



国信证券  
GUOSEN SECURITIES



# 2022

国信证券股份有限公司

## 年度报告

GUOSEN SECURITIES ANNUAL REPORT

股票代码 Stock Code: 002736

## 战略愿景

打造全球视野、本土优势、创新驱动、科技引领的  
世界一流综合型投资银行

## 价值观念

创造价值 成就你我 服务社会

## 文化理念

合规自律 专业务实 诚信稳健 和谐担当

# 董事长致辞

各位股东：

2022年是极为重要、极不平凡的一年。党的二十大胜利召开，描绘了全面建设社会主义现代化国家的宏伟蓝图。资本市场制度日趋完善，A股上市公司突破5,000家，投资者数量突破两亿大关。在发达经济体加息、俄乌冲突等多种超预期因素冲击下，A股市场主要指数震荡下行，日均股基成交额下降10%，股票项目发行数量下降20%，债券市场收益率宽幅震荡，证券行业面临巨大压力。

志不求易者成，事不避难者进。面对复杂外部环境，公司坚持党建引领，强化风控合规，协同发力，加快改革创新，优化组织架构，加强人才队伍建设，深化金融科技赋能，全面提升以客户为中心的综合金融服务能力，各项工作取得积极进展。公司2022年实现营业收入158.76亿元、归属于母公司净利润60.88亿元，年末总资产达3,943.31亿元，净资产达1,068.85亿元，净资产首次跃升至千亿新台阶。高质量完成国企改革三年行动，获批多项创新业务资格，公募REITs业务保持良好态势，股权融资、债权融资份额均位居深圳市场前列，研究业务连续两年获评新财富年度进步最快的研究机构。主动承担国有金融企业与上市公司的双重社会责任，首次发布环境信息披露报告，扎实开展8县1村1镇结对帮扶工作。

公司发展获得监管及市场各方广泛认可，获得境内券商最高的国际信用评级（惠誉“BBB+”）；白沙泉国家级投教基地及重庆、湖南、福建、北京等4个省级基地全部考核优秀；金融科技项目获评第八届证券期货科学技术奖三等奖和优秀奖。公司入围《财富》中国500强，获评“本土最佳投行”“年度财富管理证券公司”等一百多个奖项。我谨代表公司董事会对一直以来关心和支持国信证券的各级党委和政府、监管部门、广大股东和客户、全体干部员工、社会各界朋友表示衷心的感谢！

征程万里风正劲，重任千钧再奋蹄。2023年是全面贯彻落实党的二十大精神开局之年。公司作为粤港澳大湾区唯一一家本地国资控股的头部券商，将贯彻落实中央、省、市相关会议精神，为全国全省全市经济发展大局作出国信最大程度贡献，全力开创公司高质量发展新局面，向着“打造全球视野、本土优势、创新驱动、科技引领的世界一流综合型投资银行”的战略愿景砥砺前行，为广大股东创造更大价值。

党委书记、董事长：张纳沙

2023年4月28日

# 01

## 重要提示、 目录和释义



## 重要提示

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。

公司负责人张纳沙、主管会计工作负责人及会计机构负责人周中国声明：保证本年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

本报告经公司第五届董事会第十五次会议审议通过。所有董事均已出席了审议本报告的董事会会议。未有董事、监事、高级管理人员对本报告提出异议。

公司 2022 年度财务报告已经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了无保留意见的审计报告。

本报告中涉及的未来发展计划等前瞻性陈述属于计划性事项，不构成公司对投资者的实质性承诺，敬请投资者注意投资风险。

公司经营中面临的风险主要有市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险等，公司建立了完善的内部控制体系、合规管理体系和风险控制指标动态监管体系，确保公司经营在风险可测、可控、可承受的范围内开展。请投资者认真阅读本年度报告第四节“公司治理”，并特别注意上述风险因素。

经公司第五届董事会第十五次会议审议通过的利润分配预案为：以 2022 年 12 月 31 日总股本 9,612,429,377 为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 2.70 元（含税），不进行送股或以公积金转增股本。

# CONTENTS

## 目录

01	董事长致辞	87	第六节 重要事项
02	第一节 重要提示、目录和释义	107	第七节 股份变动及股东情况
06	第二节 公司简介和主要财务指标	113	第八节 优先股相关情况
25	第三节 管理层讨论与分析	115	第九节 债券相关情况
53	第四节 公司治理	126	第十节 财务报告
82	第五节 环境和社会责任	249	第十一节 证券公司信息披露

### 备查文件目录

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

# 释义

释义项	指	释义内容
国信证券、公司、本公司	指	国信证券股份有限公司
董事会	指	国信证券股份有限公司董事会
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
中国保监会	指	原中国保险监督管理委员会
香港证监会	指	香港证券及期货事务监察委员会
深圳证监局	指	中国证券监督管理委员会深圳监管局
浙江证监局	指	中国证券监督管理委员会浙江监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
中证协	指	中国证券业协会
股转公司	指	全国中小企业股份转让系统有限责任公司
中登公司	指	中国证券登记结算有限责任公司
证金公司	指	中国证券金融股份有限公司
深圳市国资委	指	深圳市人民政府国有资产监督管理委员会
深投控	指	深圳市投资控股有限公司
华润信托	指	华润深国投信托有限公司
云南红塔	指	原云南红塔集团有限公司
云南合和	指	云南合和（集团）股份有限公司
中国一汽	指	中国第一汽车集团有限公司
一汽投资	指	一汽股权投资（天津）有限公司
北京城建	指	北京城建投资发展股份有限公司
国信弘盛	指	国信弘盛私募基金管理有限公司
国信期货	指	国信期货有限责任公司
国信香港	指	国信证券（香港）金融控股有限公司
国信资本	指	国信资本有限责任公司
鹏华基金	指	鹏华基金管理有限公司
REITs	指	基础设施证券投资基金
QFII	指	合格境外机构投资者
《公司法》	指	《中华人民共和国公司法》
《证券法》	指	《中华人民共和国证券法》
《公司章程》	指	《国信证券股份有限公司章程》
报告期	指	2022 年
报告期末	指	2022 年 12 月 31 日
元	指	人民币元

2022 年年度报告中，部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能略有差异，这些差异是由于四舍五入造成的。

# 02

## 公司简介 和主要财务指标



## 一、公司信息

股票简称	国信证券	股票代码	002736
变更后的股票简称	不适用		
股票上市证券交易所	深圳证券交易所		
公司的中文名称	国信证券股份有限公司		
公司的中文简称	国信证券		
公司的外文名称	GUOSEN SECURITIES CO.,LTD.		
公司的外文名称缩写	GUOSEN SECURITIES		
公司的法定代表人	张纳沙		
公司的总经理	邓舸		
注册地址	深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
注册地址的邮政编码	518001		
公司注册地址历史变更情况	不适用		
主要办公地址	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦		
主要办公地址的邮政编码	518046		
公司网址	<a href="http://www.guosen.com.cn">http://www.guosen.com.cn</a>		
电子信箱	ir@guosen.com.cn		
公司注册资本	96.12 亿元		
公司净资本	794.35 亿元		

## 二、联系人和联系方式

董事会秘书	谌传立	证券事务代表	蔡妮芬
联系地址	深圳市福田区福华一路 125 号 国信金融大厦 45 楼	联系地址	深圳市福田区福华一路 125 号 国信金融大厦 45 楼
电 话	0755-82130188	电 话	0755-82130188
传 真	0755-82133453	传 真	0755-82133453
电子信箱	ir@guosen.com.cn	电子信箱	ir@guosen.com.cn

## 三、信息披露及备置地点

公司披露年度报告的证券交易所网站	深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> )
公司披露年度报告的媒体名称及网址	《证券时报》( <a href="http://www.stcn.com">http://www.stcn.com</a> ) 《中国证券报》( <a href="https://www.cs.com.cn">https://www.cs.com.cn</a> ) 《上海证券报》( <a href="https://www.cnstock.com">https://www.cnstock.com</a> ) 《证券日报》( <a href="http://www.zqrb.cn">http://www.zqrb.cn</a> )
公司年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 45 楼董事会办公室

## 四、注册变更情况

统一社会信用代码	914403001922784445
公司上市以来主营业务的变化情况	公司的经营范围为：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；金融产品代销；为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管业务；股票期权做市；上市证券做市交易。公司上市以来主营业务未发生重大变化。
历次控股股东的变更情况	公司控股股东为深投控，报告期内未发生变更。

## 五、各单项业务资格

### (一) 报告期末，公司及控股子公司获取的各单项业务资格情况

#### 1. 财富管理与机构业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2001年2月5日	网上证券委托业务资格	中国证监会
2	2002年8月6日	开放式证券投资基金代销业务资格	中国证监会
3	2005年8月22日	权证买入合格结算参与者	中登公司
4	2006年3月28日	中国证券登记结算有限责任公司结算参与者	中登公司
5	2008年2月1日	中国证券登记结算有限公司甲类结算参与者	中登公司
6	2008年5月13日	为国信期货提供中间介绍业务资格	中国证监会
7	2011年2月23日	向保险机构投资者提供交易单元	中国保监会
8	2011年5月20日	开展客户资金第三方存管单客户多银行服务资格	深圳证监局
9	2011年9月16日	外币有价证券经纪业务、承销业务资格	国家外汇管理局
10	2012年12月21日	私募基金资产托管业务试点资格	中国证监会
11	2013年3月14日	代销金融产品业务资格	深圳证监局
12	2013年12月31日	证券投资基金托管资格	中国证监会
13	2014年3月11日	开展客户证券资金消费支付服务资格	中国证监会
14	2014年9月17日	开展互联网证券业务试点资格	中证协
15	2014年10月14日	A股交易单元的港股通业务交易权限	上交所
16	2015年1月16日	股票期权经纪业务、自营业务交易参与者资格	上交所
17	2015年1月16日	期权业务结算资格	中登公司
18	2015年1月22日	衍生品合约账户开户资格	中登公司
19	2015年4月21日	私募基金份额登记外包服务资格、估值核算外包服务资格	中国证券投资基金业协会
20	2016年11月3日	深港通下港股通业务交易权限	深交所
21	2019年3月26日	证券账户业务无纸化业务资格	中登公司
22	2019年12月9日	股票期权经纪业务、自营业务交易参与者资格	深交所
23	2021年6月2日	基金投资顾问业务试点资格	中国证监会
24	2021年11月30日	账务管理功能优化试点业务资格	中国证监会
25	2022年11月18日	个人养老金基金销售业务资格	中国证监会

## 2. 投资银行业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2004年	保荐机构资格	中国证监会
2	2005年10月31日	从事短期融资券承销业务资格	中国人民银行
3	2012年6月11日	中小企业私募债承销业务资格	中证协
4	2013年1月4日	银行间非金融企业债务融资工具主承销业务资格	中国银行间市场交易商协会
5	2013年3月21日	全国股转系统主办券商资格	股转公司
6	2013年5月8日	军工涉密业务咨询服务	国家国防科技工业局
7	2013年8月29日	浙江股权交易中心会员	中证协
8	2013年12月30日	新疆股权交易中心会员	中证协
9	2014年2月19日	海峡股权交易中心会员	中证协
10	2020年12月18日	非金融企业债务融资工具独立主承销商资质	中国银行间市场交易商协会

## 3. 投资与交易业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	1999年9月21日	进入银行间同业市场资格	中国人民银行
2	2007年7月10日	上交所固定收益证券综合电子平台交易商资格	上交所
3	2009年4月24日	从事债券质押式报价回购业务试点资格	中国证监会
4	2011年3月21日	自营业务参与股指期货交易资格	深圳证监局
5	2012年12月21日	柜台交易业务资格	中证协
6	2013年7月29日	柜台市场股票协议逆回购业务、场外期权柜台交易业务、柜台市场权益收益互换交易业务方案备案	中证协
7	2013年12月18日	期权全真模拟交易经纪业务	上交所
8	2013年12月18日	期权全真模拟交易自营业务	上交所
9	2013年12月18日	全真模拟交易做市商业务	上交所
10	2014年5月21日	开展场外市场收益凭证业务试点资格	中证协
11	2014年5月23日	修改收益互换与场外期权业务方案的备案	中证协
12	2014年7月2日	作为主办券商从事做市业务的资格	股转公司
13	2015年2月6日	股票期权做市业务资格	中国证监会
14	2015年3月4日	非金融企业债务融资工具集中簿记建档业务资格	北京金融资产交易所有限公司
15	2015年3月19日	债券交易净额清算业务资格	银行间市场清算所股份有限公司
16	2015年4月3日	标准债券远期集中清算业务资格	银行间市场清算所股份有限公司
17	2015年5月5日	非金融企业债务融资工具报价业务资格	中国银行间市场交易商协会
18	2016年3月1日	上证50ETF期权合约品种主做市商资格	上交所
19	2018年7月31日	场外期权业务二级交易商资格	中证协
20	2019年2月28日	信用衍生品业务资格	中国证监会
21	2019年3月22日	银行间债券市场尝试做市业务资格	全国银行间同业拆借中心
22	2019年4月8日	上交所信用保护合约核心交易商	上交所
23	2019年7月3日	深交所信用保护合约核心交易商	深交所

序号	获取时间	业务资格	批准机构
24	2019年12月11日	信用保护凭证创设机构	上交所
25	2019年12月11日	深交所沪深300ETF期权主做市商资格	深交所
26	2019年12月18日	中金所沪深300股指期货期权主做市商资格	中国金融期货交易所
27	2019年12月23日	上交所沪深300ETF期权主做市商资格	上交所
28	2020年4月8日	债券通报价机构	中国外汇交易中心
29	2021年6月29日	信用缓释工具一般交易商资格	中国银行间交易商协会
30	2022年3月23日	信用保护凭证创设机构	深交所
31	2022年4月13日	受信用保护债券质押式回购业务合格创设机构	中登公司
32	2022年7月22日	中证1000股指期货期权主做市商资格	中国金融期货交易所
33	2022年9月15日	上市证券做市交易业务资格	中国证监会
34	2022年9月16日	中证500ETF期权主做市商资格	上交所
35	2022年9月19日	创业板ETF期权主做市商资格	深交所
36	2022年9月19日	中证500ETF期权主做市商资格	深交所
37	2022年12月12日	深证100ETF期权主做市商资格	深交所
38	2022年12月19日	上证50股指期货期权主做市商资格	中国金融期货交易所

#### 4. 资产管理业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2002年6月23日	客户资产管理业务资格	中国证监会
2	2008年3月2日	合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务资格	中国证监会
3	2011年6月14日	资产管理业务参与股指期货交易资格	深圳证监局
4	2012年7月31日	开展现金管理产品试点	中国证监会
5	2013年3月5日	受托保险资金管理业务资格	中国保监会

#### 5. 资本中介业务

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2010年3月18日	融资融券业务资格	中国证监会
2	2012年5月22日	约定购回式证券交易业务试点资格	中国证监会
3	2012年5月29日	约定购回式证券交易权限	上交所
4	2012年8月29日	转融通业务试点资格	证金公司
5	2012年10月26日	上市公司股权激励行权融资业务试点资格	中国证监会
6	2013年1月12日	约定购回式证券交易权限	深交所
7	2013年2月25日	转融通证券出借交易权限	深交所
8	2013年2月27日	转融通证券出借交易权限	上交所
9	2013年6月21日	股票质押式回购交易权限	上交所
10	2013年6月21日	股票质押式回购交易权限	深交所
11	2014年5月30日	上市公司限制性股票融资业务资格	中国证监会
12	2019年7月18日	科创板转融券业务资格	证金公司
13	2020年8月19日	创业板转融券业务资格	证金公司

## 6. 国信弘盛获取的单项业务资格

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2008年6月17日	开展直投业务资格	中国证监会
2	2012年9月19日	开展直投基金业务资格	中国证监会
3	2022年8月24日	外商投资股权投资试点企业 (QFLP)	深圳市地方金融监督管理局

## 7. 国信期货获取的单项业务资格

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2007年12月10日	金融期货经纪业务资格	中国证监会
2	2008年2月14日	上海期货交易所会员资格	上海期货交易所
3	2008年12月19日	大连商品交易所会员资格	大连商品交易所
4	2008年3月5日	金融期货交易结算业务资格	中国证监会
5	2008年4月2日	中国金融期货交易所交易结算会员	中国金融期货交易所
6	2009年3月25日	郑州商品交易所的会员资格	郑州商品交易所
7	2010年3月12日	委托国信证券提供IB业务资格	中国证监会河南监管局
8	2012年1月29日	期货投资咨询业务资格	中国证监会
9	2013年2月1日	资产管理业务资格	中国证监会
10	2013年11月4日	为保险机构提供期货经纪服务资格的备案	中国保监会
11	2017年6月5日	上海国际能源交易中心会员资格	上海国际能源交易中心
12	2022年6月1日	广州期货交易所会员资格	广州期货交易所

## 8. 国信香港及其控股子公司获取的单项业务资格

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2010年2月26日	第1类：证券交易（经纪公司）	香港证监会
2	2010年2月26日	第4类：就证券提供意见（经纪公司）	香港证监会
3	2010年3月15日	联交所参与者	香港联交所
4	2010年3月15日	香港结算参与者	香港中央结算有限公司
5	2010年6月29日	第4类：就证券提供意见（资管公司）	香港证监会
6	2010年6月29日	第9类：提供资产管理（资管公司）	香港证监会
7	2010年6月30日	第1类：证券交易（融资公司）（注2、3）	香港证监会
8	2010年6月30日	第6类；就机构融资提供意见（融资公司）（注2、3）	香港证监会
9	2011年3月14日	第2类：期货合约交易（经纪公司）	香港证监会
10	2011年3月14日	第5类：就期货合约提供意见（经纪公司）	香港证监会
11	2011年4月11日	期交所参与者	香港期货交易所有限公司
12	2011年4月11日	期货结算公司参与者	香港期货结算有限公司
13	2011年10月28日	第1类：证券交易（资管公司）	香港证监会
14	2016年12月5日	中华通交易所参与者	香港交易及结算有限公司
15	2016年12月5日	中华通结算参与者	香港交易及结算有限公司
16	2020年7月21日	经营证券期货业务许可证（国信香港）（注4）	中国证监会
17	2021年12月21日	经营证券期货业务许可证（资管公司）（注5）	中国证监会

