

公司代码：601375

公司简称：中原证券

中原证券股份有限公司 2021 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、本公司按照中国企业会计准则编制的 2021 年度财务报告，经大华会计师事务所（特殊普通合伙）审计，为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人菅明军先生、主管会计工作负责人朱建民先生、总会计师李昭欣先生及会计机构负责人杨波女士声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

五、 董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

本公司经第七届董事会第六次会议审议的2021年下半年度利润分配预案为：每10股派发现金红利人民币0.21元（含税）。截至2021年12月31日，公司总股本4,642,884,700股，以此计算合计拟派发现金红利人民币97,500,578.70元（含税），加上已派发2021年上半年现金红利人民币78,929,039.90元（含税），当年累计派发现金红利人民币176,429,618.60元（含税）。公司不进行资本公积金转增股本，不送红股。此预案尚需本公司股东大会批准。

六、 前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请投资者及相关人士理解计划、预测与承诺之间的差异，注意投资风险。

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

公司业务、资产主要集中于国内，高度依赖国内整体经济及市场状况，国内经济形势变化及资本市场波动，都将对公司经营业绩产生重大影响。

公司面临的风险主要包括：因国家宏观经济政策及其调控措施，与证券行业相关的法律法规、监管政策及交易规则等变动，对证券公司经营产生不利影响的政策性风险；因经营管理或执业行为违反法律法规和准则，使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的合规风险；持有金融工具的公允价值因市场价格不利变动而产生的市场风险；因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的信用风险；由于不完善或有问题的内部程序、人员、信息系统和外部事件而导致直接或间接损失的操作风险；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流动性风险；因信息技术系统及通信系统出现软硬件故障、安全漏洞、灾备系统应急能力不足等对公司业务产生不利影响的信息技术风险；由于公司行为或外部事件、及员工违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害公司品牌价值，影响正常经营的声誉风险。

公司建立并持续完善内部控制体系、合规及全面风险管理体系，建立了科学的风险识别、评估、应对、监测和报告机制，将风险管理贯穿经营决策的全过程，确保公司经营在风险可测、可控、可承受的范围内开展。公司经营中面临的有关风险，请参阅本报告“第三节 管理层讨论与分析 六、公司关于公司未来发展的讨论与分析（四）可能面对的风险”的相关内容。

十一、其他

适用 不适用

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	管理层讨论与分析.....	24
第四节	公司治理.....	50
第五节	环境与社会责任.....	81
第六节	重要事项.....	84
第七节	股份变动及股东情况.....	97
第八节	优先股相关情况.....	105
第九节	债券相关情况.....	106
第十节	财务报告.....	113
第十一节	证券公司信息披露.....	254

备查文件目录	载有本公司法定代表人签名的年度报告文本。
	载有本公司法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名盖章的财务报告文本。
	报告期内中国证监会指定网站上公开披露过的所有本公司文件的正本及公告原件。
	在其它证券市场公布的年度报告。
	其他有关资料。

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		
本公司、公司、母公司、中原证券	指	中原证券股份有限公司
本集团、集团	指	本公司及其子公司
董事会	指	本公司董事会
董事	指	本公司董事
监事会	指	本公司监事会
监事	指	本公司监事
《香港上市规则》	指	香港联交所证券上市规则
《企业管治守则》	指	《香港上市规则》附录十四之《企业管治守则》及《企业管治报告》
本报告	指	本年度报告
上交所	指	上海证券交易所
上证综指	指	上交所股票价格综合指数
深证成指	指	深圳证券交易所成份股价指数
Wind 资讯	指	上海万得信息技术股份有限公司
IPO	指	首次公开发行股票
A 股	指	本公司股本中每股面值人民币 1.00 元的境内上市普通股，该等股份均在上交所上市并交易
H 股	指	本公司股本中每股面值人民币 1.00 元的境外上市外资普通股，该等股份均在香港联交所主板上市并交易
报告期、本期	指	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
报告期末、本期末	指	2021 年 12 月 31 日
中国、我国、全国	指	中华人民共和国
国务院	指	中华人民共和国国务院
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
财政部	指	中华人民共和国财政部
发改委	指	中华人民共和国国家发展和改革委员会
中共河南省委	指	中国共产党河南省委员会
河南省政府	指	河南省人民政府
河南证监局	指	中国证券监督管理委员会河南监管局
河南省国资委	指	河南省人民政府国有资产监督管理委员会
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
科创板	指	上交所科创板
新三板	指	全国中小企业股份转让系统
河南投资集团	指	河南投资集团有限公司
安钢集团	指	安阳钢铁集团有限责任公司
平煤神马	指	中国平煤神马能源化工集团有限责任公司

安阳经开	指	安阳经济开发集团有限公司
江苏苏豪	指	江苏省苏豪控股集团有限公司
神火集团	指	河南神火集团有限公司
焦作经开	指	焦作市经济技术开发区有限公司
深圳广晟	指	深圳市广晟投资发展有限公司
鹤壁建投	指	鹤壁投资集团有限公司
河南证券	指	河南证券有限责任公司
中原期货	指	中原期货股份有限公司
中鼎开源	指	中鼎开源创业投资管理有限公司
中证开元	指	河南中证开元私募基金管理有限公司
中州蓝海	指	中州蓝海投资管理有限公司
中州国际	指	中州国际金融控股有限公司
股权中心	指	中原股权交易中心股份有限公司
中原小贷	指	河南省中原小额贷款有限公司
豫新投资	指	豫新投资管理（上海）有限公司
中原信托	指	中原信托有限公司
《公司章程》	指	本公司现行有效的《公司章程》
《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》
人民币	指	中国的法定货币—人民币，其基本单位为“元”
港币、港元	指	香港法定货币港元及港仙

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	中原证券股份有限公司
公司的中文简称	中原证券
公司的外文名称	CENTRAL CHINA SECURITIES CO., LTD.
公司的外文名称缩写	CCSC
公司的法定代表人	菅明军
公司总经理	朱建民（代）

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	4,642,884,700.00	4,642,884,700.00
净资产	9,100,531,842.63	10,141,843,317.23

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

- 1、证券经纪
- 2、证券投资咨询
- 3、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问
- 4、证券自营
- 5、上市公司并购重组财务顾问
- 6、证券资产管理
- 7、受托投资管理业务资格
- 8、股票主承销商资格
- 9、网上证券委托业务资格
- 10、证券发行上市保荐机构
- 11、开放式证券投资基金代销业务资格
- 12、“上证50ETF”参与券商业务资格
- 13、上交所国债买断式回购交易资格
- 14、IPO询价配售资格
- 15、股权分置改革保荐机构
- 16、权证交易资格
- 17、中国证券登记结算有限责任公司结算参与者资格
- 18、经营外汇业务资格
- 19、全国银行间同业拆借业务资格

- 20、上交所固定收益证券综合电子平台一级交易商资格
- 21、大宗交易系统合格投资者资格
- 22、银行间债券交易资格
- 23、为期货公司提供中间介绍业务资格
- 24、代办系统主办券商业务资格
- 25、新三板业务主办券商业务资格
- 26、通过全球公认的IT服务管理领域国际标准ISO/IEC20000
- 27、直投业务资格
- 28、融资融券业务资格
- 29、代销金融产品业务资格
- 30、中小企业私募债承销业务资格
- 31、债券质押式报价回购业务资格
- 32、约定购回式证券交易业务资格
- 33、基金业务
- 34、转融资业务资格
- 35、代理证券质押登记业务资格
- 36、股票质押回购业务
- 37、转融券与证券出借业务资格
- 38、上交所港股通业务资格
- 39、全国中小企业股份转让系统做市业务
- 40、可试点发行短期公司债券
- 41、柜台市场业务试点资格
- 42、互联网证券业务试点资格
- 43、上交所股票期权经纪业务资格
- 44、机构间私募产品报价系统做市业务
- 45、深圳证券交易所深港通业务资格
- 46、银行间非金融企业债务融资工具承销资质

二、 联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	朱启本	杨峰
联系地址	中国河南省郑州市郑东新区商务外环路20号海联大厦19楼（邮编：450018）	中国河南省郑州市郑东新区商务外环路20号海联大厦19楼（邮编：450018）
电话	0371-69177590	0371-69177590
传真	0371-86505911	0371-86505911
电子信箱	zhuqb@ccnew.com	yangfeng@ccnew.com

三、基本情况简介

公司注册地址	郑州市郑东新区商务外环路10号
公司注册地址的历史变更情况	无
公司办公地址	中国河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
公司办公地址的邮政编码	450018
公司网址	http://www.ccnew.com
电子信箱	investor@ccnew.com
香港主要营业地址	香港湾仔皇后大道东248号大新金融中心40楼

四、信息披露及备置地点

公司披露年度报告的媒体名称及网址	中国证券报： https://www.cs.com.cn/ 上海证券报： https://www.cnstock.com/ 证券时报： http://www.stcn.com/ 证券日报： http://www.zqrb.cn/
公司披露年度报告的证券交易所网站	http://www.sse.com.cn
公司披露年度报告的香港联交所网址	http://www.hkexnews.hk
公司年度报告备置地点	河南省郑州市郑东新区商务外环路20号19楼

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	变更前股票简称
A股	上交所	中原证券	601375	不适用
H股	香港联交所	中州证券	01375	不适用

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

2002年10月25日，经中国证监会《关于同意中原证券股份有限公司开业的批复》（证监机构字[2002]326号）批准，中原证券股份有限公司在河南财政证券公司、安阳市信托投资公司证券营业部合并重组的基础上，联合其他符合条件的公司增资扩股组建而成。公司于2002年11月8日在河南省工商行政管理局登记注册，注册资本人民币103,379万元。公司成立后根据中国证监会的开业批复，收购了原河南证券所属的证券营业部和证券服务部等证券类资产。

2008年1月15日，经中国证监会核准，公司注册资本由人民币103,379万元变更为人民币203,351.57万元。

2008年6月10日，中国证监会核准河南投资集团受让河南省建设投资总公司持有的公司19,670.42万股股份（占注册资本9.673%）以及河南省经济技术开发公司持有的公司71,525.36万股股份（占注册资本35.173%）。股权变更完成后，河南投资集团合计持有公司91,195.78万股股份（占公司注册资本的44.846%）。

2011年9月22日，中国证监会核准渤海产业投资基金管理有限公司（代表渤海产业投资基金）持有中原证券股份有限公司5%以上股权的股东资格，并受让许继集团有限公司持有公司的60,800万股股份（占公司注册资本的29.899%）。

2014年6月25日，公司境外发行股份在香港联交所主板上市，股票简称：中州证券，股票代码：01375。根据国务院国有资产监督管理委员会《关于中原证券股份有限公司国有股权管理及国有股转持有关问题的批复》（国资产权[2013]1070号），在本公司完成该次发行后，国有股东河南投资集团、安钢集团、平煤神马、安阳经开、江苏苏豪、神火集团、焦作经开、深圳广晟和鹤壁建投分别将其持有的40,994,778股、8,842,345股、3,738,231股、2,432,074股、1,348,575股、884,166股、678,113股、449,525股和442,193股股份划转给全国社会保障基金理事会持有，上述9家划转由全国社会保障基金理事会持有的股份合计59,810,000股。2014年10月28日，公司在河南省工商行政管理局办理完成注册资本的工商变更登记，注册资本增加至人民币2,631,615,700元。

2015年8月3日，公司完成非公开发行H股股票592,119,000股，每股面值人民币1元，发行价格为每股H股港币4.28元。2015年8月14日，公司在河南省工商行政管理局办理完成注册资本的工商变更登记，注册资本增加至人民币3,223,734,700元。

2016年11月18日，公司发行人民币普通股不超过700,000,000股，每股面值人民币1元。根据《境内证券市场转持部分国有股充实全国社会保障基金实施办法》（财企[2009]94号）和河南省国资委《关于中原证券股份有限公司发行A股国有股权管理方案及国有股转持的批复》（豫国资产权[2015]26号），按本次发行700,000,000股计算，国有股东河南投资集团、安钢集团、平煤神马、安阳经开、江苏苏豪、神火集团、焦作经开、深圳广晟和鹤壁建投分别将其持有的47,979,175股、10,348,840股、4,375,124股、2,846,433股、1,578,336股、1,034,804股、793,645股、526,112股和517,531股股份划转给全国社会保障基金理事会持有，上述9家划转由全国社会保障基金理事会持有的股份合计70,000,000股。

2017年1月3日，公司A股在上交所挂牌上市。

2018年2月12日起，公司通过场内股份回购的形式回购部分H股股票。2018年5月18日，公司H股回购实施完毕。公司累计回购H股54,664,000股。2018年7月11日，公司完成工商变更登记手续，并取得了河南省工商行政管理局换发的《营业执照》，公司注册资本变更为人民币3,869,070,700元。

2020年7月30日，公司完成非公开发行A股股票773,814,000股，每股面值人民币1元，发行价格为每股A股人民币4.71元。2020年9月4日，公司在河南省工商行政管理局办理完成注册资本的工商变更登记，注册资本增加至人民币4,642,884,700元。

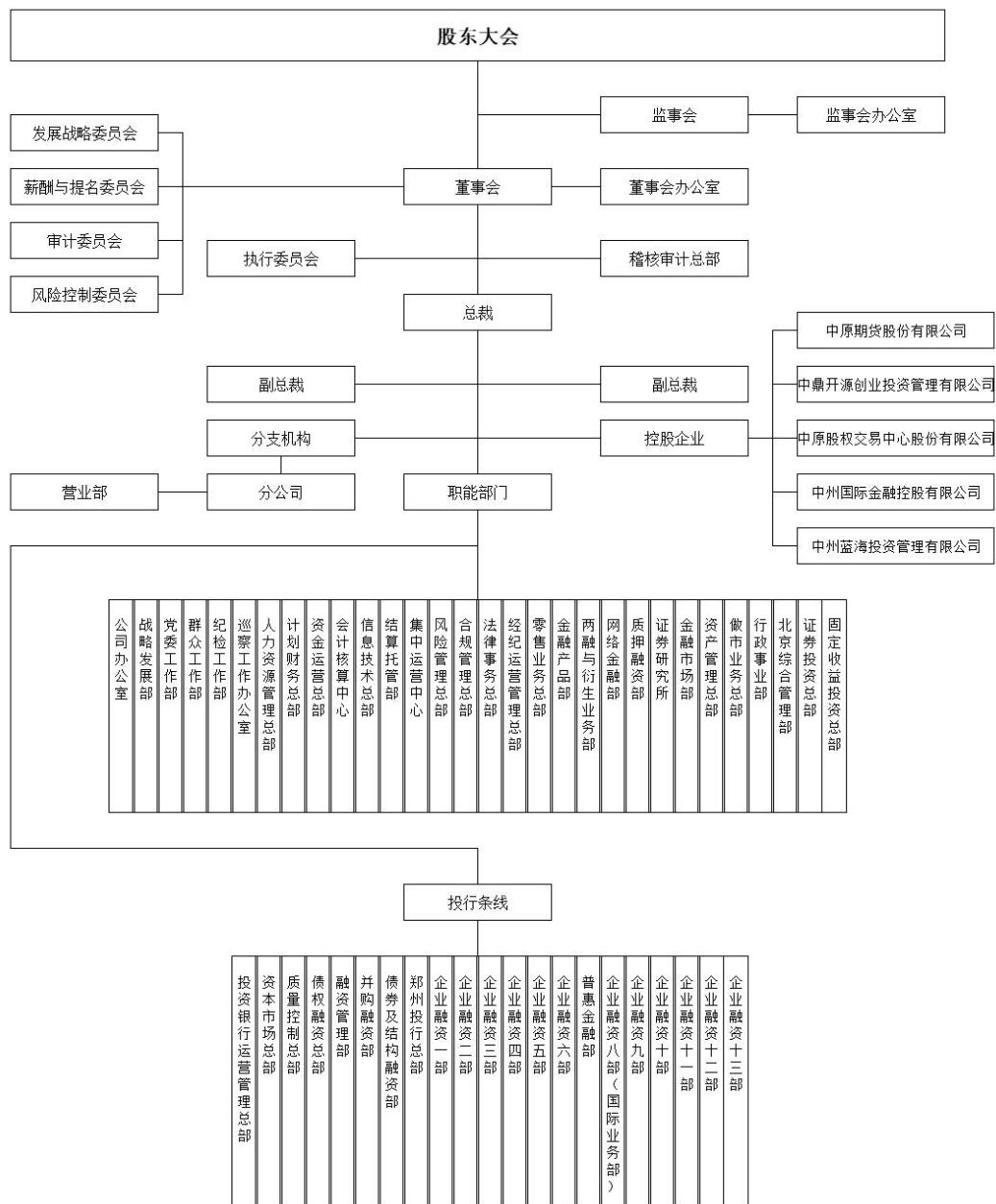
（二）公司组织机构情况

√适用 □不适用

公司依据《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》等有关法律法规及《公司章程》的规定，规范运作，构建了科学规范的法人治理体系，建立了包括股东大会、董事会、监事会在内的三权制衡的法人治理结构，股东大会为公司权力机构，董事会为决策机构，监事会为监督机构。

1、 公司的组织结构图

截至本报告日，公司组织结构图如下：



2、 公司主要控股子公司情况

截至报告期末，公司直接拥有 4 家境内子公司和 1 家境外子公司，请参见本报告“第三节 管理层讨论与分析 五、报告期内主要经营情况（七）主要控股参股公司分析”。

（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，公司拥有83家证券营业部。证券营业部分布在全国12个省、自治区、直辖市，其中，北京市2家、上海市2家、浙江省1家、广东省1家、湖北省1家、湖南省1家、江苏省2家、山东省1家、河北省1家、天津市1家、山西省1家、河南省69家。详见下表：

序号	证券营业部	地址	负责人
1	中原证券郑州黄河路营业部	河南省郑州市金水区黄河路 11 号西配二楼	陈明伟
2	中原证券郑州桐柏路营业部	河南省郑州市中原区桐柏路 43 号	辛志红
3	中原证券郑州自贸区营业部	河南省自贸试验区郑州片区（经开）经北一路 138 号 5A 楼 202 号	张英聚
4	中原证券郑州紫荆山路营业部	河南省郑州市管城回族区紫荆山路 61 号邮政大厦 20 层	贾英魁
5	中原证券郑州经三路营业部	河南省郑州市金水区经三路 25 号	李凯辉
6	中原证券郑州纬二路营业部	河南省郑州市金水区纬二路三十号经纬公寓商用楼三楼	宋伊涛
7	中原证券郑州商务内环路证券营业部	河南省自贸试验区郑州片区（郑东）商务内环 11 号 2 楼	郭志军
8	中原证券新郑新华路营业部	河南省新郑市新华路新华小区一号楼一楼 4-5 号	冯永军
9	中原证券新密东大街营业部	河南省郑州市新密市东大街 17 号	张永红
10	中原证券巩义嵩山路营业部	河南省巩义市嵩山路 119 号附 8 号	牛志鸿
11	中原证券中牟广惠街营业部	河南省郑州市中牟县广惠街与万胜路交叉口东南临街一楼商铺	陈忠
12	中原证券登封少林大道营业部	河南省登封市少林大道(少林国际大酒店一楼西厅)	曲波
13	中原证券邓州新华路营业部	河南省邓州市新华东路 17 号	张辉
14	中原证券南阳范蠡东路营业部	河南省南阳市范蠡东路儒林玉竹苑 2 号楼	赵小宇
15	中原证券南阳五一路营业部	河南省南阳市官庄工区五一路东段	王青峰
16	中原证券西峡人民路营业部	河南省南阳市西峡县白羽路与人民路交叉口	张宛东
17	中原证券平顶山凌云路营业部	河南省平顶山市新华区凌云路中段西九九绿墅园 20 号楼 2 层商业 207 号	李建功

序号	证券营业部	地址	负责人
18	中原证券平顶山建设路营业部	河南省平顶山市卫东区建设路中段 37 号（人民商场）	郑文朝
19	中原证券汝州城垣路营业部	河南省汝州市城垣路西侧一楼及二楼	史林
20	中原证券宝丰中兴路营业部	河南省平顶山市宝丰县城关镇中兴路东城国际住宅小区门面房 111 铺	焦德志
21	中原证券漯河长江路营业部	河南省漯河市源汇区长江路 29 号	吴军
22	中原证券临颍颍河路营业部	河南省漯河市临颍县颍河路中段龙庭首府小区门面房 A6-8	赵军
23	中原证券濮阳开州路营业部	河南省濮阳市中原路与开州路交叉口西南角联通公司裙楼一层	武志高
24	中原证券濮阳中原路营业部	河南省濮阳市中原路 18 号	张运朋
25	中原证券清丰朝阳路营业部	河南省濮阳市清丰县朝阳路 240 号	王相信
26	中原证券濮阳县育民路营业部	河南省濮阳市濮阳县育民路中段路东	常少勇
27	中原证券安阳中华路营业部	河南省安阳市中华路广厦新苑 7 号楼	裴海霞
28	中原证券安阳文峰大道营业部	河南省安阳市殷都区文峰大道西段	付宏斌
29	中原证券林州兴林街营业部	河南省林州市开元区振林路与兴林街交叉口西北角	姜华
30	中原证券滑县文明路营业部	河南省安阳市滑县文明路华通世纪城 B28 栋 2 号	陈利民
31	中原证券汤阴人民路营业部	河南省安阳市汤阴县人民路与中华路交叉口西南角香格里拉 A 区	武新胜
32	中原证券新乡人民东路营业部	河南省新乡市红旗区洪门镇牧野大道（中）166 号天安名邸 1 号楼 1201 商铺	邱飞
33	中原证券长垣山海大道营业部	河南省新乡市长垣市山海大道卫华世纪城 11 号楼 116 号商铺	申长军
34	中原证券辉县共城大道营业部	河南省新乡市长垣市共城大道东段路北	张晓冬
35	中原证券卫辉比干大道营业部	河南省新乡市卫辉比干大道 152 号	魏东
36	中原证券原阳黄河大道营业部	河南省新乡市原阳县黄河大道南侧盛世佳苑 2-2-1 东	张乐飞
37	中原证券浚县黄河路营业部	河南省鹤壁市浚县黄河路与黎阳路交汇处北 200 米路东	介积武
38	中原证券淇县淇河路营业部	河南省鹤壁市淇县淇河路 306 号	贾渊
39	中原证券许昌八龙路营业部	河南省许昌市八龙路南段未来东岸华城	李建新
40	中原证券长葛陈寔路证券营业部	河南省长葛市陈寔路与天平路交叉口	王军
41	中原证券禹州府东路营业部	河南省许昌市禹州市府东路中段	王志全

序号	证券营业部	地址	负责人
42	中原证券鄢陵翠柳路营业部	河南省许昌市鄢陵县开发区翠柳路县政府西邻四层临街楼一楼	张伟琳
43	中原证券襄城中心路营业部	河南省许昌市襄城县中心路东段(财政局对面)	乔广军
44	中原证券固始红苏路营业部	河南省信阳市固始县城蓼北路与红苏路交汇处陈元光广场世纪大厦三楼	李晓红
45	中原证券光山光辉大道营业部	河南省信阳市光山县紫水办事处光辉大道与光明大街交叉口财富广场	李明保
46	中原证券孟州西韩愈大街营业部	河南省孟州市西韩愈大街 292 号	甄荣兴
47	中原证券沁阳建设北路营业部	河南省沁阳市建设北路	马杰
48	中原证券武陟兴华路营业部	河南省焦作市武陟县和平路与兴华路交叉口西北角三楼	严蕾
49	中原证券济源济源大道营业部	河南省济源市学苑路南侧济水苑小区 A 区 1 号商住楼门面房从西往东第 14 间	张巍铎
50	中原证券兰考裕禄大道营业部	河南省开封市兰考县裕禄大道北段东侧	李铭
51	中原证券灵宝函谷路营业部	河南省灵宝市函谷路与荆山路交叉口	李进峰
52	中原证券浉池黄河路营业部	河南省三门峡市浉池县黄河路中段(新华国际小区 1 号楼-06 商铺)	张学运
53	中原证券三门峡崱山路证券营业部	河南省三门峡市湖滨区崱山路中段 57 号(明珠宾馆)一楼商铺	冯斌
54	中原证券商丘南京路营业部	河南省商丘市睢阳区南京路南归德路西应天国际 C 座 110 铺一楼门面	张忠敏
55	中原证券永城中原路营业部	河南省商丘市永城市中原路与光明路交叉口	钟亚辉
56	中原证券民权博爱路营业部	河南省商丘市民权县秋水路与博爱路交叉口中置华府 11 号楼 6 号商铺	王鹏
57	中原证券夏邑孔祖大道营业部	河南省商丘市夏邑县孔祖大道 595 号商铺	陈海滨
58	中原证券虞城嵩山路营业部	河南省商丘市虞城县城关镇嵩山路北侧珠江豪庭 5 号楼商铺 109-110 号 1-2 层	马中良
59	中原证券柘城未来大道证券营业部	河南省商丘市柘城县未来大道金沙府西花园门面房 116 铺	史地
60	中原证券鹿邑真源大道营业部	河南省周口市鹿邑县真源大道 428 号	理勇
61	中原证券西华奉母路营业部	河南省周口市西华县奉母路中段	张阳
62	中原证券沈丘吉祥路营业部	河南省周口市沈丘县槐店镇吉祥东路路南	马广
63	中原证券洛阳开元大道营业部	河南省洛阳市开元大道 260 号 1 幢	张瑞萍
64	中原证券洛阳中州西路营业部	河南省洛阳市涧西区中州西路 26 号	朱宇
65	中原证券伊川人民东路营业部	河南省洛阳市伊川县滨河新区人民东路北侧圣府嘉苑 1 幢 3 楼	陈奕

序号	证券营业部	地址	负责人
66	中原证券新安磁河路营业部	河南省洛阳市新安县新城西区涧河路北侧	王海云
67	中原证券偃师迎宾路营业部	河南省偃师市伊洛街道办事处华夏路 41 号院粤海国际 1 号楼 301 户	黄二彬
68	中原证券西平西平大道营业部	河南省驻马店市西平县西平大道 158 号	李广锡
69	中原证券上蔡蔡都大道证券营业部	河南省驻马店市上蔡县重阳办事处蔡都大道西段 21 号	李大伟
70	中原证券上海牡丹江路证券营业部	上海市宝山区牡丹江路 318 号 C404 单元	周大为
71	中原证券上海沪南路营业部	上海市浦东新区沪南路 2589 号 1-2 层	章振明
72	中原证券深圳龙城大道营业部	广东省深圳市龙岗区龙城街道中心城龙城大道 89 号正中时代大厦 907 单位	曾浩
73	中原证券济南玉函路营业部	山东省济南市市中区玉函路 89 号 1 号楼南楼二楼	杨晨
74	中原证券北京月坛北街营业部	北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦北座主楼 16 层 1601、1602	罗南
75	中原证券北京酒仙桥路营业部	北京市朝阳区酒仙桥路 14 号 53 幢九层 909	夏群
76	中原证券义乌稠州北路营业部	浙江省义乌市稠州北路 955 号 201、202 室	李洪强
77	中原证券天津张自忠路营业部	天津市红桥区海河华鼎大厦张自忠路 2 号 702	郭嘉
78	中原证券石家庄中山西路营业部	河北省石家庄市桥西区中山西路 356 号中电信息大厦二层 2A003 铺位	常红心
79	中原证券吉首世纪大道营业部	湖南省吉首市乾州世纪大道中铁置业世纪山水二期 62 号楼 106 号房	向清丰
80	中原证券张家港建农路营业部	江苏省张家港市杨舍镇建农路 18 号	朱晟
81	中原证券武汉珞狮路营业部	湖北省武汉市洪山区珞狮南路和文荟路交叉口南湖星光时代 7 层 12、13、14 号房	段瑞星
82	中原证券运城槐东北路营业部	山西省运城市槐东北路 9 号天宇商务楼一层	汤峰
83	中原证券太仓太平南路证券营业部	江苏省太仓市城厢镇太平南路 19-3 号	顾雅军

(四) 其他分支机构数量与分布情况

√适用 □不适用

截至报告期末，公司拥有30家分公司，具体情况如下：

序号	分公司	地址	成立时间	负责人	联系电话
1	中原证券郑州分公司	河南省郑州市金水区经三路 15 号广汇国贸 1 号楼 11 层	2011/3/10	李华锋	0371-61916172
2	中原证券南阳分公司	河南省南阳市人民路 170 号	2003/5/20	董保军	0377-63595666

序号	分公司	地址	成立时间	负责人	联系电话
3	中原证券平顶山分公司	河南省平顶山市新华区建设路中段 26 号佳田新天地 1 号楼 28 层, 2 号楼 101 铺	2015/6/30	文义尧	0375-4851999
4	中原证券漯河分公司	河南省漯河市郾城区黄河路金色华府君苑 7#楼 101 号	2003/6/9	骆东海	0395-3152525
5	中原证券濮阳分公司	河南省濮阳市建设路中段 203 号	2014/4/21	于春艳	0393-8152849
6	中原证券安阳分公司	河南省安阳市北关区红旗路北段财政证券大楼	2003/5/8	田丽琪	0372-5914195
7	中原证券新乡分公司	河南省新乡市人民路 250 号	2003/4/29	王天鹏	0373-2033009
8	中原证券鹤壁分公司	河南省鹤壁市淇滨区淇滨大道与兴鹤大街交叉口东南角	2004/5/26	王楠	0392-3321781
9	中原证券许昌分公司	河南省许昌市魏都区颍昌大道 669 号	2014/6/12	陈磊	0374-2334988
10	中原证券信阳分公司	河南省信阳市浉河区中山路 136 号弘运鑫鑫广场写字楼	2006/7/26	徐宏建	0376-6210668
11	中原证券焦作分公司	河南省焦作市解放中路 1838 号	2003/6/2	苏文峰	0391-3911111
12	中原证券开封分公司	河南省开封市大梁路与西环路交叉口银地商务广场	2006/8/11	李晖	0371-23156528
13	中原证券黄河金三角示范区分公司	河南省三门峡市大岭路锦绣华庭 4 号-6 号楼二楼	2013/11/20	王琳	0398-2829463
14	中原证券商丘分公司	河南省商丘市神火大道 96 号(工会办公楼)	2014/4/24	丁清明	0370-2580009
15	中原证券周口分公司	河南省周口市七一路中段 81 号河南网通公司周口分公司办公楼临街三楼	2006/4/26	宋飞	0394-8288681
16	中原证券洛阳分公司	河南省洛阳市西工区凯旋西路 30 号	2013/11/28	高景现	0379-63121666
17	中原证券驻马店分公司	河南省驻马店市解放路 196 号	2003/4/23	程喜文	0396-2989875
18	中原证券上海第一分公司	上海市虹口区大连西路 261 号 301-318 室	2003/8/29	沈若蔚	021-65074677
19	中原证券深圳分公司	广东省深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 123 号中国人寿大厦 31 楼 04、05 单元	2015/5/14	蒋会军	0755-83821553
20	中原证券北京分公司	北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦北座主楼 16 层 1611	2011/9/16	周卫东	010-83065880
21	中原证券四川分公司	四川省成都高新区锦城大道 1000 号 13 幢 2 层 4 号	2017/2/3	任莉	028-86051588
22	中原证券江苏分公司	江苏省南京市建邺区庐山路 168 号 1205-1206 室	2017/9/5	张瀚敏	025-86793336
23	中原证券海南分公司	海南省海口市美兰区国兴大道 5 号海南大厦 20 层 2007 号房	2017/9/12	孟宗毅	0898-66515051
24	中原证券山东分公司	山东省济南市历下区经十路 15982 号第一大道 10 楼 1001 号	2011/2/25	孔庆丽	0531-55513888
25	中原证券山东第一分公司	山东省青岛市崂山区仙霞岭路 16 号金领尚街 B 区	2004/2/4	赵胜长	0532-83898830

序号	分公司	地址	成立时间	负责人	联系电话
26	中原证券湖南分公司	湖南省长沙市芙蓉区远大一路730号东盈商业广场2栋2554、2555、2556、2557房	2011/1/11	朱国俊	0731-84598688
27	中原证券陕西分公司	陕西省西安市碑林区南关正街1号泛溪大厦A座3楼	2011/4/19	姬丽娟	029-86351806
28	中原证券浙江分公司	浙江省杭州市江干区新塘路111号新城时代广场2号楼3楼301室	2004/8/10	曹剑波	0571-28916100
29	中原证券广州分公司	广东省广州市天河区临江大道395号2401室(部位:自编02)(仅限办公)	2014/11/27	熊培黎	020-87308225
30	中原证券股份有限公司上海分公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1788号、1800号T1栋22-23	2009/7/2	刘灏	021-50588666

七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所(境内)	名称	大华会计师事务所(特殊普通合伙)
	办公地址	北京市海淀区西四环中路16号院7号楼1101
	签字会计师姓名	敖都吉雅、李甜甜
报告期内履行持续督导职责的保荐机构	名称	华泰联合证券有限责任公司
	办公地址	北京市西城区丰盛胡同22号丰铭国际大厦A座6层
	签字的保荐代表人姓名	孙泽夏、孙轩
	持续督导的期间	2019年10月11日-2021年12月31日
中国内地法律顾问	北京市君致律师事务所	
香港法律顾问	竞天公诚律师事务所	
A股股份登记处	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	
H股股份登记处	香港中央证券登记有限公司	
统一社会信用代码	91410000744078476K	

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	2021年	2020年	本期比上年同期增减(%)	2019年
营业收入	4,420,848,497.96	3,103,301,696.87	42.46	2,372,526,991.25
归属于母公司股东的净利润	513,210,337.25	104,302,038.78	392.04	58,222,745.44
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	490,355,011.21	95,722,370.32	412.27	19,157,977.42
经营活动产生的现金流量净额	-956,413,909.29	1,370,803,122.31	-169.77	3,488,339,970.68
其他综合收益	-13,421,475.85	-23,994,465.35	不适用	12,417,598.13
	2021年末	2020年末	本期末比上年同期末增减(%)	2019年末
资产总额	53,748,323,524.71	52,376,875,557.00	2.62	43,569,902,415.77
负债总额	39,604,243,601.31	38,190,399,466.49	3.70	33,072,115,962.00

代理买卖证券款	12,571,797,812.48	10,555,230,551.25	19.10	8,895,066,941.34
归属于母公司股东的权益	13,681,883,165.28	13,368,714,617.90	2.34	9,671,208,012.75
所有者权益总额	14,144,079,923.40	14,186,476,090.51	-0.30	10,497,786,453.77
期末总股本	4,642,884,700.00	4,642,884,700.00	0.00	3,869,070,700.00
归属于母公司股东的每股净资产(元/股)	2.95	2.88	2.43	2.50

(二) 主要财务指标

主要财务指标	2021年	2020年	本期比上年同期增减(%)	2019年
基本每股收益(元/股)	0.11	0.02	450	0.02
稀释每股收益(元/股)	0.11	0.02	450	0.02
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.11	0.02	450	0.005
加权平均净资产收益率(%)	3.78	0.93	增加2.85个百分点	0.59
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	3.61	0.85	增加2.76个百分点	0.19

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

加权平均净资产收益率及每股收益按照《公开发行证券公司信息披露编报规则第9号—净资产收益率和每股收益的计算及披露》的要求计算。

(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	9,100,531,842.63	10,141,843,317.23
净资产	14,055,597,217.02	13,743,917,923.23
各项风险资本准备之和	3,613,024,828.10	3,402,946,504.41
表内外资产总额	41,382,722,652.76	40,511,316,360.05
风险覆盖率(%)	251.88	298.03
资本杠杆率(%)	18.48	21.39
流动性覆盖率(%)	170.42	169.52
净稳定资金率(%)	140.92	169.30
净资本/净资产(%)	64.75	73.79
净资本/负债(%)	36.00	39.93
净资产/负债(%)	55.60	54.12
自营权益类证券及其衍生品/净资本(%)	6.77	3.82
自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%)	253.05	226.07
融资(含融券)的金额/净资本(%)	99.39	85.84

注：报告期内，公司净资本等各项主要风险控制指标均符合监管要求。

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、2021 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	1,076,191,096.51	1,259,850,052.24	1,137,702,274.62	947,105,074.59
归属于上市公司股东的净利润	120,959,031.78	108,002,668.70	267,791,961.79	16,456,674.98
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	118,075,383.25	103,056,332.40	271,739,634.69	-2,516,339.13
经营活动产生的现金流量净额	87,066,272.40	-1,369,810,240.99	467,790,690.80	-141,460,631.50

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	2021 年金额	附注 (如适用)	2020 年金额	2019 年金额
非流动资产处置损益	20,420,575.16	主要为处置子公司影响	-1,434,940.82	23,826,434.25
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	12,833,519.07	主要为政府补助	15,188,914.70	17,715,676.78
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回			5,000,000.00	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	5,556,296.97		-7,817,648.40	-5,966,282.11
减: 所得税影响额	11,092,326.41		2,527,734.55	8,893,957.23
少数股东权益影响额 (税后)	4,862,738.75		-171,077.53	-12,382,896.33
合计	22,855,326.04		8,579,668.46	39,064,768.02

将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益项目的情况说明

适用 不适用

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
交易性金融资产	22,592,572,498.77	24,507,919,178.87	1,915,346,680.10	1,530,326,997.17
其他债权投资	2,088,805,149.07	970,426,547.78	-1,118,378,601.29	80,258,999.69
衍生金融资产		54,610.00	54,610.00	-81,608,550.20
衍生金融负债	57,980.91	465,376.83	407,395.92	
交易性金融负债	1,356,226,583.04	971,171,013.72	-385,055,569.32	-463,067,392.11
合计	26,037,662,211.79	26,450,036,727.20	412,374,515.41	1,065,910,054.55

十三、 其他

√适用 □不适用

(一) 合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)
货币资金	12,332,030,422.75	10,951,131,021.90	12.61
融出资金	8,148,017,143.05	7,400,757,113.38	10.10
衍生金融资产	54,610.00		不适用
应收款项	98,055,900.27	169,323,523.34	-42.09
买入返售金融资产	972,870,075.44	2,055,964,889.83	-52.68
交易性金融资产	24,507,919,178.87	22,592,572,498.77	8.48
债权投资	263,452,484.68	456,168,931.89	-42.25
其他债权投资	970,426,547.78	2,088,805,149.07	-53.54
长期股权投资	1,659,879,203.08	1,067,276,173.44	55.52
其他资产	283,225,421.38	1,387,323,474.69	-79.58
应付短期融资款	7,032,271,969.93	4,154,657,809.90	69.26
拆入资金	2,900,742,263.92	3,694,418,222.23	-21.48
衍生金融负债	465,376.83	57,980.91	702.64
卖出回购金融资产款	10,548,472,328.09	12,200,308,194.73	-13.54
代理买卖证券款	12,571,797,812.48	10,555,230,551.25	19.10
应付职工薪酬	768,133,013.64	561,932,538.17	36.69
应付款项	143,594,220.52	65,874,572.60	117.98
合同负债	6,872,133.68	26,495,681.41	-74.06
长期借款		1,001,741.67	-100.00
应付债券	3,685,225,541.41	4,610,250,342.02	-20.06
递延所得税负债	38,563,107.66	14,241,536.99	170.78
股本	4,642,884,700.00	4,642,884,700.00	0.00
资本公积	6,301,860,583.46	6,330,622,817.68	-0.45
其他综合收益	-872,349.97	12,549,125.88	-106.95
未分配利润	295,251,945.46	102,780,913.15	187.26

少数股东权益	462,196,758.12	817,761,472.61	-43.48
项目	2021 年度	2020 年度	增减幅度 (%)
利息净收入	138,347,509.79	101,097,703.29	36.85
手续费及佣金净收入	1,636,808,462.51	1,172,198,286.83	39.64
公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	489,485,981.10	-48,524,176.45	不适用
汇兑收益 (损失以“-”号填列)	1,578,376.60	-3,348,221.20	不适用
资产处置收益 (损失以“-”号填列)	69,744.36	-20,777.16	不适用
业务及管理费	1,803,962,502.07	1,334,084,832.77	35.22
其他资产减值损失	2,752,382.99	31,841,326.55	-91.36
营业外收入	18,736,381.72	5,860,453.04	219.71
所得税费用	167,195,492.71	41,911,301.78	298.93
其他综合收益的税后净额	-13,421,475.85	-23,994,465.35	不适用

(二) 母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	增减幅度 (%)
货币资金	10,787,186,204.27	9,353,694,098.48	15.33
融出资金	8,081,803,812.77	7,248,897,079.39	11.49
衍生金融资产	54,610.00		不适用
应收款项	29,485,887.66	85,450,845.08	-65.49
买入返售金融资产	972,870,075.44	2,055,165,080.52	-52.66
交易性金融资产	20,891,935,865.83	19,933,278,797.76	4.81
其他债权投资	970,426,547.78	2,088,805,149.07	-53.54
长期股权投资	5,296,280,233.94	4,126,432,553.95	28.35
其他资产	232,547,711.06	523,400,315.46	-55.57
应付短期融资款	7,032,271,969.93	3,425,939,961.92	105.27
拆入资金	2,900,742,263.92	3,694,418,222.23	-21.48
交易性金融负债	0.00	778,986,314.11	-100.00
衍生金融负债	465,376.83	57,980.91	702.64
卖出回购金融资产款	10,448,272,328.09	12,002,208,194.73	-12.95
代理买卖证券款	11,400,036,597.27	9,666,752,032.28	17.93
应付职工薪酬	719,713,530.83	517,314,154.75	39.13
应付款项	116,166,224.28	60,063,783.40	93.40
合同负债	5,113,846.11	10,997,000.07	-53.50
应付债券	3,685,225,541.41	4,610,250,342.02	-20.06
其他负债	122,760,647.36	47,982,898.50	155.84
股本	4,642,884,700.00	4,642,884,700.00	0.00
资本公积	6,606,160,370.84	6,606,160,370.84	0.00
其他综合收益	454,814.24	-1,388,009.67	不适用
未分配利润	426,335,070.44	286,790,057.51	48.66
项目	2021 年度	2020 年度	增减幅度 (%)
利息净收入	89,238,835.37	46,243,250.79	92.98
手续费及佣金净收入	1,472,777,921.89	1,038,150,743.24	41.87
投资收益 (损失以“-”号填列)	932,957,257.98	631,253,436.58	47.79
公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	76,803,683.45	-88,807,494.18	不适用
汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-189,029.17	-646,160.05	不适用
其他业务收入	12,637,023.36	18,079,232.10	-30.10
资产处置收益 (损失以“-”号填列)	61,132.30	-20,667.36	不适用

业务及管理费	1,576,873,987.71	1,149,447,203.93	37.19
信用减值损失	168,069,536.77	263,120,359.08	-36.12
其他资产减值损失	213,448,720.01		不适用
营业外收入	3,658,099.45	2,410,755.63	51.74
营业外支出	9,320,144.10	7,004,959.37	33.05
所得税费用	142,219,610.57	16,466,013.88	763.72
其他综合收益的税后净额	1,842,823.91	-6,823,772.15	不适用

第三节 管理层讨论与分析

一、经营情况讨论与分析

(一) 总体经营情况

2021年，面对复杂多变的环境，抢抓资本市场全面推行注册制改革、入围首批“白名单”券商及与顶尖机构合作等重大机遇，大力推进公司主要业务条线的上档升级、空间布局的进一步优化，财富管理、固定收益投资、投行、股权投资等主体业务保持良好发展态势，开启快速发展的新阶段。

财富管理条线坚持稳中求进主基调，强化科技赋能，加快数字化转型，持续提升服务专业能力和服务支撑能力，改革成效进一步显现，两融余额、公募基金销量及新增客户等较去年同期实现大幅提升；投行业务全面开花，股权承销及保荐总收入排名第18名，IPO主承销家数排名第15名，IPO主承销金额排名第19名，IPO项目主承销收入排名第16名，市场影响力进一步提升；自营交易业务延续强势表现，实现债券和股票投资“双丰收”；旗下中州蓝海坚持与“巨人”同行，不断加大优质项目布局，优化投资结构，丰富公司投资品种，投资能力和投资收益显著提升；公司控股的股权中心持续优化服务方式，加快实现从注重规模扩张向注重质量提升的转变，承接运营全国中小企业股份转让系统（新三板）河南基地，发掘新三板与股权中心联动合作新模式，促进四板与三板市场的互联互通，助推河南省优秀企业借助多层次资本市场快速发展。【数据来源：Wind资讯】

(二) 主要业务分析

1、 证券经纪业务

市场环境

2021年，注册制等多项基础制度改革逐步落地，交投活跃度明显提升。上证综指收于3,639.78点，较上年末上涨4.80%；深证成指收于14,857.35点，较上年末上涨2.67%；创业板指数收于3,322.67点，较上年末上涨12.02%。两市股票成交量放大，全年股基交易额276.23万亿元，同比增长25.36%。随着行业通道佣金率持续下降，市场交易的活跃度提升和规模放大对经纪业务收入贡献逐步减弱，投顾收入、代销金融产品业务收入占比不断提升。新冠疫情的出现进一步推动客户对于非现场交易和服务的需求，“线上获客”方式得以进一步强化，证券经纪业务正朝着“集中化、线上化、智能化”的方向发展。【数据来源：Wind资讯】

经营举措及业绩

2021年，公司证券经纪业务通过数字化支撑赋能和管理驱动引导，基本实现了“数据打通”、“流程打通”、“业务打通”的数字化“三通”工作，初步构建了精准化数字营销网络，推出了智能机器人服务，加速了公司智能财富管理升级，有效提高了公司客户服务质量、黏性和市场竞

争力。公司“财升宝”APP日活跃用户量和月活跃用户量等互联网运营指标综合排名稳居券商第24名，官方微信服务号月均影响力行业内排名稳居第11名，报告期内，公司入选东方财富互联金融概念板块指标股。通过强化产品研究能力，建立科学的产品分类分级体系，贯彻“优选精品基金”战略，不断提升产品评价和资产配置专业能力，优选的重点产品及构建的投资组合表现良好。完成资产配置系统和基金投顾运营平台的部署和测试，为基金投顾业务打好基础。开展投资顾问团队结构优化，强化专业培训、优化绩效评价体系，注册投顾数量在129家券商中排名第26位，营销服务团队能力大幅度提升。加强互联网活动运营，建立全流程协同机制，策划“618财富地图”、“818理财节”、“实盘大赛——夏季PK赛”等活动，实施数字化、精细化运营。【数据来源：易观千帆、清博大数据】

报告期内，公司股票基金交易量合计人民币2.04万亿元，同比增长7.74%。截至报告期末，线上金融服务平台产品销售额人民币78.3亿元，较上年增长80.83%；金融产品销售总计人民币122.27亿元，较上年增长50.96%，公司非货币公募基金日均保有额达到人民币51.49亿元，较上年增长103.00%，非货币公募基金时点保有额达到人民币48.64亿元，同比增长15.00%，公募基金累计销售人民币45.41亿元，较上年增长2.80%，全年累计发行收益凭证人民币76.42亿元，同比增长96%；证券经纪业务客户总数211.98万户，较上年增长19.78%。

2022 年展望

2022年，公司证券经纪业务将围绕强基固本上台阶，坚持改革创新和合规风控，依托公司整体的专业能力和数字化支撑赋能，积极推进服务和管理的精细化、标准化、专业化（“三化”）建设。同时，加快实现线下与线上协同发展，线上继续推动人工智能和大数据业务应用，强化营销与服务的精准化和数据化，为客户提供量身定制的理财规划和全天候的资产配置服务。线下将继续深耕河南，充分利用地域和渠道优势新增客户及资产，提高投顾人员专业能力和服务水平，成为投资者身边的理财专家。坚持精品代销策略，扩大公募基金产品代销规模，积极推动私募基金代销业务，提升代销金融产品业务收入占比，探索适合自身发展的财富管理转型之路。

2、 信用业务

市场环境

2021年，融资融券业务受益于股市行情，市场参与者交投活跃，融资融券规模持续增长，截至报告期末，沪深两市融资融券余额为人民币1.83万亿元，较上年末增长13.17%。券商更加重视股票质押式回购业务的风险防控，谨慎开展新增业务，股票质押式回购业务整体规模维持下降趋势，市场风险得到有效缓解。

经营举措和业绩

2021年，融资融券业务方面，持续推进存量及待开客户激活和开发工作，通过开展“强基固本”等主题营销服务活动，创新开展优秀讲师跨分支机构巡讲助力业务开展，持续拓宽融券券源渠道，以自有资金购入及转融券借入券源满足客户融券需求，融资融券业务规模明显提升。股票

质押式回购业务方面，坚持“服务协同”的基本定位，充分利用公司投行及其他业务条线资源、信息优势挖掘优质客户，新增生息资产人民币2.9亿元。进一步完善具有自身特色的类信贷操作流程和风控体系，持续化解违约项目，释放潜在风险，收回违约项目本息及违约金合计人民币2.93亿元，累计压退高风险项目人民币1.2亿元，业务结构进一步优化。

报告期内，公司融资融券账户新增3,526户，融资融券余额人民币80.25亿元，同比增长11.60%。股票质押式回购待购回余额人民币20.60亿元，较上年末下降13.60%。其中表内股票质押式回购业务待购回融出资金本金人民币13.81亿元，同比下降19.01%，平均维持担保比率213.47%；表外股票质押式回购业务待购回融出资金本金人民币6.79亿元，与上年同期持平。

2022年展望

2022年，公司将持续加大融资融券客户拓展力度，进一步聚焦高净值客户拓展，提高融资融券客户使用率，稳步提升公司融资融券业务规模。股票质押式回购业务将继续坚持稳中有进，在进一步化解违约项目风险的基础上，稳步拓展新项目，借助业务协同信息优势，服务公司重要机构客户，做好存量管理，高质量开展新增业务。

3、 期货业务

公司通过子公司中原期货开展期货业务、期货投资咨询及资产管理业务，并通过中原期货子公司豫新投资开展风险管理业务。

市场环境

2021年，我国期货市场稳步推进品种创新和制度创新，市场容量、深度、广度和多元化程度持续提升。大宗商品、金融市场波动加剧，实体企业、金融机构避险、投资需求增加，对期货市场参与度大幅提升。报告期内，全国期货市场累计成交量为75.14亿手，同比增长22.13%；累计成交额为人民币581.20万亿元，同比增长32.84%。【数据来源：中国期货业协会】

经营举措和业绩

2021年，中原期货围绕煤化工、农产品、黑色和有色金属等四个优势产业链，通过提升原创研究水平，与龙头企业开展战略合作，组织“中原汇”行业高端闭门论坛及产业基地论坛等形式，提升服务区域产业链能力和水平。

报告期内，期货经纪业务客户权益规模实现快速增长，新增客户3,646户，服务客户总量达3.21万户，其中机构客户同比增长129%；累计成交手数2,679.87万手，同比增长10.58%；成交金额人民币23,672.81亿元，同比增长54.17%，荣获郑州商品交易所年度“农业产业服务奖”，中国金融期货交易所年度“成长突破奖”。期货资产管理业务以发展“固收+权益+衍生品”为转型突破口，初步形成涵盖债券、股票、期货多市场、多策略的大类资产配置产品布局，存续资管计划共26支，管理规模期末净值为人民币30.94亿元。风险管理子公司综合运用期货、期权、互换等期货衍生工具，发挥风险承接、转移和对冲的功能，助力中小企业应对原材料价格大幅波动

风险。其中风险管理子公司开展的生猪、花生、鸡蛋、玉米、豆粕等“保险+期货”项目，有效帮助企业及农户抵御市场风险。风险管理子公司累计采购商品人民币 13.3 亿元，同比减少 5.63%；累计销售商品收入人民币 15.43 亿元，同比增长 23.97%。

2022 年展望

2022年，中原期货将继续围绕防风险、稳经营、创利润的目标，推动综合竞争实力不断增强，进一步提升服务实体经济能力。期货经纪业务着力打造优势产业链期货衍生品服务品牌，提升产业客户占有率。期货资管业务完善多元化产品供给体系，在保持固收类、权益类、综合类、CTA及 FOF 等多个产品类型布局的基础上，丰富期货衍生品产品线及量化产品设计，拓宽投资范围，实现产品管理规模和收入的稳步增长。风险管理业务聚焦做市业务和风险控制，进一步参与期货交易所的“保险+期货”项目，积累场外衍生品管理经验，帮助企业抵御风险。

4、 投资银行业务

市场环境

2021年随着注册制的深入推进和北交所的设立、资本市场的持续改革为投行业务发展提供了广阔市场机遇。2021年，沪深两市共有483家企业完成首发上市，募集资金人民币5,351.46亿元，同比增长13.87%。上市公司再融资募集资金人民币12,463.64亿元，同比增长8.22%。北交所成立以来共有11家企业完成首次公开发行，募集资金75.22亿元。新三板市场募集资金合计人民币259.68亿元，同比增长11.82%。各类机构发行债券总额人民币61.75万亿元，同比增长8.56%。【数据来源：Wind资讯、北京证券交易所官网】

经营举措和业绩

2021年，公司持续聚焦河南本土，充分发挥省内“全覆盖”的地域优势，通过“三位一体”链式服务，为省内企业在培育、融资、上市等方面提供综合金融服务：不断完善制度体系，修订了《中原证券股份有限公司保荐代表人执业管理办法》等多项制度；优化组织架构，成立债权融资总部规划统筹公司债券类业务，取得银行间非金融企业债务融资工具的承销资质，为债券类业务发展打开了上升空间；持续优化升级信息系统，升级多个重要的系统模块，与行业前沿科技企业对接智能投行相关系统的开发，通过科技赋能提高运营效率；积极推进重点项目落地，公司完成 IPO 主承销项目共 13 单（含 2 单联席主承销项目），上市公司再融资主承销项目 6 单，已过会待发行 IPO 主承销项目 3 单，沪深两市股权主承销金额全年累计人民币 110.83 亿元，同比增长 24.95%；完成企业债项目 1 单，公司债项目 10 单，金融债项目 1 单，债券类主承销金额全年累计人民币 75.13 亿元，同比减少 46.52%。此外，完成上市公司并购重组独立财务顾问项目 1 单；完成新三板定向发行 3 单，累计融资人民币 0.53 亿元。

截至报告期末，公司 IPO 项目主承销收入排名第 16 名，IPO 主承销家数排名第 15 名，股权承销及保荐总收入排名第 18 名，IPO 主承销金额排名第 19 名，IPO 保荐项目过会家数行业排名第

21 名，股权承销金额排名第 26 名；公司在 2021 年证券公司公司债券业务执业能力评价中获得 B 类评级，在 2021 年度证券公司从事上市公司并购重组财务顾问业务执业能力专业评价中获得 B 类评级；在 Wind 资讯“2021 年度最佳投行”评选活动中，荣获 2021 年度最佳投行之“A 股 IPO 承销快速进步奖”。【数据来源：Wind 资讯】

2022 年展望

2022 年公司投行业务将持续深耕河南市场，提高省内市场占有率，对接省内大型国企、上市公司及优秀民企的业务需求，提供“一企一策”针对性服务，更好地服务实体经济发展。围绕重大国家战略，开拓北上广深等发达地区市场，充实项目储备。与投资业务加强联动，并带动公司其他业务发展，发挥好“火车头”的作用。

5、投资管理业务

(1) 资产管理

市场环境

2021 年是资管新规过渡期最后一年，资产管理行业净值化转型进入最后冲刺阶段，行业开启规范发展新征程，产品创新持续萌生新活力，衍生出新模式和新格局，头部效应愈加明显。证券公司通过设立资产管理子公司、申请公募基金业务管理资格、加快大集合产品公募化改造等多种方式，加快资管业务分层布局。未来，券商资管将继续坚持以主动管理为核心，积极整合资源禀赋，探索特色化与差异化的核心竞争力，致力于为客户提供多层次、高质量的产品体系。截至报告期末，证券期货经营机构私募资管业务规模合计人民币 15.98 万亿元（不含社保基金、企业年金）。从产品类型看，存续产品以单一资产管理计划为主，规模占比为 54.23%，从产品管理方式看（不含证券公司私募子公司私募基金），通道类产品规模继续下降，主动管理类产品稳步增长。通道类产品规模人民币 1.72 万亿元，同比减少人民币 3.88 万亿元；主动管理类产品规模人民币 13.71 万亿元，同比增加人民币 3.58 万亿元。【数据来源：中国证券投资基金业协会】

经营举措和业绩

2021 年，公司资产管理业务严格落实资管新规要求，平稳完成存续私募资产管理产品规范整改，有序推进大集合产品公募化改造。加强风险控制，制定风险化解方案，积极跟进，有序化解历史风险。遵循行业发展趋势，以市场为导向，聚焦投研核心能力建设，积极探索特色化、差异化业务发展方向，设立新的标准化资产管理产品，逐步丰富基础产品体系。

截至报告期末，公司资产管理总规模人民币 37.37 亿元，其中集合资产管理计划 7 支，管理规模人民币 32.44 亿元，单一资产管理计划 1 支，管理规模人民币 0.53 亿元，专项资产管理计划 2 支，管理规模人民币 4.39 亿元。

2022 年展望

2022年，公司在资管业务方面继续打造投研一体化平台，提升核心主动管理能力；大力巩固现有业务服务水平，积极布局固收业务和FOF产品，并探索寻求差异化发展，培养构建自身资管业务特色。同时细化专业团队培养，并加强合规风控能力和文化建设，积极推动资管业务规范长远发展。

（2） 私募基金管理

公司通过子公司中鼎开源及其子公司开展私募基金管理业务。

市场环境

2021年，我国股权投资市场整体表现活跃，募投总额均打破历史记录，募资金额为人民币2.21万亿，同比增长84.5%，投资金额为人民币1.42万亿元，同比增长60.4%。投资活动在疫情防控常态化后空前活跃，行业分布具有鲜明的时代特征，开启了面向信息技术、医疗健康、半导体、机械制造和互联网行业的投资热潮。注册制改革持续推进和北交所成立进一步扩充了股权投资市场退出渠道，退出案例显著增加，全年退出案例数共4,532笔，同比上升18.0%。【数据来源：清科数据】

经营举措和业绩

2021年，中鼎开源沿着政府产业基金和上市公司并购基金两条主线，广泛对接意向合作伙伴，推动基金的设立。通过合作头部机构，联动公司投行，挖掘河南省及发达地区市场的投资机会，围绕科技产业、新能源、新材料、现代服务业等板块，实现投资人民币12,619万元，进一步发挥政府引导基金的引领带动作用，支持“专精特新”企业的发展。狠抓投后管理，赋能优质企业发展，实现在投项目炬光科技科创板上市；通过股权回购、寻求第三方受让等手段，加快风险项目脱困和退出进度，逐步化解风险。

报告期内，中鼎开源及其下设机构管理备案私募基金14支，管理规模人民币49.995亿元，在投规模人民币12.34亿元。

2022年展望

2022年，中鼎开源将发挥中原证券省内唯一法人券商优势，提高募资能力，进一步与地市平台和头部机构展开合作，做大“朋友圈”，争取更多政府引导基金，做大基金规模，挖掘优质项目资源，形成稳定且多层次的客户梯队。同时，提高投资能力，抓住北交所的设立机遇，扩大向“专精特新”中小企业投资比重，借助中原证券平台优势，提供投资、投行、投贷联动“三位一体”的优质服务，实现“科技-产业-金融”高水平循环。

