

---

# 国新证券股份有限公司

## 公司债券年度报告

(2022 年)

二〇二三年三月

## 重要提示

发行人承诺将及时、公平地履行信息披露义务。

本公司董事、高级管理人员已对年度报告签署书面确认意见。公司监事会（如有）已对年度报告提出书面审核意见，监事已对年度报告签署书面确认意见。

发行人及其全体董事、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，并承担相应的法律责任。

中兴华会计师事务所（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。

## 重大风险提示

投资者在评价和购买本公司债券时，应认真考虑各项可能对债券的偿付、债券价值判断和投资者权益保护产生重大不利影响的风险因素，并仔细阅读相应募集说明书中“风险因素”等有关章节内容。

截至本报告期末，除上述提示风险外，公司面临的风险因素与上一报告期末及《募集说明书》中提示的风险无重大变化。

## 目录

|                                  |    |
|----------------------------------|----|
| 重要提示.....                        | 2  |
| 重大风险提示.....                      | 3  |
| 释义.....                          | 5  |
| 第一节 发行人情况.....                   | 6  |
| 一、 公司基本信息.....                   | 6  |
| 二、 信息披露事务负责人.....                | 6  |
| 三、 控股股东、实际控制人及其变更情况.....         | 7  |
| 四、 报告期内董事、监事、高级管理人员的变更情况.....    | 8  |
| 五、 公司业务和经营情况.....                | 10 |
| 六、 公司治理情况.....                   | 15 |
| 七、 环境信息披露义务情况.....               | 17 |
| 第二节 债券事项.....                    | 17 |
| 一、 公司信用类债券情况.....                | 17 |
| 二、 公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况.....   | 19 |
| 三、 公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况..... | 19 |
| 四、 公司债券募集资金使用情况.....             | 19 |
| 五、 发行人或者公司信用类债券报告期内资信评级调整情况..... | 19 |
| 六、 公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施情况..... | 20 |
| 七、 中介机构情况.....                   | 21 |
| 第三节 报告期内重要事项.....                | 22 |
| 一、 财务报告审计情况.....                 | 22 |
| 二、 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正.....     | 22 |
| 三、 合并报表范围调整.....                 | 23 |
| 四、 资产情况.....                     | 23 |
| 五、 非经营性往来占款和资金拆借.....            | 24 |
| 六、 负债情况.....                     | 24 |
| 七、 利润及其他损益来源情况.....              | 26 |
| 八、 报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十..... | 26 |
| 九、 对外担保情况.....                   | 27 |
| 十、 重大诉讼情况.....                   | 27 |
| 十一、 报告期内信息披露事务管理制度变更情况.....      | 28 |
| 十二、 向普通投资者披露的信息.....             | 29 |
| 第四节 特定品种债券应当披露的其他事项.....         | 29 |
| 一、 发行人为可交换债券发行人.....             | 29 |
| 二、 发行人为非上市公司非公开发行可转换公司债券发行人..... | 29 |
| 三、 发行人为绿色债券发行人.....              | 29 |
| 四、 发行人为永续期公司债券发行人.....           | 29 |
| 五、 其他特定品种债券事项.....               | 29 |
| 第五节 发行人认为应当披露的其他事项.....          | 29 |
| 第六节 备查文件目录.....                  | 30 |
| 财务报表.....                        | 32 |
| 附件一： 发行人财务报表.....                | 32 |

## 释义

|                 |   |  |
|-----------------|---|--|
| 本报告             | 指 | 国新证券公司债券年度报告（2022年）  |
| 报告期             | 指 | 2022年1月1日至2022年12月31日  |
| 《公司法》           | 指 | 《中华人民共和国公司法》   |
| 《证券法》           | 指 | 《中华人民共和国证券法》   |
| 中国证监会           | 指 | 中国证券监督管理委员会  |
| 交易所             | 指 | 上海证券交易所、深圳证券交易所及北京证券交易所                                      |
| 上交所             | 指 | 上海证券交易所  |
| 北交所             | 指 | 北京证券交易所  |
| 公司、本公司、母公司、国新证券 | 指 | 国新证券股份有限公司   |
| 国资委             | 指 | 国务院国有资产监督管理委员会   |
| 中国国新            | 指 | 中国国新控股有限责任公司   |
| 中国华融            | 指 | 中国华融资产管理股份有限公司（前身为中国华融资产管理公司）                                |
| 国新资本            | 指 | 国新资本有限公司   |
| 国新国证期货          | 指 | 国新国证期货有限责任公司，系国新证券股份有限公司的子公司                                 |
| 国新国证投资          | 指 | 国新国证投资管理有限公司，系国新证券股份有限公司的子公司                                 |
| 国新国证基金          | 指 | 国新国证基金管理有限公司，系国新证券股份有限公司的子公司                                 |
| 融鲲公司            | 指 | 融鲲（上海）企业管理有限公司，系国新国证期货有限责任公司的子公司                             |
| 工作日             | 指 | 每周一至周五，不含法定节假日或休息日   |
| 法定节假日/休息日       | 指 | 中华人民共和国的法定及政府指定节假日和/或休息日（不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾省的法定节假日和/或休息日） |
| 元、万元、亿元         | 指 | 人民币元、人民币万元、人民币亿元   |

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

## 第一节 发行人情况

### 一、公司基本信息

|           |   |
|-----------|---|
| 中文名称      | 国新证券股份有限公司  |
| 中文简称      | 国新证券  |
| 外文名称（如有）  | China Reform Securities Company Limited                       |
| 外文缩写（如有）  | China Reform Securities                                       |
| 法定代表人     | 张海文   |
| 注册资本（万元）  | 584,070.2569  |
| 实缴资本（万元）  | 584,070.2569  |
| 注册地址      | 北京市 西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室                              |
| 办公地址      | 北京市 朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦                                    |
| 办公地址的邮政编码 | 100020  |
| 公司网址（如有）  | <a href="http://www.crsec.com.cn">http://www.crsec.com.cn</a> |
| 电子信箱      | dshbgs@crsec.com.cn   |

### 二、信息披露事务负责人

|               |  |
|---------------|--|
| 姓名            | 汪强   |
| 在公司所任职务类型     | <input type="checkbox"/> 董事 <input checked="" type="checkbox"/> 高级管理人员 |
| 信息披露事务负责人具体职务 | 党委委员、执行委员会委员、副总经理、董事会秘书、财务负责人  |
| 联系地址          | 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦  |
| 电话            | 010-85556675   |
| 传真            | 010-85556690   |
| 电子信箱          | wangqiang@crsec.com.cn   |

### 三、控股股东、实际控制人及其变更情况

#### （一）报告期末控股股东、实际控制人信息

报告期末控股股东名称：国新资本有限公司

报告期末实际控制人名称：中国国新控股有限责任公司

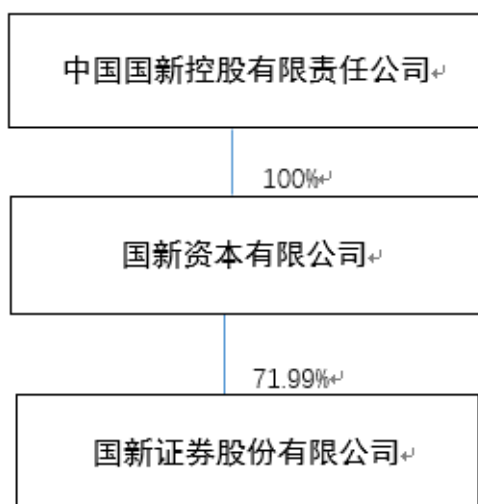
报告期末控股股东资信情况：截至 2022 年 12 月末，国新资本有限公司到期债务均已按期归还。

报告期末实际控制人资信情况：截至 2022 年 9 月末，中国国新控股有限责任公司到期债务均已按期归还。

报告期末控股股东对发行人的持股比例及股权<sup>1</sup>受限情况：报告期末控股股东对发行人的持股比例为 71.99%，不存在股权受限情况。

报告期末实际控制人对发行人的持股比例及股权受限情况：报告期末实际控制人对发行人的间接持股比例为 71.99%，不存在股权受限情况。

发行人与控股股东、实际控制人之间的产权及控制关系的方框图（有实际控制人的披露至实际控制人，无实际控制人的披露至最终自然人、法人或结构化主体）



控股股东为机关法人、国务院组成部门或相关机构直接监管的企业以外主体或者实际控制人为自然人

适用 不适用

控股股东、实际控制人所持有的除发行人股权外的其他主要资产及其受限情况

#### （1）国新资本

截至 2022 年 12 月末，国新资本有限公司资产总额 1,924 亿元，负债总额为 1,296 亿元，净资产为 628 亿元。2022 年 12 月末，国新资本有限公司资产主要包括应收保理融资款 582 亿元、应收租赁融资款 583 亿元、应收中国国新控股有限责任公司借款 318 亿元。国新资本有限公司被用作借款和金融机构融资款项抵质押物的账面价值为 309 亿元。

#### （2）中国国新

截至 2022 年 9 月末，中国国新控股有限责任公司合并层面资产总额 8,209 亿元，负债

<sup>1</sup>均包含股份，下同。

总额为4,636亿元，净资产为3,573亿元。2022年9月末，中国国新控股有限责任公司合并层面主要包括交易性金融资产2,247亿元、长期股权投资2,448亿元、其他权益工具投资1,134亿元。截至2022年6月，中国国新控股有限责任公司合并层面被用作履约保证金、央行法定准备金、卖出回购金融资产质押和借款质押的受限资产账面价值为333亿元。

## （二） 报告期内控股股东的变更情况

√适用 □不适用

报告期初控股股东名称：中国华融资产管理股份有限公司

变更生效时间：2022年6月24日

变更原因：根据监管机构对金融资产管理公司逐步退出非主业的要求，公司原控股股东中国华融将持有的公司股权对外公开转让。2022年1月27日，中国华融与国新资本签署《国有产权交易合同》。本次交易经中国华融2022年第一次临时股东大会审议通过，获国务院国有资产监督管理机构批准，并于2022年6月23日收到中国证券监督管理委员会批复，核准中国国新为公司实际控制人，对国新资本受让中国华融股权无异议。2022年6月24日交易双方完成了股权交割工作。

## （三） 报告期内实际控制人的变更情况

√适用 □不适用

报告期初实际控制人名称：中华人民共和国财政部

变更生效时间：2022年6月24日

变更原因：根据监管机构对金融资产管理公司逐步退出非主业的要求，公司原控股股东中国华融将持有的公司股权对外公开转让。2022年1月27日，中国华融与国新资本签署《国有产权交易合同》。本次交易经中国华融2022年第一次临时股东大会审议通过，获国务院国有资产监督管理机构批准，并于2022年6月23日收到中国证券监督管理委员会批复，核准中国国新为公司实际控制人，对国新资本受让中国华融股权无异议。2022年6月24日交易双方完成了股权交割工作。