注1：“经纪公司”指国信证券（香港）经纪有限公司；“资管公司”指国信证券（香港）资产管理有限公司；“融资公司”指国信证券（香港）融资有限公司。

注2：就第1类受规管活动而言，持牌人不得从事涉及企业融资以外的交易活动。

注3：持牌人不得持有客户资产。“持有”及“客户资产”的定义已在《证券及期货条例》的释义条文内界定。

注4：国信香港于2011年12月22日获取的《证券投资业务许可证》已经由《经营证券期货业务许可证》替代。

注5：资管公司于2013年9月29日获取的《合格境外机构投资者证券投资业务许可》已经由《经营证券期货业务许可证》替代。

## （二）报告期内公司及控股子公司获取的单项业务资格情况

序号	获取时间	业务资格	批准机构
1	2022年3月23日	信用保护凭证创设机构	深交所
2	2022年4月13日	受信用保护债券质押式回购业务合格创设机构	中登公司
3	2022年6月1日	广州期货交易所会员资格	广州期货交易所
4	2022年7月22日	中证1000股指期货主做市商资格	中国金融期货交易所
5	2022年8月24日	外商投资股权投资试点企业（QFLP）	深圳市地方金融监督管理局
6	2022年9月15日	上市证券做市交易业务资格	中国证监会
7	2022年9月16日	中证500ETF期权主做市商资格	上交所
8	2022年9月19日	创业板ETF期权主做市商资格	深交所
9	2022年9月19日	中证500ETF期权主做市商资格	深交所
10	2022年11月18日	个人养老金基金销售业务资格	中国证监会
11	2022年12月12日	深证100ETF期权主做市商资格	深交所
12	2022年12月19日	上证50股指期货主做市商资格	中国金融期货交易所

## 六、公司历史沿革

### （一）公司成立

公司前身深圳国投证券有限公司于1994年6月由深圳国际信托投资公司与中国国际企业合作公司共同出资设立，注册资本为10,000万元，深圳国际信托投资公司及中国国际企业合作公司各占注册资本的70%及30%。

### （二）第一次股权转让、增资及更名

1996年6月，中国国际企业合作公司将持有的公司30%股权转让给深圳市投资管理公司，本次股权转让后，公司的股东变更为深圳国际信托投资公司和深圳市投资管理公司，各占注册资本的70%及30%。

1997年6月，公司以扣除公益金后的公积金及未分配利润转增注册资本，并引入新投资者深圳市深业投资开发有限公司对公司增资。本次增资完成后，公司注册资本增加至80,000万元，股东变更为深圳国际信托投资公司、深圳市投资管理公司和深圳市深业投资开发有限公司，各占注册资本的51%、29%及20%。

1997年6月，公司名称变更为“国信证券有限公司”。

### **(三) 第二次股权转让、增资及更名**

1999年4月，深圳市深业投资开发有限公司将持有公司20%股权转让给深圳市机场股份有限公司。

1999年7月，公司股东会决议，以可分配利润及公积金向原股东转增注册资本，并引入云南红塔实业有限责任公司、中国一汽和北京城建股份有限公司等3家新投资者，同时深圳国际信托投资公司和深圳市投资管理公司分别向深圳市机场股份有限公司转让部分股权。

2000年6月公司名称规范为“国信证券有限责任公司”，注册资本变更为200,000万元，股东为深圳国际信托投资公司、深圳市投资管理公司、深圳市机场股份有限公司、云南红塔实业有限责任公司、中国第一汽车集团有限公司和北京城建股份有限公司，各占注册资本的30%、20%、20%、20%、5.10%及4.90%。

### **(四) 第三次股权转让**

2006年4月，深圳市机场股份有限公司将其持有公司的20%股权转让给深圳市机场（集团）有限公司。

### **(五) 第四次股权转让**

2007年1月，深圳市机场（集团）有限公司将其持有公司20%的股权转让给深投控。

### **(六) 整体变更为股份有限公司**

2008年3月，公司以2007年12月31日经审计的净资产折股变更为股份有限公司，注册资本变更为700,000万元，股东为深投控、华润信托、云南红塔、中国一汽和北京城建，持股比例分别为40%、30%、20%、5.10%及4.90%。

### **(七) 2014年12月首次公开发行股票并上市**

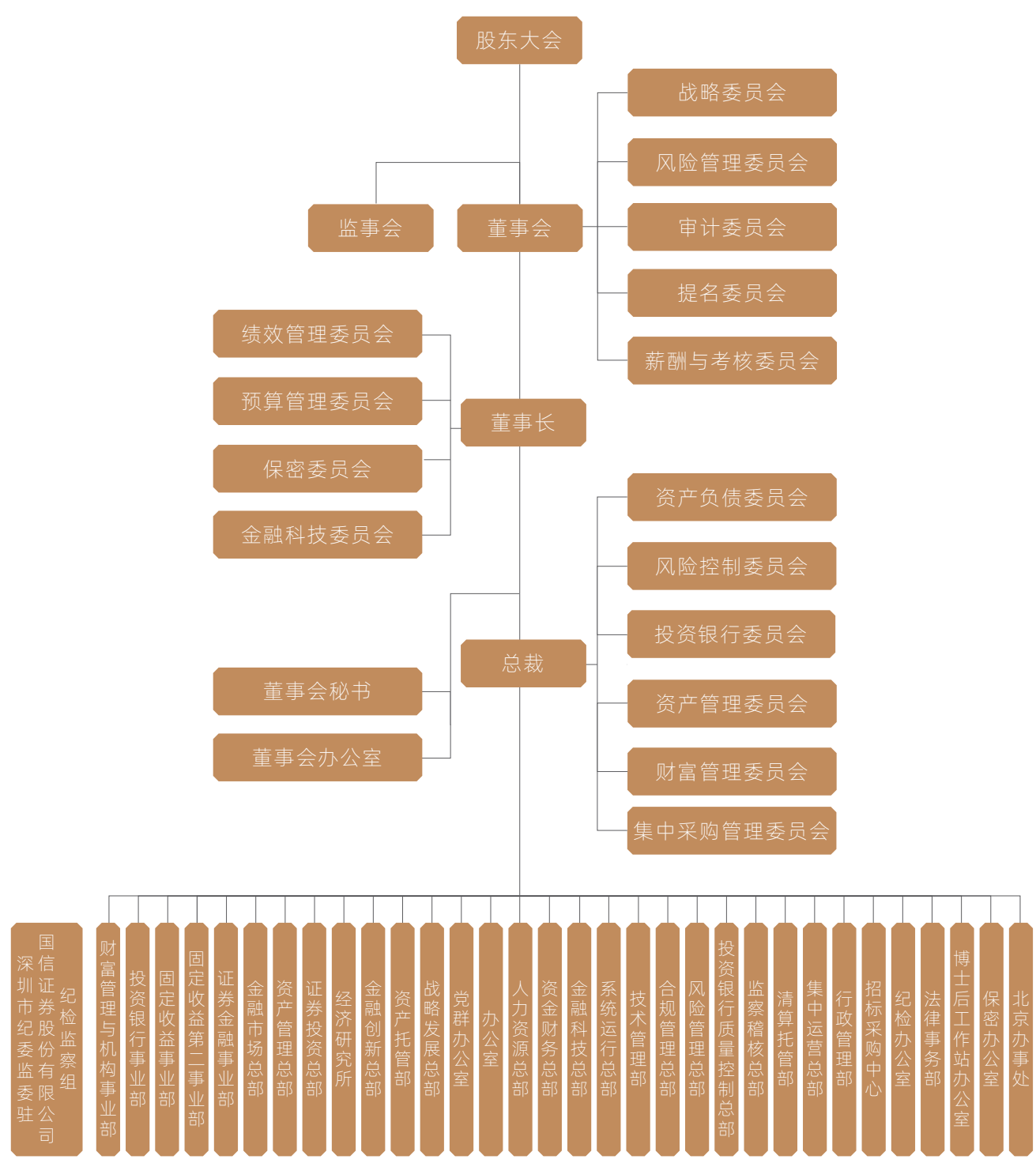
2014年12月10日，公司收到中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》（证监许可[2014]1335号），核准公司公开发行新股不超过12亿股。2014年12月29日，公司发行的12亿股人民币普通股股票在深交所上市交易。2015年3月4日，公司完成相关的工商变更登记及备案手续，注册资本由700,000万元变更为820,000万元。

### **(八) 2020年8月非公开发行A股股票**

经中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2020]471号）核准，公司向深投控、华润信托、云南合和、全国社会保障基金理事会等10名特定投资者非公开发行1,412,429,377股A股股票。2020年8月14日，新股在深交所上市。2020年11月12日，公司完成相关的工商变更登记及备案手续，注册资本由820,000万元变更为961,242.9377万元。

# 七、公司组织机构情况

## (一) 公司组织机构



## (二) 境内外重要分公司

序号	分公司名称	营业地址	成立日期	负责人
1	深圳分公司	深圳市福田区华强北街道华航社区华富路 1018 号中航中心西座 21 层 01、03-08 单元	2013 年 4 月 12 日	魏 辉
2	深圳红岭分公司	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路 6 号免税商务大厦 1601 楼整层	2021 年 6 月 22 日	谢庆伟
3	深圳深南分公司	深圳市福田区南园街道巴登社区深南中路 1099 号平安银行大厦 18 层	2014 年 9 月 2 日	钱湘平
4	深圳泰九分公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1258 号卓越后海金融中心 2601-2612	2015 年 12 月 29 日	景 佳
5	深圳振华分公司	深圳市福田区华强北街道华航社区华富路 1018 号中航中心西座 21 层 02 单元	2014 年 9 月 9 日	卢瑞华(代)
6	深圳科技园分公司	深圳市南山区粤海街道大冲社区铜鼓路 39 号大冲商务中心(三期) 4 栋 32A3BC1	2002 年 4 月 23 日	周国柳
7	深圳前海分公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 170102A	2021 年 5 月 27 日	邹 青
8	深圳互联网分公司	深圳市福田区福田街道福华一路 125 号国信金融大厦 7 层及裙楼 1 层东南角	2010 年 9 月 9 日	王燕华
9	浙江互联网分公司	浙江省杭州市滨江区长河街道滨盛路 1688 号明豪大厦 1002、1005、1007 室	2020 年 7 月 9 日	王建维
10	西南互联网分公司	中国(四川)自由贸易试验区成都高新区锦城大道 539 号 B 座 1306 号	2020 年 7 月 8 日	段 志
11	上海分公司	中国(上海)自由贸易试验区民生路 1199 弄 1 号楼 1108-1112 室	2009 年 9 月 24 日	殷红华
12	上海自贸试验区分公司	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 807-808 室	2015 年 5 月 6 日	何 嘉
13	北京分公司	北京市海淀区三里河路 13 号 1、10、11、12 层	2000 年 7 月 5 日	谢 青
14	广州分公司	广州市天河区天河北路 183-187 号 1901-1916 室, 2001-2016 室	2009 年 8 月 13 日	陈奕辉
15	广西分公司	南宁市青秀区民族大道 146 号三祺广场 2801、2803A	2014 年 8 月 5 日	陈正鑫
16	浙江分公司	浙江省杭州市萧山区宁围街道诺德财富中心 1 幢 102 室、2901-2904 室	2001 年 3 月 1 日	章海波
17	金华分公司	浙江省金华市义乌市福田街道城北路国信大厦 1 楼、601、607-609 号	2010 年 4 月 29 日	叶 玲
18	浙江自贸区分公司	中国(浙江)自由贸易试验区舟山市普陀区东港街道文康街 53 号、55 号	2022 年 5 月 20 日	袁如佳
19	杭州分公司	浙江省杭州市上城区万象城 3 幢 901-902、908 室	2009 年 8 月 13 日	王 帆

序号	分公司名称	营业地址	成立日期	负责人
20	绍兴分公司	浙江省绍兴市越城区解放大道713-1、越发大厦1803室	2014年7月21日	陈 锋
21	温州分公司	浙江省温州市鹿城区南汇街道温州大道2088号悦尚大厦1幢106号、1幢701室、707室	2009年8月3日	殷 俊
22	宁波分公司	浙江省宁波市海曙区厂堂街80号(8-2)-(8-5)室、88号(1-4)室	2014年7月31日	夏 映
23	福建分公司	厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场30层01-09室	2014年6月27日	陈茹娟
24	四川分公司	四川省成都市武侯区人民南路四段46号附1号上善国际写字楼2栋22楼1号	2013年1月11日	刘应达
25	江苏分公司	南京市鼓楼区汉中路2号亚太商务楼第17层19层	2013年1月24日	张 宁
26	苏州分公司	中国(江苏)自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区苏州中心广场58幢3401室内中的35层03号	2021年6月22日	张旭薇
27	湖北分公司	湖北省武汉市江岸区沿江大道159号时代广场1座16-17层	1998年1月9日	文德军
28	江西分公司	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1568号红谷凯旋商业办公综合楼及商业六101、901、902、904、906室	2014年8月7日	徐汉坤
29	佛山分公司	广东省佛山市禅城区季华六路三号一区2座24楼	2000年11月17日	王厚伟
30	陕西分公司	陕西省西安市浐灞生态区东二环6589号陕西建工第五建设集团有限公司总部办公大楼20层-2层L2-16A	2012年4月27日	卢龙斌
31	甘肃分公司	甘肃省兰州市城关区甘南路122号至诚首府写字楼13楼	2010年4月6日	陈兔明
32	珠海分公司	广东省珠海市香洲区拱北九洲大道西2021号富华里中心写字楼A座28层2801、02、03、04、05、06室	2014年7月15日	田 赛
33	湖南分公司	湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道茶子山东路102号浦发金融大厦第7层	2014年7月15日	朱 勇
34	天津分公司	天津市和平区小白楼街解放北路与哈尔滨道交口东北侧金之谷大厦1-102号、1-901号、1-902号、1-903号、1-904号	2012年7月25日	姜 鹏
35	粤西分公司	广东省佛山市顺德区大良街道德和社区国泰南路3号保利商贸中心1栋10层办公室1001-1012单元	2006年8月14日	林 枫
36	中山分公司	广东省中山市东区中山五路2号紫马奔腾广场6座1层电梯旁房间、9层	2012年7月30日	黄文燊
37	肇庆分公司	广东省肇庆市端州区端州三路南侧16号(70区)名城星岸商住中心A区15层15、16、18、19、20、21单元	2014年8月27日	杨晓阳
38	山东分公司	济南市历城区华信路3号鑫苑鑫中心7号楼历城金融大厦112-113、1801-1804、1810-1812	2009年8月25日	姜仁东
39	烟台分公司	山东省烟台市经济技术开发区珠江路66号正海大厦104、1709、1710室	2014年9月10日	冯 杨

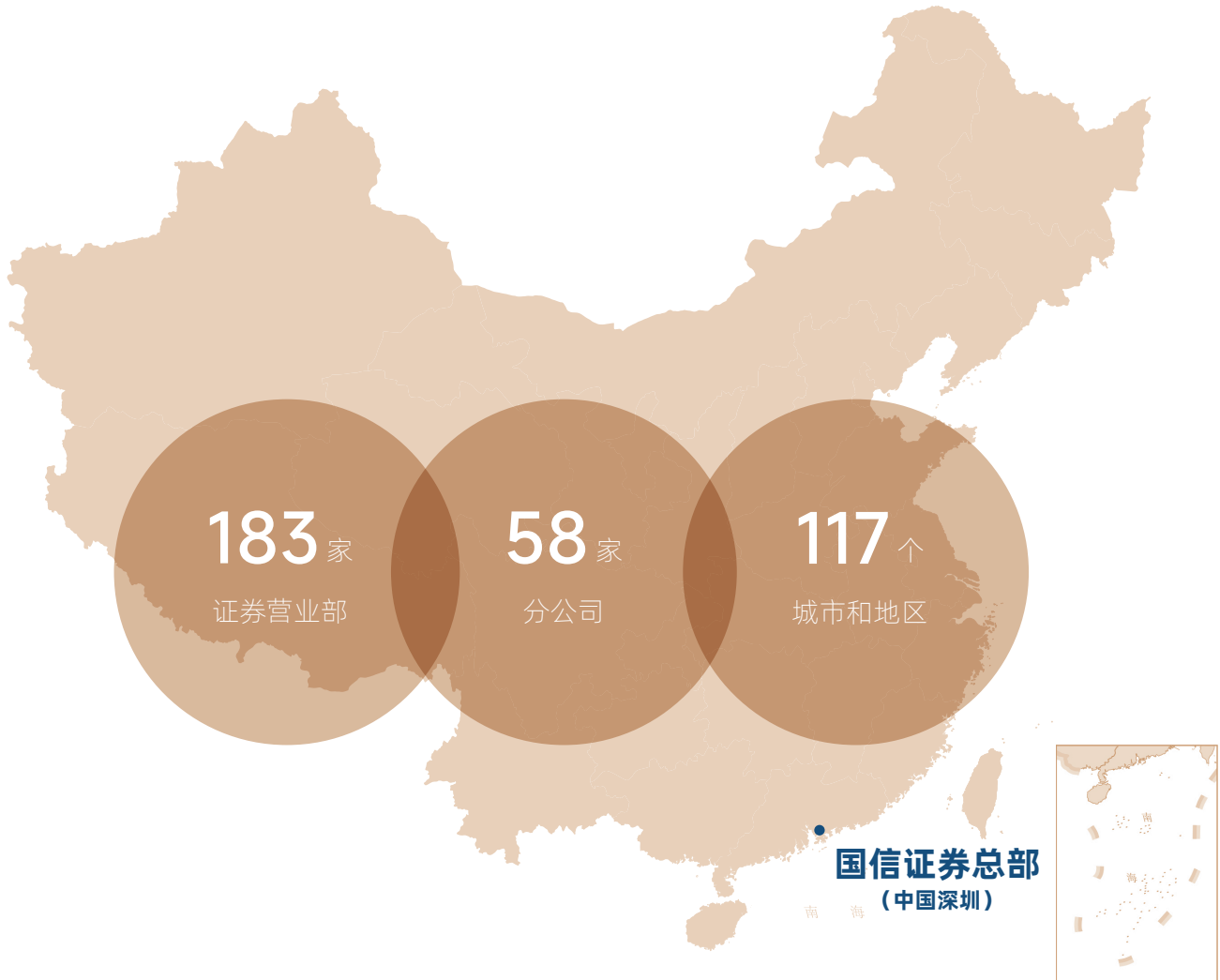
序号	分公司名称	营业地址	成立日期	负责人
40	惠州分公司	惠州市文明一路9号富绅大厦24层01号01、02、03、04、05、10、11、12单元	2014年9月25日	朱林峰
41	大连分公司	辽宁省大连市沙河口区高尔基路737号3层1号	1997年7月15日	杨春生
42	黑龙江分公司	黑龙江省哈尔滨市道里区群力新区景江西路1栋商业1-4层009号	2014年7月4日	郑少友
43	云南分公司	云南省昆明市西山区前卫西路润城小区A4块地2栋8层	2014年8月15日	盛红敏
44	江苏苏南分公司	江苏省无锡市滨湖区万达广场A区梁溪路51号12楼	2014年8月6日	阎肃
45	河南分公司	郑州市二七区民主路10号华润大厦20层2006室	2014年6月25日	贾少飞
46	东莞分公司	广东省东莞市南城区胜和路金盈大厦主附楼二楼	2010年3月4日	王凌
47	吉林分公司	吉林省长春市朝阳区西安大路万达时代商务中心101号	2003年7月7日	王浩
48	重庆分公司	重庆市江北区庆云路16号18-1至18-3、18-5至18-11	2014年7月4日	高莉
49	安徽分公司	安徽省合肥市包河区马鞍山路130号包河万达广场7号楼12层	2007年1月11日	代汉军
50	辽宁分公司	沈阳市和平区南京南街52号鸿源大厦一楼大堂北侧、五楼	2007年1月5日	孟寰
51	山西分公司	山西省太原市晋源区长兴南街8号环球金融中心29层	2014年8月11日	曹星
52	河北分公司	河北省石家庄市裕华区建设南大街59号1-2层	2014年9月1日	朱晓科
53	青岛分公司	青岛市市南区香港中路68号华普大厦七层	2014年8月20日	杨翔
54	海南分公司	海南省海口市龙华区世贸北路1号海岸壹号之佳景国际之第1层前左2垮和第4层前大半层	2010年3月15日	陈协明
55	内蒙古分公司	内蒙古呼和浩特市赛罕区大学东街68号印象北京1号楼18层1801号	2010年4月1日	徐洁静
56	贵州分公司	贵州省贵阳市观山湖区长岭北路6号东原财富广场一期1号楼1单元1层1室门面, 5层7-14号房	2015年6月10日	严江涛
57	宁夏分公司	宁夏银川市兴庆区上海东路北侧、民族北街东侧中环大厦11层1、2、3、4、12号房、1层6号房(自主申报)	2014年7月14日	冯啟枝
58	新疆分公司	新疆乌鲁木齐新市区北京南路203号中厦大厦1栋9层北向半层、10层	2014年8月5日	李胜春

