

公司代码：600918

公司简称：中泰证券

# 中泰证券股份有限公司 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、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人李峰、主管会计工作负责人袁西存及会计机构负责人（会计主管人员）刘健声明：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

以公司总股本为基数，向实施权益分派股权登记日登记在册的全体股东每10股派发现金红利0.63元（含税）。按2021年末公司总股本6,968,625,756.00股计算，合计派发现金红利439,023,422.63元，占2021年合并报表归属于母公司股东净利润的比例为13.72%，剩余可供分配的未分配利润结转下一年度。预案尚需公司股东大会审议。公司将于股东大会审议通过之日起两个月内派发现金红利，具体日期将在权益分派实施公告中明确。

### 六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本报告中所涉及的发展战略、未来计划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

公司主营业务与国内外经济形势、资本市场走势高度相关，资本市场的波动、行业监管政策的调整等，都将对公司经营业绩产生直接或间接的影响。

公司已在本报告中详细描述日常经营活动中可能面临的风险，本公司可能面临的重大风险主要包括合规风险、市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、声誉风险、洗钱与恐怖融资风险等，敬请查阅本报告“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（包括落实全面风险管理以及合规风控、信息技术投入情况）”中的相关内容。

#### 十一、其他

适用 不适用

本报告中若出现总数与各分项数值之和尾数有不符的情况，均系四舍五入原因造成。

## 董事长致辞

各位股东：

2021 年是我国“十四五”开局之年，也是资本市场深化改革的关键一年。这一年，多层次资本市场建设取得实质性突破，深交所主板与中小板合并、北交所成立，各板块间呈现出错位竞争、相互补充的良性生态。这一年，资本市场服务实体经济量质双升，科创板、创业板首发上市企业达到 360 余家。这一年，机构投资力量持续壮大，全年成立 2,000 余只基金，非自然人投资者达到 46 万多户。这一年，在以人民为中心、共同富裕等理念引领下，投资者保护体系日臻完善，让投资者放心、舒心、满意投资的新格局正在积极显现……总的来说，“而立”之年的资本市场，交上了一份优异的成绩单。

2021 年是中泰证券成立二十周年，也是二次创业的正式启航之年。一年来，公司按照“永葆四心”和以党建为统领，以客户为中心，深入实施区域突破、人才强企、转型提升、金融科技四大战略，将改革创新、风控合规作为两大支撑的“1142”总体发展思路，积极抢抓市场机遇，持续深化内部改革，不断创新业务打法，努力推动各项经营管理工作提质增效，主要经营指标实现了较快增长。全年实现营业收入 131.50 亿元、净利润 32.99 亿元，同比分别增长 27.02%、27.82%。总体来讲，公司在以下几个方面开创了新局、提升了能力。

**区域突破开新局，服务实体经济能力持续提升。**我们按照“深耕山东、南布重兵、做强北京”的区域突破战略，积极推动与各地方政府、大企业集团、金融机构签约，不断创新服务手段、丰富服务内容，加大对实体经济的服务支持力度。通过举办高端论坛、发挥投融资联动优势、强化研究支持等一系列举措，在助推国家双碳目标实现、黄河流域生态保护和高质量发展、专精特新企业发展等过程中努力贡献中泰力量。

**转型提升开新局，综合金融服务能力持续提升。**我们坚持以客户为中心，积极为客户提供优质、全面的资本市场服务，为客户创造价值，与客户共同成长、共享发展成果。公司以产品销售为抓手，大力推动财富管理转型，取得公募基金投顾业务资格，推出了“齐富投”投顾品牌，进一步完善公司综合金融服务体系。截至 2021 年末，公司共服务客户 726.54 万户，管理客户资产 1.09 万亿元。聚焦科技强国战略，积极为科技型中小企业提供融资服务，帮助它们加快步伐、缩短成长进程，助力解决国家面临的“卡脖子”技术。2021 年，公司投行业务主要指标行业排名实现历史最佳。

**改革发展开新局，经营活力持续提升。**我们坚信，通过改革，能够进一步激发动力、释放活力、增强免疫力、提高竞争力。一年来，按照更市场、更开放、更灵活的原则，推出了组织架构、薪酬体系、考核机制等一系列改革组合拳。尤其是年初实施了自 2007 年整合天同证券以来力度最大的一次改革，将总部 53 个一级部整合压缩到 41 个，对 75 名干部进行了调整。坚持薪酬与考核目标市场化“双对标”，在薪酬体系改革的基础上，出台对标考核实施方案，全面实行机构和员工刚性考核，有效激发了员工干事创业的主动性。

**人才建设开新局，干事创业能力持续提升。**在人才强企战略引领下，我们坚持高举高打，持续加大各类人才引进，公司人才队伍日益壮大、引才聚才效应显著提升。积极营造“干事创业、担当作为”的浓厚氛围，不拘一格、大胆使用年轻人才，为优秀干部成长打开空间。完成了第一批“310”后备干部培养，启动第二批“310”后备干部计划，“310”已经成为培养选拔年轻干部的标杆性项目。

**科技创新开新局，数字化引领能力持续提升。**我们大力实施金融科技战略，持续加大科技投入和 IT 团队建设，强化科技研发能力。自主研发的 XTP 系统行业领先，年交易量突破 9 万亿元，已经成为优质量化私募的资产聚集平台。数字化转型与流程管理项目入选国务院国有重点企业管理标杆项目，成为唯一一家入选标杆项目的券商。齐富通 APP 功能日益完善，客户体验不断提升，连续七年获得“十佳券商 APP”称号。

**党建工作开新局，党建引领能力持续提升。**我们坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，增强“在经济领域为党工作”的职责使命，将“党建统领”摆在总体发展思路的第一位，推进全面从严治党、党史学习教育等各项工作走深走实，党建对经营管理的引领保障作用持续强化，党建与业务同频共振、同向发展的良好局面日益显现。

2022 年是“十四五”规划承上启下的关键一年，也是中泰证券实现新跨越、各项工作再上新台阶的突破之年。公司将继续按照“1142”的总体发展思路，踔厉奋发、笃行不怠，持续提升专业能力和服务水平，为各位股东、各位客户交上一份满意的答卷！

董事长 李峰

2022 年 3 月 29 日

## 目录

第一节	释义.....	7
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.....	58
第五节	环境与社会责任.....	91
第六节	重要事项.....	95
第七节	股份变动及股东情况.....	116
第八节	优先股相关情况.....	131
第九节	债券相关情况.....	131
第十节	财务报告.....	140
第十一节	证券公司信息披露.....	327

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

## 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		
公司、本公司、中泰证券	指	中泰证券股份有限公司
报告期	指	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
本报告期末	指	2021 年 12 月 31 日
齐鲁经纪	指	山东省齐鲁证券经纪有限公司，齐鲁证券前身
齐鲁证券	指	齐鲁证券有限公司，本公司前身
莱钢集团	指	莱芜钢铁集团有限公司
山钢集团	指	山东钢铁集团有限公司
山能集团	指	山东能源集团有限公司
济钢集团	指	济钢集团有限公司
鲁信集团	指	山东省鲁信投资控股集团有限公司
新矿集团	指	新汶矿业集团有限责任公司
枣矿集团	指	枣庄矿业（集团）有限责任公司
高速投资	指	山东高速投资控股有限公司
建银投资	指	中国建银投资有限责任公司
鲁证期货	指	鲁证期货股份有限公司
中泰资本	指	中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司
中泰国际	指	中泰金融国际有限公司
中泰资管	指	中泰证券（上海）资产管理有限公司
中泰创投	指	中泰创业投资（深圳）有限公司
中泰物业	指	齐鲁中泰物业有限公司
齐鲁股权	指	齐鲁股权交易中心有限公司
万家基金	指	万家基金管理有限公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
山东省国资委	指	山东省人民政府国有资产监督管理委员会
山东证监局	指	中国证券监督管理委员会山东监管局
中金所	指	中国金融期货交易所
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
元、万元、亿元	指	人民币元、人民币万元、人民币亿元

## 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	中泰证券股份有限公司
公司的中文简称	中泰证券
公司的外文名称	ZHONGTAI SECURITIES CO.,LTD.

公司的外文名称缩写	ZHONGTAI SECURITIES
公司的法定代表人	李峰
公司总经理	毕玉国

公司注册资本和净资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	本报告期末	上年度末
注册资本	6,968,625,756.00	6,968,625,756.00
净资产	26,838,171,134.31	25,657,836,200.06

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

**母公司主要业务资质：**

公司经营范围包括：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；股票期权做市；证券投资基金托管。此外，公司还具有以下业务资格：

1.中国人民银行批准的业务资格：全国银行间同业拆借市场同业拆借业务。

2.中国证监会批准的业务资格：外资股经纪商、为期货公司提供中间介绍业务、保荐机构、参与股指期货保值交易、债券质押式报价回购业务、参与国债期货交易、人民币利率互换业务、客户资金消费支付服务试点、基金投资顾问业务试点。

3.国家外汇管理局批准的业务资格：外币有价证券经纪业务。

4.中国证券业协会批准的业务资格：柜台交易业务、股票收益互换业务、场外期权业务。

5.上交所、深交所批准的业务资格：权证交易、港股通业务、股票期权经纪业务、股票期权自营业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购业务、沪深300ETF期权主做市商、上交所上证50ETF期权主做市商、上交所固定收益证券综合电子平台交易商、上交所上市基金主做市商、深交所上市公司股权激励行权融资业务试点、深交所质押式报价回购交易、深交所期权程序化交易。

6.中国证券登记结算有限责任公司批准的业务资格：结算参与人资格、B股结算业务、权证买入合资格结算参与人、代理证券质押登记业务、托管人结算业务、期权结算业务。

7.中国证券金融股份有限公司批准的业务资格：转融通业务资格试点、转融资业务试点、转融券业务试点、科创板转融券、创业板转融券。

8.其他机构批准的业务资格：全国中小企业股份转让系统主办券商、向保险机构投资者提供综合服务、军工涉密业务咨询服务、标准债券远期交易、利率期权交易、中金所沪深300股指期货做市商、私募基金业务外包服务、ETF一级交易商、机构间私募产品报价与服务系统参与人、报价商、估值商和做市商、非金融企业债务融资工具主承销商、接入中国票据交易系统、全国社保基金境内签约券商。

**子公司主要业务资质：**



**中泰资管：**

1. 证券资产管理
2. 公开募集证券投资基金管理
3. 保险资金投资管理人

**鲁证期货：**

1. 经营证券期货业务许可证
2. 金融期货经纪业务资格
3. 商品期货经纪业务资格
4. 期货投资咨询业务资格
5. 资产管理业务资格
6. 中国金融期货交易所全面结算会员资格
7. 中国期货业协会设立子公司开展以风险管理服务为主的业务试点
8. 上海期货交易所会员资格
9. 大连商品交易所会员资格
10. 郑州商品交易所会员资格
11. 中国期货业协会团体会员资格
12. 上海证券交易所股票期权业务资格
13. 深圳证券交易所股票期权业务资格
14. 上海国际能源交易中心会员资格

**中泰国际：**

1. 中国证券监督管理委员会核准的合格境外机构投资者资格
2. 香港证券及期货事务监察委员会证券公司牌照第 1 类（证券交易）及第 4 类（就证券提供意见）
3. 香港联合交易所有限公司中华通交易所参与者资格
4. 香港联合交易所有限公司交易所参与者资格
5. 香港联合交易所有限公司期权买卖交易所参与者资格
6. 香港联合交易所期权结算所有限公司直接结算参与者资格
7. 香港中央结算有限公司中华通直接结算参与者资格
8. 香港中央结算有限公司直接结算参与者资格
9. 香港证券及期货事务监察委员会期货公司牌照第 2 类(期货合约交易)
10. 香港期货结算有限公司直接结算参与者资格
11. 香港期货交易所有限公司期货交易商资格
12. 香港证券及期货事务监察委员会融资公司牌照第 1 类(证券交易)及第 6 类(就机构融资提供意见)

- 13.香港证券及期货事务监察委员会资管公司牌照第 4 类(就证券提供意见)及第 9 类(提供资产管理)
- 14.中泰国际资产管理有限公司持有中国人民银行全国银行间债券市场的入市资格
- 15.香港证券及期货事务监察委员会金融产品公司牌照第 1 类(证券交易)
- 16.香港强制性公积金计划管理局强积金主事中介人
- 17.香港保险业监管局一般及长期业务(包括相连长期业务) 持牌保险中介人牌照
- 18.新加坡金融管理局新加坡证券公司的 Capital Markets Services 牌照(证券交易)
- 19.新加坡金融管理局新加坡资管公司的 Capital Markets Services 牌照(基金管理)
- 20.宏润（上海）融资租赁有限公司持有中国（上海）自由贸易试验区管理委员会的外商独资融资租赁业务备案，以及持有中国银行间市场交易商协会会员资格

**中泰资本：**

- 1.私募投资基金业务

**中泰创投：**

- 1.另类投资业务

**报告期内，母、子公司业务资质变化情况如下：**

**母公司：**获得非金融企业债务融资工具主承销商；接入中国票据交易系统；全国社保基金境内签约券商；基金投资顾问业务试点。

**子公司：**中泰国际下属子公司获得中国人民银行全国银行间债券市场的入市资格。

**二、 联系人和联系方式**

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	张晖	英学夫
联系地址	济南市市中区经七路86号	济南市市中区经七路86号
电话	0531-68889038	0531-68889038
传真	0531-68889001	0531-68889001
电子信箱	ztsdb@zts.com.cn	ztsdb@zts.com.cn

**三、 基本情况简介**

公司注册地址	济南市市中区经七路86号
公司注册地址的历史变更情况	2010年公司注册地址由“山东省济南市经十路20518号”变更为“济南市市中区经七路86号”
公司办公地址	济南市市中区经七路86号
公司办公地址的邮政编码	250001
公司网址	www.zts.com.cn
电子信箱	ztsdb@zts.com.cn

**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： <a href="https://www.cs.com.cn">https://www.cs.com.cn</a> 上海证券报： <a href="https://www.cnstock.com">https://www.cnstock.com</a>
------------------	--

	证券时报: <a href="http://www.stcn.com">http://www.stcn.com</a> 证券日报: <a href="http://www.zqrb.cn">http://www.zqrb.cn</a>
公司披露年度报告的证券交易所网站	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>
公司年度报告备置地点	济南市市中区经七路86号证券大厦2011董事会办公室

## 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	上海证券交易所	中泰证券	600918	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

公司系由齐鲁证券整体变更设立，齐鲁证券的前身为齐鲁经纪。

齐鲁经纪成立于 2001 年 5 月 15 日，由山东省齐鲁资产管理有限公司、山东省国际信托投资有限公司、泰安市基金投资担保经营有限公司、济宁市投资中心、德州市德信资产管理有限公司、山东省齐鲁投资管理有限公司、威海市财政局、淄博市财政局、烟台市财政局等 9 家单位共同出资成立，注册资本为 51,224.57 万元。

2004 年 12 月，莱钢集团向齐鲁经纪增资 30,000.00 万元，增资后齐鲁经纪注册资本为 81,224.57 万元，同时名称变更为“齐鲁证券有限公司”。

2006 年 12 月，莱钢集团、建银投资、济钢集团、兖矿集团有限公司（以下简称“兖矿集团”，现已更名为山东能源集团有限公司）和新矿集团等 5 家公司向齐鲁证券增资 140,000.00 万元，增资后齐鲁证券注册资本为 221,224.57 万元。

2008 年 4 月，莱钢集团等 27 家单位向齐鲁证券增资 300,000.00 万元，增资后齐鲁证券注册资本为 521,224.57 万元。

2015 年 7 月 20 日，齐鲁证券召开临时股东会并作出决议，同意以 2014 年 12 月 31 日为改制基准日，按照有限公司经审计的净资产值进行折股，整体变更设立股份有限公司。截至 2014 年 12 月 31 日，齐鲁证券经审计的净资产为人民币 13,767,359,661.36 元，扣除 2014 年度分红款人民币 564,623,670.00 元后的净资产人民币 13,202,735,991.36 元，按照 1:0.4014 的比例折合为股份有限公司股份 5,300,000,000 股，每股面值人民币 1 元，折股后股份有限公司的股本总额为人民币 5,300,000,000 元。2015 年 9 月 9 日，公司完成本次整体变更的工商登记变更事项，同时名称变更为“中泰证券股份有限公司”。

2015 年 9 月，莱钢集团等 27 家股东向公司增资 583,057.92 万元，其中注册资本增加 97,176.32 万元，增资完成后公司注册资本为 627,176.32 万元。

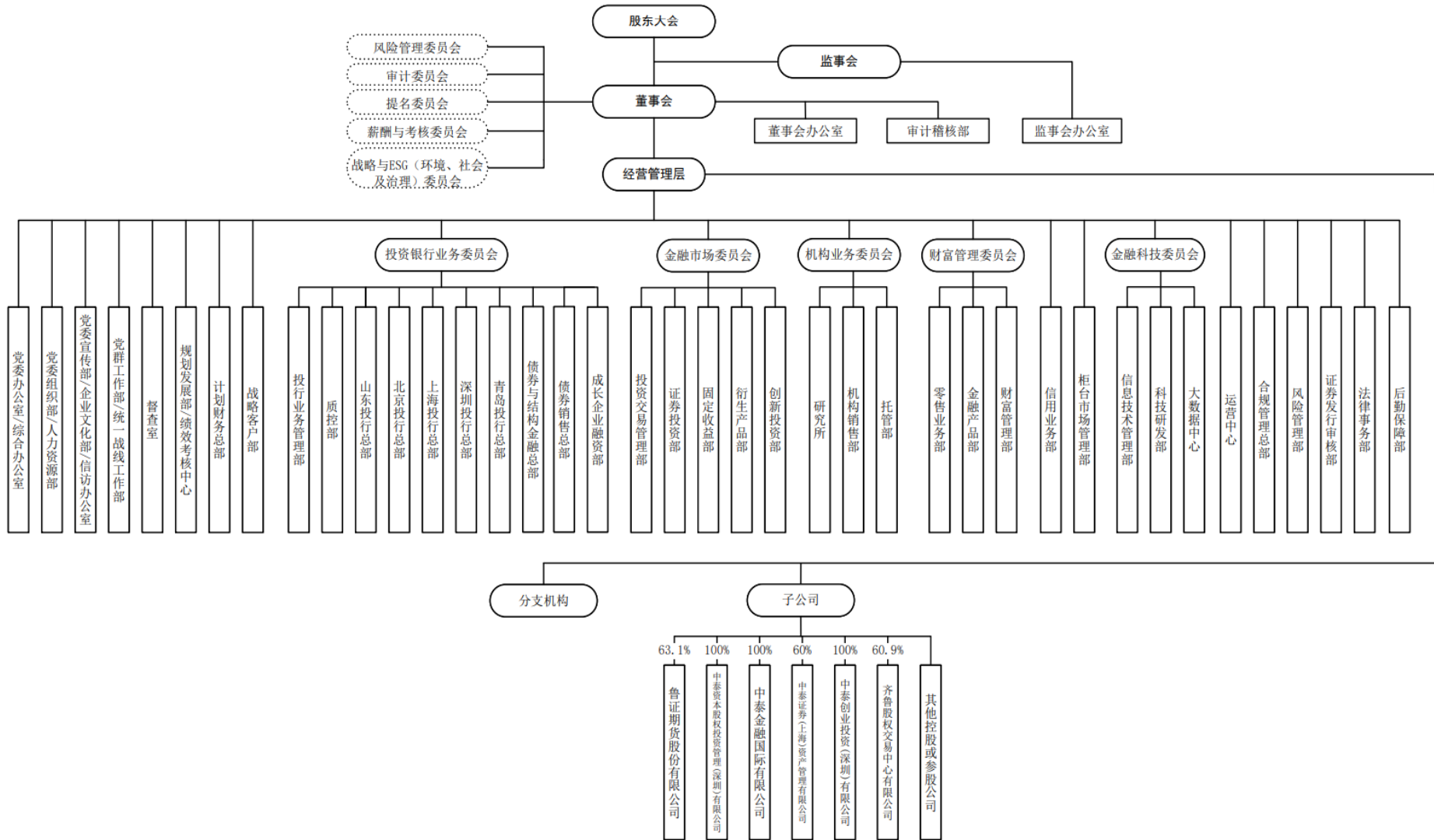
经中国证监会证监许可[2020]736 号文核准，公司于 2020 年 5 月 20 日公开发行 69,686.2576 万股人民币普通股新股，全部为无限售条件流通股。公司发行的人民币普通股于 2020 年 6 月 3

日起在上海证券交易所上市交易。本次发行完成后，公司注册资本增至 696,862.5756 万元。2020 年 9 月 1 日，公司完成注册资本的工商变更登记手续。

**(二) 公司组织机构情况**

√适用 不适用

1、截至本报告签署日，公司组织结构如下图所示：



## 2、公司主要控股子公司、参股公司情况

截至 2021 年 12 月 31 日，公司控股的主要子公司有 7 家，参股公司 1 家，具体见下表：

类别	公司名称	注册地址	设立时间	注册资本	法定代表人/负责人	股权比例	联系电话
控股公司	鲁证期货	济南市市中区经七路 86 号 15、16 层	1995.06	100,190.00 万元	钟金龙	63.10%	0531-81678629
	中泰资本	深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道 1003 号东方新天地广场 C2006	2010.05	222,000.00 万元	刘玉星	100%	0531-68889188
	中泰国际	香港中环德辅道中 189 号李宝椿大厦 19 楼	2011.06	275,946.3375 万港币	冯艺东	100%	0531-68889092
	中泰资管	上海市黄浦区延安路 175 号 24 楼 05 室	2014.08	16,666.00 万元	黄文卿	60%	021-20521111
	中泰创投	深圳市福田区福田街道中心区中心广场香港中旅大厦第八 01B.03	2017.08	400,000.00 万元	姜颖	100%	010-59013977
	中泰物业	山东省济南市市中区经七路 86 号	2014.11	82,834.71 万元	刘心义	100%	0531-68889328
	齐鲁股权	山东省淄博市张店区人民西路 228 号金融大厦 3、4、20、21、22 层	2013.11	22,500.00 万元	王胜进	60.8889%	0531-81752968
参股公司	万家基金	中国(上海)自由贸易试验区浦电路 360 号 8 层(名义楼层 9 层)	2002.08	30,000.00 万元	方一天	49%	021-38909600

## 3、分公司情况

截至 2021 年 12 月 31 日，公司设有 44 家证券分公司。具体见下表：

序号	分公司名称	地址	设立时间	负责人	联系电话
1	滨州分公司	山东省滨州市经济技术开发区黄河五路以北渤海十八路以西帝堡广场 A 座 5 层北侧	2012/1/12	毕京利	0543-3216135

2	德州分公司	山东省德州市经济技术开发区三八东路1420号5楼	2013/12/18	李龙升	0534-2226789
3	东营分公司	山东省东营市东营区北一路751号四层	2011/10/13	周顺远	0546-8774501
4	菏泽分公司	山东省菏泽市开发区人民路111号交通未来城8号楼1单元3楼(03004室、03006-03010室)以及1楼大厅南区	2012/8/15	李永平	0530-5827799
5	济南分公司	济南市历下区经十路13866号中润世纪财富中心5号楼9楼	2013/12/12	刘华琦	0531-81752968
6	济宁分公司	山东省济宁市北湖许庄街道奥体路15号13层	2011/10/12	张雷	0537-2208078
7	莱芜分公司	济南市莱芜雪野旅游区雪野生态软件园	2013/12/9	罗海涛	0634-6223766
8	聊城分公司	山东省聊城市东昌府区柳园街道柳园南路6号(新开大酒店三楼,3001、3005、3007、3011、3013、3028室)	2012/8/7	姜亦豪	0635-8217379
9	临沂分公司	山东省临沂市兰山区柳青街道北京路环球丹桂园13号楼2301、2302、2303、2304	2013/8/26	马军	0539-8212222
10	青岛分公司	山东省青岛市崂山区香港东路195号5号楼101室、1001室、1003室、1005室	2012/1/13	张庆	0532-85715949
11	日照分公司	山东省日照市东港区石臼街道黄海一路33号四层	2013/9/5	秦旭	0633-2685499
12	泰安分公司	山东省泰安市泰山区东岳大街以南、校场街以东恒隆广场(东岳大街288号)1层西南角、7层东侧(706-715房间)、7层西侧(704、705房间)	2012/1/12	陈志伟	0538-8272199
13	威海分公司	山东省威海市环翠区新威路-17-1-17-2号-1-603至605、1203-1	2011/10/10	迟法泉	0631-5197766

14	潍坊分公司	山东省潍坊高新区新城街道北海社区东风东街 5738 号清荷园小区 12 号综合楼 26、27 层及 28 层 2801、2803、2805	2011/10/12	张诚	0536-8321996
15	烟台分公司	山东省烟台市芝罘区向阳街道北大街 53 号 4 层东区	2011/10/13	陈庆之	0535-6696868
16	枣庄分公司	山东省枣庄高新区武夷山路锦绣园小区沿街营业楼 12-15 号、25-26 号	2012/5/2	张大伟	0632-3326588
17	淄博分公司	山东省淄博市张店区人民西路 66 号大楼 2 层西厅、3 层、6 层房间、9 层东区、10 层西区	2012/1/9	董典波	0533-2152099
18	电子商务分公司	济南市市中区经七路 86 号证券大厦 1812 室	2013/11/18	杨卫东	021-20235882
19	北京分公司	北京市朝阳区新源南路 8 号院 4 号楼 13 层 1301 内 08 单元	2014/4/15	吴迪	010-66555598
20	福建分公司	厦门市思明区厦禾路 837 号三层 05、06、07 单元	2012/1/20	黄剑峰	0592-5821237
21	上海分公司	上海市杨浦区黄兴路 1800 号 1510 室	2012/11/20	郑韩胤	021-20235899
22	辽宁分公司	辽宁省大连市沙河口区星海广场 A 区 13 号 16 层 1 号、2 号	2013/9/22	李健	0411-82526026
23	江苏分公司	南京市建邺区泰山路 189 号万得大厦 B 栋一层东侧	2013/9/6	王金泽	025-58995967
24	广东分公司	广州市天河区 2901 房(自编 2902 至 2903 室、2907 室)、3801 房(自编 3803 室)、3601 房(自编 3603 室、3604 至 3605 室)	2018/2/26	苑强	020-38992727
25	深圳分公司	深圳市福田区华强北街道通心岭社区红荔路 1001 号银荔大厦 2 层	2013/9/11	尹戈	0755-82095076
26	宁波分公司	浙江省宁波市鄞州区福明街道中山东路 1800 号 17-3-1、17-4 室	2013/9/26	项一凡	139 1707 7885



27	湖北分公司	湖北省武汉市硚口区古田二路与南泥湾大道交汇处海尔国际广场 09 栋 22 层 11 号、12 号、13 号	2014/1/15	朱立新	027-83776088
28	安徽分公司	合肥市庐阳区阜南路 169 号东怡金融广场 B-601、B-1303	2014/3/28	周朝平	0551-67111678
29	宁夏分公司	银川市金凤区正丰金城广场 D 栋 2 层 201 室	2015/6/23	代光辉	0951-6858066
30	云南分公司	云南省昆明市盘龙区人民东路香博商厦商业广场 1 栋 2 层	2015/8/11	王豫	0871-63160580
31	河南分公司	河南自贸试验区郑州片区（郑东）金水东路 80 号绿地新都会 9 号楼 1707、1708 号	2015/7/17	李无畏	0371-53360898
32	天津分公司	天津市南开区长江道与南开三马路交口融汇广场 2-1-2201	2015/8/20	乔楠	022-83576968
33	陕西分公司	陕西省西安市经济技术开发区凤城八路 158 号风景御园 20 幢 1 单元 10109 室	2015/10/14	李泱泱	029-89663393
34	湖南分公司	湖南省长沙市芙蓉区浏阳河大道一段 588 号红橡华园 1 栋 22 层	2015/10/14	杨文明	0731-84667866
35	东北分公司	哈尔滨市松北区创新路 1238 号 T-B 号楼 24 层	2015/10/22	张晓刚	0451-51109666
36	广西分公司	南宁市青秀区金湖路 57 号金湖商住小区 4 层 D5、D6 号商铺	2016/5/11	朱国华	0771-5673516
37	西南分公司	成都高新区天府一街 369 号 1 幢 2 楼 1 号、3 楼 1 号	2016/2/26	李蕾	028-65733889
38	贵州分公司	贵州省贵阳市贵阳国家高新技术产业开发区茅台国际商务中心 C 栋写字楼第 16 层 7、8、9、10	2016/11/2	柏明辉	0851-86520685
39	江西分公司	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1669 号华尔登商业中心 33 楼 3304 室、3305 室、3306 室	2016/8/30	李娜	0791-83798822
40	河北分公司	石家庄桥西区中华南大街 172 号	2018/1/30	纪涛	0311-80959588

41	山西分公司	山西省太原市万柏林区迎泽西大街 86 号信达国际金融中心 36 层 3601、3602、3611、3612 室	2018/3/2	赵静	0351-7588521
42	浙江分公司	浙江省杭州市江干区荣安大厦 2502A 室、2502B 室	2020/3/6	姚强	0571-85131788
43	新疆分公司	新疆乌鲁木齐市水磨沟区南湖南路 66 号水清木华 A0 座四楼	2021/4/13	胡景怡	0991-4653300
44	海南分公司	海口市人民大道 39 号南苑大厦三层北半幅	2021/4/23	林涛	0898-36686001

### (三) 公司证券营业部的数量和分布情况

√适用 □不适用

截至 2021 年 12 月 31 日，公司设有 285 家证券营业部，具体见下表：

省市或地区	营业部数量	省市或地区	营业部数量	省市或地区	营业部数量
山东	131	广东	20	河北	3
北京	11	浙江	15	陕西	4
天津	3	江苏	15	山西	3
上海	14	湖北	9	云南	4
黑龙江	4	湖南	8	重庆	1
吉林	4	安徽	5	四川	3
辽宁	4	河南	3	江西	4
福建	12	广西	3	内蒙古	2

### (四) 其他分支机构数量与分布情况

√适用 □不适用

截至 2021 年 12 月 31 日，公司控股子公司鲁证期货设有 5 家期货分公司，具体见下表：

序号	分支机构名称	注册地址	成立时间	负责人	电话
1	上海分公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 20 层（名义楼层，实际楼层 18 层）01、02B 单元	2016/2/1	任一飞	021-61620235
2	武汉分公司	武汉市江岸区中山大道 1627 号企业天地 3 号 10 楼 1009 号	2017/6/8	邱宽宏	027-86681096

3	济南分公司	济南市天桥区英贤街19号吉华大厦主楼四楼A区	2017/7/27	赵东	0531-86113901
4	南京分公司	南京市建邺区庐山路168号2112室	2017/8/3	武静	025-57626667
5	杭州分公司	杭州市西湖区莫干山路231号锐明大厦4001室	2008/7/31	王根望	0571-28118966

截至2021年12月31日，公司控股子公司鲁证期货设有22家期货营业部，具体见下表：

省市或地区	营业部数量	省市或地区	营业部数量	省市或地区	营业部数量
山东省	10	北京市	1	辽宁省	2
江苏省	1	浙江省	2	广东省	2
湖南省	1	上海市	1	天津市	1
河南省	1				

## 七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所（境内）	名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
	办公地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26
	签字会计师姓名	吴强、汪玉寿、倪士明
报告期内履行持续督导职责的保荐机构	名称	东吴证券股份有限公司
	办公地址	苏州工业园区星阳街5号
	签字的保荐代表人姓名	方磊、王茂华
	持续督导的期间	2020年6月3日-2022年12月31日

## 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	13,149,669,222.30	10,352,224,019.84	27.02	9,708,987,193.91
归属于母公司股东的净利润	3,200,009,354.36	2,525,298,270.86	26.72	2,249,463,067.12
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	3,104,894,896.59	2,460,643,554.32	26.18	2,219,586,843.55
经营活动产生的现金流量净额	2,272,074,709.25	2,148,771,692.23	5.74	11,141,066,209.59
其他综合收益	72,058,636.63	65,827,137.10	9.47	338,022,690.65
主要会计数据	2021年末	2020年末	本期末比上年	2019年末

			同期末 增减（ %）	
资产总额	204,689,764,870.78	174,509,560,415.70	17.29	146,613,149,711.09
负债总额	167,529,999,830.29	140,079,813,166.95	19.60	111,606,582,579.68
归属于母公司股东的权益	35,789,915,007.61	33,278,256,110.96	7.55	33,909,579,330.15
所有者权益总额	37,159,765,040.49	34,429,747,248.75	7.93	35,006,567,131.41

## （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）	0.46	0.36	27.78	0.30
稀释每股收益（元/股）	0.46	0.36	27.78	0.30
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.45	0.35	28.57	0.30
加权平均净资产收益率（%）	9.25	7.73	增加1.52个百分点	7.06
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	8.97	7.52	增加1.45个百分点	6.95

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

## （三）母公司的净资本及风险控制指标

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
核心净资本	20,438,171,134.31	19,557,836,200.06
附属净资本	6,400,000,000.00	6,100,000,000.00
净资本	26,838,171,134.31	25,657,836,200.06
净资产	34,797,831,814.18	32,312,053,757.79
各项风险资本准备之和	12,689,122,431.16	11,078,924,343.34
表内外资产总额	143,884,638,352.82	126,573,343,360.84
风险覆盖率（%）	211.51	231.59
资本杠杆率（%）	15.09	16.64
流动性覆盖率（%）	282.68	243.62
净稳定资金率（%）	141.93	149.74
净资本/净资产（%）	77.13	79.41
净资本/负债（%）	26.79	29.78
净资产/负债（%）	34.73	37.50
自营权益类证券及证券衍生品/ 净资本（%）	23.22	34.29
自营非权益类证券及衍生品/ 净资本（%）	232.90	214.43

报告期内，公司各项风险控制指标均持续符合规定标准，除“持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例”外，各项风险控制指标均无触及预警标准情形。2020年12月，因公司另类投资子公司中泰创业投资（深圳）有限公司原持有的标的公司股权在科创板上市，导致持仓集中度

超过监管标准，公司已向山东证监局作出书面报告，并按监管要求及时出售，2022 年 1 月，该比例降至监管标准以下，2022 年 3 月，该比例降至预警标准以下。

### 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	2,449,259,353.94	3,311,573,614.34	3,242,585,779.61	4,146,250,474.41
归属于上市公司股东的净利润	666,340,029.62	1,034,832,985.66	843,179,531.47	655,656,807.61
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	664,844,919.02	981,324,635.32	839,948,059.46	618,777,282.79
经营活动产生的现金流量净额	-1,152,080,999.12	2,444,689,331.59	5,651,589,648.08	-4,672,123,271.30

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	49,277,965.58		21,089,974.15	-1,432,398.62
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	64,605,584.31		60,307,644.14	60,480,990.55
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认	3,906,468.72			

净资产公允价值产生的收益				
单独进行减值测试的应收款项、 合同资产减值准备转回	5,366,766.42		33,843,545.52	
除上述各项之外的其他营业外 收入和支出	3,759,626.68		-41,495,365.16	-11,226,288.12
其他符合非经常性损益定义的 损益项目	17,528,590.21		17,069,053.80	5,657,629.89
减：所得税影响额	35,586,072.82		22,786,835.28	12,077,863.84
少数股东权益影响额（税 后）	13,744,471.33		3,373,300.63	11,525,846.29
合计	95,114,457.77		64,654,716.54	29,876,223.57

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

由于交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债、债权投资和其他债权投资属于本公司正常自营业务，因此公司根据自身正常经营业务的性质和特点，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（2008）》中列举的非经常性损益项目持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债、债权投资和其他债权投资取得的投资收益，界定为经常性损益项目。

## 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	46,526,715,197.97	53,385,599,334.16	6,858,884,136.19	2,534,715,919.75
交易性金融负债	8,014,669.01	54,450,766.68	46,436,097.67	5,756,807.83
其他债权投资	17,759,974,678.54	20,806,019,158.84	3,046,044,480.30	864,825,698.35
其他权益工具投 资	5,964,824,777.85	3,249,721,525.98	-2,715,103,251.87	334,465,667.17
衍生金融工具	-50,040,169.61	63,346,004.44	113,386,174.05	81,541,370.75
合计	70,209,489,153.76	77,559,136,790.10	7,349,647,636.34	3,821,305,463.85

## 十三、 其他

√适用 □不适用

按照《证券公司年度报告内容与格式准则》（2013 年修订）的要求计算的财务报表中的主要项目和同比变动幅度超过 30% 的项目

### 1、合并财务报表

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	增减 (%)
货币资金	46,090,288,079.05	36,651,600,637.15	25.75
结算备付金	11,097,890,604.20	8,827,027,434.56	25.73
融出资金	35,821,147,194.79	31,206,744,639.54	14.79

衍生金融资产	430,613,618.22	270,143,072.50	59.40
存出保证金	10,284,255,949.87	8,982,591,206.22	14.49
应收款项	1,572,351,957.16	1,008,821,124.39	55.86
合同资产	18,834,724.14	6,461,613.75	191.49
买入返售金融资产	12,474,745,640.83	9,160,815,458.42	36.18
交易性金融资产	53,385,599,334.16	46,526,715,197.97	14.74
债权投资	2,197,335,613.93	3,732,092,907.91	-41.12
其他债权投资	20,806,019,158.84	17,759,974,678.54	17.15
其他权益工具投资	3,249,721,525.98	5,964,824,777.85	-45.52
投资性房地产	1,141,381,313.10	455,042,060.54	150.83
在建工程	727,952,539.42	6,064,308.53	11,903.88
使用权资产	661,924,830.84		不适用
其他资产	1,638,966,993.20	1,060,265,114.02	54.58
应付短期融资款	12,910,778,536.39	11,604,103,001.41	11.26
拆入资金	2,785,248,841.87	2,038,836,747.11	36.61
交易性金融负债	54,450,766.68	8,014,669.01	579.39
卖出回购金融资产款	36,995,348,838.82	31,603,737,261.85	17.06
代理买卖证券款	56,213,164,519.52	44,434,372,998.58	26.51
代理承销证券款	5,650,010.43	2,963,337.06	90.66
应付款项	3,415,541,309.95	1,911,785,575.07	78.66
合同负债	51,724,061.22	31,205,667.32	65.75
预计负债	1,430,522.07	29,568,504.39	-95.16
应付债券	43,525,535,155.58	32,805,189,719.93	32.68
租赁负债	653,224,021.22		不适用
递延收益	2,396,028.00		不适用
递延所得税负债	822,187,410.41	505,440,524.78	62.67
其他负债	2,010,622,531.99	6,716,884,970.16	-70.07
<b>项目</b>	<b>2021 年</b>	<b>2020 年</b>	<b>增减 (%)</b>
利息净收入	1,792,807,446.69	2,082,828,785.20	-13.92
手续费及佣金净收入	6,386,935,837.93	5,193,989,578.05	22.97
投资收益	2,398,441,556.01	1,660,443,628.08	44.45
公允价值变动收益	826,400,010.19	428,392,065.24	92.91
汇兑收益	20,876,582.83	37,382.28	55,746.20
其他业务收入	1,598,292,991.25	900,413,570.54	77.51
资产处置收益	43,780,622.88	8,742,312.51	400.79
业务及管理费	6,483,910,118.42	5,701,571,886.70	13.72
信用减值损失	761,462,408.26	401,680,980.92	89.57
其他资产减值损失	1,727,848.53		不适用
其他业务成本	1,527,999,143.96	852,326,666.96	79.27
营业外收入	24,393,385.41	2,245,015.84	986.56
营业外支出	20,509,272.09	43,740,381.00	-53.11
所得税费用	999,244,885.77	693,966,305.01	43.99
利润总额	4,298,610,841.71	3,275,271,873.27	31.24
归属于母公司所有者的净利润	3,200,009,354.36	2,525,298,270.86	26.72
少数股东损益	99,356,601.58	56,007,297.40	77.40
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	-573,904.37	3,650,693.04	-115.72

## 2、母公司财务报表

单位：元 币种：人民币

项目	2021年12月31日	2020年12月31日	增减(%)
货币资金	32,242,078,271.70	27,989,827,406.84	15.19
结算备付金	11,273,482,164.77	8,949,041,030.56	25.97
融出资金	34,556,474,321.33	30,085,911,990.66	14.86
存出保证金	1,556,853,334.03	2,871,478,534.45	-45.78
应收款项	597,342,892.03	380,714,201.00	56.90
买入返售金融资产	10,150,996,426.39	7,593,113,606.19	33.69
交易性金融资产	43,407,587,828.17	37,438,751,607.40	15.94
其他债权投资	19,608,886,289.48	17,759,974,678.54	10.41
其他权益工具投资	4,767,096,117.17	7,744,968,168.69	-38.45
长期股权投资	10,586,062,807.93	8,335,070,165.13	27.01
投资性房地产	9,631,125.58	15,067,217.80	-36.08
使用权资产	579,412,957.25		不适用
其他资产	2,748,858,933.12	700,307,245.98	292.52
应付短期融资款	13,891,453,974.74	12,579,476,019.72	10.43
拆入资金	2,507,527,084.87	1,507,510,950.31	66.34
卖出回购金融资产款	36,092,989,381.08	35,962,040,221.29	0.36
代理买卖证券款	38,593,663,529.44	32,782,973,977.13	17.72
应交税费	377,244,045.03	670,491,008.85	-43.74
合同负债	16,360,517.28	10,113,648.50	61.77
预计负债	317,245.29	102,539.59	209.39
应付债券	41,588,826,643.68	30,826,513,928.06	34.91
租赁负债	561,251,135.49		不适用
资本公积	12,853,257,732.67	12,852,639,623.42	0.00
其他综合收益	250,930,603.76	163,326,545.77	53.64
项目	2021年	2020年	增减(%)
利息净收入	1,333,669,265.22	1,638,196,824.95	-18.59
手续费及佣金净收入	5,407,135,898.88	4,554,162,174.21	18.73
投资收益	2,202,932,757.96	1,302,839,180.00	69.09
公允价值变动收益	43,123,144.14	468,536,739.21	-90.80
汇兑收益	-473,384.78	-1,423,755.21	不适用
其他业务收入	11,311,385.84	32,745,253.97	-65.46
资产处置收益	380,370.66	7,905,669.33	-95.19
业务及管理费	5,264,682,633.81	4,763,873,541.36	10.51
信用减值损失	-34,904,530.69	157,840,999.97	-122.11
其他业务成本	920,165.77	10,318,734.32	-91.08
营业外收入	18,171,772.25	1,708,857.83	963.39
营业外支出	17,059,824.91	12,271,848.12	39.02
其他综合收益的税后净额	99,762,712.84	3,191,546.91	3,025.84

### 第三节 管理层讨论与分析



## 一、经营情况讨论与分析

2021 年是“十四五”开局之年，也是公司二次创业的起步之年。公司按照“一个统领、一个中心、四大战略、两个支撑”的 1142 总体发展思路，不断厚植“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以党建为统领，以客户为中心，积极把握市场机遇，持续深化内部改革，深入实施区域突破战略，加快推进业务转型提升，综合金融服务能力显著增强，经营业绩稳步提升，发展质量不断提高。报告期末，公司总资产为 2,046.90 亿元，归属于母公司股东的权益为 357.90 亿元。报告期内，公司实现营业收入 131.50 亿元，同比增长 27.02%；利润总额 42.99 亿元，同比增长 31.24%；实现归属于母公司股东的净利润 32.00 亿元，同比增长 26.72%。

### （一）投资银行业务

2021 年，科创板、创业板注册制改革持续深化，沪深两市上市公司快速扩容，各板块定位和审核标准进一步明晰，再融资和并购重组制度得以完善和优化；聚焦服务创新型中小企业的北京证券交易所正式开板，标志着我国多层次资本市场体系进一步完善，加速了我国全面注册制改革的步伐。监管部门出台和修订一系列监管措施，进一步压实中介机构责任，对规范上市公司治理、信息披露等提出更高要求。债券市场信用分化延续，高等级品种发行规模占比维持高位，虽然信用债发行规模相比去年有所增加，但是由于到期和提前兑付规模上升明显，导致净融资规模同比大幅缩减。

报告期内，公司致力于服务实体经济，坚持以客户为中心，进一步优化业务布局，强化基础管理，深化内部协同，积极抢抓机遇，投行业务整体发展势头良好，公司投行业务取得了历史最佳业绩。

#### 1. 股票保荐承销

报告期内，公司不断提升大项目运作、销售和定价能力，着力推动区域突破战略和“行业组”建设，深耕重点区域和行业，同时积极开拓北交所业务机会，股权业务取得历史最佳成绩，完成项目单数及收入均达到近年新高，共完成了 35 单股权主承销项目的发行，合计承销规模 236.19 亿元，包括 IPO 项目 13 单、配股 1 单、非公开发行项目 20 单、可转债项目 1 单（数据来源：公司内部统计）。

报告期内，公司股权主承销项目情况如下表所示：

项目	2021 年度	2020 年度	同比增长
股权主承销项目单数	35	17	105.88%
股权主承销项目承销规模	236.19 亿元	179.86 亿元	31.32%

报告期内，公司明确行业聚焦与行业组打造方案，确定重点行业方向，着力推动“行业组”建设，其中，公司保荐主承销的普联软件 IPO 项目，是山东省第一家纳斯达克回归 A 股的 IPO 项目，为公司在科技行业赢得了良好口碑。

报告期内，公司不断深化投行业务发展格局，持续推进了一系列重大项目落地，大项目运作能力持续提升，公司联合主承销的维远股份 IPO 项目，是山东省目前融资规模最大的化工企业 IPO 项目，也是山东省近 5 年来融资规模最大的 IPO 项目；公司联合主承销的潍柴动力定增项目，是报告期内资本市场的标杆项目之一。

报告期内，公司把握北交所成立历史机遇，充分利用公司在新三板业务的行业优势地位，筛选出一批专精特新企业、知名投资机构投资以及行业前沿领域的项目作为重点项目持续跟踪、加快推进，公司保荐主承销的志晟信息 IPO 项目，是首批在北交所发行上市的企业之一。

报告期内，公司连续第二年获评中国证券业协会“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”A 类券商，在《证券时报》主办的“2021 中国证券业君鼎奖”评选中荣获“2021 中国证券业股权再融资团队君鼎奖”、“2021 中国证券业财务顾问项目君鼎奖”等奖项。

## 2. 债券发行承销业务

报告期内，公司债券业务资格牌照进一步完备，客户结构不断优化，细分领域持续保持优势地位，金融债实现新的突破，承销债券类项目 684 单，承销规模合计 1,591.35 亿元，其中，主承销 282 单，承销规模合计 1,120.67 亿元（数据来源：公司内部统计）。

报告期内，公司债券类项目情况如下表所示：

项目	2021 年度	2020 年度	同比增长
债券类项目单数	684	378	80.95%
债券类项目承销规模	1,591.35 亿元	1,322.65 亿元	20.32%
债券类主承销项目单数	282	189	49.21%
债券类主承销项目承销规模	1,120.67 亿元	1,045.38 亿元	7.20%

报告期内，公司重点加大优质客户的开发力度，进一步优化了客户结构，高信用等级的优质客户持续增加，作为主承销商参与了国家电网有限公司 2021 年公开发行短期公司债券（第一期）、中国民生银行股份有限公司 2021 年第一期无固定期限资本债券、中国工商银行股份有限公司 2021 年二级资本债券（第二期）等项目，为进一步覆盖央企及大型金融企业客户奠定坚实基础；公司参与的中国民生银行股份有限公司 2021 年第一期无固定期限资本债券项目，创造了近一年来股份制银行永续债最低发行利差；公司参与的中国工商银行股份有限公司 2021 年二级资本债券（第二期）项目，是公司首次承销国有大型商业银行金融债，也是公司历史上参与承销的单只规模最大的债券项目。

报告期内，公司充分发挥本土券商优势，坚持深耕山东市场，加大业务开拓和客户服务力度，共完成了山东省鲁信投资控股集团有限公司公开发行 2021 年公司债券、山东省财金投资集团有限公司 2021 年公开发行公司债券（面向专业投资者）、山东高速集团有限公司公开发行 2021 年公司债券（面向专业投资者）、山东国惠投资有限公司 2021 年非公开发行公司债券等一系列山东省管企业债权融资项目，服务省属企业能力进一步提升。

报告期内，公司成功取得非金融企业债务融资工具主承销商资格，实现银行间与交易所产品的全牌照经营，主承销的中国冶金科工股份有限公司 2020-2022 年度债务融资工具项目，是公司

成功发行的首单非金融企业债务融资工具产品。公司成功入选山东地方政府债主承销商，实现了地方政府债主承销商角色零的突破。

### 3.新三板推荐及相关业务

报告期内，公司积极把握北交所成立的历史机遇，加强优质挂牌项目储备，加大存量项目跟踪服务，推荐 2 家企业在新三板挂牌、参与 22 次挂牌公司定向发行股票，定向发行融资规模 6.59 亿元；持续督导新三板挂牌公司 263 家，其中，创新层公司 38 家，基础层公司 225 家（数据来源：公司内部统计、全国中小企业股份转让系统 2021 年市场统计快报）。

报告期内，新三板推荐及相关业务情况如下表所示：

项目	2021 年度	2020 年度
新三板挂牌家数	2	8
挂牌公司定向发行次数	22 次	16 次
定向发行融资规模	6.59 亿元	4.05 亿元
持续督导新三板挂牌公司家数	263	313

报告期内，公司获得《证券时报》主办评选的“最受上市公司尊敬的新三板投行”奖项。在全国股转公司 2021 年证券公司服务新三板改革评价中，公司评价总得分行业排名第 4 位。

2022 年发展展望：公司将进一步深耕重点区域，提升区域覆盖广度深度；推动建立行业组模式，在重点行业形成深耕、专精的差异化竞争格局；建立投行客户经营体系，打造企业客户平台化服务模式，加大优质客户开发维护力度，全面推动客户“1+N”综合金融服务体系建设。

#### （二）财富管理业务

2021 年，沪深两市股基交易量（剔除货币基金）268.09 万亿元，日均交易量 1.1 万亿元，较 2020 年增加 2,182.59 亿元，增幅 24.66%（数据来源：沪深交易所）；市场新增投资者 1,963.36 万户，比 2020 年增加 161.11 万户，增幅 8.94%（数据来源：中国证券登记结算有限责任公司网站）。在资管新规、打破刚兑、房住不炒、注册制深化改革等多种因素的共同助推下，居民财富管理需求不断增长，同时也对证券公司财富管理服务能力提出了更高要求。

报告期内，公司进一步优化财富管理组织架构，深化财富管理转型落地，以监管为导向，以客户为中心，努力打造具有市场竞争力的“三体系一平台”，即交易服务体系、产品服务体系、综合金融服务体系及金融科技平台，以金融产品销售和公募基金投顾业务为抓手，持续深化财富管理转型。凭借公司 XTP 系统在量化交易领域的优势，打造了量化细分市场的私募产品“中泰量化 30”，差异化推出“FOF”和“专享”两大细分子策略系列产品，不断完善公司金融产品体系；积极推进公募基金投顾业务，取得公募基金投顾业务资格，推出公募基金投顾业务品牌——“齐富投”，进一步完善公司综合金融服务体系。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司共服务客户 726.54 万户，管理客户资产 1.09 万亿元（不含未解禁限售股、OTC 市值）。报告期内，公司新增开户 64.24 万户，实现股票基金交易额 14.55 万亿元，同比增幅 15.20%。截至报告期末，公司代销金融产品保有规模 535.24 亿元，同比增长 30.09%。

报告期内，公司经纪业务交易情况如下表所示：

单位：亿元

项目		2021 年度	2020 年度
股票	交易额	140,398.99	121,510.69
	市场份额	2.72%	2.94%
基金	交易额	5,082.10	4,774.33
	市场份额	2.51%	2.90%
债券	交易额	52,332.43	28,058.43
	市场份额	0.69%	0.46%

数据来源：沪深交易所数据，债券包括债券现货和债券回购

报告期内，公司代销金融产品保有规模如下表所示：

单位：亿元

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	同比增长
金融产品保有量	535.24	411.44	30.09%

数据来源：公司内部统计

公司为投资者提供多终端多渠道一体化互联网综合服务平台，包括中泰齐富通 APP、融易汇 PC 端、微信公众号、门户网站等，打造线上线下一体化综合财富管理服务体系。截至 2021 年末，中泰齐富通 APP 月活数为 464.10 万，在券商 APP 领域（不含同花顺、大智慧等第三方 APP）排名第 11 位（数据来源：易观）。

2022 年发展展望：公司将遵循财富管理业务监管导向及行业发展趋势，以客户为中心，持续加强交易服务体系、产品服务体系、综合金融服务体系及金融科技平台“三体系一平台”建设，坚持金融产品销售和公募基金投顾业务双轮驱动，加快财富管理转型步伐，努力打造国内一流财富管理品牌。

### （三）机构业务

报告期内，公司优化机构业务组织体系，设立机构业务委员会，统一同业机构客户的开发、服务、销售职能，调整研究业务、托管业务定位，强化机构销售渠道建设；以研究业务为引领，以算法交易为抓手，联合银行、保险、信托等资金方以及金融科技公司等平台，为机构客户服务全方位赋能，机构业务实现平稳发展。

#### 1. 研究业务

截至 2021 年 12 月 31 日，公司共有研究人员 130 人，全年对外发布研究报告 4,714 篇。公司研究所构建了完整的宏观经济、产业经济及上市公司研究框架体系，覆盖了宏观策略、固定收益、金融工程及 20 余个行业，实现行业全覆盖，在宏观、金融、金属等研究领域得到国内外投资者认可。2021 年成为全国社会保障基金新增境内签约券商之一，不断优化研究收入结构。加强海外研究服务，推动业务国际化发展，提升品牌影响力。

#### 2. 托管外包与机构交易业务

报告期内，公司托管外包业务聚焦运营效率与客户服务能力提升，加强合规风控建设，以创新驱动金融科技赋能，打造特色服务品牌，全力推进数字化转型，实现托管外包业务稳健发展。报告期末，公司存续托管外包各类产品共 2,414 只，规模 1,342.66 亿元。

报告期内，公司在机构交易方面已经形成了以 XTP 自主研发极速交易系统为核心、行业标准化机构交易系统为基础、定制化交易系统为突破点的金融科技竞争优势。报告期末，公司机构交易服务存量客户 1,603 户，较上年末增长 28.86%，存量资产规模 711.67 亿元，较上年末增长 36.77%。

报告期内，公司机构交易业务情况如下表所示：

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	增长
机构交易期末客户数量（户）	1,603	1,244	28.86%
机构交易期末存量资产规模（亿元）	711.67	520.33	36.77%

数据来源：公司内部统计

2022 年发展展望：公司将进一步整合研究力量，强化专业研究能力建设，打造集卖方研究、内部协同、智库研究为一体的研究平台；持续强化业务风险管控能力，加快智能化系统建设，不断丰富客户服务体系；充分利用 XTP 系统先发优势，加大 PB 业务开拓力度，强化业务协同，以机构投顾、FOF 业务为抓手，推动机构业务实现更大突破。

#### （四）投资业务

##### 1. 投资交易业务

2021 年，经济修复放缓，资本市场呈现分化加大、博弈加剧的特征。股票结构化行情明显，短期板块极端行情频繁出现。债市趋势性机会较少，利率波动区间震荡，信用风险持续积累。衍生品市场，收益互换新规发布，业务模式有待重构。新三板市场受北交所推出利好影响，全年涨幅较大。

报告期内，公司权益投资业务加强投研一体化建设，在坚持价值投资的同时，完善择时和行业配置模型，提升交易能力，丰富投资策略。固定收益业务方面，重点加强信用风险管理能力、流动性管理能力、多策略能力建设，布局资本中介业务，积极争取新业务资格，报告期内中金所国债期货做市业务资格获中国证监会无异议函。衍生品业务方面，持续改进做市系统，丰富期权做市和 ETF 做市策略，探索量化投资新策略；提升场外衍生品产品开发能力，加强系统建设，提高风险管理能力。新三板、北交所业务方面，持续加强北交所上市企业覆盖与研究，加强市场走势研判，及时调整投资交易策略，合规开展新三板股票做市业务。报告期内，公司在全国中小企业股份转让系统 2021 年做市商评优结果中获得“年度优秀流动性提供做市商”荣誉称号。

2022 年发展展望：2022 年，我国经济面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，大类资产配置将迎来内生和外围的诸多困难和挑战，各类资产估值预期仍将受到压制。公司投资交易业务将继续优化投资研究体系，加强组合管理能力、多策略投资能力、产品设计能力和综合服务能力，优化大类资产配置体系，加强信息系统建设，提升合规风控管理能力，争取获得稳定的投资收益。

##### 2. 另类投资业务

中泰创投为公司从事另类投资业务的全资子公司。报告期内，中泰创投持续健全内部管理制度和机制，主要将投资聚焦于航空航天、军工、新能源、新材料、节能环保及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业，重点布局于山东省、长三角和珠三角等区域。2021 年，共完成 17 个项目投资，总投资金额 13.22 亿元。报告期内，有 5 个项目在科创板上市，1 个项目在主板上市。2021 年，中泰创投实现营业收入 11.22 亿元，净利润 8.15 亿元。

2022 年发展展望：中泰创投将继续聚焦航天航空军工、新能源、新材料及先进制造等行业，持续深度挖掘行业投资机会，不断提升资产组合质量及平衡性，稳步提高投资盈利水平，有效增强抵御市场波动与经济周期能力，力争另类投资业务再上新台阶。

## （五）信用业务

### 1. 融资融券业务

2021 年，市场融资融券规模稳步提升，截至报告期末，市场融资融券余额 18,321.91 亿元，较上年同期增加 2,131.83 亿元，同比增幅 13.17%（数据来源：Wind）。报告期内，公司坚持“服务客户、管住风险、积极竞争、业务赋能”的工作思路，持续优化风险管控措施，推进精细化管理，大力拓展券源供给渠道，稳步推进融资融券业务高质量发展。截至 2021 年 12 月 31 日，公司融资融券余额 362.99 亿元，较 2020 年末增加 43.67 亿元，同比增长 13.68%，期末总体维持担保比例为 273.19%，融资融券业务整体风险可控。

报告期内，公司融资融券业务开展情况如下表所示：

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
融资融券余额（亿元）	362.99	319.32
期末维持担保比例	273.19%	262.97%

数据来源：公司内部统计

### 2. 股票质押业务

2021 年，公司贯彻“降风险、控规模、促协同”的工作思路，持续加大风险管控力度，不断优化承做项目质量，促进股票质押业务稳健持续发展。截至 2021 年 12 月 31 日，公司股票质押业务待购回余额 79.36 亿元，较上年同期减少 7.52 亿元，其中，自有资金融资规模为 56.40 亿元，平均履约保障比例为 337.21%；资管计划作为融出方的融资规模为 22.96 亿元。

报告期内，公司股票质押业务规模情况如下表所示：

单位：亿元

项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
股票质押业务待购回余额	79.36	86.88
其中：自有资金融资规模	56.40	58.07
资管计划作为融出方的融资规模	22.96	28.81

数据来源：公司内部统计

2022 年发展展望：公司将进一步提升客户服务水平，提升客户感受；紧跟市场创新步伐，探索融券业务发展新模式，努力满足客户的多样化需求；稳妥发展股票质押业务，加强风险管控，扩大协同效应，推动信用业务高质量发展。

## （六）资产管理业务

### 1. 中泰资管

2021 年是资管新规过渡期的收官之年，券商资产管理行业总体规模企稳，资产管理业务收入止跌回升；头部机构集中度持续提高，“马太效应”日益明显。报告期内，中泰资管持续打造投研一体化的投研体系，大力发展权益投资业务，深化母子公司业务协同，大力发展机构客户，业务经营实现稳步增长。

2021 年，中泰资管实现营业收入 5.36 亿元，净利润 0.69 亿元。截至 2021 年 12 月 31 日，中泰资管资产管理业务规模 1,856.17 亿元，比 2020 年末增加 386.58 亿元。其中，主动资产管理规模 1,845.39 亿元，比 2020 年末增加 658.07 亿元，主动管理规模占比 99.42%；被动资产管理规模 10.78 亿元，比 2020 年末减少 271.50 亿元。在主动资产管理规模中，公募基金业务规模 174.68 亿元、集合资产管理规模 393.22 亿元、专项资产管理规模 21.77 亿元、单一主动资产管理规模 1,255.71 亿元。

报告期内，中泰资管资产管理业务规模情况如下表所示：

单位：亿元

业务类型	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
集合资产管理业务	393.22	335.44
单一资产管理业务	1,266.49	1,012.97
专项资产管理业务	21.77	14.62
公募基金业务	174.68	106.56
合计	1,856.17	1,469.59

数据来源：公司内部统计

2022 年发展展望：中泰资管将继续坚持“以权益业务为引领，公募与私募业务齐头并进”的战略目标，充分发挥市场化机制优势，积聚优秀专业人才，发挥自身禀赋特点，积极寻找市场机会，为各类投资者提供差异化专业理财服务。

### 2. 万家基金

报告期内，万家基金坚守合规底线，不断提高风险防范能力，经营平稳有序。把握市场行情和业务机会，强化投研体系建设，持续丰富产品线，权益、固收、量化、FOF 各条线投资业绩总体良好。2021 年，万家基金实现营业收入 15.67 亿元，净利润 3.06 亿元。截至报告期末，万家基金旗下管理公募基金 100 只，管理规模 2,652.67 亿元，较上年末增长 765.47 亿元，同比增幅 40.56%，其中，非货币基金管理规模 1,634.82 亿元，较上年末增长 426.85 亿元，同比增幅 35.34%。（数据来源：中国证券投资基金业协会、公司内部统计）

报告期内，万家基金公募基金管理规模变动情况如下表所示：

单位：亿元

产品类别	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
货币基金	1,017.85	679.23

非货币基金	1,634.82	1,207.97
合计	2,652.67	1,887.20

2022 年发展展望：万家基金将聚焦市场变化和客户需求，坚持提升投资能力，进一步完善产品布局，提升管理规模和盈利水平；以队伍建设、IT 系统建设、内控体系建设为抓手，强化运营支持能力，带动公司整体竞争实力提升。

### 3.中泰资本

报告期内，中泰资本及其子公司完成齐鲁中泰定增2号私募股权基金、中泰威智（枣庄）新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）、蚌埠中泰成长一号企业管理合伙企业（有限合伙）、烟台国丰芝财中泰股权投资基金合伙企业（有限合伙）、济南中泰新动能海富股权投资基金合伙企业（有限合伙）5只基金的募集，实缴规模共7.475亿元。报告期末，中泰资本连同子公司管理存量私募股权基金16只，基金实缴出资金额合计27.36亿元，投资领域涉及新能源、新材料、医养康美、高端装备制造、节能环保、文化传媒等多个行业，投资效果良好。2021年，中泰资本实现营业收入1.17亿元，净利润0.66亿元。

2022年发展展望：中泰资本将进一步提升私募股权基金管理能力，提高在行业的知名度；进一步优化业务布局，完善组织架构设置，强化与公司投行、财富管理等的业务交流合作，互惠共赢；借助母公司在山东省内的综合优势，创新打法，深化服务，开创服务山东市场新局面。

#### （七）国际业务

报告期内，中泰国际完成 8 个 IPO 股票承销项目，股票承销规模 57.39 亿港元；完成债券承销项目 69 个，债券承销规模 1,111.4 亿港元。根据彭博 Bloomberg 数据，中泰国际的股票承销项目数量在中资券商排名第 17 位，债券承销项目数量在中资券商排名第 9 位。

2022 年发展展望：公司国际业务将更加注重债券通、RQFII 等跨境投资业务，积极推进数字化转型，金融科技带动财富管理业务转型，聚焦推进重点市场区域的港股上市及美元债融资，优化投资业务范围和投资结构，提高投研、投决和交易能力，提升风险管理能力和投融资能力，增强子公司贡献度。

#### （八）期货业务

2021 年，全国期货市场累计成交量约为 75.14 亿手，累计成交额约为 581.20 万亿元，同比分别增长 22.13% 和 32.84%（数据来源：中国期货业协会，单边统计）。

报告期内，鲁证期货不断深化内部改革，抢抓市场机遇，加大业务开拓，深耕基础期货经纪业务，稳健开展风险管理业务，着力打造专业研究能力，2021 年，鲁证期货实现营业收入 22.55 亿元，净利润 1.89 亿元，同比均大幅增长，取得了历史最好的经营业绩，实现了提级进位目标。2021 年，鲁证期货期货端期末权益为人民币 169.58 亿元，同比增长 67.82%；股票期权业务（含股票）期末权益人民币 7.27 亿元，同比增长 92.84%。

报告期内，鲁证期货的期末客户权益及成交金额情况如下表所示：

类别	2021 年	2020 年
期末客户权益（亿元）	176.85	104.83



成交金额（亿元）	147,889.15	71,072.52
----------	------------	-----------

数据来源：公司内部统计

2022 年发展展望：鲁证期货将大力推动业务转型升级，强化营销服务团队建设，提升服务机构客户能力，促进财富管理转型；优化业务协同架构和机制，持续加强合规风控能力建设，进一步提升服务实体经济能力。

## 二、报告期内公司所处行业情况

报告期内，面对复杂严峻的国际环境和国内疫情散发等多重考验，我国坚持稳中求进工作总基调，科学统筹疫情防控和经济社会发展，加强宏观政策跨周期调节，加大实体经济支持力度，国民经济持续恢复发展，实现“十四五”良好开局。资本市场作为国民经济的“晴雨表”，全面深化改革向纵深推进，改革举措接连落地，注册制配套制度规则不断完善，深市主板与中小板合并，北交所开市并实施注册制，多层次资本市场建设再上新台阶；退市制度改革取得实质性进展，有进有出、优胜劣汰的常态化退市机制加速形成；证券纠纷特别代表人诉讼制度落地，证券司法体制机制进一步健全，“零容忍”的震慑力更加彰显，市场生态持续优化。

报告期内，中国证监会继续坚持“建制度、不干预、零容忍”理念，大力推进简政放权，同时坚持分类监管、差异化监管，扶优限劣，证券行业迎来首批“白名单”券商，为优质证券公司创新发展打开空间；险资获准参与证券出借业务，引入长期资金，公募基金投顾业务试点加速，为证券行业带来新发展机遇。

报告期内，市场交投活跃，全年股票基金交易额 268.09 万亿元，较去年同期增长 24.66%；居民理财需求提升，行业财富管理转型初见成效，代销金融产品保有规模持续提升，第二批买方投顾试点逐步展业；市场投资者结构不断完善，公募基金发行数量提升，基金管理养老金资产实现良好增长，券商机构业务迎来机遇期；证券公司参控股公募基金具备市场竞争力，资管公募业务加速发展，转型不断深化。

## 三、报告期内公司从事的业务情况

公司是经中国证监会批准设立的综合类证券公司，业务资格牌照完备并不断取得新成果。报告期内，公司获得非金融企业债务融资工具主承销商资格和基金投资顾问业务试点资格。所从事的主要业务包括投资银行业务、财富管理业务、机构业务、投资业务、信用业务、资产管理业务、国际业务、期货业务等，能够为客户提供系统性、多层次、专业化的投融资服务，满足多样化金融服务需求。

投资银行业务是为各类型企业和机构客户提供股票保荐与承销、债券承销、资产证券化、新三板推荐挂牌、并购重组等全业务链的一揽子综合金融服务。

财富管理业务是为公司各类客户提供证券经纪服务、投资顾问服务、产品配置服务、综合金融服务。

机构业务是指为各类机构客户提供的研究、托管外包等业务。研究业务是为公募基金、保险、私募基金、银行等机构客户提供总量和行业研究、公司调研、定制课题或报告、会议推介路演等研究服务。托管业务指公司作为托管人依据法律法规及合同约定提供资产保管、清算交收、估值核算、投资监督等服务；外包业务指公司受资产管理机构委托，依据法律法规及合同约定提供份额登记、估值核算、绩效分析等一站式后台运营支持服务。

投资业务是指公司以自有资金开展权益类证券、固定收益类证券、衍生金融工具等金融产品的交易和做市业务，以及通过全资子公司中泰创投开展的另类投资业务。

信用业务是为客户提供融资融券、股票质押式回购交易、约定购回式证券交易和上市公司股权激励行权融资等证券融资类业务。

资产管理业务主要是通过全资子公司中泰资本、控股子公司中泰资管及参股公司万家基金开展的业务，包括私募投资基金管理、集合资产管理、单一资产管理、专项资产管理、基金管理及其他投资账户管理。

国际业务主要是通过全资子公司中泰国际在香港开展企业融资、跨境及结构性投融资、财富管理和经纪、资产管理、固定收益产品销售及交易、投资、研究和机构销售等业务，同时在新加坡和日本设有子公司开展业务。

期货业务主要通过控股子公司鲁证期货开展为客户提供与期货及衍生品有关的产品和服务，包括期货经纪、期货投资咨询及资产管理；并通过鲁证期货的全资子公司鲁证资本管理有限公司开展大宗商品风险管理业务，包括基差贸易、仓单服务、合作套保、场外衍生品业务、做市业务等。

#### 四、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

公司的核心竞争力主要体现在以下七个方面

##### （一）清晰明确的发展思路和战略规划

作为业务牌照齐备的全国大型综合类上市券商，公司深入贯彻落实“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化建设要求，在对国际国内发展格局和资本市场改革发展的新形势、新挑战进行全面研判、深入分析的基础上，提出了“永葆四心”和以党建为统领，以客户为中心，深入实施区域突破、人才强企、转型提升、金融科技四大战略，将改革创新、风控合规作为两大支撑的“1142”总体发展思路；高起点编制了“十四五”发展规划，明确了未来五年的发展目标，为公司高质量发展、打造高质量现代投资银行提供了战略引领。

##### （二）持续提升的市场竞争力

公司聚焦服务区域资本市场和实体经济，深入实施“深耕山东、南布重兵、做强北京”的区域突破战略，针对不同区域的不同业务进行差异化布局和资源配置，立足山东，辐射全国，市场竞争力持续提升。作为山东省委管理的国有重要骨干企业，公司把深耕山东作为区域突破战略的

首选之题，牢牢把握山东区位优势，主动服务山东新旧动能转换、黄河流域高质量发展战略布局，积极推动与各地方政府、大企业集团、金融机构签约，为公司业务开展提供了丰富的项目储备。实施“泰山登顶”计划，为独角兽、瞪羚和专精特新高成长企业提供全流程资本市场服务；主动拥抱北交所，与省地方金融监管局等联合主办了多次北交所上市专题培训，增强了服务中小企业的粘性，公司在专精特新企业中的影响力逐步扩大和提升。同时，公司积极布局全国市场，将人员、机构、资金向长三角、珠三角、北京等地区倾斜，推动北京、深圳、上海地区集中办公、加强协同，更好地整合内部资源，加大当地市场开发、服务力度，中泰证券品牌影响力持续提升。2021 年度，公司股权、债券业务在山东的市场份额大幅增长，在长三角、珠三角、北京等地区也实现了较快发展。

### （三）以客户需求为导向的综合金融服务能力

公司牢固树立长期经营客户的理念，坚持以客户为中心，以客户需求为导向，财富管理、投资银行等业务加快转型提升，为客户提供全生命周期服务，与客户共同成长。财富管理业务打造以投顾为核心，集专业交易、产品销售、综合金融服务为一体的国内一流财富管理平台，服务客户 720 万余户；获得基金投资顾问业务试点资格，上线了“齐富投”基金投顾品牌，正式进军买方投顾业务；依托于量化交易领域的优势，打造以“中泰量化 30”为代表的产品线，公司产品体系进一步丰富，“中泰量化 30”FOF 及专享产品累计销售规模增长迅速，以产品销售为先导的财富管理转型取得显著成效。投资银行业务致力于为企业和机构客户提供卓越的融资及财务顾问服务，服务范围覆盖全投行业务链；持续优化业务布局，投行委下设山东、北京、上海、深圳四大投行总部，形成大协同作战格局；获批非金融企业债务融资工具主承销商资格，实现银行间与交易所产品的全牌照经营，公司投行业务多项指标市场排名实现历史最佳。机构业务统一客户的开发、服务、销售职能，坚持打造国内最具影响力的研究机构，依托研究品牌优势，发挥牵引带动作用，公司机构客户开发服务能力不断提高。

### （四）健全完善的市场化经营机制

公司按照更市场、更开放、更灵活的原则持续深化改革，以改革激发动力、释放活力，增强免疫力、提高竞争力，市场化的经营管理机制进一步健全完善。公司推动组织架构变革，形成以投资银行、财富管理、金融市场、机构业务、金融科技五大委员会为支撑的综合金融服务架构体系，支持公司创新发展。公司大力实施人才强企战略，秉承“五湖四海、不拘一格，举贤荐能、唯才是举，德才兼备、以德为先”的人才观，持续创新人才引进、使用、培养、激励机制，打造投资银行、研究、投资、财富管理、金融科技等专业水平高、业务能力强、具有市场竞争力的人才队伍。公司持续深化三项制度改革，优化调整干部队伍，建设年轻化、专业化、复合型的干部人才梯队；坚持“以业绩论英雄”的考核导向，建立了更具市场竞争力的薪酬激励约束机制。通过加强重点地区重点业务人才队伍建设、完善市场化激励约束机制、搭建多层次人才培养体系，吸引凝聚更多的优秀人才加入公司，并让加入公司的优秀人才变得更加优秀，使人才优势成为公司发展的竞争优势，为公司高质量发展提供了核心保障。

### （五）稳健有效的合规风控体系

公司坚持“合规风控至上”的经营理念，以建设风险管控长效机制为目标，形成了董事会及其风险管理委员会-经理层-合规总监-合规管理总部-各部门、分支机构合规负责人（专员）的合规管理组织体系，建立健全涵盖董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司的全面风险管理组织架构。各层级履行全面风险管理的职责明确、报告路径畅通，形成相互衔接、有效制衡的运行机制。公司持续完善风险管理制度体系、风险指标体系，不断壮大风险管理专业队伍，同时利用金融科技积极推进风险管理信息化建设，对各类风险及业务实施有效监测、评估、计量、报告，有效提高了全面风险管理的质量和效率。

### （六）不断强化的金融科技支撑

公司高度重视金融科技发展，持续加大科技投入和人才队伍建设，搭建了一支素质过硬、科研能力突出的金融科技团队，着力构建“科技牵引，全面赋能”的金融科技体系，以金融科技赋能业务发展、推动业务创新、强化支撑体系，努力打造数字化智能化券商。借助人工智能、大数据、云计算、生物识别等先进技术，推动各项业务与金融科技深度融合，公司业务线上化水平大幅提升；全面推进数字化转型，以科技助力公司运营效率提升；自主研发了资金运营管理平台、公募基金投顾服务中台，打造了 XTP 极速交易系统、齐富通 APP 等多个行业领先的科技平台，推动金融科技赋能公司管理提升和业务发展。XTP 作为服务量化私募细分领域的发力产品，通过自主研发走出了差异化路线，建立了服务量化私募的全方位产品矩阵，产品生态持续优化，服务实盘客户超 1,600 户，年内为公司贡献超过 9 万亿交易量，已经成为连接优质私募和银行理财子公司、信托等超级资金的桥梁，进一步拓宽了公司服务高净值客户的优质资产渠道，推动公司财富管理业务转型提升不断加速。

### （七）协同高效的集团一体化运营

公司持续推动集团一体化管控，“一个中泰”意识持续加强，在合规前提下，“同开发、同营销、同服务”协同机制不断优化，“1+N”综合金融服务模式效果显著。通过完善管理和考核办法、树立协同发展导向，推动各业务条线、分公司和子公司间高效协同；强化对子公司的管控，推进集团化信息系统平台建设，促进母子公司联动，形成中泰发展合力。通过集团一体化运营管控，公司大协同的局面正在加快形成，运营效率进一步提升，品牌效应更加凸显，融合发展不断取得新成效。

## 五、报告期内主要经营情况

截至 2021 年末，公司总资产为 2,046.90 亿元，归属于母公司所有者的权益为 357.90 亿元；2021 年，公司实现营业收入 131.50 亿元，同比增长 27.02%；实现归属于母公司股东的净利润 32.00 亿元，同比增长 26.72%；加权平均净资产收益率为 9.25%，较上年提升 1.52 个百分点。

**(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	13,149,669,222.30	10,352,224,019.84	27.02
营业成本	8,854,942,493.91	7,035,456,781.41	25.86
经营活动产生的现金流量净额	2,272,074,709.25	2,148,771,692.23	5.74
投资活动产生的现金流量净额	-151,016,452.71	1,769,817,211.62	-108.53
筹资活动产生的现金流量净额	8,564,152,050.58	4,130,851,355.81	107.32

营业收入变动原因说明：2021 年，公司实现营业收入 131.50 亿元，同比增加 27.97 亿元，增幅 27.02%。主要增加项目为：一是手续费及佣金净收入同比增加 11.93 亿元，增幅 22.97%；二是投资收益（含公允价值变动损益）同比增加 11.36 亿元，增幅 54.38%；三是其他业务收入同比增加 6.98 亿元，增幅 77.51%。主要减少项目为：利息净收入同比减少 2.90 亿元，降幅 13.92%。

营业成本变动原因说明：2021 年，公司发生营业成本 88.55 亿元，同比增加 18.19 亿元，增幅 25.86%。主要增加项目为：一是业务及管理费同比增加 7.82 亿元，增幅 13.72%；二是信用减值损失同比增加 3.60 亿元，增幅 89.57%；三是其他业务成本同比增加 6.76 亿元，增幅 79.27%。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：2021 年，经营活动产生的现金流量净额为 22.72 亿元，同比增加 1.23 亿元，增幅 5.74%，主要为为交易目的而持有的金融资产资金净流出同比减少、返售业务资金净流入同比减少、结构化主体其他持有人资金净流出同比增加。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：2021 年，投资活动产生的现金流量净额为-1.51 亿元，同比减少 19.21 亿元，降幅 108.53%，主要为购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的资金同比增加。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：2021 年，筹资活动产生的现金流量净额为 85.64 亿元，同比增加 44.33 亿元，增幅 107.32%，主要为上年同期赎回永续债使得本期现金净流出同比减少。

