



西南证券股份有限公司2021年年度报告



西南证券
SOUTHWEST SECURITIES

用心创造价值·专业成就梦想

公司代码：600369

公司简称：西南证券

西南证券股份有限公司 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、天健会计师事务所（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、公司负责人吴坚、主管会计工作负责人吴坚及会计机构负责人（会计主管人员）叶平声明：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

公司2021年度利润分配预案为：以公司截至2021年末总股本6,645,109,124股为基数，向全体股东每10股派发现金红利0.80元（含税），实际分配现金利润为531,608,729.92元，占本年度归属于母公司股东净利润的比重为51.21%，本次分配后剩余未分配利润结转至下一年度。本预案尚需提交股东大会审议。

六、前瞻性陈述的风险声明

适用 不适用

本年度报告中涉及的未来计划、发展战略等前瞻性陈述，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

公司已在本年度报告中详述经营活动可能遇到的风险，具体参见“第三节管理层讨论与分析”中“六、公司关于公司未来发展的讨论与分析”之“（四）可能面对的风险”部分。

十一、其他

适用 不适用

目录

第一节	释义.....	4
第二节	公司简介和主要财务指标.....	5
第三节	管理层讨论与分析.....	19
第四节	公司治理.....	47
第五节	环境与社会责任.....	63
第六节	重要事项.....	65
第七节	股份变动及股东情况.....	79
第八节	优先股相关情况.....	84
第九节	债券相关情况.....	85
第十节	财务报告.....	91
第十一节	证券公司信息披露.....	214

备查文件目录	载有公司法定代表人签字和公司盖章的公司2021年年度报告全文文本
	载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的公司2021年年度财务报表
	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
	报告期内在中国证监会指定网站上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿
	其他有关资料

第一节 释义

一、释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义		
西南证券、本公司、公司、母公司	指	西南证券股份有限公司
西南有限	指	原西南证券有限责任公司
*ST 长运	指	原重庆长江水运股份有限公司
重庆渝富	指	重庆渝富资本运营集团有限公司
重庆城投	指	重庆市城市建设投资（集团）有限公司
重庆发展	指	重庆发展投资有限公司
重庆地产	指	重庆市地产集团有限公司
银华基金	指	银华基金管理股份有限公司
西证投资	指	西证股权投资有限公司
西证创新	指	西证创新投资有限公司
西证国际	指	西证国际投资有限公司
西证国际证券	指	西证国际证券股份有限公司
西南期货	指	西南期货有限公司
重庆股份转让中心	指	重庆股份转让中心有限责任公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
重庆市国资委	指	重庆市国有资产监督管理委员会
公司选定信息披露媒体	指	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及上海证券交易所网站（ http://www.sse.com.cn ）

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	西南证券股份有限公司
公司的中文简称	西南证券
公司的外文名称	Southwest Securities Co., Ltd.
公司的外文名称缩写	SWSC
公司的法定代表人	吴坚
公司总经理	吴坚

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	6,645,109,124.00	6,645,109,124.00
净资产	15,882,718,611.51	18,902,596,160.42

公司的各单项业务资格情况

√适用 □不适用

1. 证券经纪业务资格
2. 证券承销与保荐资格
3. 证券资产管理业务资格
4. 证券自营业务资格
5. 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问资格
6. 证券投资咨询资格
7. 证券投资基金代销资格
8. 融资融券业务资格
9. 代销金融产品业务资格
10. 保险资金受托管理业务资格
11. 股票质押式回购业务资格
12. 为期货公司提供中间介绍业务资格
13. 直接投资业务资格
14. 全国中小企业股份转让系统主办券商推荐业务和经纪业务资格
15. 中小企业私募债券承销业务试点资格
16. 证券经纪人制度实施资格
17. 外币有价证券经纪业务资格
18. 网上证券委托业务资格
19. 公司自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格
20. 公司资产管理业务参与股指期货交易资格

21. 债券质押式报价回购业务资格
22. 约定购回式证券交易业务资格
23. 开放式证券投资基金代销业务资格
24. 转融通业务资格
25. 新股网下询价业务资格
26. 利率互换交易资格
27. 上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格
28. 全国银行间同业拆借市场从事同业拆借业务资格
29. 向保险机构投资者提供交易单元资格
30. 代理证券质押登记业务资格
31. 全国中小企业股份转让系统做市商业务资格
32. 沪港通下港股通业务资格
33. 深港通下港股通业务资格
34. 柜台市场业务试点资格
35. 私募基金综合托管业务试点资格
36. 互联网证券业务试点资格
37. 股票期权经纪业务、自营业务及做市业务资格
38. 期权结算业务资格
39. 客户资金消费支付服务资格
40. 上市公司股权激励行权融资业务试点资格
41. 中国证券登记结算有限责任公司乙类结算参与者资格
42. 创业板转融券业务资格
43. 科创板转融券业务资格
44. 上海票据交易所中国票据交易系统交易成员资格
45. 场外期权业务二级交易商资格

公司还拥有上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、中国证券业协会、中国银行间市场交易商协会、中国证券投资基金业协会、中国期货业协会以及重庆股份转让中心的会员资格，亦具有中国国债协会理事级会员资格。

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	李军	刘瑞
联系地址	重庆市江北区金沙门路 32 号 西南证券总部大楼	重庆市江北区金沙门路 32 号 西南证券总部大楼
电话	023-63786433	023-63786433

传真	023-63786001	023-63786001
电子信箱	ljun@swsc.com.cn	liurui@swsc.com.cn

三、基本情况简介

公司注册地址	重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼
公司注册地址的历史变更情况	1. 公司于2011年2月9日完成同城搬迁，注册地址变更为重庆市江北区桥北苑8号西南证券总部大厦（2011年3月25日至2022年1月11日） 2. 公司于2021年12月27日完成同城搬迁，注册地址变更为重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼（2022年1月11日至今）
公司办公地址	重庆市江北区金沙门路32号，西南证券总部大楼
公司办公地址的邮政编码	400025
公司网址	http://www.swsc.com.cn
电子信箱	dshb@swsc.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、上海证券报、证券时报
公司披露年度报告的证券交易所网站	http://www.sse.com.cn
公司年度报告备置地点	重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼， 公司董事会办公室

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	西南证券	600369	*ST长运

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

西南证券系经中国证监会批准，通过*ST长运重大资产重组及吸收合并西南有限，并依法承继西南有限的各项证券业务资格设立的全国第9家上市证券公司。

西南有限是1999年12月28日经中国证监会证监机构字[1999]32号文、证监机构字[1999]114号文和证监机构字[1999]159号文批复，以原重庆国际信托投资有限公司证券部、原重庆市证券公司、原重庆有价证券公司和原重庆证券登记有限责任公司的全部净资产为基础，联合其他股东（均以现金出资）共同发起设立的有限责任公司。西南有限设立时注册资本为112,820.99万元。

2002年11月14日，经中国证监会证监机构字[2002]332号文批复，西南有限实施增资扩股，注册资本增至163,043.12万元。

2006年8月7日，经中国证监会证监机构字[2006]185号文批复，西南有限于2006年8月实施减资，股东和持股比例不变，注册资本由163,043.12万元减至81,521.56万元。

2006年10月23日，经中国证监会证监机构字[2006]250号文批复，西南有限实施增资扩股，注册资本由81,521.56万元增至233,661.56万元。

2009年2月，经中国证监会证监许可[2009]62号文批复，*ST长运重大资产重组并以新增1,658,997,062股人民币普通股吸收合并西南有限，并依法承继西南有限的各项证券业务资格。公司名称变更为“西南证券股份有限公司”，注册资本变更为190,385.46万元。公司证券简称由“*ST长运”变更为“西南证券”，证券代码为600369。

2010年5月21日，经中国证监会证监许可[2010]673号文核准，公司非公开发行人民币普通股41,870万股，并于2010年8月30日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成新增股份的登记托管手续，公司总股本（注册资本）增至2,322,554,562股（元）。

2013年12月6日，经中国证监会证监许可[2013]1533号文核准，公司非公开发行人民币普通股50,000万股，并于2014年2月24日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成新增股份的登记托管手续，公司总股本（注册资本）增至2,822,554,562股（元）。

2015年9月，根据公司2015年第四次临时股东大会通过的《关于公司2015年半年度利润分配及资本公积金转增股本预案的议案》，公司以资本公积金向全体股东每10股转增10股，总股本相应增至5,645,109,124股，并于2015年9月30日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成转增股份的登记托管手续，公司注册资本相应变更为5,645,109,124元。

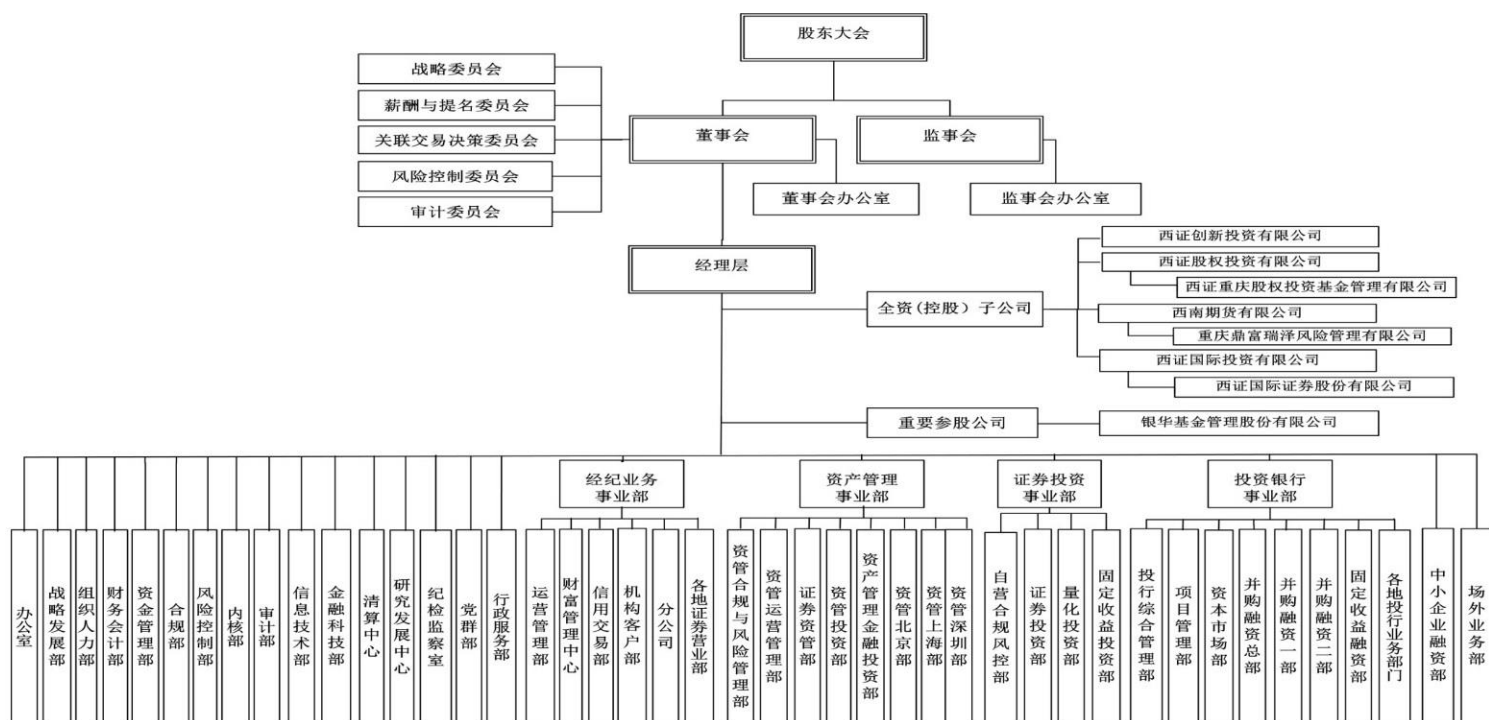
2020年6月7日，中国证监会证监许可[2020]1090号文件核准公司非公开发行不超过10亿股新股，公司于2020年7月22日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司完成新增10亿股股份的登记托管手续，公司总股本（注册资本）相应变更为6,645,109,124股（元）。

（二）公司组织机构情况

√适用 □不适用

公司遵循《公司法》《证券法》《证券公司内部控制指引》，中国证监会有关规章制度及《公司章程》的规定，规范运作，构建了科学有效的法人治理结构，建立了符合公司发展需要的组织构架和运行机制。

公司组织机构图如下：



(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，公司共拥有 83 家证券营业部（详见下表）。在区域分布上，公司在重庆地区有 42 家证券营业部（对重庆区县实现全覆盖），其余 41 家证券营业部分布于北京、上海、广东、山东、山西、安徽、福建、河北、河南、湖北、湖南、内蒙古、四川、江苏、宁夏、云南、浙江、陕西等全国 18 个省、直辖市及自治区。

序号	省份	证券营业部名称	运营状态
1	重庆	重庆总部证券营业部	运营中
2		重庆嘉陵桥西村证券营业部	运营中
3		重庆大石坝七村证券营业部	运营中
4		重庆渝碚路证券营业部	运营中
5		重庆惠工路证券营业部	运营中
6		重庆杨家坪正街证券营业部	运营中
7		重庆春晖路证券营业部	运营中
8		重庆北碚证券营业部	运营中
9		重庆金渝大道证券营业部	运营中
10		重庆南川证券营业部	运营中
11		重庆万州高笋塘证券营业部	运营中
12		重庆涪陵滨江路证券营业部	运营中
13		重庆长寿证券营业部	运营中
14		重庆潼南证券营业部	运营中
15		重庆荣昌证券营业部	运营中

16		重庆垫江证券营业部	运营中
17		重庆合川希尔安大道证券营业部	运营中
18		重庆黄山大道证券营业部	运营中
19		重庆秀山证券营业部	运营中
20		重庆万盛大道证券营业部	运营中
21		重庆开州证券营业部	运营中
22		重庆永川证券营业部	运营中
23		重庆江津江州大道证券营业部	运营中
24		重庆巴南证券营业部	运营中
25		重庆大足证券营业部	运营中
26		重庆璧山证券营业部	运营中
27		重庆武隆建设东路证券营业部	运营中
28		重庆铜梁证券营业部	运营中
29		重庆忠县证券营业部	运营中
30		重庆丰都证券营业部	运营中
31		重庆黔江证券营业部	运营中
32		重庆酉阳证券营业部	运营中
33		重庆綦江证券营业部	运营中
34		重庆奉节永安路证券营业部	运营中
35		重庆梁平证券营业部	运营中
36		重庆云阳云江大道证券营业部	运营中
37		重庆石柱证券营业部	运营中
38		重庆彭水证券营业部	运营中
39		重庆巫山证券营业部	运营中
40		重庆巫溪证券营业部	运营中
41		重庆城口证券营业部	运营中
42		重庆余溪路证券营业部	运营中
43		北京北三环中路证券营业部	运营中
44		北京丽泽路证券营业部	运营中
45	北京	北京昌平证券营业部	运营中
46		北京房山证券营业部	运营中
47		北京平谷证券营业部	运营中
48		上海普陀区宜君路证券营业部	运营中
49	上海	上海田林东路证券营业部	运营中
50		上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部	运营中
51		深圳滨河大道证券营业部	运营中
52	广东	深圳深南大道证券营业部	运营中
53		杭州庆春东路证券营业部	撤销中
54		温州汤家桥路证券营业部	运营中
55		金华八一南街证券营业部	运营中
56	浙江	绍兴延安东路证券营业部	运营中
57		义乌香山路证券营业部	运营中
58		宁波杭州湾新区滨海二路证券营业部	运营中

59		台州市府大道证券营业部	运营中
60	江苏	徐州二环西路证券营业部	运营中
61		常熟海虞北路证券营业部	撤销中
62		无锡青山西路证券营业部	运营中
63	福建	龙岩西陂路证券营业部	运营中
64	山东	淄博柳泉路证券营业部	运营中
65	河北	唐山友谊路证券营业部	运营中
66	河南	安阳商都路证券营业部	运营中
67		洛阳西苑路证券营业部	运营中
68	湖北	荆州北京路证券营业部	运营中
69	湖南	浏阳环府路证券营业部	运营中
70		岳阳通海南路证券营业部	运营中
71	山西	运城学苑路证券营业部	运营中
72		大同永和路证券营业部	运营中
73	四川	成都红星路证券营业部	运营中
74		攀枝花机场路证券营业部	运营中
75		德阳泰山南路证券营业部	运营中
76		绵阳安昌路证券营业部	运营中
77		乐山人民北路证券营业部	运营中
78	云南	曲靖麒麟南路证券营业部	运营中
79		大理云岭大道证券营业部	运营中
80	陕西	西安高新路证券营业部	撤销中
81	安徽	马鞍山花雨路证券营业部	运营中
82	宁夏	吴忠裕民东街证券营业部	运营中
83	内蒙古	包头金融广场证券营业部	运营中

(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，公司共拥有 37 家分公司（详见下表），分布于重庆、北京、天津、上海、广东、广西、浙江、江西、江苏、福建、山东、河北、河南、湖北、湖南、山西、四川、云南、贵州、陕西、甘肃、安徽、青海、辽宁、吉林、黑龙江、宁夏、内蒙古和新疆等全国 29 个省、直辖市及自治区。

序号	分公司名称	地址	设立时间	负责人	联系电话	运营状态
1	重庆第一分公司	重庆市璧山区璧泉街道双星大道 50 号 3 幢 5-1、5-2	20160115	陈鹏	023-41410475	运营中
2	重庆第二分公司	重庆市万州区高笋塘 85 号(三峡水利大厦)6 楼	20160118	刘文棋	023-58660715	运营中
3	重庆第三分公司	重庆市渝中区沧白路 19 号	20000126	王文胜	023-63835018	运营中
4	重庆第四分公司	重庆市江北区鹅子丘路 62 号 1 幢 5-1 至 5-26	20000126	毛亚娜	023-67732888	运营中
5	北京分公司	北京市西城区北三环中路 27 号四层 427	20091119	谢海龙	010-62051038	运营中

6	上海分公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路 166 号一楼北侧大堂	20160113	王伟	021-50755280	运营中
7	深圳分公司	深圳市福田区沙头街道天安社区深南大道 6023 号耀华创建大厦 4 层 401A1	20160115	熊晓强	0755-23601942	运营中
8	浙江分公司	杭州市江干区紫晶商务城 1 幢 304-1 室	20160119	米兵	0571-86784069	运营中
9	四川分公司	成都市高新区天府大道北段 1480 号 8 栋 2 单元 6 层 1 号	20010222	杨道宏	028-87670355	运营中
10	西北分公司	西安市高新区丈八街办高新路 51 号高新大厦五层南户	20160111	高明星	029-88827576	运营中
11	山西分公司	太原市高新区长治路 306 号火炬创业大厦 C 座 17 层	20031110	王瑾	0351-7825383	运营中
12	山东分公司	济南市历下区黑虎泉西路 183 号	20010416	卢红伟	0531-86075959	运营中
13	湖南分公司	长沙市雨花区芙蓉中路三段 569 号陆都小区湖南商会大厦 28 楼	20100126	何起宏	0731-88225801	运营中
14	湖北分公司	武昌区中北路 31 号办公大楼（2009-093）18 楼西侧部分	20100315	万少智	027-59730108	运营中
15	河北分公司	保定市竞秀区朝阳北大街 582 号	20100316	郝丽维	0312-3190399	运营中
16	云南分公司	云南省昆明市北京路 1079 号欣都龙城 A1 栋 17 楼	20010314	胡洪	0871-65135388	运营中
17	新疆分公司	新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 416 号盈科国际中心五层 1-2 号	20160113	周柯	0991-3639888	运营中
18	天津分公司	天津市和平区福安大街和平园 1-8 门二层商 4、商 5	20140113	马力	022-23456377	运营中
19	苏州分公司	苏州工业园区苏州大道西 119 号苏悦商贸广场 1 幢 601-2003 室	20130819	储友余	0512-65980903	运营中
20	石家庄分公司	河北省石家庄市桥西区站前街 8 号金创大厦（原华联商厦）一层 B 区	20210601	张智慧	0311-68025618	运营中
21	沈阳分公司	辽宁省沈阳市大东区东望街 20-10 号（18 门）	20141124	张楠	024-86104145	运营中
22	青海分公司	西宁市城西区五四大街 33 号五四百货大楼 9 层	20130605	孙茜蓉	0971-8299755	运营中
23	青岛分公司	山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号山东高速大厦 1501-1504	20191018	隋晓娟	0532-55795088	运营中
24	宁夏分公司	宁夏银川市兴庆区银川国际贸易中心 B 栋 11 层 C01、C02、C03 室	20140312	许宁庆	0951-5137028	运营中
25	内蒙古分公司	内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区呼伦贝尔南路 119 号东达城市广场商务写字楼 14 层 1402	20141201	贾宇耕	0471-5201918	运营中
26	江西分公司	江西省南昌市红谷滩新区中央广场 B 区准甲办公楼 601-602 室（第 6 层）	20141106	姜文杰	0791-82096088	运营中
27	江苏分公司	南京市建邺区庐山路 168 号南京新地中心二期 2 层 D 区 D04 单元	20140326	熊贤德	025-86538309	运营中
28	吉林分公司	长春市南关区长春大街 1177 号中远大厦 A 座一楼门市	20131225	史宇龙	0431-81916577	运营中
29	黑龙江分公司	哈尔滨经开区南岗集中区红旗大街 270 号民防商务酒店一层	20140318	李昊	0451-82348369	运营中
30	河南分公司	河南自贸试验区郑州片区（郑东）商务外环路 8 号世博大厦 4 层 401-4 号	20140317	孙伟伟	0371-56559919	运营中
31	贵州分公司	贵州省贵阳市云岩区中山西路 58 号恒峰步行街 1 单元写字楼 16 层 1 号附 1 号	20141105	曾娟	0851-85855466	运营中
32	广州分公司	广州市越秀区天河路 3 号 401-404、411-412 房	20000920	张祥	020-87398582	运营中
33	广西分公司	南宁市青秀区中泰路 8 号天健·商务大厦 1203-1204 房	20141127	陈婷	0771-8018616	运营中
34	甘肃分公司	甘肃省兰州市城关区南昌路 562 号之 2 号 2 楼	20100121	张燕君	0931-8272332	运营中

35	福州分公司	福建省福州市鼓楼区井大路 113 号柒星佳寓 4 层 01 商业用房	20000126	林奕军	0591-87981133	运营中
36	大连分公司	辽宁省大连市西岗区长江路 593-6 号	20130922	张颖莉	0411-39940000	运营中
37	安徽分公司	合肥市蜀山区长江西路 189 号之心城 B 座写字楼 2204 室	20101220	王玫	0551-65226133	运营中

七、其他相关资料

公司聘请的会计师事务所（境内）	名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
	办公地址	浙江省杭州市江干区钱江路 1366 号华润大厦 B 座 31 楼
	签字会计师姓名	赵兴明、肖桂春
报告期内履行持续督导职责的保荐机构	名称	华福证券有限责任公司
	办公地址	福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层
	签字的保荐代表人姓名	陈灿雄、李伟
	持续督导的期间	2020 年 7 月 22 日至募集资金使用完毕

注：2021 年 2 月 5 日，华福证券原指派保荐代表人李伟先生因个人原因离职。为保障持续督导工作的连续性，华福证券委派沈羽珂先生接替李伟先生担任公司持续督导工作的保荐代表人，继续履行持续督导职责。有关内容详见 2021 年 2 月 6 日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于变更持续督导保荐代表人的公告》。

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	3,096,080,385.10	3,169,571,453.97	-2.32	3,488,837,437.18
归属于母公司股东的净利润	1,038,152,895.95	1,091,487,407.23	-4.89	1,042,001,454.67
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,003,226,332.35	1,087,991,582.99	-7.79	1,012,993,690.57
经营活动产生的现金流量净额	-157,191,967.69	-3,808,187,088.30	不适用	1,464,202,163.31
其他综合收益	-155,344,875.95	23,018,348.58	-774.87	142,704,447.24
	2021年末	2020年末	本期末比上年同期末增减 (%)	2019年末
资产总额	82,258,033,563.18	79,188,318,465.26	3.88	65,850,994,601.60
负债总额	56,975,519,750.63	54,108,953,622.67	5.30	46,293,216,844.58
归属于母公司股东的权益	25,357,779,155.53	25,143,360,134.41	0.85	19,593,568,754.34
所有者权益总额	25,282,513,812.55	25,079,364,842.59	0.81	19,557,777,757.02

（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）	0.16	0.18	-11.11	0.18
稀释每股收益（元 / 股）	0.16	0.18	-11.11	0.18

扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.15	0.18	-16.67	0.18
加权平均净资产收益率（%）	4.11	4.97	减少 0.86 个百分点	5.46
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	3.97	4.95	减少 0.98 个百分点	5.31

报告期末公司前三年主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

（三）母公司的净资本及风险控制指标

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	15,882,718,611.51	18,902,596,160.42
净资产	24,599,189,796.55	24,567,115,030.68
净资本/各项风险准备之和(%)	358.03	335.59
资本杠杆率(%)	22.65	24.50
流动性覆盖率(%)	176.02	315.31
净稳定资金率(%)	151.66	187.20
净资本/净资产(%)	64.57	76.94
净资本/负债(%)	39.20	48.16
净资产/负债(%)	60.71	62.59
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	19.07	28.61
自营固定收益类证券/净资本(%)	211.33	170.08

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	749,840,068.84	1,208,601,213.59	603,813,233.15	533,825,869.52
归属于上市公司股东的净利润	246,332,427.04	439,910,111.60	218,024,836.68	133,885,520.63

归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	240,123,341.56	438,299,823.81	216,915,120.77	107,888,046.21
经营活动产生的现金流量净额	-789,629,416.02	-1,443,124,381.40	3,365,771,109.45	-1,290,209,279.72

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	2020 年金额	2019 年金额
非流动资产处置损益	4,368,643.70	1,012,312.84	4,908,990.18
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	37,273,332.79	13,880,777.06	34,426,260.48
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	38,807.00	-17,550,539.39	-6,932,664.72
其他符合非经常性损益定义的损益项目	4,489,752.67	7,066,298.25	6,061,395.76
减：所得税影响额	11,243,972.56	913,024.52	9,456,217.60
合计	34,926,563.60	3,495,824.24	29,007,764.10

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

适用 不适用

十二、采用公允价值计量的项目

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

项目名称	期初余额	期末余额	当期变动	对当期利润的影响金额
交易性金融资产	26,860,163,662.56	30,371,192,097.77	3,511,028,435.21	847,443,019.10
其他债权投资	9,107,073,011.84	8,974,792,747.89	-132,280,263.95	346,603,947.25
其他权益工具投资	3,424,774,498.21	888,450,912.82	-2,536,323,585.39	241,465,888.19
交易性金融负债	594,122,571.81	622,547,367.97	28,424,796.16	8,853,274.78
衍生金融工具	-1,628,626.72	18,034,882.93	19,663,509.65	-29,329,487.31
合计	39,984,505,117.70	40,875,018,009.38	890,512,891.68	1,415,036,642.01

十三、其他

适用 不适用

(1) 合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2021年12月31日	2020年12月31日	增减率(%)
货币资金	15,373,626,059.26	17,203,544,523.08	-10.64
结算备付金	4,239,132,214.73	3,429,659,479.81	23.60
融出资金	14,272,175,002.17	12,001,843,139.77	18.92
存出保证金	1,504,711,833.90	1,405,554,892.41	7.05
应收款项	289,299,825.76	118,444,884.10	144.25
买入返售金融资产	1,475,449,768.49	1,404,131,659.30	5.08
交易性金融资产	30,371,192,097.77	26,860,163,662.56	13.07
其他债权投资	8,974,792,747.89	9,107,073,011.84	-1.45
其他权益工具投资	888,450,912.82	3,424,774,498.21	-74.06
长期股权投资	2,438,035,301.51	2,241,094,880.32	8.79
固定资产	1,291,599,965.64	234,252,429.42	451.37
在建工程		767,019,295.87	-100.00
使用权资产	115,245,103.29		不适用
无形资产	174,849,023.28	165,408,654.14	5.71
商誉	11,022,697.75	119,636,099.49	-90.79
递延所得税资产	527,648,007.59	374,210,282.57	41.00
其他资产	224,049,001.79	261,284,049.30	-14.25
应付短期融资款	3,386,823,021.21	3,773,336,512.74	-10.24
拆入资金	2,407,134,499.87	2,007,622,222.23	19.90
交易性金融负债	622,547,367.97	594,122,571.81	4.78
卖出回购金融资产款	21,072,631,177.76	18,321,196,405.95	15.02
代理买卖证券款	14,382,125,029.05	12,455,051,319.74	15.47
应付职工薪酬	1,293,065,029.58	1,252,851,712.88	3.21
应交税费	116,561,367.28	67,051,168.80	73.84
应付款项	99,763,100.89	109,801,383.70	-9.14
应付债券	12,979,277,733.07	15,126,853,662.88	-14.20
租赁负债	114,074,885.90		不适用
递延所得税负债	145,071,649.39	213,997,175.09	-32.21
其他负债	350,928,955.75	183,283,545.41	91.47
实收资本(或股本)	6,645,109,124.00	6,645,109,124.00	0.00
资本公积	11,654,405,801.60	11,654,405,801.60	0.00
其他综合收益	59,808,045.65	203,085,565.91	-70.55
盈余公积	1,260,844,773.36	1,176,661,527.73	7.15
一般风险准备	2,444,709,558.32	2,276,343,067.06	7.40
未分配利润	3,292,901,852.60	3,187,755,048.11	3.30
利润表项目	2021年度	2020年度	增减率(%)
营业总收入	3,096,080,385.10	3,169,571,453.97	-2.32
利息净收入	331,360,278.85	330,983,229.17	0.11
手续费及佣金净收入	1,120,596,000.02	1,044,580,610.10	7.28
投资收益	1,983,703,258.82	1,690,362,722.60	17.35

其他收益	41,763,085.46	20,947,075.31	99.37
公允价值变动收益	-439,277,490.59	-1,035,892.54	不适用
其他业务收入	59,260,201.13	57,919,811.88	2.31
营业总支出	2,057,550,532.99	1,970,058,018.44	4.44
税金及附加	27,002,096.32	22,130,728.58	22.01
业务及管理费	1,835,451,049.98	1,688,549,956.15	8.70
信用减值损失	34,739,234.76	130,415,975.39	-73.36
其他资产减值损失	107,155,070.66	65,581,527.31	63.39
其他业务成本	53,203,081.27	63,379,831.01	-16.06
营业外支出	4,244,987.40	18,266,280.14	-76.76
所得税费用	13,100,207.89	124,168,840.63	-89.45
净利润	1,025,468,451.22	1,057,794,055.51	-3.06
其他综合收益的税后净额	-155,344,875.95	23,018,348.58	-774.87

(2) 母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2021年12月31日	2020年12月31日	增减率(%)
货币资金	13,280,774,788.79	14,814,222,449.60	-10.35
结算备付金	3,762,869,908.39	3,073,943,997.55	22.41
融出资金	14,236,568,821.64	11,925,957,812.41	19.37
存出保证金	722,887,839.28	642,746,129.30	12.47
应收款项	145,266,331.97	49,761,070.31	191.93
买入返售金融资产	1,352,205,855.26	1,129,715,941.37	19.69
交易性金融资产	25,249,024,193.05	22,794,288,250.42	10.77
其他债权投资	8,974,792,747.89	9,107,073,011.84	-1.45
其他权益工具投资	888,450,912.82	3,424,774,498.21	-74.06
长期股权投资	7,102,429,089.86	6,551,036,608.54	8.42
固定资产	1,289,171,337.45	230,238,769.98	459.93
在建工程		767,019,295.87	-100.00
使用权资产	101,441,164.61		不适用
无形资产	172,086,917.20	162,104,744.05	6.16
递延所得税资产	498,407,060.24	271,893,737.02	83.31
其他资产	133,656,625.64	109,486,069.43	22.08
应付短期融资款	3,386,823,021.21	3,773,336,512.74	-10.24
拆入资金	2,407,134,499.87	2,007,622,222.23	19.90
交易性金融负债	158,557,798.33		不适用
卖出回购金融资产款	21,038,325,684.94	18,301,300,144.26	14.96
代理买卖证券款	12,878,717,392.90	11,301,462,420.56	13.96
应付职工薪酬	1,121,315,038.45	1,068,028,171.22	4.99
应付债券	11,831,029,699.32	13,804,981,258.70	-14.30
其他负债	315,256,196.27	125,577,242.65	151.05
实收资本(或股本)	6,645,109,124.00	6,645,109,124.00	0.00
资本公积	11,654,405,801.60	11,654,405,801.60	0.00
其他综合收益	49,178,515.11	180,305,447.46	-72.72

盈余公积	1,260,844,773.36	1,176,661,527.73	7.15
一般风险准备	2,444,709,558.32	2,276,343,067.06	7.40
未分配利润	2,544,942,024.16	2,634,290,062.83	-3.39
利润表项目	2021 年度	2020 年度	增减率 (%)
营业总收入	2,518,895,874.94	2,722,035,990.93	-7.46
利息净收入	373,982,169.04	382,395,239.60	-2.20
手续费及佣金净收入	1,051,691,838.59	977,140,198.86	7.63
投资收益	1,710,335,004.54	1,477,834,332.81	15.73
其他收益	40,045,280.18	19,357,050.43	106.88
公允价值变动收益	-665,194,714.67	-134,573,376.85	不适用
营业总支出	1,740,993,992.08	1,895,104,433.00	-8.13
税金及附加	24,523,957.08	20,289,810.02	20.87
业务及管理费	1,608,325,433.85	1,383,234,024.08	16.27
其他资产减值损失	95,547,939.87	487,034,628.87	-80.38
营业外支出	4,240,266.17	18,224,522.12	-76.73
所得税费用	-66,589,508.74	48,874,573.71	-236.25
净利润	841,832,456.34	760,134,882.07	10.75
其他综合收益的税后净额	-145,246,778.07	48,257,369.04	-400.98

(3) 比较式会计报表中变动幅度超过 30%以上项目的情况

单位：元 币种：人民币

资产负债表项目	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	增减率 (%)	变动原因说明
应收款项	289,299,825.76	118,444,884.10	144.25	应收清算款增加
其他权益工具投资	888,450,912.82	3,424,774,498.21	-74.06	其他权益工具投资减少
固定资产	1,291,599,965.64	234,252,429.42	451.37	在建工程转入
在建工程		767,019,295.87	-100.00	转出至固定资产
使用权资产	115,245,103.29		不适用	实施新租赁准则影响
商誉	11,022,697.75	119,636,099.49	-90.79	计提商誉减值
递延所得税资产	527,648,007.59	374,210,282.57	41.00	金融工具公允价值变动浮亏增加
应交税费	116,561,367.28	67,051,168.80	73.84	应交增值税和企业所得税增加
租赁负债	114,074,885.90		不适用	实施新租赁准则影响
递延所得税负债	145,071,649.39	213,997,175.09	-32.21	金融工具公允价值变动浮盈减少
其他综合收益	59,808,045.65	203,085,565.91	-70.55	其他权益工具投资浮盈减少
利润表项目	2021 年度	2020 年度	增减率 (%)	变动原因说明
其他收益	41,763,085.46	20,947,075.31	99.37	专项人才奖励增加
公允价值变动收益	-439,277,490.59	-1,035,892.54	不适用	交易性金融资产浮亏
信用减值损失	34,739,234.76	130,415,975.39	-73.36	其他应收款坏账损失减少
其他资产减值损失	107,155,070.66	65,581,527.31	63.39	商誉减值损失增加
营业外支出	4,244,987.40	18,266,280.14	-76.76	捐赠支出减少
所得税费用	13,100,207.89	124,168,840.63	-89.45	应纳税所得额减少
其他综合收益的税后净额	-155,344,875.95	23,018,348.58	-774.87	其他权益工具投资浮盈减少

第三节 管理层讨论与分析

一、经营情况讨论与分析

2021 年，世界经济实现恢复性增长，中国国内生产总值突破 110 万亿元，比上年增长 8.1%。中国股市总市值超过 90 万亿元，年内呈微涨态势且波动较小，但板块之间分割加剧且转换频繁，结构性行情特征明显。其中上证指数上涨 4.80%，深证成指上涨 2.67%，创业板指上涨 12.02%。

2021 年，公司以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，积极贯彻落实党中央决策部署和重庆市委市政府工作要求，坚定践行国家战略，坚持服务实体经济，统筹抓好疫情防控和经营管理，进一步夯实发展根基，推动公司持续健康均衡发展，聚焦提质增效推进改革创新，经营规模和实力不断壮大。年内公司有序完成总部大楼搬迁，分类评级重回 A 类，进入证监会首批券商“白名单”。经纪业务实现稳步提升，投行业务复苏势头较好，资管业务规范发展，自营业务探索创新，并在市场化运营体系、财富管理转型、业务协同联动、创新驱动发展、服务实体经济以及运营管理能力等方面取得积极成效，保持了稳中有进、稳中向好、稳中提质的发展态势，实现了“十四五”良好开局。

截止报告期末，公司各业务板块详细经营情况见本节中“五、报告期内主要经营情况”中“（一）主营业务分析”之“主营业务分类别、分地区模式情况”相关部分。

二、报告期内公司所处行业情况

2021 年是我国“十四五”开局之年，也是中国共产党成立一百周年，我国立足新发展阶段，全面贯彻新发展理念，持续深化改革开放，坚持创新驱动发展，沉着应对百年变局和世纪疫情，构建新发展格局迈出新步伐，高质量发展取得新成效。2021 年我国国内生产总值突破 110 万亿元，达 114.4 万亿元，同比增长 8.1%，经济增速在全球主要经济体中名列前茅，同时经济总量按年平均汇率折算，达 17.7 万亿美元，稳居世界第二位。

2021 年，我国资本市场改革继续深入推进，并取得良好成果。科创板注册制、创业板注册制试点扎实推进，并达到预期效果，为全市场实行股票发行注册制奠定了坚实基础。北京证券交易所正式成立运行，不仅推动我国多层次资本市场体系建设迎来了新格局，也为我国“专精特新”企业上市融资发展提供了新的通道。同时，上市公司常态化退市、投资者保护等基础性制度建设有序推进，再融资、并购重组、股份减持等关键制度的创新持续深化，我国资本市场现代监管体系日益完善。

受益于此,2021 年上证指数收于 3,639.8 点,较 2020 年末上涨 166.7 点,涨幅为 4.8%;深证成指收于 14,857.4 点,较 2020 年末上涨 386.7 点,涨幅为 2.7%。两市全年成交额 258 万亿元,同比增长 24.7%。证券行业 140 家证券公司全年实现营业收入 5,024.10 亿元,实现净利润 1,911.19 亿元。截至 2021 年末,证券行业总资产为 10.59 万亿元,净资产为 2.57 万亿元,较上年末分别增长 19.07%、11.34%。

三、报告期内公司从事的业务情况

公司主要业务包括证券及期货经纪业务、投资银行业务、自营业务、资产管理业务等。

公司经纪业务主要为接受客户委托,按其要求代理买卖证券并收取佣金。此外还包括金融产品销售、融资融券、股票质押、约定购回、股票期权、PB 业务、投资顾问、期货 IB 等业务。公司经纪业务以合规风控为前提,强调做深做实传统业务、坚持财富管理转型、不断提升员工业务创新能力,在系统建设、综合业务平台搭建、产品货架、渠道建设、资产规模、服务高净值客户、智能投顾、互联网金融、网点优化、服务实体经济、投资者教育等方面均取得了长足发展。

公司投资银行业务主要为客户提供股权融资、债权融资,以及财务顾问等服务。公司投行业务延续精品投行发展模式,整体实力较强,业务发展较为均衡。

公司自营业务主要以自有资金及合法筹措的资金在资本市场进行主动性投资和量化投资等,投资品种主要包括权益类资产、固定收益类资产、另类投资资产以及衍生品等。公司自营业务综合平衡回报率与风险控制需求,以风险收益比作为投资决策的重要参考指标,根据市场情况适时调整各类资产投资规模,以期取得合理的投资收益。

公司资产管理业务是指公司作为资产管理人,接受客户财产委托,为客户提供投资管理服务。公司可为单个客户提供单一资产管理业务,为多个客户提供集合资产管理业务,为客户办理特定目的的专项资产管理业务,以及为外部资产管理机构开展资产管理业务提供投资顾问服务。按投向分,目前公司资产管理产品的种类涵盖债券、权益、混合、量化、现金管理、股票质押式回购、资产证券化等品种。

此外,公司亦有新三板业务、场外市场业务等,并通过子公司开展私募股权、直接股权投资、另类投资、跨境及海外融资等业务。

四、报告期内核心竞争力分析

适用 不适用

持续的改革创新为公司未来 近年来,公司以国企改革和证券行业文化建设为契机,扎实

发展打下了坚实基础	推进改革创新，持续健全经营管理制度，优化管理流程，不断强化合规风控建设，进一步夯实内控成果。同时，着重开展业务能力建设，从面向行业前沿、面向市场和客户需求出发，深入推进业务模式创新，不断完善创新驱动体制机制。公司有效把握市场机遇，持续开拓进取，创造了多个第一，如精选层开板第一股、深交所分拆过会第一股、全国首单生猪期货交割等，有效促进了公司品牌和声誉的不断提升，为公司持续开拓市场、服务客户打下了更为坚实的基础。
拥有全牌照业务资格且综合业务平台逐步发力，能为客户提供全方位服务	公司拥有经纪业务、投资银行、资产管理、证券投资四大事业部，全资拥有西证股权、西证创新、西南期货、西证国际等子公司，参股银华基金和重庆股份转让中心、控股西证国际证券，并拥有中小企业融资、场外等业务部门，形成了全牌照经营格局，能够为境内客户提供全链条金融服务。同时，公司综合业务平台逐步发挥效用，各业务条线间、总部与基层、母公司与子公司、境内与境外的业务协同效率不断提高，能够较好地满足客户多层次金融需求，并促进公司经营效益的不断提升。
精细化管理卓有成效，为公司可持续发展注入强劲动力	公司持续优化完善精细化管理理念和机制，通过强化预算编制、财务管理核算和绩效考核分配等，节约了大量支出，成本管理水平显著提升，降本增效成果持续显现，为公司进一步提升经营效益，增强发展后劲提供了重要支撑。
股东的长期支持和完善的公司治理结构，为公司发展提供充足动力	公司主要股东长期关心和支持公司发展，在资本补充方面给予公司大力支持。公司形成了以“三会一层”（股东大会、董事会、监事会、经理层）为基础，相互分离、相互制衡、归位尽责、运行良好的公司治理结构，确保了公司长期保持市场化运行机制，为公司发展提供了充足动力。

五、报告期内主要经营情况

2021 年度，公司实现营业收入 30.96 亿元，同比减少 2.32%；净利润 10.25 亿元，同比减少 3.06%；归属于母公司股东的净利润 10.38 亿元，同比减少 4.89%；加权平均净资产收益率 4.11%，基本每股收益 0.16 元。

(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	3,096,080,385.10	3,169,571,453.97	-2.32
营业成本	2,057,550,532.99	1,970,058,018.44	4.44
经营活动产生的现金流量净额	-157,191,967.69	-3,808,187,088.30	不适用
投资活动产生的现金流量净额	3,169,041,204.52	2,572,208,068.03	23.20
筹资活动产生的现金流量净额	-4,022,730,664.02	5,567,630,746.99	-172.25

营业收入变动原因说明：营业收入同比减少 0.73 亿元，主要因公允价值变动收益同比减少 4.38 亿。

营业成本变动原因说明：营业成本同比增加 0.87 亿元，主要因业务及管理费同比增加 1.47 亿元。

经营活动产生的现金流量净额变动原因说明：经营活动产生的现金流量净额增加，主要因现金流出减少，其中，为交易目的而持有的金融资产净增加额导致现金流出同比减少 53.27 亿元。

投资活动产生的现金流量净额变动原因说明：投资活动产生的现金流量净额增加，主要因现金流入增加，其中，收回投资收到的现金同比增加 2.72 亿元，取得投资收益收到的现金同比增加 2.41 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额变动原因说明：筹资活动产生的现金流量金额大幅减少，主要因现金流入减少，而现金流出增加。现金流入减少，主要包括吸收投资收到的现金减少 48.86 亿元，发行债券收到的现金减少 23.08 亿元；现金流出增加，主要为偿还债务支付的现金增加 24.00 亿元。

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

2021 年度，公司实现营业收入 30.96 亿元，同比减少 2.32%。其中，利息净收入 3.31 亿元，占营业收入比重为 10.70%，较上年同期增加 0.11%；手续费及佣金净收入 11.21 亿元，占营业收入比重为 36.19%，较上年同期增加 7.28%；投资收益与公允价值变动收益共 15.44 亿元，占营业收入比重为 49.88%，较上年同期减少 8.58%。

公司发生营业支出 20.58 亿元，同比增加 4.44%。其中，业务及管理费 18.35 亿元，占营业支出比重为 89.21%，较上年同期增加 8.70%；减值损失 1.42 亿元，占营业支出比重为 6.90%，较上年同期减少 27.60%。