**(三) 境内外控股子公司、参股公司**

序号	公司名称	注册地址	设立时间	注册资本 (万元)	持股 比例	负责人
1	国信弘盛	深圳市罗湖区桂园街道红村社区红岭中路1012号国信证券1601	2008年8月8日	405,000	100.00%	成飞
2	国信期货	上海市虹口区东大名路358号2001、2002、2003、2005、2006、2007、2008、2009、2010、2013、2015、2016、2017室	1995年5月4日	200,000	100.00%	邓舸
3	国信香港	香港金钟道88号太古广场1座32楼3207-3212室	2008年11月13日	港币263,000	100.00%	谌传立
4	国信资本	深圳市龙华区民治街道北站社区汇隆商务中心2号楼3312	2019年6月18日	300,000	100.00%	周中国
5	鹏华基金	广东省深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	1998年12月22日	15,000	50.00%	何如
6	青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	山东省青岛市崂山区松岭路169号国际创新园B座17层B1、B2	2014年2月13日	10,000	20.00%	蒲晓煜
7	前海股交投资控股(深圳)有限公司	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)	2011年11月15日	117,740	10.62%	林凡
8	哈尔滨股权登记托管中心有限责任公司	黑龙江省哈尔滨市松北区滨北街2140号	1993年6月4日	260	7.69%	孙名扬
9	红塔创新投资股份有限公司	云南省昆明市二环西路398号高新科技信息中心主楼14层	2000年6月15日	90,000	2.50%	李双友
10	证通股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号1号楼	2015年1月8日	251,875	1.99%	王关荣
11	深圳市雅都软件股份有限公司	广东省深圳市南山区高新南七道022号高新工业村T2-A栋402	1997年1月29日	3,261	1.86%	李毅
12	中证信用增进股份有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道金融街1号前海弘毅大厦8层B2单元	2015年5月27日	458,598	1.09%	牛冠兴
13	中证机构间报价系统股份有限公司	北京市西城区金融大街4号楼8-10层	2013年2月27日	755,024	0.66%	安青松

#### (四) 证券营业网点数量和分布情况

截至报告期末，公司共设有 183 家证券营业部，58 家分公司，分布于全国 117 个城市和地区。具体情况如下：



## 1. 证券营业部分布情况

省 / 直辖市 / 自治区	营业部数量	省 / 直辖市 / 自治区	营业部数量
北京	11	辽宁	4
上海	8	山西	4
天津	3	安徽	3
重庆	3	江西	3
广东	52	黑龙江	3
浙江	20	云南	3
四川	14	广西	2
江苏	11	吉林	2
福建	8	河南	2
陕西	8	河北	1
山东	6	贵州	1
湖南	6	海南	1
湖北	4		

## 2. 分公司分布情况

省 / 直辖市 / 自治区	分公司数量	省 / 直辖市 / 自治区	分公司数量
北京	1	陕西	1
上海	2	甘肃	1
天津	1	湖南	1
重庆	1	湖北	1
广东	16	黑龙江	1
浙江	8	吉林	1
山东	3	贵州	1
江苏	3	宁夏	1
四川	2	云南	1
辽宁	2	河南	1
山西	1	安徽	1
河北	1	内蒙古	1
福建	1	新疆	1
江西	1	海南	1
广西	1		

### (五) 其他分支机构数量与分布情况

公司子公司国信期货共设有 22 家分支机构，其中 15 家期货营业部，7 家分公司，分布于全国 19 个城市。

## 八、其他有关资料

### (一) 公司聘请的会计师事务所

会计师事务所名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所办公地址	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼
签字会计师姓名	燕玉嵩、黄燕

### (二) 公司聘请的报告期内履行持续督导职责的保荐机构

报告期内，公司未聘请履行持续督导职责的保荐机构。

### (三) 公司聘请的履行持续督导职责的财务顾问

报告期内，公司未聘请履行持续督导职责的财务顾问。

## 九、主要会计数据和财务指标

### (一) 合并报表

单位：万元

项目	2022 年度	2021 年度	本年比上年增减	2020 年度
营业收入	1,587,576.83	2,381,803.70	-33.35%	1,878,407.12
归属于上市公司股东的净利润	608,799.47	1,011,475.88	-39.81%	661,573.95
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	595,188.32	985,006.41	-39.58%	681,228.79
其他综合收益的税后净额	-38,592.38	-98,977.31	不适用	21,378.62
经营活动产生的现金流量净额	-734,151.63	-671,538.78	不适用	-347,227.66
基本每股收益（元/股）	0.52	0.97	-46.39%	0.72
稀释每股收益（元/股）	0.52	0.97	-46.39%	0.72
加权平均净资产收益率	6.50%	12.71%	下降 6.21 个百分点	10.61%

项目	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日	本年末比上年末增减	2020 年 12 月 31 日
资产总额	39,433,077.89	36,230,144.23	8.84%	30,275,587.63
负债总额	28,744,574.65	26,537,452.29	8.32%	22,183,140.69
归属于上市公司股东的净资产	10,688,503.24	9,691,011.01	10.29%	8,090,741.72

### (二) 母公司

单位：万元

项目	2022 年度	2021 年度	本年比上年增减	2020 年度
营业收入	1,334,076.98	1,931,947.41	-30.95%	1,627,109.10
净利润	620,081.81	868,009.57	-28.56%	655,551.84
扣除非经常性损益的净利润	610,865.14	841,253.56	-27.39%	677,210.96
其他综合收益的税后净额	-41,832.64	-78,495.48	不适用	26,509.72
经营活动产生的现金流量净额	-586,338.86	-674,971.17	不适用	-526,294.58
基本每股收益（元/股）	0.53	0.82	-35.37%	0.71
稀释每股收益（元/股）	0.53	0.82	-35.37%	0.71
加权平均净资产收益率	6.88%	11.06%	下降 4.18 个百分点	10.75%

项目	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日	本年末比上年末增减	2020 年 12 月 31 日
资产总额	37,510,763.10	34,499,967.57	8.73%	28,769,550.98
负债总额	27,072,328.19	25,067,066.96	8.00%	20,813,935.17
所有者权益总额	10,438,434.91	9,432,900.61	10.66%	7,955,615.80

截至披露前一交易日的公司总股本（股）	9,612,429,377
支付的优先股股利	-
支付的永续债利息（万元）	91,150.00
用最新股本计算的全面摊薄每股收益（元/股）	0.52

## 十、境内外会计准则下会计数据差异

不适用。公司未按照国际会计准则编制 2022 年财务报告。

## 十一、分季度主要财务指标

### （一）合并报表

单位：万元

项目	第一季度	第二季度	第三季度	第四季度
营业收入	297,587.76	532,990.98	499,826.22	257,171.87
归属于上市公司股东的净利润	76,740.76	243,950.21	155,507.99	132,600.51
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	75,442.15	242,863.43	153,313.04	123,569.71
经营活动产生的现金流量净额	-1,013,286.61	-530,481.16	-331,469.17	1,141,085.30

### （二）母公司

单位：万元

项目	第一季度	第二季度	第三季度	第四季度
营业收入	257,784.48	498,498.09	367,657.45	210,136.96
净利润	95,545.92	257,854.29	149,806.06	116,875.54
扣除非经常性损益的净利润	94,292.98	257,272.19	147,785.52	111,514.45
经营活动产生的现金流量净额	-932,454.40	-512,747.35	-402,758.70	1,261,621.60

上述财务指标及其加总数与公司已披露季度报告、半年度报告相关财务指标不存在重大差异。

## 十二、非经常性损益项目及金额

单位：万元

项目	2022 年度	2021 年度	2020 年度	说明
非流动资产处置损益（包括已计提资产减值准备的冲销部分）	209.84	-26.08	-21.22	主要是处置固定资产损失。
计入当期损益的政府补助（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）	11,420.72	6,172.58	6,303.33	收到政府补贴。
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	5,429.78	32,898.73	-31,318.62	诉讼案件预计负债冲回。
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回	1,452.32	-	-	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-758.15	-3,152.77	-1,338.36	
减：所得税影响额	4,143.37	9,422.98	-6,720.04	
合计	13,611.15	26,469.47	-19,654.84	

公司不存在其他符合非经常性损益定义的损益项目的具体情况。

公司将《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：

单位：万元

项目	涉及金额	原因
持有交易性金融资产、衍生金融工具和其他权益工具投资产生的公允价值变动损益及取得的投资收益	317,344.69	公司属于证券业金融企业，证券投资业务为公司的正常经营业务，故公司持有交易性金融资产、衍生金融工具和其他权益工具投资期间产生的公允价值变动损益及取得的投资收益，处置交易性金融工具、债权投资、衍生金融工具和其他债权投资取得的投资收益不作为非经常性损益项目。
处置交易性金融工具、债权投资、其他债权投资和衍生金融工具取得的投资收益	86,637.23	

### 十三、母公司净资本及有关风险控制指标

单位：万元

项目	2022年 12月31日	2021年 12月31日	本年末比上年末 增减	预警标准	监管标准
核心净资本	5,295,639.81	5,596,776.01	-5.38%	-	-
附属净资本	2,647,819.90	2,000,000.00	32.39%	-	-
净资本	7,943,459.71	7,596,776.01	4.56%	-	-
净资产	10,438,434.91	9,432,900.61	10.66%	-	-
各项风险资本准备之和	1,922,809.26	1,734,745.54	10.84%	-	-
表内外资产总额	33,151,604.49	28,463,351.77	16.47%	-	-
风险覆盖率	413.12%	437.92%	下降 24.80 个百分点	≥ 120%	≥ 100%
资本杠杆率	15.97%	19.66%	下降 3.69 个百分点	≥ 9.6%	≥ 8%
流动性覆盖率	236.62%	318.25%	下降 81.63 个百分点	≥ 120%	≥ 100%
净稳定资金率	171.89%	178.53%	下降 6.64 个百分点	≥ 120%	≥ 100%
净资本 / 净资产	76.10%	80.53%	下降 4.43 个百分点	≥ 24%	≥ 20%
净资本 / 负债	37.32%	41.08%	下降 3.76 个百分点	≥ 9.6%	≥ 8%
净资产 / 负债	49.04%	51.01%	下降 1.97 个百分点	≥ 12%	≥ 10%
自营权益类证券及其衍生品 / 净资本	20.58%	20.38%	上升 0.20 个百分点	≤ 80%	≤ 100%
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本	254.32%	213.22%	上升 41.10 个百分点	≤ 400%	≤ 500%

# 03

## 管理层 讨论与分析



## 一、报告期内公司所处行业的情况

2022年，证券行业坚持和加强党的全面领导，积极主动融入国家发展大局，充分发挥资本市场在促进资本形成、价格发现、资源配置、风险管理等方面的重要功能，进一步提升服务实体经济和投资者能力，有力支持科技创新和国家重大战略实施。

证券行业的经营业绩受资本市场变化影响较大，呈现明显的波动性和周期性特征。2022年末，上证指数收于3,089.3点，下跌15.1%；深证成指收于11,016.0点，下跌25.9%。两市全年成交额224.5万亿元，同比减少13.0%。2022年，受多重超预期因素冲击，证券行业经营业绩短期承压。据中证协统计，全行业140家证券公司实现营业收入3,949.73亿元，实现净利润1,423.01亿元，分别较上年下降21.38%、25.54%。截至2022年末，行业总资产为11.06万亿元，净资产为2.79万亿元，净资本2.09万亿元，分别较上年末增长4.41%、8.52%、4.69%。

根据中证协公布的证券公司会员经营业绩排名，近年来，公司净资产、净资本、营业收入、净利润等主要指标排名行业前列。报告期内，公司继续保持行业领先的市场地位，各项主要业务实现稳健发展。公司入选中国上市公司协会2021年度“上市公司丰厚回报榜”，入围《财富》中国500强，在央行、证监会、沪深交易所、《中国证券报》《证券时报》等机构和权威财经媒体的各项评选中，荣获“最佳公募REITs财务顾问”“中国证券公司金牛奖”“中国证券业投资银行君鼎奖”等奖项。

## 二、报告期内公司从事的主要业务

公司向个人、机构客户提供全方位的金融产品和服务，并自营相关金融产品的投资与交易业务，主要业务如下：

财富管理与机构业务，为个人和机构客户提供全价值链财富管理服务，包括证券、期货、期权经纪服务；推广和销售金融产品，提供投资咨询、资产配置服务；提供资产托管、专业化研究和咨询等服务；提供融资融券、股票

质押式回购、约定购回、行权融资等资本中介服务，赚取手续费、佣金、利息及相关收入。

投资银行业务，为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问、新三板挂牌推荐等金融服务，赚取承销费、保荐费、财务顾问费及相关收入。

投资与交易业务，从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募股权及另类投资业务等，赚取投资收益及相关收入。

资产管理业务，根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，集合、单一、专项资产管理业务及私募股权基金管理业务等，赚取管理费、业绩报酬及相关收入。

## 三、核心竞争力分析

公司自1994年成立以来，秉承“敢闯、敢试、敢为人先”的特区精神，依靠“国企体制、市场化机制”，从地方性单一经纪牌照公司，发展壮大成为拥有内地及香港市场证券业务全牌照的全国性大型综合类证券公司。目前，公司的核心竞争力主要包括：

### （一）“双区”建设和国资国企综改试点中的区位优势

目前，深圳市处在“双区”建设、“双区”叠加、“双改”示范的重大战略机遇期，将在深化改革扩大开放、科技创新、基础设施互联互通建设、战略性新兴产业、金融创新、国际及港澳专业服务九大领域大力推进体制机制创新。作为粤港澳大湾区唯一一家本地国资控股的头部券商，国信证券具备良好的业务专业能力和客户基础，区位优势较为明显。

国信证券发挥本土优势，植根粤港澳大湾区，成为深圳打造全球创新资本形成中心、金融创新中心和金融科技中心提供综合金融服务的标杆企业，保持深圳国资国企的领军地位。公司贯彻深圳“20+8”产业集群部署，加大对战略性新兴产业“全价值链”综合金融服务力度，积极参与产业基金管理人遴选工作，形成服务推进方案；与罗湖、南山、龙华、坪山、光明等区在综合金融、投融资服务、

股权投资基金、财富管理、行业研究、招商引资等领域开展全面战略合作；再次服务深圳市政府成功发行离岸人民币债券 50 亿元，助推内地与香港金融市场互联互通和人民币国际化。2022 年，公司利用多层次资本市场为深圳企业特别是科技创新型企业提供包括股权融资、债权融资、企业上市、并购重组、场外市场等专业服务。股权融资方面，公司在大湾区完成主承销项目 10 家，募集资金 70.42 亿元，其中 IPO 项目 7 家，募集资金 53.37 亿元，完成 IPO 项目家数居于深圳地区券商机构首位。债券融资方面，公司为大湾区企业发行各类债券 83 只，规模共计 1,077 亿元，客户群体实现各级国企全覆盖，多只债券创市场首单、可比债券最低利率。国信证券服务大湾区实体经济高质量发展，持续为产业升级和企业发展提供金融支撑。截至 2022 年末，子公司国信资本累计已完成 44 项粤港澳大湾区的自主投资项目，累计投资 15 家属于“20+8”产业集群的深圳企业。子公司国信弘盛在粤港澳大湾区设立私募股权投资基金 12 支，总规模近 40 亿元，累计投资 13 家深圳战略性新兴产业和未来产业企业。

## （二）实力强劲的股东背景

公司前六大股东均为实力强劲的央地两级国有企事业单位，国有股东持股占比合计超 80%，构成支持公司稳定发展的“基本盘”。近年来，公司与国资国企的协同成效较为明显，成立了服务深圳“双区”建设和综改试点的领导小组及专项工作小组，大力提升对国资客户的服务能力和服务质量，公司积极与深圳市多个行政区及其他部分城市开展战略合作，与多家国企、大型企业集团、金融机构建立了良好的业务合作关系。公司不断探索，从客户的综合金融服务需求出发，稳步推进不同业务条线之间、母子之间以及总部与分支机构之间的协同，综合服务能力不断增强。

2022 年，公司累计为深圳市、区国企发行各类债券（不含自承自销）35 只，承销规模共 201 亿元，发行债券利率多次创下行业新低。2022 年 7 月，公司推出首只深圳市国有企业信用债指数——“中债-国信证券深圳市国有企业信用债精选指数”，助力构建高效的深圳国企债务融资生态圈。

## （三）突出的市场化能力及业务创新能力

公司具有市场定位准确、客户服务能力强的优势，在经营中具备较强的前瞻性及市场敏感性，善于迅速把握市场机遇。公司是行业前八家创新试点证券公司之一，首创了“银证通”“金天利”等众多具有示范效应的业务模式。

当前，公司坚持一手抓传统优势业务转型，一手抓创新业务发展。公司财富管理转型不断深化，秉承“以客户为中心”的理念，构建“国信鑫投顾”“国信鑫智投”“国信鑫优选”“国信鑫私享”等四大财富管理品牌，形成了基于市场多层次需求的财富管理服务；面向机构和高净值客户，提供定制化综合金融服务，串联起财富管理、资产管理、投资银行服务链条，实现“全价值链财富管理”。公司致力于服务实体经济发展、推动科技创新，为符合注册制要求的企业提供专业的投资银行服务，同时积极响应国家产业发展战略，并以注册制全面实施、科创板设立、创业板改革以及北交所设立为契机，为新兴产业、创新创业企业提供高质量、全生命周期的金融支持，助推国家战略性新兴产业发展和实体经济转型升级。同时，公司加快构建创新容错机制，鼓励各业务线密切关注行业发展动态，着力推进改革创新。2022 年，公司获批首批上市证券做市交易、个人养老金基金销售等多项新业务资格，业务布局进一步拓宽。一批新业务、新产品加速落地，业务规模稳步增长，公募基金投顾服务品牌“国信鑫智投”签约资产近百亿元、创新打造私人财富服务品牌“国信鑫私享”；上线全市场首只券结模式港股通 ETF；落地首单挂钩黄金远期的收益凭证；完成首笔行权融资（含税）交易等；首次发布专项环境信息披露报告。