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

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)	情况说明
手续费及佣金净收入	6,386,935,837.93	5,193,989,578.05	22.97	主要是经纪业务、投资银行业务和资产管理业务手续费收入增加
其中：经纪业务手续费净收入	4,349,369,456.47	3,600,295,034.89	20.81	主要是代理买卖手续费收入增加
投资银行	1,280,672,303.52	1,092,454,364.32	17.23	主要是股票承销和债券承销

业务手续费净收入				收入增加
资产管理业务手续费净收入	558,496,390.72	327,769,988.85	70.39	主要是管理的资产规模增加
利息净收入	1,792,807,446.69	2,082,828,785.20	-13.92	主要是债务融资规模增加
投资收益	2,398,441,556.01	1,660,443,628.08	44.45	主要是金融工具持有期间和处置投资收益增加
公允价值变动收益	826,400,010.19	428,392,065.24	92.91	主要是金融投资规模增加和投资业绩提升
其他业务收入	1,598,292,991.25	900,413,570.54	77.51	主要是期现结合业务销售收入增加
业务及管理费	6,483,910,118.42	5,701,571,886.70	13.72	主要是人工和折旧费用增加
信用减值损失	761,462,408.26	401,680,980.92	89.57	主要是债权投资减值准备增加
其他业务成本	1,527,999,143.96	852,326,666.96	79.27	主要是期现结合业务销售成本增加

(1). 主营业务分行业、分地区情况

单位:元 币种:人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
财富管理业务	4,387,836,161.57	2,797,003,341.11	36.26	30.86	36.54	减少 2.65 个百分点
证券及另类投资业务	2,465,099,439.96	333,983,723.47	86.45	230.32	3.78	增加 29.57 个百分点
投资银行业务	1,213,837,668.77	757,143,392.72	37.62	26.15	19.10	增加 3.69 个百分点
期货业务	2,249,581,744.54	1,991,351,298.71	11.48	75.30	70.11	增加 2.70 个百分点
资产管理业务	535,784,070.23	332,178,610.44	38.00	29.85	37.73	减少 3.55 个百分点
信用业务	1,168,141,037.66	33,572,447.27	97.13	-31.97	-58.01	增加 1.79 个百分点
境外业务	271,870,993.96	1,068,886,319.95	-293.16	-44.85	77.23	减少 270.82 个百分点
其他业务	857,518,105.61	1,540,823,360.24	-79.68	-38.07	-20.35	减少 39.97 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 (%)
公司本部	4,832,256,728.21	2,734,603,892.75	43.41	4.17	-6.64	增加 6.55 个百分点

山东省	4,705,465,964.37	3,057,209,124.40	35.03	38.02	48.72	减少 4.67 个百分点
上海市	1,227,561,354.49	716,993,558.87	41.59	12.81	29.28	减少 7.44 个百分点
广东省	1,283,754,673.75	155,522,589.17	87.89	598.63	-4.02	增加 76.08 个百分点
其他地区	1,100,630,501.48	2,190,613,328.72	-99.03	6.64	64.22	减少 69.78 个百分点

#### 主营业务分行业、分地区情况的说明

适用 不适用

2021 年，公司财富管理业务实现营业收入 43.88 亿元，同比增长 30.86%，主要是公司持续深化财富管理转型，代理买卖证券业务收入、代销金融产品收入、投资咨询业务收入等大幅增长。证券及另类投资业务实现营业收入 24.65 亿元，同比增长 230.32%，主要是公司另类投资业务前期投资的多个项目在本年首次发行股票上市，实现了较好收益；证券投资交易业务加强投研建设，优化大类资产配置，收入稳步提升。投资银行业务实现营业收入 12.14 亿元，同比增长 26.15%，主要是公司进一步优化投行业务布局，深入实施区域突破战略，股权及债券承销规模和完成单数同比增加，投行业务收入稳步提升。期货业务实现营业收入 22.50 亿元，同比增长 75.30%，主要是期货子公司加大业务开拓力度，期货经纪业务收入及风险管理业务收入大幅提升。资产管理业务实现营业收入 5.36 亿元，同比增长 29.85%，主要是资产管理业务持续打造投研一体化体系，大力发展权益投资业务，收入稳步提升。

公司深入实施区域突破战略，牢牢把握山东区位优势，并积极布局全国市场，加大对长三角、珠三角、北京等地区市场开发、服务力度，市场竞争力得到明显提升。2021 年，公司本部实现营业收入 48.32 亿元，同比增长 4.17%；在山东省实现营业收入 47.05 亿元，同比增长 38.02%；在上海市实现营业收入 12.28 亿元，同比增长 12.81%；在广东省实现营业收入 12.84 亿元，同比增长 598.63%；在其他地区实现营业收入 11.01 亿元，同比增长 6.64%。

#### (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

#### (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

报告期内，公司的业务及管理费情况请参见本年度报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 64.业务及管理费”。

#### 4. 研发投入

##### (1). 研发投入情况表

√适用 □不适用

单位：元

本期费用化研发投入	154,594,084.94
本期资本化研发投入	0
研发投入合计	154,594,084.94
研发投入总额占营业收入比例（%）	1.18
研发投入资本化的比重（%）	0

##### (2). 研发人员情况表

√适用 □不适用

公司研发人员的数量	339
研发人员数量占公司总人数的比例（%）	3.87
研发人员学历结构	
学历结构类别	学历结构人数
博士研究生	1
硕士研究生	198
本科	135
专科	5
高中及以下	0
研发人员年龄结构	
年龄结构类别	年龄结构人数
30岁以下（不含30岁）	104
30-40岁（含30岁，不含40岁）	203
40-50岁（含40岁，不含50岁）	29
50-60岁（含50岁，不含60岁）	3
60岁及以上	0

##### (3). 情况说明

√适用 □不适用

2021年，公司持续推进数字化转型，制定金融科技“一个中心、两条主线、四大举措”的发展规划。一是全面推进能力中心建设，打造架构统一可复用的业务、数据、技术、AI等4大能力中台，通过建设统一智能问答知识库、私募基金区块链存证平台、数据魔方平台、监控运维一体化平台、RPA智能机器人服务平台等，全面提升IT中台服务能力。二是建立OKR目标推进体系，通过推动产品价值度量，保障IT资源合理分配，不断提升金融科技敏捷响应能力。三是建立投行一体化平台、机构客户管理平台、投顾投研服务平台等，提升公司高端展业服务能力。四是数字化转型与流程优化推进工作入选国务院国资委国有重点企业管理标杆项目创建行动名单，全面推进业务数字化转型、服务数字化转型、员工数字化转型，全面提升客户服务体验和业务运营效率。

##### (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

经营活动产生的现金流量净额为 22.72 亿元。其中, 现金流入 343.96 亿元, 主要为: 收取利息、手续费及佣金增加的现金 128.43 亿元, 代理买卖证券款净增加 117.79 亿元, 回购业务资金净增加额 53.88 亿元; 现金流出 321.24 亿元, 主要为: 融出资金净增加额和返售业务资金净增加额 78.79 亿元, 支付的职工薪酬和各项税费 59.71 亿元, 结构化主体其他持有人资金流出 51.02 亿元, 为交易目的而持有的金融资产净增加额 44.55 亿元, 支付利息、手续费及佣金的现金 35.50 亿元。

投资活动产生的现金流量净额为-1.51 亿元。其中, 现金流入 23.46 亿元, 主要为: 取得投资收益收到的现金 14.10 亿元, 收回投资收到的现金 6.36 亿元; 现金流出 24.97 亿元, 主要为: 购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 24.97 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额为 85.64 亿元。其中, 现金流入 459.65 亿元, 主要为: 发行债券收到的现金 454.42 亿元; 现金流出 374.00 亿元, 主要为: 偿还债务支付的现金 344.66 亿元, 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 27.24 亿元。

### (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

### (三) 资产、负债情况分析

适用 不适用

#### 1. 资产及负债状况

单位: 元

项目名称	本期期末数	本期期末数占总资产的比例 (%)	上期期末数	上期期末数占总资产的比例 (%)	本期期末金额较上期期末变动比例 (%)	情况说明
货币资金	46,090,288,079.05	22.52	36,651,600,637.15	21.00	25.75	
结算备付金	11,097,890,604.20	5.42	8,827,027,434.56	5.06	25.73	
融出资金	35,821,147,194.79	17.50	31,206,744,639.54	17.88	14.79	
衍生金融资产	430,613,618.22	0.21	270,143,072.50	0.15	59.40	主要是衍生金融工具规模增加
存出保证金	10,284,255,949.87	5.02	8,982,591,206.22	5.15	14.49	
应收款项	1,572,351,957.16	0.77	1,008,821,124.39	0.58	55.86	主要是应收经纪及交易商款项增加
合同资产	18,834,724.14	0.01	6,461,613.75	0.00	191.49	保险期货业务规模增加
买入返售金融资产	12,474,745,640.83	6.09	9,160,815,458.42	5.25	36.18	主要是银行间债券逆回购规模增加
交易性金融	53,385,599,334.16	26.08	46,526,715,197.97	26.66	14.74	

资产						
债权投资	2,197,335,613.93	1.07	3,732,092,907.91	2.14	-41.12	公司投资策略调整及计提减值
其他债权投资	20,806,019,158.84	10.16	17,759,974,678.54	10.18	17.15	
其他权益工具投资	3,249,721,525.98	1.59	5,964,824,777.85	3.42	-45.52	公司投资策略调整
投资性房地产	1,141,381,313.10	0.56	455,042,060.54	0.26	150.83	主要是外购房产出租
在建工程	727,952,539.42	0.36	6,064,308.53	0.00	11,903.88	主要是转入待装修办公楼
使用权资产	661,924,830.84	0.32			不适用	首次实施新租赁准则
其他资产	1,638,966,993.20	0.80	1,060,265,114.02	0.61	54.58	主要是预付购房款增加
应付短期融资款	12,910,778,536.39	6.31	11,604,103,001.41	6.65	11.26	
拆入资金	2,785,248,841.87	1.36	2,038,836,747.11	1.17	36.61	主要是转融通融入资金规模增加
交易性金融负债	54,450,766.68	0.03	8,014,669.01	0.00	579.39	主要是债券沽空业务持仓规模增加
卖出回购金融资产款	36,995,348,838.82	18.07	31,603,737,261.85	18.11	17.06	
代理买卖证券款	56,213,164,519.52	27.46	44,434,372,998.58	25.46	26.51	
代理承销证券款	5,650,010.43	0.00	2,963,337.06	0.00	90.66	未结算代理承销款增加
应付款项	3,415,541,309.95	1.67	1,911,785,575.07	1.10	78.66	主要是场外业务规模增加
合同负债	51,724,061.22	0.03	31,205,667.32	0.02	65.75	主要是公司实施新收入准则影响所致
预计负债	1,430,522.07	0.00	29,568,504.39	0.02	-95.16	主要是预计赔偿损失余额减少
应付债券	43,525,535,155.58	21.26	32,805,189,719.93	18.80	32.68	主要公司债、次级债的发行规模增加
租赁负债	653,224,021.22	0.32			不适用	首次实施新租赁准则
递延收益	2,396,028.00	0.00			不适用	递延政府补助增加
递延所得税负债	822,187,410.41	0.40	505,440,524.78	0.29	62.67	主要是金融工具公允价值变动收益增加
其他负债	2,010,622,531.99	0.98	6,716,884,970.16	3.85	-70.07	主要是合并结构化主体其他

						持有人的权益减少
--	--	--	--	--	--	----------

#### 其他说明

截至 2021 年 12 月 31 日,公司资产总额 2,046.90 亿元,比上年末增加 301.80 亿元,增幅 17.29%。主要变动项目是:货币资金、结算备付金和存出保证金增加 130.11 亿元,融出资金、买入返售金融资产增加 79.28 亿元,衍生金融资产、交易性金融资产、债权投资、其他债权投资和其他权益工具投资增加 58.16 亿元,投资性房地产、在建工程、使用权资产和预付购房款增加 26.74 亿元。公司资产流动性强,资产结构符合行业特点。

截至 2021 年 12 月 31 日,公司负债总额 1,675.30 亿元,比上年末增加 274.50 亿元,增幅 19.60%。主要变动项目是:应付短期融资款、拆入资金、卖出回购金融资产和应付债券增加 181.65 亿元,代理买卖证券款增加 117.79 亿元,合并结构化主体其他持有人的权益减少 51.02 亿元。负债结构合理,无到期未偿付债务,偿债能力强。

## 2. 境外资产情况

适用 不适用

### (1) 资产规模

其中:境外资产 11,023,470,159.97 (单位:元 币种:人民币),占总资产的比例为 5.39%。

### (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

报告期末,公司主要资产受限情况请参见“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目 附注 75. 所有权或使用权受到限制的资产”的相关内容。

## 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

报告期内,公司行业经营性信息分析请参见本报告“本节 一、经营情况讨论与分析”及“本节 二、报告期内公司所处行业情况”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，公司合并口径长期股权投资 9.37 亿元，较上年末增加 0.97 亿元，增幅 11.53%，具体参见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 17.长期股权投资”。子公司投资参见本报告“第十节 财务报告 十、在其他主体中的权益 1.在子公司中的权益”。

### 1. 重大的股权投资

√适用 □不适用

2020 年 7 月 22 日，公司第二届董事会第三十次会议审议通过了《关于调整香港子公司增资方案的议案》，公司向中泰国际增资金额调整为不超过 16 亿元人民币（或等值港币）。具体内容详见公司 2020 年 7 月 24 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第三十次会议决议公告》。2021 年 2 月 19 日，公司收到中国证监会出具的《关于中泰证券股份有限公司向中泰金融国际有限公司增资有关意见的复函》（机构部函〔2021〕446 号），中国证监会对公司向中泰国际增资 16 亿元人民币（或等值港币）无异议，具体内容详见公司 2021 年 2 月 20 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于向中泰金融国际有限公司增资收到中国证监会复函的公告》。截至 2021 年 12 月 31 日，公司已对中泰国际增资 8 亿元人民币。中泰国际注册资本变更为 2,245,262,515.28 元（折合 2,759,463,375 港币）。

2021 年 7 月 6 日，公司第二届董事会第四十六次会议审议通过了《关于对全资子公司中泰创业投资(深圳)有限公司增资的议案》，同意公司在满足风险控制指标的前提下，增加中泰创投注册资本合计不超过 10 亿元人民币。具体内容详见公司 2021 年 7 月 8 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第四十六次会议决议公告》。截至 2021 年 12 月 31 日，公司已对中泰创投增资 10 亿元人民币。中泰创投注册资本变更为 40 亿元。中泰创投已完成工商登记手续的变更。

### 2. 重大的非股权投资

√适用 □不适用

2021 年 3 月 22 日，公司第二届董事会第三十九次会议审议通过了《关于购置上海绿地外滩中心办公楼的议案》，同意以公司全资子公司中泰物业为购买主体，总价款以不超过 27.35 亿元（含增值税，不含其他税费及附加）购置上海绿地外滩中心办公楼。2021 年 6 月，中泰物业与中民外滩房地产开发有限公司签署购置房产协议，中泰物业以总价款 27.21 亿元购置上海绿地外滩中心办公楼。截至本报告披露日，公司已支付购房款 27.14 亿元。A2 办公楼、C2 办公楼已办理完毕不动产证。

### 3. 以公允价值计量的金融资产

√适用 □不适用

报告期末，公司以公允价值计量的金融资产具体参见本报告“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

##### (七) 主要控股参股公司分析

适用 不适用

###### 1. 鲁证期货

鲁证期货股份有限公司，注册资本为 100,190.00 万元人民币，公司持有 63.10% 的股权，经营范围为：商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理。（有效期限以许可证为准）。（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）。截至 2021 年 12 月 31 日，鲁证期货总资产 2,068,209.97 万元，净资产 228,196.18 万元，2021 年实现营业收入 225,461.71 万元，利润总额 25,620.39 万元，净利润 18,857.29 万元。2021 年中国期货市场保持良好发展态势，大宗商品价格波动剧烈，投资者交易活跃度提升，鲁证期货抓住市场机遇，经纪业务和风险管理业务收入稳定增长，取得历史最佳经营业绩。

鲁证期货于 2015 年 7 月 7 日在香港联交所主板挂牌上市，股票简称“鲁证期货”，股票代码为 01461。

###### 2. 中泰资本

中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司，注册资本为 222,000.00 万元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：受托资产管理、投资管理（不得从事信托、金融资产管理、证券资产管理及其他限制项目）；股权投资、受托管理股权投资基金（不得从事证券投资活动；不得以公开方式募集资金开展投资活动；不得从事公开募集基金管理业务）；投资咨询。（法律、行政法规、国务院决定禁止的项目除外，限制的项目须取得许可后方可经营）。截至 2021 年 12 月 31 日，中泰资本总资产 223,163.53 万元，净资产 207,029.51 万元，2021 年实现营业收入 11,660.66 万元，利润总额 8,115.93 万元，净利润 6,602.36 万元。

###### 3. 中泰创投

中泰创业投资（深圳）有限公司，注册资本为 400,000.00 万元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：创业投资业务。（法律、行政法规、国务院决定禁止的项目除外，限制的项目须取得许可后方可经营）。截至 2021 年 12 月 31 日，中泰创投总资产 525,398.59 万元，净资产 467,118.41 万元，2021 年实现营业收入 112,240.45 万元，营业利润 107,406.58 万元，利润总额 107,406.58 万元，净利润 81,517.41 万元。2021 年，中泰创投经营业绩同比大幅增长，主要因为中泰创投前期投资的多个项目在 2021 年首次发行股票并上市，中泰创投实现了较好的收益。

###### 4. 中泰国际

中泰金融国际有限公司，注册资本为 275,946.3375 万港币，为公司全资子公司，经营范围为：证券经纪、期货、机构融资、资产管理。截至 2021 年 12 月 31 日，中泰国际总资产 1,102,347.02

万元，净资产 145,033.07 万元，2021 年实现营业收入 27,353.63 万元，营业利润-79,535.00 万元，利润总额-79,535.01 万元，净利润-80,435.44 万元。2021 年，因持有的境外地产美元债出现兑付风险，中泰国际计提了信用减值损失，导致中泰国际业绩亏损。

#### 5.中泰资管

中泰证券（上海）资产管理有限公司，注册资本为 16,666.00 万元人民币，公司持有 60% 的股权，经营范围为：证券资产管理和公开募集证券投资基金管理业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。截至 2021 年 12 月 31 日，中泰资管总资产 116,733.73 万元，净资产 66,429.62 万元，2021 年实现营业收入 53,578.41 万元，利润总额 9,081.83 万元，净利润 6,867.03 万元。

#### 6.中泰物业

齐鲁中泰物业有限公司，注册资本为 82,834.71 万元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：物业管理服务，房屋修缮服务，汽车租赁服务；房屋出售及出租；保洁服务；搬家服务；绿化工程、市内外装饰工程施工；美容美发；服装清洗；康乐健身及家政服务；蔬菜、水果、日用百货、办公用品的批发零售。截至 2021 年 12 月 31 日，中泰物业总资产 350,677.32 万元，净资产 86,735.58 万元，2021 年实现营业收入 12,743.53 万元，利润总额 4,173.16 万元，净利润 3,129.85 万元。

#### 7.齐鲁股权

经公司总经理办公会决策，公司于 2021 年 8 月与鲁信集团签署协议，通过协议转让方式以 7,888 万元受让鲁信集团所持齐鲁股权 24.8889% 的股权。2021 年 12 月 30 日完成股权转让工商变更登记。公司现持有齐鲁股权 60.8889% 的股权，齐鲁股权成为公司控股子公司。

齐鲁股权交易中心有限公司，注册资本为 22,500.00 万元人民币，公司持有 60.8889% 股权，经营范围为：为非上市公司股权、债权、资产支持证券的登记、托管、挂牌、鉴证、交易、过户、结算提供场所、设施和服务，为企业融资、并购及其他资本运作提供服务，省交易场所监管部门批准的其他业务，提供与前述业务相关的咨询、培训、信息服务，企业推介，财务顾问，投资管理。（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）。截至 2021 年 12 月 31 日，齐鲁股权总资产 48,352.87 万元，净资产 33,764.55 万元，2021 年实现主营业务收入 6,375.58 万元，利润总额 2,271.05 万元，净利润 1,676.99 万元。

#### 8.万家基金

万家基金管理有限公司，注册资本为 30,000.00 万元人民币，公司持有 49% 股权，为公司参股公司，经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。截至 2021 年 12 月 31 日，万家基金总资产 286,559.75 万元，净资产 143,920.09 万元，2021 年实现营业收入 156,728.42 万元，利润总额 39,142.99 万元，净利润 30,591.53 万元。

## (八) 公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

公司对担任结构化主体的管理人或持有产品份额的结构化主体，在综合考虑对其拥有的投资决策权及可变回报的敞口等因素后，认定对部分结构化主体拥有控制权，并将其纳入合并范围。截至报告期末，公司合并了 54 只结构化主体。具体参见本报告“第十节 财务报告 十、在其他主体中的权益 1、在子公司中的权益”。

## 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，面对百年变局和新冠肺炎疫情，资本市场实现“十四五”良好开局，服务构建新发展格局和高质量发展取得新成效。2022 年，尽管我国经济发展面临需求收缩、供给冲击和预期转弱三重压力，但我国经济稳中向好、长期向好的发展态势没有改变，韧性强的特点仍较为突出。随着直接融资助力实体经济转型发展重要性不断提升，资本市场在我国金融体系中的功能和地位将显著提升，证券行业发展将呈现以下趋势。

1.基础制度改革不断深化，行业发展迎来新机遇。全面实行股票发行注册制、建立常态化退市机制、引入长期资本投入、加强投资者保护等基础性制度改革，将进一步激发证券市场活力和创新力，优化资本市场直接融资能力，深化服务实体经济转型发展。证券公司作为资本市场的核心中介主体，将直接受益于注册制政策推动，多项投融资业务迎来新的机遇。同时，资管新规全面落地、公募基金投顾试点推广有望推动财富管理转型升级。

2.行业整合持续加速，市场竞争进一步加剧。在监管层扶优限劣、打造航母级券商的政策导向下，证券行业马太效应日益凸显，市场份额将进一步向头部券商集中。随着资本市场对外开放的持续推进，海外龙头券商加速中国布局，国内证券公司将迈入与海外龙头券商同台竞技的新阶段。

3.客户需求日益多样化，综合服务要求不断提高。客户是金融机构业务的基础及核心，新时代标准化服务的忠诚度呈现下降趋势，证券公司将重新定义“以客户为中心”，从“细化”到“泛化”，做到“千人千面”，同时满足客户多样化需求；重新定义组织业务流程，从单兵作战到多业务协同作战，为客户的“一人多面”提供全生命周期服务体验。

4.金融科技快速发展，支撑赋能作用凸显。金融与科技的融合日趋加深，端到端数字化应用将成为行业常态，组织、人才、理念等方面的数字化转型、智能化运营将成为证券公司打造差异化竞争优势的重要方向。

### (二) 公司发展战略

√适用 □不适用

坚持“一个统领、一个中心、四大战略、两个支撑”发展思路，以党建为统领，以客户为中心，深入实施区域突破、人才强企、转型提升、金融科技四大战略，强化改革创新、风控合规两大支撑，全面推动公司高质量发展再上新台阶，为资本市场和实体经济高质量发展贡献力量。

### (三) 经营计划

√适用 □不适用

2022年，公司将在“一个统领、一个中心、四大战略、两个支撑”1142总体发展思路的指引下，以服务实体经济高质量发展为己任，认真落实证券行业文化建设要求，进一步完善公司治理，加强规范运作，不断提升公司治理水平；聚力深化改革创新，着力提升资本支持能力、研究引领能力、人力资源保障能力、金融科技支撑能力、合规风控管理能力，持续提升综合竞争力和品牌知名度，推动公司高质量发展迈上新台阶。

公司将始终以客户为中心，坚持客户利益至上，深耕细作区域市场，深入实施转型提升，不断提升综合金融服务水平，进一步增强业务竞争力。**投行业务**将深耕重点区域，提升区域覆盖广度深度；推动行业组建设，提高细分领域竞争力；完善客户经营体系，加大优质客户开发维护力度，全面推动客户“1+N”综合金融服务体系。**财富管理业务**将进一步加强产品服务体系、综合金融服务体系、交易服务体系三大体系建设，不断完善金融科技平台，提升客户服务水平，强化内部协同，实现业务强力突破；**信用业务**将进一步优化业务流程，探索融券业务发展新模式，稳妥发展股票质押业务，努力满足客户多样化需求；**机构业务**将聚焦发挥研究引领作用，打造集卖方研究、内部协同、智库研究为一体的研究平台；利用XTP系统先发优势，加大PB业务开拓力度，强化托管外包与资管、代销、研究、信用、衍生品等业务条线的协同，推动机构业务实现更大突破。**金融市场业务**将聚焦权益类投资收益率提升，加强团队建设，提升大类资产配置能力。此外，公司将加强子公司管理，促进子公司规范运行，强化母子公司协同，不断提升子公司发展质量。

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

√适用 □不适用

#### 1、可能面对的风险

##### （1）合规风险

合规风险是指因公司或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。

##### （2）市场风险

市场风险是由于相关市场价格或波动率的不利变化而导致公司可能损失的风险。公司涉及市场风险的业务主要来自于自营投资、做市业务以及其他投资活动等。

公司面临的市场风险主要类别如下：①利率类风险：主要来自于公司固定收益类投资组合（包括债券、利率互换和国债期货等）在收益率曲线结构、利率波动性及信用利差等变化上的风险敞口；②汇率类风险：主要来自于公司在外汇汇率即期、远期价格及波动率变化上的风险敞口。③



其他价格风险：主要来自于公司自营证券投资和做市类业务持仓组合在股票、股票组合、股指期货、期权、大宗商品现货、商品期货等证券的价格及波动率变化上的风险敞口。

### （3）信用风险

信用风险是指由于融资方、交易对手或发行人等违约导致公司可能面临损失的风险。报告期内，公司面临的信用风险主要集中在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务、债券投资交易业务、场外衍生品业务等。

### （4）流动性风险

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

### （5）操作风险

操作风险是指由于不完善或有问题的内部操作流程设计、员工相关事项和信息技术系统以及外部事件而导致直接或间接损失的风险，包括法律风险，不包括策略风险和声誉风险。操作风险存在于公司各机构、各业务条线、各类业务及工作流程中，具有覆盖面广、种类多样、易发难控的特点，随着创新业务的不断增加、业务流程的日趋复杂、金融科技的广泛应用，如未能及时识别各业务条线和日常经营的操作风险隐患并采取有效缓释措施，可能会导致公司相关业务流程设置不合理、风险控制措施设计不完善、执行不到位，进而引发操作风险。操作风险防控工作强调全员参与，防控策略应根据关键风险特征变化情况进行动态更新调整。

### （6）声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件、及其工作人员违反廉洁规定、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，不利公司正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。声誉事件是指引发公司声誉风险的相关行为或事件。公司建立健全声誉风险管理体系，实现日常声誉风险管理和对声誉事件的妥善处置，是公司全面风险管理体系的有机组成部分。

### （7）洗钱与恐怖融资风险

公司面临的洗钱、恐怖融资和扩散融资风险是指公司的产品或服务被不法分子利用从事洗钱、恐怖融资、扩散融资等活动的可能性。

## 2、落实全面风险管理情况

公司持续贯彻落实《证券公司全面风险管理规范》等要求，全面风险管理体系覆盖各业务、各环节、各机构。公司持续完善风险管理制度体系、风险指标体系，健全涵盖董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司的全面风险管理组织架构，不断壮大风险管理专业队伍，利用金融科技赋能风险管理，对各类风险实施有效监测、评估、计量、报告。

公司建立了分层分类、操作性强、覆盖面广的风险管理制度体系。《公司全面风险管理基本制度》为全面风险管理的纲领性文件，针对各风险类型分别制定管理办法，针对主要业务领域制

定风险管理实施细则。根据经营环境变化及公司管理需要持续修订与完善，报告期内新制定了 2 项制度，修订了 18 项制度。

公司搭建了层次分明、相互衔接、有效制衡的风险管理组织架构。公司董事会及风险管理委员会审议重大风险事项，履行风险管理决策职能。公司监事会组织调研、座谈及专项检查等活动，承担全面风险管理的监督责任。公司经理层落实董事会决议事项，从人才队伍、风险限额指标、制度修订、绩效考核等方面持续优化风险管理体系。公司首席风险官代表经理层组织、协调、落实全面风险管理工作，风险管理部监测、分析、评估、报告公司整体风险水平；各部门、分支机构、子公司对各自业务范围内的风险管理有效性承担首要责任。报告期内，各层级均依职有效履职。

公司设计了配置合理、逐级分解的风险指标体系。公司针对各类业务建立规模指标、敏感性指标、风险价值、集中度指标等风险指标，设置专岗进行监测分析，执行统一的预警提示和异常报告处置机制。报告期内，公司风险管理监测岗位动态监控各业务风险指标，识别、分析、评估业务风险，经过判断、预测发出各类风险预警、风险提示，相关风险得到提前防范和有效化解。

公司建设了功能齐全、具有特色的风险管理系统。公司探索出以数据加应用双轮驱动风险管理数字化转型的推进路径，利用大数据、AI 等技术提升全面风险管理工作的智能化、数字化水平。公司风险管理系统功能覆盖各风险类型、各业务条线，管理范围触达包括子公司在内的各单位，满足公司对不同风险类型、不同业务风险管理的计量、监控、预警、分析、展示等需求。报告期内，公司持续完善风险数据集市及风险管理各应用系统功能，以子公司风险管理、投行业务风险管理、同一客户风险信息集中管理为重点推进全面风险管理数字化转型。

公司组建了专业的风险管理团队。公司成立了一支职业素养高、专业能力强的风险管理专业队伍，员工专业背景涵盖经济、金融、会计、计算机、数学等相关领域。报告期内为风险管理部增配 14 人。

公司建立了一套持续改进、策略丰富的风险应对机制。公司针对各类风险制定了相应的风险缓释措施，在业务开展中充分揭示主要业务风险并制定应急预案。公司重视信息技术风险、流动性风险的应急管理，报告期内组织 4 次信息系统应急演练、1 次流动性风险应急演练，不断提高突发事件应急处置能力。

公司推行稳健的风险管理文化。公司定期检视风险偏好体系，以此作为公司经营活动和全面风险管理的出发点。公司通过各种形式宣导风险管理理念，在各类培训中嵌入风险管理内容，提升一线业务人员的风险辨识和防范能力。报告期内，公司风险文化建设实践案例入选《2020 年证券行业文化建设年报》。

### 3、各类风险的应对措施

#### (1) 合规风险

公司建立董事会及其风险管理委员会、经营管理层、合规总监、合规管理总部、各单位合规管理人員的合规管理组织体系。报告期内，公司严格落实《证券公司和证券投资基金管理公司合

规管理办法》及《证券公司合规管理实施指引》，持续优化合规管理机制，努力做实合规管理基础，全面强化重点风险管控，切实把合规主体责任贯穿于经营管理和业务发展始终。通过合规审查、合规咨询、合规监测、合规检查、合规考核等具体合规管理工作，对公司经营管理中的合规风险进行识别、评估和监控，从事前、事中、事后有效防范合规风险，并通过合规管理有效性评估及时发现合规管理存在的问题或隐患，并及时予以修正完善。同时，公司还积极落实“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化建设要求，通过组织合规培训、强化合规宣导等工作，增强全体工作人员合规管理的思想自觉和行动自觉，持续提升公司文化软实力和核心竞争力。

公司合规管理总部通过工作联系函、现场督导、约谈等方式，督促各部门认真整改经营管理和业务发展中出现的不规范事项或风险隐患；密切跟踪最新监管政策，定期印发监管案例学习资料、发布业务风险点和监管红线清单、举办专题培训，传递最新监管政策和动态，为公司各单位合规展业提供支持；坚持监管导向、问题导向，结合行业多发问题和监管关注重点，组织开展合规检查，持续跟踪整改落实情况，强化业务管理，防范合规风险；加强信息技术合规管理，初步构建数字化的合规管理体系；持续对工作人员证券投资行为等进行监测、处理；持续优化信息隔离墙管理机制，完善信息隔离墙管理系统，防控内幕信息及未公开信息不当流动和使用；牵头组织完善客户投诉举报处理机制，履行客户投诉处理的协调、督办、核查、责任认定与报告；完善子公司分类合规管理方式，修订子公司合规管理办法，加强对子公司合规考核，建立健全子公司风险监控机制。审计稽核部牵头组织对公司合规管理的有效性进行评估，并就评估发现的问题督促相关单位落实整改。

## （2）市场风险

公司建立了完善的市场风险管理体系，通过风控前置、限额管理、风险分析、风险报告等措施对市场风险进行分析和控制，将公司整体市场风险水平管理在适当的范围内。

**风控前置：**公司业务部门开展风险排查工作并向风险管理部报告风险管理情况。业务系统或业务管理系统设置风险管理模块，在业务处理过程中由系统自动执行检查和监控措施，实现部分限额指标的前端控制。

**限额管理：**公司建立了完善的市场风险限额管理体系，设定各业务规模、敞口、集中度等关键风险指标，进行系统动态监测，分析、评估各业务市场风险，对超限情况及时通知、警示并督促业务部门采取措施控制风险。公司设置止损限额及市场风险总量 VaR 限额有效控制自营业务亏损过大的风险。

**风险分析：**公司建立了完善的市场风险计量模型库，风险管理部对公司整体市场风险进行全面评估、监测并实现量化分析。公司使用 VaR 作为衡量市场风险状况的重要指标，VaR 风险计量模型覆盖了权益价格风险、利率风险、商品价格风险、汇率风险等风险类型，能够衡量由于利率曲线变动、证券价格变动、汇率变动等因素导致的市场风险变动。公司 RNIV 风险计量模型覆盖新三板做市业务风险。

**风险报告：**公司建立了市场风险分析报告机制，公司通过市场风险日报、月报等定期报告及

不定期报告的形式反映风险识别和应对方案。通过敏感性分析、压力测试等工具定期或不定期对公司风险承受能力进行评估，针对市场异常波动、特定风险事件等情形提高评估频率，控制公司在极端情况下可能承担的损失，并将压力测试结果运用于市场风险管理及限额管理，确保公司在市场风险可控、可承受的情况下开展各项业务。

截至报告期末，公司持仓投资组合一天 95% 市场风险 VaR 为 1.06 亿元，占公司净资本的 0.4%；其中，公司权益类投资组合一天 95% 市场风险 VaR 为 7259.92 万元；公司场外衍生品业务一天 95% 市场风险 VaR 为 276.96 万元；公司场内期权做市和期权自营业务的 delta 风险敞口为 5.03 万元；公司固定收益类投资组合 DV01 敏感度为 764.93 万元。报告期内公司权益类投资规模整体保持稳定、风险敞口可控，非权益类投资久期相对稳定，公司自营投资、做市业务市场风险可控、可承受。

### （3）信用风险

公司主要采取信用评估、交易对手管理、尽职调查、限额管理、盯市管理等方式管理信用风险。

**信用评估：**在融资类业务中建立客户准入与适当性管理机制，制定客户信用等级评价体系，综合确定客户信用等级及授信额度，制定担保品准入条件；在债券投资交易和场外衍生品业务中，对标的证券、交易对手进行尽职调查和内部评级，区分风险等级；对质押证券建立准入标准，合理确定质押率；公司建立了内部评级模型，确定了内部评级覆盖的业务范围，建立了内部评级管理工具、方法和标准。

**交易对手管理：**在债券投资交易和场外衍生品业务中优先选择管理规范、资信状况良好的大型客户开展交易，根据内部评级风险等级分配确定交易额度；在融资类业务中建立科学的客户资质审核机制，通过对客户的资产情况、投资经验、资信状况等进行评价，严格执行信用授信和后续管理，及时调整客户授信额度。

**尽职调查：**公司根据各类业务特点建立了尽职调查要求与规范，在开展具有信用风险的业务前，需要根据制度要求对融资方、交易对手及标的证券等进行尽职调查和有效评估，必要时提交尽职调查报告、分析报告，符合公司准入标准并审核通过后可以实施项目。

**限额管理：**对债券投资交易建立了限额管理机制，确立了与业务规模、业务复杂度相匹配的分级授权审批机制；对衍生品交易，根据对手方内部评级、所属行业、资产实力等确定交易额度，并建立了相互制衡的分级授权管理体系；对融资类业务，确定风险限额，明确各层级审批权限，设定业务规模、集中度等指标，适时调整监控指标与阈值。

**盯市管理：**公司持续落实盯市制度，相关部门每日独立安排专人进行风险监控指标、标的证券及客户舆情风险的盯市，同时建立了良好的沟通协作机制和健全的风险应急处置预案，在发生风险时执行对内和对外的风险报告程序并及时采取应急处置措施。

公司严格控制业务规模并稳步提升整体信用风险管理水平，报告期内公司总体信用风险在可承受范围内。

#### （4）流动性风险

公司在融资负债统一归口管理的基础上积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构，保持资产负债期限始终处于合理水平；公司及时完善负债规划，通过调整到期融资集中度等手段，避免因融资渠道过于单一或债务集中到期的偿付风险，使负债结构和到期日分布更趋合理。

公司建立了现金流预测和分析框架，运用现金流缺口、敏感性分析、压力测试等管理工具，能够计量、监测和控制不同情景下未来不同时间段的现金流缺口；公司按照审慎原则确定优质流动性资产规模和构成，保持多层次的充足的优质流动性资产储备，以确保公司在压力情景下能够及时获得充足资金满足流动性需求；公司制定了流动性风险应急计划，定期进行演练和评估，不断提高流动性风险处置能力；公司持续推进流动性管理信息系统建设，自主研发了资金管理平台，以科技赋能公司流动性风险管理。

公司重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持畅通的融资渠道，必要时可通过资金拆借、债券回购、短期融资券、短期公司债、公司债、次级债、收益凭证及其他符合法律及监管规定的方式进行融资，以解决资金需求。

报告期内，公司保持了充足的流动性资产储备，流动性覆盖率和净稳定资金率均符合监管标准及监管预警标准。

#### （5）操作风险

公司开展操作风险基础管理工作的方法主要包括风险与控制自我评估（RCSA）、损失数据收集（LDC）、关键风险指标（KRI）、操作风险状况分析报告等。公司利用风险与控制自我评估（RCSA）工具识别关键风险点和控制措施，并对控制效果进行评估；利用风险日报、操作风险管理系统等方式定期或不定期收集内外部损失数据（风险事件），汇总各类风险事件并进行分析归类、入库整理；制定 22 项公司级关键风险指标（KRI），实现对覆盖经纪、自营、投行、研究、IT、结算及人力资源等关键条线的关键风险因素的后端趋势监测；建立畅通的操作风险报告机制，对于风险与控制自我评估、关键风险指标、操作风险状况分析等实行定期报告制度；将操作风险损失限额分解至各业务条线、分支机构、子公司，并实现系统化限额分配及使用监控；强化子公司操作风险管理覆盖效果，通过宣导与培训，指导各子公司建立适合自身业务种类、规模的操作风险管理体系，促进操作风险管理系统在子公司的落地、推广；结合操作风险管理体系建设要求，不断完善新产品（新业务）评估管理制度，持续加强新业务跟踪管理；风险管理部对各单位报备的操作风险数据进行汇总、分类、分析、评估，并对各单位数据报送情况提出考核意见。

报告期内，公司积极参与行业操作风险管理指引制定及意见反馈，通过线上培训、现场检查、案例分析报告等多种形式宣导全员操作风险防控理念，针对性加强子公司操作风险管理工具应用指导，持续推动操作风险三大基础管理工具、操作风险管理系统在集团层面的落地应用，组织开展操作风险日常管理工作及 RCSA 梳理、操作风险状况分析等年度常规工作，优化操作风险管理工作流程及相关系统流程，通过开展信息技术风险监测机制有效性自查评估等工作持续深化对金融

科技应用外溢风险的关注，公司操作风险得到有效防控。

#### （6）声誉风险

公司落实《证券公司声誉风险管理指引》要求，制定了《公司声誉风险管理办法》《公司突发事件维稳工作应急预案》等制度，遵循全程全员、预防第一、审慎管理、快速响应原则，从风险识别、风险评估、风险控制、风险监测、风险应对和风险报告六个方面对声誉风险进行全方位和全过程管理。

报告期内，公司认真落实声誉风险管理要求，定期汇总自身面临的主要风险以及所包含的风险因素，确定可能影响公司声誉的风险来源，全面、系统、持续地收集和识别相关内外部信息，在经营管理的各领域充分考虑声誉风险并做好事前评估；声誉风险归口管理部门企业文化部设立声誉风险管理岗，每日监测各类媒体的舆情动态，做好声誉风险因素的搜集、整理、分析和舆情研判工作，并督促相关单位采取相应的声誉风险控制措施或手段。对于可能导致公司声誉损失的报道，由相关部门联合采取必要措施予以防范、处理，经评估后纳入公司风险日报。

#### （7）洗钱与恐怖融资风险

公司构建了以公司董事会负责、监事会督导、总部反洗钱工作领导小组统筹领导，合规管理总部组织实施，相关业务部门和分支机构落实执行的反洗钱组织架构体系，严格执行反洗钱法律法规，采取有效措施控制洗钱及恐怖融资风险。公司制定了较为完备的反洗钱制度体系，包括洗钱风险管理基本制度、反洗钱内部控制制度以及其他多项反洗钱专项制度，并在公司全面风险管理、重大事项报告、合规绩效考核、员工违规违纪处罚办法等有关制度中涵盖了反洗钱相关内容。报告期内，公司全面梳理修订了《公司洗钱风险管理基本制度》《公司反洗钱内部控制管理办法》《公司客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存实施细则》《公司大额交易和可疑交易报告实施细则》《公司客户洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理实施细则》《公司反洗钱重点可疑交易报告实施细则》《公司涉及恐怖活动资产冻结实施细则》《公司洗钱风险自评估实施细则》《公司反洗钱工作保密实施细则》等制度，进一步完善了公司反洗钱制度体系。

报告期内，公司根据中国人民银行相关规定，认真履行反洗钱工作职责和相关义务，全面组织开展了洗钱风险自评估工作，研究制定了公司洗钱风险评估体系和标准，对目前开展的各类业务逐一进行了风险评估，持续提升公司洗钱风险管理水平。

### 4、合规风控及信息技术投入

公司重视合规风控投入。报告期内，公司持续优化完善合规风控管理体系，为公司稳健发展奠定良好基础，合规风控方面的投入主要包括：合规风控人员薪酬，合规风控类专业培训，合规风控类相关系统建设，基于提高合规风控能力组织的国内外交流、调研活动，向国内著名咨询机构购买合规风控类咨询服务，组织合规风控类会议、监督检查等方面的日常运营开支等。2021年，母公司在以上方面共投入金额 29,447.40 万元（其中：薪酬支出 22,060.63 万元、系统建设支出 2,826.04 万元、培训支出 17.27 万元、外部咨询支出 364.07 万元、日常支出 4,179.38 万元），占母公司 2021 年度营业收入的 3.26%。

公司投入大量资源提高信息技术水平、优化信息系统，以提供安全、稳定及个性化的服务，保障和支持业务发展。信息技术投入主要包括：基础设施建设，网络规划调整，系统建设与安全管控，扩充研发力量，信息技术人员薪酬，金融科技培训及交流，外部咨询，日常运营支出等。2021 年，母公司信息技术投入总额为 80,793.12 万元（其中：薪酬支出 21,555.83 万元、系统建设支出 30,197.85 万元、培训支出 181.77 万元、外部咨询支出 2,844.24 万元、日常支出 26,013.44 万元），占母公司 2021 年度营业收入的 8.93%（注：信息技术投入不包括风控、合规投入）。

## （五）其他

√适用 □不适用

### 1、业务创新情况及风险控制

报告期内，在证券行业财富管理转型加速推进、注册制发行效率大幅提升、权益衍生品业务兴起的形势下，公司在夯实现有业务的基础上，积极推进业务转型、扎实实施业务创新，前、中、后台等各业务条线均呈现出创新发展全面推进的良好局面。公司深入推进数字化与流程优化，在国内证券公司中首家通过 TMMi3 级国际认证，蜂巢小 R 数字化劳动力平台在中国信息通信研究院组织的 RPA 系统和工具应用成熟度评估中获得开发测试模块 3 级+评级；持续提升 XTP 系统性能，缪斯智能算法推荐系统正式上线；不断丰富齐富通 APP 功能，中签缴款预冻结、打新全生命周期一键查询功能正式上线；成功取得非金融企业债务融资工具主承销商、公募基金投顾业务牌照，业务范围进一步扩大。

公司制定了《公司合规审查与合规咨询管理办法》《公司新产品（新业务）风险评价管理规定》《公司重大事项报告管理办法》《公司风险信息报告管理办法》《公司风险事件处置管理办法》等，界定了新业务、新产品的审查、评价范围、评价标准和报告路径，规定了对新业务、新产品的审查、控制和监督程序，确保了公司新业务、新产品依法合规并在风险可测、可控、可承受范围内有效开展。公司要求所有新业务、新产品“制度先行”，在相关制度中嵌入合规、风控要求；同时要求实施部门对新业务、新产品全面分析风险特征、划分风险等级、提出应对措施，实施部门合规风控管理人员对新业务、新产品申报材料出具明确意见。公司所有新业务、新产品均经合规审查，公司设立产品风险评价决策小组针对新业务、新产品要点、风险等级、客户适当性安排、主要风险点及控制措施进行评估，出具风险评价意见书。在业务开展过程中，由新业务、新产品实施部门具体落实相关意见、采取相关风险防范和控制措施；风险管理部、合规管理总部依据各自职责提供合规风控咨询，监控相关风险因素的变化，跟踪指导相关风险事项处理、报告。发生风险事件时由新业务、新产品实施部门予以处理并报告合规管理总部、风险管理部，纳入公司风险日报，重大事项报监管部门。公司在总结、评估风险管理和合规管理有效性时，涵盖新业务、新产品开展情况，评估报告定期向公司董事会及其风险管理委员会、经理层报告，确保相关风险信息得到及时传递、有效沟通。

### 2、风险控制指标监控体系及资本补足机制

公司根据《证券公司风险控制指标管理办法》等监管要求，建立健全了以净资本和流动性为核心的风险控制指标动态监控机制。公司动态监控系统能够覆盖影响净资本和流动性等风险控制指标的各项业务，逐日准确计量、动态监测、自动预警，生成监管报表；公司按照严于监管预警标准的原则设定公司风险控制指标警告级和严重级监控阈值，并设置了相应的报告路径和应对预案；公司风险管理部门逐日监测各项风险控制指标运行情况，以业务为导向，分析和测试公司净资本配置有效性，强化风险控制指标前瞻性调整意识，及早研判、及时报告和处理风险事项。报告期内，公司不断完善动态监控制度、优化监控流程、升级动态监控系统，确保公司风险控制指标持续符合监管要求。报告期内，公司持续按照《证券公司风险控制指标管理办法》规定程序向监管机构报送风险控制指标监管报表及风险控制指标变化情况报告。

公司建立了净资本动态补足机制。公司做好资本配置和融资安排，当资本充足目标持续下降或存在潜在大幅下降因素时，公司将采取控制和压缩自营投资品种规模、调整自营业务持仓结构、优化资产结构、控制费用支出、变现优质流动性资产、发行长期次级债、增资扩股等方式补充公司净资本，并做好资本补足措施和各项措施的跟踪落实工作。报告期内，公司通过公开发行长期次级债募集资金 70 亿元，有效增强了净资本实力。

公司将压力测试作为风险控制指标事前控制的重要工具，建立了风险控制指标前瞻性调整机制，进一步丰富压力测试情景库，根据监管要求、内部经营管理需要，针对年度经营计划及预算、资产负债配置计划、负债到期情况、重大固定资产投资、限额调整、投行承销项目、对子公司增资等重大事项，采用敏感性分析、情景分析等多种方法，测试压力情景下公司风险控制指标的达标情况及承受能力，提出相关风险管理建议，根据压力测试有关结论及反向压力测试结果，制定合理的资本补充计划或调整资产负债结构，确保公司风险控制指标持续符合监管要求及公司偏好。

### 3、资金需求

2021 年，公司各项业务持续健康有序开展。报告期内，公司完成公开发行四期公司债券，发行规模合计人民币 105 亿元；公开发行两期次级债券，发行规模人民币 70 亿元；公开发行两期短期公司债券，发行规模人民币 60 亿元；公开发行三期短期融资券，发行规模合计人民币 75 亿元（截至 2021 年 12 月 31 日，待偿还余额 25 亿元）。

2022 年，公司将根据业务发展的需要，继续做好负债与流动性管理，科学合理安排负债规模和结构，保持合理稳健的杠杆水平。

### 4、融资渠道和融资能力

公司根据市场环境和自身发展需要，按照法律法规、主管部门有关政策，在证券交易所、全国银行间债券市场、全国银行间同业拆借市场、机构间私募产品报价与服务系统及证券公司柜台市场，通过债券回购、拆借、转融资、发行收益凭证、短期公司债券、证券公司短期融资券等方式，融入短期资金，通过权益融资、发行公司债券、次级债券、永续次级债券、私募债券或其他主管部门批准的方式融入中长期资金。



公司规范经营，信誉良好，具备较强的盈利能力和偿付能力，具有良好的信用记录，建立并持续完善融资策略，积极创新融资方式，不断拓宽融资渠道，提升融资能力。同时，加强同业合作，与各大商业银行保持良好的合作关系，获得多家商业银行综合授信，授信额度 1,500 多亿元。通过融资来源的多元化和稳定程度，使公司的整体流动性状态有效维持在较为安全的水平。

#### 5、维持流动性水平所采取的措施和相关管理政策

公司高度重视流动性管理，坚持流动性、安全性、效益性协调统一的原则，加强资金管理，在经营战略上注重资产、负债的规模与结构管理，在融资规划上注重来源与运用在规模、结构、期限上的匹配。

公司各项业务发展较好，资产质量优良，从根本上保障了公司资产的流动性。日常工作中，公司对各业务条线确定了规模限额和风险限额，对流动性风险控制指标等实行动态监控，确保持续符合监管要求。公司遵纪守法，合规经营，维护良好的金融信用，积极做好融资通道和交易对手的维护与拓展，确保融资渠道的畅通。

公司不断加强流动性风险的管理。一方面，建立了包括流动性风险在内的全面风险管理体系，提高了流动性风险管理的系统性、全面性和准确性。另一方面，不断拓宽融资渠道，成功发行公司债、短期公司债券、次级债、短期融资券、收益凭证等，进一步提高公司防范资金流动性风险的能力。公司可用资金和优质流动性资产储备能够覆盖未来一段时间的资金需求，各项流动性指标均处于安全状态。

#### 6、账户规范情况

报告期内，公司严格落实监管要求，不断完善账户管理系统，有效核实投资者身份信息、充分了解投资者业务办理意愿，做好投资者教育及风险揭示等工作，不断提升公司运营效率、风险控制能力和客户服务水平，有效杜绝新开不规范账户的情形。同时，公司加强了账户管理工作，建立了完善的账户规范管理工作长效机制，对剩余不合格账户、司法冻结账户、剩余风险处置账户、纯资金账户、剩余小额休眠账户等积极实施清理规范。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司不合格账户 721 户，司法冻结账户 22 户，风险处置账户 313,757 户，纯资金账户 187,592 户，休眠账户 645,144 户。

#### 7、募集资金使用情况

经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]736 号文核准，本公司于 2020 年 5 月向社会公开发行人民币普通股（A 股）696,862,576.00 股，每股发行价为 4.38 元，募集资金总额为人民币 3,052,258,082.88 元。扣除各项发行费用后，本次发行募集资金净额为人民币 2,924,280,854.03 元。

截至 2021 年 12 月 31 日，前述向社会公开发行人民币普通股（A 股）募集资金累计已使用人民币 2,925,225,816.05 元，其中以前年度已使用金额为人民币 2,924,280,854.03 元，本年度募集资金使用金额为人民币 944,962.02 元。截至 2021 年 12 月 31 日，本公司向社会公开发行人民币普通股（A 股）募集资金全部使用完毕，募集资金专用账户均已注销。具体内容详见公司 2022 年 3

月 30 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》。

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

公司根据《公司法》《证券法》《证券公司治理准则》《上市公司治理准则》等法律法规和规范性文件的规定，持续完善治理机制，不断加强规范运作，有效提升公司治理水平。公司建立了由股东大会、董事会、监事会和经营管理层组成的健全的法人治理结构，制定了《公司章程》《公司股东大会议事规则》《公司董事会议事规则》《公司监事会议事规则》《公司独立董事工作细则》《公司总经理工作细则》等一系列公司治理的规章制度，并将党建工作有关要求写入章程，形成了权责明确、运转协调、制衡有效的公司治理机制，为公司经营发展提供了保障。

（一）股东和股东大会。股东大会是公司最高权力机构，股东依照法律法规和《公司章程》规定享有权利并承担义务。《公司章程》《公司股东大会议事规则》中规定了股东大会的召集、提案、通知、召开、表决和决议等事项。公司股东大会根据相关法律法规、规范性文件以及《公司章程》《公司股东大会议事规则》的规定规范运作，切实维护公司和股东合法权益。报告期内，公司共召开 4 次股东大会，股东大会的召集和召开程序、表决程序等事项符合《公司法》和《公司章程》的规定。

（二）董事和董事会。董事会对公司股东大会负责，公司董事遵守法律法规及《公司章程》有关规定，忠实、勤勉、审慎履职。《公司章程》《公司董事会议事规则》中规定了董事会会议的召集和主持、召开、记录、决议以及决议的执行等事项。公司董事会按照有关法律法规、规范性文件和《公司章程》《公司董事会议事规则》的规定规范运作，科学决策。报告期内，公司共召开 17 次董事会会议，董事会会议的召集和召开程序、表决程序等事项符合《公司法》和《公司章程》的规定。

公司建立独立董事制度，设独立董事 4 名，包括 1 名会计专业人士。《公司章程》《公司独立董事工作细则》中规定了独立董事的任职、提名、选举、更换以及权利义务等事项。公司独立董事按照有关法律法规、规范性文件和《公司章程》《公司独立董事工作细则》的规定，客观、忠实、勤勉履职。报告期内，独立董事不断加强与公司沟通，了解掌握公司经营情况，积极参加股东大会、董事会及专门委员会会议，独立决策、审慎表决，及时发表独立意见，保护了股东尤其是中小股东的合法权益。

公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会、提名委员会、薪酬与考核委员会和战略与 ESG（环境、社会及治理）委员会 5 个专门委员会，并制定相关工作细则。各专门委员会对董事会负

责，行使《公司章程》规定的职权。专门委员会成员全部由董事组成，专门委员会成员具有相应的专业知识和工作经验。审计委员会、提名委员会、薪酬与考核委员会中的独立董事占 1/2 以上，并由独立董事担任委员会主任；审计委员会中有一名独立董事是会计专业人士，并且从事会计工作 5 年以上。

（三）监事和监事会。监事会对公司股东大会负责，公司监事遵守法律法规及《公司章程》有关规定，忠实、勤勉、审慎履职。公司监事会由 7 名监事组成，其中，职工代表监事 3 人。《公司章程》《公司监事会议事规则》中规定了监事会会议的召集和主持、召开、记录、决议以及决议的执行等事项。公司监事会按照有关法律法规、规范性文件和《公司章程》《公司监事会议事规则》的规定规范运作。报告期内，公司共召开 6 次监事会会议，监事会会议的召集和召开程序、表决程序等事项符合《公司法》和《公司章程》的规定。

（四）高级管理人员。公司设总经理 1 人及副总经理、合规总监、首席风险官、财务负责人、董事会秘书、首席信息官、总法律顾问等高级管理人员。公司高级管理人员的聘任依照有关法律法规和《公司章程》的规定进行。截至 2021 年 12 月 31 日，公司高级管理人员共 10 人。公司高级管理人员遵守相关法律法规、规范性文件和《公司章程》的规定，忠实、勤勉、审慎地履行职责，认真组织实施董事会决议。

（五）信息披露与透明度。公司制定了《信息披露事务管理制度》《重大信息内部报告制度》《内幕信息知情人登记制度》等规章制度，健全信息披露工作机制，加强信息披露事务管理，不断提升公司信息披露工作水平，全年编制披露公告 146 项，提升了公司透明度。

（六）投资者关系管理。公司制定了《投资者关系管理制度》《投资者关系管理工作方案》，完善投资者关系管理工作机制，加强投资者关系管理。积极拓宽沟通渠道，构建了投资者电话、电子邮箱、上交所 e 互动平台、业绩说明会等多层次的沟通体系。全年通过上交所 e 互动平台答复投资者问询 106 次，召开线上业绩说明会 2 次，参加了山东辖区上市公司集体接待日活动，主动传播公司价值，增进了投资者对公司的了解和认同，提升了公司的品牌形象。

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

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	决议刊登的披露	会议决议
------	------	-----------	---------	------

		的查询索引	日期	
2021 年第一次临时股东大会	2021 年 1 月 29 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2021 年 1 月 30 日	详见公司在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年第一次临时股东大会决议公告》
2020 年度股东大会	2021 年 6 月 1 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2021 年 6 月 2 日	详见公司在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2020 年度股东大会决议公告》
2021 年第二次临时股东大会	2021 年 7 月 7 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2021 年 7 月 8 日	详见公司在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年第二次临时股东大会决议公告》
2021 年第三次临时股东大会	2021 年 12 月 22 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2021 年 12 月 23 日	详见公司在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年第三次临时股东大会决议公告》

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4次股东大会，其中年度股东大会1次，临时股东大会3次。具体如下

:

会议届次	召开时间	会议议案	决议情况
2021 年第一次临时股东大会	2021 年 1 月 29 日	1、《关于修订<中泰证券股份有限公司章程>及相关附件的议案》； 2、《关于聘任会计师事务所的议案》； 3、《关于公司发行境内外债务融资工具一般性授权的议案》； 4、《关于制定<公司对外担保管理制度>的议案》； 5、《关于修订<公司对外投资管理制度>的议案》	均通过

2020 年度股东大会	2021 年 6 月 1 日	1、《公司 2020 年度董事会工作报告》； 2、《公司 2020 年度监事会工作报告》； 3、《公司 2020 年年度报告》； 4、《公司 2020 年度财务决算报告》； 5、《公司 2020 年度利润分配方案》； 6、《关于确认 2020 年日常关联交易及预计 2021 年日常关联交易的议案》； 7、《关于续聘会计师事务所的议案》； 8、《关于公司董事 2020 年度考核及薪酬情况的议案》； 9、《关于公司监事 2020 年度考核及薪酬情况的议案》； 10、《关于修订<公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法>的议案》； 11、《关于公司 2021 年度自营投资额度的议案》 听取《公司 2020 年度独立董事述职报告》	均通过
2021 年第二次临时股东大会	2021 年 7 月 7 日	《关于选举公司第二届董事会独立董事的议案》	通过
2021 年第三次临时股东大会	2021 年 12 月 22 日	《关于修订<中泰证券股份有限公司章程>及其附件的议案》	通过

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	年初持股数	年末持股数	年度内股份增减变动量	增减变动原因	报告期内从公司获得的税前报酬总额(万元)	是否在公司关联方获取报酬
李峰	董事长	男	50	2020-12-02	至今	0	0	0	-	75.25	否
冯艺东	董事	男	49	2020-11-23	至今	0	0	0	-	67.18	否
陈肖鸿	董事	男	53	2018-11-19	至今	0	0	0	-	0.00	是
范奎杰	董事	男	58	2008-09-18	至今	0	0	0	-	6.05	是
曹孟博	董事	男	54	2020-01-09	至今	0	0	0	-	0.00	是
刘锋	董事	男	51	2015-06-24	至今	0	0	0	-	6.05	是
张晖	职工董事	女	51	2021-10-29	至今	0	0	0	-	138.11	否
	董事会秘书			2014-09-04	至今						
	副总经理(已离任)			2018-11-20	2021-08-27						
侯祥银(已离任)	职工董事	男	60	2011-12-26	2021-10-29	0	0	0	-	62.70	否
时英(已离任)	独立董事	女	65	2015-06-24	2021-07-07	0	0	0	-	12.65	否
郑伟(已离任)	独立董事	男	48	2015-06-24	2021-07-07	0	0	0	-	12.65	否
陈晓莉(已离任)	独立董事	女	44	2015-06-24	2021-07-07	0	0	0	-	12.65	否

严法善	独立董事	男	70	2021-07-07	至今	0	0	0	-	0.00	否
綦好东	独立董事	男	61	2021-07-07	至今	0	0	0	-	0.00	否
胡希宁	独立董事	男	69	2021-07-07	至今	0	0	0	-	0.00	否
满洪杰	独立董事	男	47	2018-11-19	至今	0	0	0	-	12.65	否
郭永利	监事会主席	男	57	2020-11-23	至今	0	0	0	-	73.34	否
曹灶强	监事	男	36	2018-11-19	至今	0	0	0	-	0.00	否
王思远	监事	男	51	2015-06-24	至今	0	0	0	-	0.00	否
范天云	监事	男	51	2018-11-19	至今	0	0	0	-	0.00	是
安铁	职工监事	男	52	2008-09-18	至今	0	0	0	-	175.51	否
王丽敏	职工监事	女	45	2015-06-24	至今	0	0	0	-	144.62	否
崔建忠	职工监事	男	57	2016-06-29	至今	0	0	0	-	186.49	否
毕玉国	总经理	男	53	2013-12-08	至今	0	0	0	-	192.91	否
孙培国	副总经理	男	55	2007-03-12	至今	0	0	0	-	142.48	否
钟金龙	副总经理	男	56	2011-12-26	至今	0	0	0	-	133.88	否
袁西存	财务总监	男	53	2014-09-04	至今	0	0	0	-	145.37	否
	副总经理			2018-11-20							
胡增永	副总经理	男	49	2021-07-30	至今	0	0	0	-	32.69	否
刘珂滨 (已离任)	副总经理	男	51	2014-10-27	2021-09-10	0	0	0	-	388.03	否
黄永刚 (已离任)	副总经理	男	47	2018-11-20	2021-12-22	0	0	0	-	443.90	否
亓兵	总法律顾问 (已离任)	男	53	2020-08-03	2021-03-30	0	0	0	-	100.35	否
	合规总监				至今						
张勇	首席信息官	男	53	2021-03-30	至今	0	0	0	-	53.81	否

程龙（已 离任）	首席信息 官	男	45	2019-12-31	2021-03-02	0	0	0	-	40.31	否
李恒第 （期后离 任）	首席风险 官	男	57	2016-06-29	2022-01-05	0	0	0	-	112.47	否
张云伟 （期后离 任）	总法律顾 问	男	57	2021-03-30	2022-01-05	0	0	0	-	43.61	否
合计	/	/	/	/	/				/	2,815.70	/

注：1、董事、监事和高级管理人员报告期内从公司获得的税前报酬总额统计口径为其在报告期内担任董监高职务而发放的薪酬，不含公司承担的社保公积金、企业年金和递延薪酬，在公司担任非董监高职务期间领取的薪酬未统计在内。

2、报告期内，公司董事刘锋未直接持有公司股份，间接持有公司股份，具体见本报告“第七节 股份变动及股东情况”相关内容。除此以外，其他董事、监事和高级管理人员未持有公司股份。

3、报告期内，公司董事、监事和高级管理人员未从公司获得非现金薪酬。

4、根据《公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法》，公司独立董事工作补贴分上半年和下半年两次发放。

姓名	主要工作经历
李峰	1971年12月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。曾在山东经济学院、民生银行上海分行工作。历任潍坊经济开发区管委会副主任；潍坊国家高新技术产业开发区管委会副主任；潍坊市委组织部副部长，山东省领导干部考试题库管理中心主任；诸城市委副书记、市长、市委书记，潍坊市政府党组成员；日照市副市长；山东省财政厅党组成员、副厅长。2020年9月至今任公司党委书记，2020年12月至今任公司董事长。
冯艺东	1972年7月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。历任中国证券登记结算公司部门总监；聊城市副市长（挂职）；东营市副市长。现兼任中泰金融国际有限公司董事局主席。2020年11月至今任公司董事。
陈肖鸿	1968年3月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历、教授级高级政工师。曾任莱芜钢铁总厂运输部机修段技术干部、段长助理，莱芜钢铁股份有限公司运输部群众工作部团委副书记、团委青工部干事、副部长、部长，莱钢集团团委副书记、工会生产保护部部长、团委书记、工会副主席，莱芜钢铁集团机械制造有限公司董事长、经理、党委副书记，莱芜钢铁股份有限公司特殊钢厂党委书记、副厂长，莱芜钢铁股份有限公司特钢事业部党委书记、副经理，山东钢铁股份有限公司莱芜分公司特钢事业部党委书记兼副经理、工会副主席，莱芜钢铁集团银山型钢有限公司职工代表监事等职务；现任莱钢集团党委委员、董事，东平铁路有限责任公司副董事长，莱商银行股份有限公司董事，山东钢铁股份有限公司董事。2018年11月至今任公司董事。
范奎杰	1963年3月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，经济师。曾任兖州矿务局机厂办公室副主任，局经济研究室副科长，驻美代



	表；兖州矿业（集团）有限责任公司国际贸易部主任经济师，国际融资办公室副主任，股份制改造与境内外上市办公室专业组组长，国际工程承包办公室主任，海外项目开发办公室副主任，北京银信光华房地产开发有限公司董事、济南阳光壹佰房地产开发有限公司董事；兖矿集团有限公司发展战略研究院副院长，兖矿集团董事局资本运营委员会专务委员兼兖矿集团（香港）有限公司董事总经理，兖矿集团副总经济师兼董事会决策咨询中心（北京）主任，上海金谷裕丰投资有限公司（后更名为兖矿资本管理有限公司）董事长；中国国际期货经纪有限公司监事长，盘江煤电有限责任公司监事会召集人，中国经济景气监测中心咨询委员会委员、中国政策研究会经济委员会委员等职务；现任山东能源集团有限公司顾问，北京银信光华房地产开发有限公司董事长，华泰保险集团股份有限公司董事，北京西郊宾馆有限责任公司董事，北京阳光壹佰优客工场创业投资有限公司董事。2008 年 9 月至今任公司董事。
曹孟博	1967 年 10 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历。曾任济钢集团财务处科员、科长、处长助理，山东钢铁股份有限公司济南分公司财务部部长，山钢股份财务部部长，济钢集团财务部部长等职务；现任济钢集团党委委员、董事等职务。2020 年 1 月至今任公司董事。
刘锋	1970 年 10 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历。曾任莱芜钢铁总厂办公室秘书，山东巾帼实业有限公司秘书，山东锋通经贸有限公司经理、山东永锋国际贸易有限公司执行董事等职务；现任永锋集团有限公司执行董事兼总经理，永通（香港）实业有限公司董事，永通兴业发展有限公司董事，德州银行股份有限公司董事，山东创诚实业有限公司监事，永锋集团（上海）有限公司执行董事等职务。2015 年 6 月至今任公司董事。
张晖	1970 年 11 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，经济师。曾任山东省国际信托投资公司上海证券业务部交易部经理、副总经理、总经理，公司总经理助理、纪委副书记、工会副主席、信访办公室主任、党务工作部部长、企业文化部总经理等职务；现任公司党委委员、工会主席，兼任中泰证券（上海）资产管理有限公司董事等职务。2018 年 11 月至 2021 年 8 月任公司副总经理，2021 年 10 月至今任公司职工董事，2014 年 9 月至今任公司董事会秘书。
严法善	1951 年 12 月生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，博士研究生。现任复旦大学教授、博士生导师，兼任中泛控股有限公司独立董事，中国民生信托有限公司独立董事，泛海控股股份有限公司独立董事。2021 年 7 月至今任公司独立董事。
綦好东	1960 年 11 月生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，博士研究生。曾任山东财经大学教授、副校长；现任山东财经大学教授，兼任山东海化股份有限公司独立董事，山东鲁抗医药股份有限公司独立董事，山东泰和水处理科技股份有限公司独立董事。2021 年 7 月至今任公司独立董事。
胡希宁	1952 年 4 月生，中国国籍，无永久境外居留权，中共党员，学士学位。原中共中央党校经济学教授、博士生导师；曾任吉林省白城地区通榆师范学校教师、中国科学院院部管理学筹备组管理人员。2021 年 7 月至今任公司独立董事。
满洪杰	1974 年 10 月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。曾任济南市中级人民法院助理审判员、山东大学法学院院长助理等职务；现任山东大学法学院教授、博士生导师、副院长，山东睿扬律师事务所兼职律师。2018 年 11 月至今任公司独立董事。
郭永利	1964 年 7 月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。历任莱芜市副市长；山东省金融工作办公室副主任；泰山财产保险股份有限公司党委书记、董事长；山东农村信用社联合社党委副书记、主任。2020 年 9 月至今任公司党委副书记，2020 年 11 月至今任公司监事会主席。
曹灶强	1985 年 10 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历，高级会计师。曾任山东新巨龙能源有限责任公司财务部科员、主任会计师、

	副主任，新矿集团财务部科员等职务；现任新矿集团财务部副部长。2018 年 11 月至今任公司监事。
王思远	1970 年 11 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，高级经济师。曾任山东省国际信托投资公司能源交通部及基金部业务经理，山东省社会保险事业局基金稽核处科长，山东省失业人员再就业贷款担保中心副主任、山东省国际信托股份有限公司基础设施部总经理等职务；现任新华（山东）房地产交易中心有限公司监事等职务。2015 年 6 月至今任公司监事。
范天云	1970 年 12 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，正高级会计师，中国注册会计师，国际注册内部审计师。曾任济南供水集团有限公司计财处副处长、财务部部长，济南水业集团有限公司财务部部长，济南市小清河开发建设投融资管理中心总会计师，济南滨河新区建设投资集团有限公司总会计师等职务；现任济南城市建设集团有限公司总会计师、董事，济南市小清河开发建设投资有限公司董事，济南滨河文化发展有限公司董事长，济南市小清河资产运营有限公司监事，济南国际机场建设有限公司董事、副总经理、财务总监，济南西城投资开发集团有限公司董事、济南滨河新区建设投资集团有限公司董事等职务。2018 年 11 月至今任公司监事。
安铁	1969 年 9 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，会计师。曾任山东省齐鲁信托投资股份有限公司信托部科长、证券清算部经理，公司济南石棚街、北坦南街营业部总经理，公司审计稽核部总经理等职务；现任公司合规管理总部总经理，兼任鲁证期货股份有限公司监事会主席。2008 年 9 月至今任公司职工代表监事。
王丽敏	1976 年 6 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，高级会计师，中国注册会计师、美国注册管理会计师。曾任山东省齐鲁信托投资有限公司财务部业务经理，公司计划财务部高级业务经理、副总经理、机构业务部总经理、业务协同部总经理、审计稽核部总经理等职务；现任公司监事会办公室主任，兼任中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司监事会主席。2015 年 6 月至今任公司职工代表监事。
崔建忠	1964 年 9 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历，高级经济师。曾任山东省青年管理干部学院、山东省青少年研究所编辑部主任，山东省人民政府办公厅综合文秘（借调），天同证券有限责任公司福州湖东路营业部副总经理、办公室副主任、济宁古槐路营业部总经理，公司济宁中心营业部总经理、济宁古槐路营业部总经理、济宁管理总部总经理、济宁管理总部党委书记、济宁业务总部总经理、济宁业务总部党委书记、济宁协作中心主任、济宁协作中心党委书记、济宁分公司总经理、济宁分公司党委书记，公司总经理助理、纪委副书记、直属党委书记、党务工作部部长、纪检监察室主任、党群工作部部长、扶贫办主任等职务；现任公司党委委员。2016 年 6 月至今任公司职工代表监事。
毕玉国	1968 年 8 月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生，正高级会计师。曾任莱芜钢铁股份有限公司炼铁厂财务科科长、财务处成本科科长，日照钢铁有限公司财务总监，莱钢集团财务部副部长，公司计划财务部总经理、公司副总经理、财务负责人、党委副书记等职务；现任公司党委委员，2013 年 12 月至今任公司总经理。
孙培国	1966 年 4 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，高级经济师。曾任中国济南化纤总公司干部，济南市体改委主任科员，山东证监局上市公司监管处处长、期货监管处处长，公司投资银行总部总经理、证券投资部总经理、合规总监、总法律顾问等职务。现任公司党委委员。2007 年 3 月至今任公司副总经理。
钟金龙	1965 年 3 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，工程师。曾任山东省电力局电力试验研究所系统室工程师、深圳核电工程公司工程师，山东省国际信托投资公司办公室主任，民生证券股份有限公司（原黄河证券有限公司）副总经理、总经理，公司合规管理总部总经理、合规总监等职务；现兼任鲁证期货股份有限公司党委书记、董事长。2011 年 12 月至今任公司副总经理。

袁西存	1968 年 8 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，正高级会计师。曾任莱钢集团财务处科长、副处长，公司纪委委员、资金管理总部总经理、计划财务总部总经理等职务；现兼任万家基金管理有限公司董事，中泰金融国际有限公司董事，齐鲁中泰物业有限公司董事长等职务。2014 年 9 月至今任公司财务总监，2018 年 11 月至今任公司副总经理。
胡增永	1972 年 1 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，高级经济师。曾任济南第二市政工程公司统计师、山东证券有限责任公司人力资源管理总部经理助理，天同证券有限责任公司聊城柳园南路证券营业部总经理、人力资源总部副总经理、副总经理（主持工作），公司总经理助理、纪委委员、人力资源部副总经理、总经理、党委组织部副部长、部长、党委办公室主任、综合办公室主任等职务，现兼任中泰金融国际有限公司董事。2021 年 7 月至今任公司副总经理。
亓兵	1968 年 10 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历，高级经济师。曾任中国重汽集团公司物资供应部员工，山东省证券管理办公室上市组干部，济南证券监管办公室历任上市处干部、稽查处科员、副主任科员，党委办公室、纪检监察办公室主任科员，山东证监局办公室（党办）主任科员、办公室副主任、稽查二处副处长，党务工作办公室、纪检监察办公室副主任（主持工作）、主任，稽查一处处长、机构监管处处长等职务。2020 年 8 月至 2021 年 3 月任公司总法律顾问，2020 年 8 月至今任公司合规总监。
张勇	1968 年 12 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，工程师。曾任山东证券有限责任公司工程部员工、机构电脑部副经理、电脑部副经理（主持工作），天同证券有限责任公司经纪业务总部副总经理、电脑总部总经理，公司信息技术总部总经理、金融科技委员会副主任、信息技术管理部总经理等职务。2021 年 3 月至今任公司首席信息官。
侯祥银（已离任）	1961 年 9 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，高级经济师。曾任莱芜钢铁总厂调研室科长，莱芜钢铁股份有限公司董事会秘书室副主任、综合业务处副处长、证券部副主任、董事会审计委员会办公室主任、监事会办公室主任，莱芜钢铁集团银山型钢有限公司综合业务处副处长，公司董事会秘书、党委常委、党委委员、工会主席等职务。2011 年 12 月至 2021 年 10 月任公司职工董事。
时英（已离任）	1956 年 11 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历。曾任山东财经大学（原山东经济学院）国际经贸学院讲师、副教授、教授、院长等职务。2015 年 6 月至 2021 年 7 月任公司独立董事。
郑伟（已离任）	1973 年 4 月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。曾任山东财经大学会计学院讲师、副教授、财务会计系主任等职务；现任山东财经大学会计学院教授，中国会计学会金融会计专业委员会委员。2015 年 6 月至 2021 年 7 月任公司独立董事。
陈晓莉（已离任）	1977 年 6 月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。曾任山东大学经济学院金融系讲师、副教授、副主任，中国社科院世界经济与政治研究所博士后，美国巴尔的摩大学访问学者，澳大利亚昆士兰大学访问学者，美国加州大学伯克利分校访问学者；现任山东大学经济学院金融学系教授、博士研究生导师，齐鲁银行股份有限公司外部监事，山东鑫创元通信科技有限公司监事，济南嘉源电子有限公司董事。2015 年 6 月至 2021 年 7 月任公司独立董事。
程龙（已离任）	1976 年 3 月生，中国国籍，无永久境外居留权，博士研究生。曾任国际商业机器有限公司中国研究院高级研究员，中信证券股份有限公司信息技术部总监，东兴证券股份有限公司首席信息官，公司信息技术总部首席信息官、金融科技委员会首席信息官、公司金融科技委员会主任、财富管理委员会副主任、网络金融部总经理等职务。2019 年 12 月至 2021 年 3 月任公司首席信息官。
刘珂滨（离任）	1970 年 2 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士研究生。曾任航天部二院四部助理工程师，香港和成系统有限公司经理，厦门国际信托投资公司北京营业部部门经理，中信证券股份有限公司投行委员会交通组行政负责人、企业融资业务线行政负责人、投行委员会基础设施及房地产组行政负责人、投行委员会委员，公司投资银行业务委员会主任等职务。2014 年 10 月至 2021 年 9 月任公司副总经理。

黄永刚（离任）	1974 年 7 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位。曾任中国电子科技集团第三研究所财务处职员，中国投资咨询公司资产评估部职员，中信证券股份有限公司投行委债务资本市场部负责人、计划财务部负责人，招商证券股份有限公司固定收益总部总经理，公司自营业务委员会主任等职务；现任公司金融市场委员会主任。2018 年 11 月至 2021 年 12 月任公司副总经理。
李恒第（期后离任）	1964 年 1 月生，中国国籍，无永久境外居留权，大学学历，高级会计师。曾任山东省炼化化工总公司计划财务科科长，天同证券有限责任公司计划财务总部副总经理，鲁银投资股份有限公司财务部总经理，公司计划财务总部副总经理、风险控制部总经理、风控合规总部总经理、风险管理部总经理、职工监事等职务。2016 年 6 月至 2022 年 1 月任公司首席风险官。
张云伟（期后离任）	1964 年 10 月生，中国国籍，无永久境外居留权，硕士学位，高级经济师。曾任山东省地质矿产局测绘队办公室副主任、主任，山东省地质测绘院办公室主任、政治处副主任、纪委副书记，齐鲁信托投资公司办公室副主任，公司办公室副主任、法律事务部总经理、办公室（董事会办公室）主任、党委常委、纪委书记。2020 年 8 月至今任公司党委委员。2021 年 3 月至 2022 年 1 月任公司总法律顾问。

