 年度:实体的首 200 万元利润将按 8.25%课税,而超过 200 万元利润则按 16.5%课税)。

2、 增值税

本集团适用增值税。本公司及子公司购进应税货物或接受应税劳务及服务,取得的增值税进项税额可以按相关规定抵扣销项税额。增值税应纳税额为当期销项税额抵减当期可抵扣进项税额后的余额。当期销项税额小于当期进项税额不足抵扣时,其不足部分可以结转下期继续抵扣。销项税额按根据相关税法规定计算的销售额计算,本公司提供的金融服务适用 6%的税率。

自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

3、 其他主要税项

| <u>税项</u> | <u>计税基础</u> | <u>税率</u> |
|-----------|-------------|-----------|
| 城市维护建设税 | 实际缴纳的流转税额 | 7% |
| 教育费附加 | 实际缴纳的流转税额 | 3% |
| 地方教育费附加 | 实际缴纳的流转税额 | 2% |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

六、企业合并及合并财务报表

1、 子公司情况

(1) 主要的子公司

| 子公司全称 | 子公司类型 | 注册地 | 业务性质及经营范围 | 注册资本 | 持股比例 | 表决权比例 | 取得方式 | 是否合并报表 |
|--|----------|-----|-----------|-------------|--------|--------|------------|--------|
| | | | | | % | % | | |
| 上海东证期货有限公司 | 有限公司 | 上海 | 期货经纪 | 23 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 非同一控制下企业合并 | 是 |
| 上海东祺投资管理有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资管理 | 2.5 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东证润和资本管理有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资管理 | 10 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东证期货国际(新加坡)有限公司 | 私人股份有限公司 | 新加坡 | 外汇经纪人和交易商 | 4,000 万新加坡币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | 有限公司 | 上海 | 证券资产管理 | 3 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 上海东方证券创新投资有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资 | 58 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方证券承销保荐有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资银行 | 8 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方金融控股(香港)有限公司 | 有限公司 | 香港 | 集团管理 | 27.54 亿港元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方证券(香港)有限公司 | 有限公司 | 香港 | 证券经纪 | 10 亿港元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方期货(香港)有限公司 | 有限公司 | 香港 | 期货经纪 | 2.3 亿港元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方资产管理(香港)有限公司 | 有限公司 | 香港 | 证券资产管理 | 1 亿港元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方融资(香港)有限公司 | 有限公司 | 香港 | 投资银行 | 1.5 亿港元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方信贷财务(香港)有限公司 | 有限公司 | 香港 | 财务融资 | 3,100 万港币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方鸿盛有限公司 | 有限公司 | BVI | 特殊目的 | 1 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方智汇有限公司 | 有限公司 | BVI | 特殊目的 | 1 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| Orient Zhisheng Limited | 有限公司 | BVI | 特殊目的 | 1 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| Orient HuiZhi Limited | 有限公司 | BVI | 特殊目的 | 1 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东证国际金融集团有限公司 | 有限公司 | 香港 | 投资管理 | 20.1 亿港元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东证科技(深圳)有限公司 | 有限公司 | 深圳 | 软件开发服务 | 1,000 万人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| Orient International Investment Products Limited | 有限公司 | BVI | 产品投资 | 1 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 上海东方证券资本投资有限公司 | 有限公司 | 上海 | 股权投资 | 40 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方星晖(北京)投资基金管理有限公司 | 有限公司 | 北京 | 投资管理 | 880 万人民币 | 57.95 | 57.95 | 设立 | 是 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

六、企业合并及合并财务报表 - 续

2、子公司情况 - 续

(1) 主要的子公司 - 续

| 子公司全称 | 子公司类型 | 注册地 | 业务性质及经营范围 | 注册资本 | 持股比例 | 表决权比例 | 取得方式 | 是否合并报表 |
|----------------------------|-------|-----|-----------|------------|--------|--------|------|--------|
| | | | | | % | % | | |
| 海宁东方红投资管理有限公司 | 有限公司 | 浙江 | 投资管理 | 200 万人民币 | 51.00 | 51.00 | 设立 | 是 |
| 上海东方富厚股权投资管理有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资管理 | 500 万人民币 | 58.00 | 58.00 | 设立 | 是 |
| 东石发展有限公司 | 有限公司 | 香港 | 投资管理 | 300 万港币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 新疆东证新城股权投资管理有限公司 | 有限公司 | 新疆 | 投资管理 | 500 万人民币 | 51.00 | 51.00 | 设立 | 是 |
| 海宁东证投资管理有限公司 | 有限公司 | 浙江 | 投资管理 | 1,000 万人民币 | 58.00 | 58.00 | 设立 | 是 |
| 东方翌睿(上海)投资管理有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资管理 | 200 万人民币 | 51.00 | 51.00 | 设立 | 是 |
| 东方弘泰资本投资(成都)有限公司 | 有限公司 | 四川 | 投资管理 | 3,000 万人民币 | 51.00 | 51.00 | 设立 | 是 |
| Golden Power Group Limited | 有限公司 | BVI | 投资管理 | 100 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 诚麒环球有限公司 | 有限公司 | BVI | 投资管理 | 100 美元 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 景德镇北汽东证产业投资管理有限公司 | 有限公司 | 江西 | 投资管理 | 1,000 万人民币 | 66.00 | 66.00 | 设立 | 是 |
| 东方睿信有限公司 | 有限公司 | 香港 | 投资管理 | 1 万港币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |
| 东方睿义(上海)投资管理有限公司 | 有限公司 | 上海 | 投资管理 | 13.5 亿人民币 | 100.00 | 100.00 | 设立 | 是 |

财务报表附注
2020 年 12 月 31 日止年度
六、 企业合并及合并财务报表 - 续
1、 子公司情况 - 续
(2) 纳入合并范围的结构化主体

本年末，本集团合并了一些结构化主体，包括本集团管理并投资的资产管理计划和基金。本集团主要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金额三个要素判断是否构成控制结构化主体。

2020 年 12 月 31 日，纳入合并财务报表范围的结构化主体的净资产为人民币 7,368 百万元（2019 年 12 月 31 日：6,077 百万元）。

截至 2020 年及 2019 年 12 月 31 日，本集团于纳入合并范围的资产管理计划、基金和有限合伙企业中所持有的份额的公允价值分别为人民币 6,105 百万元及人民币 5,801 百万元。截至 2020 年 12 月 31 日及 2019 年 12 月 31 日，本集团并未持有结构化产品的次级部分。

七、 合并财务报表项目附注
1、 货币资金
(1) 按类别列示

| 类别 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 库存现金 | 287,629.71 | 351,542.25 |
| 银行存款 | 65,248,779,303.68 | 48,678,668,209.08 |
| 其中： 客户存款 | 48,384,423,234.76 | 29,749,885,413.76 |
| 公司存款 | 16,864,356,068.92 | 18,928,782,795.32 |
| 其他货币资金 | 391,292,623.26 | 261,814,103.75 |
| 合计 | 65,640,359,556.65 | 48,940,833,855.08 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

1、 货币资金 - 续

(2) 按币种列示

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|-------------------|--------|--------------------------|-------------------|--------|--------------------------|
| | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 |
| 库存现金 | | | | | | |
| 人民币 | 203,097.92 | 1.0000 | 203,097.92 | 341,340.71 | 1.0000 | 341,340.71 |
| 港币 | 100,441.77 | 0.8416 | 84,531.79 | 11,388.19 | 0.8958 | 10,201.54 |
| 小计 | | | 287,629.71 | | | 351,542.25 |
| 客户资金 | | | | | | |
| 人民币 | 44,146,931,620.49 | 1.0000 | 44,146,931,620.49 | 27,186,118,912.08 | 1.0000 | 27,186,118,912.08 |
| 美元 | 65,216,829.80 | 6.5249 | 425,533,292.76 | 26,006,776.46 | 6.9762 | 181,428,473.92 |
| 港币 | 1,359,920,101.26 | 0.8416 | 1,144,508,757.22 | 505,568,224.65 | 0.8958 | 452,888,015.64 |
| 欧元 | 1,539,225.60 | 8.0250 | 12,352,285.47 | 883,442.62 | 7.8155 | 6,904,545.81 |
| 其他 | | | 3,350,719.39 | | | 1,554,209.17 |
| 小计 | | | 45,732,676,675.33 | | | 27,828,894,156.62 |
| 客户信用资金 | | | | | | |
| 人民币 | 2,651,746,559.43 | 1.0000 | 2,651,746,559.43 | 1,920,991,257.14 | 1.0000 | 1,920,991,257.14 |
| 小计 | | | 2,651,746,559.43 | | | 1,920,991,257.14 |
| 客户存款合计 | | | 48,384,423,234.76 | | | 29,749,885,413.76 |
| 公司自有资金 | | | | | | |
| 人民币 | 13,301,047,583.59 | 1.0000 | 13,301,047,583.59 | 11,309,751,969.84 | 1.0000 | 11,309,751,969.84 |
| 美元 | 211,224,501.48 | 6.5249 | 1,378,218,749.70 | 627,783,902.64 | 6.9762 | 4,379,546,061.61 |
| 港币 | 1,526,512,201.57 | 0.8416 | 1,284,712,668.84 | 931,106,235.57 | 0.8958 | 834,084,965.82 |
| 欧元 | 6,783,045.49 | 8.0250 | 54,433,940.07 | 200,313,099.66 | 7.8155 | 1,565,547,030.41 |
| 澳元 | 1,533,874.99 | 5.0163 | 7,694,377.09 | 1,588,346.95 | 4.8843 | 7,757,963.01 |
| 新加坡元 | 981,641.27 | 4.9314 | 4,840,865.74 | 4,279,475.27 | 5.1739 | 22,141,577.12 |
| 其他 | | | 4,343,364.31 | | | 2,585,865.64 |
| 小计 | | | 16,035,291,549.34 | | | 18,121,415,433.45 |
| 公司信用资金 | | | | | | |
| 人民币 | 829,064,519.58 | 1.0000 | 829,064,519.58 | 807,367,361.87 | 1.0000 | 807,367,361.87 |
| 小计 | | | 829,064,519.58 | | | 807,367,361.87 |
| 公司存款合计 | | | 16,864,356,068.92 | | | 18,928,782,795.32 |
| 其他货币资金 | | | | | | |
| 人民币 | 391,292,623.26 | 1.0000 | 391,292,623.26 | 261,292,741.37 | 1.0000 | 261,292,741.37 |
| 美元 | | | - | 74,734.44 | 6.9762 | 521,362.38 |
| 小计 | | | 391,292,623.26 | | | 261,814,103.75 |
| 合计 | | | 65,640,359,556.65 | | | 48,940,833,855.08 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

1、 货币资金 - 续

(2) 按币种列示 - 续

其中，融资融券业务：

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|--------|------------------|--------|------------------|------------------|--------|------------------|
| | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 |
| 自有信用资金 | | | 829,064,519.58 | | | 807,367,361.87 |
| 人民币 | 829,064,519.58 | 1.0000 | 829,064,519.58 | 807,367,361.87 | 1.0000 | 807,367,361.87 |
| 客户信用资金 | | | 2,651,746,559.43 | | | 1,920,991,257.14 |
| 人民币 | 2,651,746,559.43 | 1.0000 | 2,651,746,559.43 | 1,920,991,257.14 | 1.0000 | 1,920,991,257.14 |
| 合计 | | | 3,480,811,079.01 | | | 2,728,358,619.01 |

注：于 2020 年 12 月 31 日，本集团受限制的货币资金为 132,708,255.74 元。(2019 年 12 月 31 日，本集团受限制的货币资金为 21,303,804.53 元)

2、 结算备付金

(1) 按类别列示

| 类别 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 客户备付金 | 18,591,394,862.89 | 10,832,489,059.97 |
| 公司备付金 | 2,924,961,783.72 | 2,411,164,653.71 |
| 合计 | 21,516,356,646.61 | 13,243,653,713.68 |

(2) 按币种列示

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|---------|-------------------|--------|-------------------|-------------------|--------|-------------------|
| | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 |
| 客户普通备付金 | | | 18,291,394,823.77 | | | 10,466,997,569.98 |
| 人民币 | 18,035,922,032.12 | 1.0000 | 18,035,922,032.12 | 10,175,655,946.05 | 1.0000 | 10,175,655,946.05 |
| 美元 | 31,575,757.14 | 6.5249 | 206,028,657.76 | 34,695,228.28 | 6.9762 | 242,040,851.53 |
| 港币 | 58,750,159.09 | 0.8416 | 49,444,133.89 | 55,035,468.18 | 0.8958 | 49,300,772.40 |
| 客户信用备付金 | | | 300,000,039.12 | | | 365,491,489.99 |
| 人民币 | 300,000,039.12 | 1.0000 | 300,000,039.12 | 365,491,489.99 | 1.0000 | 365,491,489.99 |
| 客户备付金合计 | | | 18,591,394,862.89 | | | 10,832,489,059.97 |
| 公司自有备付金 | | | 2,924,961,783.72 | | | 2,411,164,653.71 |
| 人民币 | 2,924,961,783.72 | 1.0000 | 2,924,961,783.72 | 2,411,164,653.71 | 1.0000 | 2,411,164,653.71 |
| 公司备付金合计 | | | 2,924,961,783.72 | | | 2,411,164,653.71 |
| 合计 | | | 21,516,356,646.61 | | | 13,243,653,713.68 |

财务报表附注
 2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

2、 结算备付金 - 续

注：于 2020 年 12 月 31 日，本集团受限制的结算备付金为 106,916,434.69 元。(2019 年 12 月 31 日，本集团受限制的结算备付金为 194,657,298.11 元)

3、 融出资金

(1) 按类别列示

| 类别 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 1. 融资融券业务融出资金 | 20,951,466,503.22 | 12,930,750,730.33 |
| 2. 孖展融资 | 267,053,777.38 | 498,107,318.82 |
| 小计 | 21,218,520,280.60 | 13,428,858,049.15 |
| 减：减值准备 | 46,600,866.54 | 214,595,808.40 |
| 融出资金净值 | 21,171,919,414.06 | 13,214,262,240.75 |

(2) 按客户类别列示

| 类别 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 个人 | 16,880,091,261.76 | 11,400,212,079.45 |
| 机构 | 4,071,375,241.46 | 1,530,538,650.88 |
| 香港孖展融资 | 267,053,777.38 | 498,107,318.82 |
| 小计 | 21,218,520,280.60 | 13,428,858,049.15 |
| 减：减值准备 | 46,600,866.54 | 214,595,808.40 |
| 合计 | 21,171,919,414.06 | 13,214,262,240.75 |

(3) 融资融券业务期末客户担保物情况

| 担保物类别 | 2020 年 12 月 31 日公允价值 | 2019 年 12 月 31 日公允价值 |
|-------|----------------------|----------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 股票 | 75,119,588,720.24 | 46,140,190,958.54 |
| 基金 | 2,346,444,094.81 | 575,973,217.42 |
| 资金 | 2,865,292,937.51 | 1,932,869,771.15 |
| 债券 | 51,818,994.77 | 9,570,914.15 |
| 合计 | 80,383,144,747.33 | 48,658,604,861.26 |

注：2020 年在卖出回购协议下作为担保物资产的融出资金账面价值为 3,819,545,927.18 元 (2019 年：无)。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

4、 衍生金融工具

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|--------------------|----------------|----------------|--------------------|----------------|------------------|
| | 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 |
| 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | |
| 利率衍生工具 | | | | | | |
| - 利率互换 | 485,237,470,000.00 | 1,728,173.16 | 11,355,436.62 | 624,601,448,668.00 | 1,702,837.50 | - |
| - 利率互换期权 | 20,000,000.00 | 26,593.85 | 42,203.95 | - | - | - |
| - 国债期货(注 1) | 8,404,925,750.00 | - | - | 16,542,771,950.00 | - | - |
| 权益衍生工具 | | | | | | |
| - 股指期货合约(注 1) | 3,192,945,273.62 | 332,204.60 | 301,833.95 | 2,477,329,760.00 | - | - |
| - 权益类收益互换(注 2) | 55,380,000.00 | 2,336,676.57 | 2,482,843.47 | 88,050,000.00 | 720,042.54 | - |
| - 嵌入期权式收益凭证 | 18,493,000.00 | - | 34,689.43 | 195,985,000.00 | - | 3,479,837.25 |
| - 股票期权 | 6,037,660,767.54 | 70,875,468.89 | 58,197,099.42 | 2,176,526,021.10 | 22,051,199.29 | 49,636,713.49 |
| - 股票挂钩工具 | 1,230,544,383.26 | 249,534.90 | 17,120,144.19 | 549,327,833.74 | - | 4,275,026.90 |
| 信用衍生工具 | | | | | | |
| - 信用违约互换 | 375,690,784.00 | 650,958.15 | 3,150,669.29 | 328,579,467.20 | 1,102,279.34 | 5,314,021.73 |
| 其他衍生工具 | | | | | | |
| - 商品期货(注 1) | 10,588,143,206.60 | - | - | 11,148,530,015.00 | 24,017,161.84 | - |
| - 黄金掉期 | 9,802,831,000.00 | - | 49,029,150.00 | 6,577,055,500.00 | 500,644,000.00 | - |
| - 黄金远期 | 516,366,330.00 | - | 36,223,621.89 | 344,800,000.00 | - | 5,378,000.00 |
| - 商品期权 | 1,281,175,366.24 | 12,473,079.50 | 1,371,680.00 | 3,608,418,240.00 | 16,189,267.50 | 10,278,325.38 |
| - 黄金期权(注 3) | 4,313,560,000.00 | 12,852,855.69 | 268,564,073.99 | 14,934,002,120.00 | 35,777,364.46 | 2,555,328,059.77 |
| - 黄金延期(注 1) | 402,970.00 | - | - | 317,100.00 | - | - |
| - 货币互换 | 399,053,056.00 | - | 15,001,917.24 | 546,590,286.00 | 6,897,985.94 | 4,174,594.61 |
| - 外汇期货 | 897,869.38 | 47,509.16 | - | - | - | - |
| - 外汇掉期 | 6,305,547,060.00 | - | - | - | - | - |
| - 外汇远期 | 3,840,334,000.00 | 49,738,780.56 | 41,465,993.00 | - | - | - |
| - 非权益类收益互换 | 430,658,318.16 | 4,564,634.73 | 615,340.04 | 211,289,249.82 | - | 5,510,223.23 |
| 合计 | 542,052,079,134.80 | 155,876,469.76 | 504,956,696.48 | 684,331,021,210.86 | 609,102,138.41 | 2,643,374,802.36 |

注 1： 本集团除香港子公司外于本期末所持有的国债期货、股指期货、商品期货、黄金延期和外汇掉期，均为每日无负债结算。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本集团所持有的股指期货、国债期货和商品期货合约产生的公允价值变动金额。香港的股指期货合约与商品期货并未采用无负债结算制度，其衍生金融资产及负债均系香港子公司衍生业务产生。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

4、 衍生金融工具 - 续

衍生金融工具项下的境内国债期货合约、境内股指期货合约、商品期货合约、黄金延期合约以及部分利率互换合约形成的金融资产或金融负债与相关业务的暂收暂付款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额列示,为人民币零元。抵销前衍生金融资产/负债与国债期货、股指期货、商品期货、黄金延期以及利率互换的暂收/暂付款的期末金额如下表所示:

| | 2020 年 12 月 31 日 | | 2019 年 12 月 31 日 | |
|--------|------------------|----------------|------------------|----------------|
| | 衍生金融资产/ 暂收款 | 衍生金融负债/ 暂付款 | 衍生金融资产/ 暂收款 | 衍生金融负债/ 暂付款 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 利率互换合约 | 132,048,689.81 | - | - | 81,770,025.77 |
| 国债期货合约 | 6,617,000.00 | - | - | 5,487,850.00 |
| 股指期货合约 | - | 78,316,860.00 | - | 50,645,700.00 |
| 商品期货合约 | - | 20,854,745.00 | 30,075,877.50 | - |
| 黄金延期合约 | 10,790.00 | - | 6,540.00 | - |
| 外汇掉期合约 | 85,350,301.26 | - | - | - |
| 外汇远期合约 | 11,613,368.85 | - | - | - |

注 2: 本集团与符合一定条件的客户约定在未来一定期限内,按照约定的名义本金和收益率进行权益收益互换。该互换合约的收益率与标的权益证券的市场表现挂钩。

注 3: 本集团与符合一定条件的客户签订了一系列与黄金价格相关的期权合约。尽管黄金的公允价值具有波动性,这些期权合约组合在一起以使得本集团支付相对固定的费用支出。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

5、 应收款项

(1) 按明细列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 应收手续费及佣金 | 451,060,951.38 | 513,582,223.46 |
| 应收清算款项 | 435,545,767.20 | 514,380,584.57 |
| 合计 | 886,606,718.58 | 1,027,962,808.03 |
| 减：坏账准备 | 12,201,165.36 | 8,043,140.61 |
| 应收款项账面价值 | 874,405,553.22 | 1,019,919,667.42 |

(2) 按账龄分析

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | | 2019 年 12 月 31 日 | | | |
|-------|------------------|--------|---------------|-------|------------------|--------|--------------|--------|
| | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 |
| | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % |
| 1 年以内 | 871,110,629.96 | 98.25 | 3,809,869.99 | 0.44 | 907,532,524.58 | 88.28 | 4,021,939.45 | 0.44 |
| 1-2 年 | 438,451.88 | 0.05 | 2,192.26 | 0.50 | 59,038,677.39 | 5.74 | 729,243.13 | 1.24 |
| 2-3 年 | 9,817,876.05 | 1.11 | 5,377,904.31 | 54.78 | 58,391,606.06 | 5.68 | 291,958.03 | 0.50 |
| 3 年以上 | 5,239,760.69 | 0.59 | 3,011,198.80 | 57.47 | 3,000,000.00 | 0.30 | 3,000,000.00 | 100.00 |
| 合计 | 886,606,718.58 | 100.00 | 12,201,165.36 | 1.38 | 1,027,962,808.03 | 100.00 | 8,043,140.61 | 0.78 |

(3) 按评估方式列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | | 2019 年 12 月 31 日 | | | |
|----------|------------------|--------|---------------|-------|------------------|--------|--------------|-------|
| | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 |
| | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % |
| 单项计提坏账准备 | 12,791,305.58 | 1.44 | 8,383,387.17 | 65.54 | 12,791,305.58 | 1.24 | 3,432,995.59 | 26.84 |
| 组合计提坏账准备 | 873,815,413.00 | 98.56 | 3,817,778.19 | 0.44 | 1,015,171,502.45 | 98.76 | 4,610,145.02 | 0.45 |
| 合计 | 886,606,718.58 | 100.00 | 12,201,165.36 | 1.38 | 1,027,962,808.03 | 100.00 | 8,043,140.61 | 0.78 |

(4) 本年末应收款项金额前五单位名称/性质情况

| 单位名称 | 金额 | 账龄 | 坏账准备 | 性质或内容 | 占应收款项 总额比例 |
|--------------------------|---------------|-------------|--------------|----------|---------------|
| | 人民币元 | | 人民币元 | | % |
| 东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 | 20,926,890.83 | 1 年以内 | 104,634.45 | 应收手续费及佣金 | 2.36 |
| 东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 | 13,848,545.05 | 1 年以内 | 69,242.73 | 应收手续费及佣金 | 1.56 |
| 华夏基金管理有限公司 | 11,569,132.96 | 1 年以内/2-3 年 | 5,383,387.17 | 应收手续费及佣金 | 1.30 |
| 东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金 | 11,489,964.91 | 1 年以内 | 57,449.82 | 应收手续费及佣金 | 1.30 |
| 富国基金管理有限公司 | 9,474,832.65 | 1 年以内 | 47,374.16 | 应收手续费及佣金 | 1.07 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

6、 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

| | 2020年12月31日 | 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券 | 3,155,427,768.10 | 5,482,150,138.05 |
| 股票 | 16,338,943,231.20 | 20,531,489,436.80 |
| 小计 | 19,494,370,999.30 | 26,013,639,574.85 |
| 减：减值准备 | 5,033,945,627.94 | 1,807,097,592.56 |
| 合计 | 14,460,425,371.36 | 24,206,541,982.29 |

(2) 按业务类别列示

| | 2020年12月31日 | 2019年12月31日 |
|---------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券质押式回购 | 2,028,907,238.63 | 5,482,150,138.05 |
| 债券买断式回购 | 1,126,520,529.47 | - |
| 股票质押式回购 | 16,338,943,231.20 | 20,531,489,436.80 |
| 减：减值准备 | 5,033,945,627.94 | 1,807,097,592.56 |
| 合计 | 14,460,425,371.36 | 24,206,541,982.29 |

(3) 股票质押式回购剩余期限明细列示

| | 2020年12月31日 | | 2019年12月31日 | |
|--------|-------------------|--------|-------------------|--------|
| | 金额 | 持有比例 | 金额 | 持有比例 |
| | 人民币元 | % | 人民币元 | % |
| 1月以内 | 16,100,121,842.45 | 98.54 | 17,718,108,318.39 | 86.30 |
| 1-3月 | 238,821,388.75 | 1.46 | 1,305,701,586.19 | 6.36 |
| 3月-1年 | - | - | 1,118,849,820.44 | 5.45 |
| 1年以上 | - | - | 388,829,711.78 | 1.89 |
| 合计 | 16,338,943,231.20 | 100.00 | 20,531,489,436.80 | 100.00 |
| 减：减值准备 | 5,033,945,627.94 | | 1,807,097,592.56 | |
| 净额 | 11,304,997,603.26 | | 18,724,391,844.24 | |

(4) 收取的担保物情况

| | 年末公允价值 | 年初公允价值 |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| 担保物(注 1) | 17,837,382,646.06 | 28,634,532,678.51 |
| 其中：已出售或已再次向外抵押的担保物 | 1,126,520,529.47 | - |

注 1：通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因无法获知对手方质押库信息而无法披露，故此金额并未包括交易所国债逆回购所取得的担保物资产的公允价值。其所担保的买入返售金融资产 2020 年 12 月 31 日余额为人民币 652,647,368.20 元(2019 年 12 月 31 日：人民币 1,627,393,240.37 元)。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

7、 交易性金融资产

(1) 按类别列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | | 2019 年 12 月 31 日 | |
|------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 成本 | 公允价值 | 成本 | 公允价值 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券 | 26,512,297,118.09 | 26,977,230,840.64 | 29,966,190,536.40 | 30,575,190,387.73 |
| 股票/股权(注 1) | 8,375,681,194.69 | 8,839,918,130.44 | 7,952,468,152.26 | 8,125,586,263.01 |
| 公募基金(注 1) | 10,913,348,495.23 | 11,407,654,399.00 | 9,360,909,395.94 | 9,599,802,765.84 |
| 券商资管产品 | 2,502,111,944.64 | 2,745,531,139.70 | 1,262,312,223.46 | 1,323,563,925.34 |
| 信托产品 | 266,717,119.89 | 276,318,813.46 | 698,800,000.00 | 733,611,280.62 |
| 银行理财 | 2,694,000,000.00 | 2,710,547,492.45 | 961,000,000.00 | 961,000,000.00 |
| 其他 | 18,985,065,861.39 | 19,743,916,227.01 | 15,488,689,129.16 | 15,582,338,863.37 |
| 合计 | 70,249,221,733.93 | 72,701,117,042.70 | 65,690,369,437.22 | 66,901,093,485.91 |

注 1: 于 2020 年 12 月 31 日, 交易性金融资产中含拟融出证券的账面价值人民币 144,212,016.82 元(2019 年 12 月 31 日: 人民币 172,204,450.34 元)。

(2) 变现受限制的交易性金融资产

| 项目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------|-------------------|-------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 股票及其他(注 1) | 限售股及其他 | 680,415,839.51 | 741,581,033.88 |
| 债券 | 卖出回购业务作为担保物 | 14,545,294,427.67 | 16,915,505,956.70 |
| 基金 | 卖出回购业务作为担保物 | 5,460,045,330.30 | 3,789,506,570.13 |
| 债券 | 债券借贷作为担保物 | 1,003,785,297.29 | 1,055,463,527.75 |
| 债券及其他 | 其他负债作为担保物 | 872,743,083.24 | 2,629,106,531.86 |

注 1: 本集团年末持有的存在限售期限的交易性金融资产包括存在限售期限的股票、以自有资金投资的集合资产管理计划和其他投资产品。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

8、 债权投资

(1) 按投资品种类别列示

| | 成本 | 2020 年 12 月 31 日 | | |
|------|------------------|------------------|------------|------------------|
| | | 利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| | | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 金融债 | 2,833,989,784.65 | 73,433,569.72 | - | 2,907,423,354.37 |
| 企业债 | 40,372,980.33 | 971,211.13 | 15,792.76 | 41,328,398.70 |
| 中期票据 | 360,000,000.00 | 20,734,360.64 | 131,700.57 | 380,602,660.07 |
| 公司债 | 1,548,973,156.63 | 52,168,831.39 | 515,350.02 | 1,600,626,638.00 |
| 其他 | 1,302,201,993.31 | 11,716,096.41 | 1,991.05 | 1,313,916,098.67 |
| 合计 | 6,085,537,914.92 | 159,024,069.29 | 664,834.40 | 6,243,897,149.81 |

| | 成本 | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|------|------------------|------------------|--------------|------------------|
| | | 利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| | | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 金融债 | 2,858,338,208.44 | 73,361,361.48 | - | 2,931,699,569.92 |
| 企业债 | 121,912,718.71 | 2,279,386.08 | 94,994.67 | 124,097,110.12 |
| 中期票据 | 380,000,000.00 | 21,893,100.32 | 227,255.24 | 401,665,845.08 |
| 公司债 | 2,133,889,073.97 | 77,880,983.09 | 1,017,530.61 | 2,210,752,526.45 |
| 其他 | 1,507,975,746.78 | 17,475,930.27 | 112,499.81 | 1,525,339,177.24 |
| 合计 | 7,002,115,747.90 | 192,890,761.24 | 1,452,280.33 | 7,193,554,228.81 |

(2) 变现受限制的债权投资

| 项目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 2020年12月31日 | 2019年12月31日 |
|----|------------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券 | 卖出回购业务作为担保物 | 4,842,860,944.90 | 5,057,632,118.17 |
| 债券 | 债券借贷作为担保物 | 84,619,293.18 | 168,341,079.82 |

9、 其他债权投资

(1) 按投资品种类别列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | | |
|------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|----------------|
| | 成本 | 利息 | 公允价值变动 | 账面价值 | 预期信用损失(注) |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 国债 | 16,195,809,281.49 | 168,058,789.22 | (124,741,501.49) | 16,239,126,569.22 | - |
| 金融债 | 1,386,372,694.62 | 27,405,595.91 | 13,598,400.78 | 1,427,376,691.31 | 550,716.58 |
| 企业债 | 9,878,356,109.02 | 254,976,775.82 | 53,245,870.62 | 10,186,578,755.46 | 110,598,170.05 |
| 中期票据 | 6,444,971,104.63 | 130,037,380.96 | 52,574,415.38 | 6,627,582,900.97 | 47,213,957.33 |
| 公司债 | 11,204,677,096.53 | 298,623,524.62 | (47,773,026.37) | 11,455,527,594.78 | 63,953,490.51 |
| 其他 | 16,229,842,986.74 | 262,718,417.20 | 217,221,001.16 | 16,709,782,405.10 | 50,174,285.92 |
| 合计 | 61,340,029,273.03 | 1,141,820,483.73 | 164,125,160.08 | 62,645,974,916.84 | 272,490,620.39 |

财务报表附注
 2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

9、 其他债权投资 - 续

(1) 按投资品种类别列示 - 续

| | 2019 年 12 月 31 日 | | | | |
|------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|----------------|
| | 成本 | 利息 | 公允价值变动 | 账面价值 | 预期信用损失(注) |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 国债 | 13,453,959,917.63 | 127,331,418.60 | 77,897,563.37 | 13,659,188,899.60 | - |
| 金融债 | 2,411,879,445.36 | 63,877,234.37 | 41,408,287.04 | 2,517,164,966.77 | 112,152.42 |
| 企业债 | 9,073,057,502.46 | 260,962,273.05 | 185,952,150.34 | 9,519,971,925.85 | 4,541,851.06 |
| 中期票据 | 8,135,606,439.00 | 170,861,659.37 | 184,040,716.00 | 8,490,508,814.37 | 48,488,889.32 |
| 公司债 | 11,766,178,008.13 | 286,828,444.98 | 75,642,750.47 | 12,128,649,203.58 | 28,229,783.63 |
| 其他 | 18,081,229,840.37 | 318,250,568.85 | 180,599,205.86 | 18,580,079,615.08 | 43,275,743.43 |
| 合计 | 62,921,911,152.95 | 1,228,111,599.22 | 745,540,673.08 | 64,895,563,425.25 | 124,648,419.86 |

注：其他债权投资的预期信用损失计入其他综合收益。

(2) 变现受限制的其他债权投资

| 项目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 2020年12月31日 | 2019年12月31日 |
|----|------------------|-------------------|-------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券 | 债券借贷作为担保物 | 3,113,329,122.28 | 5,262,898,905.84 |
| 债券 | 卖出回购业务作为担保物 | 24,840,196,083.16 | 33,456,044,874.91 |

10、 其他权益工具投资

(1) 按投资品种类别列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | | 2019 年 12 月 31 日 | |
|------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 初始成本 | 年末公允价值 | 初始成本 | 年末公允价值 |
| 股票(注 1) | 3,426,340,899.37 | 2,793,477,118.37 | 3,056,572,300.67 | 2,553,973,264.08 |
| 永续债投资(注 2) | 2,912,957,279.26 | 3,013,878,663.01 | 3,152,957,279.26 | 3,264,036,729.00 |
| 其他(注 3) | 4,890,320,000.00 | 5,129,101,790.46 | 4,890,320,000.00 | 5,014,863,160.58 |
| 合计 | 11,229,618,178.63 | 10,936,457,571.84 | 11,099,849,579.93 | 10,832,873,153.66 |

注 1：于 2020 年 12 月 31 日，本集团将部分以非交易性目的持有的股票及未上市股权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。