（3） 另类投资

公司通过子公司中州蓝海开展另类投资业务。

市场环境

2021年受新冠疫情及全球超发影响，国际市场通胀苗头显现，宏观经济延续了较为低迷的态势，国际政治经济环境不确定性依然存在。国内市场资金两级分化加大、市场投资环境复杂，部分行业持续低迷，部分行业借助全球超发而呈现“过热”局面。同时，中国高度重视资本市场发展，注册制改革持续深化，11月北交所成功开市，为中小企业提供了更为便利的融资渠道，也为一级市场投资的退出提供了新的通道。从产业层面来看，新一轮科技和产业变革正在加速全球创新版图重构，国内的新能源、新材料、生命科学、半导体、碳中和等领域正在迎来较好的投资期。

经营举措和业绩

2021年，中州蓝海积极推动业务转型发展，紧抓注册制实施的有利政策，逐步加大早期优质项目的投资。实施“与巨人同行，加快发展”的策略，与国内多个顶尖投资机构开展深度合作，在高科技、碳中和、新兴产业方面广泛布局。与公司投资银行条线协同，发挥“投行+投资+投贷联动”优势，积极赋能河南省内优质实体企业，推动省内实体经济发展。同时，加强存量低效投资资金的盘活，不断优化资产结构。

报告期内，中州蓝海新增投资 20 单，规模合计人民币 13.12 亿元，其中股权投资 10 单，规模人民币 1.71 亿元；金融产品投资 16 单，规模人民币 11.41 亿元。各类退出投资项目 14 个，回收投资额人民币 2.63 亿元。截至报告期末，中州蓝海在投项目 53 单，规模总计人民币 29.86 亿元。

2022 年展望

2022年，中州蓝海将在严控风险的基础上，紧抓资本市场发展机遇，积极践行ESG标准，继续加强与业内知名投资机构的合作，逐步提升自主投资能力，采用参与基金、跟投、混合投资等多种方式，提升投资规模和盈利水平；保持和投行紧密联动，将有限的自有资金投资于风险较小、周期较短的项目，加快资金周转效率，提高投资收益；加强投后管理工作，逐个项目进行排查，逐一施策，形成投资-增值退出-再投资的良性循环，实现经济效益和社会效益双丰收。

6、 自营交易

市场环境

2021年随着疫情反复，全球宏观经济遭遇供应链、能源和通胀危机，大宗商品价格高企，国际主要经济体修复进程不一，国内经济基本面修复进程放缓，整体上看金融市场波动较大，上证综指上涨4.80%，深证成指上涨2.67%，创业板上涨12.02%。股票市场方面，市场结构分化较为严重，业绩依然是股价最基本驱动因素，新能源及周期涨板块幅居前。债券市场方面，年初受通胀预期担忧等因素影响，10年期国债收益率快速上行。下半年受宏观经济复苏放缓以及疫情反复，叠加“双限双控”和房地产政策加码等因素影响，宏观经济开始呈现走弱趋势，利率债收益率震荡下行。信用债分化持续加大，高等级信用债收益率开始下行，低等级信用债收益率持续上行。中债总全价指数上升2.28%。【数据来源：Wind资讯】。

经营举措和业绩

2021 年，权益投资方面，公司以优化调整投资策略为抓手，主要围绕定向增发、股票权益自主投资和委托投资三方面开展。特别是在定向增发投资方面，增强了现有研究力量，深入个股及行业研究，实现了投研互动，精选投资品种，取得了较好的投资收益。同时，通过优化投资策略，实现了自有投资和委托投资的双轮驱动运行方式，持续与优秀机构合作，不断提升权益类投资收益水平。

固定收益方面，利率债券投资通过加强衍生品投资对冲交易，逐步扩大国债期货、利率互换交易量，增加了现有利率债投资收益；债券销售业务通过提升市场交易能力，把握市场上涨机会，抓住一级地方政府债券销售市场机遇，增加地方债在团数量，债券销售收入实现较高增长；可转债完善业务投资体系，根据市场行情变化选取投资标的，可转债投资收益较去年大幅提升。

报告期内，自营交易业务实现营业收入人民币 57,838.21 万元。

2022 年展望

2022 年，公司权益投资将持续提升投资研究能力，积极把握市场节奏，审慎运作，稳步扩大定增、打新股等中性自营业务，实现收益多元化。固定收益投资业务将结合市场变化不断改进和优化投资策略，研判债市行情，深入信用债券投资研究，丰富债券投资品种，综合运用现券、利率互换、国债期货等工具开展组合套利，提升自有资金投入，逐步降低杠杆水平，提高投资收益率。在现有自营业务的基础上，增加量化交易等投资内容，做好大类资产配置，并积极发掘场外衍生品业务机遇，增加自营业务深度和广度，提高投资收益。

7、 境外业务

公司通过子公司中州国际及其子公司开展境外业务。

市场环境

2021 年，香港资本市场交投活跃，金融市场募资总额达港币 3,288 亿元，全球排名第四，全年完成 98 单 IPO，新上市债券数量达 508 只，创历史新高，上市债券总募资额达 1.55 万亿港元。受疫情、经济预期等综合影响，恒指全年下跌约 14.1%，恒生科技指数全年下跌约 32.7%，在全球主要市场中的表现较为低迷。【数据来源：Wind 资讯，港交所】

经营举措和业绩

2021 年，中州国际高度重视投行业务发展，加大河南省内业务拓展力度，稳健发展持牌类业务，审慎开展投资业务，储备项目资源，培育股权融资、债权融资的核心竞争力，打造公司海外市场服务平台。

截至报告期末，中州国际证券业务客户 8,532 户，证券市值 13.91 亿港元，累计港股交易量 32.51 亿港元，2021 年于香港交易所 613 家会员中的交易量排名第 300 名。孖展融资业务余额约 0.81 亿港元，较上年末下跌 54.84%。期货业务客户 263 户，全年总成交量 239.42 万手，在港交

所黄金期货产品和 LME 迷你金属产品成交量位居交易所前列，期货公司荣获 2021 年模范中资期货商奖项。投行业务积极开展保荐类业务，新增 1 单主板 IPO 项目交表，完成多单财务顾问项目，参与 4 单境外美元债业务。审慎开展自营投资业务，与行业领先机构的合作，培育投资能力。

2022 年展望

2022 年，中州国际将以投行业务为导向，充分发挥公司与一流机构合作的资源优势，加强境内外协同，强化海外市场融资服务能力，带动投资和机构业务；完善合规风控体系，对风险项目分类施策，加大风险化解力度，减少损失；通过互联网金融引流促进经纪业务转型发展，审慎开展自营业务，适时开发结构化业务，为客户提供定制化的服务和金融产品。

8、 其他业务

区域性股权市场业务

公司通过子公司股权中心开展区域性股权市场业务。

市场环境

2021年，中国证监会《关于完善全国中小企业股份转让系统终止挂牌制度的指导意见》正式发布，这是继2020年《关于规范开展全省非上市股份有限公司股权登记托管工作的意见》（豫金发〔2020〕63号）后又一登记托管政策利好，对股权中心开展新三板摘牌企业登记托管业务意义重大，更有利于多层次资本市场的上下联动。此外，河南省内出台的多项政策进一步明确股权中心的职责和未来三到四年的发展方向，为河南省区域股权市场发展营造了良好政策环境。截至报告期末，全国区域性股权市场共有挂牌公司3.81万家（其中股份公司2.34万家），展示企业13.84万家，托管公司5.77万家，合格投资者12.49万户，累计实现各类融资人民币16,664.63亿元。【数据来源：中国新四板 区域性股权市场】

经营举措和业绩

2021年，股权中心加快从注重规模向注重质量转变，聚集重点区域和优质企业，强化资源对接和精准服务，通过发挥平台优势和资源汇集效应，不断提升私募融资和培育孵化服务水平，推动挂牌企业迈入更高层次资本市场。报告期内，股权中心正式揭牌并承接运营全国中小企业股份转让系统（新三板）河南基地；设立基金投资企业服务专板，全年顺利承办2021年度“郑创汇”国际创新创业大赛四月份月赛和河南省发改委战略性新兴产业优质企业路演等四次活动，扩充优质企业项目储备，为挂牌企业和金融机构之间提供更加便捷的融资对接渠道；加强市场开拓，完成河南消费金融类公司等股权登记托管，拓宽了股权中心登记托管业务的服务企业类型；线上线下相结合，组织会员机构专场业务培训2期、股权业务培训3期、常态化路演配套培训活动5次，共覆盖300余家企业，为挂牌、展示、托管企业及会员单位持续提供融智服务；积极落实“推动企业股份制改造”工作，签订企业改制及交易板挂牌业务3单，成功辅导改制企业2家，多项融资对接

逐步落地；推动挂牌企业快速成长，15家发展较快企业实现内部升级转板，5家优质企业迈入科创板、主板、新三板等更高层次板块。

截至报告期末，累计挂牌企业突破9,500家；累计融资人民币178.47亿元，较上年末增长52.07%；托管企业470家，托管股份663.11亿股，分别较上年末增长5.62%和7.42%。

2022 年展望

2022年，股权中心将充分发挥上交所资本市场服务河南基地和全国中小企业股份转让系统（新三板）河南基地作用，持续完善培育孵化功能，推动全省“小升规、规改股、股上市”战略实施；进一步完善融资服务功能，扩大私募融资规模；丰富板块设置，研究增设“专精特新板”，更好对接新三板和北交所；拓展商业银行及非上市股份公司股权托管，规范企业股权管理，发掘运用股权价值，促进股权合理流动；积极探索国有企业股权转让业务，通过市场功能，发现股权价值，减少交易成本。

二、报告期内公司所处行业情况

2021年，万众瞩目的十四五规划正式发布，其中涉及资本市场、证券行业的重要表述为未来五年全面深化资本市场改革指明了方向。全面实行股票发行注册制、深化新三板改革、设立北交所，十四五期间各项改革政策红利有望持续释放，资本市场的改革将更加深入。根植于资本市场的证券行业势必持续受益，随着证券公司“白名单”制度的启用，行业高质量发展的空间被进一步打开。

根据中国证券业协会的统计，截至2021年底，我国共有140家证券公司，总资产、净资产、净资本分别为人民币10.59万亿元、人民币2.57万亿元、人民币2.00万亿元，同比分别增长18.99%、11.26%、9.89%；共实现营业收入、净利润分别为人民币5,024.10亿元、人民币1,911.19亿元，同比分别增长12.03%、21.32%，整体经营业绩持续改善，但幅度同比出现收敛。截至目前，证券行业的周期属性尚未显著减弱，但整体处于“螺旋式”上升的趋势中。

公司目前是河南省内注册的唯一一家法人证券公司。经过十余年的发展，公司已发展为具有独特区域优势的综合性证券公司。

三、报告期内公司从事的业务情况

公司主要业务有证券经纪业务、信用业务、期货业务、投资银行业务、投资管理业务、自营交易业务和境外业务。

公司证券经纪业务指公司接受客户委托，代理客户买卖股票、基金、债券等业务，并提供投资顾问服务、理财策划服务。公司通过收取佣金及其他服务费用等获得收入。

公司信用业务指公司向客户提供融资融券、约定购回及股票质押等融资类业务服务。公司通过收取利息获得收入。

公司期货业务涵盖了期货经纪业务、期货资产管理业务、期货投资咨询业务及风险管理业务。公司通过期货经纪业务收取交易手续费、交割手续费等获得收入，通过期货资产管理业务赚取管理费用及超额收益分配，通过期货投资咨询业务收取投资咨询服务费，并通过设立风险管理子公司开展基差贸易、场外衍生品等风险管理服务业务获取收入。

公司投资银行业务主要包括股权类承销与保荐业务、债券类产品承销业务、并购重组等财务顾问业务及新三板业务，通过向客户提供以上类型的金融服务取得对应的承销费、保荐费、财务顾问费等收入。

公司投资管理业务包括资产管理业务、私募基金管理业务以及另类投资业务。公司通过资产管理业务、私募基金管理业务赚取管理费用及超额收益分配，并从自有资金投资中获得投资收益。

公司自营交易业务投资范围包括依法公开发行的股票、债券、基金、衍生工具及中国证监会认可的其他金融产品，通过投资上述产品获得投资收益。

公司境外业务范围涵盖了证券经纪、孖展融资、期货经纪、投资银行、证券研究、自营投资等资本市场服务。

四、报告期内核心竞争力分析

√适用 □不适用

（一）以投行为龙头的全业务链协同优势

围绕“做强投行、做优投资”业务战略，公司持续深化投行改革，专业能力显著提高，股权业务承销金额、并购重组财务顾问交易金额及承销定增融资规模等核心指标排名大幅提升，进入行业前列，保荐IPO项目过会数量及投行储备项目大幅增加，对投资、信用业务和财富管理等业务的龙头带动作用日益凸显。

（二）A+H两地上市平台优势

公司是拥有A+H双资本通道的证券公司，具备一定的品牌、社会影响力以及丰富便捷的融资渠道，可以迅速扩充资本实力、补足运营资金。

（三）金融综合经营优势

目前公司在北京、上海、香港、广州、深圳等省会城市及核心城市，河南省内各省辖市和发达县（市）设有分支机构110多家，拥有股权中心、中原期货、中州蓝海、中鼎开源、中州国际等子公司，初步形成以证券业务为基础、涵盖区域性股权市场、期货、另类投资、私募基金管理等金融业态在内的综合经营格局，探索实行投行保荐企业上市、投资跟进和投贷联动的“三位一体”服务模式，为客户提供全方位全生命周期的服务。

（四）“根据地”优势

公司是河南省唯一法人券商，河南资本市场发展的主体，天然拥有中国中西部最大经济省份“根据地”，长期深耕河南市场，与地方政府、企业及个人客户建立了深度合作关系，具有稳定的客户群体，多项业务区域市场占有率名列前茅。

五、报告期内主要经营情况

详见本节“一、经营情况讨论与分析”。

(一) 主营业务分析

1. 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	4,420,848,497.96	3,103,301,696.87	42.46
营业成本	3,710,316,417.23	2,954,485,813.12	25.58
经营活动产生的现金流量净额	-956,413,909.29	1,370,803,122.31	-169.77
投资活动产生的现金流量净额	1,396,672,398.03	-1,335,439,661.91	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	1,115,907,979.30	1,474,831,325.48	-24.34

本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

2. 收入和成本分析

适用 不适用

其中合并利润表中变动超过 30% 的项目如下：

单位：元 币种：人民币

项目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)	情况说明
利息净收入	138,347,509.79	101,097,703.29	36.85	主要为本期融出资金利息收入增加
手续费及佣金净收入	1,636,808,462.51	1,172,198,286.83	39.64	主要为本期投资银行业务净收入增加
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	489,485,981.10	-48,524,176.45	不适用	主要为本期交易性金融资产公允价值变动
汇兑收益（损失以“-”号填列）	1,578,376.60	-3,348,221.20	不适用	主要为本期汇率变动
资产处置收益（损失以“-”号填列）	69,744.36	-20,777.16	不适用	主要为本期固定资产处置收益增加
业务及管理费	1,803,962,502.07	1,334,084,832.77	35.22	主要为本期职工费用增加
其他资产减值损失	2,752,382.99	31,841,326.55	-91.36	主要为本期计提存货跌价准备减少
营业外收入	18,736,381.72	5,860,453.04	219.71	主要为本期违约赔偿金收入增加
所得税费用	167,195,492.71	41,911,301.78	298.93	主要为本期递延所得税费用增加
其他综合收益的税后净额	-13,421,475.85	-23,994,465.35	不适用	主要为本期其他债权投资价值变动影响

(1). 主营业务分行业、分产品、分地区、分销售模式情况

单位:万元 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 (%)
证券经纪业务	91,665.02	63,731.61	30.47	2.66	9.33	减少 4.24 个百分点
自营业务	57,838.21	14,674.90	74.63	365.61	-16.73	增加 116.49 个百分点
投资银行业务	61,868.98	49,475.06	20.03	245.90	154.86	增加 28.56 个百分点
信用业务	46,632.32	20,469.45	56.1	55.80	-0.95	增加 25.15 个百分点
投资管理业务	21,709.16	20,834.21	4.03	154.70	514.45	减少 56.19 个百分点
期货业务	162,063.44	161,047.31	0.63	19.69	21.04	减少 1.11 个百分点
境外业务	-17,642.25	7,600.86	不适用	不适用	13.39	不适用
总部及其他	21,130.29	53,258.19	-152.05	4.06	39.25	减少 63.71 个百分点
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 (%)
省内分支机构	83,148.34	52,687.10	36.63	2.43	7.95	减少 3.25 个百分点
省外分支机构	66,354.89	25,719.41	61.24	223.15	-5.13	增加 93.27 个百分点
境内子公司	205,166.90	185,738.53	9.47	31.40	25.83	增加 4.01 个百分点
境外子公司	-17,642.25	7,600.86	不适用	不适用	13.39	不适用
总部业务	108,237.29	119,345.69	-10.26	93.56	77.72	增加 9.84 个百分点

主营业务分行业、分产品、分地区、分销售模式情况的说明

√适用 □不适用

报告期内,本集团实现营业收入人民币 44.21 亿元,同比增长 42.46%。其中,自营交易业务人民币 5.78 亿元,增加人民币 4.54 亿元,主要为本期二级市场投资业务收入增加;投资银行业务人民币 6.19 亿元,增加人民币 4.40 亿元,主要为本期证券承销业务收入增加;期货业务人民币 16.21 亿元,增加人民币 2.67 亿元,主要为本期子公司豫新投资大宗商品销售收入增加;信用业务人民币 4.66 亿元,增加人民币 1.67 亿元,主要为本期融出资金利息收入增加;投资管理业务人民币 2.17 亿元,增加人民币 1.32 亿元,主要为本期子公司基金投资收入增加;证券经纪业务人民币 9.17 亿元,增加人民币 0.24 亿元,主要为本期代理买卖证券业务和代理销售金融产品业务收入增加;境外业务人民币-1.76 亿元,减少人民币 1.47 亿元,主要为本期中州国际所持金融产品公允价值变动收益减少。

报告期内,本集团营业支出为人民币 37.10 亿元,同比增长 25.58%。其中,业务及管理费人民币 18.04 亿元,增加人民币 4.70 亿元,主要为本期职工费用增加;其他业务成本人民币 15.08 亿元,增加人民币 2.83 亿元,主要为本期子公司豫新投资大宗商品销售成本增加;信用

减值损失人民币 3.74 亿元，增加人民币 0.29 亿元，主要为公司按照谨慎性和充分计提的原则评估每笔业务的信用风险，通过预期损失模型计提减值准备。公司会持续监控担保品市值和融资人信用状况的变化，审慎评估股票质押式回购业务等风险，若出现担保品市值下跌等不利因素，公司将严格按照企业会计准则及公司会计政策规定，足额计提当期减值准备。

报告期内，本集团实现归属于母公司股东的净利润人民币 5.13 亿元，同比增长 392.04%，主要为公司积极把握市场机遇，不断提升核心竞争力，经营业绩显著增长。

报告期内，子公司豫新投资大宗商品业务规模增加，销售收入和销售成本同时增加，毛利率较低。

(2). 重大采购合同、重大销售合同的履行情况

适用 不适用

(3). 报告期主要子公司股权变动导致合并范围变化

适用 不适用

报告期内，中原小贷 15%的股权处置完成，公司对中原小贷的持股比例由 65%降为 50%，丧失控制权，因此不再纳入合并范围。中原小贷 11%的股权处置进展请参见本报告“第十节 财务报告 十三、资产负债表日后事项”。

(4). 公司报告期内业务、产品或服务发生重大变化或调整有关情况

适用 不适用

3. 费用

适用 不适用

请参见本报告“第十节 财务报告 六、合并财务报表主要项目 注释 50、业务及管理费”。

4. 研发投入

(1). 研发投入情况表

适用 不适用

(2). 研发人员情况表

适用 不适用

(3). 情况说明

适用 不适用

(4). 研发人员构成发生重大变化的原因及对公司未来发展的影响

适用 不适用

5. 现金流

适用 不适用

2021 年度，本集团现金及现金等价物净增加额人民币 15.58 亿元。

(1) 经营活动产生的现金流量净额

报告期内，经营活动产生的现金流量净额为人民币-9.56 亿元，同比减少人民币 23.27 亿元，主要为卖出回购业务本年为净流出，上年同期为净流入，导致现金流入减少。

经营活动产生的现金流入人民币 79.26 亿元，占现金流入总量的 36.87%。主要为：收取利息、手续费及佣金的现金人民币 29.84 亿元，占比 37.65%；返售业务资金净减少额人民币 9.08 亿元，占比 11.46%；代理买卖证券收到的现金净额人民币 20.17 亿元，占比 25.44%；收到其他与经营活动有关的现金人民币 20.17 亿元，占比 25.44%。经营活动产生的现金流出人民币 88.82 亿元，占现金流出总量的 44.55%。主要为：交易性金融工具净增加额人民币 13.36 亿元，占比 15.04%；拆入资金净减少额人民币 7.90 亿元，占比 8.89%；回购业务资金净减少额人民币 16.52 亿元，占比 18.60%；融出资金净增加额人民币 7.38 亿元，占比 8.31%；支付利息、手续费及佣金的现金人民币 7.69 亿元，占比 8.65%；支付给职工以及为职工支付的现金人民币 11.39 亿元，占比 12.83%；支付的各项税费人民币 4.72 亿元，占比 5.31%；支付其他与经营活动有关的现金人民币 19.86 亿元，占比 22.36%。

报告期内公司经营活动产生的现金净流量与本年净利润存在重大差异的原因说明：

公司经营活动产生的现金流量净额为人民币-9.56 亿元，公司净利润人民币 5.51 亿元，差异的主要原因是：公司经营活动产生的现金流量净额包括交易性金融工具的购入成本及卖出的净现金流量，拆入资金、回购返售业务、融出资金的净现金流量，代理买卖证券业务的净现金流量；而利润表中体现的是以上业务现金流转形成的投资收益、利息支出、佣金收入等收入或支出情况和非现金流对损益的影响，如资产折旧、摊销、减值损失等。

(2) 投资活动产生的现金流量净额

报告期内，投资活动产生的现金流量净额为人民币 13.97 亿元，同比增加人民币 27.32 亿元，主要为收回资金收到的现金增加。

投资活动产生的现金流入人民币 16.17 亿元，占现金流入总量的 7.52%。主要为：收回投资收到的现金人民币 13.26 亿元，占比 82.00%；取得投资收益收到的现金人民币 1.28 亿元，占比 7.89%；处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额人民币 0.01 亿元，占比 0.08%；

处置子公司及其他营业单位收到的现金净额人民币 1.62 亿元，占比 10.03%。投资活动产生的现金流出人民币 2.21 亿元，占现金流出总量的 1.11%。主要为：购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金人民币 2.21 亿元，占比 100%。

(3) 筹资活动产生的现金流量净额

报告期内，筹资活动产生的现金流量净额为人民币 11.16 亿元，同比减少人民币 3.59 亿元，主要为吸收投资收到的现金减少。

筹资活动产生的现金流入人民币 119.51 亿元，占现金流入总量的 55.60%。主要为：发行债券收到的现金人民币 119.41 亿元，占比 99.92%；取得借款所收到的现金人民币 0.10 亿元，占比

0.08%。筹资活动产生的现金流出人民币 108.35 亿元，占现金流出总量的 54.34%。主要为：偿还债务所支付的现金人民币 99.83 亿元，占比 92.14%；分配股利、利润或偿付利息所支付的现金人民币 6.78 亿元，占比 6.26%；支付其他与筹资活动有关的现金人民币 1.74 亿元，占比 1.60%。

(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	12,332,030,422.75	22.94	10,951,131,021.90	20.91	12.61	主要为期末受市场行情影响客户资金存款增加
融出资金	8,148,017,143.05	15.16	7,400,757,113.38	14.13	10.10	主要为期末融出资金规模增加
衍生金融资产	54,610.00	0.00		0.00	不适用	主要为期末个股期权变动影响
应收款项	98,055,900.27	0.18	169,323,523.34	0.32	-42.09	主要为期末应收债券兑息款项减少
买入返售金融资产	972,870,075.44	1.81	2,055,964,889.83	3.93	-52.68	主要为期末质押式回购业务规模减少
交易性金融资产	24,507,919,178.87	45.60	22,592,572,498.77	43.13	8.48	主要为期末基金投资规模增加
债权投资	263,452,484.68	0.49	456,168,931.89	0.87	-42.25	主要为期末债权投资减值准备增加
其他债权投资	970,426,547.78	1.81	2,088,805,149.07	3.99	-53.54	主要为期末债券投资规模减少
长期股权投资	1,659,879,203.08	3.09	1,067,276,173.44	2.04	55.52	主要为期末合并范围变化，联营企业增加
其他资产	283,225,421.38	0.53	1,387,323,474.69	2.65	-79.58	主要为期末合并范围变化，贷款减少
应付短期融资款	7,032,271,969.93	13.08	4,154,657,809.90	7.93	69.26	主要为期末部分债券剩余期限不足 1 年，划分至应付短期融资款核算
拆入资金	2,900,742,263.92	5.40	3,694,418,222.23	7.05	-21.48	主要为期末转融通拆入资金减少
衍生金融负债	465,376.83	0.00	57,980.91	0.00	702.64	主要为期末个股期权变动影响
卖出	10,548,472,328.09	19.63	12,200,308,194.73	23.29	-13.54	主要为期末质押式卖出

回购金融资产款						回购业务规模减少
代理买卖证券款	12,571,797,812.48	23.39	10,555,230,551.25	20.15	19.10	主要为期末受市场行情影响客户资金存款增加
应付职工薪酬	768,133,013.64	1.43	561,932,538.17	1.07	36.69	主要为期末应付工资费用增加
应付款项	143,594,220.52	0.27	65,874,572.60	0.13	117.98	主要为期末应付清算款增加
合同负债	6,872,133.68	0.01	26,495,681.41	0.05	-74.06	主要为期末贸易预收款减少
长期借款	0.00	0.00	1,001,741.67	0.00	-100.00	主要为期末信用借款减少
应付债券	3,685,225,541.41	6.86	4,610,250,342.02	8.80	-20.06	主要为期末部分债券剩余期限不足1年,划分至应付短期融资款核算
递延所得税负债	38,563,107.66	0.07	14,241,536.99	0.03	170.78	主要为期末金融资产价值变动影响

其他说明

(1) 资产状况

2021年末,集团总资产人民币537.48亿元,较年初人民币523.77亿元增加人民币13.71亿元,增长2.62%。其中,货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的比率为29.20%,金融资产占总资产的比率为47.89%,融出资金占总资产的比率为15.16%,投资性房地产、固定资产、在建工程、使用权资产占总资产的比率为0.79%,长期股权投资占总资产的比率为3.09%,买入返售金融资产占总资产的比率为1.81%,递延所得税资产、无形资产、其他资产等占总资产的比率为2.06%。公司的资产质量和流动性较好,资产结构优良。

(2) 负债状况

2021年末,集团总负债人民币396.04亿元,较年初人民币381.90亿元增加人民币14.14亿元,增长3.70%。其中,代理买卖证券款(含信用交易代理买卖证券款)占总负债的比率为31.74%,应付债券、应付短期融资款占总负债的比率为27.06%,卖出回购金融资产款占总负债的比率为26.63%,银行借款占总负债的比率为0.65%,拆入资金占总负债的比率为7.32%,交易性金融负债、衍生金融负债占总负债的比率为2.45%,应付薪酬、税金、其他负债等占总负债的比率为4.15%。

截至2021年12月31日,集团扣除代理买卖证券款(含信用交易代理买卖证券款)和代理承销证券款的资产负债率为65.65%,同比减少0.43个百分点。

2. 境外资产情况

√适用 □不适用

(1) 资产规模

其中：境外资产 11.23（单位：亿元 币种：人民币），占总资产的比例为 2.09%。

(2) 境外资产占比较高的相关说明

适用 不适用

3. 截至报告期末主要资产受限情况

适用 不适用

请参见本报告“第十节 财务报告 六、合并财务报表主要项目注释 60、所有权或使用权受到限制的资产”。

4. 其他说明

适用 不适用

(四) 行业经营性信息分析

适用 不适用

请参见本报告本节“一、经营情况讨论与分析”中的相关内容。

(五) 投资状况分析**对外股权投资总体分析**

适用 不适用

报告期末，本集团长期股权投资人民币 16.60 亿元，与上年末相比增加人民币 5.93 亿元，增幅为 55.52%，主要为出售中原小贷部分股权后，中原小贷转为联营企业。

1. 重大的股权投资

适用 不适用

请参见本报告“第十节 财务报告 六、合并财务报表主要项目注释 11、长期股权投资”。

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

请参见本报告“第二节 公司简介和主要财务指标 十二、采用公允价值计量的项目”。

4. 报告期内重大资产重组整合的具体进展情况

适用 不适用

(六) 重大资产和股权出售

适用 不适用

2020 年 8 月 13 日，公司第六届董事会第二十一次会议审议通过了《关于转让中州蓝海持有中原小贷部分股权的议案》，同意中州蓝海转让中原小贷 15%股权。2020 年 9 月，公司完成了河

南省财政厅国有资产评估项目备案程序。2021 年 1 月，中州蓝海与漯河市金融控股有限公司（以下简称“漯河金控”）签订了《国有产权交易合同》，将其持有的中原小贷 15%股权转让给漯河金控。2021 年 12 月，中原小贷收到《河南省地方金融监督管理局关于河南省中原小额贷款有限公司变更事项的批复》（豫金监〔2021〕137 号），同意关于本次 15%股权转让的股权结构调整等有关事项，根据上述批复，中原小贷于 2021 年 12 月完成了工商变更。

2021 年 10 月 15 日，公司第六届董事会第三十五次会议审议通过了《关于第二次转让中州蓝海持有中原小贷部分股权的议案》，同意中州蓝海转让中原小贷 11%股权。2021 年 10 月，公司完成了河南省财政厅国有资产评估项目备案程序。2021 年 11 月，公司取得了河南省财政厅《关于中州蓝海投资管理有限公司转让河南省中原小额贷款有限公司 11%股权的批复》。2021 年 12 月，中州蓝海与漯河金控签订了《国有产权交易合同》，将其持有的中原小贷 11%股权转让给漯河金控。2022 年 3 月，河南省地方金融监督管理局出具《河南省地方金融监督管理局关于河南省中原小额贷款有限公司变更事项的批复》（豫金监〔2022〕56 号），同意中原小贷变更股权结构等事项。

上述具体内容请参阅公司于上交所网站披露的日期分别为 2020 年 8 月 14 日、2020 年 10 月 9 日、2021 年 1 月 23 日、2021 年 10 月 16 日、2021 年 12 月 21 日和 2022 年 3 月 16 日的相关公告。（公告编号：2020-062、2020-066、2021-005、2021-059、2021-068、2022-009）

（七）主要控股参股公司分析

√适用 □不适用

中原期货股份有限公司

注册地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦 4 楼

成立日期：1993 年 4 月 18 日

注册资本：人民币 3.3 亿元

持股比例：51.357%

法定代表人：谢雪竹

联系电话：0371-68599199

主要业务：商品期货经纪；金融期货经纪；期货投资咨询；资产管理

财务状况：截至 2021 年 12 月 31 日，总资产为人民币 19.98 亿元，净资产人民币 4.35 亿元；2021 年，实现营业收入人民币 16.21 亿元，净利润人民币 1,989.48 万元。

中鼎开源创业投资管理有限公司

注册地址：北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 501-11 室

成立日期：2012 年 2 月 8 日

注册资本：人民币 6.8 亿元

持股比例：100%

法定代表人：周捷

联系电话：0371-69177108

主要业务：投资管理；资产管理；股权投资；创业投资；投资咨询；财务顾问

财务状况：截至 2021 年 12 月 31 日，总资产为人民币 13.17 亿元，净资产人民币 8.02 亿元；2021 年，实现营业收入人民币 1.15 亿元，净利润人民币 4,790.90 万元。

出现大幅波动原因：中鼎开源 2021 年营业收入同比增加 114.31%，利润总额同比增加 127.32%，净利润同比增加 128.14%。主要原因为报告期内中鼎开源子公司中证开元所投企业市值屡创历史新高，为中鼎开源贡献较高投资收益。

中州国际金融控股有限公司

注册地址：香港中环康乐广场 8 号交易广场二期 1505 及 1508 室

成立日期：2014 年 10 月 29 日

注册资本：港币 18 亿元

持股比例：100%

联系电话：00852-25001375

主要业务：证券经纪、期货经纪、就证券提供意见、孖展融资、期货经纪、就期货合约提供意见、保荐承销、财务顾问、自营投资

财务状况：截至 2021 年 12 月 31 日，中州国际总资产为 13.74 亿港元，净资产 8.04 亿港元；2021 年，实现收入及其他收益 -1.39 亿港元，净利润 -3.04 亿港元。

亏损原因：因疫情持续、港股市场波动等不利影响，以服务内地客户为主的持牌公司业务受到重大影响，业务收入下降。此外，历史风险项目公允价值调减及计提减值对经营结果产生阶段性影响。

中州蓝海投资管理有限公司

注册地址：许昌市魏都产业集聚区劳动路以西宏腾路以北

成立日期：2015 年 3 月 25 日

注册资本：人民币 35.00 亿元

持股比例：100%

法定代表人：徐海军

联系电话：0371-86503971

主要业务：以自有资金进行金融产品投资、证券投资、股权投资

财务状况：截至 2021 年 12 月 31 日，中州蓝海总资产为人民币 32.70 亿元，净资产人民币 31.17 亿元；2021 年，实现营业收入人民币 2.55 亿元，净利润人民币 0.39 亿元。

中原股权交易中心股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 23 号

成立日期：2015 年 6 月 29 日

注册资本：人民币 3.5 亿元

持股比例：35%

法定代表人：赵继增

联系电话：0371-61775086

主要业务：为企业提供股权、债权和其他权益类资产的登记、托管、挂牌、转让和融资等服务；投资与资产管理；财务顾问、企业推介、企业展示、培训和咨询服务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

财务状况：截至 2021 年 12 月 31 日，总资产为人民币 5.11 亿元，净资产人民币 4.45 亿元；2021 年，实现营业收入人民币 1.66 亿元，净利润人民币 1.13 亿元。

（八）公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

截至 2021 年 12 月 31 日，本集团合并 5 家结构化主体，这些主体包括资产管理计划及合伙企业。公司对担任结构化主体的管理人或投资顾问，且持有产品份额的结构化主体，综合考虑公司拥有的投资决策权、可变回报的敞口及运用投资决策权影响可变回报等因素后，将公司拥有控制权的结构化主体纳入合并报表范围。结构化主体合并范围变化请参见本报告“第十节 财务报告七、合并范围的变更”。

六、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

2021 年上半年，十四五规划正式发布，全面注册制写入“十四五”规划，资本市场的地位已经提升到前所未有的高度。中国证监会主席易会满在题为《提高直接融资比重》的文章中表示十四五时期提高直接融资比重的六大重点任务：全面实行股票发行注册制，拓宽直接融资入口；健全中国特色多层次资本市场体系，增强直接融资包容性；推动上市公司提高质量，夯实直接融资发展基石；深入推进债券市场创新发展，丰富直接融资工具；加快发展私募股权基金，突出创新资本战略作用；大力推动长期资金入市，充沛直接融资源头活水。提高直接融资比重，将有助于健全金融市场功能、丰富金融服务和产品供给，提高金融体系适配性。

随着北交所的成立，新三板改革进一步深化，对于健全多层次资本市场，加快完善中小企业金融支持体系，推动创新驱动发展和经济转型升级具有重要意义，是新形势下全面深化资本市场改革的重要举措。

资本市场制度改革全面铺开，居民财富管理需求稳定增长，权益资产的配置比例将持续提升，给证券行业的发展注入了不竭的动力。行业经纪、投行、私募基金、另类投资等业务将迎来新的业务增量。

与此同时，随着资本市场快速发展，证券行业面临着对外、对内双重的政策环境，行业竞争进一步加剧：证券公司外资股比限制取消以及证券业务牌照逐步放开，外资投行和以商业银行为代表的国内其他金融机构将逐步进入证券市场，进而改变证券行业现有的竞争格局；证券行业头部集中的趋势较明显，整个市场的份额在快速地向头部券商集中；以构建互联网生态为基础，聚集海量用户资源并增强用户粘性的互联网券商、第三方销售机构持续冲击证券公司传统的经营模式，证券行业的整体竞争格局趋于复杂化、白热化，中小券商的生存空间受到进一步压缩。未来证券公司会向差异化、特色化、专业化、国际化的方向发展。头部券商可以通过并购继续做大，中小券商应该向专业化、特色化发展。

展望 2022 年，国内资本市场日均成交量有望保持在较高水平，但受制于佣金率下滑以及北向资金成交占比提高等因素，能否实现进一步增长存在不确定性；券商自营业务难有大的增长空间，进入整固期的概率较大；全面注册制有望正式落地，券商投行业务将继续高位运行；券商资管业务有望稳中有升；券商信用业务利息净收入有望保持小幅增长。预计 2022 年证券行业整体经营业绩将在目前的水平上下小幅波动，维持较高景气度。

(二) 公司发展战略

√适用 □不适用

以习近平新时代中国特色社会主义思想为指引，以落实我省创新驱动战略为重点，在河南省委、省政府的正确领导和各方面的关心支持下，大力加强党建和党风廉政建设，紧紧抓住 A 股全面实行注册制、与国际顶尖机构合作及入围首批“白名单”券商等重大机遇，加强合规风控建设，推进主要业务条线的上档升级，优化公司发展的空间布局，加快数字化转型，争取再造一个中原证券，持续为股东创造价值。

(三) 经营计划

√适用 □不适用

以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，全面贯彻党的十九大、十九届历次全会和中央经济工作会议精神，认真落实省委、省政府工作部署，以高质量党建为引领，坚持稳中求进工作总基调，锚定目标、砥砺奋进，大力提升专业能力，业务上档升级和风险防范化解两手抓，打好“再造一个中原证券”关键之年攻坚战。

统筹抓好公司层面重要经营管理事项的推进。高水平做好融资工作，打造强大可靠的低成本资金保障；开展大学习、大培训、大练兵、大提升活动，全面提升各领域专业能力；着力构建“投行+投资+投贷联动”长效机制，优化提升“三位一体”金融服务模式；进一步加快数字化转

型步伐,提升金融科技对公司发展的支撑水平;多措并举加快其它业务发展,优化完善公司业务结构。

大力推进各业务条线提质增效上档升级。依托公司整体实力和金融科技赋能,再接再厉做好财富管理条线客户、渠道、产品、工具、团队和管理的上档升级;投行业务继续保持好快速增长势头,做优做大做强,带动其它业务加快发展;自营投资业务做好现有业务,审慎开展场外衍生品业务,确保实现稳定增长;资产管理业务全面转向业务发展,尽快做大主动管理规模;质押融资业务加大拓展力度,稳步提升优质资产规模;做市业务优化资产结构,进一步提高资产收益率;中原期货聚焦主业稳健发展,不断增强综合竞争实力;中鼎开源有效破解募资难题,提升投资能力,加速迈入券商私募子公司第一梯队步伐;中州蓝海培养自主投资核心能力,积极赋能优秀企业,力争进入券商另类投资子公司第一梯队;中原股权交易中心充分发挥平台优势和资源汇集效应,加快业务转型升级和高质量发展;中州国际努力开拓业务机会,完善合规风控体系,确保发展稳定。

进一步加大风险化解力度。继续高度重视风险防范化解工作,认真总结既往风险化解成功经验,进一步加大工作力度,力争重点风险项目化解取得重大突破。

(四) 可能面对的风险

√适用 □不适用

公司面临的主要风险包括:信用风险、市场风险、流动性风险、操作风险、合规风险及信息技术风险等。具体如下:

(1) 信用风险及应对措施

信用风险指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。具体表现为:(1)投资对象的违约或评级下降;(2)交易对手的违约;(3)产品或客户合约到期、维持担保比例或履约保障比例低于平仓线,无法按时偿还资金或证券的风险;(4)因经纪业务结算带来的应收款项的坏账风险。公司目前面临的信用风险主要集中在债券投资业务、融资融券业务、股票质押式回购交易业务以及子公司开展的融资类业务、投资业务、场外衍生品业务等。

信用风险的管理围绕明确的融资人/交易对手和担保品/投资标的准入标准政策、科学的担保品折算率模型、统一的尽职调查标准、健全的授信审批制度、投后/贷后跟踪管理及违约处置管理等六个方面进行。同时,通过违约概率、违约损失率、信用风险敞口等计算预期损失与非预期损失,对公司业务信用风险进行计量和评估;依据各业务的风险特点,设定业务规模限额、单一投资标的/单一交易对手限额、单一客户/单一证券融资规模、单一客户/单一证券集中度等在内的风险指标进行监控;通过采取收取保证金、合格抵质押物以及采用净额结算等进行风险缓释,降低公司承担的风险净敞口和预期损失。

各信用风险业务具体管控:(1)债券投资业务设定准入标准,进行投资标的和交易对手准入管理和集中度控制,进行分级审核,并持续跟踪评估持仓债券信用风险。(2)融资融券业务、股

票质押式回购交易、约定购回式证券交易及境外子公司孖展业务，根据业务特征建立了严格的担保物范围及折算率、保证金比例、维持担保比例的标准，从征信、授信、盯市、平仓等多个环节进行前端控制，存续期对集中度、合约到期、维保比例或履保比例、重大事项等风险状况，进行动态监控。（3）对于因代垫经纪业务结算款项带来应收款项的信用风险，通过加强客户授信和保证金、担保证券管理，控制信用风险。（4）将子公司的风险管理纳入全面风险管理体系，对子公司风险管理工作实行垂直管理，通过委派子公司风险管理负责人推进子公司参照公司建立风险控制框架，建立定期和不定期风险报告及重点风险盯市机制，对子公司风险进行监测和管控。

报告期内，公司推进内部评级结果在公司债券业务的应用；严格按照股票质押业务的尽职调查及存续期管理制度，进行业务风险审核及分类控制；对融资融券业务证券池进行分池管理，确定风险池标准，控制业务风险；推进公司信用风险舆情监控系统在各业务、各子公司风险监控中发挥作用；细化对子公司垂直管理的措施。公司各项业务未新增重大信用风险。

报告期末，公司融资融券存量负债客户的平均维持担保比例为281%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为364%，表内股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为213%。

（2） 市场风险及应对措施

市场风险主要指所持有的金融工具的公允价值因市场价格不利变动而发生的风险，包括权益类资产价格波动风险、利率风险和汇率风险等。具体表现为：价格风险主要为证券市场波动导致股票等证券产品价格的不利变动而使公司表内和表外业务发生损失的风险；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；汇率风险指公司持有或运用外汇的经营活动中，因汇率变动而蒙受损失的可能性。公司市场风险主要涉及权益类证券及其衍生品投资交易、固定收益类证券及其衍生品投资交易、做市业务等。

公司对市场风险的管理围绕五个方面进行，一是执行严格的投资授权体系，公司管理层在董事会授权的权益类证券自营、固定收益类证券自营、资产管理等业务规模和风险限额范围内负责对业务规模和风险限额在年度内进行分解配置；二是建立证券池、黑白名单库管理机制，明确准入标准，严格池内交易；三是建立多指标风险监测评估体系，设置规模、集中度、风险限额、仓位控制、风险敞口、止损等风控指标，运用压力测试及敏感性分析，评估市场风险；四是建立逐日盯市机制，前后台协同，动态实时监控，保证风险管理政策、策略、风控指标得到执行，识别、预警、报告相关风险，及时采取降低敞口或对冲等措施控制风险；五是建立市场风险计量分析模型和工具，通过风险计量模型如VaR值、波动率、Beta、久期、凸性、DV01等指标对市场风险进行量化、分析，及时调整业务策略控制市场风险。

报告期内，公司不断完善市场风险的管控，一是将基点价值管理指标DV01额度分解细化到部门，对信用债、利率债等证券品种进行管控；二是不断加强权益类证券投资业务证券池管理，完善证券池分类及准入标准、规范出入池管理，不断提高选股科学性；三是积极研究对冲投资策略，运用国债期货、利率互换等金融衍生工具，开展风险中性的投资交易业务，对冲部分市场风险敞

口；四是统一市场风险管理，将公司及子公司市场风险类业务按照同一风控管理原则进行完善，包括按照产品类别完善资产管理业务各类产品的风控方案，完善中原期货投资业务规模、限额、单一品种集中度及止损限额等风控指标。

截至报告期末，公司市场风险控制在董事会授权的规模及限额以内。

(3) 流动性风险及应对措施

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。

为防范流动性风险，采取如下措施：一是强化资金头寸和现金流管理，采用大额资金提前预约模式，加强大额资金的监控及管理，科学预测未来不同时间段的现金流缺口，确保融资安排和业务用资节奏的一致性；二是积极拓展融资渠道、综合运用多种融资方式、均衡债务到期分布，提高融资的多元化和稳定程度，避免因融资渠道过于单一或债务集中到期的偿付风险；三是建立流动性储备资金运作管理机制，合理设置流动性储备资金最低持有规模和优质流动性资产配置比例，持有较为充足的优质流动性资产，确保公司能够及时变现足额资金应对在正常和压力情景下出现的资金缺口；四是采用以净资本、流动性为核心的风险监控体系，对风险控制指标进行监控，并使用压力测试评估业务活动对公司流动性的影响；五是建立并持续完善流动性风险应急机制，定期开展流动性风险应急演练，以确保公司流动性危机应对的及时性和有效性。

截至报告期末，公司流动性覆盖率和净稳定资金率分别为170.42%和140.92%，均符合监管要求，报告期内未发生重大流动性风险事件。

(4) 操作风险及应对措施

操作风险是由于不完善或有问题的内部程序、人员、信息系统和外部事件而导致的直接或间接损失的风险。涉及操作风险的包括公司各业务及各子公司。

在操作风险管理方面，公司通过较为完善的内部控制环境建设及合规有效性管理及评估，作为操作风险防范的基础。操作风险的具体管控包括：一是公司制定了操作风险管理办法，对操作风险识别、评估、监测、控制与报告的全过程进行规范；二是各单位制定有效的操作风险识别评估程序，主动识别存在于业务、流程及系统内的操作风险，并确保在推出新的业务和产品前，对其内在的操作风险作出充分评估；三是建立操作风险关键指标管理细则，对操作风险进行监控；四是进行操作风险损失事件收集及分析；五是通过风险管理系统，进行操作风险的计量、监控，形成操作风险的可视化报表。

报告期内，公司完成操作风险流程梳理及评估、关键风控指标及操作风险损失事件收集的工作，通过三个管控工具，优化了融资融券、经纪业务、债券受托管理、信息技术等部分操作流程，推进公司有效识别和控制“高频低损”操作风险事件的风险累积量以及“低频高损”操作风险事件发生概率及预警及时性。

(5) 合规风险及应对措施

合规风险是指因公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规和准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。

公司合规管理总部及时跟踪法律法规和准则，并结合公司实际情况持续制定完善公司合规管理制度体系；督导公司各单位根据法律法规和监管规则的变化，制定/修订内部管理制度、完善业务流程；加强各有关单位合规管理员的培训工作，打造一支合规意识强、专业能力过硬的合规管理员队伍；为公司经营管理层及各单位提供合规建议及咨询，并对其经营管理活动的合规性进行监督；对公司内部管理制度、重大决策、新产品、新业务方案等进行事前合规审查；严格落实合规考核与问责机制，为合规管理提供有力保障；履行向监管部门定期、临时报告义务；依据公司反洗钱有关制度，组织开展洗钱风险防控工作；通过合规咨询、合规审查、合规检查、合规监测等多种途径，及时对公司经营管理中的相关合规风险进行识别、评估和管理，将合规管理贯穿于决策、执行、监督、反馈等各个环节，并纳入公司运营管理的全过程；公司积极开展合规文化建设，完善自我约束机制，保证合规运营与规范发展。2021年，按照母公司口径，公司合规风控投入总额为人民币10,699.37万元。

(6) 信息技术风险及应对措施

信息技术风险主要指信息技术系统及通信系统不能提供正常服务，影响公司正常业务办理的风险；信息技术系统和关键数据的安全防护、备份能力不足，导致公司出现业务连续性问题或信息安全风险；重要信息技术系统提供商不能提供技术系统生命周期内持续支持和服务的风险。

报告期内，公司非常重视技术风险的防范，在基础资源投入，IT 运维管理、信息安全防护、灾备能力建设、应急能力建设等各方面持续投入，不断优化，以确保信息系统安全运行。2021年，按照母公司口径，公司信息技术投入总额为人民币 18,450.44 万元。具体措施如下：

(1) 持续加大对信息安全、云计算应用、基础设施新增和更新等方面的资金投入，夯实了信息系统运维保障的基础，使得信息系统健壮性进一步得到提高。

(2) 通过优化网络结构，加强威胁预警和病毒防范，定期开展安全渗透测试，利用全流量告警及大数据平台，提高了公司信息安全防护水平。

(3) 积极推进规范化、标准化、流程化、精细化建设，主动自查整改，不断完善和优化 IT 运维体系，确保信息系统安全稳定运行。

(4) 定期修订公司信息与网络安全事件应急处置预案，优化完善应急处置场景的判断、决策流程；常态化、模块化开展技术系统应急演练，提升技术人员应急熟练程度。

(五) 其他

适用 不适用

七、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

第四节 公司治理

一、公司治理相关情况说明

适用 不适用

作为在中国大陆和香港两地上市的公众公司，公司严格遵守《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》等境内外上市地的法律、法规及规范性文件的要求，依法合规运作，始终致力于维护和提升公司良好的社会形象。报告期内，公司成功完成了董事会、监事会换届，在原有经验丰富的管理团队基础上补充了新鲜血液，并借鉴行业先进经验，推进内部治理机制创新，制订并全面实行了执行委员会制度，提高公司重大经营管理事项决策效率，理清了党委领导、董事会决策、管理层执行、监事会监督的职责边界，形成各司其职、各负其责、协调运转、有效制衡的公司治理机制，确保了公司的规范运作。公司严格遵守了《企业管治守则》全部守则条文，并达到了《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。

公司治理与法律、行政法规和中国证监会关于上市公司治理的规定是否存在重大差异；如有重大差异，应当说明原因

适用 不适用

二、公司控股股东、实际控制人在保证公司资产、人员、财务、机构、业务等方面独立性的具体措施，以及影响公司独立性而采取的解决方案、工作进度及后续工作计划

适用 不适用

公司拥有独立的业务和经营自主能力，严格按照《公司法》、《证券法》等有关法律、法规和《公司章程》的要求规范运作，在资产、人员、财务、机构、业务等方面与控股股东相互独立。报告期内，公司重大决策由公司独立作出和实施，没有发生控股股东越过股东大会干预公司决策和生产经营活动的情况。

为避免同业竞争，本公司与河南投资集团于 2014 年 3 月 10 日签订了《避免同业竞争协议》。河南投资集团承诺，如果河南投资集团或其控股企业发现任何与本公司或本公司控股企业主营业务构成或可能构成直接或间接竞争的新业务机会，在不违反河南投资集团适用的法律法规的情况下，应在发现该等业务机会的 10 个工作日内书面通知本公司并提供本公司所需的有关该新业务机会的信息，并尽力促使该业务机会按合理和公平的条款和条件首先提供给本公司或本公司控股企业。

控股股东、实际控制人及其控制的其他单位从事与公司相同或者相近业务的情况，以及同业竞争或者同业竞争情况发生较大变化对公司的影响、已采取的解决措施、解决进展以及后续解决计划

适用 不适用

三、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	会议决议
2020 年年度股东大会	2021 年 6 月 30 日	http://www.sse.com.cn/ http://www.hkexnews.hk	2021 年 7 月 1 日	2020 年年度股东大会会议决议
2021 年第一次临时股东大会	2021 年 11 月 9 日	http://www.sse.com.cn/ http://www.hkexnews.hk	2021 年 11 月 10 日	2021 年第一次临时股东大会会议决议

表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

股东大会情况说明

适用 不适用

报告期内，公司共召开股东大会 2 次，其中年度股东大会 1 次，临时股东大会 1 次，会议情况和决议内容如下：

1、公司 2020 年年度股东大会于 2021 年 6 月 30 日召开，会议审议通过了《2020 年度董事会工作报告》《2020 年度监事会工作报告》《2020 年年度报告》《2020 年度利润分配方案》《2020 年度财务决算报告》《关于聘任 2021 年度审计机构的议案》《2020 年度董事考核及薪酬情况专项说明》《2020 年度监事考核及薪酬情况专项说明》《关于为中州国际金融控股有限公司提供担保或反担保的议案》《关于确定 2021 年度证券自营业务规模及风险限额的议案》《关于选举第六届董事会独立董事的议案》；

2、公司 2021 年第一次临时股东大会于 2021 年 11 月 9 日召开，会议审议通过了《关于修改〈公司章程〉的议案》《2021 年上半年利润分配方案》《关于选举第七届董事会董事的议案》《关于选举第七届董事会独立董事的议案》《关于选举第七届监事会监事的议案》。

四、董事、监事和高级管理人员的情况

(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A股数	年末持A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后报酬总额(万元)	是否在公司关联方获取报酬
菅明军	董事长、执行董事	男	59	2015年9月10日	2024年11月9日				不适用	97.18	否
	执行委员会主任委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
常军胜	副董事长(离任)	男	51	2018年10月16日	2021年6月8日				不适用	53.39	否
	执行董事(离任)			2018年5月17日	2021年6月8日						
	总裁(离任)			2018年4月25日	2021年6月8日						
李兴佳	非执行董事	男	57	2015年10月12日	2024年11月9日				不适用	0	是
张秋云	股东代表监事(离任)	女	50	2020年6月10日	2021年11月9日				不适用	0	是
	非执行董事			2021年11月9日	2024年11月9日						
唐进	非执行董事	男	56	2022年2月17日	2024年11月9日				不适用	0	是
王立新	非执行董事(离任)	男	55	2015年9月10日	2021年12月24日				不适用	3.07	是
田圣春	非执行董事	男	47	2018年10月16日	2024年11月9日				不适用	0	否
张笑齐	非执行董事	男	36	2015年9月10日	2024年11月9日				不适用	3.07	否
陆正心	非执行董事	男	40	2018年11月1日	2024年11月9日				不适用	3.51	否
袁志伟	独立非执行董事(离任)	男	46	2015年9月10日	2021年6月30日				不适用	11.35	否
宁金成	独立非执行董事(离任)	男	65	2015年9月10日	2021年6月30日				不适用	10.50	否
于绪刚	独立非执行董事(离任)	男	53	2015年12月7日	2022年2月17日				不适用	21	否

张东明	独立非执行董事	女	69	2018年10月16日	2024年11月9日				不适用	21	否
陈志勇	独立非执行董事	男	64	2021年6月30日	2024年11月9日				不适用	10.50	否
曾崧	独立非执行董事	男	50	2021年6月30日	2024年11月9日				不适用	11.35	否
贺俊	独立非执行董事	男	46	2022年2月17日	2024年11月9日				不适用	0	否
鲁智礼	监事会主席	男	55	2015年9月10日	2024年11月9日				不适用	105.63	否
魏志浩	股东代表监事	男	41	2021年11月9日	2024年11月9日				不适用	0	是
张宪胜	股东代表监事	男	56	2018年5月17日	2024年11月9日				不适用	0	是
谢俊生	股东代表监事(离任)	男	55	2016年10月13日	2021年11月9日				不适用	0	是
张博	股东代表监事	男	44	2021年11月9日	2024年11月9日				不适用	0	是
项思英	独立监事	女	58	2015年9月10日	2024年11月9日				不适用	10.08	否
夏晓宁	独立监事	男	61	2016年5月9日	2024年11月9日				不适用	11.29	否
张露	职工代表监事(离任)	女	53	2017年6月16日	2021年11月9日				不适用	87.73	否
张华敏	职工代表监事(离任)	男	50	2019年6月3日	2021年11月9日				不适用	112.11	否
巴冠华	职工代表监事	男	47	2021年11月9日	2024年11月9日				不适用	3.23	否
许昌玉	职工代表监事	女	42	2021年11月9日	2024年11月9日				不适用	2.87	否
肖怡忱	职工代表监事	女	37	2018年1月12日	2024年11月9日				不适用	54.49	否
朱建民	常务副总裁	男	59	2015年9月10日	2024年11月9日				不适用	104.55	否
	执行委员会副主任委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
朱军红	副总裁	女	52	2015年9月10日	2024年11月9日				不适用	99.50	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						

徐海军	副总裁	男	51	2016年9月3日	2024年11月9日				不适用	97.56	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
李昭欣	总会计师、 财务负责人	男	52	2018年1月29日	2024年11月9日				不适用	96.41	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
花金钟	副总裁	男	49	2019年2月25日	2024年11月9日				不适用	99.01	否
	合规总监 (离任)			2018年4月12日	2021年11月9日						
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
朱启本	董事会秘书	男	57	2018年1月18日	2024年11月9日				不适用	153.46	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
刘灏	首席投资官	男	50	2020年5月6日	2024年11月9日				不适用	326.91	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
李峰	首席风险官	男	51	2019年10月29日	2024年11月9日				不适用	96.41	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
王晓刚	执行委员会委员	男	51	2022年1月18日	2024年11月9日				不适用	0	否
史红星	合规总监	男	47	2021年11月9日	2024年11月9日				不适用	5.68	否
	执行委员会委员			2022年1月18日	2024年11月9日						
韩军阳	首席信息官	男	52	2019年10月29日	2024年11月9日				不适用	75.43	否
合计	/	/	/	/	/				/	1,788.27	/

姓名	主要工作经历
菅明军	1963年出生，河南省人大常委，经济学博士，高级会计师，河南省劳动模范，享受国务院政府特殊津贴专家。曾任国家财政部综合计划司干部，河南省财政厅办公室副主任，亚太会计集团常务副总裁，河南省财政厅办公室主任，河南省政府省管国有企业监事会主席，目前兼任中国证券业协会理事、河南省证券期货基金业协会会长、中国证券业协会投资银行专业委员会委员。2008年10月至2012年