## （四）领先的金融科技水平

公司以建设“数字国信”为总目标，以深入融合业务与技术并加快金融科技与数字化建设为总抓手，以加速实现公司“十四五”战略目标为指导思想，加强规划引领，把握数字化转型方向，持续加大信息技术投入，加强金融科技战略布局，致力于以领先的科技能力驱动业务创新，赋能公司数字化转型，全面建设智慧化国信。

在财富管理与机构业务领域，公司金融科技推动从“产

品驱动”迈向“客户体验驱动”，发布了金太阳 APP6.0，打造四大财富管理品牌，为客户提供专业化、陪伴式的线上投顾服务，全品类、一站式的综合理财服务，智能化、启发式的投资管家服务；通过定制化资产配置、场景化产品推荐、个性化专属服务形成千人千面服务能力，以实践推动券业数字化财富管理转型提速。公司打造了行业领先的极速交易科技平台，建设了算法交易中心，建成全品种量化交易平台，上线了上市公司综合服务平台，搭建了衍生品一体化交易平台，建设企业级投研中台、研究所智慧研究平台，提升公司投研和服务能力，为机构投资者提供全链路、高智能、低延时的整体解决方案。在投资与交易业务领域，公司以投资价值链为核心，依托极速交易、大数据挖掘、人工智能、分布式计算等能力，围绕投资交易、做市服务、场外衍生品等核心业务，打造“综合投资交易平台”“智能做市交易平台”“一体化场外衍生品平台”，提供数字化、一体化、智能化三维一体的解决方案，并以此为抓手向客户提供投融资、风险管理、对冲交易、做市流动性支持等一系列综合金融服务，重塑投资交易新格局。在投行业务领域，公司通过人工智能技术提升投行自动化与数字化分析水平，持续推动大投行业务平台数字化建设；推进投行电子底稿、质量评价体系、智能文档审核、银行流水分析、机会挖掘等，加快投行智能化建设。在风险合规管理领域，公司以极速计算、人工智能等金融科技为核心，构建了数字风控新基建，聚焦风险发现、风险计量、风险阻断三大能力建设，形成业务、模型、数据和流程的闭环，实现对集团级风险管理赋能。在金融科技领域，以“云计算大后台”建设基础信息基座，保证系统安全运行和弹性交付；以“人工智能平台”实现智慧大脑全面升级，提升 AI 对各业务的赋能效果；以“智慧数据中台”推动公司数据共享互联，提升数据资产价值和数据洞察力；以“风险管理中台”输出可信稳定风险 API 服务体系；以“数字员工管理中心”推进运营管理智慧升级。公司围绕云原生技术体系和 BizDevOps（业务、开发、运营一体化）工作体系，自主建成数字化技术平台、云原生智能研运一体化平台，打造敏捷高效的新一代自主研发模式，提升金融科技交付能力。在数据治理和数据安全领域，公司积极探索数据治理与业务管理、技术实践的深入应用，在数据标准、数据质量、数据安全等方面进行融合打通，构建数据治理生态化体系，切实保障公司和客户数据的安全、合规、可靠。

在网络信息安全领域，公司多年来以“安全第一，预防为主，管理与技术并重，综合防范”为安全运行的总体方针，建立了完善的管理保障体系和技术保障体系，实现了运行管理的“全流程、全过程、全覆盖”管控，确保信息系统的可控、能控和在控。

2022 年，公司《基于 riskAPI 的企业级智能化信用风险管理平台项目》和《“擎天”证券数字化技术平台项目》荣获中国人民银行与中国证监会联合举办的 2021 年度金融科技发展奖三等奖；《基于分布式低时延架构的证券交易智能监控平台》获得第八届证券期货科学技术奖三等奖；荣获 2022 年 DAMA 中国数据管理峰会的数据治理最佳实践奖，入选大数据技术标准推进委员会组织的“2022 星河大赛”数据安全标杆案例，并作为唯一一家证券基金经营机构获得了工业和信息化部主办的首届数据安全大赛三等奖。

#### （五）稳健经营的理念

公司自成立以来，始终秉持审慎经营理念，坚持依法合规运作。公司建立了科学、稳健的经营决策体系，重大事项决策均采用集体决策机制。公司成立了资产负债委员会、风险控制委员会、金融科技委员会等专业委员会，由董事长或经营管理层担任委员会主任，由业务部门负责人、合规风控等相关人员担任成员。公司针对各重要业务线设置了相应的业务管理委员会，如投资银行委员会、资产管理委员会、财富管理委员会等。公司坚持风险可控下追求合理收益的风险管理理念，贯彻全面性、有效性、制衡性的基本原则。在长期的业务发展中，公司建立健全了包括组织体系、授权体系、制度体系、防火墙体系、技术防范体系、监控体系、监督与评价体系在内的内部控制体系。公司建立多层次的内部控制机构，内控制度覆盖各项业务的日常运行，对违规行为实行严格问责。公司对流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等实施精准管理，在风险可测、可控和可承受的范围内稳健开展各项业务。公司完善风险导向的内部审计体系，把风险、合规管理制度建设及实施情况纳入大内控体系监督评价范畴，构建了合规、风控、法务、稽核等高效协同的联合监督机制，形成了稳健经营、守法合规的国信特色。公司首批入选中国证监会“白名单”证券公司。

## 四、主营业务分析

### (一) 概述

公司通过总部下设机构以及下属分公司、营业部从事财富管理与机构、投资银行、投资与交易、资产管理等业务；通过全资子公司国信弘盛、国信期货、国信资本、国信香港分别开展私募基金管理、期货、另类投资和境外金融服务等业务。2022年度，公司实现营业收入158.76亿元，同比下降33.35%；实现归属于上市公司股东的净利润60.88亿元，同比下降39.81%。

### (二) 收入与成本

#### 1. 营业总收入构成

##### ◆ 按会计科目分类

单位：万元

项目	2022年度		2021年度		同比增减幅度
	金额	占营业总收入比重	金额	占营业总收入比重	
手续费及佣金净收入	757,725.96	47.73%	1,003,287.16	42.12%	-24.48%
投资收益	727,220.82	45.81%	743,613.12	31.22%	-2.20%
其他业务收入	211,693.31	13.33%	217,219.64	9.12%	-2.54%
利息净收入	182,962.68	11.52%	241,062.39	10.12%	-24.10%
公允价值变动收益(损失)	-297,073.40	-18.71%	174,044.02	7.31%	-270.69%
其他收益	4,494.98	0.28%	2,667.24	0.11%	68.53%
汇兑损失	342.63	0.02%	-63.79	0.00%	不适用
资产处置收益	209.84	0.01%	-26.08	0.00%	不适用
营业总收入合计	1,587,576.83	100.00%	2,381,803.70	100.00%	-33.35%

2022年公司营业总收入同比减少79.42亿元，降幅为33.35%，主要是：

- (1) 手续费及佣金净收入75.77亿元，同比减少24.56亿元和24.48%，主要是财富管理与机构业务手续费净收入减少；
- (2) 公允价值变动收益-29.71亿元，同比减少47.11亿元和270.69%，主要是证券市场波动导致金融资产公允价值减少。

◆ 按业务类型分类

单位：万元

项目	2022 年度		2021 年度		同比增减
	收入金额	占营业总收入比重	收入金额	占营业总收入比重	
财富管理与机构业务	830,034.89	52.28%	1,076,907.00	45.21%	-22.92%
投资银行业务	188,185.57	11.85%	206,637.69	8.68%	-8.93%
投资与交易业务	274,673.40	17.30%	741,591.95	31.14%	-62.96%
资产管理业务	36,543.68	2.30%	54,169.74	2.27%	-32.54%
其他业务	258,139.28	16.27%	302,497.31	12.70%	-14.66%
合计	1,587,576.83	100.00%	2,381,803.70	100.00%	-33.35%

(1) 财富管理与机构业务

公司财富管理与机构业务主要包括：为个人和机构客户提供全价值链财富管理服务，包括证券、期货、期权经纪，推广和销售证券及金融产品，提供投资咨询、资产配置、资产托管等服务；提供融资融券、股票质押式回购、约定购回、行权融资等资本中介服务。报告期内，财富管理与机构业务实现营业收入 83.00 亿元，同比下降 22.92%。

① 证券类零售业务

市场环境

2022 年，市场呈现出高波动与多反转的特点，同时受国际局势、汇率等影响，海外机构入市谨慎。A 股市场主要指数震荡下行，日均股基成交额下降 10%。随着资本市场全面深化改革的持续推进、金融科技对证券行业的加速渗透，财富管理市场竞争日趋激烈。

经营举措及业绩

公司秉持“以客户为中心”的发展理念，不断打造专业化、差异化、高品质的综合服务体系，全力推进全价值链财富管理转型。一是通过互联网渠道引流和集约化管理运营，提升互联网金融发展速度，线上营销服务水平显著提高。截至 2022 年末，公司经纪客户数量超过 1,400 万，托管资产超过 2.1 万亿元。金太阳手机证券用户总数突破 2,000 万，微信公众号用户数超过 280 万。二是大力推进高净值客户服务深化扩面，着重打造“国信鑫私享”等高端财富管理品牌，客户结构实现进一步优化。三是代销和自有产品体系持续完善，丰富的基金投顾策略覆盖多元化理财场景，满足投资者多样化需求，投顾规模稳步增长；首批获得个人养老金基金销售业务资格，银行合作有序推进，资产配置能力不断提升。

2023 年展望

公司将秉承高质量发展理念，持续优化财富管理服务。通过互联网获客裂变与客户成长运营，提升互联网引流客户规模和占比，提高线上营销服务效能；加大中高净值客户开发服务力度，扩大客户交易资产规模和市场占有率；不断增强“国信鑫投顾”“国信鑫智投”“国信鑫优选”“国信鑫私享”等品牌影响力，提升客户覆盖率；不断丰富产品种类，提高产品质量，扩大产品保有规模。

## ② 证券类机构业务

### 市场环境

近年来，随着资本市场深化改革推进，市场投资者结构不断优化，A股机构化交易占比逐步提升。公私募、保险等各类机构投资者规模持续扩大，进一步提升市场活跃度，对包含交易、研究、代销、衍生品等在内的证券类综合服务需求不断提升，对券商机构业务专业能力、内部协同也提出更高要求。

### 经营举措及业绩

公司机构业务为客户提供跨业务、全周期服务，不断夯实财富管理服务能力。2022年，公司强化整体统筹，加强总部赋能，推动机构业务协同的流程化、制度化和数字化。深化拓展各类机构合作，通过高层互访等方式，重点推动与公私募管理人、银行及理财子公司、保险资管等客户合作，代销产品数量和质量不断提升，银行理财子公司产品托管规模及交易佣金快速提高，年金业务取得突破。公司应用多项金融科技前沿技术，围绕客户需求迭代GTrade+私募机构综合服务品牌和“企明星”上市公司综合服务品牌，机构综合服务水平进一步提升。着重加强策略会、专家交流会、调研等机构客户营销活动策划及开展，保持线上线下机构投研交流热度，多维度满足客户投研需求，吸引新客户建立业务合作。通过与研究、投行、直投、两融、托管等业务条线的协同配合，客户群体及收入来源进一步多元化。此外，公司紧抓海外机构对中国资本市场关注度持续提升的机遇，深挖重量级客户需求，与海外机构客户建立多方位合作。

### 2023年展望

公司将充分整合内部资源，持续完善产品线布局，重点加强机构销售服务的多样性和精准性，提升机构客户综合服务层级、服务专业度和客户满意度。同时，持续加大金融科技投入，提升投研服务能力，有机结合机构客户需求并提供个性化服务方案，全力打造高净值与机构客户服务生态圈。

## ③ 研究业务

公司经济研究所以“深度研究，创造价值”为核心理念，以专业研究为基础，以客户需求为导向，通过对国内外宏观经济、市场政策、产业政策，以及行业、上市公司等进行深入研究，对外服务公募、社保、保险、私募、银行理财子公司、资产管理公司及其他专业投资机构，对内为公司各项业务提供研究支持，通过专业研究实现业务赋能。2022年，公司经济研究所坚定提升研究的广度与深度，坚持价值研究，深耕产业研究，为客户提供多方位专业服务，研究影响力实现稳步提升。同时研究所积极发挥研究能力优势，紧紧围绕国家战略部署，参与相关领域产业研究、举办投研活动，全方位、多途径满足各级政府、企业的研究支持需求。公司持续深耕研究业务数字化转型，积极推动研究方式、客户服务和管理模式智能化解决方案落地，研究工作的质量与效率得到有效提升。

公司经济研究所将继续坚持四个面向，即面向世界科技前沿、面向国家战略、面向“双区”建设、面向公司业务发展，聚焦高质量发展，继续秉持“深度研究，创造价值”的核心理念，紧密跟踪国内外产业演进趋势，形成有影响力的研究成果，全面提升研究业务市场影响力。

## ④ 资本中介业务

### 市场环境

2022年，市场交投和客户融资需求下滑，市场年末融资融券余额为15,404亿元，较2021年末下降15.9%。股票质押式回购业务规模持续下降，存量风险得到进一步化解。

### 经营举措及业绩

在融资融券方面，公司通过管理模式调整、零售与机构双线拓展、夯实券源供需基础、强化总分专业联动等举措，推动业务转型升级，提升客户体验和运营效率。同时，公司持续完善融资融券风险管控，推动担保物等精细化管理。2022年末，公司融资融券客户数同比增长6.1%，连续两年超过全市场增幅；融资融券业务规模为538.9亿元，市场份额连续两年实现增长；融资融券利息收入排名行业第九。在股票质押式回购方面，公司在以流动性为核心的授信模型下，增加赋强公证等风险管控手段，强化资产安全保障。2022年末，公司自有资金出资的股票质押式回购业务规模为56.6亿元，较2021年末增长8%。

公司财富管理加速转型发展，行权融资、约定购回服务水平不断提升，多项业务守正创新。2022年，公司推出行权融资（含税）业务，为上市公司激励对象提供更多元化融资增值服务；完成公司首单QFII融资融券授信，开启公司融资融券境外服务模式；成为业内首批开通北交所融资融券交易单元及权限的券商，并率先推出线上权限开通业务。

### 2023年展望

公司将继续深耕财富管理领域，提供个性化、多样化的融资、融券服务，全面赋能资本中介业务；持续提升精细化管理水平，开展创新研究，加快数字化转型，推动资本中介业务高质量发展。

## ⑤ 期货类经纪业务

### 市场环境

2022年，全球经济增速放缓，海外通胀高位运行，期货市场运行平稳，成交量较上年有所回落。根据中国期货业协会公布数据，按照单边计算，2022年国内期货市场全年成交67.68亿手和534.93万亿元，分别同比下降9.93%、7.96%；150家期货公司净利润同比下降19.82%。

### 经营举措及业绩

报告期内，子公司国信期货多措并举，积蓄发展新动能。一是持续夯实经纪业务，着力产业客户及金融机构客户的开发与维护，并大力推动高频量化业务的发展。2022年，公司期货经纪业务成交量及成交额相较行业实现逆势增长，同比分别上升7.44%、5.49%。二是积极开展创新业务，资产管理及风险管理业务均保持了良好的发展势头。

### 2023年展望

国信期货将聚焦衍生品市场业务，以经纪业务为主体，以风险管理服务和资产管理服务为两大抓手，强化“一体两翼”体系建设，围绕三大客群，不断提升服务质量。通过开拓获客渠道、完善网点布局、优化信息系统建设等措施，推动经纪业务再上新台阶；立足自身、做好定位、培育特色，着力拓展资产管理及风险管理业务，提升期货业务综合服务能力。

## ⑥ 资产托管业务

伴随市场行情下跌、行业同质化竞争日渐激烈、托管费率不断降低，公司托管业务规模及收入出现下降，但运营效率不断优化，服务能力持续提升。公司建立客户分类分级服务模式，通过线下及线上专业客户服务团队，高效响应客户需求；建立数据分析和通报的常态化机制，为持续优化客户服务策略提供数据支持；构建“知识输出、关怀、生态赋能”三位一体的客户营销支持体系，拓展业务生态价值；完善客户需求收集、管理、评审、跟进、回访的闭环管理机制，全力提高服务质量和效率。公司将实施客户全生命周期精细化管理，创新运用大数据、人工智能、机器人自动化等前沿科技手段，推进系统升级建设，重塑流程机制，以科技赋能推动托管运营不断进化，满足客户多样化需求。

## (2) 投资银行

公司投资银行业务主要是向企业客户提供金融服务，主要包括股票承销保荐、债券承销、并购重组财务顾问和新三板挂牌推荐等业务。报告期内，公司投资银行业务实现营业收入 18.82 亿元，同比下降 8.93%。

### ① 股票承销保荐业务

#### 市场环境

2022 年，随着北交所设立和股票发行注册制改革加速推进，已形成从科创板到创业板、再到全市场的注册制改革布局。截至 2022 年底，根据 Wind 统计数据，沪深 A 股市场年内共发行股票项目 903 个，同比下降 20.02%，募集资金 14,686 亿元，同比下降 6.83%。其中，市场发行 IPO 项目 428 个，同比下降 18.32%，IPO 募集资金 5,870 亿元，同比增长 7.34%；发行股权再融资项目 475 个，同比下降 21.49%，募集资金 8,817 亿元，同比下降 14.35%。

#### 经营举措及业绩

2022 年，公司不断提升保荐承销服务能力，夯实传统优势业务市场地位。报告期内，公司完成股票承销项目 28.75 个，市场份额 3.18%，行业排名第 8；募集资金 295.92 亿元，市场份额 2.01%，行业排名第 10。其中，完成 IPO 项目 14.5 家，行业排名第 10；完成再融资项目 14.25 个，行业排名第 9。公司完成的贝泰妮 IPO 项目，为中国化妆品行业市值第一，并荣获第十五届新财富“年度最佳 IPO 项目”奖项。同时，公司聚焦“双区”建设和大湾区发展，持续提升专项服务团队服务水平，积极推进国资国企协同发展。报告期内，公司在大湾区完成主承销项目 10 家，募集资金 70.42 亿元，其中 IPO 项目 7 家，募集资金 53.37 亿元，完成 IPO 项目家数居于深圳地区券商首位。公司与多家深圳国企建立业务合作关系，积极提供股权融资、财务顾问等资本运作服务。公司荣获第十五届新财富“本土最佳投行”“最佳 IPO 投行”等多个奖项。