于 2020 年 12 月 31 日，其他权益工具投资中含拟融出证券的账面价值人民币 66,185,227.00 元(2019 年 12 月 31 日：人民币 639,045,471.50 元)。

注 2：于 2020 年 12 月 31 日，本集团将部分永续债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权益工具投资。本集团拟长期持有这些永续债投资并获取相关股利收入。

财务报表附注
 2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

10、 其他权益工具投资 - 续

(1) 按投资品种类别列示 - 续

注 3：于 2020 年 12 月 31 日，其他权益工具投资中包括本公司对中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)专户的投资。根据本公司与证金公司签订的相关合同，该专户由证金公司进行统一运作与投资管理，由本公司与其他投资该专户的证券公司按投资比例分担投资风险和分享投资收益。本年末，该专户投资成本为 4,890,320,000.00 元，本公司根据证金公司提供的资产报告确定该专户投资的账面价值。

(2) 变现受限制的其他权益工具投资

| 项目 | 限售条件或变现方面的其他重大限制 | 2020年12月31日 | 2019年12月31日 |
|-------|------------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 永续债投资 | 卖出回购业务作为担保物 | 1,686,324,106.32 | 1,777,689,509.00 |
| 永续债投资 | 债券借贷作为担保物 | 11,745,124.78 | - |
| 股票 | 限售股 | 33,780,614.28 | 80,086,542.00 |

(3) 处置其他权益工具投资情况

| 项目 | 本期终止确认时的公允价值 | 本期股利收入 | 终止确认时的累计利得或损失本期从其他综合收益转入留存收益的金额 |
|-------|------------------|---------------|---------------------------------|
| | 人民币元 | | |
| 股票 | 698,279,547.58 | 13,219,607.77 | (49,772,704.80) |
| 未上市股权 | 110,415,958.35 | 420,099.85 | 7,057,664.20 |
| 永续债投资 | 399,789,816.36 | - | 14,002,228.56 |
| 合计 | 1,208,485,322.29 | 13,639,707.62 | (28,712,812.04) |

财务报表附注
 2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

11、 融出证券业务

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------|------------------|
| | 公允价值 人民币元 | 公允价值 人民币元 |
| 融出证券 | 1,891,866,052.48 | 226,598,282.80 |
| - 交易性金融资产 | 445,322,506.07 | 197,890,244.14 |
| - 转融通融入证券 | 1,317,694,542.01 | 23,093,109.66 |
| - 其他权益工具投资 | 128,849,004.40 | 5,614,929.00 |

12、 存出保证金

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|-------|------------------|--------|------------------|------------------|--------|------------------|
| | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 | 原币金额 | 折算率 | 折人民币金额 |
| 交易保证金 | | | 829,247,936.42 | | | 665,691,087.87 |
| 人民币 | 668,512,664.15 | 1.0000 | 668,512,664.15 | 464,739,973.33 | 1.0000 | 464,739,973.33 |
| 港币 | 163,940,619.06 | 0.8416 | 137,972,425.00 | 2,000,000.00 | 0.8958 | 1,791,600.00 |
| 美元 | 3,488,612.44 | 6.5249 | 22,762,847.27 | 28,548,423.86 | 6.9762 | 199,159,514.54 |
| 履约保证金 | | | 1,305,349,270.33 | | | 954,238,766.48 |
| 人民币 | 1,141,590,901.92 | 1.0000 | 1,141,590,901.92 | 937,203,816.41 | 1.0000 | 937,203,816.41 |
| 港币 | 194,579,810.37 | 0.8416 | 163,758,368.41 | 19,016,465.81 | 0.8958 | 17,034,950.07 |
| 信用保证金 | | | 48,492,488.02 | | | 22,964,494.12 |
| 人民币 | 48,492,488.02 | 1.0000 | 48,492,488.02 | 22,964,494.12 | 1.0000 | 22,964,494.12 |
| 合计 | | | 2,183,089,694.77 | | | 1,642,894,348.47 |

13、 长期股权投资

(1) 按类别列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 联营企业 | 5,771,193,948.89 | 4,453,754,152.13 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

13、 长期股权投资- 续

(2) 长期股权投资详细情况如下:

| 被投资单位名称 | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增减变动 | | | | | | | | 2020 年 12 月 31 日 | 减值准备 年末余额 |
|------------------------------------|---------------------|----------------|------------------|------------------|----------------|---------------|------------------|------------|----|---------------------|--------------|
| | | 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 | | |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 2,066,501,987.16 | - | - | 905,857,438.59 | (8,357,018.46) | - | (378,192,299.47) | - | - | 2,585,810,107.82 | - |
| 温州俊元资产管理合伙企业(有限合伙) | 177,053,420.73 | - | (93,911,623.63) | - | - | - | - | - | - | 83,141,797.10 | - |
| 嘉兴君兆投资管理合伙企业(有限合伙) | - | 30,000,000.00 | - | (283,426.39) | - | - | - | - | - | 29,716,573.61 | - |
| 上海颐歌资产管理有限公司 | - | 30,160,000.00 | - | 1,634,444.79 | - | - | - | - | - | 31,794,444.79 | - |
| 深圳盟海五号智能产业投资合伙企业(有限合伙) | - | 65,000,000.00 | - | (1,177,844.79) | - | - | - | - | - | 63,822,155.21 | - |
| 上海诚毅投资管理有限公司 | 22,300,709.05 | - | (18,000,000.00) | (1,164,122.60) | - | - | (3,136,586.45) | - | - | - | - |
| OCI International Holdings Limited | 406,559,077.40 | - | - | (11,705,016.20) | (4,937,534.80) | 36,384,726.71 | - | - | - | 426,301,253.11 | - |
| 东证睿波(上海)投资中心(有限合伙) | 105,625,966.33 | - | - | 25,675,101.37 | 3,612,876.99 | 8,160,898.61 | - | - | - | 143,074,843.30 | - |
| 东证腾骏(上海)投资合伙企业(有限合伙) | 15,057,943.05 | - | (9,109,427.00) | (1,327,221.92) | - | - | - | - | - | 4,621,294.13 | - |
| 上海诚毅新能源创业投资有限公司 | 156,559,512.37 | - | - | 20,058,568.16 | - | - | - | - | - | 176,618,080.53 | - |
| 上海东证春医投资中心(有限合伙) | 78,099,095.66 | - | - | 37,373,224.11 | - | - | - | - | - | 115,472,319.77 | - |
| 上海东证今缘股权投资基金合伙企业(有限合伙) | 3,072,336.69 | - | - | (924,781.14) | - | - | - | - | - | 2,147,555.55 | - |
| 上海东证远誉投资中心(有限合伙) | 6,594,124.09 | - | - | (6,258,941.26) | - | - | - | - | - | 335,182.83 | - |
| 上海君煜投资中心(有限合伙) | 51,520,703.95 | - | (49,999,500.00) | 3,914,630.76 | - | - | (4,187,973.31) | - | - | 1,247,861.40 | - |
| 宜兴东证睿元股权投资合伙企业(有限合伙) | - | 41,650,000.00 | - | (363,708.90) | - | - | - | - | - | 41,286,291.10 | - |
| 珠海横琴东证云启科创投资合伙企业(有限合伙) | - | 2,700,000.00 | - | 778.82 | - | - | - | - | - | 2,700,778.82 | - |
| 宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙) | - | 85,000,000.00 | - | 29,986,410.26 | - | - | - | - | - | 114,986,410.26 | - |
| 南通东证富象股权投资中心(有限合伙) | - | 59,000,000.00 | - | 10,942,919.81 | - | - | - | - | - | 69,942,919.81 | - |
| 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | 928,637,643.13 | - | - | 94,280,682.32 | - | - | (48,082,710.90) | - | - | 974,835,614.55 | - |
| 上海东恺投资管理有限公司 | 20,821,604.36 | - | - | 52,147.94 | - | - | - | - | - | 20,873,752.30 | - |
| 杭州数行科技有限公司 | - | 3,302,568.49 | - | - | - | - | - | - | - | 3,302,568.49 | - |
| 海宁东证蓝海并购投资合伙企业(有限合伙) | 353,080,000.00 | - | (95,339,970.00) | 84,987,670.00 | - | - | - | - | - | 342,727,700.00 | - |
| 成都交子东方投资发展合伙企业(有限合伙) | - | 500,000,000.00 | - | (1,391,504.88) | - | - | - | - | - | 498,608,495.12 | - |
| 海宁春秋投资合伙企业(有限合伙) | 62,270,028.16 | - | (10,206,718.59) | 22,290,568.43 | - | - | (36,527,928.71) | - | - | 37,825,949.29 | - |
| 合计 | 4,453,754,152.13 | 816,812,568.49 | (276,567,239.22) | 1,212,458,017.28 | (9,681,676.27) | 44,545,625.32 | (470,127,498.84) | - | - | 5,771,193,948.89 | - |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

14、 使用权资产

| 项目 | 房屋及建筑物 | 交通运输设备 | 合计 |
|------------------------|------------------|--------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一、账面原值： | | | |
| 1.2020 年 1 月 1 日余额 | 1,270,603,127.08 | 1,950,081.61 | 1,272,553,208.69 |
| 2.本年增加 | 205,206,201.87 | 1,589,815.12 | 206,796,016.99 |
| 3.本年减少 | 91,590,853.16 | 203,768.09 | 91,794,621.25 |
| 4.本年转入 | 179,713.67 | - | 179,713.67 |
| 5.外币报表折算差额 | (4,435,496.42) | - | (4,435,496.42) |
| 6.2020 年 12 月 31 日余额 | 1,379,962,693.04 | 3,336,128.64 | 1,383,298,821.68 |
| 二、累计折旧 | | | |
| 1.2020 年 1 月 1 日余额 | 269,175,206.48 | 628,866.58 | 269,804,073.06 |
| 2.本年增加 | 321,187,735.77 | 905,509.03 | 322,093,244.80 |
| 3.本年减少 | 54,008,102.04 | 202,218.49 | 54,210,320.53 |
| 4.外币报表折算差额 | (1,743,123.67) | - | (1,743,123.67) |
| 5.2020 年 12 月 31 日余额 | 534,611,716.54 | 1,332,157.12 | 535,943,873.66 |
| 三、账面价值 | | | |
| 1.2020 年 1 月 1 日账面价值 | 1,001,427,920.60 | 1,321,215.03 | 1,002,749,135.63 |
| 2.2020 年 12 月 31 日账面价值 | 845,350,976.50 | 2,003,971.52 | 847,354,948.02 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

14、 使用权资产 - 续

| 项目 | 房屋及建筑物 | 交通运输设备 | 合计 |
|------------------------|------------------|--------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一、账面原值： | | | |
| 1.2019 年 1 月 1 日余额 | 834,143,530.57 | 923,550.72 | 835,067,081.29 |
| 2.本年增加 | 445,352,970.48 | 1,181,693.18 | 446,534,663.66 |
| 3.本年减少 | 8,733,646.94 | 155,162.29 | 8,888,809.23 |
| 4.本年转出 | 1,077,387.60 | - | 1,077,387.60 |
| 5.外币报表折算差额 | 917,660.57 | - | 917,660.57 |
| 6.2019 年 12 月 31 日余额 | 1,270,603,127.08 | 1,950,081.61 | 1,272,553,208.69 |
| 二、累计折旧 | | | |
| 1.2019 年 1 月 1 日余额 | - | - | - |
| 2.本年增加 | 272,872,106.87 | 682,834.66 | 273,554,941.53 |
| 3.本年减少 | 3,914,413.69 | 53,968.08 | 3,968,381.77 |
| 4.外币报表折算差额 | 217,513.30 | - | 217,513.30 |
| 5.2019 年 12 月 31 日余额 | 269,175,206.48 | 628,866.58 | 269,804,073.06 |
| 三、账面价值 | | | |
| 1.2019 年 1 月 1 日账面价值 | 834,143,530.57 | 923,550.72 | 835,067,081.29 |
| 2.2019 年 12 月 31 日账面价值 | 1,001,427,920.60 | 1,321,215.03 | 1,002,749,135.63 |

本集团租赁了多项资产，包括房屋及建筑物和交通运输设备，租赁期为 1 年到 10 年。租赁条款系在个别基础上磋商，包括各种不同条款及条件。在厘定租期及评估不可撤回租赁期间的长度时，本集团应用合同的定义并厘定合同可强制执行的期间。

2020 年度，本集团与租赁相关的现金流出合计人民币 375,482,681.26 元。

2020 年度，计入当期损益的简化处理的短期租赁费用为人民币 37,873,631.70 元、低价值资产租赁费用为人民币 1,747,210.37 元。于 2020 年 12 月 31 日，本集团的短期租赁组合与列示于附注七、50 的租赁费对应的短期租赁相类似。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

15、 投资性房地产

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------------|------------------|
| | 人民币元 |
| 一、账面原值 | |
| 1.年初余额 | 43,793,783.97 |
| 2.本年转入 | 24,212,737.97 |
| 3.本年转出 | 4,490,099.16 |
| 4.年末余额 | 63,516,422.78 |
| 二、累计折旧 | |
| 1.年初余额 | 13,722,449.87 |
| 2.本年计提 | 2,663,884.16 |
| 3.本年转入 | 6,925,393.74 |
| 4.本年转出 | 255,975.02 |
| 5.年末余额 | 23,055,752.75 |
| 三、投资性房地产账面价值 | |
| 1.年末账面余额 | 40,460,670.03 |

| 项目 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------------|------------------|
| | 人民币元 |
| 一、账面原值 | |
| 1.2018 年 12 月 31 日余额 | - |
| 2.新租赁准则影响 | 4,700,781.99 |
| 3.2019 年 1 月 1 日余额 | 4,700,781.99 |
| 4.本年转入 | 39,093,001.98 |
| 5.年末余额 | 43,793,783.97 |
| 二、累计折旧 | |
| 1.年初余额 | - |
| 2.本年计提 | 5,590,343.02 |
| 3.本年转入 | 8,132,106.85 |
| 4.年末余额 | 13,722,449.87 |
| 三、投资性房地产账面价值 | |
| 1.年末账面余额 | 30,071,334.10 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

16、 固定资产

(1) 账面价值

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 固定资产原值 | 2,952,918,605.26 | 2,833,811,899.19 |
| 减：累计折旧 | 933,316,632.62 | 793,538,467.53 |
| 固定资产减值准备 | - | - |
| 固定资产账面价值合计 | 2,019,601,972.64 | 2,040,273,431.66 |

(2) 固定资产增减变动表

| 项目 | 房屋及建筑物 | 电子设备 | 运输设备 | 办公设备 | 合计 |
|--------------------|------------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一、账面原值： | | | | | |
| 1.2019 年 12 月 31 日 | 1,902,810,440.77 | 784,629,041.56 | 42,766,434.96 | 103,605,981.90 | 2,833,811,899.19 |
| 2.本年增加 | 4,310,385.49 | 159,652,076.28 | 2,216,982.30 | 23,558,355.13 | 189,737,799.20 |
| (1)本年购置 | - | 58,254,334.43 | 926,767.08 | 11,599,302.48 | 70,780,403.99 |
| (2)在建工程转入 | - | 101,397,741.85 | 1,290,215.22 | 11,959,052.65 | 114,647,009.72 |
| (3)投资性房地产转入 | 4,310,385.49 | - | - | - | 4,310,385.49 |
| 3.本年减少 | 27,279,809.53 | 34,199,373.15 | 2,183,456.35 | 5,906,716.68 | 69,569,355.71 |
| (1)处置或报废 | 3,067,071.56 | 34,199,373.15 | 2,183,456.35 | 5,906,716.68 | 45,356,617.74 |
| (2)转出投资性房地产 | 24,212,737.97 | - | - | - | 24,212,737.97 |
| 4.外币报表折算差额 | - | (907,375.35) | (37,695.36) | (116,666.71) | (1,061,737.42) |
| 5.2020 年 12 月 31 日 | 1,879,841,016.73 | 909,174,369.34 | 42,762,265.55 | 121,140,953.64 | 2,952,918,605.26 |
| 二、累计折旧： | | | | | |
| 1.2019 年 12 月 31 日 | 138,941,014.47 | 557,594,991.04 | 28,373,044.13 | 68,629,417.89 | 793,538,467.53 |
| 2.本年计提 | 66,933,861.31 | 100,049,287.32 | 4,059,820.21 | 10,517,518.42 | 181,560,487.26 |
| 3.本年减少 | 6,669,418.72 | 27,501,070.97 | 2,052,977.84 | 4,878,571.35 | 41,102,038.88 |
| 4.外币报表折算差额 | - | (595,873.07) | (25,423.34) | (58,986.88) | (680,283.29) |
| 5.2020 年 12 月 31 日 | 199,205,457.06 | 629,547,334.32 | 30,354,463.16 | 74,209,378.08 | 933,316,632.62 |
| 三、减值准备： | - | - | - | - | - |
| 四、账面价值： | | | | | |
| 1.年末账面价值 | 1,680,635,559.67 | 279,627,035.02 | 12,407,802.39 | 46,931,575.56 | 2,019,601,972.64 |
| 2.年初账面价值 | 1,763,869,426.30 | 227,034,050.52 | 14,393,390.83 | 34,976,564.01 | 2,040,273,431.66 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

17、 在建工程

(1) 在建工程账面价值

| 项目 | 2020 年 12 月 31 日 | | | 2019 年 12 月 31 日 | | |
|------------------|------------------|------|---------------|------------------|------|---------------|
| | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 金桥数据中心网络设备项目 | 20,522,378.79 | - | 20,522,378.79 | - | - | - |
| 新源广场 5F 数据机房改造项目 | - | - | - | 2,997,296.76 | - | 2,997,296.76 |
| 营业部装修及设备更新 | 8,752,728.67 | - | 8,752,728.67 | 4,365,053.21 | - | 4,365,053.21 |
| 东方投行办公室装修 | - | - | - | 10,678,627.93 | - | 10,678,627.93 |
| 其他 | 36,563,417.52 | - | 36,563,417.52 | 31,993,302.61 | - | 31,993,302.61 |
| 合计 | 65,838,524.98 | - | 65,838,524.98 | 50,034,280.51 | - | 50,034,280.51 |

18、 无形资产

| 项目 | 计算机软件 | 交易席位费(1) | 合计 |
|---------------------|----------------|---------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一、账面原值： | | | |
| 1. 2019 年 12 月 31 日 | 540,393,078.87 | 61,552,797.50 | 601,945,876.37 |
| 2. 本年增加 | 144,322,834.82 | - | 144,322,834.82 |
| 3. 本年减少 | 114,260.54 | - | 114,260.54 |
| 4. 外币报表折算差额 | (566,727.29) | - | (566,727.29) |
| 5. 2020 年 12 月 31 日 | 684,034,925.86 | 61,552,797.50 | 745,587,723.36 |
| 二、累计摊销 | | | |
| 1. 2019 年 12 月 31 日 | 393,616,581.03 | 39,810,214.52 | 433,426,795.55 |
| 2. 本年增加 | 97,335,805.49 | - | 97,335,805.49 |
| 3. 本年减少 | 31,068.92 | - | 31,068.92 |
| 4. 外币报表折算差额 | (456,903.10) | - | (456,903.10) |
| 5. 2020 年 12 月 31 日 | 490,464,414.50 | 39,810,214.52 | 530,274,629.02 |
| 三、减值准备 | - | - | - |
| 四、账面价值 | | | |
| 1. 2019 年 12 月 31 日 | 146,776,497.84 | 21,742,582.98 | 168,519,080.82 |
| 2. 2020 年 12 月 31 日 | 193,570,511.36 | 21,742,582.98 | 215,313,094.34 |

(1) 本集团交易席位费主要包括上海证券交易所、深圳证券交易所和全国中小企业股份转让系统的交易席位费。

七、 合并财务报表项目附注 - 续

18、 无形资产 - 续

使用寿命不确定的交易席位费的减值测试

本公司管理层认为持有的交易席位费的使用寿命不确定，主要系其预计带来现金净流入的具体期限不确定。交易席位费将于使用寿命确定时才开始摊销。本集团持有的交易席位费每年或者当有迹象表明其可能减值时将对其进行减值测试。本集团持有的交易席位费所属的经纪业务资产组的预计可收回金额超过该资产组的账面价值，因此管理层认为截至 2020 年 12 月 31 日及 2019 年 12 月 31 日，本集团交易席位费未发生减值。

19、 商誉

| | 年末及上年末余额 |
|---------|---------------|
| | 人民币元 |
| 收购营业部商誉 | 18,947,605.48 |
| 东证期货商誉 | 13,187,769.62 |
| 减：减值准备 | - |
| 合计 | 32,135,375.10 |

商誉的减值测试

本集团进行商誉的减值测试时，将商誉分摊至两个独立的资产组，分别为本公司收购的证券经纪营业部(“资产组 A”)及本公司收购的上海东证期货有限公司(“资产组 B”)。

截至 2020 年 12 月 31 日及 2019 年 12 月 31 日，资产组 A 和资产组 B 的预计可收回金额均超过该资产组的账面价值，故本集团认为其均不存在减值。

资产组 A 和资产组 B 的预计可收回金额按照未来现金流量的现值确定。预计现金流量的现值以管理层的财务预算为基础按照折现率 15% 计算确定。根据资产组的历史业绩和管理层对未来市场发展的预期，管理层认为以上资产组的账面价值预计超过可收回金额的可能性很低。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

20、 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 按总额列示的递延所得税资产和递延所得税负债

未经抵销的递延所得税资产

| 项目 | 可抵扣暂时性差异 | | 递延所得税资产 | |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、衍生金融资产/负债 | 374,711,308.44 | 881,300,934.08 | 93,677,827.11 | 220,325,233.52 |
| 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融工具 | 129,035,446.71 | - | 32,258,861.68 | - |
| 应付职工薪酬 | 1,532,262,374.24 | 1,008,492,823.68 | 383,065,593.56 | 252,123,205.92 |
| 坏账准备 | 720,714,856.60 | 390,978,542.20 | 180,178,714.15 | 97,744,635.55 |
| 买入返售金融资产减值准备 | 5,033,945,627.94 | 1,807,097,592.56 | 1,258,486,406.99 | 451,774,398.14 |
| 可抵扣亏损 | 6,034,307.40 | 1,504,662,422.56 | 1,508,576.85 | 376,165,605.64 |
| 其他 | 7,247,185.76 | 6,538,453.84 | 1,811,796.44 | 1,634,613.46 |
| 合计 | 7,803,951,107.09 | 5,599,070,768.92 | 1,950,987,776.78 | 1,399,767,692.23 |

未经抵销的递延所得税负债

| 项目 | 应纳税暂时性差异 | | 递延所得税负债 | |
|----------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具、衍生金融资产/负债 | 2,028,326,104.04 | 1,396,160,777.72 | 507,081,526.01 | 349,040,194.43 |
| 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融工具 | - | 478,567,185.48 | - | 119,641,796.37 |
| 长期股权投资 | 32,654,287.20 | 26,825,057.24 | 8,163,571.80 | 6,706,264.31 |
| 政府补助收入 | - | 729,667,616.12 | - | 182,416,904.03 |
| 合计 | 2,060,980,391.24 | 2,631,220,636.56 | 515,245,097.81 | 657,805,159.14 |

(2)按净额列示的递延所得税资产和递延所得税负债

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 递延所得税资产 | 1,455,922,066.16 | 760,993,782.62 |
| 递延所得税负债 | 20,179,387.19 | 19,031,249.53 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

21、 其他资产

按类别列示

| | | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-----|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 其他应收款 | (1) | 354,157,255.42 | 277,038,733.34 |
| 贷款和委托贷款 | (2) | 78,720,680.82 | 288,337,494.42 |
| 预付款项 | | 459,301,919.63 | 484,282,940.46 |
| 长期待摊费用 | (3) | 140,221,702.24 | 98,896,651.83 |
| 其他 | | 1,105,598,151.74 | 584,062,937.78 |
| 合计 | | 2,137,999,709.85 | 1,732,618,757.83 |

(1) 其他应收款

(i) 按明细列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 其他应收款款项余额 | 1,057,519,251.55 | 657,284,055.48 |
| 减：坏账准备 | 703,361,996.13 | 380,245,322.14 |
| 其他应收款净值 | 354,157,255.42 | 277,038,733.34 |

(ii) 按账龄分析

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | | 2019 年 12 月 31 日 | | | |
|-------|------------------|--------|----------------|-------|------------------|--------|----------------|-------|
| | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 |
| | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % |
| 1 年以内 | 274,519,161.11 | 25.96 | 1,334,709.43 | 0.49 | 239,696,731.55 | 36.47 | 54,375,304.96 | 22.69 |
| 1-2 年 | 118,551,501.69 | 11.21 | 73,057,312.41 | 61.62 | 40,862,289.16 | 6.22 | 204,311.45 | 0.50 |
| 2-3 年 | 7,645,180.91 | 0.72 | 38,110.89 | 0.50 | 8,898,573.16 | 1.35 | 44,492.86 | 0.50 |
| 3 年以上 | 656,803,407.84 | 62.11 | 628,931,863.40 | 95.76 | 367,826,461.61 | 55.96 | 325,621,212.87 | 88.53 |
| 合计 | 1,057,519,251.55 | 100.00 | 703,361,996.13 | 66.51 | 657,284,055.48 | 100.00 | 380,245,322.14 | 57.85 |

(iii) 评估方式列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | | 2019 年 12 月 31 日 | | | |
|----------|------------------|--------|----------------|-------|------------------|--------|----------------|-------|
| | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 | 账面余额 | 比例 | 坏账准备 | 计提比例 |
| | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % | 人民币元 | % |
| 单项计提坏账准备 | 755,035,344.04 | 71.40 | 701,895,396.47 | 92.96 | 400,272,936.87 | 60.90 | 375,690,866.30 | 93.86 |
| 组合计提坏账准备 | 302,483,907.51 | 28.60 | 1,466,599.66 | 0.48 | 257,011,118.61 | 39.10 | 4,554,455.84 | 1.77 |
| 合计 | 1,057,519,251.55 | 100.00 | 703,361,996.13 | 66.51 | 657,284,055.48 | 100.00 | 380,245,322.14 | 57.85 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

21、 其他资产 - 续

(2) 贷款和委托贷款

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 贷款和委托贷款余额 | 79,116,262.13 | 289,786,426.55 |
| 减：坏账准备 | 395,581.31 | 1,448,932.13 |
| 贷款和委托贷款净值 | 78,720,680.82 | 288,337,494.42 |

注：于 2020 年 12 月 31 日，本集团之子公司以质押的方式向若干企业出借资金，期限为一年。

(3) 长期待摊费用

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加额 | 本年摊销额 | 其他减少额 | 汇率差额 | 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|---------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 租入固定资产改良支出 | 94,469,126.09 | 100,877,761.46 | 58,379,344.05 | 3,120,667.87 | (638,580.42) | 133,208,295.21 |
| 其他 | 4,427,525.74 | 2,741,737.55 | 155,856.26 | - | - | 7,013,407.03 |
| 合计 | 98,896,651.83 | 103,619,499.01 | 58,535,200.31 | 3,120,667.87 | (638,580.42) | 140,221,702.24 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

22、 资产减值准备

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加 (含汇率变动) | 转入/(转出) | 核销 | 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|---------------------|------------------|------------------|------------------|---------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 坏账准备 | 389,737,394.88 | 35,227,621.88 | 292,760,917.13 | (1,767,191.09) | 715,958,742.80 |
| 债权投资减值准备 | 1,452,280.33 | (787,445.93) | - | - | 664,834.40 |
| 融出资金减值准备 | 214,595,808.40 | 3,879,542.16 | - | (171,874,484.02) | 46,600,866.54 |
| 买入返售金融资产 减值准备 | 1,807,097,592.56 | 3,696,273,987.63 | (469,425,952.25) | - | 5,033,945,627.94 |
| 合计 | 2,412,883,076.17 | 3,734,593,705.74 | (176,665,035.12) | (173,641,675.11) | 5,797,170,071.68 |
| 其他债权投资预期 信用损失(注 1) | 124,648,419.86 | 147,842,200.53 | - | - | 272,490,620.39 |

| | 2018 年 12 月 31 日 | 本年增加 (含汇率变动) | 转入/(转出) | 核销 | 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|---------------------|------------------|---------|------|---------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 坏账准备 | 345,844,842.41 | 43,892,552.47 | - | - | 389,737,394.88 |
| 债权投资减值准备 | 1,941,343.45 | (489,063.12) | - | - | 1,452,280.33 |
| 融出资金减值准备 | 204,211,412.35 | 10,384,396.05 | - | - | 214,595,808.40 |
| 买入返售金融资产 减值准备 | 833,745,202.31 | 973,352,390.25 | - | - | 1,807,097,592.56 |
| 合计 | 1,385,742,800.52 | 1,027,140,275.65 | - | - | 2,412,883,076.17 |
| 其他债权投资预期 信用损失(注 1) | 102,952,522.78 | 21,695,897.08 | - | - | 124,648,419.86 |

注 1：其他债权投资的预期信用损失准备在其他综合收益中确认。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

22、 资产减值准备 - 续

金融资产预期损失减值准备如下：

| 金融工具类别 | 2020 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|-------------|-------------------|---------------|------------------|---------------|-------------------|------------------|------------------|
| | 未来 12 个月 | | 整个存续期(未发生信用减值) | | 整个存续期(已发生信用减值) | | 合计 |
| | 原值 | 预期信用损失 | 原值 | 预期信用损失 | 原值 | 预期信用损失 | |
| 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | |
| 应收款项 | | | 873,815,413.00 | 3,817,778.19 | 12,791,305.58 | 8,383,387.17 | 12,201,165.36 |
| 其他资产 | 381,600,169.64 | 1,862,180.97 | - | - | 755,035,344.04 | 701,895,396.47 | 703,757,577.44 |
| 债权投资 | 6,244,561,984.21 | 664,834.40 | - | - | - | - | 664,834.40 |
| 融出资金 | 20,750,014,198.10 | 1,054,384.07 | 423,269,640.80 | 310,040.77 | 45,236,441.70 | 45,236,441.70 | 46,600,866.54 |
| 买入返售金融资产 | 3,839,920,502.60 | 271,595.83 | 2,936,498,660.27 | 26,276,216.71 | 12,717,951,836.43 | 5,007,397,815.40 | 5,033,945,627.94 |
| 其中：股票质押式回购 | 684,492,734.50 | 271,595.83 | 2,936,498,660.27 | 26,276,216.71 | 12,717,951,836.43 | 5,007,397,815.40 | 5,033,945,627.94 |
| 合计 | 31,216,096,854.55 | 3,852,995.27 | 4,233,583,714.07 | 30,404,035.67 | 13,531,014,927.75 | 5,762,913,040.74 | 5,797,170,071.68 |
| 其他债权投资(注 1) | 62,019,433,363.14 | 14,218,904.04 | 30,170,126.67 | 171,979.90 | 432,246,266.95 | 258,099,736.45 | 272,490,620.39 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

22、 资产减值准备 - 续

| 金融工具类别 | 2019 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|-------------|-------------------|---------------|-------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|
| | 未来 12 个月 | | 整个存续期(未发生信用减值) | | 整个存续期(已发生信用减值) | | 合计 |
| | 原值 | 预期信用损失 | 原值 | 预期信用损失 | 原值 | 预期信用损失 | |
| 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | |
| 应收款项 | | | 1,015,171,502.45 | 4,610,145.02 | 12,791,305.58 | 3,432,995.59 | 8,043,140.61 |
| 其他资产 | 546,797,545.16 | 6,003,387.97 | - | - | 400,272,936.87 | 375,690,866.30 | 381,694,254.27 |
| 债权投资 | 7,195,006,509.14 | 1,452,280.33 | - | - | - | - | 1,452,280.33 |
| 融出资金 | 13,035,817,632.60 | 1,172,546.69 | 179,334,360.68 | 131,403.16 | 213,706,055.87 | 213,291,858.55 | 214,595,808.40 |
| 买入返售金融资产 | 8,228,675,659.68 | 4,901,396.87 | 9,910,334,723.15 | 137,022,248.35 | 7,874,629,192.02 | 1,665,173,947.34 | 1,807,097,592.56 |
| 其中：股票质押式回购 | 2,746,525,521.63 | 4,901,396.87 | 9,910,334,723.15 | 137,022,248.35 | 7,874,629,192.02 | 1,665,173,947.34 | 1,807,097,592.56 |
| 合计 | 29,006,297,346.58 | 13,529,611.86 | 11,104,840,586.28 | 141,763,796.53 | 8,501,399,490.34 | 2,257,589,667.78 | 2,412,883,076.17 |
| 其他债权投资(注 1) | 64,006,322,485.22 | 17,788,152.91 | - | - | 143,700,266.95 | 106,860,266.95 | 124,648,419.86 |

注 1：其他债权投资的预期信用损失准备在其他综合收益中确认。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

23、 短期借款

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 信用借款 | 579,732,185.45 | 640,153,529.20 |
| 合计 | 579,732,185.45 | 640,153,529.20 |

24、 应付短期融资款

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加 | 本年减少 | 2020 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 短期债券 | 7,652,733,819.93 | 22,156,785,941.90 | 24,750,516,999.62 | 5,059,002,762.21 |
| 收益凭证 | 8,460,465,739.57 | 34,696,835,196.73 | 31,960,817,912.14 | 11,196,483,024.16 |
| 合计 | 16,113,199,559.50 | 56,853,621,138.63 | 56,711,334,911.76 | 16,255,485,786.37 |

注：根据中国证监会《关于同意开展场外市场收益凭证业务试点的函》(中证协函[2014]285号)，本公司获准试点开展收益凭证业务。于 2020 年 12 月 31 日，未到期收益凭证的票面利率为 2.1%至 10.0%(于 2019 年 12 月 31 日：未到期收益凭证的票面利率为 3.1%至 8.0%)。

25、 拆入资金

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 银行拆入资金 | 8,666,963,871.43 | 4,871,391,422.22 |
| 转融通融入资金 | 1,003,150,000.00 | 1,513,267,361.11 |
| 合计 | 9,670,113,871.43 | 6,384,658,783.33 |