	8 月任本公司总裁，2012 年 8 月至今任本公司董事长，2014 年 11 月至今兼任本公司党委书记，2022 年 1 月至今兼任本公司执行委员会主任委员。
李兴佳	1964 年出生，硕士研究生学历。现任本公司董事，河南投资集团董事、副总经理。历任河南省计划经济委员会、计划委员会、发展改革委员会科员、主任科员、副处长，河南省建设投资总公司总经济师、副总经理并兼任豫能控股股份有限公司董事长，河南投资集团有限公司资产管理一部临时负责人、技术总监、副总经理。
张秋云	1972 年出生，经济学博士。现任本公司董事，历任开封市第一中学教师、河南省发展和改革委员会财政金融处任副调研员、副处长，河南省宏观经济研究院党支部书记，中国（河南）自由贸易试验区郑州片区管委会常务副主任，自 2019 年 6 月至今任河南投资集团有限公司金融管理部主任，2020 年 6 月至 2021 年 11 月任本公司监事。
唐进	1966 年出生，江苏省委党校研究生，现任江苏苏豪副总裁、党委委员。历任江苏省建湖县委办公室秘书科科长、副主任，江苏省政府研究室、省政府办公厅副处长、处长，江苏苏豪副总裁、党委委员。
田圣春	1975 年出生，北京科技大学在职研究生学位，高级工程师。现任安阳钢铁集团有限责任公司规划发展部副总监。1998 年参加工作，历任安阳钢铁集团有限责任公司第四轧钢厂助理工程师、工程师、综合办科员、副主任、策划部投资管理科投资管理员、战略投资处对外投资管理办公室主任、规划发展部政策研究室主任、首席二级管理专家。
张笑齐	1985 年出生，本科学历，商学学士。现任北京懋源资本投资管理有限公司董事、副总经理。历任深圳证券交易所下属单位深圳证券信息有限公司指数事业部职员，北京懋源资本投资管理有限公司项目经理。
陆正心	1982 年出生，清华大学五道口金融学院高级工商管理硕士。现任珠海融泽通远投资管理合伙企业（有限合伙）董事总经理。曾任摩根士丹利亚洲投资银行部分析员、高盛亚洲特别机会投资部执行董事、工银国际控股有限公司董事总经理、天津工银国际投资顾问合伙企业（有限合伙）董事总经理。
张东明	1953 年出生，经济学博士学位。现为中国财政科学研究院（原财政部财政科学研究所）退休研究员。1969 年 9 月参加工作，历任牡丹江空军五七干校工人、北京市东城区委工业交通部干部、财政部财政科学研究所研究生部科长、教务处副处长、处长，高级经济师、研究员，外国财政研究中心研究员。
陈志勇	1958 年出生，中共党员，中南财经政法大学经济学博士学位。现为中南财经政法大学教授、博士生导师。1987 年研究生毕业于原中南财经政法大学财政学专业，同年留校任教。历任中南财经政法大学财政系主任、财政税务学院副院长、财政税务学院院长。现兼任中国高等教育学会高等财经教育分会财政学专业委员会主任委员、全国高校财政学教学研究会副会长、全国税务专业学位研究生教学指导委员会委员、湖北省财政学会常务理事、湖北省预算与会计研究会副会长、湖北省税务学会副会长、湖北省国际文化交流中心理事等职，享受国务院政府特殊津贴。
曾崧	1972 年出生，香港中文大学工商管理学士及英国伯明翰大学工商管理（国际银行与金融）硕士学位。现为溢达中国控股有限公司董事长兼溢达集团董事总经理（集团人力资源）。1996 年 10 月参加工作，拥有丰富的战略管理、企业运营及人力资源管理经验。曾任美国评值公司亚太区总裁助理、中国区总经理，全校网（北京）信息科技有限公司营运总监，慧科管理咨询有限公司副总裁，2002 年加入溢达集团，历任分支机构总经理、集团首席人力资源官及集团全球销售董事总经理职务。
贺俊	1976 年出生，中国社会科学院研究生院产业经济学博士，入选国家百千万人才工程、国家有突出贡献中青年专家，享受国务院政府特殊

	津贴。2002年参加工作，曾任中信建投证券有限责任公司证券研究所投资策略分析师。现任中国社会科学院工业经济研究所研究员、教授、博士生导师，中国社会科学院中小企业研究中心主任，国家频谱资源委员会委员。
鲁智礼	1966年出生，经济学硕士，高级经济师。曾任河南证券公司证券发行部经理、总经理助理兼研究所所长。2002年11月至2013年3月任本公司副总裁，2013年3月至2015年9月任本公司常务副总裁，2015年9月至今任本公司监事会主席。目前，兼任河南省法学会金融法学研究会第二届理事会副会长。
魏志浩	1980年出生，工学硕士，高级审计师。曾任河南省审计厅信息中心副科长、科长，河南省审计厅计算机审计中心副主任。2019年9月至2020年11月任河南投资集团有限公司审计部副主任，2020年11月至今任河南投资集团有限公司审计部主任。2021年11月9日至今任本公司监事。
张宪胜	1965年出生，河南省委党校在职研究生学历，正高级会计师、注册会计师。曾任安钢焦化厂财务科科长，安阳钢铁集团有限责任公司有限公司财务处科员、副科长、科长、处长助理、副处长，安钢股份公司董事会秘书、财务负责人、财务处长。2015年7月至2016年12月任安阳钢铁集团有限责任公司有限公司审计部部长，2016年12月至2017年11月任审计与法律事务部部长，2017年11月至今任安阳钢铁集团有限责任公司财务部部长，2021年7月至今任安阳钢铁股份有限公司总会计师。2018年5月17日至今任本公司监事。
张博	1977年出生，哲学硕士，正高级会计师。曾任安阳方正会计事务所项目经理、注册资产评估师，安阳市委办公室国家安全综合协调科科长。2020年7月至今担任安阳经济开发集团有限公司党委委员、副总经理。2021年11月9日至今任本公司监事。
项思英	1963年出生，经济学硕士、工商管理硕士。曾任中国农业部外经工作办公室及农村经营管理总站干部，国际金融公司中国代表处担任投资分析员，国际金融公司东亚及太平洋局及全球制造业和消费服务局华盛顿特区担任投资官员，中国国际金融有限公司担任直接投资部及投资银行部执行总经理，鼎晖投资执行董事、投资顾问。自2008年5月至今担任中海重工集团有限公司（其股份于香港联交所上市，股票代码：00651）独立董事，自2017年9月至今担任汇力资源（集团）有限公司（其股份于香港联交所上市，股票代码：01303）独立董事。2015年9月10日至今任本公司独立监事。
夏晓宁	1960年出生，工学学士。曾任亚洲开发银行投资员，殷库资本有限公司资深合伙人及董事总经理，中银国际基建基金管理有限公司行政总裁，睿智金融集团有限公司高级顾问。2016年12月至今担任中国医疗网络有限公司（其股份于香港联交所上市，股份代码：00383）独立非执行董事。2016年5月9日至今任本公司独立监事。
巴冠华	1974年出生，货币银行学硕士。曾在交通银行郑州分行、河南证券、中原证券筹备组工作。2002年11月至2010年8月，先后在本公司董秘处、经纪业务总部、营销管理总部工作；2010年9月至2016年12月，任本公司财富管理中心总经理助理、副总经理、资本市场总部副总经理、做市业务总部副总经理（主持工作）；2017年1月至2020年2月，任新疆维吾尔自治区哈密市国有资产投资经营有限公司新疆哈密市国投公司党委委员、副总经理（援疆）；2020年3月至2021年3月，任本公司巡察工作办公室副主任，兼第一巡察组组长，兼风险防范化解办公室风险化解办常务副主任；2021年4月至今，任本公司巡察工作办公室主任。2021年11月9日至今任本公司职工代表监事。
许昌玉	1979年出生，法律硕士，具有法律职业资格。曾于九江学院任教。2007年7月至2016年3月任本公司合规管理总部二级部负责人；2016年3月至2017年3月任本公司办公室主任助理、研究室主任助理；2017年3月至2020年1月任本公司董事会办公室主任助理、副主任、证券事务代表；2020年1月任本公司合规管理总部总经理。2021年11月9日至今任本公司职工代表监事。

肖怡忱	1984年出生，会计学硕士，保荐代表人。2010年3月至2014年1月在本公司投资银行总部、资本市场总部工作；2014年12月至2017年12月任投资银行综合管理部质控一部负责人；2018年1月至2018年4月任投资银行综合管理部总经理助理；2018年5月至2021年12月任质量控制总部总经理助理；2022年1月至今任普惠金融部负责人。2018年1月12日至今任本公司职工代表监事。
朱建民	1963年出生，工商管理硕士，高级经济师。曾任河南证券发行部副经理、伏牛路营业部经理、北京办事处主任、经纪管理部经理、商丘营业部经理，本公司总裁办公室主任、经纪业务总部总经理、总裁助理等，2007年8月至2015年9月任本公司副总裁。2015年9月任本公司常务副总裁，2018年9月任本公司党委副书记，2022年1月任本公司执行委员会副主任委员。现任本公司党委副书记、常务副总裁（代为行使总裁职责）、执行委员会副主任委员。目前兼任中国证券业协会证券经纪与财富管理委员会委员、河南省证券期货基金业协会副会长。
朱军红	1969年出生，工商管理硕士、正高级会计师、河南省学术技术带头人。曾任河南财政证券公司会计主管、计划财务部副经理、经理、总会计师。2002年11月至2009年9月任本公司财务负责人、总裁助理兼计划财务总部总经理，2009年9月至2012年8月任本公司总会计师、财务负责人兼计划财务总部总经理，2012年8月至2018年1月任本公司总会计师、财务负责人。2012年8月至今任本公司副总裁，2022年1月至今任本公司执行委员会委员。
徐海军	1970年出生，计算机技术工程硕士，高级程序员。曾任河南证券上海业务部电脑部经理、花园路营业部副经理、紫荆山营业部经理、总经理助理兼深圳营业部经理及上海汇尔顿投资公司总经理助理。2004年1月至2018年1月历任公司信息技术总部总经理、合规管理总部总经理、合规总监及董事会秘书等职务。2016年9月至今任本公司副总裁，2022年1月至今任本公司执行委员会委员。目前兼任河南省法学会商法学研究会副会长、河南资产管理有限公司董事、中州国际金融控股有限公司董事长。
李昭欣	1969年出生，会计学专业，硕士学位，正高级会计师、注册会计师、注册税务师、经济师。自1991年7月至2004年10月在河南省劳改局、河南省监狱管理局从事财务工作，2004年10月至2017年11月在河南省国资委工作，历任产权管理处副处长、规划发展处调研员、综合处（研究室）处长。2017年11月至今任本公司党委委员，2018年1月至今任本公司总会计师、财务负责人，2022年1月至今任本公司执行委员会委员。目前兼任中国证券业协会财务会计专业委员会委员。
花金钟	1972年出生，管理学硕士，高级会计师、注册会计师、注册资产评估师、注册税务师。自1993年11月至2001年4月在河南莱恩（集团）股份有限公司工作，2001年4月至2004年10月在中国长城资产管理公司郑州办事处工作，2004年10月至2018年3月在中国证监会河南监管局工作，历任上市公司监管处主任科员、副处长，办公室副主任，新业务监管处副处长，公司检查处处长，办公室（党务工作办公室）主任。2018年4月至2021年11月任公司合规总监。2019年2月至今任公司副总裁，2022年1月至今任本公司执行委员会委员。目前兼任中国证券业协会投资银行委员会委员。
朱启本	1964年出生，经济学硕士。曾任河南证券投资银行部项目经理和办公室主任助理。2002年11月至2015年12月历任本公司人力资源管理总部副总经理、总经理、总裁助理兼人力资源管理总部总经理、督查室主任及稽核负责人。2015年12月至2018年1月任公司首席风险官。2018年1月至今任本公司董事会秘书，2022年1月至今任本公司执行委员会委员。目前兼任中原股权交易中心股份有限公司董事、中国证券业协会发展战略委员会委员。
刘灏	1972年出生，工商管理硕士，注册会计师。自1993年7月至1998年1月任深圳中华会计事务所审计二部高级经理职务；1998年1月至2006年10月任光大证券投行总部高级经理等职务；2006年10月至2011年08月任联合证券债券业务部总经理职务；2011年08月

	至 2018 年 05 月任民生证券投行事业部副总裁、固定收益事业部总裁、公司副总裁等职务。2018 年 6 月加入本公司，2020 年 5 月至今任公司首席投资官，2022 年 1 月至今任本公司执行委员会委员。
李峰	1971 年出生，工学硕士，工商管理硕士。1996 年 7 月参加工作，曾在河南证券公司工作，先后任职三门峡营业部副总经理、总经理。2002 年至 2015 年先后任本公司三门峡营业部总经理、新乡营业部总经理、上海营业部总经理、经纪业务总部总经理、创新业务总部总经理、总裁助理等职务，2015 年至 2017 年任中原股权交易中心总裁，2017 年至 2019 年任本公司总裁助理。2019 年至今任本公司首席风险官，2022 年 1 月至今任本公司执行委员会委员。
王晓刚	1971 年出生，工商管理硕士。1993 年 8 月参加工作，曾在河南包装新技术中心期货部、河南证券纬五路营业部工作，2002 年至 2015 年先后任本公司纬五路营业部副总经理、北京酒仙桥营业部总经理、经纪业务总部副总经理、营销管理总部总经理、财富管理中心总经理等职务，2015 年至 2019 年任本公司上海分公司总经理、证券投资总部总经理、资产管理总部总经理、总裁助理等职务，2019 年 2 月至 2019 年 12 月任本公司副总裁级干部兼资产管理总部总经理，2019 年 12 月至 2021 年 3 月任中州国际金融控股有限公司总经理，2021 年 3 月至 2022 年 1 月任本公司高级董事总经理。2022 年 1 月至今任本公司执行委员会委员。
史红星	1974 年出生，工商管理硕士。1997 年 7 月参加工作，曾先后任职于河南省油脂公司、河南省期货业协会，2004 年 10 月至 2016 年 8 月在中国证监会河南监管局工作，历任期货监管处四级行政助理、副主任科员、主任科员，机构监管处副处长。2016 年 8 月至 2020 年 1 月任中原股权交易中心副总裁、总裁，2020 年 1 月至 2021 年 11 月任公司郑州分公司总经理。2021 年 11 月至今任本公司合规总监，2022 年 1 月至今任本公司执行委员会委员。目前兼任中州国际金融控股有限公司董事、中国证券业协会自律处分和内审委员会委员。
韩军阳	1970 年出生，工程硕士。1993 年 7 月参加工作，曾在河南证券工作，先后任深圳营业部电脑部经理、行政区营业部副经理、电脑中心部门主任。2002 年至 2019 年先后任本公司信息技术总部副总经理、杭州营业部总经理、信息技术总部总经理、经纪业务总部总经理、互联网金融总部总经理等职务，2015 年至 2019 年兼任公司职工代表监事。2019 年至今任本公司首席信息官。目前兼任中国证券业协会投资者服务与保护委员会委员。

其它情况说明

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**1. 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
李兴佳	河南投资集团	董事、副总经理	2010年6月	
田圣春	安钢集团	副部长	2016年12月	
张秋云	河南投资集团	金融管理部主任	2019年6月	
唐进	江苏苏豪	副总裁、党委委员	2017年12月	
魏志浩	河南投资集团	审计部主任	2020年11月	
张宪胜	安钢集团	财务部部长	2017年11月	
谢俊生	安阳经开	监事长	2020年9月	
张博	安阳经开	副总经理、党委委员	2020年7月	
在股东单位任职情况的说明	无			

2. 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
菅明军	河南省证券期货基金业协会	会长	2013年6月	
	中州国际	董事	2015年1月	
李兴佳	河南省天然气储运有限公司	董事长	2018年8月	
张秋云	河南投资集团担保有限公司	执行董事	2019年6月	
	中富支付服务有限公司	执行董事	2019年6月	
	中原豫泽融资租赁(上海)有限公司	董事长	2019年7月	
	中原信托	董事	2020年9月	
	中原银行股份有限公司	董事	2021年1月	
	河南立安卓越保险经纪有限责任公司	执行董事	2020年8月	
	中原资本国际控股有限公司	董事	2019年6月	
	河南投资集团有限公司资产管理公司	董事长	2020年12月	
	河南资产管理有限公司	董事	2019年10月	
	河南汇融供应链管理有限公司	董事长	2020年9月	
唐进	江苏省国际信托有限公司	董事	2018年6月	
	江苏沿海创新资本管	董事	2018年6月	

	理有限公司			
	江苏爱涛文化产业有限公司	党总支书记	2019年11月	
田圣春	安钢自动化软件股份有限公司	董事	2018年9月	
陆正心	珠海融泽通远投资管理合伙企业	董事总经理	2014年1月	
张笑齐	北京懋源资本投资管理有限公司	副总经理	2014年3月	
陈志勇	中南财经政法大学	教授、博士生导师	1987年9月	
	中国高等教育学会高等财经教育分会	财政学专业委员会主任委员	2016年5月	
	全国高校财政学教学研究会	副会长	2014年8月	
	全国税务专业学位研究生教学指导委员会	委员	2016年9月	
	湖北省财政学会	常务理事	2003年6月	
	湖北省预算与会计研究会	副会长	2012年5月	
	湖北省税务学会	副会长	2016年4月	
曾崧	溢达集团	董事总经理	2002年10月	
	溢达中国控股有限公司	董事长	2021年12月	
贺俊	中国社会科学院工业经济研究所	研究员	2008年9月	
魏志浩	新乡中益发电有限公司	监事	2019年11月	
张宪胜	安阳钢铁股份有限公司	总会计师	2021年7月	
项思英	中海重工集团有限公司(其股份于香港联交所上市, 股份代码: 00651)	独立董事	2008年5月	
	汇力资源(集团)有限公司(其股份于香港联交所上市, 股份代码: 01303)	独立董事	2017年9月	
夏晓宁	中国医疗网络有限公司(其股份于香港联交所上市, 股份代码: 00383)	独立董事	2016年12月	
朱建民	中国证券业协会证券经纪与财富管理委员会	委员	2022年1月	
	河南省证券期货基金业协会	副会长	2019年11月	
徐海军	河南省法学会商法学	副会长	2017年7月	

	研究会			
	河南资产管理有限公司	董事	2020 年 8 月	
	中州国际金融控股有限公司	董事、董事长	2019 年 9 月	
李昭欣	中国证券业协会财务会计委员会	委员	2022 年 1 月	
花金钟	中国证券业协会投资银行委员会	委员	2022 年 1 月	
朱启本	中原股权交易中心股份有限公司	董事	2018 年 6 月	
	中国证券业协会发展战略委员会	委员	2022 年 1 月	
史红星	中州国际金融控股有限公司	董事	2021 年 11 月	
	中国证券业协会自律处分和内审委员会	委员	2022 年 1 月	
韩军阳	中国证券业协会投资者服务与保护委员会	委员	2022 年 1 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	公司董事的薪酬与考核由董事会薪酬与提名委员会提出方案，董事会审议通过，股东大会审议决定；监事的薪酬与考核由监事会提出方案，由股东大会审议决定；高级管理人员的薪酬与考核由董事会薪酬与提名委员会提出方案，由董事会决定。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	公司内部董事、监事薪酬根据公司股东大会关于董监事薪酬决议，并结合公司经营业绩、岗位职责、工作表现及市场环境等因素确定。 外部董事、监事薪酬由董事会薪酬与提名委员会根据行业市场水平制定方案，并经股东大会通过实施。 公司高级管理人员薪酬及奖惩事项根据董事会决议并结合公司考核激励约束机制方案确定，高级管理人员薪酬发放严格按照国家关于薪酬延期支付相关规定执行。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	董事、监事和高级管理人员薪酬支付情况请参见本报告本节一、“（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”。 根据国家有关规定，结合个人意愿，董事李兴佳先生、董事张秋云女士、董事唐进先生、董事田圣春先生、监事魏志浩先生、张宪胜先生及张博先生自任职起放弃领取其津贴，但仍将履行相关职责。
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	人民币 1,788.27 万元(税后)

(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
菅明军	执行委员会主任委员	聘任	
常军胜	副董事长、执行董事、 总裁	离任	个人原因
张秋云	非执行董事	选举	
	监事	离任	换届选举离任
袁志伟	独立董事	离任	独立董事任期届满
宁金成	独立董事	离任	独立董事任期届满
王立新	非执行董事	离任	个人原因
于绪刚	独立董事	离任	独立董事任期届满
唐进	非执行董事	选举	
陈志勇	独立董事	选举	
曾崧	独立董事	选举	
贺俊	独立董事	选举	
魏志浩	监事	选举	
谢俊生	监事	离任	换届选举离任
张博	监事	选举	
张露	职工监事	离任	换届选举离任
张华敏	职工监事	离任	换届选举离任
巴冠华	职工监事	选举	
许昌玉	职工监事	选举	
朱建民	执行委员会副主任委员	聘任	
朱军红	执行委员会委员	聘任	
徐海军	执行委员会委员	聘任	
李昭欣	执行委员会委员	聘任	
花金钟	执行委员会委员	聘任	
	合规总监	离任	换届选举离任
朱启本	执行委员会委员	聘任	
刘灏	执行委员会委员	聘任	
李峰	执行委员会委员	聘任	
王晓刚	执行委员会委员	聘任	
史红星	合规总监、执行委员会 委员	聘任	

(五)近三年受证券监管机构处罚的情况说明

√适用 □不适用

2020年8月28日，公司收到河南证监局《关于对朱建民实施出具警示函行政监管措施的决定》（河南证监局行政监管措施决定书（2020）13号），《关于对王晓刚实施出具警示函行政监管措施的决定》（河南证监局行政监管措施决定书（2020）14号），具体内容请参阅2020年8月31日披露的相关公告（公告编号：2020-063）。

(六)其他

□适用 √不适用

五、报告期内召开的董事会有关情况

会议届次	召开日期	会议决议
第六届董事会第二十六次会议	2021年1月29日	审议通过了以下议案： 一、《关于计提资产减值准备的议案》 二、《关于经纪业务分支机构设置授权的议案》
第六届董事会第二十七次会议	2021年3月25日	审议通过了以下议案： 一、《关于确定2021年度风险偏好和风险容忍度的议案》 二、《关于确定2021年度证券自营业务规模及风险限额的议案》 三、《关于确定2021年度资产管理业务自有资金投入规模及风险限额的议案》 四、《关于确定2021年度融资融券、股票质押、约定购回及转融通业务规模的议案》 五、《关于确定2021年对外捐赠预算以及制定〈中原证券股份有限公司对外捐赠管理办法〉的议案》 六、《关于2021年预计日常关联/持续关连交易的议案》
第六届董事会第二十八次会议	2021年3月30日	审议通过了以下议案： 一、《2020年度董事会工作报告》 二、《2020年度总裁工作报告》 三、《2020年度独立董事述职报告》 四、《2020年年度报告（A股）》 五、《2020年年度报告（H股）及截至2020年12月31日止年度之业绩公告》 六、《董事会审计委员会2020年度工作报告》 七、《董事会风险控制委员会2020年度工作报告》 八、《董事会发展战略委员会2020年度工作报告》 九、《董事会薪酬与提名委员会2020年度工作报告》 十、《2020年度社会责任报告暨ESG（环境、社会及管治）报告》 十一、《2020年度合规工作报告》 十二、《2020年风险管理年度报告》 十三、《2020年度内部控制评价报告》 十四、《2020年度信息技术工作专项报告》 十五、《2020年度稽核报告书》 十六、《2020年度利润分配方案》 十七、《2020年度财务决算报告》 十八、《2020年度董事考核及薪酬情况专项说明》 十九、《关于为中州国际金融控股有限公司提供担保或反担保的议案》 二十、《2020年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》 二十一、《关于授权召开2020年年度股东大会的议案》
第六届董事会第二十九次会议	2021年4月20日	审议通过了以下议案： 一、《2021年第一季度报告》 二、《关于调整公司组织架构的议案》 三、《关于修订〈中原证券股份有限公司财务管理制度〉的议案》 四、《关于修订〈中原证券股份有限公司会计制度〉的议案》

		五、《关于计提资产减值准备的议案》
第六届董事会第三十次会议	2021 年 5 月 28 日	审议通过了以下议案： 一、《关于聘任 2021 年度审计机构的议案》 二、《关于提名公司第六届董事会独立董事候选人的议案》 三、《关于调整公司第六届董事会专门委员会成员的议案》 四、《关于制定〈中原证券股份有限公司内幕信息知情人登记管理制度〉的议案》
第六届董事会第三十一次会议	2021 年 6 月 9 日	审议通过了《关于常务副总裁代为履行总裁职责的议案》
第六届董事会第三十二次会议	2021 年 6 月 25 日	审议通过了《中原证券股份有限公司关于对外捐赠的议案》
第六届董事会第三十三次会议	2021 年 8 月 10 日	审议通过了以下议案： 一、《关于对外专项捐赠的议案》 二、《关于规范公司大集合产品合同变更及运作管理相关事项的议案》 三、《关于修改〈公司章程〉的议案》
第六届董事会第三十四次会议	2021 年 8 月 27 日	审议通过了以下议案： 一、《关于审议 2021 年半年度报告、截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月之中期业绩公告及 2021 年中期报告的议案》 二、《2021 年上半年利润分配方案》 三、《关于计提资产减值准备的议案》 四、《关于修订〈合规管理有效性评估实施办法(2021 年修订)〉的议案》 五、《关于授权召开 2021 年第一次临时股东大会的议案》
第六届董事会第三十五次会议	2021 年 10 月 15 日	审议通过了以下议案： 一、《关于推选第七届董事会董事候选人的议案》 二、《关于为境外全资附属公司发行美元债券提供连带责任担保的议案》 三、《关于第二次转让中州蓝海持有中原小贷部分股权的议案》
第六届董事会第三十六次会议	2021 年 10 月 29 日	审议通过了《2021 年第三季度报告》
第七届董事会第一次会议	2021 年 11 月 9 日	审议通过了以下议案： 一、《关于选举菅明军为公司董事长的议案》 二、《关于选举公司董事会审计委员会成员的议案》 三、《关于选举公司董事会发展战略委员会成员的议案》 四、《关于选举公司董事会薪酬与提名委员会成员的议案》 五、《关于选举公司董事会风险控制委员会成员的议案》 六、《关于聘任高级管理人员的议案》 七、《关于聘任证券事务代表的议案》
第七届董事会第二次会议	2021 年 11 月 29 日	审议通过了《关于公司董事买卖本公司证券通知程序的议案》
第七届董事会第三次会议	2021 年 12 月 24 日	审议通过了以下议案： 一、《关于公司设立执行委员会并制定〈中原证券股份有限公司执行委员会议事规则〉的议案》 二、《关于修改〈公司章程〉的议案》 三、《关于对外捐赠的议案》
第七届董事会第四次会议	2021 年 12 月 30 日	审议通过了以下议案： 一、《关于签署持续关连交易框架协议及设定年度交易上限的议案》

		二、《关于修订〈合规考核管理办法〉的议案》 三、《关于修订〈洗钱和恐怖融资风险管理办法〉的议案》 四、《关于制订〈风险偏好管理办法〉的议案》
--	--	--

六、董事履行职责情况

(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
		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	出席股东大会的次数
菅明军	否	15	15	13	0	0	否	2
常军胜	否	5	5	4	0	0	否	0
李兴佳	否	15	15	13	0	0	否	2
张秋云	否	4	4	4	0	0	否	0
王立新	否	14	14	12	0	0	否	1
田圣春	否	15	15	13	0	0	否	1
张笑齐	否	15	15	13	0	0	否	2
陆正心	否	15	15	13	0	0	否	2
袁志伟	是	7	7	6	0	0	否	0
宁金成	是	7	7	6	0	0	否	0
于绪刚	是	15	15	13	0	0	否	2
张东明	是	15	15	13	0	0	否	2
陈志勇	是	8	8	7	0	0	否	1
曾崧	是	8	8	7	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	15
其中：现场会议次数	0
通讯方式召开会议次数	12
现场结合通讯方式召开会议次数	3

(二) 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

七、董事会下设专门委员会情况

适用 不适用

(1). 董事会下设专门委员会成员情况

专门委员会类别	成员姓名
发展战略委员会	菅明军、李兴佳、张秋云、田圣春、唐进、王立新（离任）
审计委员会	张东明、曾崧、田圣春

薪酬与提名委员会	陈志勇、张笑齐、陆正心、曾崧、贺俊、于绪刚（离任）
风险控制委员会	菅明军、张笑齐、陈志勇

注：公司于 2022 年 1 月 18 日召开公司第七届董事会第五次会议，审议通过了《关于推选第七届董事会董事的议案》《关于推选第七届董事会独立董事的议案》《关于调整公司第七届董事会专门委员会成员的议案》，并于 2022 年 2 月 17 日召开了 2022 年第一次临时股东大会，选举唐进为公司第七届董事会董事、选举贺俊为第七届董事会独立董事，任期至第七届董事会届满。

(2). 报告期内发展战略委员会召开 3 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议	其他履行职责情况
2021 年 1 月 28 日	发展战略委员会 2021 年第一次会议	会议审议通过了： 《关于经纪业务分支机构设置授权的议案》	发展战略委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 3 月 29 日	发展战略委员会 2021 年第二次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《2020 年度董事会工作报告》 二、《2020 年度总裁工作报告》 三、《董事会发展战略委员会 2020 年度工作报告》 四、《2020 年度社会责任报告暨 ESG（环境、社会及管治）报告》 五、《2020 年度信息技术工作专项报告》 六、《关于为中州国际金融控股有限公司提供担保或反担保的议案》	发展战略委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 12 月 23 日	发展战略委员会 2021 年第三次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《关于公司设立执行委员会并制定〈中原证券股份有限公司执行委员会会议事规则〉的议案》 二、《关于修改〈公司章程〉的议案》	发展战略委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。

(3). 报告期内审计委员会召开 9 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议	其他履行职责情况
2021 年 1 月 28 日	审计委员会 2021 年第一次会议	会议审议通过了： 《关于计提资产减值准备的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。

2021 年 3 月 24 日	审计委员会 2021 年第二次会议	会议审议通过了： 《关于 2021 年预计日常关联持续关连交易的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 3 月 29 日	审计委员会 2021 年第三次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《2020 年年度报告（A 股）》 二、《2020 年年度报告（H 股）及截至 2020 年 12 月 31 日止年度之业绩公告》 三、《董事会审计委员会 2020 年度工作报告》 四、《2020 年度合规报告》 五、《2020 年度内部控制评价报告》 六、《2020 年度稽核报告书》 七、《2020 年度利润分配方案》 八、《2020 年度财务决算报告》 九、《关于为中州国际金融控股有限公司提供担保或反担保的议案》 十、《2020 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 4 月 19 日	审计委员会 2021 年第四次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《2021 年第一季度报告》 二、《关于修订〈中原证券股份有限公司财务管理制度（2021 年修订）〉的议案》 三、《关于修订〈中原证券股份有限公司会计制度（2021 年修订）〉的议案》 四、《关于计提资产减值准备的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 5 月 28 日	审计委员会 2021 年第五次会议	会议审议通过了： 《关于聘任 2021 年度审计机构的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 8 月 27 日	审计委员会 2021 年第六次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《关于审议 2021 年半年度报告、截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月之中期业绩公告及 2021 年中期报告的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。

		二、《2021 年上半年利润分配方案》 三、《关于计提资产减值准备的议案》	
2021 年 10 月 14 日	审计委员会 2021 年第七次会议	会议审议通过了： 《关于为境外全资附属公司 发行美元债券提供连带责任 担保的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 10 月 28 日	审计委员会 2021 年第八次会议	会议审议通过了： 《2021 年第三季度报告》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 12 月 29 日	审计委员会 2021 年第九次会议	会议审议通过了： 《关于签署持续关连交易框 架协议及设定年度交易上限 的议案》	审计委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。

(4). 报告期内薪酬与提名委员会召开 3 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议	其他履行职责情况
2021 年 3 月 29 日	薪酬与提名委员会 2021 年第一次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《董事会薪酬与提名委员会 2020 年度工作报告》 二、《2020 年度董事考核及薪酬情况专项说明》	薪酬与提名委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 5 月 26 日	薪酬与提名委员会 2021 年第二次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《关于提名公司第六届董事会独立董事候选人的议案》 二、《关于调整公司第六届董事会专门委员会成员的议案》	薪酬与提名委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021 年 10 月 14 日	薪酬与提名委员会 2021 年第三次会议	会议审议通过了： 《关于推选第七届董事会董事候选人的议案》	薪酬与提名委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。

(5). 报告期内风险控制委员会召开 2 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议	其他履行职责情况
2021 年 3 月 24 日	风险控制委员会 2021 年第一次会议	会议审议通过了： 《关于确定 2021 年度风险偏好和风险容忍度的议案》	风险控制委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规

			则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。
2021年3月29日	风险控制委员会2021年第二次会议	会议审议通过了以下议案： 一、《董事会风险控制委员会2020年度工作报告》 二、《2020年度合规工作报告》 三、《2020年风险管理年度报告》 四、《2020年度内部控制评价报告》	风险控制委员会严格按照《公司法》、中国证监会监管规则以及《公司章程》《董事会议事规则》开展工作，勤勉尽责，经过充分沟通讨论，一致通过上述议案。

(6). 存在异议事项的具体情况

□适用 √不适用

八、监事履行职责情况

(一) 监事参加监事会和股东大会的情况

监事姓名	是否独立监事	参加监事会情况						参加股东大会情况
		本年应参加监事会次数	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	出席股东大会的次数
鲁智礼	否	10	10	7	0	0	否	2
张秋云	否	7	7	5	0	0	否	2
魏志浩	否	3	3	2	0	0	否	1
张宪胜	否	10	10	7	0	0	否	2
谢俊生	否	7	7	5	0	0	否	1
张博	否	3	3	2	0	0	否	1
项思英	是	10	10	7	0	0	否	2
夏晓宁	是	10	10	7	0	0	否	2
张露	否	7	7	5	0	0	否	1
张华敏	否	7	7	7	0	0	否	1
巴冠华	否	3	3	2	0	0	否	1
许昌玉	否	3	3	2	0	0	否	1
肖怡忱	否	10	10	7	0	0	否	2
年召开监事会会议次数						10		
其中：现场会议次数						0		
通讯方式召开会议次数						7		
现场结合通讯方式召开会议次数						3		

(二) 监事会会议情况

会议届次	召开日期	会议决议
第六届监事会第十七次会议	2021年1月29日	审议通过了《关于计提资产减值准备的议案》
第六届监事会第十八次会议	2021年3月25日	审议通过了《关于2021年预计日常关联/持续关联交易的议案》
第六届监事会第十	2021年3月30日	审议通过了以下议案：

九次会议		<p>一、《2020 年度监事会工作报告》</p> <p>二、《监事会财务监督检查委员会 2020 年度工作报告》</p> <p>三、《监事会履职监督评价委员会 2020 年度工作报告》</p> <p>四、《2020 年度利润分配方案》</p> <p>五、《2020 年度财务决算报告》</p> <p>六、《2020 年年度报告（A 股）》</p> <p>七、《2020 年年度报告（H 股）及截至 2020 年 12 月 31 日止年度之业绩公告》</p> <p>八、《2020 年度社会责任报告暨 ESG（环境、社会及管治）报告》</p> <p>九、《2020 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》</p> <p>十、《2020 年度合规工作报告》</p> <p>十一、《2020 年度内部控制评价报告》</p> <p>十二、《关于修订〈中原证券股份有限公司监事会对董事、监事、高管人员履职评价办法〉的议案》</p> <p>十三、《2020 年度监事考核及薪酬情况专项说明》</p> <p>十四、《关于变更监事会履职监督评价委员会成员的议案》</p> <p>会议还听取了《2020 年度稽核报告书》和《2020 年风险管理年度报告》</p>
第六届监事会第二十次会议	2021 年 4 月 20 日	<p>审议通过了以下议案：</p> <p>一、《2021 年第一季度报告》</p> <p>二、《关于计提资产减值准备的议案》</p>
第六届监事会第二十一次会议	2021 年 8 月 27 日	<p>审议通过了以下议案：</p> <p>一、《关于审议 2021 年半年度报告、截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月之中期业绩公告及 2021 年中期报告的议案》</p> <p>二、《2021 年上半年利润分配方案》</p> <p>三、《关于计提资产减值准备的议案》</p>
第六届监事会第二十二次会议	2021 年 10 月 15 日	审议通过了《关于推选第七届监事会监事候选人的议案》
第六届监事会第二十三次会议	2021 年 10 月 29 日	审议通过了《2021 年第三季度报告》
第七届监事会第一次会议	2021 年 11 月 9 日	<p>审议通过了以下议案：</p> <p>一、《关于选举鲁智礼为公司监事会主席的议案》</p> <p>二、《关于选举公司监事会履职监督评价委员会成员的议案》</p> <p>三、《关于选举公司监事会财务监督检查委员会成员的议案》</p>
第七届监事会第二次会议	2021 年 11 月 22 日	审议通过了《关于公司监事买卖本公司证券通知程序的议案》
第七届监事会第三次会议	2021 年 12 月 30 日	<p>审议通过了以下议案：</p> <p>一、《关于签署持续关连交易框架协议及设定年度交易上限的议案》</p> <p>二、《关于制订〈监事会内部控制与风险管理监督办法〉的议案》</p>

九、监事会发现公司存在风险的说明

适用 不适用

监事会对报告期内的监督事项无异议。

十、报告期末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	2,386
主要子公司在职员工的数量	341
在职员工的数量合计	2,727
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
经纪业务人员	1,756
投行人员	270
资产管理业务人员	48
证券投资业务人员	56
研究人员	35
国际业务人员	46
法律合规、风控及稽核审计人员	78
信息技术人员	78
财务人员	59
行政及管理人员	232
其他	69
合计	2,727
教育程度	
教育程度类别	数量（人）
博士	12
硕士	605
本科	1,911
专科及以下	199
合计	2,727

(二) 薪酬政策

适用 不适用

公司员工薪酬由基本工资、津贴、绩效奖金和福利构成。基本工资是薪酬构成中相对固定的部分，是员工基本收入。津贴包括特殊岗位津贴、专业技术人才津贴等，是基本工资的补充。绩效奖金从年度利润中提取，根据绩效考核结果进行分配，向业绩突出的业务一线及员工倾斜。

公司按照国家相关规定为员工建立社会保险、住房公积金等法定福利，同时为提高员工的福利保障水平，公司还为员工提供企业年金计划。

公司积极探索建立员工股权激励计划，研究筹划员工股权激励设计方案，将在外部法律政策环境允许的情况下，适时启动员工股权激励。

(三) 培训计划

√适用 □不适用

为不断提升公司干部员工的专业能力和职业素养，公司建立了分层分类、统筹兼顾的培训计划。对经营管理人员重点开展以提高证券行业发展认知、管理理论与技能战略思维能力、经营管理能力等内容的培训；对各业务条线和部门的员工重点以强化业务知识、提高产品开发、营销技巧和服务能力等内容的培训。同时，鼓励员工通过自学、参加职业资格证书考试等方式进行自主学习，及时更新专业知识，特别是对取得 CIIA、CFA、FRM 等资格的员工给予奖励。

报告期内，公司利用面授或移动网络培训方式，开展了多层级的员工培训、多元化的业务培训、多类型的合规培训及多种创新型培训项目，以提升员工职业技能和素养，配合公司战略发展。总部先后组织内训 8 场，累计有 1,227 人次参加内训；参加上级单位及外部培训机构组织的培训，主要包括中国证监会、中国证券业协会、河南省委组织部、河南省财政厅、河南省国资委、证券交易所等举办的培训班共计 56 场，累计有 168 人次参训；组织后续职业网络培训，人均学习课程数 30 课时；总体使用培训经费人民币 198.7 万元。公司组织实施一系列针对性、前瞻性较强的员工职业及业务培训项目，为员工综合素质、业务能力提升搭建进修平台，进而实现公司和员工共赢的良好局面。2022 年度公司将结合公司业务需求，加大员工培训的力度和广度，注重培训工作的实用性，为公司持续发展提供源源不断的人力资源，培育更多的优秀员工。

(四) 劳务外包情况

√适用 □不适用

劳务外包的工时总数	45.70 万小时
劳务外包支付的报酬总额	466.43 万元

十一、 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

根据《公司章程》，公司可以采取现金或者股票方式分配股利。公司的利润分配应重视对投资者的合理投资回报，利润分配政策应保持连续性和稳定性。公司应充分考虑和听取股东（特别是中小股东）、独立董事的意见，坚持现金分红为主，如无重大投资计划、重大现金支出和相关法律、法规及规范性文件规定的不能分红的其他事项发生，每年以现金分红分配的利润不少于当年实现的可供分配利润的 20%。

公司董事会应当综合考虑所处行业特点、发展阶段、自身经营模式、盈利水平以及是否有重大资金支出安排等因素，区分不同情形，提出差异化的现金分红政策。现金分红在每次利润分配中所占比例最低应达到 20%，公司在现金分红的同时，也可以以股票股利的方式分配利润，但如公司当年未以现金分红，则不得单独以股票股利的方式分配利润。

公司董事会结合公司具体经营数据、盈利规模、现金流量状况、发展阶段及当期资金需求，并结合股东（特别是中小股东）、独立董事的意见，认真研究和论证公司现金分红的时机、条件

和最低比例、调整的条件及其决策程序要求等事宜，提出年度或中期利润分配方案。独立董事发表明确意见。

经大华会计师事务所（特殊普通合伙）审计，公司 2021 年度实现归属于母公司股东的净利润人民币 513,210,337.25 元，提取盈余公积及各项风险准备金后，2021 年实现的可供分配利润人民币 350,329,112.11 元。截至 2021 年 12 月 31 日，母公司可供分配利润人民币 426,335,070.44 元。

公司 2021 年下半年度拟以实施权益分派股权登记日登记的总股本为基数分配利润。公司拟向全体股东（包括 A 股股东及 H 股股东）每 10 股派发现金红利人民币 0.21 元（含税）。截至 2021 年 12 月 31 日，公司总股本 4,642,884,700 股，以此计算合计拟派发现金红利人民币 97,500,578.70 元（含税），加上已派发 2021 年上半年现金红利人民币 78,929,039.90 元（含税），当年累计派发现金红利人民币 176,429,618.60 元（含税），占 2021 年归属于母公司股东的净利润的 34.38%。在批准 2021 年下半年利润分配预案的董事会召开日后至实施权益分派的股权登记日前公司总股本发生变动的，维持分配总额不变，相应调整每股分配比例。公司不进行资本公积金转增股本，不送红股。

本次利润分配方案尚需提交公司 2021 年年度股东大会审议。

公司上述利润分配方案制订合规、透明，符合《公司章程》及审议程序的规定，有明确的分红标准和分红比例，相关决策程序和机制完备，独立董事履职尽责并发表了独立意见，充分保护了中小股东的合法利益。

（二）现金分红政策的专项说明

适用 不适用

是否符合公司章程的规定或股东大会决议的要求	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
分红标准和比例是否明确和清晰	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
相关的决策程序和机制是否完备	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
独立董事是否履职尽责并发挥了应有的作用	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
中小股东是否有充分表达意见和诉求的机会，其合法权益是否得到了充分保护	<input checked="" type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否

（三）报告期内盈利且母公司可供股东分配利润为正，但未提出现金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

十二、 公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

（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

其他激励措施

适用 不适用

(三) 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

(四) 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

公司坚持高管激励与约束并重原则，严格执行高级管理人员的考评机制，完善干部考核评价体系，丰富干部评价内容，保证干部队伍战斗力。通过业绩考核、民主测评、个别谈话等方式，全面考核干部德、能、勤、绩、廉。加大考核结果的运用力度，对考核优秀干部提拔重用，对不符合任职条件的干部，严格执行公司有关制度，真正实现能者上、庸者下的用人机制，树立正确的用人导向。

对公司高级管理人员的目标考核，完不成经营目标和主要工作任务的，将分别对其进行批评警告、诫勉谈话、按照目标完成情况核减奖金或由公司研究后向董事会和上级主管部门提出建议予以降级。高管人员年度目标任务完成情况考核结果作为激励确定的基础，根据经董事会审议通过的《中原证券股份有限公司奖金分配实施方案》，确定高管人员绩效奖励，并在实施过程中，严格执行行业关于高管薪酬递延发放的有关要求。

十三、 报告期内的内部控制制度建设及实施情况

适用 不适用

公司自设立以来一直注重内部规章制度和管理体制的建设，从公司治理层面开始，自上而下的对各项业务及管理工作强化制度控制。公司以相关法律法规为依据，结合公司实际情况，综合考虑公司内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等因素，制定了较为全面的公司内部控制制度体系，并根据行业监管、业务发展和加强风险管理的要求，不断补充、修订和完善内部控制制度体系，基本涵盖了公司经营管理的各个层级、各个方面和各项业务环节，并得到有效执行。公司把内部控制建设始终贯穿于公司的经营发展之中，不断完善制度建设，强化制度执行，落实监督检查，确保公司持续、健康、稳定的发展。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

十四、 报告期内对子公司的管理控制情况

适用 不适用

截至报告期末，公司共控股子公司 14 家，其中一级控股子公司 5 家，二级控股子公司 9 家。公司对子公司施行战略+运营管控模式，一是严格按照《公司法》《证券法》等有关法律法规和准则，通过参与制定子公司章程、子公司董事会、监事会和股东大会，向子公司推荐董监事及高级管理人员，完善公司治理、加强三会履职，依法行使享有的资产收益和参与重大决策等股东权利。二是根据中国证监会《证券公司监督管理条例》等相关规定，公司合规、风控和财务等各职能部门对子公司实行垂直和穿透式管理，更好地把控子公司经营风险，杜绝资金占用，防范经营风险传输。

十五、 内部控制审计报告的相关情况说明

√适用 □不适用

本公司聘请大华会计师事务所（特殊普通合伙）作为内部控制审计机构。大华会计师事务所（特殊普通合伙）出具了《中原证券股份有限公司内部控制审计报告》。

内部控制审计报告详见于公司与本报告同期在上交所网站披露的《中原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

十六、 上市公司治理专项行动自查问题整改情况

公司于 2020 年 12 月收到河南证监局下发的《上市公司治理专项自查清单》，对照清单，公司进行了全面自查，自查结果如下：

1、报告期内，公司于 2020 年 4 月 29 日召开的公司第六届董事会第十九次会议涉及董事弃权票，本次会议审议了《关于对香港子公司中州国际金融控股有限公司实施增资的议案》，表决结果为：同意 10 票，反对 0 票，弃权 1 票。股东董事王立新先生因时间较为紧张，未能深入了解香港子公司相关业务开展情况，无法表达意见，因此投弃权票。

整改情况：董事会将预留更充足的时间为公司董事深入了解议案的背景和内容，发表意见提供支持 and 帮助。

2、公司于 2020 年 6 月 2 日披露了《关于独立董事任职期满继续履职的公告》，袁志伟先生于 2020 年 6 月 3 日因任职期满六年离任。鉴于袁志伟先生离任将导致公司第六届董事会中独立董事人数少于董事会成员的三分之一，不符合相关规定的要求，在新任独立董事就任前，袁志伟先生将继续履职。

整改情况：公司 2020 年年度股东大会审议通过了《关于选举第六届董事会独立董事的议案》，袁志伟先生不再继续履职。

十七、 其他

√适用 □不适用

1、 报告期内公司营业部、分公司、子公司新设和处置情况以及对业绩的影响

报告期内，公司在境内共完成 2 家证券分公司及 6 家证券营业部同城迁址。以上变化将有助于优化本集团的网络布局、提升公司客户服务能力及子公司的综合实力。

(1) 分公司、营业部设立和变动情况

公司持续进行营业网点布局调整和优化。报告期内，公司在境内共完成 2 家证券分公司及 6 家证券营业部同城迁址工作。

详情参见“第十一节 证券公司信息披露 一、(一)报告期内分公司、营业部行政许可情况”。

(2) 子公司设立和变动情况

中州国际：

2020 年 4 月 29 日，公司第六届董事会第十九次会议审议通过了《关于对香港子公司中州国际金融控股有限公司实施增资的议案》，同意对中州国际增资 5 至 10 亿港元。公司于 2021 年 1 月收到中国证监会出具的《关于中原证券股份有限公司对中州国际金融控股有限公司增资有关意见的复函》（机构部函〔2021〕275 号）。根据上述复函，中国证监会对公司向中州国际增资 8 亿港元无异议。公司于 2021 年 3 月收到河南省改革和发展委员会《境外投资项目备案通知书》（豫发改外资备〔2021〕10 号），2021 年 6 月公司完成向中州国际划拨注册资本金 8 亿港元。2021 年 7 月中州国际在香港公司注册处完成注册登记手续，注册资本变更为 18 亿港元。

上述具体内容请参阅公司 2020 年 4 月 30 日、2021 年 1 月 27 日、2021 年 7 月 3 日披露的相关公告。（公告编号：2020-042、2021-006、2021-038）

中州蓝海：

2021 年 11 月 3 日，公司出具《中州蓝海投资管理有限公司股东决定》，同意中州蓝海注册资本变更为人民币 35.00 亿元。截至报告期末，中州蓝海已办理完毕工商变更登记手续。

2、 证券经纪人

证券经纪人是接受公司的委托，在公司授权范围内代理从事与经纪业务相关的客户招揽、客户服务等活动的公司员工以外的自然人，公司与证券经纪人签订委托代理合同。公司制定了完备的证券经纪人管理制度，包括证券经纪人的资格管理、委托合同管理、执业前培训和后续职业培训、登记管理与信息查询、执业行为规范、风险控制以及绩效考核与报酬支付等方面，实现了公司对证券经纪人的集中统一管理，证券营业部负责证券经纪人的日常管理。报告期内，公司在证券经纪人基本管理制度有效运行的情况下，持续加强对分支机构证券经纪人业务的管理，深入了解各分支机构证券经纪人团队发展现状，优化证券经纪人日常管理相关流程。截至 2021 年底，公司证券经纪人数量达 265 人。

3、 账户规范情况专项说明

公司始终坚持把客户账户规范管理作为重要的基础工作,把客户账户管理工作常规化、规范化、制度化,不断完善客户账户规范管理的长效机制。2021年,根据中国证券登记结算有限责任公司和公司相关制度要求,有效落实客户账户规范管理的各项措施,认真做好职业类别规范、手机号码核查、机构账户信息核查、一码通账户规范等工作,持续做好存量客户账户信息规范、客户资料完善、休眠账户激活及不合格账户规范等基础性工作,确保客户账户信息真实、准确、完整、有效。

报告期内,公司新增休眠资金账户 22,060 户,激活休眠证券账户 3,670 户,期末休眠资金账户 414,397 户,休眠证券账户 656,554 户;规范不合格资金账户 23 户,规范不合格证券账户 25 户,期末不合格资金账户 1,108 户,不合格证券账户 1,168 户;期末司法冻结资金账户 7 户,司法冻结证券账户 14 户;无风险处置账户。详见下表:

账户类型:人民币账户

账户类别		2021 年	2020 年	同比变动
休眠账户	资金账户	414,397	392,337	22,060
	证券账户	656,554	660,224	-3,670
不合格账户	资金账户	1,108	1,131	-23
	证券账户	1,168	1,193	-25
司法冻结账户	资金账户	7	7	0
	证券账户	14	14	0
风险处置账户	资金账户	0	0	0
	证券账户	0	0	0

4、 业务创新情况

随着《中华人民共和国国民经济和社会发展“十四五”规划和 2035 年远景目标纲要》发布,加快数字化发展,建设数字中国,打造数字经济新优势已成为我国下阶段重点发展战略内容。2021 年,按照财富管理数字化转型整体蓝图,公司致力于打造线上线下一体化标准化数字化服务运营体系,运用 AI 驱动和数据驱动,围绕赋能业务提质、增效、降本的总体目标,在财富管理数字化转型一些关键领域获得重大突破,完成了构建客户洞察 KYC,实现了全景客户画像,做到了一站式全通道智能触达,开展了按照客户全生命周期的核心业务场景化运营,自主策划设计开发了“618 理财地图”、“818 理财节”、“嗨翻双 11”等运营活动,填补了公司数字化业务应用的空白。公司推出的智能机器人服务,以 91.35%的成功回复率和“7*24 随时随地响应”的优势,极大提升了客户服务效率,为分支机构释放了更多有价值的人力资源。

截至报告期末,中原证券财升宝 APP 客户数较上年度提升 42.3%,中原证券财升宝 APP 已承载了公司 90%以上的客户服务,公司 93.4%的理财订单在中原证券财升宝 APP 实现;互联网渠道合作新增客户数量和质量双提升。

5、 公司风险管理体系建设情况

公司风险管理总体定位为稳健风险偏好策略，始终秉持资本、风险与收益相匹配的风险管理理念，以承担适度风险，实现业务规模、盈利能力与风险承受能力的最优平衡，为股东带来持续稳定的利润回报。公司持续优化完善全面风险管理体系建设，不断完善风险管理制度体系、健全风险管理组织架构、优化风险控制指标体系、加强风险管理信息技术系统建设、强化风险应对机制等，具体如下：

风险管理架构

公司建立四层架构的全面风险管理架构：第一层为公司董事会、监事会；第二层为公司董事会风险控制委员会、审计委员会和经理层；第三层为合规管理总部、法律事务总部、风险管理总部、稽核审计总部组成的风险控制系统；第四层为公司各业务与管理总部、各分支机构与子公司的一线风险控制系统。通过四层架构的分级授权，实现对风险管理的全面覆盖。

报告期内，公司持续完善风险管理组织架构，积极推动各层级组织架构的职责履行，优化各业务条线及子公司年度业务规模和风险限额的分级授权管理；完善各部门、各子公司重点风险管理流程，加强一线风险管理，不断增强全面风险管理的有效性。

风险管理制度体系

公司建立了四级风险管理制度体系，第一层级为基本的风险管理制度；第二层级为净资本风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险管理制度，及各类业务、产品和子公司的风险管理制度；第三层级为各业务、各产品风险管理监控细则及各类风险管理工具细则；第四层级为各业务、各子公司前端风险管理制度。

报告期内，公司持续完善风险管理制度体系：一是制定了公司风险偏好管理办法；二是修订了流动性风险、权益类证券投资业务风险、信息技术风险、财务风险、子公司投资业务管理等制度；三是修订了自营固定收益业务、股转做市业务、融资融券业务、股票质押式回购交易业务、资产管理业务现金管理产品等风险监控细则，完善了风险管理流程及风控指标体系；四是推进资产管理业务证券库管理、资产管理产品压力测试、私募代销业务合作机构管理、代销私募基金产品尽职调查及风险评估、子公司压力测试及公司转融券业务等前端风控制度修订完善。

风险管理信息系统

公司初步建立了覆盖各风险类型、各部门、分支机构及子公司的风险管理信息技术系统，对各类风险进行计量、汇总、预警和监控，并在不断升级现有系统的基础上，重点完善信用风险管理系统和子公司系统建设，积累真实、准确、完整的内部和外部数据，用于风险识别、计量、评估、监测和报告，以符合公司整体风险管理的需要。

报告期内，公司风险管理系统不断升级完善：一是完成子公司业务管理系统建设，实现对子公司主要业务数据的采集和系统监控；二是完成现有风控系统的升级改造，包括创业板、利率互换、委外业务等；三是推进内部评级系统落地实施，强化信用风险管理；四是完成同一业务同一客户系统建设实施方案，推进系统建设；五是组织中国人民银行征信二代系统升级工作。

6、公司合规管理体系建设情况

根据中国证监会《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等规定，公司建立了体系完备、分工明确的合规管理组织体系。董事会决定公司合规管理目标，对公司合规管理有效性承担责任；监事会按规定履行监督职责；高级管理人员负责落实合规管理目标，对合规运营承担责任；各单位负责人负责落实本单位的合规管理目标，对本单位合规运营承担责任。公司设置合规总监直接对董事会负责；设立合规管理总部对合规总监负责，并在合规总监领导下开展合规管理工作；公司在各相关单位配备专兼职合规管理员，合规管理员接受合规管理总部指导，组织实施本单位或所管辖条线合规管理工作。同时，公司合规与风控、稽核审计等内控部门协同配合，对公司各单位的合规运营起到了有效的控制作用。

2021 年公司深入推进各项合规管理工作。一是以制度建设为基础，加强合规审核把关，筑牢公司合规风险防线。全年组织制定修订公司《规章制度管理办法》《廉洁从业实施细则》《利益冲突管理办法》《合规管理有效性评估实施办法》《投资银行类业务合规管理办法》等 17 项合规管理制度，有效完善合规管理制度体系，同时督导公司各单位做好制度建设完善工作，将合规要求嵌入业务流程，贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节。持续加强对业务的审查和咨询支持力度，落实多层级审查机制，严把入口关、严控合规风险，组织对公司制度、重大决策、新产品新业务方案进行合规审查并发表合规审查意见。二是以合规风险管控为导向，加强监督检查力度，切实防范合规风险。公司结合经营管理实际，组织开展对重点业务、重点区域、重点维度的合规检查、监测工作，有效起到防范化解合规风险隐患、加强公司内控管理的作用；以日常监督检查等工作为基础，开展定期不定期报告工作，使经营管理层及时掌握公司整体合规情况。三是厚植公司合规文化建设，开展常态化持续宣导培训，进一步提高全员合规意识。全年组织编发各类宣导材料 200 余份，持续向各级管理人员和员工传达最新监管精神，促使全体员工自觉做法律规则的坚定信仰者和践行者。四是以合法合规运营为标准，加强合规考核，提升合规管理执行效力。将合规管理的有效性和执业行为的合规性纳入对公司高级管理人员、各单位及工作人员的年度考核范围，进一步完善年度合规考核指标体系；定期组织对各单位合规管理有效性的全面评估，针对评估问题及时督导整改落实，形成自我评估、自我完善的正向循环。

（1）合规部门完成的检查

2021 年，合规管理总部根据监管规定及自律规则，结合公司经营管理实际和业务开展中的主要风险领域，组织开展公司内部检查、自查 30 余次。包括：投行业务全面检查、投行股权类承销业务专项检查、廉洁从业专项检查、分支机构日常合规管理工作检查、工作人员股票账户开立情况核查、客户适当性检查、反洗钱义务履行情况检查、股票质押式回购交易业务全面检查、资产管理业务合规检查、信息技术合规管理情况检查、子公司合规管理情况检查等。通过合规检查、自查，公司有效识别并防范合规风险，排查合规隐患，促进各有关单位筑牢合规工作基础，规范业务发展。

（2）稽核部门工作开展情况

报告期内，公司内部审计工作坚持以问题和风险为导向，围绕党和国家加强内部审计工作的方针政策，优化工作模式，聚焦重点领域和关键环节，持续提升稽核审计质量。2021 年公司稽核审计总部组织对公司主要业务条线、总部部门、分支机构、控股子公司开展了常规稽核审计，对部分经营管理人员开展了离任经济责任审计，另外组织开展了公司年度内部控制评价、全面风险管理评估、投资银行类业务内部控制有效性评估等工作。

通过稽核审计的监督检查，客观的反映了被稽核审计单位存在的一些问题，通过强化整改落实，不断提升被稽核审计单位的风险防范意识和主动合规意识，促进公司内部控制体系各道防线能充分发挥作用。

(3) 风险控制指标监控和补足机制建设情况

根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》等一系列相关规定，公司建立了以净资本和流动性为核心的风险控制指标体系及动态监控与管理的工作模式，不断优化净资本和流动性动态监控系统功能，实现对净资本和流动性等风险控制指标的动态监控和自动预警，确保公司净资本和流动性等各项风险控制指标在任一时点都符合监管要求。根据中国证券业协会《证券公司压力测试指引》等制度要求，公司建立了完整的压力测试工作机制，定期、不定期开展压力测试工作，评估压力情景下公司风险承受能力，并采取必要应对措施，确保公司在压力情景下的风险可测、可控、可承受，实现可持续经营。

公司建立了动态的净资本补足机制，当净资本等各项风险控制指标接近或达到证监会规定的预警标准时，公司将采用控制业务规模、调整资产结构、发行次级债、募集资本金等方式补充净资本，保障公司净资本等各项风险控制指标持续符合监管要求。同时，持续提升资本管理能力，提高资本对各项业务发展的引导和约束作用，以充足的资本保障各业务持续健康发展，实现股东价值最大化目标。

报告期内，公司在对净资本等各项指标进行监控和测算的基础上，定期分析、评价净资本对公司各项业务发展的支撑作用，研究和测试净资本的合理有效配置，建立各项业务规模与净资本水平动态挂钩机制。并在前述风险管理活动基础上定期撰写《净资本风险管理月报》，对公司财务及净资本的风险状况进行综合分析评价，实现财务和净资本风险的有效控制。报告期内，净资本等各项风险控制指标均符合监管要求。