## 四、报告期内董事、监事、高级管理人员的变更情况

### （一） 报告期内董事、监事、高级管理人员是否发生变更

√发生变更 □未发生变更

| 变更人员类型 | 变更人员名称 | 变更人员职务 | 变更类型 | 决定（议）时间或辞任生效时间 | 工商登记完成时间   |
|--------|--------|--------|------|----------------|------------|
| 董事     | 陈 稹    | 独立董事   | 任职   | 2022年6月12日     | 2022年8月15日 |
| 董事     | 姚长辉    | 独立董事   | 离任   | 2022年6月12日     | 2022年8月15日 |
| 董事     | 郑则鹏    | 董事     | 任职   | 2022年7月28日     | 2022年8月15日 |
| 董事     | 孙鲁军    | 董事     | 任职   | 2022年7月        | 2022年8月    |

|        |     |          |    |             |                   |
|--------|-----|----------|----|-------------|-------------------|
|        |     |          |    | 28日         | <b>15日</b>        |
| 董事     | 申小林 | 董事       | 任职 | 2022年7月28日  | 2022年8月15日        |
| 董事     | 王志学 | 董事       | 任职 | 2022年7月28日  | 2022年8月15日        |
| 董事     | 孙宏慧 | 董事       | 任职 | 2022年7月28日  | <b>2022年8月15日</b> |
| 董事     | 严红波 | 董事       | 离任 | 2022年7月28日  | <b>2022年8月15日</b> |
| 董事     | 高洁  | 董事       | 离任 | 2022年7月28日  | <b>2022年8月15日</b> |
| 董事     | 刘晓群 | 董事       | 离任 | 2022年7月28日  | 2022年8月15日        |
| 监事     | 关丽  | 监事       | 任职 | 2022年7月28日  | 2022年8月16日        |
| 监事     | 辛学东 | 监事会主席、监事 | 离任 | 2022年7月28日  | 2022年8月16日        |
| 监事     | 关丽  | 监事会主席    | 任职 | 2022年8月8日   | 2022年8月16日        |
| 监事     | 孙玉梅 | 监事       | 任职 | 2022年11月23日 | 暂未进行工商登记          |
| 监事     | 王胜华 | 监事       | 离任 | 2022年11月23日 | 暂未进行工商登记          |
| 高级管理人员 | 汪强  | 董事会秘书    | 任职 | 2022年3月17日  | 不适用               |
| 高级管理人员 | 齐宁  | 董事会秘书    | 离任 | 2022年3月17日  | 不适用               |
| 高级管理人员 | 汪强  | 财务负责人    | 任职 | 2022年8月5日   | 2022年8月15日        |
| 高级管理人员 | 高鹤  | 副总经理     | 离任 | 2022年12月15日 | 不适用               |
| 高级管理人员 | 邹煜  | 总经理助理    | 任职 | 2022年12月15日 | 不适用               |
| 高级管理人员 | 齐宁  | 总法律顾问    | 任职 | 2022年11月17日 | 不适用               |

注：1、上述人员变动主要系因公司控股股东变更、工作调整安排及个人原因所致，未影响公司治理的稳定性，未对公司持续经营产生不利影响，且履行了必要的法定程序。

2、除总经理、财务负责人外的高级管理人员变更无须进行工商变更或备案。

## （二）报告期内董事、监事、高级管理人员离任人数

报告期内董事、监事、高级管理人员的离任（含变更）人数：13人，离任人数占报告期初全体董事、监事、高级管理人员总人数59%。

## （三）定期报告批准报出日董事、监事、高级管理人员名单

定期报告批准报出日发行人的全体董事、监事、高级管理人员名单如下：

发行人的法定代表人：张海文

发行人的董事长：张海文

发行人的其他董事：郑则鹏、葛东红、张涵宇、马媛茹、申小林、葛群、杨铭海、杨生斌、刘宁宇、陈稹

发行人的监事：关丽、孙玉梅、徐维利、王云峰、盖克苏

发行人的总经理：曾建勇

发行人的财务负责人：汪强

发行人的其他非董事高级管理人员：李虎、齐宁、黄芳、邹煜

## 五、公司业务和经营情况

### （一）公司业务情况

#### 1.报告期内公司业务范围、主要产品（或服务）及其经营模式、主营业务开展情况

**经营范围：**证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营业务；证券资产管理；融资融券；代销金融产品业务；证券投资基金销售业务。

此外，公司还具有以下业务资格：

（1）经中国证监会核准或认可的业务资格：网上交易、受托理财、直接投资、银行间市场利率互换、集合资管计划投资权益收益互换产品、自营业务及证券资产管理业务开展股指期货交易、证券资产管理业务开展国债期货交易、约定回购式证券交易、股票收益互换业务。

（2）交易所核准的业务资格：权证交易、质押式回购、港股通、上市公司股权激励行权融资、股票期权经纪、股票期权自营业务、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易、转融通证券出借交易。

（3）中国证券业协会核准的业务资格：报价转让、中小企业私募债券承销、柜台市场、股份转让系统从事推荐业务和经纪业务、互联网证券业务。

（4）中国人民银行核准的业务资格：全国银行间拆借市场成员。

（5）其它资格：证券业务外汇经营许可证、受托管理保险资金、期权结算、转融资、转融券、新三板做市商、军工涉密业务咨询服务业务、标准化票据业务存托机构资质。

公司坚持以服务实体经济为使命，积极贯彻“以投研为先导，以投行为引领，资管、财富、自营协同驱动”的发展思路，构建了包括“投行、资管、财富管理、自营投资、公募基金、期货和私募股权基金”在内的较为全面的业务布局，同时拥有代销金融产品、新三板、股票期权等多项重要业务资格，形成了较为健全的牌照体系。

#### 主营业务开展情况：

### （1）投资银行业务

2022年，公司投行股权业务创收能力不断提高，债券业务稳步发展。年内完成保荐承销项目3单，其中IPO项目2单、上市公司再融资项目1单，募集资金总规模为50.75亿元，公司承销规模37.48亿元。截至2022年末，公司督导新三板挂牌公司33家（含1家北交所上市企业），年内共完成新三板挂牌项目2单，新三板定向增发项目1单，定增规模0.1亿元。债券业务方面，全年共完成债券承销项目16单，项目总规模425.85亿元，公司承销规模52.36亿元；全年共承销地方政府债74只，承销规模32.98亿元。

### （2）资产管理业务

2022年，公司资产管理业务坚持“稳住主营业务，恢复增长态势”的基本思路，以投研能力和营销能力提升为驱动，以合规风控能力建设为保障，坚持绝对收益策略打磨产品，在资本市场震荡加剧的市场环境下，产品取得较好业绩，立足客户以理财子公司为突破点，开拓新的合作渠道；抓住有利时机推进产品整改，助力公司资产管理业务高质量发展。截至2022年末，资产管理业务整体管理规模192.07亿元，未终止产品规模154.26亿元。未终止产品中，集合产品7.11亿元，单一产品147.15亿元。全年新发产品6只，收益率均优于市场平均水平。

### （3）财富管理业务

2022年，公司财富管理业务单元坚定推进“2+2”业务发展战略，全力推动金融产品销售、融资融券两项重点业务突破，做好机构经纪、投顾业务两项重点业务布局，着力提升机构客户综合化服务能力，业务指标逆市优化，形成向上发展的良好势头。截至2022年末，公司累计账户总数达到137.8万户，较上年末增长5.2%；代销金融产品净收入排名实现逆市上升，由上年末的53名（53/94）提升至2022年第三季度的50名（50/98）<sup>2</sup>；在市场交易量萎缩的形势下，公司融券规模达到1,241万元，较上年增长45.99%。

### （4）自营业务

2022年，公司自营业务单元加快融入国有资本运营业务格局，立足国有资本运营事业，紧密围绕服务国家战略、服务实体经济、服务国资国企改革发展。支持基础设施领域投融资，积极参与公募REITs投资，平均收益率达15.36%。自营固定收益投资业务强化市场研判，以利率债、央企债等优质债券投资为主，获取稳健、高质量的投资回报，收益率达8%以上。

### （5）主要控股公司的经营情况

#### <1> 国新国证期货

2022年，国新国证期货经纪业务营销取得较好成效，年末客户规模8.57亿元，同比增长53.4%；全年手续费收入0.17亿元，同比下降20.4%；成交额5,802.67亿元，同比增长31.02%；新增开户数567户，同比增长45.76%。全年实现营业收入0.34亿元（含融鲲公司），同比下降37.43%；净利润-0.22亿元，同比下降912.31%，降幅较大的原因主要为公允价值变动损益-0.2亿元，较上年同期减少0.35亿元。

#### <2> 国新国证投资

2022年，国新国证投资新增投资项目4个，共计管理股权投资基金10只，总认缴规模132.46亿元（实缴规模20.07亿元）。全年实现合并口径收入-2.83亿元，净利润0.13亿元，收入主要为手续费及佣金收入、投资收益、公允价值变动损益等。其中，手续费及佣金收入主要为国新国证投资收取的基金管理费收入，投资收益主要来源于基金投放项目取得的投资收益，以及国新国证投资和旗下基金的闲置资金流动性管理收益，公允价值变动损益反映的为项目估值变化。

#### <3> 国新国证基金

<sup>2</sup> 数据来自中国证券业协会综合业务管理平台（<https://mh.sac.net.cn/#/>）。

2022年，国新国证基金共管理公募基金产品10只，产品线覆盖货币型基金、债券型基金、偏股混合型基金、FOF基金，管理规模达到58.02亿元，同比增长10.35%。根据公募基金2022年四季报<sup>3</sup>，作为行业内第142家成立的公募基金管理人，国新国证基金非货币型基金的资产管理规模在全行业156家公募基金公司中排名第130位。

2.报告期内公司所处行业情况，包括所处行业基本情况、发展阶段、周期性特点等，以及公司所处的行业地位、面临的主要竞争状况，可结合行业特点，针对性披露能够反映公司核心竞争力的行业经营性信息

2022年，A股市场整体呈现振荡下跌走势，428家公司首发上市，比2021年下降18.16%；筹资5,869亿元，增长8.14%。上证指数下跌15.13%，创业板指下跌29.37%，科创50指数下跌31.35%。A股市场日均成交额1.18万亿元，比2021年日均成交额增长7.33%。债券市场总体保持横盘振荡行情，债券发行61.53万亿元，比2021年下降0.38%，其中，信用债发行20.49万亿元，比2021年增长2.19%。2022年，中证国债指数涨3.36%，中证企业债指数涨2.53%，5年期国债期货跌0.73%，10年期国债期货跌0.53%<sup>4</sup>。

2022年，证券行业集中度持续提高，各家券商充分利用自身的资源禀赋建立细分领域的差异化竞争优势，扬长避短稳住态势，力争在新一轮竞争中确立行业地位。

2022年是公司重装起航的新起点，公司坚持“稳中求进”和“高质量发展”的工作总要求，以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，全面贯彻党的二十大精神，深入贯彻落实中央金融工作决策部署和监管要求，积极融入国有资本运营事业，全力开启“二次创业”新征程。年内公司克服市场低迷、疫情冲击等不利因素影响，大力推进业务开拓，努力防范、化解风险，整体保持了稳中有进的发展态势。公司合并口径全年实现营业收入5.97亿元，净利润5.01亿元，较上年大幅上升176.43%。公司各项财务指标保持稳健，风控指标及流动性指标符合监管要求。总体来看，公司业绩不断向好、行业排名稳步提升、业务协同加大、内控基础夯实、机制改革深化、声誉品牌重塑，全面开启发展新篇章。