转融通融入资金的剩余期限和利率区间

| 剩余期限 | 2020 年 12 月 31 日 | | 2019 年 12 月 31 日 | |
|-----------|------------------|-------|------------------|-------------|
| | 人民币元 | 利率区间 | 人民币元 | 利率区间 |
| 1 至 3 个月 | 1,003,150,000.00 | 2.80% | 1,010,062,500.00 | 3.25%-3.50% |
| 3 至 12 个月 | - | - | 503,204,861.11 | 3.25%-3.50% |
| 合计 | 1,003,150,000.00 | | 1,513,267,361.11 | |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

26、 交易性金融负债

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 交易性金融负债 | | |
| 其中：借入债券(注 1) | 2,254,362,770.18 | 4,124,611,741.87 |
| 黄金借贷 | 9,906,000,000.00 | 7,514,640,000.00 |
| 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 | | |
| 其中：合并结构化主体其他份额持有人利益(注 2) | 1,262,525,977.61 | 286,059,246.99 |
| 其他(注 3) | 1,153,184,396.44 | 705,649,606.20 |
| 合计 | 14,576,073,144.23 | 12,630,960,595.06 |

注 1：系债券借贷业务借入债券后卖出产生的交易性金融负债。

注 2：系因本集团能够实施控制而纳入合并财务报表范围的结构化主体的其他份额持有人利益。

注 3：其他主要系本集团发行的结构化票据和收益凭证。收益凭证合约包含嵌入式衍生金融工具，整份合约在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益。

27、 卖出回购金融资产款

(1) 按标的物类别列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券 | 44,856,999,176.67 | 54,335,352,994.78 |
| 基金 | 4,598,388,568.61 | 3,142,709,871.15 |
| 融出资金收益权 | 3,405,495,694.45 | - |
| 合计 | 52,860,883,439.73 | 57,478,062,865.93 |

(2) 按业务类别列示

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 买断式卖出回购 | 3,507,966,964.83 | 5,810,219,123.25 |
| 质押式卖出回购 | 40,728,628,912.65 | 47,474,788,725.82 |
| 质押式报价回购 | 5,218,791,867.80 | 3,684,061,924.18 |
| 其他卖出回购 | 3,405,495,694.45 | 508,993,092.68 |
| 合计 | 52,860,883,439.73 | 57,478,062,865.93 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

27、 卖出回购金融资产款 - 续

(3) 报价回购融入资金的剩余期限和利率区间

| | 2020年12月31日 | | 2019年12月31日 | |
|--------|------------------|-------------|------------------|-------------|
| | 金额 | 利率区间 | 金额 | 利率区间 |
| | 人民币元 | | 人民币元 | |
| 1个月以内 | 1,444,467,385.55 | 2.60%-5.58% | 1,098,553,924.18 | 2.50%-6.00% |
| 1-3个月 | 1,593,389,854.55 | 2.70%-4.18% | 1,191,315,000.00 | 3.50%-4.00% |
| 3个月-1年 | 2,180,934,627.70 | 0.35%-4.10% | 1,394,193,000.00 | 3.00%-4.00% |
| 合计 | 5,218,791,867.80 | | 3,684,061,924.18 | |

(4) 作为担保物的资产账面价值

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 债券(注) | 47,041,196,091.52 | 57,206,872,458.78 |
| 其中：交易性金融资产 | 14,545,294,427.67 | 16,915,505,956.70 |
| 其他债权投资 | 24,840,196,083.16 | 33,456,044,874.91 |
| 其他权益工具投资 | 1,686,324,106.32 | 1,777,689,509.00 |
| 债权投资 | 4,842,860,944.90 | 5,057,632,118.17 |
| 买入返售金融资产 | 1,126,520,529.47 | - |
| 基金 | 5,460,045,330.30 | 3,789,506,570.13 |
| 其中：交易性金融资产 | 5,460,045,330.30 | 3,789,506,570.13 |
| 融出资金收益权 | 3,819,545,927.18 | - |
| 合计 | 56,320,787,349.00 | 60,996,379,028.91 |

注：不含通过债券借贷融入的债券。

28、 代理买卖证券款

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 普通经纪业务 | | |
| - 个人客户 | 23,834,030,040.42 | 18,681,218,993.83 |
| - 机构客户 | 39,943,348,180.57 | 19,565,316,234.70 |
| 信用业务 | | |
| - 个人客户 | 2,038,271,304.51 | 1,542,964,327.03 |
| - 机构客户 | 827,021,633.00 | 389,678,806.78 |
| 合计 | 66,642,671,158.50 | 40,179,178,362.34 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

29、 代理承销证券款

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 股票 | - | 80,000,000.00 |
| 债券 | 346,000,000.00 | - |
| 合计 | 346,000,000.00 | 80,000,000.00 |

30、 应付职工薪酬

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加 | 本年减少 | 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------|------------------|------------------|---------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 工资、奖金、津贴和补贴 | 1,588,884,316.15 | 4,337,616,720.67 | 3,414,684,304.02 | 2,511,816,732.80 |
| 职工福利费 | - | 82,865,078.61 | 82,862,198.61 | 2,880.00 |
| 社会保险费 | 161,276.40 | 111,220,239.79 | 111,078,186.08 | 303,330.11 |
| 其中：医疗保险费 | 143,721.51 | 104,255,364.72 | 104,102,584.94 | 296,501.29 |
| 工伤保险费 | 4,022.22 | 1,110,791.60 | 1,109,997.02 | 4,816.80 |
| 生育保险费 | 13,532.67 | 5,854,083.47 | 5,865,604.12 | 2,012.02 |
| 离职后福利(设定提存计划) | 11,784,269.96 | 310,709,421.71 | 228,788,735.23 | 93,704,956.44 |
| 其中：基本养老保险费 | 686,442.79 | 97,183,197.47 | 97,024,105.47 | 845,534.79 |
| 年金缴费 | 11,084,290.53 | 210,512,582.37 | 128,757,755.95 | 92,839,116.95 |
| 失业保险费 | 13,536.64 | 3,013,641.87 | 3,006,873.81 | 20,304.70 |
| 住房公积金 | 248,509.73 | 137,407,460.35 | 137,376,416.29 | 279,553.79 |
| 工会经费和职工教育经费 | - | 73,615,694.49 | 71,716,886.28 | 1,898,808.21 |
| 其他 | 7,523.51 | 9,509,350.43 | 9,514,582.54 | 2,291.40 |
| 合计 | 1,601,085,895.75 | 5,062,943,966.05 | 4,056,021,309.05 | 2,608,008,552.75 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

31、 应交税费

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 企业所得税 | 570,866,847.89 | 161,568,509.74 |
| 个人所得税 | 35,590,598.07 | 23,017,487.47 |
| 限售股个人所得税 | 9,063,190.01 | 31,442,936.10 |
| 增值税 | 121,580,568.87 | 38,943,569.07 |
| 城市维护建设税 | 10,565,425.83 | 4,292,144.81 |
| 教育费附加 | 4,529,455.49 | 1,841,769.66 |
| 其他 | 30,618,526.94 | 17,117,561.67 |
| 合计 | 782,814,613.10 | 278,223,978.52 |

32、 应付款项

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 应付手续费及佣金 | 260,589,391.70 | 337,956,182.96 |
| 应付清算款项 | 315,995,187.31 | 142,144,865.78 |
| 合计 | 576,584,579.01 | 480,101,048.74 |

33、 合同负债

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 基金管理服务 | 17,118,074.89 | 20,163,324.90 |
| 大宗商品交易 | 387,005,547.54 | 187,950,244.53 |
| 合计 | 404,123,622.43 | 208,113,569.43 |

34、 租赁负债

租赁负债的到期期限分析如下：

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 3 个月以内 | 80,978,475.15 | 87,076,540.94 |
| 3 个月-1 年 | 225,654,601.56 | 229,475,439.79 |
| 1-2 年 | 235,211,003.66 | 253,765,617.30 |
| 2-3 年 | 191,561,167.40 | 185,480,885.32 |
| 3-5 年 | 112,544,441.99 | 217,389,487.69 |
| 5 年以上 | 10,960,639.10 | 21,817,260.16 |
| 合计 | 856,910,328.86 | 995,005,231.20 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

35、 应付债券

| 债券名称 | 债券类型 | 发行日期 | 到期日期 | 发行面值 | 票面利率 | 2019 年 12 月 31 日 | 本期增加额 | 本期减少额 | 2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|------|------------|------------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|---------------------|
| | | | | | % | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2015 公司债(注 1) | 公司债 | 26/11/2015 | 26/11/2020 | 12,000,000,000.00 | 3.90 | 12,049,857,878.08 | 391,216,094.52 | 12,441,073,972.60 | - |
| 16 东方次级债(注 2) | 次级债 | 14/11/2016 | 14/11/2021 | 4,000,000,000.00 | 3.45 | 4,018,365,728.27 | 133,851,560.45 | 133,841,095.89 | 4,018,376,192.83 |
| 17 东次 01(注 3) | 次级债 | 26/04/2017 | 26/04/2020 | 1,500,000,000.00 | 4.90 | 1,550,340,217.13 | 18,326,906.16 | 1,568,667,123.29 | - |
| 17 东次 02(注 4) | 次级债 | 26/04/2017 | 26/04/2022 | 1,500,000,000.00 | 5.10 | 1,552,396,412.21 | 71,879,516.19 | 71,469,863.01 | 1,552,806,065.39 |
| 17 东次 03(注 5) | 次级债 | 15/05/2017 | 15/05/2020 | 1,500,000,000.00 | 5.15 | 1,549,100,171.85 | 25,610,102.13 | 1,574,710,273.98 | - |
| 17 东次 04(注 6) | 次级债 | 15/05/2017 | 15/05/2022 | 1,500,000,000.00 | 5.35 | 1,551,007,885.77 | 77,605,761.47 | 77,611,643.83 | 1,551,002,003.41 |
| 17 东证 01(注 7) | 公司债 | 09/06/2017 | 09/06/2020 | 4,000,000,000.00 | 5.30 | 4,121,318,463.66 | 88,358,248.67 | 4,209,676,712.33 | - |
| 17 东证 02(注 8) | 公司债 | 09/06/2017 | 09/06/2022 | 1,000,000,000.00 | 5.50 | 1,031,469,615.26 | 54,402,295.12 | 54,397,260.27 | 1,031,474,650.11 |
| 2017 公司债(注 9) | 公司债 | 03/08/2017 | 03/08/2027 | 4,000,000,000.00 | 4.98 | 4,082,954,253.41 | 183,349,560.87 | 182,281,643.83 | 4,084,022,170.45 |
| 17 海外美元债(注 10) | 海外债 | 30/11/2017 | 30/11/2022 | US\$500,000,000.00 | 3.625 | 3,465,981,646.47 | 118,822,606.13 | 334,144,032.73 | 3,250,660,219.87 |
| 18 海外美元债(注 11) | 海外债 | 22/03/2018 | 30/11/2022 | US\$250,000,000.00 | 3.625 | 1,703,037,511.49 | 69,798,489.23 | 165,816,848.66 | 1,607,019,152.06 |
| 18 次级债(注 12) | 次级债 | 12/07/2018 | 12/07/2020 | 6,400,000,000.00 | 5.18 | 6,558,039,671.23 | 165,305,863.01 | 6,723,345,534.24 | - |
| 19 东次 01(注 13) | 次级债 | 19/03/2019 | 19/03/2022 | 6,000,000,000.00 | 4.20 | 6,198,709,631.90 | 240,974,982.41 | 240,305,278.00 | 6,199,379,336.31 |
| 19 东次 02(注 14) | 次级债 | 14/06/2019 | 14/06/2022 | 4,000,000,000.00 | 4.20 | 4,092,515,068.49 | 163,402,485.62 | 162,712,561.38 | 4,093,204,992.73 |
| 19 海外美元债(注 15) | 海外债 | 20/08/2019 | 20/08/2022 | US\$300,000,000.00 | 6 个月 LIBOR+1.25 | 2,117,129,974.05 | 60,372,843.90 | 212,953,205.54 | 1,964,549,612.41 |
| 19 海外欧元债(注 16) | 海外债 | 20/08/2019 | 20/08/2022 | EU\$200,000,000.00 | 0.625 | 1,559,889,237.86 | 57,885,572.11 | 16,962,067.19 | 1,600,812,742.78 |
| 19 海外坡元债(注 17) | 海外债 | 27/09/2019 | 27/09/2022 | SG\$200,000,000.00 | 2.90 | 1,039,889,971.14 | 36,743,960.53 | 85,674,621.74 | 990,959,309.93 |
| 2019 公司债(注 18) | 公司债 | 25/11/2019 | 25/11/2022 | 4,900,000,000.00 | 3.50 | 4,917,384,931.51 | 161,132,730.41 | 160,853,807.42 | 4,917,663,854.50 |
| 20 东证 02(注 19) | 公司债 | 24/03/2020 | 24/03/2022 | 3,000,000,000.00 | 2.95 | - | 3,069,713,064.03 | 1,768,867.92 | 3,067,944,196.11 |
| 20 东证 03(注 20) | 公司债 | 18/06/2020 | 18/06/2023 | 4,000,000,000.00 | 3.45 | - | 4,077,624,946.61 | 3,839,622.64 | 4,073,785,323.97 |
| 20 东债 01(注 21) | 公司债 | 19/08/2020 | 19/08/2023 | 4,000,000,000.00 | 3.50 | - | 4,054,558,352.15 | 2,924,528.30 | 4,051,633,823.85 |
| 20 东债 02(注 22) | 公司债 | 28/09/2020 | 28/09/2023 | 3,500,000,000.00 | 3.75 | - | 3,536,811,902.29 | 2,650,943.39 | 3,534,160,958.90 |
| 20 海外美元债(注 23) | 海外债 | 13/10/2020 | 13/10/2023 | US\$160,000,000.00 | 2.40 | - | 1,042,492,161.46 | - | 1,042,492,161.46 |
| 20 东债 03(注 24) | 公司债 | 04/11/2020 | 04/11/2023 | 3,500,000,000.00 | 3.65 | - | 3,522,958,851.77 | 3,113,207.54 | 3,519,845,644.23 |
| 长期收益凭证(注 25) | | | | 5,950,000,000.00 | | 4,149,810,499.62 | 2,040,720,723.76 | 76,850,137.00 | 6,113,681,086.38 |
| 合计 | | | | | | 67,309,198,769.40 | 23,463,919,581.00 | 28,507,644,852.72 | 62,265,473,497.68 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

35、 应付债券 - 续

注 1：公司于 2015 年 11 月 2 日收到中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司向公众投资者公开发行公司债券的批复》(证监许可[2015]2406 号)文件。根据该批复，中国证监会核准公司向公众投资者公开发行面值不超过人民币 120 亿元的公司债券，公司债券采用分期发行方式，首期发行自中国证监会核准发行之日起 12 个月内完成，该批复有效期为 24 个月。2015 年 11 月 26 日，公司成功发行了 2015 年公司债券，规模为人民币 120 亿元，债券期限为 5 年期，债券发行利率为 3.90%。

注 2：2016 年 11 月 14 日，根据 2015 年度股东大会审议通过的《关于公司发行次级债券(含永续次级债券)的议案》，以及上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司成功发行了 2016 年第一期次级债券，规模为人民币 40 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 3.45%。

注 3：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司于 2017 年 4 月 26 日成功发行了 2017 年第一期次级债券(品种一简称“17 东次 01”)，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 3 年，债券发行利率为 4.90%。

注 4：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司于 2017 年 4 月 26 日成功发行了 2017 年第一期次级债券(品种二简称“17 东次 02”)，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 5.10%。

注 5：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司于 2017 年 5 月 15 日成功发行了 2017 年第二期次级债券(品种一简称“17 东次 03”)，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 3 年，债券发行利率为 5.15%。

注 6：根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司 2016 年次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2016]2057 号)，公司于 2017 年 5 月 15 日成功发行了 2017 年第二期次级债券(品种二简称“17 东次 04”)，规模为人民币 15 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 5.35%。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

35、 应付债券 - 续

注 7： 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2017]491 号)，公司于 2017 年 6 月 9 日成功发行了 2017 年第一期非公开发行公司债券(品种一简称“17 东证 01”)，规模为人民币 40 亿元，债券期限为 3 年，债券发行利率为 5.30%。

注 8： 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2017]491 号)，公司于 2017 年 6 月 9 日成功发行了 2017 年第一期非公开发行公司债券(品种二简称“17 东证 02”)，规模为人民币 10 亿元，债券期限为 5 年，债券发行利率为 5.50%。

注 9： 经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]974 号文核准，公司获准面向合格投资者公开发行面值不超过人民币 40 亿元的公司债券。2017 年 8 月 3 日，公司实际发行规模为人民币 40 亿元，债券期限为 10 年期，债券发行利率为 4.98%。

注 10： 海外美元债以 Orient HuiZhi Limited 为发行主体，公司提供担保。2017 年 11 月 30 日，Orient HuiZhi Limited 向符合条件的投资者发行 5 亿美元海外债，到期日为 2022 年 11 月 30 日，债券发行利率为 3.625%。

注 11： 海外美元债以 Orient HuiZhi Limited 为发行主体，东方证券股份有限公司提供担保。2018 年 3 月 22 日，公司向符合条件的投资者发行 2.5 亿美元海外债，到期日为 2022 年 11 月 30 日，债券发行利率为 3.625%。

注 12： 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2018]205 号)，公司于 2018 年 7 月 12 日成功发行了 2018 年第一期次级债券(品种二简称“18 东次 01”)，规模为人民币 64 亿元，债券期限为 2 年，债券发行利率为 5.18%。

注 13： 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2019]306 号)，公司于 2019 年 3 月 19 日成功发行了东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)(简称“19 东次 01”)，规模为人民币 60 亿元，期限 3 年，最终票面利率 4.20%。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

35、 应付债券 - 续

注 14: 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行次级债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2019]306 号), 公司于 2019 年 6 月 14 日成功发行了东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第二期)(简称“19 东次 02”), 规模为人民币 40 亿元, 期限 3 年, 最终票面利率 4.20%。

注 15: 2019 年 8 月 20 日, 公司向符合条件的投资者发行 3 亿美元海外债, 债券期限为 3 年期, 债券利率为 6 个月 LIBOR 加上 1.25%。

注 16: 2019 年 8 月 20 日, 公司向符合条件的投资者发行 2 亿欧元海外债, 债券期限为 3 年期, 债券利率为 0.625%。

注 17: 2019 年 9 月 27 日, 公司向符合条件的投资者发行 2 亿新加坡元海外债, 债券期限为 3 年期, 债券利率为 2.90%。

注 18: 经中国证券监督管理委员会“证监许可〔2019〕900 号”批复核准, 东方证券股份有限公司(以下简称“发行人”)获准向合格投资者公开发行总额不超过人民币 49 亿元(含 49 亿元)的公司债券。2019 年 11 月 25 日, 公司实际发行规模为人民币 49 亿元, 债券期限为 3 年期, 债券发行利率为 3.50%。

注 19: 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2020]160 号), 公司于 2020 年 3 月 24 日成功发行了 2020 年第一期非公开发行公司债券(品种二简称“20 东证 02”), 规模为人民币 30 亿元, 债券期限为 2 年, 债券发行利率为 2.95%。

注 20: 根据上海证券交易所《关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函》(上证函[2020]160 号), 公司于 2020 年 6 月 18 日成功发行了 2020 年第二期非公开发行公司债券(品种一简称“20 东证 03”), 规模为人民币 40 亿元, 债券期限为 3 年, 债券发行利率为 3.45%。

注 21: 经中国证券监督管理委员会“证监许可〔2020〕1329 号”批复核准, 东方证券股份有限公司(以下简称“发行人”)获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元(含 200 亿元)的公司债券。2020 年 8 月 19 日, 公司实际发行规模为人民币 40 亿元, 债券期限为 3 年期, 债券发行利率为 3.50%。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

35、 应付债券 - 续

注 22：经中国证券监督管理委员会“证监许可〔2020〕1329 号”文件注册，东方证券股份有限公司（以下简称“发行人”）获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元（含 200 亿元）的公司债券。2020 年 9 月 28 日，公司实际发行规模为人民币 35 亿元，债券期限为 3 年期，债券发行利率为 3.75%。

注 23：海外美元债以 Orient HuiZhi Limited 为发行主体，东方证券股份有限公司提供担保。2020 年 10 月 13 日，公司向符合条件的投资者发行 1.6 亿美元海外债，到期日为 2023 年 10 月 13 日，债券发行利率为 2.40%。

注 24：经中国证券监督管理委员会“证监许可〔2020〕1329 号”文件注册，东方证券股份有限公司（以下简称“发行人”）获准向专业投资者公开发行总额不超过人民币 200 亿元（含 200 亿元）的公司债券。2020 年 11 月 4 日，公司实际发行规模为人民币 35 亿元，债券期限为 3 年期，债券发行利率为 3.65%。

注 25：长期收益凭证为本集团发行的期限大于一年的收益凭证。于 2020 年 12 月 31 日，未到期长期收益凭证的票面利率为 3.20%至 4.25%（于 2019 年 12 月 31 日：未到期长期收益凭证的票面利率为 4.00%至 4.25%）。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

36、 其他负债

| | | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-----|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 其他应付款 | (1) | 1,923,550,764.14 | 1,911,615,247.40 |
| 代理兑付证券款 | | 802,403.76 | 802,403.76 |
| 预提费用 | | 11,853,524.14 | 6,958,945.84 |
| 应付股利 | | 80,000.00 | 80,000.00 |
| 合计 | | 1,936,286,692.04 | 1,919,456,597.00 |

(1) 其他应付款

| | | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 证券投资者保护基金 | ① | 34,601,932.62 | 24,244,075.86 |
| 期货风险准备金 | ② | 106,004,794.44 | 82,066,683.38 |
| 履约保证金 | | 775,057,149.97 | 205,949,586.00 |
| 购买子公司少数股东股权款项 | ③ | - | 475,583,890.59 |
| 其他应付款项 | | 1,007,886,887.11 | 1,123,771,011.57 |
| 合计 | | 1,923,550,764.14 | 1,911,615,247.40 |

① 证券投资者保护基金系公司根据中国证监会证监发[2007]50 号文《关于印发〈证券公司缴纳证券投资者保护基金实施办法(试行)〉的通知》、中国证监会机构部部函[2007]268 号文《关于发布实施〈证券公司分类监管工作指引(试行)〉的通知》按营业收入的一定比例计提，2020 年和 2019 年计提比例均为 0.5%。

② 依据《期货公司监督管理办法》(证监会令[2007]第 43 号)和《商品期货交易财务管理暂行规定》(财商字[1997]44 号)的有关规定，本公司按代理手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5%提取期货风险准备金。

③ 2019 年 5 月 30 日，本公司和花旗环球金融亚洲有限公司(以下简称“花旗亚洲”)分别作为受让人和让与人签订了股权转让协议，本公司向花旗亚洲支付 4.76 亿元人民币，并受让其持有的 33.33%东方花旗证券有限公司(以下简称“东方花旗”)的股权。2020 年 3 月 11 日，上海证监局批准花旗亚洲向本公司转让东方花旗的 33.33%股权，以及变更东方花旗公司章程的主要条款(上海证监局[2019]465 号)。截至 2020 年 12 月 31 日，本公司已办理该子公司的工商登记变更并已支付对价。本次交易完成后，支付的对价与少数股东权益之间的差额 11,928,038.45 元已计入资本公积。此外，截至 2020 年 12 月 31 日，东方花旗已更名为东方证券承销保荐有限公司，并成为本集团的全资子公司。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

37、 股本

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年变动 | | | | | 2020 年 12 月 31 日 |
|------|---------------------|----------|----------|-----------|----------|----------|---------------------|
| | | 发行 新股 | 送股 | 公积金 转股 | 其他 | 小计 | |
| | 人民币元 | 人民币 元 | 人民币 元 | 人民币 元 | 人民币 元 | 人民币 元 | 人民币元 |
| 股份总数 | 6,993,655,803.00 | - | - | - | - | - | 6,993,655,803.00 |

38、 其他权益工具

| 发行在外的金融工具 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------------|---------------------|---------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 公司 2020 年永续次级债券(第一期) | 5,000,000,000.00 | - |

注1：中国证监会于2020年7月2日下发《关于东方证券股份有限公司发行永续次级债券有关意见的复函》(机构部函[2020]1577号)，对本公司公开发行永续次级债券事项无异议。本公司于2020年8月26日完成2020年公开永续次级债券（第一期）的发行，发行规模为人民币50亿元。

注2：本次永续次级债券无担保，以每5个计息年度为一个周期。在每一个重定价周期到期日，本公司有权选择将债券的期限延长至下一个重定价周期，或完全赎回债券。首个周期的票面利率为初始基准利率加上初始利差；后续周期的票面利率调整为当期基准利率加上初始利差再加300个基点，当期基准利率为票面利率重置日前5个工作日中国债券信息网上公布的中债国债收益率曲线中，待偿期为5年的国债收益率算术平均值。本期债券附设发行人递延支付利息权，除非发生强制付息事件，本期债券的每个付息日，发行人可自行选择将当期利息以及按照本条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于发行人未能按照约定足额支付利息的行为。强制性支付利息事件仅限于付息日前12个月内发行人向普通股股东分红和减少注册资本的情形。

39、 资本公积

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加 | 本年减少 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|---------------|------|---------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 股本溢价 | 28,251,704,604.61 | - | - | 28,251,704,604.61 |
| 其他资本公积 | 3,225,387.02 | 56,473,663.77 | - | 59,699,050.79 |
| 合计 | 28,254,929,991.63 | 56,473,663.77 | - | 28,311,403,655.40 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

40、 其他综合收益

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年变动 | | | | | 税后归属于 少数股东 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------------|---------------------|------------------|------------------|----------------------------|----------------------------------|------------------|---------------|---------------------|
| | | 本年所得税前 发生额 | 减：所得税 费用 | 减：前期计入 其他综合收益 当期转入损益 | 减：前期计入其 他综合收益当 期转入留存收 益 | 税后归属于 母公司股东 | | |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一、以后不能重分类进损益的其他综合收益 | | | | | | | | |
| 其中：权益法下在被投资单位以后不可重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资公允价值变动损益 | (200,232,319.70) | (64,467,929.91) | (16,116,982.48) | - | (28,712,812.04) | (19,638,135.39) | - | (219,870,455.09) |
| 二、以后将重分类进损益的其他综合收益 | | | | | | | | |
| 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 | 13,285,631.83 | (9,681,676.27) | - | - | - | (9,681,676.27) | - | 3,603,955.56 |
| 其他债权投资公允价值变动损益 | 559,155,504.81 | (218,061,822.43) | (145,353,878.25) | 363,353,690.57 | - | (436,061,634.75) | - | 123,093,870.06 |
| 其他债权投资信用减值准备 | 93,486,314.88 | 147,842,200.53 | 36,960,550.12 | - | - | 110,881,650.41 | - | 204,367,965.29 |
| 外币财务报表折算差额 | 1,062,633.79 | (109,866,649.82) | - | - | - | (109,866,649.82) | - | (108,804,016.03) |
| 其他 | 33,203,015.80 | - | - | - | - | - | - | 33,203,015.80 |
| 合计 | 499,960,781.41 | (254,235,877.90) | (124,510,310.61) | 363,353,690.57 | (28,712,812.04) | (464,366,445.82) | - | 35,594,335.59 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

41、 盈余公积

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加 | 本年减少 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------|----------------|------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 法定盈余公积 | 2,671,560,199.47 | 153,639,300.82 | - | 2,825,199,500.29 |
| 任意盈余公积 | 774,129,230.22 | 76,819,650.41 | - | 850,948,880.63 |
| 合计 | 3,445,689,429.69 | 230,458,951.23 | - | 3,676,148,380.92 |

根据《中华人民共和国公司法》及本公司章程的规定，法定盈余公积金按照本公司当期净利润的 10% 提取，当法定盈余公积累计额达到本公司注册资本的 50% 以上时，可不再提取。

42、 一般风险准备

| | 2019 年 12 月 31 日 | 本年增加 | 本年减少 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------|----------------|------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一般风险准备 | 3,661,478,438.64 | 450,844,150.62 | - | 4,112,322,589.26 |
| 交易风险准备 | 4,336,197,814.80 | 242,576,786.06 | - | 4,578,774,600.86 |
| 合计 | 7,997,676,253.44 | 693,420,936.68 | - | 8,691,097,190.12 |

本集团的一般风险准备金包括了本公司及子公司的一般风险准备金和交易风险准备金。

根据《金融企业财务规则》要求，一般风险准备金按公司年度净利润之 10% 提取。2019 年，公司选择按照净利润之 11% 提取一般风险准备金。自 2020 年起，公司按照净利润之 10% 提取一般风险准备金。

根据《证券法》等法律法规的规定，交易风险准备金按本公司净利润之 10% 提取。

根据《关于修改〈关于基金管理公司提取风险准备金有关问题的通知〉的决定》(证监会公告[2008]46 号)以及《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》(中国证监会公告[2018]39 号)的规定，本公司之子公司上海东方证券资产管理有限公司分别按基金管理费收入之 10% 与大集合资产管理业务管理费收入之 10% 计提一般风险准备金。

本公司之子公司亦按照相关法律法规的规定，计提相应的其他风险准备金和交易风险准备金。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

43、 未分配利润

| | 本年 | 上年 | 提取或分配比例 |
|-------------------|------------------|------------------|---------|
| | 人民币元 | 人民币元 | |
| 年初未分配利润 | 6,773,604,053.96 | 6,542,724,243.23 | |
| 加：本年归属于母公司所有者的净利润 | 2,722,988,518.72 | 2,435,079,764.10 | |
| 减：提取法定盈余公积 | 153,639,300.82 | 240,207,299.62 | 详见附注 41 |
| 提取任意盈余公积 | 76,819,650.41 | 120,103,649.81 | 详见附注 41 |
| 提取一般风险准备 | 450,844,150.62 | 543,132,532.45 | 详见附注 42 |
| 提取交易风险准备 | 242,576,786.06 | 392,938,591.32 | 详见附注 42 |
| 应付普通股股利(注 1) | 1,049,048,370.45 | 699,365,580.30 | |
| 其他综合收益结转留存收益 | (28,712,812.04) | (208,452,299.87) | |
| 年末未分配利润 | 7,494,951,502.28 | 6,773,604,053.96 | |

注 1：2020 年 5 月 15 日，本公司 2019 年度股东大会审议通过以公司总股本 6,993,655,803.0 股为基数，向公司股权登记日登记在册的全体股东每 10 股派发现金股利 1.50 元(含税)，共计分配现金股利人民币 1,049,048,370.45 元。

2019 年 5 月 28 日，本公司 2018 年度股东大会审议通过以公司总股本 6,993,655,803.0 股为基数，向公司股权登记日登记在册的全体股东每 10 股派发现金股利 1.00 元(含税)，共计分配现金股利人民币 699,365,580.30 元。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

44、 手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入按类别列示

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 手续费及佣金收入 | | |
| 1. 经纪业务收入 | 3,196,837,892.09 | 1,908,284,099.80 |
| 其中：证券经纪业务收入 | 2,704,131,286.92 | 1,641,044,937.05 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 1,667,375,703.87 | 1,112,351,053.62 |
| 交易单元席位租赁 | 646,445,430.98 | 421,867,470.79 |
| 代销金融产品业务 | 390,310,152.07 | 106,826,412.64 |
| 期货经纪业务收入 | 492,706,605.17 | 267,239,162.75 |
| 2. 投资银行业务收入 | 1,638,703,656.06 | 1,088,168,019.22 |
| 其中：证券承销业务 | 1,481,898,723.35 | 906,389,869.36 |
| 证券保荐业务 | 30,010,196.41 | 30,832,922.30 |
| 财务顾问业务 | 126,794,736.30 | 150,945,227.56 |
| 3. 资产管理业务收入 | 2,508,599,346.63 | 1,824,144,379.54 |
| 4. 私募基金管理业务收入 | 283,842,270.78 | 115,011,428.96 |
| 5. 投资咨询业务收入 | 173,357,524.25 | 84,276,409.81 |
| 6. 其他 | 152,517,028.57 | 30,789,316.79 |
| 手续费及佣金收入小计 | 7,953,857,718.38 | 5,050,673,654.12 |
| 手续费及佣金支出 | | |
| 1. 经纪业务支出 | 576,235,646.06 | 362,693,785.97 |
| 其中：证券经纪业务支出 | 573,612,850.32 | 361,585,880.97 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 573,612,850.32 | 361,585,880.97 |
| 期货经纪业务支出 | 2,622,795.74 | 1,107,905.00 |
| 2. 投资银行业务支出 | 56,907,972.57 | 38,156,130.63 |
| 其中：证券承销业务 | 55,923,632.95 | 25,272,239.12 |
| 财务顾问业务 | 984,339.62 | 12,883,891.51 |
| 3. 资产管理业务支出 | 43,121,655.98 | 23,914,554.23 |
| 4. 其他 | 156,061,943.67 | 110,246,653.67 |
| 手续费及佣金支出小计 | 832,327,218.28 | 535,011,124.50 |
| 手续费及佣金净收入 | 7,121,530,500.10 | 4,515,662,529.62 |

(2) 财务顾问业务净收入明细如下：

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|------------------------|----------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 并购重组财务顾问业务净收入 - 境内上市公司 | 25,945,046.77 | 46,603,773.59 |
| 其他财务顾问业务净收入 | 99,865,349.91 | 91,457,562.46 |
| 合计 | 125,810,396.68 | 138,061,336.05 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