## 其它情况说明

√适用 □不适用

公司第二届董事会、监事会任期于 2021 年 11 月 18 日届满。鉴于公司董事会、监事会换届工作尚在筹备中，为保证公司董事会、监事会工作的连续性，公司董事会、监事会延期进行换届。在换届选举工作完成前，公司第二届董事会、监事会成员，董事会各专门委员会委员及高级管理人员，依照相关法律、法规、规范性文件和《公司章程》的规定继续履行相应职责。具体内容详见公司 2021 年 11 月 17 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于公司董事会、监事会延期换届的提示性公告》。截至本报告披露日，换届工作仍在筹备中。

**(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
陈肖鸿	莱芜钢铁集团有限公司	董事	2017.04	/
曹灶强	新汶矿业集团有限责任公司	财务部副部长	2021.09	/
范奎杰	山东能源集团有限公司	顾问	2020.08	/
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
冯艺东	中泰金融国际有限公司	董事局主席	2021.02	/
陈肖鸿	东平铁路有限责任公司	副董事长	2018.11	/
	莱商银行股份有限公司	董事	2019.10	/
	山东钢铁股份有限公司	董事	2021.04	/
范奎杰	北京银信光华房地产开发有限公司	董事长	2017.11	/
	华泰保险集团股份有限公司	董事	2008.04	/
	北京西郊宾馆有限责任公司	董事	2002.09	/
	北京阳光壹佰优客工场创业投资有限公司	董事	2017.04	/
	上海金谷裕丰投资有限公司（已更名为兖矿资本管理有限公司）	董事长	2015.07	2021.08
曹孟博	济钢集团有限公司	董事	2021.12	/
刘锋	山东钢铁集团永锋淄博有限公司	董事长	2016.10	2021.09
	上海鲁证锋通经贸有限公司	董事长	2017.04	2021.10
	永锋集团有限公司	执行董事兼总经理	2002.08	/
	永通（香港）实业有限公司	董事	2012.04	/
	永通兴业发展有限公司	董事	2008.08	/

	德州银行股份有限公司	董事	2004.12	/
	山东创诚实业有限公司	监事	2015.05	/
	永锋集团（上海）有限公司	执行董事	2021.09	/
张晖	中泰证券（上海）资产管理有限公司	董事	2016.04	/
满洪杰	山东大学	法学院教授、副院长	2019.09	/
	山东睿扬律师事务所	兼职律师	2010.05	/
严法善	复旦大学	教授	2003.12	
	中泛控股有限公司	独立董事	2014.11	/
	中国民生信托有限公司	独立董事	2019.08	/
	泛海控股股份有限公司	独立董事	2021.07	/
	鹏起科技发展股份有限公司	独立董事	2017.10	2021.09
綦好东	山东财经大学	教授	2011.07	/
	山东海化股份有限公司	独立董事	2021.01	/
	山东鲁抗医药股份有限公司	独立董事	2021.05	/
	山东泰和水处理科技股份有限公司	独立董事	2021.06	/
王思远	新华（山东）房地产交易中心有限公司	监事	2011.06	/
范天云	济南城市建设集团有限公司	总会计师、董事	2017.06	/
	济南市小清河开发建设投资有限公司	董事	2007.09	/
	济南滨河文化发展有限公司	董事长	2018.03	/
	济南国际机场建设有限公司	董事、副总经理、财务总监	2020.02	/
	济南西城投资开发集团有限公司	董事	2019.11	/
	济南市小清河资产运营有限公司	监事	2010.01	/
	济南滨河新区建设投资集团有限公司	董事	2019.11	/
安铁	鲁证期货股份有限公司	监事会主席	2020.11	/
王丽敏	中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司	监事会主席	2017.08	/
	中泰证券（上海）资产管理有限公司	董事	2014.09	2021.04
钟金龙	鲁证期货股份有限公司	董事长	2019.12	/

	司			
袁西存	万家基金管理有限公司	董事	2015.07	/
	中泰金融国际有限公司	董事	2014.10	/
	齐鲁中泰物业有限公司	董事长	2018.08	/
胡增永	中泰金融国际有限公司	董事	2019.09	/
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	股东大会负责审议确定《公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法》和薪酬考核方案；董事会负责审议确定《公司高级管理人员薪酬管理与绩效考核办法》和薪酬考核方案。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	《公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法》《公司高级管理人员薪酬管理与绩效考核办法》
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	详见本报告“第四节 公司治理 四、董事、监事、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”
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	2,815.70 万元

### (四)公司董事、监事、高级管理人员变动情况

√适用 □不适用

姓名	担任的职务	变动情形	变动原因
程龙	首席信息官	离任	个人原因辞职
张勇	首席信息官	聘任	董事会聘任
亓兵	总法律顾问	解聘	董事会解聘
张云伟（期后离任）	总法律顾问	聘任	董事会聘任
时英	独立董事	离任	独立董事任期届满
郑伟	独立董事	离任	独立董事任期届满
陈晓莉	独立董事	离任	独立董事任期届满
严法善	独立董事	选举	董事会提名、股东大会选举
胡希宁	独立董事	选举	董事会提名、股东大会选举
綦好东	独立董事	选举	董事会提名、股东大会选举
胡增永	副总经理	聘任	董事会聘任
张晖	副总经理	离任	工作变动原因辞职
刘珂滨	副总经理	离任	个人原因辞职
侯祥银	职工董事	离任	达到法定退休年龄离任

张晖	职工董事	选举	职工代表大会选举
黄永刚	副总经理	离任	个人原因辞职
张云伟（期后离任）	总法律顾问	离任	个人原因辞职
李恒第（期后离任）	首席风险官	离任	个人原因辞职
胡开南（期后聘任）	首席风险官	聘任	董事会聘任

变动说明：

#### 1、董事变更情况

因时英女士、郑伟先生、陈晓莉女士于 2021 年 6 月 23 日任职满 6 年，2021 年 6 月 21 日，公司第二届董事会第四十五次会议提名严法善先生、胡希宁先生、綦好东先生为公司第二届董事会独立董事候选人，具体内容详见公司于 2021 年 6 月 22 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第四十五次会议决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于独立董事任职期满继续履职的公告》。2021 年 7 月 7 日，公司 2021 年第二次临时股东大会选举严法善先生、胡希宁先生、綦好东先生为公司第二届董事会独立董事。具体内容详见公司于 2021 年 7 月 8 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年第二次临时股东大会决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于独立董事任职的公告》。

因侯祥银先生达到法定退休年龄辞任公司职工董事，公司召开第二届职工代表大会第三十次会议，选举张晖女士为公司第二届董事会职工董事。具体内容详见公司于 2021 年 11 月 2 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于变更职工董事的公告》。

#### 2、高级管理人员变更情况

程龙先生因个人原因，向董事会申请辞去公司首席信息官职务。具体内容详见公司于 2021 年 3 月 3 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于首席信息官辞职的公告》。

2021 年 3 月 30 日，公司第二届董事会第四十次会议聘任张勇先生为公司首席信息官、张云伟先生为公司总法律顾问，亓兵先生不再担任公司总法律顾问。具体内容详见公司于 2021 年 3 月 31 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第四十次会议决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于首席信息官、总法律顾问任职的公告》。

2021 年 7 月 30 日，公司第二届董事会第四十七次会议聘任胡增永先生为公司副总经理。具体内容详见公司 2021 年 7 月 31 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第四十七次会议决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于副总经理任职的公告》。

张晖女士因工作变动原因，向董事会申请辞去公司副总经理职务，辞任副总经理后仍担任董事会秘书职务。具体内容详见公司 2021 年 8 月 28 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于副总经理辞职的公告》。

刘珂滨先生因个人原因，向董事会申请辞去公司副总经理职务，具体内容详见公司 2021 年 9 月 11 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于副总经理辞职的公告》。



黄永刚先生因个人原因，向董事会申请辞去公司副总经理职务，辞任副总经理后仍担任公司金融市场委员会主任职务。具体内容详见公司 2021 年 12 月 23 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于副总经理辞职的公告》。

### 3、资产负债表日后高级管理人员变更情况

公司首席风险官李恒第先生因个人原因申请辞去首席风险官职务，按照《公司章程》规定，首席风险官提出辞职需经董事会批准。2022年1月5日，公司召开第二届董事会第五十三次会议，同意李恒第先生辞去公司首席风险官职务；根据公司经营需要，聘任胡开南先生为公司首席风险官，任期自本次董事会审议通过之日起至公司第二届董事会换届完成之日止。具体内容详见公司 2022 年 1 月 6 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第五十三次会议决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于首席风险官变更的公告》。

张云伟先生因个人原因，申请辞去公司总法律顾问职务。具体内容详见公司 2022 年 1 月 6 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于总法律顾问辞职的公告》。

## (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，严法善先生在担任\*ST 鹏起独立董事期间受到上交所通报批评。

## (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
第二届董事会第三十六次会议	2021 年 1 月 13 日	1、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司章程>及相关附件的议案》； 2、审议通过了《关于调整公司第二届董事会专门委员会成员的议案》； 3、审议通过了《关于聘任会计师事务所的议案》； 4、审议通过了《关于公司与齐鲁股权交易中心有限公司订立收益凭证产品认购协议暨日常关联交易的议案》
第二届董事会第三十七次会议	2021 年 2 月 8 日	审议通过了《关于公司设立战略客户部、督查室的议案》
第二届董事会第三十八次会议	2021 年 3 月 1 日	1、审议通过了《关于公司组织架构调整的议案》； 2、审议通过了《关于制定<公司内部控制基本制度>的议案》
第二届董事会第三十九次会议	2021 年 3 月 22 日	1、审议通过了《关于维持公司自营权益类证券及其衍生品、自营非权益类证券及其衍生品和融资类业务规模上限的议案》； 2、审议通过了《关于购置上海绿地外滩中心办公楼的议案》
第二届董事会第四十次会议	2021 年 3 月 30 日	1、审议通过了《关于聘任公司首席信息官的议案》； 2、审议通过了《关于聘任公司总法律顾问的议案》； 3、审议通过了《关于授权公司经营管理层办理分支机构相关事宜的议案》
第二届董事会第	2021 年 4 月	1、审议通过了《公司董事会战略委员会 2020 年度履职情况报

四十一次会议	20 日	<p>告》；</p> <p>2、审议通过了《公司董事会风险管理委员会 2020 年度履职情况报告》；</p> <p>3、审议通过了《公司董事会提名委员会 2020 年度履职情况报告》；</p> <p>4、审议通过了《公司董事会薪酬与考核委员会 2020 年度履职情况报告》；</p> <p>5、审议通过了《公司 2020 年度反洗钱工作报告》；</p> <p>6、审议通过了《公司 2020 年度全面风险管理报告》；</p> <p>7、审议通过了《关于维持公司总体风险偏好量化指标的议案》；</p> <p>8、审议通过了《关于制定&lt;公司内部控制评价办法&gt;的议案》；</p> <p>9、审议通过了《关于修订&lt;公司董事会秘书工作细则&gt;的议案》；</p> <p>10、审议通过了《关于制定&lt;公司重大信息内部报告制度&gt;的议案》；</p> <p>11、审议通过了《关于修订&lt;公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法&gt;的议案》；</p> <p>12、审议通过了《关于公司廉洁从业管理目标的议案》</p>
第二届董事会第四十二次会议	2021 年 4 月 22 日	<p>1、审议通过了《公司 2020 年度董事会工作报告》；</p> <p>2、审议通过了《公司 2020 年度总经理工作报告》；</p> <p>3、审议通过了《公司 2020 年年度报告》；</p> <p>4、审议通过了《公司 2020 年度财务决算报告》；</p> <p>5、审议通过了《公司 2020 年度利润分配预案》；</p> <p>6、审议通过了《公司关于 2020 年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》；</p> <p>7、审议通过了《关于计提资产减值准备的议案》；</p> <p>8、审议通过了《关于变更会计政策的议案》；</p> <p>9、审议通过了《关于确认 2020 年日常关联交易及预计 2021 年日常关联交易的议案》；</p> <p>10、审议通过了《关于续聘会计师事务所的议案》；</p> <p>11、审议通过了《关于公司董事 2020 年度考核及薪酬情况的议案》；</p> <p>12、审议通过了《关于公司高级管理人员 2020 年度考核及薪酬情况的议案》；</p> <p>13、审议通过了《公司 2020 年度独立董事述职报告》；</p> <p>14、审议通过了《公司董事会审计委员会 2020 年度履职情况报告》；</p> <p>15、审议通过了《公司 2020 年度内部控制评价报告》；</p> <p>16、审议通过了《公司 2020 年度社会责任报告》；</p> <p>17、审议通过了《公司 2020 年度合规报告》；</p> <p>18、审议通过了《公司 2020 年度净资本等风险控制指标有关情况的报告》；</p> <p>19、审议通过了《关于公司 2021 年度自营投资额度的议案》；</p> <p>20、审议通过了《关于召开公司 2020 年度股东大会的议案》</p>
第二届董事会第四十三次会议	2021 年 4 月 28 日	审议通过了《公司 2021 年第一季度报告》
第二届董事会第四十四次会议	2021 年 5 月 27 日	审议通过了《关于制定<公司总经理办公会议事规则>及<公司总经理办公会议事清单>的议案》
第二届董事会第四十五次会议	2021 年 6 月 21 日	<p>1、审议通过了《关于提名公司第二届董事会独立董事候选人的议案》；</p> <p>2、审议通过了《关于召开公司 2021 年第二次临时股东大会的</p>

		议案》
第二届董事会第四十六次会议	2021年7月6日	审议通过了《关于对全资子公司中泰创业投资（深圳）有限公司增资的议案》
第二届董事会第四十七次会议	2021年7月30日	1、审议通过了《关于调整公司第二届董事会专门委员会成员的议案》； 2、审议通过了《关于聘任公司副总经理的议案》
第二届董事会第四十八次会议	2021年8月16日	1、审议通过了《关于制定<中泰证券股份有限公司“十四五”规划>的议案》； 2、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司内部审计制度>的议案》； 3、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司洗钱风险管理基本制度>的议案》； 4、审议通过了《关于公司试点开展公募基金投资顾问业务的议案》
第二届董事会第四十九次会议	2021年8月27日	1、审议通过了《公司2021年半年度报告》； 2、审议通过了《公司关于2021年上半年募集资金存放与实际使用情况的专项报告》； 3、审议通过了《公司2021年上半年风险控制指标有关情况的报告》
第二届董事会第五十次会议	2021年10月28日	1、审议通过了《公司2021年第三季度报告》； 2、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司章程>及相关附件的议案》； 3、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司募集资金管理办法>的议案》； 4、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司信息披露事务管理制度>的议案》； 5、审议通过了《关于制定<中泰证券股份有限公司董事会向经理层授权及总经理向董事会报告工作制度>的议案》； 6、审议通过了《关于召开公司2021年第三次临时股东大会的议案》
第二届董事会第五十一次会议	2021年11月16日	1、审议通过了《关于公司第二届董事会延期换届的议案》； 2、审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司董事会战略委员会工作细则>的议案》； 3、审议通过了《关于选举公司第二届董事会风险管理委员会成员的议案》
第二届董事会第五十二次会议	2021年12月21日	1、审议通过了《关于制订<中泰证券股份有限公司“十四五”金融科技发展规划>的议案》； 2、审议通过了《公司2020年度信息技术管理工作报告》

报告期内，公司共召开 17 次董事会会议，除依法回避表决的情况外，公司董事对董事会所审议议案均投同意票，无弃权或反对情形。

## 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

李峰	否	17	17	14	0	0	否	3
冯艺东	否	17	17	14	0	0	否	4
陈肖鸿	否	17	17	14	0	0	否	2
范奎杰	否	17	17	14	0	0	否	4
曹孟博	否	17	16	15	1	0	否	4
刘锋	否	17	16	14	1	0	否	3
张晖	否	2	2	2	0	0	否	1
侯祥银 (已离任)	否	15	15	12	0	0	否	2
严法善	是	6	6	5	0	0	否	1
胡希宁	是	6	6	4	0	0	否	1
綦好东	是	6	6	4	0	0	否	1
时英(已离任)	是	11	11	10	0	0	否	3
郑伟(已离任)	是	11	11	10	0	0	否	3
陈晓莉 (已离任)	是	11	11	10	0	0	否	3
满洪杰	是	17	17	15	0	0	否	4

注：严法善、胡希宁、綦好东于 2021 年 7 月 7 日担任公司独立董事，出席董事会会议 6 次；张晖于 2021 年 10 月 29 日担任公司职工董事，出席董事会会议 2 次；时英、郑伟、陈晓莉自 2021 年 7 月 7 日起不再担任公司独立董事，出席董事会会议 11 次；侯祥银自 2021 年 10 月 29 日起不再担任公司职工董事，出席董事会会议 15 次。

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	17
其中：现场会议次数	0
通讯方式召开会议次数	14
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

报告期内，公司董事按照《公司法》《证券公司治理准则》《上市公司治理准则》等法律法规、规范性文件及《公司章程》规定，认真履行职责，未对公司有关事项提出异议。

## (三)其他

适用 不适用

**公司董事履行职责情况。**报告期内，公司董事按照《公司法》《证券法》等法律法规、规范性文件及《公司章程》的规定，勤勉尽责、忠实履职。积极出席股东大会、董事会和董事会各专门委员会会议，认真审阅会议材料，审慎发表意见，不断提高董事会决策效率；对公司总部及分支机构开展调研，加强对公司情况的了解；积极参加各类培训，及时掌握最新监管规定和证券知识，不断提升履职能力。

**公司独立董事履行职责情况。**报告期内，公司独立董事按照《公司法》《证券法》《上市公司独立董事规则》等法律法规、规范性文件及《公司章程》的规定，客观、独立履行职责，维护了公司股东、特别是中小股东的合法权益。具体内容详见公司 2022 年 3 月 30 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年度独立董事述职报告》。

## 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
风险管理委员会	李峰（主任）、冯艺东、张晖、綦好东、满洪杰
审计委员会	綦好东（主任）、冯艺东、曹孟博、严法善、满洪杰
提名委员会	胡希宁（主任）、李峰、冯艺东、严法善、满洪杰
薪酬与考核委员会	严法善（主任）、李峰、冯艺东、胡希宁、满洪杰
战略与 ESG（环境、社会及治理）委员会	李峰（主任）、冯艺东、陈肖鸿、范奎杰、刘锋

2021 年 1 月 13 日，第二届董事会第三十六次会议审议通过了《关于调整公司第二届董事会专门委员会成员的议案》。调整后董事会各专门委员会成员名单如下：

董事会风险管理委员会：李峰（主任）、冯艺东、侯祥银、满洪杰、郑伟；

董事会审计委员会：郑伟（主任）、冯艺东、曹孟博、时英、满洪杰；

董事会提名委员会：陈晓莉（主任）、李峰、冯艺东、满洪杰、郑伟；

董事会薪酬与考核委员会：陈晓莉（主任）、李峰、冯艺东、时英、满洪杰；

董事会战略委员会：李峰（主任）、冯艺东、陈肖鸿、范奎杰、刘锋。

2021 年 7 月 30 日，第二届董事会第四十七次会议审议通过了《关于调整公司第二届董事会专门委员会成员的议案》。调整后董事会各专门委员会成员名单如下：

董事会风险管理委员会：李峰（主任）、冯艺东、侯祥银、綦好东、满洪杰；

董事会审计委员会：綦好东（主任）、冯艺东、曹孟博、严法善、满洪杰；

董事会提名委员会：胡希宁（主任）、李峰、冯艺东、严法善、满洪杰；

董事会薪酬与考核委员会：严法善（主任）、李峰、冯艺东、胡希宁、满洪杰；

董事会战略委员会：李峰（主任）、冯艺东、陈肖鸿、范奎杰、刘锋。

2021 年 11 月 16 日，第二届董事会第五十一次会议审议通过了《关于选举公司第二届董事会风险管理委员会成员的议案》。选举后董事会风险管理委员会成员名单如下：

董事会风险管理委员会：李峰（主任）、冯艺东、张晖、綦好东、满洪杰。

2021 年 12 月 22 日，经公司 2021 年第三次临时股东大会审议，公司对《公司章程》进行了修订，将董事会战略委员会更名为董事会战略与 ESG（环境、社会及治理）委员会。

### (2). 报告期内董事会战略与 ESG（环境、社会及治理）委员会召开 5 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15日	第二届董事会战略委员会第五次会议审议通过了《关于购置上海绿地外滩中心办公楼的议案》	同意将《关于购置上海绿地外滩中心办公楼的议案》提交董事会审议。	
2021年4月9日	第二届董事会战略委员会第六次会议审议通过了《公司董事会战略委员会2020年度履职情况报告》	同意将《公司董事会战略委员会2020年度履职情况报告》提交董事会审议。	
2021年7月2日	第二届董事会战略委员会第七次会议审议通过了《关于对全资子公司中泰创业投资（深圳）有限公司增资的议案》	同意将《关于对全资子公司中泰创业投资（深圳）有限公司增资的议案》提交董事会审议。	
2021年8月13日	第二届董事会战略委员会第八次会议审议通过了《关于制定<中泰证券股份有限公司“十四五”规划>的议案》	同意将《关于制定<中泰证券股份有限公司“十四五”规划>的议案》提交董事会审议。	
2021年12月14日	第二届董事会战略委员会第九次会议审议通过了《关于制订<中泰证券股份有限公司“十四五”金融科技发展规划>的议案》	同意将《关于制订<中泰证券股份有限公司“十四五”金融科技发展规划>的议案》提交董事会审议。	

注：2021年12月22日，公司董事会战略委员会更名为董事会战略与ESG（环境、社会及治理）委员会。

### (3). 报告期内董事会薪酬与考核委员会召开1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4月12日	第二届董事会薪酬与考核委员会第八次会议审议通过了《公司董事会薪酬与考核委员会2020年度履职情况报告》《关于修订<公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法>的议案》《关于公司董事2020年度考核及薪酬情况的议案》《关于公司高级管理人员2020年度考核及薪酬情况的议案》	同意将《公司董事会薪酬与考核委员会2020年度履职情况报告》《关于修订<公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法>的议案》《关于公司董事2020年度考核及薪酬情况的议案》《关于公司高级管理人员2020年度考核及薪酬情况的议案》提交董事会审议。	

### (4). 报告期内董事会提名委员会召开4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23日	第二届董事会提名委员会第七次会议审议通过了《公司董事会提名委员会2020年度履职情况报告》《关于聘任公司首席信息官的议案》《关于聘任公司总法律顾问的议案》	同意将《公司董事会提名委员会2020年度履职情况报告》《关于聘任公司首席信息官的议案》《关于聘任公司总法律顾问的议案》提交董事会审议。	

2021年6月18日	第二届董事会提名委员会第八次会议审议通过了《关于提名公司第二届董事会独立董事候选人的议案》	同意将《关于提名公司第二届董事会独立董事候选人的议案》提交董事会审议。	
2021年7月27日	第二届董事会提名委员会第九次会议审议通过了《关于聘任公司副总经理的议案》	同意将《关于聘任公司副总经理的议案》提交董事会审议。	
2021年12月31日	第二届董事会提名委员会第十次会议审议通过了《关于聘任公司首席风险官的议案》	同意将《关于聘任公司首席风险官的议案》提交董事会审议。	

(5). 报告期内董事会审计委员会召开 8 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10日	第二届董事会审计委员会第十八次会议审议通过了《关于聘任会计师事务所的议案》《关于公司与齐鲁股权交易中心有限公司订立收益凭证产品认购协议暨日常关联交易的议案》	同意将《关于聘任会计师事务所的议案》《关于公司与齐鲁股权交易中心有限公司订立收益凭证产品认购协议暨日常关联交易的议案》提交董事会审议。	
2021年2月26日	第二届董事会审计委员会第十九次会议审议通过了《关于制定<中泰证券股份有限公司内部控制基本制度>的议案》	同意将《关于制定<中泰证券股份有限公司内部控制基本制度>的议案》提交董事会审议。	
2021年4月9日	第二届董事会审计委员会第二十次会议审议通过了《关于制定<公司内部控制评价办法>的议案》	同意将《关于制定<公司内部控制评价办法>的议案》提交董事会审议。	
2021年4月12日	第二届董事会审计委员会第二十一次会议审议通过了《公司 2020 年年度报告》《公司董事会审计委员会 2020 年度履职情况报告》《公司 2020 年度内部控制评价报告》《关于变更会计政策的议案》《关于计提资产减值准备的议案》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于确认 2020 年日常关联交易及预计 2021 年日常关联交易的议案》	同意将《公司 2020 年年度报告》《公司董事会审计委员会 2020 年度履职情况报告》《公司 2020 年度内部控制评价报告》《关于变更会计政策的议案》《关于计提资产减值准备的议案》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于确认 2020 年日常关联交易及预计 2021 年日常关联交易的议案》提交董事会审议。	
2021年4月25日	第二届董事会审计委员会第二十二次会议审议通过了《公司 2021 年第一季度	同意将《公司 2021 年第一季度报告》提交董事会审议。	

	报告》		
2021年8月13日	第二届董事会审计委员会第二十三次会议审议通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司内部审计制度>的议案》	同意将《关于修订<中泰证券股份有限公司内部审计制度>的议案》提交董事会审议。	
2021年8月24日	第二届董事会审计委员会第二十四次会议审议通过了《公司2021年半年度报告》《公司关于2021年上半年募集资金存放与实际使用情况的专项报告》	同意将《公司2021年半年度报告》《公司关于2021年上半年募集资金存放与实际使用情况的专项报告》提交董事会审议。	
2021年10月18日	第二届董事会审计委员会第二十五次会议审议通过了《公司2021年第三季度报告》	同意将《公司2021年第三季度报告》提交董事会审议。	

**(6). 报告期内董事会风险管理委员会召开 5 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15日	第二届董事会风险管理委员会第十九次会议审议通过了《公司2020年度反洗钱工作报告》《关于维持公司自营权益类证券及其衍生品、自营非权益类证券及其衍生品和融资类业务规模上限的议案》《关于维持公司总体风险偏好量化指标的议案》《关于购置上海绿地外滩中心办公楼的议案》	同意将《公司2020年度反洗钱工作报告》《关于维持公司自营权益类证券及其衍生品、自营非权益类证券及其衍生品和融资类业务规模上限的议案》《关于维持公司总体风险偏好量化指标的议案》《关于购置上海绿地外滩中心办公楼的议案》提交董事会审议。	
2021年4月12日	第二届董事会风险管理委员会第二十次会议审议通过了《公司董事会风险管理委员会2020年度履职情况报告》《公司2020年度全面风险管理报告》《公司2020年度净资本等风险控制指标有关情况的报告》《公司2020年度合规报告》《关于公司2021年度自营投资额度的议案》	同意将《公司董事会风险管理委员会2020年度履职情况报告》《公司2020年度全面风险管理报告》《公司2020年度净资本等风险控制指标有关情况的报告》《公司2020年度合规报告》《关于公司2021年度自营投资额度的议案》提交董事会审议。	
2021年7月2日	第二届董事会风险管理委员会第二十一次会议审议通过了《关于对全资子公司中泰创业投资（深圳）有限公司增资的议案》	同意将《关于对全资子公司中泰创业投资（深圳）有限公司增资的议案》提交董事会审议。	
2021年8月13日	第二届董事会风险管理委员会第二十二次会议审议	同意将《关于修订<中泰证券股份有限公司洗钱风险管理基本	



	通过了《关于修订<中泰证券股份有限公司洗钱风险管理基本制度>的议案》	制度>的议案》提交董事会审议。	
2021年8月24日	第二届董事会风险管理委员会第二十三次会议审议通过了《公司2021年上半年风险控制指标有关情况的报告》	同意将《公司2021年上半年风险控制指标有关情况的报告》提交董事会审议。	

(7). 存在异议事项的具体情况

适用 不适用

八、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。

1、监事参加监事会情况

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	出席股东大会的次数
郭永利	6	6	3	0	0	3
王思远	6	6	3	0	0	4
曹灶强	6	6	3	0	0	4
范天云	6	6	3	0	0	4
崔建忠	6	6	3	0	0	4
安铁	6	6	3	0	0	4
王丽敏	6	6	3	0	0	4

2、监事会召开情况

会议届次	召开时间	会议议案	决议情况
第二届监事会第十一次会议	2021年4月20日	1、《公司2020年度反洗钱工作报告》； 2、《公司2020年度全面风险管理报告》； 3、《关于维持公司总体风险偏好量化指标的议案》； 4、《关于修订<公司董事、监事薪酬管理与绩效考核办法>的议案》。	均通过
第二届监事会第十二次会议	2021年4月22日	1、《公司2020年度总经理工作报告》； 2、《公司2020年年度报告》； 3、《公司2020年度财务决算报告》； 4、《公司2020年度利润分配预案》； 5、《公司关于2020年度募集资金存放与实际使用情况的专项报告》； 6、《关于计提资产减值准备的议案》； 7、《关于变更会计政策的议案》； 8、《关于确认2020年日常关联交易及预	均通过

		计 2021 年日常关联交易的议案》； 9、《公司 2020 年度内部控制评价报告》； 10、《公司 2020 年度社会责任报告》； 11、《公司 2020 年度合规报告》； 12、《公司 2020 年度净资产等风险控制指标有关情况的报告》； 13、《关于公司监事 2020 年度考核及薪酬情况的议案》； 14、《公司 2020 年度监事会工作报告》。	
第二届监事会第十三次会议	2021 年 4 月 28 日	《公司 2021 年第一季度报告》	通过
第二届监事会第十四次会议	2021 年 8 月 27 日	1、《公司 2021 年半年度报告》； 2、《公司关于 2021 年上半年募集资金存放与实际使用情况的专项报告》； 3、《公司 2021 年上半年风险控制指标有关情况的报告》。	均通过
第二届监事会第十五次会议	2021 年 10 月 28 日	1、《公司 2021 年第三季度报告》； 2、《关于修订<中泰证券股份有限公司章程>及相关附件的议案》。	均通过
第二届监事会第十六次会议	2021 年 11 月 16 日	《关于公司第二届监事会延期换届的议案》	通过

## 九、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	7,495
主要子公司在职员工的数量	1,276
在职员工的数量合计	8,771
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	222
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
经纪业务人员	5,373
研究人员	218
投行人员	874
投资人员	267
资产管理业务人员	168
财务人员	218
行政人员	136
信息技术人员	563
合规风控人员	251
其他	703
合计	8,771
教育程度	
教育程度类别	数量（人）
研究生及以上	2,910
大学本科	5,458
大学专科及以下	403
合计	8,771

**(二) 薪酬政策**√适用 不适用

公司根据法律法规及《公司章程》等规定，结合证券行业特点和业务发展需要，建立了效率优先、兼顾公平的薪酬管理体系；制定了《员工薪酬管理办法》《员工考核管理办法》及各业务条线薪酬管理和考核分配办法等一系列薪酬管理制度，加强员工薪酬考核管理，强化业绩和能力导向，发挥薪酬考核的激励约束作用，吸引、留住人才，调动各类人员的积极性；公司依据《中华人民共和国劳动法》《中华人民共和国社会保险法》以及各地规章制度的要求，依法合规为员工足额缴纳社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险等）和住房公积金；公司建立了企业年金制度，进一步健全养老保障体系。

**(三) 培训计划**√适用 不适用

2021 年，公司认真落实“人才强企”战略，重点聚焦干部队伍、后备干部、新员工、投研投顾高端人才、金融科技复合型人才、营销人员队伍等六大培养对象，个性化设计培训方案，涉及思想政治、行业文化建设、经营管理、法律合规风控、业务技能、廉洁从业、综合素养、潜能挖掘等内容；灵活开展线下面授、军训营、中共一大会址及纪念馆等地红色教育、E-Learning 线上学习、岗位锻炼、岗位认证及外部学习等形式多样的培训；积极探索年轻人才和专业人才培养模式，增强人才自主培养力度，在持续提升员工岗位胜任力、优化人才队伍结构和打造企业凝聚力等方面发挥重要作用。全年累计培训 200 余场，人均在线学习 72.23 小时、在线测试 316 场，外部培训 300 余人次。

2022 年，公司将继续实施“人才强企”战略，进一步整合培训资源，打造集团化培训平台，重点针对财富管理专业能力提升打造系列“学习智库”，自主研发重点专业课程，为一线人员深度赋能；持续深入打造“五层级”综合人才培养体系，强抓后备干部、后备人才、新员工、管培生等年轻人才培养工程；加大对投研投顾、Fin-Tech 复合人才等专业人才的培养。

**(四) 劳务外包情况**√适用 不适用

劳务外包的工时总数	48.59 万工时
劳务外包支付的报酬总额	7,280.62 万元

**十、利润分配或资本公积金转增预案****(一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况**√适用 不适用

公司根据《公司法》《证券法》及中国证监会、上交所等有关监管要求，结合实际情况，在《公司章程》中明确了利润分配政策，具体如下：“公司可以采取现金、股票或现金与股票相结合的方式分配股利，在符合现金分红的条件下，公司优先采取现金方式分配股利。公司实施现金

分红时，应综合考虑内外部因素、董事的意见和股东的期望，在无重大投资计划或重大现金支出等事项发生时，在不影响公司正常经营的基础上以及在公司当年实现的净利润为正数、当年末公司累计未分配利润为正数且资本公积为正的情况下，公司董事会根据公司的资金情况提议公司进行年度或中期现金分配，公司每年以现金方式分配的利润（包括年度分配和中期分配）应不低于当年实现的可分配利润（根据相关规定扣除公允价值变动收益等部分）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，区分下列情形，提出差异化的现金分红政策：（1）公司发展阶段属成熟期且无重大资金支出安排的，进行利润分配时，现金分红在本次利润分配中所占比例最低应达到80%；（2）公司发展阶段属成熟期且有重大资金支出安排的，进行利润分配时，现金分红在本次利润分配中所占比例最低应达到40%；（3）公司发展阶段属成长期且有重大资金支出安排的，进行利润分配时，现金分红在本次利润分配中所占比例最低应达到20%。公司发展阶段不易区分但有重大资金支出安排的，可以按照前项规定处理。公司采取股票方式分配股利的，应结合公司的经营状况和股本规模，充分考虑成长性、每股净资产摊薄等因素。”

2021年6月1日，公司2020年度股东大会审议通过了公司2020年度利润分配方案，即：每10股派发现金红利人民币1.09元（含税），该方案已于2021年7月16日实施完毕。该次分配的现金红利占2020年合并报表归属于母公司股东净利润的30.08%，符合《公司章程》和上交所的有关规定。公司独立董事就公司2020年度利润分配方案出具了独立意见，认为该方案符合股东的整体利益和长期利益，符合公司实际情况，有利于公司持续稳健发展。

#### 2021年利润分配预案：

经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，公司2021年度合并报表归属于母公司股东的净利润为3,200,009,354.36元。母公司2021年度实现净利润3,144,977,441.70元，分别按照净利润的10%计提法定公积金、按照净利润的10%计提一般风险准备金、按照净利润的10%计提交易风险准备金、按照公募基金托管费收入的2.5%计提一般风险准备金，合计943,522,894.71元，由其他综合收益结转留存收益12,158,654.85元后，母公司2021年度可供股东分配的利润为2,213,613,201.84元。加上以前年度结余未分配利润，母公司2021年末累计可供股东分配的利润为6,486,051,253.12元。

根据中国证监会相关规定，证券公司可供分配利润中公允价值变动收益部分不得用于向股东进行现金分配。2021年度母公司可供分配利润中公允价值变动累计数为22,639,650.67元，按照规定扣除后，母公司2021年度实现的可供股东分配的利润为2,190,973,551.17元。

综合考虑公司发展、资金需求和股东利益等因素，拟定2021年度利润分配方案如下：

以公司总股本为基数，向实施权益分派股权登记日登记在册的全体股东每10股派发现金红利0.63元（含税）。按2021年末公司总股本6,968,625,756.00股计算，合计派发现金红利439,023,422.63元，占2021年合并报表归属于母公司股东净利润的比例为13.72%，占母公司2021年度实现的可供

供股东分配利润的比例为 20.04%，符合《公司章程》的规定，剩余可供分配的未分配利润结转下一年度。

**(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

**十一、 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

公司制定了《高级管理人员薪酬管理与绩效考核办法》。董事会负责根据公司发展战略，确定每位高管人员业绩目标，业绩目标主要挂钩经营管理、公司净利润计划完成率、风控合规和党建责任等。董事会根据高管人员的年度业绩目标完成情况，对高管人员进行年度考核，并根据考核结果确定每位高管人员绩效年薪和职务任免等。公司将根据上级主管部门和监管要求，结合公司实际，持续优化高级管理人员薪酬管理与绩效考核办法。

**十二、 报告期内的内部控制制度建设及实施情况**

适用 不适用

公司高度重视内部控制机制建设，按照《公司法》《证券法》《企业内部控制基本规范》《证券公司内部控制指引》《证券公司监督管理条例》等规范性文件的要求，不断增强自我约束能力，持续推动现代企业制度建设，有效防范和化解金融风险，将内部控制的建设贯穿于公司经营发展的全过程之中。

报告期内，公司持续完善内部控制体系，优化公司组织架构和配套经营管理机制，及时更新相关内部制度，保障内部控制设计的有效性。截至报告期末，公司累计制定或修订完善各项制度及操作规程 400 余项，涵盖业务管理、合规管理、风险管理、财务管理、信息系统、人力资源及行政管理等多个方面。修订《公司章程》《公司董事会议事规则》等公司治理相关制度；持续完善基础管理，制定、修订《企业内部控制基本制度》《公司保密工作管理制度》《公司子公司管理办法》等管理制度；针对北交所开市，制定《公司北京证券交易所与全国中小企业股份转让系统自营投资管理办法》。报告期内，公司加大各项制度的执行落实力度，持续深化内控体系运行，保障内部控制运行的有效性。深入推动数字化转型与流程优化工作，不断推进完善全面风险管理体系建设及运行，加强重点业务流程和高风险领域风险监测、排查和检查，完善动态的净资本监控机制，有效推动风险事件处置，强化内控文化宣导，持续落实内部控制有效性自我评价机制，提升控制措施的执行有效性。

公司内部控制评价报告的具体内容详见公司 2022 年 3 月 30 日在上海证券交易所网站 (<http://www.sse.com.cn>) 披露的《中泰证券股份有限公司 2021 年度内部控制评价报告》。

#### （一）关于内部控制责任的声明及建立财务报告内部控制的依据

##### 1、关于内部控制责任的声明

按照企业内部控制规范体系的规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告是公司董事会的责任。监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。经理层负责组织领导企业内部控制的日常运行。

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

##### 2、建立财务报告内部控制的依据

公司根据《公司法》《证券法》《企业内部控制基本规范》及其配套指引、《证券公司内部控制指引》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号——规范运作》，以及《中华人民共和国会计法》《企业会计准则》等法律、法规和规则的要求，结合公司实际情况，建立健全公司财务报告内部控制。

#### （二）内部控制评价情况的说明

根据《企业内部控制基本规范》及其配套指引的规定和其他内部控制监管要求，结合公司内部控制系统和评价办法，在内部控制日常监督和专项监督的基础上，董事会对公司 2021 年 12 月

31 日（内部控制评价报告基准日）的内部控制有效性进行了评价。根据公司财务报告内部控制重大缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司不存在财务报告内部控制重大缺陷，董事会认为，公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。根据公司非财务报告内部控制重大缺陷认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司未发现非财务报告内部控制重大缺陷。自内部控制评价报告基准日至内部控制评价报告发出日之间未发生影响内部控制有效性评价结论的因素。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

### 十三、 报告期内对子公司的管理控制情况

适用 不适用

公司按照《公司法》《证券法》以及中国证监会、上交所的有关规定，坚持一个中泰理念，不断加强子公司管控，推动子公司规范运作，提升子公司治理水平；制定了《子公司管理办法》《子公司风险管理办法》《子公司合规管理办法》《子公司财务管理办法》等规章制度，健全子公司管理机制，明确了子公司管控的内容、责任分工，保障了对子公司的有效管控。报告期内，公司修订了《子公司管理办法》《子公司合规管理办法》《子公司风险管理办法》等制度，进一步完善了子公司合规管理和风险管理组织架构及职责分工，细化了子公司合规管理和风险管理基本要求，明确了子公司重大事项报告机制，强化对子公司的合规管理和风险管控，推动了子公司持续健康发展。

### 十四、 内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

公司聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）作为内部控制审计机构。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）出具了《中泰证券股份有限公司内部控制审计报告》（容诚审字[2022]251Z0103 号），认为公司于 2021 年 12 月 31 日按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。具体内容详见公司 2022 年 3 月 30 日在上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）披露的《中泰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

### 十五、 上市公司治理专项行动自查问题整改情况

报告期内，公司开展了上市公司治理专项行动自查，并结合实际情况，通过完善公司治理制度，加强职能部门服务支撑，健全信息报送、日常沟通机制等多种措施，服务保障董事、监事履行职责，进一步发挥董事会委员会、独立董事作用，提升公司董事会科学决策水平。

## 十六、 其他

√适用 □不适用

### 1、合规体系建设

公司始终坚持“合规风控至上”的经营理念，坚持监管导向、问题导向原则，结合疫情期间特殊情形灵活调整合规管控措施，以提升合规管理能力为抓手，建立健全合规管理制度，完善全方位、多层次的合规管理组织架构，强化合规监督检查，深化公司合规管理工作，有效保障公司各项业务持续规范发展。

根据监管要求及业务发展需要，公司在报告期内贯彻落实《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》及《证券公司合规管理实施指引》，根据市场环境、监管要求的变化及业务发展需要，完善合规管理组织架构及相关制度，确保合规管理各层级职责定位明晰准确，倡导全员合规的公司文化理念。

合规管理组织架构。公司建立董事会及其风险管理委员会、监事会、经营管理层、合规总监、合规管理总部、各部门/分支机构合规风控负责人（专员）的合规管理组织体系，在各自职责范围内履行合规管理职责。董事会是公司合规管理的最高决策机构，承担合规管理有效性最终责任，决定公司合规管理目标，对公司合规管理有效性负责；董事会下设风险管理委员会，负责审议合规管理总体目标、基本政策及合规管理机构设置，提出决策意见。监事会负责监督董事、高级管理人员履行合规管理职责情况。经营管理主要负责人对公司合规运营承担责任，其他高级管理人员对其分管领域的合规运营承担责任。合规总监作为公司高级管理人员，对本公司及其工作人员的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督和检查，直接向董事会负责。各部门/分支机构主要负责人负责落实本单位的合规管理目标，主动识别、控制所在单位合规风险。公司全体工作人员对其自身经营活动范围内业务事项和执业行为的合规性负责。公司设合规管理总部，协助合规总监具体履行合规管理职责，负责建设公司合规管理体系及制度架构，开展合规宣导与培训、合规检查与审查，建设监控预警系统及信息隔离墙系统，报送合规报告及对接外部监管协作，统筹公司反洗钱工作等。公司各部门及分支机构内部配备合规管理人员，负责本单位的合规管理工作，对本单位合规管理情况进行及时有效的检查、督导和报告，负责与合规管理总部的沟通和交流，落实监管部门及公司的各项合规工作要求，从源头上防范一线业务合规风险。

子公司合规管理。公司贯彻落实《公司子公司合规管理办法》《公司另类投资、私募基金子公司从业人员证券投资管理暂行办法》等子公司合规管理制度，修订了《公司子公司合规管理办法》，建立健全子公司合规管理体系，明确子公司合规管理职责，确立子公司合规管理的基本原则、组织架构和工作机制。同时，公司建立了专门的合规管理信息报告机制，各子公司按月度、年度报送合规管理运作情况，不定期报送合规管理专项报告，有效掌握子公司合规风险管控情况；参加子公司重大事项决策会议、审查各子公司业务制度与报告，开展子公司联合检查工作，切实掌握子公司合规管理情况，构建统一完善的子公司合规管理机制。

公司合规制度建设。公司建立了一整套持续完善的合规管理制度体系。报告期内，公司根据



《证券法》《证券公司监督管理条例》《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等法律法规和规范性文件的要求，结合合规管理实际和业务运作实践，修订了《公司合规管理绩效考核办法》《公司廉洁从业管理办法》《公司合规检查管理办法》《公司客户投诉管理办法》《公司证券投资顾问业务合规管理办法》《公司场外衍生品业务合规管理办法》等 21 项合规管理制度，形成了系统完备、行之有效的合规管理制度体系，多层次、多方位完善业务合规管理要求和合规管控重点。

合规管理机制运行情况。公司持续深化并完善合规管理机制，始终坚持监管导向、问题导向的原则，紧紧围绕公司“1142”发展思路，推动各单位合规经营，切实履行合规管理各项职能，推进合规机制优化升级。公司合规部门持续跟踪监管动态，不断优化合规对接方式，为各单位业务开展提供合规咨询；持续加强合规宣导和培训工作，召开全员合规专题会议，强化全员合规意识；扎实开展合规审查工作，深入论证业务开展中的重大事项，发表合规意见，引导做好合规风险管控，支持业务规范开展；加强对投资银行、产品销售、债券自营、场外衍生品、反洗钱等重点业务、重点领域的检查，指导投资银行、信用等业务部门开展风险自查，有效排查风险隐患、及时发现合规问题、督促进行规范整改；主动报告公司重要业务合规运行状况，按时向监管机构报送月度、年度合规报告，并根据要求报送临时性报告；优化完善合规考核与合规问责机制，保障合规管理工作有序开展和合规管理制度的有效实施；推动合规管理信息化工作，持续优化升级集中监控系统、办公电话监测系统和信息隔离墙系统，强化员工执业行为监控，对公司经营管理中的相关合规风险进行识别、评估和监控，并探索建设合规业务支持系统，为日常合规管理提供技术支持；建立并完善客户投诉举报信息获取、记录和处理机制，定期对各部门、全体员工合规管理的有效性和执业行为的合规性进行考核，并将考核结果纳入公司绩效考核体系。

反洗钱工作。公司紧跟监管形势，积极推进反洗钱工作，切实提高反洗钱工作有效性，认真履行反洗钱义务。报告期内，针对历史遗留的不规范账户，通过信息技术手段筛选排查后重点开展了反洗钱账户规范工作，进一步减少公司及分支机构洗钱风险隐患，夯实反洗钱工作基础；持续做好机构客户受益所有人身份识别工作，认真履行客户身份识别义务；持续加强对分支机构的反洗钱工作督导和检查；进一步优化反洗钱监控系统，持续推动反洗钱监测工作智能化运营，推进完成反洗钱系统升级工作，优化系统内各项监测功能，切实提高反洗钱工作效率；持续做好反洗钱宣传与培训工作，积极营造良好的反洗钱社会氛围。2021 年，公司持续强化反洗钱制度体系建设，发布了《公司反洗钱内部控制管理办法》《公司反洗钱重点可疑交易报告实施细则》《公司反洗钱工作保密实施细则》等 9 项制度，指导业务部门建立了反洗钱工作细则，指导分支机构完成了反洗钱工作细则的修订，形成了总部、分公司、营业部多层次反洗钱制度体系。

## 2、合规检查情况

报告期内，公司合规管理总部结合行业多发问题和监管关注重点，运用合规检查手段，结合检查实际，梳理投行业务、信用业务等业务条线及分支机构管理检查重点，持续完善合规检查工作底稿；制定报告期内合规检查重点任务，组织对场外衍生品、债券发行业务、再融资保荐业务、

信用业务、投行关联交易项目等风险易发高发领域开展专项合规检查，针对发现的问题或不规范情形，督促相关单位采取有效措施进行整改，确保公司各项业务总体规范运作；开展公司范围内合规风控专项整改和“回头看”活动，组织各单位深入排查合规风险隐患，规范公司业务运营情况；根据日常管理情况、结合反洗钱账户规范工作等加强对各分支机构的反洗钱现场督导和检查。

**场外衍生品业务：**为规范场外衍生品业务运作，强化重点领域的合规风控管理，提高场外衍生品业务合规风控管理水平，全面落实各项监管要求，合规管理总部对场外衍生品业务进行检查，重点检查投资者适当性管理情况、数据报送情况、信息隔离墙制度执行情况等方面，结合检查发现的问题提出具体整改建议。

**债券发行业务：**为全面落实《证券公司投资银行类业务内部控制指引》相关规定，进一步强化对公司债券类投行业务发行工作合规、风险管控，防范公司债券类投行业务风险，公司合规管理总部、风险管理部成立联合检查组，对公司债券发行业务进行了联合检查，针对检查发现的关联方认购核查、投资者适当性核查、定价配售集体决策、簿记现场管理、工作底稿留痕管理等方面问题，提出专项整改意见。

**再融资保荐业务：**为进一步加强再融资保荐业务合规管控，结合监管要求，公司合规管理总部对公司再融资保荐业务相关制度及其执行情况进行了合规检查，针对制度制定、尽职调查、工作底稿完备性等方面问题提出具体整改意见及建议。

**投行关联交易类项目：**合规管理总部在开展投资银行类业务利益冲突合规审查时，发现涉及关联方的，同时向投行委发出检查通知书，对项目合理性、定价公允性开展现场合规检查。

**信用业务：**合规管理总部完成对公司信用业务部及相关分支机构的信用业务专项检查，对风险测评、客户征信、信用等级评估等方面提出具体的意见及建议，督导相关部门整改到位。

**反洗钱：**合规管理总部分别对上海建国中路证券营业部、淄博分公司等 2 家分支机构开展了反洗钱现场检查或督导，出具了现场检查或督导报告，提高对分支机构反洗钱工作管控力度。

**经纪业务：**完成对大连、济南、泰安、湖北、滨州、厦门等证券营业部合规专项现场检查，检查内容涵盖廉洁从业、投资者适当性管理、账户管理、投资者教育、营销管理、从业人员执业行为等方面，针对现场检查问题督促营业部制定整改措施并持续监督其落实到位。

**子公司管理：**合规管理总部会同其他职能部室，完成对中泰创业投资（深圳）有限公司合规与风控现场检查，重点关注制度制定、项目尽调、投后管理等方面，对检查发现的问题督促其落实整改规范。

### 3、内部审计稽核情况

报告期内，公司审计稽核部通过独立、客观的监督、评价和建议活动，运用系统化和规范化的方法，审查评价并督促改善公司及所属单位业务经营、财务管理、内部控制、合规风控和公司治理效果，促进公司稳健运行和价值提升。

报告期内，公司审计稽核部根据年度审计计划开展内部审计工作，审计对象覆盖总部业务及管理部门、分支机构和子公司。全年完成分支机构经济责任审计项目 167 项，其中强制离岗稽核

73 项、离任审计 94 项；完成公司内部控制评价、合规管理有效性评估、投资银行类业务内部控制有效性评估、基金托管业务内部控制评估、私募投资基金外包服务业务评估、证券投资基金销售业务专项稽核等审计或评估类项目。

#### 4、证券经纪人情况

截至 2021 年 12 月 31 日，公司证券经纪人 944 人。2021 年，公司按照《证券经纪人管理暂行规定》《公司证券经纪人管理办法》等规定开展证券经纪人业务。公司不断完善证券经纪人管理体系，优化证券经纪人业务管理机制，严格、审慎审核证券经纪人签约和续约，加强证券经纪人合规培训，采取系统控制、核查督导等有效措施，落实对分支机构证券经纪人的规范管理。报告期内，公司证券经纪人业务运行平稳，整体状况良好。公司将规范实施证券经纪人制度，进一步优化证券经纪人队伍建设，确保证券经纪人业务平稳发展。

## 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

#### (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

公司坚定不移贯彻新发展理念，积极响应国家绿色环保号召，坚持依法依规、协调发展、全员参与的低碳环保与节能减排工作原则；成立低碳环保与节能减排工作现场检查督导组，明确各单位主要负责人是本单位低碳环保、节能减排工作的第一责任人，保障公司节能减排与绿色环保工作有序有效推进。**在节约用水方面**，公司积极倡导水资源循环使用，督导员工养成节约用水的良好习惯；加强用水设备日常维护和管理，及时处理供水设备“跑冒滴漏”故障；公区院落绿化用水，在条件允许的情况下尽可能利用中水或集蓄雨水。**在节约用电方面**，公司积极推广使用节能型灯具，随日常维修更换逐步彻底淘汰白炽灯、高汞灯等高耗能照明灯具；推行办公区无人办公时间、下班后，人走灯灭，电脑传真、打印复印、扫描投影等办公、电子及电器设备，人走关机、关机断电；合理开启和使用空调，提倡下班或离开前半小时关闭空调。**在节约办公及耗材方面**，公司积极推行自动化、网络化办公，鼓励使用电子文件、电子信箱等网络工具部署、联系工作；优先选用高效节能、绿色环保设备。**有害垃圾和废旧设备处置方面**，优先选择具有环保资质的公司进行回收，使废旧设备得到科学、及时、高效地处理回收再利用，防止对环境造成二次污染。**在倡导绿色环保理念方面**，积极倡导绿色出行和低碳生活，号召员工从我做起，从家庭做起，在

工作和生活中养成节能减排降耗、垃圾分类投放等文明生活习惯，做节约型公民，做节能环保型家庭，用行动推动低碳生活新时尚。

#### (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

公司积极响应和支持国家“碳达峰”“碳中和”战略目标，在做好自身低碳环保、节能减排工作的同时，有效发挥金融专业优势，助力绿色低碳可持续发展，为建设美丽中国贡献中泰力量。

研究服务方面：2021年4月，公司在上海举办以“碳中和”为主题的投资策略峰会，为300多名投资者深度全面交流碳中和将面临的困难和挑战、对全球经济和社会产生的影响，推动经济绿色低碳转型发展。2021年6月，公司联合山东省工信厅、山东省新动能基金管理有限公司主办“2021山东化工产业发展论坛”，支持山东化工行业在“十四五”时期的发展，推动山东化工行业转型升级、提质增效和新旧动能转换。2021年12月，公司联合山东省发展和改革委员会、山东省地方金融监督管理局、山东省新动能基金管理有限公司举办“金融助推山东绿色低碳发展论坛”，并发布《中泰证券“碳达峰、碳中和”行动计划》，构建公司“双碳”金融综合服务体系。

产品布局方面：公司切实加强“双碳”“低碳”主题基金以及光伏、水电、风电、新能源车、芯片、环保新材料等行业和板块主题基金的引入和推介力度。

投行服务方面：2021年4月，公司担任联合保荐主承销商的新风光电子科技股份有限公司在科创板成功上市，该企业是专业从事大功率电力电子节能控制技术及相关产品研发、生产、销售和服务的高新技术企业，此次上市将助力其优化产品结构，提高生产效率。2021年12月，公司保荐主承销的石家庄通合电子科技股份有限公司向特定对象发行股票项目完成发行上市，该企业的主要业务之一为新能源汽车业务，其主要产品包括充换电站充电电源系统及电动汽车车载电源，是业界率先推出符合国网“六统一”标准的20KW宽范围恒功率充电模块的厂家之一。

投资方面：公司全资另类投资子公司中泰创投投资永臻科技股份有限公司，助力该公司光伏业务发展。

## 二、社会责任工作情况

√适用 □不适用

公司社会责任工作履行情况，详见公司2022年3月30日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司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，公司深入贯彻落实党中央国务院决策部署，认真落实监管部门“一司一县”“一县一企”帮扶倡议，积极响应“证券行业促进乡村振兴公益行动”倡议，坚持义利并举，积极履行社会责任，努力践行国企担当，赢得了社会各界广泛赞誉。

发挥专业优势，贴心服务客户。公司与诸城市政府签署全面深化合作协议，发挥专业优势，强化资源配置，成立服务专班，与当地政府在智库研究、乡村振兴、招商引资、资本市场等方面展开全面合作，以诸城市为试点，打造服务乡村振兴和县域经济发展的“中泰样板”。公司与陕西柞水盘龙药业签署战略合作协议，进一步深化在资本市场方面的合作，助推企业高质量发展；发挥全链条金融服务优势，为柞水各类企业提供规范改制、股债融资、并购重组、资产管理、研究咨询等全方位资本市场服务，助推柞水县域经济健康发展。公司控股子公司鲁证期货报告期内累计开展“保险+期货”项目 90 余个，涉及山东、黑龙江、辽宁、新疆等 11 个省 43 个县区，玉米、大豆、花生、红枣、鸡蛋等 9 个品种，项目总承保规模覆盖农产品种植面积约 70 万亩，覆盖农户约 6 万户。新疆麦盖提县红枣“保险+期货”项目荣获郑商所“保险+期货”试点建设优秀项目奖。

巩固脱贫攻坚成果，助力乡村振兴。公司积极响应中国证券业协会“证券行业促进乡村振兴公益行动”倡议，持续深化产业帮扶、教育帮扶、智力帮扶、金融帮扶、文化帮扶、生态帮扶、消费帮扶，在贵州赫章、江西修水、安徽临泉、陕西柞水及略阳等 5 个原国家级贫困县，投入 157.55 万元资金，实施一系列乡村振兴帮扶项目。山东中泰慈善基金会捐资 20 万元持续推进临沂市城南村乡村振兴暨新时代文明实践站项目，相关基础设施建设工程、文明实践大讲堂、中泰特色产业园等多个子项目得以顺利实施。公司工会将职工福利与促进帮扶地区产业发展有机结合，组织采购当地农副产品 1,188 万元，对于拓宽农副产品销路、提升农产品品牌，带动当地产业发展，增加农户收入，发挥了积极作用。公司控股子公司鲁证期货 2021 年累计购买新疆维吾尔自治区麦盖提县、安徽省太湖县、黑龙江桦川县等原贫困地区产品 70 万元。积极响应中国证券业协会倡议，公司组队参加 2021 年成都善行者公益徒步活动，筹集资金 2.06 万元全部由中国扶贫基金会用于隰县特困群众帮扶项目。鲁证期货与安徽省安庆市宿松县、山东省菏泽市巨野县营里镇田庙村签订结对帮扶协议，在实施公益帮扶、专业帮扶、消费帮扶等领域开展合作，全方位支持当地巩固拓展脱贫攻坚成果，助力推进乡村振兴。

多种方式开展捐资助学活动。公司通过山东中泰慈善基金会出资 50 万元，资助山东财经大学困难学子、设立奖学金、支持优秀科研课题、支持大学生开展社会实践活动；通过山东中泰慈善基金会向诸城市 5 所农村薄弱小学捐资助学，改善农村学校办学条件；结合国家帮扶政策的指引及以往帮扶成效，公司通过山东中泰慈善基金会面向西部贫困地区、大别山革命老区、原扶贫攻坚核心区和少数民族聚居区的品学兼优贫困学生开展“泰温暖”走访慰问活动，发放价值 11.67 万元的物资。

积极开展扶弱济困、爱心慈善活动。通过山东中泰慈善基金会出资 1.13 万元，帮助临沂市莒南县 290 户困难家庭安装一氧化碳泄露报警器，为“走进革命老区崖子村，关爱留守孤寡老人困难户”项目贡献绵薄之力。通过山东中泰慈善基金会出资 9.78 万元，助力山东残疾人事业和文化繁荣。大力弘扬社会主义核心价值观，广泛动员，积极参与“慈心一日捐”活动，公司总部及济南分公司员工向山东省慈善总会捐款 50.14 万元，用于关心关爱社会困难群体。公司控股子公司鲁证

期货向安徽省宿松县捐款 10 万元，捐赠金额纳入上海证券交易所“爱心救助基金”，用于解决宿松县未脱贫户、脱贫监测户、边缘易致贫户、老小病残孤群体“三户一体”家庭基本生活困难问题。

实施就业扶贫，激活造血功能。公司响应国家号召，根据自愿原则，积极安排符合条件的新疆籍少数民族应届大学毕业生就业；鲁证期货录用原国家级贫困县黑龙江桦川县残疾人、原国家级贫困县河北省蔚县大学毕业生，系列就业扶贫措施，助力贫困家庭再生造血功能，获得了各方肯定。

## 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
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	股份限售	枣矿集团	关于股东持股期限的承诺	自枣矿集团持股日起 60 个月内	是	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	股份限售	高速投资	关于股东持股期限的承诺	自高速投资持股日起 60 个月内	是	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	枣矿集团	稳定股价预案	自 A 股上市后 3 年内	是	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	枣矿集团	关于承诺履行的约束措施	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	枣矿集团	保证上市公司独立性	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	枣矿集团、山能集团	避免同业竞争	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	枣矿集团、山能集团	减少和规范关联交易	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	枣矿集团、新矿集团	关于收购报告书虚假披	长期有效	否	是	不适用	不适用

			露情形下承担相应法律责任的承诺					
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	高速投资	关于简式权益变动报告书虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	山能集团、新矿集团	关于简式权益变动报告书虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	股份限售	莱钢集团	关于股东持股期限的承诺	自莱钢集团持股日起 60 个月内	是	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	莱钢集团	关于简式权益变动报告书虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	莱钢集团	保证上市公司独立性	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	莱钢集团	避免同业竞争	长期有效	否	是	不适用	不适用



收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	莱钢集团	规范关联交易	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	莱钢集团	关于收购报告书虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	其他	济钢集团	关于简式权益变动报告书虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	莱钢集团、山能集团、鲁信集团、新矿集团、山东省国有资产投资控股有限公司	关于股东持股期限的承诺	自 A 股上市之日起 36 个月	是	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	山东省财金投资集团有限公司	关于股东持股期限的承诺	自 A 股上市之日起 36 个月	是	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	股份限售	公司首次公开发行上市前的其余 33 家股东及德州市财政局、浙江海岳新材料有限公司	关于股东持股期限的承诺	自 A 股上市之日起 12 个月，截至 2021 年 6 月 3 日已履行完毕	是	是	不适用	不适用

		司、钱紫阁						
与首次公开发行相关的承诺	其他	莱钢集团、公司及全体董事(不包括独立董事)、高级管理人员	稳定股价预案	自 A 股上市后 3 年内	是	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	山钢集团、莱钢集团	避免同业竞争	长期有效	否	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	山钢集团、莱钢集团、济钢集团	规范关联交易	长期有效	否	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	莱钢集团	公司上市前持股 5%以上股东的持股意向及减持意向	股票锁定期满后两年内、两年后	是	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	山能集团	公司上市前持股 5%以上股东的持股意向及减持意向	股票锁定期满后两年内、两年后	是	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	公司全体董事、高级管理人员	对公司填补回报措施能够得到切实履行作出的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	莱钢集团、公司及全体董事、监事、高级管理人员	关于招股说明书虚假披露情形下承担相应法律责任的承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用

与首次公开发行相关的承诺	其他	公司及全体董事、高级管理人员	关于信息披露与投资者教育的专项承诺	长期有效	否	是	不适用	不适用
与首次公开发行相关的承诺	其他	莱钢集团、山钢集团、公司及全体董事、监事、高级管理人员	关于承诺履行的约束措施	长期有效	否	是	不适用	不适用

(二) 公司资产或项目存在盈利预测，且报告期仍处在盈利预测期间，公司就资产或项目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

1、会计政策变更

2018年12月7日，财政部发布了《企业会计准则第21号——租赁》（以下简称“新租赁准则”），新租赁准则对于承租人的变化是除短期租赁和低值资产租赁豁免外，承租人需要确认租赁合同中的相关资产和负债，对损益的影响由租赁费变为折旧和利息支出。对于出租人变化主要在于识别租赁和非租赁组成部分，以及增加了披露要求。

本公司自2021年1月1日起执行新租赁准则，对于首次执行日前已存在的合同，本公司在首次执行日选择不重新评估其是否为租赁或者包含租赁。对于首次执行日之后签订或变更的合同，本公司按照新租赁准则中租赁的定义评估合同是否为租赁或者包含租赁。此项会计政策变更经公司2021年4月22日召开的第二届董事会第四十二次会议决议批准。

(1) 本公司作为承租人

本公司选择首次执行新租赁准则的累积影响数调整首次执行当年年初(即2021年1月1日)留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整：

①对于首次执行日前的融资租赁，本公司在首次执行日按照融资租入资产和应付融资租赁款的原账面价值，分别计量使用权资产和租赁负债；

②对于首次执行日前的经营租赁，本公司在首次执行日根据剩余租赁付款额按首次执行日承租人增量借款利率折现的现值计量租赁负债，并根据每项租赁按照与租赁负债相等的金额及预付租金进行必要调整计量使用权资产。

③在首次执行日，本公司按照“第十节 财务报告 五、25”，对使用权资产进行减值测试并进行相应会计处理。

本公司首次执行日之前租赁资产属于低价值资产的经营租赁，采用简化处理，未确认使用权资产和租赁负债。除此之外，本公司对于首次执行日前的经营租赁，采用下列一项或多项简化处理：

A. 将于首次执行日后 12 个月内完成的租赁，作为短期租赁处理；

B. 计量租赁负债时，具有相似特征的租赁采用同一折现率；

C. 使用权资产的计量不包含初始直接费用；

D. 存在续租选择权或终止租赁选择权的，本公司根据首次执行日前选择权的实际行使及其他最新情况确定租赁期；

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

F. 首次执行日之前发生租赁变更的，本公司根据租赁变更的最终安排进行会计处理。

## （2）本公司作为出租人

对于首次执行日前划分为经营租赁且在首次执行日后仍存续的转租赁，本公司作为转租出租人在首次执行日基于原租赁和转租赁的剩余合同期限和条款进行重新评估并做出分类。除此之外，本公司未对作为出租人的租赁按照衔接规定进行调整，而是自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

## （3）售后租回交易

对于首次执行日前已存在的售后租回交易，本公司在首次执行日不重新评估资产转让是否符合“第十节 财务报告 五、35”，作为销售进行会计处理的规定。对于首次执行日前应当作为销售和融资租赁进行会计处理的售后租回交易，本公司作为卖方（承租人）按照与其他融资租赁相同的方法对租回进行会计处理，并继续在租赁期内摊销相关递延收益或损失。对于首次执行日前作为销售和经营租赁进行会计处理的售后租回交易，本公司作为卖方（承租人）应当按照与其他经营租赁相同的方法对租回进行会计处理，并根据首次执行日前计入资产负债表的相关递延收益或损失调整使用权资产。

因执行新租赁准则，本公司合并财务报表相应调整 2021 年 1 月 1 日使用权资产 488,876,434.60 元、租赁负债 451,912,726.80 元、其他资产-53,315,333.12 元、其他负债-13,691,584.14 元。相关调整对本公司合并财务报表中归属于母公司股东权益的影响金额为-2,660,041.18 元，其中其他综合收益为 1,400,513.45 元、未分配利润为-4,060,554.63 元。具体各报表项目影响金额详见本报告“第十节 财务报告 五、44 重要会计政策和会计估计的变更”。

## 2、会计估计变更

为准确、公允反映有明确限售期的股票的公允价值，根据中国证券业协会《证券公司金融工具估值指引》和财政部《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》相关要求，对估值方法进行变更。本次变更前，如果估值日公开、非公开发行有明确限售期的股票的初始取得成本高于在证券

交易所上市交易的同一股票的市价，采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。如果估值日公开、非公开发行有明确限售期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，综合考虑限售期等因素确定流动性折扣计算估值日该股票的价值。

本次变更后，公司通过公开、非公开等方式取得且有明确限售期的股票，在限售期内，以证券交易所上市交易的同一股票的公允价值为基础，根据第三方估值机构采用亚式期权 AAP 模型计算的流动性折扣确定估值日该股票的价值。变更日期为 2021 年 10 月 1 日。根据《企业会计准则》相关规定，会计估计变更采用未来适用法处理，无需对以前年度进行追溯调整，因此不会对本公司已披露的财务报告产生影响。此项会计估计变更经公司 2022 年 3 月 29 日召开的第二届董事会第五十六次会议决议批准。本次会计估计变更对公司当期财务状况的影响金额为：增加本期净利润 251,137,877.52 元；增加税后其他综合收益 24,213,878.48 元；增加资产总额 367,135,674.67 元；增加净资产 275,351,756.00 元。具体各报表项目影响金额详见本报告“第十节 财务报告 五、44.重要会计政策和会计估计的变更”。

(二) 公司对重大会计差错更正原因及影响的分析说明

适用 不适用

(三) 与前任会计师事务所进行的沟通情况

适用 不适用

(四) 其他说明

适用 不适用

六、聘任、解聘会计师事务所情况

单位：万元 币种：人民币

	现聘任
境内会计师事务所名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬	95
境内会计师事务所审计年限	1

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	25
保荐人	东吴证券股份有限公司	0

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

2021 年 4 月 22 日，公司第二届董事会第四十二次会议审议通过了《关于续聘会计师事务所的议案》。同意续聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司 2021 年度财务报告和内部控制审计机构，聘期一年。2021 年 6 月 1 日，公司 2020 年度股东大会审议通过该项议案。

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) 报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》规定的重大诉讼、仲裁事项。

(二) 报告期内，公司涉案金额超过 5,000 万元的未决诉讼、仲裁事项如下：

### 1、以前年度已披露的未决诉讼、仲裁案件进展情况

以前年度案件披露情况详见公司于 2021 年 4 月 24 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司 2020 年度报告》。

(1) 东旭光电债券纠纷案、安徽外经集团债券兑付纠纷案、海航财务债券质押式回购案，报告期至本报告披露之日，无后续进展。

(2) 华阳经贸债权纠纷案。2021 年 8 月 21 日，北京市第一中级人民法院裁定受理对中国华阳经贸集团有限公司的破产清算申请，破产案件正在审理过程中。

上述第 (1) (2) 案件为中泰资管作为管理人代资管计划提起，不会对报告期内公司的生产经营及财务状况产生重大不利影响。

(3) 金山实业有抵押优先贷款票据买卖纠纷案、大民种业股权投资纠纷案、林某某股权回购合同纠纷案、“15 华信债”公司债券兑付纠纷案、高源投资有限公司抵押保证融资纠纷案、皇月国际项目贷款违约纠纷案，报告期至本报告披露之日，无后续进展。

(4) 乌海洪远融资租赁合同执行纠纷案。2021 年 4 月 13 日，二审诉讼请求（请求撤销一审判决，改判不得追加乌海市富海资产管理公司为被执行人）被上海市第一中级人民法院驳回，已申请恢复执行。2021 年 8 月 31 日，宏润（上海）融资租赁有限公司（以下简称“上海宏润”）收到部分执行款。2021 年 9 月 28 日，上海市浦东新区人民法院告知，因乌海洪远新能源科技有限公司被申请破产清算而被终止执行，上海宏润已申报债权。

(5) 国购投资公司债券交易纠纷案。2021 年 12 月 20 日，国购投资有限公司等四十三家公司破产重整案召开第二次债权人会议。2021 年 12 月 29 日，安徽省合肥市中级人民法院出具(2020)皖 01 破 14 号之一《民事裁定书》。根据该民事裁定书，合肥中院裁定批准国购投资等 43 家公司

的重整计划，并终止国购投资等 43 家公司的重整程序。重整计划执行期限为 3 年，自《重整计划草案》经合肥中院裁定批准之日起算，监督期限与执行期限一致，现重整计划正在执行过程中。

(6) 镇江兆和项目贷款违约纠纷案。珠海市兆和投资有限公司管理人已确认了国信证券（香港）经纪有限公司代中泰金融投资有限公司申报的债权。

## 2、报告期内，公司新增未决诉讼、仲裁案件进展情况

(1) 福建福晟集团有限公司债券违约纠纷案。福建福晟集团有限公司（以下简称“福晟集团”）发行福晟集团 2018 年公司债券（第二期）（以下简称“18 福晟 03”）、福晟集团 2019 年公司债券（第一期）（以下简称“19 福晟 01”），公司担任受托管理人。因福晟集团违约，“18 福晟 03”债券持有人中信信托有限责任公司、国投泰康信托有限公司与“19 福晟 01”债券持有人中国对外经济贸易信托有限公司、国投泰康信托有限公司、三度星和（北京）投资有限公司授权公司以福晟集团为被申请人于 2021 年 2 月 10 日分别向上海仲裁委员会申请仲裁，标的额分别为 208,547,000 元、314,057,167.8 元（以仲裁申请书中暂计的各项请求金额为依据），2021 年 6 月 30 日，仲裁委员会裁决福晟集团支付“18 福晟 03”债券本金、利息、违约金、律师费、预缴的仲裁费。2021 年 6 月 28 日，仲裁委员会裁决福晟集团支付“19 福晟 01”债券本金、利息、违约金、保全费、保全担保费、律师费、预缴的仲裁费。2021 年 7 月 28 日，公司向福建省福州市中级人民法院申请强制执行。现均在执行过程中。

(2) 漳州农村商业银行股份有限公司合同纠纷案。漳州农村商业银行股份有限公司（以下简称“漳州农商行”）与中泰资管签订了《齐鲁资管 0231 号定向资产管理合同》，中泰资管为管理产品的管理人。2021 年 1 月 4 日，中泰资管收到上海金融法院送达的应诉通知书，漳州农商行以中泰资管为被告向上海金融法院提起诉讼，标的额 65,035,624.77 元（以起诉状中暂计的各项请求金额为依据），请求判令解除双方签订的合同，中泰资管返还委托资金、回购利息、赔偿损失等费用。现本案正在一审过程中。

(3) 刘某融资融券交易纠纷案。2015 年 6 月 3 日，公司与刘某签订《融资融券合同》及风险揭示书。2021 年 8 月 1 日，公司以刘某为被告向济南市中级人民法院提起诉讼，标的额 56,304,765.07 元（以起诉状中暂计的各项请求金额为依据），请求判令刘某偿还欠款、逾期利息、诉讼费、保全费。2021 年 9 月 6 日，公司收到法院送达的（2021）鲁 01 民初 1553 号《受理案件通知书》。2021 年 12 月 30 日，公司收到济南市中级人民法院送达的（2021）鲁 01 民初 1553 号《民事判决书》，判决刘某支付公司融资融券欠款 36,139,130.34 元及逾期利息。2022 年 2 月 9 日，公司向济南市中级人民法院申请强制执行，现本案正在执行过程中。

(4) 北京绵世方达投资有限责任公司股票质押式回购交易纠纷案。2017 年 12 月 4 日，公司与北京绵世方达投资有限责任公司（简称“北京方达投资”）签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议。因北京方达投资未按协议约定支付利息，2021 年 5 月 27 日，公司以北京方达投资为被告向济南市中级人民法院提起诉讼，标的额 363,719,183.05 元（以起诉状中暂计的各项请求金额为依据），请求判令北京方达投资向公司支付融资本金、违约金、诉讼费、保全费、律师费等



费用，并确认公司对北京方达投资提供质押的股票在全部债权范围内享有优先受偿权。2021 年 7 月 18 日，公司收回部分债权，2021 年 7 月 20 日，公司向法院申请变更诉讼请求，标的额变更为 334,527,630.79 元（以诉状中暂计的各项请求金额为依据）。2021 年 11 月 3 日，公司收到济南市中级人民法院送达的（2021）鲁 01 民初 1363 号《民事判决书》，判决北京方达投资支付公司融资本金 308,091,337.77 元、违约金、律师代理费，确认公司对质押的股票享有质权。2022 年 2 月 9 日，公司向济南市中级人民法院申请强制执行。2022 年 3 月 9 日，公司收到济南市中级人民法院作出的《执行裁定书》，裁定拍卖、变卖北京方达投资持有的西水股份股票 62,897,971 股，现本案正在执行过程中。

#### 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

（一）报告期内，公司受到的行政管理部门行政处罚及证券监管部门行政监管措施情况

1、2021 年 1 月，中国人民银行济南分行（以下简称“人行济南分行”）对中泰证券及中泰证券原经纪业务部负责人刘洪松、中泰证券合规管理总部负责人安铁（同时为公司职工监事）分别出具了《中国人民银行济南分行行政处罚决定书》（济银罚字[2021]第 8 号、济银罚字[2021]第 9 号、济银罚字[2021]第 10 号），指出公司存在未按照规定识别客户身份、未按规定重新识别客户以及未按规定采取切实可行的措施保存客户身份资料等问题，人行济南分行采取行政处罚，对公司处 95 万元罚款，对上述部门负责人分别处 2.5 万元和 3.5 万元罚款。

公司对此高度重视，按照法律法规、监管规定、自律规则以及公司反洗钱方面制度的要求，成立专项整改小组并制定整改方案，对上述事实逐项整改，落实反洗钱方面工作要求。

2、2021 年 5 月，山东证监局出具《关于对中泰证券股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2021]17 号），指出公司存在网上营业厅系统升级、变更上线前未进行充分测试、信息系统安全监测机制不健全、发生信息安全事件未及时上报等问题。

公司对此高度重视，及时按照山东证监局要求提交了整改报告，有效落实监管整改要求。通过整改，进一步提升全员合规风控意识，落实岗位责任，压实信息技术网络安全突发事件各级责任义务。

3、2021 年 8 月，福建证监局出具《关于对中泰证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2021]31 号），福建证监局查明公司作为福建福晟集团公司债券受托管理人，在受托管理期间未严格遵守执业行为准则，未能对发行人未披露重大债务逾期违约、重大股权资产被冻结、重大诉讼等情况保持必要关注，未督导发行人真实、准确、完整、及时披露相关信息。

公司高度重视，对上述问题涉事员工严肃问责，根据严重程度分别处以警告、扣发奖金等考核措施，进一步增强工作责任心和主动性，提高风险事项的甄别能力和敏感性，强化全员风控合规意识。

4、2021 年 1 月，山东证监局出具《关于对鲁证期货股份有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2021]2 号），指出鲁证期货存在后台部门部分员工为其推荐客户并领取业务提成的问题。

鲁证期货对此高度重视，及时按照山东证监局要求提交整改报告，通过修订相关制度、梳理岗位职责等措施，有效落实监管整改要求。

（二）报告期内，除上述情况外，公司及董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人不存在受有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会采取行政监管措施、立案调查或行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被环保、安监、税务等其他行政管理部门给予重大行政处罚，或被证券交易所纪律处分的情形。

## 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

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

## 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

#### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

√适用 □不适用

（1）公司第二届董事会第四十二次会议及公司 2020 年度股东大会审议通过了《关于确认 2020 年日常关联交易及预计 2021 年日常关联交易的议案》。报告期内，公司日常关联交易按照预计的范围执行。情况如下：

关联交易类别	关联方	相关业务或事项简介	2021 年预计关联交易金额和上限		2021 年实际发生金额（万元）
			金额（万元）	占同类业务的上限	
证券经纪业务	山东省鲁信投资控股集团有限公司	公司为关联方提供证券代理买卖服务收取的手续费收入	由于客户需求无法预计，该项金额以实际发生额计算。	5%	20.02
	万家共赢资产管理有限公司				1.11
	其他关联方				