报告期内，公司股票承销保荐业务的具体情况如下：

类别	2022 年度		2021 年度	
	主承销金额 (亿元)	承销家数	主承销金额 (亿元)	承销家数
首次公开发行	139.65	14.5	134.88	16.5
再融资发行	156.27	14.25	304.48	21
合计	295.92	28.75	439.36	37.5

注：联合主承销家数及金额以 1/N 计算

#### 2023 年展望

公司将进一步做好服务实体经济发展工作，大力支持科技创新，打造“积极稳健型投行”。紧抓注册制全面实施、深圳市“双区”建设的机遇，进一步提高公司研究、价值发现、质量控制、客户服务、直投等综合能力，切实提升项目质量，加强定价、估值和销售能力的培养，加强平台资源的整合，拓深服务企业客户或投资的深度与广度，以专业能力为客户提供一体化、全生命周期的金融服务。着力构建“投行+”生态体系，发挥投行业务企业客户流量入口的作用，带动公司各业务条线在展业、管理、科技赋能上的全面发展。

## ② 债券承销业务

### 市场环境

2022年，在国际经济高通胀、快紧缩态势持续强化背景下，国内经济企稳回升，稳经济各项政策进一步落地见效，金融体系流动性充足。但受市场融资需求低迷、城投债发行审核趋严叠加房企债券融资尚未回暖等因素影响，债券市场整体呈收缩态势。

### 经营举措及业绩

面对复杂的市场情况，公司精准把握市场动向，及时向发行人传递市场信息，在业务创新等方面取得较好成绩。一是公司充分发挥区位优势及专业优势，继续加强与深圳企业全方位、多品种紧密合作，以业务发展助推“双区”建设。2022年，公司为深圳地区企业发行债券80只、规模合计960亿元，承销深圳市属区属国企债券规模保持市场前列，客户群体实现各级国企全覆盖，多只创市场首单、可比债券最低利率。其中，“22深安02”系全市场首单“保障性租赁住房”主体标识公司债券；“22深新01”系全市场首单“专精特新”公司债券。二是积极开展公募REITs业务，品牌影响力稳步提升。截至2022年末，公司以上市公募REITs财务顾问角色参与的项目数量排名行业第二。其中，“鹏华深圳能源REIT”为国内能源行业首支公募REITs产品；“红土深圳安居REIT”成功开创了保障性租赁住房发行公募REITs先河。三是坚持创新金融产品支持实体经济，持续加大绿色债、科创债业务开拓。2022年，公司成功发行17只绿色债券及清洁能源行业公募REITs，规模约480亿元；科技创新债4只，规模约40亿元。其中，“国家电投-吉电股份清洁能源绿色碳中和资产支持专项计划（类REITs）”为交易所上市公司首单风电、光伏绿色碳中和权益融资类REITs。四是深度挖掘优质资产，持续推动ABS业务多元发展，稳步推进金融债业务开拓。报告期内，公司债券承销情况具体如下：

类别	2022年度		2021年度	
	主承销金额 (亿元)	承销家数	主承销金额 (亿元)	承销家数
公司债	628.13	71.69	1,313.55	126.97
债务融资工具	521.73	79.17	509.32	83.50
资产支持证券	187.70	26.83	320.88	57.73
企业债	153.69	16.89	308.47	37.13
金融债	695.48	23.44	232.11	15.81
合计	2,186.73	218.02	2,684.33	321.14

注：联合主承销家数及金额以1/N计算

### 2023年展望

公司将充分利用区位优势、专业优势，不断增强债券融资创新力度，逐步形成差异化竞争优势。同时，加快业务布局调整，加大产业企业服务力度，全力聚焦科技创新、绿色低碳、乡村振兴等国家战略支持领域，奋力开创高质量发展新局面。

## ③ 并购重组业务

2022年，并购重组市场总体持续低迷，并购交易数量、金额继续下降。坚守主业发展、回归并购本源已成为市场共识，基于产业逻辑的上市公司收购成为主流。2022年，中国证监会并购重组委共审核了40单并购重组项目，其中，无条件通

过 27 家，有条件通过 19 家，未通过 4 家，整体通过率为 90%。此外，还有 5 家公司撤回材料，终止并购重组审核。公司抓住注册制改革发展机遇，继续夯实并购重组业务基础，做好重点客户维护，积极拓展项目储备，妥善处置和防范业务风险。公司将进一步拓展 TMT、高端装备制造、医药、新材料等行业优质标的储备，加大并购撮合力度，同时防控业务风险。

#### ④ 北交所与新三板业务

##### 市场环境

截至 2022 年底，北交所上市公司共 162 家，全年新增上市公司 83 家，其中战略性新兴产业、先进制造业、现代服务业等占比 84%，上市公司经营业绩突出、创新能力较强；新三板挂牌公司 6,580 家，其中创新层公司 1,658 家，一部分企业符合北交所上市财务条件，市场服务创新型中小企业的聚集效应初步形成，服务创新驱动发展、经济转型升级等国家战略的功能更加凸显。

##### 经营举措及业绩

公司坚持做好新三板客户的服务、增值及创新业务的拓展，同时注重防范和化解风险；积极备战北交所企业公开发行与承销业务，服务北交所和新三板深化改革。公司累计保荐 2 家企业登陆北交所，其中贝特瑞市值约占北交所总市值 14.36%（截至 2022 年 12 月 31 日），居市场首位。截至 2022 年底，公司持续督导新三板项目 76 个，年内完成新三板挂牌项目 5 个，定增项目 2 个，合计募集资金 3.64 亿元。

##### 2023 年展望

公司将继续把握北交所和新三板改革机遇，做好项目开发、储备和推荐，积极推动北交所项目申报；持续提升服务水平，促进中小企业和民营经济创新发展；加强对新三板企业的持续督导，大力开拓新的融资项目。

#### ⑤ 境外投行业务

报告期内，子公司国信香港以联席全球协调人、联席账簿管理人、财务顾问、融资安排人等角色总共完成了 32 个境外资本市场项目，其中包括香港上市、上市公司顾问及美元债发行等多类型项目，项目数量较上年增长明显。报告期内，国信香港完成的自贸区离岸债券承销金额位列在港中资券商第 3 位。国信香港将进一步加强与深圳国资国企的协同联动，不断优化业务布局，为推动深港一体化发展贡献力量。

#### (3) 投资与交易

公司的投资与交易业务主要是从事权益类、固定收益类、衍生类产品、其他金融产品的交易和做市业务、私募股权及另类投资业务等。报告期内，公司投资与交易业务共实现营业收入 27.47 亿元，同比下降 62.96%。

##### ① 权益类投资业务

2022 年，受政策环境、美国通胀等多重因素影响，权益市场剧烈波动。公司权益投资业务顶住市场压力，实施以资产配置和多策略组合为支柱的投资模式，坚持以风险控制体系为底线，通过红利投资策略、定增投资策略、价值成长投资策略、公私募基金组合投资策略、衍生品套利策略等多种投资策略有效分散了投资风险，丰富了收益来源，降低了组合波动。

## ② 固定收益类投资业务

2022年，除美元指数和原油上涨外，全球主要资产普跌，国内债券市场和商品期货宽幅震荡，房地产行业遭遇前所未有的困境。在降息等因素作用下，国内债券市场前三季度一路向好，至11月份出现年内最大幅度调整，并创下2020年债券熊市以来最快的调整速度。报告期内，公司通过丰富投资策略、增加资产种类、完善交易体系，着力推进中性、低风险业务发展，增强应对市场不利因素的固定收益投资能力。

## ③ 衍生类产品投资业务

公司以场外衍生品业务为抓手，积极发展客需驱动的交易业务，提升中性业务收入占比。2022年，公司场外衍生品业务规模增长较快，业务规模迅速扩大，名义规模同比增速超过1,000%；及时推出多空类型收益互换交易业务，并根据交易对手方需求，推出多种结构、挂钩标的、期限的衍生品交易，满足机构投资者风险管理等需要。公司积极构建包含期权与互换在内的固收类场外衍生品业务体系，力求为客户提供更为丰富的风险管理工具和定制化的衍生品风险管理方案。报告期内，公司成功达成挂钩“中债十年期国债到期收益率”的区间累积式期权交易、挂钩利率债的收益互换交易，进一步提升面向机构客户的综合金融服务能力。公司着力打造以交易与风控为核心的场外衍生品一体化业务平台，提高衍生品交易能力、全面风险管理能力以及数字化运营能力，为业务高质量发展蓄能。

## ④ 另类投资业务

面对多重超预期因素冲击，国内股权投资市场投资热度降低，子公司国信资本积极把握市场机会，投资业务规模逆势增长。2022年，国信资本完成项目投资24个，投资金额14.18亿元，实现6个投资项目的首发上市。在大湾区完成项目投资14个，投资金额10.08亿元，其中完成深圳地区项目投资6个，投资金额4.64亿元。积极响应国家战略性新兴产业发展规划，认真贯彻落实金融服务实体经济的方针，所投项目涵盖生物医药、新一代信息技术、高端智能制造等领域；坚守服务“双区”实体经济的本源初心，在服务深圳“20+8”规划产业集群的道路上笃实前行。同时，国信资本积极开展ESG投资工作，投资宜宾锂宝锂电池正极材料项目、广汽新能源综合项目等，以实际行动推动绿色金融发展。

### (4) 资产管理

公司资产管理业务主要是根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，集合、单一、专项资产管理业务及私募股权基金管理业务等。报告期内，公司资产管理业务实现收入3.65亿元，同比下降32.54%。

#### ① 券商资产管理业务

##### 市场环境

2022年，受到需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力影响，券商资管整体规模和收入出现“双降”，分别较上年下滑约10%和15%。固定收益市场在年末受到银行理财赎回冲击，债券价格出现下跌；权益市场估值持续处于低位，行业大部分主流基金净值出现了明显回撤。但另一方面，随着中国经济迈向高质量发展阶段，资管行业正加速向主动管理转型，投研能力成为资管机构应对全新市场环境、打造核心竞争优势、实现健康长远发展的关键因素。

##### 经营举措及业绩

2022年，公司积极把握资管行业高质量发展的机会，有效应对市场波动，推动券商资管业务逆势增长。一是进一步丰富投研策略和产品种类，在保持固收类产品优势的基础上，权益、FOF产品也取得了突破，重点产品规模较上年末大幅增长。

二是圆满完成大集合公募化改造工作,以公募化大集合为抓手,助力投资者实现资产保值增值,践行普惠金融,推动共同富裕。三是全面加强市场拓展力度,与主流商业银行和互联网代销平台建立合作关系,公司资管产品的销售渠道和客户覆盖面进一步扩大。四是积极融入公司财富管理转型,不断强化资管与经纪、投行、机构等业务的协同,提升综合金融服务能力。

报告期内,公司资产管理业务结构持续优化,创收能力和业务质量显著提升。截至报告期末,公司集合、单一、专项等资产管理业务净值规模 1,352.30 亿元,业务规模较 2021 年末下降 8.41%,实现收入 3.21 亿元,同比上升 32.33%。业务规模情况具体如下:

单位:亿元

类型	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日	较上年末增减
集合资产管理业务	671.00	795.20	-15.62%
单一资产管理业务	360.85	379.16	-4.83%
专项资产管理业务	320.45	302.15	6.06%
合计	1,352.30	1,476.51	-8.41%

## 2023 年展望

随着中国经济稳步复苏,中国式现代化进程全面推进,居民资产管理需求持续增长,资产管理行业有望迎来黄金发展期。但与此同时,银行理财子公司、券商资管子公司纷纷成立,公募和私募基金数量不断增长,国际资管机构加速布局中国市场,资产管理行业的竞争也明显加剧。面对复杂的市场环境,公司资产管理业务将继续坚持“立足长远、聚焦投研”的战略方向,不断优化投研体系,坚持以客户为中心,加快推动资管子公司设立,全面强化业务协同,努力服务国家重大战略,全力实现高质量发展。

### ② 私募股权基金管理业务

2022 年,我国私募股权投资市场呈现“募资难、投资冷”的整体特征,全年募资规模、投资金额同比下降 5% 和 23%。市场投资活跃度相对不足,募资结构两极化趋势显著,但市场多元化退出渠道持续拓宽。受市场环境影响,公司私募股权基金管理业务收入同比下降明显。报告期内,子公司国信弘盛圆满完成私募股权基金“双整改”工作,稳步推进新基金平台创设、项目投资及退出管理,以“专业投资”为方向,持续打造符合行业未来发展趋势的投研策略体系;深度参与深圳市“20+8”产业集群中的智能传感器、新材料、海洋产业等主题基金创设,全面强化对实体经济的支持力度和对战略性新兴产业的投资布局,为后续业务发展储备了丰富的业务资源。

### (5) 其他业务

公司的其他业务主要是通过联营企业鹏华基金从事基金管理业务。鹏华基金始终坚持长期投资和价值投资的理念,2022 年紧抓市场机遇,取得突出业绩,主要表现在:一是基金规模持续提升。截至 2022 年末,鹏华基金资产管理规模(不含子公司)达 11,141 亿元,同比增长 848 亿元,同比增长 8%。其中,公募规模为 8,483 亿元,同比增长 778 亿元,增幅 10%,稳居行业第一梯队。二是服务国家战略和资本市场改革发展。2022 年鹏华基金发行了全市场首只能源行业 REIT——鹏华深圳能源 REIT;入围首批个人养老金投资基金名录,4 只产品均增设 Y 份额,满足民众个人养老投资的多样化需求;成功中标养老基金战略新兴组合和养老基金可持续投资组合,服务国家养老保障大局。三是投资业绩表现出色。截至 2022 年末,鹏华基金三年和五年平均股票投资主动管理净值增长率分别为 43.1% 和 68.8%,三年和五年平均债券投资主动管理净值增长率分别为 9.6% 和 25.2%,投资业绩获得市场认可。

## 2. 已签订的重大销售合同、重大采购合同情况

不适用。

## 3. 营业成本构成

单位：万元

项目	2022 年度		2021 年度		同比增减幅度
	金额	占营业成本比重	金额	占营业成本比重	
业务及管理费	731,744.07	74.82%	973,246.42	84.45%	-24.81%
税金及附加	12,558.12	1.28%	14,335.40	1.24%	-12.40%
其他业务成本	208,462.45	21.31%	216,968.20	18.83%	-3.92%
信用减值损失	25,084.54	2.56%	-52,145.06	-4.52%	不适用
其他资产减值损失	219.11	0.02%	9.63	0.00%	2,176.17%
合计	978,068.29	100.00%	1,152,414.58	100.00%	-15.13%

2022 年公司营业支出同比减少 17.43 亿元，降幅 15.13%，主要是：

- (1) 业务及管理费 73.17 亿元，同比减少 24.15 亿元和 24.81%，主要是职工薪酬减少；
- (2) 信用资产减值损失 2.51 亿元，同比增加 7.72 亿元，主要是融资业务及其他债权投资信用减值损失增加。

## 4. 报告期内合并范围是否发生变动

具体请参见第六节“七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明”。

## 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

不适用。

### (三) 费用

单位：万元

项目	2022 年度	2021 年度	同比增减幅度	重大变动说明
业务及管理费	731,744.07	973,246.42	-24.81%	主要是职工薪酬减少。

### (四) 研发投入

不适用。

## (五) 现金流

单位：万元

项目	2022 年度	2021 年度	同比增减幅度
经营活动现金流入小计	4,445,550.82	7,110,709.15	-37.48%
经营活动现金流出小计	5,179,702.46	7,782,247.93	-33.44%
经营活动产生的现金流量净额	-734,151.63	-671,538.78	不适用
投资活动现金流入小计	64,235.60	114,704.81	-44.00%
投资活动现金流出小计	65,510.22	73,986.93	-11.46%
投资活动产生的现金流量净额	-1,274.62	40,717.88	-103.13%
筹资活动现金流入小计	7,285,181.99	11,736,403.98	-37.93%
筹资活动现金流出小计	7,100,619.53	10,316,184.49	-31.17%
筹资活动产生的现金流量净额	184,562.46	1,420,219.49	-87.00%
现金及现金等价物净增加额	-525,682.89	783,222.77	-167.12%

### 1. 相关数据同比发生重大变动的主要影响因素说明

报告期内，公司（合并）现金流量净额为 -52.57 亿元。各项现金流量中，经营活动的现金流量净额为 -73.42 亿元，其中：现金流入 444.56 亿元，主要是收取利息、手续费及佣金的现金 159.92 亿元、融出资金净减少额 93.67 亿元、回购业务资金净增加额 85.11 亿元、拆入资金净增加额 45.55 亿元、为交易目的而持有的金融资产净减少额 29.72 亿元；现金流出 517.97 亿元，主要是其他债权投资净增加额 207.42 亿元、代理买卖证券支付的现金净额 80.16 亿元、支付给职工以及为职工支付的现金 60.33 亿元、支付利息、手续费及佣金的现金 44.61 亿元、其他权益工具投资净增加额 29.98 亿元、支付的各项税费 20.29 亿元。投资活动的现金流量净额为 -0.13 亿元，其中：投资活动现金流入 6.42 亿元，主要是取得投资收益所收到的现金 5.96 亿元、收回投资所收到的现金 1.09 亿元；投资活动现金流出 6.55 亿元，主要是购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金 5.96 亿元、投资所支付的现金 0.59 亿元。筹资活动产生的现金流量净额为 18.46 亿元，其中：筹资活动现金流入 728.52 亿元，主要是发行债券收到的现金 623.27 亿元、吸收投资所收到的现金 100.00 亿元；筹资活动现金流出 710.06 亿元，主要是偿还债务所支付的现金 626.52 亿元、分配股利、利润或偿付利息所支付的现金 80.92 亿元。

### 2. 报告期内公司经营活动产生的现金净流量与本年度净利润存在重大差异的原因说明

2022 年公司实现净利润 60.85 亿元，与本年经营活动产生的现金流量净额有差异，主要是自营业务投资规模增加、回购业务资金净增加额、代理买卖证券支付的现金净额、融出资金净减少额、拆入资金净增加额等影响。

## 五、主营业务构成情况

### (一) 主营业务分业务情况

单位：万元

业务类别	营业总收入	营业支出	营业利润率	营业总收入 同比增减幅度	营业支出 同比增减幅度	营业利润率 比上年增减
财富管理与机构业务	830,034.89	441,267.68	46.84%	-22.92%	1.17%	-12.66%
投资银行业务	188,185.57	123,165.98	34.55%	-8.93%	-7.55%	-0.98%
投资与交易业务	274,673.40	77,442.32	71.81%	-62.96%	-4.57%	-17.25%
资产管理业务	36,543.68	18,053.33	50.60%	-32.54%	-28.26%	-2.94%
其他业务	258,139.28	318,138.97	不适用	-14.66%	-33.26%	不适用
合计	1,587,576.83	978,068.29	38.39%	-33.35%	-15.13%	-13.23%