(1). 主营业务分类别、分地区模式情况

单位:元 币种:人民币

主营业务分类别情况						
分类别	营业收入	营业成本	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业成本比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
证券经纪业务	1,953,248,310.32	810,452,186.00	58.51	5.36	4.07	增加 0.52 个百分点
证券自营业务	493,449,194.35	111,162,706.96	77.47	-41.95	-28.28	减少 4.3 个百分点
投资银行业务	251,408,714.22	188,081,585.88	25.19	7.72	6.04	增加 1.18 个百分点
资产管理业务	23,565,035.72	49,752,498.91	-111.13	-18.99	19.46	
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 (%)
华北	119,873,171.59	45,941,534.13	61.67	-1.84	2.73	减少 1.71 个百分点
华东	171,328,226.34	78,895,893.99	53.95	-6.34	1.93	减少 3.74 个百分点
中南	107,468,076.58	54,929,501.54	48.89	-0.01	-12.73	增加 7.45 个百分点
西南	2,626,706,407.76	1,673,646,258.75	36.28	1.07	16.58	减少 8.48 个百分点
西北	25,123,646.31	14,146,245.46	43.69	3.43	6.33	减少 1.54 个百分点
东北	6,378,526.86	5,746,973.26	9.90	9.15	12.75	减少 2.88 个百分点
境外	39,202,329.66	184,244,125.86	-369.98	-69.39	-44.33	

主营业务分类别、分地区模式情况的说明

√适用 □不适用

1) 主营业务分类别情况的说明

证券经纪业务

2021 年公司经纪业务一方面严守合规风控底线，持续推进精细化管理，通过补短板、强基础，不断提升经纪业务运营效率，业务规模、收入利润继续保持稳步增长；另一方面通过产品创新、服务能力创新、财富管理转型、部门协同等方式，不断提升盈利能力和运营水平，在客户开发、渠道建设、金融产品销售等方面取得了良好成绩。截止 2021 年 12 月 31

日，公司客户总数 159.78 万户，同比增长 10%；客户净资产总额 4,817.70 亿元，同比增长 30%。信用交易业务规模、盈利水平持续增长，项目质量明显提升，转融通业务取得突破，信用总客户数超过 4.26 万户，同比增长 4.94%；融资融券日均余额 128.78 亿元，同比增长 20.31%，信用业务已成为经纪业务首要的业务贡献单元。

经纪业务以提升行业竞争力为导向，坚持机构与零售业务双轮驱动，财富管理转型不断走深走实，产品销售数量、规模、收入等指标实现连续四年正增长并创历史新高。渠道建设取得明显成效，全年累计开户数 15.22 万户，同比增幅 123%；进一步加强与知名公募基金公司合作和明星产品的引进，重点权益类产品平均收益率全面超越同期沪深 300 指数。此外，公司投资者教育工作成效显著，品牌影响力有效提升，投教基地西牛学苑在中国证监会 2020-2021 年度全国证券期货投资者教育基地考核中再次获评“优秀”，同时荣获深交所颁发的 2021 年“投服成果特别奖”及“投教红色行优秀组织奖”等多个奖项；投顾队伍专业能力提升明显，公司荣获《证券时报》和《每日经济新闻》两个专业媒体颁发的“2021 中国证券投资顾问团队君鼎奖”和“2021 中国金鼎奖金牌投资顾问团队”两项荣誉，并连续四年获得新财富“最佳投资顾问评选”卓越组织奖，进一步夯实公司专业服务品牌，提升了品牌美誉度。

投资银行业务

2021 年，我国资本市场注册制改革持续深化。在注册制改革等利好因素驱动下，券商投行业务整体发展较为迅速。报告期内，公司在满足疫情防控要求的情况下积极促进业务复苏，大力拓展投资银行业务，紧抓注册制改革机遇，发挥公司股权融资、并购重组、债券融资三大类业务并举的业务结构特点，积极服务实体经济。

① 股权并购类业务

报告期内，公司以发掘培育定位于北交所、创业板、科创板等重点板块上市的战略新兴产业客户为股权并购类业务重点目标，利用西南投行在市场沉淀的品牌效应优势不断推新出精。

2021 年，公司担任保荐及承销的凯盛新材为深交所分拆上市过会第一股。由公司担任牵头主承销商的恒力集团 2021 年非公开发行可交换公司债券项目成功募集资金 120 亿元，为最近两年全市场发行规模最大的可交债项目；由公司担任保荐机构及主承销商的涪陵榨菜非公开发行股票，仅用 18 天时间就完成了项目受理到过会。

根据 Wind 资讯统计，2021 年西南证券股权类业务融资规模 103.24 亿元（含可转债和可交债项目），排名第 31 位，融资规模较 2020 年增加 92.12 亿元，排名较 2020 年上升 35

位。再融资承销规模为 101.69 亿元，排名第 20 位，融资规模较 2020 年增加 96.02 亿元，排名较去年上升 47 位，实现了跨越式增长，大大提升了公司投行业务在业内的知名度和美誉度。

② 债券承销业务

报告期内，公司继续保持在公司债券领域的优势，坚持以风险控制为导向，信息披露为中心，大力拓展大型债券项目和地方政府债券项目的承销规模，支持绿色债、养老产业专项债等债券的发行。

2021 年，公司累计承销公司债券 203.03 亿元（不含可转债和可交债项目）、地方政府债券 60.19 亿元，其中企业债券 29.4 亿元。2021 年度，公司成功助力重庆黔江旅投发行 2021 年扶贫专项公司债；成功发行泸州汇兴绿色债，完成重庆石柱县和永川区企业约 20 亿元绿色债的发行申报，支持乡村振兴与绿色金融实践；完成重庆悦来集团发行公司债，3.94% 的票面利率创重庆同评级同期限私募公司债历史最低；服务重庆城投发行优质企业债，3.2% 的发行利率创 2021 年西南地区同期限信用债最低。

资产管理业务

2021 年，140 家证券公司实现主营业务收入 5,024.10 亿元（数据来源：中国证券业协会），同比增长 12.03%。其中，资产管理业务净收入合计 317.86 亿元，同比增长 6.1%。资产管理业务净收入占证券公司主营收入比重为 6.3%。2021 年末，证券行业资产管理业务规模为 10.88 万亿元，同比增加 3.53%。

截至 2021 年末，公司资管（本部）存续资产管理计划 29 只，其中，集合资管计划 12 只，单一资管计划 15 只，专项资管计划 2 只，合计管理份额规模 155.12 亿元。公司资管坚决落实资管新规要求，按照监管规定有效推进资管新规整改工作；持续优化投资能力，提升产品投资业绩，创新产品体系，2021 年新发集合计划 5 只，新产品类型包括 FOF、固收+等新业务领域；强化融资服务，在 ABS、REITs 业务上形成新的增长点，年内新发专项计划 2 只，新增发行规模 31 亿元，其中，银海租赁项目在重庆本地国有企业 ABS 业务上实现突破，丰禾 1 号实现了公司在同业资产 ABS 业务首单落地，我司作为总协调人协同联合体项目组中选“重庆城投公租房公募 REITs 项目服务机构”；积极探索与银行、保险等金融机构业务合作模式，以与平安银行和民生银行合作认购“信托收益权”的模式助力企业可交换债发行；搭建重庆国企金融服务平台，推进区域内大中型国有企业投融资服务事宜，切实把握国企现阶段投融资痛点，结合公司既有资源，精准施策，实现合作共赢。

证券自营业务

2021 年，海外各经济体受疫情反复影响，复苏步伐不一，国内在常态化疫情防控背景下，经济持续稳定恢复，货币政策保持稳健、适度宽松、灵活精准；受经济、政策、供需多因素影响，国内大宗商品呈现先涨后跌的行情；A 股市场全年宽幅震荡，整体呈现结构性行情。在此行情之下，公司自营业务坚持长期稳健发展原则，以固收类资产为支撑，通过灵活配置优质权益类资产增厚业绩。报告期内，公司自营业务整体运行平稳，继续保持了较好的投资业绩。

量化投资业务坚持多策略、多品种、全市场的大类资产配置理念，综合应用各类金融工具及衍生品平滑市场波动风险，持续为公司创造稳定回报。全年，公司量化投资业务适时调整权益类资产仓位，并通过多市场投资策略降低单一市场波动风险。同时，通过内部持仓风格的再平衡以及期权产品的主动运用，较好的抓住了市场波动机会。

股票方向性投资业务始终将风险控制放在首位，持续贯彻绝对收益理念，采取低风险投资策略，根据市场环境变化，积极优化投资组合，灵活操作，获取长期持续稳定收益。2021 年，宏观环境纷繁复杂，股票市场呈现出结构性行情，经历了较大的风格切换。公司股票方向性投资业务坚持长期价值投资理念，主要持有优质核心资产，积极拓展多种投资策略，为后续发展打下了深厚基础。

债券方向性投资业务坚持投研先行，在深度聚焦企业内在价值、严防信用风险的投资准则下，以利率债和高等级信用债配置为主，同时通过深挖个券的结构性机会获取超额收益。本年度，公司债券方向性投资业务继续维持久期中性选择，积极把握资产配置时间窗口，通过杠杆和资金配置等方式适时增加投资规模。另外，还通过探索跨境业务，不断丰富盈利模式，分散整体投资风险。

子公司经营业务

西证投资作为私募股权基金业务平台，积极开拓项目来源，重点关注半导体、生物医药、智能制造、人工智能、交通运输等多个行业，挖掘并评估了近二百个潜在投资项目，截至 2021 年 12 月 31 日，累计管理基金规模约为 13 亿元（认缴）。

西证创新紧跟国家产业政策导向和未来发展趋势，聚焦碳达峰碳中和、新一代信息技术以及医疗卫生健康等领域，不断探索并推进研究驱动投资模式，深挖产业链投资机会，重点投资相关领域中具有核心竞争力的行业领先企业。同时，西证创新积极践行金融服务实体经济发展，支持成渝双城经济圈建设，以不良资产为重点开展非标资产投资。报告期内，西证创新完成投资项目 13 个，投资金额 15.66 亿元，存量投资项目中有 6 家企业在 2021 年实现了 IPO。

西南期货严控经营风险，持续提升营销能力和服务水平，进一步强化网点布局和渠道建设，不断提高服务实体经济的能力，各项业务健康、平稳、可持续发展。2021 年，西南期货经纪业务收入同比增长 79.80%，超行业同期 55.89% 的平均增长水平，创历史新高。期货经纪成交金额和成交量同比分别实现约 58% 和 53% 的增长，均超过行业同期 32.97% 和 20.68% 平均增长量。此外，西南期货分支机构继续保持 90% 以上的盈利比率，在业内处于领先地位。

西证国际证券 2021 年度同比实现大幅减亏，在全球疫情肆虐，金融市场剧烈动荡，道指、港股恒指大幅下跌且回报率为负的情况下，坚持价值投资和组合投资结合，采取了安全垫策略和对冲操作，全年实现正向年化投资收益率；于年内设立 1 支固收资管产品；2021 年度，西证国际证券为客户完成了 4 个美元债券配售项目，3 个股票配售项目，1 个私有化项目，正在推进 5 个上市项目。

其他业务

2021 年新三板业务克服市场下行和疫情造成的影响，稳健展业，维持既定市场排名和份额，年内完成推荐挂牌 2 家，行业排名居并列第 9 位；截止年末督导企业 148 家，市场份额占比 2.1%；推荐挂牌和持续督导在 109 家主办券商中继续保持在行业第一梯队；全年协助 9 家企业完成股票定向发行 9 次，融资金额 2.43 亿元，完成新三板收购项目 5 单，重大资产重组 2 单，实施退市公司股票挂牌业务 2 单；抢抓北交所设立机遇，牵头推进各项配套准备工作和业务推广，取得首批北交所会员资格，多个北交所储备项目正在积极推进。

场外创新业务持续探索，存量业务稳定发展，运营管理不断优化。在深交所报价回购业务方面，产品种类进一步丰富，新增上线 4 个期限品种；全年共发行产品 1,548 期，发行数量持续增加；存续规模大幅增长，年末余额 4.52 亿元，增长幅度超过 400%；客户基础稳步扩大，增长幅度超过 700%。在收益凭证业务方面，加大产品开发、创设力度，产品种类进一步丰富，全年新增 12 个产品系列。组织产品日常发行兑付工作，频率数量持续增加，合计发行 259 期，发行数量同比增长 6.6%；发行金额 48.49 亿元，同比增加 13%。报告期内取得场外期权二级交易商和票据交易系统交易成员两项业务资格。

研究业务继续推进“内外并举”的战略转型，大力充实和培育研究队伍，积极借力金融科技，努力完善研究服务体系，研究实力、服务水平与品牌影响力有所提升。对外，公司采用聚焦大客户战略，巩固并拓展研究市场份额；对内，紧贴业务需求，在合规前提下持续为投行、自营、资管等业务部门提供研究支持。报告期内，在“水晶球”“金牛奖”斩获佳绩，先后举办多场大型线上线下投资策略会，获得了业内关注和肯定。

2) 主营业务分地区情况的说明

①营业收入地区分布报告

单位：元 币种：人民币

地区	2021 年度		2020 年度		营业收入增 减百分比(%)
	分支机 构数量	营业收入	分支机 构数量	营业收入	
北京	8	82,344,354.10	8	85,601,414.30	-3.80
广东	5	63,566,762.62	5	62,619,004.26	1.51
江苏	5	18,390,979.00	6	21,710,904.64	-15.29
广西	1	3,082,761.50	2	3,345,971.41	-7.87
山东	3	11,869,648.27	3	12,014,026.67	-1.20
山西	3	15,618,891.78	3	14,448,331.23	8.10
陕西	2	8,450,310.51	2	8,105,394.87	4.26
上海	4	74,933,043.17	4	73,798,479.67	1.54
四川	6	48,241,927.30	6	44,320,232.07	8.85
贵州	1	1,396,510.07	1	1,197,833.59	16.59
云南	3	15,845,483.28	3	16,284,071.10	-2.69
浙江	8	50,578,886.21	8	57,008,163.02	-11.28
重庆	45	490,662,171.43	45	474,568,839.08	3.39
甘肃	1	8,402,700.46	1	7,579,464.90	10.86
河北	3	16,597,226.31	2	16,849,011.80	-1.49
湖南	3	18,658,313.54	5	18,179,371.58	2.63
福建	2	8,171,406.32	2	9,100,080.16	-10.21
湖北	2	9,163,323.48	2	9,822,168.79	-6.71
安徽	2	4,946,159.48	2	5,225,960.32	-5.35
青海	1	1,425,530.12	1	1,768,651.13	-19.40
辽宁	2	3,748,943.55	2	3,674,229.10	2.03
天津	1	1,810,516.36	1	2,064,610.41	-12.31
吉林	1	1,374,659.56	1	1,153,822.49	19.14
内蒙古	2	3,502,183.04	2	3,155,061.56	11.00
宁夏	2	5,738,763.70	2	5,885,332.66	-2.49
河南	3	12,996,915.44	5	13,509,738.40	-3.80
黑龙江	1	1,254,923.75	1	1,015,534.21	23.57
江西	1	2,438,103.89	1	4,066,138.91	-40.04
新疆	1	1,106,341.52	1	951,230.97	16.31
境外		39,202,329.66		128,075,435.91	-69.39
公司本部		2,070,560,315.68		2,062,472,944.76	0.39
合计	122	3,096,080,385.10	127	3,169,571,453.97	-2.32

注：2021 年分支机构数量和营业收入含本期产生营业收入而期末已注销的分支机构。

②营业利润地区分部报告

单位：元 币种：人民币

地区	2021 年度	2020 年度	
----	---------	---------	--

	分支机 构数量	营业利润	分支机 构数量	营业利润	营业利润增减 百分比 (%)
北京	8	52,237,752.28	8	55,275,524.08	-5.50
广东	5	32,847,980.84	5	27,713,011.98	18.53
江苏	5	7,363,937.32	6	8,781,102.09	-16.14
广西	1	1,173,407.42	2	507,552.28	131.19
山东	3	-2,731,507.78	3	-2,221,107.00	不适用
山西	3	8,083,684.56	3	7,745,658.31	4.36
陕西	2	3,085,645.96	2	3,298,167.70	-6.44
上海	4	52,174,774.99	4	54,313,737.41	-3.94
四川	6	29,855,257.34	6	29,906,594.35	-0.17
贵州	1	196,412.42	1	-107,358.60	不适用
云南	3	9,356,376.00	3	9,940,777.22	-5.88
浙江	8	30,659,937.07	8	35,999,219.48	-14.83
重庆	45	363,265,658.06	45	366,991,932.46	-1.02
甘肃	1	6,400,730.43	1	5,614,141.89	14.01
河北	3	11,959,062.75	2	12,398,936.07	-3.55
湖南	3	8,742,688.52	5	6,978,582.29	25.28
福建	2	3,174,754.32	2	4,223,227.70	-24.83
湖北	2	2,913,752.53	2	3,141,673.93	-7.25
安徽	2	862,757.41	2	1,882,114.22	-54.16
青海	1	168,842.77	1	569,993.73	-70.38
辽宁	2	767,758.87	2	723,646.15	6.10
天津	1	409,485.59	1	747,193.67	-45.20
吉林	1	26,846.45	1	223,703.65	-88.00
内蒙古	2	1,241,652.28	2	1,231,384.82	0.83
宁夏	2	2,287,214.10	2	2,911,613.49	-21.45
河南	3	6,860,745.73	5	6,196,413.43	10.72
黑龙江	1	-163,051.72	1	-200,706.51	不适用
江西	1	927,679.02	1	2,546,823.53	-63.58
新疆	1	-965,032.41	1	-1,407,576.63	不适用
境外		-145,041,796.20		-202,880,662.34	不适用
公司本部		550,386,445.19		756,468,120.68	-27.24
合计	122	1,038,529,852.11	127	1,199,513,435.53	-13.42

注：2021 年分支机构数量和营业利润含本期产生营业利润而期末已注销的分支机构。

(2). 营业成本分析

单位：元 币种：人民币

分类别情况						
分类别	成本构成项目	本期金额	本期占总成 本比例 (%)	上年同期金额	上年同期占总 成本比例 (%)	本期金额较上年 同期变动比例 (%)

证券经纪业务	业务及管理费、税金及附加、减值损失、其他业务成本	810,452,186.00	39.39	778,779,760.40	39.53	4.07
证券自营业务	业务及管理费、税金及附加、减值损失	111,162,706.96	5.40	154,989,849.69	7.87	-28.28
投资银行业务	业务及管理费、税金及附加	188,081,585.88	9.14	177,364,219.42	9.00	6.04
资产管理业务	业务及管理费、税金及附加	49,752,498.91	2.42	41,649,438.53	2.11	19.46

(3). 重大采购合同、重大销售合同的履行情况

适用 不适用

(4). 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

(5). 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

业务及管理费用情况详见本报告“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

(2). 研发人员情况表

适用 不适用

(3). 情况说明

适用 不适用

(4). 研发人员构成发生重大变化的原因及对公司未来发展的影响

适用 不适用

5. 现金流

适用 不适用

报告期内，公司现金及现金等价物净减少 10.18 亿元。具体分析如下：

(1) 经营活动产生的现金净流出 1.57 亿元，现金流入包括：收取利息、手续费及佣金的现金 39.58 亿元，回购业务资金净增加额 27.49 亿元，代理买卖证券收到的现金净额 19.27 亿元，拆入资金净增加额 4.00 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 1.46 亿元；现金流出

包括：为交易目的而持有的金融资产净增加额 35.90 亿元，融出资金净增加额 22.48 亿元，支付给职工及为职工支付的现金 13.49 亿元，支付利息、手续费及佣金的现金 10.90 亿元，支付的各项税费 3.43 亿元，返售业务资金净增加额 0.75 亿元，支付其他与经营活动有关的现金 6.42 亿元。

(2) 投资活动产生的现金净流入 31.69 亿元，现金流入包括：收回投资收到的现金 25.14 亿元，取得投资收益收到的现金 8.47 亿元，处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 0.04 亿元；现金流出为：购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 1.97 亿元。

(3) 筹资活动产生的现金净流出 40.23 亿元，现金流入包括：发行债券收到的现金 79.80 亿元，取得借款收到的现金 6.20 亿元；现金流出包括：偿还债务支付的现金 109.26 亿元，分配股利、利润或偿付利息支付的现金 14.58 亿元，支付其他与筹资活动有关的现金 2.39 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 币种：人民币

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	15,373,626,059.26	18.69	17,203,544,523.08	21.72	-10.64	自有资金存款减少
结算备付金	4,239,132,214.73	5.15	3,429,659,479.81	4.33	23.60	客户备付金增加
融出资金	14,272,175,002.17	17.35	12,001,843,139.77	15.16	18.92	两融规模增加
存出保证金	1,504,711,833.90	1.83	1,405,554,892.41	1.77	7.05	交易保证金增加
买入返售金融资产	1,475,449,768.49	1.79	1,404,131,659.30	1.77	5.08	买入返售业务规模增加
交易性金融资产	30,371,192,097.77	36.92	26,860,163,662.56	33.92	13.07	债券投资增加
其他债权投资	8,974,792,747.89	10.91	9,107,073,011.84	11.50	-1.45	其他债权投资规模减少
其他权益工具投资	888,450,912.82	1.08	3,424,774,498.21	4.32	-74.06	其他权益工具投资减少
长期股权投资	2,438,035,301.51	2.96	2,241,094,880.32	2.83	8.79	确认联营企业投资收益
固定资产	1,291,599,965.64	1.57	234,252,429.42	0.30	451.37	在建工程转入
在建工程			767,019,295.87	0.97	-100.00	转出至固定资产
递延所得税资产	527,648,007.59	0.64	374,210,282.57	0.47	41.00	金融工具公允价值变动盈亏增加

应付短期融资款	3,386,823,021.21	4.12	3,773,336,512.74	4.77	-10.24	短期融资款存续规模降低
拆入资金	2,407,134,499.87	2.93	2,007,622,222.23	2.54	19.90	银行拆入资金增加
交易性金融负债	622,547,367.97	0.76	594,122,571.81	0.75	4.78	浮动收益凭证增加
卖出回购金融资产款	21,072,631,177.76	25.62	18,321,196,405.95	23.14	15.02	卖出回购业务规模增加
代理买卖证券款	14,382,125,029.05	17.48	12,455,051,319.74	15.73	15.47	客户交易结算资金增加
应付职工薪酬	1,293,065,029.58	1.57	1,252,851,712.88	1.58	3.21	应付职工薪酬增加
应付债券	12,979,277,733.07	15.78	15,126,853,662.88	19.10	-14.20	次级债存续规模降低

其他说明

(1) 资产情况

2021 年末，公司资产总额 822.58 亿元，较上期末增长 3.88%。其中，货币资金与结算备付金共 196.13 亿元，占总资产的比重为 23.84%，较上期末减少 4.95%；交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资共 402.34 亿元，占总资产的比重为 48.91%，较上期末增加 2.14%；融出资金为 142.72 亿元，占总资产的比重为 17.35%，较上期末增长 18.92%；长期股权投资为 24.38 亿元，占总资产的比重为 2.96%，较上期末增长 8.79%；存出保证金为 15.05 亿元，占总资产的比重为 1.83%，较上期末增长 7.05%；买入返售金融资产为 14.75 亿元，占总资产的比重为 1.79%，较上期末增加 5.08%；固定资产为 12.92 亿元，占总资产的比重为 1.57%，较上期末增长 451.37%。期末公司流动资产规模较大，资产流动性充足，同时对存在减值迹象的资产计提了减值准备，公司资产质量较高。

(2) 负债情况

2021 年末，公司负债总额 569.76 亿元，较上期末增长 5.30%。其中，应付短期融资款与应付债券共 163.66 亿元，占负债总额的比重为 28.72%，较上期末减少 13.41%；卖出回购金融资产款为 210.73 亿元，占负债总额的比重为 36.99%，较上期末增加 15.02%；代理买卖证券款为 143.82 亿元，占负债总额的比重为 25.24%，较上期末增长 15.47%；拆入资金为 24.07 亿元，占负债总额的比重为 4.22%，较上期末增长 19.90%；应付职工薪酬为 12.93 亿元，占负债总额的比重为 2.27%，较上期末增长 3.21%。扣除代理买卖证券款后，公司自有负债总额为 425.93 亿元，资产负债率为 62.75%，资产负债结构稳定，经营状况良好，长短期偿债能力俱佳。

2. 境外资产情况

√适用 □不适用

(1) 资产规模

境外资产 1,526,850,059.49（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 1.86%。

(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

报告期末受限资产详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 75. 所有权或使用权受到限制的资产”。

4. 其他说明

适用 不适用

(四) 行业经营性信息分析

适用 不适用

具体参见本节“一、经营情况讨论与分析”及“二、报告期内公司所处行业情况”。

(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，公司长期股权投资为 24.38 亿元，较年初增加 1.97 亿元，增幅为 8.79%。具体内容详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 17. 长期股权投资以及十九、母公司财务报表主要项目注释 1. 长期股权投资”。

1. 重大的股权投资

适用 不适用

2. 重大的非股权投资

适用 不适用

报告期内，公司重大的非股权投资主要为江北嘴大楼（在建工程）项目，已于报告期内全部转入固定资产。

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包括交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资、衍生金融资产，具体内容详见本报告“第十节 财务报告 十八、其他重要事项 9. 以公允价值计量的资产和负债”。

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. 西证股权投资有限公司

西证股权投资有限公司系公司全资子公司，成立于 2010 年 3 月，注册资本 5 亿元人民币，注册地重庆，办公地址重庆市江北区金沙门路 32 号，法定代表人、董事长朱红，经营范围为股权投资，股权投资管理。

截至 2021 年 12 月 31 日，西证投资总资产 115,940.03 万元，净资产 66,417.93 万元；报告期内实现营业收入 4,228.59 万元，净利润 1,644.72 万元。

2. 西证创新投资有限公司

西证创新投资有限公司系公司全资子公司，成立于 2013 年 4 月，注册资本 40 亿元人民币，注册地重庆，办公地址重庆市江北区金沙门路 32 号，法定代表人、董事长黄青山，经营范围为从事投资业务。

截至 2021 年 12 月 31 日，西证创新总资产 367,996.59 万元，净资产 350,093.64 万元；报告期内实现营业收入 33,172.94 万元，利润总额 24,973.51 万元，净利润 18,729.14 万元。

3. 西南期货有限公司

西南期货有限公司于 2013 年 10 月成为公司全资子公司，注册资本 8.5 亿元人民币，注册地重庆，法定代表人、董事长李星光，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。西南期货有限公司于 2017 年 2 月全资设立了期货风险管理子公司——重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司，面向客户提供风险管理等服务。

截至 2021 年 12 月 31 日，西南期货总资产 261,876.69 万元，净资产 90,308.05 万元；报告期内实现营业收入 14,827.84 万元，净利润 2,568.97 万元。

4. 西证国际投资有限公司

西证国际投资有限公司系公司在香港特别行政区注册设立的全资子公司，成立于 2013 年 11 月，资本金 15.70 亿元港币，注册地香港，董事长吴坚。西证国际下属西证国际证券，通过其子公司持有香港证监会核发的第 1 类（证券交易）、第 2 类（期货合约交易）、第 4 类（就证券提供意见）、第 6 类（就机构融资提供意见）、第 9 类（提供资产管理）业务牌照。

截至 2021 年 12 月 31 日，西证国际总资产 152,685.01 万元，净资产 27,459.12 万元；报告期内实现营业收入 3,920.23 万元，亏损 14,504.18 万元。

5. 银华基金管理股份有限公司

银华基金管理股份有限公司系公司联营企业，公司持有 44.10% 股权，为其第一大股东。银华基金成立于 2001 年 5 月，注册资本 22,220 万元人民币，注册地深圳，法定代表人、董事长王珠林，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

截至 2021 年 12 月 31 日，银华基金总资产 655,844.15 万元，净资产 366,789.49 万元；报告期内实现营业收入 398,557.85 万元，利润总额 122,967.28 万元，净利润 92,229.54 万元。

(八) 公司控制的结构化主体情况

适用 不适用

根据《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》（2014），对于公司管理并投资的结构化主体（如：资产管理计划、基金），公司会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明公司对结构化主体拥有控制权。若公司对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

本报告期末，公司及子公司作为资产管理计划管理人或合伙企业的普通合伙人并投资西南证券双喜基金优选 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉策略 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜聚金 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜盛誉混合配置 4 号集合资产管理计划、西南证券新三板鑫瑞 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债中银 1 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 2 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 3 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 4 号集合资产管理计划、西南证券双喜金债 5 号集合资产管理计划、西南证券盛誉定增策略 1 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 4 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 5 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 6 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 8 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 11 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 12 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 18 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 33 号集合资产管理计划、西南证券涌泉 34 号集合资产管理计划、西南期货 CTA 基本面量化 1 号集合资产管理计划、重庆西证阳光股权投资基金合伙企业（有限合伙）、重庆西证价值股权投资基金合伙企业（有限合伙）、珠海西证汇盈股权投资基金合伙企业（有限合伙）、重庆两江西证股权投资基金合伙企业（有限合伙），并对其实施控制，故将其纳入公司合并财务报表的合并范围。

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

资本市场改革深入推进将为证券行业发展提供更为广阔的空间

随着国家持续把资本市场改革发展放在国家治理体系和治理能力现代化的总体框架中来思考、谋划和推动，我国资本市场改革将持续深入推进，以进一步增强服务实体经济的能力。未来，全市场注册制改革将重点推进，并将以此为牵引，推进提高上市公司质量、建立健全常态化退市机制、强化中介机构责任、开展投资端改革等重点改革，资本市场将在进一步畅通资本、科技等方面发挥更大的作用，提供更高的资源配置效率，这将为证券行业提供更广阔的发展前景和更大的服务空间。

资本市场的全方位开放将推动证券行业更高层次的发展

随着国际经济互联互通的持续推进，我国资本市场发展进入了全面开放的新阶段。近年来，沪深港通机制不断完善、沪伦通及H股全流通正式启动、QFII和RQFII取消额度限制、合资券商持股比例取消限制等推动了我国资本市场在更高层次和更大范围内开放。在新发展格局下，我国将持续推进资本市场对外开放的深度，境内外市场互联互通机制、跨境产品创新体系、跨境资本市场风险防范和化解等将不断完善和优化，国内证券公司将在与国际投行的合作和竞争中不断向前发展。

金融科技持续赋能证券业务发展，打造全新客户服务生态

当前，新一轮科技革命和产业变革持续推动信息技术与金融业务的深度融合，金融科技迅速发展，人工智能、大数据、云计算、区块链等新技术的崛起，加速了金融数字化时代的来临。国内外领先金融机构持续加大金融科技投入，不断布局金融科技生态，推动产品创新和客户服务全面升级，全力打造全新竞争优势。可以预见，证券公司将越发重视金融科技建设，不断采用成熟的金融科技服务业务发展，将金融科技由支撑业务发展快速升级为赋能业务发展，并重塑服务体系，创造全新价值。

(二) 公司发展战略

√适用 □不适用

公司将坚持稳中求进、提质增效的工作总基调，以服务实体经济发展为宗旨，以客户为中心，深化完善综合金融服务模式，进一步提升产品和服务创新力度，提升业务品质，增强业务韧性，推动公司持续高质量发展。通过深化国企改革，为公司发展注入新动能，提供新活力。通过有效发挥公司作为国有上市证券公司的专业能力和资源优势，为“一带一路”、成渝地区双城经济圈、西部科学城、西部金融中心建设等提供高效的资本市场服务。通过推进公司战略行动计划，打造具备一流创新意识、业务能力和管理水平的综合金融服务商，并以一流综合金融服务，践行国家战略，助推高质量发展。

(三) 经营计划

√适用 □不适用

2022 年是“十四五”规划建设承上启下的一年，公司将以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，全面贯彻习近平总书记关于国企改革和党的建设系列重要论述，全面落实党的十九大和十九届历次全会精神，以及中央和重庆市委经济工作会议精神，立足新发展阶段，贯彻新发展理念，积极融入和服务新发展格局，把握改革发展机遇，推动公司高质量发展迈上新台阶，努力以优异成绩迎接党的二十大胜利召开。2022 年公司将重点开展如下工作：

一是深化改革创新，积极打造特色化差异化竞争优势。公司将密切跟踪政策变化，有效整合资源要素，聚焦公司发展的关键领域和关键环节，在服务重大战略、业务创新与协同、投资能力、内部控制、人才建设、金融科技等方面，构建和培育竞争优势。

二是加强统筹协调，落实战略部署。公司将进一步强化前中后台各部门、各子公司大局观意识和责任担当，提升执行效率，更突出实干和注重细节，以更加务实向上的工作作风，确保公司发展战略落到实处，产生实效。

三是聚焦业务转型，实现经营效益稳中有进。公司将坚定市场化发展道路，持续优化业务模式，推动各业务条线转型发展。公司将进一步提升在投资银行、财富管理、资产管理、投资业务、机构业务、国际业务等领域的专业化能力，不断推进产品和服务创新，强化业务协同，通过专业高效的金融服务，推动公司经营稳定健康发展。

四是优化运营环境，推动管理水平稳步提升。公司将进一步加强在党建、公司治理、企业文化、监督管理、合规风控、内核、财务资金、品牌建设、疫情防控等方面的工作力度，深入准确推进精细化管理，促进公司运营环境的持续优化和管理水平的不断提升。

(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

报告期内，公司坚持“稳健”的总体风险偏好，持续推进全面风险管理体系建设，完善风险管理制度流程，建设风险管理信息系统，强化各类型风险管控，提升整体风险管理能力，支持业务创新发展，保障公司持续稳健运行。

1. 风险管理概况

公司建立了与经营管理和业务规模相适应的全面风险管理体系，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，并不断加强流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险、信息技术风险、合规风险等管理，确保公司经营过程中的风险可测可控可承受。

可操作的管理制度

风险管理的目标、原则、授权体系、相关职责和基本程序。

风险识别、评估、监测、应对和报告的方法和流程。

健全的组织架构

董事会、监事会、经理层承担全面风险管理的责任。

合规、风控和审计部门在董事会和经理层的领导下履行不同的风险管理职责。

各业务部门负责人承担相关风险管理有效性的直接责任。

各业务部门合规风控岗专职履行合规风险管理职责。

可靠的信息技术系统

覆盖市场、信用、操作、流动性、声誉等各类别风险和各业务风险管理。

与公司发展水平和业务复杂程度相适应。

对风险进行计量、汇总、预警和监控。

量化的风险指标体系

证券公司监管报表。

风险偏好、风险容忍度和重大风险限额等指标，通过业务授权逐级分解至各业务部门。

专业的人才队伍

任命首席风险官全面负责风险管理工作。

设立独立的风险控制部门并配置专业人才。

业务部门配备专、兼职风控岗，子公司配首席风险官。

有效的风险应对机制

风险识别、评估、监测和报告。

压力测试。

补充资本、减值准备、风险规避、风险转移等应对措施。

(1) 风险管理组织架构

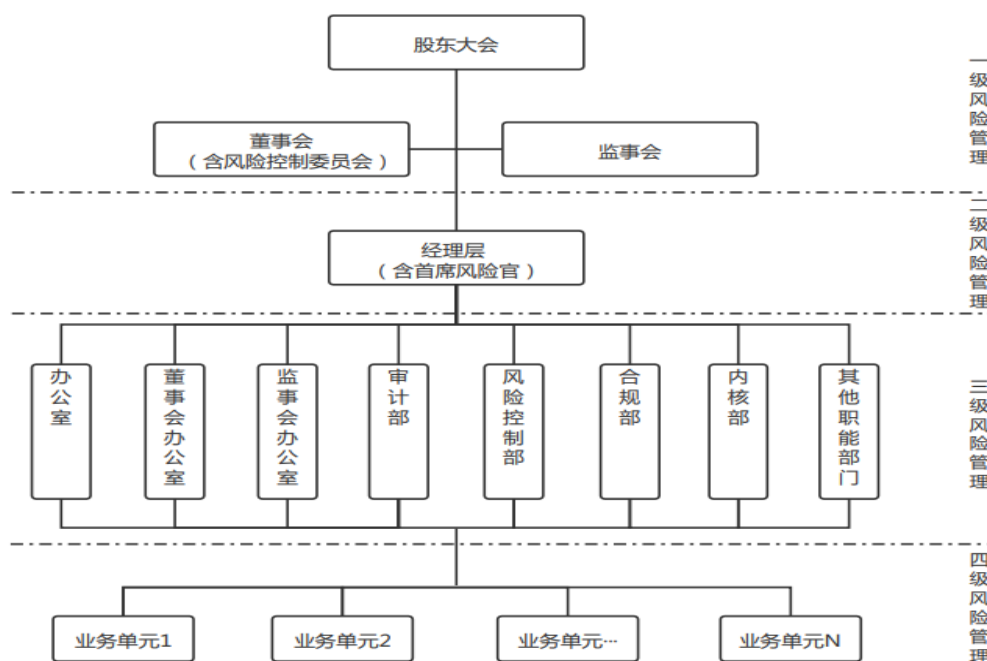
公司以分层架构、集中管理模式对整体风险进行管控，风险管理组织包括董事会、监事会，经理层和首席风险官，风控、合规、审计等内控部门，各业务部门等四个层级。

第一层：公司董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作，下设风险控制委员会，负责审议公司定期风险评估报告、重大风险事件评估报告和重大风险控制解决方案等董事会授权履行的风险管理职责。公司监事会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。

第二层：公司经理层负责经营管理中各项风险管理工作的落实。设首席风险官负责全面风险管理工作，有权参加或列席与其履行职责相关的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。

第三层：公司设置独立的风险控制部门，在首席风险官领导下贯彻落实全面风险管理工作，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、分支机构的风险管理工作。其它内控部门分别承担职责范围内的风险管理责任。

第四层：公司各部门及分支机构根据职责范围设置合规风控岗，协助负责人履行风险管理职责。各分支机构负责人应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，并承担风险管理有效性的直接责任。



图：公司全面风险管理组织架构

(2) 风险管理制度

公司制定了以《西南证券股份有限公司风险管理制度》为核心的风险管理制度体系，主要包括各类型风险管理、净资本与流动性风控指标管理、压力测试以及授权管理等。定期组织评估修订并通过稽核、检查等手段保证其贯彻落实。报告期内，公司新制定了《场外衍生

品业务交易对手内部信用评级与授信管理办法》《场外衍生品交易对手方评级和授信管理细则》《风险管理工作考核实施暂行办法》《转融通业务风险控制实施细则》4项风险管理制度，并根据监管要求和业务发展需要修订了《风险管理制度》《内部评级管理办法》《风险与合规管理委员会议事规则》《股票期权自营业务风险管理办法》等36项风险管理制度，保障了公司风险管理制度与监管要求、业务发展相一致。

(3) 风险量化指标

公司以净资本和流动性风险指标为基础，构建了包括风险偏好、风险容忍度和风险限额在内的风控指标体系，董事会审议确定公司整体风险偏好，确定每年风险容忍度和重大风险限额，以业务授权形式将其分解至各业务单元、各部门及分支机构并监督执行；风险指标覆盖可量化的各类型风险和各业务风险，定期对估值与风险计量模型的有效性进行检验和评价，确保计量结果准确性和可靠性。

报告期内，公司紧跟业务发展，推动修订了公司总体经营风险偏好，明确公司总体风险管理偏好为“稳健”型，根据风险偏好修订了公司风险容忍度和重大风险限额，进一步强化业务风险整体控制能力；对风险控制指标体系进行动态调整，加强了权益类方向性投资、债券投资交易、质押融资类业务、场外衍生品业务的风险管理，风险控制部定期独立对风险计量模型的有效性进行检验和评价，确保计量结果准确性和可靠性。

(4) 风险管理系统

为保障风险管理制度和风险政策的执行，公司按年制定风险管理信息技术系统专项预算，着力提升风险管理信息系统自研能力，建立了与自身风险偏好和业务复杂程度相适应的风险管理系统，覆盖各类型风险和各业务条线风险管理，并建立了数据治理和质量控制机制，以满足风险识别、计量、汇总、监控和预警等需要。

报告期内，建设完善了全面风险管理驾驶舱系统、异常交易监测系统、风险信息监测、声誉风险管理系统等，对各类业务管理系统风险控制模块进行优化，推进风险数据集市项目建设，不断健全数据治理和质量控制机制，推动市场风险管理系统升级，确保风险系统能够满足风险管理需要；同时，公司对信息技术系统风险开展专项评估，对识别出的风险点进行强化管理，确保信息技术系统风险整体可控。

(5) 风险应对机制

公司制定了完善的风险事件应急处置管理流程，规范了公司风险事件应急处置和报告的触发条件、组织体系、等级划分、应对措施、处置流程、报告流程等，重点加强流动性危机、交易系统事故等重大风险和突发事件应急管理，定期通过应急演练、压力测试和风

险评估结果调整应对策略。同时，公司确立了以各部门、分支机构及子公司负责人为风险事件第一责任人的风险处置流程，各部门、分支机构及子公司负责人应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、评估和报告相关风险，并承担风险管理有效性的直接责任。报告期内，各类风险应急管理措施有效运行，对公司经营过程中面临的各类风险进行了有效管理，促进公司各项业务健康持续发展。

(6) 风险管理文化

公司推行稳健经营的风险管理文化，并将稳健经营风险管理文化纳入公司企业文化体系内，形成“诚信、稳健、求精、创新”的企业文化管理理念，持续通过媒体宣传、组织内外部培训、交流讲座等方式进行宣传倡导，提升了公司全员风险防控内生力；建立了覆盖全员的、与风险管理效果挂钩的绩效考核及责任追究机制，保障全面风险管理的有效性。

2. 各类风险及其应对措施

报告期内，公司面临的主要风险包括：流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险、信息技术风险、合规风险等，风险状况及其应对措施如下：

(1) 流动性风险

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

公司流动性风险主要包括资产流动性风险和负债流动性风险。资产流动性风险是指公司所持资产不能及时变现或变现成本过高，导致自营投资及客户资产损失的可能；负债流动性风险是指由于公司缺乏现金，不能维持正常的业务支出或不能按时偿还债务，以及流动资金不足以应对客户大规模赎回公司管理产品的风险。此外，投资银行业务大额包销及自营业务投资规模过大、期限不匹配、长期资产比例过高等因素，都可能导致公司资金周转不畅，出现流动性困难的状况。

为控制和防范流动性风险，公司通过丰富融资渠道，综合运用多种融资方式均衡债务到期分布，提高融资的多元化和稳定程度；监控净资本、流动性等风险控制指标，合理配置各项业务规模，做到业务规模与公司资本实力相匹配；积极运用现金流缺口、压力测试等管理工具，确保融资安排和业务用资的匹配；建立充足的流动性资产储备，制定流动性应急管理计划，以确保公司流动性危机应对的及时性和有效性。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司流动性覆盖率（LCR）和净稳定资金率（NSFR）分别为 176.02%和 151.66%，均符合监管要求，报告期内未发生重大流动性风险事件。

金融负债按剩余到期日分类

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数						
	账面价值	未折现合同金额	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年-5 年	5 年以上
应付短期融资款	3,386,823,021.21	3,427,435,072.79	164,500,443.96	217,494,166.58	3,045,440,462.25		
拆入资金	2,407,134,499.87	2,414,177,561.65	1,407,196,739.73	1,006,980,821.92			
交易性金融负债	622,547,367.97	622,547,367.97	523,784,529.23	90,447,390.68	2,303,100.50	6,012,347.56	
卖出回购金融资产款	21,072,631,177.76	21,083,890,823.84	21,052,835,510.14	30,122,387.73	932,925.97		
应付债券	12,979,277,733.07	14,327,114,657.70		22,697,586.55	8,591,444,983.81	5,712,972,087.34	
租赁负债	114,074,885.90	124,397,844.56	1,449,682.16	8,518,276.10	34,286,250.55	67,804,558.98	12,339,076.77
衍生金融负债	5,515,932.91	5,515,932.91	5,515,932.91				
应付款项	99,763,100.89	99,763,100.89	99,763,100.89				
其他应付款	291,586,757.83	291,586,757.83	291,174,189.14		412,568.69		
代理买卖证券款	14,382,125,029.05	14,382,125,029.05	14,382,125,029.05				
应付股利	38,020,702.61	38,020,702.61	38,020,702.61				
合 计	55,399,500,209.07	56,816,574,851.80	37,966,365,859.82	1,376,260,629.56	11,674,820,291.77	5,786,788,993.88	12,339,076.77

(2) 市场风险

公司面临的市场风险是指所持金融工具的公允价值因市场价格不利变动而使公司发生损失的风险，包括股票、基金及衍生品等权益类证券价格风险、利率风险以及汇率风险等。

为有效控制市场风险，公司董事会确定公司市场风险容忍度和重大风险限额，公司经理层下设投资决策委员会在董事会授权范围内确定业务市场风险限额，并以授权的形式分解至业务部门、分支机构及子公司监督执行。公司定期结合市场和自身业务开展情况对风险限额进行调整，确保业务市场风险整体可控、可承受。公司风险指标限额主要包括：业务规模、风险价值（VaR）、基点价值、希腊字母值、净敞口、投资集中度等，能够对整体市场风险进行有效管控。公司定期开展市场风险压力测试和敏感性分析，准确评估压力情景下可能损失，压力测试结果为业务决策提供依据。公司还通过投资库管理、盯市监测、风险对冲等措施对市场风险进行管理。

截至 2021 年 12 月 31 日，针对公司持有的固定收益类投资组合进行敏感性分析，假设收益率曲线水平变动 100 个基点对利润总额和股东权益的影响如下：

单位：元 币种：人民币

利率变动	利润	股东权益
上升 100 个基点	-549,053,156.69	-287,179,754.05
下降 100 个基点	572,287,593.45	293,245,541.88

截至 2021 年 12 月 31 日，针对投资组合进行股票价格敏感性分析和利率敏感性分析。根据历史数据计算 VaR 值(99%置信区间)，观察 1 个交易日风险价值如下：