						103.51
	利息支出	山东省鲁信投资控股集团有限公司	公司为关联方提供证券代理买卖服务，支付给关联方交存公司保证金存款的利息		5%	63.53
		万家共赢资产管理有限公司				0.20
		其他关联方				38.93
期货和场外期权业务	手续费收入	山东莱钢永锋钢铁有限公司	公司为关联方提供期货经纪服务收取的手续费收入		5%	0.98
		其他关联方				41.46
	投资收益	山东永锋国际贸易有限公司	公司为关联方提供场外期权服务取得的投资收益		5%	164.89
	现货的采购成本、销售收入	山东莱钢永锋钢铁有限公司	公司开展期现结合业务，向关联方采购现货的成本、销售现货的收入		50%	25,569.28
其他关联方		9,644.72				
投资银行业务	财务顾问和承销保荐收入	山东能源集团有限公司	公司为关联方提供财务顾问、保荐、承销等服务产生的收入		10%	862.50
		山东钢铁股份有限公司				0.00
		其他关联方				602.59
产品销售和席位租赁业务	交易单元租赁和金融产品销售收入	万家基金管理有限公司	公司为关联方提供金融产品代销、租用交易单元等服务产生的收入		30%	14,111.73
		万家共赢资产管理有限公司				647.89
资产管理业务	管理费收入	山东中泰齐东信息产业发展投资中心(有限合伙)(现更名为山东未来产业科技成果转化基金合伙企业(有限合伙))	公司开展资产和基金管理业务，向关联方收取的相关收入		10%	0.00
		其他关联方				966.32

投资业务	债券或基金等投资收入	万家基金管理有限公司	申购关联方发行的票据、基金产品产生的投资收益	由于投资标的和交易金额无法准确预计，该项金额以实际发生计算。	5%	1,196.87
	债券利息收入	山东钢铁集团有限公司	申购关联方发行的债券产生的利息收入		10%	2,369.86
		莱芜钢铁集团有限公司				318.80
		其他关联方				1,761.00
融资业务	发行收益凭证利息支出	德州银行股份有限公司	关联方申购公司发行的收益凭证产生的利息支出	5%	0.00	
		其他关联方			140.35	
资金往来	利息收入	莱商银行股份有限公司	存放关联方存款产生的利息收入	由于业务发生时间、金额无法准确预计，该项金额以实际发生额计算。	10%	2,643.05
	利息支出	莱商银行股份有限公司	向关联方借款产生的利息支出		30%	1,390.92

(2) 2021年1月13日，公司第二届董事会第三十六次会议审议通过了《关于公司与齐鲁股权交易中心有限公司订立收益凭证产品认购协议暨日常关联交易的议案》。同意公司与齐鲁股权订立协议，齐鲁股权购买公司不超过8,000万元的收益凭证，期限6个月。具体见公司2021年1月14日在上海证券交易所披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第三十六次会议决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于订立收益凭证产品认购协议暨日常关联交易的公告》。

2021年2月1日，公司与齐鲁股权签署《收益凭证产品认购协议》，齐鲁股权购买公司收益凭证8,000万元。2021年8月2日，根据协议，产品到期。

### 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：亿元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）														
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										32.09				
报告期末对子公司担保余额合计（B）										64.18				
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）														
担保总额（A+B）										64.18				
担保总额占公司净资产的比例（%）										17.93				
其中：														
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）										0				
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）										44.04				
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）										0				
上述三项担保金额合计（C+D+E）										44.04				
未到期担保可能承担连带清偿责任说明														
担保情况说明										上述担保总额（A+B）为公司对子公司的担保14.96亿元和子公司之间的担保49.22亿元，具体如下： 1.公司对子公司的担保为：（1）2016年9月1日，经公司2016年第五次临时股东大会审议，同意公司向中泰资管的净资本担保规模由不超过5.5亿元增至不超过15.5亿元；截至				

2021年12月31日，公司为中泰资管提供净资本担保余额为人民币6.5亿元。（2）2019年2月18日，经公司2019年第二次临时股东大会审议，同意公司通过内保外贷为中泰国际融资，规模不超过人民币10亿元；截至2021年12月31日，公司通过内保外贷方式协助中泰国际境外融资人民币8.46亿元。

2.子公司之间的融资类担保为：（1）中泰国际为其子公司中泰国际证券有限公司贷款提供担保，担保规模为12.18亿元人民币；（2）中泰国际子公司中泰国际金融服务有限公司为中泰国际贷款提供担保，担保规模为7.36亿元人民币；（3）中泰国际为ZHONGTAI INTERNATIONAL FINANCE (BVI) COMPANY LIMITED发行美元债提供担保，担保规模19.13 亿元人民币。截至2021年12月31日，上述担保金额约合38.67亿元人民币。

3.子公司之间的非融资类担保为：中泰国际为中泰国际金融产品有限公司、中泰国际金融服务有限公司提供非融资类担保，主要为国际衍生品框架协议（ISDA协议）、全球总回购协议（GMRA协议）等，均为满足正常业务开展而进行。截至2021年12月31日，此类业务实际交易的担保金额约合10.55亿元人民币。

## (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

## (一) 分支机构变更情况

报告期内，公司 2 家证券营业部更名为证券分公司，新设 3 家证券营业部，迁址 27 家证券分公司和证券营业部，撤销 5 家证券营业部。

## 1、更名分支机构

序号	更名前分支机构名称	更名后分支机构名称	更名后地址
1	乌鲁木齐南湖南路证券营业部	新疆分公司	新疆乌鲁木齐市水磨沟区南湖南路 66 号水清木华 A0 座四楼
2	海口人民大道证券营业部	海南分公司	海口市人民大道 39 号南苑大厦三层北半幅

## 2、新设分支机构

序号	分支机构名称	注册地址
1	郑州金水东路证券营业部	河南省郑州市郑东新区金水东路黄河南路西南角聚龙城 7 号楼附 47、附 48 号商铺
2	通辽滨河大街证券营业部	内蒙古自治区通辽市科尔沁区团结办事处五委鑫成综合楼 A 座 1 单元 1-2 层-/101 号
3	佛山顺德国泰南路证券营业部	广东省佛山市顺德区大良街道德和社区国泰南路 6 号保利中悦花园 A 区 6 座 103、104、105 号

## 3、迁址分支机构

序号	迁址前分支机构名称	迁址后分支机构名称	迁址后地址
1	滨州分公司	滨州分公司	山东省滨州市经济技术开发区黄河五路以北渤海十八路以西帝堡广场 A 座 5 层北侧
2	菏泽分公司	菏泽分公司	山东省菏泽市开发区人民路 111 号交通未来城 8 号楼 1 单元 3 楼 (03004 室、03006-03010 室) 以及 1 楼大厅南区
3	宁波分公司	宁波分公司	浙江省宁波市鄞州区福明街道中山东路 1800 号 17-3-1、17-4 室
4	河南分公司	河南分公司	河南自贸试验区郑州片区 (郑东) 金水东路 80 号绿地新都会 9 号楼 1707、1708 号
5	山西分公司	山西分公司	山西省太原市万柏林区迎泽西大街 86 号信达国际金融中心 36 层 3601、3602、3611、3612 室
6	贵州分公司	贵州分公司	贵州省贵阳市贵阳国家高新技术产业开发区茅台国际商务中心 C 栋写字楼第 16 层 7、8、9、10



7	泰安岱宗大街证券营业部	泰安龙潭路证券营业部	泰安市泰山区龙潭路 68 号(泰安君达山海酒店一楼北侧商铺 A 区及一楼大厅北侧房间)
8	珠海情侣中路证券营业部	珠海情侣中路证券营业部	广东省珠海市吉大情侣中路 51 号二楼 203 号商铺
9	杭州求是路证券营业部	杭州湖墅南路证券营业部	浙江省杭州市拱墅区湖墅南路滨绿大厦 1 幢 701、706 室
10	文登米山路证券营业部	文登圣经山路证券营业部	山东省威海市文登区环山办圣经山路 199 号一楼东、5 楼、6 楼
11	芜湖镜湖路证券营业部	芜湖中山南路证券营业部	安徽省芜湖市弋江区中南街道中山南路 307 号国贸长江 DS-3#楼 01 室
12	运城槐东南路证券营业部	运城槐东南路证券营业部	山西省运城市盐湖区槐东南路国土公寓小区 1-2 层 3 号商铺
13	绍兴环城北路证券营业部	绍兴洋江西路证券营业部	浙江省绍兴市越城区灵芝街道洋江西路 278 号新泽大厦 2303 室、2304 室
14	成都新光华街证券营业部	成都新光华街证券营业部	四川省成都市锦江区新光华街 7 号航天科技大厦第 25 层第 05 号
15	上海东江湾路证券营业部	上海中山北一路证券营业部	上海市虹口区中山北一路 1230 号 1 幢 A201-2、A203-1 室
16	广州华穗路证券营业部	广州珠江东路证券营业部	广州市天河区珠江东路 6 号 1701 房自编 02 单元
17	莒南十泉路证券营业部	莒南民主路证券营业部	山东省临沂市莒南县民主路阜丰时代广场 12 号楼 105、106 铺
18	义乌城中北路证券营业部	义乌诚信大道证券营业部	浙江省义乌市福田街道诚信大道 367 号
19	蒙自天马路证券营业部	蒙自天马路证券营业部	云南省红河哈尼族彝族自治州蒙自市天马路 42 号蒙自天源大酒店一楼(天马路入口旁)
20	深圳前海大道证券营业部	深圳科苑南路证券营业部	深圳市南山区粤海街道高新区社区科苑南路 3099 号中国储能大厦 29 层 C-D 单元
21	潍坊东风西街证券营业部	潍坊东风西街证券营业部	山东省潍坊市潍城区东风西街 277 号 1 号楼南区一层东侧、南区二层及三层
22	三明列东街证券营业部	三明列东街证券营业部	福建省三明市三元区和仁新村 6 幢 20 层 2002 室
23	陕西西工大证券营业部	西安朱雀大街证券营业部	陕西省西安市碑林区朱雀大街北段 158 号五号楼裙楼四层一号
24	慈溪天九街证券营业部	慈溪新城大道证券营业部	浙江省慈溪市白沙路街道慈惠大厦(3-1)室 301 室
25	东阿前进街证券营业部	东阿前进街证券营业部	山东省聊城市东阿县前进街 159 号博学苑 1 号楼 1 单元 1 号商铺(一层南侧、二层)

26	滨州渤海七路证券营业部	滨州黄河六路证券营业部	山东省滨州市黄河小区沿街3号楼西1户
27	上海虹梅路证券营业部	上海申长路证券营业部	上海市闵行区申长路1588弄7-8号107-110室

## 4、撤销分支机构

序号	分支机构名称	注册地址
1	武汉光谷大道证券营业部	湖北省武汉市东湖新技术开发区金融港一路7号6号楼
2	新乡人民路证券营业部	新乡市红旗区牧野大道(中)166号天安明邸1号楼1201号商铺
3	咸阳渭阳东路证券营业部	陕西省咸阳市渭城区渭阳东路湖境尚都2-2-2号
4	肇东正阳大街证券营业部	黑龙江省绥化市肇东市城区北十八街农村信用联社办公楼
5	青岛香港中路民航大厦证券营业部	青岛市市南区香港中路30号民航大厦三层

报告期内，鲁证期货迁址1家期货分公司和6家期货营业部。此外，鲁证期货杭州营业部变更为杭州分公司。

序号	分支机构原名称	分支机构现名称	迁址后地址
1	上海分公司	上海分公司	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号20层(名义楼层,实际楼层18层)01、02B单元
2	上海营业部	上海营业部	中国(上海)自由贸易试验区浦电路438号1502A室(名义楼层1802A室)
3	宁波营业部	宁波营业部	宁波市鄞州区江东北路475号004幢宁波和丰创意广场意庭楼905-1室
4	广州营业部	广州营业部	广州市天河区天河路230号3001房(自编3008室)
5	青岛营业部	青岛营业部	山东省青岛市崂山区香港东路195号5号楼505-1室
6	潍坊营业部	潍坊营业部	山东省潍坊市潍城区东风西街277号1号楼001
7	淄博营业部	淄博营业部	淄博市张店区人民西路66号证券大厦9层西区

## 更名分支机构

序号	更名前分支机构名称	更名后分支机构名称	更名后地址
1	杭州营业部	杭州分公司	杭州市西湖区莫干山路231号锐明大厦4001室

## （二）子公司重要事项

公司本期注销 3 家子公司，包括 Jinova Limited、上海逸道资产管理有限公司、深圳市聚合润邦投资合伙企业（有限合伙）。

经公司总经理办公会决策，公司于 2021 年 8 月与鲁信集团签署协议，通过协议转让方式以 7,888 万元受让鲁信集团所持齐鲁股权 24.8889% 的股权。2021 年 12 月 30 日，完成股权转让工商变更登记。公司现持有齐鲁股权 60.8889% 的股权，齐鲁股权成为公司控股子公司。

## （三）资产负债表日后事项

### 1、发行债券

2022年1月14日，公司已完成中泰证券股份有限公司公开发行2022年公司债券（第一期）（代码：185246，简称：22中泰01）的发行工作，发行规模30亿元，债券期限为3年，债券票面利率为2.97%。

2022年2月21日，公司已完成中泰证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）（代码：185367，简称：22中泰C1）的发行工作，发行规模30亿元，债券期限为3年，债券票面利率为3.17%。

2022年2月23日，公司已完成中泰证券股份有限公司2022年度第一期短期融资券（代码：072210029，简称：22中泰证券CP001）的发行工作，发行规模10亿元，债券期限为275天，债券票面利率为2.53%，到期一次还本付息。

2022年3月21日，公司已完成中泰证券股份有限公司公开发行2022年公司债券（第二期）（代码：185558，简称：22中泰02）的发行工作，发行规模15亿元，债券期限为3年，债券票面利率为3.18%。

### 2、拟购买重大资产

2022年3月18日，公司第二届董事会第五十五次会议审议通过了《关于变更济南汉峪金谷办公楼相关事项的议案》。同意公司将原拟购济南汉峪金谷办公楼变更为云鼎大厦 7-46 层（含车位），总价款（含购房款、增值税，不含其他交易税费）不超过 17.38 亿元，资金来源为原拟购置汉峪金谷办公楼预付房款及利息 5.82 亿元、处置济南市中区证券大厦及其他房产回笼资金、部分现金等。

### 3、高级管理人员变更

公司首席风险官李恒第先生因个人原因申请辞去首席风险官职务，按照《公司章程》规定，首席风险官提出辞职需经董事会批准。2022年1月5日，公司召开第二届董事会第五十三次会议，同意李恒第先生辞去公司首席风险官职务；根据公司经营需要，聘任胡开南先生为公司首席风险官，任期自本次董事会审议通过之日起至公司第二届董事会换届完成之日止。具体内容详见公司2022年1月6日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司第二届董事会第五十三次会议决议公告》和《中泰证券股份有限公司关于首席风险官变更的公告》。

张云伟先生因个人原因，申请辞去公司总法律顾问职务。具体内容详见公司2022年1月6日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于总法律顾问辞职的公告》。

#### 4、利润分配预案

2022年3月29日，公司第二届董事会第五十六次会议审议通过《公司2021年度利润分配预案》，公司2021年度利润分配预案为：以公司总股本为基数，向实施权益分派股权登记日登记在册的全体股东每10股派发现金红利0.63元（含税）。按2021年末公司总股本6,968,625,756.00股计算，合计派发现金红利439,023,422.63元，不送红股，不以公积金转增股本。本预案尚需提交公司股东大会审议。

#### 5、诉讼事项

公司发生达到《上海证券交易所股票上市规则》规定的重大诉讼标准的案件 1 起，详情如下：2022 年 1 月上海君盈资产管理合伙企业（有限合伙）等两千名证券投资者诉乐视网信息技术（北京）股份有限公司及贾跃亭等十四名自然人、公司等三家证券公司和三家会计师事务所证券虚假陈述责任纠纷案，具体内容详见公司于 2022 年 1 月 18 日在上海证券交易所网站披露《中泰证券股份有限公司关于公司涉及诉讼事项的公告》。截至本报告披露之日，该事项无后续进展。

公司发生未达到《上海证券交易所股票上市规则》规定的重大诉讼标准，但涉案金额超过 5,000 万元的未决诉讼案件 1 起，详情如下：2022 年 2 月 21 日，中创环球控股有限公司（以下简称“中创环球”）主席及执行董事胡某某以个人身份，向香港高等法院诉请判决中创环球原董事长兼执行董事陈某某、中泰金融投资有限公司、中泰国际证券有限公司、中泰国际金融产品有限公司和中泰金融国际有限公司（合称“中泰国际及其子公司”）连同中泰国际时任董事高峰、王乐平、吕涛江和张延峰，共同向原告支付 2.6 亿港元和利息，以及其他法院认为合适的救济。原告主要指控中泰国际及其子公司涉嫌与陈某某在 2.5 亿港元贷款项目中，合谋欺骗中创环球全体股东及债权人。截至本报告披露之日，案件正在审理过程中。

## 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	6,271,763,180	90.00	0	0	0	-1,912,206,950	-1,912,206,950	4,359,556,230	62.56

股份									
1、国家持股	17,214,400	0.25	0	0	0	-17,214,400	-17,214,400	0	0
2、国有法人持股	4,844,650,630	69.52	0	0	0	-485,094,400	-485,094,400	4,359,556,230	62.56
3、其他内资持股	1,409,898,150	20.23	0	0	0	-1,409,898,150	-1,409,898,150	0	0
其中：境内非国有法人持股	1,409,898,150	20.23	0	0	0	-1,409,898,150	-1,409,898,150	0	0
境内自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、外资持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
其中：境外法人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
境外自然人持股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
二、无限售条件流通股	696,862,576	10.00	0	0	0	1,912,206,950	1,912,206,950	2,609,069,526	37.44
1、人民币普通股	696,862,576	10.00	0	0	0	1,912,206,950	1,912,206,950	2,609,069,526	37.44
2、境内上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
3、境外上市的外资股	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4、其他	0	0	0	0	0	0	0	0	0
三、股份总数	6,968,625,756	100.00	0	0	0	0	0	6,968,625,756	100.00

## 2、股份变动情况说明

√适用 □不适用

浙江海岳新材料有限公司于 2021 年 1 月 25 日、2 月 24 日、4 月 14 日通过非交易过户方式合计取得联合创业融资担保集团有限公司所持公司 1,920.00 万股限售股；钱紫阁于 2021 年 1 月 14 日通过非交易过户方式取得联合创业融资担保集团有限公司所持公司 360.00 万股限售股。

2021年6月3日，公司36家股东持有的首次公开发行限售股股份解除限售，股份数量合计为1,912,206,950股。本次解除限售后，公司无限售条件流通股股份由696,862,576股增加至2,609,069,526股，公司仍有4,359,556,230股限售股股份。具体内容详见公司2021年5月28日在上海证券交易所披露的《中泰证券股份有限公司部分首次公开发行限售股上市流通公告》。

2021年8月11日，公司股东济钢集团与莱钢集团签署《关于中泰证券股份有限公司国有股份无偿划转协议》，拟将其持有的公司351,729,000股股份（占公司总股本的5.05%）无偿划转至莱钢集团。2021年11月12日已完成股份过户登记手续。

### 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
济南西城投资发展有限公司	241,737,300	241,737,300	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东永通实业有限公司	203,366,300	203,366,300	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
德州禹佐投资中心（有限合伙）	183,415,900	183,415,900	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
安吉美舜企业管理中心（有限合伙）	152,523,400	152,523,400	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
上海弘康实业投资	122,021,900	122,021,900	0	0	A股首次	2021年6月3日

有限公司					公开发行 股份 限售	
烟台市广信投资发展有限责任公司	80,332,100	80,332,100	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
泰安点石资产管理有限责任公司	79,581,600	79,581,600	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
共青城瑞顿投资管理中心（有限合伙）	65,842,900	65,842,900	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东省宏恩投资有限公司	64,478,400	64,478,400	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
共青城汇泉投资管理合伙企业（有限合伙）	60,435,900	60,435,900	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
宁波梅山保税港区丰海投资有限公司	60,435,900	60,435,900	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东中通科技发展有限公司	55,342,900	55,342,900	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
霍氏文化产业集团有限公司	43,873,200	43,873,200	0	0	A 股首次公开发行	2021年6月3日

					股份限售	
烟台蓝天投资控股有限公司	43,460,000	43,460,000	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
苏州金安九鼎创业投资中心(有限合伙)	41,094,900	41,094,900	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东豪晟投资置业有限公司	40,672,200	40,672,200	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
淄博市城市资产运营有限公司	35,582,400	35,582,400	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
济宁市投资中心有限公司	35,303,300	35,303,300	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
联合创业集团有限公司	35,010,800	35,010,800	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
江苏新潮科技集团有限公司	30,506,800	30,506,800	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
威海产业投资集团有限公司	25,256,700	25,256,700	0	0	A股首次公开发行股份限售	2021年6月3日



山东省融资担保有限公司	24,173,100	24,173,100	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
浙江杭州湾投资有限公司	24,173,100	24,173,100	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
蓬莱市茂源建筑工程有限公司	22,046,450	22,046,450	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东天宝翔基机械有限公司	21,369,600	21,369,600	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东润邦能源科技有限公司	20,336,100	20,336,100	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
浙江海岳新材料有限公司	0	19,200,000	19,200,000	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东华联矿业股份有限公司	18,137,700	18,137,700	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
德州市财政局	17,214,400	17,214,400	0	0	A 股首次公开发行股份限售	2021年6月3日
山东环球渔具股份	14,502,600	14,502,600	0	0	A 股首次	2021年6月3日

有限公司					公开发 行股份 限售	
济南均土 源投资有 限公司	12,089,700	12,089,700	0	0	A 股 首次公 开发行 股份 限售	2021 年 6 月 3 日
江苏汇鸿 国际集团 畜产进出 口股份有 限公司	6,041,700	6,041,700	0	0	A 股 首次公 开发行 股份 限售	2021 年 6 月 3 日
中扶华夏 管理咨询 有限公司	5,411,300	5,411,300	0	0	A 股 首次公 开发行 股份 限售	2021 年 6 月 3 日
钱紫阁	0	3,600,000	3,600,000	0	A 股 首次公 开发行 股份 限售	2021 年 6 月 3 日
联合创业 融资担保 集团有限 公司	25,418,800	2,618,800	-22,800,000	0	A 股 首次公 开发行 股份 限售	2021 年 6 月 3 日
南山集团 有限公司	1,017,600	1,017,600	0	0	A 股 首次公 开发行 股份 限售	2021 年 6 月 3 日
莱芜钢铁 集团有限 公司	2,879,559,900	0	351,729,000	3,231,288,900	A 股 首次公 开发行 股份 限售	原持有的 2,879,559,9 00 股解除 限售期为 2023 年 6 月 3 日, 受让 的 351,729,000 股解除限售 期为 2026

						年 11 月 12 日
济钢集团有限公司	351,729,000	0	-351,729,000	0	转让股份	2021 年 11 月 12 日
合计	5,143,495,850	1,912,206,950	0	3,231,288,900	/	/

注：2021 年 4 月，山东润邦科技投资有限公司更名为“山东润邦能源科技有限公司”

## 二、证券发行与上市情况

### (一) 截至报告期内证券发行情况

√适用 □不适用

单位：亿股 币种：人民币

股票及其衍生证券的种类	发行日期	发行价格(或利率)	发行数量	上市日期	获准上市交易数量	交易终止日期
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)						
公司债券	2021-01-25	3.70%	25.00	2021-01-28	25.00	2024-01-25
短期融资券	2021-01-27	2.85%	25.00	2021-01-28	25.00	2021-04-26
次级债券	2021-03-04	4.25%	30.00	2021-03-10	30.00	2024-03-04
次级债券	2021-04-23	4.05%	40.00	2021-04-28	40.00	2024-04-23
短期融资券	2021-07-23	2.38%	25.00	2021-07-26	25.00	2021-10-11
公司债券	2021-08-27	3.10%	15.00	2021-09-02	15.00	2024-08-27
公司债券	2021-08-27	3.47%	15.00	2021-09-02	15.00	2026-08-27
短期公司债券	2021-09-27	2.85%	30.00	2021-10-11	30.00	2022-08-26
短期融资券	2021-10-22	2.90%	25.00	2021-10-25	25.00	2022-09-26
公司债券	2021-10-27	3.34%	30.00	2021-11-02	30.00	2024-10-27
公司债券	2021-11-19	3.14%	20.00	2021-11-25	20.00	2024-11-19
短期公司债券	2021-11-25	2.77%	30.00	2021-11-30	30.00	2022-10-27

截至报告期内证券发行情况的说明(存续期内利率不同的债券,请分别说明):

√适用 □不适用

1、2021 年 1 月,公司公开发行了面值人民币 25 亿元的公司债券“21 中泰 01”,债券期限 3 年,采用固定利率形式,票面利率 3.70%,单利按年计息,不计复利,每年付息一次,本期债券为无担保债券。

2、2021 年 1 月,公司公开发行了面值人民币 25 亿元的短期融资券“21 中泰证券 CP001”,债券期限 90 天,采用固定利率形式,票面利率 2.85%,到期一次还本付息,本期债券为无担保债券。

3、2021 年 3 月,公司公开发行了面值人民币 30 亿元的次级债券“21 中泰 C1”,债券期限 3 年,采用固定利率形式,票面利率 4.25%,单利按年计息,不计复利,每年付息一次,本期债券为无担保债券。

4、2021 年 4 月,公司公开发行了面值人民币 40 亿元的次级债券“21 中泰 C2”,债券期限 3 年,采用固定利率形式,票面利率 4.05%,单利按年计息,不计复利,每年付息一次,本期债券为无担保债券。

5、2021 年 7 月,公司公开发行了面值人民币 25 亿元的短期融资券“21 中泰证券 CP002”,债券期限 81 天,采用固定利率形式,票面利率 2.38%,到期一次还本付息,本期债券为无担保债券。

6、2021 年 8 月，公司公开发行了面值人民币 15 亿元的公司债券“21 中泰 02”，债券期限 3 年，采用固定利率形式，票面利率 3.10%，单利按年计息，不计复利，每年付息一次，本期债券为无担保债券。

7、2021 年 8 月，公司公开发行了面值人民币 15 亿元的公司债券“21 中泰 03”，债券期限 5 年，采用固定利率形式，票面利率 3.47%，单利按年计息，不计复利，每年付息一次，本期债券为无担保债券。

8、2021 年 9 月，公司公开发行了面值人民币 30 亿元的短期公司债券“21 中泰 S1”，债券期限 333 天，采用固定利率形式，票面利率 2.85%，到期一次还本付息，本期债券为无担保债券。

9、2021 年 10 月，公司公开发行了面值人民币 25 亿元的短期融资券“21 中泰证券 CP003”，债券期限 340 天，采用固定利率形式，票面利率 2.90%，到期一次还本付息，本期债券为无担保债券。

10、2021 年 10 月，公司公开发行了面值人民币 30 亿元的公司债券“21 中泰 04”，债券期限 3 年，采用固定利率形式，票面利率 3.34%，单利按年计息，不计复利，每年付息一次，本期债券为无担保债券。

11、2021 年 11 月，公司公开发行了面值人民币 20 亿元的公司债券“21 中泰 05”，债券期限 3 年，采用固定利率形式，票面利率 3.14%，单利按年计息，不计复利，每年付息一次，本期债券为无担保债券。

12、2021 年 11 月，公司公开发行了面值人民币 30 亿元的短期公司债券“21 中泰 S2”，债券期限 336 天，采用固定利率形式，票面利率 2.77%，到期一次还本付息，本期债券为无担保债券。

## (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)	144,223
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	146,368
截至报告期末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0
年度报告披露日前上一月末表决权恢复的优先股股东总数(户)	0

### (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	质押、标记或冻结 情况	股东 性质

				量	股份 状态	数量	
莱芜钢铁集团有限公司	351,729,000	3,231,288,900	46.37	3,231,288,900	无	0	国有法人
山东能源集团有限公司	0	458,091,900	6.57	458,091,900	无	0	国有法人
山东省鲁信投资控股集团有限公司	0	277,566,330	3.98	277,566,330	无	0	国有法人
新汶矿业集团有限责任公司	0	241,737,300	3.47	241,737,300	无	0	国有法人
山东永通实业有限公司	-1,685,100	201,681,200	2.89	0	无		境内非国有法人
济南西城投资发展有限公司	-55,584,816	186,152,484	2.67	0	无	0	国有法人
德州禹佐投资中心（有限合伙）	-5,122,700	178,293,200	2.56	0	质押	51,600,000	其他
山东省国有资产投资控股有限公司	0	120,871,800	1.73	120,871,800	无	0	国有法人
泰安点石资产管理有限公司	0	79,581,600	1.14	0	质押	79,581,600	国有法人
宁波梅山保税港区丰海投资有限公司	0	60,435,900	0.87	0	质押	15,000,000	境内非国有法人
前十名无限售条件股东持股情况							
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量					
		种类	数量				
山东永通实业有限公司	201,681,200	人民币普通股	201,681,200				
济南西城投资发展有限公司	186,152,484	人民币普通股	186,152,484				
德州禹佐投资中心（有限合伙）	178,293,200	人民币普通股	178,293,200				
泰安点石资产管理有限公司	79,581,600	人民币普通股	79,581,600				
宁波梅山保税港区丰海投资有限公司	60,435,900	人民币普通股	60,435,900				
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	54,560,355	人民币普通股	54,560,355				
山东省宏恩投资有限公司	51,627,700	人民币普通股	51,627,700				
香港中央结算有限公司	45,552,221	人民币普通股	45,552,221				

霍氏文化产业集团有限公司	43,873,200	人民币普通股	43,873,200
烟台蓝天投资控股有限公司	43,460,000	人民币普通股	43,460,000
前十名股东中回购专户情况说明	无		
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	无		
上述股东关联关系或一致行动的说明	截至报告期末，山东能源集团有限公司持有本公司 6.57% 的股份；新汶矿业集团有限责任公司是山东能源集团有限公司全资子公司，持有本公司 3.47% 的股份，山东能源集团有限公司与新汶矿业集团有限责任公司是一致行动人。山东永通实业有限公司持有本公司 2.89% 的股份，本公司董事刘锋及其配偶林旭燕通过其控制的永锋集团有限公司间接控股山东永通实业有限公司；德州禹佐投资中心（有限合伙）持有本公司 2.56% 的股份，本公司董事刘锋为其有限合伙人，刘锋及其配偶林旭燕分别间接和直接持有其普通合伙人山东诚业发展有限公司的股权，刘锋及其配偶林旭燕可对德州禹佐投资中心（有限合伙）施加重大影响。除前述情况外，公司未发现上述其他股东之间存在包括持股和任职在内的关联关系或《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用		

注：

2021 年 2 月，上海禹佐投资管理中心（有限合伙）更名为“德州禹佐投资中心（有限合伙）”。  
2021 年 4 月，兖矿集团有限公司更名为“山东能源集团有限公司”。

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

√适用 □不适用

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	莱芜钢铁集团有限公司	2,879,559,900	2023-6-3	0	自公司股票上市之日起满 36 个月
	莱芜钢铁集团有限公司	351,729,000	2026-11-12	0	自持股之日起满 60 个月
2	山东能源集团有限公司	458,091,900	2023-6-3	0	自公司股票上市之日起满 36 个月

3	山东省鲁信投资控股集团有限公司	277,566,330	2023-6-3	0	自公司股票上市之日起满 36 个月
4	新汶矿业集团有限责任公司	241,737,300	2023-6-3	0	自公司股票上市之日起满 36 个月
5	山东省国有资产投资控股有限公司	120,871,800	2023-6-3	0	自公司股票上市之日起满 36 个月
6	山东省财金投资集团有限公司	30,000,000	2023-6-3	0	自公司股票上市之日起满 36 个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		截至报告期末，山东能源集团有限公司持有本公司 6.57% 的股份；新汶矿业集团有限责任公司是山东能源集团有限公司全资子公司，持有本公司 3.47% 的股份，山东能源集团有限公司与新汶矿业集团有限责任公司是一致行动人。除前述情况外，公司未发现上述其他股东之间存在包括持股和任职在内的关联关系或《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情形。			

### (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	莱芜钢铁集团有限公司
单位负责人或法定代表人	李洪建
成立日期	1999-5-6
主要经营业务	对外派遣劳务人员(有效期限以许可证为准)。黑色金属冶炼、压延、加工；球团、焦及焦化产品、建筑材料的生产、销售；粒化高炉矿渣粉、水泥生产、销售；铁矿石销售；钢材销售及技术咨询服务；铸锻件、机电设备制造，机械加工；技术开发；备案范围内的进出口业务；仪器检测；工程设计，冶金废渣、废气综合利用；日用品销售；房屋租赁；干洗、广告业务；机电设备维修及安装；园林绿化工程、物业管理服务、建筑安装工程施工、市政工程施工、室内外装饰工程设计与施工、预制构件加工；有线电视网络设计、建设、运营、维护；广播影视节目制作、传送；文化产业服务；会务、展览服务；家用电子(电器)产品销售；党校教育培训；职业

	技能鉴定；企业管理咨询服务；承包本行业境外工程及境内国际招标工程；（以下限分支机构）烟（零售）酒糖茶，住宿、餐饮、文化娱乐服务；打字复印；许可范围内印刷；普通货运、客运、租赁；专用铁路运输；供水。（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）
报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况	山东钢铁（600022），持股 18.24%
其他情况说明	无

注：莱钢集团注册资本为 513,254.59 万元，总经理为李洪建。

## 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

2021 年 7 月 14 日，公司接间接控股股东山钢集团通知，山东省国资委正在与中国宝武钢铁集团有限公司筹划对山钢集团战略重组事项。该事项可能导致公司控股股东发生变化，但公司实际控制人仍为山东省国资委，未发生变化。具体内容详见公司 2021 年 7 月 15 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于涉及山东钢铁集团有限公司战略重组暨公司股东拟变更的提示性公告》。

2021 年 8 月 11 日，济钢集团与莱钢集团签署《关于中泰证券股份有限公司国有股份无偿划转协议》，拟将其持有的公司 351,729,000 股股份（占公司总股本的 5.05%）无偿划转至莱钢集团。2021 年 11 月 12 日，已完成股份过户登记手续。具体内容详见公司 2021 年 8 月 12 日在上海证券交易所披露的《中泰证券股份有限公司关于股东签署国有股权无偿划转协议的提示性公告》、2021 年 8 月 13 日披露的《简式权益变动报告书》、2021 年 8 月 19 日披露的《收购报告书》及 2021 年 11 月 16 日披露的《中泰证券股份有限公司关于股东国有股权无偿划转完成过户的公告》。

2021 年 11 月 30 日，莱钢集团分别与枣矿集团、高速投资签署了《关于中泰证券股份有限公司之股份转让协议》，莱钢集团拟将其持有的公司 1,815,254,297 股股份（占公司总股本的 26.05%）通过非公开协议转让方式转让至枣矿集团，将其持有的公司 370,740,740 股股份（占公司总股本的 5.32%）通过非公开协议转让方式转让至高速投资。2021 年 11 月 30 日，山能集团与枣矿集团签署了《国有股份无偿划转协议》，山能集团拟将其持有的公司 458,091,900 股股份（占公司总股本的 6.57%）无偿划转至枣矿集团。本次协议转让和本次无偿划转完成后，枣矿集团合计将持有公司 2,273,346,197 股股份（占公司总股本的 32.62%），与其一致行动人新矿集团合计持有公司 2,515,083,497 股股份（占公司总股本的 36.09%），莱钢集团将持有公司 1,045,293,863 股股份（占公司总股本的 15.00%），高速投资将持有公司 370,740,740 股股份（占公司总股本的 5.32%）。公司控股股东将由莱钢集团变更为枣矿集团，公司实际控制人仍为山东省国资委。具体内容详见

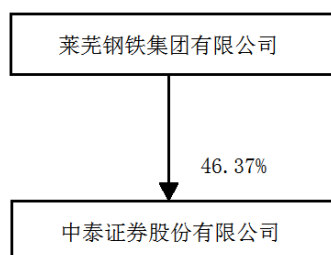


公司 2021 年 12 月 2 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于公司股东权益变动暨控股股东变更进展情况的公告》、2021 年 12 月 3 日披露的《简式权益变动报告书》和《收购报告书摘要》、2021 年 12 月 9 日披露的《收购报告书》。

枣矿集团已取得香港证券及期货事务监察委员会出具的函件，同意枣矿集团免于以要约方式收购公司控股子公司鲁证期货股份有限公司；取得国家市场监督管理总局出具的《经营者集中反垄断审查不实施进一步审查决定书》，国家市场监督管理总局对枣矿集团收购公司股权案不实施进一步审查。本次控股股东变更事项尚需中国证监会核准枣矿集团、高速投资的股东资格以及上海证券交易所对本次权益变动进行合规性确认，本次股权变动尚未完成过户登记手续。具体内容详见公司分别于 2022 年 1 月 7 日、2022 年 2 月 8 日、2022 年 3 月 8 日在上海证券交易所网站披露的《中泰证券股份有限公司关于股东权益变动暨控股股东变更进展情况的公告》。截至本报告披露之日，该事项尚无最新进展。

## 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	山东省人民政府国有资产监督管理委员会
主要经营业务	山东省人民政府国有资产监督管理委员会为山东省政府直属特设机构，山东省政府授权其代表履行出资人职责

#### 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

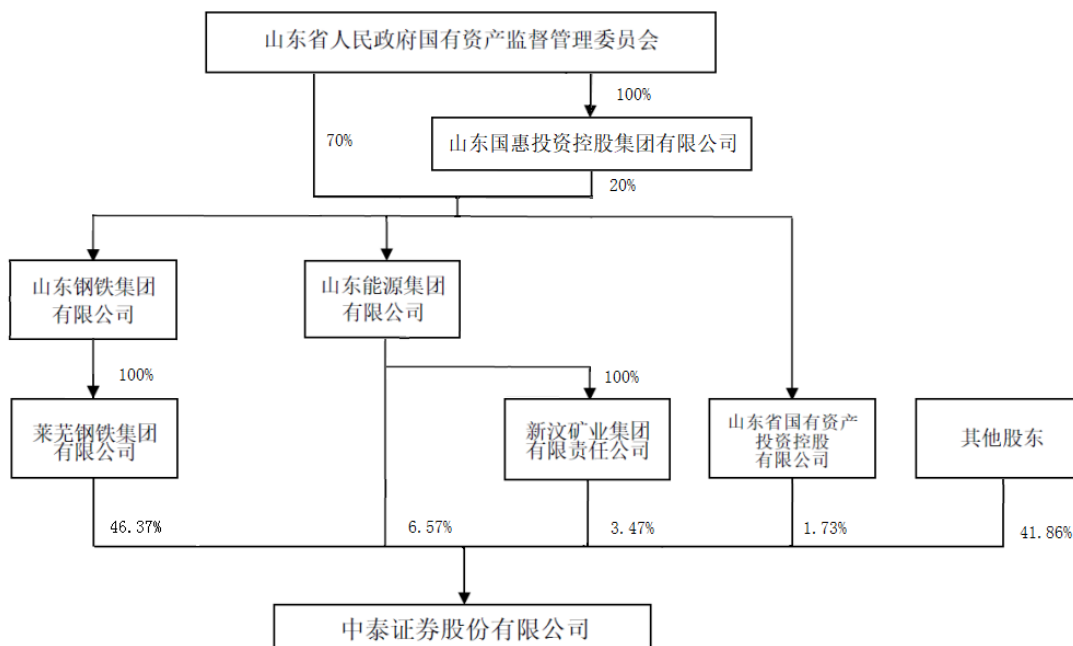
适用 不适用

#### 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

公司实际控制人山东省国资委通过公司股东莱钢集团、山能集团、新矿集团、山东省国有资产投资控股有限公司合计间接持有公司 58.15% 的股份。

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
中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券 (第三期)	19 中泰 C3	151594	2019-05-28	2019-05-28	2022-05-28	40.00	4.30	每年付息一次, 到期一次还本, 最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向合格投资者非公开发行	报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券 (第一期)	19 中泰 01	155433	2019-08-08	2019-08-08	2022-08-08	9.00	3.57	每年付息一次, 到期一次还本, 最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向合格投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司	19 中泰 02	163053	2019-12-09	2019-12-09	2022-12-09	20.00	3.56	每年付息一次, 到	上海	面向合格	竞价、	否

公司公开发行 2019 年公司债券（第二期）								期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	证券交易所	投资者公开发行	报价、询价和协议交易	
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第一期）（疫情防控债）	20 中泰 01	1636 26	2020-06-19	2020-06-19	2023-06-19	15.00	3.27	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第二期）	20 中泰 02	1637 67	2020-07-28	2020-07-28	2022-07-28	15.00	3.35	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第三期）	20 中泰 03	1753 23	2020-10-29	2020-10-29	2023-10-29	40.00	3.79	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年次级债券（第一期）	20 中泰 C1	1754 83	2020-11-27	2020-11-27	2023-11-27	30.00	4.55	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第一期）	21 中泰 01	1756 75	2021-01-25	2021-01-25	2024-01-25	25.00	3.70	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开	21 中泰 C1	1757 80	2021-03-04	2021-03-04	2024-03-04	30.00	4.25	每年付息一次，到期一次还	上海证	面向专业投资	竞价、报	否

发行 2021 年次级债券（第一期）								本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	券交易所	者公开发	价、询价和协议交易	
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年次级债券（第二期）	21 中泰 C2	188032	2021-04-23	2021-04-23	2024-04-23	40.00	4.05	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第二期）品种一	21 中泰 02	188647	2021-08-27	2021-08-27	2024-08-27	15.00	3.10	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第二期）品种二	21 中泰 03	188648	2021-08-27	2021-08-27	2026-08-27	15.00	3.47	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年短期公司债券（第一期）	21 中泰 S1	188815	2021-09-27	2021-09-27	2022-08-26	30.00	2.85	到期一次还本付息	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第三期）	21 中泰 04	188928	2021-10-27	2021-10-27	2024-10-27	30.00	3.34	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债	21 中泰 05	185028	2021-11-19	2021-11-19	2024-11-19	20.00	3.14	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息	上海证券交	面向专业投资者公开发	竞价、报价、询价	否

券（第四期）								随本金的兑付一起支付	易所	行	和协议交易	
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年短期公司债券（第二期）	21 中泰 S2	185037	2021-11-25	2021-11-25	2022-10-27	30.00	2.77	到期一次还本付息	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2022 年公司债券（第一期）	22 中泰 01	185246	2022-01-14	2022-01-14	2025-01-14	30.00	2.97	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）	22 中泰 C1	185367	2022-02-21	2022-02-21	2025-02-21	30.00	3.17	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰证券股份有限公司公开发行 2022 年公司债券（第二期）	22 中泰 02	185558	2022-03-21	2022-03-21	2025-03-21	15	3.18	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	上海证券交易所	面向专业投资者公开发行	竞价、报价、询价和协议交易	否
中泰国际*（*正式名称 Zhongtai International Finance(BVI) Company Ltd300,000,000 美元 3.85% 担保债券于 2023 年到期）	-	XS2203111120	2020-08-12	2020-08-12	2023-08-12	3 亿美元	3.85	每半年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	香港交易所上市（场外交易市场	S 条例下的专业投资者	询价交易	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
中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券(第一期)	2021 年 2 月 8 日到期兑付
中泰证券股份有限公司非公开发行 2018 年公司债券(第二期)	2021 年 4 月 26 日到期兑付
中泰证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券(第一期)	2021 年 12 月 13 日到期兑付
中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券(第一期)	2021 年 1 月 25 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券(第二期)	2021 年 3 月 11 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券(第三期)	2021 年 5 月 28 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券(第一期)	2021 年 8 月 9 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券(第二期)	2021 年 12 月 9 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司非公开发行 2020 年公司债券(第一期)	2021 年 3 月 17 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券(第一期)(疫情防控债)	2021 年 6 月 21 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司非公开发行 2020 年公司债券(第二期)	2021 年 8 月 30 日到期兑付
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券(第二期)	2021 年 7 月 28 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券(第三期)	2021 年 10 月 29 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年次级债券(第一期)	2021 年 11 月 29 日按时足额付息
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年短期公司债券(第一期)	2021 年 11 月 9 日到期兑付
中泰国际* (*正式名称 Zhongtai International Finance(BVI) Company Ltd300,000,000 美元 3.85% 担保债券于 2023 年到期)	2021 年 2 月 12 日、2021 年 8 月 12 日按时付息
中泰国际发行(2020 年 9 月 14 日发行,票面利率为 5.50%)的私募债	2021 年 3 月 14 日到期兑付
中泰国际发行(2020 年 9 月 28 日发行、票面利率为 5.50%)的私募债	2021 年 3 月 28 日到期兑付
中泰国际发行(2021 年 3 月 16 日发行、票面利率为 5.00%)的私募债	2021 年 9 月 16 日到期兑付

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

中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	联系人	联系电话
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 8 层	王贡勇、路清、吕玉磊	吕玉磊	010-65542288
容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26	吴强、汪玉寿、倪士明	倪士明	010-66001391
渤海证券股份有限公司	天津市南开区水上公园东路宁汇大厦 1 号	-	魏利军	022-23861685
国信证券股份有限公司	北京市西城区金融大街兴盛街 6 号国信证券大厦 4 层	-	郭睿	010-88005006
中信建投证券股份有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B、E 座 2 层	-	王森、申伟	010-65608411 010-86451352
北京金诚同达律师事务所	济南市历下区经十路 12111 号中润世纪锋 1 号楼 10 层	-	喻平保、孙文婷	0531-86465166
中诚信国际信用评级有限责任公司	北京市东城区朝阳门内大街南竹杆胡同 2 号银河 SOHO6 号楼	-	张云鹏、谭嘉庆	010-66428877

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
中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券(第三期)	40.00	40.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开	9.00	9.00	0.00	募集资金专项账户运作	无	是



发行 2019 年公司债券（第一期）				规范		
中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券（第二期）	20.00	20.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第一期）（疫情防控债）	15.00	15.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第二期）	15.00	15.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第三期）	40.00	40.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年次级债券（第一期）	30.00	30.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第一期）	25.00	25.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年次级债券（第一期）	30.00	30.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年次级债券（第二期）	40.00	40.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第二期）品种一	15.00	15.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份	15.00	15.00	0.00	募集资金专	无	是

有限公司公开发行 2021 年公司债券（第二期）品种二				项账户运作规范		
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年短期公司债券（第一期）	30.00	30.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第三期）	30.00	30.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第四期）	20.00	20.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年短期公司债券（第二期）	30.00	30.00	0.00	募集资金专项账户运作规范	无	是
中泰国际 3 亿美元债	19.38	19.38	0	募集资金专项账户运作规范	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

债券名称	信用评级机构名称	信用评级级别	评级展望变动	信用评级结果变化的原因
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年次级债券（第一期）	中诚信国际信用评级有限责任公司	AAA	评级展望为稳定	公司上市后，资本实力有所增强，整体业务稳健增长，盈利水平提高，近年来公司合规经营水平保持良好。
中泰证券股份有限公司公开发行	中诚信国际信用评级有限责任公司	AAA	评级展望为稳定	公司上市后，资本实力有所增强，整体业务稳健增长，盈利水平提高，近年

2021 年次级债券（第一期）				来公司合规经营水平保持良好。
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年次级债券（第二期）	中诚信国际信用评级有限责任公司	AAA	评级展望为稳定	公司上市后，资本实力有所增强，整体业务稳健增长，盈利水平提高，近年来公司合规经营水平保持良好。

## 其他说明

√适用 □不适用

报告期内，中诚信国际信用评级有限责任公司决定维持中泰证券股份有限公司的主体信用等级为 AAA，评级展望为稳定，将公司发行的“20 中泰 C1”、“21 中泰 C1”和“21 中泰 C2”的债项信用等级由 AA+调升至 AAA。

## 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机构批准	变更对债券投资者权益的影响
根据募集说明书约定，制定偿债计划及偿债保障措施	按照募集说明书约定执行	否	不适用	不适用	不适用	不适用
根据募集说明书约定，提前准备偿债资金，对偿债保障措施做出承诺及制定救济措施	按照募集说明书约定执行	否	不适用	不适用	不适用	不适用

报告期内，公司按时、足额支付债券利息和/或本金，偿债账户运作规范，与募集说明书的相关承诺保持一致。

## 7. 公司债券其他情况的说明

□适用 √不适用

## (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	3,104,894,896.59	2,460,643,554.32	26.18	
流动比率	1.77	1.77	0.00	
速动比率	1.77	1.76	0.57	
资产负债率 (%)	74.97	73.53	增加 1.44 个百分点	
EBITDA 全部债务比	0.08	0.07	14.29	
利息保障倍数	2.39	2.26	5.75	
现金利息保障倍数	2.07	1.99	4.02	
EBITDA 利息保障倍数	2.55	2.36	8.05	
贷款偿还率 (%)	100.00	100.00	0.00	
利息偿付率 (%)	100.00	100.00	0.00	

## 二、可转换公司债券情况

适用 不适用

## 第十节 财务报告

## 一、审计报告

适用 不适用

## 审计报告

容诚审字[2022]251Z0102号

中泰证券股份有限公司全体股东：

## 一、审计意见

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

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

## 二、形成审计意见的基础

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

## 三、关键审计事项

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

### （一）融出资金、买入返售金融资产、债权投资和其他债权投资减值准备的评估

#### 1、事项描述

如财务报表附注七、5、11、14 和 15 所述，2021 年 12 月 31 日，中泰证券采用预期信用损失模型进行减值测算的金融工具主要包括融出资金、买入返售金融资产、债权投资和其他债权投资，上述金融资产账面价值合计为 712.99 亿元，占总资产的 34.83%；上述金融资产已确认的减值准备合计为 16.64 亿元。中泰证券根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》，运用三阶段减值模型计量预期信用损失，由于中泰证券上述金融资产金额较大，结果对财务报表影响重大，且其减值评估需要中泰证券管理层（以下简称管理层）作出主观判断和重大估计，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

#### 2、审计应对

我们对上述资产减值评估实施相关程序包括：

- （1）评估并测试了与金融工具减值测试相关的关键内部控制的设计和运行的有效性；
- （2）对资产减值阶段的划分结果与预期信用损失的划分标准进行对比分析；
- （3）检查评估所用的模型及方法的适当性及一贯性、预估损失率的合理性等；重新计算减值准备以验证其准确性；

(4) 检查管理层用于计算抵押资产的市场价值；获取管理层的评估记录及交易对手方资料，关注客户过往的还款历史，进而综合判断管理层估计的合理性。

## (二) 金融工具公允价值的评估

### 1、事项描述

如附注十二、1 所述，截至 2021 年 12 月 31 日，中泰证券以公允价值计量的金融资产总额为 778.72 亿元。其中，公允价值属于第一层次、第二层次和第三层次的金融资产分别为 387.20 亿元、315.48 亿元和 76.04 亿元。中泰证券金融工具的估值是以市场数据和估值模型相结合为基础，在对第三层次金融工具进行估值时，部分重大输入值并非基于可观察的市场数据。由于在对第三层次金融工具估值时，管理层需要对所采用的重大不可观察输入值作出重大估计及判断，因此我们将其确定为关键审计事项。

### 2、审计应对

我们对金融工具公允价值的评估实施的相关程序包括：

- (1) 评估并测试了与估值相关的关键内部控制的设计和运行的有效性；
- (2) 通过将公司采用的公允价值与公开可获取的市场数据进行比较，评价公司对所有在活跃市场交易的金融工具的估值的准确性；
- (3) 评价公司用于公允价值属于第二层次和第三层次金融工具的估值所使用的模型，同时，选取样本对公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具进行独立估值，并将我们的估值结果与公司的估值结果进行对比分析。

## (三) 结构化主体合并范围的确定

### 1、事项描述

如财务报表附注三、2 及十、1 所述，截至 2021 年 12 月 31 日，中泰证券作为管理人或作为投资人以自有资金持有份额的结构化主体纳入合并范围的资产总额为 98.33 亿元，占合并财务报表资产总额的 4.80%。

根据《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》之规定，合并财务报表的合并范围应当以控制为基础予以确定。管理层根据控制的三要素对是否控制结构化主体进行判断：(1) 中泰证券是否拥有对结构化主体的权力；(2) 中泰证券是否通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报；(3) 中泰证券是否有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。为此，管理层应对是否控制结构化主体予以判断。由于该事项涉及管理层的重大判断，我们将该事项确认为合并财务报表审计的关键审计事项。

### 2、审计应对

我们对结构化主体合并范围的确定实施相关程序包括：

- (1) 测试与管理层确定结构化主体是否纳入合并范围相关的关键控制；
- (2) 获取了相关资产管理产品及投资产品的合同、产品说明书等，并运用控制三要素评估管理层对控制的判断是否合理；

(3) 检查了中泰证券纳入合并范围及未纳入合并范围的结构化主体相关披露的充分性,以判断其是否符合《企业会计准则第 33 号—合并财务报表》之相关规定。

#### 四、其他信息

管理层对其他信息负责。其他信息包括中泰证券 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到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。

#### 五、管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时,管理层负责评估中泰证券的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项,并运用持续经营假设,除非管理层计划清算中泰证券、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督中泰证券的财务报告过程。

#### 六、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序。

(三) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中泰证券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果

我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中泰证券不能持续经营。

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

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

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

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

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。

容诚会计师事务所  
(特殊普通合伙)

中国注册会计师：吴强  
(项目合伙人)

中国注册会计师：汪玉寿

中国·北京

中国注册会计师：倪士明

2022年3月29日

## 二、财务报表

### 合并资产负债表

2021年12月31日

编制单位：中泰证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年12月31日	2020年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	七、1	46,090,288,079.05	36,651,600,637.15



其中：客户资金存款	七、1	40,424,121,995.23	32,266,259,169.30
结算备付金	七、2	11,097,890,604.20	8,827,027,434.56
其中：客户备付金	七、2	8,664,534,703.53	6,713,988,018.44
贵金属			
拆出资金			
融出资金	七、5	35,821,147,194.79	31,206,744,639.54
衍生金融资产	七、6	430,613,618.22	270,143,072.50
存出保证金	七、7	10,284,255,949.87	8,982,591,206.22
应收款项	七、8	1,572,351,957.16	1,008,821,124.39
应收款项融资			
合同资产	七、10	18,834,724.14	6,461,613.75
买入返售金融资产	七、11	12,474,745,640.83	9,160,815,458.42
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产	七、13	53,385,599,334.16	46,526,715,197.97
债权投资	七、14	2,197,335,613.93	3,732,092,907.91
其他债权投资	七、15	20,806,019,158.84	17,759,974,678.54
其他权益工具投资	七、16	3,249,721,525.98	5,964,824,777.85
长期股权投资	七、17	937,490,105.79	840,538,978.51
投资性房地产	七、18	1,141,381,313.10	455,042,060.54
固定资产	七、19	918,573,195.27	892,159,550.65
在建工程	七、20	727,952,539.42	6,064,308.53
使用权资产	七、21	661,924,830.84	
无形资产	七、22	219,638,420.68	206,497,460.44
商誉			
递延所得税资产	七、24	1,015,034,071.31	951,180,194.21
其他资产	七、25	1,638,966,993.20	1,060,265,114.02
资产总计		204,689,764,870.78	174,509,560,415.70
<b>负债：</b>			
短期借款	七、29	4,245,356,203.37	4,622,149,402.73
应付短期融资款	七、30	12,910,778,536.39	11,604,103,001.41
拆入资金	七、31	2,785,248,841.87	2,038,836,747.11
交易性金融负债	七、32	54,450,766.68	8,014,669.01
衍生金融负债	七、6	367,267,613.78	320,183,242.11
卖出回购金融资产款	七、33	36,995,348,838.82	31,603,737,261.85
代理买卖证券款	七、34	56,213,164,519.52	44,434,372,998.58
代理承销证券款	七、35	5,650,010.43	2,963,337.06
应付职工薪酬	七、36	2,653,875,665.52	2,386,986,778.18
应交税费	七、37	515,121,097.97	733,796,178.45
应付款项	七、38	3,415,541,309.95	1,911,785,575.07
合同负债	七、39	51,724,061.22	31,205,667.32
持有待售负债			
预计负债	七、41	1,430,522.07	29,568,504.39
长期借款	七、42	301,076,695.50	324,594,588.81
应付债券	七、43	43,525,535,155.58	32,805,189,719.93
其中：优先股			
永续债			
租赁负债	七、44	653,224,021.22	

递延收益	七、45	2,396,028.00	
递延所得税负债	七、24	822,187,410.41	505,440,524.78
其他负债	七、46	2,010,622,531.99	6,716,884,970.16
负债合计		167,529,999,830.29	140,079,813,166.95
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	七、47	6,968,625,756.00	6,968,625,756.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	七、49	13,085,961,776.46	13,084,704,526.59
减：库存股			
其他综合收益	七、51	-301,345,141.69	-361,669,126.18
盈余公积	七、52	2,396,132,802.71	2,081,635,058.54
一般风险准备	七、53	6,022,375,667.28	5,356,840,035.07
未分配利润	七、54	7,618,164,146.85	6,148,119,860.94
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		35,789,915,007.61	33,278,256,110.96
少数股东权益		1,369,850,032.88	1,151,491,137.79
所有者权益（或股东权益）合计		37,159,765,040.49	34,429,747,248.75
负债和所有者权益（或股东权益）总计		204,689,764,870.78	174,509,560,415.70

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

### 母公司资产负债表

2021年12月31日

编制单位：中泰证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年12月31日	2020年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金		32,242,078,271.70	27,989,827,406.84
其中：客户资金存款		29,862,508,105.10	25,988,278,930.81
结算备付金		11,273,482,164.77	8,949,041,030.56
其中：客户备付金		7,642,742,321.75	6,713,988,018.44
贵金属			
拆出资金			
融出资金		34,556,474,321.33	30,085,911,990.66
衍生金融资产		185,046,074.41	176,565,737.30
存出保证金		1,556,853,334.03	2,871,478,534.45
应收款项		597,342,892.03	380,714,201.00
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产		10,150,996,426.39	7,593,113,606.19
持有待售资产			
<b>金融投资：</b>			
交易性金融资产		43,407,587,828.17	37,438,751,607.40

债权投资			
其他债权投资		19,608,886,289.48	17,759,974,678.54
其他权益工具投资		4,767,096,117.17	7,744,968,168.69
长期股权投资	十九、1	10,586,062,807.93	8,335,070,165.13
投资性房地产		9,631,125.58	15,067,217.80
固定资产		312,095,817.04	263,853,473.30
在建工程			
使用权资产		579,412,957.25	
无形资产		177,493,713.89	158,616,260.02
商誉			
递延所得税资产		823,652,974.10	790,480,973.30
其他资产		2,748,858,933.12	700,307,245.98
资产总计		173,583,052,048.39	151,253,742,297.16
<b>负债：</b>			
短期借款			
应付短期融资款		13,891,453,974.74	12,579,476,019.72
拆入资金		2,507,527,084.87	1,507,510,950.31
交易性金融负债			
衍生金融负债		223,865,018.79	207,697,756.64
卖出回购金融资产款		36,092,989,381.08	35,962,040,221.29
代理买卖证券款		38,593,663,529.44	32,782,973,977.13
代理承销证券款			
应付职工薪酬	十九、2	2,092,956,493.03	1,952,492,679.41
应交税费		377,244,045.03	670,491,008.85
应付款项		1,987,759,096.47	1,663,380,187.51
合同负债		16,360,517.28	10,113,648.50
持有待售负债			
预计负债		317,245.29	102,539.59
长期借款			
应付债券		41,588,826,643.68	30,826,513,928.06
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		561,251,135.49	
递延收益			
递延所得税负债		476,002,596.51	440,094,782.94
其他负债		375,003,472.51	338,800,839.42
负债合计		138,785,220,234.21	118,941,688,539.37
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）		6,968,625,756.00	6,968,625,756.00
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积		12,853,257,732.67	12,852,639,623.42
减：库存股			
其他综合收益		250,930,603.76	163,326,545.77
盈余公积		2,398,298,604.68	2,083,800,860.51
一般风险准备		5,840,667,863.95	5,211,642,713.41
未分配利润		6,486,051,253.12	5,032,018,258.68

所有者权益（或股东权益）合计		34,797,831,814.18	32,312,053,757.79
负债和所有者权益（或股东权益）总计		173,583,052,048.39	151,253,742,297.16

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

## 合并利润表

2021年1—12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年度	2020年度
一、营业总收入		13,149,669,222.30	10,352,224,019.84
利息净收入	七、55	1,792,807,446.69	2,082,828,785.20
其中：利息收入	七、55	5,102,629,489.38	4,847,619,086.08
利息支出	七、55	3,309,822,042.69	2,764,790,300.88
手续费及佣金净收入	七、56	6,386,935,837.93	5,193,989,578.05
其中：经纪业务手续费净收入	七、56	4,349,369,456.47	3,600,295,034.89
投资银行业务手续费净收入	七、56	1,280,672,303.52	1,092,454,364.32
资产管理业务手续费净收入	七、56	558,496,390.72	327,769,988.85
投资收益（损失以“-”号填列）	七、57	2,398,441,556.01	1,660,443,628.08
其中：对联营企业和合营企业的投资收益	七、57	206,451,764.88	105,924,138.05
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）	七、57	7,618,253.87	1,493,673.35
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益	七、59	82,134,174.52	77,376,697.94
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	七、60	826,400,010.19	428,392,065.24
汇兑收益（损失以“-”号填列）		20,876,582.83	37,382.28
其他业务收入	七、61	1,598,292,991.25	900,413,570.54
资产处置收益（损失以“-”号填列）	七、62	43,780,622.88	8,742,312.51
二、营业总支出		8,854,942,493.91	7,035,456,781.41
税金及附加	七、63	79,842,974.74	79,877,246.83
业务及管理费	七、64	6,483,910,118.42	5,701,571,886.70
信用减值损失	七、65	761,462,408.26	401,680,980.92
其他资产减值损失	七、66	1,727,848.53	
其他业务成本	七、67	1,527,999,143.96	852,326,666.96
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		4,294,726,728.39	3,316,767,238.43
加：营业外收入	七、68	24,393,385.41	2,245,015.84
减：营业外支出	七、69	20,509,272.09	43,740,381.00
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,298,610,841.71	3,275,271,873.27
减：所得税费用	七、70	999,244,885.77	693,966,305.01
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,299,365,955.94	2,581,305,568.26
（一）按经营持续性分类			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		3,299,365,955.94	2,581,305,568.26
2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
（二）按所有权归属分类			

1. 归属于母公司股东的净利润（净亏损以“-”号填列）		3,200,009,354.36	2,525,298,270.86
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		99,356,601.58	56,007,297.40
六、其他综合收益的税后净额		72,058,636.63	65,827,137.10
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额	七、71	72,632,541.00	62,176,444.06
（一）不能重分类进损益的其他综合收益	七、71	34,028,036.85	383,092,256.27
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益	七、71	-1,746,175.99	62,180,898.37
3. 其他权益工具投资公允价值变动	七、71	35,774,212.84	320,911,357.90
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
（二）将重分类进损益的其他综合收益	七、71	38,604,504.15	-320,915,812.21
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	七、71	72,254,345.62	-203,580,682.36
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用损失准备	七、71	-1,460,954.46	-39,852,032.77
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额	七、71	-32,188,887.01	-77,483,097.08
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	七、71	-573,904.37	3,650,693.04
七、综合收益总额		3,371,424,592.57	2,647,132,705.36
归属于母公司所有者的综合收益总额		3,272,641,895.36	2,587,474,714.92
归属于少数股东的综合收益总额		98,782,697.21	59,657,990.44
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）		0.46	0.36
（二）稀释每股收益（元/股）		0.46	0.36

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

### 母公司利润表

2021年1—12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年度	2020年度
一、营业总收入		9,042,886,773.83	8,041,838,896.62
利息净收入	十九、3	1,333,669,265.22	1,638,196,824.95
其中：利息收入	十九、3	4,314,808,186.08	4,069,899,450.46
利息支出	十九、3	2,981,138,920.86	2,431,702,625.51
手续费及佣金净收入	十九、4	5,407,135,898.88	4,554,162,174.21
其中：经纪业务手续费净收入	十九、4	4,034,510,138.18	3,466,048,282.34
投资银行业务手续费净收入	十九、4	1,208,078,918.68	962,133,210.59
资产管理业务手续费净收入	十九、4		
投资收益（损失以“-”号填列）	十九、5	2,202,932,757.96	1,302,839,180.00

其中：对联营企业和合营企业的投资收益	十九、5	155,994,533.55	116,520,429.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益（损失以“-”号填列）			
其他收益		44,807,335.91	38,876,810.16
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	十九、6	43,123,144.14	468,536,739.21
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-473,384.78	-1,423,755.21
其他业务收入		11,311,385.84	32,745,253.97
资产处置收益（损失以“-”号填列）		380,370.66	7,905,669.33
二、营业总支出		5,282,329,529.86	4,990,437,057.73
税金及附加		51,631,260.97	58,403,782.08
业务及管理费	十九、7	5,264,682,633.81	4,763,873,541.36
信用减值损失		-34,904,530.69	157,840,999.97
其他资产减值损失			
其他业务成本		920,165.77	10,318,734.32
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		3,760,557,243.97	3,051,401,838.89
加：营业外收入		18,171,772.25	1,708,857.83
减：营业外支出		17,059,824.91	12,271,848.12
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,761,669,191.31	3,040,838,848.60
减：所得税费用		616,691,749.61	614,735,347.85
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,144,977,441.70	2,426,103,500.75
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		3,144,977,441.70	2,426,103,500.75
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）			
六、其他综合收益的税后净额		99,762,712.84	3,191,546.91
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		22,319,237.09	246,624,262.04
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动		22,319,237.09	246,624,262.04
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		77,443,475.75	-243,432,715.13
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		79,098,861.75	-203,580,682.36
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用损失准备		-1,655,386.00	-39,852,032.77
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		3,244,740,154.54	2,429,295,047.66

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

## 合并现金流量表

2021年1—12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年度	2020年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
向其他金融机构拆入资金净增加额		746,395,686.87	
收取利息、手续费及佣金的现金		12,843,363,233.63	11,479,181,021.22
拆入资金净增加额			
返售业务资金净减少额			3,323,772,451.44
回购业务资金净增加额		5,388,410,193.83	6,110,630,873.81
代理买卖证券收到的现金净额		11,778,791,520.94	10,939,900,291.38
代理承销证券收到的现金净额		2,686,673.37	208,349.12
收到其他与经营活动有关的现金	七、72	3,636,456,612.80	2,959,143,523.63
经营活动现金流入小计		34,396,103,921.44	34,812,836,510.60
为交易目的而持有的金融资产净增加额		4,454,669,604.08	11,758,214,226.00
拆出资金净增加额			
向其他金融机构拆入资金净减少额			1,526,670,445.68
拆入资金净减少额			
融出资金净增加额		4,589,066,794.63	7,684,728,055.08
返售业务资金净增加额		3,289,509,852.95	
代理承销证券支付的现金净额			
支付利息、手续费及佣金的现金		3,549,649,082.91	3,187,330,149.44
支付给职工及为职工支付的现金		4,367,116,070.40	3,527,207,685.70
支付的各项税费		1,603,904,888.17	1,173,623,947.75
支付其他与经营活动有关的现金	七、72	10,270,112,919.05	3,806,290,308.72
经营活动现金流出小计		32,124,029,212.19	32,664,064,818.37
经营活动产生的现金流量净额		2,272,074,709.25	2,148,771,692.23
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		635,892,338.30	864,873,464.73
取得投资收益收到的现金		1,409,886,695.21	1,078,682,823.37
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		21,634,011.87	36,378,742.92
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金	七、72	278,842,034.06	
投资活动现金流入小计		2,346,255,079.44	1,979,935,031.02
投资支付的现金			
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		2,497,271,532.15	210,117,819.40
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		2,497,271,532.15	210,117,819.40
投资活动产生的现金流量净额		-151,016,452.71	1,769,817,211.62
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			2,924,280,854.03
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		522,279,324.82	26,733,077,706.81

发行债券收到的现金		45,442,298,333.60	49,434,687,386.06
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		45,964,577,658.42	79,092,045,946.90
偿还债务支付的现金		34,465,794,967.70	66,738,823,571.56
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,723,686,375.27	2,184,421,326.11
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		12,365,600.79	4,803,122.27
支付其他与筹资活动有关的现金	七、72	210,944,264.87	6,037,949,693.42
筹资活动现金流出小计		37,400,425,607.84	74,961,194,591.09
筹资活动产生的现金流量净额		8,564,152,050.58	4,130,851,355.81
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-16,679,656.24	-76,597,208.28
五、现金及现金等价物净增加额		10,668,530,650.88	7,972,843,051.38
加：期初现金及现金等价物余额		44,967,138,284.74	36,994,295,233.36
六、期末现金及现金等价物余额		55,635,668,935.62	44,967,138,284.74

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

## 母公司现金流量表

2021年1—12月

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021年度	2020年度
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
向其他金融机构拆入资金净增加额		1,000,000,000.00	
收取利息、手续费及佣金的现金		10,929,196,264.35	9,762,340,489.01
拆入资金净增加额			
返售业务资金净减少额			3,476,178,690.43
回购业务资金净增加额		131,582,369.84	7,453,047,308.20
代理买卖证券收到的现金净额		5,810,689,552.31	6,216,465,701.73
收到其他与经营活动有关的现金		1,685,700,854.74	1,022,915,920.85
经营活动现金流入小计		19,557,169,041.24	27,930,948,110.22
为交易目的而持有的金融资产净增加额		4,545,651,397.23	9,276,608,532.59
拆出资金净增加额			
向其他金融机构拆入资金净减少额			1,500,000,000.00
融出资金净增加额		4,385,991,618.96	7,730,674,539.04
拆入资金净减少额			
返售业务资金净增加额		2,572,215,340.11	
支付利息、手续费及佣金的现金		2,896,594,657.14	2,513,913,319.32
支付给职工及为职工支付的现金		3,685,247,820.48	2,950,651,857.87
支付的各项税费		1,262,140,488.44	848,535,039.97
支付其他与经营活动有关的现金		1,924,463,649.33	1,290,179,277.53
经营活动现金流出小计		21,272,304,971.69	26,110,562,566.32
经营活动产生的现金流量净额		-1,715,135,930.45	1,820,385,543.90
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金			



取得投资收益收到的现金		1,429,472,731.79	779,371,070.99
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		19,439,991.09	33,690,118.13
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		1,448,912,722.88	813,061,189.12
投资支付的现金		796,746,029.39	2,048,035,602.60
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		291,137,821.14	190,086,934.43
支付其他与投资活动有关的现金		2,021,830,000.00	
投资活动现金流出小计		3,109,713,850.53	2,238,122,537.03
投资活动产生的现金流量净额		-1,660,801,127.65	-1,425,061,347.91
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
吸收投资收到的现金			2,924,280,854.03
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		47,019,086,129.00	49,442,893,028.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		47,019,086,129.00	52,367,173,882.03
偿还债务支付的现金		35,058,523,973.00	39,193,145,655.92
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		2,503,233,082.65	1,904,741,115.86
支付其他与筹资活动有关的现金		189,854,510.35	6,000,000,000.00
筹资活动现金流出小计		37,751,611,566.00	47,097,886,771.78
筹资活动产生的现金流量净额		9,267,474,563.00	5,269,287,110.25
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-473,384.78	-1,423,755.21
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		5,891,064,120.12	5,663,187,551.03
加：期初现金及现金等价物余额		36,807,818,093.27	31,144,630,542.24
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		42,698,882,213.39	36,807,818,093.27

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

## 合并所有者权益变动表

2021 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

项目	2021 年度											
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减:库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
	优先股	永续债	其他									
一、上年年末余额	6,968,625,756.00				13,084,704,526.59		-361,669,126.18	2,081,635,058.54	5,356,840,035.07	6,148,119,860.94	1,151,491,137.79	34,429,747,248.75
加: 会计政策变更							1,400,513.45			-4,060,554.63		-2,660,041.18
前期差错更正												
其他												
二、本年年初余额	6,968,625,756.00				13,084,704,526.59		-360,268,612.73	2,081,635,058.54	5,356,840,035.07	6,144,059,306.31	1,151,491,137.79	34,427,087,207.57
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)					1,257,249.87		58,923,471.04	314,497,744.17	665,535,632.21	1,474,104,840.54	218,358,895.09	2,732,677,832.92
(一)综合收益总额							72,632,541.00			3,200,009,354.36	98,782,697.21	3,371,424,592.57
(二)所有者投入和减少资本											131,568,001.23	131,568,001.23
1.所有者投入的普通股												
2.其他权益工具持有者投入资本												
3.股份支付计入所有者权益的金额												
4.其他											131,568,001.23	131,568,001.23
(三)利润分配								314,497,744.17	665,535,632.21	-1,739,613,583.78	-12,365,600.79	-771,945,808.19
1.提取盈余公积								314,497,744.17		-314,497,744.17		
2.提取一般风险准备										-665,535,632.21		
3.对所有者(或股东)的分配										-759,580,207.40	-12,365,600.79	-771,945,808.19
4.其他												
(四)所有者权益内部结转							-13,709,069.96			13,709,069.96		

1. 资本公积转增资本(或股本)											
2. 盈余公积转增资本(或股本)											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益						-13,709,069.96			13,709,069.96		
6. 其他											
(五) 其他				1,257,249.87						373,797.44	1,631,047.31
四、本年年末余额	6,968,625,756.00			13,085,961,776.46		-301,345,141.69	2,396,132,802.71	6,022,375,667.28	7,618,164,146.85	1,369,850,032.88	37,159,765,040.49

项目	2020 年度											
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益合计
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
	优先股	永续债	其他									
一、上年年末余额	6,271,763,180.00		6,000,000,000.00		10,857,565,036.70		-429,340,321.18	1,839,215,368.76	4,823,677,831.72	4,546,698,234.15	1,096,987,801.26	35,006,567,131.41
加：会计政策变更												
前期差错更正												
其他												
二、本年初余额	6,271,763,180.00		6,000,000,000.00		10,857,565,036.70		-429,340,321.18	1,839,215,368.76	4,823,677,831.72	4,546,698,234.15	1,096,987,801.26	35,006,567,131.41
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)	696,862,576.00		-6,000,000,000.00		2,227,139,489.89		67,671,195.00	242,419,689.78	533,162,203.35	1,601,421,626.79	54,503,336.53	-576,819,882.66
(一) 综合收益总额							62,176,444.06			2,525,298,270.86	59,657,990.44	2,647,132,705.36
(二) 所有者投入和减少资本	696,862,576.00		-6,000,000,000.00		2,227,139,489.89						-351,531.64	-3,076,070,677.61
1. 所有者投入的普通股	696,862,576.00				2,227,139,489.89						-351,531.64	2,923,929,322.39
2. 其他权益工具持有者投入资本			-6,000,000,000.00									-6,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额												

4. 其他												
(三) 利润分配												
1. 提取盈余公积							242,610,350.08	533,162,203.35	-918,572,553.43	-4,803,122.27	-147,603,122.27	
2. 提取一般风险准备								533,162,203.35	-533,162,203.35			
3. 对所有者(或股东)的分配										-4,803,122.27	-4,803,122.27	
4. 其他									-142,800,000.00		-142,800,000.00	
(四) 所有者权益内部结转						5,494,750.94	-190,660.30		-5,304,090.64			
1. 资本公积转增资本(或股本)												
2. 盈余公积转增资本(或股本)												
3. 盈余公积弥补亏损												
4. 设定受益计划变动额结转留存收益												
5. 其他综合收益结转留存收益						5,494,750.94	-190,660.30		-5,304,090.64			
6. 其他												
(五) 其他												-278,788.14
四、本年年末余额	6,968,625,756.00				13,084,704,526.59		-361,669,126.18	2,081,635,058.54	5,356,840,035.07	6,148,119,860.94	1,151,491,137.79	34,429,747,248.75

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

母公司所有者权益变动表

2021 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年年末余额	6,968,625,756.00				12,852,639,623.42		163,326,545.77	2,083,800,860.51	5,211,642,713.41	5,032,018,258.68	32,312,053,757.79
加：会计政策变更											
前期差错更正											
其他											

中泰证券股份有限公司 2021 年年度报告

二、本年年初余额	6,968,625,756.00				12,852,639,623.42		163,326,545.77	2,083,800,860.51	5,211,642,713.41	5,032,018,258.68	32,312,053,757.79
三、本年增减变动金额（减少以“－”号填列）					618,109.25		87,604,057.99	314,497,744.17	629,025,150.54	1,454,032,994.44	2,485,778,056.39
（一）综合收益总额							99,762,712.84			3,144,977,441.70	3,244,740,154.54
（二）所有者投入和减少资本											
1. 所有者投入的普通股											
2. 其他权益工具持有者投入资本											
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
（三）利润分配								314,497,744.17	629,025,150.54	-1,703,103,102.11	-759,580,207.40
1. 提取盈余公积								314,497,744.17		-314,497,744.17	
2. 提取一般风险准备									629,025,150.54	-629,025,150.54	
3. 对所有者（或股东）的分配										-759,580,207.40	-759,580,207.40
4. 其他											
（四）所有者权益内部结转											
1. 资本公积转增资本（或股本）											
2. 盈余公积转增资本（或股本）											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益											
6. 其他											
（五）其他					618,109.25						618,109.25
四、本年年末余额	6,968,625,756.00				12,853,257,732.67		250,930,603.76	2,398,298,604.68	5,840,667,863.95	6,486,051,253.12	34,797,831,814.18

项目	2020 年度										
	实收资本(或股本)	其他权益工具			资本公积	减:库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他							
一、上年年末余额	6,271,763,180.00		6,000,000,000.00		10,625,500,133.53		158,228,395.88	1,841,381,170.73	4,726,422,013.25	3,478,261,750.85	33,101,556,644.24
加: 会计政策变更											
前期差错更正											
其他											
二、本年年初余额	6,271,763,180.00		6,000,000,000.00		10,625,500,133.53		158,228,395.88	1,841,381,170.73	4,726,422,013.25	3,478,261,750.85	33,101,556,644.24
三、本年增减变动金额（减少以“－”号填	696,862,576.00		-6,000,000,000.00		2,227,139,489.89		5,098,149.89	242,419,689.78	485,220,700.16	1,553,756,507.83	-789,502,886.45