报告期内，公司主营业务数据统计口径未发生调整。

### (二) 主营业务分地区情况

#### 1. 营业总收入地区分部情况

单位：万元

地区	2022 年度		2021 年度		营业总收入 同比增减幅度
	营业网点数量	营业总收入	营业网点数量	营业总收入	
广东	71	217,188.33	70	288,502.93	-24.72%
浙江	31	55,235.66	30	68,657.79	-19.55%
北京	13	44,116.05	13	57,503.64	-23.28%
上海	12	39,456.56	12	52,695.11	-25.12%
四川	16	22,115.30	15	25,905.00	-14.63%
福建	11	15,333.07	11	19,832.72	-22.69%
湖北	6	14,811.79	6	20,180.19	-26.60%
江苏	14	14,016.54	14	18,925.71	-25.94%
陕西	9	11,878.17	9	16,119.81	-26.31%
山东	11	10,154.63	10	13,677.15	-25.75%
湖南	7	7,280.05	7	10,426.20	-30.18%
天津	4	5,995.34	4	7,649.00	-21.62%
辽宁	7	5,290.20	8	7,495.58	-29.42%
云南	4	4,986.29	4	6,802.28	-26.70%

地区	2022 年度		2021 年度		营业总收入 同比增减幅度
	营业网点数量	营业总收入	营业网点数量	营业总收入	
河南	7	4,465.53	7	5,911.38	-24.46%
安徽	5	3,965.87	5	5,428.91	-26.95%
山西	5	3,297.38	5	4,191.71	-21.34%
重庆	5	2,886.72	4	3,515.18	-17.88%
江西	4	2,524.37	4	3,361.60	-24.91%
黑龙江	4	2,514.13	5	3,438.32	-26.88%
海南	3	2,319.82	3	3,230.92	-28.20%
吉林	3	1,904.60	3	2,461.44	-22.62%
广西	3	1,414.63	3	2,035.08	-30.49%
河北	2	1,248.28	2	1,552.21	-19.58%
内蒙古	1	1,203.66	1	1,493.20	-19.39%
贵州	2	845.51	2	1,369.03	-38.24%
宁夏	1	806.63	2	1,068.05	-24.48%
甘肃	1	801.61	1	1,166.48	-31.28%
新疆	1	646.80	2	960.80	-32.68%
公司总部及境 内子公司	-	1,073,108.92	-	1,708,167.56	-37.18%
境外小计	-	15,764.40	-	18,078.75	-12.80%
合计	263	1,587,576.83	262	2,381,803.70	-33.35%

注：营业网点数量包括公司证券及期货营业网点。

## 2. 营业利润地区分部情况

单位：万元

地区	2022 年度		2021 年度		营业利润 同比增减幅度
	营业网点数量	营业利润	营业网点数量	营业利润	
广东	71	91,830.23	70	146,465.38	-37.30%
北京	13	20,012.83	13	29,846.14	-32.95%
浙江	31	19,576.06	30	31,859.28	-38.55%
上海	12	19,044.13	12	25,616.30	-25.66%
湖北	6	5,902.02	6	8,702.83	-32.18%
陕西	9	4,734.42	9	7,249.70	-34.69%
江苏	14	3,270.53	14	7,483.60	-56.30%
福建	11	3,052.97	11	6,939.85	-56.01%

地区	2022 年度		2021 年度		营业利润 同比增减幅度
	营业网点数量	营业利润	营业网点数量	营业利润	
云南	4	2,445.29	4	3,475.03	-29.63%
四川	16	2,424.71	15	8,399.62	-71.13%
湖南	7	1,835.96	7	4,179.92	-56.08%
山东	11	1,525.28	10	2,553.25	-40.26%
安徽	5	949.49	5	1,776.40	-46.55%
河南	7	926.12	7	2,322.41	-60.12%
辽宁	7	882.56	8	2,007.07	-56.03%
天津	4	849.80	4	1,944.40	-56.30%
山西	5	740.40	5	1,117.21	-33.73%
海南	3	357.99	3	554.04	-35.39%
江西	4	353.55	4	772.90	-54.26%
黑龙江	4	167.26	5	746.48	-77.59%
吉林	3	154.62	3	264.58	-41.56%
内蒙古	1	82.63	1	2.82	2833.33%
重庆	5	-81.99	4	71.05	-215.40%
甘肃	1	-85.82	1	59.81	-243.48%
河北	2	-98.35	2	222.08	-144.29%
宁夏	1	-111.73	2	55.34	-301.90%
新疆	1	-119.23	2	-131.14	不适用
广西	3	-213.73	3	-95.14	不适用
贵州	2	-498.80	2	-273.59	不适用
公司总部及境内子公司	-	429,428.13	-	933,914.69	-54.02%
境外小计	-	171.20	-	1,286.82	-86.70%
合计	263	609,508.54	262	1,229,389.12	-50.42%

注：营业网点数量包括公司证券及期货营业网点。

## 六、非主要经营业务情况

不适用。

## 七、资产及负债状况分析

### (一) 资产及负债构成重大变动情况

单位：万元

项目	2022 年末		2022 年初		占比增减 (百分点)
	金额	占总资产比例	金额	占总资产比例	
<b>资产：</b>					
货币资金	6,497,782.63	16.48%	6,772,174.10	18.69%	-2.21
结算备付金	1,573,479.93	3.99%	1,708,782.40	4.72%	-0.73
交易性金融资产	15,947,257.32	40.44%	15,231,212.33	42.04%	-1.60
债权投资	6,926.62	0.02%	-	0.00%	0.02
其他债权投资	5,150,147.28	13.06%	2,964,427.44	8.18%	4.88
其他权益工具投资	1,042,979.10	2.64%	718,602.23	1.98%	0.66
应收账款	472,893.49	1.20%	143,259.57	0.40%	0.80
投资性房地产	27,912.25	0.07%	28,843.73	0.08%	-0.01
长期股权投资	346,846.82	0.88%	356,133.96	0.98%	-0.10
固定资产	264,891.56	0.67%	267,989.94	0.74%	-0.07
在建工程	2,056.94	0.01%	2,385.68	0.01%	0.00
使用权资产	41,788.02	0.11%	45,979.73	0.13%	-0.02
融出资金	5,267,209.46	13.36%	6,197,331.18	17.11%	-3.75
衍生金融资产	16,420.40	0.04%	5,796.69	0.02%	0.02
买入返售金融资产	1,582,451.74	4.01%	677,099.44	1.87%	2.14
存出保证金	790,022.15	2.00%	758,757.23	2.09%	-0.09
无形资产	70,840.32	0.18%	68,351.18	0.19%	-0.01
商誉	1,026.02	0.00%	1,026.02	0.00%	0.00
递延所得税资产	284,815.29	0.72%	235,291.45	0.65%	0.07
其他资产	45,330.55	0.11%	46,699.92	0.13%	-0.02
<b>负债：</b>					
拆入资金	900,616.25	2.28%	445,679.80	1.23%	1.05
卖出回购金融资产款	11,418,385.94	28.96%	9,652,492.95	26.64%	2.32
短期借款	-	0.00%	22,527.00	0.06%	-0.06
合同负债	43.30	0.00%	3,869.60	0.01%	-0.01
长期借款	-	0.00%	-	0.00%	0.00
租赁负债	41,212.99	0.10%	44,701.67	0.12%	-0.02

项目	2022 年末		2022 年初		占比增减 (百分点)
	金额	占总资产比例	金额	占总资产比例	
应付短期融资款	2,251,599.53	5.71%	1,980,003.28	5.47%	0.24
交易性金融负债	178,984.74	0.45%	46,098.28	0.13%	0.32
衍生金融负债	32,467.24	0.08%	22,604.95	0.06%	0.02
代理买卖证券款	5,941,381.45	15.07%	6,728,029.21	18.57%	-3.50
代理承销证券款	-	0.00%	2,700.00	0.01%	-0.01
应付职工薪酬	586,369.82	1.49%	649,198.09	1.79%	-0.30
应交税费	47,124.47	0.12%	83,117.91	0.23%	-0.11
应付款项	1,269,883.13	3.22%	527,497.91	1.46%	1.76
预计负债	3,999.94	0.01%	19,365.83	0.05%	-0.04
应付债券	4,885,043.67	12.39%	5,100,248.75	14.08%	-1.69
递延收益	12,281.38	0.03%	12,628.97	0.03%	0.00
递延所得税负债	39,027.48	0.10%	69,669.21	0.19%	-0.09
其他负债	1,136,153.33	2.88%	1,127,018.89	3.11%	-0.23

公司 2022 年末总资产 3,943.31 亿元，较年初增加 320.29 亿元和 8.84%；剔除客户资金后的总资产 3,349.17 亿元，较年初增加 398.96 亿元和 13.52%，其中货币资金及结算备付金 118.79 亿元、融出资金 526.72 亿元、交易性金融资产 1,594.73 亿元、买入返售金融资产 158.25 亿元、其他债权投资 515.01 亿元、其他权益工具投资 104.30 亿元，这七类资产合计占总资产（扣除客户资金）的 90.11%，公司资产结构合理、具有较强的流动性。

公司 2022 年末负债总额 2,874.46 亿元，较年初增加 220.71 亿元和 8.32%；扣除代理买卖证券款后，公司负债 2,280.32 亿元，其中：公司债 516.60 亿元，收益凭证 42.90 亿元，短期融资券 160.50 亿元，其余均为正常的经营性短期负债。公司 2022 年底资产负债率 72.89%，剔除客户资金和代理买卖证券款后资产负债率 68.09%。

公司不存在境外资产占比较高的情况。

## （二）以公允价值计量的资产和负债

单位：万元

项目	期初数	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	本期购买金额	本期出售 金额	其他 变动	期末数
金融资产								
1. 交易性金融资产	15,231,212.33	-329,378.20	-	-	1,016,356.33	-	-	15,947,257.32
2. 衍生金融资产	5,796.69	38,865.90	-	-	12,731.78	-	-	16,420.40
3. 其他债权投资	2,964,427.44	-	-10,148.90	20,972.94	2,146,993.89	-	-	5,150,147.28
4. 其他权益工具投资	718,602.23	-	-71,976.65	-	371,890.40	-	-	1,042,979.10
合计	18,920,038.68	-290,512.30	-82,125.55	20,972.94	3,547,972.40	-	-	22,156,804.10
金融负债	68,703.23	-6,561.10	-	-	155,297.62	-	-	211,451.98

注：因证券自营业务为证券公司的主营业务，交易频繁，因此，以本期成本变动来反映公司购买、出售金融资产变动的情况。

报告期内，公司主要资产计量属性未发生重大变化。

### (三) 截至报告期末的资产权利受限情况

详见公司 2022 年度财务报表附注“五、合并财务报表项目注释”之“(四)其他 1. 所有权或使用权受到限制的资产”。

### (四) 比较式财务报表中变动幅度超过 30% 以上项目的情况

单位：万元

项目	2022 年末	2021 年末	同比增减幅度	变动原因
衍生金融资产	16,420.40	5,796.69	183.27%	主要是场外期权公允价值变动。
买入返售金融资产	1,582,451.74	677,099.44	133.71%	主要是债券质押式回购规模增加。
应收款项	472,893.49	143,259.57	230.10%	主要是应收清算款项增加。
债权投资	6,926.62	-	不适用	主要是投资规模增加。
其他债权投资	5,150,147.28	2,964,427.44	73.73%	主要是中期票据及地方债投资规模增加。
其他权益工具投资	1,042,979.10	718,602.23	45.14%	主要是投资规模增加。
短期借款	-	22,527.00	-100.00%	主要是信用借款减少。
拆入资金	900,616.25	445,679.80	102.08%	主要是银行拆入资金增加。
交易性金融负债	178,984.74	46,098.28	288.27%	主要是收益凭证、债券借贷及第三方在结构化主体中享有的权益增加。
衍生金融负债	32,467.24	22,604.95	43.63%	主要是股指期货及股票期权公允价值变动。
代理承销证券款	-	2,700.00	-100.00%	支付定向增发认购保证金。
应交税费	47,124.47	83,117.91	-43.30%	主要是应交企业所得税及代扣代缴限售股份转让所得税减少。
应付款项	1,269,883.13	527,497.91	140.74%	主要是收益互换业务相关款项增加。
合同负债	43.30	3,869.60	-98.88%	主要是大宗交易商品货款结清。
预计负债	3,999.94	19,365.83	-79.35%	主要是部分诉讼案件了结。
递延所得税负债	39,027.48	69,669.21	-43.98%	主要是金融工具公允价值变动产生的递延所得税负债减少。
其他权益工具	3,000,000.00	2,000,000.00	50.00%	主要是发行的永续次级债券增加。
其他综合收益	-35,983.53	-5,755.30	不适用	主要是其他权益工具投资公允价值变动。
少数股东权益	-	1,680.93	-100.00%	子公司少数股东权益减少。

项目	2022 年度	2021 年度	同比增减幅度	变动原因
其他收益	4,494.98	2,667.24	68.53%	主要是代缴税金手续费返还增加。
公允价值变动收益（损失）	-297,073.40	174,044.02	-270.69%	证券市场波动导致金融工具公允价值变动减少。
汇兑损失	342.63	-63.79	不适用	主要是汇率变动。
资产处置收益（损失）	209.84	-26.08	不适用	主要是资产处置产生的收益增加。
信用减值损失	25,084.54	-52,145.06	不适用	主要是融资业务及其他债权投资信用减值损失增加。
其他资产减值损失	219.11	9.63	2,176.17%	主要是计提的存货跌价准备增加。
营业外收入	8,294.91	4,785.99	73.32%	主要是收到的政府补助增加。
营业外支出	-4,413.08	-29,274.10	不适用	主要是诉讼案件预计负债的冲回金额减少。
所得税费用	13,757.55	251,743.70	-94.54%	主要是利润总额减少及免税收入等增加所致。
少数股东损益	-340.49	229.64	-248.27%	子公司少数股东损益减少。
其他综合收益的税后净额	-38,592.38	-98,977.31	不适用	主要是其他权益工具投资公允价值变动。
每股收益	0.52	0.97	-46.39%	主要是净利润减少所致。
投资活动产生的现金流量净额	-1,274.62	40,717.88	-103.13%	主要是收回投资所收到的现金减少。
筹资活动产生的现金流量净额	184,562.46	1,420,219.49	-87.00%	主要是发行债券收到的现金减少。

## （五）融资渠道、长短期负债结构分析

### 1. 融资渠道

从融资方式来看，公司的融资渠道包括股权融资和债权融资两种方式。从融资期限来看，公司的短期融资渠道包括银行间市场同业拆借、债券回购、转融通、融资资产债权收益权转让与回购、债券借贷等，以及发行短期融资券、短期公司债券、收益凭证等；中长期融资渠道包括发行公司债券、次级债券、永续次级债券、融出资金债权资产证券化，以及发行股票、可转换公司债券等。

2022 年，公司综合运用短期和中长期融资渠道筹措资金，包括开展同业拆借、债券回购、转融通、发行短期融资券、收益凭证、公司债券、永续次级债券等。

### 2. 负债结构

2022 年末，公司总负债 2,874.46 亿元。扣除客户存放的交易结算资金后，自有负债 2,280.32 亿元，其中应付债券占比 21.42%、应付短期融资款占比 9.87%、卖出回购金融资产款占比 50.07%、拆入资金（含转融通）占比 3.95%。截至报告期末，公司无到期未偿还的债务。

### 3. 流动性管理措施与政策

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。

报告期内，公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

- (1) 积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平；
- (2) 加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求；
- (3) 持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地；
- (4) 持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口；
- (5) 适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施；
- (6) 持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

#### 4. 融资能力分析

公司经营稳健，信誉良好，盈利能力和偿付能力较强。公司积极拓展融资渠道和交易对手，与各大国有商业银行、股份制商业银行等金融机构均保持良好的合作关系。截至 2022 年末，公司获得多家金融机构合计超过 2,000 亿元的综合授信，具备能够以合适的成本随时获得短期和长期资金的能力。

## 八、投资状况分析

### (一) 对外股权投资总体情况

单位：万元

报告期投资额	上年同期投资额	变动幅度
150,746.18	87,824.76	71.64%

### (二) 报告期内获取的重大的股权投资情况

不适用。

### (三) 报告期内正在进行的重大的非股权投资情况

不适用。

#### (四) 金融资产投资

##### 1. 证券投资情况

单位：万元

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
其他	EB4595	光银现金 A	296,960.00	公允价值计量	19,656.10	388.36	-	715,230.00	438,387.38	6,244.64	297,604.46	交易性金融资产	自有
基金	000621	易方达现金增利货币 B	270,623.83	公允价值计量	258,148.07	-	-	151,475.76	139,000.00	5,475.76	270,623.83	交易性金融资产	自有
其他	CTZQ01	财通证券资管智选 FOF6 号单一资产管理计划	208,151.81	公允价值计量	107,639.51	840.96	-	126,000.00	23,816.07	183.93	210,664.39	交易性金融资产	自有
基金	003474	南方天天利货币 B	207,839.51	公允价值计量	105,822.67	-	-	102,016.84	-	3,379.13	207,839.51	交易性金融资产	自有
其他	pa028888	工行随心 E	200,000.00	公允价值计量	150,055.34	39.34	-	900,000.00	850,000.00	6,620.08	200,094.68	交易性金融资产	自有
其他	931830	证券行业支持民企发展系列之国信证券 1 号集合资产管理计划	150,292.50	公允价值计量	160,670.53	-	13,161.96	-	-	2.96	163,454.46	其他权益工具投资	自有
境内外股票	601328	交通银行	117,313.35	公允价值计量	65,078.78	0.00	-3,576.63	51,692.53	3,007.05	8,730.53	113,736.72	其他权益工具投资	自有
其他	132015	18 中油 EB	110,071.29	公允价值计量	14,246.63	264.40	-	96,201.97	-	862.57	111,891.44	交易性金融资产	自有
基金	003281	广发活期宝货币 B	107,807.94	公允价值计量	253,776.65	-	-	4,031.29	150,000.00	4,031.29	107,807.94	交易性金融资产	自有
基金	004137	博时合惠货币 B	105,849.80	公允价值计量	103,745.96	-	-	2,103.84	-	2,277.90	105,849.80	交易性金融资产	自有
期末持有的其他证券投资			20,294,337.72	-	17,681,198.44	-330,911.26	-91,710.88	142,728,618.65	139,739,044.50	365,373.07	20,357,743.08	-	-
合计			22,069,247.75	-	18,920,038.68	-329,378.20	-82,125.55	144,877,370.88	141,343,255.00	403,181.86	22,147,310.32	-	-
证券投资审批董事会公告披露日期			不适用										
证券投资审批股东会公告披露日期			不适用										