3.报告期内公司业务、经营情况及公司所在行业情况是否发生重大变化，以及变化对公司生产经营和偿债能力产生的影响

报告期内公司经营正常，各项业务稳步开展，公司业务、经营情况及公司所在行业未发生重大变化。

## （二） 新增业务板块

报告期内发行人合并报表范围新增收入或者利润占发行人合并报表相应数据10%以上业务板块

是 否

## （三） 主营业务情况

### 1. 分板块、分产品情况

#### (1) 业务板块情况

单位：亿元 币种：人民币

<sup>3</sup> 数据来源于Wind。

<sup>4</sup> 本段数据来源于Wind。

| 业务板块   | 本期    |       |         |         | 上年同期  |       |        |         |
|--------|-------|-------|---------|---------|-------|-------|--------|---------|
|        | 营业收入  | 营业成本  | 毛利率（%）  | 收入占比（%） | 营业收入  | 营业成本  | 毛利率（%） | 收入占比（%） |
| 自营业务   | 2.84  | 0.29  | 89.79   | 47.57   | 4.84  | 0.39  | 91.94  | 58.52   |
| 财富管理业务 | 6.48  | 5.19  | 19.91   | 108.54  | 7.95  | 5.51  | 30.69  | 96.13   |
| 投资银行业务 | 1.45  | 1.07  | 26.21   | 24.29   | 1.52  | 1.25  | 17.76  | 18.38   |
| 资产管理业务 | -0.63 | 0.50  | —       | -10.55  | 0.52  | 0.51  | 1.92   | 6.29    |
| 其他业务   | -4.17 | 5.35  | —       | -69.85  | -6.56 | 3.34  | —      | -79.32  |
| 合计     | 5.97  | 12.40 | -107.71 | 100.00  | 8.27  | 11.00 | -33.01 | 100.00  |

数据来源：公司管理报表，营业成本为业务及管理费

## (2) 各产品（或服务）情况

适用 不适用

按产品或服务不能反映公司经营全貌。

## 2. 收入和成本分析

各业务板块、各产品（或服务）营业收入、营业成本、毛利率等指标同比变动在 30%以上的，发行人应当结合所属行业整体情况、经营模式、业务开展实际情况等，进一步说明相关变动背后的经营原因及其合理性。

**自营业务：**营业收入为 2.84 亿元，较上年同期变动率为-41.32%。变动原因：受宏观经济影响，权益市场大幅波动，导致权益投资业务收入下降。

**财富管理业务：**毛利率 19.91%，较上年同期变动率为-35.13%。变动原因：2022 年经纪业务、融资融券业务收入受资本市场动荡影响均同比下降，同时较上年减少了自有资金股票质押业务，导致营业收入较上年同期下降 18.49%，而营业成本无较大变化，收入下降幅度大于成本是导致毛利率较上年同期出现较大降幅的主要原因。

**投资银行业务：**毛利率 26.21%，较上年同期变动率为 47.56%。变动原因：2022 年投行业务单元营业收入较上年同期下降 4.61%，而受疫情影响差旅费等业务费用减少、证券投保基金缴纳比例下降等，导致营业成本较上年同期下降 14.40%，成本下降幅度大于收入是导致毛利率较上年同期出现较大增幅的主要原因。

**资产管理业务：**营业收入为-0.63 亿元，较上年同期变动率为-221.15%，较上年同期由盈转亏。变动原因：多只产品清算、产品规模压降导致管理费收入、投资收益等下降。

**其他业务：**营业收入为-4.17 亿元，较上年同期变动率为 36.43%，营业成本 5.35 亿元，较上年同期变动率为 60.18%。变动原因：（1）公司偿还到期债务后融资成本较去年同期减少，导致利息净收入同比增加；（2）所持抵债权益资产恢复上市后估值上涨，导致公允价值收益同比增加等。

## （四） 公司关于业务发展目标的讨论与分析

1. 结合公司面临的特定环境、所处行业及所从事业务的特征，说明报告期末的业务发展目

标

按照公司所处的新的发展阶段和整体转型战略要求，公司业务发展的总体目标是：全面落实中国国新“1345”战略，紧紧围绕“立足国有资本运营公司服务国资央企改革大局”这一中心任务，立足于国新，服务于央企，助力于国家战略，以促进实体产业发展为主线，以遵循证券业务规律为基础，以助力打造国有资本运营升级版为抓手，以改革创新为动力、以合规经营为保障，通过“专业能力+品牌建设”加快构筑自身的竞争优势，为资本市场发展、国资央企改革和中国式现代化建设作出积极贡献。

## 2.公司未来可能面对的风险，对公司的影响以及已经采取或拟采取的措施

### （1）市场风险及其应对措施

公司面临的市场风险是公司投资组合由于相关市场的不利变化而导致损失的风险，主要来自三方面：

〈1〉权益类风险：来自股票、股票组合及股指期货等权益类证券的价格及波动率变化上的风险暴露；

〈2〉利率类风险：来自固定收益投资收益率期限结构、利率波动性和信用利差等变化上的风险暴露；

〈3〉汇率类风险：来自外汇汇率即期、远期价格及波动率变化上的风险暴露。

公司主要采取以下措施管理和防范市场风险：一是在风险偏好及限额方案中确定风险敞口、久期、杠杆等指标，并逐日监控；二是针对权益投资建立股票池，对投资经理管理账户买入单一股票的集中度进行管控；针对固收投资建立债券池，分为投资级、谨慎投资级、禁止投资级三类，分别制定相应投资限制；三是逐日计算在险价值（VaR），有效计量市场风险，持续开展压力测试；四是通过信息系统实现对相关限额指标的前端控制，报告期内对市场风险系统进行了升级，可全面覆盖面临市场风险的各类业务，可计量权益类、固定收益类及金融衍生类等资产的在险价值（VaR）。

### （2）信用风险及其应对措施

公司面临的信用风险是指由于融资方或交易对手不能正常履约而导致公司发生经济损失的风险，主要来自三方面：

〈1〉融资融券等融资类业务客户出现违约的风险；

〈2〉债券投资中由于发行人出现违约，不能兑付本息的风险；

〈3〉利率互换等场外衍生品交易中交易对手不能履行支付义务的风险。

公司主要采取以下措施管理和防范信用风险：一是在风险偏好及限额方案中确定自营债券投资的准入评级、AA级以上债券持仓占比、AA+级以上债券持仓占比，融资融券业务的履约保障比例等指标；二是根据发行人、交易对手信用等级进行投资债券集中度限制，采取分散化投资策略；三是通过对融资融券标的价格、客户维持担保比例等指标的逐日盯市，及时监控客户和标的证券负面事件，提前发现潜在信用风险；通过风险提示、补充担保、强制平仓、司法追索等方式确保公司融出资金安全，并对违约客户进行债务追偿；四是结合风险排查、投后跟踪等手段控制投后信用风险；五是优化信用评级体系，上线内评系统。

### （3）流动性风险及其应对措施

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。

公司主要采取以下措施管理和防范流动性风险：一是与商业银行保持良好合作关系，不断拓宽融资渠道；二是密切监控资产负债表，管理资产与负债的匹配情况；三是加强现金流管理，编制资金头寸日报表，动态反映资金充足水平，定期开展资金缺口分析，及时制定流动性补充计划，妥善安排资金来源和运用。报告期内公司未发生流动性风险事件。

### （4）操作风险及其应对措施

公司面临的的操作风险是指由于不完善或有问题的内部程序、员工、信息科技系统以及外部事件造成损失的风险。

公司操作风险分布于各部门、分支机构及子公司的各个岗位及流程，主要采取以下措

施管理和防范操作风险：一是将操作风险管理与内控管理相结合，完善内控手册和风险控制矩阵，明确业务开展关键风险环节的操作要求；二是通过业务流程梳理与制度审核等手段不断完善工作流程；三是定期开展内控和操作风险检查；四是开展培训宣导，不断提升全员操作风险防控意识。

#### （5）声誉风险及其应对措施

公司面临的声誉风险是指由于公司行为或外部事件及公司工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范等相关行为，导致利益相关方对公司形成负面评价的风险。

公司声誉风险分布于各部门、分支机构及子公司的各个岗位及流程，主要采取以下措施管理和防范声誉风险：一是进一步优化声誉风险管理职能部门职责分工；二是修订声誉风险管理制度，落实外规内化要求；三是持续开展声誉风险舆情监测，进行声誉风险事前评估，有效识别风险信息 and 风险来源，采取相应风控措施。

## 六、公司治理情况

### （一） 发行人报告期内是否存在与控股股东、实际控制人以及其他关联方之间不能保证独立性的情况：

是 否

### （二） 发行人报告期内是否存在与控股股东、实际控制人以及其他关联方之间在资产、人员、机构、财务、业务经营等方面的相互独立情况：

报告期内，公司控股股东国新资本、实际控制人中国国新严格遵照《公司法》要求依法行使出资人权利并履行相应义务，赋予公司充分的经营自主权，保持公司经营管理独立性。不利用控制权损害公司及其他股东的合法权益，不利用控制地位谋取非法利益。

国新资本作为公司控股股东，一是严格依法行使出资人权利、履行出资人义务。按照法律法规和《公司章程》提名董事和监事，不对股东大会人事选举结果和董事会人事聘任决议设置批准程序。不超越股东大会和董事会直接或间接干预公司的决策和经营活动。尊重公司财务独立性，不占用、支配其资产，不干预其财务、会计活动。二是不干预公司的经营管理活动，维护公司董事会、监事会、业务经营部门或其他机构及其人员的独立运作，不干预公司机构的设立、调整或者取消，不通过行使投票权以外的方式对公司董事会、监事会和其他机构及其人员行使职权进行限制或施加其他不正当影响。坚决规范国新资本与公司之间董事、监事、高级管理人员的交叉任职，且国新资本与公司的高级管理人员不得兼任另一方的高级管理人员。

中国国新作为公司实际控制人，一是坚持以符合《公司法》《公司章程》的方式，履行实控人职责，尊重公司的法人治理结构和内部决策流程。二是建立防范违法违规干预公司业务经营的工作机制，在纪检监察、内部审计、法律风控、财务等条线完善对于中国国新的机构、人员违规干预公司业务经营的监督追责机制。

### （三） 发行人关联交易的决策权限、决策程序、定价机制及信息披露安排

#### 1. 决策权限和决策程序

本公司严格按照公司关联交易管理办法的规定，并履行关联交易决策审批程序：

（1）重大关联交易是指连续十二个月内与同一关联人累计交易金额在 3000 万元以上，且占公司最近一期经审计净资产绝对值 5% 以上的关联交易事项（对外提供担保、受赠现金资产、单纯减免公司义务的债务除外），以及为关联人提供担保。重大关联交易应提交董事会审议，股东大会审批。关联董事、关联股东应回避表决，也不得代理其他董事、股东行使表决权。

公司拟发生重大关联交易的，应聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所或资产评估事务所对交易标的进行审计或评估，出具审计或者评估报告。与日常经营相关的重大关联交易所涉及的交易标的，可以不进行审计或者评估。重大关联交易应由独立董事对其公允性及合规性发表意见，方可提交董事会审议。公司审计委员会应同时对该交易事项进行审核，形成书面意见，提交董事会审议，并报告监事会。