单位：万元 币种：人民币

项目	期末数	本期最高	本期最低	本期平均
股价敏感型金融工具	2,906	4,945	2,176	3,671
利率敏感型金融工具	4,851	5,145	511	1,724
整体组合	7,757	10,090	2,687	5,395

(3) 信用风险

信用风险是指在交易对手或公司持有证券的发行人无法履行合同义务的情况下给公司造成损失的风险，以及公司持有证券的发行人信用状况发生恶化情况下给公司造成损失的风险。公司面临的信用风险主要包括：融资融券、约定购回式证券交易以及股票质押回购等融资类业务信用风险，债券类投资交易信用违约风险，场外衍生品交易对手违约风险，针对代理客户买卖证券及期货结算资金不足风险。

为有效控制融资类业务信用风险，公司通过对客户进行风险教育、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，建立担保物范围及折算率、保证金比例、履约担保比例的标准，对质押融资业务规模和集中度进行限额管理，对质押标的和客户信用风险进行监测等措施进行管理。为有效控制债券投资信用风险，通过对投资集中度限额管理、债项内部评级、债券信用风险监测、交易授信管理、控制信用风险敞口等措施管理信用风险；为有效控制场外衍生品业务交易对手信用风险，通过交易对手进行尽职调查、信用评级和交易规模授信管理，

盯市监测、担保物管理、追保、处置担保品等措施管理信用风险。为有效控制代理客户买卖证券及期货结算信用风险，以保证金结算方式对信用风险进行有效控制。

截止 2021 年末，公司融资融券业务整体维持担保比例为 387.62%，约定购回业务整体履约保障比例为 375.22%，股票质押回购业务整体履约保障比例为 376.66%。

(4) 操作风险

操作风险是指由不完善或有问题的内部程序、人员、信息技术系统，以及外部事件造成损失的风险。具体包括外部欺诈，就业制度和 workplace 安全，客户、产品和业务活动，实物资产损坏，营业中断和信息技术系统瘫痪，执行、交割和流程管理等操作风险。

为有效控制操作风险，公司制定了操作风险管理办法，建立了操作风险偏好、容忍度，将公司各业务条线、各操作环节的风险情况进行梳理，不断完善内控流程，强化对操作风险的主动识别、发现、评估和报告；通过综合应用操作风险管理三大工具，对日常运营中的风险进行管控，及时收集和分析操作风险损失事件相关数据，提高操作风险管理效率；持续完善公司新业务、新产品及子公司的风险评估和风险控制，制定应急处置预案；不断优化操作风险管理系统，通过规范化、电子化、一体化的操作风险管理平台，对操作风险进行全面管理；通过多种途径开展操作风险管理培训，树立员工操作风险管理理念，增强员工风险防范意识，持续提升公司的核心竞争力。

报告期内，公司操作风险整体可控，未发生重大操作风险事件。

(5) 声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件、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，不利正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。

为有效控制声誉风险，公司建立了声誉风险管理办法、科学的组织架构以及完善的声誉风险管理机制，制定了声誉风险偏好和风险容忍度，持续识别监测评估报告公司声誉风险事项；公司不断通过宣导、培训等，提高工作人员声誉风险意识，积极防范声誉风险和应对声誉事件；公司设专门声誉风险管理岗和媒体宣传岗，负责公司声誉风险管理、声誉风险监测以及对外媒体管理工作，防范声誉风险升级扩散，最大程度降低声誉损失和负面影响；定期组织开展声誉风险管理考核，将考核结果应用于年度综合考核和人事管理体系进行管理，防范工作人员引发声誉风险。

报告期内，公司声誉风险整体可控，未发生重大声誉风险事件。

(6) 洗钱风险

洗钱风险是指公司在业务开展和经营管理过程中可能被洗钱和恐怖融资等违法犯罪活动利用而面临的合规风险、声誉风险、法律风险等系列风险和客户流失、业务损失等财务损失的风险。

为有效控制洗钱风险，公司将洗钱风险纳入全面风险管理，制定公司整体洗钱风险管理的风险偏好、风险容忍度，明确洗钱风险管理的组织架构和工作职责，成立反洗钱工作领导小组具体负责洗钱风险管理，确保洗钱风险整体可控。通过制定并有效执行各项洗钱风险管理相关制度流

程、建设反洗钱信息技术系统、相关部门及分支机构设置专、兼职反洗钱岗、建立客户洗钱和恐怖融资风险的等级管理机制等措施，保障了公司反洗钱工作有效落实开展。不断开展受众广泛的宣传与培训，提升公司各个层级员工的反洗钱工作意识。积极组织开展客户身份重新识别工作，对不同洗钱风险等级和不同身份信息完善程度的客户分别设置不同的管控措施。

报告期内，公司洗钱风险管理工作有序开展，未发生洗钱风险事件。

(7) 信息技术风险

信息技术风险主要是指各种内、外部原因造成公司信息技术系统和通信系统无法提供正常服务，影响公司正常业务办理，进而影响公司的声誉和服务质量，甚至会带来经济损失和法律纠纷的风险。

为有效控制信息技术风险，公司持续深化数字化转型，加强信息系统建设和管理，加大对信息安全、云计算应用、基础设施新增和更新等方面的投入；加强同城灾备和异地灾备系统建设，持续完善各类系统应急预案，加强系统运行监控，定期完成信息系统的运行评估和应急演练工作；优化网络结构，加强网络运行监控，定期做好网络安全漏洞扫描工作，及时更新防病毒软件。

报告期内，公司信息技术风险整体可控，重要信息技术系统安全稳定运行。

(8) 合规风险

合规风险是指证券公司或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律、法规或准则，从而使证券公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。

为有效控制合规风险，公司通过建立切实可行的合规管理体系，实现对合规风险的有效识别、评估和管理，形成合规考核、培训等长效机制，为公司各项业务依法合规经营提供有效支持和监督。主要措施包括：严格遵守外部法律规定和监管要求，不断强化制度建设、员工执业行为、反洗钱管理和隔离墙管理等各项合规管理工作；公司推崇全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础的理念，倡导和推进合规文化建设，培育全体工作人员的合规意识，并采取有效措施保障合规管理人员职业荣誉感和专业化、职业化水平；公司建立了董事会及监事会、经理层及合规总监、合规部门及各部门、各分支机构及各层级子公司四级合规管理组织体系，通过事前合规审查，事中合规监测、事后合规检查等流程，防范重大合规风险发生。

3. 动态的风险控制指标动态监控和补足机制建设情况

公司建立并执行风险控制指标的动态监控机制，根据监管标准及创新业务的开展情况，持续升级和优化净资本系统，每日计算各项风险控制指标，按照预先设定的阈值和监控标准对风控指标进行自动预警。同时，定期向监管部门报告风险控制指标数据和达标情况，发生风控指标不利变动及超预警、超限情况及时向当地证监局报告基本情况、问题成因、解决措施等。此外，公司制订了《风险控制指标动态监控管理办法》，对净资本等风控指标的计算规则、方法和流程予以明确，通过建立净资本与风险控制指标监控系统，实施净资本与风险控制指标的动态监控和自动预警机制，实现动态监控。

公司制订了《西南证券股份有限公司资本补充管理办法》，完善了净资本补足机制。净资本补足途径包括但不限于限制资本占用程度高的业务发展、采用风险缓释措施、制定资本工具的类型、发行规模、发行市场、投资者群体、定价机制以及相关政策问题的解决方案等。已发行资本工具附有减记或转股条款的，根据约定或监管规定进行减记或转股；调整资本补充期间分红政策，根据需要暂缓、推迟或免除向股东分红；确保各项风险控制指标持续符合监管标准，提高公司吸收损失和抵御风险的能力。

报告期内，公司净资本和流动性等各项风险控制指标均持续符合监管要求，不存在不符合监管标准的情形；截至报告期末，母公司净资本为 158.83 亿元。

4. 公司合规风控及信息技术投入情况

公司高度重视合规管理和风险管理，不断加强内控管理体系和制度建设，持续强化全面风险管理能力，有效管理和控制各类风险，保障公司稳健运行。2021 年，公司合规风控方面投入 0.96 亿元，主要为合规风控人员薪酬、合规风控系统建设投入等。

公司近年来不断加强信息系统建设，着力增强金融科技自主研发能力，提高信息技术对公司运营管理支撑力度。2021 年，公司信息技术方面投入 1.99 亿元，主要为系统建设投入、信息技术日常支出及人员薪酬等。

(五) 其他

适用 不适用

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

适用 不适用

第四节 公司治理

一、公司治理相关情况说明

适用 不适用

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》及《公司章程》的规定，制定了《股东大会议事规则》《董事会议事规则》和《监事会议事规则》《总裁工作细则》，建立了符合现代企业制度要求的法人治理结构，公司股东大会、董事会、监事会及经理层的职责权限清晰、明确，形成了权力机构、决策机构、监督机构和经理层之间权责明确、运作规范的相互制衡机制。

股东大会是公司的最高权力机构。董事会是股东大会的执行机构，对股东大会负责。公司董事会成员人数、人员构成、专门委员会的设置与构成符合法律、法规的要求。公司董事会设立了战略委员会、审计委员会、风险控制委员会、薪酬与提名委员会、关联交易决策委员会等 5 个专门委员会，并制定了相应委员会的工作细则，明确了其权责、议事规则和决策程序。公司董事会设 3 名独立董事，制定了《独立董事工作制度》，保证董事会决策的客观性和科学性。公司设监事会，行使监督职责，对股东大会负责，维护公司和股东及其他利益相关者的合法权益。公司经理层设总裁 1 名，主持公司的经营管理工作，设副总裁、董事会秘书、合规总监、首席风险官、首席信息官等，负责所分管领域相关工作。

报告期内，公司股东大会、董事会及专门委员会、监事会会议的通知、召开、表决程序和决议内容均符合《公司法》和《公司章程》等的规定。公司董事、监事依照法律法规和公司章程勤勉尽职地履行职责和义务，独立董事依据《独立董事工作制度》认真审议议案并发表独立意见，充分保障股东依法行使权利。

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

作为公司控股股东，持续注重并坚持在资产、人员、财务、机构以及业务等方面与公司保持相互独立，充分尊重公司独立法人地位，严格遵照相关法律法规及规范性文件、公司章程等的规定，规范行使股东权力、履行股东义务。

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

适用 不适用

三、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2021 年第一次临时股东大会	2021 年 1 月 8 日	http://www.sse.com.cn	2021 年 1 月 9 日	审议通过《关于确认聘请公司 2020 年度年报审计及内部控制审计中介机构的议案》，内容详见披露当日公司刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
2020 年年度股东大会	2021 年 5 月 26 日	http://www.sse.com.cn	2021 年 5 月 27 日	审议通过《关于公司 2020 年度董事会工作报告的议案》等 7 项议案，内容详见披露当日公司刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
2021 年第二次临时股东大会	2021 年 12 月 30 日	http://www.sse.com.cn	2021 年 12 月 31 日	审议通过《关于确认聘请 2021 年公司年报审计及内部控制审计中介机构的议案》等 3 项议案，内容详见披露当日公司刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。

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

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
吴 坚	董事长	男	58	2021.9.6	至今					81.23	否
	总裁			2016.7.18							
彭作富	董事	男	60	2020.5.29	至今					10	是
张纯勇	董事	男	56	2017.3.21	至今					73.63	否
	副总裁			2009.2.15							
张 刚	董事	男	59	2017.5.3	至今					0	是
万树斌	董事	男	58	2017.5.3	至今					0	否
赵如冰	独立董事	男	65	2017.5.3	至今					16	否
罗 炜	独立董事	男	47	2017.5.3	至今					16	否
傅达清	独立董事	男	55	2017.5.3	至今					16	否
廖庆轩	原董事长	男	60	2016.7.15	2021.9.3					58.31	否
倪月敏	监事会主席	女	56	2019.6.5	至今					39.63	否
徐 平	监事	男	60	2019.11.20	至今					10	是
严 洁	职工监事	男	42	2020.7.23	至今					183.24	否
李 勇	副总裁	男	55	2009.2.15	至今					71.67	否
侯曦蒙	副总裁	女	51	2010.9.16	至今					71.86	否
李 军	董事会秘书	男	48	2021.4.23	至今					269.95	否
赵天才	合规总监	男	49	2020.10.12	至今					149.05	否
张宏伟	首席风险官	男	58	2020.10.12	至今					151.94	否
林 林	首席信息官	男	60	2020.3.30	至今					131.45	否
蒲 锐	副总裁	男	48	2015.4.30	2021.5.31					52.06	否
合计	/	/	/	/	/				/	1,402.02	/

姓名	主要工作经历
吴 坚	研究生，中共党员，现任公司党委书记、董事长、总裁，西证国际投资有限公司董事长，西证国际证券股份有限公司董事会主席，银华基金管理股份有限公司董事，中国证券业协会托管结算委员会主任委员。吴坚先生曾任重庆证监局上市处处长；重庆渝富资产经营管理集团有限公司党委委员、副总经理；重庆东源产业投资股份有限公司董事长；重庆上市公司董事长协会秘书长；安诚财产保险股份有限公司副董事长；重庆银海融资租赁有限公司董事长；西南药业股份有限公司独立董事；西南证券股份有限公司董事；西南证券股份有限公司副总裁；重庆股份转让中心有限责任公司董事长、总裁；重庆仲裁委仲裁员；上交所第四届理事会会员自律管理委员会委员；中国证券业协会国际业务委员会副主任委员；重庆市证券期货业协会会长。
彭作富	研究生，正高级经济师，中共党员，现任公司董事，重庆渝富控股集团有限公司总法律顾问。曾在中共四川省乐至县委、四川省乐至县童家区公所、乐至县统计局、审计署驻重庆特派员办事处、重庆渝富资产经营管理集团有限公司、贵州渝富能源股份有限公司、重庆汽车金融有限公司、重庆市再担保有限责任公司、重庆金融后援服务有限公司、重庆渝富资本运营集团有限公司等单位工作，曾任四川省乐至县童家区公所副区长，乐至县统计局副局长、党组书记兼局长，审计署驻重庆特派员办事处审计业务三处副处长、计算机审计处处长，贵州渝富能源股份有限公司董事长，重庆渝富资产经营管理集团有限公司监事会办公室主任、审计部部长、总法律顾问，重庆市再担保有限责任公司监事会主席，重庆渝富资本运营集团有限公司总法律顾问，重庆金融后援服务有限公司监事会主席。
张纯勇	硕士研究生，中共党员，现任公司党委委员、董事、副总裁。张纯勇先生于 1984 年参加工作，曾任解放军第 324 医院、第三军医大学附一院医生；重庆市出入境检验检疫局第一检验监管处副科长、科长、副处长；重庆证监局上市公司监管处负责人；西南合成制药股份有限公司（现为北大医药股份有限公司）董事长；重庆市人民政府金融工作办公室上市公司处处长、证券处处长；西南证券有限责任公司副总裁；西证创新投资有限公司董事长；重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司董事长；重庆西证小额贷款有限公司董事长；西证股权投资有限公司董事；西证重庆股权投资基金管理有限公司董事；西证国际投资有限公司董事；西证国际证券股份有限公司董事；西南期货有限公司董事长。
张 刚	工商管理硕士，高级经济师，中共党员，现任公司董事，重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司财务总监、董事、党委委员，中保保险资产登记交易系统有限公司董事。张刚先生曾在中国农业银行、中国长城信托投资公司、银河证券、亚洲证券等单位工作，先后任重庆渝富资产经营管理集团有限公司办公室主任、总经理助理（兼办公室主任）；重庆城市公共交通站场集团有限公司党委委员、副总经理等职务。
万树斌	大学本科学历，中共党员，现任公司董事，建投华科投资股份有限公司监事长。万树斌先生曾任中国建设银行会计部财务处副处长，计财部购建处副处长、处长，资债部利率处高级经理；中国建银投资有限责任公司财务会计部副总经理、业务总监；中投科信科技股份有限公司党委副书记、董事、总经理；中国建银投资有限责任公司集中采购办公室负责人、资产管理分公司副总经理、财务资金部业务总监、风险管理部总经理；建投华文投资有限责任公司纪委书记、监事长。
赵如冰	金融学硕士，研究员级高级工程师，中共党员，现任公司独立董事，深圳市深粮控股股份有限公司独立董事，博时基金管理有限公司独立董事。赵如冰先生曾任葛洲坝水力发电厂主任；葛洲坝至上海超高压直流输电葛洲坝站站站长、书记；华能南方开发公司党组书记、总经理；华能房地产开发公司党组书记、总经理；长城证券有限责任公司董事、副董事长、党委副书记；景顺长城基金管理有限公司董事长；阳光资产管理股份有限公司副董事长；广东威华股份有限公司独立董事，百隆东方股份有限公司独立董事。
罗 炜	会计学博士，中共党员，现任公司独立董事，北京大学光华管理学院会计学系副教授、副系主任，信华信技术股份有限公司独立董事，中电科技（北京）股份有限公司独立董事。罗炜先生曾任中南财经大学会计学院助教；北京大学光华管理学院会计系助理教授（讲师）；北京数

	字认证股份有限公司独立董事、北京汇冠新技术股份有限公司独立董事、华油惠博普科技股份有限公司独立董事、新晨科技股份有限公司独立董事、东旭蓝天新能源股份有限公司独立董事。
傅达清	法学硕士，现任公司独立董事，泰和泰律师事务所律师，重庆水务集团股份有限公司独立董事，上海丰华（集团）股份有限公司独立董事，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，中国海事仲裁委员会仲裁员。傅达清先生曾任重庆工商大学英语讲师；重庆渝和律师事务所律师；重庆城市交通开发投资（集团）有限公司外部董事；重庆粮食集团有限责任公司外部董事。
廖庆轩	硕士研究生，高级经济师，中共党员，报告期内曾任公司董事长、党委书记。廖庆轩先生曾在中国人民银行重庆分行、中国工商银行重庆分行、华夏证券重庆公司、重庆市证券管理办公室筹备组、重庆市商业银行、重庆市国资委、重庆渝富资产管理集团有限公司、重庆市人民政府等单位工作，先后任重庆市商业银行行长；重庆市国资委副主任（正厅局长级）；重庆市人民政府副秘书长（正厅局长级）；重庆渝富资产管理集团有限公司董事长、党委书记；重庆市国资委主任、党委副书记等职务；第十二届全国人大代表。
倪月敏	工商管理硕士、中国注册会计师协会非执业会员及高级会计师，中共党员，现任公司监事会主席、党委委员。倪月敏女士曾任四川省重庆市财政局沙坪坝区驻厂工作组驻厂员，四川省重庆市财政局企财一处科员，四川省重庆市财政局企财一处副主任科员，重庆市财政局企财一处主任科员，重庆市财政局企业一处副处长，重庆市国有资产监督管理委员会考核分配处处长，重庆市国有资产监督管理委员会产权管理处处长，重庆银行股份有限公司党委委员、副行长、董事；重庆农村商业银行股份有限公司党委委员、监事会主席。
徐平	研究生学历，中共党员，正高级工程师，现任公司监事，重庆市城市建设投资（集团）有限公司副总经理、党委委员。徐平先生曾任贵州省水利水电勘测设计院项目设计总负责人、水工专业负责人；重庆市水利电力建筑勘测设计研究院土建设计室主任；重庆市城市建设投资公司工程部经理助理、副经理（主持工作）、经理，并先后兼任石桥铺立交、四公里立交建设项目部经理；重庆港务（集团）有限公司副总经理、党委委员，兼任重庆港寸滩港区建设指挥部指挥长；重庆港务物流集团有限公司副总经理、党委委员，兼任重庆港务物流建设投资公司董事长；重庆市城市建设投资（集团）有限公司副总经理、党委委员兼任重庆渝开发股份有限公司第七届、第八届董事会董事长，重庆渝开发股份有限公司党委书记。
严洁	经济学硕士，中共党员，现任公司职工监事，西证创新投资有限公司总经理。严洁先生曾任西南证券有限责任公司长江二路证券营业部高级客户经理，公司合规与风险管理部业务合规岗、武汉中北路证券营业部总经理助理、合规与风险管理部经纪业务风险监控岗、法律合规部经纪业务合规岗、法律合规部总经理助理、法律合规部副总经理，合规部副总经理兼西证创新投资有限公司合规总监、首席风险官。
李勇	研究生，中共党员，现任公司副总裁、党委委员。李勇先生于 1988 年参加工作，曾任中国人民银行重庆市分行非银处市场科科长；中国证券监督管理委员会重庆监管局上市处副处长；重庆国际信托投资有限公司（现重庆国际信托股份有限公司）党委委员、工会主席兼综合管理部总经理；西南证券有限责任公司办公室主任、副总裁、合规总监；西证股权投资有限公司董事；西证创新投资有限公司董事；西证重庆股权投资基金管理有限公司董事；公司合规总监、首席风险官。
侯曦蒙	硕士，中共党员，现任公司副总裁、党委委员。侯曦蒙女士于 1993 年参加工作，曾任西南证券有限责任公司人力资源部副总经理（主持工作）、经纪业务总部副总经理、办公室主任，公司总裁办公室主任；西证国际投资有限公司董事、总经理；重庆西证小额贷款有限公司董事。
李军	博士研究生，中共党员，现任公司董事会秘书、经纪业务事业部执行总裁兼运营管理部总经理，银华基金管理股份有限公司监事，西证创新投资有限公司董事。李军先生曾任西南证券有限责任公司成都营业部总经理助理、业务总监，经纪业务部副总经理，重庆市国资委副处长、处长兼重庆渝富资产管理集团有限公司外部董事，西南期货有限公司董事。
赵天才	计算机硕士、工商管理硕士，现任公司合规总监、首席反洗钱合规官、合规部总经理，西证股权投资有限公司董事、西证创新投资有限公司

	董事。赵天才先生曾任西南大学图书馆系统管理员，重庆有价证券公司营业部系统管理员，西南证券有限责任公司重庆胜利路证券营业部交易主管、徐州淮海西路证券营业部业务总监、风险管理部总经理助理、合规与风险管理部总经理助理，西南证券股份有限公司合规与风险管理部总经理助理、风险控制部副总经理、风险控制部总经理、职工监事。
张宏伟	工商管理硕士，现任公司首席风险官、风险控制部总经理、西证国际投资有限公司董事、西证国际证券股份有限公司执行董事。张宏伟先生曾任重庆有价证券公司南坪营业部总经理、交行南坪支行证券部副经理，西南证券有限责任公司重庆惠工路证券营业部总经理、重庆胜利路证券营业部总经理、上海定西路证券营业部总经理、经纪业务总部总经理，西南证券股份有限公司合规与风险管理部总经理、法律合规部总经理、合规部总经理、首席反洗钱合规官。
林 林	工学学士，中共党员，现任公司首席信息官。林林先生于 1982 年参加工作，曾任江苏南通无线电厂设计所产品负责人、设计师，重庆长江轮船公司通信导航处雷达室负责人。1992 年进入证券行业，具有 20 余年证券信息技术相关工作经验，曾任重庆有价证券公司总工程师，西南证券有限责任公司技术总监兼电脑中心总经理、信息技术中心总经理、清算中心总经理，公司信息技术部总经理、运营管理部技术总监、场外业务部技术总监。
蒲 锐	经济学硕士，中共党员，报告期内曾任公司副总裁、党委委员，西证国际投资有限公司董事、总经理，西证国际证券股份有限公司执行董事、行政总裁。蒲锐先生于 1994 年 8 月参加工作，曾任四川省证管办上市发行部副科长、科长；中国证券监督管理委员会成都证管办上市公司监管处副处长；中国证券监督管理委员会四川证监局上市公司监管一处副处长；中国证券监督管理委员会四川证监局上市二处处长（其间：2007 年 5 月至 2008 年 5 月挂职任四川省遂宁市人民政府市长助理）；中国证券监督管理委员会四川证监局稽查二处处长；公司总裁助理。

其它情况说明

√适用 □不适用

1. 公司董事长、监事会主席、高级管理人员 2021 年度的税前薪酬总额仍在确认过程中，待确认后再另行披露；
2. 以上人员披露的薪酬中包含 2021 年兑现的 2015-2017 年任期激励（如有），分别为：廖庆轩 24.38 万元、吴坚 41.6 万元、张纯勇 37.98 万元、李勇 36.07 万元、侯曦蒙 36.26 万元、蒲锐 33.75 万元。
3. 报告期内，公司将彭作富董事 2021 年度津贴支付至重庆渝富企业账户；将徐平监事 2021 年度津贴支付至重庆城投企业账户。
4. 2021 年 1 月 18 日，经公司第九届董事会第九次会议审议通过，同意聘任李军先生为公司董事会秘书。李军先生自 2021 年 4 月 23 日起正式任职，至公司第九届董事会终止履职之日止。
5. 2021 年 5 月 31 日，经公司第九届董事会第十一次会议审议通过，同意蒲锐先生辞去公司副总裁职务。
6. 2021 年 9 月 3 日，廖庆轩先生辞去公司董事长职务。
7. 2021 年 9 月 6 日，经公司第九届董事会第十三次会议审议通过，选举吴坚先生为公司董事长。

(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
彭作富	重庆渝富资本运营集团有限公司	总法律顾问	2019年9月	2021年6月
张刚	重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	财务总监、董事、党委委员	2012年4月	至今
徐平	重庆市城市建设投资(集团)有限公司	党委委员、副总经理	2010年8月	至今
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
吴坚	西证国际投资有限公司	董事长	2016年11月	至今
吴坚	西证国际证券股份有限公司	董事会主席	2016年11月	至今
吴坚	银华基金管理股份有限公司	董事	2016年8月	至今
彭作富	重庆渝富控股集团有限公司	总法律顾问	2020年4月	至今
彭作富	重庆金融后援服务有限公司	监事会主席	2019年1月	2021年12月
彭作富	重庆市再担保有限责任公司	监事会主席	2019年1月	2021年3月
张刚	中保保险资产登记交易系统有限公司	董事	2017年7月	至今
万树斌	建投华科投资股份有限公司	监事长	2020年5月	至今
赵如冰	深圳市深粮控股股份有限公司	独立董事	2019年2月	至今
赵如冰	百隆东方股份有限公司	独立董事	2016年8月	2021年5月
赵如冰	博时基金管理有限公司	独立董事	2017年11月	至今
罗炜	北京大学光华管理学院	会计学系副教授、副系主任	2011年8月	至今
罗炜	东旭蓝天新能源股份有限公司	独立董事	2019年3月	2021年9月
罗炜	信华信技术股份有限公司	独立董事	2020年12月	至今
罗炜	中电科技(北京)股份有限公司	独立董事	2022年3月	至今
傅达清	泰和泰律师事务所	律师	2015年10月	至今
傅达清	重庆水务集团股份有限公司	独立董事	2021年3月	至今
傅达清	上海丰华(集团)股份有限公司	独立董事	2021年9月	至今
严洁	西证创新投资有限公司	合规总监、首席风险官	2019年8月	2021年10月
严洁	西证创新投资有限公司	总经理	2021年10月	至今
李军	西证创新投资有限公司	董事	2020年5月	至今
李军	西南期货有限公司	董事	2017年5月	2021年3月
李军	银华基金管理股份有限公司	监事	2016年9月	至今
赵天才	西证股权投资有限公司	董事	2020年6月	至今
赵天才	西证创新投资有限公司	董事	2020年5月	至今
张宏伟	西证国际投资有限公司	董事	2022年4月	至今
张宏伟	西证国际证券股份有限公司	执行董事	2022年4月	至今
蒲锐	西证国际投资有限公司	董事、总经理 (其中2016年9-11月间代行)	2015年3月	2021年6月

		董事长职责)		
蒲锐	西证国际证券股份有限公司	执行董事、 行政总裁	2015年2月	2021年3月
在其他单位任职情况的说明	无			

(三)董事、监事、高级管理人员报酬情况

√适用 □不适用

董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序	根据《公司章程》，董事、监事报酬由股东大会决定，高级管理人员报酬由董事会决定。
董事、监事、高级管理人员报酬确定依据	公司董事、监事报酬标准参照上市券商水平及公司实际情况确定，高级管理人员的报酬按照公司薪酬制度确定，与绩效考核结果挂钩。
董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况	报告期内，公司董事、监事和高级管理人员应付报酬总额为1,402.02万元。报告期内公司未实行股权激励计划，没有非现金薪酬情况。
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	1,625.84万元。

注：报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬为报告期内向董事、监事、高级管理人员支付的归属于2021年的工资薪金及清算兑付的往年度薪酬。

(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
李军	董事会秘书	聘任
蒲锐	副总裁	离任
廖庆轩	董事长	离任
吴坚	董事长	选举

(五)近三年受证券监管机构处罚的情况说明

□适用 √不适用

(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
第九届董事会第九次会议	2021年1月18日	审议通过《关于确定公司管理层人员2019年度薪酬分配的议案》及《关于聘任公司董事会秘书的议案》两项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
第九届董事会第十次会议	2021年4月28日	审议通过《关于公司2020年度董事会工作报告的议案》等30项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
第九届董事会第十一次会议	2021年5月31日	审议通过《关于蒲锐先生辞职的议案》及《关于制定〈西南证券股份有限公司信息披露暂缓与豁免管理制度〉的议案》两项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。

第九届董事会第十二次会议	2021年8月24日	审议通过《关于公司2021年半年度报告的议案》等7项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
第九届董事会第十三次会议	2021年9月6日	审议通过《关于选举公司董事长的议案》及《关于调整公司董事会专门委员会成员的议案》两项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
第九届董事会第十四次会议	2021年10月29日	审议通过《关于公司2021年第三季度报告的议案》等7项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。
第九届董事会第十五次会议	2021年12月14日	审议通过《关于调整公司2021年度经营计划的议案》等10项议案，内容详见披露当日刊载于公司选定信息披露媒体的相关公告。

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
吴坚	否	7	7	0	0	0	否	3
彭作富	否	7	3	4	0	0	否	0
张纯勇	否	7	6	1	0	0	否	3
张刚	否	7	6	1	0	0	否	0
万树斌	否	7	1	6	0	0	否	0
赵如冰	是	7	2	5	0	0	否	1
罗炜	是	7	1	6	0	0	否	0
傅达清	是	7	3	4	0	0	否	2
廖庆轩	否	4	4	0	0	0	否	2

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	7
其中：现场会议次数	1
通讯方式召开会议次数	0
现场结合通讯方式召开会议次数	6

(二) 董事对公司有关事项提出异议的情况

适用 不适用

(三) 其他

适用 不适用

七、董事会下设专门委员会情况

适用 不适用

(一) 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
战略委员会	主任委员：吴坚；委员：彭作富、张刚、赵如冰（独立董事）

风险控制委员会	主任委员：吴坚；委员：张纯勇、万树斌
审计委员会	主任委员：罗炜（会计专业独立董事）；委员：张刚、傅达清（独立董事）
薪酬与提名委员会	主任委员：赵如冰（独立董事）；委员：罗炜（独立董事）、傅达清（独立董事）
关联交易决策委员会	主任委员：傅达清（独立董事）；委员：赵如冰（独立董事）、罗炜（独立董事）

(二) 报告期内战略委员会召开 2 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议
2021. 4. 27	听取公司《2020 年企业文化和建设工作推进与落实情况》及《2021 年企业文化和建设工作方案》	-
2021. 12. 14	审议《关于发行境内债务融资工具及一般性授权的议案》	同意提交董事会审议

(三) 报告期内风险控制委员会召开 3 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议
2021. 4. 27	1. 审议《关于公司 2020 年度合规报告的议案》 2. 审议《关于公司 2020 年度风险评估报告的议案》 3. 审议《关于公司 2021 年度自营投资额度的议案》 4. 审议《关于〈西南证券股份有限公司 2021 年度风险容忍度及重大风险限额指标〉的议案》 5. 审议《关于修订〈西南证券股份有限公司风险偏好〉的议案》 6. 审议《关于公司 2020 年度合规管理有效性评估报告的议案》 7. 审议《关于公司 2020 年度内部控制评价报告的议案》	同意提交董事会审议
2021. 8. 24	审议《关于公司 2021 年半年度风险评估报告的议案》	同意提交董事会审议
2021. 12. 14	1. 审议《关于修订〈西南证券股份有限公司内部控制缺陷认定标准〉的议案》 2. 审议《关于修订〈西南证券股份有限公司合规管理有效性评估实施办法〉的议案》	同意提交董事会审议

(四) 报告期内审计委员会召开 4 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议
2021. 4. 27	1. 沟通公司 2020 年财务审计情况 2. 审议《关于公司董事会审计委员会 2020 年度履职情况报告的议案》 3. 审议《关于公司 2020 年年度报告的议案》 4. 审议《关于公司 2021 年第一季度报告的议案》 5. 审议《关于公司 2020 年度财务决算报告的议案》 6. 审议《关于变更公司租赁相关会计政策的议案》 7. 审议《关于计提资产减值准备的议案》 8. 审议《关于公司 2020 年度内部控制评价报告的议案》 9. 审议《关于公司 2020 年度内部审计工作总结暨 2021 年度审计工作计划的议案》	同意提交董事会审议或听取

2021.8.24	1. 审议《关于公司 2021 年半年度报告的议案》 2. 审议《关于确认聘请 2021 年公司年报审计及内部控制审计中介机构的议案》	同意提交董事会审议
2021.10.29	审议《关于公司 2021 年第三季度报告的议案》	同意提交董事会审议
2021.12.14	1. 审议《关于部分募投项目资金使用延期的议案》 2. 审议《关于修订〈西南证券股份有限公司内部控制缺陷认定标准〉的议案》 3. 审议《关于公司 2020 年度反洗钱工作审计报告的议案》	同意提交董事会审议

(五) 报告期内薪酬与提名委员会召开 6 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议
2021.1.18	1. 审议《关于确定公司管理层人员 2019 年度薪酬分配的议案》 2. 审议《关于聘任公司董事会秘书的议案》	同意提交董事会审议
2021.4.27	审议《关于公司董事 2020 年度履职考核的议案》	同意提交董事会审议
2021.8.24	1. 审议《关于确定公司主要负责人 2020 年度和 2018-2020 年任期经营业绩考核结果的议案》 2. 审议《关于制定公司主要负责人 2021 年度和 2021-2023 年任期经营业绩考核目标的议案》 3. 审议《关于制定〈西南证券股份有限公司合规与风险管理人员薪酬管理办法〉的议案》	同意提交董事会审议
2021.9.6	1. 审议《关于选举公司董事长的议案》 2. 审议《关于调整公司董事会专门委员会成员的议案》	同意提交董事会审议
2021.10.29	审议《关于制定〈西南证券股份有限公司合规总监、首席风险官、首席信息官 2020 年度考核方案〉的议案》	同意提交董事会审议
2021.12.14	1. 审议《关于调整公司主要负责人 2021 年度经营业绩考核目标的议案》 2. 审议《关于〈西南证券股份有限公司经理层成员任期制和契约化管理工作方案〉的议案》 3. 审议《关于〈西南证券股份有限公司领导人员 2021 年度与 2021-2023 年任期考核方案〉的议案》	同意提交董事会审议

(六) 报告期内关联交易决策委员会召开 2 次会议

召开日期	会议内容	重要意见和建议
2021.4.27	审议《关于公司 2020 年度日常关联交易执行情况及预计 2021 年度日常关联交易的议案》	同意提交董事会审议
2021.12.14	审议《关于采购国资国企监管平台相关事宜的议案》	同意该审议事项

(七) 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。

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	2,131
主要子公司在职员工的数量	267
在职员工的数量合计	2,398
母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数	41
专业构成	
专业构成类别	专业构成人数
中后台部门	393
证券投资事业部	50
资产管理事业部	79
投资银行事业部	185
经纪业务事业部	1,255
中小企业融资部	50
场外业务部	22
研究发展中心	96
主要子公司	267
其他	1
合计	2,398
教育程度	
教育程度类别	数量（人）
博士研究生	23
硕士研究生	869
大学本科	1,384
大专及以下	122
合计	2,398

(二) 薪酬政策

√适用 □不适用

公司根据经营目标，结合证券行业特点，按照“公平、公正”的原则，以业绩为导向，搭建了市场化的员工薪酬体系。员工薪酬结构包括基本工资、绩效工资、福利等。按照《中华人民共和国劳动合同法》等相关法律、法规及地方政府的有关规定，公司为员工办理了各项社会统筹保险、住房公积金、企业年金。

(三) 培训计划

√适用 □不适用

2021 年公司培训工作以加强党性教育、完善人才梯队培养、提高业务水平为重点，以数字化学习、智慧培训体系建设为支撑，服务公司战略发展和员工的综合能力提升。在党性教育方面，针对领导干部开展十九届五中全会和党史轮训，实现重点人群全覆盖，全面强化公司员工党性、政治修养；在人才梯队培养方面，持续完善人才队伍培养体系，分层次推开各级梯队的培养工作，加强青年人才培育力度；在业务培训方面，根据公司战略部署以及市场变化，及时满足业务培训需求，精选师资、课题，强化内外部经验交流，为公司业务发展提供助力；开展系统性内部课程

体系梳理与课程开发，加强内部知识积累传承。组织“书香西证—修身立德读好书”活动，深入开展全员读书，并荣获重庆市“书香西证重庆全面阅读推广示范单位”称号。

2022 年，在有效应对、防控新冠疫情的前提下，进一步加快数字化培训建设，围绕公司业务战略落地、人才梯队建设、岗位簇技能提升等开展培训工作，全面提升员工政治素养和专业能力，进一步深化各层级人才梯队培养，服务公司人才与业务发展。

(四) 劳务外包情况

适用 不适用

(五) 证券经纪人情况

截至 2021 年末，公司 120 家证券分支机构共有经纪人 417 名，并已全部取得了证券经纪人资格。经纪人直接隶属于证券分支机构，不分序列和职级，经纪人的执业信息可通过公司网站、客户服务统一电话等方式进行查询。分支机构负责人作为第一管理责任人，全面负责本机构内部经纪人的管理工作，并接受公司总部的管理、协调和监督、检查。另外公司还建立经纪人风险监控系統，实现对经纪人日常风险的监控、评估及预警，有效控制经纪人风险。分支机构还定期通过面谈、电话、信函或者其他方式对经纪人招揽和服务的客户进行回访，了解经纪人的执业合规情况。

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

报告期内，公司严格遵行监管机构和公司章程关于现金分红比例的相关规定，未调整现金分红政策。公司 2020 年度利润分配方案由独立董事发表意见并经股东大会审批通过后实施，切实维护包括中小投资者在内的广大投资者合法权益。

(二) 现金分红政策的专项说明

适用 不适用

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

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

适用 不适用

十一、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

高管人员的考核按照有关部门对企业领导班子和领导人员综合考核评价相关规定执行，综合考核包括经营业绩考核、合规与反洗钱工作考核、党的建设考核、综合测评等。综合考核评价结果作为教育培养、管理监督、选拔任用、激励保障的重要依据。

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

公司按照《中华人民共和国证券法》《证券公司治理准则》《证券公司内部控制指引》《企业内部控制基本规范》及其配套指引等相关法律、法规和监管规则的要求，以《公司章程》为基础，制订了《内部控制制度》《合规管理制度》《风险管理制度》和《审计管理制度》等基本的内部控制制度，并在此基础上，根据公司业务发展的需要及风险控制要求，制定了涵盖公司治理、业务管理、合规管理、风险控制、人事行政、财务资金、信息技术、清算、审计等各项工作的七百余项制度，建立了内容完备、逻辑严密、结构完整的内部控制制度体系，实现了管理制度化、制度流程化以及制度对经营管理各方面的全覆盖，确保了公司经营管理、业务开展各项工作有章可循，对各项业务、各种风险进行有效防范和控制。公司不断健全内部控制制度，完善内部控制机制，围绕重点领域，制定了进一步加强内控体系建设的措施，促进内控体系持续优化。公司内部控制体系运转有效，能够保障各项业务规范、稳健、有序开展，为公司经营管理的合法合规、资产安全、财务报告及相关信息的真实完整，经营效率和效果的提高，发展战略的实现提供了合理保证。

公司通过持续健全合规检查、监督、有效性评估及合规考核、问责等机制督促制度的有效执行。公司通过合规检查与监督，及时发现并整改制度执行方面存在的问题，及时防范并控制相关的风险；至少每年开展一次合规管理有效性评估工作，将制度的建设及运行情况涵盖在内，重点关注制度是否健全、是否与外部法律法规等相一致、是否及时修订及完善、是否得到严格执行、是否及时发现并纠正有章不循、违规操作等问题；严格实施合规考核机制，对发现的违法违规行

为部门进行合规考核扣分，考核结果与其绩效直接挂钩；通过持续完善问责机制，强化对制度执行的监督力度。

2021 年，公司持续积极组织开展内部规章制度维护工作，不断提升规章制度的规范性，集中系统地优化完善规章制度 400 余项，确保制度体系持续符合法律、法规和准则的规定；通过各种内部控制管控措施，实现了对经纪业务、自营业务、资产管理业务、投资银行业务、资金、财务、信息技术、人力资源、分支机构及子公司等的有效管理，规范了各项业务的依法、合规操作，保障了公司健康持续发展。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

十三、报告期内对子公司的管理控制情况

适用 不适用

公司在法人治理框架下行使对子公司的股东权力，履行股东义务，通过制定并根据监管要求及行业动态及时修订完善《西南证券股份有限公司股权投资企业管理制度》《西南证券股份有限公司境外经营机构管理办法》《西南证券股份有限公司子公司合规管理办法》《西南证券股份有限公司境外子公司审计管理办法》《西南证券股份有限公司境外经营机构风险管理办法》《西南证券股份有限公司子公司信息系统建设管理办法》等制度，在组织人力、财务、资金管理、合规、风控、审计及信息系统建设方面实现对子公司的管理。

十四、内部控制审计报告的相关情况说明

适用 不适用

公司聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）对公司内部控制进行了审计，并于 2022 年 4 月 25 日出具了标准无保留意见的内部控制审计报告。

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

2021 年，按照监管机构统一部署，公司从历史沿革、组织架构、股东管理、内部控制、信息披露、社会责任等各方面对公司治理情况进行了全面梳理，顺利完成证监会上市公司治理专项自查工作，未发现公司相关治理问题。

十六、其他

适用 不适用

（一）公司合规管理体系建设情况

公司坚持“合规是公司生存基础”初衷，积极贯彻落实“合规从管理层做起”“合规创造价值”及“全员合规”理念，崇尚“做长期且正确的事”的发展战略，时刻践行“稳健”的企业文

化。在合规管理组织架构方面，公司确立了合规管理目标、理念与原则，搭建了董事会及监事会、经理层及合规总监、合规部和各部门、各分支机构、各层级子公司的四级合规管理组织体系，实现了合规管理对所有业务、各部门、各分支机构、各层级子公司和全体工作人员的全面覆盖。在合规管理制度体系方面，公司搭建了以《公司章程》《合规管理制度》为基础，包括 50 余项配套规章与工作流程在内的完备合规管理制度体系，涵盖了合规履职、考核、问责、员工执业管理、隔离墙、反洗钱、子公司合规管理等，引导合规体系顺畅运转与合规工作的有效实施。在合规管理人员配置方面，公司设合规部，并在各业务部门、各分支机构设置了合规管理团队或专兼职合规经理，向相关子公司选派合规负责人。在合规信息系统建设方面，公司建设了合规管理信息系统、监管数据报表报送系统，包括了反洗钱、信息隔离墙、员工执业行为管理以及合规考核、合规报告以及报表数据信息的生成、复核及报送等功能模块，有效支撑了公司相关合规管理工作的有效开展，提升了合规管理工作的效率与规范性、准确性。在合规文化宣导机制方面，通过制定员工执业行为管理办法，编发监管信息周报、合规信息传导、合规手册，全员签署《依法合规经营承诺书》《廉洁从业承诺书》等，以及线上及线下合规课程培训等方式，建立了系统、高效的合规文化宣导机制，将监管新规、行业监管案例与廉洁从业理念等方面内容及时传达至业务一线。

2021 年，公司合规管理组织体系各层级严格依规履职、紧密衔接，共同对公司及工作人员的经营管理和执业行为的合规性履行审查、监督、检查及报告等职责，对发现的合规风险或隐患及时进行规范整改，保障了公司经营管理与业务活动的总体规范有序、稳健运行。报告期内，公司以管理机制建立健全、重点工作扎实推进、日常工作高效开展为重点，不断深化合规管理建设。持续完善合规管理机制，结合北交所设立、中介机构归位尽责等外规要求修订完善业务规则，并就公司规章制度规范性、问责程序及业务条线合规管理机制的优化等开展专项工作；同时，继续扎实推进公司廉洁从业管理、合规文化建设等，有序推进新规落实与重点工作，保障了公司合规管理工作有序开展，不断提升公司合规管理水平。

（二）稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

2021 年，公司内部审计部门共计开展了 22 大项工作，认真履行内审机构的职责，在充分揭示内控管理缺陷的同时，加强与管理层及被审单位的沟通，以达成对发现的问题和整改措施的共识。针对审计发现的问题，共计提出了 160 余条整改建议。整改建议均得到了被审单位的认同，大多数发现的问题已完成整改；针对正在整改和尚未整改的问题，公司将进行持续跟踪和督导；对已整改的问题，公司亦将关注整改效果，切实履行审计促进公司提高经营管理的职能。