第五节 环境与社会责任

一、环境信息情况

(一) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其主要子公司的环保情况说明

适用 不适用

(二) 重点排污单位之外的公司环保情况说明

适用 不适用

1. 因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

2. 参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

3. 未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

经核查，本公司及子公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位。

本公司严格遵守《中华人民共和国环境保护法》、《中华人民共和国水污染防治法》、《中华人民共和国大气污染防治法》、《中华人民共和国固体废物污染防治法》等环保方面的法律法规，报告期内未出现因违反环保相关法规而受到处罚的情况。公司对环境的影响主要是日常办公的能源资源消耗和排放，对环境影响较小。

(三) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

适用 不适用

(四) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

适用 不适用

二、社会责任工作情况

适用 不适用

公司履行社会责任的工作情况请详见公司于上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 披露的《中原证券股份有限公司 2021 年度社会责任报告》。

三、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

适用 不适用

2021 年，中原证券以实际行动全面深入贯彻落实习近平新时代中国特色社会主义思想，积极服务乡村振兴大局，持续通过强化金融帮扶举措、强化教育帮扶力度、做好消费扶贫引导和选派优秀干部驻村、公益捐赠等措施，助力巩固拓展脱贫攻坚成果同乡村振兴有效衔接。

(一) 强化金融帮扶举措，推动乡村产业发展。

2021 年，中原证券持续加大金融帮扶力度，不断引入资本市场金融活水，助推贫困地区乡村产业实现高质量跨越发展。1 月 29 日，中原证券保荐注册地在驻马店市确山县的蓝天燃气在上交所主板上市，募集资金人民币 8.7 亿元，使得驻马店市确山县主板上市企业实现零的突破。12 月 23 日，中原证券保荐注册地在周口市沈丘县的凯旺科技成功在深交所创业板上市，募集资金近人民币 6.5 亿元，实现了沈丘县上市公司零的突破。中原证券将切实做好“十四五”时期乡村金融服务工作，巩固拓展脱贫攻坚成果，持续提升金融服务乡村振兴能力和水平，更好地发挥资本市场在全面推进乡村振兴中的积极作用。

(二) 强化教育帮扶力度，阻断贫困代际传递。

中原证券充分发挥河南省扶贫基金会平台优势，坚持创新扶贫理念，持续打造“晨曦计划”品牌项目，通过支付宝、腾讯等公益募集平台开通线上全国募捐通道，举办第四届“晨曦计划”夏令营活动，全省 9 市 15 个县共计 13 万余名高中生从中受益；推进“爱心书屋”、“情系留守爱暖童心”、“雷锋助学”等公益项目在全省开展，受助学生达 4.2 万余名；设立信阳市光山县罗陈乡罗陈村产业扶持与教育发展项目，资助结对帮扶村罗陈村困难家庭大学生，扶持当地产业项目，带动低收入家庭就业，对巩固罗陈村脱贫成果和全面推进乡村振兴发挥了积极作用。

(三) 做好消费帮扶引导，巩固脱贫攻坚成果。

2021 年，河南省受疫情和暴雨灾害双重影响，部分地区出现农产品滞销难卖的情况，中原证券坚持以消费帮扶形成产业引导，在元旦、春节和国庆中秋双节员工集体福利采购上加大力度，共采购固始、兰考、桐柏、上蔡和光山等帮扶县困难村的小米、干菜、花生、挂面、生姜等农产品人民币 66 万元，同时号召公司党员群众帮助销售脱贫地区农产品人民币 11.94 万元，有力帮助困难地区人民群众应对灾情疫情带来不利影响。

(四) 选派优秀干部驻村，助力乡村振兴战略。

根据河南省组织部要求，中原证券精心挑选优秀干部接替原驻村干部，坚持以产业发展为工作核心，严格落实“四个不摘”要求，因地制宜加强基础设施建设，通过推进“粳改粳”产业提升计划、重点发展农产品加工产业、开展油茶种植产业、成立合作社发展牛羊养殖和藕虾共作、开展草莓种植和旅游采摘等措施全力保障就业；充分利用河南省第一书记展销中心、信阳市供销网、河南农村广播、河南省扶贫产品展销会等平台推广罗陈村特色农产品，提高困难群众收入；通过协调公立幼儿园建设、开展污水管网改造、开展体检和义诊活动等持续改善人居环境，全方位提升困难群众获得感、幸福感和安全感。

(五) 公益捐赠，支持乡村建设。

作为理事长单位，公司通过河南省扶贫基金会开展扶贫工作。2021 年，对河南省扶贫基金会捐赠人民币 190 万元，35 万元用于洛阳市宜阳县盐镇乡中峪村基础设施建设；75 万元用于驻马店遂平县高标准农田管理中心项目，以促进农业增效、农民增收和农村繁荣；30 万元用于周口市沈丘县尹庄村党建文化广场升级改造，以深入推进农村基层党的建设；50 万元用于洛阳市新安

县北冶镇涧沟村对饮水工程建设项目，以积极推进解决农村饮水安全问题，全面提高农村供水保障水平。

2021 年 5 月，在河南省脱贫攻坚总结表彰大会上，公司工会副主席陈利涛荣获“河南省脱贫攻坚先进个人”，兰考裕禄大道营业部荣获“河南省脱贫攻坚先进集体”，这些荣誉的取得，充分体现了河南省委省政府对公司巩固拓展脱贫攻坚成果、助力乡村振兴战略等工作的高度肯定。

第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

(一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内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	股份限售	河南投资集团	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自河南投资集团所持有的中原证券首次公开发行A股限售股上市流通之日起12个月内,不以任何方式减持所持有的股份	是	是		
	解决同业竞争	河南投资集团	关于避免同业竞争的承诺	与中原证券2014年3月10日签订了《避免同业竞争协议》期限为长期	是	是		
	解决同业竞争	本公司	关于避免同业竞争的承诺	与河南投资集团2014年3月10日签订了《避免同业竞争协议》期限为长期	是	是		
与再融资相关的承诺	其他	本公司	加大对合规风控及信息技术方面资源投入的承诺	注	是	是		
	股份限售	上海高毅资产管理合伙企业(有限合伙)	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
	股份限售	中国国际金融股份有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
	股份限售	国泰君安证券股份有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		

股份限售	中国平煤神马能源化工集团有限责任公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	财通基金管理有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	河南铁路投资有限责任公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	中意资产管理有限责任公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	锦绣中和(天津)投资管理有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	中信证券股份有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	湾区产融投资(广州)有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	江苏省苏豪控股集团有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	中信建投证券股份有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	杭州泽桐投资管理有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	阳光资产管理股份有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	河北国控资本管理有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	譬建军	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		

股份限售	国信证券股份有限公司	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		
股份限售	上海铂绅投资中心(有限合伙)	股东对所持股份自愿锁定的承诺	自中原证券非公开发行A股并在证券交易所上市之日起6个月	是	是		

注：（1）自2020年至2022年，公司连续三年在合规风控方面的投入，不少于公司上一年度营业收入的3%；

（2）自2020年至2022年，公司连续三年在信息技术方面的投入，不少于公司上一年度营业收入的6%；

（3）自2020年至2022年，公司在年度报告中披露合规风控及信息技术方面投入的实际情况；

（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

二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

三、违规担保情况

适用 不适用

四、公司董事会对会计师事务所“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

	原聘任	现聘任
境内会计师事务所名称	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）	大华会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬	255.00	75.00
境内会计师事务所审计年限	9 年	1 年

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	大华会计师事务所（特殊普通合伙）	20.00
保荐人	华泰联合证券有限责任公司	0

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

√适用 □不适用

根据《财政部关于印发〈国有金融企业选聘会计师事务所管理办法〉的通知》（财金[2020]6号）的有关规定，公司聘用信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）年限已满，2021 年度需变更会计师事务所。经公司 2020 年年度股东大会审议批准，同意聘任大华会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2021 年度唯一审计机构，负责根据中国企业会计准则同时提供境内及境外审计服务。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

□适用 √不适用

七、面临退市风险的情况**(一) 导致退市风险警示的原因**

□适用 √不适用

(二) 公司拟采取的应对措施

□适用 √不适用

(三) 面临终止上市的情况和原因

□适用 √不适用

八、破产重整相关事项

□适用 √不适用

九、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

(一) 诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

□适用 √不适用

(二) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

√适用 □不适用

单位:万元 币种:人民币

报告期内:									
起诉(申请)方	应诉(被申请人)方	承担连带责任方	诉讼仲裁类型	诉讼(仲裁)基本情况	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)是否形成预计负债及金额	诉讼(仲裁)进展情况	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况
中原证券	石河子市瑞晨股权投资合伙企业(有限合伙)、谭颂斌、周娟	无	合同纠纷	注 1	18,799.98	注 1	注 1	注 1	注 1
中原证券	长城影视文化企业集团有限公司(现已更名为浙江清风原生文化有限公司)	无	合同纠纷	注 2	20,000.00	注 2	注 2	注 2	注 2
中原证券	科迪食品集团股份有限公司	无	合同纠纷	注 3	43,165.83	注 3	注 3	注 3	注 3
中州蓝海	河南中益置业有限公司、葛洪涛、徐香红、徐增才、河南中益重工机械科技股份有限公司、河南中益工程勘察有限公司、河南中益实业集团有限公司、河南中益物业服务集团有限公司、郑州盛之峰实业有限公司	无	合同纠纷	注 4	10,580.88	注 4	注 4	注 4	注 4

注 1：石河子市瑞晨股权投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“瑞晨投资”）、谭颂斌及周娟股票质押业务违约，公司提起诉讼，河南省高级人民法院（以下简称“河南省高院”）一审判决后，被告瑞晨投资、谭颂斌、周娟提起上诉。公司于 2020 年 1 月 22 日收到中华人民共和国最高人民法院（2019）最高法民终 1917 号民事判决书，判令瑞晨投资向公司支付融资本金约人民币 18,799.98 万元及违约金、律师费、保险费，谭颂斌对上述判决确定的义务承担连带清偿责任，公司对被告瑞晨投资质押给公司的广东银禧科技股份有限公司（以下简称“银禧科技”）股票（证券代码：300221）24,529,900 股的折价、拍卖或者变卖所得价款在上述判决确定的债权范围内享有优先受偿权，驳回中原证券的其他诉讼请求。河南省高院于 2020 年 3 月 30 日执行立案。郑州市中级人民法院（以下简称“郑州市中院”）按照相应程序对银禧科技股票 24,529,900 股进行拍卖，该股票第一次拍卖流拍。第二次拍卖公告期间瑞晨投资提出执行异议，郑州市中院做出（2020）豫 01 执异 1155 号执行裁定书，裁定驳回瑞晨投资异议请求，瑞晨投资不服向河南省高院申请复议。2021 年 1 月 12 日河南省高院做出（2020）豫执复 587 号执行裁定书，裁定驳回瑞晨投资复议申请，维持郑州市中院（2020）豫 01 执异 1155 号执行裁定。郑州市中院依法对银禧科技股票 24,529,900 股进行第二次拍卖，拍卖股票于 2021 年 3 月 2 日以 188,884,151.85 元全部成交，公司已收到全部拍卖款 188,884,151.85 元。公司于 2021 年 4 月 6 日收到郑州市中院（2021）豫 01 执 490 号执行裁定书，因公司与瑞晨投资达成和解协议并长期履行，裁定终结本案的执行。2021 年 8 月 31 日，公司与瑞晨投资又达成新的和解协议，该协议尚处于履行期间。

另，上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行与谭颂斌、周娟金融借款合同纠纷一案中，公司作为债权人申请对谭颂斌持有的银禧科技 2,478 万股股票拍卖所得人民币 158,380,000 元参与分配。2020 年 12 月 23 日，扣除相关费用后公司实际收到执行分配款人民币 13,942,396.35 元。2021 年 3 月 16 日公司收到剩余执行分配款人民币 754,490.15 元。截至 2021 年 12 月 31 日，本金已全部收回。

注 2：长城影视文化企业集团有限公司（现已更名为浙江清风原生文化有限公司，以下简称“长城影视”或“浙江清风”）股票质押式回购合同违约，公司提起诉讼，2019 年 12 月 5 日河南省高院做出（2019）豫民初 11 号民事判决书，该判决支持了长城影视支付融资本金人民币 20,000 万元及利息、违约金、律师费、诉讼财产保全保险费等诉讼请求。该案件进入强制执行程序后，郑州市中院裁定将长城影视持有的长城影视股份有限公司（证券简称：*ST 长城）股票（证券代码：002071）50,400,000 股作价人民币 71,542,800 元，交付公司抵偿其等额债权，并裁定终结本次执行程序。

为维护自身合法权益，公司向郑州市中院提起执行异议诉讼，请求判令依法追加被告赵非凡、赵锐勇为公司与第三人浙江清风执行案件的被执行人，并在二人认缴出资范围内对第三人浙江清风欠公司人民币 14,656.71 万元债务承担连带清偿责任。（前序事项已在 2021 年 3 月 31 日公开披露的《中原证券股份有限公司 2020 年年度报告》中进行了详细披露。）公司于 2021 年 5 月 26 日收到郑州市中院（2020）豫 01 民初 1751 号民事判决书，判决追加赵锐勇、赵非凡为中原证券诉长城影视质押式证券回购纠纷一案的被执行人，并分别在其未足额缴纳出资人民币 35,006.5 万元、人民币 64,993.5 万元范围内承担责任。该判决已生效，公司与长城影视（浙江清风）股票质押式回购合同违约案已恢复执行。截至报告期末，该案处于执行阶段。截至 2021 年 12 月 31 日，账面债权余额为人民币 1.28 亿元，已全额计提坏账准备。

注 3：科迪食品集团股份有限公司（以下简称“科迪集团”）股票质押式回购合同违约，公司提起诉讼，郑州市中院一审判决后，科迪集团和公司均不服一审判决而提起上诉。公司于 2020 年 8 月 3 日收到河南省高院（2020）豫民终 636 号民事裁定书，因科迪集团未在规定时间内缴纳上诉费用，按其自动撤回上诉处理；准许公司撤回上诉，本裁定为终审裁定。郑州市中院于 2020 年 8 月 24 日执行立案。2020 年 12 月 24 日，河南科迪乳业股份有限公司发布关于控股股东被申请破产重整的提示性公告，商丘市中级人民法院（以下简称“商丘市中院”）做出（2020）豫 14 破申 20 号民事裁定书，裁定受理魏均平对科迪集团的破产重整申请。公司已完成债权申报。2021 年 1 月 21 日，郑州市中院做出（2020）豫 01 执 1089 号之二执行裁定书：因商丘市中院受理了对科迪集团的破产重整申请，裁定终结对被执行人科迪集团的执行。截至报告期末，科迪集团处于破产重整程序中。截至 2021 年 12 月 31 日，账面融资本金人民币 3.05 亿元，累计计提减值准备人民币 2.02 亿元。

注 4：河南中益置业有限公司（以下简称“中益置业”）金融委托理财合同违约，中州蓝海提起诉讼，中州蓝海于 2019 年 10 月 31 日收到郑州市中院（2019）豫 01 民初 1407 号民事判决书，该判决支持了中益置业向中州蓝海偿还信托贷款本金人民币 9,969 万元及利息、罚息、复利、违约金以及律师费用等诉讼请求。中州蓝海对坐落于银屏路东、冬青街南，不动产单元号为 410102103004GB00071W00000000 的在建工程及分摊土地使用权享有抵押权，并就折价或拍卖、变卖所得的价款在其债权范围内享有优先受偿权，河南中益重工机械科技股份有限公司等共 8 名被告对本判决确定的上述债务承担连带保证责任，并在承担保证责任后，有权向中益置业追偿。该案郑州市中院于 2020 年 1 月 13 日执行立案。郑州市中院按照相应程序对被执行人徐增才、徐香

红名下分别位于金水区鸿苑路 69 号东园区 31 号楼 1-4 层 2 号、30 号楼 1-4 层 4 号的房产进行拍卖，该两处房产第一次拍卖流拍。郑州市中院于 2021 年 1 月 5 日对上述两处房产进行第二次拍卖，其中位于金水区鸿苑路 69 号东园区 31 号楼 1-4 层 2 号的房产再次流拍。位于金水区鸿苑路 69 号东园区 30 号楼 1-4 层 4 号的房产以人民币 5,527,354.5 元拍卖成交，该房产拍卖所得价款扣除银行按揭贷款本息余额及执行费用后，中州蓝海于 2021 年 6 月 18 日收到法院分配执行款人民币 2,443,099.88 元。

另，郑州高新技术产业开发区人民法院（以下简称“郑州高新区法院”）于 2021 年 6 月 3 日做出（2021）豫 0191 执恢 2387 号裁定书，依据（2020）豫 0191 协执 9422 号执行裁定书，查封了被执行人中益置业名下位于高新技术产业开发区银屏路 5 号共计 37 套房产，并拟对上述被查封财产进行处置。中州蓝海作为上述被查封房产的抵押权人，对法院的执行行为不服，2021 年 6 月 10 日向郑州高新区法院提出执行异议，郑州高新区法院于 2021 年 9 月 6 日出具（2021）豫 0191 执异 637 号裁定书，裁定驳回异议请求。中州蓝海不服判决，向郑州市中院提出执行异议复议，郑州市中院于 2021 年 12 月 17 日出具（2021）豫 01 执复 589 号裁定书，裁定撤销原裁定，发回郑州高新区法院重新作出裁定。截至报告期末，该案尚未做出新的裁定。截至 2021 年 12 月 31 日，账面余额人民币 1 亿元，累计计提减值准备人民币 0.28 亿元。

报告期内，公司与神雾科技集团股份有限公司合同纠纷案、新光控股集团有限公司合同纠纷案皆暂无新进展，前序事项分别已在 2021 年 3 月 31 日公开披露的《中原证券股份有限公司 2020 年年度报告》中进行了披露。

（三）其他说明

适用 不适用

十、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人涉嫌违法违规、受到处罚及整改情况

适用 不适用

2021 年 7 月 7 日，公司收到河南证监局出具《关于对中原证券股份有限公司实施出具警示函措施的决定》（河南证监局行政监管措施决定书（2021）12 号）。要求公司在监管措施下发之日起 60 日内完成整改，并向河南证监局提交书面整改报告。具体内容请参阅公司 2021 年 7 月 13 日披露的相关公告（公告编号：2021-039）。

2021年8月17日，河南证监局出具《关于对中原证券股份有限公司南阳分公司实施责令改正并责令增加内部合规检查次数行政监管措施的决定》（河南证监局行政监管措施决定书（2021）15号）。要求南阳分公司在监管措施下发之日起60日内完成整改，并自本措施下发之日起一年内，每3个月开展一次合规检查。南阳分公司对此高度重视，立即召开会议传达落实监管要求，积极研究相关问题的整改工作。

截至本报告日，相关问题已整改完毕，并在规定时间内向河南证监局报送整改报告。同时，南阳分公司已按要求完成两次内部合规检查，后续将严格按照要求在规定时间内完成剩余两次合规检查工作。

十一、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

本集团及控股股东、实际控制人不存在未履行法院生效判决，不存在负数额较大的债务到期未清偿及不良诚信等情况。

十二、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

事项概述	查询索引
公司于本报告同期发布的《中原证券股份有限公司关于2022年预计日常关联/持续关连交易的公告》，披露了公司2021年日常关联交易执行情况。	公告编号：2022-015

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

（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

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) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务

适用 不适用

(六) 其他

适用 不适用

十三、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：元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）														
担保方	担保方与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期(协议签署日)	担保起始日	担保到期日	担保类型	担保物(如有)	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	反担保情况	是否为关联方担保	关联关系
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）							0							
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）							0							
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							269,808,000.00							
报告期末对子公司担保余额合计（B）							253,456,000.00							
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）														
担保总额（A+B）							253,456,000.00							
担保总额占公司净资产的比例（%）							1.85							
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）														
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）														
未到期担保可能承担连带清偿责任说明														
担保情况说明							报告期末，公司为全资子公司中州国际在境外借款提供反担保余额合计人民币253,456,000.00元（港币310,000,000.00元）							

(三) 其他重大合同

适用 不适用

十四、其他对投资者作出价值判断和投资决策有重大影响的重大事项的说明

适用 不适用

非公开发行 A 股股票募集资金使用情况

经中国证监会《关于核准中原证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可【2020】1190号）核准，本公司于2020年7月完成非公开发行人民币普通股（A股）773,814,000.00股，每股面值人民币1.00元，因此总发行面值为人民币773,814,000元，每股发行价格人民币4.71元，共计募集资金人民币3,644,663,940.00元，扣除本次非公开发行的相关发行费用（不含税）人民币27,534,113.67元后，本次非公开发行实际募集资金净额为人民币3,617,129,826.33元。

经河南兴华会计师事务所有限公司以“豫兴华验字【2020】第010号”《验资报告》验证，截至2020年7月23日止，本公司实际已发行人民币普通股（A股）773,814,000.00股，募集资金总额人民币3,644,663,940.00元，扣除承销及保荐费人民币24,800,000.00元（承销及保荐费含税金额总计为人民币26,300,000.00元，其中本公司本次非公开发行前以自有资金已支付人民币1,500,000.00元）后的募集资金为人民币3,619,863,940.00元，上述募集资金已于2020年7月23日全部到位。

截至2021年12月31日，本公司非公开发行A股普通股募集资金已使用完毕，具体情况如下：人民币2,000,000,000.00元用于扩大融资融券和股票质押等资本中介业务规模；人民币1,000,000,000.00元用于扩大固定收益类业务投资规模，增加公司优质流动资产储备；人民币438,576,800.00元用于对境内外全资子公司进行增资，提升子公司资本实力；人民币35,400,009.19元用于加大信息系统的投入，持续提升信息化管理水平；人民币150,000,000.00元用于补充营运资金。

2021年5月27日，公司董事会发布了《关于募集资金使用完毕及注销募集资金账户的公告》，鉴于公司募集资金已使用完毕，募集资金专用账户不再使用，公司已注销了募集资金专户，并将募集资金专户注销时结余的募集资金利息299,929.32元（低于500万且低于募集资金净额的5%）转出用于补充流动资金。

上述具体内容请参阅公司2021年5月27日披露的相关公告（公告编号：2021-028）。

第七节 股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、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	773,814,000	16.67				-773,814,000	-773,814,000	0	0
1、国家持股									
2、国有法人持股	409,235,666	8.82				-409,235,666	-409,235,666	0	0
3、其他内资持股	364,578,334	7.85				-364,578,334	-364,578,334	0	0
其中：境内非国有法人持股	345,470,054	7.44				-345,470,054	-345,470,054	0	0
境内自然人持股	19,108,280	0.41				-19,108,280	-19,108,280	0	0
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	3,869,070,700	83.33				773,814,000	773,814,000	4,642,884,700	100
1、人民币普通股	2,673,705,700	57.59				773,814,000	773,814,000	3,447,519,700	74.25
2、境内上市的外资股									
3、境外上市的外资股	1,195,365,000	25.74						1,195,365,000	25.75
4、其他									
三、股份总数	4,642,884,700	100						4,642,884,700	100

2、 股份变动情况说明

√适用 □不适用

非公开发行 A 股限售股上市流通

2021 年 2 月 1 日，上海高毅资产管理合伙企业（有限合伙）、平煤神马、江苏苏豪等参与公司非公开发行的股东持有的公司 A 股限售股共计 773,814,000 股解除限售并上市流通。

上述具体内容请参阅公司 2021 年 1 月 23 日披露的相关公告（公告编号：2021-004）

3、 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
上海高毅资产管理合伙企业（有限合伙）	116,595,322	116,595,322		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
中国国际金融股份有限公司	91,295,116	91,295,116		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
国泰君安证券股份有限公司	82,802,547	82,802,547		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
中国平煤神马能源化工集团有限责任公司	63,694,267	63,694,267		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
财通基金管理有限公司	53,927,813	53,927,813		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
河南铁路投资有限责任公司	47,239,915	47,239,915		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
中意资产管理有限责任公司	42,462,845	42,462,845		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
锦绣中和（天津）投资管理有限公司	39,702,760	39,702,760		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
中信证券股份有限公司	35,031,847	35,031,847		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
湾区产融投资（广州）有限公司	31,847,133	31,847,133		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
江苏省苏豪控股集团有限公司	25,477,707	25,477,707		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
中信建投证券股份有限公司	25,477,707	25,477,707		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日
杭州泽桐投资管理有限公司	21,443,736	21,443,736		0	非公开发行限售股	2021 年 2 月 1 日

阳光资产管理股份有限公司	20,382,165	20,382,165		0	非公开发行限售股	2021年2月1日
河北国控资本管理有限公司	19,108,280	19,108,280		0	非公开发行限售股	2021年2月1日
訾建军	19,108,280	19,108,280		0	非公开发行限售股	2021年2月1日
国信证券股份有限公司	19,108,280	19,108,280		0	非公开发行限售股	2021年2月1日
上海铂绅投资中心(有限合伙)	19,108,280	19,108,280		0	非公开发行限售股	2021年2月1日
合计	773,814,000	773,814,000			/	/

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：万股/万张 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
债券(包括企业债券、公司债券以及非金融企业债务融资工具)						
中原证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	2021年3月4日	4.03%	1,000.00	2021年3月11日	1,000.00	2024年3月5日
中原证券股份有限公司面向专业投资者公开发行2021年短期公司债券(第一期)	2021年5月19日	3.21%	1,000.00	2021年5月27日	1,000.00	2022年5月20日
中原证券股份有限公司面向专业投资者公开发行2021年短期公司债券(第二期)	2021年6月17日	3.35%	1,200.00	2021年6月25日	1,200.00	2022年6月18日
中原证券股份有限公司2021年非公开发行次级债券(第一期)	2021年10月21日	4.7%	1,100.00	2021年10月27日	1,100.00	2024年10月22日

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

报告期内,公司发行了4支债券,其中公开发行公司债1支,即“21中原01”,发行金额人民币10亿元,发行利率4.03%,期限为3年;公开发行短期公司债券2支,分别为“21中原S1”,发行金额人民币10亿元,发行利率3.21%,期限为1年;“21中原S2”,发行金额人民币12亿元,发行利率3.35%,期限为1年;非公开发行次级债1支,即“21中原C1”,发行金额人民币11亿元,发行利率4.7%,期限为3年。

(二) 公司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

(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

截至报告期末普通股股东总数(户)	144,671
	其中 A 股 144,630; H 股登记股东 41
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	155,479
	其中 A 股 155,439; H 股登记股东 40

(二) 截至报告期末前十名股东、前十名流通股股东(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、标记或冻结 情况		股东 性质
					股份 状态	数量	
香港中央结 算(代理 人)有限公 司	-28,000	1,195,112,850	25.74	0	无		境外法 人
河南投资集 团有限公司		822,983,847	17.73	0	无		国有法 人
安阳钢铁集 团有限责任 公司		177,514,015	3.82	0	无		国有法 人
江苏省苏豪 控股集团有 限公司	99,304,900	124,782,607	2.69	0	无		国有法 人
渤海产业投 资基金管理 有限公司一 渤海产业投 资基金一期	-322,857,018	108,881,533	2.35	0	无		其他
中国平煤神 马能源化工 集团有限责 任公司		63,694,267	1.37	0	无		国有法 人
郑宇	16,361,000	51,003,190	1.10	0	无		境内自 然人

安阳经济开发集团有限公司		48,824,693	1.05	0	质押	24,412,346	国有法人
河南铁路投资有限责任公司		47,239,915	1.02	0	无		国有法人
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	18,069,708	44,794,808	0.96	0	无		其他
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				
香港中央结算（代理人）有限公司	1,195,112,850	境外上市外资股	1,195,112,850				
河南投资集团有限公司	822,983,847	人民币普通股	822,983,847				
安阳钢铁集团有限责任公司	177,514,015	人民币普通股	177,514,015				
江苏省苏豪控股集团有限公司	124,782,607	人民币普通股	124,782,607				
渤海产业投资基金管理有限公司—渤海产业投资基金一期	108,881,533	人民币普通股	108,881,533				
中国平煤神马能源化工集团有限责任公司	63,694,267	人民币普通股	63,694,267				
郑宇	51,003,190	人民币普通股	51,003,190				
安阳经济开发集团有限公司	48,824,693	人民币普通股	48,824,693				
河南铁路投资有限责任公司	47,239,915	人民币普通股	47,239,915				
中国建设银行股份有限公司—国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	44,794,808	人民币普通股	44,794,808				
上述股东关联关系或一致行动的说明	未知上述股东存在关联关系或存在《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形						

注 1：据公司所知，截至报告期末，河南投资集团有限公司除直接持有公司 822,983,847 股 A 股外，亦通过其全资附属公司大河纸业（香港）有限公司持有公司 4,673.3 万股 H 股，通过港股通持有公司 10,497.7 万股 H 股，合计持有公司股份 974,693,847 股，占公司已发行总股数的 20.99%。

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

适用 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、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

名称	河南投资集团有限公司
单位负责人或法定代表人	刘新勇
成立日期	1991 年 12 月 18 日
主要经营业务	投资管理、建设项目的投资、建设项目所需工业生产资料和机械设备、投资项目分的产品原料的销售（国家专项规定的除外）；房屋租赁（以上范围凡需审批的，未获批准前不得经营）
报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况	控股的境内上市公司有：豫能控股（001896）持股 943,700,684 股，占总股本比例 69.62%；城发环境（000885）持股 362,579,146 股，占总股本比例 56.47%，安彩高科（600207）持股 407,835,649 股，占总股本比例 47.26%。参股的境内上市公司有：中航光电（002179）和郑州银行（002936）。参股的境外上市公司有：中原银行（01216.HK）和郑州银行（06196.HK）。

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

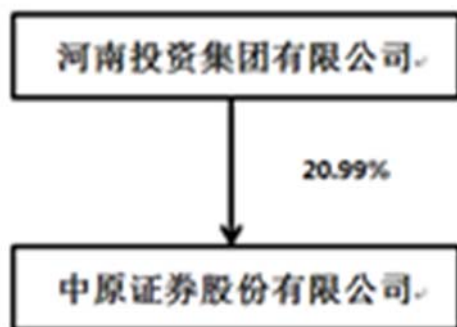
适用 不适用

4 报告期内控股股东变更情况的说明

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

名称	河南省财政厅
单位负责人或法定代表人	王东伟

其他情况说明	河南投资集团隶属于河南省政府，由河南省政府授权河南省财政厅履行出资人职责。河南省财政厅为本公司实际控制人。
--------	---

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

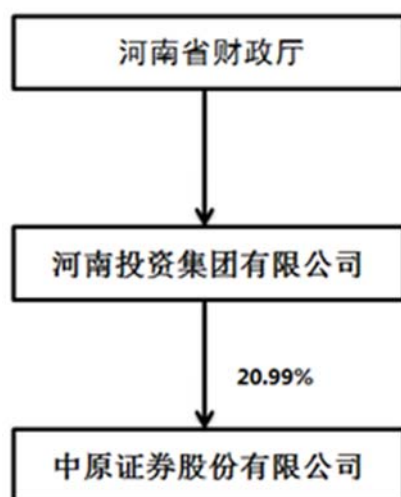
适用 不适用

4 报告期内公司控制权发生变更情况的说明

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

河南投资集团隶属于河南省政府，由河南省政府授权河南省财政厅履行出资人职责。河南省财政厅为本公司实际控制人。

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

适用 不适用

六、其他持股在百分之十以上的法人股东

适用 不适用

七、股份限制减持情况说明

适用 不适用

八、股份回购在报告期的具体实施情况

适用 不适用

第八节 优先股相关情况

适用 不适用

第九节 债券相关情况

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

√适用 □不适用

(一) 企业债券

□适用 √不适用

(二) 公司债券

√适用 □不适用

1. 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	起息日	到期日	债券余额	利率(%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排(如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
中原证券股份有限公司2019年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)	19 中原 01	155259	2019/3/25	2019/3/26	2022/3/26	20	3.9	单利按年付息, 到期一次还本	上交所	符合	竞价、报价、询价和协议交易	否
中原证券股份有限公司2019年非公开发行次级债券(第一期)	19 中原 C1	162323	2019/10/29	2019/10/30	2022/10/30	10	4.9	单利按年付息, 到期一次还本	上交所	符合	报价、询价和协议交易	否
中原证券股份有限公司2020年非公开发行次级债券(第一期)	20 中原 C1	166631	2020/4/22	2020/4/23	2023/4/23	15	4.08	单利按年付息, 到期一次还本	上交所	符合	报价、询价和协议交易	否

中原证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	21 中原 01	175736	2021/3/4	2021/3/5	2024/3/5	10	4.03	单利按年付息, 到期一次还本	上交所	符合	竞价、报价、询价和协议交易	否
中原证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年短期公司债 (第一期)	21 中原 S1	163875	2021/5/19	2021/5/20	2022/5/20	10	3.21	单利按年计息, 到期一次还本付息	上交所	符合	竞价、报价、询价和协议交易	否
中原证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年短期公司债 (第二期)	21 中原 S2	163881	2021/6/17	2021/6/18	2022/6/18	12	3.35	单利按年计息, 到期一次还本付息	上交所	符合	竞价、报价、询价和协议交易	否
中原证券股份有限公司 2021 年非公开发行次级债券 (第一期)	21 中原 C1	197241	2021/10/21	2021/10/22	2024/10/22	11	4.7	单利按年计息, 到期一次还本付息	上交所	符合	报价、询价和协议交易	否

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

逾期未偿还债券

适用 不适用

报告期内债券付息兑付情况

适用 不适用

债券名称	付息兑付情况的说明
中原证券股份有限公司2018年次级债券(第一期)	按照上交所和中国结算公司相关制度规定,“18中原01”于2021年4月27日到期,已按时足额兑付本息。
中原证券股份有限公司2019年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)	按照上交所和中国结算公司相关制度规定,“19中原01”于2021年3月26日进行年度付息,已按时足额兑息。
中原证券股份有限公司2019年非公开发行次级债券(第一期)	按照上交所和中国结算公司相关制度规定,“19中原C1”于2021年11月1日进行年度付息,已按时足额兑息;
中原证券股份有限公司2020年非公开发行次级债券(第一期)	按照上交所和中国结算公司相关制度规定,“20中原C1”于2021年4月23日进行年度付息,已按时足额兑息。

2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

3. 为债券发行及存续期业务提供服务的中介机构

中介服务内容	中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	联系人	联系电话
主承销商/债券受托管理人	东海证券股份有限公司	上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦6楼		张宜生、江艳	021-20333333
债券受托管理人	长江证券承销保荐有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第三座36楼		陈培生、张俊青	0755-82548008
债券受托管理人	华西证券股份有限公司	成都市高新区天府二街198号1107室		吕松阳	028-86158285
主承销商/债券受托管理人	中国银河证券股份有限公司	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座		陈曲、石榴	010-83574504
会计师事务所	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座9层	颜凡清、崔巍巍	晁小燕	0531-86595111
资信评级机构	上海新世纪资信评估投资服务有限公司	上海市汉口路398号华盛大厦14F		徐兴村	021-63500711
资信评级机构	大公国际资信评估有限公司	北京市海淀区西三环北路89号		李佳睿、李喆	010-67413300

		外文大厦 A 座 3 层			
律师事务所	河南仟问律师事务所	郑州市金水区纬五路 43 号经纬大厦十二楼		赵晓峰	0371-65953550
律师事务所	河南法本律师事务所	郑州市郑东新区七里河南路 75 号意中大厦 15A 层		王安平	0371-60999150
律师事务所	河南陆达律师事务所	河南省郑州市金水东路 109 号美侨世纪广场 A 座 6 层、20 层		何肇杰、马亚丽	0371-88927791

上述中介机构发生变更的情况

适用 不适用

4. 报告期末募集资金使用情况

适用 不适用

单位:亿元 币种:人民币

债券名称	募集资金总金额	已使用金额	未使用金额	募集资金专项账户运作情况(如有)	募集资金违规使用的整改情况(如有)	是否与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致
中原证券股份有限公司 2019 年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)	20	20	0	无	无	是
中原证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)	10	10	0	无	无	是
中原证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期)	15	15	0	无	无	是
中原证券股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	10	10	0	无	无	是
中原证券股份有限公司	10	10	0	无	无	是

面向专业投资者公开发行 2021 年短期公司债 (第一期)						
中原证券股份有限公司面向专业投资者公开发行 2021 年短期公司债 (第二期)	12	12	0	无	无	是
中原证券股份有限公司 2021 年非公开发行次级债券 (第一期)	11	11	0	无	无	是

募集资金用于建设项目的进展情况及运营效益

适用 不适用

报告期内变更上述债券募集资金用途的说明

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

5. 信用评级结果调整情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

上海新世纪资信评估投资服务有限公司于 2021 年 1 月 11 日和 5 月 28 日分别出具了对“21 中原 01”、“19 中原 01”的债项及跟踪评级报告，维持公司 AAA 主体信用等级和 AAA 债项信用等级，评级展望为稳定，债项和跟踪评级结果一致。上海新世纪资信评估投资服务有限公司于 2021 年 5 月 28 日出具了对“19 中原 C1”、“20 中原 C1”的跟踪评级报告，给予公司 AAA 主体信用等级和 AA+ 债项信用等级，评级展望为稳定，与上一次评级结果一致。大公国际资信评估有限公司 2021 年 4 月 27 日出具了对“21 中原 S1”债项评级报告，给予公司 AAA 主体信用等级和 A-1 债项信用等级，评级展望为稳定。“21 中原 S2”未进行债项评级，无跟踪评级安排。上海新世纪资信评估投资服务有限公司于 2021 年 9 月 9 日出具了对“21 中原 C1”的债项评级报告，给予公司 AAA 主体信用评级和 AA+ 债项信用评级，评级展望为稳定，与上一次债项评级结果一致。

6. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响

适用 不适用

现状	执行情况	是否发生变更	变更后情况	变更原因	变更是否已取得有权	变更对债券投资者权益的影响

					机构批准	
报告期内债券无担保情况	无	否				
报告期内偿债计划正常	注 1	否				
报告期内其他偿债保障措施正常	注 2、注 3	否				

注1：偿债计划。“19中原01”、“19中原C1”、“20中原C1”、“21中原01”、“21中原C1”的偿债计划均为在债券存续期内每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。“21中原S1”、“21中原S2”的偿债计划为采用单利按年计息，不计复利，到期一次还本付息。

注2：偿债保障措施。

(1) 公司债券。报告期内，公司不断加强证券经纪业务、投资银行业务、证券自营业务、资产管理、融资融券、股票质押式回购等业务的发展力度，偿债能力和获取现金能力较强。公司严格按照财务制度进行资金管理，根据债务结构情况不断优化公司的资产负债管理、加强公司的流动性管理，制定年度及阶段性的资金使用计划，及时、足额地准备偿债资金并按时兑付；同时公司还通过充分发挥受托管理人的作用、严格执行《债券持有人会议规则》、保持良好的流动性、建立偿付工作小组等措施保障债券持有人的利益。报告期内“19 中原 01”于 2021 年 3 月 26 日进行年度付息，已按时足额兑息，公司未出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息情况，因而未提高任意盈余公积比例和一般风险准备金比例，也未采取不向股东分配利润、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施、调减或停发公司董事和高级管理人员的工资和奖金、主要责任人员不得调离等偿债保障措施。

(2) 次级债券。报告期内，公司通过持续完善公司治理结构和风险控制体系、充分发挥债券受托管理人作用、严格执行《债券持有人会议规则》、指定专门人员负责还本付息事宜及严格信息披露等措施保障债券持有人的利益。报告期内，“18 中原 01”于 2021 年 4 月 27 日到期，已按时足额兑付本息；“19 中原 C1”于 2021 年 11 月 1 日进行年度付息，已按时足额兑息；“20 中原 C1”于 2021 年 4 月 23 日进行年度付息，已按时足额兑息。报告期内公司未出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息，因而未采取不向股东分配利润、暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施、调减或停发公司董事和高级管理人员的工资和奖金、主要责任人员不得调离等偿债保障措施。

注3：其他相关情况。公司其他偿债保障措施的执行情况，公司严格按照法律法规的规定，聘请华西证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、长江证券承销保荐公司、中国银河证券股份有限公司作为相应债券的受托管理人，并按照签订的《债券受托管理协议》约定，维护债券持有人的利益、严格执行资金的管理计划与信息披露要求，以上措施与募集说明书保持一致。

7. 公司债券其他情况的说明

适用 不适用

报告期内，公司严格按照上述债券募集说明书的相关约定或承诺执行，不存在违反募集说明书约定和承诺的事项。公司各期债券均按照募集说明书约定按期足额付息兑付，未发生违约情况。

(三) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

(四) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

适用 不适用

(五) 报告期末除债券外的有息债务逾期情况

适用 不适用

(六) 报告期内违反法律法规、公司章程、信息披露事务管理制度规定的情况以及债券募集说明书约定或承诺的情况对债券投资者权益的影响

适用 不适用

(七) 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	2021 年	2020 年	本期比上年同期增减 (%)	变动原因
扣除非经常性损益后净利润	490,355,011.21	95,722,370.32	412.27	主要是因为公司利润总额增加导致
流动比率	1.58	1.56	1.28	
速动比率	1.58	1.56	1.28	
资产负债率 (%)	65.65	66.08	-0.65	
EBITDA 全部债务比	6.45	3.96	62.88	主要是因为 EBITDA 增加及全部债务减少导致
利息保障倍数	1.86	1.18	57.63	主要是因为利润总额增加导致
现金利息保障倍数	-0.53	4.25	不适用	主要是因为卖出回购业务本年为净流出,上年同期为净流入,导致现金流入减少
EBITDA 利息保障倍数	1.95	1.27	53.54	主要是因为利润总额增加导致
贷款偿还率 (%)	100	100	0.00	
利息偿付率 (%)	100	100	0.00	

二、可转换公司债券情况

适用 不适用

第十节 财务报告

审计报告

大华审字[2022]002570号

中原证券股份有限公司全体股东：

一、 审计意见

我们审计了中原证券股份有限公司（以下简称“中原证券”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2021 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司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，公允反映了中原证券 2021 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况以及 2021 年度的合并及母公司经营成果和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，我们独立于中原证券，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。

1. 融出资金、买入返售金融资产、债权投资和其他债权投资减值准备的确定

2. 金融工具公允价值的评估

(一)融出资金、买入返售金融资产、债权投资和其他债权投资减值准备的确定

1. 事项描述

如财务报表附注六注释 3、注释 7、注释 9 和注释 10 所述，截止 2021 年 12 月 31 日，中原证券融出资金、买入返售金融资产、债权投资和其他债权投资账面价值分别为人民币 81.48 亿元、人民币 9.73 亿元、人民币 2.63 亿元和人民币 9.70 亿元，前述资产合计占资产总额的 19.27%，已确认的减值准备余额总计为 9.03 亿元。

2021 年 12 月 31 日管理层运用预期信用损失模型计量预期信用损失。对于阶段一和阶段二的上述金融资产，管理层运用包含违约概率、违约损失率及违约风险敞口等关键参数的计量模型评估减值准备。对于阶段三已发生信用减值的上述金融资产，管理层通过预估未来金融资产的现金流量，计量减值准备。

针对不同类型的产品，预期信用损失计量模型所包含的重大管理层判断和假设主要包括：判断信用风险显著增加的标准；选择计量预期信用损失的适当模型和假设；使用的前瞻性信息和权重。

由于管理层需要对预期信用损失模型涉及的假设及参数的选取作出重大判断，且结果对于财务报表影响重大，因此我们认为该事项属于合并及母公司财务报表审计的关键审计事项。

2. 审计应对

我们对于以摊余成本计量的金融资产减值准备的确定所实施的重要审计程序包括：

1) 了解与计提预期信用减值准备相关的内部控制，并测试相关内部控制执行的有效性；

2) 选取样本执行审阅程序，检查相关金融资产的逾期信息、抵质押资产价值、融资人或发行人的信用状况、负面信息等情况，评价管理层作出的上述金融资产信用风险自初始确认后是否显著增加的判断以及是否已发生信用减值的判断的合理性；

3) 检查管理层评估减值准备时所用的预期信用损失模型和参数的可靠性，包括违约概率、违约损失率、违约风险暴露及前瞻性调整等，评价其一贯性、准确性和完整性；

4) 在选取样本的基础上，评价已发生信用减值的金融资产违约损失率的合理性，检查债务人和担保人的财务信息、抵质押物或查封资产的市场价值等信息，对金融资产的可回收金额作出考量；

5) 评价与金融资产减值准备相关的财务报表信息披露是否符合企业会计准则的披露要求。

基于已执行的审计工作，我们认为，管理层在前述以摊余成本计量的金融资产减值准备的确定的相关判断及假设是合理的。

(二)金融工具公允价值的评估

1. 事项描述

如财务报表附注六注释 8、注释 10、注释 25、财务报表附注十所述，截止 2021 年 12 月 31 日，中原证券交易性金融资产、其他债权投资、交易性金融负债的账面价值分别为 245.08 亿元、9.70 亿元和 9.71 亿元，本期确认的公允价值变动金额总计为 4.90 亿。

中原证券以公允价值计量的金融工具的估值是以市场数据和估值模型相结合为基础，其中估值模型通常需要大量的输入值。大部分输入值来源于能够可靠获取的数据。当可观察的输入值无法可靠获取时，即第三层次公允价值计量的金融工具的情形下，不可观察输入值的确定会使用到管理层估计，这当中会涉及管理层的重大判断。

由于以公允价值计量的金融工具公允价值的评估较为复杂，且在确定估值模型使用的输入值时涉及管理层判断的程度重大，我们将金融工具公允价值的评估识别为关键审计事项。

2. 审计应对

我们对于金融工具公允价值的评估所实施的重要审计程序包括：

1) 了解和评价与估值、独立价格验证及金融工具估值模型审批相关的关键财务报告内部控制的设计和运行有效性；

2) 就第一层次公允价值计量的金融工具，通过比较中原证券采用的公允价值与公开可获取的市场数据，评价第一层次公允价值计量的金融工具的估值；

3) 就第二层次和第三层次公允价值计量的金融工具，选取金融工具，查阅本年度签署的投资协议，了解相关投资条款，并识别与金融工具估值相关的条件，评估管理层采用的估值模型，以及所使用的可观察及不可观察输入值的合理性及适当性；

4) 根据相关会计准则，评价与金融工具公允价值相关的披露的合理性。

基于已执行的审计工作，我们认为，管理层在金融工具公允价值的评估的相关判断及假设是合理的。

四、其他信息

中原证券管理层对其他信息负责。其他信息包括 2021 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

中原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，中原证券管理层负责评估中原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中原证券、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督中原证券的财务报告过程。

六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预

期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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

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，就可能对中原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告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中原证券不能持续经营。

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

6. 就中原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，以对财务报表发表意见。我们负责指导、监督和执行集团审计。我们对审计意见承担全部责任。

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

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

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

（本页以下无正文）

（本页无正文，为大华审字[2022]002570 号审计报告之签字盖章页）

大华会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师：_____

（项目合伙人） 敖都吉雅

中国·北京

中国注册会计师：_____

李甜甜

二〇二二年三月二十五日

合并资产负债表

2021年12月31日

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注六	2021年12月31日	2020年12月31日
资产：			
货币资金	注释1	12,332,030,422.75	10,951,131,021.90
其中：客户资金存款		9,990,048,353.53	8,193,682,554.76
结算备付金	注释2	2,558,219,120.46	2,379,100,088.00
其中：客户备付金		2,446,921,329.46	2,287,871,177.95
融出资金	注释3	8,148,017,143.05	7,400,757,113.38
衍生金融资产	注释4	54,610.00	
存出保证金	注释5	802,256,089.47	744,878,747.69
应收款项	注释6	98,055,900.27	169,323,523.34
买入返售金融资产	注释7	972,870,075.44	2,055,964,889.83
金融投资：			
交易性金融资产	注释8	24,507,919,178.87	22,592,572,498.77
债权投资	注释9	263,452,484.68	456,168,931.89
其他债权投资	注释10	970,426,547.78	2,088,805,149.07
长期股权投资	注释11	1,659,879,203.08	1,067,276,173.44
投资性房地产	注释12	15,666,107.28	16,474,089.01
固定资产	注释13	188,201,266.95	179,004,039.77
在建工程	注释14	58,641,526.64	52,427,024.00
使用权资产	注释15	160,408,039.28	163,033,163.26
无形资产	注释16	223,016,230.62	188,018,189.26
递延所得税资产	注释17	486,461,663.34	464,734,648.09
商誉	注释18	19,522,493.37	19,882,791.61
其他资产	注释19	283,225,421.38	1,387,323,474.69
资产总计		53,748,323,524.71	52,376,875,557.00

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

2021年年度报告
合并资产负债表（续）
2021年12月31日

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注六	2021年12月31日	2020年12月31日
负债：			
短期借款	注释22	256,191,822.27	315,977,554.88
应付短期融资款	注释23	7,032,271,969.93	4,154,657,809.90
拆入资金	注释24	2,900,742,263.92	3,694,418,222.23
交易性金融负债	注释25	971,171,013.72	1,356,226,583.04
衍生金融负债	注释4	465,376.83	57,980.91
卖出回购金融资产款	注释26	10,548,472,328.09	12,200,308,194.73
代理买卖证券款	注释27	12,571,797,812.48	10,555,230,551.25
应付职工薪酬	注释28	768,133,013.64	561,932,538.17
应交税费	注释29	121,620,959.74	131,604,084.55
应付款项	注释30	143,594,220.52	65,874,572.60
合同负债	注释31	6,872,133.68	26,495,681.41
长期借款	注释32		1,001,741.67
应付债券	注释33	3,685,225,541.41	4,610,250,342.02
租赁负债	注释34	157,162,685.95	157,698,672.45
递延所得税负债	注释17	38,563,107.66	14,241,536.99
其他负债	注释35	401,959,351.47	344,423,399.69
负债合计		39,604,243,601.31	38,190,399,466.49
股东权益：			
股本	注释36	4,642,884,700.00	4,642,884,700.00
资本公积	注释37	6,301,860,583.46	6,330,622,817.68
其他综合收益	注释38	-872,349.97	12,549,125.88
盈余公积	注释39	908,512,430.25	838,358,247.79
一般风险准备	注释40	1,534,245,856.08	1,441,518,813.40
未分配利润	注释41	295,251,945.46	102,780,913.15
归属母公司股东权益合计		13,681,883,165.28	13,368,714,617.90
少数股东权益		462,196,758.12	817,761,472.61
股东权益合计		14,144,079,923.40	14,186,476,090.51
负债和股东权益总计		53,748,323,524.71	52,376,875,557.00

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

合并利润表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注六	2021年度	2020年度
一、营业总收入		4,420,848,497.96	3,103,301,696.87
利息净收入	注释42	138,347,509.79	101,097,703.29
其中：利息收入		1,017,022,199.16	959,869,249.40
利息支出		878,674,689.37	858,771,546.11
手续费及佣金净收入	注释43	1,636,808,462.51	1,172,198,286.83
其中：经纪业务手续费净收入		845,736,024.69	790,645,044.22
投资银行业务手续费净收入		635,907,867.58	206,756,722.44
资产管理业务手续费净收入		37,289,783.89	47,316,049.98
投资收益（损失以“-”号填列）	注释44	588,394,946.32	606,652,804.47
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		52,636,085.81	53,783,145.31
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	注释45	489,485,981.10	-48,524,176.45
汇兑收益（损失以“-”号填列）		1,578,376.60	-3,348,221.20
其他业务收入	注释46	1,557,032,891.52	1,264,503,482.85
资产处置收益（损失以“-”号填列）	注释47	69,744.36	-20,777.16
其他收益	注释48	9,130,585.76	10,742,594.24
二、营业总支出		3,710,316,417.23	2,954,485,813.12
税金及附加	注释49	22,031,146.36	19,375,311.17
业务及管理费	注释50	1,803,962,502.07	1,334,084,832.77
信用减值损失	注释51	373,913,233.39	344,960,999.30
其他资产减值损失	注释52	2,752,382.99	31,841,326.55
其他业务成本	注释53	1,507,657,152.42	1,224,223,343.33
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		710,532,080.73	148,815,883.75
加：营业外收入	注释54	18,736,381.72	5,860,453.04
减：营业外支出	注释55	11,053,100.46	10,645,944.64
四、利润总额（亏损以“-”号填列）		718,215,361.99	144,030,392.15
减：所得税费用	注释56	167,195,492.71	41,911,301.78
五、净利润（净亏以“-”号填列）		551,019,869.28	102,119,090.37
（一）按经营持续性分类			
持续经营净利润（净亏以“-”号填列）		551,019,869.28	102,119,090.37
终止经营净利润（净亏以“-”号填列）			
（二）按所有权归属分类			
归属于母公司所有者的净利润		513,210,337.25	104,302,038.78
少数股东损益		37,809,532.03	-2,182,948.41
六、其他综合收益的税后净额		-13,421,475.85	-23,994,465.35
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-13,421,475.85	-23,994,465.35
（一）不能重分类进损益的其他综合收益			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		-13,421,475.85	-23,994,465.35
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		-2,405,906.43	181,829.12
2. 其他债权投资公允价值变动		2,509,789.28	-59,904,500.70
3. 其他债权投资信用损失准备		-666,965.37	53,080,728.55
4. 外币财务报表折算差额		-12,858,393.33	-17,352,522.32
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		537,598,393.43	78,124,625.02
归属于母公司所有者的综合收益总额		499,788,861.40	80,307,573.43
归属于少数股东的综合收益总额		37,809,532.03	-2,182,948.41
八、每股收益：			
（一）基本每股收益		0.11	0.02
（二）稀释每股收益		0.11	0.02

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

合并现金流量表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注六	2021年度	2020年度
一、经营活动产生的现金流量：			
收取利息、手续费及佣金的现金		2,984,204,762.72	2,702,035,174.80
拆入资金净增加额			1,330,000,000.00
回购业务资金净增加额			3,480,155,509.95
返售业务资金净减少额		908,351,491.46	700,025,363.10
代理买卖证券收到的现金净额		2,016,567,261.23	1,660,163,609.91
收到其他与经营活动有关的现金	注释58	2,016,609,365.55	1,506,857,134.57
经营活动现金流入小计		7,925,732,880.96	11,379,236,792.33
交易性金融工具净增加额		1,336,048,752.31	4,504,583,697.73
拆入资金净减少额		790,000,000.00	
回购业务资金净减少额		1,652,086,917.38	
融出资金净增加额		738,220,210.20	1,622,093,003.66
支付利息、手续费及佣金的现金		768,512,368.10	688,281,627.02
支付给职工以及为职工支付的现金		1,139,438,589.33	850,448,240.88
支付的各项税费		471,594,792.58	244,373,933.87
支付其他与经营活动有关的现金	注释58	1,986,245,160.35	2,098,653,166.86
经营活动现金流出小计		8,882,146,790.25	10,008,433,670.02
经营活动产生的现金流量净额	注释59	-956,413,909.29	1,370,803,122.31
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资所收到的现金		1,326,111,871.62	
取得投资收益收到的现金		127,650,667.04	60,584,894.64
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		1,284,228.66	219,869.46
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		162,261,400.00	
投资活动现金流入小计		1,617,308,167.32	60,804,764.10
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		220,635,769.29	117,362,199.51
投资支付的现金			1,278,882,226.50
投资活动现金流出小计		220,635,769.29	1,396,244,426.01
投资活动产生的现金流量净额		1,396,672,398.03	-1,335,439,661.91
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			3,644,663,940.00
取得借款收到的现金		10,000,000.00	689,174,336.00
发行债券收到的现金		11,941,017,000.00	6,117,939,031.63
筹资活动现金流入小计		11,951,017,000.00	10,451,777,307.63
偿还债务支付的现金		9,983,292,940.64	8,366,714,808.43
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		678,187,191.34	476,776,544.21
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		22,110,119.80	6,634,020.00
支付其他与筹资活动有关的现金	注释58	173,628,888.72	133,454,629.51
筹资活动现金流出小计		10,835,109,020.70	8,976,945,982.15
筹资活动产生的现金流量净额		1,115,907,979.30	1,474,831,325.48
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		1,578,376.60	-3,348,221.20
五、现金及现金等价物净增加额	注释59	1,557,744,844.64	1,506,846,564.68
加：期初现金及现金等价物余额		13,312,322,291.24	11,805,475,726.56
六、期末现金及现金等价物余额		14,870,067,135.88	13,312,322,291.24

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

合并股东权益变动表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	2021年度						少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益							
	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		
一、上年年末余额	4,642,884,700.00	6,330,622,817.68	12,549,125.88	838,358,247.79	1,441,518,813.40	102,780,913.15	817,761,472.61	14,186,476,090.51
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年初余额	4,642,884,700.00	6,330,622,817.68	12,549,125.88	838,358,247.79	1,441,518,813.40	102,780,913.15	817,761,472.61	14,186,476,090.51
三、本年增减变动金额		-28,762,234.22	-13,421,475.85	70,154,182.46	92,727,042.68	192,471,032.31	-355,564,714.49	-42,396,167.11
(一) 综合收益总额			-13,421,475.85			513,210,337.25	37,809,532.03	537,598,393.43
(二) 股东投入和减少资本							-371,264,126.72	-371,264,126.72
1. 股东投入的普通股								
2. 其他权益工具持有者投入资本								
3. 股份支付计入股东权益的金额								
4. 其他							-371,264,126.72	-371,264,126.72
(三) 利润分配				70,154,182.46	111,601,092.06	-339,613,354.32	-22,110,119.80	-179,968,199.60
1. 提取盈余公积				70,154,182.46		-70,154,182.46		
2. 提取一般风险准备					111,601,092.06	-111,601,092.06		
3. 对股东的分配						-157,858,079.80	-22,110,119.80	-179,968,199.60
4. 其他								
(四) 股东权益内部结转								
1. 资本公积转增股本								
2. 盈余公积转增股本								
3. 盈余公积弥补亏损								
4. 其他								
(五) 其他		-28,762,234.22			-18,874,049.38	18,874,049.38		-28,762,234.22
四、本期末余额	4,642,884,700.00	6,301,860,583.46	-872,349.97	908,512,430.25	1,534,245,856.08	295,251,945.46	462,196,758.12	14,144,079,923.40

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

合并股东权益变动表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2020年度							少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益								
	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			
一、上年年末余额	3,869,070,700.00	3,487,237,785.96	36,543,591.23	808,084,287.96	1,382,038,921.28	88,232,726.32	826,578,441.02	10,497,786,453.77	
加：会计政策变更									
前期差错更正									
其他									
二、本年初余额	3,869,070,700.00	3,487,237,785.96	36,543,591.23	808,084,287.96	1,382,038,921.28	88,232,726.32	826,578,441.02	10,497,786,453.77	
三、本年增减变动金额	773,814,000.00	2,843,385,031.72	-23,994,465.35	30,273,959.83	59,479,892.12	14,548,186.83	-8,816,968.41	3,688,689,636.74	
(一) 综合收益总额			-23,994,465.35			104,302,038.78	-2,182,948.41	78,124,625.02	
(二) 股东投入和减少资本	773,814,000.00	2,843,315,826.36						3,617,129,826.36	
1. 股东投入的普通股	773,814,000.00	2,843,315,826.36						3,617,129,826.36	
2. 其他权益工具持有者投入资本									
3. 股份支付计入股东权益的金额									
4. 其他									
(三) 利润分配				30,273,959.83	59,479,892.12	-89,753,851.95	-6,634,020.00	-6,634,020.00	
1. 提取盈余公积				30,273,959.83		-30,273,959.83			
2. 提取一般风险准备					59,479,892.12	-59,479,892.12			
3. 对股东的分配							-6,634,020.00	-6,634,020.00	
4. 其他									
(四) 股东权益内部结转									
1. 资本公积转增股本									
2. 盈余公积转增股本									
3. 盈余公积弥补亏损									
4. 其他									
(五) 其他		69,205.36						69,205.36	
四、本期末余额	4,642,884,700.00	6,330,622,817.68	12,549,125.88	838,358,247.79	1,441,518,813.40	102,780,913.15	817,761,472.61	14,186,476,090.51	