## 2. 衍生品投资情况

不适用。

### (五) 募集资金使用情况

报告期内，公司无募集资金使用情况。

## 九、重大资产和股权出售

### (一) 出售重大资产情况

不适用。

### (二) 出售重大股权情况

不适用。

## 十、主要控股参股公司分析

单位：万元

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	2022 年末总资产	2022 年末净资产	2022 年度营业总收入	2022 年度营业利润	2022 年度净利润
国信期货	子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理	200,000.00	2,050,153.45	325,547.24	259,218.04	29,351.93	22,456.39
国信弘盛	子公司	创业投资业务	405,000.00	331,905.35	304,376.03	12,214.04	6,818.66	6,029.63
国信香港	子公司	股票及期货经纪、投资银行、资产管理	港币 263,000.00	312,365.93	135,846.01	15,764.40	171.20	1,048.47
国信资本	子公司	股权投资	300,000.00	481,863.82	451,128.98	24,765.31	18,632.06	16,801.33
鹏华基金	参股公司	基金募集、基金销售、资产管理	15,000.00	755,569.87	409,872.42	436,409.64	134,389.48	100,125.27

报告期内，公司未新增子公司，处置子公司的情况如下：

公司名称	报告期内取得和处置子公司方式	对整体生产经营和业绩的影响
国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司	注销	无重大影响
深圳市国信大族机器人产业投资基金管理有限公司	注销	无重大影响
深圳市国信众创基金管理有限公司	注销	无重大影响
深圳市国信运通基金管理有限公司	注销	无重大影响
华文弘盛基金管理（珠海）有限公司	注销	无重大影响

## 十一、公司控制的结构化主体情况

公司合并的结构化主体包括公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。公司通过综合评估本公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2022年12月31日，纳入公司财务报表合并范围的结构化主体共40个，合并的结构化主体的总资产为人民币1,091,894.53万元。公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产和其他权益工具投资的金额为人民币1,026,628.22万元。

## 十二、公司未来发展的展望

### （一）证券行业的发展趋势和竞争格局

目前，我国证券行业大、中、小型公司共存，面对实体经济直接融资需求和居民财富管理需要，龙头券商优势地位显著，中小证券公司探索差异化、特色化发展是必然选择。

近年来行业内呈现头部证券公司领先发展、中小证券公司差异化特色化发展的良好格局。一方面，大型证券公司的业务和区域布局更加综合多元，并积极探索各类创新业务，综合实力、创新能力强的头部证券公司整体竞争优势更加凸显。另一方面，中小证券公司面对头部证券公司的马太效应，抓住证券行业不断涌现的新业务机会，逐渐走上精品化、特色化发展的道路。

在金融供给侧结构性改革的引领下，中国经济正处在从总量扩张向结构优化转变、产业结构转型升级的新时代。中国经济的高质量发展，需要金融体系进一步深化改革，提高直接融资比重，也需要涌现更多高质量发展的证券公司。站在新的历史起点上，证券行业正在向专业化、机构化、国际化转型。

#### 1. 专业化

资本市场改革将促进我国证券公司从“通道类中介”向“专业型投行”转型。当前中国经济在创新驱动下高质量发展，证券公司要为科技创新型企业提供全生命周期、全价值链的综合金融服务，需要做好信息传递、价值发现、综合服务等工作，这对证券公司的风险管理水平、研究定价能力、销售能力等都提出了更高的要求。证券公司要更好地在促进中国经济转型中发挥作用，就需要提升专业服务能力，打造专业化人才队伍，形成竞争优势。

## 2. 机构化

随着以全面注册制为代表的资本市场改革不断深化，市场生态环境不断改善，专业机构投资者持股市值占比逐年稳步提升。与此同时，随着投资者教育和投资者保护制度不断完善，更多投资者倾向于通过专业财富管理机构参与资本市场，这为证券公司业务发展提供了更好的机遇。

## 3. 国际化

在资本市场双向开放、资本配置国际化进程加速、客户跨境投融资需求增强等多方面因素推动下，证券公司逐渐从以境内为主转向境内外联动发展。在国际化大背景下，证券作为连接实体经济和资本市场的桥梁，需要全面提升跨境金融服务能力，持续探索跨境金融创新，在跨境投资渠道、投资产品供给、风险管理等方面优化与拓展，提升跨境业务的竞争力，应对国际竞争。

### (二) 公司发展战略

当前，多层次资本市场建设持续推进，证券行业的改革、创新和发展不断深化，资本市场服务实体经济能力不断提升，带动金融和实体经济良性循环。随着证券公司的经营范围和业务空间逐步拓展、财富管理转型持续推进以及全面注册制的正式实施，证券行业将开启高质量发展新征程。在整体战略上，公司坚持以客户为中心，全力实施“一个打造、两翼驱动、六大推进、八大支撑”（即“1、2、6、8”）工程，服务经济高质量发展。“一个打造”，即公司的战略愿景是“打造全球视野、本土优势、创新驱动、科技引领的世界一流综合型投资银行”。“两翼驱动”，即将夯实资本硬实力与提升管理能力作为驱动公司发展的两翼；夯实资本硬实力就是要积极采用非公开发行股票、H股上市等方式，扩大资本规模和境内外影响力，为实现公司行业地位的跨越提供坚实支撑；提升管理能力就是要以加强管理体系和管理能力建设为主线，夯实管理基础，优化管理流程，推动管理创新，全面提升管理现代化水平，不断增强公司的核心竞争力。公司的发展目标是“六大推进”，即推进“全价值链财富管理”“积极稳健型投行服务”“多平台价值投资”“全方位研究服务”“金融科技驱动发展”“多渠道国际化发展”六大业务主线。为实现公司总体战略愿景和业务规划，公司将重点实施“八大支撑”，即重点实施金融控股战略、非有机增长战略、客户服务战略、金融科技领先战略、内部管控战略、人才优先战略、深耕深圳本土战略、国资国企协同发展战略等八大战略支撑。与此同时，进一步落实党建责任、完善公司治理、提升管理效能、加强战略协同、夯实人才支撑、强化风险管控、提升运行保障、鼓励创新发展、推进文化建设、履行社会责任等十大战略保障，以此确保公司“十四五”战略规划目标顺利实现。

### (三) 2023 年度公司经营计划

2023 年，公司将继续贯彻落实中央、省、市决策部署，紧紧围绕高质量发展这一工作主线，按照“担当责任，融入大局，稳中求进，奋勇争先”的经营思路，全力以赴完成各项经营管理任务，奋力开创发展新局面。一是于变局中开新局，稳步推进各项业务发展。以公司业务主线为抓手，稳步走好高质量发展之路，以自身经营业绩的“稳中向好”，助力经济和社会实现高质量发展。二是加强整体作战，提升协同发展实效。持续激发内部协同效能，推动协同实效再上新台阶，不断提高综合金融服务能力。三是强化科技赋能，加速推动数字化转型。积极推进“数字化、智慧化、敏捷化、生态化”的金融科技战略，更快更深度地推动数字化转型。四是坚持稳健经营，守住不发生系统性风险底线。以“时时放心不下”的责任意识，牢牢守住不发生系统性风险底线，为稳健经营保驾护航。五是加强人才培养，打造能攻善战队伍。推动人力资源“十四五”战略规划落地，打造能打仗、能打胜仗硬仗的人才队伍。六是坚持党建引领，加强党的全面领导。把党的领导贯彻到经营管理的全过程、各方面，为各项重点工作的落地提供坚强的政治保障。

#### (四) 公司各业务线的创新及风险控制

##### 1. 报告期内业务创新情况

2022年，公司积极把握资本市场和证券行业改革创新的发展机遇，稳步推动新资格申请、新业务拓展。报告期内，公司成为首批获得上市证券做市交易业务行政许可的8家券商之一，取得包括沪深交易所和中金所新推出的全部6只期权品种的主做市商资格等多项创新业务资格；抢下多项市场“首单”，包括上线全市场首只券结模式港股通ETF、落地首单挂钩黄金远期的收益凭证等。公司各相关业务加速推进，继续开创公司在新市场、新客户、新品种等方面的业务新局面，助力中国资本市场高质量发展。

##### 2. 业务创新的风险控制情况

公司将创新业务一并纳入多层次、全方位的内部控制和风险管理体系中，确保风险可控。公司制定并实施了《国信证券股份有限公司新产品新业务管理办法》，对创新业务的筹备、业务评估与决策、业务开展及后续管理进行要求。

在经营创新类业务时，公司始终坚持合法合规、制度先行、流程优先的原则，在业务开展之前制定一系列完备的管理制度、业务流程和风控制度，确保创新业务有条不紊地开展。事前，内控部门全面参与每项创新业务，业务筹备之初介入业务研讨，进行合规论证，商定业务方案，对风险予以识别分析；业务开展后，业务部门和内控部门各自独立进行持续监控和报告，确保各项风控措施落到实处。

### 十三、报告期内接待调研、沟通、采访等活动

序号	接待时间	接待地点	接待方式	接待对象类型	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料	调研的基本情况索引
1	2022年4月26日	“全景路演”网络平台 ( <a href="http://rs.p5w.net">http://rs.p5w.net</a> )	其他	其他	通过网络方式参加公司2021年度业绩说明会的公众投资者	公司发展战略、经营情况、年度报告相关披露内容。业绩说明会演示材料已随该次活动的投资者关系活动记录表公开披露。	详见公司于2022年4月27日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》
2	2022年7月19日	国信金融大厦	其他	机构	中银国际证券	公司发展战略、经营情况。	详见公司于2022年7月20日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》
3	2022年11月9日	“全景路演”网络平台 ( <a href="http://rs.p5w.net">http://rs.p5w.net</a> )	其他	其他	通过网络方式参加2022年深圳辖区上市公司投资者网上集体接待日活动的公众投资者	公司发展战略、经营情况	详见公司于2022年11月10日在深交所互动易平台披露的《投资者关系活动记录表》

# 04

## 公司治理



## 一、公司治理的基本状况

公司严格按照《公司法》《证券法》及中国证监会相关规章及规范性文件要求，规范运作，持续致力于维护和提升公司良好的市场形象。公司不断完善公司治理结构，持续健全合规风控制度和内控管理体系，形成了股东大会、董事会、监事会和经营管理层相互分离、相互制衡的公司治理结构，各层级在各自职责、权限范围内，各司其职、各负其责，确保公司治理的规范有效。

### （一）股东与股东大会

公司严格按照相关规定召集、召开股东大会，确保所有股东，特别是中小股东享有平等的地位，能够充分行使自己的权利。公司控股股东及实际控制人能够按照相关法律、法规及《公司章程》的规定行使其享有的权利，不存在超越股东大会直接或间接干预公司决策和经营活动的情形，没有占用公司资金，没有要求公司为其担保或为他人担保，在人员、资产、财务、机构和业务方面做到与公司明确分开。

### （二）董事与董事会

公司董事会不断完善董事会议事规则，董事会会议的召集、召开及表决程序合法有效。公司建立了独立董事制度，董事会成员中现有三名独立董事，独立及客观地维护中小股东权益，在董事会进行决策时发挥监督制衡作用。

### （三）监事和监事会

公司监事会不断完善监事会议事规则，监事会会议的召集、召开及表决程序合法有效。公司监事会向股东大会负责，本着对全体股东负责的精神，对公司财务以及公司董事会、高级管理人员履行职责的合法合规性进行了有效监督。

### （四）经营管理层

公司经营管理层产生的程序符合《公司法》《公司章程》的规定。公司全面推行经理层成员任期制和契约化管理，对经理层成员实行个性化针对性考核，进一步健全市场化经营机制，激发公司高质量发展活力，能够依照法律、法规和董事会的授权，依法合规经营，忠实勤勉，努力实现股东利益和社会效益的最大化。

### （五）报告期内建立和完善的公司治理制度情况

报告期内，公司及时组织更新和修订《公司章程》，制定《董事会授权管理办法》。公司治理结构完善，与《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。

## 二、公司相对于控股股东、实际控制人在保证公司资产、人员、财务、机构、业务等方面的独立情况

公司与控股股东在资产、人员、财务、机构、业务等方面完全分开，具有独立完整的业务及自主经营能力。

### （一）公司资产独立完整情况

公司经营和办公场所独立，具备与经营有关的业务体系及相关资产，各种资产权属清晰、完整，不存在依赖控股股东的资产进行经营的情况；不存在资产、资金被控股股东占用而损害公司利益的情况。

### （二）公司人员独立完整情况

公司具有完善的人力资源管理体系、独立的职工薪酬制度及完整的职工培训计划，与控股股东完全分离。

公司董事、监事和高级管理人员的选聘符合《公司法》《证券法》及《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的有关规定，公司高级管理人员不存在在控股股东及其关联方任职的情形。

### （三）公司财务独立完整情况

公司按照《企业会计准则》《企业会计准则 - 应用指南》等规定建立了独立的财务会计核算体系，具有完善的财务管理制度体系，并且设立了独立的财务部门，配备了独立的财务会计人员，不存在财务会计人员在股东单位兼职的现象。

公司开设了独立的银行账户，办理了独立的税务登记，依法纳税，未与股东单位混合纳税。

截至报告期末，公司不存在为股东单位及其他关联方提供担保的情况。

### （四）公司机构独立完整情况

公司具备完善的法人治理结构，股东大会、董事会、监事会、经营管理层职责明确，各机构严格按照《公司法》《公司章程》等规定高效运行。公司拥有独立、完善的组织架构，业务部门与职能部门，公司总部与分公司、营业部相互协调，工作有序开展。公司的办公机构和各项经营业务完全独立于股东及关联方，与控股股东、实际控制人及其控制的其他企业间没有机构混同的情形。

### （五）公司业务独立完整情况

公司已获得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》，各项业务资质及经营许可文件齐备，具有独立完整的经营体系。公司业务与控股股东及其他关联方不存在同业竞争的情形，亦不受其控制与影响。

## 三、同业竞争情况

报告期内，公司控股股东除持有本公司股权外，未在中国境内或境外，直接或间接从事与公司相同或相似并构成竞争关系的业务，亦未直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权，与公司不存在同业竞争。

公司控股股东深投控出具了《避免同业竞争及利益冲突的承诺及约束措施》，详见本报告第六节“一、承诺事项履行情况”。

## 四、报告期内召开的年度股东大会和临时股东大会的有关情况

### (一) 本报告期股东大会情况

会议届次	会议类型	投资者参与比例	召开日期	披露日期	会议决议
2021 年度股东大会	年度股东大会	80.7370%	2022 年 6 月 1 日	2022 年 6 月 2 日	审议通过如下议案： 1.2021 年度财务决算报告； 2.2021 年度利润分配方案； 3.2021 年度董事会工作报告； 4.2021 年度监事会工作报告； 5.2021 年年度报告及其摘要； 6.2021 年度独立董事工作报告； 7. 关于 2021 年度关联交易及预计 2022 年度日常关联交易的议案； 8. 关于聘请 2022 年度审计机构及其报酬的议案； 9. 关于确定 2022 年度自营投资额度的议案； 10. 关于国信证券（香港）金融控股有限公司 2022 年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案； 11. 关于公司开展科创板股票做市交易业务的议案； 12. 关于设立资产管理子公司的议案； 13. 关于为公司及公司董事、监事及高级管理人员购买董监高责任保险的议案。

注：“投资者参与比例”是指出席会议的股东及股东授权委托代表所代表股份数量占公司有效表决权股份总数的比例。

### (二) 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

不适用。

## 五、董事、监事和高级管理人员情况

### (一) 基本情况

姓名	职务	任职状态	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	期初持股数 (股)	本期增持股份数量 (股)	本期减持股份数量 (股)	其他增减变动 (股)	期末持股数 (股)	股份增减变动的原因
张纳沙	董事长	现任	女	53	2021 年 4 月 26 日	2024 年 9 月 2 日	-	-	-	-	-	-
邓 舸	董事、总裁	现任	男	54	董事职务： 2020 年 6 月 15 日 总裁职务： 2020 年 5 月 14 日	2024 年 9 月 2 日	-	-	-	-	-	-
姚 飞	董事	现任	男	55	2018 年 8 月 6 日	2024 年 9 月 2 日	-	-	-	-	-	-
刘小腊	董事	现任	男	53	2017 年 10 月 16 日	2024 年 9 月 2 日	-	-	-	-	-	-
李双友	董事	现任	男	54	2015 年 11 月 20 日	2024 年 9 月 2 日	-	-	-	-	-	-
赵 军	董事	现任	男	54	2021 年 9 月 3 日	2024 年 9 月 2 日	-	-	-	-	-	-

姓名	职务	任职状态	性别	年龄	任期起始日期	任期终止日期	期初持股数 (股)	本期增持股份数量 (股)	本期减持股份数量 (股)	其他增减变动 (股)	期末持股数 (股)	股份增减变动的原因
白涛	独立董事	现任	女	58	2016年12月23日	2022年12月22日	-	-	-	-	-	-
郑学定	独立董事	现任	男	59	2017年12月21日	2023年12月20日	-	-	-	-	-	-
金李	独立董事	现任	男	52	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
李保军	监事会主席	现任	男	59	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
张财广	监事	现任	男	60	2012年4月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
洪伟南	职工监事	现任	男	58	2021年9月3日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
陈华	副总裁	现任	男	57	2017年7月10日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
湛传立	副总裁、 董事会秘书	现任	男	59	副总裁职务： 2018年1月8日 董事会秘书职务： 2018年12月28日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
杜海江	副总裁	现任	男	52	2018年5月15日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
揭冠周	副总裁	现任	男	44	2021年4月26日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
成飞	副总裁	现任	男	39	2021年5月25日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
陈勇	合规总监	现任	男	58	2009年4月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
袁超	首席营销官	现任	男	54	2021年11月23日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
曾信	首席风险官	现任	男	47	2017年7月31日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
周中国	财务负责人	现任	男	49	2018年1月16日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-
刘汉西	首席信息官	现任	男	58	2021年11月23日	2024年9月2日	-	-	-	-	-	-

### 1. 报告期是否存在任期内董事、监事离任和高级管理人员解聘的情况

不适用。

### 2. 公司董事、监事、高级管理人员变动情况

报告期内，公司董事会收到独立董事白涛女士的《辞职报告及相关说明》。因个人任期即将届满，白涛女士向公司董事会申请辞去公司第五届董事会独立董事、薪酬与考核委员会主任委员和审计委员会委员职务。该辞职报告将在下任独立董事填补因其辞职产生的空缺后生效。在辞职报告生效前，白涛女士将按照有关法律法规、《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》的规定，继续履行公司独立董事、薪酬与考核委员会主任委员和审计委员会委员的职责。

## (二) 任职情况

### 1. 公司现任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历以及目前在公司的主要职责

#### (1) 董事

**张纳沙女士**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1969年12月，硕士。张纳沙女士曾任深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副主任、党委委员，深圳市龙华区委常委、区政府党组副书记、副区长等职务。现任公司党委书记、董事长，兼任中国证券业协会副会长，深圳市证券业协会会长，深圳证券交易所会员理事代表、上诉复核委员会主任委员。2021年4月起任公司董事长。

**邓舸先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年9月，硕士。邓舸先生曾任中国证券监督管理委员会副处长、处长、证监会新闻发言人、上市公司监管部副主任等职务。2020年5月加入公司，现任公司董事、总裁，兼任国信期货有限责任公司董事长、中国证券业协会风险管理委员会主任委员，中国上市公司协会第三届并购融资委员会主任委员、上海证券交易所债券发展委员会主任委员，深圳证券交易所创业板股票发行规范委员会副主任委员。2020年6月起任公司董事。