45、 利息净收入

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|---------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 利息收入 | | |
| 其中：存放金融同业利息收入 | 984,975,407.36 | 956,943,063.09 |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 330,030,066.36 | 347,062,593.17 |
| 客户资金存款利息收入 | 654,945,341.00 | 609,880,469.92 |
| 融出资金利息收入 | 1,099,363,138.37 | 799,806,076.49 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 660,905,770.97 | 1,331,674,108.07 |
| 其中：股票质押回购利息收入 | 598,443,036.60 | 1,257,964,967.39 |
| 债权投资利息收入 | 247,485,791.72 | 297,409,052.48 |
| 其他债权投资利息收入 | 2,535,829,069.23 | 2,673,743,330.08 |
| 贷款和委托贷款利息收入 | 7,427,512.43 | 24,588,987.72 |
| 其他 | 2,196,768.57 | 1,930,289.61 |
| 小计 | 5,538,183,458.65 | 6,086,094,907.54 |
| 利息支出 | | |
| 其中：客户资金存款利息支出 | 93,802,085.77 | 73,732,003.63 |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 1,295,451,817.10 | 1,655,921,375.60 |
| 其中：报价式回购利息支出 | 160,308,006.06 | 107,561,055.75 |
| 拆入资金利息支出 | 117,243,841.29 | 180,651,405.94 |
| 其中：转融通利息支出 | 35,761,805.56 | 64,363,194.57 |
| 借款利息支出 | 42,175,555.55 | 57,111,350.00 |
| 短期融资券利息支出 | 507,051,640.44 | 456,391,803.60 |
| 债券利息支出 | 2,668,708,943.48 | 2,736,923,510.35 |
| 租赁负债利息支出 | 34,976,956.11 | 34,741,462.55 |
| 小计 | 4,759,410,839.74 | 5,195,472,911.67 |
| 利息净收入 | 778,772,618.91 | 890,621,995.87 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

46、 投资收益

投资收益明细情况

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-------------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 权益法核算的长期股权投资收益 | 1,212,458,017.28 | 591,070,224.75 |
| 处置联营企业产生的投资收益 | 2,937,541.47 | - |
| 金融工具投资收益 | 3,796,233,748.39 | 2,823,651,660.44 |
| 其中：持有期间取得的收益/(损失) | 2,048,245,787.41 | 2,031,188,968.96 |
| - 交易性金融资产 | 1,853,321,646.62 | 1,541,555,701.73 |
| - 其他权益工具投资 | 284,614,545.85 | 541,864,709.44 |
| - 交易性金融负债 | (89,690,405.06) | (52,231,442.21) |
| 处置金融工具取得的收益/(损失) | 1,747,987,960.98 | 792,462,691.48 |
| - 交易性金融资产 | 2,209,194,899.66 | 1,020,978,399.70 |
| - 其他债权投资 | 363,353,690.57 | 65,571,975.78 |
| - 债权投资 | 859,420.43 | - |
| - 衍生金融工具 | (813,615,723.55) | (318,963,838.93) |
| - 交易性金融负债 | (11,804,326.13) | 24,876,154.93 |
| 合计 | 5,011,629,307.14 | 3,414,721,885.19 |

47、 公允价值变动收益

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|---------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 交易性金融资产 | 1,363,919,737.85 | 1,387,528,762.98 |
| 交易性金融负债 | 327,009,468.43 | (423,838,336.51) |
| 衍生金融工具 | (315,035,880.01) | (26,980,356.89) |
| 合计 | 1,375,893,326.27 | 936,710,069.58 |

48、 其他业务收入及成本

| | 本年发生额 | | 上年发生额 | |
|-----------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | | 人民币元 | |
| | 其他业务收入 | 其他业务成本 | 其他业务收入 | 其他业务成本 |
| 租赁业务 | 5,853,273.25 | 2,663,884.16 | 9,246,509.94 | 5,590,343.02 |
| 咨询服务 | 15,783,798.26 | - | 5,179,245.14 | - |
| 大宗商品交易及其他 | 8,599,189,845.68 | 8,647,133,964.65 | 9,244,211,740.76 | 9,237,851,025.84 |
| 合计 | 8,620,826,917.19 | 8,649,797,848.81 | 9,258,637,495.84 | 9,243,441,368.86 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

49、 税金及附加

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-------|---------------|---------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 城建税 | 45,011,587.41 | 30,979,647.87 |
| 教育费附加 | 19,299,252.29 | 13,279,650.87 |
| 其他 | 32,632,567.18 | 27,079,251.34 |
| 合计 | 96,943,406.88 | 71,338,550.08 |

50、 业务及管理费

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|--------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 职工薪酬 | 5,062,943,966.05 | 3,654,584,255.57 |
| 产品代销费用 | 660,121,147.69 | 549,816,156.41 |
| 租赁费 | 39,620,842.07 | 44,387,684.50 |
| 咨询费 | 107,620,953.51 | 112,144,060.36 |
| 证券及期货投资者保护基金 | 65,061,287.23 | 46,738,788.16 |
| 电子设备运转费 | 308,505,597.57 | 199,995,421.60 |
| 通讯费 | 190,649,356.01 | 129,461,726.14 |
| 差旅费 | 79,275,509.06 | 109,006,815.11 |
| 折旧和摊销 | 659,524,737.86 | 548,944,460.02 |
| 业务招待费 | 102,881,625.70 | 92,980,356.84 |
| 其他 | 529,075,504.15 | 453,365,807.94 |
| 合计 | 7,805,280,526.90 | 5,941,425,532.65 |

51、 信用减值损失

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|--------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 坏账损失 | 35,358,012.85 | 43,750,196.56 |
| 其他债权投资减值损失 | 147,842,200.53 | 21,695,897.08 |
| 买入返售金融资产减值损失 | 3,696,273,987.63 | 973,352,390.25 |
| 融出资金减值损失 | 6,445,686.08 | 6,148,629.69 |
| 债权投资减值损失 | (787,445.93) | (489,063.12) |
| 合计 | 3,885,132,441.16 | 1,044,458,050.46 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

52、 营业外收入

(1) 营业外收入明细如下：

| | 本年发生额 | 上年发生额 | 计入本年 非经常性损益的金额 |
|------|----------------|----------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 政府补助 | 129,627,312.76 | 154,765,462.96 | 129,627,312.76 |
| 其他 | 4,131,951.01 | 4,243,624.79 | 4,131,951.01 |
| 合计 | 133,759,263.77 | 159,009,087.75 | 133,759,263.77 |

(2) 政府补助明细

| 项目 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|----------|----------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 金融企业扶持资金 | 119,252,309.00 | 144,654,582.70 |
| 财政局奖励 | 87,000.00 | 1,335,070.00 |
| 其他 | 10,288,003.76 | 8,775,810.26 |
| 合计 | 129,627,312.76 | 154,765,462.96 |

53、 营业外支出

| | 本年发生额 | 上年发生额 | 计入本年 非经常性损益的金额 |
|-------|---------------|---------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 捐赠支出 | 35,116,943.19 | 35,448,644.05 | 35,116,943.19 |
| 赔偿款支出 | 3,962,550.00 | 18,320,000.00 | 3,962,550.00 |
| 其他 | 5,108,530.26 | 2,143,546.60 | 5,108,530.26 |
| 合计 | 44,188,023.45 | 55,912,190.65 | 44,188,023.45 |

54、 所得税费用

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------|------------------|-----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 当期所得税费用 | 652,460,211.67 | 324,735,322.88 |
| 递延所得税费用 | (579,131,696.19) | (46,101,320.74) |
| 以前年度所得税调整 | (8,728,526.14) | 97,157,850.40 |
| 合计 | 64,599,989.34 | 375,791,852.54 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

54、 所得税费用 - 续

所得税费用与会计利润的调节表如下：

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|------------------------------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 会计利润 | 2,786,363,781.86 | 2,854,530,708.80 |
| 按 25% 的税率计算的所得税费用 | 696,590,945.47 | 713,632,677.20 |
| 子公司适用不同税率的影响 | 105,141.08 | (4,601,740.08) |
| 非应纳税收入的纳税影响 | (745,806,151.39) | (545,996,901.80) |
| 不可抵扣支出的纳税影响 | 74,823,867.16 | 68,565,469.18 |
| 利用以前年度未确认递延所得税资产的可抵扣亏损及可抵扣暂时性差异的影响 | (983,875.32) | (401,462.60) |
| 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 | 74,334,412.63 | 62,253,479.89 |
| 在其他地区的子公司税率不一致的影响 | (4,913,906.34) | (14,817,519.65) |
| 以前年度所得税调整 | (8,728,526.14) | 97,157,850.40 |
| 其他 | (20,821,917.81) | - |
| 合计 | 64,599,989.34 | 375,791,852.54 |

55、 每股收益

计算基本每股收益时，归属于普通股股东的当年净利润为：

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 归属于母公司所有者的当年净利润 | 2,722,988,518.72 | 2,435,079,764.10 |
| 减：归属于其他权益工具持有者的净利润的影响 | 83,287,671.23 | - |
| 归属于本公司普通股股东的当年净利润 | 2,639,700,847.49 | 2,435,079,764.10 |

计算基本每股收益时，发行在外普通股加权平均数为：

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------------|---------------|---------------|
| | 股数 | 股数 |
| 年末发行在外普通股的加权平均数 | 6,993,655,803 | 6,993,655,803 |

每股收益：

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|---------------------|-------|-------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 按归属于母公司普通股股东的净利润计算： | | |
| 基本每股收益 | 0.38 | 0.35 |

本公司 2020 年度和 2019 年度不存在稀释性潜在普通股。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

56、 现金流量表项目注释

(1) 收到其他与经营活动有关的现金

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------|------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 收到政府补助补贴款 | 129,627,312.76 | 154,765,462.96 |
| 收到的其他业务收入 | 8,620,826,917.19 | 9,258,637,495.84 |
| 收到的其他收益 | 17,528,470.48 | 23,767,187.04 |
| 其他 | 958,379,556.54 | 598,172,758.39 |
| 合计 | 9,726,362,256.97 | 10,035,342,904.23 |

(2) 支付其他与经营活动有关的现金

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-------------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 支付的其他业务及管理费 | 2,082,811,822.99 | 1,737,896,817.06 |
| 支付的其他业务成本 | 8,647,133,964.65 | 9,237,851,025.84 |
| 营业外支出支付的现金 | 43,842,916.79 | 53,838,632.51 |
| 支付的存出保证金净额 | 540,195,346.30 | 617,529,035.48 |
| 其他 | 389,266,218.52 | 790,126,298.93 |
| 合计 | 11,703,250,269.25 | 12,437,241,809.82 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

57、 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------------------|--------------------|--------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 1.将净利润调节为经营活动现金流量: | | |
| 净利润 | 2,721,763,792.52 | 2,478,738,856.26 |
| 加: 信用减值损失 | 3,885,132,441.16 | 1,044,458,050.46 |
| 固定资产、使用权资产和投资性房地产折旧 | 506,317,616.22 | 443,973,974.32 |
| 无形资产摊销 | 97,335,805.49 | 70,864,222.58 |
| 长期待摊费用摊销 | 58,535,200.31 | 39,696,606.14 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失 | 228,799.94 | 1,644,144.51 |
| 公允价值变动收益 | (1,375,893,326.27) | (936,710,069.58) |
| 利息收入 | (2,783,314,860.95) | (2,971,152,382.56) |
| 利息支出 | 3,252,913,095.58 | 3,285,168,126.50 |
| 汇兑收益 | (208,302,301.95) | (12,163,513.10) |
| 投资收益 | (2,252,581,556.65) | (1,367,877,145.95) |
| 递延所得税资产增加 | (579,988,910.33) | (28,800,383.93) |
| 递延所得税负债增加 | 1,148,137.66 | 19,031,249.53 |
| 交易性金融资产的增加 | (1,837,195,466.41) | (8,113,776,613.71) |
| 交易性金融负债的增加 | 1,772,165,957.60 | 5,372,741,150.97 |
| 经营性应收项目的增加 | (2,854,125,330.49) | (1,136,178,668.69) |
| 经营性应付项目的增加 | 27,791,501,119.31 | 12,195,376,323.02 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 28,195,640,212.74 | 10,385,033,926.77 |
| 2. 现金及现金等价物净变动情况: | | |
| 现金的年末余额 | 86,853,417,188.80 | 61,940,172,286.80 |
| 减: 现金的年初余额 | 61,940,172,286.80 | 46,079,670,480.45 |
| 加: 现金等价物的年末余额 | - | - |
| 减: 现金等价物的年初余额 | - | - |
| 现金及现金等价物净增加额 | 24,913,244,902.00 | 15,860,501,806.35 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

七、 合并财务报表项目附注 - 续

57、 现金流量表补充资料 - 续

(2) 现金及现金等价物的构成

| | 年末余额 | 年初余额 |
|----------------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 一、现金 | 86,853,417,188.80 | 61,940,172,286.80 |
| 其中：库存现金 | 287,629.71 | 351,542.25 |
| 可随时用于支付的银行存款 | 65,218,993,482.26 | 48,637,010,225.23 |
| 可随时用于支付的其他货币资金 | 232,695,864.91 | 261,814,103.75 |
| 可随时用于支付的结算备付金 | 21,401,440,211.92 | 13,040,996,415.57 |
| 二、现金等价物 | - | - |
| 三、现金及现金等价物余额 | 86,853,417,188.80 | 61,940,172,286.80 |

八、 母公司财务报表项目注释

1、 长期股权投资

(1) 按类别列示

| | 年末余额 | 年初余额 |
|------|-------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 子公司 | 15,773,303,729.53 | 13,985,793,300.00 |
| 联营企业 | 2,585,810,107.82 | 2,066,501,987.16 |
| 合计 | 18,359,113,837.35 | 16,052,295,287.16 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

八、 母公司财务报表项目注释 - 续

1、 长期股权投资 - 续

(2) 对子公司投资

| 被投资单位 | 年初余额 | 本年增加 | 本年减少 | 本年计提减值准备 | 年末余额 |
|----------------|-------------------|------------------|------|----------|-------------------|
| 上海东证期货有限公司 | 2,312,420,000.00 | - | - | - | 2,312,420,000.00 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | 300,000,000.00 | - | - | - | 300,000,000.00 |
| 上海东方证券资本投资有限公司 | 4,000,000,000.00 | - | - | - | 4,000,000,000.00 |
| 东方金融控股(香港)有限公司 | 1,840,040,000.00 | 500,000,000.00 | - | - | 2,340,040,000.00 |
| 东方证券承销保荐有限公司 | 533,333,300.00 | 487,510,429.53 | - | - | 1,020,843,729.53 |
| 上海东方证券创新投资有限公司 | 5,000,000,000.00 | 800,000,000.00 | - | - | 5,800,000,000.00 |
| 合计 | 13,985,793,300.00 | 1,787,510,429.53 | - | - | 15,773,303,729.53 |

(3) 对联营企业投资

| 被投资单位 | 年初余额 | 本年增减变动 | | | | | | | | 年末余额 | 减值准备 年末余额 |
|-------------------|------------------|----------|----------|-----------------|----------------|------------|------------------|------------|----|------------------|--------------|
| | | 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 | | |
| 汇添富基金管理 股份有限公司 | 2,066,501,987.16 | - | - | 905,857,438.59 | (8,357,018.46) | - | (378,192,299.47) | - | - | 2,585,810,107.82 | - |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

八、 母公司财务报表项目注释 - 续

2、 手续费及佣金净收入

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 手续费及佣金收入： | | |
| 1.经纪业务收入 | 2,663,178,959.60 | 1,612,239,985.37 |
| 其中：证券经纪业务收入 | 2,663,178,959.60 | 1,612,239,985.37 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 1,626,775,710.60 | 1,084,784,263.00 |
| 交易单元席位租赁 | 646,445,430.98 | 421,867,470.79 |
| 代销金融产品业务 | 389,957,818.02 | 105,588,251.58 |
| 2.投资银行业务收入 | 642,459,140.99 | 371,690,526.40 |
| 其中：证券承销业务 | 642,459,140.99 | 367,195,479.23 |
| 财务顾问业务 | - | 4,495,047.17 |
| 3.投资咨询业务收入 | 47,450,885.14 | 71,933,546.61 |
| 4.其他 | 73,507,150.67 | 30,782,931.94 |
| 手续费及佣金收入小计 | 3,426,596,136.40 | 2,086,646,990.32 |
| 手续费及佣金支出： | | |
| 1.经纪业务支出 | 564,040,857.66 | 347,561,643.78 |
| 其中：证券经纪业务支出 | 564,040,857.66 | 347,561,643.78 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 564,040,857.66 | 347,561,643.78 |
| 2.投资银行业务支出 | 50,760,028.08 | 36,712,252.18 |
| 其中：证券承销业务 | 49,775,688.46 | 23,828,360.67 |
| 财务顾问业务 | 984,339.62 | 12,883,891.51 |
| 3.其他 | 155,166,624.49 | 110,246,653.67 |
| 手续费及佣金支出小计 | 769,967,510.23 | 494,520,549.63 |
| 手续费及佣金净收入 | 2,656,628,626.17 | 1,592,126,440.69 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

八、 母公司财务报表项目注释 - 续

3、 利息净收入

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|---------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 利息收入 | | |
| 其中：存放金融同业利息收入 | 619,793,659.37 | 537,343,519.67 |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 193,546,698.62 | 196,068,336.62 |
| 客户资金存款利息收入 | 426,246,960.75 | 341,275,183.05 |
| 融出资金利息收入 | 1,046,809,889.91 | 770,951,210.91 |
| 买入返售金融资产利息收入 | 658,511,711.67 | 1,326,264,586.66 |
| 其中：股票质押回购利息收入 | 598,443,036.60 | 1,257,476,090.27 |
| 债权投资利息收入 | 247,485,791.72 | 297,409,052.48 |
| 其他债权投资利息收入 | 2,535,829,069.23 | 2,673,743,330.08 |
| 其他 | 603,261.12 | - |
| 小计 | 5,109,033,383.02 | 5,605,711,699.80 |
| 利息支出 | | |
| 其中：客户资金存款利息支出 | 93,762,650.38 | 72,958,680.14 |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 1,234,713,990.84 | 1,521,095,616.91 |
| 其中：报价式回购利息支出 | 160,308,006.06 | 107,561,055.75 |
| 拆入资金利息支出 | 117,243,841.29 | 176,795,771.49 |
| 其中：转融通利息支出 | 35,761,805.56 | 64,363,194.57 |
| 借款利息支出 | 44,991.17 | 19,995.32 |
| 短期融资券利息支出 | 474,985,844.36 | 443,689,858.96 |
| 债券利息支出 | 2,461,314,055.02 | 2,524,617,926.03 |
| 租赁负债利息支出 | 21,159,916.31 | 23,259,117.21 |
| 小计 | 4,403,225,289.37 | 4,762,436,966.06 |
| 利息净收入 | 705,808,093.65 | 843,274,733.74 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

八、 母公司财务报表项目注释 - 续

4、 投资收益

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 对子公司的投资收益 | 639,243,318.02 | 950,000,000.00 |
| 权益法核算的长期股权投资收益 | 905,857,438.59 | 443,762,875.74 |
| 金融工具投资收益 | 3,063,434,509.40 | 1,629,368,184.32 |
| 其中：持有期间取得的收益 | 1,527,883,252.08 | 1,625,122,576.52 |
| - 交易性金融资产 | 1,336,848,615.20 | 1,119,699,472.60 |
| - 其他权益工具投资 | 284,110,673.64 | 540,222,673.70 |
| - 交易性金融负债 | (93,076,036.76) | (34,799,569.78) |
| 处置金融工具取得的收益 | 1,535,551,257.32 | 4,245,607.80 |
| - 交易性金融资产 | 2,051,529,153.14 | 399,994,263.60 |
| - 其他债权投资 | 363,353,690.57 | 65,571,975.78 |
| - 债权投资 | 859,420.43 | - |
| - 衍生金融工具 | (859,487,915.88) | (483,672,840.59) |
| - 交易性金融负债 | (20,703,090.94) | 22,352,209.01 |
| 合计 | 4,608,535,266.01 | 3,023,131,060.06 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

八、 母公司财务报表项目注释 - 续

5、 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

| | 本年发生额 | 上年发生额 |
|---------------------------|--------------------|--------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 1.将净利润调节为经营活动现金流量: | | |
| 净利润 | 1,536,393,008.19 | 2,402,072,996.16 |
| 加: 信用减值损失 | 3,880,760,015.39 | 1,012,742,297.59 |
| 固定资产、使用权资产和投资性房地产折旧 | 368,866,075.53 | 342,868,542.46 |
| 无形资产摊销 | 74,601,256.50 | 56,803,052.56 |
| 长期待摊费用摊销 | 33,186,108.66 | 26,865,231.39 |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失 | 130,855.70 | 2,066,448.94 |
| 公允价值变动收益 | (837,015,001.43) | (1,207,520,920.22) |
| 利息收入 | (2,783,314,860.95) | (2,971,152,382.56) |
| 利息支出 | 2,957,504,806.86 | 2,991,586,897.52 |
| 汇兑(收益)/损失 | (142,532,996.20) | 21,376,364.01 |
| 投资收益 | (2,399,742,790.75) | (2,266,002,731.53) |
| 递延所得税资产增加 | (512,419,259.23) | (9,012,590.14) |
| 交易性金融资产的减少 | (2,998,324,309.35) | (9,620,003,956.29) |
| 交易性金融负债的增加 | 1,103,931,020.89 | 5,756,116,179.00 |
| 经营性应收项目的减少 | (2,851,588,431.04) | (226,220,811.55) |
| 经营性应付项目的增加 | 9,369,479,767.54 | 5,838,997,919.07 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 6,799,915,266.31 | 2,151,582,536.41 |
| 2. 现金及现金等价物净变动情况: | | |
| 现金的年末余额 | 37,270,278,035.64 | 33,351,673,065.35 |
| 减: 现金的年初余额 | 33,351,673,065.35 | 21,747,700,505.58 |
| 加: 现金等价物的年末余额 | - | - |
| 减: 现金等价物的年初余额 | - | - |
| 现金及现金等价物净增加额 | 3,918,604,970.29 | 11,603,972,559.77 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

九、 在其他主体中权益的披露

1、 在联营企业中的权益

(1) 重要的联营企业

| 被投资单位名称 | 主要经营地 | 注册地 | 持股比例 (%) | 表决权比例 (%) | 核算方法 |
|---------------|-------|-----|----------|-----------|------|
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 上海 | 上海 | 35.41 | 35.41 | 权益法 |

(2) 重要联营企业的主要财务信息

| | 年末余额或本年发生额 | 年初余额或上年发生额 |
|----------------|-------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 资产合计 | 10,980,067,122.30 | 8,085,625,189.58 |
| 负债合计 | 3,531,077,230.95 | 2,107,682,801.51 |
| 净资产 | 7,448,989,891.35 | 5,977,942,388.07 |
| 归属于母公司所有者权益 | 7,302,643,116.67 | 5,836,031,773.19 |
| 对联营企业权益投资的账面价值 | 2,585,810,107.82 | 2,066,501,987.16 |
| 营业收入 | 6,643,037,635.47 | 4,078,048,171.49 |
| 净利润 | 2,566,382,823.43 | 1,248,692,831.68 |
| 其他综合收益 | (23,600,729.92) | 5,512,470.73 |
| 综合收益总额 | 2,542,782,093.51 | 1,254,205,302.41 |

(3) 不重要的联营企业的汇总财务信息

| | 年末余额或本年发生额 | 年初余额或上年发生额 |
|-----------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 投资账面价值合计 | 3,185,383,841.07 | 2,387,252,164.97 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数 | | |
| 净利润 | 306,600,578.69 | 147,307,349.01 |
| 其他综合收益 | (1,324,657.81) | (10,475,875.58) |
| 综合收益总额 | 305,275,920.88 | 136,831,473.43 |

2、 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本集团发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本集团发起设立的资产管理计划、基金和有限合伙企业。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收取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本集团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收取管理费收入。本集团所承担的与产品收益相关的可变回报并不重大，因此，本集团未合并此类产品。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

九、 在其他主体中权益的披露 - 续

2、 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益 - 续

截至 2020 年 12 月 31 日，本集团管理的未纳入合并范围的基金、有限合伙企业及资产管理计划的净资产为人民币 328,845 百万元(2019 年 12 月 31 日：238,139 百万元)。

下表列示了于 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日本集团对发起设立的未合并资产管理计划、基金和有限合伙企业中所享有的权益在本集团合并资产负债表中的相关资产账面价值信息及对应的最大损失敞口的信息：

| | 年末余额 | | 年初余额 | |
|---------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 投资账面价值 | 最大损失敞口 | 投资账面价值 | 最大损失敞口 |
| 交易性金融资产 | 2,918,024,487.23 | 2,918,024,487.23 | 2,144,541,180.90 | 2,144,541,180.90 |
| 长期股权投资 | 1,194,076,808.79 | 1,194,076,808.79 | 507,424,203.44 | 507,424,203.44 |
| 合计 | 4,112,101,296.02 | 4,112,101,296.02 | 2,651,965,384.34 | 2,651,965,384.34 |

本集团通过直接持有投资而在结构化主体中享有的权益在本集团合并资产负债表中的相关资产负债项目列示如下：

| | 年末余额 | 年初余额 |
|----------|-------------------|-------------------|
| | 投资账面价值 | 投资账面价值 |
| 交易性金融资产 | 26,884,403,557.90 | 20,308,841,924.04 |
| 其他权益工具投资 | 5,129,101,790.46 | 5,014,863,160.58 |
| 长期股权投资 | 357,581,318.50 | 318,262,260.30 |
| 合计 | 32,371,086,666.86 | 25,641,967,344.92 |

十、 关联方关系及其交易

1、 本公司的第一大股东

| 被投资单位名称 | 注册地 | 业务性质 | 注册资本 | 对本公司持股比例(%) | 对本公司表决权比例(%) |
|------------|-----|------|-----------------|-------------|--------------|
| 中能(集团)有限公司 | 上海 | 电力 | 2,000,000.00 万元 | 25.27 | 25.27 |

2、 子公司相关信息详见附注“六、1 子公司情况”。

3、 本集团的联营企业相关信息详见附注“七、13 长期股权投资”。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

4、 与本集团发生重大关联交易的其他关联方情况

| 其他关联方名称 | 关联关系 |
|-------------------|-------------------------|
| 中能股份有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 中能集团财务有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 上海燃气(集团)有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 上海久联集团有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 上海大众燃气有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 上海中能物业管理有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 上海中能诚毅股权投资有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 上海燃气市北销售有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 中能碳科技有限公司 | 第一大股东的子公司 |
| 长城基金管理有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 上海新华发行集团有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 海通证券股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 上海建工集团股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 上海上报资产管理有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 绿地控股集团有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 浙江省能源集团有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 中国长城科技集团股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 烟台张裕葡萄酒股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 上海金桥出口加工区开发股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 江苏金融租赁股份有限公司 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 上海东方证券心得益彰公益基金会 | 由本集团关联自然人担任董事、高级管理人员的公司 |
| 东方国际集团上海投资有限公司 | 东方证券子公司的持股比例 10% 以上股东 |

5、 存在控制关系且已纳入本公司合并财务报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 除了此财务报表其他相关附注已披露的信息之外，本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易：

(1) 本集团向申能(集团)有限公司及其子公司提供了如下服务：

| 关联方 | 关联交易类型及内容 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|----------------|-------------|------------|--------------|
| | | 金额 | 金额 |
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 上海燃气(集团)有限公司 | 财务顾问收入 | - | 500,000.00 |
| | 客户保证金利息支出 | 12,599.04 | 13,227.79 |
| 申能股份有限公司 | 承销注册费收入 | - | 2,085,849.06 |
| | 代理买卖证券手续费收入 | 65,974.08 | 26,210.58 |
| | 客户保证金利息支出 | 17,308.13 | 28,334.41 |
| 申能(集团)有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | 177,440.27 | 401,568.55 |
| | 承销注册费收入 | - | 725,000.00 |
| | 客户保证金利息支出 | 65,245.07 | 28,109.86 |
| 申能集团财务有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | 106,875.60 | 43,651.62 |
| | 客户保证金利息支出 | 20,442.78 | 30,654.56 |
| 上海久联集团有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | 130,858.99 | 23,237.48 |
| | 客户保证金利息支出 | 24,414.91 | 42,061.83 |
| 上海大众燃气有限公司 | 客户保证金利息支出 | 17,529.62 | 11,901.79 |
| 上海申能物业管理有限公司 | 客户保证金利息支出 | 49.02 | 48.98 |
| 上海申能诚毅股权投资有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | 1,943.74 | - |
| | 客户保证金利息支出 | 10,545.51 | 68.68 |
| 上海燃气市北销售有限公司 | 客户保证金利息支出 | 18.70 | 18.68 |
| 申能碳科技有限公司 | 客户保证金利息支出 | 1,866.84 | 1,069.74 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易 - 续

(2) 本集团向联营企业提供如下服务：

| 关联方 | 关联交易类型及内容 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|--------------------------|-------------|----------------|---------------|
| | | 金额 | 金额 |
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 海宁东证蓝海并购投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理收入 | 14,079,244.89 | 14,079,244.89 |
| | 代理买卖证券手续费收入 | 106,446.15 | - |
| | 客户保证金利息支出 | 32,417.04 | 1,092.20 |
| 汇添富基金管理股份有限公司 | 交易席位出租收入 | 186,772,425.28 | 97,946,144.65 |
| | 代销金融产品业务收入 | 89,860,811.33 | 37,788,689.10 |
| | 代理买卖证券手续费收入 | 16,643.86 | - |
| | 客户保证金利息支出 | 10,288.19 | 73,575.44 |
| 上海君煜投资中心(有限合伙) | 基金管理收入 | - | 2,075,471.70 |
| | 客户保证金利息支出 | 11,949.35 | 4,749.42 |
| 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | 财务顾问收入 | 104,330.19 | 968,726.42 |
| | 客户保证金利息支出 | 0.16 | 39.01 |
| 东证睿波(上海)投资中心(有限合伙) | 财务顾问收入 | - | 4,292,452.71 |
| 南通东证富象股权投资中心(有限合伙) | 基金管理收入 | 5,584,905.50 | 5,584,905.50 |
| 宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理收入 | 7,641,509.42 | 3,820,754.61 |
| | 客户保证金利息支出 | 2,183.62 | 406.32 |
| 成都交子东方投资发展合伙企业(有限合伙) | 基金管理收入 | 7,336,320.78 | - |
| 宜兴东证睿元股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理收入 | 2,023,933.84 | - |
| 上海东恺投资管理有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | 75.00 | 80.03 |
| | 客户保证金利息支出 | 1.90 | 50.20 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易 - 续

(3) 本集团向其他关联方提供如下服务：

| 关联方 | 关联交易类型及内容 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------------|-------------|--------------|--------------|
| | | 金额 | 金额 |
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 上海建工集团股份有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | - | 11,021.80 |
| | 客户保证金利息支出 | 68,230.22 | 22,910.77 |
| | 承销注册费收入 | 820,000.00 | - |
| 长城基金管理有限公司 | 交易席位出租收入 | 3,458,493.44 | 2,707,286.44 |
| | 代理销售金融产品收入 | 3,136.25 | 3,065.97 |
| 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 客户保证金利息支出 | - | 18.69 |
| 上海新华发行集团有限公司 | 承销注册费收入 | 27,000.00 | 90,000.00 |
| 绿地控股集团有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | - | 712,105.29 |
| | 客户保证金利息支出 | 633,301.18 | 352,697.76 |
| 上海上报资产管理有限公司 | 客户保证金利息支出 | 5.08 | 1,433.00 |
| 浙江省能源集团有限公司 | 承销注册费收入 | 218,318.00 | 125,000.00 |
| 中国长城科技集团股份有限公司 | 客户保证金利息支出 | 1,297.84 | - |
| 东方国际集团上海投资有限公司 | 代理买卖证券手续费收入 | 8,495.37 | 89,959.41 |
| | 客户保证金利息支出 | 789.67 | 5,442.00 |
| 上海东方证券心得益彰公益基金会 | 代理买卖证券手续费收入 | 7,953.52 | - |
| | 客户保证金利息支出 | 2,311.26 | 476.67 |

(4) 关联方向本集团提供如下服务：

| 关联方 | 关联交易类型及内容 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------------|-----------|---------------|---------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 上海申能物业管理有限公司 | 物业费支出 | 17,523,036.57 | 12,172,548.57 |
| 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 保险费支出 | 630,167.25 | 441,390.57 |
| 上海大众燃气有限公司 | 燃气费支出 | 147,200.00 | 211,214.88 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易 - 续

(5) 本集团持有关联方作为发行主体的证券而产生的利息收入

| 关联方 | 关联交易 类型及内容 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-----------------|---------------|--------------|--------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | 利息收入 | - | 7,903,430.85 |
| 上海新华发行集团有限公司 | 利息收入 | 3,178,598.78 | 4,482,680.97 |
| 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 利息收入 | 4,837,649.47 | 5,637,251.14 |
| 上海上报资产管理有限公司 | 利息收入 | 1,542,923.39 | 406,924.81 |
| 绿地控股集团有限公司 | 利息收入 | 457,230.15 | 772,273.22 |

(6) 本集团持有关联方作为发行主体的证券而产生的投资收益

| 关联方 | 关联交易 类型及内容 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|-------------------|---------------|----------------|--------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 上海建工集团股份有限公司 | 投资收益 | 7,758,309.25 | 7,778,362.04 |
| 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | 投资收益 | 12,951,417.85 | 987,108.31 |
| 海通证券股份有限公司 | 投资收益 | (898,665.44) | 3,398,906.70 |
| 长城基金管理有限公司 | 投资收益 | 6,622,659.69 | 118,654.35 |
| 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 投资收益 | (1,172,108.52) | (298,333.86) |
| 上海东恺投资管理有限公司 | 投资收益 | 112,890.31 | - |
| 绿地控股集团有限公司 | 投资收益 | (137,752.05) | 30,145.12 |
| 中国长城科技集团股份有限公司 | 投资收益 | 88,252.47 | 69,738.89 |
| 烟台张裕葡萄酒股份有限公司 | 投资收益 | 20,157.19 | (1,452.77) |
| 上海金桥出口加工区开发股份有限公司 | 投资收益 | (3,159.56) | 2,832.41 |
| 江苏金融租赁股份有限公司 | 投资收益 | 12,244.28 | 6,089.26 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易 - 续