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

公司不属于重庆市重点排污单位。长期以来，公司重视节能环保，推行网上交易，实行在线办公，提供通讯方式参会渠道，做好环保宣导，提倡降耗增效，尽力降低对环境的影响。

(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

公司按照《重庆市垃圾分类管理办法》及渝国资《新建项目要同步规划建设污水和垃圾集中处理设施》与《防止固废垃圾再污染》的文件精神，与大楼建设顾问单位进行实地考察后，在总部大楼内增设重力式垃圾管道收集处理和餐厨垃圾回收处理等系统，实现了垃圾分类、环境监控，减少了垃圾二次污染，为员工创造绿色、洁净、健康的工作环境。

1. 重力式垃圾自动收集系统

重力式生活垃圾自动收集系统由楼层设置的智能投放口经垂直管道重力方式输送至 LG 层机房进行分类收集，系统由管道、垃圾存储节、缓冲器、气动装置、旋转机构及垃圾收集箱、排气过滤装置、排风机、过滤箱等组成，可实现垃圾自动分类收集，减少垃圾二次污染。

2. 厨房垃圾真空管道收集及资源化利用系统

餐厨垃圾真空管道收集及资源化利用系统由管道、投放口、气动阀门、传感器、气动装置、排气过滤装置、油水分离器、真空泵、过滤箱、提升泵等电气和控制部件组成，厨房设置的投放站设备将厨余垃圾粉碎后经真空管道输送至机房，由 LG 层餐厨垃圾降解箱自动降解，生成的有机肥进入传输打包机，有机肥可用于项目绿化使用。

3. 环境工程监控系统

大楼车库设置有甲醛、一氧化碳、二氧化碳传感器探头，办公楼层设置有甲醛、二氧化碳、温湿度传感器探头并接入大楼集中控制系统，对大楼的环境品质进行 24 小时实时监测，后期运行时可根据监测的实时数据对暖通系统进行调控，保障大楼室内空气质量。

(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

公司提倡绿色办公理念，降低能源消耗，实施节能减排，切实履行保护生态、防治污染、环境保护主体责任。

公司积极推行“节约能源，人人有责”方针，深入开展节能宣传活动，不断营造良好的节能工作环境和氛围；组织开展节能培训，不断提高员工的节能意识水准；持续开展“光盘行动”，公司食堂倡导不浪费粮食的光盘行动，效果显著。

公司以《公共机构节能条例》为落脚点，坚持节能标准，持之以恒的开展节能降耗工作，对办公场所电源、水源、办公电脑和办公设施设备做到人走必关闭；办公场所安装节能灯、办公设备统一设置节能运行模式、空调冬夏两季设置高低限温；职工食堂采用节能灶具、水龙头处设置节水标识；大额采购项目选择环保材料供应商、办公用品按需领用、打印纸双面使用；推行无纸化办公（OA 系统）、低碳办公（视频会议），大力降低办公的运行成本，从办公环境、办公方式等方面全面落实低碳环保要求。

二、社会责任工作情况

√适用 □不适用

报告期内，公司积极履行社会责任，有关内容详见 2022 年 4 月 27 日刊载于公司选定信息披露媒体的《西南证券股份有限公司 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，在中国证监会和重庆市委市政府的领导下，公司推进脱贫攻坚转入乡村振兴新阶段，充分发挥在资本市场的专业能力，通过捐赠帮扶、公益帮扶、消费支持等多种方式，助力相关地区巩固脱贫成果，推动乡村振兴发展。

一是持续开展对口帮扶工作。公司与酉阳县政府签署了《共同推进乡村振兴战略合作框架协议》，从县域企业上市培育、县级创投孵化基金建设与管理、金融专业知识培训、金融人才交流等方面提供服务支持；同时，向酉阳县捐赠资金 350 万元，并选派 2 名年轻干部担任驻村第一书记，为努力巩固拓展脱贫攻坚成果，助力推动乡村全面振兴贡献力量。

二是大力开展消费帮扶工作。公司不断加大力度，各地分支机构积极响应号召，投入消费帮扶工作。2021 年，公司以“以购代扶”的方式，积极支持偏远地区的农副产品销售，定点采购物资，消费帮扶酉阳县、城口县 70 余万元。同时，公司各地分支机构积极开展助销活动，鼓励公司员工采购了宁夏、湖南、四川、山西等地乡村的特色农产品。

三是继续做好金融支持工作。2021 年，公司为重庆涪陵、黔江、万盛等区县提供资金支持；完成重庆峡谷城文旅扶贫专项债，并运用“保险+期货”的业务模式服务乡村产业发展。

四是将扶贫与扶志、扶智相结合。2021 年，公司鼓励分支机构和广大员工向四川、湖北、山西、安徽等地区困难儿童和家庭捐赠物资 5 万余元；通过“西牛学苑”投教团队开展投资者教育和国民教育活动，向当地群众传播了最及时的投教知识及正确的投资观，帮助防范远离投资风险。

第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

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

√适用 □不适用

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
与再融资相关的承诺	股份限售	重庆渝富	认购的公司 2019 年度非公开发行股票自发行结束之日起 60 个月内不得转让。	2020 年 7 月至 2025 年 7 月	是	是	不适用	不适用
与再融资相关的承诺	股份限售	重庆城投	认购的公司 2019 年度非公开发行股票自发行结束之日起 36 个月内不得转让。	2020 年 7 月至 2023 年 7 月	是	是	不适用	不适用
与再融资相关的承诺	股份限售	重庆发展	认购的公司 2019 年度非公开发行股票自发行结束之日起 36 个月内不得转让。	2020 年 7 月至 2023 年 7 月	是	是	不适用	不适用
与再融资相关的承诺	股份限售	重庆地产	认购的公司 2019 年度非公开发行股票自发行结束之日起 36 个月内不得转让。	2020 年 7 月至 2023 年 7 月	是	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

公司自 2021 年 1 月 1 日起执行经修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》，具体内容详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 50. 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

	原聘任	现聘任
境内会计师事务所名称	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬	115	115
境内会计师事务所审计年限	1 年	1 年

注：上述境内会计师事务所报酬包含内部控制审计费用

	名称	报酬
内部控制审计会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙）	20

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

公司 2021 年第二次临时股东大会审议通过《关于确认聘请 2021 年公司年报审计及内部控制审计中介机构的议案》，同意聘请信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2021 年度年报

审计和内部控制审计中介机构，审计费为 115 万元（含异地差旅费）。有关内容详见 2021 年 12 月 31 日刊载于公司选定信息披露媒体的《2021 年第二次临时股东大会决议公告》。

因金融团队人员安排不能确定在既定日期前完成公司 2021 年度报表审计的全部工作，信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）主动辞任公司年报审计工作，公司就变更会计师事务所与信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）进行沟通，双方无异议。有关内容详见 2022 年 2 月 22 日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于变更会计师事务所的公告》。

公司 2022 年第一次临时股东大会审议通过《关于变更公司 2021 年度年报审计及内部控制审计中介机构的议案》，同意聘任天健会计师事务所（特殊普通合伙）为公司 2021 年度审计及内部控制审计中介机构，审计费为 115 万元（含异地差旅费）。有关内容详见 2022 年 3 月 10 日刊载于公司选定信息披露媒体的《2022 年第一次临时股东大会决议公告》。

审计期间改聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

公司前任会计师事务所为信永中和会计师事务所（特殊普通合伙），已为公司提供的审计服务年限为一年，上年度为公司出具了标准无保留意见的《审计报告》。信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）开展了前期基础工作，形成了初步审计计划，因其自身原因申请辞任公司 2021 年年报审计工作。有关内容详见 2022 年 2 月 22 日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于变更会计师事务所的公告》。

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

报告期内，公司不存在《上海证券交易所股票上市规则》规定的涉案金额超过 1,000 万元，并且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10%以上的重大诉讼、仲裁事项，其他涉案金额超过 1,000 万元的诉讼及进展情况如下：

（一）公司管理的资产管理计划股票质押式回购交易纠纷案（公司作为资产管理计划管理人，仅严格遵照委托人指令处理相关事务，案件的最终诉讼结果由委托人实际承受）

1. 公司申请执行庄敏股票质押式回购交易纠纷案

2017 年 10 月，公司作为“西南证券鹏瑞 2 号定向资产管理计划”管理人（公司未以自有资金出资），受该资管计划委托人委托，代表资管计划向重庆市高级人民法院提起诉讼，2018 年 6 月，法院判决被告庄敏支付融资本金 7.41 亿元、融资利息、违约金及律师费，判决公司对庄敏质押给公司的 7,800 万股“退市保千”（股票代码：600074）享有优先受偿权。2020 年 3 月 13 日，重庆第一中级人民法院作出（2019）渝 01 执 3 号罚款 1,000 元决定及限制消费令，但经查明本案执行人除涉案股票外无其他财产可执行，而该股票系本案轮候冻结，首轮冻结法院亦未向法院移送处置权。鉴于此，重庆市第一中级人民法院依法终结此次执行程序，申请执行人发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

2. 公司申请执行庄明、庄敏股票质押式回购交易纠纷案

2017 年 10 月，公司作为“西南证券鹏瑞 2 号定向资产管理计划”管理人（公司未以自有资金出资），受该资管计划委托人委托，代表资管计划向重庆市高级人民法院提起诉讼，2018 年 6 月，法院判决被告庄明支付融资本金 3.99 亿元、融资利息、违约金及律师费，判决公司对庄明质押给公司的 4,200 万股“退市保千”（股票代码：600074）享有优先受偿权，被告庄敏承担连带清偿责任。2020 年 5 月 26 日，公司向重庆第一中级人民法院申请司法划转 4,200 万股保千里股份，经查该股票已于 2020 年 5 月 26 日在上海证券交易所退市。鉴于此，重庆市第一中级人民法院依法终结此次执行程序，申请执行人发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

3. 公司申请执行云南兴龙实业有限公司、赵宁、王瑛琰股票质押式回购交易纠纷案

2018 年 9 月，公司作为“西南证券互利通 8 号定向资产管理计划”管理人（公司未以自有资金出资），受该资管计划委托人委托，代表该资管计划向重庆市高级人民法院提起诉讼，2018 年 12 月，法院判决被告云南兴龙实业有限公司支付融资本金 3 亿元、融资利息及违约金，判决被告赵宁、王瑛琰就判决确认的融资人债务，在公司对融资人持有的 5,280 万股“东方金钰”（股票代码：600086）实现质押权后仍不能清偿的部分承担连带清偿责任。公司于 2020 年 9 月收到重庆市高级人民法院裁定，重庆市高级人民法院已强制执行被告云南兴龙实业有限公司对第三人云南景城集团有限公司的到期债权 900.82 万元。2020 年 12 月，重庆市高级人民法院下达裁定，将案件指定给重庆市第一中级人民法院执行，目前该案其余未执行部分尚在执行过程中。

4. 公司申请执行新光控股集团有限公司股票质押式回购交易纠纷案

2018 年 11 月，公司作为“西南证券鑫沅质押 1 号定向资产管理计划”管理人（公司未以自有资金出资），受该资管计划委托人委托，代表资管计划向重庆市高级人民法院提起诉讼，后案件移送至浙江省金华市中级人民法院。2020 年 1 月，法院判决被告新光控股集团有限公司支付本金 8 亿、利息 47,226,666.67 元、违约金 82,460,000 元（合计 929,686,666.67 元）及律师费 70 万元；确认公司在前述债权范围内对被告质押的 175,382,658 股“新光圆成”（股票代码：002147）折价或拍卖、变卖所得价款享有优先受偿权。

报告期后,2022年3月,公司与资管计划委托人及相关方签署协议,将上述诉讼涉及的债权、担保权利及附属权益全部转让给资管计划委托人并办理了移交手续。后续,资管计划委托人将作为债权人直接行使破产债权受偿等相应权利,并自行承担相关责任和风险。

5. 公司诉北京北大未名生物工程集团有限公司股票质押式回购交易纠纷案

2020年1月,公司作为“西南证券鹏瑞3号定向资产管理计划”管理人(公司未以自有资金出资),按照该资管计划委托人指令,代表该资管计划向深圳市福田区人民法院提起实现担保物权申请。2020年5月,法院裁定准许拍卖、变卖被申请人北京北大未名生物工程集团有限公司持有的57,204,000股“未名医药”(股票代码:002581);公司就处分上述股票及孳息所得价款在债权本金787,076,920元、利息56,803,945.6元及逾期利息、违约金之范围内享有优先受偿权。被申请人北京北大未名生物工程集团有限公司提出异议后被深圳市福田区人民法院驳回,现该案已进入执行程序。

6. 公司诉韩华、杨立军、陈红、什邡星昇投资管理合伙企业(有限合伙)股票质押式回购交易纠纷案

2020年7月,公司作为“西南证券鑫沅质押1号定向资产管理计划”管理人(公司未以自有资金出资),受该资管计划委托人委托,代表资管计划向重庆市第一中级人民法院提起诉讼,申请融资人韩华偿付本金人民币400,000,000.00元及相关利息、违约金、律师费等,对韩华质押给公司的6,402.636万股新研股份(股票代码:300159)限售流通股享有优先受偿权;申请被告杨立军承担连带清偿责任;申请对被告什邡星昇投资管理合伙企业(有限合伙)质押给公司的1,055万股新研股份(股票代码:300159)限售流通股享有优先受偿权;申请对被告陈红质押给公司的德阳中衍泰富投资管理有限公司的59%的股权享有优先受偿权。2021年7月,重庆市第一中级人民法院出具《民事判决书》,判决被告韩华于本判决生效后十日内向公司偿还融资本金400,000,000元及相关利息、违约金、律师费等(以下简称给付义务);被告杨立军对被告韩华在本判决所负的给付义务向公司承担连带清偿责任;公司有权在被告韩华未履行本判决所确定的给付义务范围内,对被告韩华所持有的6,402.636万股新研股份(股票代码:300159)限售流通股折价、拍卖或者变卖所得价款优先受偿;被告什邡星昇投资管理合伙企业(有限合伙)对被告韩华在本判决中所负的给付义务之不能清偿部分的二分之一向公司承担赔偿责任;公司有权在被告韩华未履行本判决所确定的给付义务范围内,对被告陈红所持有的德阳中衍泰富投资管理有限公司的59%股权折价、拍卖或者变卖所得价款优先受偿。因什邡星昇投资管理合伙企业(有限合伙)不服一审判决向重庆市高级人民法院提请上诉,现该案件进入二审阶段。

7. 公司诉杨立军、韩华、黄云辉、什邡星昇投资管理合伙企业(有限合伙)、陈红股票质押式回购交易纠纷案

2020年12月,公司作为“西南证券双喜聚金1号集合资产管理计划”(以下简称资管计划)管理人,代表资管计划向深圳市福田区人民法院申请实现担保物权的特别程序,分别申请杨立军、韩华、黄云辉、什邡星昇投资管理合伙企业(有限合伙)(以下统称被申请人)就杨立军和公司

签订的新研股份（股票代码：300159）股票质押式回购交易承担违约责任或担保责任，准许拍卖、变卖被申请人持有的 3,717.0964 万股新研股份（股票代码：300159）股票，公司就处分上述股票及孳息所得价款在债权本金 230,000,000 元及相应利息、违约金、律师费、保函费范围内享有优先受偿权，上述案件申请费、保全费、保全担保费等实现债权的全部费用由被申请人承担。

2021 年 3 月，公司代表该资管计划向深圳市福田区人民法院撤回实现担保物权的申请，并另行向重庆市第一中级人民法院提起诉讼，申请被告杨立军就新研股份（300159）股票质押式回购交易承担违约责任，偿还本金人民币 230,000,000.00 元及相关利息、违约金、诉讼费、诉讼保全保险费、律师费等（以下简称诉讼请求）；申请被告韩华就上述诉讼请求所述债务承担连带责任；申请在被告杨立军未履行上述诉讼请求所述债务范围内，公司有权对被告杨立军、韩华、黄云辉、什邡星昇投资管理合伙企业（有限合伙）质押给公司的新研股份股票和被告陈红质押给公司的霍山鑫盛股权投资合伙企业（有限合伙）实缴 4,186 万元的财产份额及收益折价、拍卖或者变卖所得价款优先受偿；申请全部诉讼费用由上述各位被告共同承担。

2022 年 4 月，公司（代资产管理计划）收到重庆市第一中级人民法院出具《民事判决书》判决被告杨立军于本判决生效后十日内向公司偿还融资本金约 2.25 亿元及相关利息、违约金、律师费（以下简称给付义务）；被告韩华对被告杨立军在本判决所负的给付义务向公司承担连带清偿责任；公司有权在被告杨立军未履行本判决所确定的给付义务范围内，对被告杨立军持有的 2516086 股新研股份（证券代码 300159）、被告韩华持有的 1500000 股新研股份（证券代码 300159）、被告黄云辉持有的 3190000 股新研股份（证券代码 300159）折价、拍卖或者变卖所得价款优先受偿；被告什邡星昇投资管理合伙企业（有限合伙）、被告陈红在各自担保物价值范围内，对被告杨立军在本判决中所负的给付义务之不能清偿部分的二分之一向公司承担赔偿责任。一审判决尚未生效。

公司作为该资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金 2,300 万元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。

（二）公司管理的资产管理计划债券违约纠纷案（公司作为资产管理计划管理人，仅严格遵照委托人指令处理相关事务，案件的最终诉讼结果由委托人实际承受）

1. 公司诉安徽省外经建设（集团）有限公司债券违约纠纷案

2019 年 8 月 23 日，公司作为“西南证券-双喜金债广农商 1 号定向资产管理计划”、“西南证券双喜金债 7 号集合资产管理计划”（以下简称资管计划）管理人，代表资管计划向重庆市第一中级人民法院提起诉讼，2020 年 8 月，法院判决被告安徽省华安外经建设（集团）有限公司支付债券回售本金 2 亿元、支付公司债券 2019 年度利息 1,160 万元，并以 2 亿元为基数自 2019 年 7 月 16 日起按照日利率万分之一支付违约金至付清时止、以 2 亿元为基数自 2019 年 7 月 16 日起按照年利率 5.8% 支付逾期利息至付清时止。安徽省华安外经建设（集团）有限公司不服一审判决向重庆市高级人民法院提交民事上诉状，请求撤销重庆市第一中级人民法院一审关于逾期利息计

算标准部分的判决。2020 年 12 月，重庆市高级人民法院终审判决驳回安徽省华安外经建设（集团）有限公司的上诉，维持原判。因安徽省华安外经建设（集团）有限公司进入破产重整程序，需对债权债务进行统一清理及处理，公司已于 2021 年 2 月完成债权申报。

公司作为资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金约 140 万元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。

2. 公司诉同益实业集团有限公司债券违约纠纷案

2019 年 9 月 16 日-17 日，公司作为“西南证券双喜金债中银 1 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 2 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 3 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 4 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 5 号集合资产管理计划”“西南证券双喜盛誉策略 2 号集合资产管理计划”“西南证券盛誉定增策略 1 号集合资产管理计划”“西南证券双喜盛誉混合配置 4 号集合资产管理计划”（以下简称资管计划）管理人，代表资管计划分别向重庆市第一中级人民法院、重庆市江北区人民法院提起诉讼，申请同益实业集团有限公司就 2016 年公司债券（债券简称：16 同益债）未能根据约定履行回售义务承担违约责任，偿付债券本金 23,132.60 万元及利息、违约金、逾期利息、律师费、诉讼费等。2020 年 11 月，根据重庆市第一中级人民法院和重庆市江北区人民法院总共八份民事判决书的判决结果，同益实业集团有限公司向公司支付债券本金 2.31 亿元和 2018 年度利息约 0.18 亿元，并支付相应的资金占用损失或逾期利息损失，案件受理费、保全费等主要由同益实业集团有限公司承担。八起案件进入执行程序后，因暂无财产可供执行，重庆市第一中级人民法院和重庆市江北区人民法院现已依法终结此次执行程序，申请执行人发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

公司作为资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金约 2.31 亿元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。

3. 公司诉正源房地产开发有限公司债券违约纠纷案

公司作为“西南证券-双喜金债广农商 1 号定向资产管理计划”“西南证券双喜金债中银 1 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 2 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 3 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 4 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 5 号集合资产管理计划”（以下简称资管计划）管理人，于 2021 年 1 月代表资管计划向重庆市第一中级人民法院提起诉讼，就正源房地产开发有限公司未能根据约定支付正源房地产开发有限公司 2016 年公司债券（债券简称：16 正源 01、16 正源 02、16 正源 03）本金及利息（人民币 54,946.68 万元），申请判令正源房地产开发有限公司偿付上述债券本金及利息、违约金、逾期利息、律师费、诉讼费等。现该案件处于一审阶段。

公司作为资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金约 4.03 亿元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。

4. 公司与上海三盛宏业投资（集团）有限责任公司债券违约纠纷案

公司作为“西南证券双喜金债 2 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 3 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 4 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 5 号集合资产管理计划”和“西南证券双喜金债 7 号集合资产管理计划”（以下简称资管计划）管理人，代表资管计划投资并持有上海三盛宏业投资（集团）有限责任公司（以下简称三盛宏业）发行的标的债券“16 三盛 04”，因三盛宏业未按约偿还本金及利息，公司向上海金融法院提出强制执行申请，请求强制执行三盛宏业向公司归还债务本金 23,000 万元及相关利息、违约金和律师费；请求强制执行上海三盛房地产（集团）有限责任公司、上海盛铭房地产开发有限公司、中昌海运控股有限公司、佛山茂国房地产开发有限公司、佛山三盛兰亭房地产有限责任公司和陈建铭（以下统称其他被申请人）对三盛宏业上述偿付义务承担连带清偿保证责任；请求三盛宏业和其他被申请人向公司支付相关公证费。2021 年 2 月，上海金融法院决定立案执行。因无财产可供执行，上海金融法院现已终结此次执行程序，申请执行人发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

公司作为资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金 20,000 万元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。鉴于上述案件尚未正式执行，暂无法预计对公司期后利润的影响。

(三) 邓朝晖诉公司、西南证券股份有限公司湖北分公司、陕西龙鑫矿产资源有限公司、张林、何彦林民间借贷纠纷案

2020 年 10 月，邓朝晖向北京市通州区人民法院提起诉讼，请求法院判令陕西龙鑫矿产资源有限公司偿还借款 14,997,721 元并给付利息损失，张林对前述欠款及利息承担连带保证责任，公司及西南证券股份有限公司湖北分公司、何彦林对借款本金 14,997,721 元归还承担连带责任。现该案处于一审阶段。

(四) 西证创新申请执行张抛贫、邓祖兰抵押借款合同纠纷案

公司全资子公司重庆西证小额贷款有限公司于 2015 年 8 月向重庆市江北区人民法院提起诉讼，请求法院判令被告张抛贫偿还欠款本金 1,170 万元并承担利息及实现债权的费用，判令被告邓祖兰承担连带清偿责任。目前该案已进入执行阶段，现已收回本金 1,003.42 万元。由于重庆西证小额贷款有限公司已注销，已于清算期间内将债权转让公司全资子公司西证创新。2020 年 2 月 27 日，经重庆市江北区人民法院裁定：变更申请执行人为西证创新。因被执行人目前无财产可供执行，重庆市江北区人民法院依法终结此次执行程序，申请执行人发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

(五) 西证创新申请执行邓刚、邓丽娟等六保证人保证合同纠纷案

公司全资子公司重庆西证小额贷款有限公司 2016 年 7 月向重庆市渝北区人民法院提起诉讼，请求法院判令邓刚、邓丽娟、邓苏轩、吴开平、赵红浪、重庆荟林科技发展有限公司六保证人连带支付重庆公信科技发展（集团）有限公司所欠西证小贷的借款本金 1,000 万元、利息、罚息及复利。2016 年 9 月，渝北区人民法院一审判决邓刚、邓丽娟、邓苏轩、吴开平、赵红浪、重庆荟林科技发展有限公司等六位保证人对本笔贷款的本金、利息、复利及罚息承担连带清偿责任。由于重庆西证小额贷款有限公司已注销，已于清算期间内将债权转让公司全资子公司西证创新，2019 年 12 月 25 日，经渝北区人民法院裁定：变更申请执行人为西证创新。目前该案处于执行阶段，已收回资金 69.50 万元及以物抵债受偿金额 1,427,389.40 元。

（六）公司诉张林、唐军股票质押式回购交易纠纷案

2019 年 5 月，公司向重庆市第一中级人民法院提起诉讼，2020 年 6 月，法院判决被告张林偿还公司融资本金 3,499 万元并支付利息和违约金、律师费，公司对张林持有的 371.41 万股“派生科技”（股票代码：300176）在前述债权范围内享有优先受偿权，唐军对前述债务承担连带保证责任。判决通过公告送达生效，2020 年 10 月进入执行程序。因无财产可供执行，重庆市第一中级人民法院现已终结此次执行程序，申请执行人发现被执行人有可供执行财产的，可以再次申请执行。

（七）孙凤娟诉公司、公司上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部确权及合同违约纠纷案

2021 年 4 月，孙凤娟向上海市浦东新区人民法院起诉，要求公司上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部归还其资金账户内被划转的资金 900 万元及同期银行贷款利息，并要求公司对此承担连带赔偿责任。2021 年 6 月，孙凤娟变更诉讼请求，请求法院确认某资金账户属于其所有，判令公司上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部赔偿其 2,000 万元及同期银行贷款利息损失，并要求公司对此承担补充清偿责任。该案件一审判决驳回孙凤娟全部诉讼请求，孙凤娟因不服一审判决已提请上诉。

（八）创金合信基金管理有限公司诉公司、联合信用评级有限公司及信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）证券虚假陈述责任纠纷案

2021 年 11 月，创金合信基金管理有限公司（以下简称“创金合信”）向北京金融法院起诉公司、联合信用评级有限公司（以下简称“联合评级”）及信永中和会计师事务所（以下简称“信永中和”）。创金合信以公司作为 16 协信 03 债券的主承销商及受托管理人违反履行勤勉尽责义务，未对债券发行文件中存在的虚假陈述等情形进行审慎核查、依法审计、及时纠正，导致其受误导买入债券从而遭受投资损失为由，请求法院判令包括公司在内的各被告赔偿其投资损失及各项费用暂共计 1.53 亿元。现该案件处于一审阶段。

（九）截至目前，投资者因鞍重股份重组项目诉公司证券虚假陈述责任纠纷案件共计 15 起，沈阳市中级人民法院一审判决公司与鞍山重型矿山机器股份有限公司、九好网络科技集团有限公司共同向 15 位投资者赔偿经济损失共计约 150 万元，公司提起上诉，后由辽宁省高级人民法院下

达终审判决，驳回公司上诉维持原判。鞍山重型矿山机器股份有限公司现已完成对 15 位投资者的全部支付。

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

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

报告期内，公司及公司控股股东不存在未履行法院生效判决、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

十二、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

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：美元

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	1.96
报告期末对子公司担保余额合计（B）	1.96
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	1.96
担保总额占公司净资产的比例（%）	4.94
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）	1.96
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）	1.96
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	不适用
担保情况说明	公司于2020年8月13日召开2020年第二次临时股东大会，同意为公司下属子公司西证国际证券或其下属公司境外债务融资提供连带责任担保。2021年2月9日，公司与纽约梅隆银行伦敦分行签署了《担保契约》，为西证国际证券拟发行金额为1.78亿美元，期限为3年，票面利率为4.0%的美元债券提供连带责任担保，担保金额为2亿美元，担保期限至债券、信托契约及担保契约项下发行人及担保人的全部偿付义务履行完毕为止。有关内容详见2021年2月10日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于为境外附属公司债务融资提供连带责任担保的公告》。

注：按照 2021 年 12 月 31 日美元兑人民币汇率计算担保总额占公司净资产的比例。

(三) 其他重大合同

√适用 □不适用

2021年2月9日公司与纽约梅隆银行伦敦分行签署了《担保契约》，为西证国际证券拟发行金额为178,000,000美元，期限为3年，票面利率为4.0%的美元债券提供连带责任担保，担保金额为2亿美元，担保期限至债券、信托契约及担保契约项下发行人及担保人的全部偿付义务履行完毕为止。有关内容详见2021年2月10日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于为境外附属公司债务融资提供连带责任担保的公告》。

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) 关于公司监事及高级管理人员变动的情况说明

2021年1月18日，经公司第九届董事会第九次会议审议通过，同意聘任李军先生为公司董事会秘书。李军先生自2021年4月23日起正式任职，至公司第九届董事会终止履职之日止。有关内容详见2021年4月24日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于董事会秘书任职的公告》。

2021年5月，公司原副总裁蒲锐先生因个人原因申请辞去公司副总裁职务。有关内容详见2021年5月26日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于副总裁辞职的公告》。

2021年9月，公司原董事长廖庆轩先生因年龄原因辞去公司第九届董事长、战略委员会主任委员、董事及在公司担任的其他职务。有关内容详见2021年9月7日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于董事长辞职的公告》。

2021年9月6日，经公司第九届董事会第十三次会议审议通过，选举吴坚先生为公司董事长。吴坚先生自2021年9月6日起正式任职，至公司第九届董事会终止履职之日止。有关内容详见2021年9月7日刊载于公司选定信息披露媒体的《第九届董事会第十三次会议决议公告》。

(二) 关于公司计提减值准备的情况说明

2021年4月，根据《企业会计准则》和公司会计政策的相关规定，公司对商誉、其他应收款、融出资金等资产进行减值测试，并相应计提了资产减值准备。有关内容详见2021年4月30日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于计提资产减值准备的公告》。

2022年4月，经公司第九届董事会第十八次会议及第九届监事会第十一次会议同意，公司对商誉、买入返售金融资产、其他应收款等进行减值测试，并计提了资产减值准备。有关内容详见2022年4月27日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于计提资产减值准备的公告》。

(三) 关于《公司章程》修订的情况说明

2021年12月30日，公司召开2021年第二临时股东大会，审议通过了《关于修订〈公司章程〉的议案》。有关内容详见2021年12月31日刊载于公司选定信息披露媒体的《2021年第二次临时股东大会决议公告》。

(四) 关于控股股东拟参与转融通证券出借业务的情况说明

2022 年 3 月 2 日，公司收到控股股东重庆渝富《关于拟参与转融通证券出借业务的函》，其通过“招商财富-招商银行-渝富 4 号专项资产管理计划”持有公司股票，该资管计划拟通过转融通证券出借业务将持有的公司部分股份出借给中国证券金融股份有限公司。有关内容详见 2022 年 3 月 3 日刊载于公司选定信息披露媒体的《关于控股股东拟参与转融通证券出借业务的公告》。

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

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。

2. 股份变动情况说明

适用 不适用

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

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：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）						
21 西南 D1（短期公司债券）	2021-04-27	3.25%	2,000,000,000	2021-04-30	2,000,000,000	2022-04-26

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

根据上海证券交易所债券挂牌的有关规定，公司 2021 年非公开发行证券公司短期公司债券（第一期）于 2021 年 4 月 30 日起在上海证券交易所挂牌，发行总额 20 亿元，期限 1 年，票面利率 3.25%，到期还本付息。

(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)	133,801
年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户)	128,056

(二)截至报告期末前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位:股

前十名股东持股情况							
股东名称 (全称)	报告期内 增减	期末持股数量	比例 (%)	持有有限售 条件股份数 量	质押、标记或 冻结情况		股东性质
					股份 状态	数量	
重庆渝富资本运营集团有限公司	0	1,853,443,610	27.89	330,000,000	无	0	国有法人
重庆市城市建设投资(集团)有限公司	0	689,293,065	10.37	350,000,000	质押	158,060,000	国有法人
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	0	400,500,000	6.03	0	无	0	国有法人
中国建银投资有限责任公司	0	328,427,012	4.94	0	无	0	国有法人
重庆高速公路集团有限公司	0	275,167,400	4.14	0	无	0	国有法人
重庆发展投资有限公司	0	200,000,000	3.01	200,000,000	无	0	国有法人
重庆市地产集团有限公司	0	120,000,000	1.81	120,000,000	无	0	国有法人
招商财富-招商银行-渝富4号 专项资产管理计划	0	107,218,242	1.61	0	无	0	其他
重庆水务环境控股集团有限公司	0	100,000,000	1.50	0	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	-15,277,630	97,060,204	1.46	0	无	0	未知
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				
重庆渝富资本运营集团有限公司	1,523,443,610	人民币普通股	1,523,443,610				
重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司	400,500,000	人民币普通股	400,500,000				
重庆市城市建设投资(集团)有限公司	339,293,065	人民币普通股	339,293,065				
中国建银投资有限责任公司	328,427,012	人民币普通股	328,427,012				
重庆高速公路集团有限公司	275,167,400	人民币普通股	275,167,400				
招商财富-招商银行-渝富4号专项资产管理计划	107,218,242	人民币普通股	107,218,242				
重庆水务环境控股集团有限公司	100,000,000	人民币普通股	100,000,000				
中国证券金融股份有限公司	97,060,204	人民币普通股	97,060,204				
重庆国际信托股份有限公司	83,954,868	人民币普通股	83,954,868				
香港中央结算有限公司	65,890,072	人民币普通股	65,890,072				
前十名股东中回购专户情况说明	不适用						
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	不适用						
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中,重庆渝富资本运营集团有限公司通过招商财富-招商银行-渝富4号专项资产管理计划增持公司股份,除此之外,公司未知上述其他股东之间的关联关系或一致行动关系。						
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用						

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

√适用 □不适用

单位:股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限 售条件股份 数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交 易股份数量	
1	重庆渝富资本运营集团有限公司	330,000,000	2025年7月22日	330,000,000	认购的公司非公开发行的人民币普通股股票,限售期为60个月。
2	重庆市城市建设投资(集团)有限公司	350,000,000	2023年7月22日	350,000,000	认购的公司非公开发行的人民币普通股股票,限售期为36个月。
3	重庆发展投资有限公司	200,000,000	2023年7月22日	200,000,000	认购的公司非公开发行的人民币普通股股票,限售期为36个月。

4	重庆市地产集团有限公司	120,000,000	2023年7月22日	120,000,000	认购的公司非公开发行的人民币普通股股票，限售期为36个月。
上述股东关联关系或一致行动的说明		公司未发现该等股东之间因就公司而存在关联关系或一致行动关系。			

(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	重庆渝富资本运营集团有限公司					
单位负责人或法定代表人	杨雨松					
成立日期	2004年2月27日					
主要经营业务	市政府授权范围内的资产收购、处置及相关产业投资，投资咨询，财务顾问，企业重组兼并顾问及代理，企业和资产托管（国家法律法规规定须取得前置审批的，在未取得审批前不得经营）。					
报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况	序号	投资上市企业	股票代码	总股本（万元）	持股数（万股）	持股比例
	1	重庆银行股份有限公司	601963.SH	347,451	41,087	11.83%
	2	重庆农村商业银行股份有限公司	601077.SH	1,135,700	98,800	8.70%
	3	重庆川仪自动化股份有限公司	603100.SH	39,500	4,943	12.51%
	4	重庆机电股份有限公司	02722.HK	368,464	23,213	6.30%
	5	中交地产股份有限公司	000736.SZ	69,543	6,900	9.93%
	6	重庆建工集团股份有限公司	600939.SH	181,455	2,571	1.42%
	7	华润微电子有限公司	688396.SH	132,009	183	0.14%
其他情况说明	无					

2. 自然人

□适用 √不适用

3. 公司不存在控股股东情况的特别说明

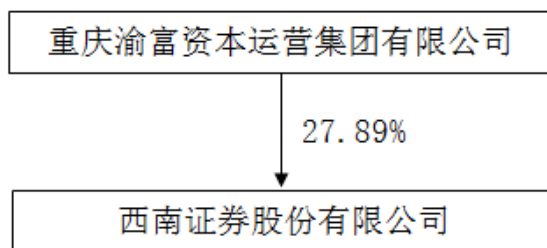
□适用 √不适用

4. 报告期内控股股东变更情况的说明

□适用 √不适用

5. 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

√适用 □不适用



(二) 实际控制人情况

1. 法人

√适用 □不适用

名称	重庆市国有资产监督管理委员会
单位负责人或法定代表人	罗清泉

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

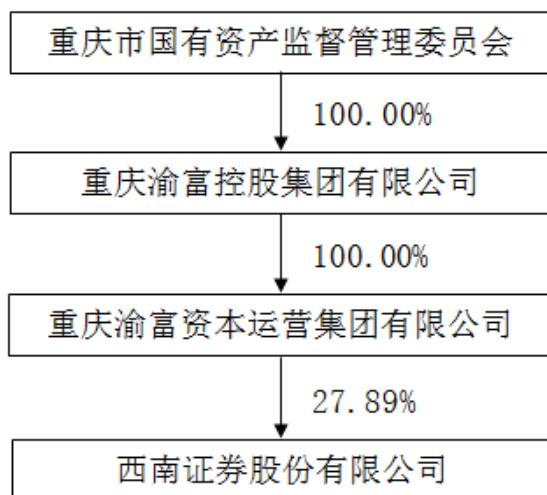
□适用 √不适用

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

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

单位：亿元 币种：人民币

法人股东名称	单位负责人或 法定代表人	成立日期	组织机构代码	注册资本	主要经营业务或管理 活动等情况
重庆市城市建设投资 (集团)有限公司	李明	1993年2月26日	91500000202814256L	200	城市建设投资(不含金融及财政信用业务)。

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：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	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第一期)	19 西南 01	155296	2019 年 4 月 2 日	2019 年 4 月 2 日	2022 年 4 月 2 日	2,500,000,000	3.85	本期债券采用单利按年计息,不计复利。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	竞价、报价、询价、协议交易	否
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第二期)	19 西南 02	155539	2019 年 7 月 18 日	2019 年 7 月 18 日	2022 年 7 月 18 日	2,500,000,000	3.77	本期债券采用单利按年计息,不计复利。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	竞价、报价、询价、协议交易	否
西南证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券	20 西证 01	163624	2020 年 7 月 14 日	2020 年 7 月 14 日	2023 年 7 月 14 日	2,000,000,000	3.80	本期债券采用单利按年计息,不计复利。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	竞价、报价、询价、协议交易	否
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	20 西南 D1	166698	2020 年 4 月 24 日	2020 年 4 月 24 日	2021 年 4 月 24 日	2,000,000,000	2.70	本期债券采用单利按年计息,不计复利。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	报价、询价、协议交易	否

西南证券股份有限公司 2021 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	21 西南 D1	178488	2021 年 4 月 27 日	2021 年 4 月 27 日	2022 年 4 月 27 日	2,000,000,000	3.25	本期债券采用单利按年计息, 不计复利。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	报价、询价、协议交易	否
西南证券股份有限公司 2018 年非公开发行次级债券(第一期)	18 西南 C1	150375	2018 年 5 月 8 日	2018 年 5 月 8 日	2021 年 5 月 8 日	1,900,000,000	6.10	本期债券采用单利按年计息, 不计复利, 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	报价、询价、协议交易	否
西南证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)	19 西南 C1	162136	2019 年 9 月 12 日	2019 年 9 月 12 日	2022 年 9 月 12 日	2,640,000,000	4.50	本期债券采用单利按年计息, 不计复利, 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	报价、询价、协议交易	否
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期)	20 西南 C1	177394	2020 年 12 月 15 日	2020 年 12 月 15 日	2023 年 12 月 15 日	2,000,000,000	4.70	本期债券采用单利按年计息, 不计复利, 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	报价、询价、协议交易	否

1. 此处列示的公司债券仅包含公司在中华人民共和国境内发行并在证券交易所上市或转让的公司债券、短期公司债券及次级债券。
2. 以上所列示的利率均为票面利率。
3. 从适当性管理原则出发, 以上债券发行均面向合格投资者或专业投资者发行。

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
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第一期)	按时足额兑息
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第二期)	按时足额兑息
西南证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券	按时足额兑息
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	按时足额兑息兑付
西南证券股份有限公司 2018 年非公开发行次级债券(第一期)	按时足额兑息兑付
西南证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)	按时足额兑息
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期)	按时足额兑息

2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

3. 为债券发行及存续期业务提供服务的中介机构

中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	联系人	联系电话
联合资信评估股份有限公司	北京市朝阳区建外大街 2 号院 2 号楼 17 层	不适用	姜羽佳	010-85679696
天健会计师事务所(特殊普通合伙)	杭州市西溪路 128 号新湖商务大厦 9 层	赵兴明、肖桂春	赵兴明	023-86218000
信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 9 层	藺怀阳	胡小琴	023-88755566
华西证券股份有限公司	四川省成都市高新区天府二街 198 号 1107	不适用	刘凯月	17396239929
上海中联律师事务所	重庆市渝中区华盛路 7 号企业天地 7 号楼 12 层	不适用	周小茜	023-63631830

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: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
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第一期)	2,500,000,000	2,500,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第二期)	2,500,000,000	2,500,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是

西南证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券	2,000,000,000	2,000,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	2,000,000,000	2,000,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是
西南证券股份有限公司 2021 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	2,000,000,000	2,000,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是
西南证券股份有限公司 2018 年非公开发行次级债券(第一期)	1,900,000,000	1,900,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是
西南证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)	2,640,000,000	2,640,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	是
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期)	2,000,000,000	2,000,000,000	0	严格按照募集资金用途使用。	不适用	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
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第一期)	联合资信评估股份有限公司	AAA	无	不适用
西南证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券(第二期)	联合资信评估股份有限公司	AAA	无	不适用
西南证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券	联合资信评估股份有限公司	AAA	无	不适用
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	联合资信评估股份有限公司	A-1	无	不适用
西南证券股份有限公司 2021 年非公开发行证券公司短期公司债券(第一期)	联合资信评估股份有限公司	A-1	无	不适用

西南证券股份有限公司 2018 年非公开发行次级债券(第一期)	联合资信评估股份有限公司	AA+	无	不适用
西南证券股份有限公司 2019 年非公开发行次级债券(第一期)	联合资信评估股份有限公司	AA+	无	不适用
西南证券股份有限公司 2020 年非公开发行次级债券(第一期)	联合资信评估股份有限公司	AA+	无	不适用

其他说明

适用 不适用

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

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
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,003,226,332.35	1,087,991,582.99	-7.79	
流动比率	1.78	1.59	11.95	交易性金融资产等高流动性资产增加
速动比率	1.78	1.59	11.95	交易性金融资产等高流动性资产增加
资产负债率 (%)	62.75	62.42	增加 0.33 个百分点	
EBITDA 全部债务比	0.06	0.07	-14.29	卖出回购金融资产款增加
利息保障倍数	1.80	1.91	-5.76	
现金利息保障倍数	-0.13	-2.83	不适用	

EBITDA 利息保障倍数	1.92	1.99	-3.52	
贷款偿还率 (%)	100.00	100.00	-	
利息偿付率 (%)	100.00	100.00	-	

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

天健审〔2022〕8-277号

西南证券股份有限公司全体股东：

一、审计意见

我们审计了西南证券股份有限公司（以下简称西南证券）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，公允反映了西南证券 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，我们独立于西南证券，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）商誉和长期股权投资的减值评估

1. 事项描述

详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 25. 长期资产减值 与 七、合并财务报表项目注释 23. 商誉 十九、母公司财务报表项目注释 1. 长期股权投资”。截至 2021 年 12 月 31 日，西南证券合并财务报表商誉账面余额为人民币 289 百万元，其减值准备余额为人民币 278 百万元；母公司财务报表长期股权投资账面余额为人民币 8,375 百万元，其减值准备余额为人民币 1,272 百万元。为评估商誉和长期股权投资的可回收金额，西南证券管理层（以下简称管理层）委聘外部估值专家对可回收金额进行了评估。在确定是否应计提减值时涉及重大的管理

层判断和估计，特别在预测未来现金流量方面包括对预测收入、长期平均增长率和利润率以及确定恰当的折现率所作的假设，这些关键假设具有固有不确定性且可能受到管理层偏向的影响。

由于合并财务报表商誉金额、母公司财务报表长期股权投资金额重大，且管理层需要作出重大判断和估计，因此我们将商誉和长期股权投资的减值确定为关键审计事项。

2. 审计应对

我们针对商誉和长期股权投资的减值评估执行的主要审计程序包括：

(1) 了解与商誉和长期股权投资减值相关的关键内部控制，评价其设计，确定其是否得到执行，并测试相关内部控制的运行有效性；

(2) 复核管理层以前年度对未来现金流量现值的预测和实际经营结果，评价管理层过往预测的准确性；

(3) 了解并评价管理层聘用的外部估值专家的胜任能力、专业素质和客观性；

(4) 评价管理层在减值测试中使用方法的合理性和一致性；

(5) 评价管理层在减值测试中采用的关键假设的适当性；

(6) 测试管理层在减值测试中使用数据的准确性、完整性和相关性，并复核减值测试中有关信息的内在一致性；

(7) 测试管理层对预计未来现金流量现值的计算是否准确；

(8) 检查与商誉和长期股权投资减值相关的信息是否已在财务报表中作出恰当列报。

(二) 融出资金、买入返售金融资产、其他债权投资的预期信用减值评估

1. 事项描述

详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 10. 金融工具 与 七、合并财务报表项目注释 5. 融出资金 11. 买入返售金融资产 15. 其他债权投资”。截至2021年12月31日，西南证券合并财务报表融出资金账面余额为人民币14,307百万元，其减值准备余额为人民币35百万元，账面价值为人民币14,272百万元；买入返售金融资产账面余额为人民币1,558百万元，其减值准备余额为人民币83百万元，账面价值为人民币1,475百万元；其他债权投资账面价值为人民币8,975百万元，其减值准备余额为人民币2百万元。管理层采用预期信用损失模型对以上金融资产计量预期信用损失。

以上金融资产对合并财务报表影响重大，且预期信用损失模型中采用的参数和数据、减值阶段的划分均涉及重大管理层判断和假设，因此我们将融出资金、买入返售金融资产、其他债权投资的预期信用减值评估确定为关键审计事项。