（2）一般关联交易是指连续十二个月内累计与同一关联自然人发生的交易金额在 30

万元以上，以及与同一关联法人发生的交易金额在 300 万元以上，且占公司最近一期经审计净资产绝对值 0.5% 以上的关联交易事项。一般关联交易应提交董事会审批。关联董事回避表决，也不得代理其他董事行使表决权。

（3）金额在一般关联交易以下的为其他关联交易，其他关联交易的审批层级与相应业务的授权一致。

## 2. 定价机制

本公司严格按照关联交易管理办法的规定，遵守关联交易定价原则：

- （1）交易事项实行政府定价的，可以直接适用该价格。
- （2）交易事项实行政府指导价的，可以在政府指导价的范围内合理确定交易价格。
- （3）除实行政府定价或政府指导价外，交易事项有可比的独立第三方的市场价格或收费标准的，可以优先参考该价格或标准确定交易价格。

（4）关联事项无可比的独立第三方市场价格的，交易定价可以参考关联方与独立于关联方的第三方发生非关联交易价格确定。

（5）既无独立第三方的市场价格，也无独立的非关联交易价格可供参考的，可以合理的构成价格作为定价的依据，构成价格为合理成本费用加合理利润。

## 3. 信息披露安排

公司关联交易情况根据相关规定在公司定期报告或临时报告中予以披露。

### （四） 发行人关联交易情况

#### 1. 日常关联交易

适用  不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 关联交易类型          | 该类关联交易的金额 |
|-----------------|-----------|
| 向关联方提供服务        | 0.28      |
| 接受关联方出让资产使用权或服务 | 0.08      |
| 利息支出            | 0.05      |

#### 2. 其他关联交易

适用  不适用

#### 3. 担保情况

适用  不适用

#### 4. 报告期内与同一关联方发生的关联交易情况

报告期内与同一关联方发生关联交易累计金额超过发行人上年末净资产的

适用  不适用

### （五） 发行人报告期内是否存在违反法律法规、自律规则、公司章程、公司信息披露事务管理制度等规定的情况

是  否

### （六） 发行人报告期内是否存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况

是  否

## 七、环境信息披露义务情况

发行人是否属于应当履行环境信息披露义务的主体

是 否

## 第二节 债券事项

### 一、公司信用类债券情况

公司债券基本信息列表（以未来行权（含到期及回售）时间顺序排列）

单位：亿元 币种：人民币

|                            |                            |
|----------------------------|----------------------------|
| 1、债券名称                     | 华融证券股份有限公司 2020 年次级债券（第一期） |
| 2、债券简称                     | 20 华融 C1                   |
| 3、债券代码                     | 166035.SH                  |
| 4、发行日                      | 2020 年 3 月 26 日            |
| 5、起息日                      | 2020 年 3 月 26 日            |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日   | -                          |
| 7、到期日                      | 2023 年 3 月 26 日            |
| 8、债券余额                     | 36                         |
| 9、截止报告期末的利率(%)             | 4.60                       |
| 10、还本付息方式                  | 每年付息一次，到期一次还本              |
| 11、交易场所                    | 上交所                        |
| 12、主承销商                    | 东兴证券股份有限公司                 |
| 13、受托管理人                   | 东兴证券股份有限公司                 |
| 14、投资者适当性安排                | 面向专业机构投资者交易的债券             |
| 15、适用的交易机制                 | 报价、询价和协议交易                 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 无                          |

|                          |  |
|--------------------------|--|
| 1、债券名称                   | 华融证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（疫情防控债）（第一期） |
| 2、债券简称                   | 20 华融 G1                                     |
| 3、债券代码                   | 163373.SH                                    |
| 4、发行日                    | 2020 年 4 月 2 日                               |
| 5、起息日                    | 2020 年 4 月 2 日                               |
| 6、2023 年 4 月 30 日后的最近回售日 | -  |
| 7、到期日                    | 2023 年 4 月 2 日                               |
| 8、债券余额                   | 30   |
| 9、截止报告期末的利率(%)           | 3.14   |
| 10、还本付息方式                | 每年付息一次，到期一次还本                                |
| 11、交易场所                  | 上交所  |
| 12、主承销商                  | 东兴证券股份有限公司                                   |
| 13、受托管理人                 | 东兴证券股份有限公司                                   |

|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| 14、投资者适当性安排                | 面向专业投资者交易的债券  |
| 15、适用的交易机制                 | 竞价、报价、询价和协议交易 |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 无             |

|                            |                               |
|----------------------------|-------------------------------|
| 1、债券名称                     | 华融证券股份有限公司2020年非公开发行公司债券（第一期） |
| 2、债券简称                     | 20华融F1                        |
| 3、债券代码                     | 167919.SH                     |
| 4、发行日                      | 2020年10月23日                   |
| 5、起息日                      | 2020年10月23日                   |
| 6、2023年4月30日后的最近回售日        | -                             |
| 7、到期日                      | 2023年10月23日                   |
| 8、债券余额                     | 20                            |
| 9、截止报告期末的利率(%)             | 4.65                          |
| 10、还本付息方式                  | 每年付息一次，到期一次还本                 |
| 11、交易场所                    | 上交所                           |
| 12、主承销商                    | 东兴证券股份有限公司                    |
| 13、受托管理人                   | 东兴证券股份有限公司                    |
| 14、投资者适当性安排                | 面向专业机构投资者交易的债券                |
| 15、适用的交易机制                 | 报价、询价和协议交易                    |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 无                             |

|                            |                          |
|----------------------------|--------------------------|
| 1、债券名称                     | 华融证券股份有限公司2020年次级债券（第二期） |
| 2、债券简称                     | 20华融C2                   |
| 3、债券代码                     | 167920.SH                |
| 4、发行日                      | 2020年10月26日              |
| 5、起息日                      | 2020年10月26日              |
| 6、2023年4月30日后的最近回售日        | -                        |
| 7、到期日                      | 2023年10月26日              |
| 8、债券余额                     | 10                       |
| 9、截止报告期末的利率(%)             | 4.95                     |
| 10、还本付息方式                  | 每年付息一次，到期一次还本            |
| 11、交易场所                    | 上交所                      |
| 12、主承销商                    | 东兴证券股份有限公司               |
| 13、受托管理人                   | 东兴证券股份有限公司               |
| 14、投资者适当性安排                | 面向专业机构投资者交易的债券           |
| 15、适用的交易机制                 | 报价、询价和协议交易               |
| 16、是否存在终止上市或者挂牌转让的风险及其应对措施 | 无                        |

## 二、公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况

本公司所有公司债券均不含选择权条款  本公司的公司债券有选择权条款

## 三、公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况

本公司所有公司债券均不含投资者保护条款  本公司的公司债券有投资者保护条款

债券代码：166035.SH、163373.SH、167919.SH、167920.SH

债券简称：20华融C1、20华融G1、20华融F1、20华融C2

债券约定的投资者保护条款名称：

以下事件构成本次债券项下的违约事件：

1. 本次债券到期发行人未能偿付应付本金；
2. 发行人未能偿付本次债券的到期利息；
3. 发行人不履行或违反《受托管理协议》项下的任何承诺，且经发行人书面通知该种违约情形持续三十个连续工作日；
4. 发行人发生未能清偿到期银行或其他金融机构借款本金和/或利息，以及其他到期债务的违约情况；
5. 发行人丧失清偿能力、被法院指定接管人或已开始相关的诉讼程序；
6. 在本次债券存续期间内，其他因发行人自身违约和/或违规行为而对本次债券本息偿付产生重大不利影响的情形。

如果上述违约事件发生且一直持续五个连续工作日仍未解除，单独或合并持有本次未偿还债券本金总额 50% 以上的债券持有人可通过债券持有人会议决议，以书面方式通知发行人，宣布所有本次未偿还债券的本金和相应利息，立即到期应付。在宣布加速清偿后，如果发行人在不违反适用法律规定的前提下采取了以下救济措施，单独或合并持有本次未偿还债券本金总额 50% 以上的债券持有人可通过债券持有人会议决议，以书面方式通知发行人豁免其违约行为，并取消加速清偿的决定：

1. 向债券受托管理人提供保证金，且保证金数额足以支付以下各项金额的总和：

- (1) 债券受托管理人及其代理人和顾问的合理赔偿、费用和开支；
- (2) 所有迟付的利息及罚息；
- (3) 所有到期应付的本金；
- (4) 适用法律允许范围内就迟延履行计算的债券本金计算的复利；

2. 相关的违约事件已得到救济或被豁免；

3. 债券持有人会议同意的其他措施。

如果发生《受托管理协议》约定的违约事件且一直持续，债券受托管理人应根据债券持有人会议的指示，采取任何可行的法律救济方式（包括但不限于依法申请法定机关采取财产保全措施并根据债券持有人会议的决定，对发行人提起诉讼/仲裁）回收债券本金和利息，或强制发行人履行《债券受托管理协议》或本期债券项下的义务。

投资者保护条款的触发和执行情况：

是  否

## 四、公司债券募集资金使用情况

本公司所有公司债券在报告期内和报告期后批准报出日前均不涉及募集资金使用或者整改

公司债券在报告期内和报告期后批准报出日前涉及募集资金使用或者整改

## 五、发行人或者公司信用类债券报告期内资信评级调整情况

适用  不适用

|          |           |
|----------|-----------|
| 债券代码（如有） | 163373.SH |
| 债券简称（如有） | 20华融G1    |

|                    |  |
|--------------------|--|
| 报告期初评级机构           | 联合资信评估股份有限公司   |
| 报告期末评级机构           | 联合资信评估股份有限公司   |
| 报告期初评级结果的评级出具时间    | 2021年9月1日  |
| 报告期末评级结果的评级出具时间    | 2022年6月27日   |
| 报告期初主体评级（如有）       | AAA  |
| 报告期末主体评级（如有）       | AAA  |
| 报告期初债项评级（如有）       | AAA  |
| 报告期末债项评级（如有）       | AAA  |
| 报告期初主体评级展望（如有）     | 负面   |
| 报告期末主体评级展望（如有）     | 稳定   |
| 报告期初是否列入信用观察名单（如有） | 是  |
| 报告期末是否列入信用观察名单（如有） | 否  |
| 评级结果变化的原因          | 随着股东变更事宜落地和业务逐渐恢复正常，公司竞争力有望回升。综合评估，联合资信确定维持公司主体长期信用等级为AAA，维持“20华融G1”的信用等级为AAA，评级展望调整为稳定，并移出负面评级观察名单。 |

## 六、公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施情况

### （一）报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施变更情况

适用 不适用

### （二）截至报告期末增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施情况

适用 不适用

债券代码：166035.SH

|   |  |
|---|--|
| 债券简称                                    | 20华融C1   |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容                    | 本期债券无增信机制，本期债券在存续期内每年付息一次，最后一次利息随本金兑付一起支付。本期债券设立偿付工作小组，健全风险监管和预警机制及加强信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用  |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况             | 本期债券均按时付息，偿债计划执行良好。  |