(7) 申能(集团)有限公司及其子公司在本集团代理买卖证券款余额

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 代理买卖证券款 | 上海燃气(集团)有限公司 | 8,177.10 | 8,177.65 |
| 代理买卖证券款 | 上海久联集团有限公司 | 12,664,906.95 | 394,444.09 |
| 代理买卖证券款 | 上海大众燃气有限公司 | 5,921,938.46 | 4,162,996.84 |
| 代理买卖证券款 | 申能集团财务有限公司 | 9,864,612.64 | 0.18 |
| 代理买卖证券款 | 申能(集团)有限公司 | 14,482.52 | 47,157.68 |
| 代理买卖证券款 | 上海申能物业管理有限公司 | 13,880.65 | 13,831.63 |
| 代理买卖证券款 | 上海申能诚毅股权投资有限公司 | 6,720.10 | 68.68 |
| 代理买卖证券款 | 上海燃气市北销售有限公司 | 5,296.08 | 5,277.38 |
| 代理买卖证券款 | 申能碳科技有限公司 | 0.21 | 0.01 |
| 合计 | | 28,500,014.71 | 4,631,954.14 |

(8) 联营企业在本集团代理买卖证券款余额

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|--------------------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 代理买卖证券款 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 2,085,060.16 | 2,140,800.71 |
| 代理买卖证券款 | 上海君煜投资中心(有限合伙) | - | 3,007.30 |
| 代理买卖证券款 | 海宁东证蓝海并购投资合伙企业(有限合伙) | 38,338.35 | 810,671.88 |
| 代理买卖证券款 | 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | 40.15 | 39.99 |
| 代理买卖证券款 | 上海东恺投资管理有限公司 | 1.90 | - |
| 代理买卖证券款 | 宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙) | 1,244,737.31 | 114,754.23 |
| 合计 | | 3,368,177.87 | 3,069,274.11 |

(9) 其他关联方在本集团代理买卖证券款余额

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-----------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 代理买卖证券款 | 上海建工集团股份有限公司 | 15,940.28 | 18,260,373.39 |
| 代理买卖证券款 | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | - | 1,118.69 |
| 代理买卖证券款 | 上海上报资产管理有限公司 | 14,701,799.58 | 1,433.00 |
| 代理买卖证券款 | 绿地控股集团有限公司 | 183,301.18 | 2,859,105.67 |
| 代理买卖证券款 | 中国长城科技集团股份有限公司 | 1,297.84 | - |
| 代理买卖证券款 | 上海东方证券心得益彰公益基金会 | 97.34 | 3,058.16 |
| 合计 | | 14,902,436.22 | 21,125,088.91 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易 - 续

(10) 本集团应付关联方款项

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------|--------------------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 合同负债 | 宁波梅山保税港区东证夏德投资合伙企业(有限合伙) | 2,122,641.52 | 1,273,584.87 |

(11) 本集团应收关联方款项

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|------------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 其他应收款 | 上海东证春医投资中心(有限合伙) | 9,849,395.63 | 9,797,595.63 |
| 其他应收款 | 上海君煜投资中心(有限合伙) | - | 2,075,471.70 |
| 应收手续费及佣金 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 9,657,795.92 | - |
| 合计 | | 19,507,191.55 | 11,873,067.33 |

(12) 本集团持有关联方管理的资产

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|---------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 交易性金融资产 | 上海东恺投资管理有限公司 | 132,176,801.83 | 25,221,258.94 |
| 交易性金融资产 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 955,227,487.20 | 1,360,938,534.45 |
| 交易性金融资产 | 长城基金管理有限公司 | - | 50,028,911.29 |

(13) 本集团持有关联方作为发行主体的证券

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 交易性金融资产 | 上海建工集团股份有限公司 | 67,424.00 | 667,998.00 |
| 交易性金融资产 | 海通证券股份有限公司 | 13,669,858.50 | 110,024,632.86 |
| 交易性金融资产 | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 22,138,252.80 | 9,832,837.52 |
| 交易性金融资产 | 长城基金管理有限公司 | 279,866,170.50 | 222,707,717.09 |
| 交易性金融资产 | 绿地控股集团有限公司 | 214,544.00 | 38,583.68 |
| 交易性金融资产 | 上海旗忠高尔夫俱乐部有限公司 | 15,732,495.60 | 29,000,000.00 |
| 交易性金融资产 | 中国长城科技集团股份有限公司 | 338,022.00 | 264,520.00 |
| 交易性金融资产 | 烟台张裕葡萄酿酒股份有限公司 | 30,520.00 | 43,050.00 |
| 交易性金融资产 | 上海金桥出口加工区开发股份有限公司 | 17,360.00 | 24,300.00 |
| 交易性金融资产 | 江苏金融租赁股份有限公司 | 34,713.00 | 50,560.00 |
| 交易性金融资产 | 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | 289,115,844.52 | 56,656,350.73 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

6、 本集团与关联方在本年发生了如下重大关联交易 - 续

(13) 本集团持有关联方作为发行主体的证券 - 续

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|----------|-----------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 其他债权投资 | 上海新华发行集团有限公司 | 51,018,013.56 | 142,710,035.00 |
| 其他债权投资 | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | 106,408,946.22 | 104,356,200.00 |
| 其他债权投资 | 上海上报资产管理有限公司 | 40,444,821.86 | 40,449,315.02 |
| 其他债权投资 | 绿地控股集团有限公司 | - | 20,741,139.14 |
| 其他债权投资 | 诚泰融资租赁(上海)有限公司 | - | 77,198,935.18 |
| 其他权益工具投资 | 上海建工集团股份有限公司 | 166,785,095.89 | 165,425,120.00 |

(14) 本集团与关联方进行场外期权交易

| 项目名称 | 关联方 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------|------------------|------------------|
| | | 人民币元 | 人民币元 |
| 衍生金融资产 | 中国太平洋财产保险股份有限公司 | - | 88,244.00 |

(15) 本集团与申能(集团)有限公司之子公司进行股权转让交易产生的投资收益

| 项目名称 | 关联方 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|------|----------------|--------------|-------|
| | | 人民币元 | 人民币万元 |
| 投资收益 | 上海申能诚毅股权投资有限公司 | 2,937,541.47 | - |

(16) 本集团与花旗亚洲进行股权转让交易

本集团与花旗亚洲本年进行股权转让交易的相关信息详见附注“七、36 其他负债”。

7、 关键管理人员薪酬

| 项目名称 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|----------|----------|----------|
| | 人民币万元 | 人民币万元 |
| 关键管理人员薪酬 | 4,005.35 | 5,089.87 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十、 关联方关系及其交易 - 续

8、 关联方担保

2017 年 11 月，本公司为东方金融控股(香港)有限公司的全资子公司 Orient HuiZhi Limited 发行的美元债券提供 5.91 亿美元的担保，担保到期日为 2022 年 11 月。

2018 年 3 月，本公司为东方金融控股(香港)有限公司的全资子公司 Orient HuiZhi Limited 发行的美元债券提供 2.93 亿美元的担保，担保到期日为 2022 年 11 月。

2019 年 9 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司 Orient ZhiHui Limited 发行的美元债券提供 1.66 亿美元的担保，担保到期日为 2020 年 9 月。

2019 年 10 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司东方证券(香港)有限公司获取 3 亿港元银行授信提供担保，担保到期日为 2020 年 10 月。

2019 年 12 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司东证国际金融集团有限公司提供总额不超过 1.8 亿美元非融资类担保。

2020 年 5 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司东证国际金融集团有限公司获取银行授信提供担保，担保金额为 5,000 万美元。

2020 年 7 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司 Orient International Investment Products Limited 提供非融资类担保，担保金额为 1.5 亿美元。

2020 年 7 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司东证国际金融集团有限公司获取银行授信提供担保，担保金额为 7.6 亿港元。

2020 年 10 月，东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司 Orient HongSheng Limited 发行的美元债券提供 1.72 亿美元的担保，担保到期日为 2023 年 10 月。

十一、风险管理

公司致力于推行“全员合规，风控为本”的风险管理理念，注重全面风险和内控管理体系以及风险管理文化的建设。通过多途径夯实公司全体员工的风险管理意识和风险管理专业化水平。公司着力实现风险管理、合规管理与内部控制三者间的有机融合与衔接，构建了较为完善的、内生性的全面风险管理体系和有效的内部控制机制，覆盖公司所有业务、各子公司、各个部门、分支机构和全体人员，不断推进集团化风险管理，并贯穿于决策、执行、监督、反馈等各个环节。

公司对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、技术风险、声誉风险、合规风险、法律风险、道德风险等实施风险管理全覆盖，切实保障公司总体风险可测可控可承受。

公司建立了风险识别与评估、风险监测与计量、风险分析与应对的风险管理机制，采取定性和定量相结合的风险计量方法，提升对各类风险的专业化管理能力；贯彻全面风险管理多视角的风险审查机制，对开展的各项新业务、新产品进行严格审核，对日常业务运行中的各重要风险环节进行动态监控；通过敏感性分析及压力测试，动态监测、评估公司经营过程中的各类别风险状况及风险承受能力。

全面风险管理体系离不开完备的信息技术系统。公司近几年持续增加信息技术方面的资源投入，通过搭建风险管理驾驶舱、全面风险管理系统、风控指标动态管理系统和各类专项风险管理信息系统，不断推进风险管理工作中信息技术的实践应用，风险管理的及时性和准确性得到有效提升。

（一） 风险管理组织结构

公司致力于构筑严密有效的风险管理“三道防线”。通过建立各业务部门、各分支机构、各子公司重要一线岗位的双人、双职、双责及岗位分离制衡机制，形成第一道防线；风险管理职能部门协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作，其他相关职能部门对各自职责范围内的合规与风险管理事项进行检查和督导，通过相关部门及相关岗位的相互制衡、监督，形成第二道防线；风险监督管理部门对各业务及职能部门风险管理工作实施有效的监督，形成第三道防线。

公司按照《证券公司全面风险管理规范》的要求，结合自身的运营需求，建立包括董事会，经营管理层，首席风险官，风险管理各职能部门，各业务部门、分支机构及子公司五个层次的风险管理架构，各层级在授权范围内履行风险管理职责。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险

信用风险主要指债务人或交易对手未能履行合同所规定的义务或信用质量发生变化，给公司造成损失的风险。公司的信用风险目前主要来自于证券金融业务中的融资方信用风险以及证券投资业务中的固定收益类投资业务中的债券发行人信用风险以及衍生品交易等业务中交易对手方的违约风险等。

公司围绕净资本管理与风险承受度，分层次、分模块，统筹管理规模、交易对手、风险敞口等风控指标，从品种、模型、对冲等角度出发，对信用风险敞口进行细化管理，有效控制信用风险。

从业务实践角度，公司分别建立了针对债券发行主体、交易对手方、融资类业务客户的信用风险管理体系，加强了对其资质和风险的评估工作，通过合同审查、交易及舆情监控等形式进行信用风险管理，重点关注交易过程中的可能违约环节，制定风险处置应急预案。在债券投资及信用风险相关的交易对手业务中，加强对债务发行主体及交易对手的基本面分析，相应地建立了公司信用风险内部评级体系，并通过信用风险管理系统实现了内部评级、统一授信管理、投资品集中度管理、违约客户管理、压力测试、监控预警及风险报告等功能，加强信用风险管控，提升信用风险管理能力；在衍生品交易中，公司对交易对手设定保证金比例和交易规则限制，通过每日盯市、追保、强制平仓等手段来控制交易对手的信用风险敞口；在证券金融业务中，建立了客户的信用等级评定、授信管理、担保品管理、监控报告等机制，并通过动态平仓机制及时处置潜在风险。

如附注三所述，本集团采用简化方法，对于应收款项按照整个存续期预期信用损失确认减值准备。本集团对于其他金融资产监测并评估其信用风险自初始确认后是否已显著增加，若该金融资产的信用风险自初始确认后已显著增加，本集团按照相当于该金融资产整个存续期内预期信用损失的金额而并非未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。

在进行信用风险相关评估时，本集团将考虑所有合理且有依据的定性及定量信息，包括无须付出不必要的额外成本或努力的历史经验及前瞻性信息。本集团在评估每个资产组合的信用风险是否显著增加时考虑不同的因素。

在评估信用风险是否显著增加时，本集团可能考虑的相关因素如下：

- 同一金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险的外部市场指标是否发生显著变化；
- 金融工具外部信用评级实际或预期是否发生显著变化；
- 预期将导致债务人履行其偿债义务的能力发生显著变化的业务、财务或经济状况的不利变化；
- 债务人经营成果实际或预期是否发生显著变化；
- 债务人所处的监管、经济或技术环境是否发生显著不利变化将重大影响债务人履行其偿债义务的能力；
- 作为债务抵押的担保物价值或第三方提供的担保或信用增级质量是否发生显著变化；
- 实际或预期增信措施有效性发生重大不利变化；
- 债务人预期表现和还款行为是否发生显著变化。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险 - 续

本集团货币资金、结算备付金和存出保证金等金融资产的信用风险有限，主要系相关对手方为国有商业银行、清算所、证券交易所、期货交易所、商品交易所以及国际评级机构评定的外部评级较高的商业银行等。截至 2020 年 12 月 31 日，本集团货币资金、结算备付金、拆入资金和存出保证金不存在信用风险显著增加的情形。

本集团主要依靠外部信用评级来评估债券投资的信用风险。通常情况下，当出现下列情况时，表明债券投资的信用风险显著上升：相对于初始确认日国内评级机构评定的原外部评级在 AA 以上(含)其信用等级发生下调，且下调后信用等级在 AA 以下(不含)B 以上(不含)；相对于初始确认日国内评级机构评定的原外部评级在 AA 以下(不含)其信用等级发生下调但未下调至 B 等级。截至 2020 年 12 月 31 日，本集团主要以投资债权评级为 AA 级以上(含)的债券为主。

融资融券金融资产包括客户取得融出资金金额和融券卖出金额。这些金融资产主要的信用风险来自于客户未能及时支付本息或归还证券而产生违约。本集团制定了严格的平仓制度，并对融资融券客户的信用账户执行整体监控，设置预警线和平仓线，根据客户信用账户维持担保比例变化对客户信用账户资产负债进行监控，确保担保资产充足。通常情况下，如果客户信用账户维持担保比例低于预警线则表明其信用风险已经显著增加。

在买入返售金融资产业务方面，本集团通过设置定量、定性标准以判断相关金融资产的信用风险自初始确认后是否发生显著变化，判断标准主要包括逾期天数、维保比的变化以及其他表明信用风险显著变化的定性和定量标准。对于股票质押式回购业务，本集团考虑担保证券所属板块、流动性、限售情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的平仓线。一般而言，限售股项目的平仓线不低于 140%，流通股项目的平仓线不低于 130%。本集团在充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券所属板块、流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况、发行人经营情况等因素的基础上，分析评估每笔业务自初始确认后信用风险的变化。通常情况下，按以下标准划分三个阶段：若履约保障比例不低于平仓线，且未出现逾期情形，则属于第一阶段；若履约保障比例低于平仓线或逾期，或出现其他信用风险显著增加的情形，而根据交易实质判断尚未发生信用减值，则进入第二阶段。若履约保障比例低于平仓线超过 90 天或逾期超过 90 天，本集团结合债务人的还款能力、还款意愿、担保资产价值及其他债务解决措施等因素逐一进行评估，依据交易实质判断是否已发生信用减值，若已发生信用减值，则划入第三阶段。

本集团采用三阶段模型对除应收款项以外的其余以摊余成本计量的金融资产和其他债权投资计量预期信用损失。本集团根据相关金融资产自初始确认日起信用风险的变化情况在以下三阶段进行划分：

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险 - 续

第一阶段：初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，应当按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备；

第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加，但尚无客观减值证据的金融工具，应当按照该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；

第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，应当按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

该预期信用损失模型中涉及的评估因素主要包括违约概率、违约风险敞口和违约损失率等：

- 违约概率表示在特定时间段内相关交易发生违约的可能性的估计；其计算涉及历史数据和对未来情况的预期等；
- 违约风险敞口指在未来 12 个月或整个剩余存续期中，在违约发生时本公司应被偿付的金额。
- 违约损失率表示对发生违约情形的交易产生的损失估计；本集团根据历史资料，在考虑担保措施带来的现金流以及整体信用增级的基础上进行估计，并进行前瞻性调整。

预期信用损失的计量是基于违约概率、违约损失率和违约风险敞口的概率加权结果。

本集团在判断金融资产的信用风险自初始确认后是否显著增加以及计量预期信用损失时，均结合了前瞻性信息。本集团通过进行历史数据分析，识别出影响各业务类型信用风险及预期信用损失的关键经济指标。关键经济指标包括宏观经济指标和反映市场波动率的指标，如广义货币供应量、居民消费价格指数、工业品出场价格指数等。其中：

- 广义货币供应量增长率：2021 年末预测值取值范围在 8.34% 至 11.12% 之间；
- 居民消费价格指数增长率：2021 年末预测值取值范围在 1.13% 至 1.50% 之间；
- 工业品出场价格指数增长率：2021 年末预测值取值范围在 1.39% 至 1.85% 之间。

为了确定这些经济指标与违约概率和违约损失率之间的关系，本集团通过建立经济模型来评估这些经济指标的历史变动对违约概率和违约损失率的影响。

本集团根据反映上述已考虑新型冠状病毒肺炎疫情影响的主要经济指标的情景，对预期信用损失进行前瞻性估计。本集团在组合基础上确定相关金融工具的预期信用损失时，本集团基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，共同信用风险特征的例子可包括但不限于：金融工具类型、信用风险评级、担保品类型、剩余到期期限和担保物相对于金融资产的价值。本集团将定期评估该分类以确保其具有共同信用风险特征。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险 - 续

本集团主要金融资产减值准备余额的本年和上年变动情况如下：

(1) 融出资金

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2020年1月1日 | 1,172,546.69 | 131,403.16 | 213,291,858.55 | 214,595,808.40 |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (91,883.14) | 150,412.70 | (58,529.56) | - |
| 转入未来12个月预期信用损失 | 333,546.57 | (333,546.57) | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (359,194.32) | 361,771.48 | 6,443,108.92 | 6,445,686.08 |
| 本年核销 | - | - | (171,874,484.02) | (171,874,484.02) |
| 汇兑差额 | (631.73) | - | (2,565,512.19) | (2,566,143.92) |
| 合计 | 1,054,384.07 | 310,040.77 | 45,236,441.70 | 46,600,866.54 |

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2019年1月1日 | 1,560,036.05 | 1,502,862.24 | 201,148,514.06 | 204,211,412.35 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | - | (3,706.73) | 3,706.73 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (20,267.58) | 20,267.58 | - | - |
| 转入未来12个月预期信用损失 | 748,388.39 | (748,388.39) | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (1,115,895.29) | (639,631.54) | 7,904,156.52 | 6,148,629.69 |
| 汇兑差额 | 285.12 | - | 4,235,481.24 | 4,235,766.36 |
| 合计 | 1,172,546.69 | 131,403.16 | 213,291,858.55 | 214,595,808.40 |

(2) 买入返售金融资产

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2020年1月1日 | 4,901,396.87 | 137,022,248.35 | 1,665,173,947.34 | 1,807,097,592.56 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | (1,012,400.91) | (105,293,588.80) | 106,305,989.71 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (3,080,400.18) | 3,080,400.18 | - | - |
| 转入未来12个月预期信用损失 | 9,330,172.88 | (9,330,172.88) | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (9,867,172.83) | 797,329.86 | 3,705,343,830.60 | 3,696,273,987.63 |
| 转出 | - | - | (469,425,952.25) | (469,425,952.25) |
| 合计 | 271,595.83 | 26,276,216.71 | 5,007,397,815.40 | 5,033,945,627.94 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险 - 续

(2) 买入返售金融资产 - 续

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2019年1月1日 | 9,907,003.90 | 152,348,314.51 | 671,489,883.90 | 833,745,202.31 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | - | (61,715,336.46) | 61,715,336.46 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (5,728,303.46) | 5,728,303.46 | - | - |
| 转入未来12个月预期信用损失 | 11,010,790.90 | (11,010,790.90) | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (10,288,094.47) | 51,671,757.74 | 931,968,726.98 | 973,352,390.25 |
| 合计 | 4,901,396.87 | 137,022,248.35 | 1,665,173,947.34 | 1,807,097,592.56 |

(3) 其他债权投资

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2020年1月1日 | 17,788,152.91 | - | 106,860,266.95 | 124,648,419.86 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | - | (112,354.87) | 112,354.87 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (123,974.67) | 123,974.67 | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (3,445,274.20) | 160,360.10 | 151,127,114.63 | 147,842,200.53 |
| 合计 | 14,218,904.04 | 171,979.90 | 258,099,736.45 | 272,490,620.39 |

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2019年1月1日 | 18,292,255.83 | - | 84,660,266.95 | 102,952,522.78 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | - | (124,740.53) | 124,740.53 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (124,740.53) | 124,740.53 | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (379,362.39) | - | 22,075,259.47 | 21,695,897.08 |
| 合计 | 17,788,152.91 | - | 106,860,266.95 | 124,648,419.86 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险 - 续

(4) 其他资产

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2020年1月1日 | 6,003,387.97 | - | 375,690,866.30 | 381,694,254.27 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | - | (1,752,270.97) | 1,752,270.97 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (1,752,270.97) | 1,752,270.97 | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (2,294,512.04) | - | 33,428,533.16 | 31,134,021.12 |
| 核销 | - | - | (1,767,191.09) | (1,767,191.09) |
| 转入 | - | - | 292,760,917.13 | 292,760,917.13 |
| 汇兑差额 | (64,423.99) | - | - | (64,423.99) |
| 合计 | 1,892,180.97 | - | 701,865,396.47 | 703,757,577.44 |

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|------------------|--------------------|------------------------------|------------------------------|----------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2019年1月1日 | 9,759,123.01 | - | 322,449,444.76 | 332,208,567.77 |
| 转入整个存续期(已发生信用减值) | - | (285,000.00) | 285,000.00 | - |
| 转入整个存续期(未发生信用减值) | (285,000.00) | 285,000.00 | - | - |
| 本年计提/(冲回) | (3,607,687.96) | - | 52,956,421.54 | 49,348,733.58 |
| 汇兑差额 | 136,952.92 | - | - | 136,952.92 |
| 合计 | 6,003,387.97 | - | 375,690,866.30 | 381,694,254.27 |

(5) 债权投资

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|-----------|--------------------|------------------------------|------------------------------|--------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2020年1月1日 | 1,452,280.33 | - | - | 1,452,280.33 |
| 本年冲回 | (787,445.93) | - | - | (787,445.93) |
| 合计 | 664,834.40 | - | - | 664,834.40 |

| | 未来 12 个月 预期信用损失 | 整个存续期(未发 生信用减值) 预期信用损失 | 整个存续期(已发 生信用减值) 预期信用损失 | 合计 |
|-----------|--------------------|------------------------------|------------------------------|--------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 2019年1月1日 | 1,941,343.45 | - | - | 1,941,343.45 |
| 本年冲回 | (489,063.12) | - | - | (489,063.12) |
| 合计 | 1,452,280.33 | - | - | 1,452,280.33 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(二) 信用风险 - 续

若不考虑担保品和其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面金额(即，扣除减值准备后的净额)。本集团最大信用风险敞口金额列示如下：

| 涉及信用风险的项目 | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|--------------------|--------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 货币资金 | 65,640,359,556.65 | 48,940,833,855.08 |
| 结算备付金 | 21,516,356,646.61 | 13,243,653,713.68 |
| 存出保证金 | 2,183,089,694.77 | 1,642,894,348.47 |
| 融出资金 | 21,171,919,414.06 | 13,214,262,240.75 |
| 交易性金融资产 | 26,977,230,840.64 | 30,575,190,387.73 |
| 衍生金融资产 | 155,876,469.76 | 609,102,138.41 |
| 买入返售金融资产 | 14,460,425,371.36 | 24,206,541,982.29 |
| 应收款项 | 874,405,553.22 | 1,019,919,667.42 |
| 其他债权投资 | 62,645,974,916.84 | 64,895,563,425.25 |
| 债权投资 | 6,243,897,149.81 | 7,193,554,228.81 |
| 其他资产 | 432,877,936.24 | 569,034,254.62 |
| 合计 | 222,302,413,549.96 | 206,110,550,242.51 |

(三) 市场风险

市场风险主要指在证券市场中因股市价格、利率、汇率等的变动而导致损失的风险。公司的市场风险主要来自于证券投资业务。公司的各业务部门、各分支机构、各子公司是市场风险管理的第一道防线。公司的风险管理职能部门负责统筹市场风险管理工作。

目前，为加强市场风险的管控，公司采取了如下措施：

- (1) 运用逐日盯市、集中度分析及定量风险模型对规模、杠杆、风险敞口、久期等进行管理，建立动态跟踪止损机制。
- (2) 通过敏感性分析寻找影响投资组合收益的关键因素，并通过情景分析、压力测试等方法评估投资组合对于极端市场波动的承受能力。
- (3) 进行多元化和科学化的资产配置，利用股指期货等衍生品对冲风险，运用各种投资策略实现套期保值。
- (4) 密切关注宏观经济指标和趋势，重大经济政策动向，评估宏观因素变化可能给投资带来的系统性风险。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(三) 市场风险 - 续

- (5) 建立重大事项处置决策、执行及责任机构，制定各种可预期极端情况下的应急预案，并根据严重程度对重大事项进行分级和管理。

1、 利率风险

利率风险是指公司的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本公司面临的利率风险的资产主要包括公司的现金及银行余额、结算备付金、融资客户垫款、买入返售金融资产及债券投资等。管理层透过对利率重定价的错配程度及久期的缺口设立限额，积极监控公司的利息净额风险。公司通过短期的资金拆借、收益凭证、短期融资券等来获取资金流动性，从而应对短期头寸的缺口。

中国人民银行所报的现行利率、上海银行间同业拆放利率和香港银行间同业拆放利率波动为公司现金流量利率风险的主要来源。

于各资产负债表日，本集团金融资产和金融负债按合同约定的利率重新定价日或到期日(以较早者为准)的情况如下：

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(三) 市场风险 - 续

1、利率风险 - 续

| | 年末余额 | | | | | | 合计 |
|-----------|---------------------|--------------------|-------------------|---------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 非生息 | |
| 金融资产： | | | | | | | |
| 货币资金 | 65,457,260,606.47 | 50,390,694.44 | 67,295,269.57 | 65,412,986.17 | - | - | 65,640,359,556.65 |
| 结算备付金 | 21,516,356,646.61 | - | - | - | - | - | 21,516,356,646.61 |
| 融出资金 | 1,456,820,276.66 | 6,670,845,639.30 | 13,044,253,498.10 | - | - | - | 21,171,919,414.06 |
| 衍生金融资产 | - | 12,852,855.69 | - | - | - | 143,023,614.07 | 155,876,469.76 |
| 应收款项 | - | - | - | - | - | 874,405,553.22 | 874,405,553.22 |
| 买入返售金融资产 | 14,260,090,364.15 | 200,335,007.21 | - | - | - | - | 14,460,425,371.36 |
| 交易性金融资产 | 419,311,340.00 | 2,282,402,792.61 | 5,770,777,628.43 | 12,838,976,852.92 | 5,665,762,226.68 | 45,723,886,202.06 | 72,701,117,042.70 |
| 债权投资 | 357,798,878.96 | 480,428,208.64 | 1,408,876,480.51 | 1,925,868,347.25 | 2,070,925,234.45 | - | 6,243,897,149.81 |
| 其他债权投资 | 956,203,159.44 | 978,047,413.47 | 5,660,761,117.55 | 24,409,841,921.43 | 30,641,121,304.95 | - | 62,645,974,916.84 |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - | 10,936,457,571.84 | 10,936,457,571.84 |
| 存出保证金 | 2,183,089,694.77 | - | - | - | - | - | 2,183,089,694.77 |
| 其他资产 | - | - | 78,720,680.82 | - | - | 354,157,255.42 | 432,877,936.24 |
| 金融资产合计 | 106,606,930,967.06 | 10,675,302,611.36 | 26,030,684,674.98 | 39,240,100,107.77 | 38,377,808,766.08 | 58,031,930,196.61 | 278,962,757,323.86 |
| 金融负债： | | | | | | | |
| 短期借款 | 364,298,096.43 | 215,434,089.02 | - | - | - | - | 579,732,185.45 |
| 应付短期融资款 | 6,049,340,744.44 | 5,925,800,757.29 | 4,280,344,284.64 | - | - | - | 16,255,485,786.37 |
| 拆入资金 | 9,169,763,871.43 | 500,350,000.00 | - | - | - | - | 9,670,113,871.43 |
| 交易性金融负债 | 4,009,362,770.18 | 2,769,000,000.00 | 5,850,543,120.00 | - | - | 1,947,167,254.05 | 14,576,073,144.23 |
| 衍生金融负债 | - | 268,564,073.99 | - | - | - | 236,392,622.49 | 504,956,696.48 |
| 卖出回购金融资产款 | 45,681,063,263.04 | 2,245,794,090.66 | 4,934,026,086.03 | - | - | - | 52,860,883,439.73 |
| 代理买卖证券款 | 66,642,671,158.50 | - | - | - | - | - | 66,642,671,158.50 |
| 代理承销证券款 | - | - | - | - | - | 346,000,000.00 | 346,000,000.00 |
| 应付款项 | - | - | - | - | - | 576,584,579.01 | 576,584,579.01 |
| 租赁负债 | 37,122,579.09 | 43,855,896.06 | 225,654,601.56 | 539,316,613.05 | 10,960,639.10 | - | 856,910,328.86 |
| 应付债券 | - | - | 8,759,659,379.66 | 49,421,791,947.57 | 4,084,022,170.45 | - | 62,265,473,497.68 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,867,453,267.90 | 1,867,453,267.90 |
| 金融负债合计 | 131,953,622,483.11 | 11,968,798,907.02 | 24,050,227,471.89 | 49,961,108,560.62 | 4,094,982,809.55 | 4,973,597,723.45 | 227,002,337,955.64 |
| 金融资产负债净头寸 | (25,346,691,516.05) | (1,293,496,295.66) | 1,980,457,203.09 | (10,721,008,452.85) | 34,282,825,956.53 | 53,058,332,473.16 | 51,960,419,368.22 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(三) 市场风险 - 续

1、 利率风险 - 续

| | 年初余额 | | | | | | 合计 |
|-----------|---------------------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 非生息 | |
| 金融资产： | | | | | | | |
| 货币资金 | 48,919,530,050.55 | - | 21,303,804.53 | - | - | - | 48,940,833,855.08 |
| 结算备付金 | 13,243,653,713.68 | - | - | - | - | - | 13,243,653,713.68 |
| 融出资金 | 783,661,644.70 | 3,857,970,394.38 | 8,572,630,201.67 | - | - | - | 13,214,262,240.75 |
| 衍生金融资产 | 16,034.43 | 13,446,563.61 | 22,314,766.42 | - | - | 573,324,773.95 | 609,102,138.41 |
| 应收款项 | - | - | - | - | - | 1,019,919,667.42 | 1,019,919,667.42 |
| 买入返售金融资产 | 21,507,140,435.09 | 1,299,529,391.89 | 1,115,014,777.53 | 284,857,377.78 | - | - | 24,206,541,982.29 |
| 交易性金融资产 | 1,327,603,347.35 | 624,027,042.08 | 6,144,805,067.38 | 16,897,116,005.11 | 5,581,638,925.81 | 36,325,903,098.18 | 66,901,093,485.91 |
| 债权投资 | - | 178,269,584.10 | 229,019,913.55 | 4,662,790,171.49 | 2,123,474,559.67 | - | 7,193,554,228.81 |
| 其他债权投资 | 156,238,188.03 | 363,124,955.82 | 4,523,569,049.20 | 37,257,646,031.60 | 22,594,985,200.60 | - | 64,895,563,425.25 |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - | 10,832,873,153.66 | 10,832,873,153.66 |
| 存出保证金 | 1,642,894,348.47 | - | - | - | - | - | 1,642,894,348.47 |
| 其他资产 | - | - | 148,813,061.22 | 139,524,433.20 | - | 280,696,760.20 | 569,034,254.62 |
| 金融资产合计 | 87,580,737,762.30 | 6,336,367,931.88 | 20,777,470,641.50 | 59,241,934,019.18 | 30,300,098,686.08 | 49,032,717,453.41 | 253,269,326,494.35 |
| 金融负债： | | | | | | | |
| 短期借款 | 349,735,122.49 | 290,418,406.71 | - | - | - | - | 640,153,529.20 |
| 应付短期融资款 | 4,626,536,595.60 | 8,288,989,756.65 | 3,197,673,207.25 | - | - | - | 16,113,199,559.50 |
| 拆入资金 | 4,871,391,422.22 | 1,010,062,500.00 | 503,204,861.11 | - | - | - | 6,384,658,783.33 |
| 交易性金融负债 | 5,807,584,785.10 | 1,652,880,000.00 | 4,178,786,956.77 | - | - | 991,708,853.19 | 12,630,960,595.06 |
| 衍生金融负债 | 103,254,823.73 | 1,008,320,286.57 | 1,443,752,949.47 | - | - | 88,046,742.59 | 2,643,374,802.36 |
| 卖出回购金融资产款 | 54,860,000,716.65 | 1,202,568,561.91 | 1,415,493,587.37 | - | - | - | 57,478,062,865.93 |
| 代理买卖证券款 | 40,179,178,362.34 | - | - | - | - | - | 40,179,178,362.34 |
| 代理承销证券款 | - | - | - | - | - | 80,000,000.00 | 80,000,000.00 |
| 应付款项 | - | - | - | - | - | 480,101,048.74 | 480,101,048.74 |
| 租赁负债 | 43,484,249.41 | 43,592,291.53 | 229,475,439.79 | 656,635,990.31 | 21,817,260.16 | - | 995,005,231.20 |
| 应付债券 | - | 2,117,129,974.05 | 25,828,656,401.95 | 35,280,458,139.99 | 4,082,954,253.41 | - | 67,309,198,769.40 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,912,497,651.16 | 1,912,497,651.16 |
| 金融负债合计 | 110,841,166,077.54 | 15,613,961,777.42 | 36,797,043,403.71 | 35,937,094,130.30 | 4,104,771,513.57 | 3,552,354,295.68 | 206,846,391,198.22 |
| 金融资产负债净头寸 | (23,260,428,315.24) | (9,277,593,845.54) | (16,019,572,762.21) | 23,304,839,888.88 | 26,195,327,172.51 | 45,480,363,157.73 | 46,422,935,296.13 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(三) 市场风险 - 续

