

天风证券股份有限公司

关于计提资产减值准备的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

一、公司计提资产减值准备情况概述

根据《企业会计准则》和公司会计政策的相关规定，为真实、准确地反映公司2020年12月31日的财务状况和2020年度经营成果，经公司及下属子公司对有关资产进行全面清查和资产减值测试，2020年7-12月计提各项资产减值准备共计38,142.90万元，占公司最近一个会计年度经审计净利润的10%以上，详见下表：

资产名称	2020年7-12月计提资产减值准备 (单位：万元)
融出资金	5,729.33
买入返售金融资产	2,554.65
应收款项	255.97
其他资产	22,065.84
长期股权投资	7,537.11
合 计	38,142.90

二、计提资产减值准备对公司的影响

公司2020年7-12月计提资产减值准备金额共计38,142.90万元，减少公司2020年7-12月利润总额38,142.90万元，减少公司2020年7-12月净利润30,491.46万元。

三、计提资产减值准备的具体说明

(一) 融出资金

根据《企业会计准则》和公司相关会计政策，2020年7-12月公司计提融出资金减值准备5,729.33万元，主要是因融出资金担保物价值下跌等原因已发生信用减值的合约计提的信用减值准备。

（二）买入返售金融资产

根据《企业会计准则》和公司相关会计政策，2020年7-12月公司计提买入返售金融资产减值准备2,554.65万元。其中：对合同还款日逾期或客户维持担保比例低于130%或未正常付息的股票质押式回购业务进行减值测试，经测算，按照账面价值和预计可收回金额之间的差额计提减值准备2,542.94万元；除此之外的股票质押式回购业务按预期信用损失模型计提减值准备11.71万元。

（三）应收款项

根据《企业会计准则》和公司相关会计政策，2020年7-12月公司计提应收款项坏账准备255.97万元。

（四）其他资产

根据《企业会计准则》和公司相关会计政策，2020年7-12月公司计提其他资产减值准备22,065.84万元，主要为：对应收融资融券客户款全额计提减值准备14,285.24万元及持有的债权投资减值5,880.50万元。

（五）长期股权投资

根据《企业会计准则》和公司相关会计政策，公司期末对长期股权投资进行了减值测试。经测试，公司持有权益法核算的长期股权投资存在减值，以该项资产的账面价值与其可收回金额相比较，需计提减值7,537.11万元。

特此公告。

天风证券股份有限公司董事会

2021年1月30日