列)											
(一) 综合收益总额						3,191,546.91				2,426,103,500.75	2,429,295,047.66
(二) 所有者投入和减少资本	696,862,576.00		-6,000,000,000.00		2,227,418,278.03						-3,075,719,145.97
1. 所有者投入的普通股	696,862,576.00				2,227,418,278.03						2,924,280,854.03
2. 其他权益工具持有者投入资本			-6,000,000,000.00								-6,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额											
4. 其他											
(三) 利润分配							242,610,350.08	485,220,700.16	-870,631,050.24		-142,800,000.00
1. 提取盈余公积							242,610,350.08		-242,610,350.08		
2. 提取一般风险准备								485,220,700.16	-485,220,700.16		
3. 对所有者(或股东)的分配											
4. 其他										-142,800,000.00	-142,800,000.00
(四) 所有者权益内部结转						1,906,602.98	-190,660.30			-1,715,942.68	
1. 资本公积转增资本(或股本)											
2. 盈余公积转增资本(或股本)											
3. 盈余公积弥补亏损											
4. 设定受益计划变动额结转留存收益											
5. 其他综合收益结转留存收益						1,906,602.98	-190,660.30			-1,715,942.68	
6. 其他											
(五) 其他					-278,788.14						-278,788.14
四、本年年末余额	6,968,625,756.00				12,852,639,623.42	163,326,545.77	2,083,800,860.51	5,211,642,713.41	5,032,018,258.68		32,312,053,757.79

公司负责人：李峰

主管会计工作负责人：袁西存

会计机构负责人：刘健

### 三、公司基本情况

#### 1. 公司概况

√适用 □不适用

中泰证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”），前身为齐鲁证券有限公司，2015年9月，根据莱芜钢铁集团有限公司、山东能源集团有限公司、济钢集团有限公司等40家股东签订的《中泰证券股份有限公司发起人协议书》及公司章程约定，经山东省人民政府国有资产监督管理委员会《关于齐鲁证券有限公司整体变更为股份有限公司暨更名有关问题的批复》（鲁国资收益字[2015]43号）批准，齐鲁证券有限公司整体变更为中泰证券股份有限公司，将齐鲁证券有限公司截至2014年12月31日止经审计后的扣除2014年度分红款人民币564,623,670.00元后的净资产13,202,735,991.36元按1:0.4014比例折合成5,300,000,000股股份（每股面值1元），整体变更后注册资本为人民币5,300,000,000.00元。

根据公司2015年9月6日召开的2015年第一次临时股东大会决议（中泰证券股决字[2015]1号），公司申请增加注册资本人民币971,763,180.00元，变更后的注册资本为人民币6,271,763,180.00元。

经中国证监会证监许可[2020]736号文核准，2020年5月20日，公司公开发行人民币普通股（A股）股票696,862,576.00股，每股面值1元。公司股票于2020年6月3日在上海证券交易所挂牌交易，变更后股本为6,968,625,756.00元。

公司属金融行业，经营范围包括：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；股票期权做市；证券投资基金托管。（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）

公司住所：济南市市中区经七路86号

公司总部地址：济南市市中区经七路86号

法定代表人：李峰

财务报表批准报出日：本财务报表业经本公司董事会于2022年3月29日决议批准报出。

#### 2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

(1) 本报告期末纳入合并范围的子公司

序号	子公司名称	子公司简称	持股比例(%)	
			直接	间接
1	鲁证期货股份有限公司	鲁证期货	63.10	
1.1	鲁证信息技术有限公司	鲁证信息		100.00
1.2	鲁证国际控股有限公司	鲁证国际控股		100.00
1.2.1	鲁证国际期货有限公司	鲁证国际期货		100.00
1.3	鲁证资本管理有限公司	鲁证资本		100.00
1.3.1	中泰汇融（香港）有限公司			100.00
2	中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司	中泰资本	100.00	
2.1	齐鲁中泰私募基金管理有限公司	齐鲁中泰		60.00

2.2	莱芜中泰股权投资基金（有限合伙）			20.00
2.3	莱芜中泰安盈创业投资基金（有限合伙）			20.00
3	中泰创业投资（深圳）有限公司	中泰创投	100.00	
3.1	深圳市沧乐投资合伙企业（有限合伙）			99.99
4	齐鲁中泰物业有限公司	中泰物业	100.00	
5	中泰证券（上海）资产管理有限公司	中泰资管	60.00	
6	中泰金融国际有限公司	中泰国际	100.00	
6.1	中泰金融投资有限公司	中泰金融投资		100.00
6.1.1	宏润（上海）融资租赁有限公司			100.00
6.1.2	中泰寰宇信息科技（深圳）有限公司			100.00
6.2	中泰金控国际控股有限公司			100.00
6.3	Zhongtai International Bond 2017(BVI) Company Limited			100.00
6.4	中泰金融日本株式会社			100.00
6.5	中泰国际财务（英属维尔京群岛）有限公司			100.00
6.6	Zhongtai International Holdings (Singapore) Pte. Ltd.			100.00
6.6.1	Zhongtai International Securities (Singapore) Pte. Ltd.			100.00
6.6.2	Zhongtai International Asset Management (Singapore) Pte. Ltd.			100.00
6.6.3	Zhongtai International Investment Management (Singapore) Pte. Ltd.			100.00
6.7	Zhongtai Innovation Capital Management Limited			100.00
6.8	中泰国际资产管理有限公司	中泰国际资管		100.00
6.9	中泰国际融资有限公司	中泰国际融资		100.00
6.10	中泰国际期货有限公司	中泰国际期货		100.00
6.11	中泰国际证券有限公司	中泰国际证券		100.00
6.12	中泰国际金融产品有限公司	中泰国际金融		100.00
6.13	中泰国际优越理财有限公司	优越理财		100.00
6.14	中泰国际管理有限公司	中泰国际管理		100.00
6.15	中泰国际资本投资有限公司			100.00
6.16	中泰国际战略投资有限公司			100.00
6.17	中泰国际并购投资有限公司			100.00
6.18	中泰国际投资集团有限公司			100.00
6.19	中泰国际金融服务有限公司			100.00
6.20	Zhongtai International Structured Solutions Limited			100.00
7	齐鲁股权交易中心有限公司	齐鲁股权	60.89	
7.1	山东齐鲁资本市场发展服务有限公司			100.00
7.2	山东齐惠投资管理有限公司			100.00
7.2.1	山东齐鲁金融供给管理有限公司			100.00
7.3	山东齐盛股权投资基金管理有限公司			100.00

上述子公司具体情况详见本节十、在其他主体中的权益。

(2) 本报告期末纳入合并范围的结构化主体



序号	结构名称	自有资金期末份额比例 (%)
1	齐鲁资管 8001 号定向资产管理计划	100.00
1.1	中泰资管 8106 号单一资产管理计划	100.00
1.2	中泰资管 8107 号单一资产管理计划	100.00
1.3	中泰资管 8109 号单一资产管理计划	100.00
1.4	中泰资管 8119 号单一资产管理计划	100.00
1.5	中泰资管 8120 号单一资产管理计划	100.00
1.6	中泰资管 8128 号单一资产管理计划	100.00
2	中泰资管 1 号 FOF 集合资产管理计划	100.00
2.1	中泰资管 3 号集合资产管理计划	43.20
2.2	中泰资管 9 号单一资产管理计划	100.00
2.3	中泰资管 15 号单一资产管理计划	100.00
2.4	中泰资管 17 号单一资产管理计划	100.00
2.5	中泰资管 25 号单一资产管理计划	100.00
2.6	中泰资管 28 号单一资产管理计划	100.00
2.7	中泰资管 30 号单一资产管理计划	100.00
2.8	中泰资管 36 号单一资产管理计划	100.00
2.9	中泰资管 39 号单一资产管理计划	100.00
2.10	中泰资管 42 号单一资产管理计划	100.00
2.11	中泰资管 45 号单一资产管理计划	100.00
3	中泰资管 2 号 FOF 集合资产管理计划	100.00
3.1	中泰资管 5 号集合资产管理计划	83.20
3.2	中泰资管 10 号单一资产管理计划	100.00
3.3	中泰资管 12 号单一资产管理计划	100.00
3.4	中泰资管 16 号单一资产管理计划	100.00
3.5	中泰资管 18 号单一资产管理计划	100.00
3.6	中泰资管 20 号单一资产管理计划	100.00
3.7	中泰资管 22 号单一资产管理计划	100.00
3.8	中泰资管 23 号单一资产管理计划	100.00
3.9	中泰资管 33 号单一资产管理计划	100.00
3.10	中泰资管 49 号单一资产管理计划	100.00
4	中泰资管 6012 号 FOF 单一资产管理计划	100.00
5	齐鲁全球动态精选基金	99.07
6	Zhongtai Dingfeng Classified Fund SP	47.98
7	Zhongtai China Balanced Fund No.1 SP	100.00
8	中泰富安分级基金	45.80
9	Win Win Stable No. 1 Fund SP	99.87
10	Zhongtai Pre-IPO Funds - We Doctor SP	71.99
11	EP High Yield Bond Fund SP	33.51
12	EP High Yield Bond Fund II SP	33.95
13	Zhongtai Fuan Classified Fund No.2 SP	93.57
14	财通基金中泰金融市场委定增 1 号单一资产管理计划	100.00
15	财通基金盈泰定增量化对冲 1 号单一资产管理计划	100.00
16	招证中泰海外 1 号定向资产管理计划	100.00
17	融通基金中泰证券融宝 18 号集合资产管理计划	100.00
18	东海证券海阳 9 号单一资产管理计划	100.00

19	万家基金安泰 1 号单一资产管理计划	100.00
20	万家基金安泰 2 号单一资产管理计划	100.00
21	万家基金安泰 3 号单一资产管理计划	100.00
22	万家基金安泰 4 号单一资产管理计划	100.00
23	万家基金安泰 5 号单一资产管理计划	100.00
24	万家基金安泰 6 号单一资产管理计划	100.00
25	诺德基金浦江 128 号单一资产管理计划	100.00
26	Zhongtai Stable Growth Equity Fund SP	44.49
27	Zhongtai East Peak Premier Income Fund SP	63.37

上述结构化主体情况详见本节十、在其他主体中的权益

### (3) 本报告期内合并财务报表范围变化

#### ①本报告期内新增子公司

序号	子公司全称	合并期间	纳入合并范围原因
1	齐鲁股权交易中心有限公司	2021 年 12 月	非同一控制下企业合并
1.1	山东齐鲁资本市场发展服务有限公司	2021 年 12 月	非同一控制下企业合并
1.2	山东齐惠投资管理有限公司	2021 年 12 月	非同一控制下企业合并
1.2.1	山东齐鲁金融供给管理有限公司	2021 年 12 月	非同一控制下企业合并
1.3	山东齐盛股权投资基金管理有限公司	2021 年 12 月	非同一控制下企业合并

#### ②本报告期内减少子公司

序号	子公司全称	合并期间	不再纳入合并范围原因
1	Jinova Limited	2021 年 1 月至 2021 年 10 月	注销
2	上海逸道资产管理有限公司	2021 年 1 月至 2021 年 5 月	注销
3	深圳市聚合润邦投资合伙企业(有限合伙)	2021 年 1 月至 2021 年 11 月	注销

#### ③本报告期内新增结构化主体

序号	结构化主体名称	合并期间	纳入合并范围原因
1	中泰资管 8120 号单一资产管理计划	2021 年 1 月至 2021 年 12 月	控制
2	中泰资管 8128 号单一资产管理计划	2021 年 8 月至 2021 年 12 月	控制
3	中泰资管 12 号单一资产管理计划	2021 年 12 月	控制
4	中泰资管 22 号单一资产管理计划	2021 年 6 月至 2021 年 12 月	控制
5	中泰资管 23 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
6	中泰资管 25 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
7	中泰资管 28 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
8	中泰资管 30 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
9	中泰资管 33 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
10	中泰资管 36 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
11	中泰资管 39 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
12	中泰资管 42 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
13	中泰资管 45 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
14	中泰资管 49 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
15	财通基金盈泰定增量化对冲 1 号单一资产管理计划	2021 年 6 月至 2021 年 12 月	控制

16	东海证券海阳 9 号单一资产管理计划	2021 年 11 月至 2021 年 12 月	控制
17	万家基金安泰 1 号单一资产管理计划	2021 年 7 月至 2021 年 12 月	控制
18	万家基金安泰 2 号单一资产管理计划	2021 年 7 月至 2021 年 12 月	控制
19	万家基金安泰 3 号单一资产管理计划	2021 年 11 月至 2021 年 12 月	控制
20	万家基金安泰 4 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
21	万家基金安泰 5 号单一资产管理计划	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制
22	万家基金安泰 6 号单一资产管理计划	2021 年 11 月至 2021 年 12 月	控制
23	诺德基金浦江 128 号单一资产管理计划	2021 年 7 月至 2021 年 12 月	控制
24	Zhongtai Stable Growth Equity Fund SP	2021 年 9 月至 2021 年 12 月	控制

## ④本报告期内减少结构化主体

序号	结构化主体名称	报告期	未纳入合并范围原因
1	中信建投-中泰证券融出资金债权 1 号 2 期资产支持专项计划	2021 年 1 月至 2021 年 4 月	清算
2	中信建投-中泰证券融出资金债权 1 号 3 期资产支持专项计划	2021 年 1 月至 2021 年 11 月	清算
3	中信建投-中泰证券融出资金债权 1 号 4 期资产支持专项计划	2021 年 1 月至 2021 年 11 月	清算
4	中信建投-中泰证券融出资金债权 1 号 5 期资产支持专项计划	2021 年 1 月至 2021 年 9 月	清算
5	中泰资管 7 号单一资产管理计划	2021 年 1 月至 2021 年 5 月	清算
7	中泰资管 19 号单一资产管理计划	2021 年 1 月至 2021 年 8 月	清算
8	齐鲁嘉成首选收益基金	2021 年 1 月至 2021 年 2 月	清算
9	Zhongtai Offshore Fixed Income Fund	2021 年 1 月至 2021 年 2 月	清算

## 四、财务报表的编制基础

## 1. 编制基础

公司以持续经营为基础，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》和各项具体会计准则、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”），以及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）、《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》（2021 年修订）、《证券公司年度报告内容与格式准则》（2013 年修订）、《证券公司财务报表附注编制的特别规定（2018）》的披露规定编制财务报表。

## 2. 持续经营

√适用 □不适用

本公司对自报告期末起 12 个月的持续经营能力进行了评估，未发现影响本公司持续经营能力的事项，本公司以持续经营为基础编制财务报表是合理的。

## 五、重要会计政策及会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

√适用 □不适用

本公司下列重要会计政策、会计估计根据企业会计准则制定。未提及的业务按企业会计准则中相关会计政策执行。

#### 1. 遵循企业会计准则的声明

本公司编制的财务报表符合《企业会计准则》的要求，真实、完整地反映了本公司的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

#### 2. 会计期间

本公司会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 3. 营业周期

适用 不适用

本公司以 12 个月为营业周期，营业周期起止日为 1 月 1 日至 12 月 31 日。

#### 4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本公司及子公司选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。本公司的部分子公司采用本公司记账本位币以外的货币作为记账本位币。

#### 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

适用 不适用

##### (1). 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，在合并日按取得被合并方在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。其中，对于被合并方与本公司在企业合并前采用的会计政策不同的，基于重要性原则统一会计政策，即按照本公司的会计政策对被合并方资产、负债的账面价值进行调整。本公司在企业合并中取得的净资产账面价值与所支付对价的账面价值之间存在差额的，首先调整资本公积（资本溢价或股本溢价），资本公积（资本溢价或股本溢价）的余额不足冲减的，依次冲减盈余公积和未分配利润。

通过分步交易实现同一控制下企业合并的会计处理方法详见本节五、6 合并财务报表的编制方法。

##### (2). 非同一控制下的企业合并

本公司在企业合并中取得的被购买方各项可辨认资产和负债，在购买日按其公允价值计量。其中，对于被购买方与本公司在企业合并前采用的会计政策不同的，基于重要性原则统一会计政策，即按照本公司的会计政策对被购买方资产、负债的账面价值进行调整。本公司在购买日的合并成本大于企业合并中取得的被购买方可辨认资产、负债公允价值的差额，确认为商誉；如果合并成本小于企业合并中取得的被购买方可辨认资产、负债公允价值的差额，首先对合并成本以及在企业合并中取得的被购买方可辨认资产、负债的公允价值进行复核，经复核后合并成本仍小于取得的被购买方可辨认资产、负债公允价值的，其差额确认为合并当期损益。

通过分步交易实现非同一控制下企业合并的会计处理方法详见本节五、6 合并财务报表的编制方法。

## 6. 合并财务报表的编制方法

√适用 □不适用

### (1). 合并范围的确定

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定，不仅包括根据表决权（或类似表决权）本身或者结合其他安排确定的子公司，也包括基于一项或多项合同安排决定的结构化主体。

控制是指本公司拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。子公司是指被本公司控制的主体（含企业、被投资单位中可分割的部分，以及企业所控制的结构化主体等），结构化主体是指在确定其控制方时没有将表决权或类似权利作为决定性因素而设计的主体（注：有时也称为特殊目的主体）。

### (2). 关于母公司是投资性主体的特殊规定

如果母公司是投资性主体，则只将那些为投资性主体的投资活动提供相关服务的子公司纳入合并范围，其他子公司不予以合并，对不纳入合并范围的子公司的股权投资方确认为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

当母公司同时满足下列条件时，该母公司属于投资性主体：

- ①该公司是以向投资方提供投资管理服务为目的，从一个或多个投资者处获取资金。
- ②该公司的唯一经营目的，是通过资本增值、投资收益或两者兼有而让投资者获得回报。
- ③该公司按照公允价值对几乎所有投资的业绩进行考量和评价。

当母公司由非投资性主体转变为投资性主体时，除仅将为其投资活动提供相关服务的子公司纳入合并财务报表范围编制合并财务报表外，企业自转变日起对其他子公司不再予以合并，并参照部分处置子公司股权但未丧失控制权的原则处理。

当母公司由投资性主体转变为非投资性主体时，应将原未纳入合并财务报表范围的子公司于转变日纳入合并财务报表范围，原未纳入合并财务报表范围的子公司在转变日的公允价值视同为购买的交易对价，按照非同一控制下企业合并的会计处理方法进行处理。

### (3). 合并财务报表的编制方法

本公司以自身和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和会计期间，反映企业集团整体财务状况、经营成果和现金流量。

- ①合并母公司与子公司的资产、负债、所有者权益、收入、费用和现金流量等项目。
- ②抵销母公司对子公司的长期股权投资与母公司在子公司所有者权益中所享有的份额。
- ③抵销母公司与子公司、子公司相互之间发生的内部交易的影响。内部交易表明相关资产发生减值损失的，应当全额确认该部分损失。

④站在企业集团角度对特殊交易事项予以调整。

### (4). 报告期内增减子公司的处理

### ①增加子公司或业务

#### A. 同一控制下企业合并增加的子公司或业务

(a) 编制合并资产负债表时，调整合并资产负债表的期初数，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。

(b) 编制合并利润表时，将该子公司以及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，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。

(c) 编制合并现金流量表时，将该子公司以及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。

#### B. 非同一控制下企业合并增加的子公司或业务

(a) 编制合并资产负债表时，不调整合并资产负债表的期初数。

(b) 编制合并利润表时，将该子公司以及业务购买日至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表。

(c) 编制合并现金流量表时，将该子公司以及业务购买日至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表。

### ②处置子公司或业务

A. 编制合并资产负债表时，不调整合并资产负债表的期初数。

B. 编制合并利润表时，将该子公司以及业务期初至处置日的收入、费用、利润纳入合并利润表。

C. 编制合并现金流量表时将该子公司以及业务期初至处置日的现金流量纳入合并现金流量表。

#### (5). 合并抵销中的特殊考虑

①子公司持有本公司的长期股权投资，应当视为本公司的库存股，作为所有者权益的减项，在合并资产负债表中所有者权益项目下以“减：库存股”项目列示。

子公司相互之间持有的长期股权投资，比照本公司对子公司的股权投资的抵销方法，将长期股权投资与其对应的子公司所有者权益中所享有的份额相互抵销。

②“一般风险准备”项目由于既不属于实收资本（或股本）、资本公积，也与留存收益、未分配利润不同，在长期股权投资与子公司所有者权益相互抵销后，按归属于母公司所有者的份额予以恢复。

③因抵销未实现内部销售损益导致合并资产负债表中资产、负债的账面价值与其在所属纳税主体的计税基础之间产生暂时性差异的，在合并资产负债表中确认递延所得税资产或递延所得税负债，同时调整合并利润表中的所得税费用，但与直接计入所有者权益的交易或事项及企业合并相关的递延所得税除外。

④本公司向子公司出售资产所发生的未实现内部交易损益，应当全额抵销“归属于母公司所有者的净利润”。子公司向本公司出售资产所发生的未实现内部交易损益，应当按照本公司对该子公司的分配比例在“归属于母公司所有者的净利润”和“少数股东损益”之间分配抵销。子公司之间出售资产所发生的未实现内部交易损益，应当按照本公司对出售方子公司的分配比例在“归属于母公司所有者的净利润”和“少数股东损益”之间分配抵销。

⑤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的份额的，其余部分仍应当冲减少数股东权益。

#### (6). 特殊交易的会计处理

##### ①购买少数股东股权

本公司购买子公司少数股东拥有的子公司股权，在个别财务报表中，购买少数股权新取得的长期股权投资的投资成本按照所支付对价的公允价值计量。在合并财务报表中，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，应当调整资本公积（资本溢价或股本溢价），资本公积不足冲减的，依次冲减盈余公积和未分配利润。

##### ②通过多次交易分步取得子公司控制权的

###### A. 通过多次交易分步实现同一控制下企业合并

在合并日，本公司在个别财务报表中，根据合并后应享有的子公司净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额，确定长期股权投资的初始投资成本；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取得进一步股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积（资本溢价或股本溢价），资本公积（资本溢价或股本溢价）不足冲减的，依次冲减盈余公积和未分配利润。

在合并财务报表中，合并方在合并中取得的被合并方的资产、负债，除因会计政策不同而进行的调整以外，按合并日在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量；合并前持有投资的账面价值加上合并日新支付对价的账面价值之和，与合并中取得的净资产账面价值的差额，调整资本公积（资本溢价或股本溢价），资本公积不足冲减的，调整留存收益。

合并方在取得被合并方控制权之前持有的股权投资且按权益法核算的，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一方最终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所有者权益变动，应分别冲减比较报表期间的期初留存收益。

###### B. 通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并

在合并日，在个别财务报表中，按照原持有的长期股权投资的账面价值加上合并日新增投资成本之和，作为合并日长期股权投资的初始投资成本。

在合并财务报表中，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及权益法核算下的其他综合收益等的，与其相关的其他综合收益等转为购买日所属当期

收益，但由于被合并方重新计量设定受益计划净资产或净负债变动而产生的其他综合收益除外。本公司在附注中披露其在购买日之前持有的被购买方的股权在购买日的公允价值、按照公允价值重新计量产生的相关利得或损失的金额。

### ③ 本公司处置对子公司长期股权投资但未丧失控制权

母公司在不丧失控制权的情况下部分处置对子公司的长期股权投资，在合并财务报表中，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（资本溢价或股本溢价），资本公积不足冲减的，调整留存收益。

### ④ 本公司处置对子公司长期股权投资且丧失控制权

#### A. 一次交易处置

本公司因处置部分股权投资等原因丧失了对被投资方的控制权的，在编制合并财务报表时，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或合并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。

与原子公司的股权投资相关的其他综合收益、其他所有者权益变动，在丧失控制权时转入当期损益，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。

#### B. 多次交易分步处置

在合并财务报表中，应首先判断分步交易是否属于“一揽子交易”。

如果分步交易不属于“一揽子交易”的，在个别财务报表中，对丧失子公司控制权之前的各项交易，结转每一次处置股权相对应的长期股权投资的账面价值，所得价款与处置长期股权投资账面价值之间的差额计入当期投资收益；在合并财务报表中，应按照“母公司处置对子公司长期股权投资但未丧失控制权”的有关规定处理。

如果分步交易属于“一揽子交易”的，应当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；在个别财务报表中，在丧失控制权之前的每一次处置价款与所处置的股权对应的长期股权投资账面价值之间的差额，先确认为其他综合收益，到丧失控制权时再一并转入丧失控制权的当期损益；在合并财务报表中，对于丧失控制权之前的每一次交易，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应当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。

各项交易的条款、条件以及经济影响符合下列一种或多种情况的，通常将多次交易作为“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) 一项交易单独考虑时是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

### ⑤ 因子公司的少数股东增资而稀释母公司拥有的股权比例



子公司的其他股东（少数股东）对子公司进行增资，由此稀释了母公司对子公司的股权比例。在合并财务报表中，按照增资前的母公司股权比例计算其在增资前子公司账面净资产中的份额，该份额与增资后按照母公司持股比例计算的在增资后子公司账面净资产份额之间的差额调整资本公积（资本溢价或股本溢价），资本公积（资本溢价或股本溢价）不足冲减的，调整留存收益。

## 7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

## 8. 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（从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知现金、价值变动风险很小四个条件的投资，确定为现金等价物。

## 9. 外币业务和外币报表折算

适用 不适用

### (1). 外币交易时折算汇率的确定方法

本公司外币交易初始确认时采用交易发生日的即期汇率或采用按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的汇率（以下简称即期汇率的近似汇率）折算为记账本位币。

### (2). 资产负债表日外币货币性项目的折算方法

在资产负债表日，对于外币货币性项目，采用资产负债表日的即期汇率折算。因资产负债表日即期汇率与初始确认时或前一资产负债表日即期汇率不同而产生的汇兑差额，计入当期损益。对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；对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，计入当期损益。

### (3). 外币报表折算方法

对企业境外经营财务报表进行折算前先调整境外经营的会计期间和会计政策，使之与企业会计期间和会计政策相一致，再根据调整后会计政策及会计期间编制相应货币（记账本位币以外的货币）的财务报表，再按照以下方法对境外经营财务报表进行折算：

- ①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。
- ②利润表中的收入和费用项目，采用交易发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折算。
- ③外币现金流量以及境外子公司的现金流量，采用现金流量发生日的即期汇率或即期汇率的近似汇率折算。汇率变动对现金的影响额应当作为调节项目，在现金流量表中单独列报。
- ④产生的外币财务报表折算差额，在编制合并财务报表时，在合并资产负债表中所有者权益项目下单独列示“其他综合收益”。

处置境外经营并丧失控制权时，将资产负债表中所有者权益项目下列示的、与该境外经营相关的外币报表折算差额，全部或按处置该境外经营的比例转入处置当期损益。

## 10. 金融工具

### (1). 金融资产及其他项目预期信用损失确认与计量

√适用 □不适用

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

金融工具的确认和终止确认

当本公司成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

金融资产满足下列条件之一的，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，且符合下述金融资产转移的终止确认条件。

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

本公司（借入方）与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，终止确认原金融负债，并同时确认新金融负债。本公司对原金融负债（或其一部分）的合同条款作出实质性修改的，应当终止原金融负债，同时按照修改后的条款确认一项新的金融负债。

以常规方式买卖金融资产，按交易日进行会计确认和终止确认。常规方式买卖金融资产，是指按照合同条款规定，在法规或市场惯例所确定的时间安排来交付金融资产。交易日，是指本公司承诺买入或卖出金融资产的日期。

### (2). 金融资产的分类与计量

本公司在初始确认时根据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，将金融资产分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。除非本公司改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

金融资产在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益，其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。因销售商品或提供劳务而产生的、未包含或不考虑重大融资成分的应收票据及应收账款，本公司则按照收入准则定义的交易价格进行初始计量。

金融资产的后续计量取决于其分类：

- ①以摊余成本计量的金融资产

金融资产同时符合下列条件的，分类为以摊余成本计量的金融资产：本公司管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。对于此类金融资产，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其终止确认、按实际利率法摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

- ②以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

金融资产同时符合下列条件的，分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产：本公司管理该金融资产的业务模式是既以收取合同现金流量为目标又以出售金融资产为目标；该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。对于此类金融资产，采用公允价值进行后续计量。除减值损失或利得及汇兑损益确认为当期损益外，此类金融资产的公允价值变动作为其他综合收益确认，直到该金融资产终止确认时，其累计利得或损失转入当期损益。但是采用实际利率法计算的该金融资产的相关利息收入计入当期损益。

本公司不可撤销地选择将部分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，仅将相关股利收入计入当期损益，公允价值变动作为其他综合收益确认，直到该金融资产终止确认时，其累计利得或损失转入留存收益。

### ③以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

上述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之外的金融资产，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。对于此类金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

## (3). 金融负债的分类与计量

本公司将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、低于市场利率贷款的贷款承诺及财务担保合同负债及以摊余成本计量的金融负债。

金融负债的后续计量取决于其分类：

### ①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。但本公司对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，由其自身信用风险变动引起的该金融负债公允价值的变动金额计入其他综合收益，当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和损失应当从其他综合收益中转出，计入留存收益。

### ②贷款承诺及财务担保合同负债

贷款承诺是本公司向客户提供的一项在承诺期间内以既定的合同条款向客户发放贷款的承诺。贷款承诺按照预期信用损失模型计提减值损失。

财务担保合同指，当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求本公司向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。财务担保合同负债以按照依据金融工具的减值原则所确定的损失准备金额以及初始确认金额扣除按收入确认原则确定的累计摊销额后的余额孰高进行后续计量。

### ③以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对其他金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

除特殊情况外，金融负债与权益工具按照下列原则进行区分：

A. 如果本公司不能无条件地避免以交付现金或其他金融资产来履行一项合同义务，则该合同义务符合金融负债的定义。有些金融工具虽然没有明确地包含交付现金或其他金融资产义务的条款和条件，但有可能通过其他条款和条件间接地形成合同义务。

B. 如果一项金融工具须用或可用本公司自身权益工具进行结算，需要考虑用于结算该工具的本公司自身权益工具，是作为现金或其他金融资产的替代品，还是为了使该工具持有方享有在发行方扣除所有负债后的资产中的剩余权益。如果是前者，该工具是发行方的金融负债；如果是后者，该工具是发行方的权益工具。在某些情况下，一项金融工具合同规定本公司须用或可用自身权益工具结算该金融工具，其中合同权利或合同义务的金额等于可获取或需交付的自身权益工具的数量乘以其结算时的公允价值，则无论该合同权利或合同义务的金额是固定的，还是完全或部分地基于除本公司自身权益工具的市场价格以外变量（例如利率、某种商品的价格或某项金融工具的价格）的变动而变动，该合同分类为金融负债。

#### **(4). 衍生金融工具及嵌入衍生工具**

衍生金融工具以衍生交易合同签订当日的公允价值进行初始计量，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。

除现金流量套期中属于套期有效的部分计入其他综合收益并于被套期项目影响损益时转出计入当期损益之外，衍生工具公允价值变动而产生的利得或损失，直接计入当期损益。

对包含嵌入衍生工具的混合工具，如主合同为金融资产的，混合工具作为一个整体适用金融资产分类的相关规定。如主合同并非金融资产，且该混合工具不是以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理，嵌入衍生工具与该主合同在经济特征及风险方面不存在紧密关系，且与嵌入衍生工具条件相同、单独存在的工具符合衍生工具定义的，嵌入衍生工具从混合工具中分拆，作为单独的衍生金融工具处理。如果该嵌入衍生工具在取得日或后续资产负债表日的公允价值无法单独计量，则将混合工具整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债。

#### **(5). 金融工具的减值**

本公司以预期信用损失为基础，进行减值会计处理并确认损失准备的金融工具有：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资和合同资产。计入上述分类的金融工具包括但不限于债券投资、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（含定期存款）、应收款项、合同资产等。

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，是指本公司按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于本公司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。

### ①减值阶段的划分

本公司基于单项金融工具或金融工具组合，进行减值阶段划分，有效监控资产信用风险的情况，并定期进行调整：

第一阶段：在资产负债表日信用风险较低的金融工具，或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，按照相当于该金融工具未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）预期信用损失的金额计量其损失准备；

第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具，但未发生信用减值，即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据，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；

第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，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其损失准备。

上述三阶段的划分，适用于购买或源生时未发生信用减值的金融工具。对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，应当仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。对于符合准则规定条件且如适用公司已做出相应会计政策选择的应收款项，应当始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

### ②对信用风险显著增加的评估

本公司在每个资产负债表日，评估信用风险自初始确认后是否显著增加。

在评估信用风险是否显著增加时，考虑以下事项，包括但不限于：

- A. 可获得有关过去事项、当前状况及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；
- B. 宏观经济状况、债务人经营和财务情况、内部实际违约率和预期违约概率、外部信用评级和内部信用评级、逾期情况、外部市场定价等信息；
- C. 金融工具预计存续期内违约风险的相对变化，而非违约风险变动的绝对值。

### ③已发生信用减值的依据

本公司根据金融资产的特点，针对具有相同风险特征的金融资产界定存在发生信用减值证据的情形。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- A. 发行方或债务人发生重大财务困难；
- B. 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- C. 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- D. 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- E. 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；
- F. 以大幅折扣购买或源生一项金融资产，该折扣反映了发生信用损失的事实；
- G. 其他表明金融资产已发生信用减值的情形。

金融资产发生信用减值，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。

#### ④预期信用风险三阶段的具体划分标准

A. 分类为以摊余成本计量的金融资产（债权投资）、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（其他债权投资）信用风险三阶段划分如下：

第一阶段：债券投资的信用风险较低，情况如下：

（a）投资境外债券的评级在国际外部评级 BBB-以上（含），投资境内债券的评级在国内外部评级 AA 以上（含）；

（b）公司基于内部评级定义较低信用风险的标准。

此外，国债、中央银行票据、政策性金融债由于信用风险极低，预期信用损失可视为零。

第二阶段：债券投资的信用风险显著增加。以下情况表明持有债券信用风险显著增加：

（a）宏观经济环境的重大不利变化；

（b）发行人所处行业环境或政策、地域环境的重大不利变化；

（c）初始确认时评级在 BBB-以上（含）的境外债券的评级发生下调，且下调后等级在 BBB-以下（不含）；初始确认时评级在 AA 以上（含）的境内债券的评级发生下调，且下调后等级在 AA 以下（不含）；

（d）初始确认时评级在 BBB-以下的境外债券的评级发生下调；初始确认时评级在 AA 以下的境内债券的评级发生下调；

（e）发行人合并报表口径主要经营或财务指标发生重大不利变化，如净利润、资产负债率、速动比率、总资产报酬率、已获利息倍数等；

（f）发行人控股股东、实际控制人发生重大不利变化；

（g）发行人治理结构特别是董事长、总经理等主要领导发生重要不利变化；

（h）发行人及其主要子公司的主要资产发生抵押、质押、司法查封或冻结等权利受限的重大情形；

（i）发行人未按规定或约定履行信息披露义务或募集说明书相关承诺，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

（j）发行人未按核准用途使用债券募集资金，或未按约定用途使用债券募集资金且未履行规定或约定的变更程序，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

（k）增信措施的有效性发生重大不利变化；

（l）发行人、增信机构被列为失信被执行人、环保或安全生产领域失信单位等信用惩戒对象或发生其他可能影响偿债能力的重大情况；

（m）发行人、增信机构或实际控制人受到刑事处罚、行政处罚、被采取行政监管措施或涉嫌违法犯罪的情况，对发行人偿债能力产生重大不利影响；

（n）债券信用利差和价格的重大不利变化。

第三阶段：已发生信用减值的债券。当发生如下情形之一时，应被定义为存在客观减值证据：

（a）发行人发生重大财务困难；

- (b) 发行人不能按期偿付本金或利息；
- (c) 发行人不能履行回售义务；
- (d) 发行人丧失清偿能力、被法院指定管理人或已开始相关的诉讼程序；
- (e) 发行人很可能破产或进行其他财务重组；
- (f) 发行人的其他债券违约；
- (g) 其他可视情况认定为违约的情况。

对于上款 1 至 3 可给予不超过 30 天的宽限期。

B. 融资类业务（融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务）信用风险三阶段划分如下：

第一阶段：信用风险未显著增加，情况如下：

(a) 融资融券维持担保比例、约定购回的履约保障比例和股票质押等金融工具的履约保障比例均在 130%以上；

(b) 不存在信用风险第二、第三阶段的特征。

第二阶段：融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务信用风险显著增加。以下情况表明持有融资类业务信用风险显著增加：

(a) 融资融券维持担保比例 130%以下、100%以上；

(b) 约定购回履约保障比例 130%以下、100%以上；

(c) 股票质押履约保障比例 130%以下、100%以上；

(d) 质押标的证券存在退市风险；

(e) 质押标的证券处于停牌状态且发生影响质押标的证券价格重大不利变化的情况，如上市公司经营业绩重大不利变化，发生重大负面新闻、上市公司以及高管、实际控制人发生重要不利变化（如被立案调查、发生重大纠纷等）；

(f) 股票质押客户的主要资产发生司法查封或冻结；

(g) 股票质押客户被列为失信执行人；

(h) 股票质押客户受到刑事、行政处罚、涉嫌违法犯罪的情况；

(i) 股票质押客户征信发生不利变化等；

(j) 被动展期、本金或利息逾期 30 天以上、90 天以内。

第三阶段：融出资金、约定购回式证券业务、股票质押式回购业务已发生信用减值。当发生如下情形之一时，应被定义为存在客观减值证据：

(a) 融资融券维持担保比例 100%以下，尚未平仓处置完毕；

(b) 约定购回、股票质押回购履约保障比例 100%以下；

(c) 已平仓，发生亏损；

(d) 股票质押客户发生重大财务困难；

(e) 股票质押客户未按合同约定偿还本金或利息 90 天以上；

- (f) 股票质押客户丧失清偿能力，被法院指定管理人或已开始相关的诉讼程序；
- (g) 股票质押客户很可能破产或进行其他财务重组；
- (h) 股票质押拟对单笔业务进行违约处置或已报交易所拟进行违约处置。

#### ⑤金融工具减值计量

A. 对于债券投资业务使用债项层面的违约概率/违约损失率方法，即：

$$ECL = \sum_{i=1} PD_i \times LGD_i \times EAD_i \times DF_i$$

其中：

- (a)  $PD_i$  为当前时点估计的未来第  $i$  年违约概率；
- (b)  $LGD_i$  为当前时点估计的未来第  $i$  年违约的损失率；
- (c)  $EAD_i$  为当前时点估计的未来第  $i$  年违约的风险暴露；
- (d)  $DF_i$  为违约损失折现到当前时点的折算因子。

#### B. 融出资金、买入返售金融资产

处于信用风险第一、第二阶段的股票质押回购交易业务、约定购回交易业务预期信用损失=基数\*损失率；处于信用风险第一、第二阶段的融资融券业务预期信用损失=基数\*损失率\*担保品集中度调整系数。

处于信用风险第三阶段的，按预计归还现金流单笔计算减值。预期信用损失=计提基数-（担保品价值\*预期折扣+已收到的还款金额+补充抵押物\*预期折扣+其他处置方案\*预期折扣）。

#### C. 应收款项、合同资产预期信用损失的计量

因证券清算形成的应收款项、证券公司作为管理人或者托管人应收的管理费和托管费、业绩报酬和席位佣金等由于信用风险不重大，不计提减值准备。

已发生信用风险的应收款项应单独进行减值测试，通过预估其未来现金流量现值或预估其坏账损失率计提坏账准备。

其他未发生信用风险的应收款项，按信用风险特征的相似性和相关性对金融资产进行分组。坏账准备金额根据应收款项组合结构及类似信用风险特征（债务人根据合同条款偿还欠款的能力），按历史损失经验、目前经济状况、预计应收款项组合中已经存在的损失评估确定。

其中，信用风险已经发生的情景包括但不限于以下情况：

- (a) 债务人违反了合同条款，且在 90 天内仍未履行合同义务；
- (b) 债务人发生严重财务困难，影响融资人履约能力；
- (c) 债务人经营不善，很可能破产或进行其他不利的财务重组等；
- (d) 公司出于经济或合同等方面因素的考虑，对发生财务困难的债务人做出了在任何其他情况下都不会做出的让步。

#### ⑥金融工具减值的账务处理



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。

在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本公司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，本公司在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。在每个资产负债表日，本公司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。

#### **(6). 金融资产转移**

金融资产转移是指下列两种情形：将收取金融资产现金流量的合同权利转移给另一方；将金融资产整体或部分转移给另一方，但保留收取金融资产现金流量的合同权利，并承担将收取的现金流量支付给一个或多个收款方的合同义务。

##### **①终止确认所转移的金融资产**

已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的，或既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，但放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产。

在判断是否已放弃对所转移金融资产的控制时，根据转入方出售该金融资产的实际能力。转入方能够单方面将转移的金融资产整体出售给不相关的第三方，且没有额外条件对此项出售加以限制的，则公司已放弃对该金融资产的控制。

本公司在判断金融资产转移是否满足金融资产终止确认条件时，注重金融资产转移的实质。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：

A. 所转移金融资产的账面价值；

B. 因转移而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对于终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》第十八条分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的情形）之和。

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（在此种情况下，所保留的服务资产视同继续确认金融资产的一部分）之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：

A. 终止确认部分在终止确认日的账面价值；

B. 终止确认部分的对价，与原计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》第十八条分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的情形）之和。

##### **②继续涉入所转移的金融资产**

既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，且未放弃对该金融资产控制的，应当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。

继续涉入所转移金融资产的程度，是指企业承担的被转移金融资产价值变动风险或报酬的程度。

### ③继续确认所转移的金融资产

仍保留与所转移金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，应当继续确认所转移金融资产整体，并将收到的对价确认为一项金融负债。

该金融资产与确认的相关金融负债不得相互抵销。在随后的会计期间，企业应当继续确认该金融资产产生的收入（或利得）和该金融负债产生的费用（或损失）。

## (7). 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债应当在资产负债表内分别列示，不得相互抵销。但同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本公司具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

本公司计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，转出方不得将已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

## (8). 金融工具公允价值的确定方法

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本公司以主要市场的价格计量相关资产或负债的公允价值，不存在主要市场的，本公司以最有利市场的价格计量相关资产或负债的公允价值。本公司采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

主要市场，是指相关资产或负债交易量最大和交易活跃程度最高的市场；最有利市场，是指在考虑交易费用和运输费用后，能够以最高金额出售相关资产或者以最低金额转移相关负债的市场。

存在活跃市场的金融资产或金融负债，本公司采用活跃市场中的报价确定其公允价值。金融工具不存在活跃市场的，本公司采用估值技术确定其公允价值。

以公允价值计量非金融资产的，考虑市场参与者将该资产用于最佳用途产生经济利益的能力，或者将该资产出售给能够用于最佳用途的其他市场参与者产生经济利益的能力。

### ①估值技术

本公司采用在当期情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。本公司使用与其中一种或多种估值技术相一致的方法计量公允价值，使用多种估值技术计量公允价值的，考虑各估值结果的合理性，选取在当期情况下最能代表公允价值的金额作为公允价值。

本公司在估值技术的应用中，优先使用相关可观察输入值，只有在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。可观察输入值，是指能够从市场数据中取得的输入值。该输入值反映了市场参与者在对相关资产或负债定价时所使用的假设。不可观察输入值，是指不能从市场数据中取得的输入值。该输入值根据可获得的市场参与者在对相关资产或负债定价时所使用假设的最佳信息取得。

## ②公允价值层次

本公司将公允价值计量所使用的输入值划分为三个层次，并首先使用第一层次输入值，其次使用第二层次输入值，最后使用第三层次输入值。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

## 11. 贵金属

适用 不适用

## 12. 应收款项

### 应收款项的预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

详见本节五、10 金融工具。

## 13. 应收款项融资

适用 不适用

## 14. 合同资产

### (1). 合同资产的确认方法及标准

适用 不适用

本公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中列示合同资产或合同负债。本公司已向客户转让商品或提供服务而有权收取的对价（且该权利取决于时间流逝之外的其他因素）列示为合同资产。本公司已收或应收客户对价而应向客户转让商品或提供服务的义务列示为合同负债。

合同资产和合同负债在资产负债表中单独列示。同一合同下的合同资产和合同负债以净额列示。不同合同下的合同资产和合同负债不能相互抵销。

### (2). 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用 不适用

合同资产的预期信用损失的确定方法详见本节五、10金融工具。

## 15. 持有待售资产

适用 不适用

### (1). 持有待售的非流动资产或处置组的分类

本公司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：

①根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；

②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获得确定的购买承诺，预计出售将在一年内完成。有关规定要求本公司相关权力机构或者监管部门批准后方可出售的，已经获得批准。

本公司专为转售而取得的非流动资产或处置组，在取得日满足“预计出售将在一年内完成”的规定条件，且短期（通常为 3 个月）内很可能满足持有待售类别的其他划分条件的，本公司在取得日将其划分为持有待售类别。

本公司因出售对子公司的投资等原因导致其丧失对子公司控制权的，无论出售后本公司是否保留部分权益性投资，在拟出售的对子公司投资满足持有待售类别划分条件时，在母公司个别财务报表中将对子公司投资整体划分为持有待售类别，在合并财务报表中将子公司所有资产和负债划分为持有待售类别。

#### (2). 持有待售的非流动资产或处置组的计量

采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产、采用公允价值减去出售费用后的净额计量的生物资产、职工薪酬形成的资产、递延所得税资产、由金融工具相关会计准则规范的金融资产及由保险合同相关会计准则规范的保险合同所产生的权利的计量分别适用于其他相关会计准则。

初始计量或在资产负债表日重新计量持有待售的非流动资产或处置组时，其账面价值高于公允价值减去出售费用后的净额的，将账面价值减记至公允价值减去出售费用后的净额，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益，同时计提持有待售资产减值准备。后续资产负债表日持有待售的非流动资产或处置组公允价值减去出售费用后的净额增加的，以前减记的金额予以恢复，并在划分为持有待售类别后确认的资产减值损失金额内转回，转回金额计入当期损益。已抵减的商誉账面价值不得转回。

非流动资产或处置组因不再满足持有待售类别的划分条件而不再继续划分为持有待售类别或非流动资产从持有待售的处置组中移除时，按照以下两者孰低计量：

①划分为持有待售类别前的账面价值，按照假定不划分为持有待售类别情况下本应确认的折旧、摊销或减值等进行调整后的金额；

②可收回金额。

#### (3). 列报

本公司在资产负债表中区别于其他资产单独列示持有待售的非流动资产或持有待售的处置组中的资产，区别于其他负债单独列示持有待售的处置组中的负债。持有待售的非流动资产或持有待售的处置组中的资产与持有待售的处置组中的负债不予相互抵销，分别作为流动资产和流动负债列示。

## 16. 债权投资

### 债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

适用  不适用

债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法详见本节五、10 金融工具。

## 17. 其他债权投资

### (1). 其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

其他债权投资预期信用损失的确定方法及会计处理方法详见本节五、10 金融工具。

## 18. 长期股权投资

√适用 □不适用

本公司长期股权投资包括对被投资单位实施控制、重大影响的权益性投资，以及对合营企业的权益性投资。本公司能够对被投资单位施加重大影响的，为本公司的联营企业。

### (1). 确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的依据

共同控制，是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。在判断是否存在共同控制时，首先判断所有参与方或参与方组合是否集体控制该安排，如果所有参与方或一组参与方必须一致行动才能决定某项安排的相关活动，则认为所有参与方或一组参与方集体控制该安排。其次再判断该安排相关活动的决策是否必须经过这些集体控制该安排的参与方一致同意。如果存在两个或两个以上的参与方组合能够集体控制某项安排的，不构成共同控制。判断是否存在共同控制时，不考虑享有的保护性权利。

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。在确定能否对被投资单位施加重大影响时，考虑投资方直接或间接持有被投资单位的表决权股份以及投资方及其他方持有的当期可执行潜在表决权在假定转换为对被投资方单位的股权后产生的影响，包括被投资单位发行的当期可转换的认股权证、股份期权及可转换公司债券等的影响。

当本公司直接或通过子公司间接拥有被投资单位 20%（含 20%）以上但低于 50%的表决权股份时，一般认为对被投资单位具有重大影响，除非有明确证据表明该种情况下不能参与被投资单位的生产经营决策，不形成重大影响。

### (2). 初始投资成本确定

#### ①企业合并形成的长期股权投资，按照下列规定确定其投资成本：

A. 同一控制下的企业合并，合并方以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式作为合并对价的，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的现金、转让的非现金资产以及所承担债务账面价值之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益；

B. 同一控制下的企业合并，合并方以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益；

C. 非同一控制下的企业合并，以购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值确定为合并成本作为长期股权投资的初始投资成本。

合并方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益。

②除企业合并形成的长期股权投资以外，其他方式取得的长期股权投资，按照下列规定确定其投资成本：

A. 以支付现金取得的长期股权投资，按照实际支付的购买价款作为投资成本。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；

B. 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；

C. 通过非货币性资产交换取得的长期股权投资，如果该项交换具有商业实质且换入资产或换出资产的公允价值能可靠计量，则以换出资产的公允价值和相关税费作为初始投资成本，换出资产的公允价值与账面价值之间的差额计入当期损益；若非货币资产交换不同时具备上述两个条件，则按换出资产的账面价值和相关税费作为初始投资成本。

D. 通过债务重组取得的长期股权投资，以所放弃债权的公允价值和可直接归属于该资产的税金等其他成本确定其入账价值，并将所放弃债权的公允价值与账面价值之间的差额，计入当期损益。

### (3). 后续计量及损益确认方法

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；对联营企业和合营企业的长期股权投资采用权益法核算。

#### ①成本法

采用成本法核算的长期股权投资，追加或收回投资时调整长期股权投资的成本；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

按照权益法核算的长期股权投资，一般会计处理为：

本公司长期股权投资的投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，不调整长期股权投资的初始投资成本；长期股权投资的初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资的成本。

本公司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；本公司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；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。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可辨认净资产的公允价值为基础，对被投资单位的净利润进行调整后确认。被投资单位采用的会计政策及会计期间与本公司不一致的，应按照本公司的会计政策及会计期间对被投资单位的财务报表进行调整，并据以确认投资收益和其他综合收益等。本公司与联营企业及合营企业之间发生的未实现内部交易

损益按照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。本公司与被投资单位发生的未实现内部交易损失属于资产减值损失的，应全额确认。

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。原持有的股权投资分类为其他权益工具投资的，其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利得或损失应当在改按权益法核算的当期从其他综合收益中转出，计入留存收益。

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公允价值计量，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). 持有待售的权益性投资

对于未划分为持有待售资产的剩余权益性投资，采用权益法进行会计处理。

已划分为持有待售的对联营企业或合营企业的权益性投资，不再符合持有待售资产分类条件的，从被分类为持有待售资产之日起采用权益法进行追溯调整。分类为持有待售期间的财务报表做相应调整。

#### (5). 减值测试方法及减值准备计提方法

对子公司、联营企业及合营企业的投资，计提资产减值的方法详见本节五、25 长期资产减值。

### 19. 投资性房地产

#### (1). 如果采用成本计量模式的：

##### 折旧或摊销方法

投资性房产是指为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产。主要包括：①已出租的土地使用权。②持有并准备增值后转让的土地使用权。③已出租的建筑物。

本公司采用成本模式对投资性房地产进行后续计量，计提资产减值方法详见本节五、25 长期资产减值。本公司对投资性房地产成本减累计减值及净残值后按直线法计算折旧或摊销，出租的房屋建筑物的后续计量比照同类固定资产的折旧方法；土地使用权比照同类无形资产的年限摊销。

### 20. 固定资产

#### (1). 确认条件

√适用 □不适用

固定资产是指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有的使用寿命超过一年的单位价值较高的有形资产。

固定资产在同时满足下列条件时，按取得时的实际成本予以确认：

- ①与该固定资产有关的经济利益很可能流入企业。
- ②该固定资产的成本能够可靠地计量。

固定资产发生的后续支出，符合固定资产确认条件的计入固定资产成本；不符合固定资产确认条件的在发生时计入当期损益。

**(2). 折旧方法**

√适用 □不适用

类别	折旧方法	折旧年限（年）	残值率	年折旧率
房屋及建筑物	年限平均法	15-30	3%-5%	3.17%-6.47%
电子设备	年限平均法	3-5	3%-5%	19.00%-32.33%
办公设备	年限平均法	5	3%-5%	19.00%-19.40%
其他设备	年限平均法	5-11	3%-5%	8.64%-19.40%

**(3). 融资租入固定资产的认定依据、计价和折旧方法**

□适用 √不适用

**21. 在建工程**

√适用 □不适用

(1). 在建工程以立项项目分类核算。

(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。包括建筑费用、机器设备原价、其他为使在建工程达到预定可使用状态所发生的必要支出以及在资产达到预定可使用状态之前为该项目专门借款所发生的借款费用及占用的一般借款发生的借款费用。本公司在工程安装或建设完成达到预定可使用状态时将在建工程转入固定资产。所建造的已达到预定可使用状态、但尚未办理竣工决算的固定资产，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。

**22. 借款费用**

√适用 □不适用

(1). 借款费用资本化的确认原则和资本化期间

本公司发生的可直接归属于符合资本化条件的资产的购建或生产的借款费用在同时满足下列条件时予以资本化计入相关资产成本：

- ①资产支出已经发生；
- ②借款费用已经发生；
- ③为使资产达到预定可使用状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

其他的借款利息、折价或溢价和汇兑差额，计入发生当期的损益。

符合资本化条件的资产在购建或者生产过程中发生非正常中断，且中断时间连续超过 3 个月的，暂停借款费用的资本化。

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，停止其借款费用的资本化；以后发生的借款费用于发生当期确认为费用。

(2). 借款费用资本化率以及资本化金额的计算方法



为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入专门借款的，以专门借款当期实际发生的利息费用，减去将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后的金额，确定为专门借款利息费用的资本化金额。

购建或者生产符合资本化条件的资产占用了一般借款的，一般借款应予资本化的利息金额按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。

### 23. 使用权资产

√适用 □不适用

使用权资产，是指承租人可在租赁期内使用租赁资产的权利。

在租赁期开始日，使用权资产按照成本进行初始计量。该成本包括：

- (1). 租赁负债的初始计量金额；
- (2). 在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；
- (3). 承租人发生的初始直接费用；
- (4). 承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。本公司按照预计负债的确认标准和计量方法对该成本进行确认和计量，详见本节五、30。前述成本属于为生产存货而发生的将计入存货成本。

使用权资产折旧采用年限平均法分类计提。对于能合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁资产预计剩余使用寿命内，根据使用权资产类别和预计净残值率确定折旧率；对于无法合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内，根据使用权资产类别确定折旧率。

### 24. 无形资产

#### (1). 计价方法、使用寿命、减值测试

√适用 □不适用

##### ①无形资产的计价方法

按取得时的实际成本入账。

##### ②无形资产使用寿命及摊销

###### A. 使用寿命有限的无形资产的使用寿命估计情况：

对于使用寿命有限的无形资产，在为企业带来经济利益的期限内按直线法摊销。

每年年度终了，公司对使用寿命有限的无形资产的使用寿命及摊销方法进行复核。经复核，本期末无形资产的使用寿命及摊销方法与以前估计未有不同。

B. 无法预见无形资产为企业带来经济利益期限的，视为使用寿命不确定的无形资产。对于使用寿命不确定的无形资产，公司在每年年度终了对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核，如果重新复核后仍为不确定的，于资产负债表日进行减值测试。

###### C. 无形资产的摊销

对于使用寿命有限的无形资产，本公司在取得时确定其使用寿命，在使用寿命内采用直线法系统合理摊销，摊销金额按受益项目计入当期损益。具体应摊销金额为其成本扣除预计残值后的金额。已计提减值准备的无形资产，还应扣除已计提的无形资产减值准备累计金额。使用寿命有限的无形资产，其残值视为零，但下列情况除外：有第三方承诺在无形资产使用寿命结束时购买该无形资产或可以根据活跃市场得到预计残值信息，并且该市场在无形资产使用寿命结束时很可能存在。

对使用寿命不确定的无形资产，不予摊销。每年年度终了对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核，如果有证据表明无形资产的使用寿命是有限的，估计其使用寿命并在预计使用年限内系统合理摊销。

## (2). 内部研究开发支出会计政策

适用 不适用

### 25. 长期资产减值

适用 不适用

对子公司、联营企业和合营企业的长期股权投资、采用成本模式进行后续计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、无形资产、使用权资产、商誉等（存货、按公允价值模式计量的投资性房地产、递延所得税资产、金融资产除外）的资产减值，按以下方法确定：

于资产负债表日判断资产是否存在可能发生减值的迹象，存在减值迹象的，本公司将估计其可收回金额，进行减值测试。对因企业合并所形成的商誉、使用寿命不确定的无形资产和尚未达到可使用状态的无形资产无论是否存在减值迹象，每年都进行减值测试。

可收回金额根据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较高者确定。本公司以单项资产为基础估计其可收回金额；难以对单项资产的可收回金额进行估计的，以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。资产组的认定，以资产组产生的主要现金流入是否独立于其他资产或者资产组的现金流入为依据。

当资产或资产组的可收回金额低于其账面价值时，本公司将其账面价值减记至可收回金额，减记的金额计入当期损益，同时计提相应的资产减值准备。

就商誉的减值测试而言，对于因企业合并形成的商誉的账面价值，自购买日起按照合理的方法分摊至相关的资产组；难以分摊至相关的资产组的，将其分摊至相关的资产组组合。相关的资产组或资产组组合，是能够从企业合并的协同效应中受益的资产组或者资产组组合，且不大于本公司确定的报告分部。

减值测试时，如与商誉相关的资产组或者资产组组合存在减值迹象的，首先对不包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，计算可收回金额，确认相应的减值损失。然后对包含商誉的资产组或者资产组组合进行减值测试，比较其账面价值与可收回金额，如可收回金额低于账面价值的，确认商誉的减值损失。

资产减值损失一经确认，在以后会计期间不再转回。

## 26. 长期待摊费用

适用 不适用

本公司的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)的经营租入固定资产改良和其他费用,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。

## 27. 附回购条件的资产转让

适用 不适用

## 28. 合同负债

### (1). 合同负债的确认方法

适用 不适用

本公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中列示合同资产或合同负债。本公司已收或应收客户对价而应向客户转让商品或提供服务的义务列示为合同负债。

合同资产和合同负债在资产负债表中单独列示。同一合同下的合同资产和合同负债以净额列示。不同合同下的合同资产和合同负债不能相互抵销。

## 29. 职工薪酬

### (1)、短期薪酬的会计处理方法

适用 不适用

#### ①职工基本薪酬(工资、奖金、津贴、补贴)

本公司在职工为其提供服务的会计期间,将实际发生的短期薪酬确认为负债,并计入当期损益,其他会计准则要求或允许计入资产成本的除外。

#### ②职工福利费

本公司发生的职工福利费,在实际发生时根据实际发生额计入当期损益或相关资产成本。职工福利费为非货币性福利的,按照公允价值计量。

③医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金,以及工会经费和职工教育经费

本公司为职工缴纳的医疗保险费、工伤保险费、生育保险费等社会保险费和住房公积金,以及按规定提取的工会经费和职工教育经费,在职工为其提供服务的会计期间,根据规定的计提基础和计提比例计算确定相应的职工薪酬金额,并确认相应负债,计入当期损益或相关资产成本。

#### ④短期带薪缺勤

本公司在职工提供服务从而增加了其未来享有的带薪缺勤权利时,确认与累积带薪缺勤相关的职工薪酬,并以累积未行使权利而增加的预期支付金额计量。本公司在职工实际发生缺勤的会计期间确认与非累积带薪缺勤相关的职工薪酬。

#### ⑤短期利润分享计划

利润分享计划同时满足下列条件的,本公司确认相关的应付职工薪酬:

- A. 企业因过去事项导致现在具有支付职工薪酬的法定义务或推定义务;
- B. 因利润分享计划所产生的应付职工薪酬义务金额能够可靠估计。

## (2)、离职后福利的会计处理方法

√适用 □不适用

### ①设定提存计划

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

根据设定提存计划,预期不会在职工提供相关服务的年度报告期结束后十二个月内支付全部应缴存金额的,本公司参照相应的折现率(根据资产负债表日与设定提存计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率确定),将全部应缴存金额以折现后的金额计量应付职工薪酬。

### ②设定受益计划

#### A. 确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本

根据预期累计福利单位法,采用无偏且相互一致的精算假设对有关人口统计变量和财务变量等做出估计,计量设定受益计划所产生的义务,并确定相关义务的归属期间。本公司按照相应的折现率(根据资产负债表日与设定受益计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率确定)将设定受益计划所产生的义务予以折现,以确定设定受益计划义务的现值和当期服务成本。

#### B. 确认设定受益计划净负债或净资产

设定受益计划存在资产的,本公司将设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。

设定受益计划存在盈余的,本公司以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产。

#### C. 确定应计入资产成本或当期损益的金额

服务成本,包括当期服务成本、过去服务成本和结算利得或损失。其中,除了其他会计准则要求或允许计入资产成本的当期服务成本之外,其他服务成本均计入当期损益。

设定受益计划净负债或净资产的利息净额,包括计划资产的利息收益、设定受益计划义务的利息费用以及资产上限影响的利息,均计入当期损益。

#### D. 确定应计入其他综合收益的金额

重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动,包括:

(a) 精算利得或损失,即由于精算假设和经验调整导致之前所计量的设定受益计划义务现值的增加或减少;

(b) 计划资产回报,扣除包括在设定受益计划净负债或净资产的利息净额中的金额;

(c) 资产上限影响的变动,扣除包括在设定受益计划净负债或净资产的利息净额中的金额。

上述重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动直接计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但本公司可以在权益范围内转移这些在其他综合收益中确认的金额。

### (3)、辞退福利的会计处理方法

√适用 □不适用

本公司向职工提供辞退福利的，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：

- ①企业不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；
- ②企业确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

辞退福利预期在年度报告期结束后十二个月内不能完全支付的，参照相应的折现率（根据资产负债表日与设定受益计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率确定）将辞退福利金额予以折现，以折现后的金额计量应付职工薪酬。

### (4)、其他长期职工福利的会计处理方法

√适用 □不适用

- ①符合设定提存计划条件的

本公司向职工提供的其他长期职工福利，符合设定提存计划条件的，将全部应缴存金额以折现后的金额计量应付职工薪酬。

- ②符合设定受益计划条件的

在报告期末，本公司将其他长期职工福利产生的职工薪酬成本确认为下列组成部分：

- A. 服务成本；
- B. 其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额；
- C. 重新计量其他长期职工福利净负债或净资产所产生的变动。

为简化相关会计处理，上述项目的总净额计入当期损益或相关资产成本。

## 30. 预计负债

√适用 □不适用

预计负债的确认标准如果与或有事项相关的义务同时符合以下条件，本公司将其确认为预计负债：(1). 该义务是本公司承担的现时义务；(2). 该义务的履行很可能导致经济利益流出本公司；(3). 该义务的金额能够可靠地计量。预计负债的计量方法预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量，并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。每个资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。有确凿证据表明该账面价值不能反映当前最佳估计数的，按照当前最佳估计数对该账面价值进行调整。

## 31. 租赁负债

√适用 □不适用

租赁负债应当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。租赁付款额包括以下五项内容：

- (1). 固定付款额及实质固定付款额，存在租赁激励的，扣除租赁激励相关金额；
- (2). 取决于指数或比率的可变租赁付款额；
- (3). 购买选择权的行权价格，前提是承租人合理确定将行使该选择权；
- (4). 行使终止租赁选择权需支付的款项，前提是租赁期反映出承租人将行使终止租赁选择权；
- (5). 根据承租人提供的担保余值预计应支付的款项。

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

租赁期开始日后，当实质固定付款额发生变动、担保余值预计的应付金额发生变化、用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动、购买选择权、续租选择权或终止选择权的评估结果或实际行权情况发生变化时，本公司按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值。

### 32. 股份支付

适用 不适用

### 33. 优先股、永续债等其他金融工具

适用 不适用

- (1). 优先股、永续债等其他金融工具的分类依据

本公司发行的优先股、永续债等其他金融工具划分为金融负债还是权益工具，根据相关合同或协议中具体内容，按实质重于形式的原则进行判断。本公司发行的优先股、永续债等其他金融工具如果不包括交付现金或其他金融资产给其他方，或在其他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，则分类为权益工具。

- (2). 优先股、永续债等其他金融工具的会计处理方法

本公司以所发行金融工具的分类为基础，确定该工具利息支出或股利分配等的会计处理。对于归类为权益工具的金融工具，无论其名称中是否包含“债”，其利息支出或股利分配都作为本公司（发行企业）的利润分配，其回购、注销等作为权益的变动处理；对于归类为金融负债的金融工具，无论其名称中是否包含“股”，其利息支出或股利分配原则上按照借款费用进行处理，其回购或赎回产生的利得或损失等计入当期损益。

### 34. 回购本公司股份

适用 不适用

### 35. 收入

#### (1)、收入确认和计量所采用的会计政策

适用 不适用

- ①一般原则

收入是本公司在日常活动中形成的、会导致股东权益增加且与股东投入资本无关的经济利益的总流入。

本公司在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品控制权时确认收入。取得相关商品控制权，是指能够主导该商品的使用并从中获得几乎全部的经济利益。

合同中包含两项或多项履约义务的，本公司在合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务，按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。

交易价格是本公司因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项。在确定合同交易价格时，如果存在可变对价，本公司按照期望值或最可能发生金额确定可变对价的最佳估计数，并以不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额计入交易价格。合同中如果存在重大融资成分，本公司将根据客户在取得商品控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格，该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销，对于控制权转移与客户支付价款间隔未超过一年的，本公司不考虑其中的融资成分。

满足下列条件之一的，属于在某一时段内履行履约义务；否则，属于在某一时点履行履约义务：

- A. 客户在本公司履约的同时即取得并消耗本公司履约所带来的经济利益；
- B. 客户能够控制本公司履约过程中在建的商品；
- C. 本公司履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，本公司在该段时间内按照履约进度确认收入，但是，履约进度不能合理确定的除外。本公司按照投入法（或产出法）确定提供服务的履约进度。当履约进度不能合理确定时，本公司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，本公司在客户取得相关商品控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品或服务控制权时，本公司会考虑下列迹象：

- A. 本公司就该商品或服务享有现时收款权利，即客户就该商品负有现时付款义务；
- B. 本公司已将该商品的法定所有权转移给客户，即客户已拥有了该商品的法定所有权；
- C. 本公司已将该商品的实物转移给客户，即客户已实物占有该商品；
- D. 本公司已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户，即客户已取得该商品所有权上的主要风险和报酬；
- E. 客户已接受该商品。

## ②具体方法

本公司收入确认的具体方法如下：

**A. 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。代兑付证券的手续费收入，于代兑付证券业务基本完成，与委托方结算时确认收入。

证券承销收入、保荐收入与财务顾问收入，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。如合同规定按约定比例收取管理费的，则分期确认管理费收益。

**B. 利息收入**

在相关的收入能够可靠计量，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。

融资融券业务根据与客户合约的约定，按出借资金或证券的时间和约定利率确认收入；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；在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期收入。

**C. 投资收益**

公司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收益。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。

**D. 其他业务收入**

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入，包括大宗商品交易收入及投资性房地产取得的租金收入，大宗商品交易收入于本公司已履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品控制权时确认收入。其他收入在服务提供时，按照权责发生制确认收入。

**(2)、同类业务采用不同经营模式导致收入确认会计政策存在差异的情况**

适用 不适用

**36. 合同成本**

适用 不适用

合同成本分为合同履约成本与合同取得成本。

本公司为履行合同而发生的成本，在同时满足下列条件时作为合同履约成本确认为一项资产：

(1). 该成本与一份当前或预期取得的合同直接相关，包括直接人工、直接材料、制造费用（或类似费用）、明确由客户承担的成本以及仅因该合同而发生的其他成本。

(2). 该成本增加了本公司未来用于履行履约义务的资源。

(3). 该成本预期能够收回。

本公司为取得合同发生的增量成本预期能够收回的，作为合同取得成本确认为一项资产。



与合同成本有关的资产采用与该资产相关的商品或服务收入确认相同的基础进行摊销；但是对于合同取得成本摊销期限未超过一年的，本公司将其在发生时计入当期损益。

与合同成本有关的资产，其账面价值高于下列两项的差额的，本公司将对于超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失，并进一步考虑是否应计提亏损合同有关的预计负债：

- (1). 因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价；
- (2). 为转让该相关商品或服务估计将要发生的成本。

上述资产减值准备后续发生转回的，转回后的资产账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该资产在转回日的账面价值。

### 37. 利润分配

适用 不适用

根据公司章程规定，本公司分配当年税后利润时，应当提取利润的 10%作为公司的法定公积金，公司的法定公积金累计额为公司注册资本的 50%以上时，可以不再提取。公司的法定公积金不足以弥补以前年度亏损的，在提取法定公积金之前，应先用当年利润弥补亏损。公司从税后利润中提取法定公积金、一般风险准备后，经股东大会决议，可以提取任意公积金。公司弥补亏损和提取上述公积金、准备金后所余税后利润，按股东持有的股份比例分配，但章程规定不按持股比例分配的除外。公司持有的本公司股份不参与分配利润。

本公司一般风险准备，包括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》（财政部令第 42 号）的规定，按当年实现净利润的 10%提取一般风险准备金。

根据《中华人民共和国证券法》的规定，按当年实现净利润的 10%提取交易风险准备金，用于弥补证券交易损失。

### 38. 政府补助

#### (1)、与资产相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

公司取得的、用于购建或以其他方式形成长期资产的政府补助划分为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助确认为递延收益，在相关资产使用期限内按照合理、系统的方法分期计入损益。按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

#### (2)、与收益相关的政府补助判断依据及会计处理方法

适用 不适用

除与资产相关的政府补助之外的政府补助划分为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助，分情况按照以下规定进行会计处理：

用于补偿本公司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；

用于补偿本公司已发生的相关成本费用或损失的，直接计入当期损益。

对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助，区分不同部分分别进行会计处理；难以区分的，整体归类为与收益相关的政府补助。

与本公司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。与本公司日常活动无关的政府补助，计入营业外收支。

### 39. 递延所得税资产/递延所得税负债

√适用 □不适用

本公司通常根据资产与负债在资产负债表日的账面价值与计税基础之间的暂时性差异，采用资产负债表债务法将应纳税暂时性差异或可抵扣暂时性差异对所得税的影响额确认和计量为递延所得税负债或递延所得税资产。本公司不对递延所得税资产和递延所得税负债进行折现。

#### (1). 递延所得税资产的确认

对于可抵扣暂时性差异、能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减，其对所得税的影响额按预计转回期间的所得税税率计算，并将该影响额确认为递延所得税资产，但是以本公司很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异、可抵扣亏损和税款抵减的未来应纳税所得额为限。

同时具有下列特征的交易或事项中因资产或负债的初始确认所产生的可抵扣暂时性差异对所得税的影响额不确认为递延所得税资产：

- A. 该项交易不是企业合并；
- B. 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）。

本公司对与子公司、联营公司及合营企业投资相关的可抵扣暂时性差异，同时满足下列两项条件的，其对所得税的影响额（才能）确认为递延所得税资产：

- A. 暂时性差异在可预见的未来很可能转回；
- B. 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。

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

在资产负债表日，本公司对递延所得税资产的账面价值进行复核。如果未来期间很可能无法获得足够的应纳税所得额用以抵扣递延所得税资产的利益，减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，减记的金额予以转回。

#### (2). 递延所得税负债的确认

本公司所有应纳税暂时性差异均按预计转回期间的所得税税率计量对所得税的影响，并将该影响额确认为递延所得税负债，但下列情况的除外：

①因下列交易或事项中产生的应纳税暂时性差异对所得税的影响不确认为递延所得税负债：

- A. 商誉的初始确认；
- B. 具有以下特征的交易中产生的资产或负债的初始确认：该交易不是企业合并，并且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。

②本公司对与子公司、合营企业及联营企业投资相关的应纳税暂时性差异，其对所得税的影响额一般确认为递延所得税负债，但同时满足以下两项条件的除外：

- A. 本公司能够控制暂时性差异转回的时间；
- B. 该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回。

(3). 特定交易或事项所涉及的递延所得税负债或资产的确认

①与企业合并相关的递延所得税负债或资产

非同一控制下企业合并产生的应纳税暂时性差异或可抵扣暂时性差异，在确认递延所得税负债或递延所得税资产的同时，相关的递延所得税费用（或收益），通常调整企业合并中所确认的商誉。

②直接计入所有者权益的项目

与直接计入所有者权益的交易或者事项相关的当期所得税和递延所得税，计入所有者权益。暂时性差异对所得税的影响计入所有者权益的交易或事项包括：其他债权投资公允价值变动等形成的其他综合收益、会计政策变更采用追溯调整法或对前期（重要）会计差错更正差异追溯重述法调整期初留存收益、同时包含负债成份及权益成份的混合金融工具在初始确认时计入所有者权益等。

③可弥补亏损和税款抵减

A. 本公司自身经营产生的可弥补亏损以及税款抵减

可抵扣亏损是指按照税法规定计算确定的准予用以后年度的应纳税所得额弥补的亏损。对于按照税法规定可以结转以后年度的未弥补亏损（可抵扣亏损）和税款抵减，视同可抵扣暂时性差异处理。在预计可利用可弥补亏损或税款抵减的未来期间内很可能取得足够的应纳税所得额时，以很可能取得的应纳税所得额为限，确认相应的递延所得税资产，同时减少当期利润表中的所得税费用。

B. 因企业合并而形成的可弥补的被合并企业的未弥补亏损

在企业合并中，本公司取得被购买方的可抵扣暂时性差异，在购买日不符合递延所得税资产确认条件的，不予以确认。购买日后 12 个月内，如取得新的或进一步的信息表明购买日的相关情况已经存在，预期被购买方在购买日可抵扣暂时性差异带来的经济利益能够实现的，确认相关的递延所得税资产，同时减少商誉，商誉不足冲减的，差额部分确认为当期损益；除上述情况以外，确认与企业合并相关的递延所得税资产，计入当期损益。

④合并抵销形成的暂时性差异

本公司在编制合并财务报表时，因抵销未实现内部销售损益导致合并资产负债表中资产、负债的账面价值与其在所属纳税主体的计税基础之间产生暂时性差异的，在合并资产负债表中确认递延所得税资产或递延所得税负债，同时调整合并利润表中的所得税费用，但与直接计入所有者权益的交易或事项及企业合并相关的递延所得税除外。

⑤以权益结算的股份支付

如果税法规定与股份支付相关的支出允许税前扣除，在按照会计准则规定确认成本费用的期间内，本公司根据会计期末取得信息估计可税前扣除的金额计算确定其计税基础及由此产生的暂时性差异，符合确认条件的情况下确认相关的递延所得税。其中预计未来期间可税前扣除的金额超过按照会计准则规定确认的与股份支付相关的成本费用，超过部分的所得税影响应直接计入所有者权益。

#### 40. 租赁

##### (1)、经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

以下经营租赁会计政策适用于 2020 年度及以前

本公司将实质上转移了与资产所有权有关的全部风险和报酬的租赁为融资租赁，除此之外的均为经营租赁。

①本公司作为经营租赁承租人时，将经营租赁的租金支出，在租赁期内各个期间按照直线法或根据租赁资产的使用量计入当期损益。出租人提供免租期的，本公司将租金总额在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法或其他合理的方法进行分摊，免租期内确认租金费用及相应的负债。出租人承担了承租人某些费用的，本公司按该费用从租金费用总额中扣除后的租金费用余额在租赁期内进行分摊。

初始直接费用，计入当期损益。如协议约定或有租金的在实际发生时计入当期损益。

②本公司作为经营租赁出租人时，采用直线法将收到的租金在租赁期内确认为收益。出租人提供免租期的，出租人将租金总额在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法或其他合理的方法进行分配，免租期内出租人也确认租金收入。承担了承租人某些费用的，本公司按该费用自租金收入总额中扣除后的租金收入余额在租赁期内进行分配。

初始直接费用，计入当期损益。金额较大的予以资本化，在整个经营租赁期内按照与确认租金收入相同的基础分期计入当期损益。如协议约定或有租金的在实际发生时计入当期收益。

##### (2)、融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

以下融资租赁会计政策适用于 2020 年度及以前

①本公司作为融资租赁承租人时，在租赁期开始日，将租赁开始日租赁资产公允价值与最低租赁付款额现值两者中较低者作为租入资产的入账价值，将最低租赁付款额作为长期应付款的入账价值，其差额作为未确认融资费用。在租赁期内各个期间采用实际利率法进行分摊，确认为当期融资费用，计入财务费用。

发生的初始直接费用，计入租入资产价值。

在计提融资租赁资产折旧时，本公司采用与自有应折旧资产相一致的折旧政策，折旧期间以租赁合同而定。如果能够合理确定租赁期届满时本公司将会取得租赁资产所有权，以租赁期开始日租赁资产的寿命作为折旧期间；如果无法合理确定租赁期届满后本公司是否能够取得租赁资产的所有权，以租赁期与租赁资产寿命两者中较短者作为折旧期间。

②本公司作为融资租赁出租人时，于租赁期开始日将租赁开始日最低租赁应收款额与初始直接费用之和作为应收融资租赁款的入账价值，计入资产负债表的长期应收款，同时记录未担保余值；将最低租赁应收款额、初始直接费用及未担保余值之和与其现值之和的差额作为未实现融资收益，在租赁期内各个期间采用实际利率法确认为租赁收入。

### (3)、新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法

√适用 □不适用

自 2021 年 1 月 1 日起适用

#### ①租赁的识别

在合同开始日，本公司评估合同是否为租赁或者包含租赁，如果合同中一方让渡了在一定期间内控制一项或多项已识别资产使用的权利以换取对价，则该合同为租赁或者包含租赁。为确定合同是否让渡了在一定期间内控制已识别资产使用的权利，本公司评估合同中的客户是否有权获得在使用期间内因使用已识别资产所产生的几乎全部经济利益，并有权在该使用期间主导已识别资产的使用。

#### ②单独租赁的识别

合同中同时包含多项单独租赁的，本公司将合同予以分拆，并分别各项单独租赁进行会计处理。同时符合下列条件的，使用已识别资产的权利构成合同中的一项单独租赁：①承租人可从单独使用该资产或将其与易于获得的其他资源一起使用中获利；②该资产与合同中的其他资产不存在高度依赖或高度关联关系。

#### ③本公司作为承租人的会计处理方法

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

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

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

#### A. 使用权资产

使用权资产，是指承租人可在租赁期内使用租赁资产的权利。

在租赁期开始日，使用权资产按照成本进行初始计量。该成本包括：

- (a) 租赁负债的初始计量金额；
- (b) 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；
- (c) 承租人发生的初始直接费用；