1、利率风险 - 续

敏感度分析

以下敏感度分析基于计息资产及负债的利率风险。该分析假设于各报告期末未结清的计息资产及负债于整个年度未结清，在其他变量不变的情况下，利率增减 50 个基点对净利润及所有者权益的影响。

| 项目 | 2020 年 | | 2019 年 | |
|---------------|-----------|-------------|-----------|-------------|
| | 对净利润的影响 | 对所有者权益的影响 | 对净利润的影响 | 对所有者权益的影响 |
| | 人民币千元 | 人民币千元 | 人民币千元 | 人民币千元 |
| 市场利率上升 50 个基点 | (333,117) | (1,384,387) | (421,025) | (1,336,688) |
| 市场利率下降 50 个基点 | 340,630 | 1,457,181 | 429,329 | 1,380,547 |

2、汇率风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。除海外子公司持有以不同于相关集团实体功能货币的外币计值的金融资产外，公司仅持有少量以外币计值的投资。管理层认为本集团的外汇汇率风险并不重大，因为本集团的外币资产与负债占本集团总资产与总负债的比率极低。

3、其他价格风险

其他价格风险主要指因股票价格、衍生金融工具价格和商品价格的不利变动而导致公司发生损失的风险。从定量角度而言，公司面临的价格风险主要体现在由于交易性金融工具的价格波动同比例影响公司的利润变动，以及由于其他债权投资和其他权益工具的价格波动同比例影响公司的股东权益变动。除日常监控投资头寸、交易及盈利指标外，公司亦在日常风险监控中主要使用风险敏感度指标及压力测试指标。

敏感度分析

以下分析假设其他变量保持不变的情况下，股权证券、基金、衍生工具、集合资产管理计划以及其他交易性金融工具的价格增加或减少 10% 对所得税前利润及所得税前其他综合收益的影响。下述正数表示所得税前利润及所得税前其他综合收益增加，反之亦然。

| 项目 | 2020 年 | | 2019 年 | |
|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 对利润总额的影响 | 对其他综合收益的影响 | 对利润总额的影响 | 对其他综合收益的影响 |
| | 人民币千元 | 人民币千元 | 人民币千元 | 人民币千元 |
| 市场价格增加 10% | 3,079,873 | 1,093,646 | 2,166,067 | 1,083,287 |
| 市场价格下降 10% | (3,079,873) | (1,093,646) | (2,166,067) | (1,083,287) |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(四) 流动性风险

流动性风险指证券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。

流动性风险管理方面，报告期内公司依照《证券公司流动性风险管理指引》和风控指标管理办法新规持续完善流动性风险管理系统和内部管理制度体系，设置专岗负责对公司流动性风险进行动态监控、预警、分析和报告。每年初公司审慎确定流动性风险偏好的定性原则和定量标准，年中根据市场变化和业务发展适时调整相关流动性风控指标。定期进行流动性压力测试和应急演练，并按监管要求每日报送流动性覆盖率、净稳定资金率等指标。确保公司流动性需求能够及时以合理成本得到满足，将流动性风险控制在可承受的范围内。

本集团持有的非衍生金融负债按剩余合同义务到期期限的未折现现金流分析列示如下。表格所列未折现的现金流包括利息及本金的现金流。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十一、风险管理 - 续

(四) 流动性风险 - 续

| 项目 | 年末余额 | | | | | | 总计 | 账面价值 |
|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|------|
| | 即期 | 3 个月内 | 3 个月至 1 年 | 1 至 5 年 | 5 年及以上 | | | |
| 短期借款 | - | 431,893,819.22 | 153,637,500.00 | - | - | 585,531,319.22 | 579,732,185.45 | |
| 应付短期融资款 | - | 12,015,024,894.92 | 4,356,227,219.34 | - | - | 16,371,252,114.26 | 16,255,485,786.37 | |
| 拆入资金 | - | 9,676,204,695.97 | - | - | - | 9,676,204,695.97 | 9,670,113,871.43 | |
| 交易性金融负债 | 657,569,692.90 | 7,634,218,506.16 | 5,881,807,340.01 | 460,785,106.04 | - | 14,634,380,645.11 | 14,576,073,144.23 | |
| 卖出回购金融资产款 | - | 48,250,607,121.95 | 5,005,401,829.76 | - | - | 53,256,008,951.71 | 52,860,883,439.73 | |
| 代理买卖证券款 | 66,642,671,158.50 | - | - | - | - | 66,642,671,158.50 | 66,642,671,158.50 | |
| 代理承销证券款 | 346,000,000.00 | - | - | - | - | 346,000,000.00 | 346,000,000.00 | |
| 应付款项 | 576,584,579.01 | - | - | - | - | 576,584,579.01 | 576,584,579.01 | |
| 租赁负债 | - | 82,384,574.41 | 233,001,700.08 | 590,983,012.55 | 13,796,451.90 | 920,165,738.94 | 856,910,328.86 | |
| 应付债券 | - | 289,000,000.00 | 10,544,904,311.17 | 51,915,968,927.17 | 4,398,400,000.00 | 67,148,273,238.34 | 62,265,473,497.68 | |
| 其他负债 | 1,867,453,267.90 | - | - | - | - | 1,867,453,267.90 | 1,867,453,267.90 | |
| 合计 | 70,090,278,698.31 | 78,379,333,612.63 | 26,174,979,900.36 | 52,967,737,045.76 | 4,412,196,451.90 | 232,024,525,708.96 | 226,497,381,259.16 | |

| 项目 | 年初余额 | | | | | | 总计 | 账面价值 |
|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|------|
| | 即期 | 3 个月内 | 3 个月至 1 年 | 1 至 5 年 | 5 年及以上 | | | |
| 短期借款 | - | 248,071,707.79 | 429,289,770.46 | - | - | 677,361,478.25 | 640,153,529.20 | |
| 应付短期融资款 | - | 12,963,649,580.80 | 3,252,951,551.68 | - | - | 16,216,601,132.48 | 16,113,199,559.50 | |
| 拆入资金 | - | 5,889,727,913.88 | 508,215,277.78 | - | - | 6,397,943,191.66 | 6,384,658,783.33 | |
| 交易性金融负债 | - | 7,727,555,006.01 | 4,260,249,301.65 | 705,649,606.20 | - | 12,693,453,913.86 | 12,630,960,595.06 | |
| 卖出回购金融资产款 | - | 56,062,635,791.54 | 1,433,196,813.24 | - | - | 57,495,832,604.78 | 57,478,062,865.93 | |
| 代理买卖证券款 | 40,179,178,362.34 | - | - | - | - | 40,179,178,362.34 | 40,179,178,362.34 | |
| 代理承销证券款 | 80,000,000.00 | - | - | - | - | 80,000,000.00 | 80,000,000.00 | |
| 应付款项 | 480,101,048.74 | - | - | - | - | 480,101,048.74 | 480,101,048.74 | |
| 租赁负债 | - | 87,967,476.66 | 233,218,473.91 | 721,601,504.78 | 26,602,847.87 | 1,069,390,303.22 | 995,005,231.20 | |
| 应付债券 | - | 3,023,187,931.94 | 29,501,699,435.00 | 39,230,581,865.00 | 4,597,600,000.00 | 76,353,069,231.94 | 67,309,198,769.40 | |
| 其他负债 | 1,912,497,651.16 | - | - | - | - | 1,912,497,651.16 | 1,912,497,651.16 | |
| 合计 | 42,651,777,062.24 | 86,002,795,408.62 | 39,618,820,623.72 | 40,657,832,975.98 | 4,624,202,847.87 | 213,555,428,918.43 | 204,203,016,395.86 | |

由于衍生金融工具对公司现金流影响较小，因此上述未贴现现金流中未包括衍生金融工具的影响。

十二、金融资产的转移

回购协议

回购协议指本集团与本公司在卖出一项金融资产的同时，与交易对手约定在未来指定日期以固定价格回购该资产(或与其实质上相同的金融资产)的交易。由于回购价格是固定的，本集团与本公司仍然承担与卖出资产相关的所有权上几乎所有的风险和报酬。卖出的金融资产(在卖出回购期内本集团与本公司无法使用)未在财务报表中予以终止确认，而是被视为相关担保借款的担保物，因为本集团与本公司保留了该等金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬。此外，本集团与本公司就所收到的对价确认一项金融负债。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十二、金融资产的转移 - 续

已转让但未终止确认的金融资产及相关负债如下：

| 2020 年 12 月 31 日 | 交易性金融资产 | 其他债权投资 | 其他权益工具投资 | 融出资金收益权 | 买入返售金融资产 | 债权投资 | 债券借贷 | 合计 |
|------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 转让资产的账面价值 | 20,005,339,757.97 | 24,840,196,083.16 | 1,686,324,106.32 | 3,819,545,927.18 | 1,126,520,529.47 | 4,842,860,944.90 | 1,617,533,200.22 | 57,938,320,549.22 |
| 相关负债的账面价值 | 17,695,804,145.99 | 23,331,984,666.91 | 1,503,704,064.30 | 3,405,495,694.45 | 1,125,676,261.90 | 4,431,954,420.66 | 1,366,264,185.52 | 52,860,883,439.73 |

| 2019 年 12 月 31 日 | 交易性金融资产 | 其他债权投资 | 其他权益工具投资 | 融出资金收益权 | 买入返售金融资产 | 债权投资 | 债券借贷 | 合计 |
|------------------|-------------------|-------------------|------------------|---------|----------|------------------|------------------|-------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 转让资产的账面价值 | 20,705,012,526.83 | 33,456,044,874.91 | 1,777,689,509.00 | - | - | 5,057,632,118.17 | 1,701,055,665.56 | 62,697,434,694.47 |
| 相关负债的账面价值 | 19,003,571,802.54 | 30,725,754,501.52 | 1,622,704,180.82 | - | - | 4,590,480,498.80 | 1,535,551,882.25 | 57,478,062,865.93 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债

本集团部分金融资产及金融负债于每个报告期末以公允价值进行后续计量。下表列示了这些金融资产及金融负债的公允价值如何确定的相关信息(包括公允价值层级、估值技术和所使用主要输入值)。

| 金融资产/金融负债 | 本集团 | | | 估值技术及主要输入值 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|---------------------|-------------------|-------------------|--------|--|------------------------|----------------------------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 公允价值层级 | | | |
| 1) 其他债权投资 | | | | | | |
| 债券 | | | | | | |
| - 在交易所上市的债券 | 27,054,264,562.21 | 36,821,013,228.03 | 第一层级 | 活跃市场报价 | 不适用 | 不适用 |
| - 银行间市场的债券 | 35,591,710,354.63 | 28,074,550,197.22 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作为主要参数进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 2) 其他权益工具投资 | | | | | | |
| 永续债投资 | | | | | | |
| - 在交易所上市的永续债 | 1,743,285,448.77 | 1,946,648,209.00 | 第一层级 | 活跃市场报价 | 不适用 | 不适用 |
| - 银行间市场的永续债 | 1,270,593,214.24 | 1,317,388,520.00 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于不同类型永续债的利率收益曲线作为主要参数进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 股票 | | | | | | |
| - 在交易所上市的股票 | 2,454,099,818.25 | 1,993,631,183.65 | 第一层级 | 活跃市场报价 | 不适用 | 不适用 |
| - 限售股 | 33,780,614.28 | 80,086,542.00 | 第三层级 | 现金流量折现法。公允价值系参考市场报价并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流动性折扣 | 折扣越高，公允价值越低。 |
| - 全国中小企业股份转让系统交易的股票 | 42,752,152.80 | 141,978,617.62 | 第二层级 | 最近成交价 | 不适用 | 不适用 |
| - 全国中小企业股份转让系统交易的股票 | 87,007,580.68 | 148,291,990.00 | 第三层级 | 公允价值系基于可比企业的财务比率(如市盈率)计算得到并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流动性折扣, 市盈率、市销率乘数 | 折扣越高, 公允价值越低、乘数越高, 公允价值越高。 |
| - 未上市股权 | 175,836,952.36 | 189,984,930.81 | 第三层级 | 公允价值系基于可比企业的财务比率(如市盈率)计算得到并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流动性折扣, 市盈率、市净率、市销率乘数 | 折扣越高, 公允价值越低、乘数越高, 公允价值越高。 |
| 其他投资 | | | | | | |
| - 证金公司专户投资 | 5,129,101,790.46 | 5,014,863,160.58 | 第二层级 | 所占份额对应的产品净值, 参考产品的资产净值, 按产品所投资的资产组合的可观察(报价)值及相关费用确定。 | 不适用 | 不适用 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

| 金融资产/金融负债 | 本集团 | | | 估值技术及主要输入值 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|---------------------|-------------------|-------------------|--------|---|-------------------------|----------------------------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 公允价值层级 | | | |
| 3) 交易性金融资产 | | | | | | |
| 债券 | | | | | | |
| - 在交易所上市的债券 | 16,088,427,710.81 | 19,926,770,431.56 | 第一层级 | 活跃市场报价。 | 不适用 | 不适用 |
| - 银行间市场的债券 | 10,888,803,129.83 | 10,648,419,956.17 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作为主要参数进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 股票 | | | | | | |
| - 在交易所上市的股票 | 4,858,186,522.88 | 4,164,111,734.38 | 第一层级 | 活跃市场报价。 | 不适用 | 不适用 |
| - 全国中小企业股份转让系统交易的股票 | 112,730,806.12 | 533,640,478.57 | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| - 全国中小企业股份转让系统交易的股票 | 184,610,504.06 | 68,837,850.80 | 第三层级 | 公允价值系基于可比企业的财务比率(如市盈率)计算得到并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流通性折扣, 市盈率、市净率、市销率乘数。 | 折扣越高, 公允价值越低、乘数越高, 公允价值越高。 |
| - 限售股 | 676,306,005.34 | 741,581,033.88 | 第三层级 | 现金流量折现法。公允价值系参考市场报价并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流通性折扣 | 折扣越高, 公允价值越低。 |
| - 未上市股权 | 3,008,084,292.04 | 2,617,415,165.38 | 第三层级 | 公允价值系基于可比企业的财务比率(如市盈率)计算得到并就缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流通性折扣, 市盈率、市净率、市销率乘数。 | 折扣越高, 公允价值越低、乘数越高, 公允价值越高。 |
| 基金 | | | | | | |
| - 在交易所上市的基金 | 1,905,889,650.85 | 1,670,636,403.15 | 第一层级 | 活跃市场报价 | 不适用 | 不适用 |
| - 其他基金 | 9,501,764,748.15 | 7,929,166,362.69 | 第二层级 | 基于基金的净值, 参考所投资的资产组合的可观察(报价)市值及相关费用确定。 | 不适用 | 不适用 |
| 其他投资 | | | | | | |
| - 金融机构发行的集合资产管理计划 | 18,371,376,631.07 | 11,018,349,801.88 | 第二层级 | 所占份额对应的产品净值, 参考产品的资产净值, 按产品所投资的资产组合的可观察(报价)市值及相关费用确定。 | 不适用 | 不适用 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

| 金融资产/金融负债 | 本集团 | | | 估值技术及主要输入值 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|------------------|------------------|------------------|--------|---|----------------|--------------------------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 公允价值层级 | | | |
| 3) 交易性金融资产 - 续 | | | | | | |
| 其他 - 续 | | | | | | |
| - 其他 | 23,397,015.06 | 260,592,667.75 | 第三层级 | 基于底层投资的净资产，并就交易对手信用风险作出折现调整而确定。 | 折现率 | 折现率越高，公允价值越低。 |
| - 在交易所上市的永续债 | 4,656,819,018.27 | 5,829,425,929.70 | 第一层级 | 活跃市场报价。 | 不适用 | 不适用 |
| - 银行间市场的永续债 | 2,424,721,008.22 | 1,492,145,670.00 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于不同类型永续债的利率收益曲线作为主要参数进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 4) 交易性金融负债 | | | | | | |
| 借入债券 | | | | | | |
| - 银行间市场的债券 | 2,254,362,770.18 | 4,124,611,741.87 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于不同类型债券的利率收益曲线作为主要参数进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 黄金借贷 | 9,906,000,000.00 | 7,514,640,000.00 | 第一层级 | 活跃市场报价。 | 不适用 | 不适用 |
| 合并结构化主体其他份额持有人利益 | 819,690,257.55 | 286,059,246.99 | 第二层级 | 所占份额对应的产品净值，参考产品的资产净值，按产品所投资的资产组合的可观察(报价)市值及相关费用确定。 | 不适用 | 不适用 |
| 合并结构化主体其他份额持有人利益 | 442,835,720.06 | - | 第三层级 | 所占份额对应的结构化主体净值，参考结构化主体的资产净值，基于可比企业的财务比率(如市盈率)计算得到并就结构化主体所投资的资产缺乏市场流动性作出折现调整而确定。 | 缺乏流动性折扣，市盈率乘数。 | 折扣越高，公允价值越低、乘数越高，公允价值越高。 |
| 其他 | 684,641,276.44 | 705,649,606.20 | 第二层级 | 底层挂钩资产的成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 其他 | 468,543,120.00 | - | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于期货交易所标的黄金报价以及本公司和交易对手协议里所协定的价格而计算的相关标的黄金收益率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

| 金融资产/金融负债 | 本集团 | | | 估值技术及主要输入值 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|----------------|------------------|------------------|--------|--|-----------|----------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 公允价值层级 | | | |
| 5) 衍生金融工具 | | | | | | |
| 利率互换 - 资产 | 1,728,173.16 | 1,702,837.50 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量是根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率,并按反应交易对手信贷风险的利率折现。 | 不适用 | 不适用 |
| 利率互换 - 负债 | (11,355,436.62) | - | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量是根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率,并按反应交易对手信贷风险的利率折现。 | 不适用 | 不适用 |
| 股指期货合约 - 资产 | 332,204.60 | - | 第一层级 | 活跃市场报价。 | 不适用 | 不适用 |
| 股指期货合约 - 负债 | (301,833.95) | - | 第一层级 | 活跃市场报价。 | 不适用 | 不适用 |
| 权益类收益互换 - 资产 | 2,336,676.57 | 720,042.54 | 第二层级 | 基于中国证券交易所报价计算的相关标的权益证券收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 权益类收益互换 - 负债 | (2,482,843.47) | - | 第二层级 | 基于中国证券交易所报价计算的相关标的权益证券收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 嵌入期权式收益凭证 - 负债 | (34,689.43) | (3,479,837.25) | 第二层级 | 根据合约利率并考虑标的资产市场报价来进行相关计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 股票期权 - 资产 | 70,875,468.89 | 22,051,199.29 | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 股票期权 - 负债 | (58,197,099.42) | (49,636,713.49) | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 股票挂钩工具 - 资产 | 249,534.90 | - | 第二层级 | 基于中国证券交易所对相关标的权益证券的报价与本公司和交易对手协议里所协定的固定价格的差额进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 股票挂钩工具 - 负债 | (17,120,144.19) | (4,275,026.90) | 第二层级 | 基于中国证券交易所对相关标的权益证券的报价与本公司和交易对手协议里所协定的固定价格的差额进行计算。 | 不适用 | 不适用 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

| 金融资产/金融负债 | 本集团 | | | 估值技术及主要输入值 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|---------------|------------------|--------------------|--------|--|-----------|----------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 公允价值层级 | | | |
| 5) 衍生金融工具 - 续 | | | | | | |
| 信用违约互换 - 资产 | 650,958.15 | 1,102,279.34 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于合约利率，考虑标的资产信用违约风险，并按反应交易对手信贷风险的利率折现。 | 不适用 | 不适用 |
| 信用违约互换 - 负债 | (3,150,669.29) | (5,314,021.73) | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量基于合约利率，考虑标的资产信用违约风险，并按反应交易对手信贷风险的利率折现。 | 不适用 | 不适用 |
| 商品期货 - 资产 | - | 24,017,161.84 | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 黄金掉期 - 资产 | - | 500,644,000.00 | 第二层级 | 基于底层挂钩黄金的市场报价进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 黄金掉期 - 负债 | (49,029,150.00) | - | 第二层级 | 基于底层挂钩黄金的市场报价进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 黄金远期 - 负债 | (36,223,621.89) | (5,378,000.00) | 第二层级 | 基于底层挂钩黄金的市场报价进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 商品期权 - 资产 | 12,473,079.50 | 16,189,267.50 | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 商品期权 - 负债 | (1,371,680.00) | (10,278,325.38) | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 黄金期权 - 资产 | 12,852,855.69 | 35,777,364.46 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量体现看涨期权与看跌期权行权价之间的价差，并按可观察的收益曲线折现。 | 不适用 | 不适用 |
| 黄金期权 - 负债 | (268,564,073.99) | (2,555,328,059.77) | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量体现看涨期权与看跌期权行权价之间的价差，并按可观察的收益曲线折现。 | 不适用 | 不适用 |
| 货币互换 - 资产 | - | 6,897,985.94 | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 货币互换 - 负债 | (15,001,917.24) | (4,174,594.61) | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

| 金融资产/金融负债 | 本集团 | | | 估值技术及主要输入值 | 重大不可观察输入值 | 对公允价值的影响 |
|---------------|------------------|------------------|--------|---|-----------|----------|
| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 | 公允价值层级 | | | |
| 5) 衍生金融工具 - 续 | | | | | | |
| 非权益类收益互换 - 资产 | 4,564,634.73 | - | 第二层级 | 基于相关标的证券报价计算的收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 非权益类收益互换 - 负债 | (615,340.04) | (5,510,223.23) | 第二层级 | 基于相关标的证券报价计算的收益与本公司和交易对手互换协议里所协定的固定收益的差额进行计算。 | 不适用 | 不适用 |
| 外汇期货- 资产 | 47,509.16 | - | 第二层级 | 最近成交价。 | 不适用 | 不适用 |
| 外汇远期 - 资产 | 49,738,780.56 | - | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 外汇远期 - 负债 | (41,465,993.00) | - | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量根据远期汇率(报告期末可观察的远期汇率)及合约汇率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 利率互换期权 - 资产 | 26,593.85 | - | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |
| 利率互换期权 - 负债 | (42,203.95) | - | 第二层级 | 现金流量折现法。未来现金流量根据远期利率(报告期末可观察的收益率曲线)及合约利率进行估算。 | 不适用 | 不适用 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

| | 2020 年 12 月 31 日 | | | |
|----------|-------------------|-------------------|------------------|--------------------|
| | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 总计 |
| | 人民币 | 人民币 | 人民币 | 人民币 |
| 金融资产： | | | | |
| 其他债权投资 | | | | |
| - 债券 | 27,054,264,562.21 | 35,591,710,354.63 | - | 62,645,974,916.84 |
| 其他权益工具投资 | | | | |
| - 股票 | 2,454,099,818.25 | 42,752,152.80 | 296,625,147.32 | 2,793,477,118.37 |
| - 永续债投资 | 1,743,285,448.77 | 1,270,593,214.24 | - | 3,013,878,663.01 |
| - 其他 | - | 5,129,101,790.46 | - | 5,129,101,790.46 |
| 交易性金融资产 | | | | |
| - 债券 | 16,088,427,710.81 | 10,888,803,129.83 | - | 26,977,230,840.64 |
| - 股票 | 4,858,186,522.88 | 112,730,806.12 | 3,869,000,801.44 | 8,839,918,130.44 |
| - 基金 | 1,905,889,650.85 | 9,501,764,748.15 | - | 11,407,654,399.00 |
| - 其他 | 4,656,819,018.27 | 20,796,097,639.29 | 23,397,015.06 | 25,476,313,672.62 |
| 衍生金融资产 | 332,204.60 | 155,544,265.16 | - | 155,876,469.76 |
| 总计 | 58,761,304,936.64 | 83,489,098,100.68 | 4,189,022,963.82 | 146,439,426,001.14 |
| 金融负债： | | | | |
| 交易性金融负债 | 9,906,000,000.00 | 4,227,237,424.17 | 442,835,720.06 | 14,576,073,144.23 |
| 衍生金融负债 | 301,833.95 | 504,654,862.53 | - | 504,956,696.48 |
| 总计 | 9,906,301,833.95 | 4,731,892,286.70 | 442,835,720.06 | 15,081,029,840.71 |

| | 2019 年 12 月 31 日 | | | |
|----------|-------------------|-------------------|------------------|--------------------|
| | 第一层级 | 第二层级 | 第三层级 | 总计 |
| | 人民币 | 人民币 | 人民币 | 人民币 |
| 金融资产： | | | | |
| 其他债权投资 | | | | |
| - 债券 | 36,821,013,228.03 | 28,074,550,197.22 | - | 64,895,563,425.25 |
| 其他权益工具投资 | | | | |
| - 股票 | 1,993,631,183.65 | 141,978,617.62 | 418,363,462.81 | 2,553,973,264.08 |
| - 永续债投资 | 1,946,648,209.00 | 1,317,388,520.00 | - | 3,264,036,729.00 |
| - 其他 | - | 5,014,863,160.58 | - | 5,014,863,160.58 |
| 交易性金融资产 | | | | |
| - 债券 | 19,926,770,431.56 | 10,648,419,956.17 | - | 30,575,190,387.73 |
| - 股票 | 4,164,111,734.38 | 533,640,478.57 | 3,427,834,050.06 | 8,125,586,263.01 |
| - 基金 | 1,670,636,403.15 | 7,929,166,362.69 | - | 9,599,802,765.84 |
| - 其他 | 5,829,425,929.70 | 12,510,495,471.88 | 260,592,667.75 | 18,600,514,069.33 |
| 衍生金融资产 | - | 609,102,138.41 | - | 609,102,138.41 |
| 总计 | 72,352,237,119.47 | 66,779,604,903.14 | 4,106,790,180.62 | 143,238,632,203.23 |
| 金融负债： | | | | |
| 交易性金融负债 | 7,514,640,000.00 | 5,116,320,595.06 | - | 12,630,960,595.06 |
| 衍生金融负债 | - | 2,643,374,802.36 | - | 2,643,374,802.36 |
| 总计 | 7,514,640,000.00 | 7,759,695,397.42 | - | 15,274,335,397.42 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(一) 持续以公允价值计量的金融资产及金融负债 - 续

2020 年度及 2019 年度，本集团按公允价值计量的金融工具在第一层级和第二层级之间无重大转移。

下表列示了公允价值在第三层级计量的金融资产的变动情况

其他权益工具投资

| | 2020 年度 | 2019 年度 |
|-----------------|------------------|------------------|
| | 人民币 | 人民币 |
| 年初余额 | 418,363,462.81 | 632,882,020.63 |
| 计入其他综合收益的公允价值变动 | (133,464,554.98) | (39,829,501.02) |
| 买入 | 39,410,716.80 | - |
| 转入第三层级 | 145,840,221.68 | 175,708,077.00 |
| 转出第三层级(注 1) | (137,061,615.68) | (301,257,663.42) |
| 处置 | (36,463,083.31) | (49,139,470.38) |
| 年末余额 | 296,625,147.32 | 418,363,462.81 |

交易性金融资产

| | 2020 年度 | 2019 年度 |
|-------------|--------------------|--------------------|
| | 人民币 | 人民币 |
| 年初余额 | 3,688,426,717.81 | 4,149,793,053.79 |
| 计入损益的公允价值变动 | (183,912,428.84) | 222,013,918.65 |
| 买入 | 1,880,152,301.45 | 1,548,991,915.29 |
| 转入第三层级 | 420,434,310.97 | 317,727,045.83 |
| 转出第三层级(注 1) | (1,420,857,075.35) | (1,595,239,943.05) |
| 处置 | (491,846,009.54) | (954,859,272.70) |
| 年末余额 | 3,892,397,816.50 | 3,688,426,717.81 |

注 1: 此处主要包括之前在全国中小企业股份转让系统交易的停牌股和在交易所上市的限售股。其中: 当全国中小企业股份转让系统交易的股票复牌可在市场进行交易时, 其公允价值计量层级从第三层级转至第二层级; 当交易所上市的限售股已经解禁可在市场进行交易时, 其公允价值计量层级从第三层级转至第一层级。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十三、公允价值的披露 - 续

(二) 不持续以公允价值计量的金融资产及金融负债

集团不持续以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、应收款项、存出保证金、其他金融资产、短期借款、应付短期融资产款、拆入资金、卖出回购金融资产款、长期借款、代理买卖证券款、应付款项、应付债券和其他金融负债等。

本集团管理层认为，除以下项目外，年末其他以摊余成本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。

| | 2020 年 12 月 31 日 | | 2019 年 12 月 31 日 | |
|--------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| | 账面价值 | 公允价值 | 账面价值 | 公允价值 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 金融资产 | | | | |
| - 债权投资 | 6,243,897,149.81 | 6,242,304,714.29 | 7,193,554,228.81 | 7,191,384,814.24 |
| 金融负债 | | | | |
| - 应付债券 | | | | |
| - 公司债券 | 28,280,530,622.12 | 28,446,997,200.00 | 26,202,985,141.92 | 26,462,646,200.00 |
| - 次级债券 | 17,414,768,590.67 | 17,412,690,500.00 | 27,070,474,786.85 | 27,069,055,800.00 |
| - 收益凭证 | 6,113,681,086.38 | 5,943,530,251.24 | 4,149,810,499.62 | 4,098,396,888.47 |
| - 海外债券 | 10,456,493,198.51 | 10,694,234,491.95 | 9,885,928,341.01 | 9,960,236,086.69 |
| - 总计 | 62,265,473,497.68 | 62,497,452,443.19 | 67,309,198,769.40 | 67,590,334,975.16 |

十四、承诺事项

1、资本承诺

| | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|---------------------------|------------------|------------------|
| | 人民币元 | 人民币元 |
| 至资产负债表日止，已签约但尚未于财务报表中确认的： | | |
| - 购建长期资产承诺 | 49,320,699.83 | 49,529,841.72 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十五、资产负债表日后事项

1、 发行短期融资券和公司债券

本公司于 2021 年 1 月 27 日发行了“东方证券股份有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）（第一期）”，发行总额为人民币 40 亿元，债券期限 3 年，票面利率为 3.60%。

本公司于 2021 年 3 月 8 日发行了“东方证券股份有限公司 2021 年公开发行次级债券（第一期）”，发行总额为人民币 25 亿元，债券期限 3 年，票面利率为 3.95%。

2、 利润分配

经 2021 年 3 月 30 日第五届董事会第二次会议审议通过，公司 2020 年度利润分配预案为以 2020 年末总股本 6,993,655,803 股为基数，每 10 股派发现金股利 2.50 元(含税)，该项议案尚需提交公司 2020 年度股东大会审议。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十六、其他重要事项

1、 分部报告

(1) 分部报告的确定依据与会计政策

本集团以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。本集团的经营业务根据业务的性质以及所提供的产品和劳务分开组织和管理。

以下是对本集团经营分部详细信息的概括：

证券销售及交易业务涵盖自营交易和另类投资等，主要包括买卖股票、债券、基金、衍生品、另类投资及其他金融产品所赚取的投资收益等，以及提供相关投资研究活动赚取的費用等；

投资管理业务主要包括向客户提供资产管理、基金管理及私募股权投资管理服务所赚取的管理费及咨询费，以及来自私募股权投资的投资收益；

经纪及证券金融业务主要包括证券经纪、期货经纪业务所赚取的手续费及佣金，大宗商品交易以及提供融资融券服务所赚取的利息等；

投资银行业务主要包括证券承销及保荐、以及提供财务顾问服务而赚取的手续费及佣金；

管理本部及其他主要涵盖公司总部运营及香港海外业务，包括因一般营运资金用途而赚取的利息收入及产生的支出。

分部报告信息根据各分部向管理层报告时采用的会计政策及计量基础披露，这些会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础保持一致。