2. 审计应对

我们针对融出资金、买入返售金融资产、其他债权投资的预期信用减值评估执行的主要审计程序包括：

(1) 了解和评价预期信用损失模型在模型方法论的选择、审批及应用，以及模型持续监控和优化相关等方面的内部控制设计，确定其是否得到执行，并测试运行的有效性；

- (2) 评估管理层所用的预期信用损失模型及对减值阶段划分标准的合理性；
- (3) 评价管理层在预期信用损失模型中采用的相关参数和假设的完整性和准确性；
- (4) 采用抽样的方法，复核管理层在计算预期信用损失中使用的基础数据并复核其计算的准确性；
- (5) 采用抽样的方法，评估管理层基于借款人和担保人财务信息、抵押物价值及其他相关因素计算减值准备的准确性；
- (6) 评价与以摊余成本计量的金融资产减值准备相关的财务报表信息披露是否符合企业会计准则的披露要求。

四、其他信息

管理层对其他信息负责。其他信息包括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，管理层负责评估西南证券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

西南证券治理层（以下简称治理层）负责监督西南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，就可能导致对西南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西南证券不能持续经营。

(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) 就西南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（如适用）。

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

天健会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师：赵兴明

（项目合伙人）

中国·杭州

中国注册会计师：肖桂春

二〇二二年四月二十五日

二、财务报表

合并资产负债表

2021 年 12 月 31 日

编制单位：西南证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	附注	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	1	15,373,626,059.26	17,203,544,523.08
其中：客户资金存款		11,365,910,647.68	10,421,240,189.52
结算备付金	2	4,239,132,214.73	3,429,659,479.81
其中：客户备付金		2,904,204,089.04	2,251,550,962.03
融出资金	5	14,272,175,002.17	12,001,843,139.77
衍生金融资产	6	23,550,815.84	663,975.84
存出保证金	7	1,504,711,833.90	1,405,554,892.41
应收款项	8	289,299,825.76	118,444,884.10
买入返售金融资产	11	1,475,449,768.49	1,404,131,659.30
金融投资：			
交易性金融资产	13	30,371,192,097.77	26,860,163,662.56
其他债权投资	15	8,974,792,747.89	9,107,073,011.84
其他权益工具投资	16	888,450,912.82	3,424,774,498.21
长期股权投资	17	2,438,035,301.51	2,241,094,880.32
投资性房地产	18	63,203,183.70	69,559,047.23
固定资产	19	1,291,599,965.64	234,252,429.42
在建工程	20		767,019,295.87
使用权资产	21	115,245,103.29	
无形资产	22	174,849,023.28	165,408,654.14
商誉	23	11,022,697.75	119,636,099.49
递延所得税资产	24	527,648,007.59	374,210,282.57
其他资产	25	224,049,001.79	261,284,049.30
资产总计		82,258,033,563.18	79,188,318,465.26
负债：			
应付短期融资款	30	3,386,823,021.21	3,773,336,512.74
拆入资金	31	2,407,134,499.87	2,007,622,222.23
交易性金融负债	32	622,547,367.97	594,122,571.81
衍生金融负债	6	5,515,932.91	2,292,602.56
卖出回购金融资产款	33	21,072,631,177.76	18,321,196,405.95
代理买卖证券款	34	14,382,125,029.05	12,455,051,319.74
应付职工薪酬	36	1,293,065,029.58	1,252,851,712.88
应交税费	37	116,561,367.28	67,051,168.80
应付款项	38	99,763,100.89	109,801,383.70
预计负债	41		1,493,338.88
应付债券	43	12,979,277,733.07	15,126,853,662.88
租赁负债	44	114,074,885.90	
递延所得税负债	24	145,071,649.39	213,997,175.09
其他负债	46	350,928,955.75	183,283,545.41
负债合计		56,975,519,750.63	54,108,953,622.67
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	47	6,645,109,124.00	6,645,109,124.00

资本公积	49	11,654,405,801.60	11,654,405,801.60
其他综合收益	51	59,808,045.65	203,085,565.91
盈余公积	52	1,260,844,773.36	1,176,661,527.73
一般风险准备	53	2,444,709,558.32	2,276,343,067.06
未分配利润	54	3,292,901,852.60	3,187,755,048.11
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		25,357,779,155.53	25,143,360,134.41
少数股东权益		-75,265,342.98	-63,995,291.82
所有者权益（或股东权益）合计		25,282,513,812.55	25,079,364,842.59
负债和所有者权益（或股东权益）总计		82,258,033,563.18	79,188,318,465.26

公司负责人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

母公司资产负债表

2021 年 12 月 31 日

编制单位:西南证券股份有限公司

单位:元 币种:人民币

项目	附注	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金		13,280,774,788.79	14,814,222,449.60
其中:客户资金存款		10,937,026,252.75	9,973,107,853.37
结算备付金		3,762,869,908.39	3,073,943,997.55
其中:客户备付金		2,432,839,776.61	1,893,211,629.00
融出资金		14,236,568,821.64	11,925,957,812.41
衍生金融资产		23,550,815.84	663,975.84
存出保证金		722,887,839.28	642,746,129.30
应收款项		145,266,331.97	49,761,070.31
买入返售金融资产		1,352,205,855.26	1,129,715,941.37
金融投资:			
交易性金融资产		25,249,024,193.05	22,794,288,250.42
其他债权投资		8,974,792,747.89	9,107,073,011.84
其他权益工具投资		888,450,912.82	3,424,774,498.21
长期股权投资	1	7,102,429,089.86	6,551,036,608.54
投资性房地产		60,918,488.06	66,526,452.67
固定资产		1,289,171,337.45	230,238,769.98
在建工程			767,019,295.87
使用权资产		101,441,164.61	
无形资产		172,086,917.20	162,104,744.05
递延所得税资产		498,407,060.24	271,893,737.02
其他资产		133,656,625.64	109,486,069.43
资产总计		77,994,502,897.99	75,121,452,814.41
负债:			
应付短期融资款		3,386,823,021.21	3,773,336,512.74
拆入资金		2,407,134,499.87	2,007,622,222.23
交易性金融负债		158,557,798.33	
卖出回购金融资产款		21,038,325,684.94	18,301,300,144.26
代理买卖证券款		12,878,717,392.90	11,301,462,420.56
应付职工薪酬	2	1,121,315,038.45	1,068,028,171.22
应交税费		84,086,320.20	57,947,246.99
应付款项		39,982,347.42	47,735,262.26
预计负债			1,493,338.88
应付债券		11,831,029,699.32	13,804,981,258.70
租赁负债		97,842,792.52	
递延所得税负债		36,242,310.01	64,853,963.24
其他负债		315,256,196.27	125,577,242.65
负债合计		53,395,313,101.44	50,554,337,783.73
所有者权益(或股东权益):			
实收资本(或股本)		6,645,109,124.00	6,645,109,124.00
资本公积		11,654,405,801.60	11,654,405,801.60
其他综合收益		49,178,515.11	180,305,447.46
盈余公积		1,260,844,773.36	1,176,661,527.73

一般风险准备		2,444,709,558.32	2,276,343,067.06
未分配利润		2,544,942,024.16	2,634,290,062.83
所有者权益（或股东权益）合计		24,599,189,796.55	24,567,115,030.68
负债和所有者权益（或股东权益）总计		77,994,502,897.99	75,121,452,814.41

公司负责人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

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		3,096,080,385.10	3,169,571,453.97
利息净收入	55	331,360,278.85	330,983,229.17
其中:利息收入		1,676,480,633.78	1,682,112,083.96
利息支出		1,345,120,354.93	1,351,128,854.79
手续费及佣金净收入	56	1,120,596,000.02	1,044,580,610.10
其中:经纪业务手续费净收入		822,194,924.97	746,709,232.63
投资银行业务手续费净收入		267,446,868.84	250,439,855.39
资产管理业务手续费净收入		22,762,694.71	29,613,544.26
投资收益(损失以“-”号填列)	57	1,983,703,258.82	1,690,362,722.60
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		419,618,031.91	377,284,851.50
其他收益	59	41,763,085.46	20,947,075.31
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	60	-439,277,490.59	-1,035,892.54
汇兑收益(损失以“-”号填列)		-1,964,867.89	24,801,584.61
其他业务收入	61	59,260,201.13	57,919,811.88
资产处置收益(损失以“-”号填列)	62	639,919.30	1,012,312.84
二、营业总支出		2,057,550,532.99	1,970,058,018.44
税金及附加	63	27,002,096.32	22,130,728.58
业务及管理费	64	1,835,451,049.98	1,688,549,956.15
信用减值损失	65	34,739,234.76	130,415,975.39
其他资产减值损失	66	107,155,070.66	65,581,527.31
其他业务成本	67	53,203,081.27	63,379,831.01
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		1,038,529,852.11	1,199,513,435.53
加:营业外收入	68	4,283,794.40	715,740.75
减:营业外支出	69	4,244,987.40	18,266,280.14
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,038,568,659.11	1,181,962,896.14
减:所得税费用	70	13,100,207.89	124,168,840.63
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,025,468,451.22	1,057,794,055.51
(一)按经营持续性分类			
1.持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)		1,025,468,451.22	1,057,794,055.51
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)		1,038,152,895.95	1,091,487,407.23
2.少数股东损益(净亏损以“-”号填列)		-12,684,444.73	-33,693,351.72
六、其他综合收益的税后净额		-155,344,875.95	23,018,348.58
归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-157,397,365.98	19,040,215.31
(一)不能重分类进损益的其他综合收益		-159,526,376.36	136,684,036.56
1.重新计量设定受益计划变动额		-2,256,089.48	-1,955,641.67
2.其他权益工具投资公允价值变动		-157,270,286.88	138,639,678.23
(二)将重分类进损益的其他综合收益		2,129,010.38	-117,643,821.25
1.权益法下可转损益的其他综合收益		240,251.93	-435,089.61
2.其他债权投资公允价值变动		13,898,412.17	-86,826,566.82

3. 其他债权投资信用损失准备		140,934.19	-1,165,011.09
4. 外币财务报表折算差额		-12,150,587.91	-29,217,153.73
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		2,052,490.03	3,978,133.27
七、综合收益总额		870,123,575.27	1,080,812,404.09
归属于母公司所有者的综合收益总额		880,755,529.97	1,110,527,622.54
归属于少数股东的综合收益总额		-10,631,954.70	-29,715,218.45
八、每股收益：			
（一）基本每股收益(元/股)		0.16	0.18
（二）稀释每股收益(元/股)		0.16	0.18

公司负责人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

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		2,518,895,874.94	2,722,035,990.93
利息净收入	3	373,982,169.04	382,395,239.60
其中:利息收入		1,626,999,436.61	1,616,269,705.95
利息支出		1,253,017,267.57	1,233,874,466.35
手续费及佣金净收入	4	1,051,691,838.59	977,140,198.86
其中:经纪业务手续费净收入		763,207,035.86	708,157,237.14
投资银行业务手续费净收入		260,161,567.80	230,121,407.84
资产管理业务手续费净收入		24,474,182.53	30,509,567.28
投资收益(损失以“-”号填列)	5	1,710,335,004.54	1,477,834,332.81
其中:对联营企业和合营企业的投资收益		419,618,031.91	377,284,851.50
其他收益		40,045,280.18	19,357,050.43
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6	-665,194,714.67	-134,573,376.85
汇兑收益(损失以“-”号填列)		-675,837.48	-1,853,943.93
其他业务收入		8,065,340.00	835,308.45
资产处置收益(损失以“-”号填列)		646,794.74	901,181.56
二、营业总支出		1,740,993,992.08	1,895,104,433.00
税金及附加		24,523,957.08	20,289,810.02
业务及管理费	7	1,608,325,433.85	1,383,234,024.08
信用减值损失		4,000,360.96	-3,650,597.44
其他资产减值损失		95,547,939.87	487,034,628.87
其他业务成本		8,596,300.32	8,196,567.47
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		777,901,882.86	826,931,557.93
加:营业外收入		1,581,330.91	302,419.97
减:营业外支出		4,240,266.17	18,224,522.12
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		775,242,947.60	809,009,455.78
减:所得税费用		-66,589,508.74	48,874,573.71
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		841,832,456.34	760,134,882.07
(一)持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)		841,832,456.34	760,134,882.07
(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		-145,246,778.07	48,257,369.04
(一)不能重分类进损益的其他综合收益		-159,526,376.36	136,684,036.56
1.重新计量设定受益计划变动额		-2,256,089.48	-1,955,641.67
2.其他权益工具投资公允价值变动		-157,270,286.88	138,639,678.23
(二)将重分类进损益的其他综合收益		14,279,598.29	-88,426,667.52
1.权益法下可转损益的其他综合收益		240,251.93	-435,089.61
2.其他债权投资公允价值变动		13,898,412.17	-86,826,566.82
3.其他债权投资信用损失准备		140,934.19	-1,165,011.09
七、综合收益总额		696,585,678.27	808,392,251.11
八、每股收益:			
(一)基本每股收益(元/股)			
(二)稀释每股收益(元/股)			

公司负责人:吴坚

主管会计工作负责人:吴坚

会计机构负责人:叶平

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
一、经营活动产生的现金流量：			
收取利息、手续费及佣金的现金		3,958,337,289.10	3,673,157,063.59
拆入资金净增加额		400,000,000.00	600,000,000.00
回购业务资金净增加额		2,749,197,027.31	4,020,706,231.74
代理买卖证券收到的现金净额		1,927,073,709.31	1,212,639,868.75
收到其他与经营活动有关的现金	72	145,853,033.44	278,108,906.94
经营活动现金流入小计		9,180,461,059.16	9,784,612,071.02
为交易目的而持有的金融资产净增加额		3,590,451,203.69	8,917,854,957.84
融出资金净增加额		2,247,984,266.72	1,410,444,091.30
返售业务资金净增加额		75,020,259.94	
支付利息、手续费及佣金的现金		1,090,319,763.79	868,856,116.23
支付给职工及为职工支付的现金		1,349,098,767.20	1,153,768,081.92
支付的各项税费		342,990,896.62	260,332,234.09
支付其他与经营活动有关的现金	72	641,787,868.89	981,543,677.94
经营活动现金流出小计		9,337,653,026.85	13,592,799,159.32
经营活动产生的现金流量净额		-157,191,967.69	-3,808,187,088.30
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		2,514,429,059.67	2,242,238,638.69
取得投资收益收到的现金		846,862,469.95	605,376,504.18
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		4,276,646.90	2,392,728.98
投资活动现金流入小计		3,365,568,176.52	2,850,007,871.85
投资支付的现金			6,021,525.77
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		196,526,972.00	271,778,278.05
投资活动现金流出小计		196,526,972.00	277,799,803.82
投资活动产生的现金流量净额		3,169,041,204.52	2,572,208,068.03
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金			4,886,146,082.57
取得借款收到的现金		620,263,177.92	542,205,722.85
发行债券收到的现金		7,979,955,647.40	10,288,390,566.03
筹资活动现金流入小计		8,600,218,825.32	15,716,742,371.45
偿还债务支付的现金		10,926,172,591.34	8,525,785,722.85
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,457,629,718.73	1,341,036,427.60
支付其他与筹资活动有关的现金	72	239,147,179.27	282,289,474.01
筹资活动现金流出小计		12,622,949,489.34	10,149,111,624.46
筹资活动产生的现金流量净额		-4,022,730,664.02	5,567,630,746.99
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-7,519,977.10	-36,481,770.28
五、现金及现金等价物净增加额		-1,018,401,404.29	4,295,169,956.44
加：期初现金及现金等价物余额		20,631,159,678.28	16,335,989,721.84
六、期末现金及现金等价物余额		19,612,758,273.99	20,631,159,678.28

公司负责人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

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
一、经营活动产生的现金流量:			
收取利息、手续费及佣金的现金		3,443,572,616.70	3,321,660,035.42
拆入资金净增加额		400,000,000.00	600,000,000.00
回购业务资金净增加额		2,734,795,000.00	4,030,253,005.00
代理买卖证券收到的现金净额		1,577,254,972.34	1,097,286,268.85
收到其他与经营活动有关的现金		104,606,822.94	150,159,423.06
经营活动现金流入小计		8,260,229,411.98	9,199,358,732.33
为交易目的而持有的金融资产净增加额		2,930,797,165.24	8,214,950,136.87
融出资金净增加额		2,288,233,564.32	1,619,898,311.47
返售业务资金净增加额		221,829,998.00	
支付利息、手续费及佣金的现金		899,634,369.77	841,447,355.80
支付给职工及为职工支付的现金		1,178,090,161.25	1,009,696,548.40
支付的各项税费		308,267,298.46	235,274,197.19
支付其他与经营活动有关的现金		413,127,983.45	670,919,506.45
经营活动现金流出小计		8,239,980,540.49	12,592,186,056.18
经营活动产生的现金流量净额		20,248,871.49	-3,392,827,323.85
二、投资活动产生的现金流量:			
收回投资收到的现金		2,814,429,059.67	2,232,634,110.64
取得投资收益收到的现金		858,428,780.92	833,667,495.86
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		541,689.11	2,251,040.73
投资活动现金流入小计		3,673,399,529.70	3,068,552,647.23
投资支付的现金		750,000,000.00	850,000,000.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		192,900,840.36	269,863,746.11
投资活动现金流出小计		942,900,840.36	1,119,863,746.11
投资活动产生的现金流量净额		2,730,498,689.34	1,948,688,901.12
三、筹资活动产生的现金流量:			
吸收投资收到的现金			4,886,146,082.57
发行债券收到的现金		6,848,940,000.00	10,288,390,566.03
筹资活动现金流入小计		6,848,940,000.00	15,174,536,648.60
偿还债务支付的现金		8,981,560,000.00	7,983,580,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		1,391,385,903.57	1,240,827,972.37
支付其他与筹资活动有关的现金		68,322,872.28	
筹资活动现金流出小计		10,441,268,775.85	9,224,407,972.37
筹资活动产生的现金流量净额		-3,592,328,775.85	5,950,128,676.23
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-2,940,534.95	-8,274,050.45
五、现金及现金等价物净增加额		-844,521,749.97	4,497,716,203.05
加:期初现金及现金等价物余额		17,888,166,447.15	13,390,450,244.10
六、期末现金及现金等价物余额		17,043,644,697.18	17,888,166,447.15

公司负责人:吴坚

主管会计工作负责人:吴坚

会计机构负责人:叶平

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)	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、上年年末余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	203,085,565.91	1,176,661,527.73	2,276,343,067.06	3,187,755,048.11	-63,995,291.82	25,079,364,842.59
加: 会计政策变更						-1,825,596.45	-638,096.46	-2,463,692.91
前期差错更正								
其他								
二、本年年初余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	203,085,565.91	1,176,661,527.73	2,276,343,067.06	3,185,929,451.66	-64,633,388.28	25,076,901,149.68
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)			-143,277,520.26	84,183,245.63	168,366,491.26	106,972,400.94	-10,631,954.70	205,612,662.87
(一) 综合收益总额			-157,397,365.98			1,038,152,895.95	-10,631,954.70	870,123,575.27
(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				84,183,245.63	168,366,491.26	-917,060,649.29		-664,510,912.40
1. 提取盈余公积				84,183,245.63		-84,183,245.63		
2. 提取一般风险准备					168,366,491.26	-168,366,491.26		
3. 对所有者(或股东)的分配						-664,510,912.40		-664,510,912.40
4. 其他								
(四) 所有者权益内部结转			14,119,845.72			-14,119,845.72		
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			14,119,845.72			-14,119,845.72		
6. 其他								
四、本年年末余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	59,808,045.65	1,260,844,773.36	2,444,709,558.32	3,292,901,852.60	-75,265,342.98	25,282,513,812.55

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)	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、上年年末余额	5,645,109,124	7,768,259,719.03	183,766,198.05	1,100,648,039.52	2,124,316,090.64	2,771,469,583.10	-35,790,997.32	19,557,777,757.02
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年年初余额	5,645,109,124	7,768,259,719.03	183,766,198.05	1,100,648,039.52	2,124,316,090.64	2,771,469,583.10	-35,790,997.32	19,557,777,757.02
三、本年增减变动金额（减少以“－”号填列）	1,000,000,000	3,886,146,082.57	19,319,367.86	76,013,488.21	152,026,976.42	416,285,465.01	-28,204,294.50	5,521,587,085.57
（一）综合收益总额			19,040,215.31			1,091,487,407.23	-29,715,218.45	1,080,812,404.09
（二）所有者投入和减少资本	1,000,000,000	3,886,146,082.57						4,886,146,082.57
1. 所有者投入的普通股	1,000,000,000	3,886,146,082.57						4,886,146,082.57
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				76,013,488.21	152,026,976.42	-679,649,194.55		-451,608,729.92
1. 提取盈余公积				76,013,488.21		-76,013,488.21		
2. 提取一般风险准备					152,026,976.42	-152,026,976.42		
3. 对所有者（或股东）的分配						-451,608,729.92		-451,608,729.92
4. 其他								
（四）所有者权益内部结转			279,152.55			-279,152.55		
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			279,152.55			-279,152.55		
6. 其他								
（五）其他						4,726,404.88	1,510,923.95	6,237,328.83
四、本年年末余额	6,645,109,124	11,654,405,801.60	203,085,565.91	1,176,661,527.73	2,276,343,067.06	3,187,755,048.11	-63,995,291.82	25,079,364,842.59

公司负责人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

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)	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年年末余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	180,305,447.46	1,176,661,527.73	2,276,343,067.06	2,634,290,062.83	24,567,115,030.68
加: 会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年年初余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	180,305,447.46	1,176,661,527.73	2,276,343,067.06	2,634,290,062.83	24,567,115,030.68
三、本年增减变动金额(减少以“-”号填列)			-131,126,932.35	84,183,245.63	168,366,491.26	-89,348,038.67	32,074,765.87
(一) 综合收益总额			-145,246,778.07			841,832,456.34	696,585,678.27
(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				84,183,245.63	168,366,491.26	-917,060,649.29	-664,510,912.40
1. 提取盈余公积				84,183,245.63		-84,183,245.63	
2. 提取一般风险准备					168,366,491.26	-168,366,491.26	
3. 对所有者(或股东)的分配						-664,510,912.40	-664,510,912.40
4. 其他							
(四) 所有者权益内部结转			14,119,845.72			-14,119,845.72	
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			14,119,845.72			-14,119,845.72	
6. 其他							
四、本年年末余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	49,178,515.11	1,260,844,773.36	2,444,709,558.32	2,544,942,024.16	24,599,189,796.55

项目	2020 年度						
	实收资本(或股本)	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
一、上年年末余额	5,645,109,124.00	7,768,259,719.03	131,768,925.87	1,100,648,039.52	2,124,316,090.64	2,554,083,527.86	19,324,185,426.92
加：会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年初余额	5,645,109,124.00	7,768,259,719.03	131,768,925.87	1,100,648,039.52	2,124,316,090.64	2,554,083,527.86	19,324,185,426.92
三、本年增减变动金额（减少以“－”号填列）	1,000,000,000.00	3,886,146,082.57	48,536,521.59	76,013,488.21	152,026,976.42	80,206,534.97	5,242,929,603.76
（一）综合收益总额			48,257,369.04			760,134,882.07	808,392,251.11
（二）所有者投入和减少资本	1,000,000,000.00	3,886,146,082.57					4,886,146,082.57
1. 所有者投入的普通股	1,000,000,000.00	3,886,146,082.57					4,886,146,082.57
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				76,013,488.21	152,026,976.42	-679,649,194.55	-451,608,729.92
1. 提取盈余公积				76,013,488.21		-76,013,488.21	
2. 提取一般风险准备					152,026,976.42	-152,026,976.42	
3. 对所有者（或股东）的分配						-451,608,729.92	-451,608,729.92
4. 其他							
（四）所有者权益内部结转			279,152.55			-279,152.55	
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			279,152.55			-279,152.55	
6. 其他							
四、本年年末余额	6,645,109,124.00	11,654,405,801.60	180,305,447.46	1,176,661,527.73	2,276,343,067.06	2,634,290,062.83	24,567,115,030.68

公司负责人：吴坚

主管会计工作负责人：吴坚

会计机构负责人：叶平

三、公司基本情况

1. 公司概况

√适用 □不适用

西南证券股份有限公司（以下简称公司或本公司）系经中国证券监督管理委员会（以下简称证监会）批准，通过重庆长江水运股份有限公司重大资产重组及吸收合并西南证券有限责任公司，并依法承继西南证券有限责任公司的各项证券业务资格设立的上市证券公司。

西南证券有限责任公司是 1999 年 12 月 28 日经中国证监会证监机构字[1999]32 号文、证监机构字[1999]114 号文和证监机构字[1999]159 号文批复，以原重庆国际信托投资有限公司证券部、原重庆市证券公司、原重庆有价证券公司和原重庆证券登记有限责任公司的全部净资产为基础，联合其他股东（均以现金出资）共同发起设立的有限责任公司。2009 年 2 月，经中国证监会证监许可[2009]62 号文批复，重庆长江水运股份有限公司重大资产重组并以新增 1,658,997,062 股人民币普通股吸收合并西南证券有限责任公司，并依法承继西南证券有限责任公司的各项证券业务资格。2009 年 2 月 17 日，公司在重庆市工商行政管理局办理完成相关变更登记备案手续，公司名称变更为西南证券股份有限公司。

公司现持有统一社会信用代码为 91500000203291872B 的营业执照。截至 2021 年 12 月 31 日，公司注册资本 6,645,109,124.00 元，股份总数 6,645,109,124 股（每股面值 1 元），其中：有限售条件的股份 1,000,000,000 股，无限售条件的股份 5,645,109,124 股。

本公司主要经营活动：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，证券资产管理，融资融券，证券投资基金代销，代销金融产品，为期货公司提供中间介绍业务，股票期权做市。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司拥有 4 家一级子公司，120 家证券分支机构；拥有员工 2,398 人，其中高级管理人员 8 人。

本财务报表业经 2022 年 4 月 25 日公司第九届董事会第十八次会议批准对外报出。

2. 合并财务报表范围

√适用 □不适用

本公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，具体情况详见本报告“第十节 财务报告九、合并范围的变更及十、在其他主体中的权益”。

四、财务报表的编制基础

1. 编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

2. 持续经营

√适用 □不适用

本公司不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况。

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

1. 遵循企业会计准则的声明

本公司所编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了公司的财务状况、经营成果、股东权益变动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

4. 记账本位币

本公司的记账本位币为人民币。

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) 同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在企业合并中取得的资产和负债，按照合并日被合并方在最终控制方合并财务报表中的账面价值计量。公司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份额与支付的合并对价账面价值或发行股份面值总额的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

(2) 非同一控制下企业合并的会计处理方法

公司在购买日对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；如果合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额，首先对取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值以及合并成本的计量进行复核，经复核后合并成本仍小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益。

6. 合并财务报表的编制方法

适用 不适用

母公司将其控制的所有子公司纳入合并财务报表的合并范围。合并财务报表以母公司及其子公司的财务报表为基础，根据其他有关资料，由母公司按照《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》编制。

7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

适用 不适用

(1) 合营安排分为共同经营和合营企业。

(2) 当公司为共同经营的合营方时，确认与共同经营中利益份额相关的下列项目：

- 1) 确认单独所持有的资产，以及按持有份额确认共同持有的资产；
- 2) 确认单独所承担的负债，以及按持有份额确认共同承担的负债；
- 3) 确认出售公司享有的共同经营产出份额所产生的收入；
- 4) 按公司持有份额确认共同经营因出售资产所产生的收入；
- 5) 确认单独所发生的费用，以及按公司持有份额确认共同经营发生的费用。

8. 现金及现金等价物的确定标准

列示于现金流量表中的现金是指库存现金以及可以随时用于支付的存款。现金等价物是指企业持有的期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

9. 外币业务和外币报表折算

√适用 □不适用

(1) 外币业务折算

外币交易在初始确认时，采用交易发生日即期汇率的近似汇率折算为人民币金额。资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日即期汇率折算，因汇率不同而产生的汇兑差额，除与购建符合资本化条件资产有关的外币专门借款本金及利息的汇兑差额外，计入当期损益；以历史成本计量的外币非货币性项目仍采用交易发生日的即期汇率折算，不改变其人民币金额；以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算，差额计入当期损益或其他综合收益。

(2) 外币财务报表折算

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

10. 金融工具

√适用 □不适用

(1) 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：

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

金融负债在初始确认时划分为以下四类：

- 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；
- 2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；
- 3) 不属于上述 1) 或 2) 的财务担保合同，以及不属于上述 1) 并以低于市场利率贷款的贷款承

诺；

4) 以摊余成本计量的金融负债。

(2) 金融资产和金融负债的确认依据、计量方法和终止确认条件

1) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。但是，公司初始确认的应收账款未包含重大融资成分或公司不考虑未超过一年的合同中的融资成分的，按照《企业会计准则第 14 号——收入》所定义的交易价格进行初始计量。

2) 金融资产的后续计量方法

①以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，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债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

③以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资

采用公允价值进行后续计量。获得的股利（属于投资成本收回部分的除外）计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

④以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

采用公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

3) 金融负债的后续计量方法

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此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。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因公司自身信用风险变动引起的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公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因公司自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

②金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债

按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》相关规定进行计量。

③不属于上述①或②的财务担保合同，以及不属于上述①并以低于市场利率贷款的贷款承诺

在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：A. 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；B. 初始确认金额扣除按照《企业会计准则第 14 号——收入》相关规定所确定的累计摊销额后的余额。

④以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

4) 金融资产和金融负债的终止确认

①当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

A. 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

B. 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

②当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（3）金融资产转移的确认依据和计量方法

公司转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别按下列情况处理：1) 未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；2) 保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：1) 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；2) 因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为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）之和。转移了金融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：1) 终止确认部分的账面价值；2) 终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为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）之和。

（4）金融资产和金融负债的公允价值确定方法

公司采用在当前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确定相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

1) 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；

2) 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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据作出的财务预测等。

(5) 金融工具减值

1) 金融工具减值计量和会计处理

公司以预期信用损失为基础，对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、合同资产、租赁应收款、分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的贷款承诺、不属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债或不属于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债的财务担保合同进行减值处理并确认损失准备。

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，对于公司购买或源生的已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，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。

对于租赁应收款、由《企业会计准则第14号——收入》规范的交易形成的应收款项及合同资产，公司运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

除上述计量方法以外的金融资产，公司在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，公司按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，公司按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

公司利用可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

于资产负债表日，若公司判断金融工具只具有较低的信用风险，则假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

公司判断金融工具是否已违约，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。

公司判断金融工具已发生信用减值的依据，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定量、定性指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，公司将该金融资产界定为已发生信用减值：

- ① 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- ② 债务人发生重大财务困难；
- ③ 债权人由于债务人的财务困难作出让步；
- ④ 债务人很可能破产或存在其他财务重组等事项；
- ⑤ 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；
- ⑥ 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- ⑦ 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别。

公司以单项金融工具或金融工具组合为基础评估预期信用风险和计量预期信用损失。当以金融工具组合为基础时，公司以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组合。

金融工具信用减值三阶段划分的具体标准、减值的具体计量方法和参数等，详见本报告“第十节 财务报告 十七、风险管理 2. 信用风险”之说明。

公司在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，公司在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

2) 按组合评估预期信用风险和计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
融出资金	业务性质及风险特征	根据信用风险自初始确认后是否显著增加以及是否发生信用减值，对不同的金融工具分别以未来12个月内或相当于整个存续期内的预期信用损失计量减值准备。在计量预期信用损失时，充分考虑了前瞻性信息。预期信用损失为考虑了前瞻性影响的违约概率(PD)、违约损失率(LGD)及违约风险敞口(EAD)三者乘积折现后的结果。
融出证券	业务性质及风险特征	
买入返售金融资产	业务性质及风险特征	
其他债权投资	业务性质及风险特征	
其他应收款—无信用风险组合	业务性质及风险特征	
		参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失，该组合预期信用损失率为0%。

其他应收款—账龄组合	账龄	参考历史信用损失经验，结合当前状况以及对未来经济状况的预测，通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
------------	----	---

3) 按组合计量预期信用损失的金融工具

项 目	确定组合的依据	计量预期信用损失的方法
应收款项-无收款风险组合	业务性质及风险特征	包括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、业绩报酬和佣金等，信用风险不重大，不计提减值准备。

(6) 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，公司以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：1) 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；2) 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，公司不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

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

本公司以预期信用损失为基础，对应收款项进行减值会计处理并确认损失准备，详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 10. 金融工具”中的金融工具的减值。

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

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。公司将同一合同下的合同资产和合同负债相互抵销后以净额列示。

公司将拥有的、无条件(即，仅取决于时间流逝)向客户收取对价的权利作为应收款项列示，将已向客户转让商品而有权收取对价的权利(该权利取决于时间流逝之外的其他因素)作为合同资产列示。

(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

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

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，即公司已经就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。

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，在取得日将其划分为持有待售类别。

因公司无法控制的下列原因之一，导致非关联方之间的交易未能在一年内完成，且公司仍然承诺出售非流动资产或处置组的，继续将非流动资产或处置组划分为持有待售类别：1) 买方或其他方意外设定导致出售延期的条件，公司针对这些条件已经及时采取行动，且预计能够自设定导致出售延期的条件起一年内顺利化解延期因素；2) 因发生罕见情况，导致持有待售的非流动资产或处置组未能在一年内完成出售，公司在最初一年内已经针对这些新情况采取必要措施且重新满足了持有待售类别的划分条件。

(2) 持有待售的非流动资产或处置组的计量**1) 初始计量和后续计量**

初始计量和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。

对于取得日划分为持有待售类别的非流动资产或处置组，在初始计量时比较假定其不划分为持有待售类别情况下的初始计量金额和公允价值减去出售费用后的净额，以两者孰低计量。除企业合并中取得的非流动资产或处置组外，由非流动资产或处置组以公允价值减去出售费用后的净额作为初始计量金额而产生的差额，计入当期损益。

对于持有待售的处置组确认的资产减值损失金额，先抵减处置组中商誉的账面价值，再根据处置组中的各项非流动资产账面价值所占比重，按比例抵减其账面价值。

持有待售的非流动资产或处置组中的非流动资产不计提折旧或摊销，持有待售的处置组中负债的利息和其他费用继续予以确认。

2) 资产减值损失转回的会计处理

后续资产负债表日持有待售的非流动资产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。划分为持有待售类别前确认的资产减值损失不转回。

后续资产负债表日持有待售的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非流动资产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，以及非流动资产在划分为持有待售类别前确认的资产减值损失不转回。

持有待售的处置组确认的资产减值损失后续转回金额，根据处置组中除商誉外各项非流动资产账面价值所占比重，按比例增加其账面价值。

3) 不再继续划分为持有待售类别以及终止确认的会计处理

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。

终止确认持有待售的非流动资产或处置组时，将尚未确认的利得或损失计入当期损益。

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

本公司以预期信用损失为基础，对债权投资进行减值会计处理并确认损失准备，详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 10. 金融工具”中的金融工具的减值。

17. 其他债权投资

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

本公司以预期信用损失为基础，对其他债权投资进行减值会计处理并确认损失准备，详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 10. 金融工具”中的金融工具的减值。

18. 长期股权投资

适用 不适用

(1) 共同控制、重大影响的判断

按照相关约定对某项安排存在共有的控制，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，认定为共同控制。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，认定为重大影响。

(2) 投资成本的确定

1) 同一控制下的企业合并形成的，合并方以支付现金、转让非现金资产、承担债务或发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得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其初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价的账面价值或发行股份的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。

公司通过多次交易分步实现同一控制下企业合并形成的长期股权投资，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，在合并日，根据合并后应享有被合并方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初始投资成本。合并日长期股权投资的初始投资成本，与达到合并前的长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

2) 非同一控制下的企业合并形成的，在购买日按照支付的合并对价的公允价值作为其初始投资成本。

公司通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，区分个别财务报表和合并财务报表进行相关会计处理：

①在个别财务报表中，按照原持有的股权投资的账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。

②在合并财务报表中，判断是否属于“一揽子交易”。属于“一揽子交易”的，把各项交易作为一项取得控制权的交易进行会计处理。不属于“一揽子交易”的，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。

3) 除企业合并形成以外的：以支付现金取得的，按照实际支付的购买价款作为其初始投资成本；以发行权益性证券取得的，按照发行权益性证券的公允价值作为其初始投资成本；以债务重组方式取得的，按《企业会计准则第 12 号——债务重组》确定其初始投资成本；以非货币性资产交换取得的，按《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换》确定其初始投资成本。

(3) 后续计量及损益确认方法

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。

(4) 通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权的处理方法

1) 个别财务报表

对处置的股权，其账面价值与实际取得价款之间的差额，计入当期损益。对于剩余股权，对被投资单位仍具有重大影响或者与其他方一起实施共同控制的，转为权益法核算；不能再对被投资单位实施控制、共同控制或重大影响的，按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的相关规定进行核算。

2) 合并财务报表

①通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且不属于“一揽子交易”的

在丧失控制权之前，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），资本溢价不足冲减的，冲减留存收益。

丧失对原子公司控制权时，对于剩余股权，按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司自购买日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，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益等，应当在丧失控制权时转为当期投资收益。

②通过多次交易分步处置对子公司投资至丧失控制权，且属于“一揽子交易”的

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

19. 投资性房地产

如果采用成本计量模式的：

折旧或摊销方法

(1) 投资性房地产包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权和已出租的建筑物。

(2) 投资性房地产按照成本进行初始计量，采用成本模式进行后续计量，并采用与固定资产和无形资产相同的方法计提折旧或进行摊销。

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，使用年限超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量时予以确认。

(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	30-35	3	3.23-2.77
电子设备	年限平均法	3-5	3	32.33-19.40
机器设备	年限平均法	5-10	3	19.40-9.70
运输工具	年限平均法	4-6	3	24.25-16.17
办公设备	年限平均法	3-6	3	32.33-16.17

(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) 在建工程同时满足经济利益很可能流入、成本能够可靠计量则予以确认。在建工程按建造该项资产达到预定可使用状态前所发生的实际成本计量。

(2) 在建工程达到预定可使用状态时，按工程实际成本转入固定资产。已达到预定可使用状态但尚未办理竣工决算的，先按估计价值转入固定资产，待办理竣工决算后再按实际成本调整原暂估价值，但不再调整原已计提的折旧。

22. 借款费用

□适用 √不适用

23. 使用权资产

√适用 □不适用

使用权资产详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 40. 租赁”中相关内容。

24. 无形资产**(1) 计价方法、使用寿命、减值测试**

√适用 □不适用

1) 无形资产包括土地使用权、专利权及非专利技术等，按成本进行初始计量。

2) 使用寿命有限的无形资产，在使用寿命内按照与该项无形资产有关的经济利益的预期实现方式系统合理地摊销，无法可靠确定预期实现方式的，采用直线法摊销。具体年限如下：

项目	摊销年限(年)
交易席位费	10
软件	3
土地使用权	39.5

使用寿命不确定的无形资产不摊销，公司在每个会计期间均对该无形资产的使用寿命进行复核。

(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

对长期股权投资、采用成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、使用权资产和使用寿命有限的无形资产等长期资产，在资产负债表日有迹象表明发生减值的，估计其可收回金额。对因企业合并所形成的商誉和使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年都进行减值测试。商誉结合与其相关的资产组或者资产组组合进行减值测试。

若上述长期资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额确认资产减值准备并计入当期损益。

26. 长期待摊费用

适用 不适用

长期待摊费用核算已经支出，摊销期限在 1 年以上（不含 1 年）的各项费用。长期待摊费用按实际发生额入账，在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的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

合同负债的确认方法

适用 不适用

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。公司将同一合同下的合同资产和合同负债相互抵销后以净额列示。

公司将已收或应收客户对价而应向客户转让商品的义务作为合同负债列示。

29. 职工薪酬

职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

(1) 短期薪酬的会计处理方法

适用 不适用

在职工为公司提供服务的会计期间，将实际发生的短期薪酬确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

(2) 离职后福利的会计处理方法

适用 不适用

离职后福利分为设定提存计划和设定受益计划。

1) 在职工为公司提供服务的会计期间，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。

2) 对设定受益计划的会计处理通常包括下列步骤：

①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作出估计，计量设定受益计划所产生的义务，并确定相关义务的所属期间。同时，对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；

②设定受益计划存在资产的，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，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；

③期末，将设定受益计划产生的职工薪酬成本确认为服务成本、设定受益计划净负债或净资产的利息净额以及重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动等三部分，其中服务成本和设定受益计划净负债或净资产的利息净额计入当期损益或相关资产成本，重新计量设定受益计划净负债或净资产所产生的变动计入其他综合收益，并且在后续会计期间不允许转回至损益，但可以在权益范围内转移这些在其他综合收益确认的金额。

(3) 辞退福利的会计处理方法

适用 不适用

向职工提供的辞退福利，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) 公司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) 公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

(4) 其他长期职工福利的会计处理方法

适用 不适用

向职工提供的其他长期福利，符合设定提存计划条件的，按照设定提存计划的有关规定进行会计处理；除此之外的其他长期福利，按照设定受益计划的有关规定进行会计处理，为简化相关会计处理，将其产生的职工薪酬成本确认为服务成本、其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额以及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等组成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

(1)因对外提供担保、诉讼事项、亏损合同等或有事项形成的义务成为公司承担的现时义务，履行该义务很可能导致经济利益流出公司，且该义务的金额能够可靠的计量时，公司将该项义务确认为预计负债。(2)公司按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数对预计负债进行初始计量，并在资产负债表日对预计负债的账面价值进行复核。

31. 租赁负债

适用 不适用

租赁负债详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 40. 租赁”中相关内容。

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

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) 手续费及佣金收入

与交易相关的经济利益能够流入公司，相关的收入能够可靠计量且满足下列各项经营活动的特定收入确认标准时，确认相关的手续费及佣金收入。

① 经纪业务收入

代理买卖证券手续费收入、期货经纪业务手续费收入在交易日确认收入。

② 投资银行业务收入

证券承销业务收入，按承销方式分别确认收入：1) 采用全额包销方式的，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认收入；2) 采用余额包销、代销方式的，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认。

保荐业务和财务顾问业务按照提供劳务收入的确认条件，在提供劳务交易的结果能够可靠估计时确认为收入。

③ 资产管理和基金管理业务收入

受托客户资产管理业务收入和基金管理费收入，在资产管理合同或基金到期或者定期与委托单位结算收益或损失时，按合同规定收益分成方式和比例计算的应该享有的收益或承担的损失，确认为当期损益。

④ 投资咨询业务收入

投资咨询业务收入按照提供劳务收入的确认条件，在提供劳务交易的结果能够可靠估计时确认为收入。

⑤ 代兑付债券业务收入

公司接受委托对委托方发行的债券到期进行兑付时，在代兑付债券业务提供的相关服务完成时确认收入。

2) 利息收入

对于所有以摊余成本计量的金融工具及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产中计息的金融工具，利息收入以实际利率计量。实际利率是指按金融工具的预计存续期间将其预计未来现金流入或流出折现至该金融资产账面余额或金融负债摊余成本的利率。实际利率的计算需要考虑金融工具的合同条款(例如提前还款权)并且包括所有归属于实际利率组成部分的费用和所有交易成本，但不包括预期信用损失。

公司根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入并列报为“利息收入”，但下列情况除外：①对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，自初始确认起，按照该金融资产的摊

余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入；②对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产的摊余成本（即，账面余额扣除预期信用损失准备之后的净额）和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，并且这一改善在客观上可与应用上述规定之后发生的某一事件相联系，转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

(2) 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

与合同成本有关的资产包括合同取得成本和合同履约成本。

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。

公司为履行合同发生的成本，不适用存货、固定资产或无形资产等相关准则的规范范围且同时满足下列条件的，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。

公司对于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，计入当期损益。

如果与合同成本有关的资产的账面价值高于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减去估计将要发生的成本，公司对超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失。以前期间减值的因素之后发生变化，使得转让该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价减去估计将要发生的成本高于该资产账面价值的，转回原已计提的资产减值准备，并计入当期损益，但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

公司当期实现的净利润按下列顺序分配：

(1) 弥补以前年度亏损；

(2) 按10%提取法定盈余公积金；

(3) 按10%提取一般风险准备；

(4) 并按财政部及证监会等监管机构规定的比例10%提取交易风险准备；

(5) 按公司章程或股东大会的决议提取任意盈余公积金；

(6) 按经审议通过的利润分配方案进行分配。

公司法定盈余公积达到累计达到注册资本的 50%，可不再提取。公司计提的一般风险准备金和交易风险准备金，用于弥补证券交易的损失，提取的公积金可用于弥补亏损或者转增股本。法定盈余公积金转为股本时，所留存的该项公积金不得少于转增前公司注册资本的 25%。

38. 政府补助

(1) 政府补助在同时满足下列条件时予以确认

- 1) 公司能够满足政府补助所附的条件；
- 2) 公司能够收到政府补助。政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量；公允价值不能可靠取得的，按照名义金额计量。

(2) 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

政府文件规定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。政府文件不明确的，以取得该补助必须具备的基本条件为基础进行判断，以购建或以其他方式形成长期资产为基本条件的作为与资产相关的政府补助。与资产相关的政府补助，冲减相关资产的账面价值或确认为递延收益。与资产相关的政府补助确认为递延收益的，在相关资产使用寿命内按照合理、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。

(3) 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。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，难以区分与资产相关或与收益相关的，整体归类为与收益相关的政府补助。与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关成本费用或损失的，确认为递延收益，在确认相关成本费用或损失的期间，计入当期损益或冲减相关成本；用于补偿已发生的相关成本费用或损失的，直接计入当期损益或冲减相关成本。