法定代表人： 菅明军

主管会计工作负责人： 朱建民

总会计师： 李昭欣

会计机构负责人： 杨波

母公司资产负债表

2021年12月31日

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注十五	2021年12月31日	2020年12月31日
资产：			
货币资金		10,787,186,204.27	9,353,694,098.48
其中：客户资金存款		9,475,290,338.74	7,812,001,585.50
结算备付金		2,274,149,998.54	2,165,049,237.07
其中：客户备付金		2,066,846,823.76	2,005,804,519.95
融出资金		8,081,803,812.77	7,248,897,079.39
衍生金融资产		54,610.00	
存出保证金		259,267,830.02	368,868,430.71
应收款项		29,485,887.66	85,450,845.08
买入返售金融资产		972,870,075.44	2,055,165,080.52
金融投资：			
交易性金融资产		20,891,935,865.83	19,933,278,797.76
其他债权投资		970,426,547.78	2,088,805,149.07
长期股权投资	注释1	5,296,280,233.94	4,126,432,553.95
投资性房地产		24,748,699.56	25,858,938.87
固定资产		173,173,353.77	164,207,159.80
在建工程		58,641,526.64	52,427,024.00
使用权资产		142,506,224.38	133,127,127.62
无形资产		218,187,343.75	181,335,531.53
递延所得税资产		324,344,489.89	301,081,560.09
其他资产		232,547,711.06	523,400,315.46
资产总计		50,737,610,415.30	48,807,078,929.40

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

母公司资产负债表（续）

2021年12月31日

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注十五	2021年12月31日	2020年12月31日
负债：			
应付短期融资款		7,032,271,969.93	3,425,939,961.92
拆入资金		2,900,742,263.92	3,694,418,222.23
交易性金融负债			778,986,314.11
衍生金融负债		465,376.83	57,980.91
卖出回购金融资产款		10,448,272,328.09	12,002,208,194.73
代理买卖证券款		11,400,036,597.27	9,666,752,032.28
应付职工薪酬		719,713,530.83	517,314,154.75
应交税费		111,000,397.96	118,777,886.11
应付款项		116,166,224.28	60,063,783.40
合同负债		5,113,846.11	10,997,000.07
应付债券		3,685,225,541.41	4,610,250,342.02
租赁负债		140,244,474.29	129,412,235.14
递延所得税负债			
其他负债		122,760,647.36	47,982,898.50
负债合计		36,682,013,198.28	35,063,161,006.17
股东权益：			
股本		4,642,884,700.00	4,642,884,700.00
资本公积		6,606,160,370.84	6,606,160,370.84
其他综合收益		454,814.24	-1,388,009.67
盈余公积		908,512,430.25	838,358,247.79
一般风险准备		1,471,249,831.25	1,371,112,556.76
未分配利润		426,335,070.44	286,790,057.51
股东权益合计		14,055,597,217.02	13,743,917,923.23
负债和股东权益总计		50,737,610,415.30	48,807,078,929.40

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

母公司利润表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注十五	2021年度	2020年度
一、营业总收入		2,593,098,163.83	1,653,607,413.99
利息净收入	注释2	89,238,835.37	46,243,250.79
其中：利息收入		916,567,743.30	840,710,707.82
利息支出		827,328,907.93	794,467,457.03
手续费及佣金净收入	注释3	1,472,777,921.89	1,038,150,743.24
其中：经纪业务手续费净收入		716,344,816.88	686,071,935.92
投资银行业务手续费净收入		631,244,447.05	200,925,249.51
资产管理业务手续费净收入		25,029,916.17	39,325,418.37
投资收益（损失以“-”号填列）	注释4	932,957,257.98	631,253,436.58
其中：对联营企业和合营企业的投资收益			
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		76,803,683.45	-88,807,494.18
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-189,029.17	-646,160.05
其他业务收入		12,637,023.36	18,079,232.10
资产处置收益（损失以“-”号填列）		61,132.30	-20,667.36
其他收益		8,811,338.65	9,355,072.87
二、营业总支出		1,977,521,958.93	1,430,720,797.48
税金及附加		17,872,297.15	16,838,369.81
业务及管理费	注释5	1,576,873,987.71	1,149,447,203.93
信用减值损失		168,069,536.77	263,120,359.08
其他资产减值损失		213,448,720.01	
其他业务成本		1,257,417.29	1,314,864.66
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		615,576,204.90	222,886,616.51
加：营业外收入		3,658,099.45	2,410,755.63
减：营业外支出		9,320,144.10	7,004,959.37
四、利润总额（亏损以“-”号填列）		609,914,160.25	218,292,412.77
减：所得税费用		142,219,610.57	16,466,013.88
五、净利润（净亏以“-”号填列）		467,694,549.68	201,826,398.89
持续经营净利润（净亏以“-”号填列）		467,694,549.68	201,826,398.89
终止经营净利润（净亏以“-”号填列）			
六、其他综合收益的税后净额		1,842,823.91	-6,823,772.15
（一）不能重分类进损益的其他综合收益			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		1,842,823.91	-6,823,772.15
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		2,509,789.28	-59,904,500.70
3. 其他债权投资信用损失准备		-666,965.37	53,080,728.55
4. 外币财务报表折算差额			
七、综合收益总额		469,537,373.59	195,002,626.74

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

母公司现金流量表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	附注十五	2021年度	2020年度
一、经营活动产生的现金流量：			
收取利息、手续费及佣金的现金		2,684,051,065.52	2,447,542,230.21
拆入资金净增加额			1,330,000,000.00
回购业务资金净增加额			3,282,055,509.95
返售业务资金净减少额		907,551,491.46	693,725,172.41
代理买卖证券收到的现金净额		1,733,284,564.99	1,509,151,900.87
收到其他与经营活动有关的现金		496,123,169.74	47,039,557.07
经营活动现金流入小计		5,821,010,291.71	9,309,514,370.51
交易性金融工具净增加额		693,081,454.84	4,424,200,415.64
拆入资金净减少额		790,000,000.00	
回购业务资金净减少额		1,554,186,917.38	
融出资金净增加额		824,817,236.63	1,665,197,871.00
支付利息、手续费及佣金的现金		708,392,317.36	645,952,818.64
支付给职工以及为职工支付的现金		1,009,315,086.14	741,941,079.67
支付的各项税费		376,327,235.26	164,519,232.68
支付其他与经营活动有关的现金		85,303,833.01	708,719,319.40
经营活动现金流出小计		6,041,424,080.62	8,350,530,737.03
经营活动产生的现金流量净额	注释6	-220,413,788.91	958,983,633.48
二、投资活动产生的现金流量：			
取得投资收益收到的现金		105,906,962.38	105,550,982.70
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		620,291.60	165,683.59
投资活动现金流入小计		106,527,253.98	105,716,666.29
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		139,913,380.44	112,128,505.23
投资支付的现金		273,158,156.90	1,427,522,815.54
投资活动现金流出小计		413,071,537.34	1,539,651,320.77
投资活动产生的现金流量净额		-306,544,283.36	-1,433,934,654.48
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			3,644,663,940.00
取得借款收到的现金			300,000,000.00
发行债券收到的现金		11,941,017,000.00	5,400,203,000.00
筹资活动现金流入小计		11,941,017,000.00	9,344,866,940.00
偿还债务支付的现金		9,286,065,000.00	6,715,301,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		528,184,846.94	418,420,136.68
支付其他与筹资活动有关的现金		59,131,911.23	84,168,489.90
筹资活动现金流出小计		9,873,381,758.17	7,217,889,626.58
筹资活动产生的现金流量净额		2,067,635,241.83	2,126,977,313.42
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-189,029.17	-646,160.05
五、现金及现金等价物净增加额	注释6	1,540,488,140.39	1,651,380,132.37
加：期初现金及现金等价物余额		11,500,913,337.34	9,849,533,204.97
六、期末现金及现金等价物余额		13,041,401,477.73	11,500,913,337.34

法定代表人：菅明军

主管会计工作负责人：朱建民

总会计师：李昭欣

会计机构负责人：杨波

母公司股东权益变动表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	2021年度						
	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	股东权益合计
一、上年年末余额	4,642,884,700.00	6,606,160,370.84	-1,388,009.67	838,358,247.79	1,371,112,556.76	286,790,057.51	13,743,917,923.23
加：会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年初余额	4,642,884,700.00	6,606,160,370.84	-1,388,009.67	838,358,247.79	1,371,112,556.76	286,790,057.51	13,743,917,923.23
三、本年增减变动金额			1,842,823.91	70,154,182.46	100,137,274.49	139,545,012.93	311,679,293.79
（一）综合收益总额			1,842,823.91			467,694,549.68	469,537,373.59
（二）股东投入和减少资本							
1. 股东投入的普通股							
2. 其他权益工具持有者投入资本							
3. 股份支付计入股东权益的金额							
4. 其他							
（三）利润分配				70,154,182.46	100,137,274.49	-328,149,536.75	-157,858,079.80
1. 提取盈余公积				70,154,182.46		-70,154,182.46	
2. 提取一般风险准备					100,137,274.49	-100,137,274.49	
3. 对股东的分配						-157,858,079.80	-157,858,079.80
4. 其他							
（四）股东权益内部结转							
1. 资本公积转增股本							
2. 盈余公积转增股本							
3. 盈余公积弥补亏损							
4. 其他							
（五）其他							
四、本期末余额	4,642,884,700.00	6,606,160,370.84	454,814.24	908,512,430.25	1,471,249,831.25	426,335,070.44	14,055,597,217.02

法定代表人： 菅明军

主管会计工作负责人： 朱建民

总会计师： 李昭欣

会计机构负责人： 杨波

母公司股东权益变动表

2021年度

编制单位：中原证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	2020年度						
	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	股东权益合计
一、上年年末余额	3,869,070,700.00	3,762,844,544.48	5,435,762.48	808,084,287.96	1,315,470,752.11	170,879,423.10	9,931,785,470.13
加：会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年初余额	3,869,070,700.00	3,762,844,544.48	5,435,762.48	808,084,287.96	1,315,470,752.11	170,879,423.10	9,931,785,470.13
三、本年增减变动金额	773,814,000.00	2,843,315,826.36	-6,823,772.15	30,273,959.83	55,641,804.65	115,910,634.41	3,812,132,453.10
（一）综合收益总额			-6,823,772.15			201,826,398.89	195,002,626.74
（二）股东投入和减少资本	773,814,000.00	2,843,315,826.36					3,617,129,826.36
1. 股东投入的普通股	773,814,000.00	2,843,315,826.36					3,617,129,826.36
2. 其他权益工具持有者投入资本							
3. 股份支付计入股东权益的金额							
4. 其他							
（三）利润分配				30,273,959.83	55,641,804.65	-85,915,764.48	
1. 提取盈余公积				30,273,959.83		-30,273,959.83	
2. 提取一般风险准备					55,641,804.65	-55,641,804.65	
3. 对股东的分配							
4. 其他							
（四）股东权益内部结转							
1. 资本公积转增股本							
2. 盈余公积转增股本							
3. 盈余公积弥补亏损							
4. 其他							
（五）其他							
四、本期末余额	4,642,884,700.00	6,606,160,370.84	-1,388,009.67	838,358,247.79	1,371,112,556.76	286,790,057.51	13,743,917,923.23

法定代表人： 普明军

主管会计工作负责人： 朱建民

总会计师： 李昭欣

会计机构负责人： 杨波

中原证券股份有限公司

2021 年度财务报表附注

一、公司基本情况

(一) 公司历史沿革、组织形式和总部地址

中原证券股份有限公司（以下简称公司、本公司或本集团）系 2002 年 10 月 25 日，经中国证监会《关于同意中原证券股份有限公司开业的批复》（证监机构字[2002]326 号）批准，在河南财政证券公司、安阳市信托投资公司证券营业部合并重组的基础上，联合其他符合条件的公司增资扩股组建而成。公司于 2002 年 11 月 8 日在河南省工商行政管理局登记注册，注册资本人民币 103,379 万元。公司成立后根据中国证监会的开业批复，收购了原河南证券所属的证券营业部和证券服务部等证券类资产。

2008 年 1 月 15 日，经中国证监会核准，公司注册资本由人民币 103,379 万元变更为人民币 203,351.57 万元。

2008 年 6 月 10 日，中国证监会核准河南投资集团受让河南省建设投资总公司持有的公司 19,670.42 万股股份（占注册资本 9.673%）以及河南省经济技术开发公司持有的公司 71,525.36 万股股份（占注册资本 35.173%）。股权变更完成后，河南投资集团合计持有公司 91,195.78 万股股份（占公司注册资本的 44.846%）。

2011 年 9 月 22 日，中国证监会核准渤海产业投资基金管理有限公司（代表渤海产业投资基金）持有中原证券股份有限公司 5%以上股权的股东资格，并受让许继集团有限公司持有公司的 60,800 万股股份（占公司注册资本的 29.899%）。

2014 年 6 月 25 日，公司境外发行股份在香港联交所主板上市，股票简称：中州证券，股票代码：01375。根据国务院国有资产监督管理委员会《关于中原证券股份有限公司国有股权管理及国有股转持有关问题的批复》（国资产权[2013]1070 号），在本公司完成该次发行后，国有股东河南投资集团、安钢集团、平煤神马、安阳经开、江苏苏豪、神火集团、焦作经开、深圳广晟和鹤壁建投分别将其持有的 40,994,778 股、8,842,345 股、3,738,231 股、2,432,074 股、1,348,575 股、884,166 股、678,113 股、449,525 股和 442,193 股股份划转给全国社会保障基金理事会持有，上述 9 家划转由全国社会保障基金理事会持有的股份合计 59,810,000 股。2014 年 10 月 28 日，公司在河南省工商行政管理局办理完成注册资本的工商变更登记，注册资本增加至人民币 2,631,615,700 元。

2015年8月3日，公司完成非公开发行H股股票592,119,000股，每股面值人民币1元，发行价格为每股H股港币4.28元。2015年8月14日，公司在河南省工商行政管理局办理完成注册资本的工商变更登记，注册资本增加至人民币3,223,734,700元。

2016年11月18日，公司发行人民币普通股不超过700,000,000股，每股面值人民币1元。根据《境内证券市场转持部分国有股充实全国社会保障基金实施办法》（财企[2009]94号）和河南省国资委《关于中原证券股份有限公司发行A股国有股权管理方案及国有股转持的批复》（豫国资产权[2015]26号），按本次发行700,000,000股计算，国有股东河南投资集团、安钢集团、平煤神马、安阳经开、江苏苏豪、神火集团、焦作经开、深圳广晟和鹤壁建投分别将其持有的47,979,175股、10,348,840股、4,375,124股、2,846,433股、1,578,336股、1,034,804股、793,645股、526,112股和517,531股股份划转给全国社会保障基金理事会持有，上述9家划转由全国社会保障基金理事会持有的股份合计70,000,000股。

2017年1月3日，公司A股在上交所挂牌上市。

2018年2月12日起，公司通过场内股份回购的形式回购部分H股股票。公司累计回购H股54,664,000股。2018年7月11日，公司完成工商变更登记手续，并取得了河南省工商行政管理局换发的《营业执照》，公司注册资本变更为人民币3,869,070,700元。

2020年7月30日，公司完成非公开发行A股股票773,814,000股，每股面值人民币1元，发行价格为每股A股人民币4.71元。2020年9月4日，公司在河南省工商行政管理局办理完成注册资本的工商变更登记，注册资本增加至人民币4,642,884,700元。

公司现持有统一社会信用代码为91410000744078476K的营业执照。

截止2021年12月31日，本公司累计发行股本总数464,288.47万股，注册资本为464,288.47万元，注册地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路10号，总部地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路10号，母公司为河南投资集团有限公司，公司实际控制人为河南省财政厅。

截止2021年12月31日，公司设立了30家分公司及83家证券营业部，均为经批准设立的分公司及证券营业部。

（二）公司业务性质和主要经营活动

公司属金融行业，本公司及子公司（以下简称“本集团”）的主要经营业务包括：证券经纪业务（证券经纪、财富管理以及分销金融产品）、投资银行业务（股权融资及财务顾问以及债券融资）、信用业务（融资融券业务、股票质押式回购业务及约定购回式证券交易业务）、投资管理业务（资产管理、直接投资以及基金管理）、期货业务、自营业务、境外业务、总部及其他业务（新三板做市业务、小额贷款¹、创新业务、股权交易中心以及研究业务）。

（三）财务报表的批准报出

¹ 如本附注七、合并范围的变更所述，2021年度公司通过处置部分股权，丧失对河南省中原小额贷款有限公司的控制权，丧失控制权日为2021年12月31日，2021年度公司主要经营活动仍包括小额贷款。

本财务报表业经公司董事会于 2022 年 3 月 25 日批准报出。

二、合并财务报表范围

本期纳入合并财务报表范围的子公司共 14 户，具体包括：

子公司名称	子公司类型	级次	持股比例（%）	表决权比例（%）
中原期货股份有限公司	控股子公司	2	51.36	51.36
豫新投资管理（上海）有限公司	控股子公司	3	51.36	51.36
中鼎开源创业投资管理有限公司	全资子公司	2	100.00	100.00
河南中证开元私募基金管理有限公司	控股子公司	3	60.00	60.00
中州蓝海投资管理有限公司	全资子公司	2	100.00	100.00
中原股权交易中心股份有限公司	控股子公司	2	35.00	51.00
中州国际金融控股有限公司	全资子公司	2	100.00	100.00
中州国际控股有限公司	全资子公司	3	100.00	100.00
中州国际金融集团股份有限公司	全资子公司	3	100.00	100.00
中州国际融资有限公司	全资子公司	3	100.00	100.00
中州国际证券有限公司	全资子公司	3	100.00	100.00
中州国际投资有限公司	全资子公司	3	100.00	100.00
中州国际期货有限公司	全资子公司	3	100.00	100.00
Wending Zhongyuan Company Limited	全资子公司	3	100.00	100.00

子公司的持股比例不同于表决权比例的原因、以及持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位的依据说明详见“附注八、在其他主体中的权益（一）在子公司中权益”。

纳入合并范围的结构化主体详见“附注八、在其他主体中的权益（一）在子公司中权益”。

本期纳入合并财务报表范围的主体较上期相比，减少 4 户，合并范围变更主体的具体信息详见附注七、合并范围的变更。

三、财务报表的编制基础

（一）财务报表的编制基础

本公司根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和具体企业会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）进行确认和计量，在此基础上，结合中国证券监督管理委员会《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）、香港联合交易所《上市规则》、《香港公司条例》的披露规定，编制财务报表。

（二）持续经营

本公司对报告期末起 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或情况。因此，本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

（三）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。

四、重要会计政策、会计估计

(一) 具体会计政策和会计估计提示

公司根据实际生产经营特点制定的具体会计政策和会计估计包括客户交易结算资金、金融工具、证券承销业务、受托资产管理业务、融资融券业务、买入返售与卖出回购款项、收入确认等。

(二) 遵循企业会计准则的声明

本公司所编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了报告期公司的财务状况、经营成果、现金流量等有关信息。

(三) 会计期间

自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止为一个会计年度。

(四) 营业周期

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

(五) 记账本位币

采用人民币为记账本位币，境外子公司以其经营所处的主要经济环境中的货币为记账本位币，编制财务报表时折算为人民币。

(六) 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

1. 分步实现企业合并过程中的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理

- (1) 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；
- (2) 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；
- (3) 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；
- (4) 一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

2. 同一控制下的企业合并

本公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日在被合并方资产、负债（包括最终控制方收购被合并方而形成的商誉）在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。在合并中取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。

如果存在或有对价并需要确认预计负债或资产，该预计负债或资产金额与后续或有对价结算金额的差额，调整资本公积（资本溢价或股本溢价），资本公积不足的，调整留存收益。

对于通过多次交易最终实现企业合并的，属于一揽子交易的，将各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理；不属于一揽子交易的，在取得控制权日，长期股权投资初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，

调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。对于合并日之前持有的股权投资，因采用权益法核算或金融工具确认和计量准则核算而确认的其他综合收益，暂不进行会计处理，直至处置该项投资时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；因采用权益法核算而确认的被投资单位净资产中除净损益、其他综合收益和利润分配以外的所有者权益其他变动，暂不进行会计处理，直至处置该项投资时转入当期损益。

3. 非同一控制下的企业合并

购买日是指本公司实际取得对被购买方控制权的日期，即被购买方的净资产或生产经营决策的控制权转移给本公司的日期。同时满足下列条件时，本公司一般认为实现了控制权的转移：

- ①企业合并合同或协议已获本公司内部权力机构通过。
- ②企业合并事项需要经过国家有关主管部门审批的，已获得批准。
- ③已办理了必要的财产权转移手续。
- ④本公司已支付了合并价款的大部分，并且有能力、有计划支付剩余款项。
- ⑤本公司实际上已经控制了被购买方的财务和经营政策，并享有相应的利益、承担相应的风险。

本公司在购买日对作为企业合并对价付出的资产、发生或承担的负债按照公允价值计量，公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。

本公司对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；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差额，经复核后，计入当期损益。

通过多次交换交易分步实现的非同一控制下企业合并，属于一揽子交易的，将各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理；不属于一揽子交易的，合并日之前持有的股权投资采用权益法核算的，以购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和，作为该项投资的初始投资成本；购买日之前持有的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在处置该项投资时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。合并日之前持有的股权投资采用金融工具确认和计量准则核算的，以该股权投资在合并日的公允价值加上新增投资成本之和，作为合并日的初始投资成本。原持有股权的公允价值与账面价值之间的差额以及原计入其他综合收益的累计公允价值变动应全部转入合并日当期的投资收益。

4. 为合并发生的相关费用

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直接相关费用，于发生时计入当期损益；为企业合并而发行权益性证券的交易费用，可直接归属于权益性交易的从权益中扣减。

(七) 合并财务报表的编制方法

1. 合并范围

本公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，所有子公司（包括本公司所控制的单独主体）均纳入合并财务报表。

2. 合并程序

本公司以自身和各子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，编制合并财务报表。本公司编制合并财务报表，将整个企业集团视为一个会计主体，依据相关企业会计准则的确认、计量和列报要求，按照统一的会计政策，反映本企业集团整体财务状况、经营成果和现金流量。

所有纳入合并财务报表合并范围的子公司所采用的会计政策、会计期间与本公司一致，如子公司采用的会计政策、会计期间与本公司不一致的，在编制合并财务报表时，按本公司的会计政策、会计期间进行必要的调整。

合并财务报表时抵销本公司与各子公司、各子公司相互之间发生的内部交易对合并资产负债表、合并利润表、合并现金流量表、合并股东权益变动表的影响。如果站在企业集团合并财务报表角度与以本公司或子公司为会计主体对同一交易的认定不同时，从企业集团的角度对该交易予以调整。

子公司所有者权益、当期净损益和当期综合收益中属于少数股东的份额分别在合并资产负债表中所有者权益项目下、合并利润表中净利润项目下和综合收益总额项目下单独列示。子公司少数股东分担的当期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份额而形成的余额，冲减少数股东权益。

对于同一控制下企业合并取得的子公司，以其资产、负债（包括最终控制方收购该子公司而形成的商誉）在最终控制方财务报表中的账面价值为基础对其财务报表进行调整。

对于非同一控制下企业合并取得的子公司，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其财务报表进行调整。

（1）增加子公司或业务

在报告期内，若因同一控制下企业合并增加子公司或业务的，则调整合并资产负债表的期初数；将子公司或业务合并当期期初至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；将子公司或业务合并当期期初至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表，同时对比较报表的相关项目进行调整，视同合并后的报告主体自最终控制方开始控制时点起一直存在。

因追加投资等原因能够对同一控制下的被投资方实施控制的，视同参与合并的各方在最终控制方开始控制时即以目前的状态存在进行调整。在取得被合并方控制权之前持有的股权投资，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一控制之日孰晚日起至合并日之间已确认有关损益、其他综合收益以及其他净资产变动，分别冲减比较报表期间的期初留存收益或当期损益。

在报告期内，若因非同一控制下企业合并增加子公司或业务的，则不调整合并资产负债表期初数；将该子公司或业务自购买日至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司或业务自购买日至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表。

因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资方实施控制的，对于购买日之前持有的被购买方的股权，本公司按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益。购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益以及除净损益、其他综合收益和利润分配之外的其他所有者权益变动的，与其相关的其他综合收益、其他所有

者权益变动转为购买日所属当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

(2) 处置子公司或业务

1) 一般处理方法

在报告期内，本公司处置子公司或业务，则该子公司或业务期初至处置日的收入、费用、利润纳入合并利润表；该子公司或业务期初至处置日的现金流量纳入合并现金流量表。

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对被投资方控制权时，对于处置后的剩余股权投资，本公司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有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产的份额与商誉之和的差额，计入丧失控制权当期的投资收益。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益或除净损益、其他综合收益及利润分配之外的其他所有者权益变动，在丧失控制权时转为当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

2) 分步处置子公司

通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，通常表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：

- A. 这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；
- B. 这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；
- C. 一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；
- D. 一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易属于一揽子交易的，本公司将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易不属于一揽子交易的，在丧失控制权之前，按不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资的相关政策进行会计处理；在丧失控制权时，按处置子公司一般处理方法进行会计处理。

(3) 购买子公司少数股权

本公司因购买少数股权新取得的长期股权投资与按照新增持股比例计算应享有子公司自购买日（或合并日）开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整合并资产负债表中的资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。

(4) 不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的股权投资

在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的长期股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整合并资产负债表中的资本公积中的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。

(八) 现金及现金等价物的确定标准

在编制现金流量表时，将本公司库存现金以及可以随时用于支付的存款确认为现金。将同时具备期限短（一般从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知金额的现金、价值变动风险很小四个条件的投资，确定为现金等价物。

(九) 外币业务和外币报表折算

1. 外币业务

外币业务交易在初始确认时，采用交易发生日的即期汇率作为折算汇率折合成人民币记账。

资产负债表日，外币货币性项目按资产负债表日即期汇率折算，由此产生的汇兑差额，除属于与购建符合资本化条件的资产相关的外币专门借款产生的汇兑差额按照借款费用资本化的原则处理外，均计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其记账本位币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，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。

2. 外币财务报表的折算

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

处置境外经营时，将资产负债表中其他综合收益项目中列示的、与该境外经营相关的外币财务报表折算差额，自其他综合收益项目转入处置当期损益；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。

(十) 金融工具

在本公司成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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）。

1. 金融资产分类和计量

本公司根据所管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以下三类：

- （1）以摊余成本计量的金融资产。
- （2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。
- （3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融资产的分类取决于本集团管理该资产的业务模式及该资产的现金流量特征。

业务模式反映了本集团如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本集团所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本集团在确定一组金融资产业务模式时考虑的因素包括：以往如何收取该组资产的现金流、该组资产的业绩如何评估并上报给关键管理人员、风险如何评估和管理以及业务管理人员获得报酬的方式等。

金融资产的合同现金流量特征，是指金融工具合同约定的、反映相关金融资产经济特征的现金流量属性。与基本借贷安排相一致的合同现金流量特征指相关金融工具在特定日期产生的合同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。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。本集团分类为以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具），其合同现金流量特征与基本借贷安排相一致。

本集团改变其管理金融资产的业务模式时，将对所有受影响的相关金融资产进行重分类，且自重分类日起采用未来适用法进行相关会计处理，不得对以前已经确认的利得、损失（包括减值损失或利得）或利息进行追溯调整。重分类日，是指导致本集团对金融资产进行重分类的业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天。

本集团对债务工具资产和权益工具资产的分类具体如下：

① 债务工具

债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具。本集团基于管理金融资产的业务模式及金融资产的合同现金流量特征，将债务工具划分为以下三种计量类别：

以摊余成本计量：如果本集团管理该金融资产是以收取合同现金流量为目标，且该金融资产的合同现金流量仅为对本金和利息的支付，同时并未指定该资产为以公允价值计量且其变动计入损益，那么该金融资产按照摊余成本计量。

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益：如果本集团管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流为目标又以出售该金融资产为目标，该金融资产的合同现金流量仅为对本金和利息的支付，同时并未指定该资产为以公允价值计量且其变动计入损益，那么该金融资产按照公允价值计量且其变动计入其他综合收益核算。

以公允价值计量且其变动计入损益：对于不满足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条件的资产，本集团将其计入以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产。

此外，在初始确认时如果能够消除或显著减少会计错配，本集团可以将金融资产指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。该指定一经作出，不得撤销。

② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。在同时满足下列条件的情况下，本集团持有的金融资产属于权益工具：

a. 该金融工具应当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；

b. 将来须用或可用发行人自身权益工具结算该金融工具。如为非衍生工具，该金融工具应当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，发行人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。

本集团的权益工具投资全部分类为以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产，但管理层已做出不可撤销指定为公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产除外。本集团对上述指定的政策为，将不以取得投资收益为目的的权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益。

对于含嵌入式衍生工具的金融资产，在确定合同现金流量是否仅为对本金和利息支付时，将其作为一个整体进行分析。

2. 金融负债分类和计量

本集团将金融负债分类为以摊余成本计量的负债，但以下情况除外：

①以公允价值计量且其变动计入损益的金融负债：包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）以及初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入损益的金融负债。

②由于金融资产转让不符合终止确认条件或应用继续涉入法进行核算而确认的金融负债。当该转让不符合终止确认条件时，本集团根据该转让收取的对价确认金融负债，并在后续期间确认因该负债产生的所有费用。

③财务担保合同和贷款承诺。

3. 金融工具的后续计量

①以摊余成本计量的金融资产或负债

金融资产或负债的摊余成本以该金融资产或金融负债的初始确认金额经下列调整确定：a. 扣除已偿还的本金；b. 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；c. 扣除计提的累计信用减值准备（仅适于金融资产）。

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，本集团将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，但不应当考虑预期信用损失。

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，但下列情况除外：①对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入；②对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产的摊余成本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，应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。

②以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

债务工具：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资产所产生的利得或损失，除减值损失或利得和汇兑损益外，均计入其他综合收益，直至该金融资产终止确认或被重分类。但是采用实际利率法计算的该金融资产利息计入当期损益。该类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应当从其他综合收益中转出，计入当期损益。

权益工具：将非交易性权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的，该金融资产的公允价值变动均计入其他综合收益。当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应当从其他综合收益中转出，计入留存收益。作为投资回报的股利收入在本集团确定对其收取的权利成立时进行确认并计入当期损益。企业只有在同时符合下列条件时，才能确认股利收入并计入当期损益：①企业收取股利的权利已经确立；②与股利相关的经济利益很可能流入企业；③股利的金额能够可靠计量。

③以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或负债

本集团将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的利得或损失计入当期损益，除非该金融资产或金融负债属于下列情形之一：

a. 属于《企业会计准则第 24 号——套期会计》规定的套期关系的一部分。

b. 是一项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，且按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》第六十八条规定，该负债由本集团自身信用风险变动引起的其公允价值变动应当计入其他综合收益。该金融负债的其他公允价值变动计入当期损益。该金融负债终止确认时，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。

4. 金融资产的减值

本集团以预期信用损失为基础，对下列金融资产进行减值会计处理并确认损失准备：

①以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资；

②租赁应收款；

③合同资产；

④本集团发行的分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的贷款承诺和满足一定条件的财务担保合同。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本集团按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于本集团购买或源生的已发生信用减值的金融资产，应按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

本集团结合前瞻性信息进行预期信用损失评估，并在每个资产负债表日确认相关的损失准备。对预期信用损失的计量反映了以下各种要素：①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；②货币时间价值；③在资产负债表日无需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。

对于纳入预期信用损失计量的金融工具，本集团评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加，运用“三阶段”减值模型分别计量其损失准备、确认预期信用损失：

第1阶段：如果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；

第2阶段：如果该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，但并未将其视为已发生信用减值，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；

第3阶段：对于已发生信用减值的金融工具，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。

本集团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，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本集团考虑无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。本集团考虑的信息包括：

- 债务人未能按合同到期日支付本金和利息的情况；
- 已发生的或预期的金融工具的外部或内部信用评级（如有）的严重恶化；
- 已发生的或预期的债务人经营成果的严重恶化；
- 现存的或预期的技术、市场、经济或法律环境变化，并将对债务人对本集团的还款能力产生重大不利影响。

根据金融工具的性质，本集团以单项金融工具或金融工具组合为基础评估信用风险是否显著增加。以金融工具组合为基础进行评估时，本集团可基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，例如逾期信息和信用风险评级。如果逾期超过 30 日，本集团确定金融工具的信用风险已经显著增加。

本集团在资产负债表日评估以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资是否已发生信用减值。当对金融资产预期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；
- 本集团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。

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资，在其他综合收益中确认其损失准备，并将减值损失或利得计入当期损益，且不应减少该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

在上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的，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。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，本集团在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。在每个资产负债表日，本集团将整个存续期内预期信用损失的变动金额作为减值损失或利得计入当期损益。

关于本集团对信用风险显著增加判断标准、已发生信用减值资产的定义、预期信用损失计量的假设等披露参见附注九、（一）。

5. 金融资产转移的确认依据和计量方法

金融资产满足下列条件之一的，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，且公司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，虽然公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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，且未放弃对该金融资产控制的，则按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产的账面价值，与因转移而收到的对价及原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和的差额计入当期损益。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将因转移而收到的对价及应分摊至终止确认部分的原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和，与分摊的前述账面金额的差额计入当期损益。

6. 金融资产和金融负债的公允价值确定方法

1) 金融工具存在活跃市场的，活跃市场中的市场报价用于确定其公允价值。在活跃市场上，公司已持有的金融资产或拟承担的金融负债以现行出价作为相应资产或负债的公允价值；公司拟购入的金融资产或已承担的金融负债以现行要价作为相应资产或负债的公允价值。金融资产或金融负债没有现行出价和要价，但最近交易日后经济环境没有发生重大变化的，则采用最近交易的市场报价确定该金融资产或金融负债的公允价值。最近交易日后经济环境发生了重大变化时，参考类似金融资产或金融负债的现行价格或利率，调整最近交易的市场报价，以确定该金融资产或金融负债的公允价值。公司有足够的证据表明最近交易的市场报价不是公允价值的，对最近交易的市场报价作出适当调整，以确定该金融资产或金融负债的公允价值。

2) 金融工具不存在活跃市场的，采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融资产的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

(十一) 融资融券业务核算办法

融资融券业务是指公司向客户出借资金供其买入证券或者出借证券供其卖出，并由客户交存相应担保物的经营活动。融资融券业务，分为融资业务和融券业务两类。

公司融出的资金，确认应收债权，并确认相应利息收入。公司融出资金减值准备参照金融资产减值中以摊余成本计量的金融资产确认，详见本附注四/（十）4. 金融资产的减值。

公司融出的证券，不终止确认该证券，并确认相应利息收入。

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

(十二) 客户交易结算资金

客户交易结算资金与公司自有资金分开核算，并在“货币资金”等项目中单设明细科目核算，公司代理客户买卖证券收到的客户交易结算资金全额存入公司指定的银行账户，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。公司接受客户委托通过证券交易所代理买卖证券，与客户清算时如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额，按清算日买卖证券成交价的差额，加代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费减少客户交易结算资金；如买入证券成交总额小于卖出证券成交总额，按清算日买卖证券成交价的差额，减代扣代缴的印花税和应向客户收取的佣金等手续费增加客户交易结算资金。公司代理客户买卖证券的手续费收入，在与客户办理上述买卖证券款项清算时确认收入。公司向客户统一结息，增加客户交易结算资金。

(十三) 买入返售和卖出回购业务核算办法

买入返售交易按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括债券及票据等），合同或协议到期日再以约定价格返售相同之金融产品。买入返售按买入返售相关资产时实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”列示。

卖出回购交易按照合同或协议，以一定的价格将相关的资产（包括债券和票据等）出售给交易对手，到合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。卖出回购按卖出回购相关资产时实际收到的款项入账，在资产负债表“卖出回购金融资产款”列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内，并按照相关的会计政策核算。

买入返售及卖出回购的利息收支，在返售或回购期间内以实际利率确认。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收支。

本公司股票质押式回购业务根据合约的履约保障比例的情况，充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况等因素，设置不同的预警线和平仓线，其中平仓线一般不低于 130%。

（1）对于维持担保比例大于平仓线且未逾期的股票质押式回购业务，划分为“阶段一”；

（2）对于维持担保比例大于 100%，小于等于平仓线的股票质押式回购业务，或者本金或利息发生逾期，且逾期天数小于 90 日，划分为“阶段二”；

（3）对于维持担保比例小于等于 100%的股票质押式回购业务，或者本金或利息发生逾期，且逾期天数超过 90 日，划分为“阶段三”。

对于阶段一和阶段二的上述金融资产，本公司运用包含违约概率、违约损失率及信用风险敞口等关键参数的风险参数模型法评估减值准备；对于阶段三已发生信用减值的上述金融资产，管理层考虑了前瞻性因素，通过预估未来与该金融资产相关的现金流，计提相应的减值准备。本公司计算违约损失率考虑的主要因素有：担保品的市值、可变现能力及处置周期，融资人的信用状况及还款能力等。

其他买入返售金融资产的减值准备计提参见本附注四 / （十）4. 金融资产的减值。

（十四）其他债权投资

本公司对其他债权投资的预期信用损失的确定方法及会计处理方法详见本附注四 / （十）4. 金融资产的减值。

（十五）长期股权投资

1. 初始投资成本的确定

（1）企业合并形成的长期股权投资，具体会计政策详见本附注四 / （六）同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法。

（2）其他方式取得的长期股权投资

以支付现金方式取得的长期股权投资，按照实际支付的购买价款作为初始投资成本。初始投资成本包括与取得长期股权投资直接相关的费用、税金及其他必要支出。

以发行权益性证券取得的长期股权投资，按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本；发行或取得自身权益工具时发生的交易费用，可直接归属于权益性交易的从权益中扣减。

在非货币性资产交换具备商业实质和换入资产或换出资产的公允价值能够可靠计量的前提下，非货币性资产交换换入的长期股权投资以换出资产的公允价值为基础确定其初始投资成本，除非有确凿证据表明换入资产的公允价值更加可靠；不满足上述前提的非货币性资产交换，以换出资产的账面价值和应支付的相关税费作为换入长期股权投资的初始投资成本。

通过债务重组取得的长期股权投资，其初始投资成本按照公允价值为基础确定。

2. 后续计量及损益确认

（1）成本法

本公司能够对被投资单位实施控制的长期股权投资采用成本法核算，并按照初始投资成本计价，追加或收回投资调整长期股权投资的成本。

除取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润外，本公司按照享有被投资单位宣告分派的现金股利或利润确认为当期投资收益。

（2）权益法

本公司对联营企业和合营企业的长期股权投资采用权益法核算；对于其中一部分通过风险投资机构、共同基金、信托公司或包括投连险基金在内的类似主体间接持有的联营企业的权益性投资，采用公允价值计量且其变动计入损益。

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差额，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差额，计入当期损益。

本公司取得长期股权投资后，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；并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所有者权益。

本公司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。本公司与联营企业、合营企业之间发生的未实现内部交易损益按照应享有的比例计算归属于本公司的部分予以抵销，在此基础上确认投资损益。

本公司确认应分担被投资单位发生的亏损时，按照以下顺序进行处理：首先，冲减长期股权投资的账面价值。其次，长期股权投资的账面价值不足以冲减的，以其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益账面价值为限继续确认投资损失，冲减长期应收项目等的账面价值。最后，经过上

述处理，按照投资合同或协议约定企业仍承担额外义务的，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盈利的，公司在扣除未确认的亏损分担额后，按与上述相反的顺序处理，减记已确认预计负债的账面余额、恢复其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益及长期股权投资的账面价值后，恢复确认投资收益。

3. 长期股权投资核算方法的转换

(1) 公允价值计量转权益法核算

本公司原持有的对被投资单位不具有控制、共同控制或重大影响的按金融工具确认和计量准则进行会计处理的权益性投资，因追加投资等原因能够对被投资单位施加重大影响或实施共同控制但不构成控制的，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》确定的原持有的股权投资的公允价值加上新增投资成本之和，作为改按权益法核算的初始投资成本。

按权益法核算的初始投资成本小于按照追加投资后全新的持股比例计算确定的应享有被投资单位在追加投资日可辨认净资产公允价值份额之间的差额，调整长期股权投资的账面价值，并计入当期营业外收入。

(2) 公允价值计量或权益法核算转成本法核算

本公司原持有的对被投资单位不具有控制、共同控制或重大影响的按金融工具确认和计量准则进行会计处理的权益性投资，或原持有对联营企业、合营企业的长期股权投资，因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的，在编制个别财务报表时，按照原持有的股权投资账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

购买日之前持有的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在处置该项投资时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。

购买日之前持有的股权投资按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定进行会计处理的，原计入其他综合收益的累计公允价值变动在改按成本法核算时转入当期损益。

(3) 权益法核算转公允价值计量

本公司因处置部分股权投资等原因丧失了对被投资单位的共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权改按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》核算，其在丧失共同控制或重大影响之日的公允价值与账面价值之间的差额计入当期损益。

原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在终止采用权益法核算时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。

(4) 成本法转权益法

本公司因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位的控制的，在编制个别财务报表时，处置后的剩余股权能够对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，改按权益法核算，并对该剩余股权视同自取得时即采用权益法核算进行调整。

(5) 成本法转公允价值计量

本公司因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位的控制的，在编制个别财务报表时，处置后的剩余股权不能对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，改按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定进行会计处理，其在丧失控制之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。

4. 长期股权投资的处置

处置长期股权投资，其账面价值与实际取得价款之间的差额，应当计入当期损益。采用权益法核算的长期股权投资，在处置该项投资时，采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础，按相应比例对原计入其他综合收益的部分进行会计处理。

处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：

这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；

这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；

一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；

一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

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，不属于一揽子交易的，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

(1) 在个别财务报表中，对于处置的股权，其账面价值与实际取得价款之间的差额计入当期损益。处置后的剩余股权能够对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，改按权益法核算，并对该剩余股权视同自取得时即采用权益法核算进行调整；处置后的剩余股权不能对被投资单位实施共同控制或施加重大影响的，改按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定进行会计处理，其在丧失控制之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。

(2) 在合并财务报表中，对于在丧失对子公司控制权以前的各项交易，处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产份额之间的差额，调整资本公积（股本溢价），资本公积不足冲减的，调整留存收益；在丧失对子公司控制权时，对于剩余股权，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有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等，在丧失控制权时转为当期投资收益。

处置对子公司股权投资直至丧失控制权的各项交易属于一揽子交易的，将各项交易作为一项处置子公司股权投资并丧失控制权的交易进行会计处理，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

(1) 在个别财务报表中，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置的股权对应的长期股权投资账面价值之间的差额，确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

(2) 在合并财务报表中，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

5. 共同控制、重大影响的判断标准

如果本公司按照相关约定与其他参与方集体控制某项安排，并且对该安排回报具有重大影响的活动决策，需要经过分享控制权的参与方一致同意时才存在，则视为本公司与其他参与方共同控制某项安排，该安排即属于合营安排。

合营安排通过单独主体达成的，根据相关约定判断本公司对该单独主体的净资产享有权利时，将该单独主体作为合营企业，采用权益法核算。若根据相关约定判断本公司并非对该单独主体的净资产享有权利时，该单独主体作为共同经营，本公司确认与共同经营利益份额相关的项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理。

重大影响，是指投资方对被投资单位的财务和经营政策有参与决策的权力，但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。本公司通过以下一种或多种情形，并综合考虑所有事实和情况后，判断对被投资单位具有重大影响：（1）在被投资单位的董事会或类似权力机构中派有代表；（2）参与被投资单位财务和经营政策制定过程；（3）与被投资单位之间发生重要交易；（4）向被投资单位派出管理人员；（5）向被投资单位提供关键技术资料。

(十六) 投资性房地产

投资性房地产包括已出租的建筑物。

公司投资性房地产按其成本作为入账价值，外购投资性房地产的成本包括购买价款、相关税费和可直接归属于该资产的其他支出；自行建造投资性房地产的成本，由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成。

公司对投资性房地产采用成本模式进行后续计量，按其预计使用寿命及净残值率采用平均年限法计提折旧或摊销。

公司投资性房地产的预计使用寿命、净残值率及年折旧率如下：

类别	预计使用寿命（年）	预计净残值率（%）	年折旧（摊销）率（%）
营业用房屋	40.00	5.00	2.38

当投资性房地产的用途改变为自用时，则自改变之日起，将该投资性房地产转换为固定资产或无形资产。自用房地产的用途改变为赚取租金或资本增值时，则自改变之日起，将固定资产或无形资产转换为投资性房地产。发生转换时，以转换前的账面价值作为转换后的入账价值。

当投资性房地产被处置，或者永久退出使用且预计不能从其处置中取得经济利益时，终止确认该项投资性房地产。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金额计入当期损益。

(十七) 固定资产

固定资产是指同时具有以下特征，即为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的，使用年限超过一年，单位价值在 2,000.00 元以上的有形资产。

固定资产包括营业用房屋、非营业用房屋、简易房、建筑物、机器设备、动力设备、交通运输设备、电子设备、通讯设备、电器设备、安全防卫设备、办公设备，按其取得时的成本作为入账的价值，其中，外购的固定资产成本包括买价和进口关税等相关税费，以及为使固定资产达到预定可使用状态前所发生的可直接归属于该资产的其他支出；自行建造固定资产的成本，由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成；投资者投入的固定资产，按投资合同或协议约定的价值作为入账价值，但合同或协议约定价值不公允的按公允价值入账。

与固定资产有关的后续支出，包括修理支出、更新改造支出等，符合固定资产确认条件的，计入固定资产成本，对于被替换的部分，终止确认其账面价值；不符合固定资产确认条件的，于发生时计入当期损益。

除已提足折旧仍继续使用的固定资产和单独计价入账的土地外，本集团对所有固定资产计提折旧。计提折旧时采用年限平均法，并根据用途分别计入相关资产的成本或当期费用。

固定资产的分类折旧年限、预计净残值率、折旧率如下：

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率（%）	年折旧率（%）
营业用房屋	年限平均法	40.00	5.00	2.38
非营业用房屋	年限平均法	35.00	5.00	2.71
简易房	年限平均法	5.00	5.00	19.00
建筑物	年限平均法	20.00	5.00	4.75
机械设备	年限平均法	10.00	5.00	9.50
动力设备	年限平均法	15.00	5.00	6.33
通讯设备	年限平均法	5.00	5.00	19.00
电子设备	年限平均法	5.00	5.00	19.00
电器设备	年限平均法	5.00	5.00	19.00
安全防卫设备	年限平均法	5.00	5.00	19.00
办公设备	年限平均法	5.00	5.00	19.00
其他运输设备	年限平均法	8.00	5.00	11.88

本集团于每年年度终了，对固定资产的预计使用寿命、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。

当固定资产被处置、或者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金额计入当期损益。

(十八) 在建工程

1. 在建工程初始计量

本公司自行建造的在建工程按实际成本计价，实际成本由建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的必要支出构成，自营建筑工程按直接材料、直接工资、直接施工费等计量；出包建筑工程按应支付的工程价款等计量；设备安装工程按所安装设备的价值、安装费用、工程试运转等所发生的支出等确定工程成本。在建工程成本还包括应当资本化的借款费用和汇兑损益。

2. 在建工程结转为固定资产的标准和时点

在建工程项目按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的全部支出，作为固定资产的入账价值。所建造的在建工程已达到预定可使用状态，但尚未办理竣工决算的，自达到预定可使用状态之日起，根据工程预算、造价或者工程实际成本等，按估计的价值转入固定资产，并按本公司固定资产折旧政策计提固定资产的折旧，待办理竣工决算后，再按实际成本调整原来的暂估价值，但不调整原已计提的折旧额。

(十九) 借款费用

1. 借款费用资本化的确认原则

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

符合资本化条件的资产，是指需要经过相当长时间的购建或者生产活动才能达到预定可使用或者可销售状态的固定资产、投资性房地产和存货等资产。

借款费用同时满足下列条件时开始资本化：

(1) 资产支出已经发生，资产支出包括为购建或者生产符合资本化条件的资产而以支付现金、转移非现金资产或者承担带息债务形式发生的支出；

(2) 借款费用已经发生；

(3) 为使资产达到预定可使用或者可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

2. 借款费用资本化期间

资本化期间，指从借款费用开始资本化时点到停止资本化时点的期间，借款费用暂停资本化的期间不包括在内。

当购建或者生产符合资本化条件的资产达到预定可使用或者可销售状态时，借款费用停止资本化。

当购建或者生产符合资本化条件的资产中部分项目分别完工且可单独使用时，该部分资产借款费用停止资本化。

购建或者生产的资产的各部分分别完工，但必须等到整体完工后才可使用或可对外销售的，在该资产整体完工时停止借款费用资本化。

3. 暂停资本化期间

符合资本化条件的资产在购建或生产过程中发生的非正常中断、且中断时间连续超过 3 个月的，则借款费用暂停资本化；该项中断如是所购建或生产的符合资本化条件的资产达到预定可使用状态

或者可销售状态必要的程序，则借款费用继续资本化。在中断期间发生的借款费用确认为当期损益，直至资产的购建或者生产活动重新开始后借款费用继续资本化。

4. 借款费用资本化金额的计算方法

专门借款的利息费用（扣除尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或者进行暂时性投资取得的投资收益）及其辅助费用在所购建或者生产的符合资本化条件的资产达到预定可使用或者可销售状态前，予以资本化。

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，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。资本化率根据一般借款加权平均利率计算确定。

借款存在折价或者溢价的，按照实际利率法确定每一会计期间应摊销的折价或者溢价金额，调整每期利息金额。

(二十) 使用权资产

本公司对使用权资产按照成本进行初始计量，该成本包括：

- 1) 租赁负债的初始计量金额；
- 2) 在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；
- 3) 本公司发生的初始直接费用；
- 4) 本公司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（不包括为生产存货而发生的成本）。

在租赁期开始日后，本公司采用成本模式对使用权资产进行后续计量。

能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，本公司在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，本公司在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。对计提了减值准备的使用权资产，则在未来期间按扣除减值准备后的账面价值参照上述原则计提折旧。

(二十一) 无形资产

本集团无形资产包括土地使用权、交易席位费、软件等，按取得时的实际成本计量，其中，购入的无形资产，按实际支付的价款和相关的其他支出作为实际成本；投资者投入的无形资产，按投资合同或协议约定的价值确定实际成本，但合同或协议约定价值不公允的，按公允价值确定实际成本。

土地使用权从取得之日起，按其使用年限平均摊销；交易席位费、软件和其他无形资产按预计使用年限、合同规定的受益年限和法律规定的有效年限三者中最短者分期平均摊销。摊销金额按其受益对象计入相关资产成本和当期损益。

对使用寿命有限的无形资产的预计使用寿命及摊销方法于每年年度终了进行复核，如发生改变，则作为会计估计变更处理。在每年年度终了对使用寿命不确定的无形资产的预计使用寿命进行复核，如有证据表明无形资产的使用寿命是有限的，则估计其使用寿命并在预计使用寿命内摊销。

(二十二)非金融长期资产减值

本集团于每一资产负债表日对长期股权投资、投资性房地产、固定资产、在建工程、使用寿命有限的无形资产等项目进行检查，当存在下列迹象时，表明资产可能发生了减值，公司将进行减值测试。对商誉和使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年末均进行减值测试。难以对单项资产的可收回金额进行测试的，以该资产所属的资产组或资产组组合为基础测试。

减值测试后，若该资产的账面价值超过其可收回金额，其差额确认为减值损失，上述资产的减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。资产的可收回金额是指资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

出现减值的迹象如下：

- (1) 资产的市价当期大幅度下跌，其跌幅明显高于因时间的推移或者正常使用而预计的下跌。
- (2) 企业经营所处的经济、技术或者法律等环境以及资产所处的市场在当期或者将在近期发生重大变化，从而对企业产生不利影响。
- (3) 市场利率或者其他市场投资报酬率在当期已经提高，从而影响企业计算资产预计未来现金流量现值的折现率，导致资产可收回金额大幅度降低。
- (4) 有证据表明资产已经陈旧过时或者其实体已经损坏。
- (5) 资产已经或者将被闲置、终止使用或者计划提前处置。
- (6) 企业内部报告的证据表明资产的经济绩效已经低于或者将低于预期，如资产所创造的净现金流量或者实现的营业利润（或者亏损）远远低于（或者高于）预计金额等。
- (7) 其他表明资产可能已经发生减值的迹象。

(二十三)商誉

商誉为股权投资成本或非同一控制下企业合并成本超过应享有的或企业合并中取得的被投资单位或被购买方可辨认净资产于取得日或购买日的公允价值份额的差额。

与子公司有关的商誉在合并财务报表上单独列示，与联营企业和合营企业有关的商誉，包含在长期股权投资的账面价值中。

在财务报表中单独列示的商誉，无论是否存在减值迹象，至少每年进行减值测试。减值测试时，商誉的账面价值分摊至预期从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合。测试结果表明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。减值损失金额先抵减分摊至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。

(二十四)长期待摊费用

本集团长期待摊费用是指已经支出，但应由当期及以后各期承担的摊销期限在 1 年以上（不含 1 年）的各项费用，该等费用在受益期内平均摊销。如果长期待摊费用项目不能使以后会计期间受益，则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

(二十五) 职工薪酬

职工薪酬，是指本公司为获得职工提供的服务或解除劳动关系而给予的各种形式的报酬或补偿。职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利等与获得职工提供的服务相关的支出。

1. 短期薪酬

短期薪酬是指本公司在职工提供相关服务的年度报告期间结束后十二个月内需要全部予以支付的职工薪酬，离职后福利和辞退福利除外。本公司在职工提供服务的会计期间，将应付的短期薪酬确认为负债，并根据职工提供服务的受益对象计入相关资产成本和费用。

2. 离职后福利

离职后福利是指本集团为获得职工提供的服务而在职工退休或与公司解除劳动关系后，提供的各种形式的报酬和福利，属于短期薪酬和辞退福利的除外。本集团将离职后福利计划分类为设定提存计划。离职后福利设定提存计划主要为参加劳动和社会保障机构组织实施的社会基本养老保险、失业保险等。在职工为本集团提供服务的会计期间，将根据设定提存计划计算的应缴金额确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

3. 辞退福利

辞退福利是指本公司在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或者为鼓励职工自愿接受裁减而给予职工的补偿，在本公司不能单方面撤回解除劳动关系计划或裁减建议时和确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本费用时两者孰早日，确认因解除与职工的劳动关系给予补偿而产生的负债，同时计入当期损益。

本公司向接受内部退休安排的职工提供内退福利。内退福利是指，向未达到国家规定的退休年龄、经本公司管理层批准自愿退出工作岗位的职工支付的工资及为其缴纳的社会保险费等。本公司自内部退休安排开始之日起至职工达到正常退休年龄止，向内退职工支付内部退养福利。对于内退福利，本公司比照辞退福利进行会计处理，在符合辞退福利相关确认条件时，将自职工停止提供服务日至正常退休日期间拟支付的内退职工工资和缴纳的社会保险费等，确认为负债，一次性计入当期损益。内退福利的精算假设变化及福利标准调整引起的差异于发生时计入当期损益。

4. 其他长期职工福利

其他长期职工福利是指除短期薪酬、离职后福利、辞退福利之外的其他所有职工福利。

本集团职工在参加社会基本养老保险的基础上参加本集团依据国家企业年金制度的相关政策建立的企业年金计划。年金所需费用由本集团和职工共同缴纳，缴费总额为职工上年度工资总额的 8%，职工个人缴费为本人上年度工资总额的 2%

如在职工劳动合同到期之前决定解除与职工的劳动关系，或为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，如果本集团已经制定正式的解除劳动关系计划或提出自愿裁减建议，并即将实施，同时本集团不能单方面撤回解除劳动关系计划或裁减建议的，确认因解除与职工劳动关系给予补偿产生的预计负债，计入当期损益。

对于本集团实施的职工内部退休计划，由于这部分职工不再为企业带来经济利益，比照辞退福利处理。在内退计划符合职工薪酬准则规定的确认条件时，按照内退计划规定，将自职工停止提供服务日至正常退休日之间期间、拟支付的内退人员工资和缴纳的社会保险费等，确认为预计负债，计入当期损益。

(二十六) 预计负债

1. 预计负债的确认标准

与或有事项相关的义务同时满足下列条件时，本公司确认为预计负债：

该义务是本公司承担的现时义务；

履行该义务很可能导致经济利益流出本公司；

该义务的金额能够可靠地计量。

2. 预计负债的计量方法

本公司预计负债按履行相关现时义务所需的支出的最佳估计数进行初始计量。

本公司在确定最佳估计数时，综合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。对于货币时间价值影响重大的，通过对相关未来现金流出进行折现后确定最佳估计数。

最佳估计数分别以下情况处理：

所需支出存在一个连续范围（或区间），且该范围内各种结果发生的可能性相同的，则最佳估计数按照该范围的中间值即上下限金额的平均数确定。

所需支出不存在一个连续范围（或区间），或虽然存在一个连续范围但该范围内各种结果发生的可能性不相同的，如或有事项涉及单个项目的，则最佳估计数按照最可能发生金额确定；如或有事项涉及多个项目的，则最佳估计数按各种可能结果及相关概率计算确定。

本公司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，确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

(二十七) 租赁负债

本公司对租赁负债按照租赁期开始日尚未支付的租赁付款额的现值进行初始计量。在计算租赁付款额的现值时，本公司采用租赁内含利率作为折现率；无法确定租赁内含利率的，采用本公司增量借款利率作为折现率。租赁付款额包括：

- 1) 扣除租赁激励相关金额后的固定付款额及实质固定付款额；
- 2) 取决于指数或比率的可变租赁付款额；
- 3) 在本公司合理确定将行使该选择权的情况下，租赁付款额包括购买选择权的行权价格；

4) 在租赁期反映出本公司将行使终止租赁选择权的情况下, 租赁付款额包括行使终止租赁选择权需支付的款项;

5) 根据本公司提供的担保余值预计应支付的款项。

本公司按照固定的折现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。

未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额应当在实际发生时计入当期损益或相关资产成本。

(二十八) 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》和证监机构字[2007]320号《关于证券公司2007年年度报告工作的通知》的规定, 按照当期净利润弥补亏损后的10%提取一般风险准备金; 同时本集团根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(中国证监会公告[2018]39号)和《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》计提资产管理业务风险准备金。

根据《证券法》和证监机构字[2007]320号的规定, 按照当期净利润弥补亏损后的10%提取交易风险准备金。

为降低债券的偿付风险, 经第四届董事会第十四次会议并经2013年度第六次临时股东大会审议通过, 在债券存续期间提高任意盈余公积金比例和一般风险准备金比例, 其中任意盈余公积金按照当期净利润弥补亏损后的5%提取, 一般风险准备金按照当期净利润弥补亏损后的11%提取, 在出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息时, 公司将在债券剩余存续期间, 任意盈余公积金按照当期净利润弥补亏损后的10%提取, 一般风险准备金按照当期净利润弥补亏损后的12%提取。