分部利润/(亏损)指分摊所得税费用前各分部所赚得的利润/所产生的亏损，该指标提交管理层供其分配资源及评估业绩。

分部资产/负债分配予各分部。

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十六、其他重要事项 - 续

1、 分部报告 - 续

(2) 报告分部的财务信息

| | 本金额 | | | | | | | |
|-----------|--------------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---------------------|--------------------|
| | 经纪及证券金融 | 证券销售及交易 | 投资银行 | 投资管理 | 管理本部及其他 | 抵销前合计 | 抵销 | 合计 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一：营业收入 | 13,602,798,461.73 | 4,752,700,584.11 | 1,627,838,932.64 | 4,393,061,645.79 | (579,325,552.49) | 23,797,074,071.78 | (663,127,306.49) | 23,133,946,765.29 |
| 手续费及佣金净收入 | 2,398,083,805.23 | 220,676,987.05 | 1,560,662,895.89 | 2,877,491,643.91 | 171,821,435.66 | 7,228,736,767.74 | (107,206,267.64) | 7,121,530,500.10 |
| 投资收益 | 334,987,904.17 | 2,754,378,394.95 | 36,108,796.86 | 1,345,603,197.41 | 1,122,395,054.89 | 5,593,473,348.28 | (581,844,041.14) | 5,011,629,307.14 |
| 利息净收入 | 2,062,703,893.44 | 1,482,699,860.81 | 25,412,943.97 | 51,090,778.09 | (2,869,430,635.50) | 752,476,840.81 | 26,295,778.10 | 778,772,618.91 |
| 其他收入 | 8,807,022,858.89 | 294,945,341.30 | 5,654,295.92 | 118,876,026.38 | 995,888,592.46 | 10,222,387,114.95 | (372,775.81) | 10,222,014,339.14 |
| 二：营业支出 | 14,652,993,460.54 | 765,481,187.11 | 934,704,025.33 | 2,040,308,399.58 | 2,127,770,576.60 | 20,521,257,649.16 | (84,103,425.41) | 20,437,154,223.75 |
| 三：营业利润 | (1,050,194,998.81) | 3,987,219,397.00 | 693,134,907.31 | 2,352,753,246.21 | (2,707,096,129.09) | 3,275,816,422.62 | (579,023,881.08) | 2,696,792,541.54 |
| 四：分部资产 | 114,848,731,131.86 | 108,038,849,695.86 | 2,599,190,764.37 | 12,257,302,395.54 | 70,597,344,183.62 | 308,341,418,171.25 | (17,223,976,586.82) | 291,117,441,584.43 |
| 五：分部负债 | 75,823,775,960.72 | 57,293,144,347.14 | 1,048,107,533.16 | 2,411,486,796.59 | 95,826,184,980.52 | 232,402,699,618.13 | (1,516,402,062.88) | 230,886,297,555.25 |
| 六、补充信息 | | | | | | | | |
| 1、折旧和摊销费用 | 258,133,889.92 | 21,988,049.14 | 40,462,649.33 | 73,335,273.85 | 269,076,542.03 | 662,996,404.27 | (807,782.25) | 662,188,622.02 |
| 2、资本性支出 | 216,244,717.51 | 2,367,650.49 | 49,883,479.00 | 49,924,719.97 | 343,584,852.03 | 662,005,419.00 | - | 662,005,419.00 |
| 3、信用减值损失 | 3,727,585,291.57 | 151,867,047.51 | 13,206.46 | 326,017.76 | 5,340,877.86 | 3,885,132,441.16 | - | 3,885,132,441.16 |

| | 上年金额 | | | | | | | |
|-----------|-------------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|---------------------|--------------------|
| | 经纪及证券金融 | 证券销售及交易 | 投资银行 | 投资管理 | 管理本部及其他 | 抵销前合计 | 抵销 | 合计 |
| | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 | 人民币元 |
| 一：营业收入 | 13,335,976,137.75 | 3,221,398,440.49 | 1,003,144,846.03 | 2,907,173,304.92 | (385,413,043.76) | 20,082,279,685.43 | (1,030,182,371.68) | 19,052,097,313.75 |
| 手续费及佣金净收入 | 1,390,626,582.25 | 133,755,245.50 | 948,125,534.93 | 1,925,944,847.74 | 186,835,297.54 | 4,585,287,507.96 | (69,624,978.34) | 4,515,662,529.62 |
| 投资收益 | 149,384,883.66 | 1,208,587,243.95 | 25,527,043.84 | 862,141,696.21 | 2,332,848,208.92 | 4,578,489,076.58 | (1,163,767,191.39) | 3,414,721,885.19 |
| 利息净收入 | 2,438,642,287.56 | 1,277,121,563.72 | 29,173,665.81 | 31,499,646.90 | (2,905,027,062.61) | 871,410,101.38 | 19,211,894.49 | 890,621,995.87 |
| 其他收入 | 9,357,322,384.28 | 601,934,387.32 | 318,601.45 | 87,587,114.07 | (69,487.61) | 10,047,092,999.51 | 183,997,903.56 | 10,231,090,903.07 |
| 二：营业支出 | 11,949,881,976.91 | 487,379,250.96 | 630,433,486.70 | 1,316,287,659.69 | 1,978,818,682.18 | 16,362,801,056.44 | (62,137,554.39) | 16,300,663,502.05 |
| 三：营业利润 | 1,386,094,160.84 | 2,734,019,189.53 | 372,711,359.33 | 1,590,885,645.23 | (2,364,231,725.94) | 3,719,478,628.99 | (968,044,817.29) | 2,751,433,811.70 |
| 四：分部资产 | 86,070,721,004.50 | 110,485,910,398.07 | 1,998,944,794.29 | 10,121,840,063.69 | 70,608,818,389.59 | 279,286,234,650.14 | (16,314,793,080.01) | 262,971,441,570.13 |
| 五：分部负债 | 44,881,155,975.67 | 62,661,275,699.95 | 527,263,876.89 | 1,272,779,693.88 | 101,456,199,630.11 | 210,798,674,876.50 | (1,838,870,039.21) | 208,959,804,837.29 |
| 六、补充信息 | | | | | | | | |
| 1、折旧和摊销费用 | 220,963,528.94 | 17,287,190.32 | 31,064,509.62 | 40,084,708.78 | 246,251,409.16 | 555,651,346.82 | (1,116,543.78) | 554,534,803.04 |
| 2、资本性支出 | 209,564,490.87 | 1,465,850.87 | 87,684,198.43 | 227,699,679.08 | 229,917,482.83 | 756,331,702.08 | (11,642,696.43) | 744,689,005.65 |
| 3、信用减值损失 | 983,792,557.38 | 57,932,320.19 | 759.64 | (6,263,104.81) | 8,995,518.06 | 1,044,458,050.46 | - | 1,044,458,050.46 |

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

十六、其他重要事项 - 续

- 2、 2020 年第一次临时股东大会于 7 月 13 日审批通过本公司员工持股计划的议案，并授权董事会全权办理本公司员工持股计划相关事宜。本公司选任汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“汇添富”)作为员工持股计划的资产管理机构，并代表该计划与汇添富分别签署两份资产管理计划合约，即汇添富—东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划及汇添富—东方证券员工持股计划 2 号单一资产管理计划(以下合计简称“资管计划”)。根据公告的员工持股计划，该员工持股计划的资金来源为员工合法薪酬、自筹资金以及法律、法规允许的其他方式，本公司不得向持有人提供垫资、担保、借贷等财务资助。资管计划通过沪港股票市场交易互联互通机制及/或深港股票市场交易互联互通机制在二级市场购买并持有本公司 H 股股票，员工持股计划的资产独立于本公司的固有财产。截至 2020 年 12 月 31 日，本公司员工持股计划已通过资管计划在二级市场累计买入本公司 H 股股票 65,906,800 股，约占本公司总股本的比例为 0.94%。

十七、财务报表之列报

因财务报表项目列报方式的变化，本财务报表比较数据已按照当年列报方式进行了重新列报。

十八、财务报表之批准

本财务报表业经公司董事会于 2021 年 3 月 30 日批准报出。

财务报表结束

财务报表附注

2020 年 12 月 31 日止年度

1、当期非经常性损益明细表

| 项目 | 本年发生额 | 上年发生额 |
|---|-----------------|-----------------|
| | 人民币 | 人民币 |
| 非流动资产处置损益 | (536,676.75) | (187,362.49) |
| 计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关,按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外) | 134,641,344.78 | 154,765,462.96 |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出 | (40,048,202.10) | (51,668,565.86) |
| 所得税影响额 | (31,931,384.66) | (34,577,651.70) |
| 少数股东权益影响额(税后) | (1,625,000.00) | (4,663,080.25) |
| 合计 | 60,500,081.27 | 63,668,802.66 |

本集团持有交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产、交易性金融资产、债权投资和贷款期间取得的投资收益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具、债权投资和其他债权投资取得的投资收益不作为非经常性损益项目，而界定为经常性损益项目的原因为：本集团作为证券经营机构，上述业务均属于本集团的正常经营业务。

2、净资产收益率及每股收益

本净资产收益率和每股收益计算表是本公司按照中国证监会颁布的《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 09 号-净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010 年修订)的有关规定而编制的。

| 报告期利润 | 加权平均净资产收益率(%) | 每股收益(元) | |
|-------------------------|---------------|---------|--------|
| | | 基本每股收益 | 稀释每股收益 |
| 归属于公司普通股股东的净利润 | 4.85 | 0.38 | N/A |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润 | 4.74 | 0.37 | N/A |

本公司 2020 年度不存在稀释性潜在普通股。

第十二节 备查文件目录

| | |
|--------|--|
| 备查文件目录 | 经法定代表人签字和公司盖章的本次年度报告全文和摘要 |
| 备查文件目录 | 经法定代表人、主管会计工作的负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签字并盖章的2020年年度财务会计报告 |
| 备查文件目录 | 其他 |

董事长：金文忠

董事会批准报送日期：2021 年 3 月 30 日

修订信息

适用 不适用

第十三节 证券公司信息披露

一、 公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

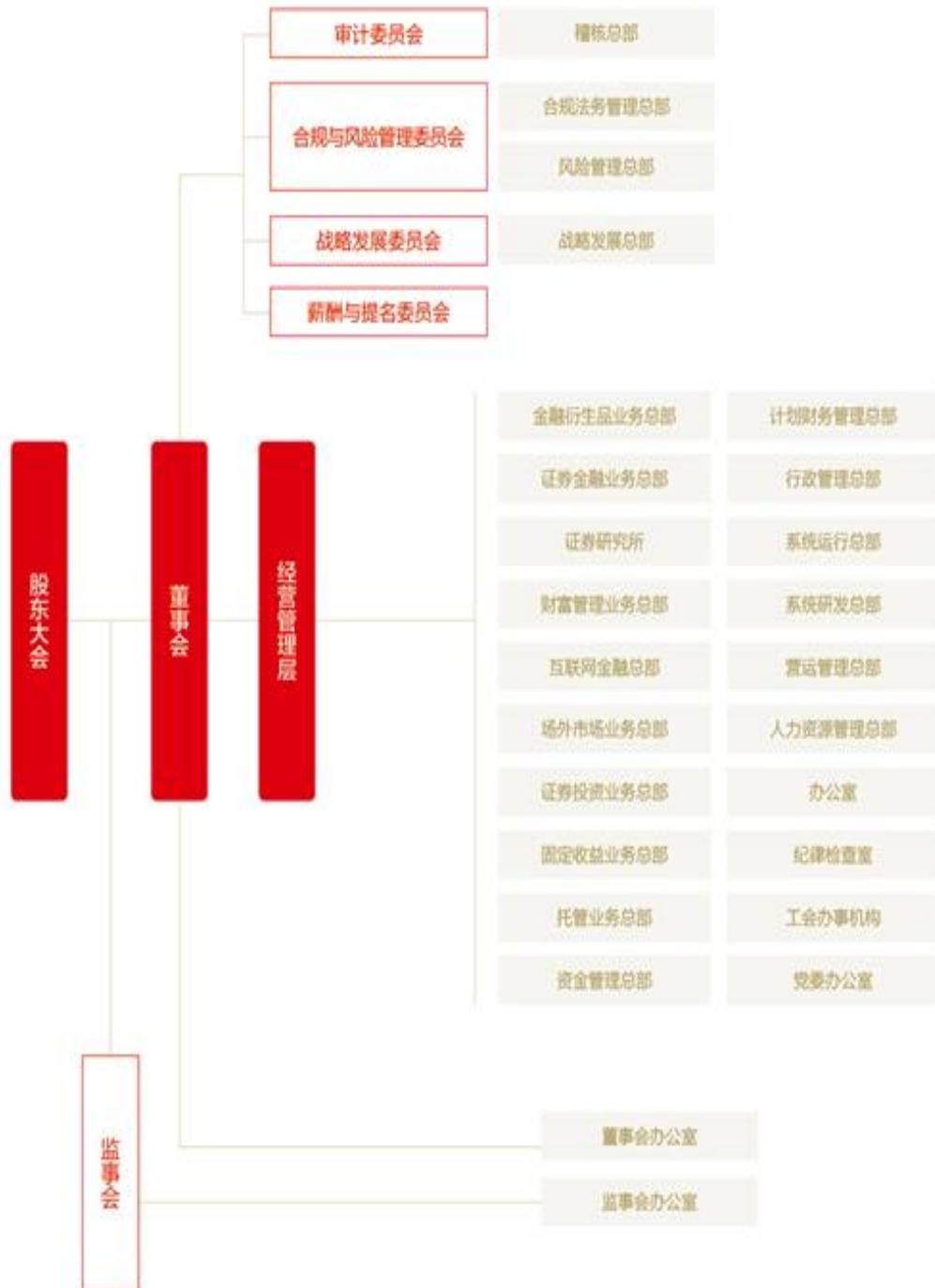
| 序号 | 发文单位 | 文件标题 | 文号 | 发文日期 |
|----|-------------------|--------------------------------------|------------------|------------|
| 1 | 国家外汇管理局 | 关于东方证券股份有限公司结售汇业务经营资格的批复 | 汇复【2020】10号 | 2020年1月16日 |
| 2 | 上交所 | 关于对东方证券股份有限公司非公开发行公司债券挂牌转让无异议的函 | 上证函【2020】160号 | 2020年1月21日 |
| 3 | 上海证监局 | 关于核准东方证券股份有限公司变更公司章程重要条款的批复 | 沪证监许可【2020】25号 | 2020年4月30日 |
| 4 | 中国证监会 | 关于东方证券股份有限公司向东方金融控股（香港）有限公司增资有关意见的复函 | 机构部函【2020】1412号 | 2020年6月15日 |
| 5 | 中国证监会 | 关于东方证券股份有限公司发行永续次级债券有关意见的复函 | 机构部函【2020】1577号 | 2020年6月30日 |
| 6 | 国家外汇管理局 | 代客外汇业务备案的函 | 汇综便函【2020】482号 | 2020年7月21日 |
| 7 | 中华人民共和国国家发展和改革委员会 | 企业借用外债备案登记证明 | 发改办外资备【2020】502号 | 2020年7月23日 |
| 8 | 上海市发展和改革委员会 | 境外投资项目备案通知书 | 沪发改开放【2020】194号 | 2020年8月12日 |

二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2020年公司分类评级结果获评A类A级。

附录一：东方证券股份有限公司组织架构图



附录二：公司各证券营业部情况

截至报告期末，公司证券营业部 177 家。

| 证券营业部名称 | 注册地址（中国） | 成立时间 |
|----------------------------|--|------------------|
| 东方证券股份有限公司上海杨浦区杨树浦路证券营业部 | 上海市杨浦区杨树浦路 318 号 2 层 | 1993 年 12 月 9 日 |
| 东方证券股份有限公司上海静安区乌鲁木齐北路证券营业部 | 上海市静安区乌鲁木齐北路 480 号 2 楼 | 1994 年 10 月 28 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区南门大街证券营业部 | 上海市浦东新区南门大街 128 号 | 1995 年 2 月 20 日 |
| 东方证券股份有限公司深圳金田路证券营业部 | 广东省深圳市福田区福华三路 100 号鼎和大厦 17 楼 01、02 单元 | 1995 年 7 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司上海长宁区遵义南路证券营业部 | 上海市长宁区遵义南路 88 号 101 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海长宁区长宁路证券营业部 | 上海市长宁区长宁路 546 号 1 号楼 1303 单元 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海杨浦区安波路证券营业部 | 上海市杨浦区安波路 521 号一层 2 室、二层、三层 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海徐汇区肇嘉浜路证券营业部 | 上海市徐汇区肇嘉浜路 333 号 9 楼 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海徐汇区广元西路证券营业部 | 上海市徐汇区广元西路 315 号 2 幢 6 楼 B、C 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海普陀区云岭东路证券营业部 | 上海市普陀区云岭东路 235、245 号 2 楼 202 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海普陀区光新路证券营业部 | 上海市普陀区光新路 88 号 401-403 室、405-406 室、2201-2203 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区源深路证券营业部 | 上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 3 楼 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区耀华路证券营业部 | 上海浦东新区耀华路 488 号 1 楼 107 室、16 楼 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区新川路证券营业部 | 上海市浦东新区市新川路 611 号 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区平度路证券营业部 | 上海市浦东新区平度路 258 号 3 幢 247 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区牡丹路证券营业部 | 上海市浦东新区牡丹路 60 号 6 楼 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区周东路证券营业部 | 上海市浦东新区川周公路 4128 号 1 楼、2 楼, 周东路 716、718 号 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海闵行区鹤庆路证券营业部 | 上海市闵行区鹤庆路 338 号 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海徐汇区宜山路证券营业部 | 上海市徐汇区宜山路 700 号 85 幢 2 楼 201 单元 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海闵行区都市路证券营业部 | 上海市闵行区都市路 2635 弄 27 号一楼 107 室、13 号三楼 310 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海静安区万荣路证券营业部 | 上海市静安区万荣路 777 弄 1 号楼 102-1、703-2、703-3 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海嘉定区曹安公路证券营业部 | 上海市嘉定区曹安公路 1685 号 1 层 106、107、108 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海黄浦区中华路证券营业部 | 上海市黄浦区中华路 1600 号西侧 301-304 室、803、804 室 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海黄浦区凤阳路证券营业部 | 上海市黄浦区凤阳路 310 号 | 1998 年 6 月 23 日 |

| | | |
|--------------------------|--|------------------|
| 东方证券股份有限公司上海黄浦区北京东路证券营业部 | 上海市黄浦区北京东路 270 号 5 层主楼 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海虹口区海宁路证券营业部 | 上海市虹口区海宁路 307 号（1 楼 C 室，12 楼）， | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海宝山区长江西路证券营业部 | 上海市宝山区长江西路 1952 弄 2 号 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司上海宝山区殷高西路证券营业部 | 上海市宝山区殷高西路 638 号 2 楼 | 1998 年 6 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司抚顺裕民路证券营业部 | 辽宁省抚顺市新抚区裕民路 15 号（浙商国际商贸城 6 号馆四、五层） | 1998 年 8 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司抚顺辽中街证券营业部 | 辽宁省抚顺市望花区辽中街 25-2 号 | 1998 年 8 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司北京安立路证券营业部 | 北京市朝阳区北辰东路 8 号院 27 号楼 2 层 202 号、203 号, 3 层 301 号 | 2001 年 4 月 4 日 |
| 东方证券股份有限公司成都建设路证券营业部 | 四川省成都市成华区建设路 9 号 1 栋 21 层 2102、2103 室 | 2001 年 4 月 11 日 |
| 东方证券股份有限公司抚顺清原证券营业部 | 辽宁省抚顺市清原满族自治县清原镇红河路 49 号 | 2001 年 12 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司抚顺新华大街证券营业部 | 辽宁省抚顺市顺城区新华大街 20 号楼 9 号 | 2002 年 3 月 28 日 |
| 东方证券股份有限公司广州宝岗大道证券营业部 | 广东省广州市海珠区宝岗大道 283 号五楼 | 2002 年 4 月 21 日 |
| 东方证券股份有限公司长沙劳动西路证券营业部 | 湖南省长沙市劳动西路 471 号 | 2002 年 6 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司杭州五星路证券营业部 | 浙江省杭州市江干区五星路 185 号（民生金融中心二层） | 2002 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司苏州西环路证券营业部 | 江苏省苏州市西环路 2115 号裙楼北一楼 | 2005 年 8 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司天津西康路证券营业部 | 天津市和平区西康路 42 号 | 2006 年 5 月 10 日 |
| 东方证券股份有限公司南京北京东路证券营业部 | 江苏省南京市玄武区北京东路 31 号工艺美术大楼 | 2006 年 5 月 10 日 |
| 东方证券股份有限公司桂林中山中路证券营业部 | 广西壮族自治区桂林市中山中路 16 号金泰大厦四楼 | 2006 年 5 月 10 日 |
| 东方证券股份有限公司武汉三阳路证券营业部 | 湖北省武汉市江岸区三阳路 118 号金阳新城 A 座 1 层 2 室、5 层 | 2006 年 5 月 11 日 |
| 东方证券股份有限公司北海北海大道证券营业部 | 广西壮族自治区北海北海大道 187 号逢胜大厦三层 0301 号 | 2006 年 5 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司汕头长平路证券营业部 | 广东省汕头市长平路 161 号艺苑大厦一楼及九至十一楼 | 2006 年 5 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司上海杨浦区控江路证券营业部 | 上海市杨浦区控江路 1555 号 101 室、2508 室 | 2006 年 5 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司沈阳南八中路证券营业部 | 辽宁省沈阳市铁西区南八中路 25 号 | 2006 年 5 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司沈阳长江南街证券营业部 | 辽宁省沈阳市皇姑区长江南街 169 号 | 2006 年 5 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司南宁金湖路证券营业部 | 广西壮族自治区南宁市金湖路 26-1 号东方商务港一层 10 号商铺、二层 2A4/2A5 号 | 2006 年 5 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司沈阳大北关街证券营业部 | 辽宁省沈阳市大东区大北关街 79 号 3-4 层 | 2006 年 5 月 16 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区张杨路证券营业部 | 上海市浦东新区张杨路 638 号 | 2006 年 5 月 17 日 |

| | | |
|--------------------------|--|------------------|
| 东方证券股份有限公司深圳深南大道证券营业部 | 广东省深圳市福田区深南大道 7888 号东海国际中心 A 座 22 楼 | 2006 年 5 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司沈阳市府大路证券营业部 | 辽宁省沈阳市沈河区市府大路 423 号 2 门、3 门 | 2006 年 6 月 14 日 |
| 东方证券股份有限公司北京学院路证券营业部 | 北京市海淀区学院路 30 号科大天工大厦 B 座 12 层 | 2006 年 7 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司长春同志街证券营业部 | 吉林省长春市朝阳区同志街 2400 号火炬大厦七楼 705、707-712 室 | 2006 年 7 月 31 日 |
| 东方证券股份有限公司杭州龙井路证券营业部 | 浙江省杭州市龙井路 53 号 | 2006 年 8 月 1 日 |
| 东方证券股份有限公司广州平月路证券营业部 | 广东省广州市平月路 161 号 | 2006 年 8 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司济南华信路证券营业部 | 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 108 室、1302-1307 室 | 2007 年 4 月 9 日 |
| 东方证券股份有限公司群众东路证券营业部 | 福建省福州市台江区新港街道群众东路 93 号三木大厦 1 层、5 层 | 2007 年 8 月 24 日 |
| 东方证券股份有限公司上海松江区沪亭北路证券营业部 | 上海市松江区沪亭北路 199 弄 1 号 901-8 室、901-9 室、901-10 室 上海市松江区沪亭北路 199 弄 5 号 127 室 | 2010 年 6 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司上海松江区新松江路证券营业部 | 上海市松江区新松江路 251 号 | 2010 年 7 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司上海金山区卫清西路证券营业部 | 上海市金山区卫清西路 132 号、134 号、128 弄 17 号 | 2011 年 6 月 30 日 |
| 东方证券股份有限公司上海青浦区公园东路证券营业部 | 上海市青浦区公园东路 1606 号 D 座 | 2011 年 7 月 1 日 |
| 东方证券股份有限公司合肥望江西路证券营业部 | 安徽省合肥市蜀山区望江西路 99 号 | 2012 年 1 月 31 日 |
| 东方证券股份有限公司临沂通达路证券营业部 | 山东省临沂市兰山区通达路旭洋城市风景沿街商铺 94-2 号和 6 号楼 402 室 | 2012 年 2 月 14 日 |
| 东方证券股份有限公司上海嘉定区金沙路证券营业部 | 上海市嘉定区金沙路 77 号 5 层 | 2012 年 2 月 17 日 |
| 东方证券股份有限公司上海奉贤区南亭公路证券营业部 | 上海市奉贤区南桥镇南亭公路 269 号 1 幢 1-2 层 | 2012 年 2 月 28 日 |
| 东方证券股份有限公司上海嘉定区沪宜公路证券营业部 | 上海市嘉定区沪宜公路 1158 号 1 层 103 室 | 2012 年 11 月 2 日 |
| 东方证券股份有限公司上海崇明东门路证券营业部 | 上海市崇明县东门路 425-427 号 | 2012 年 11 月 19 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区金科路证券营业部 | 上海市浦东新区金科路 2966 号 2 幢 216 室 | 2014 年 3 月 31 日 |
| 东方证券股份有限公司太原平阳路街证券营业部 | 山西省太原市小店区平阳路 186 号 171 幢 1-2 层 1001 号、1002 号、1003 号 | 2014 年 4 月 17 日 |
| 东方证券股份有限公司湖州志成路证券营业部 | 浙江省湖州市爱山广场 18 号楼(志成路 112 号) 18-1-06、18-2-05、18-2-06、18-2-07、18-2-08 | 2014 年 4 月 21 日 |
| 东方证券股份有限公司南昌绿茵路证券营业部 | 江西省南昌市绿茵路 129 号联发广场写字楼 2902、2903 室(第 29 层) | 2014 年 4 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司湘潭湖湘北路证券营业部 | 湘潭市岳塘区宝塔街道湖湘北路 3 号湘银熙城 D 地块 D1-2 栋 0101002-0101003 | 2014 年 4 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司抚顺绥化路证券营业部 | 辽宁省抚顺市东洲区绥化路西段 45 号 | 2014 年 4 月 25 日 |
| 东方证券股份有限公司绍兴上虞梁祝大道证券营业部 | 浙江省绍兴市上虞区北段 2389 号 | 2014 年 5 月 16 日 |

| | | |
|----------------------------|---|------------------|
| 东方证券股份有限公司义乌工人西路证券营业部 | 浙江省义乌市工人西路 113 号 | 2014 年 5 月 26 日 |
| 东方证券股份有限公司郑州黄河路证券营业部 | 河南省郑州市金水区黄河路 109 号院 | 2014 年 5 月 27 日 |
| 东方证券股份有限公司呼和浩特乌兰察布东街证券营业部 | 内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区乌兰察布东街天颐大厦商业楼一层 102 号 | 2014 年 5 月 28 日 |
| 东方证券股份有限公司莆田胜利北街证券营业部 | 福建省莆田市荔城区镇海街道胜利北街 1102 号、1106 号 1-2 楼 | 2014 年 5 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司重庆时代天街证券营业部 | 重庆市渝中区时代天街 2 号 1 栋 18-4 和 18-05 单元 | 2014 年 6 月 3 日 |
| 东方证券股份有限公司朝阳朝阳大街证券营业部 | 辽宁省朝阳市双塔朝阳大街三段 60 号 | 2014 年 6 月 4 日 |
| 东方证券股份有限公司昆明白龙路证券营业部 | 云南省昆明市盘龙区白龙路 19 号滇高商务大楼 10 层 1001、1008 号 | 2014 年 6 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司福州五四路证券营业部 | 福建省福州市鼓楼区五四路 82 号融都国际大厦 19 层 01-02 单元 | 2014 年 6 月 10 日 |
| 东方证券股份有限公司上海宝山区淞南路证券营业部 | 上海市宝山区淞南路 427-1 号(临) | 2014 年 6 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司深圳海德三道证券营业部 | 广东省深圳市南山区海德三道 199 号天利中央商务广场 A 座 9 楼 | 2014 年 6 月 17 日 |
| 东方证券股份有限公司成都天府大道证券营业部 | 四川省成都高新区天府大道南段 1399 号 1 栋 16 层 1601、1603、1605、1607、1609 号 | 2014 年 6 月 24 日 |
| 东方证券股份有限公司上海闵行区南江燕路证券营业部 | 上海市闵行区南江燕路 121 号 | 2014 年 6 月 26 日 |
| 东方证券股份有限公司桂林人民路证券营业部 | 广西壮族自治区桂林市临桂县临桂镇人民路大世界主楼二楼 1 幢 1-2-1、1-2-3 号 | 2014 年 7 月 3 日 |
| 东方证券股份有限公司拉萨金珠西路证券营业部 | 拉萨市金珠西路 123 号 | 2014 年 7 月 10 日 |
| 东方证券股份有限公司上海黄浦区中山南路第一证券营业部 | 上海市黄浦区中山南路 318 号 4 楼 402 室 | 2014 年 7 月 14 日 |
| 东方证券股份有限公司西安唐延路证券营业部 | 陕西省西安市高新区唐延路 3 号唐延国际中心 1 栋 2 单元 0501 室 | 2014 年 7 月 14 日 |
| 东方证券股份有限公司上海闵行区苏虹路证券营业部 | 上海市闵行区苏虹路 29、33 号 109、206 室 | 2014 年 7 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司烟台迎春大街证券营业部 | 山东省烟台市莱山区迎春大街 171 号内 102 号 | 2014 年 7 月 22 日 |
| 东方证券股份有限公司德阳庐山南路证券营业部 | 四川省德阳市旌阳区庐山南路一段 10-12 号 | 2014 年 8 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区启帆路证券营业部 | 上海市浦东新区启帆路 515 号南楼 B 座 1517 室 | 2014 年 9 月 2 日 |
| 东方证券股份有限公司南充红光路证券营业部 | 四川省南充市顺庆区红光路 83 号一层、三层 | 2014 年 9 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区唐安路证券营业部 | 上海市浦东新区唐安路 782 号 | 2014 年 10 月 10 日 |
| 东方证券股份有限公司上海浦东新区银城中路证券营业部 | 上海市浦东新区银城中路 488 号 2301B 室 | 2015 年 5 月 8 日 |
| 东方证券股份有限公司株洲建设南路证券营业部 | 湖南省株洲市芦淞区建设南路 320 号 | 2015 年 6 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司南通工农路证券营业部 | 江苏省南通市工农路 181、183、185 号 | 2015 年 6 月 25 日 |
| 东方证券股份有限公司江阴人民东路证券营业部 | 江苏省江阴市人民东路 112 号一层, 108、110、112 二层 | 2015 年 7 月 9 日 |

| | | |
|--------------------------|--|------------------|
| 东方证券股份有限公司厦门仙岳路证券营业部 | 福建省厦门市思明区仙岳路 555 号 105 店面、108 店面之一 | 2015 年 7 月 14 日 |
| 东方证券股份有限公司柳州文昌路证券营业部 | 广西壮族自治区柳州市文昌路 26 号东郡 21 栋 2-1、2、3 号 | 2015 年 7 月 16 日 |
| 东方证券股份有限公司西安桃园南路证券营业部 | 陕西省西安市莲湖区桃园南路 38 号 | 2015 年 7 月 22 日 |
| 东方证券股份有限公司北海茶亭路证券营业部 | 广西壮族自治区北海市茶亭路 31 号富钰大厦 1205-1207 号 | 2015 年 7 月 28 日 |
| 东方证券股份有限公司台州椒江区中山东路证券营业部 | 浙江省台州市椒江区中山东路 368 号 | 2015 年 7 月 30 日 |
| 东方证券股份有限公司宁波中兴路证券营业部 | 浙江省宁波市江东区中兴路 601 号(1-2)(2-2) | 2015 年 7 月 30 日 |
| 东方证券股份有限公司嘉兴中山西路证券营业部 | 浙江省嘉兴市秀洲区高照街道中山西路 1776 号 | 2015 年 7 月 30 日 |
| 东方证券股份有限公司泉州津淮街证券营业部 | 福建省泉州市丰泽区津淮街 25 号燃气大厦 A 座 502 | 2015 年 7 月 30 日 |
| 东方证券股份有限公司哈尔滨赣水路证券营业部 | 黑龙江哈尔滨经开区南岗集中区赣水路 84 号哈尔滨万达商业中心商业楼 1-3 层 14 号门市 | 2015 年 7 月 31 日 |
| 东方证券股份有限公司海口金龙路证券营业部 | 海南省海口市龙华区金龙路 19 号东郊椰林国际大厦第一层和第二层 | 2015 年 8 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司兰州南昌路证券营业部 | 甘肃省兰州市城关区南昌路 1918 号盛世凯旋宫一层 | 2015 年 8 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司温州信河街证券营业部 | 浙江省温州市鹿城区信河街松台大厦 A 幢 601 室 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司乌鲁木齐南湖路证券营业部 | 新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市水磨沟区南湖路 133 号城建大厦三层 4 号、5 号、6 号 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司西宁黄河路证券营业部 | 青海省西宁市城西区黄河路 21 号 3 号楼 15 号商铺 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司银川民族北街证券营业部 | 宁夏回族自治区银川市兴庆区民族北街 12 号 2 层 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司镇江东吴路证券营业部 | 江苏省镇江市东吴路 38 号 1 幢第 1 层 110 室 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司无锡新生路证券营业部 | 江苏省无锡市新生路 152 号 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司石家庄体育南大街证券营业部 | 河北省石家庄市裕华区体育南大街 233 号 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司贵阳花果园证券营业部 | 贵州省贵阳市南明区花果园彭家湾花果园项目 F 区 6 栋 1 单元 40 层 6、7、8、9、10、11、12 号写字楼 | 2015 年 8 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司太原高新街证券营业部 | 山西省太原高新区高新街 15 号 15 层 | 2016 年 12 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司包头青年路证券营业部 | 内蒙古自治区包头市青山区青年路 28 号恒源银座商务楼 1-A4 | 2016 年 12 月 19 日 |
| 东方证券股份有限公司扬州文汇东路证券营业部 | 江苏省扬州市经济开发区文汇东路 231 号 | 2017 年 1 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司常熟李闸路证券营业部 | 江苏省常熟市李闸路 65 号 21-23 | 2017 年 1 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司金华八一北街证券营业部 | 浙江省金华市婺城区八一北街 190 号 | 2017 年 1 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司张家港东环路证券营业部 | 江苏省张家港市杨舍镇东环路 68 号城南大厦 | 2017 年 1 月 6 日 |