(4) 与公司日常经营活动相关的政府补助，按照经济业务实质，计入其他收益或冲减相关成本费用。与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

(1) 根据资产、负债的账面价值与其计税基础之间的差额（未作为资产和负债确认的项目按照税法规定可以确定其计税基础的，该计税基础与其账面数之间的差额），按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计算确认递延所得税资产或递延所得税负债。

(2) 确认递延所得税资产以很可能取得用来抵扣可抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。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，确认以前会计期间未确认的递延所得税资产。

(3) 资产负债表日，对递延所得税资产的账面价值进行复核，如果未来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，则减记递延所得税资产的账面价值。在很可能获得足够的应纳税所得额时，转回减记的金额。

(4) 公司当期所得税和递延所得税作为所得税费用或收益计入当期损益，但不包括下列情况产生的所得税：1) 企业合并；2) 直接在所有者权益中确认的交易或者事项。

40. 租赁

(1) 经营租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

公司作为承租人时，不再区分经营租赁和融资租赁。公司作为出租人时，经营租赁的会计处理方法见“（3）新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法”。

(2) 融资租赁的会计处理方法

√适用 □不适用

公司作为承租人时，不再区分经营租赁和融资租赁。公司作为出租人时，融资租赁的会计处理方法见“（3）新租赁准则下租赁的确定方法及会计处理方法”。

(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

1) 公司作为承租人

在租赁期开始日，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。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，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。

① 使用权资产

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。

公司按照直线法对使用权资产计提折旧。能够合理确定租赁期届满时取得租赁资产所有权的，公司在租赁资产剩余使用寿命内计提折旧。无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，公司在租赁期与租赁资产剩余使用寿命两者孰短的期间内计提折旧。

② 租赁负债

在租赁开始日，公司将尚未支付的租赁付款额的现值确认为租赁负债。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,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,如使用权资产账面价值已调减至零,但租赁负债仍需进一步调减的,将剩余金额计入当期损益。

2) 公司作为出租人

在租赁开始日,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。

①经营租赁

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。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。

②融资租赁

在租赁期开始日,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,公司按照租赁内含利率计算并确认利息收入。

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。

41. 融资融券业务

适用 不适用

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

融资业务,按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理。公司融出的资金,确认应收债权,并确认相应利息收入。

融券业务,融出的证券按照《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》有关规定,不终止确认该证券,并确认相应利息收入。

公司对客户融资融券并代客户买卖证券时,作为证券经纪业务进行会计处理。

公司根据借出资金及违约概率情况,合理预计未来可能发生的损失,充分反映应承担的借出资金及证券的履约风险情况。

42. 资产证券化业务

适用 不适用

43. 客户交易结算资金

公司收到的客户交易结算资金存放在存管银行的专门账户上，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，在结算备付金中核算。公司在收到代理客户买卖证券款的同时确认为资产及负债，公司代理客户买卖证券的款项在与清算代理机构清算时，按规定缴纳的经手费、证管费、证券结算风险基金等相关费用确认为手续费支出，按规定向客户收取的手续费，在与客户办理买卖证券款项清算时确认为手续费收入。

44. 证券承销业务

公司证券承销的方式包括余额包销和代销。在余额包销方式下，对发行期结束后未售出的证券按约定的发行价格转为交易性金融资产等。

公司将发行项目立项之前的相关费用计入当期损益。项目立项之后，将可单独辨认的发行费用记入待转承销费用科目，待项目成功发行后，结转损益。所有已确认不能成功发行的项目费用记入当期损益。

45. 买入返售与卖出回购款项

买入返售交易是指按照合同或协议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”项目列示。

卖出回购交易是指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”项目列示。卖出的金融产品仍按原分类列于公司的资产负债表内，并按照相关的会计政策核算。

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

46. 客户资产管理

公司客户资产管理业务分为定向资产管理业务、集合资产管理业务、专项资产管理业务。

公司对所管理的不同资产管理计划以每个产品为会计核算主体，单独建账、独立核算，单独编制财务报告。不同资产管理计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。对集合资产管理业务产品的会计核算，比照证券投资基金会计核算办法进行，并于每个估值日对集合资产计划按公允价值进行会计估值。

资产管理业务形成的资产和负债不在公司资产负债表内反映，在财务报表附注中列示，详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 56. 手续费及佣金净收入”之说明。

47. 转融通业务

公司通过中国证券金融股份有限公司转融通业务融入资金或证券的，对融入的资金确认为一项资产，同时确认一项对借出方的负债，转融通业务产生的利息费用计入当期损益；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，不将其计入资产负债表。

48. 分部报告

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，本公司的经营分部是指同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 管理层能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

49. 其他重要的会计政策和会计估计

√适用 □不适用

(1) 终止经营的确认标准、会计处理方法

满足下列条件之一的、已经被处置或划分为持有待售类别且能够单独区分的组成部分确认为终止经营：

- 1) 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；
- 2) 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；
- 3) 该组成部分是专为转售而取得的子公司。

(2) 采用套期会计的依据、会计处理方法

1) 套期包括公允价值套期/现金流量套期/境外经营净投资套期。

2) 对于满足下列条件的套期，运用套期会计方法进行处理：①套期关系仅由符合条件的套期工具和被套期工具组成；②在套期开始时，公司正式指定了套期工具和被套期项目，并准备了关于套期关系和公司从事套期的风险管理策略和风险管理目标的书面文件；③该套期关系符合套期有效性要求。

套期同时满足下列条件时，公司认定套期关系符合套期有效性要求：①被套期项目和套期工具之间存在经济关系；②被套期项目和套期工具经济关系产生的价值变动中，信用风险的影响不占主导地位；③套期关系的套期比率等于公司实际套期的被套期项目数量与对其进行套期的套期工具实际数量之比，但不反映被套期项目和套期工具相对权重的失衡。

公司在套期开始日及以后期间持续地对套期关系是否符合套期有效性要求进行评估。套期关系由于套期比率的原因而不再符合套期有效性要求，但指定该套期关系的风险管理目标没有改变的，公司进行套期关系再平衡。

3) 套期会计处理

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

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

被套期项目为尚未确认的确定承诺（或其组成部分）的，其在套期关系指定后因被套期风险引起的公允价值累计变动额确认为一项资产或负债，相关的利得或损失计入各相关期间损益。当履行确定承诺而取得资产或承担负债时，调整该资产或负债的初始确认金额，以包括已确认的被套期项目的公允价值累计变动额。

被套期项目为以摊余成本计量的金融工具（或其组成部分）的，公司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利率进行摊销，并计入当期损益。被套期项目为按照《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（或其组成部分）的，按照相同的方式对累计已确认的套期利得或损失进行摊销，并计入当期损益，但不调整金融资产（或其组成部分）的账面价值。

50. 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)
根据财政部2018年12月印发的《企业会计准则第21号——租赁》（以下简称新租赁准则），公司自2021年1月1日起执行新租赁准则，并变更公司租赁业务会计政策。	经公司第九届董事会第十次会议和第九届监事会第五次会议审议通过。	因采用新租赁准则引起的具体影响科目及金额详见（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。

其他说明：

1) 本公司自 2021 年 1 月 1 日（以下称首次执行日）起执行经修订的《企业会计准则第 21 号——租赁》（以下简称新租赁准则）。

①对本公司作为承租人的租赁合同，公司根据首次执行日执行新租赁准则与原准则的累计影响数调整本报告期初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。具体处理如下：

对于首次执行日前的融资租赁，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。

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

在首次执行日，公司按照本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 25. 长期资产减值”的规定，对使用权资产进行减值测试并进行相应会计处理。

本公司的香港子公司西证国际已于 2019 年 1 月 1 日起执行新租赁准则，本公司在编制 2019 年度和 2020 年度财务报表时将西证国际报表按照未执行新租赁准则口径调整后，再纳入合并。2021 年 1 月 1 日起，本公司开始执行新租赁准则，无需再对西证国际报表进行上述调整。

A. 执行新租赁准则对公司 2021 年 1 月 1 日财务报表的主要影响详见“（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”。

B. 首次执行日计入资产负债表的租赁负债所采用的公司增量借款利率区间为 3.13%-6.90%。

C. 对首次执行日前的经营租赁采用的简化处理

a. 对于首次执行日后 12 个月内完成的租赁合同，公司采用简化方法，不确认使用权资产和租赁负债。

b. 公司根据首次执行日前续租选择权或终止租赁选择权的实际行权及其他最新情况确定租赁期；

c. 首次执行日前发生租赁变更的，公司根据租赁变更的最终安排进行会计处理。

上述简化处理对公司财务报表无显著影响。

②对首次执行日前已存在的低价值资产经营租赁合同，公司采用简化方法，不确认使用权资产和租赁负债，自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

③对公司作为出租人的租赁合同，自首次执行日起按照新租赁准则进行会计处理。

2) 公司自 2021 年 1 月 26 日起执行财政部于 2021 年度颁布的《企业会计准则解释第 14 号》，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

(2) 重要会计估计变更

适用 不适用

(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
资产:			
货币资金	17,203,544,523.08	17,203,544,523.08	
其中:客户资金存款	10,421,240,189.52	10,421,240,189.52	
结算备付金	3,429,659,479.81	3,429,659,479.81	
其中:客户备付金	2,251,550,962.03	2,251,550,962.03	
融出资金	12,001,843,139.77	12,001,843,139.77	
衍生金融资产	663,975.84	663,975.84	
存出保证金	1,405,554,892.41	1,405,554,892.41	
应收款项	118,444,884.10	118,444,884.10	
买入返售金融资产	1,404,131,659.30	1,404,131,659.30	
金融投资:			
交易性金融资产	26,860,163,662.56	26,860,163,662.56	
其他债权投资	9,107,073,011.84	9,107,073,011.84	
其他权益工具投资	3,424,774,498.21	3,424,774,498.21	
长期股权投资	2,241,094,880.32	2,241,094,880.32	
投资性房地产	69,559,047.23	69,559,047.23	
固定资产	234,252,429.42	234,252,429.42	
在建工程	767,019,295.87	767,019,295.87	
使用权资产		143,316,929.74	143,316,929.74
无形资产	165,408,654.14	165,408,654.14	
商誉	119,636,099.49	119,636,099.49	
递延所得税资产	374,210,282.57	374,210,282.57	
其他资产	261,284,049.30	251,906,212.08	-9,377,837.22
资产总计	79,188,318,465.26	79,322,257,557.78	133,939,092.52
负债:			
应付短期融资款	3,773,336,512.74	3,773,336,512.74	
拆入资金	2,007,622,222.23	2,007,622,222.23	
交易性金融负债	594,122,571.81	594,122,571.81	
衍生金融负债	2,292,602.56	2,292,602.56	
卖出回购金融资产款	18,321,196,405.95	18,321,196,405.95	
代理买卖证券款	12,455,051,319.74	12,455,051,319.74	
应付职工薪酬	1,252,851,712.88	1,252,851,712.88	
应交税费	67,051,168.80	67,051,168.80	
应付款项	109,801,383.70	109,801,383.70	
预计负债	1,493,338.88	1,493,338.88	
应付债券	15,126,853,662.88	15,126,853,662.88	
租赁负债		137,370,625.43	137,370,625.43
递延所得税负债	213,997,175.09	213,997,175.09	
其他负债	183,283,545.41	182,315,705.41	-967,840.00
负债合计	54,108,953,622.67	54,245,356,408.10	136,402,785.43
所有者权益(或股东权益):			
实收资本(或股本)	6,645,109,124.00	6,645,109,124.00	
资本公积	11,654,405,801.60	11,654,405,801.60	
其他综合收益	203,085,565.91	203,085,565.91	
盈余公积	1,176,661,527.73	1,176,661,527.73	
一般风险准备	2,276,343,067.06	2,276,343,067.06	

未分配利润	3,187,755,048.11	3,185,929,451.66	-1,825,596.45
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计	25,143,360,134.41	25,141,534,537.96	-1,825,596.45
少数股东权益	-63,995,291.82	-64,633,388.28	-638,096.46
所有者权益（或股东权益）合计	25,079,364,842.59	25,076,901,149.68	-2,463,692.91
负债和所有者权益（或股东权益）总计	79,188,318,465.26	79,322,257,557.78	133,939,092.52

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
资产：			
货币资金	14,814,222,449.60	14,814,222,449.60	
其中：客户资金存款	9,973,107,853.37	9,973,107,853.37	
结算备付金	3,073,943,997.55	3,073,943,997.55	
其中：客户备付金	1,893,211,629.00	1,893,211,629.00	
融出资金	11,925,957,812.41	11,925,957,812.41	
衍生金融资产	663,975.84	663,975.84	
存出保证金	642,746,129.30	642,746,129.30	
应收款项	49,761,070.31	49,761,070.31	
买入返售金融资产	1,129,715,941.37	1,129,715,941.37	
金融投资：			
交易性金融资产	22,794,288,250.42	22,794,288,250.42	
其他债权投资	9,107,073,011.84	9,107,073,011.84	
其他权益工具投资	3,424,774,498.21	3,424,774,498.21	
长期股权投资	6,551,036,608.54	6,551,036,608.54	
投资性房地产	66,526,452.67	66,526,452.67	
固定资产	230,238,769.98	230,238,769.98	
在建工程	767,019,295.87	767,019,295.87	
使用权资产		117,908,854.22	117,908,854.22
无形资产	162,104,744.05	162,104,744.05	
递延所得税资产	271,893,737.02	271,893,737.02	
其他资产	109,486,069.43	100,360,765.42	-9,125,304.01
资产总计	75,121,452,814.41	75,230,236,364.62	108,783,550.21
负债：			
应付短期融资款	3,773,336,512.74	3,773,336,512.74	
拆入资金	2,007,622,222.23	2,007,622,222.23	
卖出回购金融资产款	18,301,300,144.26	18,301,300,144.26	
代理买卖证券款	11,301,462,420.56	11,301,462,420.56	
应付职工薪酬	1,068,028,171.22	1,068,028,171.22	
应交税费	57,947,246.99	57,947,246.99	
应付款项	47,735,262.26	47,735,262.26	
预计负债	1,493,338.88	1,493,338.88	
应付债券	13,804,981,258.70	13,804,981,258.70	
租赁负债		108,783,550.21	108,783,550.21

递延所得税负债	64,853,963.24	64,853,963.24	
其他负债	125,577,242.65	125,577,242.65	
负债合计	50,554,337,783.73	50,663,121,333.94	108,783,550.21
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	6,645,109,124.00	6,645,109,124.00	
资本公积	11,654,405,801.60	11,654,405,801.60	
其他综合收益	180,305,447.46	180,305,447.46	
盈余公积	1,176,661,527.73	1,176,661,527.73	
一般风险准备	2,276,343,067.06	2,276,343,067.06	
未分配利润	2,634,290,062.83	2,634,290,062.83	
所有者权益（或股东权益）合计	24,567,115,030.68	24,567,115,030.68	
负债和所有者权益（或股东权益）总计	75,121,452,814.41	75,230,236,364.62	108,783,550.21

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

51. 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	销售货物或提供应税劳务	13%、6%或 3%
房产税	从价计征的，按房产原值一次减除 30%后余值的 1.2%计缴；从租计征的，按租金收入的 12%计缴	1.2%或 12%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加	应缴流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%、15%或 16.5%

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
西南期货有限公司	15%
西证股权投资有限公司	15%
西证国际证券股份有限公司	16.5%
西证国际投资有限公司	16.5%
除上述以外的其他纳税主体	25%

2. 税收优惠

适用 不适用

根据财政部、税务总局、国家发展改革委公告 2020 年第 23 号《关于延续西部大开发企业所得税政策的公告》，自 2021 年 1 月 1 日至 2030 年 12 月 31 日，对设在西部地区的鼓励类产业企业减按 15% 的税率征收企业所得税。西南期货有限公司和西证股权投资有限公司 2021 年度暂按 15% 的税率计缴企业所得税。

3. 其他

适用 不适用

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：	/	/	68,270.63	/	/	103,710.67
人民币	/	/	42,076.53	/	/	76,500.20
港元	13,000.00	0.8176	10,628.80	13,000.00	0.8416	10,940.80
新加坡元	3,299.20	4.7179	15,565.30	3,299.20	4.9314	16,269.67
银行存款：	/	/	15,319,948,523.59	/	/	17,201,548,067.19
其中：自有资金	/	/	3,954,037,875.91	/	/	6,780,307,877.67
人民币	/	/	3,739,032,982.10	/	/	6,485,818,837.29
美元	10,705,248.73	6.3757	68,253,454.33	4,131,380.24	6.5249	26,956,842.93
港元	179,171,775.18	0.8176	146,490,843.39	317,549,194.11	0.8416	267,249,401.76
新加坡元	4,989.71	4.7179	23,540.95	5,102.30	4.9314	25,161.48
澳元	29,886.69	4.622	138,136.28	29,886.45	5.0163	149,919.40
欧元	613.51	7.2197	4,429.36	618.24	8.0250	4,961.38
英镑	3,830.83	8.6064	32,969.66	3,830.83	8.8903	34,057.23
加拿大元	281.37	5.0046	1,408.14	301.26	5.1161	1,541.28
日元	1,084,755.00	0.0554	60,111.70	1,061,973.00	0.0632	67,154.92
客户资金	/	/	11,365,910,647.68	/	/	10,421,240,189.52
人民币	/	/	11,299,204,837.04	/	/	10,354,444,722.11
美元	6,644,580.09	6.3757	42,363,849.28	6,141,475.84	6.5249	40,072,515.71
港元	29,772,457.63	0.8176	24,341,961.36	31,752,556.68	0.8416	26,722,951.70
其他货币资金：	/	/	53,609,265.04	/	/	1,892,745.22
人民币	/	/	1,891,349.77	/	/	1,892,745.22
港元	63,255,767.21	0.8176	51,717,915.27			
合计	/	/	15,373,626,059.26	/	/	17,203,544,523.08

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	/	/	78,631,760.25	/	/	6,951,666.36
人民币	/	/	78,631,760.25	/	/	6,951,666.36
客户信用资金	/	/	1,148,511,468.32	/	/	1,435,755,259.73
人民币	/	/	1,148,511,468.32	/	/	1,435,755,259.73

合计	/	/	1,227,143,228.57	/	/	1,442,706,926.09
----	---	---	------------------	---	---	------------------

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

货币资金的说明：

适用 不适用

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：	/	/	1,334,928,125.69	/	/	1,178,108,517.78
人民币	/	/	1,334,928,125.69	/	/	1,178,108,517.78
客户普通备付金：	/	/	2,457,382,054.12	/	/	1,812,579,095.40
人民币	/	/	2,398,147,803.10	/	/	1,774,652,170.11
美元	6,222,325.55	6.3757	39,671,681.01	3,600,240.83	6.5249	23,491,211.39
港元	23,926,822.42	0.8176	19,562,570.01	17,152,701.88	0.8416	14,435,713.90
客户信用备付金：	/	/	446,822,034.92	/	/	438,971,866.63
人民币	/	/	446,822,034.92	/	/	438,971,866.63
合计	/	/	4,239,132,214.73	/	/	3,429,659,479.81

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	14,271,393,924.76	11,956,868,912.35
其中：个人	11,656,040,218.77	9,721,523,922.30
机构	2,615,353,705.99	2,235,344,990.05
减：减值准备	34,825,103.12	30,911,099.94
账面价值小计	14,236,568,821.64	11,925,957,812.41
境外	35,939,168.31	76,188,465.91
其中：个人	33,862,622.33	30,192,515.42
机构	2,076,545.98	45,995,950.49
减：减值准备	332,987.78	303,138.55
账面价值小计	35,606,180.53	75,885,327.36
账面价值合计	14,272,175,002.17	12,001,843,139.77

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	1,179,467,086.73	1,364,420,960.04
债券	53,789,350.07	313,760,333.58
股票	54,007,726,573.91	42,491,208,352.20
基金	319,266,205.09	102,368,618.72
合计	55,560,249,215.80	44,271,758,264.54

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

详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 27. 资产减值准备变动表和 28. 金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

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

按剩余到期日分析

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占比(%)	金额	计提比例(%)
1-3 个月	4,729,640,748.75	33.06	11,650,413.37	0.25
3-6 个月	8,457,985,198.32	59.11	20,688,227.94	0.24
6 个月以上	1,119,707,146.00	7.83	2,819,449.59	0.25
合计	14,307,333,093.07	100.00	35,158,090.90	0.25

(续上表)

账龄	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占比(%)	金额	计提比例(%)
1-3 个月	3,946,564,459.81	32.80	11,426,617.62	0.29
3-6 个月	7,471,784,282.98	62.09	18,250,282.91	0.24
6 个月以上	614,708,635.47	5.11	1,537,337.96	0.25
合计	12,033,057,378.26	100.00	31,214,238.49	0.26

6. 衍生金融工具

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

类别	期末					
	套期工具			非套期工具		
	名义金 额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资 产	负 债		资产	负债
利率衍生工具				340,000,000.00	397,206.38	
利率互换				340,000,000.00	397,206.38	
货币衍生工具						
权益衍生工具				918,558,474.32	23,153,609.46	5,515,932.91
期权				154,700,800.00	3,688,929.75	
权益类收益互 换				204,659,532.00	19,464,679.71	
期货				559,198,142.32		5,515,932.91
信用衍生工具						
其他衍生工具						
合计				1,258,558,474.32	23,550,815.84	5,515,932.91

(续上表)

类别	期初					
	套期工具			非套期工具		
	名义金 额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资 产	负 债		资产	负债
利率衍生工具				440,000,000.00	663,975.84	
利率互换				440,000,000.00	663,975.84	
货币衍生工具						
权益衍生工具				254,273,365.44		2,292,602.56
期货				254,273,365.44		2,292,602.56
信用衍生工具						
其他衍生工具						
合计				694,273,365.44	663,975.84	2,292,602.56

已抵销的衍生金融工具:

适用 不适用**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	/	/	1,487,662,172.57	/	/	1,387,012,501.75
其中: 人民 币	/	/	1,480,578,599.63	/	/	1,379,953,747.51
美元	270,000.00	6.3757	1,721,439.00	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
港元	6,558,383.00	0.8176	5,362,133.94	6,294,001.00	0.8416	5,297,031.24
信用保证金	/	/	17,049,661.33	/	/	18,542,390.66
其中: 人民 币	/	/	17,049,661.33	/	/	18,542,390.66
合计	/	/	1,504,711,833.90	/	/	1,405,554,892.41

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
应收清算款	286,930,956.06	114,509,864.12
应收资产管理费	2,239,723.76	3,802,224.22
应收托管费	129,145.94	132,795.76
合计	289,299,825.76	118,444,884.10
应收款项账面价值	289,299,825.76	118,444,884.10

(2) 按账龄分析

适用 不适用

(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：								
单项小计								
组合计提坏账准备：								
无收款风险组合	289,299,825.76	100.00			118,444,884.10	100.00		
组合小计	289,299,825.76	100.00			118,444,884.10	100.00		
合计	289,299,825.76	100.00			118,444,884.10	100.00		

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

(4) 应收票据

适用 不适用

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

(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	42,456,406.20	32,086,402.50
股票质押式回购	1,112,582,850.67	1,283,024,536.56
债券质押式回购	403,683,966.74	163,492,010.00
减：减值准备	83,273,455.12	74,471,289.76
账面价值合计	1,475,449,768.49	1,404,131,659.30

(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	1,155,039,256.87	1,315,110,939.06
债券	403,683,966.74	163,492,010.00
减：减值准备	83,273,455.12	74,471,289.76
买入返售金融资产账面价值	1,475,449,768.49	1,404,131,659.30

(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	4,662,009,057.55	5,839,102,768.77

注：通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，无法获知对手方质押库信息，故此金额并未包括交易所国债逆回购所取得的担保物资产的公允价值。上述买入返售金融资产 2021 年 12 月 31 日余额为人民币 103,634,651.68 元。

(4) 约定购回、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
一个月至三个月内	2,985,923.98	1,404,963.33

三个月至一年内	39,470,482.22	30,681,439.17
合计	42,456,406.20	32,086,402.50

(5) 股票质押回购融出资金按剩余期限分类披露

单位：元 币种：人民币

剩余期限	期末数	期初数
一个月内	127,665,137.34	195,631,273.56
一个月至三个月内	415,767,358.67	300,650,833.33
三个月至一年内	500,103,333.33	693,844,154.67
一年以上	69,047,021.33	92,898,275.00
合计	1,112,582,850.67	1,283,024,536.56

(6) 股票质押回购融出资金信用风险敞口

单位：元 币种：人民币

期末数	阶段一 未来 12 个月预期信用损失	阶段二 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	阶段三 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	合计
账面余额	999,046,946.67		113,535,904.00	1,112,582,850.67
减值准备	4,953,100.61		78,132,156.45	83,085,257.06
担保物金额	4,133,207,747.32		57,499,516.23	4,190,707,263.55

(续上表)

期初数	阶段一 未来 12 个月预期信用损失	阶段二 整个存续期预期信用损失（未发生信用减值）	阶段三 整个存续期预期信用损失（已发生信用减值）	合计
账面余额	826,837,151.89	260,556,111.11	195,631,273.56	1,283,024,536.56
减值准备	4,039,805.66	2,552,410.36	67,744,413.63	74,336,629.65
担保物金额	4,859,059,034.75	670,032,000.00	244,457,621.02	5,773,548,655.77

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

详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 27. 资产减值准备变动表和 28. 金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

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**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	20,768,522,389.83		20,768,522,389.83	21,694,474,636.98		21,694,474,636.98
公募基金	2,563,493,972.51		2,563,493,972.51	2,608,597,459.27		2,608,597,459.27
股票	3,047,011,189.05		3,047,011,189.05	2,900,603,621.17		2,900,603,621.17
银行理财产品	187,842,600.00		187,842,600.00	180,000,000.00		180,000,000.00
券商资管产品	641,529,443.56		641,529,443.56	623,990,516.55		623,990,516.55
其他	3,162,792,502.82		3,162,792,502.82	2,693,495,916.82		2,693,495,916.82
合计	30,371,192,097.77		30,371,192,097.77	30,701,162,150.79		30,701,162,150.79
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	18,169,749,485.53		18,169,749,485.53	18,575,731,800.78		18,575,731,800.78
公募基金	3,271,184,044.15		3,271,184,044.15	3,258,551,589.78		3,258,551,589.78
股票	3,322,881,426.74		3,322,881,426.74	2,952,963,591.53		2,952,963,591.53
券商资管产品	265,435,587.68		265,435,587.68	256,453,410.70		256,453,410.70
其他	1,830,913,118.46		1,830,913,118.46	1,515,250,619.74		1,515,250,619.74
合计	26,860,163,662.56		26,860,163,662.56	26,558,951,012.53		26,558,951,012.53

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

变现有限制的交易性金融资产详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释

75. 所有权或使用权受到限制的资产”。

14. 债权投资适用 不适用**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				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	175,307,351.37	897,066.79	277,071.09	176,481,489.25	
地方债	7,347,429,975.03	107,071,576.77	103,211,922.87	7,557,713,474.67	505,523.23
金融债	20,000,000.00	164,383.56	145,120.00	20,309,503.56	22,548.42

企业债	456,525,211.05	8,837,086.17	6,906,420.45	472,268,717.67	701,439.27
公司债	584,993,181.75	12,383,994.53	7,602,218.25	604,979,394.53	642,795.73
其他	140,022,532.42	1,927,408.21	1,090,227.58	143,040,168.21	374,639.31
合计	8,724,278,251.62	131,281,516.03	119,232,980.24	8,974,792,747.89	2,246,945.96

(续上表)

项目	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
国债	390,417,202.02	3,861,835.35	-8,796,027.10	385,483,010.27	
地方债	7,369,186,049.01	120,020,906.62	107,285,618.99	7,596,492,574.62	579,046.72
金融债	19,891,295.98	327,594.52	172,664.02	20,391,554.52	14,065.78
企业债	120,000,000.00	1,423,419.18	-224,400.00	121,199,019.18	214,030.91
公司债	540,434,183.50	12,664,830.14	1,824,302.10	554,923,315.74	668,976.39
其他	414,000,000.00	14,143,931.51	439,606.00	428,583,537.51	582,913.91
合计	8,853,928,730.51	152,442,517.32	100,701,764.01	9,107,073,011.84	2,059,033.71

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

详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 27. 资产减值准备变动表和 28.

金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

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：

变现有限制的其他债权投资详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注 75. 所有权或使用权受到限制的资产”。

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	期末余额		期初余额		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	初始成本	本期末公允价值	
非交易性权益工具	923,327,088.32	888,450,912.82	3,268,783,418.83	3,424,774,498.21	非交易目的持有
合计	923,327,088.32	888,450,912.82	3,268,783,418.83	3,424,774,498.21	/

注：本期确认的股利收入 241,465,888.19 元，上年同期确认股利收入 31,080,799.98 元。

(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
非交易性权益工具	2,468,082,288.73	138,684,933.91	-14,119,845.72	业务需要
合计	2,468,082,288.73	138,684,933.91	-14,119,845.72	/

其他说明：

√适用 □不适用

变现有限制的其他权益工具投资详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释

75. 所有权或使用权受到限制的资产”。

17. 长期股权投资

√适用 □不适用

(1) 分类情况

单位：元 币种：人民币

项 目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	2,646,288,177.55	208,252,876.04	2,438,035,301.51
合 计	2,646,288,177.55	208,252,876.04	2,438,035,301.51

(续上表)

项 目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	2,449,347,756.36	208,252,876.04	2,241,094,880.32
合 计	2,449,347,756.36	208,252,876.04	2,241,094,880.32

(2) 明细情况

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		
联营企业											
银华基金管理股份有限公司	2,111,525,295.98			406,773,287.15	240,251.93		216,827,231.69			2,301,711,603.37	208,252,876.04
重庆股份转让中心有限责任公司	129,569,584.34			12,844,744.76			6,090,630.96			136,323,698.14	
小计	2,241,094,880.32			419,618,031.91	240,251.93		222,917,862.65			2,438,035,301.51	208,252,876.04
合计	2,241,094,880.32			419,618,031.91	240,251.93		222,917,862.65			2,438,035,301.51	208,252,876.04

其他说明：

本公司于资产负债表日对持有的银华基金股权价值进行了减值测试，并聘请开元资产评估有限公司进行评估。评估机构按公允价值减处置费用法评估银华基金股权价值，并出具了《评估报告》（开元评报字[2022]232号）。截至2021年12月31日，本公司所持银华基金股权评估价值高于当前持有的银华基金股权账面价值，故本期不计提减值。

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	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	190,359,869.28	190,359,869.28
2. 本期增加金额	868,282.41	868,282.41
(1) 固定资产转入	868,282.41	868,282.41
3. 本期减少金额	296,860.65	296,860.65
(1) 处置	296,860.65	296,860.65
4. 期末余额	190,931,291.04	190,931,291.04
二、累计折旧和累计摊销		
1. 期初余额	113,309,499.62	113,309,499.62
2. 本期增加金额	7,100,508.00	7,100,508.00
(1) 计提或摊销	6,396,885.40	6,396,885.40
(2) 固定资产转入	703,622.60	703,622.60
3. 本期减少金额	173,222.71	173,222.71
(1) 处置	173,222.71	173,222.71
4. 期末余额	120,236,784.91	120,236,784.91
三、减值准备		
1. 期初余额	7,491,322.43	7,491,322.43
2. 期末余额	7,491,322.43	7,491,322.43
四、账面价值		
1. 期末账面价值	63,203,183.70	63,203,183.70
2. 期初账面价值	69,559,047.23	69,559,047.23

(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
房屋及建筑物	1,520,635.52	相关产权正在办理
小计	1,520,635.52	/

其他说明

□适用 √不适用

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	机器设备	运输工具	办公设备	合计
一、账面原值：						
1. 期初余额	350,817,796.46	273,573,143.59	8,072,858.32	31,300,620.96	28,088,859.08	691,853,278.41
2. 本期增加金额	941,140,400.00	12,873,447.66	121,492,040.02		10,159,753.40	1,085,665,641.08
(1) 购置		12,873,447.66	1,507,840.02		10,159,753.40	24,541,041.08

(2) 在建工程转入	941,140,400.00		119,984,200.00			1,061,124,600.00
3. 本期减少金额	868,282.41	29,564,201.89	86,592.04	18,162.33	741,803.70	31,279,042.37
(1) 处置或报废		29,224,739.70	86,592.04		675,991.00	29,987,322.74
(2) 转为投资性房地产	868,282.41					868,282.41
(3) 其他		339,462.19		18,162.33	65,812.70	423,437.22
4. 期末余额	1,291,089,914.05	256,882,389.36	129,478,306.30	31,282,458.63	37,506,808.78	1,746,239,877.12
二、累计折旧						
1. 期初余额	147,054,211.89	245,738,908.81	7,388,764.74	28,250,863.82	22,042,933.11	450,475,682.37
2. 本期增加金额	10,983,690.79	12,453,449.64	179,084.04	1,368,301.75	2,098,876.83	27,083,403.05
(1) 计提	10,983,690.79	12,453,449.64	179,084.04	1,368,301.75	2,098,876.83	27,083,403.05
3. 本期减少金额	703,622.60	28,594,252.42	83,182.66	10,291.99	652,990.89	30,044,340.56
(1) 处置或报废		28,270,492.11	83,182.66		601,154.05	28,954,828.82
(2) 转为投资性房地产	703,622.60					703,622.60
(3) 其他		323,760.31		10,291.99	51,836.84	385,889.14
4. 期末余额	157,334,280.08	229,598,106.03	7,484,666.12	29,608,873.58	23,488,819.05	447,514,744.86
三、减值准备						
1. 期初余额	7,125,166.62					7,125,166.62
2. 期末余额	7,125,166.62					7,125,166.62
四、账面价值						
1. 期末账面价值	1,126,630,467.35	27,284,283.33	121,993,640.18	1,673,585.05	14,017,989.73	1,291,599,965.64
2. 期初账面价值	196,638,417.95	27,834,234.78	684,093.58	3,049,757.14	6,045,925.97	234,252,429.42

(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

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
江北嘴大楼				767,019,295.87		767,019,295.87
合计				767,019,295.87		767,019,295.87

(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	期末余额	工程进度(%)	资金来源
江北嘴大楼	1,130,000,000.00	767,019,295.87	294,105,304.13	1,061,124,600.00		100	自有资金
合计	1,130,000,000.00	767,019,295.87	294,105,304.13	1,061,124,600.00			/

(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

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	广告位	其他	合计
一、账面原值				
1. 期初余额	164,489,938.77	3,442,303.86	649,061.28	168,581,303.91
2. 本期增加金额	53,787,439.60	1,148,612.52	985,321.65	55,921,373.77
(1) 租入	53,787,439.60	1,148,612.52	985,321.65	55,921,373.77
3. 本期减少金额	13,876,229.82	211,660.63	55,972.00	14,143,862.45
(1) 终止租赁	12,470,448.56	211,660.63	55,972.00	12,738,081.19
(2) 其他	1,405,781.26			1,405,781.26
4. 期末余额	204,401,148.55	4,379,255.75	1,578,410.93	210,358,815.23
二、累计折旧				
1. 期初余额	25,264,374.17			25,264,374.17
2. 本期增加金额	68,831,313.56	2,425,770.34	1,268,017.29	72,525,101.19
(1) 计提	68,831,313.56	2,425,770.34	1,268,017.29	72,525,101.19
3. 本期减少金额	2,586,643.17	89,120.25		2,675,763.42
(1) 终止租赁	1,866,176.23	89,120.25		1,955,296.48
(2) 其他	720,466.94			720,466.94
4. 期末余额	91,509,044.56	2,336,650.09	1,268,017.29	95,113,711.94
三、减值准备				
四、账面价值				
1. 期末账面价值	112,892,103.99	2,042,605.66	310,393.64	115,245,103.29
2. 期初账面价值	139,225,564.60	3,442,303.86	649,061.28	143,316,929.74

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	计算机软件	交易席位费	其他	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	158,578,919.84	259,587,620.79	8,455,624.87	1,400,000.00	428,022,165.50
2. 本期增加金额		41,984,209.52			41,984,209.52
(1) 购置		41,984,209.52			41,984,209.52

3. 本期减少金额		336,160.41			336,160.41
(1) 处置或报废		136,107.77			136,107.77
(2) 其他		200,052.64			200,052.64
4. 期末余额	158,578,919.84	301,235,669.90	8,455,624.87	1,400,000.00	469,670,214.61
二、累计摊销					
1. 期初余额	42,398,995.69	211,758,890.80	8,455,624.87		262,613,511.36
2. 本期增加金额	4,005,703.56	28,512,089.99			32,517,793.55
(1) 计提	4,005,703.56	28,512,089.99			32,517,793.55
3. 本期减少金额		310,113.58			310,113.58
(1) 处置或报废		136,107.77			136,107.77
(2) 其他		174,005.81			174,005.81
4. 期末余额	46,404,699.25	239,960,867.21	8,455,624.87		294,821,191.33
三、减值准备					
四、账面价值					
1. 期末账面价值	112,174,220.59	61,274,802.69		1,400,000.00	174,849,023.28
2. 期初账面价值	116,179,924.15	47,828,729.99		1,400,000.00	165,408,654.14

(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

单位：元 币种：人民币

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
西证国际证券股份有限公司	255,949,533.11		7,298,941.05	248,650,592.06
西南期货有限公司	40,620,597.75			40,620,597.75
合计	296,570,130.86		7,298,941.05	289,271,189.81

注：本期减少系汇率变动所致。

(2) 商誉减值准备

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
西证国际证券股份有限公司	147,336,131.37	107,155,070.66	5,840,609.97	248,650,592.06
西南期货有限公司	29,597,900.00			29,597,900.00
合计	176,934,031.37	107,155,070.66	5,840,609.97	278,248,492.06

注：本期增加为计提减值，本期减少系汇率变动所致。

(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

1) 西南期货有限公司

公司聘请开元资产评估有限公司对商誉可回收金额进行评估，评估机构采用未来现金流量折现模型计算资产组可收回额，可收回额基于管理层经营计划和调整后的折现率计算。评估机构出具了《评估报告》（开元评报字[2022]0184号）。截至2021年12月31日，上述对可收回金额的预计表明本期不需要计提商誉减值损失。

2) 西证国际证券股份有限公司

西证国际证券股份有限公司系香港主板上市企业，西证国际证券股份有限公司的可回收金额基于公允价值减去处置费用计算，公允价值按照其期末前五个交易日平均收盘价计算。本年度报告中按照上述方法测算并计提了商誉减值损失。截至2021年12月31日，根据测算，已全额计提商誉减值损失。

(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
资产减值准备	221,681,461.73	43,420,365.44	208,183,200.77	40,045,800.19
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	397,043,100.39	99,193,324.98		
其他权益工具投资公允价值变动	34,876,175.50	8,719,043.88		
应付职工薪酬	709,307,450.27	173,749,263.05	509,043,419.50	124,366,464.87
可抵扣亏损			35,137,732.13	5,270,659.82
结构化主体母公司承担亏损	807,923,092.11	201,935,081.86	814,092,378.36	203,523,094.59
其他	4,206,189.20	630,928.38	5,699,528.08	1,004,263.10
合计	2,175,037,469.20	527,648,007.59	1,572,156,258.84	374,210,282.57

(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
交易性金融工具、衍生金融工具的公允价值变动	473,095,920.24	102,892,713.81	622,078,491.62	133,907,226.16
其他债权投资公允价值变动	121,479,926.20	30,369,981.55	102,760,797.72	25,690,199.43
其他权益工具投资公允价值变动			155,991,079.38	38,997,769.85
结构化主体母公司享有利润	78,726,360.20	11,808,954.03	102,575,597.67	15,401,979.65
合计	673,302,206.64	145,071,649.39	983,405,966.39	213,997,175.09

(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

(4) 未确认递延所得税资产明细

□适用 √不适用

(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

其他说明：

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
应收利息	7,112,732.54	17,997,267.97
应收股利	36,071,857.97	3,514,300.63
其他应收款	99,784,355.65	117,822,600.90
长期待摊费用	19,519,162.90	24,724,107.79
预付款项	43,918,035.17	30,885,696.53
预缴税费	2,902,912.53	46,426,272.98
其他	14,739,945.03	10,535,965.28
合计	224,049,001.79	251,906,212.08

(1) 应收利息

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
应收债券利息	69,144,518.87	69,144,518.87
应收买入返售金融资产利息	5,083,945.20	5,083,945.20
减：减值准备	67,115,731.53	56,231,196.10
合计	7,112,732.54	17,997,267.97

(2) 应收股利

单位：元 币种：人民币

项目	期末数	期初数
账龄 1 年以内	36,071,857.97	3,514,300.63
其中：基金、股票红利	36,071,857.97	3,514,300.63
合计	36,071,857.97	3,514,300.63

(3) 其他应收款

1) 明细情况

① 按评估方式列示

单位：元 币种：人民币

种类	期末数				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	占比(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	637,259,484.64	92.84	585,379,279.42	91.86	51,880,205.22
组合计提坏账准备	49,175,682.27	7.16	1,271,531.84	2.59	47,904,150.43
合计	686,435,166.91	100.00	586,650,811.26	85.46	99,784,355.65

(续上表)

种类	期初数		
	账面余额	坏账准备	账面价值

	金额	占比(%)	金额	计提比例(%)	
单项计提坏账准备	650,877,550.39	91.99	588,668,726.14	90.44	62,208,824.25
组合计提坏账准备	56,667,154.95	8.01	1,053,378.30	1.86	55,613,776.65
合计	707,544,705.34	100.00	589,722,104.44	83.35	117,822,600.90

② 按账龄列示

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占比(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	10,502,168.31	1.53	1,810,441.05	17.24
1-2 年	13,277,801.05	1.93	4,231,295.99	31.87
2-3 年	316,187,869.72	46.06	263,484,999.96	83.33
3 年以上	346,467,327.83	50.48	317,124,074.26	91.53
合计	686,435,166.91	100.00	586,650,811.26	85.46

(续上表)

账龄	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占比(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	26,308,889.98	3.72	5,710,860.72	21.71
1-2 年	327,116,949.07	46.23	261,467,662.05	79.93
2-3 年	153,313,725.35	21.67	152,359,000.42	99.38
3 年以上	200,805,140.94	28.38	170,184,581.25	84.75
合计	707,544,705.34	100.00	589,722,104.44	83.35

2) 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
押金保证金	41,625,680.79	43,273,277.96
拆借款	512,727,441.71	527,367,552.90
应收暂付款	3,978,177.39	8,419,028.67
应收投资款	120,000,000.00	120,000,000.00
其他	8,103,867.02	8,484,845.81
合计	686,435,166.91	707,544,705.34

3) 其他应收款金额前 5 名情况

单位：元 币种：人民币

单位名称	款项性质	账面余额	账龄	占其他应收款余额的比例(%)	坏账准备
短欠融资客户#80819069	拆借款	233,162,496.51	2-3 年	33.97	233,162,496.51
短欠融资客户#80818983	拆借款	136,983,845.51	3 年以上	19.96	136,983,845.51
河南富田畜牧发展有限公司	投资款	120,000,000.00	3 年以上	17.48	120,000,000.00
短欠融资客户#80809619	拆借款	13,664,965.60	3 年以上	1.99	13,664,965.60
短欠融资客户#80819400	拆借款	12,968,442.94	2-3 年	1.89	12,968,442.94
合计		516,779,750.56		75.29	516,779,750.56

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

详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 27. 资产减值准备变动表和 28. 金融工具及其他项目预期信用损失准备表”。

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

(4) 长期待摊费用

单位：元 币种：人民币

项目	期初数	本期增加	本期摊销	期末数
固定资产改良	20,519,277.02	6,327,987.09	10,737,453.43	16,109,810.68
网络工程	2,820,719.40	601,230.14	1,138,267.58	2,283,681.96
其他	1,384,111.37	351,440.82	609,881.93	1,125,670.26
合计	24,724,107.79	7,280,658.05	12,485,602.94	19,519,162.90

(5) 预付款项

1) 账龄分析

单位：元 币种：人民币

账龄	期末数			
	账面余额	占比(%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	33,963,609.72	77.34		33,963,609.72
1-2 年	6,819,795.49	15.53		6,819,795.49
2-3 年	15,000.00	0.03		15,000.00
3 年以上	3,119,629.96	7.10		3,119,629.96
合计	43,918,035.17	100.00		43,918,035.17

(续上表)

账龄	期初数			
	账面余额	占比(%)	坏账准备	账面价值
1 年以内	24,053,112.37	77.87		24,053,112.37
1-2 年	833,486.38	2.70		833,486.38
2-3 年	5,141,611.36	16.65		5,141,611.36
3 年以上	857,486.42	2.78		857,486.42
合计	30,885,696.53	100.00		30,885,696.53

2) 预付款项金额前 5 名情况

单位：元 币种：人民币

单位名称	款项性质	账面余额	占预付款项余额的比例(%)
恒生电子股份有限公司	业务平台采购	6,691,133.95	15.24
中国电信股份有限公司重庆分公司	IDC 机房服务项目	3,993,985.86	9.09
北京信诚华远投资顾问有限公司	短期租赁房租	2,013,862.00	4.59
深圳市财富趋势科技股份有限公司	软件采购款	1,920,353.98	4.37
上海文华财经资讯股份有限公司	期货交易软件使用费	471,698.12	1.07
合计		15,091,033.91	34.36

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	26,247,938.85	43,358,551.34
—交易性金融资产	26,247,938.85	43,358,551.34
转融通融入证券总额		

融券业务违约情况:

□适用 √不适用

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	本期减少			期末余额
			转回	转/核销	其他	
融出资金减值准备	31,214,238.49	3,950,972.97			7,120.56	35,158,090.90
买入返售金融资产减值准备	74,471,289.76	8,802,165.36				83,273,455.12
其他债权投资减值准备	2,059,033.71	187,912.25				2,246,945.96
其他应收款坏账准备	589,722,104.44	10,927,453.97	13,805.22	487,871.09	13,497,070.84	586,650,811.26
应收利息减值准备	56,231,196.10	10,884,535.43				67,115,731.53
金融工具及其他项目信用减值准备小计	753,697,862.50	34,753,039.98	13,805.22	487,871.09	13,504,191.40	774,445,034.77
长期股权投资减值准备	208,252,876.04					208,252,876.04
投资性房地产减值准备	7,491,322.43					7,491,322.43
固定资产减值准备	7,125,166.62					7,125,166.62
商誉减值准备	176,934,031.37	107,155,070.66			5,840,609.97	278,248,492.06
其他资产减值准备小计	399,803,396.46	107,155,070.66			5,840,609.97	501,117,857.15
合计	1,153,501,258.96	141,908,110.64	13,805.22	487,871.09	19,344,801.37	1,275,562,891.92

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
融出资金减值准备	28,825,043.34	6,333,047.56		35,158,090.90
买入返售金融资产减值准备	5,141,298.67		78,132,156.45	83,273,455.12
其他债权投资减值准备	2,246,945.96			2,246,945.96
其他应收款坏账准备	32,208.14		586,618,603.12	586,650,811.26
应收利息减值准备			67,115,731.53	67,115,731.53
合计	36,245,496.11	6,333,047.56	731,866,491.10	774,445,034.77
金融工具类别	期初余额			
	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
融出资金减值准备	26,531,284.54	4,402,768.65	280,185.30	31,214,238.49

买入返售金融资产减值准备	4,174,465.77	2,552,410.36	67,744,413.63	74,471,289.76
其他债权投资减值准备	2,059,033.71			2,059,033.71
其他应收款坏账准备	58,139.93	2,248.60	589,661,715.91	589,722,104.44
应收利息减值准备			56,231,196.10	56,231,196.10
合计	32,822,923.95	6,957,427.61	713,917,510.94	753,697,862.50

29. 短期借款**(1) 短期借款分类**

适用 不适用

(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
收益凭证	1.00	2020/7/7 至 2022/11/29	1 个月至 1 年	4,910,450,000.00	3.3-6.00	1,736,054,320.97	3,250,701,304.57	3,644,275,070.10	1,342,480,555.44
20 西南 D1	100.00	2020/4/24	1 年	2,000,000,000.00	2.70	2,037,282,191.77	16,717,808.23	2,054,000,000.00	
21 西南 D1	100.00	2021/4/27	1 年	2,000,000,000.00	3.25		2,044,342,465.77		2,044,342,465.77
合计				8,910,450,000.00		3,773,336,512.74	5,311,761,578.57	5,698,275,070.10	3,386,823,021.21

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	400,134,499.96	
转融通融入资金	2,006,999,999.91	2,007,622,222.23
合计	2,407,134,499.87	2,007,622,222.23

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	1,006,066,666.58	2.80	1,006,300,000.00	2.80
1至3个月	1,000,933,333.33	2.80	1,001,322,222.23	2.80
合计	2,006,999,999.91	/	2,007,622,222.23	/

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
第三方在结构化主体中享有的权益		463,989,569.64	463,989,569.64		594,122,571.81	594,122,571.81
浮动收益凭证		158,557,798.33	158,557,798.33			
合计		622,547,367.97	622,547,367.97		594,122,571.81	594,122,571.81

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

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
质押式卖出回购	20,522,666,297.97	18,137,185,429.89
质押式报价回购	549,964,879.79	184,010,976.06
合计	21,072,631,177.76	18,321,196,405.95

(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	20,619,993,128.40	18,237,104,891.26
其他	452,638,049.36	84,091,514.69
合计	21,072,631,177.76	18,321,196,405.95

(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	22,884,970,300.86	20,490,389,837.82
其他	570,266,610.39	114,711,056.40
合计	23,455,236,911.25	20,605,100,894.22

(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	519,049,586.43	1.50-3.20	173,939,976.06	2.00-3.35
一个月至三个月内	30,915,293.36		10,071,000.00	
合计	549,964,879.79		184,010,976.06	

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	10,992,265,830.87	8,867,899,868.99
机构	2,211,576,332.48	2,222,730,490.71
小计	13,203,842,163.35	11,090,630,359.70
信用业务		
其中：个人	1,121,685,807.42	1,312,726,843.22
机构	56,597,058.28	51,694,116.82
小计	1,178,282,865.70	1,364,420,960.04
合计	14,382,125,029.05	12,455,051,319.74

35. 代理承销证券款

□适用 √不适用

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	1,218,607,655.27	1,294,201,325.48	1,256,041,022.75	1,256,767,958.00
二、离职后福利-设定提存计划	2,276,704.50	90,312,914.56	90,404,954.76	2,184,664.30
三、辞退福利	79,680.38		67,307.28	12,373.10
四、离职后福利-设定受益计划	31,887,672.73	3,472,795.52	1,260,434.07	34,100,034.18
合计	1,252,851,712.88	1,387,987,035.56	1,347,773,718.86	1,293,065,029.58

(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	1,181,085,684.85	1,155,674,670.00	1,119,521,435.37	1,217,238,919.48
二、职工福利费		23,168,759.31	23,168,759.31	
三、社会保险费	1,455,793.71	46,369,602.75	46,784,190.32	1,041,206.14
其中：医疗保险费	399,344.84	44,716,466.02	44,735,242.74	380,568.12
工伤保险费	35,538.53	1,064,668.38	1,069,080.05	31,126.86
生育保险费	1,020,910.34	588,468.35	979,867.53	629,511.16
四、住房公积金	101,615.00	55,821,002.19	55,641,370.50	281,246.69
五、工会经费和职工教育经费	35,964,561.71	13,167,291.23	10,925,267.25	38,206,585.69
合计	1,218,607,655.27	1,294,201,325.48	1,256,041,022.75	1,256,767,958.00

(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	1,761,276.79	67,953,942.10	68,072,880.96	1,642,337.93
2、失业保险费	489,273.19	2,112,414.33	2,331,122.84	270,564.68
3、企业年金缴费	26,154.52	20,246,558.13	20,000,950.96	271,761.69
合计	2,276,704.50	90,312,914.56	90,404,954.76	2,184,664.30

(4) 设定受益计划变动情况

1) 设定受益计划义务现值

单位：元 币种：人民币

项目	本期数
期初余额	31,887,672.73
计入当期综合收益的设定受益成本	3,472,795.52
①利息净额	1,216,706.04
②重新计量变动	2,256,089.48
其他变动	-1,260,434.07
①已支付的福利	-1,260,434.07
期末余额	34,100,034.18

2) 设定受益计划净负债

单位：元 币种：人民币

项目	本期数
期初余额	31,887,672.73
计入当期损益的设定受益成本	1,216,706.04
计入其他综合收益的设定受益成本	2,256,089.48
其他变动	-1,260,434.07
期末余额	34,100,034.18

3) 设定受益计划的内容

公司为2013年1月1日之前退休的职工提供以下补充退休后福利：养老金低于社平工资的人员，补足社平工资再每月每人增加500元补贴；养老金高于社平工资的人员，每月每人增加800元补贴。

4) 设定受益计划重大精算假设

精算假设条件中，折现率为3.26%，社平工资增长率区分重庆地区和深圳地区情况，设置为9.00%—4.00%，重庆地区人均预期寿命男性为75.71岁，女性为80.94岁，深圳地区人均预期寿命男性为78.89岁，女性为84.39岁。

其他说明：

□适用 不适用

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
增值税	32,484,691.32	14,946,580.89
企业所得税	40,770,350.28	3,084,580.14
个人所得税	32,170,735.40	40,155,276.66
城市维护建设税	854,101.47	236,103.83
教育费附加及地方教育费附加	623,169.81	181,727.78
投资者保护基金	8,822,369.32	7,714,806.52
其他	835,949.68	732,092.98
合计	116,561,367.28	67,051,168.80

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
应付清算款	90,242,706.29	77,858,502.38
应付手续费及佣金	8,646,822.25	31,166,147.35
应付托管费	873,572.35	776,733.97
合计	99,763,100.89	109,801,383.70

(2) 应付票据适用 不适用

其他说明

适用 不适用**39. 合同负债****(1) 合同负债情况**适用 不适用**(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：

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
未决诉讼	1,493,338.88		1,493,338.88		
合计	1,493,338.88		1,493,338.88		/

42. 长期借款**长期借款分类**适用 不适用

其他说明，包括利率区间：

适用 不适用

43. 应付债券

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

债券类型	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
18 西南 C1	100.00	2018/5/8	3 年	1,900,000,000.00	6.10	1,975,890,684.89	40,143,916.98	2,016,034,601.87	
19 西南 01	100.00	2019/4/2	3 年	2,500,000,000.00	3.85	2,571,777,712.33	97,193,585.81	96,250,000.00	2,572,721,298.14
19 西南 02	100.00	2019/7/18	3 年	2,500,000,000.00	3.77	2,542,131,023.26	95,028,830.52	94,250,000.00	2,542,909,853.78
19 西南 C1	100.00	2019/9/12	3 年	2,640,000,000.00	4.50	2,676,453,698.59	118,474,520.52	118,800,000.00	2,676,128,219.11
20 西证 01	100.00	2020/7/14	3 年	2,000,000,000.00	3.80	2,034,350,057.44	76,542,188.68	76,000,000.00	2,034,892,246.12
20 西南 C1	100.00	2020/12/15	3 年	2,000,000,000.00	4.70	2,004,378,082.19	93,999,999.98	94,000,000.00	2,004,378,082.17
2 年期离岸美元债券	1,000.00 美元	2019/4/17	2 年	1,396,140,463.70	6.90	1,321,872,404.18	21,260,789.73	1,343,133,193.91	
3 年期离岸美元债券	1,000.00 美元	2021/2/9	3 年	1,151,746,664.64	4.00		1,169,291,422.31	21,043,388.56	1,148,248,033.75
合计				16,087,887,128.34		15,126,853,662.88	1,711,935,254.53	3,859,511,184.34	12,979,277,733.07

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
房屋及建筑物	110,503,571.75	133,686,616.01
广告位	2,068,603.73	3,112,582.43
其他	1,502,710.42	571,426.99
合计	114,074,885.90	137,370,625.43

45. 递延收益

□适用 √不适用

涉及政府补助的项目：

□适用 √不适用

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	291,586,757.83	127,949,778.62
应付股利	38,020,702.61	38,020,702.61
代理兑付债券款	511,638.50	511,638.50
预收款项	1,308,433.40	361,726.25
期货风险准备金	19,501,423.41	15,471,859.43
合计	350,928,955.75	182,315,705.41

(1) 其他应付款

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
押金保证金	26,679,964.73	47,971,693.50
应付暂收款	18,905,494.46	27,193,814.40
信息系统及设备尾款	2,190,345.47	2,484,272.59
总部大楼应付工程款	184,416,579.42	
其他	59,394,373.75	50,299,998.13
合计	291,586,757.83	127,949,778.62

(2) 应付股利

单位：元 币种：人民币

单位名称	期末余额	期初余额
应付普通股股利	38,020,702.61	38,020,702.61
合计	38,020,702.61	38,020,702.61

(3) 代理兑付债券款

单位：元 币种：人民币

项目	期末余额	期初余额
企业债券	511,638.50	511,638.50
合计	511,638.50	511,638.50

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	6,645,109,124.00						6,645,109,124.00

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)	11,341,459,096.67			11,341,459,096.67
其他资本公积	312,946,704.93			312,946,704.93
合计	11,654,405,801.60			11,654,405,801.60

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						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		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	102,239,297.36	-211,949,805.32	-52,423,428.96		-14,119,845.72	-145,406,530.64	-145,406,530.64		-43,167,233.28
其中：重新计量设定受益计划变动额	-14,754,012.18	-2,256,089.48				-2,256,089.48	-2,256,089.48		-17,010,101.66
其他权益工具投资公允价值变动	116,993,309.54	-209,693,715.84	-52,423,428.96		-14,119,845.72	-143,150,441.16	-143,150,441.16		-26,157,131.62
二、将重分类进损益的其他综合收益	100,846,268.55	78,938,596.95	22,199,110.77	52,557,985.77		4,181,500.41	2,129,010.38	2,052,490.03	102,975,278.93
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	995,551.81	240,251.93				240,251.93	240,251.93		1,235,803.74
其他债权投资公允价值变动	75,526,323.01	86,503,847.60	21,625,961.90	50,979,473.53		13,898,412.17	13,898,412.17		89,424,735.18
其他债权投资信用损失准备	1,544,275.28	2,292,595.30	573,148.87	1,578,512.24		140,934.19	140,934.19		1,685,209.47
外币财务报表折算差额	29,318,107.58	-10,098,097.88				-10,098,097.88	-12,150,587.91	2,052,490.03	17,167,519.67
其他	-6,537,989.13								-6,537,989.13
其他综合收益合计	203,085,565.91	-133,011,208.37	-30,224,318.19	52,557,985.77	-14,119,845.72	-141,225,030.23	-143,277,520.26	2,052,490.03	59,808,045.65

(续上表)

项目	期初余额	上期发生金额						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		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	-34,723,891.75	182,897,262.64	46,213,226.08		-279,152.55	136,963,189.11	136,963,189.11		102,239,297.36
其中：重新计量设定受益计划变动额	-12,798,370.51	-1,955,641.67				-1,955,641.67	-1,955,641.67		-14,754,012.18
其他权益工具投资公允价值变动	-21,925,521.24	184,852,904.31	46,213,226.08		-279,152.55	138,918,830.78	138,918,830.78		116,993,309.54
二、将重分类进损益的其他综合收益	218,490,089.80	-119,455,903.72	-23,445,448.41	17,655,232.67		-113,665,687.98	-117,643,821.25	3,978,133.27	100,846,268.55
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	1,430,641.42	-435,089.61				-435,089.61	-435,089.61		995,551.81
其他债权投资公允价值变动	162,352,889.83	-94,393,806.60	-23,598,451.65	16,031,211.87		-86,826,566.82	-86,826,566.82		75,526,323.01
其他债权投资信用损失准备	2,709,286.37	612,012.95	153,003.24	1,624,020.80		-1,165,011.09	-1,165,011.09		1,544,275.28
外币财务报表折算差额	58,535,261.31	-25,239,020.46				-25,239,020.46	-29,217,153.73	3,978,133.27	29,318,107.58
其他	-6,537,989.13								-6,537,989.13
其他综合收益合计	183,766,198.05	63,441,358.92	22,767,777.67	17,655,232.67	-279,152.55	23,297,501.13	19,319,367.86	3,978,133.27	203,085,565.91

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	1,176,661,527.73	84,183,245.63		1,260,844,773.36
合计	1,176,661,527.73	84,183,245.63		1,260,844,773.36

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	计提比例 (%)	本期减少	期末余额
一般风险准备	1,138,171,533.53	84,183,245.63	10.00		1,222,354,779.16
交易风险准备	1,138,171,533.53	84,183,245.63	10.00		1,222,354,779.16
合计	2,276,343,067.06	168,366,491.26			2,444,709,558.32

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	3,187,755,048.11	2,771,469,583.10
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）	-1,825,596.45	
调整后期初未分配利润	3,185,929,451.66	2,771,469,583.10
加：本期归属于母公司所有者的净利润	1,038,152,895.95	1,091,487,407.23
减：提取法定盈余公积	84,183,245.63	76,013,488.21
提取一般风险准备	168,366,491.26	152,026,976.42
应付普通股股利	664,510,912.40	451,608,729.92
其他	14,119,845.72	-4,447,252.33
期末未分配利润	3,292,901,852.60	3,187,755,048.11

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-1,825,596.45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	1,676,480,633.78	1,682,112,083.96
其中：货币资金及结算备付金利息收入	428,948,716.49	432,527,232.16
融出资金利息收入	863,633,191.54	764,546,053.29
买入返售金融资产利息收入	76,429,116.52	101,778,259.95
其中：约定购回利息收入	2,476,219.42	1,646,798.50
股权质押回购利息收入	72,135,430.45	97,987,182.97
其他债权投资利息收入	307,469,609.23	383,220,256.69
其他		40,281.87
利息支出	1,345,120,354.93	1,351,128,854.79
其中：应付短期融资款利息支出	122,451,578.57	104,308,246.54
拆入资金利息支出	63,866,930.34	63,949,277.77

其中：转融通利息支出	55,999,999.84	57,186,111.12
卖出回购金融资产款利息支出	466,486,750.39	409,073,910.03
其中：报价回购利息支出	8,239,995.93	3,648,636.03
代理买卖证券款利息支出	49,341,444.19	48,639,509.55
应付债券利息支出	590,283,461.95	695,941,146.11
其中：次级债券利息支出	252,605,866.73	300,658,696.97
其他	52,690,189.49	29,216,764.79
利息净收入	331,360,278.85	330,983,229.17

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	757,497,210.47	707,803,728.73
证券经纪业务收入	1,018,015,098.60	965,068,371.52
其中：代理买卖证券业务	847,875,896.97	838,782,014.15
交易单元席位租赁	108,653,424.54	98,942,511.56
代销金融产品业务	61,485,777.09	27,343,845.81
证券经纪业务支出	260,517,888.13	257,264,642.79
其中：代理买卖证券业务	260,517,888.13	257,264,642.79
2. 期货经纪业务净收入	64,697,714.50	38,905,503.90
期货经纪业务收入	253,004,884.30	224,879,080.63
期货经纪业务支出	188,307,169.80	185,973,576.73
3. 投资银行业务净收入	267,446,868.84	250,439,855.39
投资银行业务收入	270,158,812.36	260,114,219.83
其中：证券承销业务	186,315,636.82	155,371,386.46
证券保荐业务	18,017,230.55	21,603,553.82
财务顾问业务	65,825,944.99	83,139,279.55
投资银行业务支出	2,711,943.52	9,674,364.44
其中：证券承销业务	2,636,471.82	9,672,477.65
证券保荐业务	75,471.70	
财务顾问业务		1,886.79
4. 资产管理业务净收入	22,762,694.71	29,613,544.26
资产管理业务收入	28,650,997.07	55,693,357.61
资产管理业务支出	5,888,302.36	26,079,813.35
5. 基金管理业务净收入	3,069,536.09	8,520,529.44
基金管理业务收入	3,069,536.09	8,520,529.44
基金管理业务支出		
6. 投资咨询业务净收入	6,128,937.37	11,020,780.15
投资咨询业务收入	7,420,661.22	12,625,478.89
投资咨询业务支出	1,291,723.85	1,604,698.74
7. 其他手续费及佣金净收入	-1,006,961.96	-1,723,331.77
其他手续费及佣金收入		
其他手续费及佣金支出	1,006,961.96	1,723,331.77
合计	1,120,596,000.02	1,044,580,610.10
其中：手续费及佣金收入	1,580,319,989.64	1,526,901,037.92

手续费及佣金支出	459,723,989.62	482,320,427.82
----------	----------------	----------------

(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	1,415,094.34	8,160,377.37
其他财务顾问业务净收入	64,410,850.65	74,977,015.39

(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	3,984,593,756.13	5,791,952.87	2,046,769,024.86	7,868,839.59
信托	2,678,560,000.00	35,142,249.21	2,365,109,207.42	15,881,863.54
其他	1,491,179,182.93	20,551,575.01	490,960,220.89	3,593,142.68
合计	8,154,332,939.06	61,485,777.09	4,902,838,453.17	27,343,845.81

(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
期末产品数量	34	21	2
期末客户数量	1,953	21	48
其中：个人客户	1,926	2	
机构客户	27	19	48
期初受托资金	5,699,882,251.21	22,546,909,131.90	1,243,000,000.00
其中：自有资金投入	1,109,719,052.41		122,000,000.00
个人客户	3,364,045,415.80	23,190,000.00	
机构客户	1,226,117,783.00	22,523,719,131.90	1,121,000,000.00
期末受托资金	1,872,575,469.25	13,514,186,896.34	3,100,000,000.00
其中：自有资金投入	1,097,081,133.41		125,000,000.00
个人客户	440,793,455.23	30,000,000.00	
机构客户	334,700,880.61	13,484,186,896.34	2,975,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	1,677,238,216.40	13,318,062,165.89	3,100,000,000.00
其中：股票	72,759,047.68	19,074,466.92	
国债		21,088,720.00	
其他债券	1,519,159,031.71	1,384,821,157.77	
基金	46,219,111.87		
其他	39,101,025.14	11,893,077,821.20	3,100,000,000.00
当期资产管理业务净收入	4,613,864.15	18,148,830.56	

手续费及佣金净收入的说明：

√适用 □不适用

受托客户资产管理业务明细情况

单位：元 币种：人民币

资产项目	期末数	期初数	负债项目	期末数	期初数
------	-----	-----	------	-----	-----

受托管理资金存款	408,090,190.58	2,714,560,378.00	受托管理资金	17,487,578,108.93	29,434,695,187.50
客户结算备付金	18,024,453.40	45,492,276.32	应付款项	65,504,622.59	327,525,049.14
存出与托管客户资金	2,230,326.23	894,045.21	卖出回购	84,298,289.00	809,214,944.08
应收款项	180,877,227.54	426,867,608.07			
受托投资	17,028,158,822.77	27,383,620,873.12			
其中：投资成本	18,095,300,382.29	28,354,015,225.06			
已实现未结算损益	-1,067,141,559.52	-970,394,351.94			
合计	17,637,381,020.52	30,571,435,180.72	合计	17,637,381,020.52	30,571,435,180.72

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	419,618,031.91	377,284,851.50
金融工具投资收益	1,564,085,226.91	1,313,077,871.10
其中：持有期间取得的收益	1,368,267,593.41	1,001,397,141.20
—交易性金融工具	1,126,801,705.22	970,316,341.22
—其他权益工具投资	241,465,888.19	31,080,799.98
处置金融工具取得的收益	195,817,633.50	311,680,729.90
—交易性金融工具	212,277,033.15	176,538,790.93
—其他债权投资	39,322,250.27	33,453,814.88
—衍生金融工具	-55,781,649.92	101,688,124.09
合计	1,983,703,258.82	1,690,362,722.60

(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	1,126,801,705.22	970,316,341.22
	处置取得收益	212,277,033.15	176,538,790.93

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
专项人才奖励	34,361,100.00	2,199,802.32
三代手续费收入	4,489,752.67	7,066,298.25
财政奖励	2,912,232.79	11,680,974.74
合计	41,763,085.46	20,947,075.31

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	-491,635,719.27	33,170,063.97
交易性金融负债	25,906,066.07	-29,925,893.91
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	25,906,066.07	-30,875,393.91
衍生金融工具	26,452,162.61	-4,280,062.60
合计	-439,277,490.59	-1,035,892.54

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
租赁收入	8,272,710.01	1,068,153.95
大宗商品销售收入	45,426,880.76	55,438,006.19
投资性房地产处置	3,728,724.40	
其他	1,831,885.96	1,413,651.74
合计	59,260,201.13	57,919,811.88

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
非流动资产处置	639,919.30	1,012,312.84
合计	639,919.30	1,012,312.84

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
城市维护建设税	9,454,123.21	9,706,693.76
教育费附加	4,055,309.04	4,111,095.13
地方教育费附加	2,710,203.83	2,723,950.73
房产税	8,029,564.93	3,230,728.95
其他	2,752,895.31	2,358,260.01
合计	27,002,096.32	22,130,728.58

注：主要税种计缴标准详见本报告“第十节 财务报告 六、税项”。

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	1,385,730,946.08	1,253,761,703.26
租赁费	18,464,257.38	86,840,914.92
折旧费	99,608,504.24	27,655,750.29
无形资产摊销	32,517,793.55	31,632,302.64
长期待摊费用摊销	12,485,602.94	45,507,937.01

差旅费	16,594,748.03	14,727,138.15
业务招待费	10,316,817.72	19,393,709.30
投资者保护基金	23,907,995.63	10,895,916.18
咨询费	20,070,530.69	23,241,949.23
电子设备运转费	69,773,227.40	57,532,707.07
邮电费	26,926,476.53	25,561,195.44
交易所会员年费	20,840,333.45	20,393,858.59
物业管理费	20,872,140.70	11,238,040.96
业务宣传费	16,436,422.68	10,129,109.93
其他	60,905,252.96	50,037,723.18
合计	1,835,451,049.98	1,688,549,956.15

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
融出资金减值损失	3,950,972.97	-2,976,678.32
买入返售金融资产减值损失	8,802,165.36	-45,233,001.08
其他债权投资减值损失	187,912.25	-1,553,348.12
其他应收款坏账损失	10,913,648.75	133,926,981.42
其他信用减值损失	10,884,535.43	46,252,021.49
合计	34,739,234.76	130,415,975.39

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
商誉减值损失	107,155,070.66	65,315,472.31
大宗商品减值损失		266,055.00
合计	107,155,070.66	65,581,527.31

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
投资性房地产摊销	6,396,885.40	5,990,912.07
三代手续费支出	2,988,335.71	3,170,194.91
大宗商品销售成本	43,694,222.22	54,218,724.03
其他	123,637.94	
合计	53,203,081.27	63,379,831.01

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
违约金及罚款收入	3,682,726.37	60,000.00	3,682,726.37
其他	601,068.03	655,740.75	601,068.03

合计	4,283,794.40	715,740.75	4,283,794.40
----	--------------	------------	--------------

计入当期损益的政府补助

适用 不适用

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
对外捐赠	3,535,561.03	16,185,901.08	3,535,561.03
赔偿支出	699,314.57	2,069,255.79	699,314.57
其他	10,111.80	11,123.27	10,111.80
合计	4,244,987.40	18,266,280.14	4,244,987.40

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	192,426,427.00	44,406,173.43
递延所得税费用	-179,326,219.11	79,762,667.20
合计	13,100,207.89	124,168,840.63

(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	1,038,568,659.11
按法定/适用税率计算的所得税费用	259,642,164.78
子公司适用不同税率的影响	-3,641,522.39
调整以前期间所得税的影响	-115,069.07
非应税收入的影响	-280,033,870.13
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	988,055.65
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	36,260,449.05
所得税费用	13,100,207.89

其他说明：

适用 不适用

71. 其他综合收益

适用 不适用

其他综合收益详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 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
衍生金融工具盈利		83,471,272.59
收现的其他收益	41,763,085.46	20,947,075.31
收资管产品代缴税款	39,847,313.08	74,047,280.56
大宗商品销售款	49,515,300.03	62,109,486.20
其他	14,727,334.87	37,533,792.28
合计	145,853,033.44	278,108,906.94

(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
存出保证金增加	99,156,941.49	527,051,622.16
付现的费用	273,617,528.64	354,912,930.18
衍生金融工具亏损	48,992,996.96	
大宗商品采购款	51,830,681.97	66,086,814.83
清算款	160,036,888.03	
其他	8,152,831.80	33,492,310.77
合计	641,787,868.89	981,543,677.94

(3) 收到的其他与投资活动有关的现金

□适用 √不适用

(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
支付结构化主体中第三方的现金	155,451,269.91	282,289,474.01
偿还租赁负债支付的现金	83,695,909.36	
合计	239,147,179.27	282,289,474.01

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

1. 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	1,025,468,451.22	1,057,794,055.51
加: 其他资产减值损失	107,155,070.66	65,581,527.31
信用减值损失	34,739,234.76	130,415,975.39
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	33,480,288.45	33,646,662.36
使用权资产摊销	72,525,101.19	
无形资产摊销	32,517,793.55	31,632,302.64
长期待摊费用摊销	12,485,602.94	45,507,937.01
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失 (收益以“-”号填列)	-4,368,643.70	-1,012,312.84
公允价值变动损失(收益以“-”号填列)	592,146,162.67	397,610,602.72
利息收入	-307,469,609.23	-383,220,256.69
利息支出	748,054,528.07	814,813,457.16
汇兑损失(收益以“-”号填列)	1,964,867.89	-24,801,584.61
投资损失(收益以“-”号填列)	-700,406,170.37	-441,819,466.36
递延所得税资产减少(增加以“-”号填列)	-144,718,681.14	-22,009,633.16
递延所得税负债增加(减少以“-”号填列)	-34,607,537.97	101,772,300.36
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产等的减少(增加以“-”号填列)	-4,142,211,138.26	-9,574,416,326.44
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-2,663,127,520.15	-1,687,840,249.20
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	5,179,180,231.73	5,648,157,920.54
经营活动产生的现金流量净额	-157,191,967.69	-3,808,187,088.30
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:		
3. 现金及现金等价物净变动情况:		
现金的期末余额	15,373,626,059.26	17,201,700,913.68
减: 现金的期初余额	17,201,700,913.68	13,424,085,562.06
加: 现金等价物的期末余额	4,239,132,214.73	3,429,458,764.60
减: 现金等价物的期初余额	3,429,458,764.60	2,911,904,159.78
现金及现金等价物净增加额	-1,018,401,404.29	4,295,169,956.44

(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	15,373,626,059.26	17,201,700,913.68
其中: 库存现金	68,270.63	103,710.67
可随时用于支付的银行存款	15,319,948,523.59	17,199,704,457.79
可随时用于支付的其他货币资金	53,609,265.04	1,892,745.22
二、现金等价物	4,239,132,214.73	3,429,458,764.60
其中: 结算备付金	4,239,132,214.73	3,429,458,764.60
三、期末现金及现金等价物余额	19,612,758,273.99	20,631,159,678.28

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
交易性金融资产	14,473,262,174.82	用于卖出回购金融资产抵押物
交易性金融资产	51,700,226.03	用于充当期货保证金
交易性金融资产	26,247,938.85	融出证券
交易性金融资产	231,685.00	停牌股票
交易性金融资产	80,421,871.53	限售股
其他债权投资	7,844,954,518.56	用于卖出回购金融资产抵押物
其他权益工具投资	11,759,891.67	停牌股票
其他权益工具投资	206,632,565.22	转融通担保
合计	22,695,210,871.68	

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			15,373,626,059.26
其中：美元	17,349,828.82	6.3757	110,617,303.61
欧元	613.51	7.2197	4,429.36
港元	272,213,000.02	0.8176	222,561,348.82
澳元	29,886.69	4.6220	138,136.28
英镑	3,830.83	8.6064	32,969.66
加拿大元	281.37	5.0046	1,408.14
日元	1,084,755.00	0.0554	60,111.70
新加坡元	8,288.91	4.7179	39,106.25
人民币			15,040,171,245.44
应收账款			289,299,825.76
其中：港元	160,126,815.15	0.8176	130,919,684.07
人民币			158,380,141.69
其他应收款			686,435,166.91
其中：港元	546,994,272.28	0.8176	447,222,517.02
人民币			239,212,649.89
结算备付金			4,239,132,214.73
其中：美元	6,222,325.55	6.3757	39,671,681.01
港元	23,926,822.42	0.8176	19,562,570.01
人民币			4,179,897,963.71

(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

西证国际投资有限公司为西南证券股份有限公司全资子公司，2013 年 11 月成立于香港，资本金 15.70 亿港元。主要从事股权及项目投资，主要经营地为香港，记账本位币为港元。

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
专项人才奖励	34,361,100.00	其他收益	34,361,100.00
财政奖励	2,912,232.79	其他收益	2,912,232.79
小计	37,273,332.79		37,273,332.79

(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

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

本公司纳入合并范围的结构化主体主要为本公司作为管理人并投资的结构化主体。本公司参与该等结构化主体的相关活动享有的可变回报影响重大，并且有能力运用对该等结构化主体的权力影响其回报金额。与年初相比，年末纳入合并范围的结构化主体减少 1 支、新增 8 支。

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

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	
西证股权投资有限公司	重庆	重庆	股权投资	100.00		设立
西证创新投资有限公司	重庆	重庆	从事投资业务	100.00		设立
西证重庆股权投资基金管理有限公司	重庆	重庆	股权投资管理和咨询		100.00	设立
西证国际投资有限公司	香港	香港	股权投资	100.00		设立
西南期货有限公司	重庆	重庆	期货经纪、投资咨询、资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司	重庆	重庆	基差交易、仓单服务、合作套保、定价服务		100.00	设立
西证国际证券股份有限公司	香港	香港	经纪业务、自营业务等		74.10	非同一控制下企业合并

对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据：

对于本公司作为管理人或投资顾问的资产管理计划，作为普通合伙人或投资管理人的有限合伙企业，本公司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，认定对部分资产管理计划及有限合伙企业拥有控制权，并将其纳入合并报表范围。

(2) 重要的非全资子公司

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

(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	
银华基金管理股份有限公司	北京	深圳	基金管理	44.10		权益法核算

(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

项目	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
	银华基金管理股份有限公司	银华基金管理股份有限公司
资产合计	6,558,441,523.88	5,302,703,118.31
负债合计	2,890,546,628.65	2,066,025,798.72
归属于母公司股东权益	3,667,894,895.23	3,236,677,319.59
按持股比例计算的净资产份额	1,617,703,419.14	1,427,517,111.75
调整事项	684,008,184.23	684,008,184.23
—商誉	892,261,060.27	892,261,060.27
—减值	-208,252,876.04	-208,252,876.04
对联营企业权益投资的账面价值	2,301,711,603.37	2,111,525,295.98
营业收入	3,985,578,486.04	3,255,795,304.31
净利润	922,295,401.18	827,816,702.11
其他综合收益	544,734.48	-986,499.34
综合收益总额	922,840,135.66	826,830,202.77
本年度收到的来自联营企业的股利	216,827,231.69	142,449,789.22

(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

项目	期末余额/ 本期发生额	期初余额/ 上期发生额
----	-------------	-------------

联营企业:	重庆股份转让中心	重庆股份转让中心
投资账面价值合计	136,323,698.14	129,569,584.34
下列各项按持股比例计算的合计数		
—净利润	12,844,744.76	12,181,261.93
—综合收益总额	12,844,744.76	12,181,261.93

(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

(1) 未纳入合并财务报表范围的结构化主体的基础信息

2021年12月31日, 与公司相关联、但未纳入公司合并财务报表范围的结构化主体, 包括公司发起设立的资产管理计划、基金和有限合伙企业等, 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, 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收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; 亦包括公司投资的其他机构设立的资产管理计划、有限合伙企业以及银行理财产品等, 这些结构化主体的性质和目的主要是获取投资收益, 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收益主要包括直接持有投资的投资收益。

2021年12月31日, 由本公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的结构化主体主要从事投资业务。这类结构化主体2021年12月31日的受托资产总额为17,466,988,788.74元。

(2) 与权益相关资产负债的账面价值和最大损失敞口

单位: 元 币种: 人民币

财务报表列报项目	账面价值		最大损失敞口	
	期末数	期初数	期末数	期初数
交易性金融资产/ 其他权益工具投资	4,002,540,418.37	3,489,619,631.83	4,002,540,418.37	3,489,619,631.83

(3) 最大损失敞口的确定方法

不承担超额损失, 以账面实际投资价值为限。

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

公司的主要金融工具包括货币资金、交易性金融资产、融出资金、其他债权投资等，各项金融工具的详细情况说明详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释”，与这些金融工具有关的风险，以及本公司为降低这些风险所采取的风险管理政策详见本报告“第十节 财务报告 十七、风险管理”。本公司管理层对这些风险敞口进行管理和监控，以确保将风险控制在限定的范围之内。

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
一、持续的公允价值计量				
(一) 交易性金融资产	5,340,493,957.62	22,045,335,387.33	2,985,362,752.82	30,371,192,097.77
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产	5,340,493,957.62	22,045,335,387.33	2,985,362,752.82	30,371,192,097.77
(1) 债务工具投资	1,673,198,582.35	19,095,323,807.48	996,650,000.00	21,765,172,389.83
(2) 权益工具投资	3,667,295,375.27	2,950,011,579.85	1,988,712,752.82	8,606,019,707.94
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				
(二) 其他债权投资	51,729,026.13	8,923,063,721.76		8,974,792,747.89
(三) 其他权益工具投资	311,792,813.36	492,768,838.34	83,889,261.12	888,450,912.82
(四) 衍生金融资产		23,550,815.84		23,550,815.84
持续以公允价值计量的资产总额	5,704,015,797.11	31,484,718,763.27	3,069,252,013.94	40,257,986,574.32
(五) 交易性金融负债		622,547,367.97		622,547,367.97
1. 以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债				
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		622,547,367.97		622,547,367.97
(六) 衍生金融负债		5,515,932.91		5,515,932.91
持续以公允价值计量的负债总额		628,063,300.88		628,063,300.88
二、非持续的公允价值计量				

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

公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

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

项目	估值技术	输入值
债务工具	现金流量折现法	债券收益率
权益工具	投资标的市价组合法	投资标的市价
衍生金融工具	现金流量折现法	远期利率、折现率
指定为以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债	投资标的市价组合法	投资标的市价

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

第三层次公允价值计量项目主要为非上市股权投资。对于用以确定公允价值的近期信息不足的非上市股权投资，本公司以成本作为对其公允价值的恰当估计；对于其他非上市股权投资，本公司采用估值技术来确定其公允价值，估值技术包括现金流折现法和市场比较法等，其公允价值的计量采用了重要的不可观察参数，比如流动性折扣、波动率、风险调整折扣和市场乘数等，非上市股权投资的公允价值对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

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	其他权益工具投资	交易性金融资产
年初余额	76,389,261.12	1,804,392,938.46
计入损益的公允价值变动		138,839,951.36
计入其他综合收益的公允价值变动	9,500,000.00	
买入		1,724,299,863.00
处置	2,000,000.00	355,320,200.00
转出		326,849,800.00
年末余额	83,889,261.12	2,985,362,752.82

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

7.本期内发生的估值技术变更及变更原因

□适用 √不适用

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金融负债主要包括：货币资金、结算备付金、融出资金、买入返售金融资产、存出保证金、应收款项、其他金融资产、应付短期融资款、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付款项、应付债券和其他金融负债等。于2021年12月31日和2020年12月31日，本公司以上金融资产和金融负债的账面价值与公允价值之间无重大差异。

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 (%)
重庆渝富资本运营集团有限公司	重庆	资产管理	1,000,000	27.89	27.89

注：本企业最终控制方是重庆市国有资产监督管理委员会。

2.本企业的子公司情况

本企业子公司的情况详见附注

√适用 □不适用

本公司的子公司情况详见本报告“第十节 十、在其他主体中的权益”之说明。

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

本公司的合营和联营企业情况详见本报告“第十节 十、在其他主体中的权益”的说明。

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
银华基金管理股份有限公司	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
重庆银行股份有限公司	公司控股股东的董、监事或高级管理人员担任其董事或高级管理人员的企业
重庆市城市建设投资(集团)有限公司	持有公司 5%以上股份的股东
安诚财产保险股份有限公司	公司控股股东的董、监事或高级管理人员担任其董事或高级管理人员的企业
博时基金管理有限公司	公司董、监事或高级管理人员担任其董事或高级管理人员的企业
重庆农村商业银行股份有限公司	公司控股股东为其第一大股东的企业
重庆川仪自动化股份有限公司	公司控股股东的上级国资企业所控制企业的下属企业
重庆银海融资租赁有限公司	公司控股股东的上级国资企业所控制的企业
重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司	重庆渝富资本运营集团有限公司所控股企业之附属企业

重庆市地产集团有限公司

公司原董事辞职后 12 个月内任职董事的企业

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

单位：万元 币种：人民币

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上期确认的租赁收入
银华基金管理股份有限公司	席位租赁	2,487.35	1,935.77
博时基金管理有限公司	席位租赁	123.67	105.60

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**(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

公司董事、监事、高级管理人员共计 19 人（含报告期内离任 2 人），本年度应付薪酬总额为 1,402.02 万元，实际发放薪酬总额 1,625.84 万元。

(8) 其他关联交易

√适用 □不适用

1) 基金代销

公司与关联方开展基金代销业务，收取代销手续费情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
银华基金管理股份有限公司	90.99	111.68
博时基金管理有限公司	51.66	0.51

2) 资产管理业务

公司向关联方提供资产管理业务服务，由此收取相应产品管理费收入情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆银行股份有限公司	671.78	790.50

3) 财务顾问服务

公司接受关联方委托，为其提供财务顾问服务，收取财务顾问费用情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆川仪自动化股份有限公司	22.64	

4) 咨询服务

公司接受关联方委托，为其提供咨询服务，收取咨询服务费用情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司		37.24

5) 利息收入

公司在关联方存入部分非公开发行募集资金，按市场利率取得存款利息收入情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆银行股份有限公司	1.47	99.69
重庆农村商业银行股份有限公司	532.79	564.20

6) 金融产品承销服务

公司向关联方提供金融产品承销服务，由此公司收取相关承销服务费情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
重庆市城市建设投资（集团）有限公司	235.85	

重庆银海融资租赁有限公司	113.20	
--------------	--------	--

7) 基金申购及赎回交易

公司在公开市场向关联方申购及赎回基金产品交易额情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
博时基金管理有限公司	84,469.81	30,364.68
银华基金管理股份有限公司	63,499.80	2,099.90

8) 银行间市场债券现券交易

公司固定收益业务日常开展过程中，通过银行间市场与关联方债券交易额情况：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
博时基金管理有限公司	1,999.85	3,037.28

9) 购买保险服务

因日常经营中购置固定资产及车辆保险的需要，向关联方投保：

单位：万元 币种：人民币

关联方名称	本期数	上期数
安诚财产保险股份有限公司	3.85	6.51

6. 关联方应收应付款项

(1) 应收项目

适用 不适用

(2) 应付项目

适用 不适用

7. 关联方承诺

适用 不适用

重庆渝富承诺：认购的公司 2019 年度非公开发行股票（3.3 亿股）自发行结束之日起 60 个月内不得转让；重庆城投承诺：认购的公司 2019 年度非公开发行股票（3.5 亿股）自发行结束之日起 36 个月内不得转让；重庆地产承诺：认购的公司 2019 年度非公开发行股票（1.2 亿股）自发行结束之日起 36 个月内不得转让。

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

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) 公司诉杨立军、韩华、黄云辉、什邡星昇投资管理合伙企业（有限合伙）、陈红股票质押式回购交易纠纷案

2020年12月，公司作为“西南证券双喜聚金1号集合资产管理计划”（以下简称资管计划）管理人，代表资管计划向深圳市福田区人民法院申请实现担保物权的特别程序，分别申请杨立军、韩华、黄云辉、什邡星昇投资管理合伙企业（有限合伙）（以下统称被申请人）就杨立军和公司签订的新研股份（股票代码：300159）股票质押式回购交易承担违约责任或担保责任，准许拍卖、变卖被申请人持有的3,717.0964万股新研股份（股票代码：300159）股票，公司就处分上述股票及孳息所得价款在债权本金230,000,000.00元及相应利息、违约金、律师费、保函费范围内享有优先受偿权，上述案件申请费、保全费、保全担保费等实现债权的全部费用由被申请人承担。

2021年3月，公司代表该资管计划向深圳市福田区人民法院撤回实现担保物权的申请，并另行向重庆市第一中级人民法院提起诉讼，申请被告杨立军就新研股份（300159）股票质押式回购交易承担违约责任，偿还本金人民币230,000,000.00元及相关利息、违约金、诉讼费、诉讼保全保险费、律师费等（以下简称诉讼请求）；申请被告韩华就上述诉讼请求所述债务承担连带责任；申请在被告杨立军未履行上述诉讼请求所述债务范围内，公司有权对被告杨立军、韩华、黄云辉、什邡星昇投资管理合伙企业（有限合伙）质押给公司的新研股份股票和被告陈红质押给公司的霍山鑫盛股权投资合伙企业（有限合伙）实缴4,186万元的财产份额及收益折价、拍卖或者变卖所得价款优先受偿；申请全部诉讼费用由上述各位被告共同承担。

2022年4月，公司（代资产管理计划）收到重庆市第一中级人民法院出具《民事判决书》判决被告杨立军于本判决生效后十日内向公司偿还融资本金约2.25亿元及相关利息、违约金、律师费（以下简称给付义务）；被告韩华对被告杨立军在本判决所负的给付义务向公司承担连带清偿责任；公司有权在被告杨立军未履行本判决所确定的给付义务范围内，对被告杨立军持有的2516086股新研股份（证券代码300159）、被告韩华持有的1500000股新研股份（证券代码300159）、被告黄云辉持有的3190000股新研股份（证券代码300159）折价、拍卖或者变卖所得价款优先受

偿；被告什邡星昇投资管理合伙企业（有限合伙）、被告陈红在各自担保物价值范围内，对被告杨立军在本判决中所负的给付义务之不能清偿部分的二分之一向公司承担赔偿责任。一审判决尚未生效。

上述资管计划纳入公司合并范围，公司作为该资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金 2,300 万元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。

2) 公司诉正源房地产开发有限公司债券违约纠纷案

公司作为“西南证券-双喜金债广农商 1 号定向资产管理计划”“西南证券双喜金债中银 1 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 2 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 3 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 4 号集合资产管理计划”“西南证券双喜金债 5 号集合资产管理计划”（以下简称资管计划）管理人，于 2021 年 1 月代表资管计划向重庆市第一中级人民法院提起诉讼，就正源房地产开发有限公司未能根据约定支付正源房地产开发有限公司 2016 年公司债券（债券简称：16 正源 01、16 正源 02、16 正源 03）本金及利息（人民币 54,946.68 万元），申请判令正源房地产开发有限公司偿付上述债券本金及利息、违约金、逾期利息、律师费、诉讼费等。现该案件处于一审阶段。