(二十九) 收入

本集团收入在履行了合同中的履约义务, 即在客户取得相关商品(指商品或服务)控制权时确认。取得相关商品控制权, 是指客户能够主导该商品的使用并从中获得几乎全部的经济利益。

履约义务是指本集团向客户转让可明确区分商品或提供服务的承诺。既包括合同中明确的承诺, 也包括客户基于本集团已公开宣布的政策、特定声明或以往的习惯做法等于合同订立时合理预期本集团将履行的承诺。

本集团于合同开始日, 对合同进行评估, 识别合同所包含的各单项履约义务, 并确定各单项履约义务是在某一时段内履行, 还是在某一时点履行。满足下列条件之一的, 属于在某一时段内履行的履约义务; 否则, 属于在某一时点履行的履约义务:

- 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。
- 客户能够控制本集团履约过程中在建的商品。
- 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。

对于在某一时段内履行的履约义务，本集团在该段时间内按照履约进度确认收入。当履约进度不能合理确定时，若本集团已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。对于在某一时点履行的履约义务，本集团在客户取得相关商品控制权时点确认收入。

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）作为合同资产列示，合同资产以预期信用损失为基础计提减值。本集团拥有的、无条件（仅取决于时间流逝）向客户收取对价的权利作为应收款项列示。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作为合同负债列示。

与本集团取得收入的主要活动相关的具体会计政策描述如下：

1. 手续费及佣金收入

代理客户买卖证券的手续费收入，在证券买卖交易日确认收入。

证券承销收入，于本公司完成承销合同中的履约义务时确认收入。

受托客户资产管理业务收入，于受托管理合同到期，与委托单位结算时，按照合同规定的比例计算应由公司享受的收益或承担的损失，确认为当期的收益或损失。合同规定公司按约定比例收取管理费和业绩报酬费的，则分期确认管理费和业绩报酬收益。

发行保荐、财务顾问业务、投资咨询业务收入，根据合约条款，在本公司履行履约义务的过程中确认收入，或于履约义务完成的时点确认。

2. 利息收入

在相关的收入金额能够可靠计量，相关的经济利益能够收到时，按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

买入返售金融资产在当期到期返售的，按返售价格与买入价格的差额确认为当期收入；在资产负债表日没有到期的，期末按摊余成本和实际利率计提利息确认为当期收入，实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率确认为当期收入。

3. 投资收益

本集团将处置交易性金融资产时其公允价值与初始入账金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。处置其他债权投资时，取得的价款与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额的和与该金融资产账面价值的差额，计入投资收益。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分派的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

4. 现货贸易收入及服务收入

本公司之子公司豫新投资管理（上海）有限公司涉及现货贸易收入及服务收入。对于现货贸易收入，其与客户之间的销售商品合同通常仅包含转让商品的履约义务，通常在综合考虑了若干因素

的基础上，以履行每一单项履约义务时点确认收入，这些因素包括取得商品的现时收款权利、商品所有权上的主要风险和报酬的转移、商品的法定所有权的转移、商品实物资产的转移、客户接受该商品；对于服务收入，于服务已经提供及收取金额可以合理估算时予以确认。

(三十)客户资产管理业务的确认和计量

公司的客户资产管理业务，包括集合资产管理业务、单一资产管理业务和专项资产管理业务。公司受托经营集合资产管理业务、单一资产管理业务和专项资产管理业务，以托管客户或集合计划为主体，独立建账，独立核算，不在公司财务报表内列示。

(三十一)政府补助

与资产相关的政府补助，是指本集团取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助；与收益相关的政府补助，是指除与资产相关的政府补助之外的政府补助。如果政府文件中未明确规定补助对象，本集团按照上述区分原则进行判断，难以区分的，整体归类为与收益相关的政府补助。

政府补助为货币性资产的，按照实际收到的金额计量，对于按照固定的定额标准拨付的补助，或对年末有确凿证据表明能够符合财政扶持政策规定的相关条件且预计能够收到财政扶持资金时，按照应收的金额计量；政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量，公允价值不能可靠取得的，按照名义金额（1元）计量。

与资产相关的政府补助，确认为递延收益，确认为递延收益的与资产相关的政府补助，在相关资产使用寿命内分期计入当期损益。

相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关成本费用或损失的期间计入当期损益。与日常活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用。与日常活动无关的政府补助，计入营业外收入。

本集团取得政策性优惠贷款贴息的，区分财政将贴息资金拨付给贷款银行和财政将贴息资金直接拨付给本集团两种情况，分别按照以下原则进行会计处理：

(1) 财政将贴息资金拨付给贷款银行，由贷款银行以政策性优惠利率向本集团提供贷款的，本集团以实际收到的借款金额作为借款的入账价值，按照借款本金和该政策性优惠利率计算相关借款费用（或以借款的公允价值作为借款的入账价值并按照实际利率法计算借款费用，实际收到的金额与借款公允价值之间的差额确认为递延收益。递延收益在借款存续期内采用实际利率法摊销，冲减相关借款费用）。

(2) 财政将贴息资金直接拨付给本集团，本集团将对应的贴息冲减相关借款费用。

本集团已确认的政府补助需要退回的，在需要退回的当期分情况按照以下规定进行会计处理：

①初始确认时冲减相关资产账面价值的，调整资产账面价值。

②存在相关递延收益的，冲减相关递延收益账面余额，超出部分计入当期损益。

③属于其他情况的，直接计入当期损益。

(三十二)递延所得税资产和递延所得税负债

递延所得税资产和递延所得税负债根据资产和负债的计税基础与其账面价值的差额（暂时性差异）计算确认。于资产负债表日，递延所得税资产和递延所得税负债，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量。

1. 确认递延所得税资产的依据

本公司以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异、能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减的应纳税所得额为限，确认由可抵扣暂时性差异产生的递延所得税资产。但是，同时具有下列特征的交易中因资产或负债的初始确认所产生的递延所得税资产不予确认：（1）该交易不是企业合并；（2）交易发生时既不影响会计利润也不影响应纳税所得额或可抵扣亏损。

对于与联营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，同时满足下列条件的，确认相应的递延所得税资产：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。

2. 确认递延所得税负债的依据

公司将当期与以前期间应交未交的应纳税暂时性差异确认为递延所得税负债。但不包括：

（1）商誉的初始确认所形成的暂时性差异；

（2）非企业合并形成的交易或事项，且该交易或事项发生时既不影响会计利润，也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）所形成的暂时性差异；

（3）对于与子公司、联营企业投资相关的应纳税暂时性差异，该暂时性差异转回的时间能够控制并且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。

(三十三)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。

1. 本集团作为承租人

在租赁期开始日，本集团对租赁确认使用权资产和租赁负债。本集团使用直线法对使用权资产计提折旧。于资产负债表日，本集团评估使用权资产是否发生减值，并对已识别的减值损失进行会计处理。

租赁负债按照租赁期开始日尚未支付的租赁付款额的现值进行初始计量。本集团按照固定的周期性利率（即折现率）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。

本集团已选择对短期租赁（租赁期不超过 12 个月的租赁）和低价值资产租赁不确认使用权资产和租赁负债，并将相关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或相关资产成本。

2. 本集团作为出租人

经营租赁的租出资产在租赁期内按直线法确认为租金收入。

(三十四) 所得税的会计核算

所得税的会计核算采用资产负债表债务法。所得税费用包括当期所得税和递延所得税。除将与直接计入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，其余的当期所得税和递延所得税费用或收益计入当期损益。

当期所得税是指企业按照税务规定计算确定的针对当期发生的交易和事项，应缴纳给税务部门的金额，即应交所得税；递延所得税是指按照资产负债表债务法应予确认的递延所得税资产和递延所得税负债在期末应有的金额相对于原已确认金额之间的差额。

(三十五) 套期会计

本公司按照套期关系，将套期保值划分为公允价值套期、现金流量套期和境外净投资套期。

1. 对于同时满足下列条件的套期工具，运用套期会计方法进行处理

(1) 套期关系仅由符合条件的套期工具和被套期项目组成。

(2) 在套期开始时，本公司正式指定了套期工具和被套期项目，并准备了关于套期关系和从事套期的风险管理策略和风险管理目标的书面文件。

(3) 套期关系符合套期有效性要求。

套期同时满足下列条件的，认定套期关系符合套期有效性要求：

1) 被套期项目和套期工具之间存在经济关系。该经济关系使得套期工具和被套期项目的价值因面临相同的被套期风险而发生方向相反的变动。

2) 被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影响不占主导地位。

3) 套期关系的套期比率，等于公司实际套期的被套期项目数量与对其进行套期的套期工具实际数量之比，但不反映被套期项目和套期工具相对权重的失衡，这种失衡会导致套期无效，并可能产生与套期会计目标不一致的会计结果。

2. 公允价值套期会计处理

(1) 套期工具产生的利得或损失计入当期损益。如果套期工具是对选择以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资（或其组成部分）进行套期的，套期工具产生的利得或损失计入其他综合收益。

(2) 被套期项目因被套期风险敞口形成的利得或损失计入当期损益，同时调整未以公允价值计量的已确认被套期项目的账面价值。被套期项目为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（或其组成部分）的，其因被套期风险敞口形成的利得或损失计入当期损益，其账面价值已经按公允价值计量，不需要调整；被套期项目为公司选择以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资（或其组成部分）的，其因被套期风险敞口形成的利得或损失计入其他综合收益，其账面价值已经按公允价值计量，不需要调整。

被套期项目为尚未确认的确定承诺（或其组成部分）的，其在套期关系指定后因被套期风险引起的公允价值累计变动额确认为一项资产或负债，相关的利得或损失计入各相关期间损益。当履行

确定承诺而取得资产或承担负债时，调整该资产或负债的初始确认金额，以包括已确认的被套期项目的公允价值累计变动额。

(3) 被套期项目为以摊余成本计量的金融工具（或其组成部分）的，对被套期项目账面价值所作的调整按照开始摊销日重新计算的实际利率进行摊销，并计入当期损益。该摊销可以自调整日开始，但不晚于对被套期项目终止进行套期利得和损失调整的时点。被套期项目为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（或其组成部分）的，则按照相同的方式对累计已确认的套期利得或损失进行摊销，并计入当期损益，但不调整金融资产（或其组成部分）的账面价值。

3. 现金流量套期会计处理

(1) 套期工具产生的利得或损失中属于套期有效的部分，作为现金流量套期储备，计入其他综合收益。现金流量套期储备的金额，按照下列两项的绝对额中较低者确定：

1) 套期工具自套期开始的累计利得或损失；

2) 被套期项目自套期开始的预计未来现金流量现值的累计变动额。每期计入其他综合收益的现金流量套期储备的金额为当期现金流量套期储备的变动额。

(2) 套期工具产生的利得或损失中属于套期无效的部分（即扣除计入其他综合收益后的其他利得或损失），计入当期损益。

(3) 现金流量套期储备的金额，按照下列规定处理：

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

2) 对于不属于前一条涉及的现金流量套期，在被套期的预期现金流量影响损益的相同期间，将原在其他综合收益中确认的现金流量套期储备金额转出，计入当期损益。

3) 如果在其他综合收益中确认的现金流量套期储备金额是一项损失，且该损失全部或部分预计在未来会计期间不能弥补的，则在预计不能弥补时，将预计不能弥补的部分从其他综合收益中转出，计入当期损益。

4. 境外经营净投资套期

对境外经营净投资的套期，包括对作为净投资的一部分进行会计处理的货币性项目的套期，本公司按照类似于现金流量套期会计的规定处理：

(1) 套期工具形成的利得或损失中属于套期有效的部分，应当计入其他综合收益。

全部或部分处置境外经营时，上述计入其他综合收益的套期工具利得或损失应当相应转出，计入当期损益。

(2) 套期工具形成的利得或损失中属于套期无效的部分，应当计入当期损益。

5. 终止运用套期会计

对于发生下列情形之一的，则终止运用套期会计：

(1) 因风险管理目标发生变化，导致套期关系不再满足风险管理目标。

(2) 套期工具已到期、被出售、合同终止或已行使。

(3) 被套期项目与套期工具之间不再存在经济关系，或者被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影响开始占主导地位。

(4) 套期关系不再满足本准则所规定的运用套期会计方法的其他条件。在适用套期关系再平衡的情况下，企业应当首先考虑套期关系再平衡，然后评估套期关系是否满足本准则所规定的运用套期会计方法的条件。

终止套期会计可能会影响套期关系的整体或其中一部分，在仅影响其中一部分时，剩余未受影响的部分仍适用套期会计。

6. 信用风险敞口的公允价值选择

当使用以公允价值计量且其变动计入当期损益的信用衍生工具管理金融工具（或其组成部分）的信用风险敞口时，可以在该金融工具（或其组成部分）初始确认时、后续计量中或尚未确认时，将其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，并同时作出书面记录，但应同时满足下列条件：

(1) 金融工具信用风险敞口的主体（如借款人或贷款承诺持有人）与信用衍生工具涉及的主体相一致；

(2) 金融工具的偿付级次与根据信用衍生工具条款须交付的工具的偿付级次相一致。

(三十六) 分部信息

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。经营分部，是指本集团内同时满足下列条件的组成部分：该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；本集团能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息，分部间转移价格参照市场价格确定。

(三十七) 持有待售和终止经营

1. 持有待售

本集团主要通过出售而非持续使用一项非流动资产或处置组收回其账面价值时，将该非流动资产或处置组划分为持有待售类别。

处置组，是指在一项交易中作为整体通过出售或其他方式一并处置的一组资产，以及在该交易中转让的与这些资产直接相关的负债。

本集团将同时满足下列条件的非流动资产或处置组划分为持有待售类别：

– 根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，该非流动资产或处置组在其当前状况下即可立即出售；

- 出售极可能发生，即本公司已经就一项出售计划作出决议且已与其他方签订了具有法律约束力的购买协议，预计出售将在一年内完成。

本集团按账面价值与公允价值减去出售费用后净额之孰低者对持有待售的非流动资产（不包括金融资产及递延所得税资产）或处置组进行初始计量和后续计量，账面价值高于公允价值减去出售费用后净额的差额确认为资产减值损失，计入当期损益。

2. 终止经营

本集团将满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已被本集团处置或划分为持有待售类别的界定为终止经营：

- 该组成部分代表一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区；
- 该组成部分是拟对一项独立的主要业务或一个单独的主要经营地区进行处置的一项相关联计划的一部分；
- 该组成部分是专为转售而取得的子公司。

本集团对于当期列报的终止经营，在当期利润表中分别列示持续经营损益和终止经营损益，并在比较期间的利润表中将原来作为持续经营损益列报的信息重新作为可比会计期间的终止经营损益列报。

(三十八)重要会计判断和估计

编制财务报表时，管理层需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。管理层对估计涉及的关键假设和不确定性因素的判断进行持续评估。会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

下列会计估计及关键假设存在导致未来期间的资产及负债账面价值发生重大调整的重要风险。

1. 金融资产减值准备

本集团以预期信用损失为基础，对债权投资、其他债权投资、开展融资类业务（含融资融券、约定购回、股票质押回购等）形成的资产，以及货币市场拆出（借出）资金或证券、应收款项等进行减值处理并确认损失准备。

本集团基于上述金融资产的分类与性质，结合自身风险管理实践及减值指引的相关要求，以概率加权平均为基础，综合考虑货币时间价值和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，建立预期信用损失模型计量上述金融工具的减值损失。预期信用损失模型的相关假设、参数、数据来源和计量程序均需本集团作出专业的判断，这些相关因素假设的变化会对金融工具的预期信用损失计算结果产生影响。

本集团采用预期信用损失模型对金融资产的减值进行评估，应用预期信用损失模型需要做出重大判断和估计如违约概率、违约损失率及信用风险是否显著增加，需考虑所有合理且有依据的信息，

包括前瞻性信息。在做出该等判断和估计时，本集团根据历史还款数据结合经济政策、宏观经济指标、行业风险等因素推断债务人信用风险的预期变动。

关于本集团对信用风险显著增加判断标准、已发生信用减值资产的定义、预期信用损失计量的假设等披露参见附注九、（一）。

2. 商誉减值准备

本集团每年对商誉进行减值测试。包含商誉的资产组和资产组组合的可收回金额为其预计未来现金流量的现值，其计算需要采用会计估计。

如果管理层对资产组和资产组组合未来现金流量计算中采用的毛利率进行修订，修订后的毛利率低于目前采用的毛利率，公司需对商誉增加计提减值准备。

如果管理层对应用于现金流量折现的税前折现率进行重新修订，修订后的税前折现率高于目前采用的折现率，本集团需对商誉增加计提减值准备。

如果实际毛利率或税前折现率高于或低于管理层的估计，本集团不能转回原已计提的商誉减值损失。

3. 递延所得税资产确认

递延所得税资产的估计需要对未来各个年度的应纳税所得额及适用的税率进行估计，递延所得税资产的实现取决于本集团未来是否很可能获得足够的应纳税所得额。未来税率的变化和暂时性差异的转回时间也可能影响所得税费用（收益）以及递延所得税的余额。上述估计的变化可能导致对递延所得税的重要调整。

4. 固定资产、无形资产的可使用年限

本集团至少于每年年度终了，对固定资产和无形资产的预计使用寿命进行复核。预计使用寿命是管理层基于同类资产历史经验、参考同行业普遍所应用的估计并结合预期技术更新而决定的。当以往的估计发生重大变化时，则相应调整未来期间的折旧费用和摊销费用。

5. 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：（1）拥有对被投资者的权力；（2）通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；（3）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。

对于本集团管理的结构化主体（如基金及资产管理计划等），本集团会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。若本集团对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。对于本集团以外各方持有的结构化主体份额，因本集团作为发行人具有合约义务以现金回购其发售的份额，本集团将其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或应付款项。

（三十九）重要会计政策、会计估计的变更

1. 会计政策变更

本报告期重要会计政策未变更。

2. 会计估计变更

本报告期主要会计估计未发生变更。

五、税项

(一) 公司主要税种和税率

税种	计税依据	税率	备注
增值税	应纳税额按应纳税销售额乘以适用税率/征收率扣除当期允许抵扣的进项税后的余额计算	3%-13%	
城市维护建设税	实缴流转税税额	1%、5%、7%	
教育费附加	实缴流转税税额	3%	
地方教育附加	实缴流转税税额	2%	
企业所得税	应纳税所得额	16.5%、25%	

不同纳税主体所得税税率说明：

根据《中华人民共和国企业所得税法》及《国家税务总局关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的公告》（国家税务总局公告2012年第57号）的规定，公司执行“统一计算、分级管理、就地预缴、汇总清算、财政调库”的企业所得税征收管理办法。

根据《中华人民共和国企业所得税法》，自2008年1月1日起，公司适用25%的企业所得税税率；中州国际及其附属香港地区子公司按照香港特别行政区相关规定适用16.5%的综合利得税税率。

六、合并财务报表主要项目注释

注释1. 货币资金

1. 明细情况

项目	2021年12月31日			2020年12月31日		
	原币	折算汇率	折合人民币	原币	折算汇率	折合人民币
库存现金			98,430.36			185,324.40
人民币	72,965.39	1.0000	72,965.39	111,968.17	1.0000	111,968.17
港币	26,493.97	0.8176	21,661.47	82,535.06	0.8416	69,464.81
加元	760.00	5.0046	3,803.50	760.00	5.1203	3,891.42
银行存款			12,243,329,985.55			10,941,803,014.08
自有存款			2,253,281,632.02			2,748,120,459.32
人民币	2,076,811,748.81	1.0000	2,076,811,748.81	2,494,458,896.71	1.0000	2,494,458,896.71
美元	4,422,196.09	6.3757	28,194,595.60	20,547,255.32	6.5249	134,066,949.25
港币	180,121,566.96	0.8176	147,267,393.15	141,461,731.71	0.8416	119,059,851.88
澳元	47,229.56	4.6220	218,295.03	47,229.09	5.0290	237,513.15
欧元	109,367.31	7.2197	789,599.20	29,609.31	8.0033	236,973.12

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	原币	折算 汇率	折合人民币	原币	折算 汇率	折合人民币
加元	0.04	5.0046	0.20	0.04	5.1203	0.20
泰铢	0.16	0.1912	0.03	228,937.98	0.2174	49,779.75
日元				165,957.00	0.0632	10,495.26
客户存款			9,990,048,353.53			8,193,682,554.76
人民币	9,915,271,951.08	1.0000	9,915,271,951.08	8,104,738,687.41	1.0000	8,104,738,687.41
美元	3,502,779.41	6.3757	22,332,670.71	4,610,580.22	6.5249	30,083,211.61
港币	63,067,824.23	0.8176	51,564,253.09	67,293,174.96	0.8416	56,636,640.55
欧元	120,799.16	7.2197	872,133.69	276,838.87	8.0033	2,215,633.25
日元	132,544.62	0.0554	7,344.96	132,540.00	0.0632	8,381.94
其他货币资金			88,602,006.84			9,142,683.42
人民币	88,602,006.84	1.0000	88,602,006.84	9,142,683.42	1.0000	9,142,683.42
合计			12,332,030,422.75			10,951,131,021.90

其中：融资融券业务：

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	原币	折算 汇率	折合人民币	原币	折算 汇率	折合人民币
自有信用资金			128,976,290.40			70,219,206.05
人民币	34,356,321.36	1.0000	34,356,321.36	2,379,906.55	1.0000	2,379,906.55
港币	115,728,924.95	0.8176	94,619,969.04	80,603,701.70	0.8416	67,839,299.50
客户信用资金			642,557,735.00			582,961,261.74
人民币	606,831,951.55	1.0000	606,831,951.55	528,880,625.85	1.0000	528,880,625.85
美元	271,849.13	6.3757	1,733,229.05	1,333,044.66	6.5249	8,697,857.34
港币	41,576,020.55	0.8176	33,992,554.40	53,921,841.34	0.8416	45,382,778.55
合计			771,534,025.40			653,180,467.79

2. 截止 2021 年 12 月 31 日，本集团存放在境外的货币资金折合人民币 248,879,305.32 元，主要是香港子公司存放款项。

3. 截止 2021 年 12 月 31 日，本集团使用受限制的银行存款共计人民币 15,174,127.73 元，主要为本公司因开展资产管理业务而存放在银行的风险准备金。

存款银行	银行账号	期末余额	受限原因
中国银行股份有限公司河南省分行营业部	262469587289	15,174,127.73	资管业务风险准备金专户
中国银行股份有限公司河南省分行营业部	262469586944		资管业务风险准备金专户

注释 2. 结算备付金

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
----	------------------	------------------

	原币	折算 汇率	折合人民币	原币	折算 汇率	折合人民币
公司自有备付金			111,297,791.00			91,228,910.05
人民币	102,105,269.63	1.0000	102,105,269.63	82,146,097.14	1.0000	82,146,097.14
港币	9,222,807.57	0.8176	7,540,567.47	10,234,072.57	0.8416	8,613,404.83
美元	235,994.84	6.3757	1,504,632.27	46,444.53	6.5249	303,041.53
欧元	19,482.27	7.2197	140,656.12	20,000.00	8.0033	160,066.63
日元	94,697.30	0.0554	5,247.65	94,922.00	0.0632	6,002.95
林吉特	651.00	1.5266	993.82	98.31	1.6185	159.11
英镑	49.27	8.6064	424.04	15.48	8.9057	137.86
客户普通备付金			2,164,814,240.23			1,975,873,287.75
人民币	2,156,650,747.55	1.0000	2,156,650,747.55	1,972,225,042.98	1.0000	1,972,225,042.98
美元	1,129,908.11	6.3757	7,203,955.14	514,990.08	6.5249	3,360,258.77
港币	1,173,602.67	0.8176	959,537.54	342,172.42	0.8416	287,986.00
客户信用备付金			282,107,089.23			311,997,890.20
人民币	282,107,089.23	1.0000	282,107,089.23	311,997,890.20	1.0000	311,997,890.20
合计			2,558,219,120.46			2,379,100,088.00

注释 3. 融出资金

1. 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
境内		
其中：个人	7,987,959,787.39	7,161,431,516.25
机构	118,055,893.89	109,194,134.07
减：减值准备	24,211,868.51	21,728,570.93
境内小计	8,081,803,812.77	7,248,897,079.39
境外		
其中：个人	73,778,914.10	157,193,911.35
机构	45,205,207.56	48,511,514.39
减：减值准备	52,770,791.38	53,845,391.75
境外小计	66,213,330.28	151,860,033.99
账面价值合计	8,148,017,143.05	7,400,757,113.38

2. 融出资金担保物类别

担保物类别	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
资金	846,581,309.11	732,150,639.06
债券	83,947,128.68	34,564,682.12
股票	22,948,357,125.90	22,251,473,685.92
基金	1,974,185,701.01	94,132,329.50

担保物类别	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
合计	25,853,071,264.70	23,112,321,336.60

注释 4. 衍生金融工具

1. 2021 年 12 月 31 日

类别	套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
商品期货				9,354,020.00		980,295.00
减：可抵消的暂收暂付款						980,295.00
利率互换				50,160,000,000.00		5,638,828.98
减：可抵消的暂收暂付款						5,638,828.98
国债期货				5,740,761,800.00	11,684,085.47	
减：可抵消的暂收暂付款					11,684,085.47	
个股期权				12,600,115.39	54,610.00	465,376.83
合计				55,922,715,935.39	54,610.00	465,376.83

2. 2020 年 12 月 31 日

类别	套期工具			非套期工具		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
商品期货	85,586,810.00		3,717,100.00	227,988,540.00	255,505.00	
减：可抵消的暂收暂付款			3,717,100.00		255,505.00	
利率互换				37,580,000,000.00	10,220,124.13	
减：可抵消的暂收暂付款					10,220,124.13	
国债期货				2,608,688,300.00	404,482.44	
减：可抵消的暂收暂付款					404,482.44	
个股期权				5,329,975.80		57,980.91
合计	85,586,810.00			40,422,006,815.80		57,980.91

当日无负债结算制度下，结算备付金包括公司于 2021 年 12 月 31 日、2020 年 12 月 31 日所持有的商品期货、利率互换及国债期货等产生的持仓损益。因此，衍生金融资产及负债项下的商品期货、利率互换及国债期货与相关的暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示。

注释 5. 存出保证金

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	原币	折算汇率	折合人民币	原币	折算汇率	折合人民币
交易保证金			784,726,026.98			539,543,098.45
人民币	783,870,927.98	1.0000	783,870,927.98	538,665,535.45	1.0000	538,665,535.45

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	原币	折算 汇率	折合人民币	原币	折算 汇率	折合人民币
港币	500,000.00	0.8176	408,800.00	500,000.00	0.8416	420,820.00
美元	70,000.00	6.3757	446,299.00	70,000.00	6.5249	456,743.00
信用保证金			11,900,318.58			10,618,496.40
人民币	11,900,318.58	1.0000	11,900,318.58	10,618,496.40	1.0000	10,618,496.40
履约保证金			5,629,743.91			194,717,152.84
人民币	5,629,743.91	1.0000	5,629,743.91	194,717,152.84	1.0000	194,717,152.84
合计			802,256,089.47			744,878,747.69

注释 6. 应收款项

1. 按明细列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收股票质押式回购业务款项	309,607,600.00	309,607,600.00
应收债券兑息款项		54,079,800.00
应收客户清算款项	35,330,595.98	43,148,113.18
应收资产管理费	42,993,026.05	33,462,467.93
应收手续费及佣金	21,474,920.01	45,840,692.93
应收融资客户款项	7,957,005.97	7,963,368.74
其他	17,074,028.66	1,004,903.94
减：坏账准备（按简化模型计提）	336,381,276.40	325,783,423.38
应收款项账面价值	98,055,900.27	169,323,523.34

注：公司根据股票质押业务融资人发生违约后法院强制执行的结果，将未获清偿的部分转入应收款项。截止 2021 年 12 月 31 日，应收股票质押式回购业务余额为 309,607,600.00 元，已全额计提坏账准备。

2. 按评估方式列示

项目	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项计提坏账准备	370,295,794.98	85.24	333,553,975.91	90.08
单项小计	370,295,794.98	85.24	333,553,975.91	
组合计提坏账准备				
其中：1 年以内	41,374,285.70	9.53	206,871.43	0.50
1-2 年	10,010,833.22	2.30	500,541.66	5.00
2-3 年	7,768,827.60	1.79	776,882.76	10.00
3-4 年	3,278,962.60	0.75	655,792.52	20.00
4-5 年	835,120.86	0.19	250,536.26	30.00

项目	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
5 年以上	873,351.71	0.20	436,675.86	50.00
组合小计	64,141,381.69	14.76	2,827,300.49	
合计	434,437,176.67	100.00	336,381,276.40	

续：

项目	2020 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
单项计提坏账准备	366,183,152.30	73.96	321,256,743.62	87.73
单项小计	366,183,152.30	73.96	321,256,743.62	
组合计提坏账准备				
其中：1 年以内	93,972,049.47	18.98	469,858.78	0.50
1-2 年	15,534,859.80	3.14	776,742.99	5.00
2-3 年	11,655,642.06	2.35	1,165,564.20	10.00
3-4 年	2,139,391.38	0.43	427,878.28	20.00
4-5 年	5,621,451.71	1.14	1,686,435.51	30.00
5 年以上	400.00		200.00	50.00
组合小计	128,923,794.42	26.04	4,526,679.76	
合计	495,106,946.72	100.00	325,783,423.38	

3. 期末应收款项余额中应收持公司 5%(含 5%)以上表决权股份的股东单位的款项 1,967,868.64 元，主要为计提的应收资产管理费收入。

注释 7. 买入返售金融资产

1. 按业务类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
约定购回式证券	5,977,183.52	9,847,902.11
股票质押式回购	1,383,442,367.59	1,707,498,529.86
债券买断式回购		40,292,940.00
债券质押式回购	24,991,123.29	565,267,829.32
减：减值准备	441,540,598.96	266,942,311.46
合计	972,870,075.44	2,055,964,889.83

2. 按金融资产种类

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股票	1,389,419,551.11	1,717,346,431.97

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
债券	24,991,123.29	605,560,769.32
减：减值准备	441,540,598.96	266,942,311.46
账面价值	972,870,075.44	2,055,964,889.83

3. 担保物类别

担保物类别	2021 年 12 月 31 日公允价值	2020 年 12 月 31 日公允价值
股票	2,717,820,013.50	2,792,479,921.43
债券		736,501,927.71
合计	2,717,820,013.50	3,528,981,849.14
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物		40,542,360.00
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		40,542,360.00

注：本公司于 2021 年 12 月 31 日在上海证券交易所进行 1 天国债逆回购（GC001），数量 25 万份，并取得足额担保物。

4. 股票质押回购融出资金按剩余期限分类

期限	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
1 个月以内		10,002,274.03
1-3 个月		
3 个月-1 年	728,821,679.20	735,430,249.94
1 年以上	7,506,700.04	50,267,123.29
已逾期	647,113,988.35	911,798,882.60
合计	1,383,442,367.59	1,707,498,529.86

5. 股票质押式回购按减值阶段列示

项目	2021 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
账面余额	736,328,379.24		647,113,988.35	1,383,442,367.59
减值准备	904,172.16		440,630,717.43	441,534,889.59
账面价值	735,424,207.08		206,483,270.92	941,907,478.00
担保物价值	2,383,911,677.58		313,148,920.92	2,697,060,598.50

续：

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
账面余额	795,699,647.26		911,798,882.60	1,707,498,529.86
减值准备	1,363,745.09		265,570,503.11	266,934,248.20

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
账面价值	794,335,902.17		646,228,379.49	1,440,564,281.66
担保物价值	2,099,499,467.60		668,709,113.83	2,768,208,581.43

注释 8. 交易性金融资产

1. 按类别列示

类别	2021 年 12 月 31 日				
	公允价值			初始成本	
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
债券	18,844,573,886.51		18,844,573,886.51	18,870,227,489.31	
公募基金	1,911,893,103.19		1,911,893,103.19	1,905,112,156.53	
股票	1,428,050,380.33		1,428,050,380.33	1,241,294,059.75	
银行理财产品	66,496,091.19		66,496,091.19	66,400,000.00	
券商资管产品	3,997,146.36		3,997,146.36	10,727,749.71	
私募基金及合伙企业	1,457,379,602.83		1,457,379,602.83	1,370,427,308.10	
其他	795,528,968.46		795,528,968.46	668,357,605.01	
合计	24,507,919,178.87		24,507,919,178.87	24,132,546,368.41	

续：

类别	2020 年 12 月 31 日				
	公允价值			初始成本	
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
债券	19,006,086,088.17		19,006,086,088.17	18,963,514,100.97	
公募基金	989,026,998.94		989,026,998.94	981,237,072.37	
股票	1,269,140,125.07		1,269,140,125.07	1,428,922,123.23	
银行理财产品	120,306,652.05		120,306,652.05	120,000,000.00	
券商资管产品	10,319,370.53		10,319,370.53	10,901,958.05	
私募基金及合伙企业	745,313,668.07		745,313,668.07	716,092,794.00	
其他	452,379,595.94		452,379,595.94	430,000,000.00	

类别	2020 年 12 月 31 日					
	公允价值			初始成本		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	公允价值合计	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	初始成本合计
合计	22,592,572,498.77		22,592,572,498.77	22,650,668,048.62		22,650,668,048.62

2. 交易性金融资产中的融出证券情况

截止 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本集团交易性金融资产余额中分别包含融出证券人民币 14,531,200.47 元和人民币 6,015,764.80 元。

3. 变现在有限制的交易性金融资产

项目	受限原因	2021年12月31日账面价值	2020年12月31日账面价值
债券	质押用于回购融资、债券借贷	12,216,894,246.31	13,222,864,812.00
债券	行权登记		193,466,175.35
公募基金	已融出证券	14,531,200.47	6,015,764.80
股票	股份减持限售	208,110,954.86	220,030,319.58
股票	大宗交易限售	18,849,600.00	18,849,600.00

注释 9. 债权投资

1. 债权投资情况

类别	2021 年 12 月 31 日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
信托计划	200,825,846.42	1,182,000.00	28,736,867.83	173,270,978.59
私募债	144,180,424.71		127,010,824.71	17,169,600.00
资管计划	231,958,603.11		158,946,697.02	73,011,906.09
合计	576,964,874.24	1,182,000.00	314,694,389.56	263,452,484.68

续：

类别	2020 年 12 月 31 日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
信托计划	217,242,739.75	4,725,086.10	2,432,928.65	219,534,897.20
私募债	147,537,686.71		106,414,092.02	41,123,594.69
资管计划	244,388,050.00		48,877,610.00	195,510,440.00
合计	609,168,476.46	4,725,086.10	157,724,630.67	456,168,931.89

2. 减值准备计提情况

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
------	------	------	------	----

	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
2021年1月1日余额	23,041.81		157,701,588.86	157,724,630.67
2021年1月1日债权投资账面余额在本期				
--转入第二阶段				
--转入第三阶段				
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提			159,520,806.13	159,520,806.13
本期转回	23,041.81			23,041.81
本期核销				
外币报表折算差额			-2,528,005.43	-2,528,005.43
2021年12月31日余额			314,694,389.56	314,694,389.56

注释 10. 其他债权投资

1. 按类别列示

类别	2021年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	310,416,597.22	4,059,843.83	1,009,012.78	315,485,453.83	
地方债					
企业债	315,614,662.15	8,332,421.91	-68,764,802.15	255,182,281.91	69,802,808.57
其他	389,839,317.44	11,642,958.91	-1,723,464.31	399,758,812.04	282,864.10
合计	1,015,870,576.81	24,035,224.65	-69,479,253.68	970,426,547.78	70,085,672.67

续：

类别	2020年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	340,391,503.36	5,862,227.41	91,496.64	346,345,227.41	
地方债	506,205,995.05	7,092,082.20	2,894,304.95	516,192,382.20	294,239.63
企业债	690,041,226.48	17,829,856.74	-73,300,586.48	634,570,496.74	70,379,414.90
其他	581,303,404.07	12,904,493.15	-2,510,854.50	591,697,042.72	301,305.30
合计	2,117,942,128.96	43,688,659.50	-72,825,639.39	2,088,805,149.07	70,974,959.83

2. 减值准备计提情况

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
2021年1月1日余额	1,266,559.83		69,708,400.00	70,974,959.83

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
2021年1月1日其他债权投资账面余额在本期				
--转入第二阶段				
--转入第三阶段				
--转回第二阶段				
--转回第一阶段				
本期计提				
本期转回	889,287.16			889,287.16
本期核销				
2021 年 12 月 31 日余额	377,272.67		69,708,400.00	70,085,672.67

3. 变现有限制的其他债权投资

项目	受限原因	2021年12月31日账面价值	2020年12月31日账面价值
企业债	质押用于债券借贷		30,822,180.41
企业债	质押用于回购融资		132,078,473.98
地方债	质押用于回购融资		516,192,382.20
国债	质押用于转融通业务		295,212,638.37

注释 11. 长期股权投资

1. 长期股权投资分类

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
按权益法核算的长期股权投资	1,686,379,521.68	1,097,430,290.95
长期股权投资合计	1,686,379,521.68	1,097,430,290.95
减：长期股权投资减值准备	26,500,318.60	30,154,117.51
长期股权投资净值	1,659,879,203.08	1,067,276,173.44

2. 对联营企业投资

被投资单位	期初账面价值	本期增减变动								期末账面价值	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
河南华泰粮油机械股份有限公司	5,941,268.76		4,600,000.00	372,266.93		-1,713,535.69					
河南中平融资担保有限公司	53,585,720.49			1,512,412.06						55,098,132.55	
河南龙凤山农牧股份有限公司	20,580,791.00	5,503,437.50		-15,984,642.07						10,099,586.43	
郑州农淘电子商务有限公司	1,274,705.60							-268,789.24		1,005,916.36	12,473,406.77
中证焦桐基金管理有限公司	20,259,530.65			-280,425.02						19,979,105.63	
河南投实文化传播有限公司	942,625.91			-78,624.93						864,000.98	
河南盛通聚源创业投资基金（有限合伙）	77,237,635.85			-5,243,611.94						71,994,023.91	
濮阳创赢产业投资基金有限公司	1,809,940.63			-114,149.06						1,695,791.57	
上蔡中鼎产业发展投资基金（有限合伙）	2,425,115.24			-44,727.94						2,380,387.30	
新乡中鼎科技成果转化基金（有限合伙）	20,111,020.69			266,881.43						20,377,902.12	
洛阳国宏中证产业发展投资基金（有限合伙）	11,928,916.25			-393,001.97						11,535,914.28	
河南金鼎盛源股权投资投资基金（有限合伙）	53,969,593.37			-4,471,390.61						49,498,202.76	

2021 年年度报告

被投资单位	期初账面价值	本期增减变动								期末账面价值	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
洛阳市中证科技创新创业投资基金(有限合伙)	11,013,547.47	9,800,000.00		-29,661.18						20,783,886.29	
漯河华瑞永磁材料股份有限公司	1,500,000.00									1,500,000.00	3,389,755.50
河南省中联装备制造技术研究中心有限公司	18,897,017.93			134,325.34						19,031,343.27	
中原环资科技有限公司	16,398,673.20			-324,718.14						16,073,955.06	
河南交广融媒信息科技有限公司	3,893,344.24			96,226.81						3,989,571.05	
河南省锐达医药科技有限公司											5,059,488.46
郑州宜家安好软件科技有限公司			3,476,571.60						3,476,571.60		
郑州大河智信科技股份有限公司	11,573,088.51			478,950.38						12,052,038.89	
河南锐锋金刚石制品有限公司	7,269,355.41			269,293.37						7,538,648.78	
郑州麦佳农业科技有限公司	1,403,826.09			6,440.31						1,410,266.40	
河南省利盈环保科技股份有限公司	24,575,575.97			2,422,445.68						26,998,021.65	
河南嘟嘟计算机科技有限公司	240,000.00									240,000.00	492,987.23
汤阴县创新产业投资基金(有限合伙)	1,200,147.22			-224,336.12						975,811.10	
民权县创新产业投资基金(有限合伙)	40,063,815.85		3,264,000.00	34,590,964.03			-12,859,792.82			58,530,987.06	

被投资单位	期初账面价值	本期增减变动								期末账面价值	减值准备期末余额
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	其他综合收益调整	其他权益变动	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
青岛中州蓝海贝升投资管理中心（有限合伙）	8,035,554.65		7,677,076.50	-358,478.15							
河南中原大数据交易中心有限公司	2,032,507.32			31,090.85						2,063,598.17	
河南资产管理有限公司	590,529,079.58			38,859,356.34	-2,405,906.43		-14,103,201.96			612,879,327.53	
河南大河财立方传媒控股有限公司	31,989,736.84			1,600,815.65			-1,500,000.00			32,090,552.49	
鹤壁镁交易中心有限责任公司	9,741,230.62			-302,432.76						9,438,797.86	
上蔡县丰拓农林科技有限公司	4,976,131.23			-26,102.86						4,950,028.37	
2242257 Ontario Inc	446,665.68								-11,941.03	434,724.65	5,084,680.64
洛阳德胜生物科技股份有限公司	11,430,011.19			-129,080.62						11,300,930.57	
河南省中原小额贷款有限公司									573,067,750.00	573,067,750.00	
合计	1,067,276,173.44	15,303,437.50	19,017,648.10	52,636,085.81	-2,405,906.43	-1,713,535.69	-28,462,994.78	-268,789.24	576,532,380.57	1,659,879,203.08	26,500,318.60

本集团于 2021 年 12 月 31 日对账面长期股权投资进行检查，结合被投资单位的经营情况、财务状况以及其他因素，评估其减值迹象，并在此基础上实施减值测试，截止 2021 年 12 月 31 日，本集团累计计提长期股权投资减值准备 26,500,318.60 元。

本期其他转出为本期对联营企业郑州宜家安好软件科技有限公司进行处置，转出已计提减值准备 3,476,571.60 元；出售子公司河南省中原小额贷款有限公司 15%股权丧失控制权，转为联营企业，转入 573,067,750.00 元，其他为外币报表折算差。

注释 12. 投资性房地产

项目	房屋及建筑物	合计
一、账面原值		
1.期初余额	33,882,398.45	33,882,398.45
2.本期增加金额		
3.本期减少金额		
4.期末余额	33,882,398.45	33,882,398.45
二、累计折旧和累计摊销		
1.期初余额	17,408,309.44	17,408,309.44
2.本期增加金额	807,981.73	807,981.73
(1) 计提或摊销	807,981.73	807,981.73
3.本期减少金额		
4.期末余额	18,216,291.17	18,216,291.17
三、减值准备		
1.期初余额		
2.本期增加金额		
3.本期减少金额		
4.期末余额		
四、账面价值		
1.期末账面价值	15,666,107.28	15,666,107.28
2.期初账面价值	16,474,089.01	16,474,089.01

于 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本公司投资性房地产无需计提减值准备。

于 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本公司投资性房地产无尚未办妥产权证的情况。

注释 13. 固定资产

1. 账面价值

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
固定资产原值	519,653,139.17	518,939,792.67
减：累计折旧	331,451,872.22	339,935,752.90
减：减值准备		
固定资产账面价值合计	188,201,266.95	179,004,039.77

2. 固定资产增减变动表

项目	房屋及建筑物	电子及电器设备	交通运输设备	其他设备	合计
一、账面原值					
1.期初余额	158,278,328.85	316,266,557.75	23,955,154.00	20,439,752.07	518,939,792.67
2.本期增加金额		37,768,955.17		3,099,317.99	40,868,273.16
(1) 购置		37,768,955.17		3,099,317.99	40,868,273.16

项目	房屋及建筑物	电子及电器设备	交通运输设备	其他设备	合计
(2) 投资性房地产转入					
3.本期减少金额		34,436,057.85	2,871,482.72	2,761,709.03	40,069,249.60
(1) 处置或报废		34,296,971.99	2,411,745.27	2,707,056.39	39,415,773.65
(2) 其他转出		139,085.86	459,737.45	54,652.64	653,475.95
4.外币报表折算差额		-45,106.07	-37,827.11	-2,743.88	-85,677.06
5.期末余额	158,278,328.85	319,554,349.00	21,045,844.17	20,774,617.15	519,653,139.17
二、累计折旧					
1.期初余额	57,680,241.87	246,559,345.70	19,653,921.67	16,042,243.66	339,935,752.90
2.本期增加金额	4,166,944.17	22,259,658.03	1,079,091.55	1,551,582.38	29,057,276.13
(1) 计提	4,166,944.17	22,259,658.03	1,079,091.55	1,551,582.38	29,057,276.13
(2) 投资性房地产转入					
3.本期减少金额		32,514,853.95	2,364,331.43	2,596,305.73	37,475,491.11
(1) 处置或报废		32,406,060.63	2,202,632.95	2,550,968.50	37,159,662.08
(2) 其他转出		108,793.32	161,698.48	45,337.23	315,829.03
4.外币报表折算差额		-36,111.82	-27,190.92	-2,362.96	-65,665.70
5.期末余额	61,847,186.04	236,268,037.96	18,341,490.87	14,995,157.35	331,451,872.22
三、减值准备					
1.期初余额					
2.本期增加金额					
3.本期减少金额					
4.期末余额					
四、账面价值					
1.期末账面价值	96,431,142.81	83,286,311.04	2,704,353.30	5,779,459.80	188,201,266.95
2.期初账面价值	100,598,086.98	69,707,212.05	4,301,232.33	4,397,508.41	179,004,039.77

3. 本期计提的固定资产折旧额为 29,057,276.13 元。

4. 截止 2021 年 12 月 31 日，本集团无暂时闲置的固定资产。

5. 截止 2021 年 12 月 31 日，本集团无尚未办妥产权证书的固定资产。

注释 14. 在建工程

1. 在建工程情况

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 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
办公楼建造	58,641,526.64		58,641,526.64	52,427,024.00		52,427,024.00
合计	58,641,526.64		58,641,526.64	52,427,024.00		52,427,024.00

2. 本报告期无计提在建工程减值准备情况。

注释 15. 使用权资产

项目	房屋及建筑物	合计
一、账面原值		
1.期初余额	275,884,275.21	275,884,275.21
2.本期增加金额	74,618,526.23	74,618,526.23
(1) 租入	74,618,526.23	74,618,526.23
3.本期减少金额	23,780,074.04	23,780,074.04
(1) 租赁到期	21,368,153.98	21,368,153.98
(2) 其他	2,411,920.06	2,411,920.06
4.外币报表折算差额	-1,062,877.00	-1,062,877.00
5.期末余额	325,659,850.40	325,659,850.40
二、累计折旧		
1.期初余额	112,851,111.95	112,851,111.95
2.本期增加金额	76,100,281.34	76,100,281.34
(1) 计提	76,100,281.34	76,100,281.34
3.本期减少金额	23,077,778.83	23,077,778.83
(1) 租赁到期	20,835,117.13	20,835,117.13
(2) 其他	2,242,661.70	2,242,661.70
4.外币报表折算差额	-621,803.34	-621,803.34
5.期末余额	165,251,811.12	165,251,811.12
三、账面价值		
1.期末账面价值	160,408,039.28	160,408,039.28
2.期初账面价值	163,033,163.26	163,033,163.26

于 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本集团使用权资产无需计提减值准备。

注释 16. 无形资产

1. 无形资产明细表

项目	软件	交易席位费	土地使用权	其他	合计
一、账面原值					
1.期初余额	285,079,501.52	32,616,590.00	105,480,246.53	2,444,000.00	425,620,338.05
2.本期增加金额	73,647,321.64				73,647,321.64
(1) 购置	73,647,321.64				73,647,321.64
3.本期减少金额	4,348,726.73			430,000.00	4,778,726.73
(1) 处置或报废	3,493,250.03			430,000.00	3,923,250.03
(2) 其他转出	855,476.70				855,476.70
4.外币报表折算差额	-1,693.02	-24,040.00			-25,733.02
5.期末余额	354,376,403.41	32,592,550.00	105,480,246.53	2,014,000.00	494,463,199.94
二、累计摊销					
1.期初余额	185,750,073.97	31,608,283.48	17,799,791.34	2,444,000.00	237,602,148.79

项目	软件	交易席位费	土地使用权	其他	合计
2.本期增加金额	35,245,079.36	49,999.92	2,637,006.12		37,932,085.40
（1）计提	35,245,079.36	49,999.92	2,637,006.12		37,932,085.40
3.本期减少金额	3,655,571.85			430,000.00	4,085,571.85
（1）处置或报废	3,491,965.10			430,000.00	3,921,965.10
（2）其他转出	163,606.75				163,606.75
4.外币报表折算差额	-1,693.02				-1,693.02
5.期末余额	217,337,888.46	31,658,283.40	20,436,797.46	2,014,000.00	271,446,969.32
三、减值准备					
1.期初余额					
2.本期增加金额					
3.本期减少金额					
4.期末余额					
四、账面价值					
1.期末账面价值	137,038,514.95	934,266.60	85,043,449.07		223,016,230.62
2.期初账面价值	99,329,427.55	1,008,306.52	87,680,455.19		188,018,189.26

2. 本期无形资产摊销额为 37,932,085.40 元。

3. 于 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本集团无用于抵押或担保的重大无形资产。

4. 交易席位费明细情况

项目	原始金额	2020 年 12 月 31 日	本期摊销或转 出数	累计摊销或转出 数	外币折算差	2021 年 12 月 31 日
上海证交所 A 股	19,462,500.00			19,462,500.00		
深圳证交所 A 股	11,812,450.00			11,812,450.00		
全国中小企业股份 转让系统有限责任 公司	500,000.00	166,666.52	49,999.92	383,333.40		116,666.60
香港证券交易所	876,200.00	841,640.00			-24,040.00	817,600.00
合计	32,651,150.00	1,008,306.52	49,999.92	31,658,283.40	-24,040.00	934,266.60

注释 17. 递延所得税资产和递延所得税负债

1. 已确认递延所得税资产和递延所得税负债

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
递延所得税资产：		
资产减值准备	290,552,437.32	243,561,201.63
应付职工薪酬	80,266,162.78	76,885,445.52
交易性金融资产、衍生金融工具公允价值变动	56,104,067.46	100,789,341.05
待结转承销款	1,529,211.22	3,045,778.89
预提费用	2,549,011.50	2,507,002.68

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
其他债权投资公允价值变动	17,369,813.42	18,206,409.85
交易性金融负债公允价值变动		1,524,273.16
期货风险准备金	105,574.86	105,574.86
其他	37,985,384.78	18,109,620.45
合计	486,461,663.34	464,734,648.09
递延所得税负债：		
交易性金融资产、衍生金融工具公允价值变动	331,009.63	7,102,318.65
其他	38,232,098.03	7,139,218.34
合计	38,563,107.66	14,241,536.99

2. 暂时性差异项目

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
可抵扣暂时性差异：		
资产减值准备	1,197,550,274.94	1,019,083,812.61
应付职工薪酬	321,064,651.12	307,541,782.10
交易性金融资产、衍生金融工具公允价值变动	276,565,541.35	456,839,987.56
待结转承销款	6,116,844.88	12,183,115.56
预提费用	10,196,046.00	10,028,010.72
其他债权投资公允价值变动	69,479,253.68	72,825,639.39
交易性金融负债公允价值变动		6,097,092.66
期货风险准备金	422,299.44	422,299.44
其他	177,002,458.23	89,776,909.66
合计	2,058,397,369.64	1,974,798,649.70
应纳税暂时性差异：		
交易性金融资产、衍生金融工具公允价值变动	1,324,038.51	28,409,274.59
其他	152,928,392.11	28,556,873.36
合计	154,252,430.62	56,966,147.95

3. 本集团认为在未来期间很可能获得足够的应纳税所得额用来抵扣可抵扣暂时性差异，因此确认相关递延所得税资产。

注释 18. 商誉

被投资单位名称	2020 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日减值准备	本期企业合并形成	外币报表折算差异	2021 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日减值准备
中原期货股份有限公司	7,268,756.37				7,268,756.37	
中州国际融资有限公司	12,614,035.24	1,576,209.93		-360,298.24	12,253,737.00	1,531,188.20
合计	19,882,791.61	1,576,209.93		-360,298.24	19,522,493.37	1,531,188.20

(1) 本公司于 2007 年非同一控制下收购了中原期货股份有限公司（原名为“豫粮期货经纪有限公司”）55.68% 的权益。合并成本超过按比例获得的中原期货股份有限公司可辨认资产、负债公允价值的差额确认为与中原期货股份有限公司相关的商誉。

(2) 本公司之子公司中州国际于 2016 年非同一控制下收购中州国际融资（原名为“泛亚金融有限公司”）100% 股权，合并对价 24,416,272.00 港币，合并日中州国际融资可辨认净资产公允价值为 7,556,040.59 港币，差额 16,860,231.41 港币，以 2021 年 12 月 31 日汇率折合人民币后计入商誉。

(3) 上述被投资单位产生的主要现金流独立于本公司的其他子公司，且本公司对上述子公司均单独进行经营管理，因此，每个子公司就是一个资产组，企业合并形成的商誉被分配至相对应的子公司以进行减值测试。本公司商誉的可收回金额以预计未来现金流量现值的方法确定。现金流量的折现使用适当的折现率进行计算，并反映相关资产组的特定风险。截止 2021 年 12 月 31 日，本公司账面商誉经减值测试，根据预计可收回金额计提减值准备人民币 1,531,188.20 元，较上期变动为外币报表折算。

注释 19. 其他资产

1. 明细情况

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
其他应收款	151,334,689.18	208,187,453.87
待摊费用	26,860,381.26	8,724,860.09
长期待摊费用	34,238,212.32	29,304,787.78
待转承销费用	627,901.97	758,196.90
委托贷款		4,000,000.00
贷款		875,830,915.70
大宗商品存货	18,632,753.49	197,278,287.50
应收结算担保金	10,049,607.08	10,053,020.30
待抵扣进项税	422,032.42	3,763,992.39
期货会员资格	1,400,000.00	1,400,000.00
应收利息	216,514.54	1,262,539.54
其他	39,443,329.12	46,759,420.62
合计	283,225,421.38	1,387,323,474.69

2. 其他应收款

(1) 按款项性质列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
预付款项	65,039,968.23	37,802,104.67
押金	20,333,604.96	18,457,262.12

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股权转让款	28,000,000.00	28,000,000.00
应收债权	13,927,354.17	14,584,450.53
保证金	54,204,892.68	107,692,585.42
代扣代缴款	110,990.67	193,064.03
其他	11,914,990.84	19,267,087.49
减：坏账准备	42,197,112.37	17,809,100.39
其他应收款账面价值	151,334,689.18	208,187,453.87

(2) 按评估方式列示

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 年 12 月 31 日		
	账面余额	坏账准备	比例 (%)	账面余额	坏账准备	比例 (%)
单项计提坏账准备	106,993,990.36	35,581,660.44	33.26	133,831,876.43	12,785,582.57	9.55
单项小计	106,993,990.36	35,581,660.44		133,831,876.43	12,785,582.57	
组合计提坏账准备						
其中：1 年以内	51,131,838.12	255,661.24	0.50	56,469,157.79	282,345.90	0.50
1-2 年	12,398,855.20	619,942.76	5.00	18,713,083.99	935,654.20	5.00
2-3 年	6,371,639.49	637,163.95	10.00	9,355,826.17	935,582.62	10.00
3-4 年	9,313,471.55	1,862,694.31	20.00	2,391,853.82	478,370.76	20.00
4-5 年	2,105,068.77	631,520.63	30.00	1,129,068.48	338,720.54	30.00
5 年以上	5,216,938.06	2,608,469.04	50.00	4,105,687.58	2,052,843.80	50.00
组合小计	86,537,811.19	6,615,451.93		92,164,677.83	5,023,517.82	
合计	193,531,801.55	42,197,112.37		225,996,554.26	17,809,100.39	

(3) 期末其他应收款余额中无应收关联方款项。

3. 长期待摊费用

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期摊销	本期其他减少	2021 年 12 月 31 日
装修改造款等	29,304,787.78	17,518,110.89	12,574,654.30	10,032.05	34,238,212.32
合计	29,304,787.78	17,518,110.89	12,574,654.30	10,032.05	34,238,212.32

4. 委托贷款

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
委托贷款	22,563,560.95	34,416,951.35
减：减值准备	22,563,560.95	30,416,951.35
委托贷款账面价值		4,000,000.00

5. 贷款

(1) 按类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
个人		40,841,156.74
机构		977,539,981.74
减：减值准备		142,550,222.78
账面价值		875,830,915.70

(2) 按增信方式列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
抵押贷款		165,098,079.70
质押贷款		69,537,966.67
保证贷款		771,612,802.11
信用贷款		12,132,290.00
减：减值准备		142,550,222.78
账面价值		875,830,915.70

(3) 贷款减值准备的变动

项目	2020 年 12 月 31 日	本期计提	其他转出	2021 年 12 月 31 日
贷款减值准备	142,550,222.78	11,479,740.61	154,029,963.39	
合计	142,550,222.78	11,479,740.61	154,029,963.39	

注释 20. 融券业务

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
融出证券	15,288,471.47	6,015,764.80
—交易性金融资产	14,531,200.47	6,015,764.80
—转融通融入证券	757,271.00	
转融通融入证券总额	4,454,060.00	

于 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本公司融券业务无重大合约逾期。

注释 21. 资产减值准备明细表

1. 变动明细表

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少		其他	外币报表折算差额	2021 年 12 月 31 日
			转回	其他转出			
融出资金减值准备	75,573,962.68	2,483,297.58	950,322.72			-124,277.65	76,982,659.89
应收账款坏账准备	325,783,423.38	10,808,127.71		185,163.47		-25,111.22	336,381,276.40
其他应收款坏账准备	17,809,100.39	24,739,015.95		325,040.77		-25,963.20	42,197,112.37
买入返售金融资产减值准备	266,942,311.46	186,789,750.66	12,191,463.16				441,540,598.96
债权投资减值准备	157,724,630.67	159,520,806.13	23,041.81			-2,528,005.43	314,694,389.56
其他债权投资减值准备	70,974,959.83		889,287.16				70,085,672.67
其他资产减值准备	9,967,776.77						9,967,776.77
贷款减值准备	142,550,222.78	11,479,740.61		154,029,963.39			
委托贷款减值准备	30,416,951.35		7,853,390.40				22,563,560.95
金融工具及其他项目信用减值准备小计	1,097,743,339.31	395,820,738.64	21,907,505.25	154,540,167.63		-2,703,357.50	1,314,413,047.57
长期股权投资减值准备	30,154,117.51	268,789.24		3,476,571.60		-446,016.55	26,500,318.60
存货跌价准备		2,483,593.75		2,470,643.76			12,949.99
商誉减值准备	1,576,209.93					-45,021.73	1,531,188.20
其他资产减值准备小计	31,730,327.44	2,752,382.99		5,947,215.36		-491,038.28	28,044,456.79
合计	1,129,473,666.75	398,573,121.63	21,907,505.25	160,487,382.99		-3,194,395.78	1,342,457,504.36

2. 金融工具及其他项目预期信用损失准备情况

项目	2021 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
融出资金减值准备	24,604,850.05	151,315.07	52,226,494.77	76,982,659.89
应收账款坏账准备		2,827,300.49	333,553,975.91	336,381,276.40
其他应收款坏账准备		6,615,451.93	35,581,660.44	42,197,112.37
买入返售金融资产减值准备	909,881.53		440,630,717.43	441,540,598.96
债权投资减值准备			314,694,389.56	314,694,389.56
其他债权投资减值准备	377,272.67		69,708,400.00	70,085,672.67
其他资产减值准备			9,967,776.77	9,967,776.77
贷款减值准备				
委托贷款减值准备			22,563,560.95	22,563,560.95
合计	25,892,004.25	9,594,067.49	1,278,926,975.83	1,314,413,047.57