| | | |
|-------------------------|--|-----------------|
| 东方证券股份有限公司绍兴胜利东路证券营业部 | 浙江省绍兴市越城区胜利东路 402 号, 迪荡湖路 68 号 705, 706-1 | 2017 年 3 月 13 日 |
| 东方证券股份有限公司西安未央路证券营业部 | 陕西省西安市未央路 109-1 号大唐星河苑 1 号楼 1F-04 号铺 | 2017 年 3 月 30 日 |
| 东方证券股份有限公司深圳深南东路证券营业部 | 广东省深圳市罗湖区桂园街道深南东路 5002 号信兴广场主楼 19 楼 02、03、05 室 | 2017 年 4 月 24 日 |
| 东方证券股份有限公司珠海吉大路证券营业部 | 广东省珠海市香洲区吉大路 103 号石油大厦第一楼 106、二楼 202 号 | 2017 年 5 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司上海静安区延平路证券营业部 | 上海市静安区延平路 167 号 1-2 层 | 2017 年 5 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司淄博柳泉路证券营业部 | 山东省淄博市高新区柳泉路 258 号 | 2017 年 5 月 17 日 |
| 东方证券股份有限公司合肥梅山路证券营业部 | 安徽省合肥梅山路 19 号安徽轻工大厦 1、2 楼 | 2017 年 5 月 17 日 |
| 东方证券股份有限公司天津南马路证券营业部 | 天津市南开区南马路 1201 号 | 2017 年 7 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司长春自由大路证券营业部 | 吉林省长春市二道区自由大路 3999 号第一国际中心 B 栋 110 室 | 2017 年 7 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司许昌许都路证券营业部 | 河南省许昌市东城区许都路南侧、智慧大厦西侧汇通商务苑 A 幢 1、2 层 | 2017 年 7 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司芜湖北京中路证券营业部 | 安徽省芜湖市镜湖区北京中路 1 号镜湖之星 104、501 | 2017 年 7 月 5 日 |
| 东方证券股份有限公司青岛苗岭路证券营业部 | 山东省青岛市崂山区苗岭路 36 号-1 号 101-A | 2017 年 7 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司常州龙锦路证券营业部 | 江苏省常州市新北区龙锦路 1590 号现代传媒中心 3 号楼 102、1103、1104 室 | 2017 年 7 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司唐山北新西道证券营业部 | 河北省唐山市路北区张大里丽景琴园北新西道 36-13 号 | 2017 年 7 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司江门迎宾大道中证券营业部 | 广东省江门市蓬江区迎宾大道中 118 号 1 幢 109 室、2208-2209 室 | 2017 年 7 月 6 日 |
| 东方证券股份有限公司大连太原街证券营业部 | 辽宁省大连市沙河口区太原街 177-13 号 | 2017 年 7 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司东莞鸿福路证券营业部 | 广东省东莞市南城街道鸿福路 102 号汇成大厦 104 号 | 2017 年 7 月 12 日 |
| 东方证券股份有限公司重庆洪湖西路证券营业部 | 重庆市渝北区洪湖西路 41、43 号 | 2017 年 7 月 13 日 |
| 东方证券股份有限公司成都益州大道证券营业部 | 四川省成都高新区益州大道北段 777 号 1 栋 2 单元 1 楼 104 号 | 2017 年 7 月 13 日 |
| 东方证券股份有限公司徐州和平路证券营业部 | 江苏省徐州市云龙区和平路 59 号江苏师范大学科技园文远大楼 101-1 | 2017 年 7 月 13 日 |
| 东方证券股份有限公司北京大郊亭南街证券营业部 | 北京市朝阳区大郊亭南街 5 号院 1 号楼 1 层 106 及 2 层 2017 | 2017 年 7 月 13 日 |
| 东方证券股份有限公司佛山南海大道北营业部 | 广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北 84 号越秀星汇云锦广场一区 E 栋写字楼 17 层 | 2017 年 7 月 16 日 |
| 东方证券股份有限公司洛阳南昌路证券营业部 | 河南省洛阳市涧西区南昌路 14 号院 4 幢 107 号 | 2017 年 7 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司中山中山五路证券营业部 | 广东省中山市东区中山五路 2 号紫马奔腾广场 3 座 12 层 01 卡 | 2017 年 7 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司广州广州大道中路证券营业部 | 广东省广州市越秀区广州大道中路 129-133 号 301 自编之二房 | 2017 年 7 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司岳阳金 | 湖南省岳阳市岳阳楼区金鹗中路 408 号圣鑫 | 2017 年 7 月 19 日 |

| | | |
|------------------------|---|------------------|
| 鄂中路证券营业部 | 城财智公馆 1 楼 | |
| 东方证券股份有限公司宜昌西陵一路证券营业部 | 湖北省宜昌市西陵区西陵一路 15 号（金安东诚 117 铺、217 铺） | 2017 年 7 月 19 日 |
| 东方证券股份有限公司九江长江大道证券营业部 | 江西省九江市长江大道 358 号新湖柴桑春天二区 2 幢不分单元 108-109 | 2019 年 4 月 8 日 |
| 东方证券股份有限公司晋中定阳路证券营业部 | 山西省晋中市榆次区定阳路 500 号 3-2、3-3 号商铺 | 2019 年 4 月 9 日 |
| 东方证券股份有限公司郑州万安街证券营业部 | 河南省郑州市郑东新区万安街 6 号 7 号楼 1-2 层 103 号、104 号、105 号、106 号 | 2019 年 4 月 15 日 |
| 东方证券股份有限公司杭州金鸡路证券营业部 | 浙江省杭州市萧山区北干街道金鸡路 327 号 | 2019 年 4 月 16 日 |
| 东方证券股份有限公司南京莫愁湖东路证券营业部 | 江苏省南京市建邺区莫愁湖东路 8-3 号 | 2019 年 4 月 16 日 |
| 东方证券股份有限公司宁波天童北路证券营业部 | 浙江省宁波市鄞州区中河街道天童北路 899 号和邦大厦 C 座 103、1605、1607 | 2019 年 4 月 17 日 |
| 东方证券股份有限公司西安翠华路证券营业部 | 陕西省西安市雁塔区翠华路 500 号佳和商务大厦 A 座 2 层 204 室、206 室 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司宜兴解放东路证券营业部 | 江苏省宜兴市宣城街道解放东路 239 号、251 号商铺 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 东方证券股份有限公司长沙人民东路证券营业部 | 湖南省长沙市雨花区人民东路 38 号东一时区商厦 0 栋 107 号东侧 | 2019 年 4 月 22 日 |
| 东方证券股份有限公司武汉云霞路证券营业部 | 湖北省武汉市江汉区云霞路 187 号 1 层 5 号商铺 | 2019 年 4 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司北京望京证券营业部 | 北京市朝阳区望京西园四区 410 楼 C 座底商 | 2019 年 4 月 23 日 |
| 东方证券股份有限公司威海世昌大道证券营业部 | 山东省威海市世昌大道 99A 号-1 室 | 2019 年 4 月 25 日 |
| 东方证券股份有限公司潍坊胜利东街证券营业部 | 山东省潍坊市奎文区胜利东街 4889 号名苑小区 1-1-03 号商铺 | 2019 年 4 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司深圳新湖路证券营业部 | 广东省深圳市宝安区新安街道新湖路 99 号壹方中心 B 座 26 楼 08、09、10 单元 | 2019 年 4 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司蚌埠胜利西路证券营业部 | 安徽省蚌埠市胜利西路 28 号银河中心 1 栋一层 101#-104#、122#-126# | 2019 年 4 月 29 日 |
| 东方证券股份有限公司东营府前大街证券营业部 | 山东省东营市开发区府前大街 128 号华利国际金融广场 A 座 22 楼 | 2020 年 5 月 19 日 |
| 东方证券股份有限公司杭州市心北路证券营业部 | 浙江省杭州市萧山区宁围街道市心北路 2028、2030、2032 号, 东方至尊国际中心 1 幢 1001 室 | 2020 年 10 月 9 日 |
| 东方证券股份有限公司保定瑞祥大街证券营业部 | 河北省保定市莲池区瑞祥大街 1988 号云溪九城商业中心 9 号楼 | 2020 年 12 月 7 日 |
| 东方证券股份有限公司晋城红星东街证券营业部 | 山西省晋城市城区红星东街泰富新居 C 座底商 1、2 层 3 户 | 2020 年 12 月 8 日 |
| 东方证券股份有限公司运城河东东街证券营业部 | 山西省运城市盐湖区河东东街 195 号汇鑫大厦 1 楼 | 2020 年 12 月 9 日 |
| 东方证券股份有限公司大同御河西路证券营业部 | 山西省大同市平城区御河西路御锦源二期小区外围商铺 2384 号 | 2020 年 12 月 11 日 |
| 东方证券股份有限公司廊坊艺术大道证券营业部 | 河北省廊坊市广阳区艺术大道 409 号（孔雀汇景轩 28 幢 1 单元 1 层 101 号） | 2020 年 12 月 11 日 |
| 东方证券股份有限公司青岛延吉路证券营业部 | 青岛市市北区延吉路 76 号 6 号楼 76-41 | 2020 年 12 月 16 日 |
| 东方证券股份有限公司温州汤家桥路证券营业部 | 浙江省温州市鹿城区南汇街道汤家桥路 439 号 | 2020 年 12 月 18 日 |

附录三：公司各期货营业部情况

截至报告期末，公司期货营业部 32 家。

| 期货营业部名称 | 注册地址（中国） | 成立时间 |
|----------------------|--|------------------|
| 上海东证期货有限公司大连营业部 | 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 2411、2412、3501-3507、3510-1 号房间 | 2009 年 1 月 16 日 |
| 上海东证期货有限公司上海福山路营业部 | 中国（上海）自由贸易试验区福山路 458 号 1107 室 | 2009 年 5 月 19 日 |
| 上海东证期货有限公司郑州营业部 | 河南省郑州市郑东新区商务外环路 30 号期货大厦 1301 室 | 2009 年 7 月 2 日 |
| 上海东证期货有限公司长沙营业部 | 湖南省长沙市雨花区劳动西路 471 号中天电力大厦 7 楼 | 2009 年 11 月 24 日 |
| 上海东证期货有限公司北京安立路营业部 | 北京市朝阳区北辰东路 8 号院 27 号楼 3 层 302、303 号 | 2009 年 12 月 28 日 |
| 上海东证期货有限公司常州营业部 | 江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号 1618-1658 室 | 2010 年 7 月 5 日 |
| 上海东证期货有限公司太原营业部 | 山西省太原市小店区长风街 705 号（和信商业广场）1 幢（塔楼）10 层 1023、1024、1025、1026 号 | 2010 年 11 月 29 日 |
| 上海东证期货有限公司上海中山南路营业部 | 上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 35 层、7 层 | 2011 年 8 月 3 日 |
| 上海东证期货有限公司广州营业部 | 广州市天河区天河北路 365 号之一 2304 房 | 2012 年 10 月 17 日 |
| 上海东证期货有限公司青岛营业部 | 山东省青岛市市南区海门路 69 号 2 号楼 1 单元 1501 户 | 2013 年 5 月 16 日 |
| 上海东证期货有限公司宁波营业部 | 宁波市鄞州区嘉会街 288 号 13-7 | 2014 年 2 月 24 日 |
| 上海东证期货有限公司深圳营业部 | 深圳市福田区中心区东南部时代财富大厦 7A | 2014 年 5 月 16 日 |
| 上海东证期货有限公司上海自贸试验区营业部 | 中国（上海）自由贸易试验区碧波路 5 号 13 层 1303 室 | 2014 年 5 月 29 日 |
| 上海东证期货有限公司杭州营业部 | 浙江省杭州市江干区钱江国际时代广场 2 幢 907 室 | 2014 年 6 月 18 日 |
| 上海东证期货有限公司成都营业部 | 四川省中国（四川）自由贸易试验区成都市天府新区华阳海昌路 330 号 | 2015 年 1 月 7 日 |
| 上海东证期货有限公司西安营业部 | 陕西省西安市莲湖区南二环西段 5 号捷瑞智能大厦 12F-6 | 2015 年 1 月 15 日 |
| 上海东证期货有限公司厦门营业部 | 福建省厦门市思明区鹭江道 100 号财富中心 908 室 | 2015 年 1 月 23 日 |

| | | |
|---------------------|--|------------------|
| 上海东证期货有限公司东营营业部 | 山东省东营市东营区府前大街 53 号国贸大厦 1 幢 903 室 | 2015 年 3 月 17 日 |
| 上海东证期货有限公司天津营业部 | 天津市南开区长江道与南开六马路交口尚澜苑 1 号楼融侨中心 1-1-803 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 上海东证期货有限公司哈尔滨营业部 | 黑龙江省哈尔滨市道里区群力新区群力大道、灵江路和群力第四大道围合区域财富中心 3 栋 1 单元 11 层 1103、1104 号 | 2015 年 4 月 3 日 |
| 上海东证期货有限公司北京朝阳门营业部 | 北京市朝阳区朝外大街 22 号 4 层 401-402 室 | 2015 年 9 月 8 日 |
| 上海东证期货有限公司重庆营业部 | 重庆市江北区庆云路 2 号 4-3 | 2016 年 5 月 19 日 |
| 上海东证期货有限公司杭州教工路营业部 | 浙江省杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心 1 号楼 (C 区) 1405 室 | 2016 年 7 月 1 日 |
| 上海东证期货有限公司汕头营业部 | 广东省汕头市龙湖区丹阳庄西三区 17 幢韩江大厦 1105、1107 号房 | 2018 年 7 月 5 日 |
| 上海东证期货有限公司泉州营业部 | 福建省泉州市丰泽区津淮街 25 号燃气大厦 A 座 1203 单元 | 2018 年 7 月 13 日 |
| 上海东证期货有限公司宁波天童南路营业部 | 浙江省宁波市鄞州区天童南路 577 弄 1305 室 | 2018 年 7 月 18 日 |
| 上海东证期货有限公司沈阳营业部 | 辽宁省沈阳市铁西区兴华北街 49 号 | 2018 年 8 月 7 日 |
| 上海东证期货有限公司苏州营业部 | 苏州工业园区星港街 199 号东方之门大厦 2 幢 3602 室 | 2018 年 10 月 11 日 |
| 上海东证期货有限公司南通营业部 | 江苏省南通市崇川区工农路 57 号圆融广场南楼 1401 室 | 2018 年 12 月 10 日 |
| 上海东证期货有限公司杭州滨江营业部 | 浙江省杭州市滨江区长河街道科技馆街 1600 号银泰国际商务中心 3806 室 | 2018 年 12 月 17 日 |
| 上海东证期货有限公司无锡营业部 | 无锡市梁溪区中山路 288-2801 号云蝠大厦 3007 室 | 2019 年 3 月 19 日 |
| 上海东证期货有限公司济南营业部 | 山东省济南市天桥区明湖西路 800 号银座好望角广场 1-1801 | 2019 年 3 月 19 日 |

附录四：信息披露指引

1、报告期内，公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 上披露的信息如下：

| 公告日期 | 公告标题 |
|------------|---|
| 2020-01-04 | H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-01-10 | 2019 年 12 月财务数据简报 |
| 2020-01-15 | 第四届董事会第十七次会议(临时会议)决议公告 |
| 2020-01-18 | 关于获得结售汇业务经营资格的公告 |
| 2020-01-21 | 2020 年第一期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-01-23 | 2019 年度业绩预增公告、2019 年第四期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-01-31 | 关于收到非公开发行公司债券挂牌转让无异议函的公告 |
| 2020-02-04 | H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-02-12 | 2020 年 1 月财务数据简报 |
| 2020-02-15 | 关于公司董事兼高级管理人员辞职的公告、关于选举职工董事的公告、关于变更职工监事的公告、2019 年度业绩快报公告 |
| 2020-02-20 | 第四届监事会第十二次会议(临时会议)决议公告 |
| 2020-03-03 | 2019 年第五期短期融资券兑付完成的公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-03-06 | 关于职工董事任职的公告、2020 年 2 月财务数据简报 |
| 2020-03-12 | 2019 年非公开发行次级债券(第一期)2020 年付息公告 |
| 2020-03-14 | H 股公告-董事会会议召开日期 |
| 2020-03-20 | 2020 年第二期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-03-24 | 关于召开 2019 年度网上业绩说明会的预告公告 |
| 2020-03-25 | 2020 年非公开发行公司债券(第一期)发行结果的公告 |
| 2020-03-28 | 2019 年年度报告, 2019 年年度报告摘要, 财务报表和审计报告, 2019 年度内部控制评价报告, 内部控制审计报告, 2019 年度社会责任报告, 第四届董事会第十八次会议决议公告, 独立董事关于第四届董事会第十八次会议相关事项的事前认可意见, 独立董事关于第四届董事会第十八次会议相关事项及公司对外担保情况的独立意见, 2019 年度独立董事述职报告, 董事会审计委员会 2019 年度履职报告, 第四届监事会第十三次会议决议公告, 关于预计公司 2020 年度日常关联交易的公告, 关于预计公司 2020 年度对外担保的公告, 关于续聘会计师事务所的公告, 关于 2019 年度利润分配方案的公告, 控股股东及其他关联方资金占用情况的专项说明, 募集资金存放与实际使用情况的专项报告及审核报告, 关于 2019 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告, 国泰君安证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司关于东方证券股份有限公司 2019 年度募集资金存放与实际使用情况的专项核查意见, 关于修改《公司章程》部分条款的公告, 公司章程(2020 年 3 月修订), 关于公司董事辞职的公告, 未来三年股东回报规划(2020-2022) |
| 2020-03-31 | 关于召开 2019 年年度股东大会的通知 |
| 2020-04-02 | H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-04-10 | 2020 年 3 月财务数据简报 |
| 2020-04-16 | 2017 年次级债券(第一期)(品种一)本息兑付和摘牌公告、H 股公告-董事会会议召开日期 |
| 2020-04-18 | 2020 年第一期短期融资券兑付完成的公告、2017 年次级债券(第一期)(品种二)2020 年付息公告 |
| 2020-04-23 | 关于收购东方花旗证券有限公司部分股权完成工商变更登记及变更企业名称的公告 |

| | |
|------------|---|
| 2020-04-24 | 2019 年年度股东大会会议资料 |
| 2020-04-28 | 2017 年次级债券(第一期)(品种一)兑付完成的公告、关于召开 2019 年年度股东大会的提示性公告 |
| 2020-04-30 | 2020 年第一季度报告、2020 年第一季度报告正文 |
| 2020-05-07 | H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-05-09 | 关于变更《公司章程》重要条款获批的公告 |
| 2020-05-12 | 2020 年 4 月财务数据简报 |
| 2020-05-14 | 关于境外全资子公司为其全资子公司获取银行授信提供担保的公告、关于向上海东方证券创新投资有限公司增资的公告 |
| 2020-05-16 | 2019 年年度股东大会决议公告、2019 年年度股东大会的法律意见书、关于公司高级管理人员辞职的公告 |
| 2020-05-22 | 2019 年年度股东大会决议更正公告 |
| 2020-05-26 | 关于筹划 H 股员工持股计划的提示性公告 |
| 2020-06-02 | H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-06-04 | 2020 年第三期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-06-05 | 2020 年 5 月财务数据简报 |
| 2020-06-11 | 关于完成公司注册地址变更的公告 |
| 2020-06-16 | 关于参加 2020 年上海辖区上市公司集体接待日活动的公告 |
| 2020-06-18 | 2019 年年度权益分派实施公告、第四届董事会第二十次会议(临时会议)决议公告、第四届监事会第十五次会议(临时会议)决议公告、员工持股计划(草案)、员工持股计划(草案)摘要、汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同、汇添富-东方证券员工持股计划 2 号单一资产管理计划资产管理合同、独立董事关于公司员工持股计划事项的独立意见、监事会关于公司员工持股计划事项的审核意见、关于召开 2020 年第一次临时股东大会的通知、2020 年第二期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-06-20 | 关于向东方金融控股(香港)有限公司增资收到中国证监会复函的公告 |
| 2020-06-24 | 2020 年第一次临时股东大会会议资料 |
| 2020-07-03 | 关于公开发行永续次级债券收到中国证监会复函的公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-07-08 | 第三届职工代表大会第四次全体会议决议公告、2020 年第四期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-07-09 | 2020 年 6 月财务数据简报 |
| 2020-07-11 | 国浩律师(上海)事务所关于东方证券股份有限公司员工持股计划之法律意见书 |
| 2020-07-14 | 2020 年第一次临时股东大会决议公告、2020 年第一次临时股东大会法律意见书、员工持股计划、关于向专业投资者公开发行公司债券获得中国证监会注册批复的公告 |
| 2020-07-21 | 关于 H 股员工持股计划的进展公告 |
| 2020-07-24 | 员工持股计划第一次持有人会议决议公告 |
| 2020-07-29 | 关于东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司提供担保的公告、2020 年第五期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-08-01 | 关于东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司获取银行授信提供担保的公告 |
| 2020-08-04 | 关于 H 股员工持股计划的进展公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-08-07 | 2020 年 7 月财务数据简报 |
| 2020-08-14 | H 股公告-董事会会议召开日期 |
| 2020-08-15 | 关于独立董事辞职的公告 |
| 2020-08-27 | 关于向东方金融控股(香港)有限公司增资的公告、关于收到非公开发行次级公司债券挂牌转让无异议函的公告 |

| | |
|------------|--|
| 2020-08-29 | 2020 年半年度报告、2020 年半年度报告摘要、第四届董事会第二十一次会议决议公告、第四届监事会第十六次会议决议公告、关于计提资产减值准备的公告、独立董事关于计提资产减值准备事项的独立意见 |
| 2020-09-01 | 2020 年第三期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-09-02 | 关于 H 股员工持股计划的进展公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-09-11 | 第四届董事会第二十二次会议(临时会议)决议公告、独立董事关于第四届董事会第二十二次会议相关事项的独立意见、关于聘任公司副总裁的公告 |
| 2020-10-01 | 2020 年第四期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-10-10 | 关于 H 股员工持股计划的进展公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-10-14 | 关于东方金融控股(香港)有限公司为其全资子公司非公开发行美元债券提供担保的公告 |
| 2020-10-16 | H 股公告-董事会会议召开日期 |
| 2020-10-17 | 关于董事长辞职的公告 |
| 2020-10-21 | 关于推举董事代行董事长职责的公告、2020 年第六期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-10-24 | 2020 年第五期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-10-27 | 2020 年前三季度业绩快报公告 |
| 2020-10-30 | 2020 年第三季度报告、2020 年第三季度报告正文、关于独立董事辞职的公告、第四届董事会第二十三次会议决议公告、独立董事提名人声明、独立董事候选人声明、独立董事关于选举公司独立非执行董事的独立意见、第四届监事会第十七次会议决议公告、关于修改《公司章程》及相关议事规则的公告、公司章程(2020 年 10 月修订) |
| 2020-11-03 | 关于 H 股员工持股计划的进展公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-11-06 | 关于向专业投资者公开发行短期公司债券获得中国证监会注册批复的公告 |
| 2020-11-12 | 关于召开 2020 年第二次临时股东大会的通知、2020 年第二次临时股东大会会议资料 |
| 2020-11-19 | 关于董事辞职的公告 |
| 2020-12-01 | H 股公告-变更在香港接收法律程序文件及通知之授权代表 |
| 2020-12-02 | 关于 H 股员工持股计划的进展公告、H 股公告-股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-12-09 | 2020 年第二次临时股东大会决议公告、2020 年第二次临时股东大会的法律意见书 |
| 2020-12-15 | 第四届董事会第二十四次会议(临时会议)决议公告 |
| 2020-12-22 | 非公开发行限售股上市流通公告, 国泰君安证券股份有限公司、东方证券承销保荐有限公司关于东方证券限售股份上市流通的核查意见 |
| 2020-12-25 | 关于 H 股员工持股计划完成购买的公告 |

2、报告期内, 公司在香港联交所网站 (<http://www.hkexnews.hk>) 上披露的信息如下:

| 公告日期 | 公告标题 |
|------------|--|
| 2020-01-03 | 截至二零一九年十二月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-01-09 | 关于 2019 年 12 月财务数据的公告 |
| 2020-01-14 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司第四届董事会第十七次会议(临时会议)决议公告 |
| 2020-01-17 | 关于获得结售汇业务经营资格的公告 |
| 2020-01-20 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第一期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-01-22 | 2019 年年度业绩预增公告、海外监管公告-东方证券股份有限公司 2019 年第四期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-01-23 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于收到非公开发行公司债券挂牌转让无异议函的公告 |

| | |
|------------|--|
| 2020-02-03 | 截至二零二零年一月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-02-11 | 关于 2020 年 1 月财务数据的公告 |
| 2020-02-14 | 非执行董事（职工代表董事）兼高级管理人员辞任、关于选举非执行董事（职工代表董事）的公告、关于变更职工代表监事的公告、董事名单与其角色和职能、2019 年年度业绩快报公告 |
| 2020-02-19 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司第四届监事会第十二次会议（临时会议）决议公告 |
| 2020-03-02 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2019 年第五期短期融资券兑付完成的公告、截至二零二零年二月二十九日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-03-05 | 关于非执行董事（职工代表董事）任职的公告、董事名单与其角色和职能、关于 2020 年 2 月财务数据的公告 |
| 2020-03-11 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券（第一期）2020 年付息公告 |
| 2020-03-13 | 董事会会议召开日期 |
| 2020-03-19 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第二期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-03-23 | 关于召开 2019 年度网上业绩说明会的预告公告 |
| 2020-03-24 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第一期）发行结果的公告 |
| 2020-03-27 | 截至 2019 年 12 月 31 日止年度之业绩公告；2019 年东方证券环境、社会及管治报告；公告(1) 建议发行境内债务融资工具一般性授权 (2) 2020 年度集团内担保预计 (3) 建议修改《公司章程》部分条款 (4) 建议授予增发公司 A 股及/或 H 股股份一般性授权 (5) 非执行董事辞任 (6) 建议委任非执行董事及 (7) 委任董事会专门委员会委员,董事名单与其角色和职能;海外监管公告:东方证券股份有限公司内部控制审计报告,东方证券股份有限公司 2019 年度内部控制评价报告,东方证券股份有限公司第四届董事会第十八次会议决议公告,东方证券股份有限公司独立董事关于第四届董事会第十八次会议相关事项的事前认可意见,东方证券股份有限公司独立董事关于第四届董事会第十八次会议相关事项及公司对外担保情况的独立意见,东方证券股份有限公司 2019 年度独立董事述职报告,东方证券股份有限公司董事会审计委员会 2019 年度履职报告,东方证券股份有限公司第四届监事会第十三次会议决议公告,东方证券股份有限公司关于预计公司 2020 年度日常关联交易的公告,东方证券股份有限公司关于续聘会计师事务所的公告,东方证券股份有限公司关于 2019 年度利润分配方案的公告,东方证券股份有限公司控股股东及其他关联方资金占用情况的专项说明,东方证券股份有限公司募集资金存放与实际使用情况的专项报告及审核报告,东方证券股份有限公司关于 2019 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告,国泰君安证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司关于东方证券股份有限公司 2019 年度募集资金存放与实际使用情况的专项核查意见,东方证券股份有限公司未来三年股东回报规划(2020-2022) |
| 2020-03-30 | 股东周年大会通告、H 股股东出席 2020 年 5 月 15 日举行的股东周年大会回条、2020 年 5 月 15 日举行的股东周年大会 H 股股东代表委任表格 |
| 2020-04-01 | 截至二零二零年三月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-04-09 | 关于 2020 年 3 月财务数据的公告 |
| 2020-04-15 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2017 年次级债券（第一期）（品种一）本息兑付和摘牌公告、董事会会议召开日期 |
| 2020-04-17 | 海外监管公告:东方证券股份有限公司 2020 年第一期短期融资券兑付完成的公告、东方证券股份有限公司 2017 年次级债券（第一期）（品种二）2020 年付息公告 |
| 2020-04-22 | 关连交易:关于收购东方花旗部分股权完成工商变更登记及变更企业名称的公告 |

| | |
|------------|---|
| 2020-04-23 | 2019 年度报告、2019 年股东周年大会通函 |
| 2020-04-27 | 关于召开股东周年大会的提示性公告, 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2017 年次级债券(第一期)(品种一)兑付完成的公告 |
| 2020-04-29 | 2020 年第一季度报告 |
| 2020-05-06 | 截至二零二零年四月三十日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-05-08 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于变更〈公司章程〉重要条款获批的公告、公司章程 |
| 2020-05-11 | 关于 2020 年 4 月财务数据的公告 |
| 2020-05-13 | 海外监管公告: 东方证券股份有限公司关于境外全资子公司为其全资子公司获取银行授信提供担保的公告、东方证券股份有限公司关于向上海东方证券创新投资有限公司增资的公告 |
| 2020-05-15 | 于二零二零年五月十五日举行之股东周年大会之投票结果、公司章程、董事名单与其角色和职能、海外监管公告: 国浩律师(上海)事务所关于东方证券股份有限公司 2019 年年度股东大会的法律意见书、东方证券股份有限公司关于公司高级管理人员辞职的公告 |
| 2020-05-21 | 于 2020 年 5 月 15 日举行之股东周年大会之投票结果更正 |
| 2020-05-25 | 自愿性公告-关于筹划 H 股员工持股计划的提示性公告 |
| 2020-06-01 | 截至二零二零年五月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-06-03 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第三期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-06-04 | 关于 2020 年 5 月财务数据的公告 |
| 2020-06-10 | 关于完成公司注册地址变更的公告 |
| 2020-06-15 | 关于参加 2020 年上海辖区上市公司集体接待日活动的公告 |
| 2020-06-17 | 建议采纳员工持股计划、2020 年第一次股东特别大会通告、2020 年 7 月 13 日举行的 2020 年第一次股东特别大会 H 股股东代表委任表格、海外监管公告: 东方证券股份有限公司 2019 年年度权益分派实施公告、东方证券股份有限公司第四届董事会第二十次会议(临时会议)决议公告、东方证券股份有限公司第四届监事会第十五次会议(临时会议)决议公告、东方证券股份有限公司独立董事关于公司员工持股计划事项的独立意见、东方证券股份有限公司监事会关于公司员工持股计划事项的审核意见、东方证券股份有限公司员工持股计划(草案)、东方证券股份有限公司员工持股计划(草案)摘要、汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同、汇添富-东方证券员工持股计划 2 号单一资产管理计划资产管理合同、东方证券股份有限公司 2020 年第二期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-06-19 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于向东方金融控股(香港)有限公司增资收到中国证监会复函的公告 |
| 2020-06-23 | 建议采纳员工持股计划、建议授权董事会全权办理员工持股计划相关事宜及二零二零年第一次股东特别大会通告 |
| 2020-07-02 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于公开发行永续次级债券收到中国证监会复函的公告、截至二零二零年六月三十日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-07-07 | 海外监管公告: 东方证券股份有限公司第三届职工代表大会第四次全体会议决议公告、东方证券股份有限公司 2020 年第四期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-07-08 | 关于 2020 年 6 月财务数据的公告 |
| 2020-07-10 | 海外监管公告-国浩律师(上海)事务所关于东方证券股份有限公司员工持股计划之法律意见书 |
| 2020-07-13 | 于二零二零年七月十三日举行之股东特别大会之投票结果、海外监管公告: 国浩律师(上海)事务所关于东方证券股份有限公司 2020 年第一次临时股东大会的法律意见书、东方证券股份有限公司员工持股计划、东方证券股份有限公司关于向专业投资者公开发行公司债券获得中国证监会注册批复的公告 |

| | |
|------------|--|
| 2020-07-20 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划的进展公告 |
| 2020-07-23 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司员工持股计划第一次持有人会议决议公告 |
| 2020-07-28 | 海外监管公告：东方证券股份有限公司关于东方金融控股（香港）有限公司为其全资子公司提供担保的公告、东方证券股份有限公司 2020 年第五期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-07-31 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于东方金融控股（香港）有限公司为其全资子公司获取银行授信提供担保的公告 |
| 2020-08-03 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划的进展公告、截至二零二零年七月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-08-06 | 关于 2020 年 7 月财务数据的公告 |
| 2020-08-13 | 董事会会议召开日期 |
| 2020-08-14 | 独立非执行董事辞任 |
| 2020-08-26 | 海外监管公告：东方证券股份有限公司关于向东方金融控股（香港）有限公司增资的公告、东方证券股份有限公司关于收到非公开发行次级公司债券挂牌转让无异议函的公告 |
| 2020-08-28 | 截至 2020 年 6 月 30 日止六个月之中期业绩公告、关于计提资产减值准备的公告、海外监管公告：东方证券股份有限公司第四届董事会第二十一次会议决议公告、东方证券股份有限公司第四届监事会第十六次会议决议公告、东方证券股份有限公司独立董事关于计提资产减值准备事项的独立意见 |
| 2020-08-31 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第三期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-09-01 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划的进展公告、截至二零二零年八月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-09-10 | 海外监管公告：东方证券股份有限公司第四届董事会第二十二次会议（临时会议）决议公告、东方证券股份有限公司独立董事关于第四届董事会第二十二次会议相关事项的独立意见、东方证券股份有限公司关于聘任公司副总裁的公告 |
| 2020-09-21 | 2020 中期报告 |
| 2020-09-30 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第四期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-10-09 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划的进展公告、截至二零二零年九月三十日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-10-13 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于东方金融控股（香港）有限公司为其全资子公司非公开发行美元债券提供担保的公告 |
| 2020-10-15 | 董事会会议召开日期 |
| 2020-10-16 | 董事长辞任、董事名单与其角色和职能 |
| 2020-10-20 | 推举董事代行董事长职责、董事名单与其角色和职能、海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第六期短期融资券发行结果公告 |
| 2020-10-23 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司 2020 年第五期短期融资券兑付完成的公告 |
| 2020-10-26 | 2020 年前三季度业绩快报公告 |
| 2020-10-29 | 2020 年第三季度报告，独立非执行董事辞任，(1) 建议修改《公司章程》、《公司股东大会议事规则》、《公司董事会议事规则》及《公司监事会议事规则》及 (2) 建议委任独立非执行董事，海外监管公告：东方证券股份有限公司第四届董事会第二十三次会议决议公告、东方证券股份有限公司独立董事提名人声明、东方证券股份有限公司独立董事候选人声明、东方证券股份有限公司独立董事关于选举独立非执行董事的独立意见、东方证券股份有限公司第四届监事会第十七次会议决议公告 |

| | |
|------------|---|
| 2020-11-02 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划的进展公告、截至二零二零年十月三十一日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-11-05 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于向专业投资者公开发行短期公司债券获得中国证监会注册批覆的公告 |
| 2020-11-11 | 2020 年第二次股东特别大会通函、2020 年第二次股东特别大会通告、2020 年 12 月 8 日举行的 2020 年第二次股东特别大会 H 股股东代表委任表格 |
| 2020-11-18 | 非执行董事（职工代表董事）辞任、董事名单与其角色和职能 |
| 2020-11-30 | 变更在香港接收法律程序文件及通知之授权代表 |
| 2020-12-01 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划的进展公告、截至二零二零年十一月三十日止月份之股份发行人的证券变动月报表 |
| 2020-12-08 | 于二零二零年十二月八日举行之股东特别大会之投票结果、公司章程、董事名单与其角色和职能、海外监管公告-国浩律师（上海）事务所关于东方证券股份有限公司 2020 年第二次临时股东大会的法律意见书 |
| 2020-12-14 | 委任董事会专门委员会委员、董事名单与其角色和职能、海外监管公告-东方证券股份有限公司第四届董事会第二十四次会议（临时会议）决议公告 |
| 2020-12-21 | 海外监管公告：东方证券股份有限公司非公开发行限售股上市流通公告，国泰君安证券股份有限公司、东方证券承销保荐有限公司关于东方证券股份有限公司非公开发行限售股份上市流通的核查意见 |
| 2020-12-24 | 海外监管公告-东方证券股份有限公司关于 H 股员工持股计划完成购买的公告 |