债券代码：163373.SH

|                      |  |
|----------------------|--|
| 债券简称                 | 20华融G1   |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容 | 本期债券无增信机制，本期债券在存续期内每年付息一次，最后一次利息随本金兑付一起支付。本期债券设立偿付工作小组，健全风险监管和预警机制及加强信息披露。 |

|   |                     |
|---|---------------------|
|   | 露。                  |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用                 |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况             | 本期债券均按时付息，偿债计划执行良好。 |

债券代码：167919.SH

|   |  |
|---|--|
| 债券简称                                    | 20 华融 F1   |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容                    | 本期债券无增信机制，本期债券在存续期内每年付息一次，最后一次利息随本金兑付一起支付。本期债券设立偿付工作小组，健全风险监管和预警机制及加强信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用  |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况             | 本期债券均按时付息，偿债计划执行良好。  |

债券代码：167920.SH

|   |  |
|---|--|
| 债券简称                                    | 20 华融 C2   |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施内容                    | 本期债券无增信机制，本期债券在存续期内每年付息一次，最后一次利息随本金兑付一起支付。本期债券设立偿付工作小组，健全风险监管和预警机制及加强信息披露。 |
| 增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的变化情况及对债券持有人利益的影响（如有） | 不适用  |
| 报告期内增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况             | 本期债券均按时付息，偿债计划执行良好。  |

七、中介机构情况

（一）出具审计报告的会计师事务所

√适用 □不适用

|         |                                      |
|---------|--------------------------------------|
| 名称      | 中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）                    |
| 办公地址    | 北京市丰台区丽泽路 20 号院 1 号楼丽泽 SOHO B 座 20 层 |
| 签字会计师姓名 | 乔迪、赵志刚                               |

（二）受托管理人/债权代理人

|      |   |
|------|---|
| 债券代码 | 166035.SH、163373.SH、167919.SH、167920.SH |
| 债券简称 | 20华融C1、20华融G1、20华融F1、20华融C2             |
| 名称   | 东兴证券股份有限公司                              |
| 办公地址 | 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座6层                    |
| 联系人  | 张嘉淮                                     |
| 联系电话 | +86 18511526056                         |

（三）资信评级机构

√适用 □不适用

|      |                       |
|------|-----------------------|
| 债券代码 | 163373.SH             |
| 债券简称 | 20华融G1                |
| 名称   | 联合资信评估股份有限公司          |
| 办公地址 | 北京市朝阳区建外大街2号PICC大厦12层 |

（四）报告期内中介机构变更情况

√适用 □不适用

| 债项代码                                    | 中介机构类型 | 原中介机构名称            | 变更后中介机构名称         | 变更时间      | 变更原因     | 履行的程序        | 对投资者利益的影响 |
|---|--------|--------------------|-------------------|-----------|----------|--------------|-----------|
| 166035.SH、163373.SH、167919.SH、167919.SH | 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中兴华会计师事务所（特殊普通合伙） | 2023年1月4日 | 合同义务履行完成 | 经公司董事会会议审议批准 | 无重大影响     |

### 第三节 报告期内重要事项

一、财务报告审计情况

√标准无保留意见 □其他审计意见

二、会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

□适用 √不适用

### 三、合并报表范围调整

报告期内新增合并财务报表范围内子公司，且新增的子公司报告期内营业收入、净利润或报告期末总资产任一占合并报表10%以上

适用 不适用

报告期内减少合并财务报表范围内子公司，且减少的子公司上个报告期内营业收入、净利润或上个报告期末总资产占上个报告期合并报表10%以上

适用 不适用

### 四、资产情况

#### （一）资产及变动情况

##### 1. 占发行人合并报表范围总资产10%以上的资产类报表项目的资产

| 项目名称    | 主要构成                                     |
|---------|--|
| 货币资金    | 货币资金主要包括现金、自有资金银行存款、客户资金银行存款以及银行存款产生的利息。 |
| 交易性金融资产 | 交易性金融资产主要包括债券、理财产品、股权、股票、基金投资。           |
| 其他债权投资  | 其他债权投资主要包括债券和资产管理计划。                     |

##### 2. 公司存在期末余额变动比例超过30%的资产项目

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 资产项目     | 本期末余额 | 占本期末资产总额的比例 (%) | 上期末余额 | 变动比例 (%) |
|----------|-------|-----------------|-------|----------|
| 应收款项     | 0.08  | 0.02            | 50.50 | -99.84   |
| 买入返售金融资产 | 14.87 | 3.86            | 8.20  | 81.34    |
| 交易性金融资产  | 45.89 | 11.93           | 69.04 | -33.53   |
| 债权投资     | 7.21  | 1.87            | 17.30 | -58.32   |
| 其他权益工具投资 | 0.25  | 0.06            | 1.07  | -76.64   |
| 无形资产     | 0.68  | 0.18            | 0.44  | 54.55    |
| 其他资产     | 1.83  | 0.48            | 3.03  | -39.60   |

发生变动的原因：

本公司所持有资管产品和其他权益投资的清理处置导致交易性金融资产、债权投资、其他权益工具投资减少。应收款项本年末减少的主要原因是收到资产转让款。买入返售金融资产本年末增加是资金头寸短期配置导致。

#### （二）资产受限情况

##### 1. 资产受限情况概述

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 受限资产类别  | 受限资产账面价值 | 资产受限金额 | 受限资产评估价值（如有） | 资产受限金额占该类别资产账面价值的比例（%） |
|---------|----------|--------|--------------|------------------------|
| 银行存款    | 64.74    | 0.23   |              | 0.36%                  |
| 交易性金融资产 | 45.89    | 5.66   |              | 12.33%                 |
| 其他债权投资  | 172.30   | 68.65  |              | 39.84%                 |
| 合计      | 282.93   | 74.54  | —            | —                      |

## 2. 单项资产受限情况

单项资产受限金额超过报告期末合并口径净资产 10%

适用 不适用

## 3. 发行人所持重要子公司股权的受限情况

截至报告期末，直接或间接持有的重要子公司股权存在权利受限情况

适用 不适用

## 五、非经营性往来占款和资金拆借

### （一）非经营性往来占款和资金拆借余额

1. 报告期初，发行人合并口径应收的非因生产经营直接产生的对其他方的往来占款和资金拆借（以下简称非经营性往来占款和资金拆借）余额：0 亿元；

2. 报告期内，非经营性往来占款和资金拆借新增：0 亿元，收回：0 亿元；

3. 报告期内，非经营性往来占款或资金拆借情形是否存在违反募集说明书相关约定或承诺的情况

无

4. 报告期末，未收回的非经营性往来占款和资金拆借合计：0 亿元，其中控股股东、实际控制人及其他关联方占款或资金拆借合计：0 亿元。

### （二）非经营性往来占款和资金拆借明细

报告期末，发行人合并口径未收回的非经营性往来占款和资金拆借占合并口径净资产的比例：0%，是否超过合并口径净资产的 10%：

是 否

### （三）以前报告期内披露的回款安排的执行情况

完全执行 未完全执行

## 六、负债情况

### （一）有息债务及其变动情况

#### 1. 发行人债务结构情况

报告期初和报告期末，发行人口径（非发行人合并范围口径）有息债务余额分别为 189.75 亿元和 173.59 亿元，报告期内有息债务余额同比变动-8.52%。

单位：亿元 币种：人民币

| 有息债务类别 | 到期时间 |           |                  |            | 金额合计 | 金额占有息债务的占比 |
|--------|------|-----------|------------------|------------|------|------------|
|        | 已逾期  | 6 个月以内（含） | 6 个月（不含）至 1 年（含） | 超过 1 年（不含） |      |            |
|        |      |           |                  |            |      |            |

|           |  |       |    |  |       |        |
|-----------|--|-------|----|--|-------|--------|
|           |  |       | )  |  |       |        |
| 公司信用类债券   |  | 66    | 30 |  | 96    | 55.30% |
| 银行贷款      |  |       |    |  |       |        |
| 非银行金融机构贷款 |  |       |    |  |       |        |
| 其他有息债务    |  | 77.59 |    |  | 77.59 | 44.70% |

注：报告期末有息债务余额不含利息。

报告期末发行人口径存续的公司信用类债券中，公司债券余额 96 亿元，企业债券余额 0 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0 亿元，且共有 30 亿元公司信用类债券在 2023 年 5 至 12 月内到期或回售偿付。

## 2. 发行人合并口径有息债务结构情况

报告期初和报告期末，发行人合并报表范围内公司有息债务余额分别为 189.75 亿元和 173.59 亿元，报告期内有息债务余额同比变动-8.52%。

单位：亿元 币种：人民币

| 有息债务类别    | 到期时间 |           |                  |            | 金额合计  | 金额占有息债务的占比 |
|-----------|------|-----------|------------------|------------|-------|------------|
|           | 已逾期  | 6 个月以内（含） | 6 个月（不含）至 1 年（含） | 超过 1 年（不含） |       |            |
| 公司信用类债券   |      | 66        | 30               |            | 96    | 55.30%     |
| 银行贷款      |      |           |                  |            |       |            |
| 非银行金融机构贷款 |      |           |                  |            |       |            |
| 其他有息债务    |      | 77.59     |                  |            | 77.59 | 44.70%     |

注：报告期末有息债务余额不含利息。

报告期末，发行人合并口径存续的公司信用类债券中，公司债券余额 96 亿元，企业债券余额 0 亿元，非金融企业债务融资工具余额 0 亿元，且共有 30 亿元公司信用类债券在 2023 年 5 至 12 月内到期或回售偿付。

## 3. 境外债券情况

截止报告期末，发行人合并报表范围内发行的境外债券余额 0 亿元人民币，且在 2023 年 5 至 12 月内到期的境外债券余额为 0 亿元人民币。

### （二）报告期末存在逾期金额超过 1000 万元的有息债务或者公司信用类债券逾期情况

适用 不适用

### （三）负债变动情况

公司存在期末余额变动比例超过 30%的负债项目

适用 不适用

单位：亿元 币种：人民币

| 负债项目    | 本期末余额 | 占本期末负债总额的比例（%） | 上年末余额  | 变动比例（%） |
|---------|-------|----------------|--------|---------|
| 应付短期融资款 | 0.05  | 0.02           | 0.13   | -61.54  |
| 拆入资金    | 6.00  | 2.15           | -      | -       |
| 代理承销证券款 | 0.00  | 0.00           | 0.76   | -100.00 |
| 应付职工薪酬  | 4.69  | 1.68           | 2.78   | 68.71   |
| 应付款项    | 32.12 | 11.51          | 113.48 | -71.70  |
| 预计负债    | 2.59  | 0.93           | 3.97   | -34.76  |
| 其他负债    | 0.08  | 0.03           | 0.17   | -52.94  |