续：

项目	2020 年 12 月 31 日			合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	
融出资金减值准备	21,729,825.88	1,614,024.67	52,230,112.13	75,573,962.68
坏账准备		9,550,197.58	334,042,326.19	343,592,523.77
买入返售金融资产减值准备	1,371,808.35		265,570,503.11	266,942,311.46
债权投资减值准备	23,041.81		157,701,588.86	157,724,630.67
其他债权投资减值准备	1,266,559.83		69,708,400.00	70,974,959.83
其他资产减值准备			9,967,776.77	9,967,776.77
贷款减值准备	4,922,882.76	641,944.33	136,985,395.69	142,550,222.78
委托贷款减值准备			30,416,951.35	30,416,951.35
合计	29,314,118.63	11,806,166.58	1,056,623,054.10	1,097,743,339.31

注释 22. 短期借款

借款类别	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
信用借款		42,082,000.00
保证借款（注 1）	256,191,822.27	273,895,554.88
合计	256,191,822.27	315,977,554.88

注 1：保证借款具体内容：

- 截止 2021 年 12 月 31 日，保证借款系子公司中州国际以内保外贷的形式向招商永隆银行有限公司借入 7,760 万港币的款项，借款期限不超过 1 年，借款年利率 Hibor+1.50%。

- 2) 截止 2021 年 12 月 31 日, 保证借款系子公司中州国际以内保外贷的形式向招商永隆银行有限公司借入 4,850 万港币的款项, 借款期限不超过 1 年, 借款年利率 Hibor+1.50%。
- 3) 截止 2021 年 12 月 31 日, 保证借款系子公司中州国际以内保外贷的形式向招商永隆银行有限公司借入港币 10,185 万的款项, 借款期限不超过 1 年, 借款年利率 Hibor+1.50%。
- 4) 截止 2021 年 12 月 31 日, 保证借款系子公司中州国际以内保外贷的形式向招商永隆银行有限公司借入港币 7,275 万的款项, 借款期限不超过 1 年, 借款年利率 Hibor+1.50%。
- 5) 截止 2021 年 12 月 31 日, 保证借款系子公司豫新投资向中国光大银行股份有限公司郑州高新区支行借入 1,000 万元人民币, 借款期限不超过 1 年, 借款年利率为 5.20%。

注释 23. 应付短期融资款

类型	面值 (万元)	起息日期	债券期限	发行金额 (万元)	票面利率	2020 年 12 月 31 日账面余额	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日账面余额
18 中原 01 (注 1)	150,000	2018 年 4 月 27 日	3 年	150,000	5.58%	1,557,328,766.98	26,371,233.02	1,583,700,000.00	
19 中原 01 (注 2)	200,000	2019 年 3 月 26 日	3 年	200,000	3.90%		2,059,902,946.46		2,059,902,946.46
21 中原 S1 (注 3)	100,000	2021 年 5 月 20 日	1 年	100,000	3.21%		1,019,875,616.43		1,019,875,616.43
21 中原 S2 (注 4)	120,000	2021 年 6 月 18 日	1 年	120,000	3.35%		1,221,696,986.32		1,221,696,986.32
收益凭证 (注 5)	288,922.40	2020 年 12 月 31 日至 2021 年 12 月 31 日	14~272 天	288,922.40	3.10%~6.00%	1,868,611,194.94	7,736,625,515.35	7,883,032,070.42	1,722,204,639.87
Guaranteed Bonds due 2021 (注 6)	11,000 (万美元)	2020 年 9 月 15 日	363 天	11,000 (万美元)	5.20%	728,717,847.98	18,572,382.47	747,290,230.45	
19 中原 C1 (注 7)	100,000	2019 年 10 月 30 日	3 年	100,000	4.90%		1,008,591,780.85		1,008,591,780.85
合计						4,154,657,809.90	13,091,636,460.90	10,214,022,300.87	7,032,271,969.93

注 1: 根据公司 2015 年度第三次临时股东大会决议通过的《中原证券股份有限公司关于公司发行境内外债务融资工具及相关授权的议案》，经上海证券交易所《关于对中原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[2017]586 号），获准面向合格投资者非公开发行总额不超过 100 亿元次级债券。于 2018 年 4 月 26 日，公司发行 2018 年第一期次级债，面值为 15 亿元，债券期限为 3 年，票面利率为 5.58%。

注 2: 根据公司 2015 年度第三次临时股东大会决议，经中国证券监督管理委员会《关于核准中原证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2019]326 号）核准，公司获准向合格投资者公开发行面值总额不超过 30 亿元的公司债券。2019 年 3 月 25 日，公司发行债券 20 亿元，债券期限为 3 年，票面利率 3.90%。

注 3: 根据公司 2019 年第一次临时股东大会决议，经中国证券监督管理委员会《关于同意中原证券股份有限公司向专业投资者公开发行短期公司债券注册的批复》（证监许可[2021]377 号）核准，公司获准向专业投资者公开发行总额不超过 50 亿元的短期公司债券。2021 年 5 月 19 日，公司发行债券 10 亿元，债券期限为 1 年，票面利率 3.21%。

注 4：根据公司 2019 年第一次临时股东大会决议，经中国证券监督管理委员会《关于同意中原证券股份有限公司向专业投资者公开发行短期公司债券注册的批复》（证监许可[2021]377 号）核准，公司获准向专业投资者公开发行总额不超过 50 亿元的短期公司债券。2021 年 6 月 17 日，公司发行债券 12 亿元，债券期限为 1 年，票面利率 3.35%。

注 5：截止 2021 年 12 月 31 日，公司存续收益凭证包括新易系列收益凭证 33,264,000.00 元，金易系列收益凭证 832,564,000.00 元，尊易系列收益凭证 436,382,000.00 元和融易系列收益凭证 410,000,000.00 元，期限为 14~341 天，利率区间为 3.10%~6.00%。

注 6：经公司 2020 年度第三次董事会决议审议及香港联交所《Chapter 37 of the Rules Governing the Listing of Securities on The Stock Exchange of Hong Kong Limited and in the Securities and Futures Ordinance (Cap. 571) of Hong Kong》核准，本公司之子公司 Wending Zhongyuan Company Limited 于 2020 年 9 月 15 日在香港联合交易所发行 363 天 1.1 亿美元高级无抵押债券，票面利率 5.20%。上述债券由本公司之子公司中州国际提供无条件及不可撤销的保证，本公司提供维好协议及流动性支持协议。

注 7：根据公司 2015 年度第三次临时股东大会决议通过的《中原证券股份有限公司关于公司发行境内外债务融资工具及相关授权的议案》，于 2019 年 10 月 29 日，公司发行 2019 年第一期次级债，面值为 10 亿元，债券期限为 3 年，票面利率为 4.90%。

注释 24. 拆入资金

1. 明细分类

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
银行拆入资金	2,900,742,263.92	1,990,620,444.45
转融通拆入资金		1,703,797,777.78
合计	2,900,742,263.92	3,694,418,222.23

2. 转融通拆入资金剩余期限

项目	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1 个月以内			503,004,444.45	2.80%
1 至 3 个月			1,200,793,333.33	2.80%
3 个月-1 年				
合计			1,703,797,777.78	

注释 25. 交易性金融负债

类别	2021 年 12 月 31 日		
	公允价值		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
纳入合并范围结构化主体分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（注 2）	971,171,013.72		971,171,013.72
合计	971,171,013.72		971,171,013.72

续：

类别	2020 年 12 月 31 日		
	公允价值		
	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
债券（注 1）	778,986,314.11		778,986,314.11
纳入合并范围结构化主体分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（注 2）	577,240,268.93		577,240,268.93
合计	1,356,226,583.04		1,356,226,583.04

注 1：截止 2020 年 12 月 31 日，本集团向其他金融机构卖出买断式债券用于融资业务。

注 2：在合并财务报表中，由于本集团有义务于结构化主体到期日按照账面净值及该结构化主体的有关条款向其他投资者进行支付，本集团将合并结构化主体所产生的金融负债分类为交易性金融负债。

注释 26. 卖出回购金融资产款

1. 按业务类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
买断式卖出回购	559,050,286.48	170,134,478.47
质押式卖出回购	9,989,422,041.61	12,030,173,716.26
合计	10,548,472,328.09	12,200,308,194.73

2. 按标的物类别列示

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
债券	10,548,472,328.09	12,200,308,194.73
合计	10,548,472,328.09	12,200,308,194.73

3. 卖出回购金融资产款的担保物信息

担保物类别	2021 年 12 月 31 日公允价值	2020 年 12 月 31 日公允价值
债券	12,261,286,301.56	13,375,777,049.15
合计	12,261,286,301.56	13,375,777,049.15

注释 27. 代理买卖证券款

1. 明细情况

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
普通经纪业务		
其中：个人	10,147,554,339.10	9,183,094,149.35
机构	1,541,998,240.91	594,826,211.62
小计	11,689,552,580.01	9,777,920,360.97
信用业务		
其中：个人	829,911,582.98	758,296,288.57
机构	52,333,649.49	19,013,901.71
小计	882,245,232.47	777,310,190.28
合计	12,571,797,812.48	10,555,230,551.25

注释 28. 应付职工薪酬

1. 应付职工薪酬分类

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日
短期薪酬	558,361,317.06	1,227,232,420.55	1,072,694,206.05	712,899,531.56
离职后福利-设定提存计划	3,012,356.72	121,748,362.95	69,939,888.58	54,820,831.09
辞退福利	558,864.39	981,204.55	1,127,417.95	412,650.99
合计	561,932,538.17	1,349,961,988.05	1,143,761,512.58	768,133,013.64

2. 短期薪酬

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日
工资、奖金、津贴和补贴	456,297,497.60	1,058,440,020.76	928,603,843.00	586,133,675.36

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日
职工福利费	34,212.67	29,643,062.44	29,627,238.00	50,037.11
社会保险费	1,295.00	44,573,981.78	44,459,230.30	116,046.48
其中：医疗保险费	510.35	33,129,623.21	33,015,532.84	114,600.72
工伤保险费	334.55	617,539.05	617,392.36	481.24
生育保险费	195.10	622,043.31	621,603.25	635.16
补充医疗保险	255.00	10,195,349.35	10,195,604.35	
其他		9,426.86	9,097.50	329.36
住房公积金		48,144,122.67	48,144,122.67	
工会经费和职工教育经费	102,028,311.79	46,431,232.90	21,859,772.08	126,599,772.61
合计	558,361,317.06	1,227,232,420.55	1,072,694,206.05	712,899,531.56

3. 离职后福利-设定提存计划

项目	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日
基本养老保险	83,998.29	61,034,057.26	61,061,006.91	57,048.64
失业保险费	4,609.78	2,628,894.38	2,630,387.52	3,116.64
企业年金缴费	2,923,748.65	58,085,411.31	6,248,494.15	54,760,665.81
合计	3,012,356.72	121,748,362.95	69,939,888.58	54,820,831.09

注：本公司及境内子公司按当地政府相关规定缴纳职工基本养老保险（“养老保险计划”），中州国际金融控股有限公司等本公司的香港子公司根据香港《强制性公积金计划条例》规定提供强制性公积金供款（“强积金供款计划”），本公司及境内子公司依据境内企业年金制度相关政策建立企业年金计划（“企业年金计划”）。

截至 2021 年 12 月 31 日，在养老保险计划及强积金供款计划下，本集团未有相关没收供款。在企业年金计划下，本集团依据境内企业年金政策及本集团企业年金管理制度将没收供款留存于企业年金公共账户内，由尚在企业年金计划内的职工所享有，没收供款不会用于抵减未来供款，亦不会降低现有及未来的供款水平。

注释 29. 应交税费

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
企业所得税	54,615,252.06	114,101,377.09
个人所得税	53,853,381.05	9,375,343.19
增值税	10,754,713.60	5,327,159.86
城市维护建设税	988,889.28	1,262,668.74
教育费附加	730,725.07	899,695.79
房产税	378,945.02	396,512.17
土地使用税	59,419.92	59,419.92

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
其他	239,633.74	181,907.79
合计	121,620,959.74	131,604,084.55

注释 30. 应付款项

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
开放式基金清算款	107,259,863.08	52,036,482.97
证券清算款	1,618,809.53	1,584,687.23
银行托管费	5,298,606.20	4,289,034.57
其他	29,416,941.71	7,964,367.83
合计	143,594,220.52	65,874,572.60

注释 31. 合同负债

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
手续费及佣金预收款	6,321,674.96	13,434,590.75
贸易预收款	550,458.72	13,061,090.66
合计	6,872,133.68	26,495,681.41

注释 32. 长期借款

借款类别	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
信用借款		1,001,741.67
合计		1,001,741.67

注释 33. 应付债券

类型	面值(万元)	起息日期	债券期限	发行金额(万元)	票面利率	2020年12月31日账面余额	本期增加	本期减少	2021年12月31日账面余额
19 中原 C1	100,000	2019 年 10 月 30 日	3 年	100,000	4.90%	1,008,591,780.85	40,408,219.15	1,049,000,000.00	
19 中原 01	200,000	2019 年 3 月 26 日	3 年	200,000	3.90%	2,059,237,739.24	18,762,260.76	2,078,000,000.00	
20 中原 C1 (注 1)	150,000	2020 年 4 月 23 日	3 年	150,000	4.08%	1,542,420,821.93	61,200,000.02	61,200,000.00	1,542,420,821.95
21 中原 01 (注 2)	100,000	2021 年 3 月 5 日	3 年	100,000	4.03%		1,032,608,330.62		1,032,608,330.62
21 中原 C1 (注 3)	110,000	2021 年 10 月 22 日	3 年	110,000	4.70%		1,110,196,388.84		1,110,196,388.84
合计	660,000			660,000		4,610,250,342.02	2,263,175,199.39	3,188,200,000.00	3,685,225,541.41

注 1：根据公司 2019 年第一次临时股东大会决议，经上海证券交易所《关于对中原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]544 号），本公司获准面向合格投资者非公开发行总额不超过 30 亿元次级债券。2020 年 4 月 22 日，公司发行债券 15 亿元，债券期限为 3 年，票面利率 4.08%。

注 2：根据公司 2015 年度第三次临时股东大会决议，经中国证券监督管理委员会《关于核准中原证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2019]326 号）核准，公司获准向合格投资者公开发行面值总额不超过 30 亿元的公司债券。2021 年 3 月 4 日，公司发行债券 10 亿元，债券期限为 3 年，票面利率 4.03%。

注 3：根据公司 2019 年第一次临时股东大会决议，经上海证券交易所《关于对中原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]544 号），本公司获准面向合格投资者非公开发行总额不超过 30 亿元次级债券。2021 年 10 月 21 日，公司发行 2021 年第一次次级债 11 亿元，债券期限为 3 年，票面利率 4.70%。注：上证函有效日期是 2021 年 3 月份，但由于疫情影响，上交所为支持抗疫，将审批有效期延长到 2021 年 12 月份。

注释 34. 租赁负债

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
租赁负债	157,162,685.95	157,698,672.45
其中：一年以内到期的租赁负债	62,127,455.74	63,101,382.10
合计	157,162,685.95	157,698,672.45

注：本集团租赁主要为房屋及建筑物。本集团租用房屋及建筑物作为办公场所，办公场所租赁通常为 1 至 5 年不等。

注释 35. 其他负债**1. 明细情况**

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
其他应付款	208,850,990.00	249,046,172.59
预收款	139,877,623.23	60,275,715.32
期货风险准备金	28,591,019.48	25,085,590.18
投资者保护基金	22,289,893.73	4,346,572.63
其他	2,349,825.03	5,669,348.97
合计	401,959,351.47	344,423,399.69

2. 其他应付款

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股权转让款	102,200,000.00	105,205,000.00
仓单质押金（注 1）	1,782,900.00	92,651,296.00
预提督导费、房租、水电费等	23,622,382.40	14,063,675.84
非货币冲抵国债期货保证金	40,075,920.00	
其他	41,169,787.60	37,126,200.75
合计	208,850,990.00	249,046,172.59

注 1：本公司之子公司因开展仓单质押融资业务而设定质押的大宗商品存货账面价值为 2,256,766.10 元，因售后回购融资业务而设定质押的大宗商品存货账面价值为 0 元。

3. 期货风险准备金

本公司之子公司中原期货根据《商品期货交易财务管理暂行规定》按期货经纪业务手续费收入减去应付期货交易所手续费后的净收入的 5% 计提期货风险准备并计入当期损益。动用风险准备金弥补因自身原因造成的损失或是按规定核销难以收回的垫付风险损失款时，冲减期货风险准备金余额。

注释 36. 股本

项目	2020年12月31日	本期变动增减（+、-）					2021年12月31日
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总额	4,642,884,700.00						4,642,884,700.00

注释 37. 资本公积

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年12月31日
股本溢价	6,575,163,079.07			6,575,163,079.07
其他资本公积	-244,540,261.39	27,466,131.91	56,228,366.13	-273,302,495.61
合计	6,330,622,817.68	27,466,131.91	56,228,366.13	6,301,860,583.46

注：本期资本公积-其他资本公积的变动，为本年转让子公司及转让联营企业等原因形成。

注释 38. 其他综合收益

项目	归属于母公司股东的其他综合收益期初余额	本期发生额					税后归属于少数股东	归属于母公司股东的其他综合收益期末余额
		所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：所得税费用	合计	税后归属于母公司		
将重分类进损益的其他综合收益	12,549,125.88	-790,763.55	12,016,437.66	614,274.64	-13,421,475.85	-13,421,475.85	-872,349.97	
其中：其他债权投资公允价值变动	-54,619,229.53	14,507,196.80	11,160,811.09	836,596.43	2,509,789.28	2,509,789.28	-52,109,440.25	
其他债权投资信用减值准备	53,231,219.86	-33,660.59	855,626.57	-222,321.79	-666,965.37	-666,965.37	52,564,254.49	
权益法下可转损益的其他综合收益	2,433,175.41	-2,405,906.43			-2,405,906.43	-2,405,906.43	27,268.98	
外币财务报表折算差额	11,503,960.14	-12,858,393.33			-12,858,393.33	-12,858,393.33	-1,354,433.19	
合计	12,549,125.88	-790,763.55	12,016,437.66	614,274.64	-13,421,475.85	-13,421,475.85	-872,349.97	

注释 39. 盈余公积

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年12月31日
法定盈余公积	663,853,582.46	46,769,454.97		710,623,037.43
任意盈余公积	174,504,665.33	23,384,727.49		197,889,392.82
合计	838,358,247.79	70,154,182.46	-	908,512,430.25

注释 40. 一般风险准备

项目	2020年12月31日	本期增加	本期减少	2021年12月31日
一般风险准备	782,419,033.04	64,831,637.09	18,874,049.38	828,376,620.75
交易风险准备	659,099,780.36	46,769,454.97		705,869,235.33
合计	1,441,518,813.40	111,601,092.06	18,874,049.38	1,534,245,856.08

一般风险准备包括本公司及本公司下属子公司根据相关规定计提的一般风险准备和交易风险准备详见附注四（二十八）一般风险准备金和交易风险准备金。

注释 41. 未分配利润

项目	2021 年度	2020 年度
上期末未分配利润	102,780,913.15	88,232,726.32
调整数		
本期期初未分配利润	102,780,913.15	88,232,726.32
加：归属于母公司股东的净利润	513,210,337.25	104,302,038.78
减：提取法定盈余公积	46,769,454.97	20,182,639.89
提取任意盈余公积	23,384,727.49	10,091,319.94
提取一般风险准备	64,831,637.09	39,297,252.23
提取交易风险准备	46,769,454.97	20,182,639.89
分配普通股股利	157,858,079.80	
其他转入	18,874,049.38	
期末未分配利润	295,251,945.46	102,780,913.15

注释 42. 利息净收入

项目	2021 年度	2020 年度
利息收入	1,017,022,199.16	959,869,249.40
其中：货币资金及结算备付金利息收入	244,851,893.64	246,792,924.19
融出资金利息收入	540,699,231.26	477,557,852.19
买入返售金融资产利息收入	80,633,423.43	82,777,504.62
其中：约定购回利息收入	923,065.44	996,809.98
股票质押回购利息收入	71,017,634.31	46,354,779.03
债权投资利息收入	4,700,029.38	15,031,439.52
其他债权投资利息收入	71,303,021.58	54,322,352.87

项目	2021 年度	2020 年度
贷款利息收入	74,834,346.84	81,401,501.07
委托贷款利息收入		496,861.31
其他	253.03	1,488,813.63
利息支出	878,674,689.37	858,771,546.11
其中：借款利息支出	16,824,922.61	46,006,968.10
应付短期融资款利息支出	124,439,414.26	40,983,987.06
拆入资金利息支出	60,198,833.27	77,148,662.74
其中：转融通利息支出	29,744,335.78	30,440,555.57
卖出回购金融资产款利息支出	314,223,872.18	263,724,123.51
代理买卖证券款利息支出	40,063,204.19	37,816,799.16
应付债券利息支出	301,919,366.87	363,302,104.60
其中：次级债券利息支出	147,031,829.42	267,812,580.47
债券借贷	10,271,094.68	15,528,329.95
其他	10,733,981.31	14,260,570.99
利息净收入	138,347,509.79	101,097,703.29

注释 43. 手续费及佣金净收入

1. 明细情况

项目	2021 年度	2020 年度
证券经纪业务净收入	722,184,615.47	702,390,449.73
——证券经纪业务收入	938,102,542.89	901,944,748.51
——代理买卖证券业务	873,331,959.37	849,557,071.59
交易单元席位租赁	185,702.18	489,128.51
代销金融产品业务	64,487,543.89	51,559,606.38
——证券经纪业务支出	215,917,927.42	199,554,298.78
——代理买卖证券业务	215,830,631.47	199,399,805.52
代销金融产品业务	55,091.74	30,611.75
期货经纪业务净收入	123,551,409.22	88,254,594.49
——期货经纪业务收入	186,802,331.83	125,000,223.60
——期货经纪业务支出	63,250,922.61	36,745,629.11
投资银行业务净收入	635,907,867.58	206,756,722.44
——投资银行业务收入	644,656,912.82	217,653,553.36
——证券承销业务	577,416,845.10	114,957,161.13
证券保荐业务	21,642,673.67	29,729,145.23
财务顾问业务	45,597,394.05	72,967,247.00
——投资银行业务支出	8,749,045.24	10,896,830.92
——证券承销业务	4,414,185.24	9,313,489.57

项目	2021 年度	2020 年度
证券保荐业务	751,014.78	567,107.20
财务顾问业务	3,583,845.22	1,016,234.15
资产管理业务净收入	37,289,783.89	47,316,049.98
——资产管理业务收入	37,397,073.12	47,758,408.04
——资产管理业务支出	107,289.23	442,358.06
基金管理业务净收入	11,940,569.81	13,254,217.54
——基金管理业务收入	18,940,480.98	13,254,217.54
——基金管理业务支出	6,999,911.17	
投资咨询业务净收入	73,962,961.66	81,561,242.32
——投资咨询业务收入	73,962,961.66	81,561,242.32
——投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	31,971,254.88	32,665,010.33
——其他手续费及佣金收入	31,971,254.88	32,811,519.76
——其他手续费及佣金支出		146,509.43
合计	1,636,808,462.51	1,172,198,286.83
其中：手续费及佣金收入合计	1,931,833,558.18	1,419,983,913.13
手续费及佣金支出合计	295,025,095.67	247,785,626.30

2. 财务顾问业务净收入

财务顾问业务净收入	2021 年度	2020 年度
并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司	4,943,396.23	18,537,735.84
并购重组财务顾问业务净收入-其他	866,037.73	1,499,999.99
其他财务顾问业务净收入	36,204,114.87	51,913,277.02
合计	42,013,548.83	71,951,012.85

3. 代理销售金融产品业务收入

项目	2021年度		2020年度	
	销售总金额	手续费及佣金收入	销售总金额	手续费及佣金收入
基金	8,037,222,981.02	64,487,543.89	6,506,725,198.64	51,559,606.38
合计	8,037,222,981.02	64,487,543.89	6,506,725,198.64	51,559,606.38

注释 44. 投资收益

1. 分类明细

项目	2021 年度	2020 年度
权益法核算的长期股权投资收益	52,636,085.81	53,783,145.31
处置长期股权投资产生的投资收益	31,527,095.80	135,461,265.95
金融工具投资收益	504,231,764.71	417,408,393.21

项目	2021 年度	2020 年度
其中：持有期间取得的收益	386,332,380.21	552,723,899.77
其中：交易性金融资产	833,364,501.56	764,610,338.43
交易性金融负债	-447,032,121.35	-211,886,438.66
处置金融工具取得的收益	117,899,384.50	-135,315,506.56
其中：交易性金融资产	216,856,716.72	-74,667,012.96
其他债权投资	8,066,690.95	10,380,784.48
衍生金融工具	-84,891,659.76	-118,841,465.29
交易性金融负债	-22,132,363.41	47,812,187.21
合计	588,394,946.32	606,652,804.47

2. 交易性金融工具投资收益明细表

交易性金融工具		2021 年度
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	833,364,501.56
	处置取得收益	216,856,716.72
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	
	处置取得收益	
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	-447,032,121.35
	处置取得收益	-22,132,363.41
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	
	处置取得收益	

注释 45. 公允价值变动收益

项目	2021 年度	2020 年度
交易性金融资产	480,105,778.89	-30,313,666.81
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债	6,097,092.65	-9,215,030.06
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	3,283,109.56	-8,995,479.58
合计	489,485,981.10	-48,524,176.45

注释 46. 其他业务收入

项目	2021 年度	2020 年度
大宗商品销售收入	1,542,937,699.11	1,244,565,859.25
股票质押业务罚息收入	8,452,385.62	13,747,986.54
租赁收入	2,702,045.88	2,872,125.98
其他收入	2,940,760.91	3,317,511.08
合计	1,557,032,891.52	1,264,503,482.85

注释 47. 资产处置收益

项目	2021 年度	2020 年度
非流动资产处置收益	69,744.36	-20,777.16
其中：固定资产处置收益	69,744.36	-20,777.16
合计	69,744.36	-20,777.16

注释 48. 其他收益**1. 其他收益明细**

项目	2021 年度	2020 年度
政府补助	9,130,585.76	10,742,594.24
合计	9,130,585.76	10,742,594.24

2. 计入其他收益的主要政府补助说明：

(1) 根据浦东新区财政扶持资格通知书编号：浦扶金融机构（2017）第 0082 号，本公司符合《“十三五”浦东新区促进金融业发展财政扶持办法》的相关规定，具备享受浦东新区财政扶持资格。于 2021 年收到上海市浦东新区金融服务局拨付的财政扶持资金人民币 6,089,000.00 元，根据会计准则的相关规定，计入其他收益。

(2) 根据《人力资源社会保障部、财政部、国家发展改革委 工业和信息化部关于失业保险支持企业稳定就业岗位的通知》（人社部发〔2019〕23 号）的相关规定，本公司及其子公司于 2021 年收到政府稳岗补贴 1,126,856.29 元，根据会计准则的相关规定，计入其他收益。

(3) 根据《财政部、税务总局、人民银行关于进一步加强代扣代收代征税款手续费管理的通知》（财行〔2019〕11 号）的相关规定，本公司及其子公司于 2021 年收到政府个税手续费返还 1,732,429.47 元，根据会计准则的相关规定，计入其他收益。

注释 49. 税金及附加

项目	2021 年度	2020 年度
城市维护建设税	10,244,658.25	9,175,747.94
教育费附加	7,829,214.10	6,576,545.43
其他	3,957,274.01	3,623,017.80
合计	22,031,146.36	19,375,311.17

注释 50. 业务及管理费

项目	2021 年度	2020 年度
职工费用	1,349,961,988.05	933,714,457.22

项目	2021 年度	2020 年度
使用权资产折旧费	76,100,281.34	75,348,822.39
电子设备运转费	41,221,527.48	45,233,347.00
无形资产摊销	37,932,085.40	31,145,351.42
证券投资者保护基金	37,707,679.54	7,811,652.08
广告宣传费	29,340,249.64	17,212,389.01
固定资产折旧费	29,057,276.13	32,922,568.19
咨询费	20,722,753.66	15,984,081.27
邮电通讯费	18,820,477.38	18,440,320.11
居间劳务费	17,893,421.01	13,465,692.06
会员费	16,213,352.81	15,615,489.85
业务招待费	14,715,810.11	12,038,255.41
差旅费	14,169,433.62	12,623,148.95
长期待摊费用摊销	12,574,654.30	13,585,931.11
其他	87,531,511.60	88,943,326.70
合计	1,803,962,502.07	1,334,084,832.77

注：本期业务及管理费中，包含审计费 4,974,620.14 元，其中审计服务 4,129,881.09 元，其他非审计服务费用 844,739.05 元。

注释 51. 信用减值损失

项目	2021 年度	2020 年度
坏账准备	35,547,143.66	6,441,529.85
债权投资减值准备	159,497,764.32	21,475,768.72
其他债权投资减值准备	-889,287.16	70,774,304.74
贷款减值准备	11,479,740.61	59,653,102.85
委托贷款减值准备	-7,853,390.40	9,612,488.41
融出资金减值准备	1,532,974.86	8,226,439.80
买入返售金融资产减值准备	174,598,287.50	166,368,476.54
其他		2,408,888.39
合计	373,913,233.39	344,960,999.30

注释 52. 其他资产减值损失

项目	2021 年度	2020 年度
存货跌价准备	2,483,593.75	24,645,128.84
长期股权投资减值准备	268,789.24	5,530,697.19
商誉减值准备		1,665,500.52
合计	2,752,382.99	31,841,326.55

注释 53. 其他业务成本

项目	2021 年度	2020 年度
大宗商品销售成本	1,506,521,199.17	1,223,165,735.20
投资性房地产折旧	807,981.73	815,580.92
其他	327,971.52	242,027.21
合计	1,507,657,152.42	1,224,223,343.33

注释 54. 营业外收入**1. 营业外收入明细**

项目	2021 年度	2020 年度	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得	36,033.78	2,516.80	36,033.78
政府补助	3,702,933.31	4,446,320.46	3,702,933.31
其他	14,997,414.63	1,411,615.78	14,997,414.63
合计	18,736,381.72	5,860,453.04	18,736,381.72

2. 计入营业外收入的主要政府补助说明：

(1) 根据《广州市天河区人民政府关于印发天河区推动经济高质量发展若干政策意见的通知》（穗天府规〔2020〕3号）的相关规定，本公司于2021年收到天河区商务和金融工作局拨付的天河区金融机构区域总部落户奖励资金人民币1,200,000.00元，根据会计准则的相关规定，计入营业外收入。

(2) 根据青政办发〔2018〕18号文件《青岛市人民政府办公厅印发关于进一步促进青岛市财富管理金融综合改革试验区发展政策措施的通知》的相关规定，本公司于2021年收到青岛市崂山区地方政府拨付的政策奖励资金人民币1,850,393.36元，根据会计准则的相关规定，计入营业外收入。

3. 计入营业外收入的主要其他说明：

其他主要为基差贸易中现货合同交易对手因违约支付的违约金。

注释 55. 营业外支出

项目	2021 年度	2020 年度	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失	1,611,982.80	1,416,680.46	1,611,982.80
捐赠和赞助支出	8,096,459.00	5,548,811.00	8,096,459.00
其他	1,344,658.66	3,680,453.18	1,344,658.66
合计	11,053,100.46	10,645,944.64	11,053,100.46

注释 56. 所得税费用

1. 所得税费用

项目	2021 年度	2020 年度
当期所得税费用	196,135,407.28	156,173,707.05
递延所得税费用	-28,939,914.57	-114,262,405.27
合计	167,195,492.71	41,911,301.78

2. 会计利润与所得税费用调整过程

项目	2021 年度
本期合并利润总额	718,215,361.99
按适用税率计算的所得税费用	179,553,840.50
子公司适用不同税率的影响	21,456,648.01
调整以前年度所得税的影响	-7,688,266.84
非应税收入的影响	-84,500,717.92
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	7,685,993.57
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	
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	41,651,140.26
其他	9,036,855.13
所得税费用	167,195,492.71

注释 57. 每股收益

项目	2021 年度	2020 年度
归属于母公司股东的净利润	513,210,337.25	104,302,038.78
归属于母公司的非经常性损益	22,855,326.04	8,579,668.46
归属于母公司股东、扣除非经常性损益后的净利润	490,355,011.21	95,722,370.32
发行在外的普通股加权平均数	4,642,884,700.00	4,191,493,200.00
基本每股收益	0.11	0.02
扣除非经常性损益的基本每股收益	0.11	0.02

截止 2021 年 12 月 31 日及 2020 年 12 月 31 日，本公司无潜在摊薄普通股，因此摊薄每股收益与基本每股收益相同。

注释 58. 现金流量表附注

1. 收到的其他与经营活动有关的现金

项目	2021 年度	2020 年度
清算款	55,257,502.41	
营业外收入	27,830,933.70	15,188,914.70
其他业务收入	1,557,032,891.52	1,264,503,482.85
贷款	74,834,346.84	219,464,346.95
存货变动	178,645,534.01	

项目	2021 年度	2020 年度
应收保证金变动	53,487,692.74	
其他	69,520,464.33	7,700,390.07
合计	2,016,609,365.55	1,506,857,134.57

2. 支付的其他与经营活动有关的现金

项目	2021 年度	2020 年度
清算款		113,286,307.99
存出保证金的增加	57,378,977.09	349,703,814.84
支付的业务及管理费	298,336,216.86	247,367,702.44
其他业务成本等	1,506,849,169.72	1,223,407,762.41
其他	123,680,796.68	164,887,579.18
合计	1,986,245,160.35	2,098,653,166.86

3. 支付的其他与筹资活动有关的现金

项目	2021 年度	2020 年度
收购少数股东股权支付的现金		28,000,000.00
偿还租赁负债支付的现金	78,788,455.53	77,920,515.87
其他	94,840,433.19	27,534,113.64
合计	173,628,888.72	133,454,629.51

注释 59. 现金流量表补充资料

1. 现金流量表补充资料

项目	2021 年度	2020 年度
1.将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	551,019,869.28	102,119,090.37
加: 信用减值损失	373,913,233.39	344,960,999.30
其他资产减值损失	2,752,382.99	31,841,326.55
投资性房地产及固定资产折旧	29,865,257.86	33,738,149.11
使用权资产折旧	76,100,281.34	75,348,822.39
无形资产摊销	37,932,085.40	31,145,351.42
长期待摊费用摊销	12,574,654.30	13,585,931.11
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”填列)	1,506,204.66	1,434,940.82
公允价值变动损益(收益以“-”填列)	-489,485,981.10	48,524,176.45
利息支出	443,183,703.74	459,039,225.10
汇兑损失(收益以“-”填列)	-1,578,376.60	3,348,221.20

投资损失（收益以“-”填列）	-168,232,923.52	-268,978,988.13
递延所得税资产的减少（增加以“-”填列）	-53,461,717.88	-120,245,657.79
递延所得税负债的增加（减少以“-”填列）	24,521,803.31	5,983,252.52
经营性应收项目的减少（增加以“-”填列）	-1,601,883,580.40	892,744,752.34
经营性应付项目的增加（减少以“-”填列）	-195,140,806.06	-283,786,470.45
经营活动产生的现金流量净额	-956,413,909.29	1,370,803,122.31
2.不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3.现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	14,870,067,135.88	13,312,322,291.24
减：现金的期初余额	13,312,322,291.24	11,805,475,726.56
加：现金等价物的期末余额		
减：现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	1,557,744,844.64	1,506,846,564.68

2. 现金和现金等价物

项目	2021年12月31日	2020年12月31日
现金	14,870,067,135.88	13,312,322,291.24
其中：库存现金	98,430.36	185,324.40
可随时用于支付的银行存款	12,224,208,660.72	10,924,832,764.95
其他货币资金	88,602,006.84	9,142,683.42
结算备付金	2,557,158,037.96	2,378,161,518.47
现金等价物		
其中：三个月内到期的债券投资		
期末现金和现金等价物余额	14,870,067,135.88	13,312,322,291.24

注释 60. 所有权或使用权受到限制的资产

项目	2021年12月31日账面价值	受限原因
货币资金	15,174,127.73	资管业务风险准备金专户
交易性金融资产	12,216,894,246.31	质押用于回购融资、债券借贷
	18,849,600.00	大宗交易限售
	14,531,200.47	已融出证券
	208,110,954.86	股份减持限售
存货	2,256,766.10	质押用于仓单质押融资

注释 61. 受托资产管理业务

项目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	29.00	5.00	2.00
期末客户数量	26,168.00	5.00	5.00
其中：个人客户	26,123.00		
机构客户	45.00	5.00	5.00
期初受托资金	4,743,456,975.63	3,446,864,014.02	591,854,372.22
其中：自有资金投入	25,400,068.05		304,476,073.61
个人客户	1,973,254,923.58		
机构客户	2,744,801,984.00	3,446,864,014.02	287,378,298.61
期末受托资金	5,631,365,502.34	2,256,105,150.42	451,888,652.41
其中：自有资金投入	10,000,149.71		279,614,073.61
个人客户	2,583,062,017.22		
机构客户	3,038,303,335.41	2,256,105,150.42	172,274,578.80
期末主要受托资产初始成本	4,935,222,521.37	2,929,646,627.40	270,790,931.66
其中：股票	15,587,349.23	15,855,916.94	
国债			
其他债券	2,503,721,705.82	2,691,792,710.46	
基金	17,604,119.91	221,998,000.00	70,931.66
信托计划	2,385,500,000.00		
其他	12,809,346.41		270,720,000.00
当期资产管理业务净收入	26,841,389.25	10,299,395.41	148,999.23

注释 62. 外币货币性项目

项目	2021年12月31日外币余额	折算汇率	2021年12月31日折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	7,924,975.50	6.3757	50,527,266.31
欧元	230,166.47	7.2197	1,661,732.89
港币	243,215,885.16	0.8176	198,853,307.71
加元	760.04	5.0046	3,803.70
澳元	47,229.56	4.6220	218,295.03
日元	132,544.62	0.0554	7,344.96
泰铢	0.16	0.1912	0.03
结算备付金			
其中：美元	1,365,902.95	6.3757	8,708,587.41
港币	10,396,410.24	0.8176	8,500,105.01
日元	94,697.30	0.0554	5,247.65
林吉特	651.00	1.5266	993.82
英镑	49.27	8.6064	424.04

项目	2021年12月31日外币余额	折算汇率	2021年12月31日折算人民币余额
欧元	19,482.27	7.2197	140,656.12
存出保证金			
其中：美元	70,000.00	6.3757	446,299.00
港币	500,000.00	0.8176	408,800.00
应收账款			
其中：港币	19,422,348.60	0.8176	15,879,712.22
美元	3,274,375.19	6.3757	20,876,433.90
日元	522,500.00	0.0554	28,946.50
林吉特	18,584.00	1.5266	28,370.33
英镑	1,688.33	8.6064	14,530.44
其他应收款			
其中：港币	10,962,029.28	0.8176	8,962,555.14
美元	200,001.08	6.3757	1,275,146.89
代理买卖证券款			
其中：美元	6,736,254.82	6.3757	42,948,339.83
港元	32,095,923.72	0.8176	26,241,627.26
欧元	39,862.88	7.2197	287,798.03
日元	655,040.00	0.0554	36,289.22
林吉特	18,584.00	1.5266	28,370.33
英镑	1,688.33	8.6064	14,530.44
短期借款			
其中：港币	301,095,808.93	0.8176	246,175,933.38
应付款项			
其中：港币	581,572.20	0.8176	475,493.43
其他应付款			
其中：港币	129,824,207.71	0.8176	106,144,272.22
美元	155.67	6.3757	992.51

注释 63. 境外经营实体

公司 2021 年 1 至 12 月合并报表中包含境外子公司中州国际金融控股有限公司、中州国际证券有限公司、中州国际期货有限公司、中州国际投资有限公司、中州国际融资有限公司、中州国际控股有限公司、中州国际金融集团股份有限公司、Wending Zhongyuan Company Limited 公司。其外币资产负债表中资产、负债类项目采用资产负债表日的即期汇率折算（1 港币：0.8176 人民币）；所有者权益类项目除“未分配利润”外，均按业务发生时的即期汇率折算；利润表中的收入与费用项目，采用交易发生日的即期汇率的近似

汇率折算（本期平均汇率 1 港币：0.829996 人民币）。上述折算产生的外币报表折算差额，在所有者权益项目下单独列示。外币现金流量采用现金流量发生日的即期汇率的近似汇率折算。汇率变动对现金的影响额，在现金流量表中单独列示。

七、合并范围的变更

(一) 处置子公司

1. 单次处置对子公司投资并丧失控制权

子公司名称	股权处置价款	股权处置比例 (%)	股权处置方式	丧失控制权的时点	丧失控制权时点的确定依据	处置价款与处置投资对应的合并财务报表层面享有该子公司净资产份额的差额
河南省中原小额贷款有限公司	162,261,400.00	15.00	有偿转让	2021/12/31	河南省地方金融监督管理局批复	-5,091,636.74

续：

子公司名称	丧失控制权之日剩余股权的比例 (%)	丧失控制权之日剩余股权的账面价值	丧失控制权之日剩余股权的公允价值	按照公允价值重新计量剩余股权产生的利得或损失	丧失控制权之日剩余股权公允价值的确定方法及主要假设	与原子公司股权投资相关的其他综合收益转入投资损益的金额
河南省中原小额贷款有限公司	50.00	557,843,455.80	573,067,750.00	15,224,294.20	以评估报告为准	

(二) 其他原因的合并范围变动

2021 年度，部分前期纳入合并范围的结构化主体在本期清算，不再纳入合并范围，具体如下：

序号	结构化主体名称	清算结束日
1	中原证券惠民一号集合资产管理计划	2021 年 11 月 25 日
2	联盟 17 号集合资产管理计划	2021 年 9 月 30 日
3	中京 1 号集合资产管理计划	2021 年 9 月 30 日

八、在其他主体中的权益

(一) 在子公司中的权益

1. 企业集团的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
中原期货股份有限公司	郑州市	郑州市	期货经纪	51.36		收购
豫新投资管理（上海）有限公司	郑州市	上海市	投资管理		51.36	投资设立
中鼎开源创业投资管理有限	郑州市	北京市	私募股权	100.00		投资设立

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
公司			投资基金管理			
河南中证开元私募基金管理有限公司	郑州市	洛阳市	股权投资管理		60.00	投资设立
中州蓝海投资管理有限公司	郑州市	许昌市	另类投资	100.00		投资设立
中原股权交易中心股份有限公司	郑州市	郑州市	区域性股权市场	35.00		投资设立
中州国际金融控股有限公司	香港	香港	投资控股	100.00		投资设立
中州国际控股有限公司	香港	英属维尔京群岛	控股公司		100.00	投资设立
中州国际金融集团股份有限公司	香港	开曼群岛	控股公司		100.00	投资设立
中州国际融资有限公司	香港	香港	投资银行		100.00	收购
中州国际证券有限公司	香港	香港	证券经纪		100.00	投资设立
中州国际投资有限公司	香港	香港	证券投资		100.00	投资设立
中州国际期货有限公司	香港	香港	期货经纪		100.00	投资设立
Wending Zhongyuan Company Limited	香港	英属维尔京群岛	其他		100.00	投资设立

(1) 子公司的持股比例不同于表决权比例的原因

中原股权交易中心股份有限公司于 2015 年成立，本公司与其他三个投资者签订了一致行动人协定，通过该协定本公司可控制中原股权交易中心股份有限公司 51% 的股权。

(2) 对于纳入合并范围的重要的结构化主体控制的依据

截止 2021 年 12 月 31 日，公司及子公司作为合伙企业的执行事务合伙人拥有河南省中原科创风险投资基金（有限合伙）、河南中证开元创业投资基金（有限合伙）、河南中证开元豫财农业创业投资基金（有限合伙）、安阳普闰高新技术产业投资基金（有限合伙）4 家有限合伙企业的投资决策权，公司能够对其实施控制，因此将上述 4 家合伙企业纳入合并范围。

按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》的规定，公司将公司为管理人且以自有资金参与、所承担的收益（或损失）与产品收益相关的可变回报重大、并满足 2014 年新修订企业会计准则规定“控制”定义的结构化主体，共 1 只集合资产管理计划产品纳入合并报表范围。

截止 2021 年 12 月 31 日，纳入合并范围的重要的结构化主体明细如下：

结构化主体名称	总额/注册资本	2021 年 12 月 31 日公司持有份额占比	直接/间接投资
中原期货天元 1 号集合资产管理计划	11,156,838.36	40.78%	间接
河南省中原科创风险投资基金（有限合伙）	500,000,000.00	50.00%	间接
河南中证开元创业投资基金（有限合伙）	110,000,000.00	15.00%	间接

结构化主体名称	总额/注册资本	2021 年 12 月 31 日公司持有份额占比	直接/间接投资
河南中证开元豫财农业创业投资基金（有限合伙）	100,000,000.00	20.00%	间接
安阳普闰高新技术产业投资基金（有限合伙）	100,000,000.00	13.00%	间接

2. 重要的非全资子公司

子公司名称	少数股东持股比例（%）	本期归属于少数股东损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额	备注
中原期货股份有限公司	48.64	9,677,442.14	6,741,919.80	216,740,687.83	
中原股权交易中心股份有限公司	65.00	73,769,481.88	14,088,200.00	287,522,175.52	

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明：

中原股权交易中心股份有限公司于 2015 年成立，本公司与其他三个投资者签订了一致行动人协定，通过该协定本公司可控制中原股权交易中心股份有限公司 51% 的股权。

3. 重要非全资子公司的主要财务信息

这些子公司的主要财务信息为本公司内各企业之间相互抵消前的金额，但经过了合并日公允价值及统一会计政策的调整：

项目	期末余额/本期发生额	
	中原期货股份有限公司	中原股权交易中心股份有限公司
资产合计	1,998,238,078.41	510,565,352.87
负债合计	1,562,801,697.20	65,892,944.72
营业收入	1,620,634,370.08	165,888,004.18
净利润	19,894,829.97	113,491,510.58
综合收益总额	19,894,829.97	113,491,510.58
经营活动现金流量	484,649,224.57	-27,355,490.17

续：

项目	期初余额/上期发生额	
	中原期货股份有限公司	中原股权交易中心股份有限公司
资产合计	1,909,882,870.38	383,792,372.43
负债合计	1,480,481,319.14	29,948,274.86
营业收入	1,354,079,151.89	86,890,028.71
净利润	18,121,553.88	27,069,279.52
综合收益总额	18,121,553.88	27,069,279.52
经营活动现金流量	-107,950,595.16	-39,512,190.67

(二) 在合营安排或联营企业中的权益

1. 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

项目	期末余额/本期发生额	期初余额/上期发生额
----	------------	------------

项目	期末余额/本期发生额	期初余额/上期发生额
联营企业投资账面价值合计	1,659,879,203.08	1,067,276,173.44
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	52,636,085.81	53,783,145.31
其他综合收益	-2,405,906.43	181,829.12
综合收益总额	50,230,179.38	53,964,974.43

2. 与合营企业投资相关的未确认承诺

本公司无需要披露的承诺事项。

3. 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

本公司不存在需要披露的或有事项。

(三) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括集合资产管理计划、单一资产管理计划、专项资产管理计划、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。公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体收取管理费收入。公司所享有的与产品收益相关的可变回报并不重大，因此未合并此类结构化主体。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司管理的未纳入合并财务报表范围的集合资产管理计划资产总额 8,098,607,820.82 元，单一资产管理计划的资产总额为 205,767,891.49 元，专项资产管理计划的资产总额为 439,935,508.01 元，合伙企业资产总额为 1,075,744,001.12 元。

截止 2021 年 12 月 31 日，本集团在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益分类为交易性金融资产、债权投资，以及计入应收款项的应收管理费、佣金，相关账面价值及最大风险敞口如下：

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易性金融资产	2,173,401,808.84	1,328,580,602.71
债权投资及应收款项	490,195,882.80	487,750,503.80
合计	2,663,597,691.64	1,816,331,106.51

九、与金融工具相关的风险披露

本集团的风险管理目标是秉持资本、风险与收益相匹配的风险管理理念，以承担适度风险，实现业务规模、盈利能力与风险承受能力的最优平衡，为股东带来持续稳定的利润回报。本集团的风险管理策略旨在识别及评估本集团面对的各种风险，设定适当风险承受水平，及时可靠计量及监测风险，确保风险控制在可承受范围内。

本集团面对的主要风险包括：信用风险、市场风险、流动性风险、操作风险、合规风险及信息技术风险等。本集团已采取风险管理政策与程序以识别及评估这些风险，并设立适当风险指标、风险限额水平、风险政策及内部控制程序，且通过信息系统持续监控及管理风险。

风险管理组织架构分为四个层次，包括（i）董事会及监事会；（ii）风险控制委员会、审计委员会及经理层；（iii）合规管理总部、法律事务总部、风险管理总部及稽核审计总部；及（iv）各部门、分支机构与子公司。

第一层次：董事会及监事会

董事会是本公司风险控制组织架构的最高层次，对建立合规有效的风险控制环境负最终责任。董事会负责制定本公司的总体风险控制目标、风险控制政策和内部控制制度，完善治理结构和分级授权委托制度，为本公司风险控制工作指明方向、确定范围并授予相关管理部门执行权力。

监事会承担全面风险管理的监督责任，以监督公司各业务与管理活动中的合法合规执行情况 and 监督公司财务为核心，对本公司董事、高级管理层及相关责任人员在风险控制环节的尽职情况进行监督，保护本公司资产安全，降低业务经营过程中的财务和法律合规风险，维护本公司及其股东的合法权益。

第二层次：风险控制委员会、审计委员会及经理层

风险控制委员会、审计委员会及经理层是本公司风险控制组织架构的第二层次，其职责包括：负责提交全面风险控制年度报告；审议风险控制策略和重大风险控制解决方案；审议重大决策、重大风险、重大事件和重要业务流程的判断标准以及重大决策的风险评估报告；审议风险管理总部提交的风险控制评价报告；审议风险控制组织架构设置以及职责方案和董事会授权的其他事宜。经理层对全面风险管理承担主要责任，制定并适时调整公司风险管理制度；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保其有效落实；对其进行监督，及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制。

第三层次：合规管理总部、法律事务总部、风险管理总部、稽核审计总部

本公司风险控制组织架构的第三个层次为合规管理总部、法律事务总部、风险管理总部、稽核审计总部组成的全面风险管理的协同工作机制。

合规管理总部主要职责：协助合规总监拟定合规政策和合规制度及程序并落实执行；跟踪法律法规和准则变化，及时向高级管理层提出管理建议，督导有关部门进行评估、修改、完善有关制度和业务流程；对内部管理制度、重大决策、新产品、新业务方案进行合规审查；

为公司经营管理层及各部门、分支机构及子公司提供合规咨询建议，对其业务及管理活动的合规性进行监督检查；组织合规培训与宣导，培育公司合规文化；组织落实信息隔离与利益冲突防范管理要求；协助合规总监牵头组织洗钱风险管理工作；组织员工证券投资行为、客户异常交易监测管理；组织合规考核问责，增强合规管理执行效力；按要求向公司董事会、监事会、高级管理层以及监管机构、自律组织履行合规报告义务。

法律事务总部主要职责：在公司董事会和监事会的领导下，协助公司经理层构建法务管理体系和法律风险防范机制，参与公司重大经济活动，为重大经营决策提供法律意见，负责公司合同管理、诉讼仲裁管理、资产保全工作，负责对公司法律顾问及诉讼律师的选聘、管理、评价工作，为公司经营管理及各部门、各分支机构的业务开展提供法律支持与咨询服务，组织开展法制宣教与培训，组织实施防范非法集资工作，指导、协调所属企业开展法律风险防范工作。

风险管理总部按照董事会制定的风险控制目标和政策开展风险控制工作；负责向本公司风险控制委员会提交风险控制政策、风险控制目标、公司治理结构、内部控制制度等风险控制环境的调整建议，供决策参考；为本公司拟订风险管理规章制度及程序并协助审定各业务和管理部门制订相关的风险管理制度及程序、办法、风险管理流程和风险控制指标，并在工作中不断补充、完善和更新风险控制政策，逐步建立并完善本公司的整体风险控制机制；识别、评估、监控业务和交易中的各项风险，并在此基础上建立健全风险政策、风险识别、风险评估和衡量、风险控制、风险监测、风险报告与分析的循环处理及反馈流程；定期检测、监控、评估各部门、分支机构及子公司对风险控制制度及程序的执行情况，如有所需，对风险控制执行情况进行定期或不定期的检查，对发现的风险问题进行及时处理并执行相关的报告程序；建立与各部门、分支机构及子公司之间在风险控制方面的沟通及合作。

稽核审计总部负责组织对公司各部门、业务条线、分支机构及控股子公司进行稽核审计，履行对业务活动、内部控制与风险管理的适当性和有效性进行检查、评价、报告和建议的职能。

第四层次：各部门、分支机构及子公司

风险控制的第四层次为各部门、分支机构及子公司的一线风险控制系统。其风险控制职责为制定本部门的内部控制制度和风险控制措施，确保于其管辖范围内作出合适的风险控制，并根据风险情况及时向风险管理总部或合规管理总部报告。

本集团采用上述风险管理架构并逐步增强风险控制，确保风险可计量并在可控及可接受范围内。

（一）信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。本公司的信用风险主要来自金融资产，金融资产包括银行存款、结算备付金、其他债权投资、买入返售金融资产、债权投资、融出资金、客户贷款及委托贷款、其他流动资产及存出保证金。

本集团的银行存款主要存入国有商业银行或股份制商业银行，而结算备付金则存入中国证券登记结算有限责任公司，相关信用风险较低。

自营交易方面，通过证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司进行交易时，对手方的违约风险较低，而通过银行间市场进行交易时，本集团会对对手方进行评估，仅选择认可信用评级之对手方交易。本公司投资信用评级可接受的债券并监控发行人的营运情况及信用评级。

融资类业务包括融出资金及融出证券。这类金融资产的主要信用风险为客户无法偿还本金、利息或向客户借出的证券。本集团按个别客户基准监管融资交易客户的账户，如有需要，将催缴额外保证金、现金担保物或证券。融出资金以担保物比率监管，确保所担保资产的价值足够支付垫款。于 2021 年 12 月 31 日及 2020 年 12 月 31 日，本集团客户的担保物价值足以抵抗融资类业务的信用风险。

本集团的信用风险亦来自证券及期货经纪业务。若客户未能存入充足的交易资金，本集团或须使用本身资金完成交易结算。本集团要求客户在本集团代其结算前全部存入所有交易所需现金，借以减轻相关信用风险，确保恰当管理有关风险。

本集团部分债权投资项目通过客户贷款²和委托贷款进行，对该类项目的信用风险管理包括立项、尽职调查、内部评审、投资决策、后续跟踪管理等环节。本集团对借款人的信用风险及项目收益进行综合评估，设定担保等风险缓释措施。客户贷款和委托贷款经有权审批人审批。本集团对已出资项目进行持续监控，对可能影响借款人偿付能力的主要负面事件及时报告，并采取措施控制风险。

本集团投资经过适当审批流程的理财产品、资产管理计划和信托计划。

本公司股票质押式回购业务的信用风险控制主要通过对客户风险教育、客户征信与资信评估、授信管理、担保证券风险评估、合理设定限额指标、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式实现。另外，对于违约客户、担保证券不足客户、正常客户的融资，公司均按照企业会计准则第 22 号的规定，按照审慎原则计提减值准备。

1. 预期信用损失计量

自 2018 年 1 月 1 日新金融工具准则首次执行，对于以摊余成本计量的金融资产（包括融出资金、买入返售金融资产和债权投资）和其他债权投资，本公司应用一般方法计量其预

² 如本附注一/（二）公司业务性质和主要经营活动及本附注七、合并范围的变更所述，2021 年度公司通过处置部分股权，丧失对河南省中原小额贷款有限公司的控制权，丧失控制权日为 2021 年 12 月 31 日，2021 年度公司主要经营活动仍包括小额贷款，2021 年度公司整体风险管理工作仍包括客户贷款相关风险管理。

期信用损失，预期信用损失的计量中使用了模型和假设。这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况和客户的信用行为（例如，客户违约的可能性及相应损失）。本公司应用简易方法计量应收款项及其他应收款的预期信用损失，根据简易方法，本公司按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对应用一般方法计量预期信用损失的金融资产，本公司运用自金融资产初始确认之后信用质量发生三阶段变化的减值模型分别计量预期信用损失，具体包括：

- 自初始确认后信用风险未发生显著增加的金融工具进入阶段一，且本公司对其信用风险进行持续监控。

- 如果识别出自初始确认后信用风险发生显著增加，但并未将其视为已发生信用减值的工具，则本公司将其转移至阶段二。

- 对于已发生信用减值的金融工具，则划分为阶段三。

阶段一金融工具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损失准备，阶段二和阶段三金融工具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损失准备。购入或源生已发生信用减值的金融资产是指在初始确认时即存在信用减值的金融资产。这些金融资产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计量损失准备。

对于阶段一和阶段二的上述金融资产，管理层运用包含违约概率、违约损失率及违约风险敞口等关键参数的风险参数模型法评估损失准备。对于阶段三已发生信用减值的上述金融资产，管理层考虑了前瞻性因素，通过预估未来与该金融资产相关的现金流，计量损失准备。

本公司根据会计准则的要求在预期信用损失计量中使用了判断、假设和估计，包括：判断信用风险显著增加的标准；选择计量预期信用损失的适当模型和假设；针对不同类型的产品，在计量预期信用时确定需要使用的前瞻性信息和权重。

2. 预期信用损失计量的参数、假设及估计技术

根据信用风险是否显著增加以及是否发生信用减值，本公司对不同的金融资产分别以 12 个月或整个存续期的预期信用损失计量减值准备。

本公司在计量预期信用损失时，充分考虑了前瞻性信息。预期信用损失为考虑了前瞻性影响的违约概率（PD）、违约损失率（LGD）及违约风险敞口（EAD）三者乘积折现后的结果：

- 违约概率是指借款人在未来 12 个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。本公司计算违约概率考虑的主要因素有：融资类业务维持担保比例及担保证券的波动特征等；债券投资业务经评估后的外部信用评级信息等。

- 违约损失率是指本公司对违约风险敞口发生损失程度作出的预期。本公司计算违约损失率考虑的主要因素有：融资类业务担保品的市值、可变现能力及处置周期，融资人的信用状况及还款能力等；债券投资业务的发行人和债券的类型等。

- 违约风险敞口是指，在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本公司应被偿付的金额。

3. 信用风险显著增加的判断标准

本公司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是否已显著增加。本公司在进行金融资产损失准备阶段划分时，充分考虑了反映金融工具的信用风险是否发生显著变化的各种合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。当触发以下一个或多个定量和定性指标时，本公司认为金融工具的信用风险已发生显著增加。

针对融资类业务，若采取追保措施，维持担保比例低于平仓线，则表明作为抵押的担保品价值或第三方担保质量显著下降，本公司认为该类融资类业务的信用风险显著增加。

如果借款人或债务人在合同付款日后逾期超过 30 天未付款，则视为该金融工具已经发生信用风险显著增加。

于 2021 年 12 月 31 日，本公司将货币资金、结算备付金、存出保证金以及买入返售金融资产中的债券逆回购等金融工具视为具有较低信用风险而不再比较资产负债表日的信用风险与初始确认时相比是否显著增加。