(d)承租人为拆卸及移除租赁资产、复原租赁资产所在场地或将租赁资产恢复至租赁条款约定状态预计将发生的成本。本公司按照预计负债的确认标准和计量方法对该成本进行确认和计量，详见本节五、30。前述成本属于为生产存货而发生的将计入存货成本。

使用权资产折旧采用年限平均法分类计提。对于能合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁资产预计剩余使用寿命内，根据使用权资产类别和预计净残值率确定折旧率；对于无法合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内，根据使用权资产类别确定折旧率。

#### B. 租赁负债

租赁负债应当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。租赁付款额包括以下五项内容：

- (a) 固定付款额及实质固定付款额，存在租赁激励的，扣除租赁激励相关金额；
- (b) 取决于指数或比率的可变租赁付款额；
- (c) 购买选择权的行权价格，前提是承租人合理确定将行使该选择权；
- (d) 行使终止租赁选择权需支付的款项，前提是租赁期反映出承租人将行使终止租赁选择权；
- (e) 根据承租人提供的担保余值预计应支付的款项。

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

租赁期开始日后，当实质固定付款额发生变动、担保余值预计的应付金额发生变化、用于确定租赁付款额的指数或比率发生变动、购买选择权、续租选择权或终止选择权的评估结果或实际行权情况发生变化时，本公司按照变动后的租赁付款额的现值重新计量租赁负债，并相应调整使用权资产的账面价值。

#### ④本公司作为出租人的会计处理方法

在租赁开始日，本公司将实质上转移了与租赁资产所有权有关的几乎全部风险和报酬的租赁划分为融资租赁，除此之外的均为经营租赁。

##### A. 经营租赁

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

##### B. 融资租赁

在租赁开始日，本公司按照租赁投资净额(未担保余值和租赁期开始日尚未收到的租赁收款额按照租赁内含利率折现的现值之和)确认应收融资租赁款，并终止确认融资租赁资产。在租赁期的各个期间，本公司按照租赁内含利率计算并确认利息收入。

本公司取得的未纳入租赁投资净额计量的可变租赁付款额在实际发生时计入当期损益。

#### ⑤租赁变更的会计处理

##### A. 租赁变更作为一项单独租赁

租赁发生变更且同时符合下列条件的，本公司将该租赁变更作为一项单独租赁进行会计处理：该租赁变更通过增加一项或多项租赁资产的使用权而扩大了租赁范围；增加的对价与租赁范围扩大部分的单独价格按该合同情况调整后的金额相当。

##### B. 租赁变更未作为一项单独租赁

###### (a) 本公司作为承租人

在租赁变更生效日，本公司重新确定租赁期，并采用修订后的折现率对变更后的租赁付款额进行折现，以重新计量租赁负债。在计算变更后租赁付款额的现值时，采用剩余租赁期间的租赁内含利率作为折现率；无法确定剩余租赁期间的租赁内含利率的，采用租赁变更生效日的增量借款利率作为折现率。

就上述租赁负债调整的影响，区分以下情形进行会计处理：租赁变更导致租赁范围缩小或租赁期缩短的，调减使用权资产的账面价值，并将部分终止或完全终止租赁的相关利得或损失计入当期损益；其他租赁变更，相应调整使用权资产的账面价值。

###### (b) 本公司作为出租人

经营租赁发生变更的，本公司自变更生效日起将其作为一项新租赁进行会计处理，与变更前租赁有关的预收或应收租赁收款额视为新租赁的收款额。

融资租赁的变更未作为一项单独租赁进行会计处理的，本公司分别下列情形对变更后的租赁进行处理：如果租赁变更在租赁开始日生效，该租赁会被分类为经营租赁的，本公司自租赁变更生效日开始将其作为一项新租赁进行会计处理，并以租赁变更生效日前的租赁投资净额作为租赁资产的账面价值；如果租赁变更在租赁开始日生效，该租赁会被分类为融资租赁的，本公司按照关于修改或重新议定合同的规定进行会计处理。

#### ⑥售后租回

本公司按照本节五、35 的规定，评估确定售后租回交易中的资产转让是否属于销售。

##### A. 本公司作为卖方（承租人）

售后租回交易中的资产转让不属于销售的，本公司继续确认被转让资产，同时确认一项与转让收入等额的金融负债，并按照本节五、10 对该金融负债进行会计处理。该资产转让属于销售的，本公司按原资产账面价值中与租回获得的使用权有关的部分，计量售后租回所形成的使用权资产，并仅就转让至出租人的权利确认相关利得或损失。

##### B. 本公司作为买方（出租人）

售后租回交易中的资产转让不属于销售的，本公司不确认被转让资产，但确认一项与转让收入等额的金融资产，并按照本节五、10 对该金融资产进行会计处理。该资产转让属于销售的，本公司根据其他适用的企业会计准则对资产购买进行会计处理，并对资产出租进行会计处理。

#### 41. 融资融券业务

√适用 □不适用

本公司专设融资专用资金账户用于存放拟向客户融出的资金。在实际向客户融出资金时增加融出资金，减少融资专用资金账户的存款。每日计提融出资金的利息，月末结息。在融资合同到期时，客户归还借款及未结算的利息。如到期客户未能还清融资款，则将未能归还部分计入应收款项-融资融券客户款。

公司开展融券业务时，按融券日融出证券的公允价值作为融出证券的初始确认金额。融出期间融出证券取得的现金股利确认为投资收益。融出证券公允价值与账面余额的差额调整融出证券的公允价值变动，同时计入公允价值变动收益或其他综合收益。客户归还融出证券时，按归还日融出证券的公允价值减少融出证券。融出证券的利息在融出期间内以合同利率确认。

#### 42. 资产证券化业务

□适用 √不适用

#### 43. 其他重要的会计政策和会计估计

√适用 □不适用

##### (1). 转融通业务

本公司通过证券金融公司转融通业务融入的资金，在资产负债表内确认为资产，同时对出借方确认一项负债，在“拆入资金”科目下列示；对融入的证券，由于其主要收益或风险不由公司享有或承担，公司不将其计入资产负债表，在财务报表附注中披露公司转融通融入的证券期末市值和转融通融入后拆借给客户的证券期末市值，未融出证券期末市值等。

##### (2). 客户交易结算资金

本公司收到的客户交易结算资金存放于存管银行的专门账户，与自有资金分开管理；为代理客户证券交易而进行资金清算与交收的款项存入交易所指定的清算代理机构，在清算备付金中核算。本公司在收到代理客户买卖证券款时确认为一项资产和一项负债。在与清算代理机构清算时，本公司按规定将缴纳的开户费、转托管费以及资金第三方存管费等相关费用确认为手续费及佣金支出；在与客户办理买卖证券款项清算时，本公司按规定将向客户收取的手续费确认为手续费及佣金收入。

##### (3). 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、定向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、定向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，不在本公司财务报表内列示。

受托理财业务情况在财务报表列示。

##### (4). 约定购回业务核算办法

约定购回式证券交易是指符合条件的客户以约定价格向其指定交易的证券公司卖出标的证券，并约定在未来某一日期客户按照另一约定价格从证券公司购回标的证券，除指定情形外，待购回期间标的证券所产生的相关权益于权益登记日划转给客户的交易行为。公司在“买入返售金融资



产”科目下设“约定购回式证券”核算交易本金，产生的利息收入在“利息收入”科目下设“约定购回利息收入”明细科目核算。

#### (5). 股票质押式回购业务核算办法

股票质押回购是指符合条件的资金融入方以所持有的股票或其他证券质押，向符合条件的资金融出方融入资金，并约定在未来返还资金、解除质押的交易。公司在“买入返售金融资产”科目下设“股票质押式回购”核算交易本金，产生的利息收入在“利息收入”科目下设“质押回购利息收入”明细科目核算。

#### (6). 买入返售和卖出回购业务核算办法

##### ①买入返售金融资产

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），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。

##### ②卖出回购金融资产款

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）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于本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合同或协议利率确认。

#### (7). 终止经营

##### ①终止经营的认定标准

终止经营，是指本公司满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已经处置或划分为持有待售类别：

A. 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；

B. 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；

C. 该组成部分是专为转售而取得的子公司。

##### ②终止经营的列示

本公司在利润表中分别列示持续经营损益和终止经营损益。对于当期列报的终止经营，本公司在当期财务报表中，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。终止经营不再满足持有待售类别划分条件的，本公司在当期财务报表中，将原来作为终止经营损益列报的信息重新作为可比会计期间的持续经营损益列报。

#### (8). 套期业务的处理方法

##### ①套期的分类

本公司将套期分为公允价值套期、现金流量套期和境外经营净投资套期。

A. 公允价值套期，是指对已确认资产或负债，尚未确认的确定承诺，或上述项目组成部分的公允价值变动风险敞口进行的套期。该公允价值变动源于特定风险，且将影响企业的损益或其他综合收益。

B. 现金流量套期，是指对现金流量变动风险进行的套期。该现金流量变动源于与已确认资产或负债、极可能发生的预期交易，或与上述项目组成部分有关的特定风险，且将影响企业的损益。

C. 境外经营净投资套期，是指对境外经营净投资外汇风险敞口进行的套期。境外经营净投资套期中的被套期风险是指境外经营的记账本位币与母公司的记账本位币之间的折算差额。

## ②套期工具和被套期项目

套期工具，是指本公司为进行套期而指定的，其公允价值或现金流量变动预期可抵销被套期项目的公允价值或现金流量变动的金融工具，包括：

A. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的衍生工具，但签出期权除外。只有在对购入期权（包括嵌入在混合合同中的购入期权）进行套期时，签出期权才可以作为套期工具。嵌入在混合合同中但未分拆的衍生工具不能作为单独的套期工具。

B. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的非衍生金融资产或非衍生金融负债，但指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益、且其自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益的金融负债除外。

自身权益工具不属于金融资产或金融负债，不能作为套期工具。

被套期项目，是指使本公司面临公允价值或现金流量变动风险，且被指定为被套期对象的、能够可靠计量的项目。本公司将下列单个项目、项目组合或其组成部分指定为被套期项目：

A. 已确认资产或负债。

B. 尚未确认的确定承诺。确定承诺，是指在未来某特定日期或期间，以约定价格交换特定数量资源、具有法律约束力的协议。

C. 极可能发生的预期交易。预期交易，是指尚未承诺但预期会发生的交易。

D. 境外经营净投资。

上述项目组成部分是指小于项目整体公允价值或现金流量变动的部分，本公司将下列项目组成部分或其组合被指定为被套期项目：

A. 项目整体公允价值或现金流量变动中仅由某一个或多个特定风险引起的公允价值或现金流量变动部分（风险成分）。根据在特定市场环境下的评估，该风险成分应当能够单独识别并可靠计量。风险成分也包括被套期项目公允价值或现金流量的变动仅高于或仅低于特定价格或其他变量的部分。

B. 一项或多项选定的合同现金流量。

C. 项目名义金额的组成部分，即项目整体金额或数量的特定部分，其可以是项目整体的一定比例部分，也可以是项目整体的某一层级部分。若某一层级部分包含提前还款权，且该提前还款

权的公允价值受被套期风险变化影响的，不得将该层级指定为公允价值套期的被套期项目，但在计量被套期项目的公允价值时已包含该提前还款权影响的情况除外。

### ③套期关系评估

在套期关系开始时，本公司对套期关系有正式指定，并准备了关于套期关系、风险管理目标和风险管理策略的正式书面文件。该文件载明了套期工具、被套期项目，被套期风险的性质，以及本公司对套期有效性评估方法。套期有效性，是指套期工具的公允价值或现金流量变动能够抵销被套期风险引起的被套期项目公允价值或现金流量的程度。此类套期在初始指定日及以后期间被持续评价符合套期有效性要求。

如果套期工具已到期、被出售、合同终止或已行使（但作为套期策略组成部分的展期或替换不作为已到期或合同终止处理），或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，或者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，或者该套期不再满足套期会计方法的其他条件时，本公司终止运用套期会计。

套期关系由于套期比率的原因不再符合套期有效性要求的，但指定该套期关系的风险管理目标没有改变的，本公司对套期关系进行再平衡。

### ④确认和计量

满足运用套期会计方法条件的，按如下方法进行处理：

#### A. 公允价值套期

套期工具产生的利得或损失计入当期损益。如果是对指定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。被套期项目因套期风险敞口形成利得或损失，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。如果被套期项目是指定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），因套期风险敞口形成利得或损失，计入其他综合收益，其账面价值已按公允价值计量，不需要调整。

就与按摊余成本计量的金融工具（或其组成部分）有关的公允价值套期而言，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，计入当期损益。该摊销日可以自调整日开始，并不得晚于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，按照同样的方式对累积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。

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累计公允价值变动确认为一项资产或负债，相关的利得或损失计入当期损益。当履行确定承诺而取得资产或承担负债时，应当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。

## B. 现金流量套期

套期工具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,确认为其他综合收益,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。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:(a)套期工具自套期开始的累计利得或损失。(b)被套期项目自套期开始的预计未来现金流量现值的累计变动额。

如果被套期的预期交易随后确认为非金融资产或非金融负债,或非金融资产或非金融负债的预期交易形成适用公允价值套期会计的确定承诺时则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。其余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,如预期销售发生时,将其他综合收益中确认的现金流量套期储备转出,计入当期损益。

## C. 境外经营净投资套期

对境外经营净投资的套期,套期工具形成的利得或损失中属于有效套期的部分,直接确认为其他综合收益;套期工具形成的利得或损失中属于无效套期的部分,计入当期损益。处置境外经营时,上述在其他综合收益中反映的套期工具利得或损失转出,计入当期损益。

## 44. 重要会计政策和会计估计的变更

## (1)、重要会计政策变更

√适用 □不适用

会计政策变更的内容和原因	审批程序	备注(受重要影响的报表项目名称和金额)
2018年12月7日,财政部修订发布了《企业会计准则第21号——租赁》(以下简称“新租赁准则”),要求在境内外同时上市的企业以及在境外上市并采用国际财务报告准则或企业会计准则编制财务报表的企业,自2019年1月1日起施行;其他执行企业会计准则的企业自2021年1月1日起施行。本公司于2021年1月1日起执行新租赁准则。	第二届董事会第四十二次会议决议批准	因执行新租赁准则,合并财务报表相应调整2021年1月1日使用权资产488,876,434.60元、其他资产-53,315,333.12元、租赁负债451,912,726.80元、其他负债-13,691,584.14元、其他综合收益1,400,513.45元及未分配利润-4,060,554.63元。相关调整对本公司合并财务报表中归属于母公司股东权益的影响金额为-2,660,041.18元。 母公司财务报表相应调整2021年1月1日使用权资产361,998,344.83元、其他资产-32,308,710.09元、租赁负债330,555,354.92元及其他负债-865,720.18元。

## (2)、重要会计估计变更

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

会计估计变更的内容和原因	审批程序	开始适用的时点	备注(受重要影响的报表项目名称和金额)	影响金额
限售股估值方法变更(具体见其他说明)	第二届董事会第五十六次会议审议通过	2021年10月1日	交易性金融资产	334,850,503.37
			其他权益工具投资	32,285,171.30
			递延所得税负债	91,783,918.67
			公允价值变动收益	334,850,503.37
			盈余公积	4,752.71

		一般风险准备	9,505.42
		未分配利润	251,123,619.39
		其他综合收益	24,213,878.48

## 其他说明

## ①变更内容

本次变更前，如果估值日公开、非公开发行有明确限售期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。如果估值日公开、非公开发行有明确限售期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，综合考虑限售期等因素确定流动性折扣计算估值日该股票的价值。

本次变更后，公司通过公开、非公开等方式取得且有明确限售期的股票，在限售期内，以证券交易所上市交易的同一股票的公允价值为基础，根据第三方估值机构采用亚式期权 AAP 模型计算的流动性折扣确定估值日该股票的价值。

## ②变更原因

为准确、公允反映有明确限售期的股票的公允价值，公司根据中国证券业协会《证券公司金融工具估值指引》和财政部《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》相关要求，对估值方法进行调整。

## (3)、2021 年起首次执行新租赁准则调整首次执行当年年初财务报表相关情况

√适用 □不适用

## 合并资产负债表

单位:元 币种:人民币

项目	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日	调整数
<b>资产:</b>			
货币资金	36,651,600,637.15	36,651,600,637.15	
其中:客户资金存款	32,266,259,169.30	32,266,259,169.30	
结算备付金	8,827,027,434.56	8,827,027,434.56	
其中:客户备付金	6,713,988,018.44	6,713,988,018.44	
贵金属			
拆出资金			
融出资金	31,206,744,639.54	31,206,744,639.54	
衍生金融资产	270,143,072.50	270,143,072.50	
存出保证金	8,982,591,206.22	8,982,591,206.22	
应收款项	1,008,821,124.39	1,008,821,124.39	
应收款项融资			
合同资产	6,461,613.75	6,461,613.75	
买入返售金融资产	9,160,815,458.42	9,160,815,458.42	
持有待售资产			
<b>金融投资:</b>			
交易性金融资产	46,526,715,197.97	46,526,715,197.97	
债权投资	3,732,092,907.91	3,732,092,907.91	
其他债权投资	17,759,974,678.54	17,759,974,678.54	
其他权益工具投资	5,964,824,777.85	5,964,824,777.85	

长期股权投资	840,538,978.51	840,538,978.51	
投资性房地产	455,042,060.54	455,042,060.54	
固定资产	892,159,550.65	892,159,550.65	
在建工程	6,064,308.53	6,064,308.53	
使用权资产		488,876,434.60	488,876,434.60
无形资产	206,497,460.44	206,497,460.44	
商誉			
递延所得税资产	951,180,194.21	951,180,194.21	
其他资产	1,060,265,114.02	1,006,949,780.90	-53,315,333.12
资产总计	174,509,560,415.70	174,945,121,517.18	435,561,101.48
<b>负债：</b>			
短期借款	4,622,149,402.73	4,622,149,402.73	
应付短期融资款	11,604,103,001.41	11,604,103,001.41	
拆入资金	2,038,836,747.11	2,038,836,747.11	
交易性金融负债	8,014,669.01	8,014,669.01	
衍生金融负债	320,183,242.11	320,183,242.11	
卖出回购金融资产款	31,603,737,261.85	31,603,737,261.85	
代理买卖证券款	44,434,372,998.58	44,434,372,998.58	
代理承销证券款	2,963,337.06	2,963,337.06	
应付职工薪酬	2,386,986,778.18	2,386,986,778.18	
应交税费	733,796,178.45	733,796,178.45	
应付款项	1,911,785,575.07	1,911,785,575.07	
合同负债	31,205,667.32	31,205,667.32	
持有待售负债			
预计负债	29,568,504.39	29,568,504.39	
长期借款	324,594,588.81	324,594,588.81	
应付债券	32,805,189,719.93	32,805,189,719.93	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		451,912,726.80	451,912,726.80
递延收益			
递延所得税负债	505,440,524.78	505,440,524.78	
其他负债	6,716,884,970.16	6,703,193,386.02	-13,691,584.14
负债合计	140,079,813,166.95	140,518,034,309.61	438,221,142.66
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	6,968,625,756.00	6,968,625,756.00	
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	13,084,704,526.59	13,084,704,526.59	
减：库存股			
其他综合收益	-361,669,126.18	-360,268,612.73	1,400,513.45
盈余公积	2,081,635,058.54	2,081,635,058.54	
一般风险准备	5,356,840,035.07	5,356,840,035.07	
未分配利润	6,148,119,860.94	6,144,059,306.31	-4,060,554.63
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	33,278,256,110.96	33,275,596,069.78	-2,660,041.18
少数股东权益	1,151,491,137.79	1,151,491,137.79	
所有者权益（或股东权	34,429,747,248.75	34,427,087,207.57	-2,660,041.18

益) 合计			
负债和所有者权益 (或 股东权益) 总计	174, 509, 560, 415. 70	174, 945, 121, 517. 18	435, 561, 101. 48

各项目调整情况的说明:

适用  不适用

### 母公司资产负债表

单位: 元 币种: 人民币

项目	2020 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日	调整数
<b>资产:</b>			
货币资金	27, 989, 827, 406. 84	27, 989, 827, 406. 84	
其中: 客户资金存款	25, 988, 278, 930. 81	25, 988, 278, 930. 81	
结算备付金	8, 949, 041, 030. 56	8, 949, 041, 030. 56	
其中: 客户备付金	6, 713, 988, 018. 44	6, 713, 988, 018. 44	
贵金属			
拆出资金			
融出资金	30, 085, 911, 990. 66	30, 085, 911, 990. 66	
衍生金融资产	176, 565, 737. 30	176, 565, 737. 30	
存出保证金	2, 871, 478, 534. 45	2, 871, 478, 534. 45	
应收款项	380, 714, 201. 00	380, 714, 201. 00	
应收款项融资			
合同资产			
买入返售金融资产	7, 593, 113, 606. 19	7, 593, 113, 606. 19	
持有待售资产			
<b>金融投资:</b>			
交易性金融资产	37, 438, 751, 607. 40	37, 438, 751, 607. 40	
债权投资			
其他债权投资	17, 759, 974, 678. 54	17, 759, 974, 678. 54	
其他权益工具投资	7, 744, 968, 168. 69	7, 744, 968, 168. 69	
长期股权投资	8, 335, 070, 165. 13	8, 335, 070, 165. 13	
投资性房地产	15, 067, 217. 80	15, 067, 217. 80	
固定资产	263, 853, 473. 30	263, 853, 473. 30	
在建工程			
使用权资产		361, 998, 344. 83	361, 998, 344. 83
无形资产	158, 616, 260. 02	158, 616, 260. 02	
商誉			
递延所得税资产	790, 480, 973. 30	790, 480, 973. 30	
其他资产	700, 307, 245. 98	667, 998, 535. 89	-32, 308, 710. 09
资产总计	151, 253, 742, 297. 16	151, 583, 431, 931. 90	329, 689, 634. 74
<b>负债:</b>			
短期借款			
应付短期融资款	12, 579, 476, 019. 72	12, 579, 476, 019. 72	
拆入资金	1, 507, 510, 950. 31	1, 507, 510, 950. 31	
交易性金融负债			
衍生金融负债	207, 697, 756. 64	207, 697, 756. 64	
卖出回购金融资产款	35, 962, 040, 221. 29	35, 962, 040, 221. 29	
代理买卖证券款	32, 782, 973, 977. 13	32, 782, 973, 977. 13	
代理承销证券款			

应付职工薪酬	1,952,492,679.41	1,952,492,679.41	
应交税费	670,491,008.85	670,491,008.85	
应付款项	1,663,380,187.51	1,663,380,187.51	
合同负债	10,113,648.50	10,113,648.50	
持有待售负债			
预计负债	102,539.59	102,539.59	
长期借款			
应付债券	30,826,513,928.06	30,826,513,928.06	
其中：优先股			
永续债			
租赁负债		330,555,354.92	330,555,354.92
递延收益			
递延所得税负债	440,094,782.94	440,094,782.94	
其他负债	338,800,839.42	337,935,119.24	-865,720.18
负债合计	118,941,688,539.37	119,271,378,174.11	329,689,634.74
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>			
实收资本（或股本）	6,968,625,756.00	6,968,625,756.00	
其他权益工具			
其中：优先股			
永续债			
资本公积	12,852,639,623.42	12,852,639,623.42	
减：库存股			
其他综合收益	163,326,545.77	163,326,545.77	
盈余公积	2,083,800,860.51	2,083,800,860.51	
一般风险准备	5,211,642,713.41	5,211,642,713.41	
未分配利润	5,032,018,258.68	5,032,018,258.68	
所有者权益（或股东权益）合计	32,312,053,757.79	32,312,053,757.79	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	151,253,742,297.16	151,583,431,931.90	329,689,634.74

各项目调整情况的说明：

适用 不适用

#### (4)、2021 年起首次执行新租赁准则追溯调整前期比较数据的说明

适用 不适用

##### ①本公司作为承租人

本公司选择首次执行新租赁准则的累积影响数调整首次执行当年年初(即2021年1月1日)留存收益及财务报表其他相关项目金额，对可比期间信息不予调整：

A. 对于首次执行日前的融资租赁，本公司在首次执行日按照融资租入资产和应付融资租赁款的原账面价值，分别计量使用权资产和租赁负债；

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



C. 在首次执行日，本公司按照本节五、25，对使用权资产进行减值测试并进行相应会计处理。

本公司首次执行日之前租赁资产属于低价值资产的经营租赁，采用简化处理，未确认使用权资产和租赁负债。除此之外，本公司对于首次执行日前的经营租赁，采用下列一项或多项简化处理：

(a) 将于首次执行日后 12 个月内完成的租赁，作为短期租赁处理；

(b) 计量租赁负债时，具有相似特征的租赁采用同一折现率；

(c) 使用权资产的计量不包含初始直接费用；

(d) 存在续租选择权或终止租赁选择权的，本公司根据首次执行日前选择权的实际行使及其他最新情况确定租赁期；

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

(f) 首次执行日之前发生租赁变更的，本公司根据租赁变更的最终安排进行会计处理。

## ②本公司作为出租人

对于首次执行日前划分为经营租赁且在首次执行日后仍存续的转租赁，本公司作为转租出租人在首次执行日基于原租赁和转租赁的剩余合同期限和条款进行重新评估并做出分类。除此之外，本公司未对作为出租人的租赁按照衔接规定进行调整，而是自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

## 45. 其他

适用 不适用

## 六、税项

### 1. 主要税种及税率

主要税种及税率情况

适用 不适用

税种	计税依据	税率
增值税	应纳增值税额	6%、5%、3%、13%、9%、2%
城市维护建设税	应缴流转税额	7%、1%
教育费附加	应缴流转税额	3%
地方教育费附加	应缴流转税额	2%、1%
企业所得税	应纳税所得额	25%、16.5%、17%

存在不同企业所得税税率纳税主体的，披露情况说明

适用 不适用

纳税主体名称	所得税税率(%)
中泰金融国际有限公司等注册地在香港的子公司	16.5
Zhongtai International Holdings (Singapore) Pte.Ltd. 等注册地在新加坡的子公司	17

## 2. 税收优惠

√适用 □不适用

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，公司纳入合并范围的集合资产管理计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

## 3. 其他

√适用 □不适用

### (1) 企业所得税

根据《中华人民共和国企业所得税法》，以及国家税务总局公告 2012 年第 57 号《跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法》，本公司采用“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计缴企业所得税。本公司总部及各分支机构 2021 年度企业所得税执行 25% 税率。

### (2) 增值税

根据财政部和国家税务总局《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 号），自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 七、合并财务报表项目注释

### 1、货币资金

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
现金：	/	/	34,616.85	/	/	86,409.76
人民币	/	/	34,431.91	/	/	86,219.38
港元	226.20	0.81760	184.94	226.20	0.84164	190.38
美元		6.3757			6.5249	
银行存款：	/	/	46,089,877,402.41	/	/	36,641,823,713.54
其中：自有资金	/	/	5,665,755,407.18	/	/	4,375,564,544.24
人民币	/	/	4,924,438,802.45	/	/	3,488,088,769.29
美元	33,597,694.73	6.3757	214,208,822.29	27,289,173.80	6.5249	178,059,130.12
港元	585,335,593.38	0.81760	478,570,381.14	817,504,020.44	0.84164	688,044,083.78
其他		/	48,537,401.30		/	21,372,561.05
客户资金	/	/	40,424,121,995.23	/	/	32,266,259,169.30
人民币	/	/	38,951,555,042.88	/	/	30,456,191,896.85
美元	104,790,702.70	6.3757	668,114,083.20	155,598,995.16	6.5249	1,015,267,883.52
港元	982,522,476.96	0.81760	803,310,377.16	944,272,149.24	0.84164	794,737,211.68
其他			1,142,491.99			62,177.25
其他货币资金：	/	/	979,852.28	/	/	9,790,103.31

人民币	/	/	979,852.28	/	/	9,790,103.31
美元		6.3757			6.5249	
港元		0.81760			0.84164	
减：减值准备			603,792.49			99,589.46
合计	/	/	46,090,288,079.05	/	/	36,651,600,637.15

其中，融资融券业务：

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
自有信用资金	/	/	429,107,085.66	/	/	191,172,174.90
人民币	/	/	429,107,085.66	/	/	191,172,174.90
美元		6.3757			6.5249	
港元		0.81760			0.84164	
客户信用资金	/	/	3,827,491,747.04	/	/	2,738,535,260.15
人民币	/	/	3,827,491,747.04	/	/	2,738,535,260.15
美元		6.3757			6.5249	
港元		0.81760			0.84164	
合计	/	/	4,256,598,832.70	/	/	2,929,707,435.05

因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明：

√适用 □不适用

截至期末，公司按照中国证券监督管理委员会规定提取的一般风险准备金专户银行存款余额为 29,662.20 元，为特定用途款项，使用受限；公司滨州黄河六路证券营业部因银行预留印鉴变更被冻结货币资金 70.93 元；子公司中泰资本因诉讼被冻结货币资金 5,397,373.73 元；子公司中泰资管按照中国证券监督管理委员会规定提取的一般风险准备金专户银行存款余额为 67,173,107.50 元，为特定用途款项，使用受限。

货币资金的说明：

√适用 □不适用

(1) 截至期末，本公司存放在境外的货币资金共计 2,367,166,579.94 元，主要为本公司之子公司中泰国际以及鲁证期货存放在境外的资金。

(2) 截至期末，其他货币资金为本公司之子公司鲁证期货存放于证券及期货经纪商未被占用的交易保证金。

## 2、结算备付金

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末			期初		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
公司自有备付金：	/	/	2,433,355,900.67	/	/	2,112,959,149.02
人民币	/	/	2,433,355,900.67	/	/	2,112,959,149.02
美元		6.3757			6.5249	
港元		0.81760			0.84164	

公司信用 备付金:	/	/		/	/	
人民币	/	/		/	/	
美元		6.3757			6.5249	
港元		0.81760			0.84164	
客户普通 备付金:	/	/	7,642,742,321.75	/	/	5,811,538,377.13
人民币	/	/	7,559,696,972.05	/	/	5,756,192,829.78
美元	10,315,384.85	6.3757	65,767,799.19	6,316,999.01	6.5249	41,217,786.84
港元	21,132,033.40	0.81760	17,277,550.51	16,785,989.86	0.84164	14,127,760.51
客户信用 备付金:	/	/	1,021,792,381.78	/	/	902,449,641.31
人民币	/	/	1,021,792,381.78	/	/	902,449,641.31
美元		6.3757			6.5249	
港元		0.81760			0.84164	
加: 应收 利息						80,267.10
合计	/	/	11,097,890,604.20	/	/	8,827,027,434.56

结算备付金的说明:

截至期末, 本公司无使用受限的结算备付金。

### 3、贵金属

适用 不适用

### 4、拆出资金

适用 不适用

### 5、融出资金

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
境内	34,229,167,814.47	29,837,611,151.02
其中: 个人	31,456,773,451.64	27,445,111,435.13
机构	2,772,394,362.83	2,392,499,715.89
加: 应收利息	457,051,269.06	398,956,526.24
减: 减值准备	129,744,762.20	150,655,686.60
账面价值小计	34,556,474,321.33	30,085,911,990.66
境外	1,496,752,349.81	1,299,648,999.44
其中: 个人	775,249,009.04	744,688,961.07
机构	721,503,340.77	554,960,038.37
减: 减值准备	232,079,476.35	178,816,350.56
账面价值小计	1,264,672,873.46	1,120,832,648.88
账面价值合计	35,821,147,194.79	31,206,744,639.54

客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况:

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

担保物类别	期末公允价值	期初公允价值
资金	4,697,191,747.04	1,555,684,647.70
债券	204,601,374.00	46,880,414.85
股票	111,913,326,847.31	83,693,970,682.45
基金	2,775,962,393.18	1,235,213,230.29
合计	119,591,082,361.53	86,531,748,975.29

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

(1) 按三阶段模型披露：

单位：元 币种：人民币

阶段	期末			期初		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
第一阶段	35,599,526,807.61	47,000,102.58	35,552,526,705.03	30,995,038,973.18	31,351,829.90	30,963,687,143.28
第二阶段	51,175,553.64	183,592.33	50,991,961.31	9,411,393.02	88,035.63	9,323,357.39
第三阶段	532,269,072.09	314,640,543.64	217,628,528.45	531,766,310.50	298,032,171.63	233,734,138.87
合计	36,182,971,433.34	361,824,238.55	35,821,147,194.79	31,536,216,676.70	329,472,037.16	31,206,744,639.54

(2) 截至期末，因强制平仓仍未收回的款项余额为 76,505,495.09 元，在应收款项列报，已全额计提坏账准备。

(3) 按账龄列示：

单位：元 币种：人民币

账龄	期末			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
融资融券业务融出资金	34,686,219,083.53	95.86	129,744,762.20	0.37
1 个月以内	5,116,890,398.57	14.14	6,472,283.80	0.13
1-3 个月	5,234,798,158.42	14.47	6,495,222.62	0.12
3-6 个月	8,702,776,449.42	24.05	10,885,004.48	0.13
6-12 个月	7,589,420,258.93	20.97	10,165,995.24	0.13
12 个月以上	8,042,333,818.19	22.23	95,726,256.06	1.19
香港孖展业务融出资金	1,496,752,349.81	4.14	232,079,476.35	15.51
合计	36,182,971,433.34	100.00	361,824,238.55	1.00

(续上表)

账龄	期初			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)
融资融券业务融出资金	30,236,567,677.26	95.88	150,655,686.60	0.50
1 个月以内	9,365,376,294.77	29.70	9,365,376.30	0.10
1-3 个月	4,849,785,521.85	15.38	4,849,785.52	0.10
3-6 个月	7,348,627,092.23	23.30	7,348,627.09	0.10
6-12 个月	3,152,664,239.41	10.00	3,152,664.24	0.10
12 个月以上	5,520,114,529.00	17.50	125,939,233.45	2.28
香港孖展业务融出资金	1,299,648,999.44	4.12	178,816,350.56	13.76
合计	31,536,216,676.70	100.00	329,472,037.16	1.04

对本期发生损失准备变动的融出资金余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

融出资金的说明：

适用 不适用

6、衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末						期初					
	套期工具			非套期工具			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		名义 金额	公允价 值		名义金额	公允价值	
		资 产	负 债		资 产	负 债		资 产	负 债		资 产	负 债
利率衍生工具				35,880,000,000.00						38,510,000,000.00		
利率互换业务				35,880,000,000.00						38,510,000,000.00		
货币衍生工具										290,826,321.00	199,762.89	504,166.45
货币期货										290,826,321.00	199,762.89	504,166.45
权益衍生工具				37,364,991,632.56	183,832,773.01					26,411,494,216.54	170,868,543.62	
股指期货业务				1,840,364,180.00						1,270,683,470.00		
权益互换业务				35,524,627,452.56	183,832,773.01					25,140,810,746.54	170,868,543.62	
信用衍生工具										50,000,000.00	360,149.01	
其他衍生工具				52,119,548,429.05	246,780,845.21	367,267,613.78				77,670,826,915.49	98,714,616.98	319,679,075.66
场内期权业务				1,805,796,951.79	26,226,746.41	22,432,085.00				1,295,945,318.36	18,554,931.97	30,820,194.01
场外期权业务				37,321,076,816.26	216,127,689.51	335,913,246.10				66,497,501,252.19	77,069,857.93	286,364,157.63
场内商品期货合约				6,713,699,915.00						4,122,179,900.00		
国债期货				4,677,326,200.00	35,509.29	844,920.67				5,411,090,204.94	39,357.08	17,124.02
远期合约				1,601,648,546.00	4,390,900.00	8,077,362.01				344,110,240.00	3,050,470.00	2,477,600.00
合计				125,364,540,061.61	430,613,618.22	367,267,613.78				142,933,147,453.03	270,143,072.50	320,183,242.11

已抵销的衍生金融工具：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	抵销前总额	抵销金额	抵销后净额
场内商品期货合约	-34,120.00	-34,120.00	
股指期货合约	-9,871,020.00	-9,871,020.00	
国债期货合约	-13,218,150.00	-13,218,150.00	
利率互换	-162,325,108.86	-162,325,108.86	
远期合约	-11,000.00	-11,000.00	
合计	-185,459,398.86	-185,459,398.86	

衍生金融工具的说明：

衍生金融资产期末余额较期初增长 59.40%，主要系随着自营业务投资规模增长，场外业务需求增加所致。

**7、存出保证金**

√适用 □不适用

单位：元

项目	期末账面余额			期初账面余额		
	外币金额	折算率	折人民币金额	外币金额	折算率	折人民币金额
交易保证金	/	/	9,598,880,496.16	/	/	7,048,263,144.40
其中：人民币	/	/	9,575,597,967.31	/	/	7,038,431,266.66
美元	2,586,683.73	6.3757	16,491,919.46	200,000.00	6.5249	1,304,980.00
港元	8,305,539.86	0.81760	6,790,609.39	10,131,288.60	0.84164	8,526,897.74
信用保证金	/	/	251,611,733.27	/	/	148,234,699.88
其中：人民币	/	/	251,570,853.27	/	/	148,192,617.88
美元		6.3757			6.5249	
港元	50,000.00	0.81760	40,880.00	50,000.00	0.84164	42,082.00
履约保证金	/	/	433,763,720.44	/	/	1,786,093,361.94
其中：人民币	/	/	400,873,033.88	/	/	1,731,589,763.73
美元	5,158,756.93	6.3757	32,890,686.56	6,569,303.16	6.5249	42,864,046.22
港元		0.81760			0.84164	
其他						11,639,551.99
合计	/	/	10,284,255,949.87	/	/	8,982,591,206.22

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

□适用 √不适用

对本期发生损失准备变动的存出保证金余额显著变动的情况说明：

□适用 √不适用

**8、应收款项****(1) 按明细列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收经纪及交易商	685,447,284.76	304,667,900.14
应收场外期权客户资金	387,171,066.11	227,717,149.52
应收清算款	37,269,473.63	222,114,343.91
应收手续费及佣金	347,000,542.37	170,803,826.51



应收客户款	96,963,052.01	96,963,052.01
应收融资融券客户款	76,505,495.09	82,111,555.99
应收客户交易款	57,147,202.05	58,523,528.19
应收资管产品管理费、风险准备金	62,345,149.35	37,960,631.22
应收票据	22,690,291.03	2,000,000.00
其他	50,160,262.25	10,797,034.59
合计	1,822,699,818.65	1,213,659,022.08
减：坏账准备(按简化模型计提)	250,347,861.49	204,837,897.69
减：坏账准备(按一般模型计提)		
应收款项账面价值	1,572,351,957.16	1,008,821,124.39

## (2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额		期初余额	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1 年以内	1,457,282,449.99	79.95	1,008,006,827.43	83.07
1-2 年	177,933,557.19	9.76	107,814,090.97	8.88
2-3 年	101,211,885.46	5.55	88,885,424.10	7.32
3-4 年	78,022,209.43	4.28	650,710.32	0.05
4-5 年	83,647.32	0.01	3,679,779.45	0.30
5 年以上	8,166,069.26	0.45	4,622,189.81	0.38
合计	1,822,699,818.65	100.00	1,213,659,022.08	100.00

## (3) 按计提坏账列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

账龄	期末余额				期初余额			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备:								
单项计提坏账准备	1,338,110,404.24	73.41	218,243,330.66	16.31	941,018,340.29	77.54	182,970,579.40	19.44
单项计小计	1,338,110,404.24	73.41	218,243,330.66	16.31	941,018,340.29	77.54	182,970,579.40	19.44
组合计提坏账准备:								
其中: 1年以内	471,341,001.72	25.86	23,567,050.09	5.00	249,110,263.28	20.52	12,455,513.16	5.00
1-2年	2,283,148.32	0.13	456,629.66	20.00	10,505,496.25	0.86	2,101,099.25	20.00
2-3年	3,903,290.74	0.21	1,561,316.29	40.00	8,108,079.81	0.67	3,243,231.92	40.00
3-4年	2,712,194.18	0.15	2,169,755.34	80.00	567,063.00	0.05	453,650.40	80.00
4-5年					3,679,779.45	0.30	2,943,823.56	80.00
5年以上	4,349,779.45	0.24	4,349,779.45	100.00	670,000.00	0.06	670,000.00	100.00
组合小计	484,589,414.41	26.59	32,104,530.83	6.63	272,640,681.79	22.46	21,867,318.29	8.02
合计	1,822,699,818.65	100.00	250,347,861.49	13.74	1,213,659,022.08	100.00	204,837,897.69	16.88

期末单项计提坏账准备的应收款项：

单位：元 币种：人民币

单位名称	账面余额	坏账准备	原因
野村证券	297,270,502.07		预计不存在回收风险
基金公司席位佣金	219,256,317.85		预计不存在回收风险
Project Globe	171,696,000.00	24,936,800.00	存在一定的回收风险
邓某	110,816,920.23	13,163,359.99	存在一定的回收风险
销售服务费（汇总）	101,245,115.50		预计不存在回收风险
李某	96,963,052.01	96,963,052.01	预计收回可能性较小
应收资管产品管理费、风险准备金	63,630,577.95		预计不存在回收风险
其他 1（汇总）	83,180,118.66	83,180,118.66	预计收回可能性较小
其他 2（汇总）	194,051,799.97		预计不存在回收风险
合计	1,338,110,404.24	218,243,330.66	

期初单项计提坏账准备的应收款项：

单位：元 币种：人民币

单位名称	账面余额	坏账准备	原因
香港交易所	178,441,161.14		预计不存在回收风险
Project Globe	176,744,400.00		预计不存在回收风险
基金公司席位佣金	144,618,586.16		预计不存在回收风险
李某	96,963,052.01	96,963,052.01	预计收回可能性较小
应收融资融券客户款（汇总）	52,726,853.95	52,726,853.95	平仓后未能全额收回的应收融资融券客户款，全额计提坏账
Project Circuit	52,265,844.00		预计不存在回收风险
其他 1（汇总）	33,280,673.44	33,280,673.44	预计收回可能性较小
其他 2（汇总）	205,977,769.59		预计不存在回收风险
合计	941,018,340.29	182,970,579.40	

按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的应收款项余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

应收款项期末余额较期初增长 50.18%，主要系境外子公司为开展证券交易存入其他交易商款项增加所致。

#### (4) 按欠款方归集的期末余额前五名的应收账款情况

单位名称	余额	占应收款项余额的比例（%）	坏账准备余额
野村证券	297,270,502.07	16.31	—
平安银行股份有限公司	202,576,744.13	11.11	10,128,837.21
Project Globe	171,696,000.00	9.42	24,936,800.00
邓某	110,816,920.23	6.08	13,163,360.00
李某	96,963,052.01	5.32	96,963,052.01

合计	879,323,218.44	48.24	145,192,049.22
----	----------------	-------	----------------

(5) 应收票据

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
银行承兑票据	22,690,291.03	2,000,000.00
商业承兑票据		
合计	22,690,291.03	2,000,000.00

9、应收款项融资

□适用 √不适用

10、合同资产

(1). 合同资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
保险期 贷款	18,834,724.14		18,834,724.14	6,461,613.75		6,461,613.75
合计	18,834,724.14		18,834,724.14	6,461,613.75		6,461,613.75

(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因

□适用 √不适用

(3). 本期合同资产计提减值准备情况

□适用 √不适用

其他说明：

□适用 √不适用

11、买入返售金融资产

(1) 按业务类别

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
约定购回式证券		
股票质押式回购	7,835,199,200.74	7,116,117,261.01
债券质押式回购	4,645,527,645.33	2,035,245,468.75
债券买断式回购		49,928,037.44
其他	121,689,919.11	82,462,819.84
减：减值准备	127,671,124.35	122,938,128.62
账面价值合计	12,474,745,640.83	9,160,815,458.42

(2) 按金融资产种类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
----	--------	--------

股票	7,835,199,200.74	7,116,117,261.01
债券	4,645,527,645.33	2,085,173,506.19
基金		
其他	121,689,919.11	82,462,819.84
减：减值准备	127,671,124.35	122,938,128.62
买入返售金融资产账面价值	12,474,745,640.83	9,160,815,458.42

**(3) 担保物金额**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
担保物	30,592,009,883.79	22,329,985,634.49
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	157,705,500.00	185,207,957.44
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	157,705,500.00	49,928,037.44

**(4) 约定购回、股票质押回购融出资金按剩余期限分类披露**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	期初账面余额
一个月内	632,277,735.83	1,890,796,651.87
一个月至三个月内	1,376,473,194.79	619,495,671.82
三个月至一年内	5,465,839,752.53	3,577,407,747.76
一年以上	360,608,517.59	1,028,417,189.56
合计	7,835,199,200.74	7,116,117,261.01

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

(1) 按三阶段模型披露:

单位: 元 币种: 人民币

阶段	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
第一阶段	10,024,381,209.56	6,539,544.75	10,017,841,664.81	5,342,352,057.35	4,792,609.83	5,337,559,447.52
第二阶段	2,125,850,553.13	6,377,551.65	2,119,473,001.48	2,871,698,867.29	2,871,698.87	2,868,827,168.42
第三阶段	452,185,002.49	114,754,027.95	337,430,974.54	1,069,702,662.40	115,273,819.92	954,428,842.48
合计	12,602,416,765.18	127,671,124.35	12,474,745,640.83	9,283,753,587.04	122,938,128.62	9,160,815,458.42

其中股票质押业务三阶段模型披露情况如下:

单位: 元 币种: 人民币

阶段	期末余额				期初余额			
	账面余额	减值准备	账面价值	担保物价值	账面余额	减值准备	账面价值	担保物价值
第一阶段	5,257,163,645.12	6,539,544.75	5,250,624,100.37	15,525,481,033.85	3,174,715,731.32	3,725,284.37	3,170,990,446.95	6,806,788,312.00
第二阶段	2,125,850,553.13	6,377,551.65	2,119,473,001.48	9,146,381,098.00	2,871,698,867.29	2,871,698.87	2,868,827,168.42	11,723,942,082.09
第三阶段	452,185,002.49	114,754,027.95	337,430,974.54	613,715,211.14	1,069,702,662.40	115,273,819.92	954,428,842.48	1,641,442,735.76
合计	7,835,199,200.74	127,671,124.35	7,707,528,076.39	25,285,577,342.99	7,116,117,261.01	121,870,803.16	6,994,246,457.85	20,172,173,129.85

对本期发生损失准备变动的买入返售余额显著变动的情况说明:

适用 不适用

买入返售金融资产的说明:

适用 不适用

买入返售金融资产期末余额较期初增长 35.75%，主要系银行间债券逆回购规模增加所致。

12、持有待售资产

适用 不适用

13、交易性金融资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

期末余额						
类别	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
债券	36,055,136,656.63		36,055,136,656.63	35,681,309,630.11		35,681,309,630.11
公募基金	5,078,687,001.49		5,078,687,001.49	4,886,366,718.82		4,886,366,718.82
股票	4,551,361,199.94		4,551,361,199.94	3,552,872,622.93		3,552,872,622.93
银行理财产品	654,182,773.15		654,182,773.15	650,123,227.66		650,123,227.66
券商资管产品	996,598,705.38		996,598,705.38	1,076,266,999.90		1,076,266,999.90
信托计划	56,488,881.31		56,488,881.31	62,913,550.37		62,913,550.37
其他	5,993,144,116.26		5,993,144,116.26	5,697,218,226.27		5,697,218,226.27
合计	53,385,599,334.16		53,385,599,334.16	51,607,070,976.06		51,607,070,976.06
期初余额						
类别	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
债券	32,488,921,870.45		32,488,921,870.45	32,291,293,570.81		32,291,293,570.81
公募基金	3,389,972,512.28		3,389,972,512.28	3,256,862,616.68		3,256,862,616.68
股票	3,457,553,797.77		3,457,553,797.77	2,947,218,440.75		2,947,218,440.75
银行理财产品	1,987,033,294.94		1,987,033,294.94	1,980,997,459.57		1,980,997,459.57
券商资管产品	1,388,109,478.42		1,388,109,478.42	1,428,840,750.58		1,428,840,750.58
信托计划	111,886,263.78		111,886,263.78	108,629,659.56		108,629,659.56

其他	3,703,237,980.33		3,703,237,980.33	3,652,261,293.12		3,652,261,293.12
合计	46,526,715,197.97		46,526,715,197.97	45,666,103,791.07		45,666,103,791.07

对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的描述性说明

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

(1) 交易性金融资产中已融出证券情况：

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
股票	3,344,520.31	67,267,366.90
基金	321,026,740.25	440,073,082.39
合计	324,371,260.56	507,340,449.29

(2) 期末存在限售期的交易性金融资产情况：

单位：元 币种：人民币

证券名称	限售解禁日	期末公允价值
证券 A	2022-01-19	8,478,080.00
证券 B	因未完成业绩承诺，暂无法申报解禁	3,630,000.00
证券 C	2022-01-05	22,733,200.00
证券 D	2022-12-01	24,983,750.00
证券 E	2023-03-31	40,777,910.00
证券 F	2023-04-12	69,262,705.00
证券 G	2023-04-27	131,893,810.80
证券 H	2023-07-15	23,421,465.00
证券 I	2022-09-14	420,900,000.00
合计		746,080,920.80

(3) 存在其他变现有限制的交易性金融资产：

单位：元 币种：人民币



项目	其他变现有限制	期末公允价值
债券	质押用于回购融资	30,243,140,245.24
股票	转融通担保	811,874,851.46
债券	质押用于债券借贷业务	293,215,380.00
债券	质押用于银行贷款	47,794,265.29
合计		31,396,024,741.99

#### 14、债权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额				期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值	初始成本	利息	减值准备	账面价值
国债								
地方债								
金融债								
企业债	3,010,406,683.33	81,223,821.85	894,294,891.25	2,197,335,613.93	3,804,694,628.00	69,927,493.48	142,529,213.57	3,732,092,907.91
合计	3,010,406,683.33	81,223,821.85	894,294,891.25	2,197,335,613.93	3,804,694,628.00	69,927,493.48	142,529,213.57	3,732,092,907.91

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

√适用 □不适用

按三阶段模型披露

单位：元 币种：人民币

阶段	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
第一阶段	1,711,537,531.80	40,407,580.06	1,671,129,951.74	3,597,394,112.18	724,570.31	3,596,669,541.87
第二阶段	151,402,028.15	11,108,676.44	140,293,351.71			
第三阶段	1,228,690,945.23	842,778,634.75	385,912,310.48	277,228,009.30	141,804,643.26	135,423,366.04
合计	3,091,630,505.18	894,294,891.25	2,197,335,613.93	3,874,622,121.48	142,529,213.57	3,732,092,907.91

对本期发生损失准备变动的债权投资余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他说明：

(1) 存在其他变现在有限制的债权投资：

单位：元 币种：人民币

项目	其他变现在有限制	期末账面价值
债券	质押用于回购融资	513,799,884.23
债券	质押用于拆入资金	10,350,354.45
合计		524,150,238.68

(2) 债权投资本期计提减值准备主要系子公司持有的地产美元债计提的信用减值准备。

### 15、其他债权投资

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额					期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债										
地方债	2,920,794,946.08	52,967,463.59	-13,270,306.08	2,960,492,103.59	256,319.39	2,989,110,843.77	42,731,533.12	-10,436,189.77	3,021,406,187.12	318,622.76
金融债	6,154,559,380.06	97,216,665.09	46,436,727.94	6,298,212,773.09	1,022,472.17	3,706,938,736.65	57,209,705.43	5,249,478.35	3,769,397,920.43	390,752.01
企业债	10,530,701,922.43	183,943,128.06	-162,189,588.33	10,552,455,462.16	278,972,567.29	7,983,455,951.26	152,052,162.20	-219,792,050.86	7,915,716,062.60	281,374,974.66
其他	974,499,080.00	20,048,080.00	311,660.00	994,858,820.00	97,375.16	2,978,908,319.40	77,003,927.39	-2,457,738.40	3,053,454,508.39	277,134.34
合计	20,580,555,328.57	354,175,336.74	-128,711,506.47	20,806,019,158.84	280,348,734.01	17,658,413,851.08	328,997,328.14	-227,436,500.68	17,759,974,678.54	282,361,483.77

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

适用 不适用

按三阶段模型披露

单位：元 币种：人民币

阶段	期末余额	期初余额
----	------	------

	账面价值	累计减值准备	账面价值	累计减值准备
第一阶段	20,720,826,945.09	2,487,570.38	17,646,837,430.02	1,841,730.82
第二阶段				
第三阶段	85,192,213.75	277,861,163.63	113,137,248.52	280,519,752.95
合计	20,806,019,158.84	280,348,734.01	17,759,974,678.54	282,361,483.77

对本期发生损失准备变动的其他债权投资余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他说明：

存在其他变现有限制的其他债权投资

单位：元 币种：人民币

项目	其他变现有限制	期末账面价值
债券	质押用于回购融资	6,218,369,053.59
债券	质押用于债券借贷业务	638,917,248.00
债券	质押用于银行贷款	109,885,440.00
合计		6,967,171,741.59

## 16、其他权益工具投资

### (1). 按项目披露

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期			上期			指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因
	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	初始成本	本期末公允价值	本期确认的股利收入	
基金	1,147,949,588.72	1,357,683,157.15		680,045,532.31	788,417,106.53		非交易目的持有
其他非交易性权益工具	1,949,032,956.64	1,892,038,368.83	334,465,667.17	5,414,370,074.66	5,176,407,671.32	27,613,413.14	非交易目的持有
合计	3,096,982,545.36	3,249,721,525.98	334,465,667.17	6,094,415,606.97	5,964,824,777.85	27,613,413.14	/

截至期末，本公司将部分权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资，主要包括以战略为目的持有的股票及股权投资，以融出证券为目的持有的基金投资。

其他权益工具投资期末余额较期初下降 45.52%，主要系公司投资策略调整所致。

## (2). 本期终止确认的其他权益工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期终止确认时的公允价值	本期股利收入	终止确认时的累计利得或损失本期从其他综合收益转入留存收益的金额	处置该项投资的原因
股票	1,208,787,336.80	78,347,053.70	1,479,588.82	投资策略调整
其他	3,681,224,538.18	212,544,762.40	12,229,481.14	投资策略调整
合计	4,890,011,874.98	290,891,816.10	13,709,069.96	/

其他说明：

√适用 □不适用

(3) 其他权益工具投资中已融出证券情况：

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
基金	1,061,846,952.88	685,395,377.40
股票	129,461,800.00	
合计	1,191,308,752.88	685,395,377.40

注：融出证券的担保情况见本节附注七、5。

(4) 存在限售期的其他权益工具投资情况：

单位：元 币种：人民币

证券名称	限售解禁日	期末公允价值
证券 A	2022-10-28	41,257,762.99
证券 B	2022-11-21	33,677,728.00
证券 C	2022-8-10	1,622,565.73
证券 D	2022-1-24	90,689,125.00
合计		167,247,181.72

(5) 存在其他变现有限制的其他权益工具投资：

单位：元 币种：人民币

项目	其他变现有限制	期末账面价值
股票	转融通担保	425,215,976.11
合计		425,215,976.11

## 17、长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	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		
一、合营企业										
小计										
二、联营企业										
万家基金管理有限公司	516,541,091.15			150,311,280.29		618,109.25	24,500,000.00			642,970,480.69
齐鲁股权交易中心有限公司	116,357,830.06			5,683,253.26					-122,041,083.32	
山东中泰齐东世华节能投资中心(有限合伙)	39,011,834.90		8,890,000.00	20,486,017.59	-503,737.68		16,338,154.64			33,765,960.17
深圳市沧金投资合伙企业(有限合伙)	29,998,109.54			-1,198.30						29,996,911.24
山东未来产业科技成果转化基金合伙企业(有限合伙)	23,170,099.51			1,734,470.90	7,008,916.51					31,913,486.92
山东中泰天使创业投资基金企业(有限合伙)	22,957,164.86		4,470,000.00	20,139,818.24	-8,264,222.12		1,612,873.97			28,749,887.01
上海鲁证锋通经贸有限公司	20,015,330.05		19,100,861.53	-914,468.52						
Zhongtai Hungsing Selected IPO Fund SP	17,056,429.17			-1,176,568.55					-487,187.58	15,392,673.04
威海市中泰齐东投资中心(有限合伙)	15,998,955.76		15,300,000.00	410,799.83			1,109,755.59			
山东交易市场清算所有有限公司	10,936,785.64	5,000,000.00		1,982,429.98		1,012,938.06				18,932,153.68
山东大宗商品交易中心有限公司	10,283,070.74			-3,838,580.08						6,444,490.66
青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业(有限合伙)	10,112,283.30			-498,775.19			15,974.99			9,597,533.12

中泰证券股份有限公司 2021 年年度报告

被投资单位	期初余额	本期增减变动							期末余额	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
中泰长安（西安）股权投资合伙企业（有限合伙）	5,000,000.00			3,218.21						5,003,218.21	
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	3,000,000.00			312,499.05						3,312,499.05	
深圳市沧鑫投资合伙企业（有限合伙）	99,993.83			-26.19						99,967.64	
中泰威智（枣庄）新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）		10,000,000.00		597,214.30						10,597,214.30	
蚌埠中泰成长一号企业管理合伙企业（有限合伙）		7,500,000.00		-42,143.63						7,457,856.37	
烟台国丰芝财中泰股权投资基金合伙企业（有限合伙）		2,000,000.00								2,000,000.00	
济南中泰新动能海富股权投资基金合伙企业（有限合伙）		20,000,000.00		-2,445.69						19,997,554.31	
共青城中泰凯金投资合伙企业（有限合伙）		30,000,000.00		26,410,467.61						56,410,467.61	
共青城中泰东方投资合伙企业（有限合伙）		29,993,250.00		-15,145,498.23						14,847,751.77	
小计	840,538,978.51	104,493,250.00	47,760,861.53	206,451,764.88	-1,759,043.29	1,631,047.31	43,576,759.19		-122,528,270.90	937,490,105.79	
合计	840,538,978.51	104,493,250.00	47,760,861.53	206,451,764.88	-1,759,043.29	1,631,047.31	43,576,759.19		-122,528,270.90	937,490,105.79	

**18、投资性房地产**

投资性房地产计量模式

**(1). 采用成本计量模式的投资性房地产**

单位：元 币种：人民币

项目	房屋、建筑物	土地使用权	在建工程	合计
一、账面原值				
1. 期初余额	545,228,724.99			545,228,724.99
2. 本期增加金额	721,888,230.89			721,888,230.89
(1) 外购	721,888,230.89			721,888,230.89
(2) 存货\固定资产\在建工程转入				
(3) 企业合并增加				
3. 本期减少金额	20,350,836.52			20,350,836.52
(1) 处置	12,969,219.72			12,969,219.72
(2) 其他转出	7,381,616.80			7,381,616.80
4. 期末余额	1,246,766,119.36			1,246,766,119.36
二、累计折旧和累计摊销				
1. 期初余额	90,186,664.45			90,186,664.45
2. 本期增加金额	26,414,568.68			26,414,568.68
(1) 计提或摊销	26,414,568.68			26,414,568.68
3. 本期减少金额	11,216,426.87			11,216,426.87
(1) 处置	8,350,736.52			8,350,736.52
(2) 其他转出	2,865,690.35			2,865,690.35
4. 期末余额	105,384,806.26			105,384,806.26
三、减值准备				
1. 期初余额				
2. 本期增加金额				
(1) 计提				
3. 本期减少金额				
(1) 处置				
(2) 其他转出				
4. 期末余额				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	1,141,381,313.10			1,141,381,313.10
2. 期初账面价值	455,042,060.54			455,042,060.54

**(2). 未办妥产权证书的投资性房地产情况**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
德州解放南路 18 号	1,762,431.50	尚未取得土地使用证

其他说明

√适用 □不适用

投资性房地产期末账面价值较期初增长 150.83%，主要系子公司中泰物业本期新增购入房产用于出租所致。

19、固定资产

(1). 固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	电子设备	办公设备	其他	合计
一、账面原值：					
1. 期初余额	1,052,391,141.84	759,015,169.51	115,629,381.83	107,769,404.63	2,034,805,097.81
2. 本期增加金额	13,024,194.58	137,278,551.33	8,295,998.94	16,165,924.71	174,764,669.56
(1) 购置		132,233,072.64	8,295,998.94	12,329,787.79	152,858,859.37
(2) 在建工程转入					
(3) 企业合并增加	5,642,577.78	5,045,478.69		3,836,136.92	14,524,193.39
(4) 投资性房地产转入	7,381,616.80				7,381,616.80
3. 本期减少金额	13,090,509.97	82,073,211.24	8,049,938.58	11,282,062.20	114,495,721.99
(1) 处置或报废	13,090,509.97	82,073,211.24	8,049,938.58	10,925,925.86	114,139,585.65
(2) 其他				356,136.34	356,136.34
4. 外币报表折算差额		-319,022.25	-47,619.12	-89,637.70	-456,279.07
5. 期末余额	1,052,324,826.45	813,901,487.35	115,827,823.07	112,563,629.44	2,094,617,766.31
二、累计折旧					
1. 期初余额	368,021,295.15	591,486,782.68	94,170,886.13	88,966,583.20	1,142,645,547.16
2. 本期增加金额	36,860,174.03	80,409,709.97	7,050,039.72	8,609,849.45	132,929,773.17
(1) 计提	33,590,586.50	76,588,609.28	7,050,039.72	6,236,086.48	123,465,321.98
(2) 企业合并增加	2,865,690.35	3,821,100.69		2,373,762.97	9,060,554.01
(3) 投资性房地产转入	403,897.18				403,897.18
3. 本期减少金额	8,428,833.60	73,060,521.49	7,128,673.86	10,416,309.94	99,034,338.89
(1) 处置或报废	8,428,833.60	73,060,521.49	7,128,673.86	10,171,979.86	98,790,008.81
(2) 其他				244,330.08	244,330.08
4. 外币报表折算差额		-519,535.72	86,620.59	-63,495.27	-496,410.40
5. 期末余额	396,452,635.58	598,316,435.44	94,178,872.58	87,096,627.44	1,176,044,571.04
三、减值准备					
1. 期初余额					
2. 本期增加金额					
(1) 计提					
3. 本期减少金额					
(1) 处置或报废					
4. 期末余额					
四、账面价值					
1. 期末账面价值	655,872,190.87	215,585,051.91	21,648,950.49	25,467,002.00	918,573,195.27
2. 期初账面价值	684,369,846.69	167,528,386.83	21,458,495.70	18,802,821.43	892,159,550.65

(2). 暂时闲置的固定资产情况

□适用 √不适用

(3). 通过融资租赁租入的固定资产情况

□适用 √不适用

(4). 通过经营租赁租出的固定资产

□适用 √不适用

(5). 未办妥产权证书的固定资产情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	账面价值	未办妥产权证书的原因
烟台南大街 104 号、105 号	16,045,875.32	尚未取得房产证和土地使用证

其他说明：

√适用 □不适用



截至期末，资产担保、抵押情况详见本节七、75 所有权或使用权受到限制的资产。

## 20、在建工程

### (1). 在建工程情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
财富中心	6,064,308.53		6,064,308.53	6,064,308.53		6,064,308.53
上海绿地外滩项目 A2 办公楼	721,888,230.89		721,888,230.89			
合计	727,952,539.42		727,952,539.42	6,064,308.53		6,064,308.53

(2). 重要在建工程项目本期变动情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	预算数	期初余额	本期增加金额	本期转入固定资产金额	本期其他减少金额	期末余额	工程累计投入占预算比例 (%)	工程进度	利息资本化累计金额	其中：本期利息资本化金额	本期利息资本化率 (%)	资金来源
上海绿地外滩项目 A2 办公楼	721,888,230.89		721,888,230.89			721,888,230.89	/	待装修	/	/	/	自有
合计	721,888,230.89		721,888,230.89			721,888,230.89	/	/			/	/

(3). 本期计提在建工程减值准备情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

在建工程期末余额较期初增长 11903.88%，主要系公司转入待装修办公楼所致。

21、使用权资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	房屋及建筑物	其他	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	534,014,838.26	994,714.62	535,009,552.88
2. 本期增加金额	413,708,740.19		413,708,740.19
3. 本期减少金额	46,024,030.95		46,024,030.95
4. 外币报表折算差额	3,278,951.53		3,278,951.53
5. 期末余额	904,978,499.03	994,714.62	905,973,213.65
二、累计折旧			
1. 期初余额	46,133,118.28		46,133,118.28
2. 本期增加金额	224,954,502.56	293,149.56	225,247,652.12
3. 本期减少金额	32,080,318.06		32,080,318.06
4. 外币报表折算差额	4,747,930.47		4,747,930.47
5. 期末余额	243,755,233.25	293,149.56	244,048,382.81
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	661,223,265.78	701,565.06	661,924,830.84
2. 期初账面价值	487,881,719.98	994,714.62	488,876,434.60

22、无形资产

(1). 无形资产情况

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	土地使用权	软件	交易席位费	商标使用权	其他	合计
一、账面原值						
1. 期初余额	58,968,314.18	587,008,252.96	44,638,254.38	2,622,200.00	141,200.00	693,378,221.52
2. 本期增加金额		117,338,851.43				117,338,851.43
(1) 购置		85,456,485.72				85,456,485.72
(2) 内部研发						
(3) 企业合并增加		31,882,365.71				31,882,365.71
3. 本期减少金额	33,504,633.00	978,324.51				34,482,957.51
(1) 处置	33,504,633.00	978,324.51				34,482,957.51

4. 外币报表折算差额		-325,553.69	-24,040.00			-349,593.69
5. 期末余额	25,463,681.18	703,043,226.19	44,614,214.38	2,622,200.00	141,200.00	775,884,521.75
二、累计摊销						
1. 期初余额	23,845,427.29	416,520,032.88	43,796,614.38	2,622,200.00	96,486.53	486,880,761.08
2. 本期增加金额	767,880.53	80,842,056.00			28,239.96	81,638,176.49
(1) 计提	767,880.53	64,573,080.68			28,239.96	65,369,201.17
(2) 企业合并增加		16,268,975.32				16,268,975.32
3. 本期减少金额	13,066,808.04	409,359.00				13,476,167.04
(1) 处置	13,066,808.04	409,359.00				13,476,167.04
4. 外币报表折算差额		-235,002.94				-235,002.94
5. 期末余额	11,546,499.78	496,717,726.94	43,796,614.38	2,622,200.00	124,726.49	554,807,767.59
三、减值准备						
1. 期初余额						
2. 本期增加金额		1,438,333.48				1,438,333.48
(1) 计提		1,438,333.48				1,438,333.48
3. 本期减少金额						
(1) 处置						
4. 期末余额		1,438,333.48				1,438,333.48
四、账面价值						
1. 期末账面价值	13,917,181.40	204,887,165.77	817,600.00		16,473.51	219,638,420.68
2. 期初账面价值	35,122,886.89	170,488,220.08	841,640.00		44,713.47	206,497,460.44

## (2). 未办妥产权证书的土地使用权情况

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

## 23、商誉

## (1). 商誉账面原值

适用 不适用

## (2). 商誉减值准备

适用 不适用

## (3). 商誉所在资产组或资产组组合的相关信息

适用 不适用

## (4). 说明商誉减值测试过程、关键参数(例如预计未来现金流量现值时的预测期增长率、稳定期增长率、利润率、折现率、预测期等,如适用)及商誉减值损失的确认方法

适用 不适用

## (5). 商誉减值测试的影响

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

## 24、递延所得税资产/ 递延所得税负债

## (1). 未经抵销的递延所得税资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	1,998,829,429.80	499,707,357.45	1,753,291,677.20	438,322,919.30
坏账准备	383,950,983.12	95,987,745.78	332,817,643.70	83,204,410.93
其他权益工具投资公允价值变动	188,024,212.12	47,006,053.03	285,107,177.40	71,276,794.35
其他债权投资公允价值变动	121,971,351.68	30,492,837.92	227,436,500.68	56,859,125.17
融资融券减值准备	129,744,762.20	32,436,190.55	150,655,686.60	37,663,921.65
其他	1,393,424,302.90	348,356,075.73	1,098,742,499.42	274,685,624.84
合计	4,215,945,041.82	1,053,986,260.46	3,848,051,185.00	962,012,796.24

## (2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
预提利息收入	1,131,265,159.28	282,816,289.82	1,010,353,169.56	252,588,292.37
结构化主体并表	780,048,534.36	195,012,133.59	566,787,026.79	141,696,756.70
其他	1,533,244,704.58	383,311,176.15	487,952,310.93	121,988,077.74
合计	3,444,558,398.22	861,139,599.56	2,065,092,507.28	516,273,126.81

## (3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	38,952,189.15	1,015,034,071.31	10,832,602.03	951,180,194.21
递延所得税负债	38,952,189.15	822,187,410.41	10,832,602.03	505,440,524.78

## (4). 未确认递延所得税资产明细

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
可抵扣亏损	1,762,906,274.00	837,395,555.40
坏账准备	4,741,646.68	
融出资金减值准备	2,881,145.36	1,383,235.83
债权投资减值准备	63,009,119.99	724,570.31
应收利息及其他资产减值准备	297,050.15	87,075,364.75

合计	1,833,835,236.18	926,578,726.29
----	------------------	----------------

(5). 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

年份	期末金额	期初金额	备注
2022 年			
2023 年			
2024 年	27,410.68	27,410.66	
2025 年	197,071,116.43	188,055,028.36	
2026 年	158,446,953.11		
无到期日	1,407,360,793.78	649,313,116.38	
合计	1,762,906,274.00	837,395,555.40	/

其他说明：

√适用 □不适用

递延所得税负债期末余额较期初增长 62.67%，主要系交易性金融资产公允价值上升，相应确认的递延所得税负债增加所致。

25、其他资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	期初账面价值
预付购房款	970,197,939.00	366,000,000.00
其他预付款项	124,930,640.25	36,178,984.81
待抵扣进项税	148,181,877.70	43,278,710.00
其他应收款	137,893,278.73	163,485,759.02
长期待摊费用	71,221,414.61	69,651,382.26
存货	44,334,964.45	107,906,079.75
待摊费用	36,436,306.31	33,676,651.39
融资租赁及保理业务应收款	35,147,732.76	123,769,360.60
应收利息	315,330.87	13,745,249.27
预缴所得税	16,614,099.48	9,500,116.18
项目融资款	6,540,800.00	6,733,120.00
应收股利	2,355,589.42	3,703,701.42
会员资格投资	1,400,000.00	1,400,000.00
其他	43,397,019.62	27,920,666.20
合计	1,638,966,993.20	1,006,949,780.90

其他应收款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

款项性质	期末账面余额	期初账面余额
往来款	73,145,940.00	48,561,323.16
押金	52,598,943.11	46,484,385.13
其他	139,839,455.43	186,637,205.77
合计	265,584,338.54	281,682,914.06

其他应收款等项目按预期信用损失一般模型计提坏账准备的注释或说明：

适用 不适用

对本期发生损失准备变动的其他资产余额显著变动的情况说明：

适用 不适用

其他资产的说明：

(1) 其他资产-其他应收款

①按明细列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
其他应收款余额	265,584,338.54	281,682,914.06
减：坏账准备	127,691,059.81	118,197,155.04
其他应收款账面价值	137,893,278.73	163,485,759.02

②按账龄分析

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内	119,938,975.77	45.17	4,839,653.12	4.04
1-2年	18,068,432.56	6.80	3,468,456.68	19.20
2-3年	32,211,454.27	12.13	28,197,190.59	87.54
3-4年	6,597,611.38	2.48	4,701,224.78	71.26
4-5年	7,413,154.13	2.79	5,166,294.21	69.69
5年以上	81,354,710.43	30.63	81,318,240.43	99.96
合计	265,584,338.54	100.00	127,691,059.81	48.08

(续)

项目	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内	148,648,484.40	52.78	5,632,160.41	3.79
1-2年	15,020,340.19	5.33	3,933,920.84	26.19
2-3年	10,742,028.73	3.81	5,449,984.29	50.74
3-4年	12,050,239.71	4.28	9,000,191.77	74.69
4-5年	66,872,735.83	23.74	65,831,812.53	98.44
5年以上	28,349,085.20	10.06	28,349,085.20	100.00
合计	281,682,914.06	100.00	118,197,155.04	41.96

③计提坏账列示

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合计比例 (%)	金额	坏账准备计提比例 (%)
单项计提坏账准备	131,875,640.00	49.65	92,446,269.40	70.10
组合计提坏账准备	133,708,698.54	50.35	35,244,790.41	26.36

其中：1 年以内	83,414,525.33	31.41	4,170,726.26	5.00
1-2 年	17,342,283.40	6.53	3,468,456.68	20.00
2-3 年	5,826,689.47	2.19	2,330,675.79	40.00
3-4 年	3,472,420.98	1.31	2,777,936.78	80.00
4-5 年	5,778,922.27	2.18	4,623,137.81	80.00
5 年以上	17,873,857.09	6.73	17,873,857.09	100.00
合计	265,584,338.54	100.00	127,691,059.81	48.08

期末单项计提坏账准备的其他应收款：

单位：元 币种：人民币

单位名称	账面余额	坏账准备	原因
北京百瑞文化传媒有限公司	48,561,323.16	48,561,323.16	收回可能性较小，全额计提
山东红牛金融服务 有限公司	24,556,698.80	24,556,698.80	收回可能性较小，全额 计提
应收资管税款	18,500,385.85		预计不存回收风险
北京聚信量化科技 有限公司	13,106,796.14	13,106,796.14	收回可能性较小，全额 计提
中国证券登记结算 有限公司	7,257,600.00		预计不存回收风险
上海华信国际集团 有限公司	1,309,816.00	1,309,816.00	收回可能性较小，全额 计提
其他 1（汇总）	13,671,384.75		预计不存回收风险
其他 2（汇总）	4,911,635.30	4,911,635.30	收回可能性较小，全额 计提
合计	131,875,640.00	92,446,269.40	

（续）

项目	期初余额			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额合 计比例（%）	金额	坏账准备计 提比例（%）
单项计提坏账准备	111,193,679.39	39.47	65,698,438.94	59.08
组合计提坏账准备	170,489,234.67	60.53	52,498,716.10	30.79
其中：1 年以内	104,119,035.31	36.97	5,205,951.77	5.00
1-2 年	13,120,524.19	4.66	2,624,104.84	20.00
2-3 年	8,816,740.73	3.13	3,526,696.29	40.00
3-4 年	11,250,239.71	3.99	9,000,191.77	80.00
4-5 年	5,204,616.53	1.85	4,163,693.23	80.00
5 年以上	27,978,078.20	9.93	27,978,078.20	100.00
合计	281,682,914.06	100.00	118,197,155.04	41.96

期初单项计提坏账准备的其他应收款：

单位：元 币种：人民币

单位名称	账面余额	坏账准备	原因
北京百瑞文化传媒有 限公司	48,561,323.16	48,561,323.16	收回可能性较小，全 额计提
资管计划税款	25,930,605.25		预计不存在回收风险
北京聚信量化科技有 限公司	13,106,796.14	13,106,796.14	收回可能性较小，全 额计提



中国证券登记结算有限公司	11,601,255.58		预计不存在回收风险
上海华信国际集团有限公司	1,309,816.00	1,309,816.00	收回可能性较小，全额计提
其他 1（汇总）	7,963,379.62		预计不存在回收风险
其他 2（汇总）	2,720,503.64	2,720,503.64	收回可能性较小，全额计提
合计	111,193,679.39	65,698,438.94	

④本期计提坏账准备的金额为-15,555,344.83 元。

⑤截至期末，本公司其他应收款中无持本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款。

⑥按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款情况

单位：元 币种：人民币

单位名称	款项的性质	期末余额	账龄	占其他应收款期末余额合计数的比例(%)	坏账准备
北京百瑞文化传媒有限公司	往来款	48,561,323.16	5 年以上	18.28	48,561,323.16
山东红牛金融服务有限公司	往来款	24,556,698.80	2-3 年	9.25	24,556,698.80
北京东方文华国际置业有限公司	押金	16,138,810.05	1 年以内	6.08	806,940.50
北京聚信量化科技有限公司	往来款	13,106,796.14	5 年以上	4.94	13,106,796.14
大连商品交易所	应收货币保证金	11,855,978.74	1 年以内	4.46	592,798.94
合计		114,219,606.89		43.01	87,624,557.54

(2) 其他资产-长期待摊费用

单位：元 币种：人民币

项目	上期期末余额	会计政策变更	本期期初余额	本期增加	本期摊销	本期其他减少	本期期末余额
固定资产改良支出	55,061,672.63		55,061,672.63	29,431,145.07	26,667,212.02	5,851.16	57,819,754.52
其他	14,589,709.63	-1,077,806.00	13,511,903.63	8,317,116.64	8,047,668.54	379,691.64	13,401,660.09
合计	69,651,382.26	-1,077,806.00	68,573,576.26	37,748,261.71	34,714,880.56	385,542.80	71,221,414.61

(3) 其他资产-预付购房款

其他资产-预付购房款为公司预付中民外滩房地产开发有限公司、济南高新控股集团有限公司、日照兴业房地产开发有限公司的购房款，金额分别为 548,944,000.00 元、366,000,000.00 元、55,253,939.00 元。

(4) 项目融资款减值说明

①中泰国际投资镇江兆和私募债券项目截至期末的减值准备余额为 75,003,000.00 港币，折合人民币 61,322,452.80 元，具体见附注“十八、其他重要事项”。

②中泰国际皇月国际项目截至期末的减值准备余额为 61,550,000.00 港币，折合人民币 50,323,280.00 元，具体见附注“十八、其他重要事项”。

(5) 应收利息的减值准备情况

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应收利息余额	69,686,252.06	105,547,025.00
减：减值准备	69,370,921.19	91,801,775.73
应收利息账面价值	315,330.87	13,745,249.27

重要的逾期利息明细如下：

单位：元 币种：人民币

融资单位	期末余额	计提减值金额	逾期天数	减值判断依据	减值计提依据
刘某某	45,182,813.95	45,182,813.95	1143	债务人逾期	债务人无力偿还利息全额计提坏账准备
北京百瑞文化传媒有限公司	11,654,717.56	11,654,717.56	731	债务人逾期	债务人无力偿还利息全额计提坏账准备
刘某	6,765,039.39	6,765,039.39	1128	债务人逾期	债务人无力偿还利息全额计提坏账准备
合计	63,602,570.90	63,602,570.90			