发生变动的原因：

应付短期融资款：上年末应付短期融资款已到期偿还；

拆入资金：上年末无拆入资金余额，本年末新增短期拆入资金；

代理承销证券款：上年末应收代理承销证券款已于本年收回；

应付职工薪酬：按照薪酬制度及业绩计提应付职工薪酬；

应付款项：本年部分资管产品清算，支付产品委托人款项；

预计负债：本年部分预计负债已支付；

其他负债：上年末部分预收账款在本年已确认收入。

#### （四） 可对抗第三人的优先偿付负债情况

截至报告期末，发行人合并报表范围内存在可对抗第三人的优先偿付负债：

适用 不适用

### 七、利润及其他损益来源情况

#### （一） 基本情况

报告期利润总额：4.64 亿元

报告期非经常性损益总额：-0.18 亿元

报告期内合并报表范围利润主要源自非主要经营业务的：

适用 不适用

#### （二） 投资状况分析

如来源于单个子公司的净利润或单个参股公司的投资收益对发行人合并口径净利润影响达到 20%以上

适用 不适用

#### （三） 净利润与经营性净现金流差异

报告期公司经营活动产生的现金净流量与报告期净利润存在重大差异

适用 不适用

### 八、报告期末合并报表范围亏损超过上年末净资产百分之十

是 否

## 九、对外担保情况

报告期初对外担保的余额：0 亿元

报告期末对外担保的余额：0 亿元

报告期对外担保的增减变动情况：0 亿元

对外担保中为控股股东、实际控制人和其他关联方提供担保的金额：0 亿元

报告期末尚未履行及未履行完毕的对外单笔担保金额或者对同一对象的担保金额是否超过报告期末净资产 10%：是 否

## 十、重大诉讼情况

截至报告期末是否存在重大未决诉讼、证券特别代表人诉讼

是 否

| 原告姓名<br>(名称)                     | 被告姓名<br>(名称)  | 案由                     | 一审受理<br>时间             | 一审受理<br>法院                    | 标的金额(如<br>有) | 目前所处的<br>诉讼程序 |
|----------------------------------|---|------------------------|------------------------|-------------------------------|--------------|---------------|
| 国新证券<br>股份有限<br>公司               | 爱建证<br>券有限<br>责任公<br>司  | 公司债<br>券交易<br>纠纷       | 2020 年<br>9 月 14<br>日  | 上海国<br>际经济<br>贸易仲<br>裁委员<br>会 | 10,515.03 万元 | 仲裁            |
| 桂林银<br>行股份<br>有限公<br>司           | 国新证<br>券股份<br>有限公<br>司、招<br>商银行<br>北京分<br>行   | 金融委<br>托理财<br>合同纠<br>纷 | 2021 年<br>11 月 11<br>日 | 北京金<br>融法院                    | 10,002.11 万元 | 一审            |
| 营口银<br>行股份<br>有限公<br>司           | 国新证<br>券股份<br>有限公<br>司  | 合同纠<br>纷               | 2022 年<br>8 月 17<br>日  | 营口市<br>中级人<br>民法院             | 88,007.73 万元 | 一审            |
| 上海映<br>雪投资<br>管理中<br>心(有<br>限合伙) | 申万宏<br>源证券<br>承销保<br>荐有限<br>责任公<br>司、国<br>新证券<br>股份有<br>限公司<br>、亚太<br>(集团)<br>会计师<br>事务所<br>(特殊<br>普通合<br>伙)、北<br>京观韬<br>中茂律<br>师事务<br>所、东<br>方金诚<br>国际信<br>用评估<br>有限公<br>司 | 证券虚<br>假陈述<br>责任纠<br>纷 | 2022 年<br>9 月 13<br>日  | 辽宁省<br>沈阳市<br>中级人<br>民法院      | 2,364.64 万元  | 一审            |
| 上海映<br>雪投资<br>管理中<br>心(有<br>限合伙) | 申万宏<br>源证券<br>承销保<br>荐有限<br>责任公<br>司  | 证券虚<br>假陈述<br>责任纠<br>纷 | 2022 年<br>9 月 13<br>日  | 辽宁省<br>沈阳市<br>中级人<br>民法院      | 13,077.74 万元 | 一审            |

|                  |   |            |                 |              |              |    |
|------------------|---|------------|-----------------|--------------|--------------|----|
|                  | 司、国新证券股份有限公司、亚太(集团)会计师事务所(特殊普通合伙)、北京观韬中茂律师事务所、东方金诚国际信用评级有限公司                |            |                 |              |              |    |
| 东吴基金管理有限公司       | 申万宏源证券承销保荐有限责任公司、国新证券股份有限公司、亚太(集团)会计师事务所(特殊普通合伙)、北京观韬中茂律师事务所、东方金诚国际信用评级有限公司 | 证券虚假陈述责任纠纷 | 2022 年 7 月 13 日 | 辽宁省沈阳市中级人民法院 | 23,737.64 万元 | 一审 |
| 湖北襄阳农村商业银行股份有限公司 | 国新证券股份有限公司、国新证券股份有限公司襄阳长虹北路证券营业部、广发银行股份有限公司                                 | 侵权责任纠纷案    | 2022 年 4 月 26 日 | 襄阳市襄城区人民法院   | 7,129.63 万元  | 结案 |

注：以上为报告期内公司作为诉讼主体参与的标的额 2,000 万元以上的未决民事诉讼、仲裁案件。

#### 十一、 报告期内信息披露事务管理制度变更情况

发生变更 未发生变更

## 十二、 向普通投资者披露的信息

在定期报告批准报出日，发行人是否存续有面向普通投资者交易的债券

是 否

## 第四节 特定品种债券应当披露的其他事项

### 一、发行人为可交换债券发行人

适用 不适用

### 二、发行人为非上市公司非公开发行可转换公司债券发行人

适用 不适用

### 三、发行人为绿色债券发行人

适用 不适用

### 四、发行人为永续期公司债券发行人

适用 不适用

### 五、其他特定品种债券事项

无

## 第五节 发行人认为应当披露的其他事项

无。

## 第六节 备查文件目录

一、载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表；

二、载有会计师事务所盖章、注册会计师签名并盖章的审计报告原件（如有）；

三、报告期内在中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿；

四、按照境内外其他监管机构、交易场所等的要求公开披露的年度报告、年度财务信息。

发行人披露的公司债券信息披露文件可在交易所网站上进行查询，<http://www.sse.com.cn/>，原件也可在发行人办公场所查询。

（以下无正文）

(以下无正文，为国新证券股份有限公司 2022 年公司债券年报盖章页)



## 财务报表

### 附件一： 发行人财务报表

#### 合并资产负债表

2022 年 12 月 31 日

编制单位：国新证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 2022 年 12 月 31 日  | 2021 年 12 月 31 日  |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>             |                   |                   |
| 货币资金                   | 6,473,974,907.79  | 9,010,522,729.41  |
| 其中：客户资金存款              | 4,878,822,864.05  | 5,429,849,785.89  |
| 结算备付金                  | 3,216,754,420.81  | 2,713,644,230.29  |
| 其中：客户备付金               | 1,521,567,033.13  | 1,536,119,890.35  |
| 贵金属                    |                   |                   |
| 拆出资金                   |                   |                   |
| 融出资金                   | 3,270,189,274.38  | 3,716,843,969.37  |
| 衍生金融资产                 |                   |                   |
| 存出保证金                  | 468,582,825.53    | 452,853,540.92    |
| 应收款项                   | 8,001,547.63      | 5,049,847,236.24  |
| 应收款项融资                 |                   |                   |
| 合同资产                   |                   |                   |
| 买入返售金融资产               | 1,486,522,307.95  | 820,083,082.76    |
| 持有待售资产                 |                   |                   |
| <b>金融投资：</b>           |                   |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |                   |                   |
| 交易性金融资产                | 4,588,693,616.53  | 6,903,968,018.06  |
| 债权投资                   | 720,691,594.44    | 1,729,551,590.67  |
| 可供出售金融资产               |                   |                   |
| 其他债权投资                 | 17,229,580,251.66 | 16,920,777,314.10 |
| 其他权益工具投资               | 25,000,000.00     | 107,014,857.64    |
| 持有至到期投资                |                   |                   |
| 长期股权投资                 |                   |                   |
| 投资性房地产                 |                   |                   |
| 固定资产                   | 51,787,871.77     | 49,529,570.60     |
| 在建工程                   | 25,726,020.75     | 26,447,565.00     |
| 使用权资产                  | 203,630,392.05    | 259,193,306.60    |
| 无形资产                   | 67,633,341.58     | 44,443,097.76     |
| 商誉                     | 18,062,512.38     | 18,062,512.38     |
| 递延所得税资产                | 426,033,848.49    | 365,234,939.88    |
| 其他资产                   | 182,885,676.75    | 302,706,907.71    |

|                        |                   |                   |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 资产总计                   | 38,463,750,410.49 | 48,490,724,469.39 |
| <b>负债：</b>             |                   |                   |
| 短期借款                   |                   |                   |
| 应付短期融资款                | 5,140,000.00      | 13,040,000.00     |
| 拆入资金                   | 600,000,000.00    |                   |
| 交易性金融负债                |                   |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 |                   |                   |
| 衍生金融负债                 | 3,237,954.23      | 3,505,132.21      |
| 卖出回购金融资产款              | 7,157,682,272.61  | 5,611,972,535.21  |
| 代理买卖证券款                | 6,173,136,494.52  | 6,736,045,462.72  |
| 代理承销证券款                | 145,000.00        | 75,580,000.00     |
| 应付职工薪酬                 | 468,995,702.23    | 277,793,208.56    |
| 应交税费                   | 10,197,908.83     | 11,448,059.63     |
| 应付款项                   | 3,211,709,774.25  | 11,348,465,963.34 |
| 合同负债                   |                   |                   |
| 持有待售负债                 |                   |                   |
| 预计负债                   | 258,667,335.08    | 396,544,563.95    |
| 长期借款                   |                   |                   |
| 应付债券                   | 9,811,703,477.11  | 13,640,212,335.95 |
| 其中：优先股                 |                   |                   |
| 永续债                    |                   |                   |
| 租赁负债                   | 193,056,861.59    | 256,337,193.85    |
| 递延收益                   |                   |                   |
| 递延所得税负债                |                   |                   |
| 其他负债                   | 7,848,933.15      | 17,197,108.20     |
| 负债合计                   | 27,901,521,713.60 | 38,388,141,563.62 |
| <b>所有者权益（或股东权益）：</b>   |                   |                   |
| 实收资本（或股本）              | 5,840,702,569.00  | 5,840,702,569.00  |
| 其他权益工具                 |                   |                   |
| 其中：优先股                 |                   |                   |
| 永续债                    |                   |                   |
| 资本公积                   | 9,627,516,000.25  | 9,627,516,000.25  |
| 减：库存股                  |                   |                   |
| 其他综合收益                 | -18,347,055.49    | 54,399,145.92     |
| 盈余公积                   | 707,345,320.73    | 707,345,320.73    |
| 一般风险准备                 | 1,436,064,907.40  | 1,436,064,907.40  |
| 未分配利润                  | -7,073,977,452.59 | -7,608,459,963.82 |
| 归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计   | 10,519,304,289.30 | 10,057,567,979.48 |
| 少数股东权益                 | 42,924,407.59     | 45,014,926.29     |
| 所有者权益（或股东权益）           | 10,562,228,696.89 | 10,102,582,905.77 |

|                   |                   |                   |
|-------------------|-------------------|-------------------|
| 合计                |                   |                   |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计 | 38,463,750,410.49 | 48,490,724,469.39 |