4. 已发生信用减值资产的定义

根据新金融工具准则判断金融工具是否发生信用减值时，本公司所采用的界定标准，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，本公司将该金融资产界定为已发生信用减值，其标准与已发生违约的定义一致：

- 债务人在合同付款日后逾期超过 90 天仍未付款；
- 融资融券业务或股票质押式回购业务采取强制平仓措施、担保物价值已经不能覆盖融资金额；
- 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别；
- 债务人发生重大财务困难；
- 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- 债务人很可能破产或其他财务重组等。

金融资产发生信用减值时，有可能是多个事件的共同作用所致，未必是可单独识别的事件所致。

5. 前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。本公司通过历史数据分析，识别出影响各资产组合的信用风险及预期信用损失的关键经济指标，主要包括宏观经济景气指数一致指数。本公司通过进行回归分析确定这些经济指标历史上与违约概率、违

约敞口和违约损失率之间的关系，并通过预测未来经济指标确定预期的违约概率、违约敞口和违约损失率。

除了提供基本经济情景外，本公司也提供了其他可能的情景及情景权重。针对每一个主要产品类型分析、设定不同的情景，以确保考虑到指标非线性发展特征。本公司在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及其特征。

本公司认为，在 2021 年 1 月 1 日及 2021 年 12 月 31 日，对于公司的所有资产组合，应当考虑应用 3 种不同情景来恰当反映关键经济指标发展的非线性特征。本公司结合统计分析 & 专家判断来确定情景权重，也同时考虑了各情景所代表的可能结果的范围。

本公司在判断信用风险是否发生显著增加时，使用了基准及其他情景下的整个存续期违约概率乘以情景权重，并考虑了定性和上限指标。本公司以加权的 12 个月预期信用损失（阶段一）或加权的整个存续期预期信用损失（阶段二及阶段三）计量相关的损失准备。上述加权的信用损失是由各情景下预期信用损失乘以相应情景的权重计算得出。

与其他经济预测类似，对预计经济指标和发生可能性的估计具有高度的固有不确定性，因此实际结果可能同预测存在重大差异。本公司认为这些预测体现了集团对可能结果的最佳估计。

6. 敏感性分析

预期信用损失计量对模型中使用的参数、前瞻性预测的宏观经济变量、经济场景权重及运用专家判断时考虑的其他因素等是敏感的。这些参数、假设和判断的变化将对信用风险显著增加以及预期信用损失计量产生影响。

7. 担保物及其他信用增级措施

本公司采用一系列政策和信用增级措施来降低信用风险敞口至可接受水平。其中，最为普遍的方法是提供抵押物或担保。本公司根据交易对手的信用风险评估决定所需的担保物金额及类型。对于融出资金和买入返售协议下的担保物主要为股票、债券和基金等。本公司管理层会定期检查担保物的市场价值，根据相关协议要求追加担保物，并在进行损失准备的充足性审查时监视担保物的市场价值变化。

8. 信用风险敞口分析

本集团融资类业务客户资产质量良好，超过 90% 的融出资金和债券逆回购业务的维持担保比达到平仓线以上，且存在充分的抵押物信息表明资产预期不会发生违约。

最大信用风险敞口：

单位：人民币万元

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
货币资金	1,233,203.04	1,095,113.10

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
结算备付金	255,821.91	237,910.01
融出资金	814,801.71	740,075.71
存出保证金	80,225.61	74,487.87
应收款项	9,805.59	16,932.35
买入返售金融资产	97,287.01	205,596.49
交易性金融资产	2,116,797.57	2,029,715.88
债权投资	26,345.25	45,616.89
其他债权投资	97,042.65	208,880.51
其他资产	17,018.40	132,664.80
合计	4,748,348.74	4,786,993.61

9. 信用质量情况分析

截止2021年12月31日，各金融资产项目的信用质量情况如下：

单位：人民币万元

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
贷款及委托贷款				
融出资金	816,058.05	847.54	5,594.39	822,499.98
其他债权投资	45,843.10	39,658.64	11,540.91	97,042.65
债权投资	1,128.20		56,686.49	57,814.69
买入返售金融资产	76,729.67		64,711.40	141,441.07
小计	939,759.02	40,506.18	138,533.19	1,118,798.39
减：减值准备	2,551.47	15.13	80,755.16	83,321.76
合计	937,207.55	40,491.05	57,778.03	1,035,476.63

（二）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。

为防范流动性风险，采取如下措施：一是强化资金头寸和现金流管理，采用大额资金提前预约模式，加强大额资金的监控及管理，科学预测未来不同时间段的现金流缺口，确保融资安排和业务用资节奏的一致性；二是积极拓展融资渠道、综合运用多种融资方式、均衡债务到期分布，提高融资的多元化和稳定程度，避免因融资渠道过于单一或债务集中到期的偿付风险；三是建立流动性储备资金运作管理机制，合理设置流动性储备资金最低持有规模和优质流动性资产配置比例，持有较为充足的优质流动性资产，确保公司能够及时变现足额资金应对在正常和压力情景下出现的资金缺口；四是采用以净资本、流动性为核心的风险监控体系，对风险控制指标进行监控，并使用压力测试评估业务活动对公司流动性的影响；五是

建立并持续完善流动性风险应急机制，定期开展流动性风险应急演练，以确保公司流动性危机应对的及时性和有效性。

本集团持有的金融负债按未折现剩余合同义务到期期限分析如下：

单位：人民币万元

非衍生金融负债	2021年12月31日							
	即期	1个月以内	1-3个月	3个月至1年	1年至5年	5年以上	无期限	合计
短期借款		24,623.37		1,027.23				25,650.60
应付短期融资款				397,651.30	305,849.32			703,500.62
拆入资金		290,267.62						290,267.62
交易性金融负债		24,930.73			72,186.37			97,117.10
卖出回购金融资产款		1,055,323.73						1,055,323.73
代理买卖证券款	126,678.38	1,130,501.41						1,257,179.78
应付债券			124,518.49	108,766.63	157,997.92			391,283.04
应付款项							14,359.42	14,359.42
长期借款								
其他负债							23,114.09	23,114.09
合计	126,678.38	2,525,646.86	124,518.49	507,445.16	536,033.60		37,473.51	3,857,796.00

续：

非衍生金融负债	2020年12月31日							
	即期	1个月以内	1-3个月	3个月至1年	1年至5年	5年以上	无期限	合计
短期借款		31,644.25						31,644.25
应付短期融资款		8,655.70	79,686.52	334,574.57				422,916.79
拆入资金		249,466.89	120,847.99					370,314.88
交易性金融负债		77,898.63			57,724.03			135,622.66
卖出回购金融资产款		1,200,820.87	19,829.62					1,220,650.49
代理买卖证券款	87,081.66	968,441.40						1,055,523.06
应付债券					493,795.39			493,795.39
应付款项							6,587.46	6,587.46
长期借款					106.11			106.11
其他负债							25,339.27	25,339.27
合计	87,081.66	2,536,927.74	220,364.13	334,574.57	551,625.53		31,926.73	3,762,500.36

(三) 市场风险

市场风险是指所持有的金融工具的公允价值因市场价格不利变动而发生的风险，包括汇率风险、利率风险、价格风险等。由于公司主要持有头寸是属于自营投资，因此股票及衍生品价格风险和利率风险对投资业务影响较大。

在市场风险方面，公司遵循稳健、审慎的原则，准确定义、统一测量和审慎评估公司承担的市场风险。公司对于方向性投资业务坚持风险可控、规模适中的风险管理策略，承担适度规模的风险头寸。

1. 汇率风险

汇率的波动会给本集团带来一定的汇兑风险。截止 2021 年 12 月 31 日，本集团外币资产折合人民币占总资产的比例为 2.09%，外币负债折合人民币占总负债的比例为 1.18%，由于外币在本集团资产负债及收入结构中所占比例较低，本集团认为汇率风险对经营影响较小。

2. 利率风险

利率风险是指本集团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。本集团受市场利率变动影响的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债权投资等。

本集团利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具。在其他变量不变的假设条件下，采用敏感性分析衡量利率发生变化时，可能对利润总额和股东权益产生的影响。本集团主要的利率敏感性资产和负债的币种和期限结构基本匹配，本集团的债券投资主要以买入持有稳健策略和利差套利策略为主，对自营业务基点价值、债券评级、久期进行控制，以防范和降低利率风险。

本集团金融资产及金融负债其合同约定重新定价日或到期日（以较早者为准）之前的剩余期限：

单位：人民币万元

项目	2021 年 12 月 31 日						合计
	1 个月 以内	1-3 个月	3 个月 至 1 年	1 年 至 5 年	5 年以上	不计息	
货币资金	1,233,193.20					9.84	1,233,203.04
结算备付金	255,821.91						255,821.91
融出资金	814,801.71						814,801.71
衍生金融资产						5.46	5.46
存出保证金						80,225.61	80,225.61
应收款项						9,805.59	9,805.59
买入返售金融资产	23,303.82	99.63	73,135.81	747.75			97,287.01
交易性金融资产	12,084.04	6,272.39	60,126.91	1,264,008.23	536,568.63	571,731.72	2,450,791.92
债权投资	22,924.10	3,421.15					26,345.25

2021 年年度报告

项目	2021 年 12 月 31 日						
	1 个月 以内	1-3 个月	3 个月 至 1 年	1 年 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
其他债权投资	10,425.34		24,458.23	62,159.08			97,042.65
其他资产						15,155.12	15,155.12
金融资产小计	2,372,554.12	9,793.17	157,720.95	1,326,915.06	536,568.63	676,933.34	5,080,485.27
短期借款	24,597.73		1,021.45				25,619.18
应付短期融资款			396,377.73	306,849.47			703,227.20
拆入资金	290,074.23						290,074.23
交易性金融负债	24,930.73			72,186.37			97,117.10
卖出回购金融资产款	1,054,847.23						1,054,847.23
代理买卖证券款	1,130,501.40					126,678.38	1,257,179.78
衍生金融负债						46.54	46.54
应付债券		111,019.64	103,260.83	154,242.08			368,522.55
应付款项						14,359.42	14,359.42
长期借款							
其他负债						23,114.09	23,114.09
金融负债小计	2,524,951.32	111,019.64	500,660.01	533,277.92		164,198.43	3,834,107.32
利率敏感度缺口	-152,397.20	-101,226.47	-342,939.06	793,637.14	536,568.63	512,734.91	733,643.04

续：

项目	2020 年 12 月 31 日						
	1 个月 以内	1-3 个月	3 个月 至 1 年	1 年 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
货币资金	1,095,094.57					18.53	1,095,113.10
结算备付金	237,910.01						237,910.01
融出资金	60,815.68	211,904.24	467,355.79				740,075.71
衍生金融资产							
存出保证金						74,487.87	74,487.87
应收款项						16,932.35	16,932.35
买入返售金融资产	126,178.03	441.47	73,955.86	5,021.13			205,596.49
交易性金融资产	34,198.68	15,747.64	458,734.50	1,147,611.52	297,037.16	305,927.75	2,259,257.25
债权投资	43,497.64	1,120.40	599.56	399.29			45,616.89
其他债权投资	5,122.99	11,068.17	182,048.99	10,640.36			208,880.51
其他资产	2,911.85	7,546.79	59,521.86	2,602.62	1,365.29	38,988.56	112,936.97
金融资产小计	1,605,729.45	247,828.71	1,242,216.56	1,166,274.92	298,402.45	436,355.06	4,996,807.15

项目	2020 年 12 月 31 日						合计
	1 个月以内	1-3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	
短期借款	31,597.76						31,597.76
应付短期融资款	8,641.78	79,201.92	327,622.08				415,465.78
拆入资金	249,362.49	120,079.33					369,441.82
交易性金融负债	77,898.63			57,724.03			135,622.66
卖出回购金融资产款	1,200,220.82	19,810.00					1,220,030.82
代理买卖证券款	968,441.40					87,081.66	1,055,523.06
衍生金融负债						5.80	5.80
应付债券				461,025.03			461,025.03
应付款项						6,587.46	6,587.46
长期借款				100.17			100.17
其他负债						25,339.27	25,339.27
金融负债小计	2,536,162.88	219,091.25	327,622.08	518,849.23		119,014.19	3,720,739.63
利率敏感度缺口	-930,433.43	28,737.46	914,594.48	647,425.69	298,402.45	317,340.87	958,726.65

3. 价格风险

价格风险指金融工具的公允价值或未来现金流量因市价变动而波动的风险（因利率或货币风险引起的风险除外），而不论有关变动是否由个别金融工具或其发行人这类特定因素或影响市场交易的所有同类金融工具的因素所引起。

本集团的价格风险主要涉及权益类证券、投资基金、可转换债券、衍生工具及集合资产管理计划，这些金融产品的价值会由于市场价格变更而波动。本集团的这类投资均属于中国资本市场的投资，由于中国股票市场波动较大，本集团面临的市场风险较大。

本集团的价格风险管理政策规定要设定及管理投资目标。本集团通过持有适当分散的投资组合、设定不同证券投资限额及密切监控投资组合以减少风险集中于任何特定行业或发行人等手段管理价格风险。本集团运用衍生工具合约经济地对冲投资组合中的风险。

以下敏感度分析，假设所有其他变量维持不变的情况下，股票、基金、可转换债券、衍生工具和集合资产管理计划的价格上升或下降 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，负数表示所得税前利润及所得税前其他综合收益减少。

单位：人民币万元

项目	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	利润总额	其他综合收益	利润总额	其他综合收益
上升 10%	34,499.74	9,704.27	23,385.33	20,888.05
下降 10%	-34,499.74	-9,704.27	-23,385.33	-20,888.05

（四）操作风险

操作风险指由于人员、内部程序、系统的不完善或失误，以及企业外部事件冲击而给本集团带来损失的风险。

本集团强调业务规模、获利与风险管理能力的匹配，不因对利润的追求而牺牲对操作风险的管控。本集团强调在稳健控制操作风险的前提下开展各项证券公司业务。在成本允许的情况下，本集团将持续强化操作风险管理体系，落实内部控制制度，达到既定业务收入下操作风险的可控。

（五）合规风险

合规风险是指因公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规和准则而使公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。

合规总监组织合规管理总部密切关注注册制全面实施、北交所成立、防范化解金融风险、证券行业文化建设等资本市场、证券行业大事要事，持续跟踪、评估最新法律法规和监管动态，为高级管理层、各单位提供完善建议；以合规审核与咨询为基础，落实多层级审核机制，严把入口关，筑牢合规底线；以合规督导、检查为抓手，以合规风险为导向，主动发现、及时防控；以合规监测为工具，利用金融科技增强合规管理信息化、专业化水平；以合规文化建设为引领，开展常态化持续宣导培训，扩大覆盖范围、深入易发合规风险的关键环节，进一步提高全员主动合规意识；将执业行为的合规性纳入工作人员绩效考核范围，优化完善考核指标，严格落实合规考核要求；严肃合规问责机制，切实发挥警示利器作用。

（六）资本管理

本集团的资本管理目标为：

- 保障本集团的持续经营能力，以便持续为股东及其他利益相关者带来回报及利益；
- 支持本集团的稳定及增长；
- 维持稳健的资本基础以支持业务发展；
- 遵守中国法规的资本规定。

中国证监会于 2016 年颁布《证券公司风险控制指标管理办法》（2016 年修订版），并于 2016 年 10 月 1 日起施行。根据上述管理办法，本公司需持续符合下列风险控制指标标准：

- 风险覆盖率不得低于 100%；
- 资本杠杆率不得低于 8%；
- 流动性覆盖率不得低于 100%；
- 净稳定资金率不得低于 100%。

十、公允价值

（一）以公允价值计量的金融工具

本公司按公允价值三个层次列示了以公允价值计量的金融工具于 2021 年 12 月 31 日的账面价值。公允价值整体归类于三个层次时，依据的是公允价值计量时使用的各重要输入值所属三个层次中的最低层次。三个层次的定义如下：

第 1 层次：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 2 层次：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；

第二层次输入值包括：1) 活跃市场中类似资产或负债的报价；2) 非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；3) 除报价以外的其他可观察输入值，包括在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线、隐含波动率和信用利差等；4) 市场验证的输入值等。

第 3 层次：是相关资产或负债的不可观察输入值。

（二）期末公允价值计量

1. 持续的公允价值计量

项目	期末公允价值			
	第 1 层次	第 2 层次	第 3 层次	合计
交易性金融资产	4,363,417,192.04	18,110,822,442.43	2,033,679,544.41	24,507,919,178.88
（1）债券投资	3,565,713,724.18	15,145,564,488.72	133,295,673.61	18,844,573,886.51
（2）股权投资	513,927,753.07	293,783,063.07	620,339,564.19	1,428,050,380.33
（3）公募基金	283,775,714.79	1,628,117,388.40		1,911,893,103.19
（4）其他		1,043,357,502.24	1,280,044,306.61	2,323,401,808.85
衍生金融资产	54,610.00			54,610.00
其他债权投资	458,431,053.14	396,586,360.40	115,409,134.24	970,426,547.78
资产合计	4,821,902,855.18	18,507,408,802.83	2,149,088,678.65	25,478,400,336.66
交易性金融负债			971,171,013.72	971,171,013.72
衍生金融负债	465,376.83			465,376.83
负债合计	465,376.83		971,171,013.72	971,636,390.55

（三）持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

活跃市场交易的金融工具的公允价值根据财务报告日的市场报价确定。倘若从交易所、经销商，及时及定期获得报价，且该等报价反映实际及定期发生的以公平磋商为基准的市场交易，一个市场则被视为活跃。以财务报告日的收盘价确定公允价值，此类工具被纳入第一层次，纳入第一层次的工具主要包括被列为交易性金融资产、其他债权投资中的上海证券交易所和深圳证券交易所交易证券。

（四）持续和非持续第二层次公允价值计量的项目，采用估值技术和重要参数的定性及定量信息

非活跃市场购买的金融工具，其公允价值采用估值技术确定。该等估值技术充分使用可获得的可观察市场数据，并尽可能不依赖实体特定估计。倘若按公允价值计量一项工具所需的所有主要输入参数均可观察获得，则该项工具列入第二层次。

债券投资：

债券投资采用债券登记结算机构估值系统报价。对于在银行间债券市场交易的债券，包括政府债券、公司债券、商业票据、特殊金融票据、中央银行票据和其他固定收益债券，债券登记结算机构估值系统的报价，采用反映市场状况的可观测输入值作为公允价值。

股权投资：

在全国中小企业股份转让系统上市的股票的公允价值以资产负债表日的收盘价为基础，由于交易频率较低，根据估值技术进行调整。该调整基于潜在最大损失，其中潜在最大损失是根据一定时期内利率、股票价格和汇率的变化确定的置信水平。上述参数都是可观测的。

公募基金：

公募基金根据资产负债表日基金的资产净值确定公允价值。基金的资产净值通常根据基础投资（投资组合中的债务工具或公开交易权益工具）的公允价值和相关费用确定，或由第三方（如注册和结算机构）根据贴现现金流模型进行估值。

其他：

本公司投资的其他金融资产主要为集合资产管理产品、基金理财产品、私募股权基金和银行理财产品。公允价值由与其份额相对应的产品净值或使用估值技术确定。估值技术要求的可观察输入值包括投资目标的市场价格和利率等。这些都是可观察的输入值。

下表列示第二层次主要金融工具的相关估值技术和输入参数：

金融工具	公允价值层级	估值技术及主要输入参数	重要不可观察输入参数	不可观察输入参数对公允价值的影响
交易性金融资产				
债券				
银行间市场债券	第二层次	债券登记结算机构估值系统报价	不适用	不适用
股票				
全国中小企业股份转让系统的股票	第二层次	以资产负债表日收盘价为基础，并根据估值技术进行调整	不适用	不适用
公募基金				
公募基金	第二层次	资产负债表日基金的资产净值	不适用	不适用
其他				
集合资产管理产品、基金理财产品、私募股权基金和银行理财产品	第二层次	对应于其份额或使用估值技术的产品净值	不适用	不适用
其他债权投资				
债券				

金融工具	公允价值层级	估值技术及主要输入参数	重要不可观察输入参数	不可观察输入参数对公允价值的影响
银行间市场债券	第二层次	债券登记结算机构估值系统报价	不适用	不适用

(五) 持续和非持续第三层次公允价值计量的项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

1. 估值技术、输入值说明

倘若一个或多个主要输入参数并非根据可观察市场数据确定，则该项工具列入第三层次。对于非上市股权投资、债券投资、信托产品及金融负债等，本公司采用估值技术来确定其公允价值，估值技术包括现金流折现法和市场比较法等。其公允价值的计量采用了重要的不可观察参数，比如流动性折扣、波动率和市场乘数等。非上市股权投资、债券投资、其他投资及金融负债的公允价值对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

2021 年度，本集团上述持续第三层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

2. 不可观察输入值信息

就第三层次金融工具而言，公允价值采用估值法（如贴现现金流量模型及其他类似技术）确定。第三层次的公允价值计量分类，一般由非可观察输入参数对计量总体公允价值的重要性确定。下表列示第三层次主要金融工具的相关估值技术和输入参数：

金融资产/金融负债	公允价值层级	估值技术及主要输入参数	重要不可观察输入参数	不可观察输入参数与公允价值的关系
交易性金融资产				
- 银行理财产品 - 券商资管产品	第三层次	- 用基于预期可收回金额估计的未来现金流量，按反映管理层对预期风险水平最佳估计的贴现率贴现现金流量；	- 预期未来现金流量； - 预期收回日期； - 与预期风险水平对应的贴现率；	- 未来现金流量越高，公允价值越高； - 到期日期越早，公允价值越高； - 贴现率越低，公允价值越高；
- 信托计划	第三层次	- 用基于预期可收回金额估计的未来现金流量，按反映管理层对预期风险水平最佳估计的贴现率贴现现金流量；	- 预期未来现金流量 - 预期收回日期 - 与预期风险水平对应的贴现率	- 未来现金流量越高，公允价值越高； - 到期日期越早，公允价值越高； - 贴现率越低，公允价值越高；
- 私募债、企业债、可转换债券	第三层次	- 用基于预期可收回金额估计的未来现金流量，按反映管理层对预期风险水平最佳估计的贴现率贴现现金流量； - 期权定价模型；	- 预期未来现金流量 - 预期收回日期 - 与预期风险水平对应的贴现率 - 股价波动率	- 未来现金流量越高，公允价值越高； - 到期日期越早，公允价值越高； - 贴现率越低，公允价值越高； - 股价波动越大，公允价值越高；
- 非上市股权	第三层次	- 采用可比公司法选择与目标公司重要财务指标类似的同行业的可比公司，计算可比公司的 PE、PB 和 PS；考虑流动性折扣，估计股权预计退出日期，计算可比公司的波动率，采用期权模型，计算可比公司的流动性折扣	- 预期收回日期 - 股价波动率	- 预计收回日期越早，公允价值越高； - 股价波动越大，公允价值越高；
- 交易性金融负债	第三层次	- 用基于预期应付金额估计的未来现金流量，按反映管理层对预期风险水平最佳估计的贴现率贴现现金流量	- 预期未来现金流量 - 预期付款日期 - 与预期风险水平对应的贴现率	- 未来现金流量越高，公允价值越高； - 付款日期越早，公允价值越高； - 贴现率越低，公允价值越高；
- 衍生金融工具	第三层次	- 采用期权定价模型进行估值，主要输入参数为标的工具的波动率。	- 标的工具波动率	- 标的工具波动率越高，公允价值越高。

(六) 第三层次金融工具的变动

项目	2021 年 1 月 1 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日
交易性金融资产	1,286,539,048.95	747,140,495.46		2,033,679,544.41
交易性金融负债	577,240,268.93	393,930,744.79		971,171,013.72
其他债权投资	115,409,134.24			115,409,134.24

续:

项目	2020 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2020 年 12 月 31 日
交易性金融资产	1,209,210,826.77	77,328,222.18		1,286,539,048.95
交易性金融负债	399,760,116.86	177,480,152.07		577,240,268.93
其他债权投资		115,409,134.24		115,409,134.24
衍生金融资产	11,265,850.93		11,265,850.93	
衍生金融负债	44,320.00		44,320.00	

(七) 持续的公允价值计量项目，本期内发生各层次之间的转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

本公司上述持续的公允价值计量项目在本期末发生各层次之间的转换。

(八) 本期内发生的估值技术变更及变更原因

本公司金融工具的公允价值估值技术在本期末发生变更。

(九) 不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：融出资金、买入返售金融资产、应收款项、债权投资、短期借款、应付款项、应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付债券和长期借款、在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资。

上述不以公允价值计量的金融资产和负债的账面价值与公允价值相差很小。

十一、关联方及关联交易**(一) 本企业的母公司情况**

截止 2021 年 12 月 31 日，河南投资集团有限公司（以下简称河南投资集团）直接或间接持有公司有表决权股份占公司总股份的 20.99%（注 1），为公司的控股股东。河南投资集团基本情况如下表：

母公司名称	企业类型	注册地	业务性质	法人代表	统一社会信用代码
河南投资集团	国有企业	郑州市	投资管理	刘新勇	914100001699542485

注 1：截至报告期末，河南投资集团持有公司 A 股 822,983,847 股，通过其全资附属公司大河纸业（香港）有限公司直接持有公司 H 股 4,673.3 万股，通过港股通持有公司 H 股 10,497.7 万股，合计持有公司 974,693,847 股，占公司总股本的 20.99%。

1. 本公司实际控制人为河南省财政厅。

(二) 本公司的合营和联营企业情况

本公司重要的合营或联营企业详见附注八（二）在合营安排或联营企业中的权益。

联营企业情况如下：

合营或联营企业名称	与本公司关系
河南省中原小额贷款有限公司	子公司的联营企业
民权县创新产业投资基金（有限合伙）	子公司的联营企业
河南大河财立方传媒控股有限公司	子公司的联营企业
河南龙凤山农牧股份有限公司	子公司的联营企业
洛阳德胜生物科技股份有限公司	子公司的联营企业
中证焦桐基金管理有限公司	子公司的联营企业
河南投实文化传播有限公司	子公司的联营企业
郑州大河智信科技股份公司	子公司的联营企业
漯河华瑞永磁材料股份有限公司	子公司的联营企业

(三) 不存在控制关系的主要关联方

关联方名称	与公司的关系	统一社会信用代码/组织机构代码
中原信托有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410000169953018F
河南汇融人力资本集团有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410105MA3X6PQ842
河南资产基金管理有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410100MA456R9R3R
河南信产软件有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410100MA3X691D21
河南天地酒店有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410100594892586U
城发环境股份有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410000711291895J
河南安彩高科股份有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	9141000070678656XY
深圳国裕高华投资管理有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	914403003267120593
河南资产管理有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410000MA448PJU6H
河南创业投资股份有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	914100007425233538
河南省科技投资有限公司	受同一控股股东及最终控制方控制的其他企业	91410000169955769X
渤海产业投资基金管理有限公司	非控股股东	911200007178678241
安阳钢铁集团有限责任公司	非控股股东	91410000706780942L
安钢集团国际贸易有限责任公司	非控股股东的子公司	91410500172267086K
安阳钢铁股份有限公司	非控股股东的子公司	914100007191734203
河南易成新能源股份有限公司	所属企业集团的联营企业	914102002681294387

关联方名称	与公司的关系	统一社会信用代码/组织机构代码
中原银行股份有限公司	所属企业集团的联营企业	9141000031741675X6
郑州银行股份有限公司	所属企业集团的联营企业	914100001699995779
泓羿投资管理(河南)合伙企业(有限合伙)	所属企业集团的联营企业	91410100MA9G4DKW4X
河南中金汇融私募基金管理有限公司	所属企业集团的联营企业	91410100MA44AMW06L
河南中智国裕基金管理有限公司	所属企业集团的联营企业	91410100MA45DE4E88
河南省南水北调对口协作产业投资基金(有限合伙)	所属企业集团的联营企业	91410000MA40EF1J3Q
河南华祺节能环保创业投资有限公司	所属企业集团的联营企业	91410000071384697T
郑州中原国际航空控股发展有限公司	所属企业集团的联营企业	91410100MA40XF1874

(四) 关联方交易

1. 提供代理买卖证券服务产生的手续费收入

关联方名称	2021 年度	2020 年度
渤海产业投资基金管理有限公司	1,284,187.09	170,704.58
河南投资集团及其子公司和联营企业	95,114.44	246,038.79
安钢集团国际贸易有限责任公司	20,406.07	4,202.49
公司与河南投资集团的董事、监事、高级管理人员及其关系密切的家庭成员等	42,968.94	36,496.87

2. 关联方贷款

关联方名称	2021 年 12 月 31 日/2021 年度		2020 年 12 月 31 日/2020 年度	
	贷款余额	利息收入	贷款余额	利息收入
河南龙凤山农牧股份有限公司		1,686,997.16	45,000,000.00	5,075,164.97

3. 关联往来余额

关联方名称	往来科目	交易内容	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
河南投资集团	应收款项	资产管理业务收入	1,967,868.64	1,309,786.65
洛阳德胜生物科技股份有限公司	应收款项	财务顾问费	200,000.00	450,000.00
安阳钢铁股份有限公司	代理买卖证券款	期货经纪业务	1,921,146.96	
安钢集团国际贸易有限责任公司	代理买卖证券款	期货经纪业务	3,710,593.59	
河南资产基金管理有限公司	交易性金融资产	私募股权投资基金	20,416,783.22	
河南省中原小额贷款有限公司	应付账款	信托计划	16,017,647.72	
河南信产软件有限公司	无形资产	购买无形资产	252,359.88	
河南投资集团及其子公司和联营企业	代理买卖证券款	证券经纪业务	17,932,558.30	11,323,588.02
公司与河南投资集团的董事、监	代理买卖证券款	证券经纪业务	4,185,687.79	773,380.47

关联方名称	往来科目	交易内容	2021年12月31日	2020年12月31日
事、高级管理人员及其关系密切的家庭成员等				
渤海产业投资基金管理有限公司	代理买卖证券款	证券经纪业务	2,436,691.26	4,471,290.10
安阳钢铁集团有限责任公司	代理买卖证券款	证券经纪业务	0.35	2,154.97
安阳钢铁股份有限公司	代理买卖证券款	证券经纪业务	387,782.11	28,118.49

续:

关联方名称	往来科目	交易内容	2021年12月31日	2020年12月31日
投资集团联营企业	交易性金融资产	理财产品		7,000,000.00
投资集团联营企业	银行存款	银行存款余额	4,068,998.40	377,648,985.84
投资集团联营企业	其他资产	费用支出	132,075.47	302,672.95
投资集团联营企业	买入返售金融资产	买断式回购		40,292,940.03
投资集团联营企业	应付债券	认购公司债券	305,822,609.89	164,524,887.67

4. 其他关联交易

关联方名称	关联交易内容	2021年度	2020年度
城发环境股份有限公司	承销收入		3,628,661.86
河南投资集团有限公司	承销保荐、财务顾问费收入、资产管理业务收入等收入	1,413,503.76	1,435,827.08
河南大河财立方传媒控股有限公司	费用支出	1,631,301.42	546,383.63
渤海产业投资基金管理有限公司	财务顾问费收入		372,539.60
洛阳德胜生物科技股份有限公司	督导费、财务顾问费收入		141,509.43
中证焦桐基金管理有限公司	费用支出		97,000.00
河南汇融人力资本集团有限公司	费用支出	19,630.56	89,067.58
河南天地酒店有限公司	费用支出		40,321.58
河南投实文化传播有限公司	费用支出		19,801.98
郑州大河智信科技股份有限公司	托管费收入		9,749.92
安阳钢铁集团有限责任公司	质押登记费	43,867.92	
安钢集团国际贸易有限责任公司	销售货物收入	34,125,663.74	
河南信产软件有限公司	费用支出	4,277.29	

续:

关联方名称	关联交易内容	2021年度	2020年度
投资集团联营企业	银行存款和理财产品收入	3,977,378.23	3,947,913.14
投资集团联营企业	质押式回购利息支出	402,394.09	434,840.05
投资集团联营企业	债券投资收益	29,641.92	1,498,186.40
投资集团联营企业	买断式回购利息收入	15,899.51	163,908.08
投资集团联营企业	财务顾问费收入和承销收入	4,739,622.38	3,773,584.90

关联方名称	关联交易内容	2021 年度	2020 年度
投资集团联营企业	银行借款利息支出、应付次级债务利息支出	7,825,637.69	4,626,525.28

5. 为子公司提供反担保

截止 2021 年 12 月 31 日,本公司为中州国际向招商银行股份有限公司郑州分行提供反担保,累计反担保金额为 310,000,000.00 港元(折合为人民币 253,456,000.00 元),反担保期限不超过 12 个月。

6. 董事、监事及职工薪酬

(1) 主要管理人员薪酬

主要管理人员包括董事会和监事会成员及其他高级管理人员。2021 年度,本公司支付及应付主要管理人员薪酬(税后)如下:

单位:人民币万元

项目	2021 年度	2020 年度
主要管理人员薪酬(税后)	1,839.60	1,809.12

(2) 董事及监事薪酬

2021 年度本公司支付及应付董事及监事的薪酬(税后)如下:

姓名	薪金	工资、津贴及其他补贴	退休金	酌情奖金	合计
执行董事					
菅明军		438,029.69	43,824.00	533,770.31	1,015,624.00
常军胜		533,931.01	25,344.00	-	559,275.01
非执行董事					
袁志伟	113,460.00				113,460.00
宁金成	105,000.00				105,000.00
于绪刚	210,000.00				210,000.00
张东明	210,000.00				210,000.00
曾崧	113,460.00				113,460.00
陈志勇	105,000.00				105,000.00
陆正心	35,136.00				35,136.00
张笑齐	30,720.00				30,720.00
王立新	30,720.00				30,720.00
监事					
鲁智礼		401,001.66	38,755.20	655,262.70	1,095,019.56
肖怡忱		390,466.94	25,291.20	154,405.87	570,164.01

姓名	薪金	工资、津贴及其他补贴	退休金	酌情奖金	合计
张露		431,740.74	29,568.00	445,642.42	906,951.16
张华敏	1,121,100.00				1,121,100.00
巴冠华		32,273.33	3,885.20		36,158.53
许昌玉		28,731.07	2,921.60		31,652.67
项思英	100,800.00				100,800.00
夏晓宁	112,920.00				112,920.00

注：上述董事、监事的 2021 年薪酬尚未最终确定，但预计未计提的薪酬不会对本集团 2021 年度财务报表产生重大影响

(3) 五名最高薪酬人士

于 2021 年度，本公司五名最高薪酬人士无董事与监事，支付及应付的薪酬（税后）如下：

项目	2021 年度	2020 年度
工资、津贴及其他福利	4,964,308.76	2,237,985.88
退休金	201,009.60	147,787.20
酌情奖金	26,350,201.43	11,532,816.66
合计	31,515,519.79	13,918,589.74

(4) 主要管理人员贷款及垫款

本公司于报告期末，无向董事会、监事会成员及其他高级管理人员发放贷款及垫款的情形。

十二、承诺及或有事项

(一) 重要承诺事项

1. 资本性承诺

本公司已签订合同但未在财务报表中确认的资本性承诺情况如下：

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
已签约但未支付	625,798,267.64	32,184,984.30
合计	625,798,267.64	32,184,984.30

除存在上述承诺事项外，截止 2021 年 12 月 31 日，本公司无其他应披露未披露的重大承诺事项。

(二) 资产负债表日存在的重要或有事项

本公司不存在需要披露的重要或有事项。

十三、资产负债表日后事项

(一) 重要的非调整事项

1. 向专业投资者公开发行公司债

2022 年 1 月，公司收到中国证券监督管理委员会《关于同意中原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[2022]39 号），同意公司向专业投资者公开发行公司债券，采用分期发行方式，面值余额不超过 20 亿元。2022 年 2 月 24 日，22 中原 01（代码：185321）债券发行完毕，实际发行规模 20 亿元，票面利率为 3.2%，并于 2022 年 3 月 8 日起在上海证券交易所上市。

2. 股东集中竞价减持股份

本公司股东渤海产业投资基金管理有限公司（以下简称“渤海产业基金”）截止 2020 年 12 月 31 日持有公司无限售流通股 431,738,551 股，占公司总股本比例约 9.30%，股份来源为公司首次公开发行股票并上市前已发行的股份，已于 2018 年 1 月 3 日解除限售。渤海产业基金拟自减持公告披露之日即 2021 年 1 月 6 日起 15 个交易日后的 6 个月内通过集中竞价方式减持公司股份数量不超过 92,857,694 股，且在任意连续 90 日内，减持股份的总数不超过公司股份总数的 1%，减持价格根据市场价格确定。公司于 2021 年 7 月 26 日收到渤海公司通知。渤海公司自 2021 年 1 月 27 日至 2021 年 7 月 26 日，通过集中竞价方式减持公司股份 92,857,694 股，占公司股份总数约 2%。减持计划时间区间届满，减持计划结束。截止 2021 年 7 月 26 日，渤海公司持有公司无限售条件流通股 296,530,857 股，占公司股份总数约 6.39%。

渤海产业基金截止 2021 年 7 月 30 日持有公司无限售流通股 292,430,857 股，占公司总股本比例约 6.30%。渤海产业基金拟自减持公告披露之日即 2021 年 7 月 30 日起 15 个交易日后的 6 个月内通过集中竞价方式减持公司股份数量不超过 92,857,694 股，且在任意连续 90 日内，减持股份的总数不超过公司股份总数的 1%，减持价格根据市场价格确定。公司于 2022 年 2 月 18 日收到渤海公司通知。渤海公司自 2021 年 8 月 20 日至 2022 年 2 月 18 日，通过集中竞价方式减持公司股份 92,008,057 股，占公司股份总数约 1.98%。截至 2022 年 2 月 19 日，减持计划时间区间届满，减持计划结束。

3. 中州蓝海公开挂牌转让中原小贷股权

2021 年 10 月 15 日，公司第六届董事会第三十五次会议审议通过了《关于第二次转让中州蓝海持有中原小贷部分股权的议案》，同意中州蓝海以公开挂牌的方式转让其持有的中原小贷 11% 股权，并授权公司经营层办理转让股权事宜过程中的各项工作。2021 年 12 月 20 日，中州蓝海与漯河市金融控股有限公司签订了《国有产权交易合同》。2022 年 3 月 10 日，河南省地方金融监督管理局出具《河南省地方金融监督管理局关于河南中原小额贷款有限公司变更事项的批复》（豫金监[2022]56 号），同意前述股权转让事项。

（二）利润分配情况

本公司经第七届董事会第六次会议审议的 2021 年下半年度利润分配预案为：每 10 股派发现金红利人民币 0.21 元（含税）。截至 2021 年 12 月 31 日，公司总股本 4,642,884,700 股，以此计算合计拟派发现金红利人民币 97,500,578.70 元（含税），加上已派发 2021 年上半年现金红利人民币 78,929,039.90 元（含税），当年累计派发现金红利人民币 176,429,618.60 元（含税）。公司不进行资本公积金转增股本，不送红股。此预案尚需本公司股东大会批准。

（三）其他资产负债表日后事项说明

除存在上述资产负债表日后事项外，截至财务报告批准报出日止，本公司无其他应披露未披露的重大资产负债表日后事项。

十四、其他重要事项说明

（一）年金计划

中原证券股份有限公司职工在参加社会基本养老保险的基础上参加公司依据国家企业年金制度的相关政策建立的企业年金计划。公司年金所需费用由企业和职工共同缴纳，公司缴费总额为职工上年度工资总额的 8%，职工个人缴费为本人上年度工资总额的 2%。

（二）分部信息

1. 报告分部的确定依据与会计政策

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

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

本公司以经营分部为基础确定报告分部，满足下列条件之一的经营分部确定为报告分部：

- （1）该经营分部的分部收入占所有分部收入合计的 10% 或者以上；
- （2）该分部的分部利润（亏损）的绝对额，占所有盈利分部利润合计额或者所有亏损分部亏损合计额的绝对额两者中较大者的 10% 或者以上。

按上述会计政策确定的报告分部的经营分部的对外交易收入合计额占合并总收入的比重未达到 75% 时，增加报告分部的数量，按下述规定将其他未作为报告分部的经营分部纳入报告分部的范围，直到该比重达到 75%：

- （1）将管理层认为披露该经营分部信息对会计信息使用者有用的经营分部确定为报告分部；

(2) 将该经营分部与一个或一个以上的具有相似经济特征、满足经营分部合并条件的其他经营分部合并，作为一个报告分部。

分部间转移价格参照市场价格确定，与各分部共同使用的资产、相关的费用按照收入比例在不同的分部之间分配。

2. 本公司确定报告分部考虑的因素、报告分部的产品和劳务的类型

公司的报告分部按照业务类型的不同，主要划分为：证券经纪业务分部、自营业务分部、投资银行业务分部、信用业务分部、投资管理业务分部、期货业务分部、境外业务分部、总部及其他业务分部。

3. 报告分部的财务信息

金额单位：万元

项目	期末余额/本期发生额									
	证券经纪业务	自营业务	投资银行业务	信用业务	投资管理业务	期货业务	境外业务	总部及其他 ³	抵销	合计
一.营业收入	91,665.02	57,838.21	61,868.98	46,632.32	21,709.16	162,063.44	-17,642.25	21,130.29	-3,180.32	442,084.85
手续费及佣金净收入	77,184.60		61,888.86	2,724.26	3,752.68	14,038.54	881.98	3,479.28	-269.35	163,680.85
投资收益		92,348.26			-39,696.72	-6,087.98	-300.73	15,374.90	-2,798.24	58,839.49
公允价值变动收益		5,262.66			56,596.13	-103.94	-15,421.76	2,615.51		48,948.60
汇兑收益	-4.34						176.74	-14.56		157.84
其他收入	249.19	659.66		849.69	2.13	154,543.75	25.40	422.06	-128.56	156,623.32
利息净收入	14,235.57	-40,432.37	-19.88	43,058.37	1,054.94	-326.93	-3,003.88	-746.90	15.83	13,834.75
二.营业支出	63,731.61	14,674.90	49,475.06	20,469.45	20,834.21	161,047.31	7,600.86	53,258.19	-20,059.95	371,031.64
三.营业利润	27,933.41	43,163.31	12,393.92	26,162.87	874.95	1,016.13	-25,243.11	-32,127.90	16,879.63	71,053.21
四.资产总额	1,092,555.03	2,204,043.37	2,595.87	1,015,711.75	518,217.53	199,823.81	112,297.48	805,675.53	-576,088.02	5,374,832.35
五.负债总额	1,191,798.15	1,407,292.14	20,134.87	16,577.94	129,248.27	156,280.17	46,540.67	1,038,920.33	-46,368.18	3,960,424.36
六.补充信息										
1、折旧和摊销费用	5,381.99	1,639.14	1,220.05	20.25	45.94	493.10	1,142.64	5,712.03	-88.71	15,566.43
2、资本性支出	10,206.41	2,485.69	1,628.38	17.72	242.90	1,034.81	6.93	6,797.53	-356.79	22,063.58

本公司各经营分部的会计政策与在“重要会计政策和会计估计”所描述的会计政策相同。

³ 如本附注一/（二）公司业务性质和主要经营活动及本附注七、合并范围的变更所述，2021 年度公司通过处置部分股权，丧失对河南省中原小额贷款有限公司的控制权，丧失控制权日为 2021 年 12 月 31 日，2021 年度公司主要经营活动仍包括小额贷款，2021 年度分部信息中小额贷款相关损益仍在“总部及其他”中列示。

(三) 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项**1. 公益捐赠**

项目	2021 年度	2020 年度
慈善捐赠	8,096,459.00	5,548,811.00
合计	8,096,459.00	5,548,811.00

2. 融资融券业务

于 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日，本集团融资融券业务规模如下：

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
融出资金	8,224,999,802.94	7,476,331,076.06
融出证券	14,531,200.47	6,015,764.80
合计	8,239,531,003.41	7,482,346,840.86

3. 债券借贷业务

公司在银行间和交易所债券市场交易平台借入债券的类别及公允价值具体如下：

债券类别	2021 年 12 月 31 日公允价值	2020 年 12 月 31 日公允价值
国债	427,403,652.00	977,436,370.00
政策性金融债		892,869,520.00
地方债	103,563,900.00	461,811,840.00
合计	530,967,552.00	2,332,117,730.00

于 2021 年 12 月 31 日，本公司通过银行间和交易所市场借入方式取得的债券中为卖出回购业务而设定质押或过户的债券公允价值为人民币 48,034.65 万元。

4. 客户资金的安全性

截止 2021 年 12 月 31 日，本公司已将客户交易结算资金存放于具有存管资格的商业银行，符合《客户交易结算资金管理办法》（中国证券监督管理委员会 3 号令）和客户交易结算资金第三方存管等有关规定对客户交易结算资金安全性的要求，保障客户资金的安全，不存在挪用客户资金问题。

5. 以公允价值计量的资产和负债

项目	2020 年 12 月 31 日	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	2021 年 12 月 31 日
1、交易性金融资产（不含衍生金融资产）	22,592,572,498.77	480,105,778.89			24,507,919,178.87
2、衍生金融资产		1,357,626.00			54,610.00
3、其他债权投资	2,088,805,149.07		3,346,385.71	-889,287.16	970,426,547.78
4、其他权益工具投资					
金融资产小计	24,681,377,647.84	481,463,404.89	3,346,385.71	-889,287.16	25,478,400,336.65
投资性房地产					
生产性生物资产					

项目	2020年12月31日	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	2021年12月31日
其他					
上述合计	24,681,377,647.84	481,463,404.89	3,346,385.71	-889,287.16	25,478,400,336.65
交易性金融负债	1,356,226,583.04	6,097,092.65			971,171,013.72
衍生金融负债	57,980.91	1,925,483.56			465,376.83
金融负债小计	1,356,284,563.95	8,022,576.21			971,636,390.55

注：本表不存在必然的勾稽关系。

6. 金融资产计量基础分类表

期末账面价值						
项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	12,332,030,422.75					
结算备付金	2,558,219,120.46					
融出资金	8,148,017,143.05					
衍生金融资产				54,610.00		
存出保证金	802,256,089.47					
应收款项	98,055,900.27					
买入返售金融资产	972,870,075.44					
交易性金融资产				24,507,919,178.87		
债权投资	263,452,484.68					
其他债权投资		970,426,547.78				
其他资产						
合计	25,174,901,236.12	970,426,547.78	-	24,507,973,788.87		

续：

期初账面价值						
项目	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
				分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

期初账面价值						
						融资产
货币资金	10,951,131,021.90					
结算备付金	2,379,100,088.00					
融出资金	7,400,757,113.38					
衍生金融资产						
存出保证金	744,878,747.69					
应收款项	169,323,523.34					
买入返售金融资产	2,055,964,889.83					
交易性金融资产				22,592,572,498.77		
债权投资	456,168,931.89					
其他债权投资		2,088,805,149.07				
其他资产	879,830,915.70					
合计	25,037,155,231.73	2,088,805,149.07		22,592,572,498.77		

7. 金融负债计量基础分类表

期末账面价值				
项目	以摊余成本计量的金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	256,191,822.27			
衍生金融负债		465,376.83		
应付短期融资款	7,032,271,969.93			
拆入资金	2,900,742,263.92			
交易性金融负债		971,171,013.72		
卖出回购金融资产款	10,548,472,328.09			
代理买卖证券款	12,571,797,812.48			
应付款项	143,594,220.52			
应付债券	3,685,225,541.41			
长期借款				
其他负债	50,880,913.21			
合计	37,189,176,871.83	971,636,390.55		

续:

期初账面价值		
项目	以摊余成本计量的	以公允价值计量且其变动计入当期损益

期初账面价值				
	金融负债	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债
短期借款	315,977,554.88			
衍生金融负债		57,980.91		
应付短期融资款	4,154,657,809.90			
拆入资金	3,694,418,222.23			
交易性金融负债		1,356,226,583.04		
卖出回购金融资产款	12,200,308,194.73			
代理买卖证券款	10,555,230,551.25			
应付款项	65,874,572.60			
应付债券	4,610,250,342.02			
长期借款	1,001,741.67			
其他负债	29,432,162.81			
合计	35,627,151,152.09	1,356,284,563.95		

8. 外币金融资产

项目	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	期末金额
金融资产					
1、交易性金融资产	856,883,301.34	-154,317,636.12			655,655,885.88
2、贷款和应收款	43,785,058.55			321,623.45	36,827,993.39
3、债权投资	41,123,594.69			23,124,738.12	114,180,424.71
金融资产小计	941,791,954.58	-154,317,636.12		23,446,361.57	806,664,303.98

十五、母公司财务报表主要项目注释

注释 1. 长期股权投资

1. 长期股权投资分类

项目	2021 年 12 月 31 日			2020 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
对子公司投资	5,509,728,953.95	213,448,720.01	5,296,280,233.94	4,126,432,553.95		4,126,432,553.95
合计	5,509,728,953.95	213,448,720.01	5,296,280,233.94	4,126,432,553.95		4,126,432,553.95

2. 对子公司投资

被投资单位	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日	本期计提减值准备	减值准备期末余额
中原期货股份有限公司	188,061,592.08			188,061,592.08		

被投资单位	2020 年 12 月 31 日	本期增加	本期减少	2021 年 12 月 31 日	本期计提减 值准备	减值准备期 末余额
中鼎开源创业投资管理 有限公司	700,530,961.87			700,530,961.87		
中州国际金融控股有限 公司	859,340,000.00	663,296,400.00		1,522,636,400.00	213,448,720.01	213,448,720.01
中州蓝海投资管理有限 公司	2,256,000,000.00	720,000,000.00		2,976,000,000.00		
中原股权交易中心股份 有限公司	122,500,000.00			122,500,000.00		
合计	4,126,432,553.95	1,383,296,400.00		5,509,728,953.95	213,448,720.01	213,448,720.01

注释 2. 利息净收入

项目	2021 年度	2020 年度
利息收入	916,567,743.30	840,710,707.82
其中：货币资金及结算备付金利息收入	219,258,200.52	220,736,495.73
融出资金利息收入	531,690,562.15	464,576,155.58
买入返售金融资产利息收入	80,476,510.30	81,991,995.95
其中：约定购回利息收入	923,065.44	996,809.98
股票质押回购利息收入	71,017,634.31	46,354,779.03
其他债权投资利息收入	70,560,447.33	54,322,352.87
其他	14,582,023.00	19,083,707.69
利息支出	827,328,907.93	794,467,457.03
其中：应付短期融资款利息支出	94,608,515.35	27,018,835.31
拆入资金利息支出	60,198,833.27	77,148,662.74
其中：转融通利息支出	29,744,335.78	30,440,555.57
卖出回购金融资产利息支出	310,977,651.89	263,204,806.08
代理买卖证券款利息支出	39,948,175.35	37,816,790.81
应付债券利息支出	301,919,366.87	363,302,104.60
其中：次级债券利息支出	147,031,829.42	267,812,580.47
债券借贷	10,271,094.68	15,528,329.95
其他	9,405,270.52	10,447,927.54
利息净收入	89,238,835.37	46,243,250.79

注释 3. 手续费及佣金净收入

1. 明细情况

项目	2021 年度	2020 年度
证券经纪业务净收入	716,344,816.88	686,071,935.92
——证券经纪业务收入	931,901,666.30	885,194,369.73
——代理买卖证券业务	866,304,715.56	831,526,528.34
交易单元席位租赁	228,065.17	1,031,189.08

项目	2021 年度	2020 年度
代销金融产品业务	64,487,543.89	51,559,606.38
——证券经纪业务支出	215,556,849.42	199,122,433.81
——代理买卖证券业务	215,469,553.47	198,967,940.55
代销金融产品业务	55,091.74	30,611.75
投资银行业务净收入	631,244,447.05	200,925,249.51
——投资银行业务收入	639,524,915.86	211,653,833.40
——证券承销业务	576,943,747.38	114,957,161.13
证券保荐业务	18,530,188.67	23,965,274.32
财务顾问业务	44,050,979.81	72,731,397.95
——投资银行业务支出	8,280,468.81	10,728,583.89
——证券承销业务	4,175,773.45	9,313,489.57
证券保荐业务	613,207.53	400,000.00
财务顾问业务	3,491,487.83	1,015,094.32
资产管理业务净收入	25,029,916.17	39,325,418.37
——资产管理业务收入	25,137,205.40	39,353,812.03
——资产管理业务支出	107,289.23	28,393.66
投资咨询业务净收入	68,787,678.69	81,559,355.53
——投资咨询业务收入	68,787,678.69	81,559,355.53
——投资咨询业务支出		
其他手续费净收入	31,371,063.10	30,268,783.91
——其他手续费收入	31,371,063.10	32,811,519.76
——其他手续费支出		2,542,735.85
合计	1,472,777,921.89	1,038,150,743.24
其中：手续费及佣金收入合计	1,696,722,529.35	1,250,572,890.45
手续费及佣金支出合计	223,944,607.46	212,422,147.21

注释 4. 投资收益

1. 分类明细

项目	2021 年度	2020 年度
成本法核算的长期股权投资收益	15,693,080.20	77,307,500.00
金融工具投资收益	917,264,177.78	553,945,936.58
其中：持有期间取得的收益	770,347,874.32	695,140,291.04
其中：交易性金融资产	791,129,965.19	719,988,683.69
交易性金融负债	-20,782,090.87	-24,848,392.65
处置金融工具取得的收益	146,916,303.46	-141,194,354.46
其中：交易性金融资产	176,531,064.62	-83,989,378.75
其他债权投资	8,066,690.95	10,380,784.48

项目	2021 年度	2020 年度
衍生金融工具	-15,549,088.70	-121,617,242.72
交易性金融负债	-22,132,363.41	54,031,482.53
合计	932,957,257.98	631,253,436.58

2. 交易性金融工具投资收益明细表

交易性金融工具		2021 年度
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	791,129,965.19
	处置取得收益	176,531,064.62
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	
	处置取得收益	
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	-20,782,090.87
	处置取得收益	-22,132,363.41
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益	

注释 5. 业务及管理费

项目	2021 年度	2020 年度
职工费用	1,211,760,242.22	829,080,934.22
使用权资产折旧费	58,319,162.96	56,650,750.59
证券投资者保护基金	37,707,679.54	7,811,652.08
无形资产摊销	36,177,836.12	29,767,221.31
电子设备运转费	31,701,000.70	35,398,233.30
广告宣传费	27,865,195.71	16,396,249.01
固定资产折旧费	26,711,373.01	30,181,550.19
邮电通讯费	16,249,311.43	15,826,770.89
会员费	15,719,537.36	15,204,571.94
咨询费	15,649,437.68	12,106,802.02
业务招待费	12,777,064.29	10,077,114.18
差旅费	12,407,616.92	10,840,414.36
长期待摊费用摊销	11,819,574.01	12,573,176.57
物业管理费	8,384,841.32	8,035,558.53
租赁费	6,511,606.78	5,776,033.67
水电费	6,164,378.39	6,854,700.01
审计费	3,674,754.70	5,985,660.37
交易所设施使用费	3,661,672.05	4,215,428.29
其他	33,611,702.52	36,664,382.40
合计	1,576,873,987.71	1,149,447,203.93

注释 6. 母公司现金流量表补充资料

项目	2021 年度	2020 年度
1.将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	467,694,549.68	201,826,398.89
加: 信用减值损失	168,069,536.77	263,120,359.08
其他资产减值损失	213,448,720.01	
投资性房地产及固定资产累计折旧	27,821,612.32	31,299,387.64
使用权资产折旧	58,319,162.96	56,650,750.59
无形资产摊销	36,177,836.12	29,767,221.31
长期待摊费用摊销	11,819,574.01	12,573,176.57
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(收益以“-”填列)	1,536,091.43	1,413,215.22
公允价值变动损益(收益以“-”填列)	-76,803,683.45	88,807,494.18
利息支出	402,841,301.93	397,411,742.61
汇兑损失(收益以“-”填列)	189,029.17	646,160.05
投资损失(收益以“-”填列)	-94,320,218.48	-142,010,637.35
递延所得税资产的减少(增加以“-”填列)	-23,877,204.44	-88,296,632.38
递延所得税负债的增加(减少以“-”填列)		-3,207,641.13
经营性应收项目的减少(增加以“-”填列)	-1,518,104,721.09	191,011,569.97
经营性应付项目的增加(减少以“-”填列)	104,774,624.15	-82,028,931.77
经营活动产生的现金流量净额	-220,413,788.91	958,983,633.48
2.不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3.现金及现金等价物净变动情况:		
现金的期末余额	13,041,401,477.73	11,500,913,337.34
减: 现金的期初余额	11,500,913,337.34	9,849,533,204.97
加: 现金等价物的期末余额		
减: 现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	1,540,488,140.39	1,651,380,132.37

十六、补充资料

(一) 当期非经常性损益明细表

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	20,420,575.16	
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)	12,833,519.07	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	5,556,296.97	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		

项目	金额	说明
减：所得税影响额	11,092,326.41	
少数股东权益影响额（税后）	4,862,738.75	
合计	22,855,326.04	

（二）净资产收益率及每股收益

报告期利润	加权平均 净资产收益率（%）	每股收益	
		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	3.78	0.11	0.11
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	3.61	0.11	0.11

中原证券股份有限公司

二〇二二年三月二十五日

董事长：菅明军

董事会批准报送日期：2022 年 3 月 25 日

修订信息

适用 不适用

第十一节 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

(一)报告期内分公司、营业部行政许可情况

分公司新设	营业部新设	分公司迁址	营业部迁址
0	0	2	6

1、报告期内分公司迁址行政许可情况

序号	迁址前分公司名称	迁址后分公司名称	新址	获得许可证日期
1	中原证券平顶山分公司	中原证券平顶山分公司	河南省平顶山市新华区建设路中段26号佳田新天地1号楼28层, 2号楼101铺	2021年12月31日
2	中原证券漯河分公司	中原证券漯河分公司	河南省漯河市郾城区黄河路金色华府君苑7#楼101号	2021年10月19日

2、报告期内营业部迁址行政许可情况

序号	迁址前营业部名称	迁址后营业部名称	新址	获得许可证日期
1	中原证券郑州纬五路证券营业部	中原证券郑州黄河路证券营业部	河南省郑州市金水区黄河路11号西配二楼	2021年12月16日
2	中原证券西峡世纪大道证券营业部	中原证券西峡人民路证券营业部	河南省南阳市西峡县白羽路与人民路交叉口	2021年6月29日
3	中原证券新乡向阳路证券营业部	中原证券新乡人民东路证券营业部	河南省新乡市红旗区洪门镇牧野大道(中)166号天安名邸1号楼1201商铺	2021年12月3日
4	中原证券长垣人民路证券营业部	中原证券长垣山海大道证券营业部	河南省新乡市长垣市山海大道卫华世纪城11号楼116号商铺	2021年9月22日
5	中原证券鹿邑紫气大道证券营业部	中原证券鹿邑真源大道证券营业部	河南省周口市鹿邑县真源大道428号	2021年12月21日
6	中原证券济南工业南路证券营业部	中原证券济南玉函路证券营业部	山东省济南市市中区玉函路89号1号楼南楼二楼	2021年6月11日

二、监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

本公司在中国证监会2019年证券公司分类评价中获得B类BBB级。

本公司在中国证监会2020年证券公司分类评价中获得A类A级。

本公司在中国证监会2021年证券公司分类评价中获得B类BBB级。