除“西南证券-双喜金债广农商 1 号定向资产管理计划”以外，上述其余资管计划纳入公司合并范围，公司作为资管计划的管理人，严格按照监管规定和资管计划合同约定履行管理人职责，案件的最终诉讼结果由资管计划投资人承担，公司自有资金参与部分（本金约 4.03 亿元）按照资管计划合同约定享有权利并承担相应的义务。

3) 邓朝晖诉公司、西南证券股份有限公司湖北分公司、陕西龙鑫矿产资源有限公司、张林、何彦林民间借贷纠纷案

2020 年 10 月，邓朝晖向北京市通州区人民法院提起诉讼，请求法院判令陕西龙鑫矿产资源有限公司偿还借款 14,997,721 元并给付利息损失，张林对前述欠款及利息承担连带保证责任，公司及西南证券股份有限公司湖北分公司、何彦林对借款本金 14,997,721 元归还承担连带责任。现该案处于一审阶段。

4) 孙凤娟诉公司、西南证券股份有限公司上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部确权及合同纠纷案

2021 年 4 月，孙凤娟向上海市浦东新区人民法院起诉，要求西南证券股份有限公司上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部归还其资金账户内被划转的资金 900 万元及同期银行贷款利息，并要求公司对此承担连带赔偿责任。2021 年 6 月，孙凤娟变更诉讼请求，请求法院确认某资金账户属于其所有，判令西南证券股份有限公司上海浦东新区陆家嘴东路证券营业部赔偿其 2,000 万元及同期银行贷款利息损失，并要求公司对此承担补充清偿责任。该案件一审判决驳回孙凤娟全部诉讼请求，孙凤娟因不服一审判决已提请上诉。

5) 创金合信基金管理有限公司诉公司、联合信用评级有限公司及信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）证券虚假陈述责任纠纷案

2021 年 11 月，创金合信基金管理有限公司（以下简称“创金合信”）向北京金融法院起诉公司、联合信用评级有限公司（以下简称“联合评级”）及信永中和会计师事务所（以下简称“信永中和”）。创金合信以公司作为 16 协信 03 债券的主承销商及受托管理人违反履行勤勉尽责义务，未对债券发行文件中存在的虚假陈述等情形进行审慎核查、依法审计、及时纠正，导致其受误导买入债券从而遭受投资损失为由，请求法院判令包括公司在内的各被告赔偿其投资损失及各项费用暂共计 1.53 亿元。现该案件处于一审阶段。

(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

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	531,608,729.92
经审议批准宣告发放的利润或股利	531,608,729.92

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

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

公司风险管理的目标是健全以净资本为核心的风控指标体系，建立覆盖各项业务和管理活动的风控系统，管好市场风险和信用风险、严控操作风险、防范流动性风险，确保公司整体风险可测可控可承受。基于该风险管理目标，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以及良好的风险管理文化。

公司按照《公司法》《证券公司全面风险管理规范》《证券公司内部控制指引》等相关要求，制订了《内部控制制度》《风险管理制度》《流动性风险管理办法》《市场风险管理办法》《操作风险管理办法》《信用风险管理办法》《压力测试管理办法》《业务授权管理办法》，以及《风险控制指标动态监控管理办法》《净资本风险控制指标监控实施细则》《股票质押式回购交易业务风险管理办法》《股票期权经纪业务风险管理办法》《场内衍生品自营交易风险管理办法》《融资融券业务风险监控作业指导书》《约定式购回业务风险监控作业指导书》《经纪业务风险监控作业指导书》《资产管理业务风险监控作业指导书》《证券投资业务风险监控作业指导书》等一系列规章制度。建立了全面、系统的风险控制政策与程序，严格遵循规范化、量化、系统化的原则，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险以及创新业务风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理，以实现风险的可测、可控、可承受。

报告期内，公司围绕《证券公司全面风险管理规范》不断加强风险管理制度建设，新制定了《场外衍生品业务交易对手内部信用评级与授信管理办法》《场外衍生品交易对手方评级和授信管理细则》《风险管理工作考核实施暂行办法》《转融通业务风险控制实施细则》4项风险管理制度，并根据监管要求和业务发展需要修订了《风险管理制度》《内部评级管理办法》《风险与合规管理委员会议事规则》《股票期权自营业务风险管理办法》等36项风险管理制度，保障了公司风险管理制度与监管要求、业务发展相一致。

(2) 风险治理组织架构

√适用 □不适用

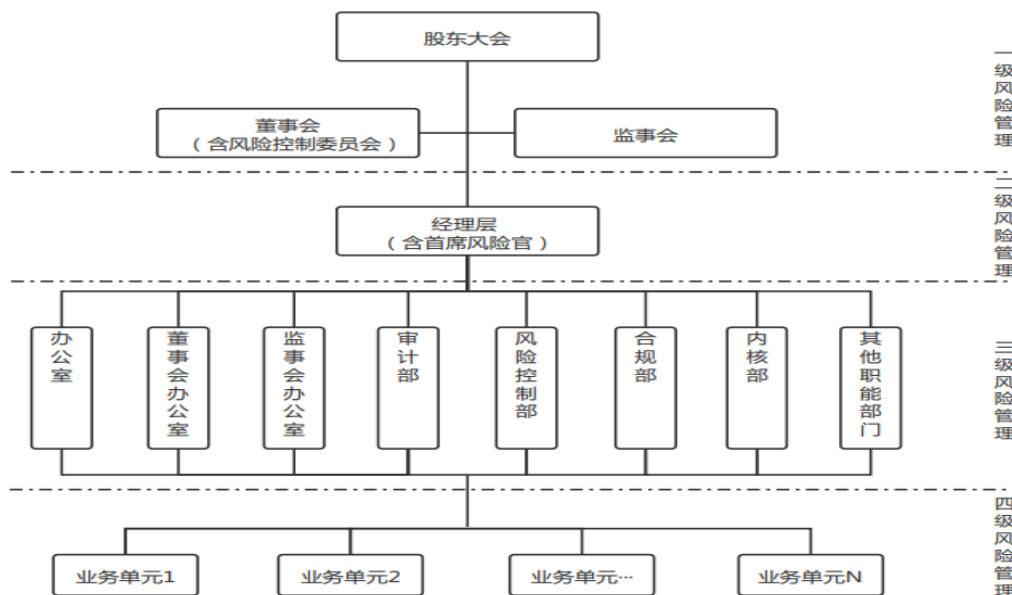
依照全面风险管理规范并结合实际情况，公司以分层架构、集中管理模式对整体风险进行管控，风险管理组织包括董事会、监事会，经理层和首席风险官，风控、合规、审计等内控部门，各业务部门等四个层级。

第一层：董事会负责督促、检查、评价公司风险管理工作，下设风险控制委员会，负责审议公司定期风险评估报告、重大风险事件评估报告和重大风险控制解决方案等董事会授权履行的风险管理职责。公司监事会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。

第二层：经理层负责经营管理中各项风险管理工作的落实。设首席风险官负责全面风险管理工作，有权参加或列席与其履行职责相关的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。

第三层：公司设置独立的风险控制部门，在首席风险官领导下贯彻落实全面风险管理工作，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、分支机构的风险管理工作。其它内控部门分别承担职责范围内的风险管理责任。

第四层：公司各部门及分支机构根据职责范围设置合规风控岗，协助负责人履行风险管理职责。公司各分支机构负责人应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，并承担风险管理有效性的直接责任。



2.信用风险

√适用 □不适用

信用风险是指因借款人或交易对手无法履约而带来损失的风险。

公司面临的信用风险主要来自两个方面：一是融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购等融资类业务的信用风险，即由于客户未能履行合同约定而给公司带来损失的风险；二是债券类投资的违约风险，即所投资债券的发行人或交易对手出现违约、拒绝支付到期本息，导致资产损失或收益变化的风险。随着公司信用业务规模的迅猛发展，如发生违约风险事件，信用风险暴露，可能对公司造成一定损失。

公司融资类业务的信用风险主要涉及客户提供虚假资料、未及时足额偿还负债、持仓规模及结构违反合同约定、交易行为违反监管规定、提供的担保物涉及法律纠纷等。公司主要通过对客户进行风险教育、征信、授信、逐日盯市、客户风险提示、强制平仓、建立业务禁入标准、加强项目尽职调查及后续管理、司法追索等手段，来对融资类业务的信用风险进行管理。

对债券投资的信用风险管理，主要借助风险限额、信用评级等手段，以信用风险限额和内部评级，从投资品种、发行主体和交易对手三个层面分类分级授权。其中，限额管理涵盖持仓限额和交易限额两大类。持仓限额包括组合信用风险值、交易对手信用风险敞口、信用债个券集中度、低评级信用债持仓占比等指标；交易限额包括低评级债券交易限额和交易对手结算风险限额，结算风险限额针对不同类别的交易对手，采用不同的交易结算方式，并设定不同的授权额度。所有超过交易额度授权的业务均需报上一级授权组织批准。交易对手内部信用评级管理体系包括交易

对手内部信用评级、交易对手信用风险敞口计量、交易对手信用风险压力测试等。

报告期内，为进一步提升信用风险防控水平，为规范债券投资内部评级体系，公司建立内部评级管理制度流程，建设内部评级系统，组成内部评级小组，设专岗负责债券投资交易内部评级体系，并根据内部评级结果建立了对应的风险限额指标体系，确保评级结果能够切实有效指导债券投资交易，控制和降低债券投资交易信用违约风险。同时，制定并完善了《西南证券股份有限公司固定收益投资业务交易对手白名单和额度管理办法》，建立了交易对手白名单及授信管理机制，对公司自营、资管债券交易对手进行统一管理，进一步明确了交易对手白名单标准、占信额度计算规则、授信额度管理规则及尽职调查标准。此外，针对债券集中到期规模大、信用风险事件频发的现状，公司在做好债券投资风险信息监控工作的基础上，主动调整了自营及资管低等级债券投资规模，控制组持仓组合风险敞口；组织对产能过剩行业、民营企业债和私募债券进行专项风险排查，有效防范债券投资交易违约风险。

同时，为进一步规范公司股票质押业务开展，防范股票质押融资违约风险，风险控制部通过严格控制业务规模、限制业务集中度、加强项目风险评估、强化授信管理、完善尽职调查、升级风险监控系統、加强业务风险监控和完善平仓追保流程，有效防范和降低了股票质押融资违约风险。当前，公司自有资金参与的股票质押融资业务风险暴露水平大幅低于全行业平均值，整体维持担保比例高于预警值，股票质押融资业务风险整体可控、可承受。截止 2021 年末，公司融资融券业务整体维持担保比例为 387.62%，约定购回业务整体履约保障比例为 375.22%，股票质押回购业务整体履约保障比例为 376.66%。

预期信用损失计量

本公司自 2019 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，以预期信用损失为基础，对纳入预期信用损失计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

本公司采用三阶段模型对除货币资金、结算备付金、存出保证金、应收款项以外的其余以摊余成本计量的金融资产和其他债权投资计量预期信用损失。本公司根据相关金融资产自初始确认日起信用风险的变化情况在以下三阶段进行划分：

第一阶段：初始确认后信用风险未显著增加的金融工具，应当按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备；

第二阶段：自初始确认后信用风险已显著增加，但尚无客观减值证据的金融工具，应当按照该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；

第三阶段：初始确认后已发生信用减值的金融工具，应当按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

该预期信用损失模型中涉及的评估因素主要包括违约概率、违约风险暴露和违约损失率等：

违约概率表示在特定时间段内相关交易发生违约的可能性的估计；其计算涉及历史数据和对未来情况的预期等；

违约风险暴露指在未来 12 个月或整个剩余存续期中，在违约发生时本公司应被偿付的金额；

违约损失率表示对发生违约情形的交易产生的损失估计。

预期信用损失的计量是基于违约概率、违约风险暴露、违约损失率的概率加权结果。

信用风险是否显著增加

本公司在初始确认金融资产时，将根据减值要求检测其信用风险是否已显著增加。如果该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，应当按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

在进行信用风险相关评估时，本公司将考虑所有合理且有依据的定性及定量信息，包括无须付出不必要的额外成本或努力的历史经验及前瞻性信息。本公司在评估每个资产组合的信用风险是否显著增加时考虑不同的因素。

在评估信用风险是否显著增加时，可能考虑的相关因素如下：

- 1) 同一金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险的外部市场指标是否发生显著变化；
- 2) 金融工具外部信用评级实际或预期是否发生显著变化；
- 3) 对债务人实际或预期的内部评级是否下调；
- 4) 预期将导致债务人履行其偿债义务的能力发生显著变化的业务、财务或经济状况的不利变化；
- 5) 债务人经营成果实际或预期是否发生显著变化；
- 6) 债务人所处的监管、经济或技术环境是否发生显著不利变化；
- 7) 作为债务抵押的担保物价值或第三方提供的担保或信用增级质量是否发生显著变化；
- 8) 实际或预期增信措施有效性发生重大不利变化；
- 9) 债务人预期表现和还款行为是否发生显著变化。

本公司在判断金融资产的信用风险自初始确认后是否显著增加以及计量预期信用损失时，均结合了前瞻性信息。本公司通过进行历史数据分析，识别出影响各业务类型信用风险及预期信用损失的关键经济指标。关键经济指标包括宏观经济指标和反映市场波动率的指标，如国内生产总值、生产价格指数、居民消费物价指数、股票指数等。

主要金融资产三阶段划分的具体标准、减值的具体计量方法和参数

1) 风险阶段划分标准

① 公司对债券投资业务按照以下标准进行风险阶段划分：

风险阶段划分	划分标准
阶段一	除阶段二和阶段三以外的其他未触发信用风险已显著增加或已发生信用减值条件的债项。
阶段二	本金或利息已逾期且小于或等于30天； 初始确认时债券主体评级在AA以上（含）的境内债券的评级发生下调，且下调后主体等级在AA以下（不含）；

	初始确认时债券主体评级在AA以下的境内债券的评级发生下调； 其他可认定为信用风险显著增加的条件。
阶段三	本金或利息已逾期大于30天； 外部评级为违约级（国内违约级为D）或债券发行人在公开市场上已有其他违约债券； 其他可认定为违约的条件。

② 公司对融资融券业务根据以下标准进行风险阶段划分：

风险阶段划分	划分标准
阶段一	履约担保比例 $\geq 150\%$ ； 满足其他未触发信用风险已显著增加且未触发已发生减值的条件。
阶段二	$130\% \leq$ 履约担保比例 $< 150\%$ ； 履约担保比例仅在当日及上一个工作日 $< 130\%$ ； 其他可认定为信用风险显著增加的条件。
阶段三	履约担保比例连续两个工作日 $< 130\%$ ； 其他可认定为违约的条件。

③ 公司对股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务根据以下标准进行风险阶段划分：

风险阶段划分	划分标准
阶段一	除阶段二和阶段三以外的其他未触发信用风险已显著增加或已发生信用减值条件的业务。
阶段二	本金或利息最长逾期天数小于或等于30天； 公司内部客户风险分类为预警级； 履约担保比例低于追保线但高于平仓线； 其他可认定为信用风险显著增加的条件。
阶段三	本金或利息最长逾期天数大于30天； 公司内部客户风险分类为违约级； 履约担保比例低于平仓线； 拟对该笔业务进行违约处置或其他满足违约的条件。

注：以上各项划分标准中满足其中一条即可。

公司股票质押式回购交易业务、约定购回式证券交易业务对作为担保品的股份性质实行差异化管理。公司自有资金出资项目原则上流通股的平仓线为130%，追保线为150%；限售股的平仓线为150%，追保线为170%。

2) 减值的具体计量方法和参数

① 第一二阶段减值计提方法

违约概率/违约损失率方法：第一二阶段使用违约概率/违约损失率模型计量预期信用损失，根据不同风险水平的资产或资产组合的违约风险敞口（EAD）、历史实际违约概率（PD）、违约损失率（LGD）及前瞻性因子等参数计量预期信用损失并进行减值计提，其中计提减值的违约风险敞口为在不同履约保障比例下的本金与应收应计利息之和，历史实际违约概率（PD）基于迁徙率转换或通过外部评级的内部主标尺映射并经前瞻性调整得到，违约损失率（LGD）基于外部违约损失率并经调整后得到。

② 第三阶段减值计提方法

公司综合考虑每笔业务的全部可收回合同现金流量，纳入考虑范围的因素包括但不限于融资人信用状况及还款能力、其他担保资产价值情况、第三方提供连带担保等其他增信措施等，并结合项目的担保物总估值、履约保障比等指标，对项目进行减值测算，并计提相应的减值准备。

在不考虑担保物或其他信用增级的情况下，公司最大信用风险敞口为金融资产的账面价值（即扣除已确认的减值准备后的余额）：

单位：元 币种：人民币

涉及信用风险科目	2021年12月31日	2021年1月1日
货币资金	15,373,557,788.63	17,203,440,812.41
结算备付金	4,239,132,214.73	3,429,659,479.81
存出保证金	1,504,711,833.90	1,405,554,892.41
交易性金融资产	21,791,420,328.68	20,328,606,052.95
融出资金	14,272,175,002.17	12,001,843,139.77
衍生金融资产	23,550,815.84	663,975.84
买入返售金融资产	1,475,449,768.49	1,404,131,659.30
应收款项	289,299,825.76	118,444,884.10
其他债权投资	8,974,792,747.89	9,107,073,011.84
其他资产中的金融资产	142,968,946.16	139,334,169.50
合计	68,087,059,272.25	65,138,752,077.93

3. 流动风险

√适用 □不适用

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

公司的流动性风险主要包括资产流动性风险和负债流动性风险。资产流动性风险是指公司所持资产不能及时变现或变现成本过高，导致自营投资及客户资产损失的可能；负债流动性风险是指由于公司缺乏现金，不能维持正常的业务支出或不能按时支付债务，以及流动资金不足以应对客户大规模赎回公司管理产品的风险。此外，投资银行业务大额包销、自营业务投资规模过大、期限错配、长期资产比例过高等因素，都会导致公司资金周转不畅，出现流动性困难的状况。

报告期内，公司进一步加强流动性指标管理，通过压力测试、日常监控、测算，及时了解公司流动性指标情况，并根据相应时期公司流动性状况，与资金管理部及业务部门沟通，建议相关部门进一步合理配置资产，减少期限错配的情况，以满足公司各项业务开展所需的充足流动性。

公司坚持资金营运安全性、流动性与效益性相统一的经营原则,强调资金的集中统一管理和运用,资金拆借、回购等业务由资金管理部集中管理,确保了资金流动性充足;通过合理控制各品种证券的投资规模,避免单一证券持仓过大和投资过于集中,同时建立投资组合量化指标分析机制,动态调整资产配置,确保投资组合的流动性适度充裕。

公司实时监控、定期计算流动性风险管理指标(流动性覆盖率和净资金稳定率),截止 2021 年末,公司流动性覆盖率(LCR) 176.02%、净稳定资金率(NSFR) 151.66%,均符合监管要求。

金融负债按剩余到期日分类：

单位：元 币种：人民币

项目	期末数						
	账面价值	未折现合同金额	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年-5 年	5 年以上
应付短期融资款	3,386,823,021.21	3,427,435,072.79	164,500,443.96	217,494,166.58	3,045,440,462.25		
拆入资金	2,407,134,499.87	2,414,177,561.65	1,407,196,739.73	1,006,980,821.92			
交易性金融负债	622,547,367.97	622,547,367.97	523,784,529.23	90,447,390.68	2,303,100.50	6,012,347.56	
卖出回购金融资产款	21,072,631,177.76	21,083,890,823.84	21,052,835,510.14	30,122,387.73	932,925.97		
应付债券	12,979,277,733.07	14,327,114,657.70		22,697,586.55	8,591,444,983.81	5,712,972,087.34	
租赁负债	114,074,885.90	124,397,844.56	1,449,682.16	8,518,276.10	34,286,250.55	67,804,558.98	12,339,076.77
衍生金融负债	5,515,932.91	5,515,932.91	5,515,932.91				
应付款项	99,763,100.89	99,763,100.89	99,763,100.89				
其他应付款	291,586,757.83	291,586,757.83	291,174,189.14		412,568.69		
代理买卖证券款	14,382,125,029.05	14,382,125,029.05	14,382,125,029.05				
应付股利	38,020,702.61	38,020,702.61	38,020,702.61				
合计	55,399,500,209.07	56,816,574,851.80	37,966,365,859.82	1,376,260,629.56	11,674,820,291.77	5,786,788,993.88	12,339,076.77

4.市场风险

√适用 □不适用

市场风险是指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，包括外汇风险、利率风险、其他价格风险。

公司承担市场风险的业务部门主要有自营业务部门，及自有资金参与资管计划开展证券投资。当投资的股票、基金、股指期货、投资组合等权益类品种及权益类衍生品，在缺乏有效的对冲机制情景下，面对市场价格或波动率变化时，将可能产生价格风险。当投资债券等固定收益类证券面对利率、收益率曲线变化时，将可能产生利率风险。外汇汇率的变化，将可能产生汇率风险。

公司建立起由董事会、投资决策委员会及自营业务部门组成投资业务三级决策与授权体系，对自有资金投资实行授权管理；同时，在业务部门之外，设立独立的风险管理部门对市场风险进行评估、监测和报告，保证公司整体市场风险水平在适当的范围之内。公司采取风险限额措施对各业务单元所承担的市场风险进行控制，风险限额主要包括规模限额、止损限额、风险度限额等。董事会确定自营业务年度规模和最大可承受风险限额；投资决策委员会确定单个项目的规模、止损限额；自营业务部门通过组合投资、逐日盯市、设置项目预警线、止损线等进行前端控制；风险管理部门进行实时监控，及时进行风险提示，督促自营业务部门进行风险处置。此外，公司建立压力测试机制，对极端情景下公司可能面临的市场风险进行分析。极端情景主要包括：宏观经济衰退、证券市场价格及利率大幅不利变动、特殊风险事件等。通过压力测试评估公司自有资金投资在极端情况下的可能损失金额，判断公司整体的市场风险是否在可承受范围之内，并拟定应对措施。

报告期内，公司完善了债券投资交易内部控制体系，包括构建和完善债券投资交易内控机制，债券投资交易各部门有效监督、相互制衡；加强债券交易统一管理、实现有效监督制衡；加强和规范债券投资交易人员行为管理，防范债券投资交易道德风险健全公司内控部门对债券业务的风险管理。建立多指标差异化投资比较基准，加强异常交易监控；完善债券投资业务授权管理，并建立风险应急处置机制；完善内部评级及尽职调查流程，提高债券投资交易信用风险管理水平；建立公司统一询价工具，规范债券投资交易询价留痕工作。

目前权益类证券价格风险和固收产品利率风险是公司主要面对的市场风险。

利率风险是指市场利率变动的不确定性给固定收益投资组合价值造成影响的风险。公司固定收益投资主要是央票、国债、短期融资券、国债期货、利率互换等。公司每日计量监测固定收益投资组合久期、凸性、DV01 等指标来衡量固定收益投资组合的利率风险。截止 2021 年底，针对公司持有的固定收益类投资组合进行敏感性分析，假设收益率增减 100 个基点对利润总额和股东权益的影响如下：

单位：元 币种：人民币

利率变动	利润	股东权益
上升 100 个基点	-549,053,156.69	-287,179,754.05
下降 100 个基点	572,287,593.45	293,245,541.88

权益类证券价格风险是指由于股票、基金及衍生品等权益类品种价格波动而导致的风险。公司通过头寸规模限额、量化风险限额、止损限额、集中度管理等风险限额指标管理市场风险，主要以风险价值（VaR）为衡量投资组合市场风险工具。风险价值（VaR）是指在一定时间段内投资组合因市场价格变动造成最大可能的损失。公司以 99%置信区间为计算标准，观察期为 1 个交易日，根据历史数据计算 VaR 值。

公司按风险类别分类的风险价值（VaR）如下：

单位：万元 币种：人民币

项目	期末数	本期最高	本期最低	本期平均
股价敏感型金融工具	2,906	4,945	2,176	3,671
利率敏感型金融工具	4,851	5,145	511	1,724
整体组合	7,757	10,090	2,687	5,395

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

依据国家企业年金制度的相关政策规定，公司于 2014 年建立企业年金方案。根据方案规定，凡与公司订立劳动合同且试用期满、依法参加企业职工基本养老保险并履行缴费义务的职工可参加该方案。

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

公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度等为依据确定经营分部，并以经营分部为基础确定报告分部。公司的报告分部为：经纪业务、自营业务、投资银行业务、资产管理业务及其他业务。

(2). 报告分部的财务信息

√适用 □不适用

2021 年度:

单位: 元 币种: 人民币

项目	经纪业务	自营业务	投资银行业务	资产管理业务	其他业务	抵销	合计
一、营业收入	1,953,248,310.32	493,449,194.35	251,408,714.22	23,565,035.72	374,409,130.49		3,096,080,385.10
其中: 1. 手续费及佣金净收入	860,925,119.56	-505,238.80	251,540,845.87	23,685,553.05	-15,050,279.66		1,120,596,000.02
2. 其他收入	1,092,323,190.76	493,954,433.15	-132,131.65	-120,517.33	389,459,410.15		1,975,484,385.08
二、营业支出	810,452,186.00	111,162,706.96	188,081,585.88	49,752,498.91	898,101,555.24		2,057,550,532.99
三、营业利润	1,142,796,124.32	382,286,487.39	63,327,128.34	-26,187,463.19	-523,692,424.75		1,038,529,852.11
四、资产总额	33,204,490,912.89	37,258,708,143.54	9,968,773.43	66,774,505.53	11,942,416,950.25	-224,325,722.46	82,258,033,563.18
五、负债总额	16,883,754,576.67	21,360,369,530.59	50,730,724.30	39,242,049.81	18,865,748,591.72	-224,325,722.46	56,975,519,750.63
六、补充信息							
1. 折旧和摊销费用	61,395,838.60	1,904,544.14	9,851,072.58	3,059,176.83	74,798,153.98		151,008,786.13
2. 资本性支出	9,103,456.95	35,115.05	41,505.74	815,150.47	63,810,680.44		73,805,908.65

2020 年度:

单位: 元 币种: 人民币

项目	经纪业务	自营业务	投资银行业务	资产管理业务	其他业务	抵销	合计
一、营业收入	1,853,809,567.48	850,030,516.31	233,399,675.76	29,090,544.94	203,241,149.48		3,169,571,453.97
其中: 1. 手续费及佣金净收入	788,650,846.09	202,910.25	232,968,870.09	29,064,530.96	-6,306,547.29		1,044,580,610.10
2. 其他收入	1,065,158,721.39	849,827,606.06	430,805.67	26,013.98	209,547,696.77		2,124,990,843.87
二、营业支出	778,779,760.40	154,989,849.69	177,364,219.42	41,649,438.53	817,274,750.40		1,970,058,018.44
三、营业利润	1,075,029,807.08	695,040,666.62	56,035,456.34	-12,558,893.59	-614,033,600.92		1,199,513,435.53
四、资产总额	28,573,545,544.43	37,648,871,553.55	6,846,025.02	62,841,833.65	13,258,953,883.96	-362,740,375.35	79,188,318,465.26
五、负债总额	15,034,603,270.94	18,899,835,509.14	56,210,153.53	59,833,788.46	20,421,211,275.95	-362,740,375.35	54,108,953,622.67
六、补充信息							
1. 折旧和摊销费用	27,922,065.28	1,165,679.31	6,352,399.55	1,205,663.15	74,141,094.72		110,786,902.01
2. 资本性支出	45,081,431.33	529,993.70	271,331.48	172,182.71	32,806,923.52		78,861,862.74

(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

(1) 公司作为承租人

1) 使用权资产相关信息详见本报告“第十节 财务报告 七、合并财务报表项目注释 21. 使用权资产”之说明;

2) 公司对短期租赁和低价值资产租赁的会计政策详见本报告“第十节 财务报告 五、重要会计政策及会计估计 40. 租赁”之说明。计入当期损益的短期租赁费用和低价值资产租赁费用金额如下:

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期数
短期租赁费用	18,464,257.38
低价值资产租赁费用(短期租赁除外)	
合计	18,464,257.38

3) 与租赁相关的当期损益及现金流

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期数
租赁负债的利息费用	5,152,298.03
与租赁相关的总现金流出	100,762,416.47

4) 租赁负债的到期期限分析和相应流动性风险管理详见本报告“第十节 财务报告 十七、风险管理 3. 流动风险”之说明。

(2) 公司作为出租人

公司作为出租人, 仅有经营租赁。

1) 租赁收入

单位: 元 币种: 人民币

项目	本期数	上年同期数
租赁收入	8,272,710.01	1,068,153.95
其中: 未纳入租赁收款额计量的可变租赁付款额相关收入		

2) 经营租赁资产

单位: 元 币种: 人民币

项目	期末数	上年年末数
投资性房地产	63,203,183.70	69,559,047.23
合计	63,203,183.70	69,559,047.23

3) 根据与承租人签订的租赁合同, 不可撤销租赁未来将收到的未折现租赁收款额

单位：元 币种：人民币

剩余期限	期末数
1 年以内	7,391,582.86
1-2 年	2,242,750.72
2-3 年	1,807,749.51
3-4 年	607,005.00
4-5 年	310,905.00
合计	12,359,993.09

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）	26,860,163,662.56	-491,635,719.27			30,371,192,097.77
2、衍生金融工具	-1,628,626.72	26,452,162.61			18,034,882.93
3、其他债权投资	9,107,073,011.84		89,424,735.18	187,912.25	8,974,792,747.89
4、其他权益工具投资	3,424,774,498.21		-26,157,131.62		888,450,912.82
金融资产小计	39,390,382,545.89	-465,183,556.66	63,267,603.56	187,912.25	40,252,470,641.41
上述合计	39,390,382,545.89	-465,183,556.66	63,267,603.56	187,912.25	40,252,470,641.41
金融负债	594,122,571.81	25,906,066.07			622,547,367.97

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

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	期末账面价值		
				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	15,373,626,059.26					
结算备付金	4,239,132,214.73					
融出资金	14,272,175,002.17					
衍生金融资产				23,550,815.84		

存出保证金	1,504,711,833.90					
应收款项	289,299,825.76					
买入返售金融资产	1,475,449,768.49					
交易性金融资产				30,371,192,097.77		
其他债权投资		8,974,792,747.89				
其他权益工具投资			888,450,912.82			
其他金融资产	142,968,946.16					
合计	37,297,363,650.47	8,974,792,747.89	888,450,912.82	30,394,742,913.61		
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	17,203,544,523.08					
结算备付金	3,429,659,479.81					
融出资金	12,001,843,139.77					
衍生金融资产				663,975.84		
存出保证金	1,405,554,892.41					
应收款项	118,444,884.10					
买入返售金融资产	1,404,131,659.30					
交易性金融资产				26,860,163,662.56		
其他债权投资		9,107,073,011.84				
其他权益工具投资			3,424,774,498.21			
其他金融资产	139,334,169.50					
合计	35,702,512,747.97	9,107,073,011.84	3,424,774,498.21	26,860,827,638.40		

(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
应付短期融资款	3,386,823,021.21			
拆入资金	2,407,134,499.87			
交易性金融负债			622,547,367.97	
衍生金融负债		5,515,932.91		
卖出回购金融资产款	21,072,631,177.76			
代理买卖证券款	14,382,125,029.05			
应付款项	99,763,100.89			
应付债券	12,979,277,733.07			
其他金融负债	329,607,460.44			
合计	54,657,362,022.29	5,515,932.91	622,547,367.97	
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
应付短期融资款	3,773,336,512.74			
拆入资金	2,007,622,222.23			
交易性金融负债			594,122,571.81	
衍生金融负债		2,292,602.56		
卖出回购金融资产款	18,321,196,405.95			
代理买卖证券款	12,455,051,319.74			
应付款项	109,801,383.70			
应付债券	15,126,853,662.88			
其他金融负债	165,970,481.23			
合计	51,959,831,988.47	2,292,602.56	594,122,571.81	

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	1,170,801,348.73	-21,220,736.04			1,042,008,686.63
2、贷款和应收款	78,131,958.44			1,209,249.54	137,038,642.97
金融资产小计	1,248,933,307.17	-21,220,736.04		1,209,249.54	1,179,047,329.60
金融负债	2,292,602.56	-3,340,297.67			9,937,522.65

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

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

(1) 明细情况

单位：元 币种：人民币

项目	期末数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	5,747,108,500.00	1,063,984,494.28	4,683,124,005.72
对联营企业投资	2,627,557,960.18	208,252,876.04	2,419,305,084.14
合计	8,374,666,460.18	1,272,237,370.32	7,102,429,089.86

(续上表)

项目	期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	5,297,108,500.00	968,436,554.41	4,328,671,945.59
对联营企业投资	2,430,617,538.99	208,252,876.04	2,222,364,662.95
合计	7,727,726,038.99	1,176,689,430.45	6,551,036,608.54

(2) 对子公司投资

单位：元 币种：人民币

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	本期计提减值准备	期末数	减值准备期末数
西证股权投资有限公司	800,000,000.00		300,000,000.00		500,000,000.00	
西证创新投资有限公司	2,650,000,000.00	400,000,000.00			3,050,000,000.00	
西南期货有限公司	509,207,000.00	350,000,000.00			859,207,000.00	29,597,900.00
西证国际投资有限公司	369,464,945.59			95,547,939.87	273,917,005.72	1,034,386,594.28
合计	4,328,671,945.59	750,000,000.00	300,000,000.00	95,547,939.87	4,683,124,005.72	1,063,984,494.28

(3) 对联营企业投资

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		
联营企业											
银华基金管理股份有限公司	2,111,525,295.98			406,773,287.15	240,251.93		216,827,231.69			2,301,711,603.37	208,252,876.04
重庆股份转让中心有限责任公司	110,839,366.97			12,844,744.76			6,090,630.96			117,593,480.77	
小计	2,222,364,662.95			419,618,031.91	240,251.93		222,917,862.65			2,419,305,084.14	208,252,876.04
合计	2,222,364,662.95			419,618,031.91	240,251.93		222,917,862.65			2,419,305,084.14	208,252,876.04

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	1,033,810,268.13	1,142,140,997.58	1,090,874,916.31	1,085,076,349.40
二、离职后福利-设定提存计划	2,250,549.98	84,093,275.19	84,217,543.40	2,126,281.77
三、辞退福利	79,680.38		67,307.28	12,373.10
四、离职后福利-设定受益计划	31,887,672.73	3,472,795.52	1,260,434.07	34,100,034.18
合计	1,068,028,171.22	1,229,707,068.29	1,176,420,201.06	1,121,315,038.45

(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	998,884,921.07	1,014,235,821.93	964,190,043.46	1,048,930,699.54
二、职工福利费		20,856,238.17	20,856,238.17	
三、社会保险费	1,453,863.21	42,788,488.44	43,204,365.21	1,037,986.44
其中：医疗保险费	397,414.34	41,297,295.56	41,317,254.10	377,455.80
工伤保险费	35,538.53	931,027.80	935,472.47	31,093.86
生育保险费	1,020,910.34	560,165.08	951,638.64	629,436.78
四、住房公积金		52,566,943.63	52,499,638.94	67,304.69
五、工会经费和职工教育经费	33,471,483.85	11,693,505.41	10,124,630.53	35,040,358.73
合计	1,033,810,268.13	1,142,140,997.58	1,090,874,916.31	1,085,076,349.40

(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	1,761,276.79	62,761,015.57	62,883,585.23	1,638,707.13
2、失业保险费	489,273.19	1,985,222.16	2,204,117.11	270,378.24
3、企业年金缴费		19,347,037.46	19,129,841.06	217,196.40
合计	2,250,549.98	84,093,275.19	84,217,543.40	2,126,281.77

(4) 设定受益计划变动情况

1) 设定受益计划义务现值

单位：元 币种：人民币

项目	本期数
期初余额	31,887,672.73
计入当期综合收益的设定受益成本	3,472,795.52
① 利息净额	1,216,706.04
② 重新计量变动	2,256,089.48
其他变动	-1,260,434.07
① 已支付的福利	-1,260,434.07
期末余额	34,100,034.18

2) 设定受益计划净负债

单位：元 币种：人民币

项目	本期数
期初余额	31,887,672.73
计入当期损益的设定受益成本	1,216,706.04
计入其他综合收益的设定受益成本	2,256,089.48
其他变动	-1,260,434.07
期末余额	34,100,034.18

3) 设定受益计划的内容

公司为 2013 年 1 月 1 日之前退休的职工提供以下补充退休后福利：养老金低于社平工资的人员，补足社平工资再每月每人增加 500 元补贴；养老金高于社平工资的人员，每月每人增加 800 元补贴。

4) 设定受益计划重大精算假设

精算假设条件中，折现率为 3.26%，社平工资增长率区分重庆地区和深圳地区情况，设置为 9.00%—4.00%，重庆地区人均预期寿命男性为 75.71 岁，女性为 80.94 岁，深圳地区人均预期寿命男性为 78.89 岁，女性为 84.39 岁。

其他说明：

适用 不适用

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	1,626,999,436.61	1,616,269,705.95
其中：货币资金及结算备付金利息收入	389,466,454.15	394,526,608.89
融出资金利息收入	859,645,033.06	751,955,600.74
买入返售金融资产利息收入	70,418,340.17	86,567,239.63
其中：约定购回利息收入	2,476,219.42	1,646,798.50
股权质押回购利息收入	67,546,250.94	84,796,378.08
其他债权投资利息收入	307,469,609.23	383,220,256.69
利息支出	1,253,017,267.57	1,233,874,466.35
其中：应付短期融资款利息支出	122,451,578.57	104,308,246.54
拆入资金利息支出	63,866,930.34	63,949,277.77
其中：转融通利息支出	55,999,999.84	57,186,111.12
卖出回购金融资产利息支出	465,344,162.47	408,998,238.26
其中：报价回购利息支出	8,239,995.93	3,648,636.03
代理买卖证券款利息支出	46,712,553.66	46,345,258.58
应付债券利息支出	521,383,042.49	595,620,744.92
其中：次级债券利息支出	252,605,866.73	300,658,696.97
其他	33,259,000.04	14,652,700.28
利息净收入	373,982,169.04	382,395,239.60

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	763,207,035.86	708,157,237.14
证券经纪业务收入	1,021,258,326.09	961,997,333.28
其中：代理买卖证券业务	851,119,124.46	835,710,975.91
交易单元席位租赁	108,653,424.54	98,942,511.56
代销金融产品业务	61,485,777.09	27,343,845.81
证券经纪业务支出	258,051,290.23	253,840,096.14
其中：代理买卖证券业务	258,051,290.23	253,840,096.14
2. 期货经纪业务净收入		
3. 投资银行业务净收入	260,161,567.80	230,121,407.84
投资银行业务收入	262,873,511.32	234,071,427.07
其中：证券承销业务	186,302,103.18	145,132,202.80
证券保荐业务	12,811,249.55	10,566,037.74
财务顾问业务	63,760,158.59	78,373,186.53
投资银行业务支出	2,711,943.52	3,950,019.23
其中：证券承销业务	2,636,471.82	3,948,132.44
证券保荐业务	75,471.70	
财务顾问业务		1,886.79
4. 资产管理业务净收入	24,474,182.53	30,509,567.28
资产管理业务收入	30,362,484.89	56,959,008.78
资产管理业务支出	5,888,302.36	26,449,441.50
5. 基金管理业务净收入	166,800.24	315,884.16
基金管理业务收入	166,800.24	315,884.16
6. 投资咨询业务净收入	4,687,762.12	9,477,611.88
投资咨询业务收入	4,687,762.12	9,477,611.88
7. 其他手续费及佣金净收入	-1,005,509.96	-1,441,509.44
其他手续费及佣金支出	1,005,509.96	1,441,509.44
合计	1,051,691,838.59	977,140,198.86
其中：手续费及佣金收入	1,319,348,884.66	1,262,821,265.17
手续费及佣金支出	267,657,046.07	285,681,066.31

(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	1,415,094.34	8,160,377.37
其他财务顾问业务净收入	62,345,064.25	70,210,922.37

(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	3,984,593,756.13	5,791,952.87	2,046,769,024.86	7,868,839.59
信托	2,678,560,000.00	35,142,249.21	2,365,109,207.42	15,881,863.54
其他	1,491,179,182.93	20,551,575.01	490,960,220.89	3,593,142.68
合计	8,154,332,939.06	61,485,777.09	4,902,838,453.17	27,343,845.81

(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
期末产品数量	32	20	2
期末客户数量	1944	20	48
其中：个人客户	1920	1	
机构客户	24	19	48
期初受托资金	5,687,882,251.21	22,546,909,131.90	1,243,000,000.00
其中：自有资金投入	1,104,719,052.41		122,000,000.00
个人客户	3,357,045,415.80	23,190,000.00	
机构客户	1,226,117,783.00	22,523,719,131.90	1,121,000,000.00
期末受托资金	1,852,457,397.03	13,504,186,896.34	3,100,000,000.00
其中：自有资金投入	1,092,081,036.20		125,000,000.00
个人客户	427,675,660.08	20,000,000.00	
机构客户	332,700,700.75	13,484,186,896.34	2,975,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	1,662,725,448.08	13,308,212,165.89	3,100,000,000.00
其中：股票	72,759,047.68	19,074,466.92	
国债		21,088,720.00	
其他债券	1,519,159,031.71	1,384,821,157.77	
基金	31,706,343.55		
其他	39,101,025.14	11,883,227,821.20	3,100,000,000.00
当期资产管理业务净收入	6,325,351.97	18,148,830.56	

手续费及佣金净收入的说明：

√适用 □不适用

受托客户资产管理业务明细情况

单位：元 币种：人民币

资产项目	期末数	期初数	负债项目	期末数	期初数
受托管理资金存款	407,912,010.62	2,714,551,196.55	受托管理资金	17,457,865,105.99	29,422,315,978.86
客户结算备付金	15,139,791.46	33,798,859.85	应付款项	65,441,058.78	327,507,455.33
存出与托管客户资金	135,737.73	199,845.21	卖出回购	84,298,289.00	809,214,944.08
应收款项	180,877,149.35	426,867,603.54			
受托投资	17,003,539,764.61	27,383,620,873.12			
其中：投资成本	18,070,937,613.97	28,354,015,225.06			
已实现未结算损益	-1,067,397,849.36	-970,394,351.94			
合计	17,607,604,453.77	30,559,038,378.27	合计	17,607,604,453.77	30,559,038,378.27

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	24,388,556.06	230,395,221.09
权益法核算的长期股权投资收益	419,618,031.91	377,284,851.50
金融工具投资收益	1,266,328,416.57	870,154,260.22
其中：持有期间取得的收益	1,206,117,285.18	802,377,330.61
—交易性金融工具	964,651,396.99	771,296,530.63
—其他权益工具投资	241,465,888.19	31,080,799.98
处置金融工具取得的收益	60,211,131.39	67,776,929.61
—交易性金融工具	9,513,169.98	-10,404,591.92
—其他债权投资	39,322,250.27	33,453,814.88
—衍生金融工具	11,375,711.14	44,727,706.65
合计	1,710,335,004.54	1,477,834,332.81

(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	964,651,396.99	771,296,530.63
	处置取得收益	9,513,169.98	-10,404,591.92

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	-695,741,644.27	-117,410,478.88
交易性金融负债	-587,798.33	461,250.00
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	-587,798.33	
衍生金融工具	31,134,727.93	-17,624,147.97
合计	-665,194,714.67	-134,573,376.85

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	1,227,450,978.81	1,029,436,422.34
租赁费	13,534,810.10	65,426,681.74
折旧费	82,892,771.64	25,220,999.49
无形资产摊销	31,058,874.30	29,349,945.42
长期待摊费用摊销	11,496,337.98	44,293,819.27
差旅费	15,117,830.75	13,683,154.41
业务招待费	9,505,186.59	18,486,635.17
投资者保护基金	23,752,389.54	10,895,916.18
咨询费	11,538,254.43	10,337,871.11
电子设备运转费	58,772,435.62	45,618,310.78
邮电费	26,251,268.72	24,693,013.16
交易所会员年费	20,641,190.09	20,393,858.59

物业管理费	18,103,871.95	10,188,256.53
业务宣传费	16,257,771.86	9,970,588.60
其他	41,951,461.47	25,238,551.29
合计	1,608,325,433.85	1,383,234,024.08

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
非流动资产处置损益	4,368,643.70
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）	37,273,332.79
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	38,807.00
其他符合非经常性损益定义的损益项目	4,489,752.67
减：所得税影响额	11,243,972.56
合计	34,926,563.60

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

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 (元/股)	稀释每股收益 (元/股)
归属于公司普通股股东的净利润	4.11	0.16	0.16
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	3.97	0.15	0.15

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：吴坚

董事会批准报送日期：2022年4月25日

修订信息

适用 不适用

第十一节 证券公司信息披露

一、公司重大行政许可事项的相关情况

√适用 □不适用

序号	行政许可批复时间	行政许可批复名称	行政许可批复文号
1	2021 年 7 月 14 日	关于申请参与科创板转融券市场化约定申报的复函	中证金函[2021]151 号
2	2021 年 12 月 17 日	关于同意场外期权业务二级交易商备案的函	中证协函[2021]871 号
3	2022 年 3 月 18 日	关于对西南证券股份有限公司非公开发行短期公司债券挂牌转让无异议的函	上证函[2022]352 号

二、监管部门对公司的分类结果

√适用 □不适用

年度	分类结果
2021	A 类 A 级
2020	B 类 BBB 级
2019	B 类 BB 级