法定代表人：张海文 主管会计工作负责人：汪强 会计机构负责人：王月晗

### 母公司资产负债表

2022年12月31日

编制单位：国新证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 2022年12月31日       | 2021年12月31日       |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>             |                   |                   |
| 货币资金                   | 5,674,815,106.57  | 7,289,761,978.76  |
| 其中：客户资金存款              | 4,230,830,885.72  | 5,035,663,608.08  |
| 结算备付金                  | 3,265,926,400.40  | 2,759,448,747.03  |
| 其中：客户备付金               | 1,521,567,033.13  | 1,536,119,890.35  |
| 贵金属                    |                   |                   |
| 拆出资金                   |                   |                   |
| 融出资金                   | 3,270,189,274.38  | 3,716,843,969.37  |
| 衍生金融资产                 |                   |                   |
| 存出保证金                  | 80,728,824.73     | 84,206,595.49     |
| 应收款项                   | 151,782,761.13    | 325,770,418.14    |
| 应收款项融资                 |                   |                   |
| 合同资产                   |                   |                   |
| 买入返售金融资产               | 1,099,364,997.27  |                   |
| 持有待售资产                 |                   |                   |
| <b>金融投资：</b>           |                   |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |                   |                   |
| 交易性金融资产                | 3,460,586,648.06  | 5,275,057,586.24  |
| 债权投资                   | 10,333,599.65     | 1,122,074,894.08  |
| 可供出售金融资产               |                   |                   |
| 其他债权投资                 | 17,229,580,251.66 | 16,920,777,314.10 |
| 其他权益工具投资               | 25,000,000.00     | 107,014,857.64    |
| 持有至到期投资                |                   |                   |
| 长期股权投资                 | 939,110,268.56    | 939,110,268.56    |
| 投资性房地产                 |                   |                   |
| 固定资产                   | 48,752,492.36     | 46,771,742.87     |
| 在建工程                   | 24,797,485.08     | 25,329,005.11     |
| 使用权资产                  | 201,488,946.73    | 256,143,645.74    |
| 无形资产                   | 61,024,432.90     | 39,088,820.30     |
| 商誉                     |                   |                   |
| 递延所得税资产                | 450,986,746.49    | 391,610,991.07    |

|                        |                   |                   |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 其他资产                   | 127,473,539.58    | 232,907,412.41    |
| 资产总计                   | 36,121,941,775.55 | 39,531,918,246.91 |
| <b>负债：</b>             |                   |                   |
| 短期借款                   |                   |                   |
| 应付短期融资款                | 5,140,000.00      | 13,040,000.00     |
| 拆入资金                   | 600,000,000.00    |                   |
| 交易性金融负债                |                   |                   |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 |                   |                   |
| 衍生金融负债                 | 3,237,954.23      | 3,505,132.21      |
| 卖出回购金融资产款              | 7,157,682,272.61  | 5,611,972,535.21  |
| 代理买卖证券款                | 5,369,356,455.92  | 6,219,300,916.91  |
| 代理承销证券款                | 145,000.00        | 75,580,000.00     |
| 应付职工薪酬                 | 436,871,640.19    | 264,510,654.55    |
| 应交税费                   | 9,572,945.19      | 10,833,618.90     |
| 应付款项                   | 980,576,474.04    | 2,145,296,147.69  |
| 合同负债                   |                   |                   |
| 持有待售负债                 |                   |                   |
| 预计负债                   | 1,067,464,664.01  | 1,314,684,952.49  |
| 长期借款                   |                   |                   |
| 应付债券                   | 9,811,703,477.11  | 13,640,212,335.95 |
| 其中：优先股                 |                   |                   |
| 永续债                    |                   |                   |
| 租赁负债                   | 191,172,292.87    | 253,158,650.10    |
| 递延收益                   |                   |                   |
| 递延所得税负债                |                   |                   |
| 其他负债                   | 7,075,277.36      | 16,421,169.74     |
| 负债合计                   | 25,639,998,453.53 | 29,568,516,113.75 |
| <b>所有者权益（或股东权益）：</b>   |                   |                   |
| 实收资本（或股本）              | 5,840,702,569.00  | 5,840,702,569.00  |
| 其他权益工具                 |                   |                   |
| 其中：优先股                 |                   |                   |
| 永续债                    |                   |                   |
| 资本公积                   | 9,627,777,370.50  | 9,627,777,370.50  |
| 减：库存股                  |                   |                   |
| 其他综合收益                 | -18,347,055.49    | 54,399,145.92     |
| 盈余公积                   | 707,345,320.73    | 707,345,320.73    |
| 一般风险准备                 | 1,420,898,246.87  | 1,420,898,246.87  |
| 未分配利润                  | -7,096,433,129.59 | -7,687,720,519.86 |
| 所有者权益（或股东权益）合计         | 10,481,943,322.02 | 9,963,402,133.16  |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计      | 36,121,941,775.55 | 39,531,918,246.91 |

法定代表人：张海文 主管会计工作负责人：汪强 会计机构负责人：王月晗

**合并利润表**  
2022年1—12月

单位:元 币种:人民币

| 项目                               | 2022年度           | 2021年度           |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| 一、营业总收入                          | 597,184,418.53   | 826,663,631.89   |
| 利息净收入                            | 230,661,092.99   | 501,491,534.61   |
| 其中：利息收入                          | 919,411,090.31   | 1,450,735,089.21 |
| 利息支出                             | 688,749,997.32   | 949,243,554.60   |
| 手续费及佣金净收入                        | 588,712,895.52   | 615,662,413.66   |
| 其中：经纪业务手续费净收入                    | 277,108,667.04   | 344,565,866.81   |
| 投资银行业务手续费净收入                     | 196,011,138.72   | 218,634,555.07   |
| 资产管理业务手续费净收入                     | 84,170,636.15    | 20,722,934.70    |
| 投资收益（损失以“-”号填列）                  | 83,301,949.23    | 490,670,674.73   |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益               |                  |                  |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列） | -31,835,908.49   | -209,075,647.02  |
| 净敞口套期收益（损失以“-”号填列）               |                  |                  |
| 其他收益                             | 6,467,918.84     | 5,023,972.71     |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）              | -344,498,591.11  | -785,933,843.09  |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列）                  | 3,246,038.69     | -827,031.83      |
| 其他业务收入                           | 29,151,429.71    | 1,704,258.73     |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列）                | 141,684.66       | -1,128,347.63    |
| 二、营业总支出                          | 111,158,365.29   | 640,211,708.89   |
| 税金及附加                            | 4,292,200.37     | 18,071,918.86    |
| 业务及管理费                           | 1,239,672,327.06 | 1,100,700,306.37 |
| 资产减值损失                           |                  |                  |
| 信用减值损失                           | -785,056,845.45  | -755,689,292.73  |
| 其他资产减值损失                         |                  |                  |
| 其他业务成本                           | -347,749,316.69  | 277,128,776.39   |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列）                | 486,026,053.24   | 186,451,923.00   |
| 加：营业外收入                          | 604,533.75       | 282,667.80       |
| 减：营业外支出                          | 22,573,799.30    | 61,359,267.79    |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）              | 464,056,787.69   | 125,375,323.01   |
| 减：所得税费用                          | -36,691,814.47   | -55,773,419.46   |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列）                | 500,748,602.16   | 181,148,742.47   |
| （一）按经营持续性分类                      |                  |                  |
| 1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）            | 500,748,602.16   | 181,148,742.47   |
| 2.终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）            |                  |                  |

|                              |                |                 |
|------------------------------|----------------|-----------------|
| (二) 按所有权归属分类                 |                |                 |
| 1. 归属于母公司股东的净利润 (净亏损以“-”号填列) | 502,839,120.86 | 180,850,403.52  |
| 2. 少数股东损益 (净亏损以“-”号填列)       | -2,090,518.70  | 298,338.95      |
| 六、其他综合收益的税后净额                | -41,102,811.04 | -174,596,878.44 |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额         | -41,102,811.04 | -174,596,878.44 |
| (一) 不能重分类进损益的其他综合收益          | -2,080,246.32  | -5,904,042.96   |
| 1. 重新计量设定受益计划变动额             |                |                 |
| 2. 权益法下不能转损益的其他综合收益          |                |                 |
| 3. 其他权益工具投资公允价值变动            | -2,080,246.32  | -5,904,042.96   |
| 4. 企业自身信用风险公允价值变动            |                |                 |
| (二) 将重分类进损益的其他综合收益           | -39,022,564.72 | -168,692,835.48 |
| 1. 权益法下可转损益的其他综合收益           |                |                 |
| 2. 其他债权投资公允价值变动              | -38,318,884.45 | -10,846,337.18  |
| 3. 可供出售金融资产公允价值变动损益          |                |                 |
| 4. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额        |                |                 |
| 5. 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益     |                |                 |
| 6. 其他债权投资信用损失准备              | -703,680.27    | -157,846,498.30 |
| 7. 现金流量套期储备 (现金流量套期损益的有效部分)  |                |                 |
| 8. 外币财务报表折算差额                |                |                 |
| 9. 其他                        |                |                 |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额          |                |                 |
| 七、综合收益总额                     | 459,645,791.12 | 6,551,864.03    |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额             | 461,736,309.82 | 6,253,525.08    |
| 归属于少数股东的综合收益总额               | -2,090,518.70  | 298,338.95      |
| 八、每股收益:                      |                |                 |
| (一) 基本每股收益(元/股)              |                |                 |
| (二) 稀释每股收益(元/股)              |                |                 |

本期发生同一控制下企业合并的,被合并方在合并前实现的净利润为:0元,上期被合并方实现的净利润为:0元。

法定代表人: 张海文 主管会计工作负责人: 汪强 会计机构负责人: 王月晗

**母公司利润表**  
2022年1—12月

单位:元 币种:人民币

| 项目 | 2022年度 | 2021年度 |
|----|--------|--------|
|----|--------|--------|

|                                  |                  |                  |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| 一、营业总收入                          | 713,006,399.48   | 577,421,173.78   |
| 利息净收入                            | 205,874,576.65   | 80,263,396.72    |
| 其中：利息收入                          | 894,054,251.45   | 1,028,975,581.43 |
| 利息支出                             | 688,179,674.80   | 948,712,184.71   |
| 手续费及佣金净收入                        | 576,491,093.83   | 696,296,844.40   |
| 其中：经纪业务手续费净收入                    | 262,792,971.45   | 325,235,495.17   |
| 投资银行业务手续费净收入                     | 196,011,138.72   | 218,634,555.07   |
| 资产管理业务手续费净收入                     | 105,158,196.20   | 137,712,075.95   |
| 投资收益（损失以“-”号填列）                  | -14,595,841.05   | 227,001,628.14   |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益               |                  |                  |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列） | -31,835,908.49   | -209,075,647.02  |
| 净敞口套期收益（损失以“-”号填列）               |                  |                  |
| 其他收益                             | 6,300,905.71     | 2,345,188.28     |
| 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）              | -82,504,219.58   | -432,274,198.20  |
| 汇兑收益（损失以“-”号填列）                  | 3,246,038.69     | -827,031.83      |
| 其他业务收入                           | 18,052,160.57    | 5,744,578.92     |
| 资产处置收益（损失以“-”号填列）                | 141,684.66       | -1,129,232.65    |
| 二、营业总支出                          | 166,605,258.80   | 416,933,209.85   |
| 税金及附加                            | 4,086,682.17     | 17,296,273.20    |
| 业务及管理费                           | 1,108,374,660.24 | 972,166,909.10   |
| 资产减值损失                           |                  |                  |
| 信用减值损失                           | -949,913,401.07  | -579,545,859.59  |
| 其他资产减值损失                         |                  |                  |
| 其他业务成本                           | 4,057,317.46     | 7,015,887.14     |
| 三、营业利润（亏损以“-”号填列）                | 546,401,140.68   | 160,487,963.93   |
| 加：营业外收入                          | 604,496.67       | 138,259.41       |
| 减：营业外支出                          | 22,488,659.06    | 60,787,410.95    |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）              | 524,516,978.29   | 99,838,812.39    |
| 减：所得税费用                          | -35,127,021.61   | -71,187,177.85   |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列）                | 559,643,999.90   | 171,025,990.24   |
| （一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）           | 559,643,999.90   | 171,025,990.24   |
| （二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）           |                  |                  |
| 六、其他综合收益的税后净额                    | -41,102,811.04   | -174,596,878.44  |
| （一）不能重分类进损益的其他综合收益               | -2,080,246.32    | -5,904,042.96    |
| 1.重新计量设定受益计划变动额                  |                  |                  |