(6) 截至期末，资产质押情况见附注七、75。

(7) 其他资产期末账面价值较期初上升 54.58%，主要系本期中泰物业预付购置上海外滩办公楼款项增加所致。

26、融券业务情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	2,008,090,170.69	2,012,010,793.26
—交易性金融资产	324,371,260.56	507,340,449.29
—其他权益工具投资	1,191,308,752.88	685,395,377.40
—转融通融入证券	492,410,157.25	819,274,966.57
转融通融入证券总额	1,121,147,519.00	1,009,800,188.00

融券业务违约情况：

适用 不适用

融券业务的说明：

截至期末，本公司融券业务无重大合约逾期。

## 27、资产减值准备变动表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	其他增加	本期减少		汇率影响	期末余额
				转回	转/核销		
货币资金减值准备	99,589.46	504,203.03					603,792.49
融出资金减值准备	329,472,037.16	38,365,043.10				-6,012,841.71	361,824,238.55
应收款项坏账准备	204,837,897.69	50,981,719.24		4,873,835.79	41,016.41	-556,903.24	250,347,861.49
其他应收款坏账准备	118,197,155.04	-15,555,344.83	25,056,698.80			-7,449.20	127,691,059.81
债权投资减值准备	142,529,213.57	767,558,905.88				-15,793,228.20	894,294,891.25
其他债权投资减值准备	282,361,483.77	4,558,389.15			6,568,123.51	-3,015.40	280,348,734.01
买入返售金融资产减值准备	122,938,128.62	5,225,926.36		492,930.63			127,671,124.35
其他资产（除其他应收款）减值准备	293,803,465.18	-84,809,667.25				-6,269,573.10	202,724,224.83
金融工具及其他项目信用减值准备小计	1,494,238,970.49	766,829,174.68	25,056,698.80	5,366,766.42	6,609,139.92	-28,643,010.85	2,245,505,926.78
长期股权投资减值准备							
投资性房地产减值准备							
固定资产减值准备							
在建工程减值准备							
无形资产减值准备		1,438,333.48					1,438,333.48
商誉减值准备							
存货跌价准备		289,515.05					289,515.05
其他资产减值准备小计		1,727,848.53					1,727,848.53
合计	1,494,238,970.49	768,557,023.21	25,056,698.80	5,366,766.42	6,609,139.92	-28,643,010.85	2,247,233,775.31

## 28、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

金融工具类别	期末余额
--------	------

	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)	合计
货币资金减值准备	603,792.49			603,792.49
融出资金减值准备	47,000,102.58	183,592.33	314,640,543.64	361,824,238.55
应收款项坏账准备(简化模型)		32,104,530.83	218,243,330.66	250,347,861.49
买入返售金融资产减值准备	6,539,544.75	6,377,551.65	114,754,027.95	127,671,124.35
债权投资减值准备	40,407,580.06	11,108,676.44	842,778,634.75	894,294,891.25
其他债权投资减值准备	2,487,570.38		277,861,163.63	280,348,734.01
其他应收款坏账准备	35,244,790.41		92,446,269.40	127,691,059.81
其他资产(除其他应收款)减值准备			202,724,224.83	202,724,224.83
合计	132,283,380.67	49,774,351.25	2,063,448,194.86	2,245,505,926.78
	期初余额			
金融工具类别	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)	合计
货币资金减值准备	99,589.46			99,589.46
融出资金减值准备	31,351,829.90	88,035.63	298,032,171.63	329,472,037.16
应收款项坏账准备(简化模型)		21,867,318.29	182,970,579.40	204,837,897.69
买入返售金融资产减值准备	4,792,609.83	2,871,698.87	115,273,819.92	122,938,128.62
债权投资减值准备	724,570.30		141,804,643.27	142,529,213.57
其他债权投资减值准备	1,841,730.82		280,519,752.95	282,361,483.77
其他应收款坏账准备	52,498,716.10		65,698,438.94	118,197,155.04
其他资产(除其他应收款)减值准备	547,322.18		293,256,143.00	293,803,465.18
合计	91,856,368.59	24,827,052.79	1,377,555,549.11	1,494,238,970.49

29、短期借款

(1). 短期借款分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

质押借款	744,369,230.43	420,932,410.82
信用借款	1,335,676,486.45	2,212,820,409.74
保证借款	2,165,310,486.49	1,988,396,582.17
合计	4,245,356,203.37	4,622,149,402.73

(2). 已逾期未偿还的短期借款情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

30、应付短期融资款

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
中泰证券短期收益凭证 (汇总)	100.00	2021/1/6~2021/12/31	14~365天	4,360,149,283.00	2.35~8.00 /浮动利率	2,875,123,663.56	13,856,628,022.29	12,351,519,249.33	4,380,232,436.52
中泰证券股份有限公司 2020 年度第五期短期融资券	100.00	2020/11/25	90 天	2,500,000,000.00	3.40	2,508,246,575.34	7,589,041.10	2,515,835,616.44	
中泰证券股份有限公司 2021 年度第一期短期融资券	100.00	2021/1/27	90 天	2,500,000,000.00	2.85		2,517,616,438.35	2,517,616,438.35	
中泰证券股份有限公司 2021 年度第二期短期融资券	100.00	2021/7/23	81 天	2,500,000,000.00	2.38		2,511,410,958.90	2,511,410,958.90	
中泰证券股份有限公司 2021 年度第三期短期融资券	100.00	2021/10/22	340 天	2,500,000,000.00	3.00		2,514,102,739.73		2,514,102,739.73
中泰证券股份有限公司非公开发行 2020 年公司债券 (第二期)	100.00	2020/8/28	1 年	3,000,000,000.00	3.40	3,034,717,808.22	493,150.68	3,035,210,958.90	
中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年短期公司债券 (第一期)	100.00	2020/11/19	1 年	3,000,000,000.00	3.55	3,007,253,424.66	61,116,616.44	3,068,370,041.10	
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年短期公司债券 (第一期)	100.00	2021/9/27	333 天	3,000,000,000.00	3.00		3,016,055,238.80		3,016,055,238.80
中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年短期公司债券 (第二	100.00	2021/11/25	336 天	3,000,000,000.00	3.00		3,000,388,121.34		3,000,388,121.34

中泰证券股份有限公司 2021 年年度报告

债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率 (%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
期)									
中泰国际私募债	USD1,000.00	2020/9/28	6 个月	137,216,622.40	5.50	132,343,587.97		132,343,587.97	
中泰国际私募债	USD1,000.00	2020/9/14	6 个月	48,025,817.84	5.50	46,417,941.66		46,417,941.66	
中泰国际私募债	USD1,000.00	2021/3/16	6 个月	45,300,289.65	5.00		45,071,749.80	45,071,749.80	
合计	/	/	/	26,590,692,012.89	/	11,604,103,001.41	27,530,472,077.43	26,223,796,542.45	12,910,778,536.39

**31、拆入资金**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
银行拆入资金		
转融通融入资金	2,507,527,084.87	1,507,510,950.31
其他	277,721,757.00	531,325,796.80
合计	2,785,248,841.87	2,038,836,747.11

转融通融入资金：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

剩余期限	期末		期初	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1 个月以内	993,751.53	2.1%-40.6%	2,593,416.34	2.80%
1 至 3 个月	2,506,533,333.34	2.80%	1,504,529,534.82	2.80%
3 至 12 个月			387,999.15	2.80%
1 年以上				
合计	2,507,527,084.87	/	1,507,510,950.31	/

拆入资金的说明：

拆入资金期末余额较期初上升 36.61%，主要系公司本期调整融资结构，转融通融入资金增加所致。

**32、交易性金融负债****(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末公允价值			期初公允价值		
	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	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
沽空交易负债-债券	54,450,766.68		54,450,766.68	3,686,591.65		3,686,591.65
结构性票据				4,328,077.36		4,328,077.36
合计	54,450,766.68		54,450,766.68	8,014,669.01		8,014,669.01

对指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的描述性说明：

□适用 √不适用

**(2) 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自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入其他综合收益**

□适用 √不适用

## (3) 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自身信用风险变动引起的公允价值变动金额计入当期损益

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

## 33、卖出回购金融资产款

## (1) 按业务类别

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
买断式卖出回购	2,888,503,021.81	134,836,990.82
质押式卖出回购	33,737,229,817.01	29,367,230,026.58
质押式报价回购	369,616,000.00	99,500,800.00
资产收益权转让		2,002,169,444.45
合计	36,995,348,838.82	31,603,737,261.85

## (2) 按金融资产种类

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	36,995,348,838.82	29,601,567,817.40
资产收益权转让		2,002,169,444.45
合计	36,995,348,838.82	31,603,737,261.85

## (3) 担保物金额

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
债券	37,387,101,282.65	37,069,296,213.44
信用业务债权收益权		2,080,318,044.78
合计	37,387,101,282.65	39,149,614,258.22

## (4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

期限	期末账面余额	利率区间	期初账面余额	利率区间
一个月内	364,733,000.00	2.50%-7.00%	99,500,800.00	2.45%-4.00%
一个月至三个月内	2,642,000.00			
三个月至一年内	2,241,000.00			
一年以上				
合计	369,616,000.00		99,500,800.00	

卖出回购金融资产款的说明：

适用 不适用



**34、代理买卖证券款**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
普通经纪业务		
其中：个人	32,087,269,768.29	29,592,420,927.83
机构	18,894,672,768.70	10,834,041,881.14
小计	50,981,942,536.99	40,426,462,808.97
信用业务		
其中：个人	3,814,561,714.06	3,529,509,749.35
机构	1,416,660,268.47	478,400,440.26
小计	5,231,221,982.53	4,007,910,189.61
合计	56,213,164,519.52	44,434,372,998.58

**35、代理承销证券款**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
股票		
债券	5,650,010.43	2,963,337.06
其中：国债		
金融债券		
企业债券	5,650,010.43	2,963,337.06
其他有价证券		
合计	5,650,010.43	2,963,337.06

**36、应付职工薪酬****(1). 应付职工薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	2,236,886,553.31	4,081,745,587.28	3,851,894,820.70	2,466,737,319.89
二、离职后福利-设定提存计划	11,599,342.78	440,142,194.27	447,028,553.79	4,712,983.26
三、辞退福利	138,500,882.09	98,305,519.67	54,381,039.39	182,425,362.37
合计	2,386,986,778.18	4,620,193,301.22	4,353,304,413.88	2,653,875,665.52

**(2). 短期薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,843,797,080.18	3,640,161,705.88	3,400,677,842.86	2,083,280,943.20
二、职工福利费	1,000,000.00	61,726,492.60	62,726,492.60	
三、社会保险费	248,605.15	126,159,350.81	125,780,856.03	627,099.93
其中：医疗保险费	220,370.96	120,715,097.57	120,371,823.04	563,645.49
工伤保险费	24,340.01	2,520,028.00	2,517,110.88	27,257.13
生育保险费	3,894.18	2,924,225.24	2,891,922.11	36,197.31

四、住房公积金	111,917.07	183,070,579.77	182,330,877.53	851,619.31
五、工会经费和职工教育经费	391,728,950.91	70,623,858.22	80,375,151.68	381,977,657.45
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
八、其他短期薪酬		3,600.00	3,600.00	
合计	2,236,886,553.31	4,081,745,587.28	3,851,894,820.70	2,466,737,319.89

(3). 设定提存计划列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	3,986,247.25	232,110,334.15	233,461,095.39	2,635,486.01
2、失业保险费	30,371.43	8,648,934.41	8,611,115.37	68,190.47
3、企业年金缴费	7,582,724.10	199,382,925.71	204,956,343.03	2,009,306.78
合计	11,599,342.78	440,142,194.27	447,028,553.79	4,712,983.26

其他说明：

√适用 □不适用

(4). 辞退福利

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
辞退福利	138,500,882.09	98,305,519.67	54,381,039.39	182,425,362.37
合计	138,500,882.09	98,305,519.67	54,381,039.39	182,425,362.37

37、应交税费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
企业所得税	266,516,190.46	324,794,412.33
代扣代缴限售股所得税	107,865,622.91	253,894,430.94
增值税	81,961,183.38	55,443,081.81
个人所得税	30,066,947.04	40,324,717.43
城市维护建设税	8,106,057.41	10,514,182.50
教育费附加及地方教育费附加	5,811,149.68	7,512,681.02
其他	14,793,947.09	41,312,672.42
合计	515,121,097.97	733,796,178.45

38、应付款项

(1). 应付款项列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
应付场外业务客户资金	2,514,697,077.31	1,762,402,706.69
客户现金股利及利息	469,971,077.40	35,533,070.90
应付清算款	114,009,124.57	66,132.74
应付资管产品管理费或佣金	49,495,655.28	34,895,391.65

资金三方存管费	28,508,435.78	27,415,883.21
经纪人佣金	10,384,426.01	15,368,007.25
其他	228,475,513.60	36,104,382.63
合计	3,415,541,309.95	1,911,785,575.07

**(2). 应付票据**

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

①截至期末，本公司无应付持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东单位款项。

②截至期末，本公司无超过一年未支付的大额应付款项。

③应付款项期末余额较期初增长 78.66%，主要系场外业务规模增长所致。

**39、合同负债**

**(1). 合同负债情况**

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
货物销售	12,343,717.33	20,445,826.31
投行业务	16,524,037.28	9,810,855.00
其他	22,856,306.61	948,986.01
合计	51,724,061.22	31,205,667.32

**(2). 报告期内账面价值发生重大变动的金额和原因**

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

**40、持有待售负债**

适用 不适用

**41、预计负债**

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因及经济利益流出不确定性的说明
预计诉讼损失	349,436.58	214,705.70	10,850.96	553,291.32	未决诉讼
资管业务预计赔偿损失	29,219,067.81		28,341,837.06	877,230.75	资管业务赔偿
合计	29,568,504.39	214,705.70	28,352,688.02	1,430,522.07	/

其他说明，包括重要预计负债的相关重要假设、估计说明：

预计负债期末余额较期初下降95.16%，主要系子公司鲁证期货本年配合资管产品代理销售机构与持有资产管理计划的投资者进行协商，与大部分投资者达成一致并相应支付人民币28,341,837.06元，预计赔偿损失余额减少所致。

## 42、长期借款

### (1). 长期借款分类

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
质押借款		
抵押借款	231,361,579.17	244,417,824.81
保证借款		
信用借款	69,715,116.33	80,176,764.00
合计	301,076,695.50	324,594,588.81

其他说明，包括利率区间：

√适用 □不适用

①本公司的长期借款利率区间为 2.73%至 5.635%。

②本公司以位于济南经七路证券大厦 86 号济房权证中字第 296343-296345、296347-296349、296352-296363 号 18 个房产提供 3 亿元最高额抵押担保，账面价值为 245,794,199.99 元。

## 43、应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率(%)	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
公司债	中泰证券股份有限公司 2018 年非公开发行公司债券（第一期）	100.00	2018/2/6	3 年	2,000,000,000.00	5.80	2,104,741,675.83	11,123,287.67	2,115,864,963.50	
公司债	中泰证券股份有限公司 2018 年非公开发行公司债券（第二期）	100.00	2018/4/26	3 年	2,000,000,000.00	5.10	2,069,719,108.09	31,857,534.25	2,101,576,642.34	
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2018 年公司债券（第一期）	100.00	2018/12/12	3 年	3,000,000,000.00	3.95	3,004,137,392.30	111,682,191.78	3,115,819,584.08	
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券（第一期）	100.00	2019/8/8	3 年	900,000,000.00	3.57	910,674,068.85	33,543,803.20	32,130,000.00	912,087,872.05
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2019 年公司债券（第二期）	100.00	2019/12/9	3 年	2,000,000,000.00	3.56	2,001,667,475.96	72,753,914.23	71,200,000.00	2,003,221,390.19
公司债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2020 年公司债券（第一期）	100.00	2020/3/17	2 年	1,600,000,000.00	3.08	1,638,912,328.76	49,480,000.00	49,280,000.00	1,639,112,328.76
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第一期）（疫情防控债）	100.00	2020/6/19	3 年	1,500,000,000.00	3.27	1,525,599,452.05	49,350,000.00	49,050,000.00	1,525,899,452.05
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第二期）	100.00	2020/7/28	2 年	1,500,000,000.00	3.35	1,520,906,712.33	50,700,000.00	50,250,000.00	1,521,356,712.33
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年公司债券（第三期）	100.00	2020/10/29	3 年	4,000,000,000.00	3.79	4,025,394,256.31	150,945,035.93	151,600,000.00	4,024,739,292.24
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第一期）	100.00	2021/1/25	3 年	2,500,000,000.00	3.70		2,585,366,324.20		2,585,366,324.20
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第二期）品种一	100.00	2021/8/27	3 年	1,500,000,000.00	3.10		1,512,196,787.82		1,512,196,787.82
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第二期）品种二	100.00	2021/8/27	5 年	1,500,000,000.00	3.47		1,513,921,062.74		1,513,921,062.74
公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第三期）	100.00	2021/10/27	3 年	3,000,000,000.00	3.34		3,009,652,115.28		3,009,652,115.28

中泰证券股份有限公司 2021 年年度报告

公司债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年公司债券（第四期）	100.00	2021/1/19	3 年	2,000,000,000.00	3.14		2,001,621,180.72		2,001,621,180.72
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券（第一期）	100.00	2019/1/24	3 年	2,000,000,000.00	4.14	2,076,469,967.88	84,056,713.94	82,800,000.00	2,077,726,681.82
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券（第二期）	100.00	2019/3/11	3 年	2,000,000,000.00	4.30	2,068,480,354.60	87,256,713.96	86,000,000.00	2,069,737,068.56
次级债	中泰证券股份有限公司非公开发行 2019 年次级债券（第三期）	100.00	2019/5/28	3 年	4,000,000,000.00	4.30	4,099,667,428.73	174,513,427.90	172,000,000.00	4,102,180,856.63
次级债	中泰证券股份有限公司公开发行 2020 年次级债券（第一期）	100.00	2020/1/27	3 年	3,000,000,000.00	4.55	3,013,089,041.10	130,779,452.05	136,500,000.00	3,007,368,493.15
次级债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年次级债券（第一期）	100.00	2021/3/4	3 年	3,000,000,000.00	4.25		3,099,322,392.76		3,099,322,392.76
次级债	中泰证券股份有限公司公开发行 2021 年次级债券（第二期）	100.00	2021/4/23	3 年	4,000,000,000.00	4.05		4,102,940,332.22		4,102,940,332.22
长期收益凭证	中泰证券长期收益凭证（汇总）	100.00	2020/1/13~2021/12/31	366~736 天	862,301,098.00	3.10~4.20/浮动利率	767,054,665.27	734,836,967.81	621,515,332.92	880,376,300.16
公司债券	ZTSECB 3.850% 12Aug2023 Corp	USD1,000.00	2020/8/12	3 年	1,893,892,958.06	3.85	1,978,675,791.87	32,485,496.86	74,452,776.83	1,936,708,511.90
合计		/	/	/	49,756,194,056.06	/	32,805,189,719.93	19,630,384,735.32	8,910,039,299.67	43,525,535,155.58

其他说明：

应付债券期末余额较期初增长 32.68%，主要系本期增加公司债、次级债融资规模所致。

**44、租赁负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
租赁付款额	712,702,761.07	488,496,148.50
未确认融资费用	-59,478,739.85	-36,583,421.70
合计	653,224,021.22	451,912,726.80

**45、递延收益**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	形成原因
政府补助		2,396,028.00		2,396,028.00	股 e 平台项目 补助资金
合计		2,396,028.00		2,396,028.00	/

涉及政府补助的项目：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

负债项目	期初余额	本期新增补助金额	本期计入营业外收入金额	本期计入其他收益金额	其他变动	期末余额	与资产相关/与收益相关
股 e 平台项目补助资金		2,396,028.00				2,396,028.00	与收益相关

其他说明：

□适用 √不适用

**46、其他负债**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	997,145,767.37	418,446,751.17
其他主体中其他持有人权益	790,703,600.05	5,892,876,421.85
期货风险准备金	137,139,704.50	116,882,271.77
预提费用	44,541,738.15	22,619,452.35
应付股利	14,235,270.00	14,235,270.00
预收款项	10,341,804.97	19,550,696.82
应付债券借贷利息	662,117.81	1,503,698.63
其他	15,852,529.14	217,078,823.43
合计	2,010,622,531.99	6,703,193,386.02

其他应付款按款项性质列示：

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
----	------	------

经纪人风险准备金	20,851,528.66	22,055,509.95
应付工会组织款项	3,833,179.15	3,426,855.12
保证金	531,386,299.15	
其他	441,074,760.41	392,964,386.10
合计	997,145,767.37	418,446,751.17

其他应付款的说明：

- (1) 公司无账龄超过 1 年的重要其他应付款。  
(2) 应付股利

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
普通股股利	14,235,270.00	14,235,270.00
合计	14,235,270.00	14,235,270.00

#### 47、股本

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

	期初余额	本次变动增减(+、-)					期末余额
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	6,968,625,756.00						6,968,625,756.00

#### 48、其他权益工具

(1) 其他金融工具划分至其他权益工具的情况(划分依据、主要条款和股利或利息的设定机制等)

适用  不适用

(2) 期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况表

适用  不适用

其他权益工具本期增减变动情况、变动原因说明，以及相关会计处理的依据：

适用  不适用

其他说明：

适用  不适用

#### 49、资本公积

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
资本溢价(股本溢价)	13,083,367,129.31			13,083,367,129.31
其他资本公积	1,337,397.28	1,257,249.87		2,594,647.15
合计	13,084,704,526.59	1,257,249.87		13,085,961,776.46

其他资本公积本期增加系权益法核算的被投资单位除综合收益和利润分配以外的其他权益变动。



50、库存股

适用 不适用

51、其他综合收益

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期发生金额						税后归属于少数股东	期末余额
		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司		
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-373,530,065.19	64,171,641.66	30,156,472.11		13,709,069.96	20,306,099.59	20,318,966.89	-12,867.30	-353,211,098.30
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益	-4,741,531.52	-1,759,043.29				-1,759,043.29	-1,746,175.99	-12,867.30	-6,487,707.51
其他权益工具投资公允价值变动	-368,788,533.67	65,930,684.95	30,156,472.11		13,709,069.96	22,065,142.88	22,065,142.88		-346,723,390.79
企业自身信用风险公允价值变动									
二、将重分类进损益的其他综合收益	13,261,452.46	70,426,082.48	25,814,491.89	6,568,123.51		38,043,467.08	38,604,504.15	-561,037.07	51,865,956.61
其中：权益法下可转损益的其他综合收益									
其他债权投资公允价值变动	-170,577,375.51	98,620,632.87	26,366,287.25			72,254,345.62	72,254,345.62		-98,323,029.89
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	211,771,112.83	4,555,373.69	-551,795.36	6,568,123.51		-1,460,954.46	-1,460,954.46		210,310,158.37
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	-27,932,284.86	-32,749,924.08				-32,749,924.08	-32,188,887.01	-561,037.07	-60,121,171.87
其他综合收益合计	-360,268,612.73	134,597,724.14	55,970,964.00	6,568,123.51	13,709,069.96	58,349,566.67	58,923,471.04	-573,904.37	-301,345,141.69

项目	期初余额	上期发生金额						期末余额
----	------	--------	--	--	--	--	--	------

中泰证券股份有限公司 2021 年年度报告

		本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	合计	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	
一、不能重分类进损益的其他综合收益	-762,117,072.40	483,089,102.94	95,692,517.32		-5,494,750.93	392,891,336.55	388,587,007.20	4,304,329.35	-373,530,065.20
其中：重新计量设定受益计划变动额									
权益法下不能转损益的其他综合收益	-51,284,351.31	66,485,227.72			15,638,078.58	50,847,149.14	46,542,819.79	4,304,329.35	-4,741,531.52
其他权益工具投资公允价值变动	-710,832,721.09	416,603,875.22	95,692,517.32		-21,132,829.51	342,044,187.41	342,044,187.41		-368,788,533.68
企业自身信用风险公允价值变动									
二、将重分类进损益的其他综合收益	332,776,751.22	-204,568,868.72	2,730,143.49	113,664,902.89		-320,963,915.10	-320,915,812.20	-48,102.90	11,860,939.02
其中：权益法下可转损益的其他综合收益									
其他债权投资公允价值变动	33,003,306.85	-218,366,117.83	-67,860,227.45	53,074,791.98		-203,580,682.36	-203,580,682.36		-170,577,375.51
金融资产重分类计入其他综合收益的金额									
其他债权投资信用损失准备	251,623,145.60	91,328,449.08	70,590,370.94	60,590,110.91		-39,852,032.77	-39,852,032.77		211,771,112.83
现金流量套期储备									
外币财务报表折算差额	48,150,298.77	-77,531,199.97				-77,531,199.97	-77,483,097.07	-48,102.90	-29,332,798.30
其他综合收益合计	-429,340,321.18	278,520,234.22	98,422,660.81	113,664,902.89	-5,494,750.93	71,927,421.45	67,671,195.00	4,256,226.45	-361,669,126.18

其他综合收益期初调整系由于会计政策变更，影响期初其他综合收益 1,400,513.45 元。

**52、盈余公积**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	1,431,434,819.64	314,497,744.17		1,745,932,563.81
任意盈余公积	650,200,238.90			650,200,238.90
合计	2,081,635,058.54	314,497,744.17		2,396,132,802.71

盈余公积说明，包括本期增减变动情况、变动原因说明：

本期增加系根据公司章程规定，按照本公司2021年度净利润的10%计提法定盈余公积。

**53、一般风险准备**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期计提	本期减少	期末余额
一般风险准备	2,816,038,702.25	346,917,668.32		3,162,956,370.57
交易风险准备	2,540,801,332.82	318,617,963.89		2,859,419,296.71
合计	5,356,840,035.07	665,535,632.21		6,022,375,667.28

一般风险准备的说明：

本公司及部分子公司按照当年实现净利润的10%计提一般风险准备金和交易风险准备金。同时，根据中国证监会的规定，本公司对公募基金及大集合资产管理业务，按照基金托管费收入之2.5%提取一般风险准备，本公司之子公司中泰资管对公募基金及大集合资产管理业务，按照管理费收入之10%提取一般风险准备。

**54、未分配利润**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期	上期
调整前上期末未分配利润	6,148,119,860.94	4,546,698,234.15
调整期初未分配利润合计数(调增+,调减-)	-4,060,554.63	
调整后期初未分配利润	6,144,059,306.31	4,546,698,234.15
加:本期归属于母公司所有者的净利润	3,200,009,354.36	2,525,298,270.86
减:提取法定盈余公积	314,497,744.17	242,610,350.08
提取任意盈余公积		
提取一般风险准备	346,917,668.32	290,551,853.27
提取交易风险准备	318,617,963.89	242,610,350.08
应付普通股股利	759,580,207.40	
转作股本的普通股股利		
分配永续次级债利息		142,800,000.00
其他综合收益结转留存收益	-13,709,069.96	5,304,090.64
期末未分配利润	7,618,164,146.85	6,148,119,860.94

(1) 调整期初未分配利润明细：

由于会计政策变更，影响期初未分配利润 4,060,554.63 元。

(2) 根据 2020 年股东大会决议，公司以总股本 6,968,625,756.00 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利人民币 1.09 元（含税），合计派发现金股利人民币 759,580,207.40 元。

## 55、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	5,102,629,489.38	4,847,619,086.08
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,125,405,311.66	1,029,306,185.50
拆出资金利息收入		
融出资金利息收入	2,352,100,226.68	1,983,442,922.12
买入返售金融资产利息收入	542,685,970.59	797,509,448.60
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	439,562,340.14	743,076,819.81
债权投资利息收入	251,986,985.39	322,846,203.92
其他债权投资利息收入	816,331,620.43	710,091,232.86
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	6,306,263.95	4,423,093.08
其他利息收入	7,813,110.68	
利息支出	3,309,822,042.69	2,764,790,300.88
其中：短期借款利息支出	98,604,740.65	140,070,630.86
应付短期融资款利息支出	430,217,387.66	60,577,712.80
拆入资金利息支出	127,258,277.98	110,133,768.69
其中：转融通利息支出	120,941,110.22	98,405,666.85
卖出回购金融资产款利息支出	845,139,626.54	710,607,972.48
其中：报价回购利息支出	11,885,053.19	6,600,284.98
代理买卖证券款利息支出	225,293,426.29	173,516,045.24
长期借款利息支出	15,193,087.01	16,726,985.11
应付债券利息支出	1,535,652,539.00	1,538,450,678.22
其中：次级债券利息支出	705,709,677.61	415,485,011.60
租赁负债利息支出	27,788,452.35	
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出		
其他利息支出	4,674,505.21	14,706,507.48
利息净收入	1,792,807,446.69	2,082,828,785.20

## 56、手续费及佣金净收入

### (1) 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	3,949,959,269.17	3,372,952,055.76
证券经纪业务收入	5,566,412,132.56	4,800,914,139.66
其中：代理买卖证券业务	4,413,967,467.99	4,059,755,592.81
交易单元席位租赁	780,266,707.95	577,146,613.32
代销金融产品业务	372,177,956.62	164,011,933.53
证券经纪业务支出	1,616,452,863.39	1,427,962,083.90

其中：代理买卖证券业务	1,490,191,086.76	1,334,247,516.64
交易单元席位租赁	124,126,966.01	87,983,184.73
代销金融产品业务	2,134,810.62	5,731,382.53
2. 期货经纪业务净收入	399,410,187.30	227,342,979.13
期货经纪业务收入	804,900,513.98	502,810,401.29
期货经纪业务支出	405,490,326.68	275,467,422.16
3. 投资银行业务净收入	1,280,672,303.52	1,092,454,364.32
投资银行业务收入	1,301,729,374.46	1,106,026,502.72
其中：证券承销业务	1,114,470,421.40	889,477,531.40
证券保荐业务	53,034,792.40	49,230,794.08
财务顾问业务	134,224,160.66	167,318,177.24
投资银行业务支出	21,057,070.94	13,572,138.40
其中：证券承销业务	18,564,005.99	9,553,452.31
证券保荐业务	632,075.48	3,594,157.80
财务顾问业务	1,860,989.47	424,528.29
4. 资产管理业务净收入	558,496,390.72	327,769,988.85
资产管理业务收入	558,496,390.72	327,769,988.85
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入	11,686,388.56	24,249,925.24
基金管理业务收入	11,686,388.56	26,769,589.48
基金管理业务支出		2,519,664.24
6. 投资咨询业务净收入	177,743,344.92	107,929,027.45
投资咨询业务收入	177,743,344.92	107,929,761.41
投资咨询业务支出		733.96
7. 其他手续费及佣金净收入	8,967,953.74	41,291,237.30
其他手续费及佣金收入	19,254,124.23	61,842,110.57
其他手续费及佣金支出	10,286,170.49	20,550,873.27
合计	6,386,935,837.93	5,193,989,578.05
其中：手续费及佣金收入	8,440,222,269.43	6,934,062,493.98
手续费及佣金支出	2,053,286,431.50	1,740,072,915.93

(2) 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	5,481,132.08	31,452,830.19
并购重组财务顾问业务净收入—其他		
其他财务顾问业务净收入	126,882,039.11	135,440,818.76

(3) 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	365,155,305,910.14	344,675,442.78	210,141,877,990.80	117,271,902.52
其他	28,351,220,841.27	27,502,513.84	13,222,525,072.00	46,740,031.01
合计	393,506,526,751.41	372,177,956.62	223,364,403,062.80	164,011,933.53

(4) 资产管理业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务	公开募集证券投资基金管理业务
期末产品数量	112.00	201.00	2.00	12.00
期末客户数量	51,354.00	201.00	15.00	391,550.00
其中：个人客户	50,874.00	19.00		391,217.00
机构客户	480.00	182.00	15.00	333.00
期初受托资金	30,206,077,011.45	88,297,325,022.03	1,435,080,000.00	9,993,988,553.16
其中：自有资金投入	559,934,942.53			10,909,951.57
个人客户	20,717,736,629.73	2,232,329,627.34		758,665,987.80
机构客户	8,928,405,439.19	86,064,995,394.69	1,435,080,000.00	9,235,322,565.36
期末受托资金	33,891,330,404.39	122,135,725,450.94	2,156,550,000.00	14,732,719,267.44
其中：自有资金投入	333,993,592.12			999,560.32
个人客户	12,771,548,556.96	4,447,972,756.59		4,130,819,055.31
机构客户	20,785,788,255.31	117,687,752,694.35	2,156,550,000.00	10,601,900,212.13
期末主要受托资产初始成本	36,892,329,436.98	136,323,775,253.56	2,156,550,000.00	23,293,625,158.45
其中：股票	16,996,482,180.15	10,036,513,708.94		5,849,749,718.58
债券	13,675,052,694.91	103,140,501,040.50		16,526,359,475.80
基金	1,012,151,568.81	6,861,610,276.99		
资产支持证券	796,280,136.98	4,337,341,532.15		
期货	3,567,291.10	19,523,580.90		206,578.40
信托计划	11,531,422.81	292,230,000.00		
专项资产管理计划				
银行承兑汇票				
资产收益权			2,156,550,000.00	
协议或定期存款	1,544,575,356.86	1,222,640,207.78		
其他投资	2,852,688,785.36	10,413,414,906.30		835,077,473.22
当期资产管理业务净收入	256,149,675.65	217,199,785.04	2,915,017.58	82,231,912.45

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

## 57、投资收益

## (1) 投资收益情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	206,451,764.88	105,924,138.05
处置长期股权投资产生的投资收益	1,239,314.88	
金融工具投资收益	2,190,750,476.25	1,554,519,490.03
其中：持有期间取得的收益	1,576,025,511.92	1,193,922,941.77
— 交易性金融工具	1,235,682,703.60	1,166,309,528.63
— 其他权益工具投资	334,465,667.17	27,613,413.14
— 衍生金融工具	5,877,141.15	
处置金融工具取得的收益	614,724,964.33	360,596,548.26
— 交易性金融工具	414,478,534.29	228,374,401.10
— 其他债权投资	53,052,467.07	113,636,738.69
— 债权投资	7,618,253.87	1,493,673.35
— 衍生金融工具	139,575,709.10	17,091,735.12
合计	2,398,441,556.01	1,660,443,628.08

## (2) 交易性金融工具投资收益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
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	1,235,717,312.26	1,107,695,395.43
	处置取得收益	409,457,631.98	206,435,460.01
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	-34,608.66	58,614,133.20
	处置取得收益	5,020,902.31	21,938,941.09

投资收益的说明：

## (1) 对联营企业的投资收益

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年度	2020 年度
万家基金管理有限公司	150,311,280.29	105,305,371.36
共青城中泰凯金投资合伙企业（有限合伙）	26,410,467.61	
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	20,486,017.59	-1,646,286.27
山东中泰天使创业投资基金企业（有限合伙）	20,139,818.24	5,944,156.92
齐鲁股权交易中心有限公司	5,683,253.26	11,215,057.73
山东交易市场清算所有限公司	1,982,429.98	-600,114.94
山东未来产业科技成果转化基金合伙企业（有限合伙）	1,734,470.90	1,757,515.17
中泰威智（枣庄）新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	597,214.30	
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	410,799.83	-206,623.59
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金合伙企	312,499.05	143,953.30

业（有限合伙）		
中泰长安（西安）股权投资合伙企业（有限合伙）	3,218.21	
共青城中泰东方投资合伙企业（有限合伙）	-15,145,498.23	
山东大宗商品交易中心有限公司	-3,838,580.08	-17,351,419.72
Zhongtai Hungsing Selected IPO Fund SP	-1,176,568.55	236,287.42
上海鲁证锋通经贸有限公司	-914,468.52	1,396,456.50
青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业（有限合伙）	-498,775.19	-387,716.70
蚌埠中泰成长一号企业管理合伙企业（有限合伙）	-42,143.63	
济南中泰新动能海富股权投资基金合伙企业（有限合伙）	-2,445.69	
深圳市沧金投资合伙企业（有限合伙）	-1,198.30	0.14
深圳市沧鑫投资合伙企业（有限合伙）	-26.19	-1.49
威海中泰齐东蓝色并购投资中心（有限合伙）		117,502.22
合计	206,451,764.88	105,924,138.05

(2) 本公司不存在投资收益汇回的重大限制。

(3) 投资收益本期发生额较上期增长 44.45%，主要系公司金融工具持有期间和处置投资收益增加所致。

#### 58、净敞口套期收益

适用  不适用

#### 59、其他收益

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助	64,605,584.31	60,307,644.14
个税手续费返还	17,528,590.21	17,069,053.80
合计	82,134,174.52	77,376,697.94

其他说明：

政府补助明细情况

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年度	2020 年度
财政补贴	40,916,868.03	43,351,297.50
政府奖励款	4,881,027.98	8,251,171.60
财政扶持资金	16,848,300.00	6,629,700.00
国资监管信息系统补助		1,057,206.47
企业发展基金	100,000.00	320,822.35
其他	1,859,388.30	697,446.22
合计	64,605,584.31	60,307,644.14

#### 60、公允价值变动收益

适用  不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
----	-------	-------



交易性金融资产	889,540,975.51	402,334,103.10
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	770,514.18	-22,313,851.46
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	-63,911,479.50	48,371,813.60
其他		
合计	826,400,010.19	428,392,065.24

公允价值变动收益的说明：

公允价值变动收益本期较上期上升 92.91%，主要系 2021 年度公司金融投资规模增加和投资业绩提升所致。

### 61、其他业务收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
期现结合业务现货销售收入	1,521,636,897.19	787,076,192.80
租赁收入	31,330,756.17	24,336,793.69
处置投资性房地产收入	8,040,009.90	21,519,828.86
其他收入	37,285,327.99	67,480,755.19
合计	1,598,292,991.25	900,413,570.54

其他业务收入说明：

其他业务收入本期较上期增长 77.51%，主要系子公司期现结合业务现货销售收入增加所致。

### 62、资产处置收益

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
处置固定资产收益	7,964,572.91	8,742,312.51
处置使用权资产收益	236,160.57	
处置无形资产收益	35,579,889.40	
合计	43,780,622.88	8,742,312.51

其他说明：

资产处置收益本期较上期大幅增长，主要系处置房产、土地收益金额较大所致。

### 63、税金及附加

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计缴标准
城市维护建设税	35,140,436.79	34,525,228.16	7%、1%
教育费附加	24,578,397.38	24,746,317.93	3%、2%、1%
水利建设基金	-331,374.36	1,946,146.27	1%、0.5%
其他	20,455,514.93	18,659,554.47	
合计	79,842,974.74	79,877,246.83	/

**64、业务及管理费**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	4,547,794,172.63	4,035,702,733.89
折旧费	348,712,974.10	123,246,778.93
交易所会员年费	202,887,763.95	138,498,916.49
咨询信息费	127,028,762.91	126,651,039.98
电子设备运转费	106,423,851.50	124,891,356.60
差旅费	86,881,422.41	57,919,444.19
业务招待费	81,188,701.40	62,064,456.32
租赁费	76,599,671.22	306,590,060.72
证券投资者保护基金及期货投资者保障基金	69,491,434.71	36,621,865.05
无形资产摊销	65,369,201.16	63,106,756.16
交易所设施使用费	61,833,306.46	54,971,277.12
通讯费	61,803,973.53	57,277,358.84
广告费	56,128,692.84	59,784,474.97
长期待摊费用摊销	34,714,880.56	42,309,053.18
其他	557,051,309.04	411,936,314.26
合计	6,483,910,118.42	5,701,571,886.70

**65、信用减值损失**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
应收款项/其他应收款坏账损失	30,552,538.62	-18,305,697.70
买入返售金融资产减值损失	4,732,995.73	67,697,726.68
融出资金减值损失	38,365,043.10	-10,606,329.19
债权投资减值损失	767,558,905.88	147,412,811.89
其他债权投资减值损失	4,558,389.15	91,328,542.28
其他资产减值损失	-84,809,667.25	124,153,926.96
货币资金减值损失	504,203.03	
合计	761,462,408.26	401,680,980.92

信用减值损失本期发生额较上期增加 89.57%，主要系子公司持有的地产美元债计提的信用减值准备增加所致。

**66、其他资产减值损失**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
存货跌价损失	289,515.05	
无形资产减值损失	1,438,333.48	
合计	1,727,848.53	

**67、其他业务成本**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	本期发生额	上期发生额
期现结合业务现货销售成本	1,499,881,007.91	821,823,168.08
投资性房地产折旧	26,414,568.68	17,625,555.56
处置投资性房地产成本		9,172,167.22
其他	1,703,567.37	3,705,776.10
合计	1,527,999,143.96	852,326,666.96

其他业务成本本期较上期增长 82.51%，主要系子公司期现结合业务现货销售成本增加所致。

**68、营业外收入**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产毁损报废利得	169,366.93	536,158.01	169,366.93
企业合并负商誉	3,906,468.72		3,906,468.72
无需支付的款项	15,515,606.82		15,515,606.82
其他	4,801,942.94	1,708,857.83	4,801,942.94
合计	24,393,385.41	2,245,015.84	24,393,385.41

其他说明：

□适用 √不适用

**69、营业外支出**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失合计	3,951,349.01	1,660,538.48	3,951,349.01
其中：固定资产处置损失	3,951,349.01	1,660,538.48	3,951,349.01
捐赠和赞助支出	12,931,319.57	11,404,992.00	12,931,319.57
预计负债	214,705.70	29,219,067.81	214,705.70
其他	3,411,897.81	1,455,782.71	3,411,897.81
合计	20,509,272.09	43,740,381.00	20,509,272.09

营业外支出的说明：

营业外支出本期较上期减少 53.11%，主要系上期子公司计提资管业务预计赔偿损失所致。

**70、所得税费用****(1) 所得税费用表**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	773,248,544.25	638,394,517.62
递延所得税费用	225,996,341.52	55,571,787.39

合计	999,244,885.77	693,966,305.01
----	----------------	----------------

**(2) 会计利润与所得税费用调整过程**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额
利润总额	4,298,610,841.71
按法定/适用税率计算的所得税费用	1,074,652,710.43
子公司适用不同税率的影响	-101,435.73
调整以前期间所得税的影响	502,674.62
非应税收入的影响	-304,327,975.50
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	36,754,893.42
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-190,145.28
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	191,954,163.81
前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	
所得税费用	999,244,885.77

其他说明：

√适用 □不适用

所得税费用本期较上期增长 43.99%，主要系本期利润总额增加所致。

**71、其他综合收益**

√适用 □不适用

详见本节“注释七、51.其他综合收益”。

**72、现金流量表项目****(1). 收到的其他与经营活动有关的现金**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
结构化主体其他持有人资金		1,210,821,238.52
期现业务收到的货款	1,958,319,621.03	970,938,643.70
客户现金股利	581,629,613.63	21,615,732.87
证券清算款	298,787,862.11	
融资租赁	175,518,475.47	130,142,336.24
其他业务收入	67,201,449.57	92,346,339.17
营业外收入、其他收益	86,936,117.46	78,028,349.30
其他	468,063,473.53	455,250,883.83
合计	3,636,456,612.80	2,959,143,523.63

**(2). 支付的其他与经营活动有关的现金**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
结构主体其他持有人资金	5,102,172,821.81	
期现业务支付的货款	1,927,929,117.18	622,005,606.20

支付的保证金	687,356,337.88	1,564,710,321.45
支付的交易所会员年费	202,887,763.95	138,498,916.49
支付的咨询信息费	127,028,762.91	126,651,039.98
支付的电子设备运转费	106,423,851.50	124,891,356.60
支付的招待费	81,188,701.40	62,064,456.32
房屋租赁费	76,599,671.22	306,590,060.72
投资者保护基金及期货投资者保障基金	69,491,434.71	37,124,634.04
其他	1,889,034,456.49	823,753,916.92
合计	10,270,112,919.05	3,806,290,308.72

## (3). 收到的其他与投资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
取得子公司收到的现金净额	278,842,034.06	
合计	278,842,034.06	

## (4). 支付的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

## (5). 收到的其他与筹资活动有关的现金

□适用 √不适用

## (6). 支付的其他与筹资活动有关的现金

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
支付租赁负债的本金和利息	210,944,264.87	
永续债赎回支付的现金		6,000,000,000.00
回购少数股东股权支付的现金		351,531.64
少数股东收回投资		37,598,161.78
合计	210,944,264.87	6,037,949,693.42

## 73、现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

补充资料	本期金额	上期金额
<b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>		
净利润	3,299,365,955.94	2,581,305,568.26
加：资产减值准备	1,727,848.53	
信用减值损失	761,462,408.26	401,680,980.92
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	149,879,890.66	140,872,334.49
使用权资产折旧	225,247,652.12	
无形资产摊销	65,369,201.16	63,106,756.16
长期待摊费用摊销	34,714,880.56	42,309,053.18
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	-51,820,632.78	-21,089,974.15

(收益以“—”号填列)		
固定资产报废损失(收益以“—”号填列)	3,781,982.08	1,124,380.47
公允价值变动损失(收益以“—”号填列)	-826,400,010.19	-428,392,065.24
财务费用(收益以“—”号填列)		
利息支出(收益以“—”号填列)	1,011,349,148.50	1,755,826,006.99
汇兑损益	-20,876,582.83	-37,382.28
投资损失(收益以“—”号填列)	-602,827,467.87	-1,281,605,400.01
递延所得税资产减少(增加以“—”号填列)	-85,416,608.66	-84,468,830.57
递延所得税负债增加(减少以“—”号填列)	310,861,154.82	147,725,202.53
存货的减少(增加以“—”号填列)	-6,094,324,017.85	-12,920,083,745.28
经营性应收项目的减少(增加以“—”号填列)	-10,656,762,754.83	-7,498,051,421.52
经营性应付项目的增加(减少以“—”号填列)	14,746,742,661.63	19,248,550,228.28
其他		
经营活动产生的现金流量净额	2,272,074,709.25	2,148,771,692.23
<b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:</b>		
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		
<b>3. 现金及现金等价物净变动情况:</b>		
现金的期末余额	55,635,668,935.62	44,967,138,284.74
减: 现金的期初余额	44,967,138,284.74	36,994,295,233.36
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	10,668,530,650.88	7,972,843,051.38

## (2) 本期支付的取得子公司的现金净额

□适用 √不适用

## (3) 本期收到的处置子公司的现金净额

□适用 √不适用

## (4) 现金和现金等价物的构成

√适用 □不适用

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末余额	期初余额
一、现金	55,635,668,935.62	44,967,138,284.74
其中: 库存现金	34,616.85	86,409.76
可随时用于支付的银行存款	44,536,763,970.89	36,130,234,337.11
可随时用于支付的其他货币资金	979,743.68	9,790,103.31
结算备付金	11,097,890,604.20	8,827,027,434.56
存放同业款项		
拆放同业款项		
二、现金等价物		
其中: 三个月内到期的债券投资		
三、期末现金及现金等价物余额	55,635,668,935.62	44,967,138,284.74
其中: 母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

其他说明：

适用 不适用

#### 74、所有者权益变动表项目注释

说明对上年期末余额进行调整的“其他”项目名称及调整金额等事项：

适用 不适用

#### 75、所有权或使用权受到限制的资产

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	72,600,214.36	司法冻结、风险准备金专户、印鉴变更期间冻结
交易性金融资产	32,142,105,662.79	限售股、转融通担保、质押用于回购融资、债券借贷、银行贷款
债权投资	524,150,238.68	质押用于回购融资、拆入资金
其他债权投资	6,967,171,741.59	质押用于回购融资、债券借贷、银行贷款
其他权益工具投资	592,463,157.83	限售股、转融通担保
固定资产	261,840,075.31	抵押用于银行贷款、为诉讼保全提供担保
合计	40,560,331,090.56	/

#### 76、外币货币性项目

##### (1). 外币货币性项目

适用 不适用

单位：元

项目	期末外币余额	折算汇率	期末折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	138,388,397.43	6.3757	882,322,905.49
港币	1,567,858,296.54	0.81760	1,281,880,943.24
其他	/	/	49,679,893.29
结算备付金			
其中：美元	10,315,384.85	6.3757	65,767,799.19
港币	21,132,033.40	0.81760	17,277,550.51
存出保证金			
其中：美元	7,745,440.66	6.3757	49,382,606.02
港币	8,355,539.86	0.81760	6,831,489.39
其他应收款			
其中：港币	1,721.51	0.81760	1,407.51
短期借款			
其中：美元	54,999,825.84	6.3757	350,662,389.61
港币	4,763,492,718.19	0.81760	3,894,631,646.39
拆入资金			
其中：港币	339,679,252.69	0.81760	277,721,757.00
代理买卖证券款			
其中：美元	46,031,639.99	6.3757	293,483,927.08
港币	944,016,257.42	0.81760	771,827,692.07
其他	/	/	1,193,614.88

应付款项			
其中：美元	36,936.01	6.3757	235,492.92
港币	758,922.52	0.81760	620,495.05
长期借款			
其中：港币	85,267,999.43	0.81760	69,715,116.33
应付债券			
其中：美元	303,710,215.69	6.3757	1,936,365,222.17
其他应付款			
其中：美元	218,315.10	6.3757	1,391,911.58
港币	896,179.15	0.81760	732,716.07

(2). 境外经营实体说明，包括对于重要的境外经营实体，应披露其境外主要经营地、记账本位币及选择依据，记账本位币发生变化的还应披露原因

√适用 □不适用

重要境外经营实体

单位名称	主要经营地	记账本位币	记账本位币选择依据
中泰金融国际有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币
中泰金融投资有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币
中泰国际资产管理有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币
中泰国际金融产品有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币
中泰国际金融服务有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币
中泰国际优越理财有限公司	香港	港币	记账本位币为当地货币

77、套期

□适用 √不适用

78、政府补助

1. 政府补助基本情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

种类	金额	列报项目	计入当期损益的金额
财政补贴	40,916,868.03	其他收益	40,916,868.03
政府奖励款	4,881,027.98	其他收益	4,881,027.98
财政扶持资金	16,848,300.00	其他收益	16,848,300.00
企业发展基金	100,000.00	其他收益	100,000.00
其他	1,859,388.30	其他收益	1,859,388.30
合计	64,605,584.31		64,605,584.31

2. 政府补助退回情况

□适用 √不适用

79、其他

□适用 √不适用

八、资产证券化业务的会计处理

□适用 √不适用



## 九、合并范围的变更

## 1、非同一控制下企业合并

√适用 □不适用

## (1). 本期发生的非同一控制下企业合并

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被购买方名称	股权取得时点	股权取得成本	股权取得比例 (%)	股权取得方式	购买日	购买日的确定依据	购买日至期末被购买方的收入	购买日至期末被购买方的净利润
齐鲁股权交易中心有限公司	2021-12-21	200,921,083.32	60.8889	受让	2021-12-21	取得控制权	13,473,577.92	1,249,905.06

## (2). 合并成本及商誉

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

合并成本	齐鲁股权交易中心有限公司
--现金	78,880,000.00
--非现金资产的公允价值	
--发行或承担的债务的公允价值	
--发行的权益性证券的公允价值	
--或有对价的公允价值	
--购买日之前持有的股权于购买日的公允价值	122,041,083.32
--其他	
合并成本合计	200,921,083.32
减：取得的可辨认净资产公允价值份额	204,827,552.04
商誉/合并成本小于取得的可辨认净资产公允价值份额的金额	-3,906,468.72

## (3). 被购买方于购买日可辨认资产、负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	齐鲁股权交易中心有限公司	
	购买日公允价值	购买日账面价值
资产：	469,734,558.38	469,734,558.38
货币资金	357,722,034.06	357,722,034.06
应收款项	2,512,489.95	2,512,489.95
存货		
买入返售金融资产	56,805,000.00	56,805,000.00
固定资产	7,925,432.55	7,925,432.55
无形资产	15,613,390.39	15,613,390.39
递延所得税资产	29,074,297.01	29,074,297.01
其他资产	81,914.42	81,914.42
负债：	133,339,005.11	133,339,005.11
借款		
应付款项	55,697,156.10	55,697,156.10
递延所得税负债		

应付职工薪酬	73,192,712.89	73,192,712.89
应交税费	2,053,108.12	2,053,108.12
其他负债	2,396,028.00	2,396,028.00
净资产	336,395,553.27	336,395,553.27
减：少数股东权益		
取得的净资产	336,395,553.27	336,395,553.27

北京中企华资产评估有限责任公司于 2020 年 12 月 31 日出具了中企华评报字(2020)第 4942 号评估报告,该基准日的可辨认净资产公允价值与账面价值差异较小。考虑到从评估基准日至购买日齐鲁股权所处的市场环境及经营情况均无重大变化,因此,公司以购买日可辨认资产、负债的账面价值作为其公允价值。

**(4). 购买日之前持有的股权按照公允价值重新计量产生的利得或损失**

是否存在通过多次交易分步实现企业合并并且在报告期内取得控制权的交易

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

被购买方名称	购买日之前原持有股权在购买日的账面价值	购买日之前原持有股权在购买日的公允价值	购买日之前原持有股权按照公允价值重新计量产生的利得或损失	购买日之前原持有股权在购买日的公允价值的确定方法及主要假设	购买日之前与原持有股权相关的其他综合收益转入投资收益的金额
齐鲁股权交易中心有限公司	122,041,083.32	122,041,083.32			

**(5). 购买日或合并当期期末无法合理确定合并对价或被购买方可辨认资产、负债公允价值的相关说明**

适用 不适用

**(6). 其他说明**

适用 不适用

上述被购买方数据为合并数据,被购买方的子公司分别为山东齐鲁资本市场发展服务有限公司、山东齐惠投资管理有限公司、山东齐鲁金融供给管理有限公司、山东齐盛股权投资基金管理有限公司。

**2、 同一控制下企业合并**

适用 不适用

**3、 反向购买**

适用 不适用

**4、 处置子公司**

是否存在单次处置对子公司投资即丧失控制权的情形

适用 不适用

**5、 其他原因的合并范围变动**

说明其他原因导致的合并范围变动(如,新设子公司、清算子公司等)及其相关情况:

√适用 □不适用

(1) 注销或以其他方式减少子公司

本公司本期注销 3 家子公司，包括 Jinova Limited、上海逸道资产管理有限公司、深圳市聚合润邦投资合伙企业（有限合伙）。

(2) 本报告期内增加、减少结构化主体情况

本公司本报告期内增加、减少结构化主体情况详见本节三、2。

## 6、其他

□适用 √不适用

### 十、在其他主体中的权益

#### 1、在子公司中的权益

##### (1) 企业集团的构成

√适用 □不适用

序号	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	
1	鲁证期货股份有限公司	济南	济南	期货经纪	63.10		设立
1.1	鲁证信息技术有限公司	济南	济南	技术服务		100.00	设立
1.2	鲁证国际控股有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
1.2.1	鲁证国际期货有限公司	香港	香港	期货		100.00	设立
1.3	鲁证资本管理有限公司	深圳	深圳	商贸		100.00	设立
1.3.1	中泰汇融（香港）有限公司	香港	香港	期货交易		100.00	设立
2	中泰资本股权投资管理（深圳）有限公司	深圳	深圳	投资管理	100.00		设立
2.1	齐鲁中泰私募基金管理有限公司	青岛	青岛	投资		60.00	设立
2.2	莱芜中泰股权投资基金（有限合伙）	济南	济南	投资		20.00	设立
2.3	莱芜中泰安盈创业投资基金（有限合伙）	济南	济南	投资		20.00	设立
3	中泰创业投资（深圳）有限公司	深圳	深圳	投资管理	100.00		设立
3.1	深圳市沧乐投资合伙企业（有限合伙）	深圳	深圳	投资		99.99	设立
4	齐鲁中泰物业有限公司	莱芜	莱芜	物业管理	100.00		设立
5	中泰证券（上海）资产管理有限公司	上海	上海	资产管理	60.00		设立
6	中泰金融国际有限公司	香港	香港	金融	100.00		设立
6.1	中泰金融投资有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.1.1	宏润（上海）融资租赁有限公司	上海	上海	融资租赁		100.00	设立
6.1.2	中泰寰宇信息科技（深圳）有限公司	深圳	深圳	投资管理		100.00	设立

6.2	中泰金控国际控股有限公司	上海	上海	金融		100.00	设立
6.3	Zhongtai International Bond 2017(BVI) Company Limited	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
6.4	中泰金融日本株式会社	日本	日本	金融		100.00	设立
6.5	中泰国际财务（英属维尔京群岛）有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
6.6	Zhongtai International Holdings (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	金融		100.00	设立
6.6.1	Zhongtai International Securities (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	金融		100.00	设立
6.6.2	Zhongtai International Asset Management (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	金融		100.00	设立
6.6.3	Zhongtai International Investment Management (Singapore) Pte. Ltd.	新加坡	新加坡	投资管理		100.00	设立
6.7	Zhongtai Innovation Capital Management Limited	开曼群岛	开曼群岛	金融		100.00	设立
6.8	中泰国际资产管理有限公司	香港	香港	资产管理		100.00	设立
6.9	中泰国际融资有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.10	中泰国际期货有限公司	香港	香港	期货经纪		100.00	设立
6.11	中泰国际证券有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.12	中泰国际金融产品有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.13	中泰国际优越理财有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.14	中泰国际管理有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.15	中泰国际资本投资有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
6.16	中泰国际战略投资有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
6.17	中泰国际并购投资有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
6.18	中泰国际投资集团有限公司	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
6.19	中泰国际金融服务有限公司	香港	香港	金融		100.00	设立
6.20	Zhongtai International Structured Solutions Limited	英属维尔京群岛	英属维尔京群岛	金融		100.00	设立
7	齐鲁股权交易中心有限公司	淄博	淄博	商务服务	60.89		购买
7.1	山东齐鲁资本市场发展服	淄博	淄博	商务		100.00	购买

	务有限公司			服务			
7.2	山东齐惠投资管理有限公司	济南	济南	商务服务		100.00	购买
7.2.1	山东齐鲁金融供给管理有限公司	济南	济南	金融		100.00	购买
7.3	山东齐盛股权投资基金管理有限公司	济南	济南	商务服务		100.00	购买

在子公司的持股比例不同于表决权比例的说明：  
不适用

持有半数或以下表决权但仍控制被投资单位、以及持有半数以上表决权但不控制被投资单位的依据：  
不适用

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

公司对担任结构化主体的管理人或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。若本集团通过投资合同等安排同时对该类结构化主体拥有权力、通过参与该结构化主体的相关活动而享有可变回报以及有能力运用本集团对该类结构化主体的权力影响可变回报，则本集团认为能够控制该类结构化主体，并将此类结构化主体纳入合并财务报表范围。

纳入合并范围的结构化主体如下所示：

单位：元 币种：人民币

序号	结构化主体全称	期末资产总额	自有资金期末份额比例 (%)	取得方式
1	齐鲁资管 8001 号定向资产管理计划	1,262,380,172.46	100.00	设立
1.1	中泰资管 8106 号单一资产管理计划	174,366,006.07	100.00	设立
1.2	中泰资管 8107 号单一资产管理计划	180,770,427.95	100.00	设立
1.3	中泰资管 8109 号单一资产管理计划	28,010.15	100.00	设立
1.4	中泰资管 8119 号单一资产管理计划	112,884,702.81	100.00	设立
1.5	中泰资管 8120 号单一资产管理计划	97,717,505.03	100.00	设立
1.6	中泰资管 8128 号单一资产管理计划	122,398,829.72	100.00	设立
2	中泰资管 1 号 FOF 集合资产管理计划	1,626,002,616.97	100.00	设立
2.1	中泰资管 3 号集合资产管理计划	565,459,913.25	43.20	设立
2.2	中泰资管 9 号单一资产管理计划	255,233,730.39	100.00	设立
2.3	中泰资管 15 号单一资产管理计划	123,301,826.22	100.00	设立
2.4	中泰资管 17 号单一资产管理计划	4,171.05	100.00	设立
2.5	中泰资管 25 号单一资产管理计划	144,840,909.53	100.00	设立
2.6	中泰资管 28 号单一资产管理计划	134,909,968.32	100.00	设立
2.7	中泰资管 30 号单一资产管理计划	192,129,520.77	100.00	设立
2.8	中泰资管 36 号单一资产管理计划	189,363,596.32	100.00	设立
2.9	中泰资管 39 号单一资产管理计划	146,055,687.59	100.00	设立
2.10	中泰资管 42 号单一资产管理计划	137,337,946.32	100.00	设立
2.11	中泰资管 45 号单一资产管理计划	94.56	100.00	设立
3	中泰资管 2 号 FOF 集合资产管理计划	1,212,313,422.33	100.00	设立

3.1	中泰资管 5 号集合资产管理计划	2,584,446.35	83.20	设立
3.2	中泰资管 10 号单一资产管理计划	4,171,560.54	100.00	设立
3.3	中泰资管 12 号单一资产管理计划	333,704,207.08	100.00	设立
3.4	中泰资管 16 号单一资产管理计划	2,353.40	100.00	设立
3.5	中泰资管 18 号单一资产管理计划	912,734,638.13	100.00	设立
3.6	中泰资管 20 号单一资产管理计划	5,572.98	100.00	设立
3.7	中泰资管 22 号单一资产管理计划	1,322,260,113.78	100.00	设立
3.8	中泰资管 23 号单一资产管理计划	115,338,764.63	100.00	设立
3.9	中泰资管 33 号单一资产管理计划	110,236,668.68	100.00	设立
3.10	中泰资管 49 号单一资产管理计划	404,446,854.10	100.00	设立
4	中泰资管 6012 号 FOF 单一资产管理计划	24,703,310.57	100.00	设立
5	齐鲁全球动态精选基金	153,338,097.90	99.61	设立
6	Zhongtai Dingfeng Classified Fund SP	910,971,303.09	66.00	设立
7	Zhongtai China Balanced Fund No.1 SP	68,088,358.28	100.00	设立
8	中泰富安分级基金	151,321,759.44	75.00	设立
9	Win Win Stable No. 1 Fund SP	677,836,780.91	99.84	设立
10	Zhongtai Pre-IPO Funds-We Doctor SP	74,383,236.18	71.00	设立
11	EP High Yield Bond Fund SP	121,555,286.13	70.00	设立
12	EP High Yield Bond Fund II SP	275,878,759.29	55.00	设立
13	Zhongtai Fuan Classified Fund No.2 SP	35,543,390.73	85.00	设立
14	财通基金中泰金融市场委定增 1 号单一资产管理计划	14,755,214.44	100.00	设立
15	财通基金盈泰定增量化对冲 1 号单一资产管理计划	111,660,057.55	100.00	设立
16	招证中泰海外 1 号定向资产管理计划	3,951,147.62	100.00	设立
17	融通基金中泰证券融宝 18 号集合资产管理计划	1,821,951,558.26	100.00	设立
18	东海证券海阳 9 号单一资产管理计划	120,226,823.38	100.00	设立
19	万家基金安泰 1 号单一资产管理计划	193,775,163.83	100.00	设立
20	万家基金安泰 2 号单一资产管理计划	154,967,830.97	100.00	设立
21	万家基金安泰 3 号单一资产管理计划	20,267,172.08	100.00	设立
22	万家基金安泰 4 号单一资产管理计划	190,498,045.86	100.00	设立
23	万家基金安泰 5 号单一资产管理计划	181,784,146.93	100.00	设立
24	万家基金安泰 6 号单一资产管理计划	121,741,546.92	100.00	设立
25	诺德基金浦江 128 号单一资产管理计划	188,992,816.77	100.00	设立
26	Zhongtai Stable Growth Equity Fund SP	114,167,568.04	44.00	设立
27	Zhongtai East Peak Premier Income Fund SP	116,521.08	63.37	设立

## (2). 重要的非全资子公司

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	少数股东持股比例	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
鲁证期货	36.90%	69,587,733.56	8,725,484.56	842,096,378.55
中泰资管	40.00%	27,468,131.42		265,718,477.27

子公司少数股东的持股比例不同于表决权比例的说明：

适用 不适用

其他说明：

适用 不适用

(3). 重要非全资子公司的主要财务信息

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

子公司名称	期末余额						期初余额					
	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计	流动资产	非流动资产	资产合计	流动负债	非流动负债	负债合计
鲁证期货	20,501,184,638.23	180,915,089.60	20,682,099,727.83	18,356,747,346.30	43,390,610.71	18,400,137,957.01	12,997,618,688.46	89,650,866.24	13,087,269,554.70	10,965,143,411.88	4,585,043.28	10,969,728,455.16
中泰资管	1,038,982,547.18	128,354,788.03	1,167,337,335.21	467,831,387.89	35,209,754.14	503,041,142.03	950,967,472.29	91,356,055.61	1,042,323,527.90	410,806,571.11	35,891,092.16	446,697,663.27

子公司名称	本期发生额				上期发生额			
	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量	营业收入	净利润	综合收益总额	经营活动现金流量
鲁证期货	2,254,617,095.22	188,572,904.13	187,052,573.22	4,976,634,925.28	1,290,889,687.53	41,927,217.81	40,238,205.19	1,246,548,675.55
中泰资管	535,784,070.23	68,670,328.55	68,670,328.55	5,769,388.05	493,401,187.54	94,228,248.05	94,228,248.05	-30,788,621.55



(4). 使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制

适用 不适用

(5). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持

适用 不适用

其他说明:

适用 不适用

2、在子公司的所有者权益份额发生变化且仍控制子公司的交易

适用 不适用

3、在合营企业或联营企业中的权益

适用 不适用

(1). 重要的合营企业或联营企业

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

合营企业或联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对合营企业或联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
万家基金管理有限公司	上海	上海	基金募集、基金销售、资产管理等	49.00		权益法

(2). 重要合营企业的主要财务信息

适用 不适用

(3). 重要联营企业的主要财务信息

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
	万家基金管理有限公司	万家基金管理有限公司
流动资产	2,605,927,794.16	2,116,991,030.40
非流动资产	259,669,715.65	173,846,826.79
资产合计	2,865,597,509.81	2,290,837,857.19
流动负债	1,223,134,372.19	1,103,115,083.24
非流动负债	203,262,261.01	
负债合计	1,426,396,633.20	1,103,115,083.24
少数股东权益	127,016,222.15	133,557,281.79
归属于母公司股东权益	1,312,184,654.46	1,054,165,492.16
按持股比例计算的净资产份额	642,970,480.69	516,541,091.15
调整事项		
—商誉		
—内部交易未实现利润		
—其他		
对联营企业权益投资的账面价值	642,970,480.69	516,541,091.15
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值		
营业收入	1,567,284,213.37	1,182,954,447.06
净利润	305,915,292.96	218,701,226.94
终止经营的净利润		
其他综合收益		
综合收益总额	305,915,292.96	218,701,226.94
本年度收到的来自联营企业的股利	24,500,000.00	

(4). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
合营企业：		

投资账面价值合计		
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润		
--其他综合收益		
--综合收益总额		
联营企业：		
投资账面价值合计	294,519,625.10	323,997,887.36
下列各项按持股比例计算的合计数		
--净利润	56,140,484.59	618,766.69
--其他综合收益	-1,759,043.29	66,485,227.72
--综合收益总额	54,381,441.30	67,103,994.41

(5). 合营企业或联营企业向本公司转移资金的能力存在重大限制的说明

适用 不适用

(6). 合营企业或联营企业发生的超额亏损

适用 不适用

(7). 与合营企业投资相关的未确认承诺

适用 不适用

(8). 与合营企业或联营企业投资相关的或有负债

适用 不适用

4、重要的共同经营

适用 不适用

5、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

未纳入合并财务报表范围的结构化主体的相关说明：

适用 不适用

本公司发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要为本公司发起设立的资产管理计划，这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

期末，本公司在上述结构化主体中的投资之账面价值 19.20 亿元，未纳入合并范围的结构化主体的利益均为交易性金融资产。上述结构化主体的最大损失敞口与其账面价值相近。

## 6、其他

适用 不适用

## 十一、与金融工具相关的风险

适用 不适用

与金融工具相关的风险情况请详见本节十七、风险管理。

## 十二、公允价值的披露

### 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

适用 不适用

单位:元 币种:人民币

项目	期末公允价值			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
<b>一、持续的公允价值计量</b>				
(一) 交易性金融资产	24,281,837,505.11	22,050,067,486.09	7,053,694,342.96	53,385,599,334.16
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	24,281,837,505.11	22,050,067,486.09	7,053,694,342.96	53,385,599,334.16
(1) 债务工具投资	15,817,380,026.86	19,718,340,106.10	1,141,513,045.87	36,677,233,178.83
(2) 权益工具投资	8,464,457,478.25	2,331,727,379.99	5,912,181,297.09	16,708,366,155.33
(3) 衍生金融资产				

2. 指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
(1) 债务工具投资				
(2) 权益工具投资				
(二) 其他债权投资	13,148,546,625.34	7,657,472,533.50		20,806,019,158.84
(三) 其他权益工具投资	1,262,340,336.14	1,437,846,597.10	549,534,592.74	3,249,721,525.98
(四) 投资性房地产				
1. 出租用的土地使用权				
2. 出租的建筑物				
3. 持有并准备增值后转让的土地使用权				
(五) 衍生金融资产	26,698,859.16	402,701,457.66	1,213,301.40	430,613,618.22
<b>持续以公允价值计量的资产总额</b>	<b>38,719,423,325.75</b>	<b>31,548,088,074.35</b>	<b>7,604,442,237.10</b>	<b>77,871,953,637.20</b>
(六) 交易性金融负债	54,450,766.68			54,450,766.68
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	54,450,766.68			54,450,766.68
其中：发行的交易性债券	54,450,766.68			54,450,766.68
衍生金融负债				
其他				
2. 指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债				
(七) 衍生金融负债	23,277,005.67	904,770.20	343,085,837.91	367,267,613.78
<b>持续以公允价值计量的负债总额</b>	<b>77,727,772.35</b>	<b>904,770.20</b>	<b>343,085,837.91</b>	<b>421,718,380.46</b>
<b>二、非持续的公允价值计量</b>				
(一) 持有待售资产				
<b>非持续以公允价值计量的资产总额</b>				

非持续以公允价值计量的负债总额				
-----------------	--	--	--	--

**2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据**

√适用  不适用

输入值是在计量日能够取得相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

**3、持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息**

√适用  不适用

输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

持续第二层次公允价值计量项目估值通常依据相关报价机构在形成报价过程中能反应市场状况的可观察输入值确定，如相关债券登记结算机构估值系统报价、相关交易所报价计算的相关权益证券回报来确定可观察输入值。

对于不存在公开市场的债务、权益工具投资及结构化主体等，其公允价值以估值技术确定。估值技术所需的可观察输入值包括但不限于收益率曲线、资产净值和市盈率等估值参数。

对于衍生金融资产和负债的公允价值是根据市场报价来确定的。根据每个合约的条款和到期日，采用类似衍生金融工具的市场利率或汇率将未来现金流折现，以验证报价的合理性。权益互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用相关交易所报价计算的相关权益证券回报来确定的。

**4、持续和非持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息**

√适用  不适用

公司对于限售股票、非上市股权投资、理财产品及部分衍生金融工具等无可观察输入值的投资，采用适当的估值技术或输入值确定其公允价值，估值方法包括期权定价模型、市场法、收益法、成本法等。这些金融工具的公允价值可能基于对估值有重大影响的不可观察输入值，因此公司将其分为第三层次。不可观察输入值包括流动性折扣等。持续第三层次公允价值计量的金融工具对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

5、持续的第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值间的调节信息及不可观察参数敏感性分析

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	转入第三层级	转出第三层级	当期利得或损失总额		购买、发行、出售、结算				期末余额
				计入当期损益	计入其他综合收益	购买	发行	出售	结算	
交易性金融资产	5,805,236,745.44		114,428,515.89	324,927,077.26		2,133,364,246.91		1,095,405,210.76		7,053,694,342.96
衍生金融资产	1,131,761.51	81,539.89								1,213,301.40
其他债权投资	50,000,000.00			4,250,000.00				50,000,000.00	4,250,000.00	
其他权益工具投资	650,310,101.05				20,880,976.26	286,880,388.75		408,536,873.32		549,534,592.74
衍生金融负债	208,470,824.48			14,148,189.44		120,466,823.99				343,085,837.91

**6、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策**

√适用 □不适用

限售股解禁后由第三层次转换为第一层次。

**7、本期内发生的估值技术变更及变更原因**

√适用 □不适用

为准确、公允反映有明确限售期的股票的公允价值，公司根据中国证券业协会《证券公司金融工具估值指引》和财政部《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》相关要求，对估值方法进行变更。

上述估值方法变更自 2021 年 10 月 1 日起适用，具体影响见本节五、44（2）重要会计估计变更。

**8、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**

√适用 □不适用

本公司不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、应收款项、存出保证金、其他资产（金融资产）、短期借款、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、代理承销证券款、应付款项、长期借款、其他负债（金融负债）等。

下表列示了本公司应付债券的账面价值以及相应的公允价值：

单位：元 币种：人民币

项目	期末		期末公允价值计量层次		
	账面价值	公允价值	第一层次	第二层次	第三层次
应付债券	43,525,535,155.58	43,700,178,412.06	43,700,178,412.06		

(续上表)

项目	期初		期初公允价值计量层次		
	账面价值	公允价值	第一层次	第二层次	第三层次
应付债券	32,805,189,719.93	32,145,370,363.34	32,145,370,363.34		

**9、其他**

□适用 √不适用

**十三、关联方及关联交易**

**1、本企业的母公司情况**

√适用 □不适用

单位：万元 币种：人民币



母公司名称	注册地	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例 (%)	母公司对本企业的表决权比例 (%)
莱芜钢铁集团有限公司	济南市钢城区	国有企业	513,254.59	46.37	46.37

本企业的母公司情况的说明：

截至期末，莱钢集团直接持有本公司有表决权股份占公司总股份的 46.37%，为本公司的母公司，莱钢集团为山东钢铁集团有限公司的全资子公司，山东钢铁集团有限公司 70%股权归山东省国资委所有。

本企业最终控制方是山东省国资委。

## 2、本企业的子公司情况

适用 不适用

本公司子公司情况请参见本节“十、在其他主体中的权益 1、在子公司中的权益”相关内容。

## 3、本企业合营和联营企业情况

本企业重要的合营或联营企业详见附注

适用 不适用

本公司重要的合营或联营企业参见本节“十、在其他主体中的权益 3、在合营企业或联营企业中的权益”相关内容。

本期与本公司发生关联方交易，或前期与本公司发生关联方交易形成余额的其他合营或联营企业情况如下

适用 不适用

合营或联营企业名称	与本企业关系
蚌埠中泰成长一号企业管理合伙企业（有限合伙）	联营企业
济南中泰新动能海富股权投资基金合伙企业（有限合伙）	联营企业
齐鲁股权交易中心有限公司	曾是联营企业（2021年12月后变更为子公司）
青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业（有限合伙）	联营企业
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	联营企业
山东交易市场清算所有限公司	联营企业
山东未来产业科技成果转化基金合伙企业（有限合伙）	联营企业
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	联营企业
山东中泰天使创业投资基金企业（有限合伙）	联营企业
上海鲁证锋通经贸有限公司	联营企业
深圳市沧金投资合伙企业（有限合伙）	联营企业
万家基金管理有限公司	联营企业
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	联营企业
威海中泰齐东蓝色并购投资中心（有限合伙）	联营企业
中泰华信股权投资管理股份有限公司	联营企业
中泰威智（枣庄）新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	联营企业
中泰长安（西安）股权投资合伙企业（有限合伙）	联营企业

其他说明

适用 不适用

## 4、其他关联方情况

√适用 □不适用

其他关联方名称	其他关联方与本企业关系
济钢集团有限公司	曾持股 5%以上的股东
山东能源集团有限公司	持股 5%以上的股东
新汶矿业集团有限责任公司	持股 5%以上股东的一致行动人
上海金谷裕丰投资有限公司	公司董事曾担任董事长的公司
德州银行股份有限公司	公司董事担任董事的公司
莱商银行股份有限公司	公司董事担任董事的公司
深圳市金证科技股份有限公司	公司董事的近亲属担任高管的公司
济南灏兴投资管理有限公司	公司董事控制的公司
齐河众鑫投资有限公司	公司董事控制的公司
山东永锋国际贸易有限公司	公司董事控制的公司
山东永通实业有限公司	公司董事控制的公司
永锋集团有限公司	公司董事控制的公司
济南西城投资发展有限公司	公司监事曾任董事长的公司
济南城市建设集团有限公司	公司监事担任董事的公司
济南西城投资开发集团有限公司	公司监事担任董事的公司
山东西进融资担保有限公司	公司监事担任董事长的公司
山东省鲁信投资控股集团有限公司	公司原董事长担任董事长的公司
山东钢铁集团永锋临港有限公司	控股股东的监事的近亲属担任董事长的企业
山东钢铁股份有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东钢铁集团财务有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东钢铁集团房地产有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东钢铁集团淄博张钢有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东金岭矿业股份有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东金岭铁矿有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东省新力冶金实业有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山钢金控资产管理（深圳）有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山钢金融控股（深圳）有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山钢信恒国际有限公司	控股股东的母公司控制的其他公司
山东莱钢永锋钢铁有限公司	控股股东控制的其他公司
山东大宗商品交易中心有限公司	联营企业控制的公司
山东齐惠投资管理有限公司	联营企业控制的公司
山东齐鲁资本市场发展服务有限公司	联营企业控制的公司
山东齐盛股权投资基金管理有限公司	联营企业控制的公司
上海万家朴智投资管理有限公司	联营企业控制的公司
万家财富基金销售（天津）有限公司	联营企业控制的公司
万家共赢资产管理有限公司	联营企业控制的公司
宜兴中瑾泰投资企业（有限合伙）	联营企业控制的公司
临沂矿业集团有限责任公司	公司控股股东将由莱钢集团变更为枣矿集团，上述公司为枣矿集团的母公司山能集团控制的公司，股权变更事项尚未获得中国证监会批复，公司预计未来将完成股权变更
龙口矿业集团有限公司	
青岛中瓷贸易有限公司	
山东安元实业有限责任公司	
山东玻纤集团股份有限公司	
山东方大清洁能源科技有限公司	
山东能源集团创元投资有限公司	
山东能源招标有限公司	