|                           |                |                 |
|---------------------------|----------------|-----------------|
| 2.权益法下不能转损益的其他综合收益        |                |                 |
| 3.其他权益工具投资公允价值变动          | -2,080,246.32  | -5,904,042.96   |
| 4.企业自身信用风险公允价值变动          |                |                 |
| (二)将重分类进损益的其他综合收益         | -39,022,564.72 | -168,692,835.48 |
| 1.权益法下可转损益的其他综合收益         |                |                 |
| 2.其他债权投资公允价值变动            | -38,318,884.45 | -10,846,337.18  |
| 3.可供出售金融资产公允价值变动损益        |                |                 |
| 4.金融资产重分类计入其他综合收益的金额      |                |                 |
| 5.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益   |                |                 |
| 6.其他债权投资信用损失准备            | -703,680.27    | -157,846,498.30 |
| 7.现金流量套期储备(现金流量套期损益的有效部分) |                |                 |
| 8.外币财务报表折算差额              |                |                 |
| 9.其他                      |                |                 |
| 七、综合收益总额                  | 518,541,188.86 | -3,570,888.20   |
| 八、每股收益:                   |                |                 |
| (一)基本每股收益(元/股)            |                |                 |
| (二)稀释每股收益(元/股)            |                |                 |

法定代表人: 张海文 主管会计工作负责人: 汪强 会计机构负责人: 王月晗

### 合并现金流量表

2022年1—12月

单位: 元 币种: 人民币

| 项目                    | 2022年度           | 2021年度            |
|-----------------------|------------------|-------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量:</b> |                  |                   |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额     | 1,961,522,176.28 | 6,320,633,390.32  |
| 销售商品、提供劳务收到的现金        |                  |                   |
| 向其他金融机构拆入资金净增加额       |                  |                   |
| 收取利息、手续费及佣金的现金        | 1,331,763,235.82 | 1,759,705,417.90  |
| 融出资金净减少额              | 446,494,939.76   |                   |
| 拆入资金净增加额              | 600,000,000.00   |                   |
| 回购业务资金净增加额            | 1,655,122,846.70 | 4,638,252,960.48  |
| 代理买卖证券收到的现金净额         |                  | 1,035,077,783.75  |
| 收到其他与经营活动有关的现金        | 51,287,880.96    | 337,187,541.35    |
| 经营活动现金流入小计            | 6,046,191,079.52 | 14,090,857,093.80 |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额     |                  |                   |
| 支付合并结构化主体其他份额持有人的资金净额 | 4,496,767,688.8  | 10,498,282,764.48 |
| 融出资金净增加额              |                  | 446,167,429.59    |

|                           |                   |                   |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 拆入资金净减少额                  |                   | 800,000,000.00    |
| 代理买卖证券支付的现金净额             | 650,834,708.65    |                   |
| 拆出资金净增加额                  |                   |                   |
| 返售业务资金净增加额                |                   |                   |
| 支付利息、手续费及佣金的现金            | 255,368,612.28    | 381,345,657.73    |
| 支付给职工及为职工支付的现金            | 698,467,289.98    | 635,609,010.17    |
| 支付的各项税费                   | 105,549,211.32    | 306,435,415.87    |
| 支付其他与经营活动有关的现金            | 548,789,296.74    | 227,405,215.37    |
| 经营活动现金流出小计                | 6,755,776,807.77  | 13,295,245,493.21 |
| 经营活动产生的现金流量净额             | -709,585,728.25   | 795,611,600.59    |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>     |                   |                   |
| 收回投资收到的现金                 | 32,366,006,332.68 | 19,758,038,909.15 |
| 取得投资收益收到的现金               | 544,632,632.08    | 1,123,259,170.42  |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | 334,006.85        | 48,722,602.70     |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额       |                   |                   |
| 收到其他与投资活动有关的现金            |                   |                   |
| 投资活动现金流入小计                | 32,910,972,971.61 | 20,930,020,682.27 |
| 投资支付的现金                   | 29,699,320,000.00 | 14,666,400,060.99 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金   | 69,310,342.74     | 208,860,723.14    |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额       |                   |                   |
| 支付其他与投资活动有关的现金            |                   |                   |
| 投资活动现金流出小计                | 29,768,630,342.74 | 14,875,260,784.13 |
| 投资活动产生的现金流量净额             | 3,142,342,628.87  | 6,054,759,898.14  |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>     |                   |                   |
| 吸收投资收到的现金                 |                   |                   |
| 其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金       |                   |                   |
| 取得借款收到的现金                 |                   |                   |
| 发行债券收到的现金                 | 404,150,000.00    | 698,010,000.00    |
| 收到其他与筹资活动有关的现金            |                   |                   |
| 筹资活动现金流入小计                | 404,150,000.00    | 698,010,000.00    |
| 偿还债务支付的现金                 | 4,162,050,000.00  | 5,716,310,000.00  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金         | 588,000,072.84    | 1,089,809,273.53  |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润       |                   |                   |
| 支付其他与筹资活动有关的现金            | 65,789,465.43     | 10,843,689.70     |
| 筹资活动现金流出小计                | 4,815,839,538.27  | 6,816,962,963.23  |

|                    |                   |                   |
|--------------------|-------------------|-------------------|
| 筹资活动产生的现金流量净额      | -4,411,689,538.27 | -6,118,952,963.23 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | 3,246,038.69      | -827,031.83       |
| 五、现金及现金等价物净增加额     | -1,975,686,598.96 | 730,591,503.67    |
| 加：期初现金及现金等价物余额     | 11,642,980,872.90 | 10,912,389,369.23 |
| 六、期末现金及现金等价物余额     | 9,667,294,273.94  | 11,642,980,872.90 |

法定代表人：张海文 主管会计工作负责人：汪强 会计机构负责人：王月晗

### 母公司现金流量表

2022年1—12月

单位：元 币种：人民币

| 项目                        | 2022年度            | 2021年度            |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b>     |                   |                   |
| 为交易目的而持有的金融资产净减少额         | 1,762,179,746.19  | 943,173,737.46    |
| 销售商品、提供劳务收到的现金            |                   |                   |
| 向其他金融机构拆入资金净增加额           |                   |                   |
| 收取利息、手续费及佣金的现金            | 1,095,864,125.18  | 1,609,981,538.38  |
| 融出资金净减少额                  | 446,494,939.76    |                   |
| 拆入资金净增加额                  | 600,000,000.00    |                   |
| 回购业务资金净增加额                | 442,313,000.00    | 1,789,790,355.19  |
| 代理买卖证券收到的现金净额             |                   | 863,073,465.88    |
| 收到其他与经营活动有关的现金            | 17,763,685.64     | 28,668,262.73     |
| 经营活动现金流入小计                | 4,364,615,496.77  | 5,234,687,359.64  |
| 为交易目的而持有的金融资产净增加额         |                   |                   |
| 融出资金净增加额                  |                   | 446,167,429.50    |
| 拆入资金净减少额                  |                   | 800,000,000.00    |
| 代理买卖证券支付的现金净额             | 925,379,460.99    |                   |
| 拆出资金净增加额                  |                   |                   |
| 返售业务资金净增加额                |                   |                   |
| 支付利息、手续费及佣金的现金            | 231,107,570.29    | 367,773,698.32    |
| 支付给职工及为职工支付的现金            | 628,081,281.89    | 574,148,330.79    |
| 支付的各项税费                   | 98,865,265.56     | 299,728,313.26    |
| 支付其他与经营活动有关的现金            | 464,533,921.88    | 2,315,975,091.16  |
| 经营活动现金流出小计                | 2,347,967,500.61  | 4,803,792,863.03  |
| 经营活动产生的现金流量净额             | 2,016,647,996.16  | 430,894,496.61    |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>     |                   |                   |
| 收回投资收到的现金                 | 30,529,176,121.57 | 21,639,218,975.04 |
| 取得投资收益收到的现金               | 513,168,474.22    | 547,764,296.94    |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | 334,006.85        | 45,296,254.80     |
| 收到其他与投资活动有关的现金            |                   |                   |
| 投资活动现金流入小计                | 31,042,678,602.64 | 22,232,279,526.78 |

|                           |                   |                   |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 投资支付的现金                   | 29,699,320,000.00 | 14,666,400,060.99 |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金   | 64,013,305.26     | 199,847,138.72    |
| 支付其他与投资活动有关的现金            |                   |                   |
| 投资活动现金流出小计                | 29,763,333,305.26 | 14,866,247,199.71 |
| 投资活动产生的现金流量净额             | 1,279,345,297.38  | 7,366,032,327.07  |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>     |                   |                   |
| 吸收投资收到的现金                 |                   |                   |
| 取得借款收到的现金                 |                   |                   |
| 发行债券收到的现金                 | 404,150,000.00    | 698,010,000.00    |
| 收到其他与筹资活动有关的现金            |                   |                   |
| 筹资活动现金流入小计                | 404,150,000.00    | 698,010,000.00    |
| 偿还债务支付的现金                 | 4,162,050,000.00  | 5,716,310,000.00  |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金         | 588,000,072.84    | 1,007,040,513.31  |
| 支付其他与筹资活动有关的现金            | 61,808,478.21     | 10,563,141.25     |
| 筹资活动现金流出小计                | 4,811,858,551.05  | 6,733,913,654.56  |
| 筹资活动产生的现金流量净额             | -4,407,708,551.05 | -6,035,903,654.56 |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b> | 3,246,038.69      | -827,031.83       |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>     | -1,108,469,218.82 | 1,760,196,137.29  |
| 加：期初现金及现金等价物余额            | 10,049,210,725.79 | 8,289,014,588.50  |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>     | 8,940,741,506.97  | 10,049,210,725.79 |

法定代表人：张海文 主管会计工作负责人：汪强 会计机构负责人：王月晗