山东能源重型装备制造集团有限责任公司	
山东融裕金谷创业投资有限公司	
山东省鲁北煤炭配送基地有限公司	
山东颐养健康产业发展集团有限公司	
上海飞盛国际贸易有限公司	
兖矿(海南)智慧物流科技有限公司	
兖矿东华集团有限公司	
兖矿东华建设有限公司	
兖矿资本管理有限公司	
中垠物产有限公司	
淄博矿业集团有限责任公司	
李峰、冯艺东、陈肖鸿、范奎杰、曹孟博、刘锋、张晖、严法善、綦好东、胡希宁、满洪杰、郭永利、曹灶强、王思远、范天云、安铁、王丽敏、崔建忠、毕玉国、孙培国、钟金龙、袁西存、胡增永、亓兵、张勇、李恒第、张云伟	公司的董事、监事、高级管理人员
林旭燕，刘传英等人	公司董事、监事、高级管理人员的近亲属
孟庆建，程龙	曾任公司董事、高级管理人员
李玲，李琦等人	曾任公司董事、高级管理人员的近亲属
李洪建，陈明玉等人	控股股东的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员
胡晓红，李子悦等人	控股股东的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属
王庆山、孙李涛等人	曾任控股股东董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员
柳明，逢晓男等人	曾任控股股东董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属
侯军，陶登奎等人	控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员
侯梦菲、潘建红等人	控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属
刘德华、徐有芳等人	曾任控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员
刘德云、李明芳等人	曾任控股股东母公司董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属
侯宇刚、李文等人	公司未来控股股东的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员
陈宏、乐江华等人	公司未来控股股东的母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员

## 5、关联交易情况

### (1). 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

采购商品/接受劳务情况表

适用 不适用

出售商品/提供劳务情况表

适用 不适用

购销商品、提供和接受劳务的关联交易说明

适用 不适用

**(2). 关联受托管理/承包及委托管理/出包情况**

本公司受托管理/承包情况表:

适用 不适用

关联托管/承包情况说明

适用 不适用

本公司委托管理/出包情况表:

适用 不适用

关联管理/出包情况说明

适用 不适用

**(3). 关联租赁情况**

本公司作为出租方:

适用 不适用

本公司作为承租方:

适用 不适用

关联租赁情况说明

适用 不适用

**(4). 关联担保情况**

本公司作为担保方

适用 不适用

本公司作为被担保方

适用 不适用

关联担保情况说明

适用 不适用

**(5). 关联方资金拆借**

适用 不适用

单位: 元 币种: 人民币

关联方	拆借金额	起始日	到期日	说明
拆入				
莱商银行股份有限公司	300,000,000.00	2018年12月25日	2028年12月25日	已还款6,900万元

**(6). 关联方资产转让、债务重组情况**

适用 不适用

**(7). 关键管理人员报酬**

适用 不适用

单位: 万元 币种: 人民币

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员报酬	4,860.55	4,477.89

**(8). 其他关联交易**

适用 不适用

①提供代理买卖证券服务、向其收取佣金及手续费并支付客户资金存款利息

单位: 元 币种: 人民币

关联方	期末余额	本期发生额
-----	------	-------

	资金余额	佣金总额	利息支出
济南西城投资发展有限公司	13,869,533.86	118,365.74	6,756.90
万家共赢资产管理有限公司	4,204,430.29	11,117.43	2,002.76
公司董事、监事及高级管理人员的近亲属	2,259,388.51	214,050.73	9,785.18
齐河众鑫投资有限公司	774,550.85		2,730.89
万家基金管理有限公司	375,562.11	4,896.97	6,223.49
曾任公司董事、高级管理人员	369,280.66	104.74	73.10
控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属	341,822.31	5,173.12	491.23
上海万家朴智投资管理有限公司	190,684.36		673.32
控股股东的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属	158,736.23	36,332.15	596.05
控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员	138,790.85		474.88
曾任控股股东母公司董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属	121,347.74	3,773.41	30.60
曾任控股股东董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属	119,795.13	189.07	313.47
公司未来控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员	109,917.52	3,821.03	613.27
山东省鲁信投资控股集团有限公司	93,288.34	200,237.13	635,347.04
公司的董事、监事及高级管理人员	72,627.53	3,945.00	1,255.54
德州银行股份有限公司	71,909.86		26,927.39
济南灏兴投资管理有限公司	52,397.79		75.78
公司未来控股股东的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员	11,205.02	1,036.39	321.16
山东未来产业科技成果转化基金合伙企业（有限合伙）	11,196.87	21,049.96	6,671.91
曾任公司董事、高级管理人员的近亲属	8,499.94	97,439.53	267.42
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	6,927.84	8,998.23	6,216.41
济南西城投资开发集团有限公司	6,906.90		24.39
曾任控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员	6,526.00	1,557.94	53.56
山东钢铁集团房地产有限公司	5,144.08	16,921.82	5,144.08
莱芜钢铁集团有限公司	4,951.08	19,999.82	988.82
山东能源集团有限公司	3,522.97	344,727.66	278,566.02
山东莱钢永锋钢铁有限公司	2,019.67		10.98
曾任控股股东董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员	1,991.32	4.10	7.33
永锋集团有限公司	1,489.76	60.49	6.00
山东钢铁集团有限公司	1,414.69		1,518.54
山东钢铁集团财务有限公司	1,054.88		3.72
济钢集团有限公司	1,041.50		892.76
山东西进融资担保有限公司	971.99	1,000.00	3.44
兖矿东华集团有限公司	742.87		2.60
兖矿资本管理有限公司	731.73	14,122.57	99.63
控股股东的董事、监事、高级管理人员	620.02	19,746.72	1,112.30

及其他关键管理人员			
山东融裕金谷创业投资有限公司	329.14		75.63
淄博矿业集团有限责任公司	169.03		169.11
山东省新力冶金实业有限公司	61.80		0.19
山东玻纤集团股份有限公司	52.44		0.20
山东金岭铁矿有限公司	28.06		30.53
山钢金控资产管理（深圳）有限公司	0.04		
山东能源集团创元投资有限公司		11,667.72	17,109.79
山钢金融控股（深圳）有限公司		27,949.19	7,950.54
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）		3,198.57	2.64
齐鲁股权交易中心有限公司		54,939.96	5,012.35
合计	23,401,663.58	1,246,427.19	1,026,632.94

(续上表)

关联方	期初余额	上期发生额	
	资金余额	佣金总额	利息支出
山东省鲁信投资控股集团有限公司	50,017,594.87	128,252.00	572,925.56
万家基金管理有限公司	3,514,757.94	8,670.62	3,602.29
宜兴中瑾泰投资企业（有限合伙）	1,015,530.57		2,110.33
中泰华信股权投资管理股份有限公司	930,717.63	44,968.65	2,623.95
山东钢铁集团房地产有限公司	914,994.85	49,878.77	7,494.05
齐河众鑫投资有限公司	769,519.96		2,712.23
公司董事、监事、高级管理人员的近亲属	634,323.34	141,177.04	2,294.73
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	618,498.97		2,183.97
控股股东母公司的董事、监事、高级管理人员及其近亲属	215,195.79	27,052.19	1,187.53
山东未来产业科技成果转化基金合伙企业（有限合伙）	196,044.96		692.25
控股股东的董事、监事、高级管理人员及其近亲属	185,806.45	29,128.63	1,886.53
万家共赢资产管理有限公司	98,844.20	117,372.22	18,234.33
齐鲁股权交易中心有限公司	95,310.74	62,314.94	11,454.87
德州银行股份有限公司	46,820.28		6,376.84
山东能源集团有限公司	40,298.13		41,901.52
公司的董事、监事、高级管理人员	32,240.07	1,574.18	964.83
山东齐惠投资管理有限公司	25,893.27	3,529.00	86.23
济南灏兴投资管理有限公司	21,386.01	1,414.61	214.69
山东齐鲁资本市场发展服务有限公司	11,903.18	2,970.00	61.72
莱芜钢铁集团有限公司	4,881.04	29,007.91	5,474.50
山东莱钢永锋钢铁有限公司	3,084.59		13.99
山东齐盛股权投资基金管理有限公司	2,847.77	5,489.00	130.36
山东钢铁集团有限公司	1,641.64		5.80
永锋集团有限公司	1,277.27		4.52
山东钢铁集团财务有限公司	1,051.16		3.72
山东西进融资担保有限公司	968.55		990.44
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	929.03		1.96
上海金谷裕丰投资有限公司	725.25	21,379.57	150.68

山东金岭矿业股份有限公司	77.44		0.28
山东省新力冶金实业有限公司	47.62		0.14
济南西城投资发展有限公司	34.84		8,950.47
山钢金控资产管理（深圳）有限公司	0.04		
万家财富基金销售（天津）有限公司	0.02		0.02
山钢金融控股（深圳）有限公司		1,290.24	157.04
威海中泰齐东蓝色并购投资中心（有限合伙）			0.31
山东钢铁集团淄博张钢有限公司		171.83	
山东永通实业有限公司			0.04
山东交易市场清算所有限公司			0.04
合计	59,403,247.47	675,641.40	694,892.76

②提供期货交易服务

单位：元 币种：人民币

关联方	期末余额	本期发生额
	资金余额	佣金总额
山东莱钢永锋钢铁有限公司	12,848,082.78	9,792.94
兖矿（海南）智慧物流科技有限公司	9,131,905.50	71,233.74
山东永通实业有限公司	7,564,546.15	120,080.03
青岛中兖贸易有限公司	3,146,875.19	3,623.23
山东钢铁集团永锋临港有限公司	1,456.53	113.47
上海飞盛国际贸易有限公司	1,070.03	
中垠物产有限公司	1,001.86	170,101.50
公司董事、监事及高级管理人员的近亲属	209.19	
上海鲁证锋通经贸有限公司		49,478.07
合计	32,695,147.23	424,422.98

（续上表）

关联方	期初余额	上期发生额
	资金余额	佣金总额
山东莱钢永锋钢铁有限公司	7,650,075.53	597,315.54
山东永通实业有限公司	4,464,941.19	621.25
山东钢铁股份有限公司	2,910,645.93	
公司董事、监事、高级管理人员的近亲属	209.19	
上海鲁证锋通经贸有限公司		357,582.29
合计	15,025,871.84	955,519.08

③与关联方发生的财务顾问费、席位佣金费、承销费及其他

单位：元 币种：人民币

关联方	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
山东莱钢永锋钢铁有限公司	采购现货的成本	255,692,770.43	32,178,730.79
山东钢铁股份有限公司	采购现货的成本	82,578,343.45	
万家基金管理有限公司	席位佣金收入	57,727,733.52	44,738,955.12
万家基金管理有限公司	手续费收入	30,363,495.11	15,741,278.93
万家基金管理有限公司	尾随佣金收入	24,001,248.14	5,279,569.17
万家基金管理有限公司	销售服务费	20,495,131.48	
山东安元实业有限责任公司	销售现货的收入	13,868,901.01	
山东能源集团有限公司	承销收入	8,624,989.41	

万家基金管理有限公司	业务协同收入	8,529,700.00	
万家共赢资产管理有限公司	业务协同收入	2,770,671.43	
山东未来产业科技成果转化基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入	2,593,158.79	3,161,241.75
山东中泰天使创业投资基金企业（有限合伙）	管理费收入	2,431,958.04	2,710,343.50
万家共赢资产管理有限公司	手续费及佣金收入	2,266,166.57	8,661,350.70
山钢金融控股（深圳）有限公司	承销收入	2,240,566.04	2,240,566.04
山东省鲁信投资控股集团有限公司	承销收入	1,964,528.30	
山东永锋国际贸易有限公司	场外期权投资收益	1,648,850.00	119,660.00
荣成中泰蓝润新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入	1,391,509.40	1,319,074.66
山东钢铁集团有限公司	承销收入	1,348,404.54	
青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业（有限合伙）	管理费收入	1,132,075.42	828,120.96
山东中泰齐东世华节能投资中心（有限合伙）	管理费收入	1,125,872.32	1,132,075.47
万家共赢资产管理有限公司	托管费收入	711,843.64	11,004.57
威海市中泰齐东投资中心（有限合伙）	管理费收入	379,632.98	962,264.14
万家共赢资产管理有限公司	席位佣金收入	336,311.72	162,498.76
中泰威智（枣庄）新旧动能转换股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入	293,357.45	
莱芜钢铁集团有限公司	承销收入	283,018.87	
万家共赢资产管理有限公司	销售服务收入	223,745.47	426,368.33
蚌埠中泰成长一号企业管理合伙企业（有限合伙）	管理费收入	207,902.83	
济南城市建设集团有限公司	承销收入	189,410.17	
万家共赢资产管理有限公司	外包服务收入	170,169.06	10,841.05
中泰长安（西安）股权投资合伙企业（有限合伙）	管理费收入	95,373.48	
济南中泰新动能海富股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入	12,406.30	
万家共赢资产管理有限公司	财务顾问收入		158,220.52
山东钢铁集团有限公司	财务顾问收入		84,905.66
山东钢铁股份有限公司	承销收入		2,641,509.44
山东能源集团有限公司	财务顾问收入		7,547,169.81
济钢集团有限公司	承销收入		296,223.58
山钢信恒国际有限公司	承销收入		6,996,044.84
合计		525,699,245.37	137,408,017.79

④申购关联方发行的票据、基金产品、债券及产生的投资收益、利息收入等

A. 申购关联方发行的票据、基金产品、债券

单位：元 币种：人民币

关联方	期末余额	期初余额
山东钢铁集团有限公司	399,931,810.00	916,434,550.00
万家基金管理有限公司	233,707,126.01	766,563,997.32
兖矿东华建设有限公司	175,513,100.00	



山东能源集团有限公司	135,196,710.00	
新汶矿业集团有限责任公司	71,365,090.41	
山钢信恒国际有限公司	63,416,816.96	
淄博矿业集团有限责任公司	61,650,180.00	
莱芜钢铁集团有限公司	61,355,430.00	80,110,230.00
山钢金融控股(深圳)有限公司	51,296,550.00	150,484,175.00
龙口矿业集团有限公司	30,347,040.00	
临沂矿业集团有限责任公司	20,369,480.00	
山东能源重型装备制造集团有限责任公司	20,359,820.00	
山东钢铁股份有限公司		52,316,028.45
合计	1,324,509,153.38	1,965,908,980.77

## B. 申购关联方发行的票据、基金产品产生的投资收益

单位：元 币种：人民币

关联方	本期发生额	上期发生额
万家基金管理有限公司	11,968,721.97	791,811.55
山东钢铁集团有限公司		-2,217,062.58
山钢金融控股(深圳)有限公司		-1,849,525.33
山东能源集团有限公司		259,127.50
合计	11,968,721.97	-3,015,648.86

## C. 申购关联方发行的债券产生的利息收入

单位：元 币种：人民币

关联方	本期发生额	上期发生额
山东钢铁集团有限公司	23,698,591.94	42,252,747.61
山钢金融控股(深圳)有限公司	7,050,550.00	9,583,805.47
莱芜钢铁集团有限公司	3,188,000.00	3,870,195.06
山东能源集团有限公司	3,105,835.34	1,347,776.71
山钢信恒国际有限公司	2,702,055.51	
山东钢铁股份有限公司	1,670,505.00	2,697,875.55
山东省鲁信投资控股集团有限公司	1,341,629.59	
新汶矿业集团有限责任公司	774,509.59	
兖矿东华建设有限公司	518,590.00	
淄博矿业集团有限责任公司	174,000.00	
龙口矿业集团有限公司	105,870.00	
临沂矿业集团有限责任公司	61,380.00	
山东能源重型装备制造集团有限责任公司	58,300.00	
山东钢铁集团房地产有限公司	46,786.92	413,981.76
合计	44,496,603.89	60,166,382.16

## ⑤关联方申购本公司发行的收益凭证及向关联方支付的利息

## A. 关联方申购本公司发行的收益凭证

单位：元 币种：人民币

关联方	期末余额	期初余额
曾任控股股东母公司董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属	50,000.00	

德州银行股份有限公司		260,422,997.87
控股股东的董事、监事、高级管理人员的近亲属		60,270.08
合计	50,000.00	260,483,267.95

B. 向关联方支付的利息

单位：元 币种：人民币

关联方	本期发生额	上期发生额
德州银行股份有限公司		9,370,943.08
控股股东的董事、监事、高级管理人员的近亲属		270.08
齐鲁股权交易中心有限公司	1,396,164.38	
公司董事、监事及高级管理人员的近亲属	5,646.03	
曾任控股股东母公司董事、监事、高级管理人员及其他关键管理人员的近亲属	1,679.62	
合计	1,403,490.03	9,371,213.16

⑥存放关联方款项及产生的利息收入

A. 存放关联方款项余额

单位：元 币种：人民币

关联方	期末余额	期初余额
莱商银行股份有限公司	1,520,028,689.81	857,053,910.49

B. 存放关联方款项产生的利息收入

单位：元 币种：人民币

关联方	本期发生额	上期发生额
莱商银行股份有限公司	26,430,521.92	21,253,214.72

6、 关联方应收应付款项

(1). 应收项目

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	关联方	期末余额		期初余额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	山东安元实业有限责任公司	9,671,858.14			
应收款项	万家共赢资产管理有限公司	5,421,256.45	271,062.82		
应收款项	万家基金管理有限公司	2,310,000.00	115,500.00	15,419,794.27	3,112,775.52
应付款项	山东能源集团有限公司	186,517.50			
其他应收款	万家共赢资产管理有限公司	4,000,000.00	200,000.00		
其他应收款	山东交易市场清算所有有限公司	199,471.30			
其他应收款	山东中泰天使创业投资基金企业（有限合伙）	127,780.51	6,389.03		
其他应收款	山东能源招标有限公司	100,000.00	5,000.00		
其他应收款	山东大宗商品交易中心有限公司	41,170.14			
其他应收款	深圳市沧金投资合伙企业	20,000.00	9,250.00	15,000.00	4,250.00

	(有限合伙)				
其他应收款	山东方大清洁能源科技有限公司	20,000.00	1,000.00		
其他应收款	中泰长安(西安)股权投资合伙企业(有限合伙)	13,972.60	698.63		
其他应收款	济南中泰新动能海富股权投资基金合伙企业(有限合伙)	13,150.68	657.53		
其他应收款	山东省鲁北煤炭配送基地有限公司	800.00	40.00		
其他应收款	青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业(有限合伙)			877,808.22	
其他应收款	齐鲁股权交易中心有限公司			80,000.00	32,000.00
预付款项	山东钢铁股份有限公司	13,857,592.97			
预付款项	深圳市金证科技股份有限公司	7,373,512.38			
预付账款	山东莱钢永锋钢铁有限公司	313,067.98		949,395.57	

(2). 应付项目

适用  不适用

单位:元 币种:人民币

项目名称	关联方	期末账面余额	期初账面余额
其他应付款	上海鲁证锋通经贸有限公司	52,340.57	
其他应付款	深圳市金证科技股份有限公司	18,000.00	
其他应付款	山东中泰天使创业投资基金企业(有限合伙)		2,439,259.99
合同负债	万家共赢资产管理有限公司	388,819.16	462,705.10

7、关联方承诺

适用  不适用

8、其他

适用  不适用

十四、 股份支付

1、 股份支付总体情况

适用  不适用

2、 以权益结算的股份支付情况

适用  不适用

3、 以现金结算的股份支付情况

适用  不适用

4、 股份支付的修改、终止情况

适用  不适用

5、 其他

适用  不适用

## 十五、 承诺及或有事项

### 1、 重要承诺事项

√适用 □不适用

资产负债表日存在的对外重要承诺、性质、金额

(1) 已签订的尚未履行或尚未完全履行的对外投资合同

单位：元 币种：人民币

已签约但尚未于财务报表中确认的资本承诺	期末余额	期初余额
对外投资承诺	592,500,000.00	254,500,000.00

根据公司之子公司中泰资本与西安曲江文化金融控股（集团）有限公司签订的中泰长安（西安）股权投资合伙企业（有限合伙）合伙协议，中泰资本承诺出资 20,000 万元，截至本期末，中泰资本已缴付基金出资款项 500 万元，剩余出资尚未缴付。

根据公司之子公司中泰资本及齐鲁中泰与山东省新动能基金管理有限公司、青岛市市级创业投资引导基金管理中心等各方签订的青岛中泰海控新旧动能转换股权投资企业（有限合伙）合伙协议，中泰资本承诺出资 5,250 万元，截至本期末，中泰资本已缴付基金出资款项 1,050 万元，剩余出资尚未缴付。

根据公司之子公司中泰资本与山东省新动能基金管理有限公司、潍坊恒新资本管理有限公司等各方签订的潍坊中泰恒新农创股权投资基金合伙企业（有限合伙）合伙协议，中泰资本承诺出资 10,000 万元，截至本期末，中泰资本已缴付基金出资款项 200 万元，剩余出资尚未缴付。

根据公司之子公司中泰资本与西安曲江文化产业风险投资有限公司等各方签订的中泰曲江（西安）股权投资合伙企业（有限合伙）合伙协议，中泰资本承诺出资 1,200 万元，截至本期末，中泰资本尚未实际缴付出资。

根据公司之子公司中泰资本与烟台国泰诚丰资产管理有限公司、烟台芝罘财金控股集团有限公司等各方签订的烟台国丰芝财中泰股权投资基金合伙企业（有限合伙）合伙协议，中泰资本承诺出资 4,750 万元，截至本期末，中泰资本已缴付基金出资款项 200 万元，剩余出资尚未缴付。

根据公司之子公司中泰资本及齐鲁中泰与浙江省产业基金有限公司、嘉兴市政府股权投资基金有限公司等各方签订的嘉兴蓝箭中泰商业航天中心定向基金（有限合伙）合伙协议，中泰资本承诺出资 20,000 万元，截至本期末，中泰资本尚未实际缴付出资。

(2) 截至 2021 年 12 月 31 日，除上述事项外，本公司无需要披露的其他重要承诺事项。

### 2、 或有事项

#### (1). 资产负债表日存在的重要或有事项

√适用 □不适用

①重要的未决诉讼或仲裁

A. 金山实业有抵押优先贷款票据买卖纠纷案。2015 年 5 月 13 日，子公司中泰金融投资与中国金山实业集团有限公司（中国金石之全资子公司，以下简称“金山实业”）签订贷款票据买卖协议，金山实业向中泰金融投资购买由 MagnificentCenturyLimited 发行的有抵押优先贷款票据，

贷款票据面值 1,000 万美元，收购价款为 1,000 万美元。2015 年 6 月 30 日，双方完成贷款票据的交割。该贷款票据于 2015 年 8 月 7 日到期，票据发行人未能于到期日偿还贷款票据。

金山实业诉请中泰金融投资在上述贷款票据买卖协议中误导原告金山实业，因此向被告中泰金融投资提出申索，要求解除贷款票据买卖协议、偿还 1,000 万美元并赔偿其他相关损失。截至 2022 年 3 月 29 日，该案尚在审理中。

B. 漳州农村商业银行股份有限公司合同纠纷案。漳州农村商业银行股份有限公司（以下简称“漳州农商行”）与中泰资管签订了《齐鲁资管 0231 号定向资产管理合同》，中泰资管为管理产品的管理人。2021 年 1 月 4 日，中泰资管收到上海金融法院送达的应诉通知书，漳州农商行以中泰资管为被告向上海金融法院提起诉讼，标的额 65,035,624.77 元（以诉状中暂计的各项请求金额为依据），请求判令解除双方签订的合同，中泰资管返还委托资金、回购利息、赔偿损失等费用。现本案正在一审过程中。

②截至 2021 年 12 月 31 日，除上述事项外，本公司无需要披露的其他重要或有事项。

**(2). 公司没有需要披露的重要或有事项，也应予以说明：**

适用 不适用

**3、其他**

适用 不适用

**十六、资产负债表日后事项**

**1、重要的非调整事项**

适用 不适用

(1) 2022 年 1 月 14 日，公司已完成中泰证券股份有限公司公开发行 2022 年公司债券（第一期）（代码：185246，简称：22 中泰 01）的发行工作，发行规模 30 亿元，债券期限为 3 年，债券票面利率为 2.97%。

(2) 2022 年 2 月 21 日，公司已完成中泰证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）（代码：185367，简称：22 中泰 C1）的发行工作，发行规模 30 亿元，债券期限为 3 年，债券票面利率为 3.17%。

(3) 2022 年 2 月 23 日，公司已完成中泰证券股份有限公司 2022 年度第一期短期融资券（代码：072210029，简称：22 中泰证券 CP001）的发行工作，发行规模 10 亿元，债券期限 275 天，债券票面利率 2.53%，到期一次还本付息。

(4) 2022 年 3 月 21 日，公司已完成中泰证券股份有限公司公开发行 2022 年公司债券（第二期）（代码：185558，简称：22 中泰 02）的发行工作，发行规模 15 亿元，债券期限为 3 年，债券票面利率为 3.18%。

**2、利润分配情况**

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

拟分配的利润或股利	439,023,422.63
经审议批准宣告发放的利润或股利	-

2022年3月29日，公司第二届董事会第五十六次会议审议通过《公司2021年度利润分配预案》，公司2021年度利润分配预案为：以公司总股本为基数，向实施权益分派股权登记日登记在册的全体股东每10股派发现金红利0.63元（含税）。按2021年末公司总股本6,968,625,756.00股计算，合计派发现金红利439,023,422.63元，不送红股，不以公积金转增股本。本预案尚需提交公司股东大会审议。

### 3、销售退回

适用 不适用

### 4、其他资产负债表日后事项说明

适用 不适用

#### （1）重要的期后诉讼事项

①2022年1月，公司收到北京金融法院送达的《民事起诉状》，上海君盈资产管理合伙企业（有限合伙）等两千名证券投资者（以下简称原告）向法院诉请判令乐视网向原告支付因虚假陈述引起的投资损失之侵权赔偿款项（含投资差额损失、印花税、佣金、利息），共计人民币4,571,357,198.00元，判令除乐视网外包括公司在内的二十名被告对原告的上述损失承担连带赔偿责任。公司为乐视网2016年非公开发行股票项目的联席主承销商之一而非保荐机构。截至2022年3月29日，该案尚未开庭。

②2022年2月21日，中创环球控股有限公司（以下简称“中创环球”）主席及执行董事胡某某以个人身份，向香港高等法院诉请判决中创环球原董事长兼执行董事陈某某、中泰金融投资有限公司、中泰国际证券有限公司、中泰国际金融产品有限公司和中泰金融国际有限公司（合称“中泰国际及其子公司”）连同中泰国际时任董事高峰、王乐平、吕涛江和张延峰，共同向原告支付2.6亿港元和利息，以及其他法院认为合适的救济。原告主要指控中泰国际及其子公司涉嫌与陈某某在2.5亿港元贷款项目中，合谋欺骗中创环球全体股东及债权人。截至2022年3月29日，该案尚在审理中。

#### （2）拟购买重大资产

2022年3月18日，公司第二届董事会第五十五次会议审议通过了《关于变更济南汉峪金谷办公楼相关事项的议案》。同意公司将原拟购济南汉峪金谷办公楼变更为云鼎大厦7-46层（含车位），总价款（含购房款、增值税，不含其他交易税费）不超过17.38亿元，资金来源为原拟购置汉峪金谷办公楼预付房款及利息5.82亿元、处置济南市中区证券大厦及其他房产回笼资金、部分现金等。

#### （3）高级管理人员变更

①2022年1月5日，根据公司第二届董事会第五十三次会议决议，公司首席风险官李恒第辞去首席风险官职务，经董事长提名，同意聘任胡开南为公司首席风险官。

②张云伟辞去公司总法律顾问职务。

截至 2022 年 3 月 29 日，除上述披露事项外，本公司无需要披露的其他重大资产负债表日后事项。

## 十七、 风险管理

### 1、 风险管理政策及组织架构

#### (1). 风险管理政策

√适用 □不适用

公司制定并持续完善各类风险管理制度，明确风险管理目标、原则、组织架构、授权体系、相关职责、基本程序，针对不同风险类型制定风险识别、评估、监测、应对、报告方法和流程，并通过评估、稽核、检查和绩效考核等手段保证风险管理制度的贯彻落实。公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，主要包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制。公司董事会、经理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的各类风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。

#### (2). 风险治理组织架构

√适用 □不适用

公司建立了包括董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司在内的多层次、相互衔接、有效制衡的全面风险管理组织架构。

公司董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，主要职责为：推进公司风险管理文化建设，审议批准公司全面风险管理基本制度，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等。董事会风险管理委员会在董事会的授权下，对公司日常经营中的各类重大风险事项进行审议，提出完善全面风险管理体系的建议。监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

公司经理层负责组织开展公司日常全面风险管理工作，对公司全面风险管理的有效性承担主要责任，执行董事会审议通过的风险管理策略，制定风险管理制度并适时调整，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额具体执行方案等。

公司首席风险官代表公司经理层组织、协调、落实公司经营层面的全面风险管理工作。风险管理部在首席风险官领导下推动公司全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构及子公司的风险管理工作。合规管理总部、法律事务部、计划财务总部、企业文化部分别是合规风险、法律风险、流动性风险、声誉风险的归口管理部门，负责牵头组织、推动相关风险管理工作。审计稽核部负责对公司全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价。

公司各业务部门、分支机构及子公司负责人承担风险管理的直接责任，在日常工作中全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。公司每一名员工均对风险管理有效性承担勤勉尽责、审慎防范、及时报告的责任。

## 2、信用风险

√适用 □不适用

信用风险是指由于融资方、交易对手或发行人等违约导致公司可能面临损失的风险。报告期内，公司面临的信用风险主要集中在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务、债券投资交易业务、场外衍生品业务等。

公司建立了内部评级管理制度，针对不同行业属性建立内部评级模型，同时实行定期、不定期调整机制，根据评级主体的财务预警、舆情预警进行评级分析与不定期调整。公司根据业务发展及管理需要确定了内部评级覆盖的业务范围，并建立了与自身业务复杂程度和风险指标体系相适应的内部评级管理工具、方法和标准。

在融资融券、约定购回式证券交易及股票质押式回购交易等融资类业务方面，公司制定并完善了各项业务制度，主要通过尽职调查、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、司法追索等方式对该类业务的信用风险进行控制。公司建立了较为严格的客户准入门槛、尽职调查标准，制定了客户信用等级评价体系，持续优化客户信用情况、资产状况、投资经验等方面的量化评估，严控授信上限，同时建立了多层级的业务授权管理体系；公司设置风险监控指标和预警阈值，实施逐日盯市并及时预警，同时密切跟踪融资方、标的证券等舆情变化，发现风险时及时与客户沟通，最大限度减少违约情形发生；公司通过贷后回访、黑名单管理等强化客户资质后续管理，加强对客户信用风险的预判和督促提醒，定期评估业务整体状况以及部分高风险项目情况并相应制定处置方案，维护公司债权安全。

在债券投资业务方面，公司通过制定交易对手、债券现券尽职调查标准、评级准入标准、限额管理方案，建立了与业务复杂度相适应的分级授权审批机制，实现业务风险的事前管理；公司建立了持仓债券与存续交易对手的舆情管理机制，密切关注发行主体、担保方、交易对手的评级、资质变化，对于高集中度行业的同一集团控制的主体进行集中度的合并计算，注重分散投资，优先投资管理规范、资信状况良好的资产。此外，公司不断深化内部评级在债券投资交易中的应用，包括但不限于准入管理、预警管理、风险计量等方面。

在场外衍生品业务方面，公司从客户尽职调查、内部评级、准入管理、限额管理、合同管理、风险应对与处置等方面建立了相应的管理制度与流程，对存续期内的交易对手和合约进行逐日盯市，并综合运用担保品、集中度管理、净额结算、保证等方式缓释与控制信用风险。

截至报告期末，本公司无对外担保，因此，在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，本公司最大信用风险敞口列示如下：

单位：元 币种：人民币

项目名称	期末余额	期初余额
货币资金	46,090,288,079.05	36,651,600,637.15
结算备付金	11,097,890,604.20	8,827,027,434.56
融出资金	35,821,147,194.79	31,206,744,639.54
交易性金融资产	36,055,136,656.63	40,648,444,199.43
存出保证金	10,284,255,949.87	8,982,591,206.22



衍生金融资产	430,613,618.22	270,143,072.50
买入返售金融资产	12,474,745,640.83	9,160,815,458.42
应收款项	1,572,351,957.16	1,008,821,124.39
其他债权投资	20,806,019,158.84	17,759,974,678.54
其他资产	1,638,811,121.13	734,803,721.32
债权投资	2,197,335,613.93	3,732,092,907.91
最大风险敞口合计	178,468,595,594.65	158,983,059,079.98

本公司金融资产包括货币资金、结算备付金、交易性金融资产、衍生金融资产、买入返售金融资产、存出保证金、债权投资、其他债权投资、其他权益工具投资、应收款项、融出资金等，资产负债表日公司（合并口径）最大信用风险敞口为 1,784.69 亿元，母公司最大信用风险敞口为 1,453.92 亿元。

### 3、流动风险

√适用 □不适用

#### ①本公司面临的流动性风险及其具体表现情况

流动性风险是指无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。公司可能面临流动性风险的事件和因素包括：现金流紧张、融资成本持续升高、融资渠道受阻、债务集中到期难以兑付等。

#### ②对流动性风险进行管理

公司面临的流动性风险主要为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，公司采取的措施为：

A. 在融资负债统一归口管理的基础上积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势及其可能对中长期资金的需求，调整公司负债期限结构，保持资产负债期限始终处于合理水平；

B. 及时完善负债规划，通过调整到期融资集中度等手段，避免因融资渠道过于单一或债务集中到期的偿付风险，使负债结构和到期日分布更趋合理；

C. 按照审慎原则确定优质流动性资产规模和构成，保持多层次的充足的优质流动性资产储备，定期测试优质流动性资产的变现能力，以确保公司在压力情景下能够及时获得充足资金满足流动性需求；

D. 建立现金流预测和分析框架，运用现金流缺口、敏感性分析、压力测试等管理工具，能够计量、监测和控制不同情景下未来不同时间段的现金流缺口；

E. 重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持畅通的融资渠道，如有需要，可通过资金拆借、债券回购、短期融资券、短期公司债、公司债、次级债、收益凭证及其他符合法律及监管规定的方式进行融资，以解决资金需求。

报告期内，公司保持了充足的流动性资产储备，流动性覆盖率和净稳定资金率均符合监管标准及监管预警标准。

本公司期末持有的金融负债剩余到期期限情况

单位：元 币种：人民币

项目名称	即期	3 个月以内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	无期限	合计
短期借款		3,234,674,688.23	1,010,681,515.14				4,245,356,203.37
应付短期融资款		2,948,813,796.55	9,961,964,739.84				12,910,778,536.39
拆入资金		2,785,248,841.87					2,785,248,841.87
交易性金融负债		54,450,766.68					54,450,766.68
衍生金融负债		281,642,084.47	76,617,567.10	9,007,962.21			367,267,613.78
卖出回购金融资产款		36,090,748,381.08	904,600,457.74				36,995,348,838.82
代理买卖证券款	56,213,164,519.52						56,213,164,519.52
代理承销证券款			5,650,010.43				5,650,010.43
应付款项	874,393,552.20	265,199,099.77	1,737,904,334.97	538,044,323.01			3,415,541,309.95
应付债券		5,810,986,186.75	8,873,509,134.51	28,841,039,834.32			43,525,535,155.58
长期借款		361,579.17	102,715,116.33	132,000,000.00	66,000,000.00		301,076,695.50
租赁负债				653,224,021.22			653,224,021.22
其他负债	352,551,945.93	238,184.33	517,542,711.31	47,979,527.16	301,606,563.22	633,397,635.43	1,853,316,567.38
合计	57,440,110,017.65	51,472,363,608.90	23,191,185,587.37	30,221,295,667.92	367,606,563.22	633,397,635.43	163,325,959,080.49

#### 4、市场风险

√适用 □不适用

公司涉及的市场风险主要包括证券场景气度对公司经营业绩的影响；持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括市场利率风险、汇率风险和其他价格风险等方面。

##### (1) 经营业绩依赖证券场景气度的风险

由于受经营模式、业务范围和金融产品数量等因素的制约，我国证券公司的经营状况与证券市场行情及其走势有较强的关联性，如果证券市场行情下跌，证券公司的承销、自营、经纪和资产管理等业务的经营难度将会增大，盈利水平将下降。证券市场行情受国民经济发展速度、宏观经济政策、利率及投资心理等诸多因素影响，存在一定的不确定性，因此，本公司存在因证券市场波动而导致收入和利润不稳定的风险。

##### (2) 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值因市场利率不利变动而发生损失的风险。持有的具有利率敏感性的各类金融工具因市场利率不利变动导致公允价值变动的风险是本公司利率风险的主要来源。

本公司利用敏感性分析作为监控利率风险的主要工具。采用敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，期末持有的各类金融工具公允价值变动对收入总额和股东权益产生的影响。

假设市场整体利率平行移动 100 个基点，且不考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动，本公司利率敏感性分析如下：

单位：元 币种：人民币

利率变化	对利润总额的影响		对其他综合收益的影响	
	2021 年度	2020 年度	2021 年度	2020 年度
市场利率平行上升 100 个基点	-175,950,382.97	-270,221,689.85	208,060,191.59	-159,648,247.78
市场利率平行下降 100 个基点	175,950,382.97	270,221,689.85	-208,060,191.59	159,648,247.78

##### (3) 汇率风险

汇率风险是指本公司进行的外币业务因外汇汇率变动所产生的风险。本公司面临的汇率风险主要与境外子公司的净投资及本公司的经营活动（当收支以不同于本公司记账本位币的外币结算时）有关。

截至期末，本公司境外外币资产、负债主要为全资子公司中泰国际所持有的资产和负债，占公司总资产和总负债的比例分别为 5.71%、5.39%，由于外币在本公司资产、负债结构中占比较低，因此本公司面临的汇率风险不重大。

截至期末，对于公司因境内不是以记账本位币计价的货币资金、结算备付金、存出保证金等外币资产，占整体资产的比重并不重大，因此本公司面临的汇率风险不重大。

## (4) 其他价格风险

其他价格风险是指本公司所持权益类金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本公司主要投资于证券交易所上市的股票、基金等，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。下表汇总了本公司的其他价格风险敞口：

单位：元 币种：人民币

项目	2021 年 12 月 31 日		2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占总资产的比例	公允价值	占总资产的比例
交易性金融资产				
基金	5,078,687,001.49	2.48%	3,389,972,512.28	1.94%
股票	4,551,361,199.94	2.22%	3,457,553,797.77	1.98%
银行理财产品	654,182,773.15	0.32%	1,987,033,294.94	1.14%
券商资管产品	996,598,705.38	0.49%	1,388,109,478.42	0.80%
信托计划	56,488,881.31	0.03%	111,886,263.78	0.06%
其他	5,993,144,116.26	2.93%	3,703,237,980.33	2.12%
其他权益工具投资				
基金	1,357,683,157.15	0.66%	788,417,106.53	0.45%
其他	1,892,038,368.83	0.92%	5,176,407,671.32	2.97%
合计	20,580,184,203.51	10.05%	20,002,618,105.37	11.46%

截至期末，若本公司持有的上述投资的公允价值上升 5%且其他市场变量保持不变，本公司净资产将相应增加 2.70%（2020 年：2.90%）；反之，若本公司持有金融工具的公允价值下降 5%且其他市场变量保持不变，本公司净资产则将相应下降 2.70%（2020 年：2.90%）。

## 十八、 其他重要事项

## 1、 前期会计差错更正

## (1). 追溯重述法

□适用 √不适用

## (2). 未来适用法

□适用 √不适用

## 2、 债务重组

□适用 √不适用

## 3、 资产置换

## (1). 非货币性资产交换

□适用 √不适用

## (2). 其他资产置换

□适用 √不适用

## 4、 年金计划

√适用 □不适用

本公司依据国家企业年金制度的相关政策建立了《中泰证券股份有限公司企业年金方案》。根据方案规定，凡与本公司签订劳动合同，并在本公司试用期满，且已依法参加基本养老保险并履行足额缴费义务的职工，可自愿申请参加该方案。

## 5、 终止经营

适用 不适用

## 6、 分部信息

### (1). 报告分部的确定依据与会计政策

适用 不适用

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，以经营分部为基础确定报告分部。

本公司的报告分部按照业务类型的不同，主要划分为：财富管理业务分部、证券及另类投资业务分部、投资银行业务分部、期货业务分部、资产管理业务分部、信用业务分部、境外业务以及总部及其他业务分部。

按营业利润来源于不同的地区划分为：公司本部、山东省分部、上海市分部、广东省分部以及其他地区分部。

各报告分部利润（亏损）、资产及负债信息列示如下（按业务类型）：

(2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	财富管理业务	证券及另类投资业务	投资银行业务	期货业务	资产管理业务	信用业务	境外业务	总部及其他业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	4,387,836,161.57	2,465,099,439.96	1,213,837,668.77	2,249,581,744.54	535,784,070.23	1,168,141,037.66	271,870,993.96	857,518,105.61		13,149,669,222.30
手续费及佣金净收入	3,746,875,973.81	20,120,002.25	1,211,866,650.18	393,968,953.69	558,496,390.72	-8.47	126,061,112.32	329,546,763.43		6,386,935,837.93
投资收益		1,995,475,752.45		52,594,641.54	23,542,201.40	24,250,224.36	42,977,383.22	259,601,353.04		2,398,441,556.01
公允价值变动收益		907,670,619.48		60,845,312.95	-86,151,144.39	11,625,484.50	-109,561,834.25	41,971,571.90		826,400,010.19
其他收入	640,960,187.76	-458,166,934.22	1,971,018.59	1,742,172,836.36	39,896,622.50	1,132,265,337.27	212,394,332.67	226,398,417.24		3,537,891,818.17
二、营业支出	2,797,003,341.11	333,983,723.47	757,143,392.72	1,991,351,298.71	332,178,610.44	33,572,447.27	1,068,886,319.95	1,540,823,360.24		8,854,942,493.91
三、营业利润	1,590,832,820.46	2,131,115,716.49	456,694,276.05	258,230,445.83	203,605,459.79	1,134,568,590.39	-797,015,325.99	-683,305,254.63		4,294,726,728.39
四、资产总额	106,284,564,588.86	81,962,633,497.01	2,461,954,167.75	20,682,099,727.83	1,167,337,335.21	44,241,760,914.00	11,023,470,159.97	51,276,409,705.60	114,410,465,225.45	204,689,764,870.78
五、负债总额	83,167,272,875.49	64,802,634,063.39	101,871,156.73	18,400,137,957.01	503,041,142.03	26,880,513,935.69	9,573,139,485.24	60,722,690,231.56	96,621,301,016.85	167,529,999,830.29
六、补充信息										
1、折旧和摊销费用	207,669,897.76	6,371,347.57	1,697,458.17	17,716,345.79	16,754,761.16	332,676.38	33,798,403.62	164,456,165.37		448,797,055.82
2、资本性支出	66,259,373.03	13,937,380.53	617,154.37	17,455,444.87	7,712,848.21		4,341,153.98	2,386,948,177.16		2,497,271,532.15

②上期报告分部（按业务）

单位：元 币种：人民币

项目	财富管理业务	证券及另类投资业务	投资银行业务	期货业务	资产管理业务	信用业务	境外业务	总部及其他业务	分部间抵销	合计
一、营业收入	3,353,109,714.26	746,286,561.27	962,216,958.78	1,283,290,576.86	412,628,127.46	1,717,068,204.13	492,975,474.28	1,384,648,402.80		10,352,224,019.84
手续费及佣金净收入	2,676,691,353.92	663,471.61	960,171,863.85	226,463,275.49	346,034,624.28	-60.00	184,726,199.47	799,238,849.43		5,193,989,578.05
投资收益		1,176,424,827.48		27,286,192.09	22,202,666.39	-1,116,528.58	115,728,864.14	319,917,606.56		1,660,443,628.08
公允价值变动收益		-88,347,986.17		60,579,536.13	1,726,127.02	413,108,418.98	18,820,436.74	22,505,532.54		428,392,065.24
其他收入	676,418,360.34	-342,453,751.65	2,045,094.93	968,961,573.15	42,664,709.77	1,305,076,373.73	173,699,973.93	242,986,414.27		3,069,398,748.47
二、营业支出	2,048,539,278.40	321,819,124.40	635,721,510.47	1,170,640,104.62	241,172,864.02	79,948,093.16	603,107,285.82	1,934,508,520.52		7,035,456,781.41
三、营业利润	1,304,570,435.86	424,467,436.87	326,495,448.31	112,650,472.24	171,455,263.44	1,637,120,110.97	-110,131,811.54	-549,860,117.72		3,316,767,238.43
四、资产总额	93,020,256,854.24	64,807,528,156.17	2,026,448,326.69	13,087,269,554.70	1,007,159,413.65	39,464,756,966.56	12,078,885,917.19	49,077,607,355.31	100,060,352,128.81	174,509,560,415.70
五、负债总额	70,266,385,331.60	55,926,008,709.19	126,068,768.46	10,969,728,455.16	411,533,549.02	24,408,129,782.52	10,644,898,388.65	53,015,287,548.47	85,688,227,366.12	140,079,813,166.95
六、补充信息										
1、折旧和摊销费用	53,331,860.44	3,423,476.00	2,157,978.85	10,534,103.45	4,397,733.51	248,700.10	12,376,933.52	142,191,802.40		228,662,588.27
2、资本性支出	39,618,095.09	7,854,016.31	282,810.67	8,328,502.78	3,965,047.36		7,179,399.48	142,889,947.71		210,117,819.40

③本期报告分部（按地区）

单位：元 币种：人民币

项目	公司本部	山东省	上海市	广东省	其他地区	分部间抵销	合计
一、营业收入	4,832,256,728.21	4,705,465,964.37	1,227,561,354.49	1,283,754,673.75	1,100,630,501.48		13,149,669,222.30
手续费及佣金净收入	2,329,918,666.96	2,286,040,821.43	896,297,115.08	62,832,353.24	811,846,881.22		6,386,935,837.93
投资收益	1,889,694,568.47	61,262,512.68	211,340,681.55	107,548,839.58	128,594,953.73		2,398,441,556.01
公允价值变动收益	-123,628,975.68	60,856,934.80	-101,792,811.48	1,097,931,337.77	-106,966,475.22		826,400,010.19
其他收入	736,272,468.46	2,297,305,695.46	221,716,369.34	15,442,143.16	267,155,141.75		3,537,891,818.17
二、营业支出	2,734,603,892.75	3,057,209,124.40	716,993,558.87	155,522,589.17	2,190,613,328.72		8,854,942,493.91
三、营业利润	2,097,652,835.46	1,648,256,839.97	510,567,795.62	1,128,232,084.58	-1,089,982,827.24		4,294,726,728.39
四、资产总额	161,217,070,559.80	106,816,838,513.93	14,368,240,924.31	9,377,478,447.97	27,320,601,650.22	114,410,465,225.45	204,689,764,870.78
五、负债总额	147,989,514,801.54	82,372,752,468.32	8,355,216,016.69	2,676,638,313.00	22,757,179,247.59	96,621,301,016.85	167,529,999,830.29
六、补充信息							
1、折旧和摊销费用	154,926,907.55	107,575,649.13	39,738,341.26	25,044,670.58	121,511,487.30		448,797,055.82
2、资本性支出	169,192,900.54	2,264,836,424.63	29,136,996.51	7,619,286.42	26,485,924.05		2,497,271,532.15

④上期报告分部（按地区）

单位：元 币种：人民币

项目	公司本部	山东省	上海市	广东省	其他地区	分部间抵销	合计
一、营业收入	4,638,899,958.78	3,409,300,428.91	1,088,179,920.08	183,753,082.17	1,032,090,629.90		10,352,224,019.84
手续费及佣金净收入	1,695,308,532.46	2,128,526,974.89	557,194,880.66	92,960,282.99	719,998,907.05		5,193,989,578.05
投资收益	1,302,224,387.29	-69,468,579.09	156,339,575.18	144,772,833.69	126,575,411.01		1,660,443,628.08
公允价值变动收益	489,694,878.26	-113,430,942.63	90,693,102.90	-53,341,024.03	14,776,050.74		428,392,065.24
其他收入	1,151,672,160.77	1,463,672,975.74	283,952,361.34	-639,010.48	170,740,261.10		3,069,398,748.47
二、营业支出	2,929,161,540.34	2,055,690,243.77	554,601,717.85	162,044,522.74	1,333,958,756.71		7,035,456,781.41
三、营业利润	1,709,738,418.44	1,353,610,185.14	533,578,202.23	21,708,559.43	-301,868,126.81		3,316,767,238.43
四、资产总额	143,196,790,438.46	89,360,267,962.19	10,030,446,144.59	7,105,782,702.32	24,876,625,296.95	100,060,352,128.81	174,509,560,415.70
五、负债总额	132,092,518,523.01	65,314,599,555.28	5,162,892,335.05	2,391,804,251.12	20,806,225,868.61	85,688,227,366.12	140,079,813,166.95
六、补充信息							
1、折旧和摊销费用	144,559,638.67	30,788,589.06	12,525,128.87	4,403,467.32	36,385,764.35		228,662,588.27
2、资本性支出	150,511,191.34	23,924,493.55	13,245,135.66	6,238,045.13	16,198,953.72		210,117,819.40

(3). 公司无报告分部的，或者不能披露各报告分部的资产总额和负债总额的，应说明原因

适用 不适用

(4). 其他说明

适用 不适用

7、 租赁

适用 不适用

8、 期末发行在外的、可转换为股份的金融工具

适用 不适用

9、 以公允价值计量的资产和负债

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

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(不 含衍生金融资产)	46,526,715,197.97	889,540,975.51			53,385,599,334.16
2、衍生金融资产	270,143,072.50	-61,154,139.72			430,613,618.22
3、其他债权投资	17,759,974,678.54		98,620,632.87	4,558,389.15	20,806,019,158.84
4、其他权益工具投资	5,964,824,777.85		65,930,684.95		3,249,721,525.98
金融资产小计	70,521,657,726.86	828,386,835.79	164,551,317.82	4,558,389.15	77,871,953,637.20
投资性房地产					
生产性生物资产					
其他					
上述合计	70,521,657,726.86	828,386,835.79	164,551,317.82	4,558,389.15	77,871,953,637.20
金融负债	328,197,911.12	-1,986,825.60			421,718,380.46



10、金融工具项目计量基础分类表

(1). 金融资产计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值						
金融资产项目	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	46,090,288,079.05					
结算备付金	11,097,890,604.20					
融出资金	35,821,147,194.79					
交易性金融资产				53,385,599,334.16		
存出保证金	10,284,255,949.87					
衍生金融资产				430,613,618.22		
买入返售金融资产	12,474,745,640.83					
应收款项	1,572,351,957.16					
其他债权投资		20,806,019,158.84				
其他权益工具投资			3,249,721,525.98			
债权投资	2,197,335,613.93					
其他金融资产	227,205,623.47					
合计	119,765,220,663.30	20,806,019,158.84	3,249,721,525.98	53,816,212,952.38		
期初账面价值						
金融资产项目	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	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	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其

			资	金融资产	其变动计入当期损益的金融资产	变动计入当期损益的金融资产
货币资金	36,651,600,637.15					
结算备付金	8,827,027,434.56					
融出资金	31,206,744,639.54					
交易性金融资产				46,526,715,197.97		
存出保证金	8,982,591,206.22					
衍生金融资产				270,143,072.50		
买入返售金融资产	9,160,815,458.42					
应收款项	1,008,821,124.39					
其他债权投资		17,759,974,678.54				
其他权益工具投资			5,964,824,777.85			
债权投资	3,732,092,907.91					
其他金融资产	594,550,799.23					
合计	100,164,244,207.42	17,759,974,678.54	5,964,824,777.85	46,796,858,270.47		

## (2). 金融负债计量基础分类表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

期末账面价值				
金融负债项目	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
交易性金融负债		54,450,766.68		
衍生金融负债		367,267,613.78		
应付债券	43,525,535,155.58			
应付短期融资款	12,910,778,536.39			
拆入资金	2,785,248,841.87			
卖出回购金融资产款	36,995,348,838.82			
代理买卖证券款	56,213,164,519.52			
代理承销证券款	5,650,010.43			
应付款项	3,415,541,309.95			
长期借款	301,076,695.50			
短期借款	4,245,356,203.37			
租赁负债	653,224,021.22			
其他金融负债	1,853,316,567.38			
合计	162,904,240,700.03	421,718,380.46		
期初账面价值				
金融负债项目	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
交易性金融负债		8,014,669.01		
衍生金融负债		320,183,242.11		
应付债券	32,805,189,719.93			
应付短期融资款	11,604,103,001.41			
拆入资金	2,038,836,747.11			
卖出回购金融资产款	31,603,737,261.85			
代理买卖证券款	44,434,372,998.58			
代理承销证券款	2,963,337.06			
应付款项	1,911,785,575.07			
长期借款	324,594,588.81			
短期借款	4,622,149,402.73			
其他金融负债	6,716,884,970.16			
合计	136,064,617,602.71	328,197,911.12		

## 11、外币金融资产和金融负债

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

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	3,610,682,399.38	-101,667,333.49			2,682,005,681.80
2、衍生金融资产	3,273,962.77	-923,714.24			1,685,414.15
3、贷款和应收款	1,864,670,398.36			58,704,439.87	1,967,965,389.06
4、其他债权投资			-6,813,169.74	197,446.97	1,197,132,869.36
5、其他权益工具投资	62,449,688.00		61,237,279.81		156,089,651.20
6、债权投资	3,732,092,907.91			767,558,905.88	2,197,335,613.93
金融资产小计	9,273,169,356.42	-102,591,047.73	54,424,110.07	826,460,792.72	8,202,214,619.50
金融负债	10,596,953,914.16	-21,507.38			9,058,481,988.86

## 12、其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

□适用 √不适用

## 13、其他

√适用 □不适用

(1) 本公司涉案金额在 5,000 万元以上的重要未决诉讼或仲裁事项如下：

①2021 年度前发生的未决诉讼、仲裁案件报告期内的进展情况（不含中泰资管代资管产品提起的诉讼）

A. 林某某股权回购合同纠纷仲裁案。林某某与公司签订《股票质押式回购交易业务协议》《股票质押式回购交易协议书（两方）》合约，协议到期后，林某某未履约足额偿还融资本金并付息，已构成违约。公司以林某某为被申请人提起仲裁，标的额 13,679.83 万元，请求判令：林某某支付融资本金、违约金，公司对被申请人质押股份享有优先受偿权，并就不足清偿部分以被申请人其他财产补足等。该案已取得仲裁裁决，正在执行过程中。

B. “15 华信债”公司债券兑付纠纷案。公司持有上海华信国际集团有限公司（以下简称“上海华信”）发行的“15 华信债”公司债券，后上海华信正常经营受到重大影响，无法按期偿付本次债券到期应付的本息，该债券发生实质性违约。公司以上海华信为被申请人提起仲裁，标的额 18,896.40 万元。请求判令被申请人向公司清偿债券本金及利息、被申请人向公司赔偿延期支付债券的经济损失等。该案已仲裁结案。上海华信已被法院裁定宣告破产，公司已向破产管理人申报债权，破产程序进行中。

C. 乌海洪远融资租赁合同纠纷案。宏润（上海）融资租赁有限公司（以下简称“上海宏润”）向乌海洪远新能源科技有限公司（以下简称“乌海洪远”）提供融资租赁业务，后因乌海洪远未能按时支付租金，构成违约。上海宏润以乌海洪远、神雾科技集团股份有限公司、北京华

福工程有限公司、吴某某为被告向法院提起诉讼，标的额 10,189.03 万元，请求判令：乌海洪远支付租金及延迟履行金，乌海洪远支付赔偿保全保险费，神雾科技集团股份有限公司、北京华福工程有限公司、吴某某对乌海洪远的上述付款义务承担连带清偿责任，乌海洪远支付应付未付律师费、案件受理费、保全费等（如适用）。后经法院调解，双方达成调解协议。但因被告未按调解协议履行义务，上海宏润向法院提起执行申请。另外，被执行人章程中约定的股东出资未完全到位，上海宏润已申请追加被执行人乌海洪远的股东乌海市富海资产管理有限公司（乌海市国资委下属全资子公司，简称“富海公司”）为被执行人，法院已受理相关申请。该案执行过程中，富海公司以上海宏润为被告提起执行异议之诉，请求判令不得追加富海公司为被执行人，一审诉讼请求被法院驳回后，富海公司提起上诉，二审诉讼请求被法院驳回，已申请恢复执行，后因乌海洪远新能源科技有限公司被申请破产清算而被终止执行。

D. 高源投资有限公司抵押保证融资案。高源投资有限公司将其一座房产抵押给中泰国际证券，作为对田某珍等五人所有应付给中泰国际任何成员的债务和负债的担保。后因保证金账户亏损，中泰国际证券要求五人就保证金账户的亏损自行偿还债务，标的额 15,306.03 万港元，请求判令：执行抵押协议以收回相关欠款等。中泰国际证券胜诉，后被告有异议又发起诉讼，现法院要求继续审理有争议部分。双方未能和解，香港特别行政区高等法院把案件管理会议押后。

E. 镇江兆和项目贷款违约纠纷案。中泰金融投资有限公司等向镇江兆和项目提供银团贷款，珠海市兆和投资有限公司为担保人，后借款人及担保人未能按时履行还款付息责任，导致该项目贷款违约。中泰金融投资有限公司以珠海市兆和投资有限公司为被告向法院提起诉讼，标的额 1,000.00 万美元，请求判令：被告偿还本金及利息等，该案已受理。

F. 皇月国际项目贷款违约纠纷案。优越理财向皇月国际有限公司（以下简称“皇月国际”）发放项目融资款，后皇月国际由于抵押品不足且未能及时足额补足抵押品，导致违约事件发生。此外，因中国金石矿业控股有限公司（简称“中国金石”）违反包销协议，皇月国际作为中国金石公开发售股份的包销商向其提出关于违反包销协议的损害赔偿。因此，优越理财向皇月国际及中国金石发出告票，标的额 6,705.00 万港元，请求判令：两被告支付借款本金及利息等。优越理财对皇月国际的诉讼已胜诉，对中国金石的诉讼尚未判决。

G. 大民种业股权投资纠纷案。大民种业股份有限公司（简称“大民种业”）实际控制人王某民、王某丽（合称“两被告”）违反了与中泰资本等签署的《增资及股权转让协议之股权购买协议》，且王某民、大民种业及其子公司因借款纠纷被法院判决败诉。相关行为构成违约且严重损害中泰资本的合法权益，中泰资本提起诉讼，标的额 6,693.37 万元。后因两被告未能按照调解协议履行义务，中泰资本已申请强制执行，请求判令：两被告回购中泰资本持有大民种业的股权、两被告向中泰资本付逾期付款利息等。该案已达成调解协议，目前已进入强制执行程序。

H. 国购投资公司债券交易纠纷案。公司系被告一国购投资有限公司发行的“18 国购 01、18 国购 02、18 国购 03、18 国购 04”公司债券的受托管理人，后被告一因账户被查封、现金流短缺等原因，无法按时偿付债券的本金和利息，构成违约。被告二国购产业控股有限公司、被告三华源物业发展有限责任公司为担保人。债券持有人授权公司提起诉讼，标的额 30,744.89 万元，请求判令：被告一向公司偿付债券本金、利息及逾期利息、被告二、被告三承担连带保证责任等。该公司已胜诉。根据法院民事裁定书，裁定批准国购投资等 43 家公司的重整计划，并终止国购投资等 43 家公司的重整程序，重整计划执行期限为 3 年，自《重整计划草案》经合肥中院裁定批准之日起算，监督期限与执行期限一致，现重整计划正在执行中。

②中泰资管作为管理人代资管计划提起的重要未决诉讼、仲裁案件进展

A. 安徽外经集团债券兑付纠纷案。中泰资管管理的产品持有“16 皖经 02”、“16 皖经 03”、16 皖经建 MTN001”公司债券及中期票据，安徽省外经建设（集团）有限公司（以下简称“安徽外经集团”）发生经营情况严重恶化、偿债能力严重不足、债券评级展望调整为负面等情况。中泰资管作为管理人代资管计划以安徽外经集团为被申请人申请仲裁，标的额分别为 6,771.20 万元、5,284.00 万元、5,244.00 万元，仲裁请求与安徽外经集团解除债券合同关系，并向中泰资管偿付本金、利息等。该案尚未判决。

B. 华阳经贸债权纠纷案。华阳经贸债权纠纷案。中泰资管管理的产品持有“15 华阳经贸 MTN001”中期票据，中国华阳经贸集团有限公司（以下简称“华阳经贸”）未按期支付相应利息及本金，中泰资管作为管理人代资管计划以华阳经贸为被申请人申请仲裁案件 2 起，标的额为分别为 1,052.40 万元、8,419.21 万元，仲裁请求裁决华阳经贸支付中期票据投资本金及投资利息并向中泰资管支付违约金等。目前法院裁定受理对华阳经贸的破产清算申请，破产案件正在审理过程中。

C. 海航财务债券质押式回购案。中泰资管与海航集团财务有限公司（以下简称“海航集团”）进行中国银行间市场债券质押式回购交易，并完成交易金额的支付。海航集团违约未支付到期结算金额。中泰资管作为管理人代资管计划以海航集团为被申请人申请仲裁案件 2 起，标的额分别为 3,422.27 万元、7,031.50 万元，仲裁请求裁决海航集团向中泰资管分别支付到期结算金额、补偿金额、罚息，准许实现质押权。仲裁案件已胜诉，后法院受理海航集团破产重整申请，目前在债权申报过程中。

D. 东旭光电债权纠纷案。中泰资管管理的产品持有 16 东旭光电 MTN001A、16 东旭光电 MTN002、16 东旭光电 MTN002、16 东旭光电 MTN001A、16 东旭光电 MTN002、16 东旭光电 MTN002、16 东旭光电 MTN001A、16 东旭光电 MTN002、16 东旭光电 MTN001A、16 东旭光电 MTN001A、16 东旭光电 MTN001A 中期票据。东旭光电科技股份有限公司（以下简称“东旭光电”）公告不能按期兑付中

期票据本金及利息。中泰资管作为管理人代资管计划以东旭光电为被申请人申请仲裁，标的额为 104,652.95 万元，仲裁请求东旭光电兑付中期票据本金、利息、违约金等。该案件尚未判决。

公司未持有相关资管计划份额，上述案件不会对报告期内发行人的生产经营和财务状况产生重大不利影响。

### ③公司 2021 年新增重要未决诉讼、仲裁

A. 福建福晟集团有限公司债券违约纠纷案。福建福晟集团有限公司（以下简称“福晟集团”）发行福晟集团 2018 年公司债券（第二期）（以下简称“18 福晟 03”）、福晟集团 2019 年公司债券（第一期）（以下简称“19 福晟 01”），公司担任受托管理人。因福晟集团违约，“18 福晟 03”债券持有人中信信托有限责任公司、国投泰康信托有限公司与“19 福晟 01”债券持有人中国对外经济贸易信托有限公司、国投泰康信托有限公司、三度星和（北京）投资有限公司授权公司以福晟集团为被申请人于 2021 年 2 月 10 日分别向上海仲裁委员会申请仲裁，标的额分别为 208,547,000 元、314,057,167.8 元（以仲裁申请书中暂计的各项请求金额为依据），2021 年 6 月 30 日，仲裁委员会裁决福晟集团支付“18 福晟 03”债券本金、利息、违约金、律师费、预缴的仲裁费。2021 年 6 月 28 日，仲裁委员会裁决福晟集团支付“19 福晟 01”债券本金、利息、违约金、保全费、保全担保费、律师费、预缴的仲裁费。2021 年 7 月 28 日，公司向福建省福州市中级人民法院申请强制执行。现均在执行过程中。

B. 刘某融资融券交易纠纷案。2015 年 6 月 3 日，公司与刘某签订《融资融券合同》及风险揭示书。2021 年 8 月 1 日，公司以刘某为被告向济南市中级人民法院提起诉讼，标的额 56,304,765.07 元（以诉状中暂计的各项请求金额为依据），请求判令刘某偿还欠款、逾期利息、诉讼费、保全费。2021 年 9 月 6 日，公司收到法院送达的（2021）鲁 01 民初 1553 号《受理案件通知书》。2021 年 12 月 30 日，公司收到济南市中级人民法院送达的（2021）鲁 01 民初 1553 号《民事判决书》，判决刘某支付公司融资融券欠款 36,139,130.34 元及逾期利息。2022 年 2 月 9 日，公司向济南市中级人民法院申请强制执行，现本案正在执行过程中。

C. 北京绵世方达投资有限责任公司股票质押式回购交易纠纷案。2017 年 12 月 4 日，公司与北京绵世方达投资有限责任公司（简称“北京方达投资”）签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议。因北京方达投资未按协议约定支付利息，2021 年 5 月 27 日，公司以北京方达投资为被告向济南市中级人民法院提起诉讼，标的额 363,719,183.05 元（以诉状中暂计的各项请求金额为依据），请求判令北京方达投资向公司支付融资本金、违约金、诉讼费、保全费、律师费等费用，并确认公司对北京方达投资提供质押的股票在全部债权范围内享有优先受偿权。2021 年 7 月 18 日，公司收回部分债权，2021 年 7 月 20 日，公司向法院申请变更诉讼请求，标的额变更为 334,527,630.79 元（以诉状中暂计的各项请求金额为依据）。2021 年 11 月 3 日，公司收到济南市中级人民法院送达的（2021）鲁 01 民初 1363 号《民事判决书》，判决北京方达投资支

付公司融资本金 308,091,337.77 元、违约金、律师代理费,确认公司对质押的股票享有质权。2022 年 2 月 9 日,公司向济南市中级人民法院申请强制执行。2022 年 3 月 9 日,公司收到济南市中级人民法院作出的《执行裁定书》,裁定拍卖、变卖北京方达投资持有的西水股份股票 62,897,971 股,现本案正在执行过程中。

(2) 2021 年 11 月 30 日,公司控股股东莱芜钢铁集团有限公司(以下简称“莱钢集团”)分别与枣庄矿业(集团)有限责任公司(以下简称“枣矿集团”)、山东高速投资控股有限公司(以下简称“高速投资”)签署协议,莱钢集团拟将其持有的 181,525.4297 万股股份转让至枣矿集团、将其持有的 37,074.0740 万股股份转让至高速投资;公司股东山东能源集团有限公司(以下简称“山能集团”)与枣矿集团签署协议,山能集团拟将其持有的公司 45,809.1900 万股无偿划转至枣矿集团。本次协议转让和本次无偿划转完成后,枣矿集团合计将持有公司 227,334.6200 万股股份(占公司总股本的 32.62%),与其一致行动人新汶矿业集团有限责任公司(以下简称“新矿集团”)合计持有公司 251,508.3500 万股股份(占公司总股本的 36.09%),莱钢集团将持有公司 104,529.3900 万股股份(占公司总股本的 15.00%),高速投资将持有公司 37,074.0700 万股股份(占公司总股本的 5.32%)。公司控股股东将由莱钢集团变更为枣矿集团。截至 2021 年 12 月 31 日,股东变动事项尚未获得中国证监会批复,公司控股股东仍为莱钢集团,公司实际控制人仍为山东省国资委。



十九、 母公司财务报表主要项目注释

1、 长期股权投资

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初余额	本期增减变动								期末余额	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		
一、对子公司投资											
鲁证期货	634,962,543.80									634,962,543.80	
中泰资本	1,996,000,000.00									1,996,000,000.00	
中泰金融国际	1,441,591,000.00	800,000,000.00								2,241,591,000.00	
中泰资管	100,000,000.00									100,000,000.00	
中泰物业	809,617,700.12									809,617,700.12	
中泰创投	2,720,000,000.00	1,240,000,000.00								3,960,000,000.00	
齐鲁股权		78,880,000.00							122,041,083.32	200,921,083.32	
小计	7,702,171,243.92	2,118,880,000.00							122,041,083.32	9,943,092,327.24	
二、联营企业											
万家基金管理有限公司	516,541,091.15			150,311,280.29		618,109.25	24,500,000.00			642,970,480.69	
齐鲁股权交易中心有限公司	116,357,830.06			5,683,253.26					-122,041,083.32		
小计	632,898,921.21			155,994,533.55		618,109.25	24,500,000.00		-122,041,083.32	642,970,480.69	
合计	8,335,070,165.13	2,118,880,000.00		155,994,533.55		618,109.25	24,500,000.00			10,586,062,807.93	

**2、 应付职工薪酬****(1). 应付职工薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、短期薪酬	1,810,811,105.06	3,324,256,939.06	3,224,844,212.51	1,910,223,831.61
二、离职后福利-设定提存计划	3,180,692.26	389,791,747.14	392,665,140.35	307,299.05
三、辞退福利	138,500,882.09	98,305,519.67	54,381,039.39	182,425,362.37
四、一年内到期的其他福利				
合计	1,952,492,679.41	3,812,354,205.87	3,671,890,392.25	2,092,956,493.03

**(2). 短期薪酬列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	1,459,112,299.05	2,935,982,403.78	2,827,565,318.86	1,567,529,383.97
二、职工福利费		55,957,903.74	55,957,903.74	
三、社会保险费	202,743.22	111,961,288.03	112,020,834.65	143,196.60
其中：医疗保险费	179,282.65	107,022,843.33	107,063,303.39	138,822.59
工伤保险费	23,460.57	2,205,061.29	2,224,147.85	4,374.01
生育保险费		2,733,383.41	2,733,383.41	
四、住房公积金	82,300.50	161,562,111.34	161,512,832.84	131,579.00
五、工会经费和职工教育经费	351,413,762.29	58,793,232.17	67,787,322.42	342,419,672.04
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
合计	1,810,811,105.06	3,324,256,939.06	3,224,844,212.51	1,910,223,831.61

**(3). 设定提存计划列示**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
1、基本养老保险	3,155,118.31	200,118,906.51	202,977,322.40	296,702.42
2、失业保险费	25,573.95	7,677,304.57	7,692,281.89	10,596.63
3、企业年金缴费		181,995,536.06	181,995,536.06	
合计	3,180,692.26	389,791,747.14	392,665,140.35	307,299.05

其他说明：

√适用 □不适用

**(4). 辞退福利**

单位：元 币种：人民币

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
----	------	------	------	------

辞退福利	138,500,882.09	98,305,519.67	54,381,039.39	182,425,362.37
合计	138,500,882.09	98,305,519.67	54,381,039.39	182,425,362.37

### 3、利息净收入

√适用 □不适用

单位：元币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	4,314,808,186.08	4,069,899,450.46
其中：货币资金及结算备付金利息收入	820,561,985.93	818,796,041.17
拆出资金利息收入		
融出资金利息收入	2,244,469,060.66	1,876,359,697.95
买入返售金融资产利息收入	435,533,856.96	664,719,151.93
其中：约定购回利息收入		
股权质押回购利息收入	329,904,193.47	615,799,460.52
债权投资利息收入		
其他债权投资利息收入	807,047,957.48	707,156,629.10
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	6,306,263.95	2,867,930.31
其他利息收入	889,061.10	
利息支出	2,981,138,920.86	2,431,702,625.51
其中：短期借款利息支出		
应付短期融资款利息支出	399,094,205.29	63,606,038.99
拆入资金利息支出	121,017,665.77	99,140,027.96
其中：转融通利息支出	120,941,110.22	98,405,666.85
卖出回购金融资产利息支出	842,497,156.42	703,032,650.34
其中：报价回购利息支出	11,885,053.19	6,600,284.98
代理买卖证券款利息支出	133,323,629.43	125,077,897.97
长期借款利息支出		
应付债券利息支出	1,458,287,184.60	1,428,877,401.18
其中：次级债券利息支出	705,709,677.61	415,485,011.60
租赁负债利息支出	22,244,574.14	
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出		
其他利息支出	4,674,505.21	11,968,609.07
利息净收入	1,333,669,265.22	1,638,196,824.95

### 4、手续费及佣金净收入

#### (1). 手续费及佣金净收入情况

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
1. 证券经纪业务净收入	4,034,510,138.18	3,466,048,282.34
证券经纪业务收入	5,634,450,971.80	4,880,267,679.64
其中：代理买卖证券业务	4,380,894,630.75	4,023,243,904.74
交易单元席位租赁	780,266,707.95	577,146,613.32
代销金融产品业务	473,289,633.10	279,877,161.58
证券经纪业务支出	1,599,940,833.62	1,414,219,397.30
其中：代理买卖证券业务	1,474,107,196.29	1,324,237,703.60

交易单元席位租赁	124,126,966.01	87,983,184.73
代销金融产品业务	1,706,671.32	1,998,508.97
2. 期货经纪业务净收入		
期货经纪业务收入		
期货经纪业务支出		
3. 投资银行业务净收入	1,208,078,918.68	962,133,210.59
投资银行业务收入	1,228,861,997.22	975,705,348.99
其中：证券承销业务	1,065,262,402.53	799,918,052.28
证券保荐业务	36,340,377.36	16,179,245.35
财务顾问业务	127,259,217.33	159,608,051.36
投资银行业务支出	20,783,078.54	13,572,138.40
其中：证券承销业务	18,290,013.59	9,553,452.31
证券保荐业务	632,075.48	3,594,157.80
财务顾问业务	1,860,989.47	424,528.29
4. 资产管理业务净收入		
资产管理业务收入		
资产管理业务支出		
5. 基金管理业务净收入		
基金管理业务收入		
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	173,663,156.28	107,460,691.41
投资咨询业务收入	173,663,156.28	107,461,425.37
投资咨询业务支出		733.96
7. 其他手续费及佣金净收入	-9,116,314.26	18,519,989.87
其他手续费及佣金收入	18,241.75	38,981,334.54
其他手续费及佣金支出	9,134,556.01	20,461,344.67
合计	5,407,135,898.88	4,554,162,174.21
其中：手续费及佣金收入	7,036,994,367.05	6,002,415,788.54
手续费及佣金支出	1,629,858,468.17	1,448,253,614.33

(2). 财务顾问业务净收入

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司	5,481,132.08	31,452,830.19
并购重组财务顾问业务净收入—其他		
其他财务顾问业务净收入	119,917,095.78	127,730,692.88

(3). 代理销售金融产品业务

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

代销金融产品业务	本期		上期	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	365,146,643,365.72	445,787,119.26	210,141,877,990.80	233,137,130.57
其他	28,351,220,841.27	27,502,513.84	13,222,525,072.00	46,740,031.01
合计	393,497,864,206.99	473,289,633.10	223,364,403,062.80	279,877,161.58

**(4). 资产管理业务**

□适用 √不适用

手续费及佣金净收入的说明：

□适用 √不适用

**5、 投资收益****(1). 投资收益情况**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益	217,358,047.60	
权益法核算的长期股权投资收益	155,994,533.55	116,520,429.09
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	1,829,580,176.81	1,186,318,750.91
其中：持有期间取得的收益	1,430,844,189.02	942,400,506.11
— 交易性金融工具	1,061,266,258.91	844,923,194.65
— 其他权益工具投资	369,577,930.11	97,477,311.46
— 衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	398,735,987.79	243,918,244.80
— 交易性金融工具	215,581,780.31	140,109,383.68
— 其他债权投资	53,021,121.08	113,636,738.69
— 债权投资		
— 衍生金融工具	130,133,086.40	-9,827,877.57
其他		
合计	2,202,932,757.96	1,302,839,180.00

**(2). 交易性金融工具投资收益明细表**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
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	1,061,266,258.91	847,256,529.76
	处置取得收益	215,581,780.31	122,346,831.40
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		-2,333,335.11
	处置取得收益		17,762,552.28

**6、 公允价值变动收益**

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	101,417,377.67	449,833,783.07
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		-23,207,610.00
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		

衍生金融工具	-58,294,233.53	41,910,566.14
其他		
合计	43,123,144.14	468,536,739.21

## 7、 业务及管理费

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	3,812,354,205.87	3,436,093,363.28
折旧费	266,609,758.09	83,004,121.91
交易所会员年费	200,872,117.81	136,914,938.50
租赁费	126,437,258.71	318,015,339.78
咨询信息费	79,765,895.09	82,548,032.37
电子设备运转费	75,575,102.63	117,031,608.37
差旅费	71,214,672.14	49,294,851.83
投资者保护基金	64,785,494.71	34,282,472.57
无形资产摊销	60,321,112.55	57,231,644.35
交易所设施使用费	59,335,996.49	53,088,300.75
业务招待费	59,264,659.68	47,239,691.38
通讯费	45,656,181.53	44,442,402.51
广告费	35,815,190.50	43,017,033.52
长期待摊费用摊销	27,432,498.37	31,921,968.03
其他	279,242,489.64	229,747,772.21
合计	5,264,682,633.81	4,763,873,541.36

## 8、 其他

□适用 √不适用

## 二十、 补充资料

### 1、 当期非经常性损益明细表

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益	49,277,965.58	
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）	64,605,584.31	
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益	3,906,468.72	
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回	5,366,766.42	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	3,759,626.68	
其他符合非经常性损益定义的损益项目	17,528,590.21	
减：所得税影响额	35,586,072.82	
少数股东权益影响额	13,744,471.33	
合计	95,114,457.77	

对公司根据《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》定义界定的非经常性损益项目，以及把《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的项目，应说明原因。

适用 不适用

由于交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债、债权投资和其他债权投资属于本公司正常自营业务，因此公司根据自身正常经营业务的性质和特点，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（2008）》中列举的非经常性损益项目持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债、债权投资和其他债权投资取得的投资收益，界定为经常性损益项目。

## 2、净资产收益率及每股收益

适用 不适用

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	9.25	0.46	0.46
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	8.97	0.45	0.45

## 3、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

## 4、其他

适用 不适用

董事长：李峰

董事会批准报送日期：2022 年 3 月 29 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

行政许可批复时间	行政许可批复名称	行政许可批复文号
2021 年 2 月 8 日	中国证券监督管理委员会《关于中泰证券股份有限公司向中泰金融国际有限公司增资有关意见的复函》	机构部函〔2021〕446 号
2021 年 6 月 2 日	中国证券监督管理委员会《关于中泰证券股份有限公司试点开展基金投资顾问业务有关事项的复函》	机构部函〔2021〕1685 号
2021 年 9 月 6 日	中国证券监督管理委员会《关于同意中泰证券股份有限公司向专业投资者公开发行次级公司债券注册的批复》	证监许可〔2021〕2925 号
2021 年 12 月 16 日	中国证券监督管理委员会《关于中泰证券股份有限公司申请开展国债期货做市业务的监管意见书》	机构部函〔2021〕4028 号

## 二、 监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

2019 年、2020 年、2021 年公司分类评价等级分别为 A 类 A 级、A 类 AA 级和 A 类 A 级。