**姚飞先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1967年9月，博士，教授级经济师。姚飞先生曾任中油资产管理有限公司副总经理、党委委员，兼任昆仑信托有限责任公司副总裁、海通昆仑股权投资管理（上海）有限公司董事长、黑龙江龙煤矿业集团股份有限公司监事等职务；现任深圳市投资控股有限公司党委委员，副总经理；兼任深圳资产管理有限公司董事长、总经理、党总支书记，深圳市投控资本有限公司董事长，深圳担保集团有限公司董事、深圳市怡亚通供应链股份有限公司董事、华润深国投信托有限公司董事等职务。2018年8月起任公司董事。

**刘小腊先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1970年1月，博士。刘小腊先生曾任招商银行股份有限公司资金交易部总经理、资产管理部总经理兼同业金融综合管理部总经理、同业金融总部常务副总经理兼资产管理部总经理、佛山分行党委书记，珠海华润银行股份有限公司常务副行长，华润深国投信托有限公司党委副书记、总经理等职务。现任华润深国投信托有限公司党委书记、董事长，兼任深圳红树林创业投资有限公司董事长。2017年10月起任公司董事。

**李双友先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年12月，大学本科，高级会计师。李双友先生曾任玉溪卷烟厂计财统计科科长，云南红塔集团有限公司计划财务科科长、副总经理、党委书记、董事；现任云南合和（集团）股份有限公司副总经理，兼任昆药集团股份有限公司副董事长、红塔创新投资股份有限公司董事长、云南红塔滇西水泥股份有限公司董事长、华能澜沧江水电股份有限公司副董事长、中维资本控股股份有限公司董事、红塔证券股份有限公司董事、云南红塔特铜新材料股份有限公司董事长、云南红塔蓝鹰纸业股份有限公司董事长、云南合和印务管理有限公司董事长、云南红河投资有限公司董事长、珠海红塔仁恒包装股份有限公司副董事长。2015年11月起任公司董事。

**赵军先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年12月，硕士。赵军先生曾任全国社会保障基金理事会境外投资部副主任、养老金管理部副主任；现任全国社会保障基金理事会股票投资部主任。2021年9月起任公司董事。

**白涛女士**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1965年3月，博士。白涛女士曾任中信律师事务所律师、北京市通商律师事务所合伙人及律师；现任北京市君合律师事务所合伙人及律师。2016年12月起任公司独立董事。

**郑学定先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1963年6月，硕士。郑学定先生曾任深圳市注册会计师协会秘书长，开元信德会计师事务所合伙人、大华会计师事务所深圳分所合伙人、赣州龙邦材料科技有限公司董事长。现任赣州龙邦材料科技有限公司董事，兼任国银金融租赁股份有限公司独立董事，甬兴证券有限公司独立董事。2017年12月起任公司独立董事。

**金李先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1970年12月，博士。金李先生曾任复旦大学国际金融系教员，哈佛商学院金融学助理教授，哈佛商学院金融学副教授，牛津大学金融学终身教职正教授；现任北京大学经济与管理学部副主任，北京大学国家金融研究中心主任，北京大学光华管理学院金融系讲席教授，南方科技大学副校长，中国人民政治协商会议全国委员会委员、经济委员会委员，九三学社常委、经济委员会副主任，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司独立董事。2021年9月起任公司独立董事。

## （2）监事

**李保军先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年1月，大学本科。李保军先生曾任中共深圳市纪律检查委员会副秘书长、光明新区党工委委员、纪工委书记、深圳市纪委委员等职务。2017年11月加入公司，现任深圳市纪委监委驻国信证券纪检监察组组长，公司党委委员、深圳证券业协会廉洁委员会主任委员。2021年9月起任公司监事会主席。

**张财广先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1962年7月，博士、会计师。张财广先生曾任北京城建投资发展股份有限公司投资证券部经理、经理助理兼北京城建中稷实业发展有限公司常务副总裁、北京城建投资发展股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，北京上市公司协会监事，深圳市中科招商创业投资有限公司董事，南微医学科技股份有限公司董事，二十一世纪空间技术应用股份有限公司董事，北京城建三期开发建设合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人代表，北京市中科远东创业投资有限公司董事长等职务；现任北京城建（芜湖）股权投资管理有限公司董事长。2012年4月起任公司监事。

**洪伟南先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年9月，硕士，审计师。洪伟南先生曾任深圳国际信托投资公司深圳红岭中路证券营业部员工、证券发行科经理；深圳国投证券有限公司发行部副经理、投资银行一部总经理；国信证券投资银行总部副总经理，国信财务顾问有限公司副总经理，国信证券深圳红岭中路证券营业部发展科经理，国信证券稽核审计部高级经理、监察稽核总部高级经理、主任审计师、稽核总监、副总经理、总经理等职务。现任公司职工监事、监察稽核总部总经理，工会常委，工会经费审查委员会主任。2021年9月起任公司职工监事。

### （3）高级管理人员

**邓舸先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1968年9月，硕士。邓舸先生曾任中国证券监督管理委员会副处长、处长、证监会新闻发言人、上市公司监管部副主任等职务。2020年5月加入公司，现任公司董事、总裁，兼任国信期货有限责任公司董事长、中国证券业协会风险管理委员会主任委员，中国上市公司协会第三届并购融资委员会主任委员、上海证券交易所债券发展委员会主任委员，深圳证券交易所创业板股票发行规范委员会副主任委员。

**陈华先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1965年10月，大学本科，高级审计师。陈华先生曾任审计署驻武汉特派员办事处科员、副主任科员、主任科员、副处长，审计署外资司副处长（主持工作）、处长，审计署驻武汉特派员办事处法制处处长，深圳市审计局总审计师、党组成员，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副主任、党委委员等职务。2017年7月加入公司，现任公司副总裁，兼任中国上市公司协会 ESG 委员会委员。

**谡传立先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年2月，硕士，高级工程师。谡传立先生曾任深圳证监局（证管办）科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长、上市公司监管二处处长，中国证监会第六届创业板发审委委员，深圳证监局稽查二处处长等职务。2017年12月加入公司，现任公司副总裁、董事会秘书兼投资银行事业部总裁、国信证券（香港）金融控股有限公司董事长，中国证券业协会投资银行专业委员会委员，中国上市公司协会董事会秘书委员会执行副主任委员。

**杜海江先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1971年2月，大学本科。杜海江先生2001年3月加入公司，历任杭州萧然东路证券营业部电子商务部经理、杭州保俶路证券营业部总经理助理、浙江营销中心总经理、浙江管理总部总经理、杭州分公司总经理、浙江分公司总经理、浙江金融资产交易中心董事等职务。现任公司副总裁、财富管理与机构事业部总裁，兼任鹏华基金管理有限公司董事、中国证券业协会证券经纪与财富管理专业委员会副主任委员。

**揭冠周先生**，中国国籍，美国永久居留权，出生于1978年10月，博士。揭冠周先生曾任美国富国银行固定收益部执行总经理、资深证券银行家，美国美银美林全球银行及资本市场部执行总经理、资深量化金融分析师等职务。2021年4月加入公司，现任公司副总裁。

**成飞先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1983年9月，硕士。成飞先生曾任国泰君安证券固定收益证券总部助理研究员、资产管理总部研究员、投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部副总经理、总经理、公司总裁助理、公司副总裁等职务。2021年5月加入公司，现任公司副总裁兼资产管理总部总经理，兼任国信弘盛私募基金管理有限公司董事长、中国证券业协会投资者服务与保护委员会委员。

**陈勇先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年10月，博士。陈勇先生曾任君安证券有限责任公司投资发展部业务经理、法律部部门负责人，国泰君安证券股份有限公司法律事务部副总经理，联合证券有限责任公司董事会秘书等职务；2006年11月加入公司，历任公司法律事务部总经理、董事会办公室主任、合规管理总部总经理、首席风险官等职务；现任公司合规总监，兼任中国证券业协会自律处分和内审委员会副主任委员、中国证券业协会合规管理与廉洁从业委员会秘书长、深圳市合规专家委员会专家委员、深圳市证券业协会合规专业委员会委员、深圳经济特区金融学会反洗钱专业委员会副主任委员、深圳国际仲裁院仲裁员、中国恒大风险化解委员会委员。

**袁超先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1969年2月，硕士。袁超先生曾任美国纽约瑞士信贷第一波士顿公司固定收益部金融衍生品风险管理经理，美国纽约巴克莱银行美元金融衍生品交易部金融衍生品交易员、美国纽约摩尔对冲基金管理公司风险管理部副总裁，美国芝加哥堡垒对冲基金管理公司风险管理部副总裁，鹏华基金管理有限公司总经理助理，人保资本投资管理有限公司党委书记、董事长、总裁等职务；2015年7月加入公司，曾任公司首席投资官兼资产管理总部总经理、国信弘盛私募基金管理有限公司董事长，现任公司首席营销官，兼任深圳市证券业协会理事、深圳市投资基金同业公会理事。

**曾信先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1975年6月，硕士。曾信先生曾任大鹏证券融资服务公司上海行业组副组长、执行副董事。2005年2月加入公司，历任投资银行事业部业务十一部副总经理、业务十二部总经理助理、内核办公室副主任、内核办公室主任兼投资银行业务内核负责人、内核总部副总经理（主持工作）、内核总部总经理等职务；现任公司首席风险官、投资银行质量控制总部总经理、投资银行业务内核负责人，兼任中国证券业协会风险管理委员会秘书长。

**周中国先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1973年12月，硕士，高级会计师，注册会计师。周中国先生曾任深圳华为技术有限公司定价中心经理助理。2000年7月加入公司，历任资金财务总部业务经理，深圳金地证券服务部财务经理，资金财务总部高级经理、总经理助理、副总经理，人力资源总部副总经理、人力资源总部总经理等职务。现任公司财务负责人兼资金财务总部总经理、国信资本有限责任公司董事长、鹏华基金管理有限公司董事、中国证券业协会财务会计委员会委员、深圳市会计学会副会长。

**刘汉西先生**，中国国籍，无永久境外居留权，出生于1964年10月，大学本科。刘汉西先生曾任国家经委经济信息中心系统处工程师、国家物资部中国物资信息中心数据库处主任科员。1994年6月加入公司，历任电脑部副总经理、经纪管理总部电子商务部总经理、电子商务总部副总经理、信息技术中心总经理、信息技术总部技术总监、总裁助理兼信息技术总部总经理、厦门两岸股权交易中心有限公司董事；现任公司首席信息官、系统运行总部总经理、技术管理部总经理，兼任证通股份有限公司监事、中国证券业协会信息技术专业委员会副主任委员。

## 2. 在股东单位任职情况

任职人员姓名	股东单位名称	在股东单位担任的职务	任期期间	在股东单位是否领取报酬津贴
姚 飞	深圳市投资控股有限公司	党委委员、副总经理	2017年2月至今	是
刘小腊	华润深国投信托有限公司	党委书记、董事长	党委书记： 2017年5月至今 董事长： 2023年1月至今	是
李双友	云南合和（集团）股份有限公司	副总经理	2015年1月至今	是
赵 军	全国社会保障基金理事会	股票投资部主任	2023年3月至今	是

### 3. 在其他单位任职情况

任职人员姓名	其他单位名称	在其他单位担任的职务	任期期间	在其他单位是否领取报酬津贴
姚 飞	深圳资产管理有限公司	董事长、总经理、 党总支书记	2019年12月至今	否
	深圳担保集团有限公司	董事	2017年9月至今	否
	深圳市投控资本有限公司	董事长	2020年6月至今	否
	深圳市怡亚通供应链股份有限公司	董事	2018年9月至今	否
	深圳投控湾区股权投资基金合伙企业 (有限合伙)	执行事务合伙人 委派代表	2018年5月至今	否
	华润深国投信托有限公司	董事	2019年12月至今	否
	中国北欧投资控股有限公司	董事	2017年10月至今	否
	中国国有资本风险投资基金股份有限公司	董事	2021年9月至今	否
刘小腊	深圳红树林创业投资有限公司	董事长	2017年5月至今	否
李双友	昆药集团股份有限公司	副董事长	2015年7月至今	否
	红塔创新投资股份有限公司	董事长	2009年2月至今	否
	云南红塔滇西水泥股份有限公司	董事长	2017年12月至今	否
	华能澜沧江水电股份有限公司	副董事长	2018年2月至今	否
	中维资本控股股份有限公司	董事	2018年8月至今	否
	红塔证券股份有限公司	董事	2019年9月至今	否
	云南红塔特铜新材料股份有限公司	董事长	2020年9月至今	否
	云南红塔蓝鹰纸业股份有限公司	董事长	2022年4月至今	否
	云南合和印务管理有限公司	董事长	2021年12月至今	否
	云南红河投资有限公司	董事长	2022年7月至今	否
珠海红塔仁恒包装股份有限公司	副董事长	2022年6月至今	否	
白 涛	北京市君合律师事务所	合伙人 / 律师	2002年4月至今	是
郑学定	赣州龙邦材料科技有限公司	董事	2018年8月至今	是
	国银金融租赁股份有限公司	独立董事	2016年6月至今	是
金 李	甬兴证券有限公司	独立董事	2020年3月至今	是
	中国平安保险(集团)股份有限公司	独立董事	2021年8月至今	是
张财广	北京城建(芜湖)股权投资管理有限公司	董事长	2021年4月至今	否

#### 4. 公司现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员近三年证券监管机构处罚的情况

无。

### (三) 董事、监事、高级管理人员报酬情况

#### 1. 董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序、确定依据、实际支付情况

公司董事、监事、高级管理人员的薪酬根据外部相关规定及公司内部薪酬管理相关制度的有关规定执行。其中，董事、监事的薪酬由股东大会审议确定，高级管理人员薪酬由董事会审议确定。

公司董事、监事、高级管理人员薪酬标准和发放方式根据外部相关规定及公司内部薪酬管理相关制度的有关规定执行。公司董事会负责对高级管理人员进行绩效考核以及薪酬分配。公司高级管理人员薪酬事项经过薪酬与考核委员会出具书面意见后提交董事会审议，并由独立董事发表独立意见。

根据《国信证券股份有限公司董事监事薪酬与考核管理办法》，公司外部董事、监事津贴按月发放，无递延发放安排。公司内部董事、监事会主席、职工监事的薪酬，根据其在公司担任的具体职务，按照公司有关制度执行。张纳沙董事长、邓舸总裁为公司内部董事，李保军为监事会主席，洪伟南为职工监事。董事、监事、高级管理人员报酬的实际支付情况详见下表。

## 2. 公司报告期内董事、监事和高级管理人员报酬情况

单位：万元

姓名	职务	性别	年龄	任职状态	从公司获得的税前报酬总额	是否在公司关联方获取报酬
张纳沙	董事长	女	53	现任	320.37	否
邓舸	董事、总裁	男	54	现任	320.37	否
姚飞	董事	男	55	现任	14.29	是
刘小腊	董事	男	53	现任	-	是
李双友	董事	男	54	现任	-	是
赵军	董事	男	54	现任	-	否
白涛	独立董事	女	58	现任	28.57	是
郑学定	独立董事	男	59	现任	28.57	是
金李	独立董事	男	52	现任	28.57	否
李保军	监事会主席	男	59	现任	302.32	否
张财广	监事	男	60	现任	-	是
洪伟南	职工监事	男	58	现任	158.05	否
陈华	副总裁	男	57	现任	302.36	否
谔传立	副总裁、董事会秘书	男	59	现任	308.02	否
杜海江	副总裁	男	52	现任	308.33	否
揭冠周	副总裁	男	44	现任	302.61	否
成飞	副总裁	男	39	现任	298.80	否
陈勇	合规总监	男	58	现任	302.75	否
袁超	首席营销官	男	54	现任	298.63	否
曾信	首席风险官	男	47	现任	302.60	否
周中国	财务负责人	男	49	现任	302.69	否
刘汉西	首席信息官	男	58	现任	302.70	否
合计	-	-	-	-	4,230.60	-

注1：公司不存在支付非现金薪酬的情况。公司尚未实行股权激励计划，董事、监事和高级管理人员期初、期末均未持有公司股份。

注2：报告期内，董事、监事及高级管理人员从公司获得的税前报酬总额为担任相应职务期间领取的薪酬，不包括年金养老金。职工监事在报告期内从公司获得的报酬为其作为公司职工取得的薪酬。

注3：根据证券公司治理准则及相关要求，公司内部董事、监事、高级管理人员实行绩效薪酬递延支付机制，上述人员担任相应职务期间归属于以前年度递延发放的税前薪酬金额分别为：张纳沙 92.81 万元；邓舸 92.09 万元；李保军 14.25 万元；陈华 43.18 万元；谔传立 61.00 万元；杜海江 71.21 万元；揭冠周 44.33 万元；成飞 2.88 万元；陈勇 46.27 万元；袁超 1.95 万元；曾信 46.50 万元；周中国 45.53 万元；刘汉西 43.87 万元；洪伟南 45.35 万元。公司外部董事、独立董事、监事的归属于以前年度递延发放的税前薪酬金额为 0。

注4：报告期内，公司董事会收到独立董事白涛女士的《辞职报告及相关说明》。因个人任期即将届满，白涛女士向公司董事会申请辞去公司第五届董事会独立董事、薪酬与考核委员会主任委员和审计委员会委员职务。该辞职报告将在下任独立董事填补因其辞职产生的空缺后生效。

## 六、报告期内召开的董事会会议、监事会会议的有关情况

### (一) 本报告期董事会情况

会议届次	召开日期	披露日期	会议决议
第五届董事会第五次会议	2022年3月30日	2022年3月31日	<p>审议通过如下议案：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 关于审议《国信证券股份有限公司“十四五”发展战略规划》的议案；</li> <li>2. 关于审议《国信证券股份有限公司金融科技“十四五”战略规划》的议案；</li> <li>3. 关于公司2021年信息技术管理绩效总结报告与2022年工作计划的议案；</li> <li>4. 关于确定公司2022年度自营投资额度的议案；</li> <li>5. 关于向商业银行申请2022年度综合授信额度的议案；</li> <li>6. 关于确定2022年度公司风险偏好和风险容忍度的议案；</li> <li>7. 关于审议《国信价值智选混合型集合资产管理计划2021年年度报告》的议案；</li> <li>8. 关于聘请国信金融大厦物业服务公司招标立项的议案；</li> <li>9. 关于审议《国信证券股份有限公司董事会授权管理办法》的议案。</li> </ol> <p>此外，董事会集体学习了2021年下半年监管新规动态。</p>
第五届董事会第六次会议	2022年4月18日	2022年4月19日	<p>审议通过如下议案：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 2021年度经营工作报告；</li> <li>2. 2021年度财务决算报告；</li> <li>3. 2021年度利润分配方案；</li> <li>4. 2021年年度报告及其摘要；</li> <li>5. 2021年度董事会工作报告；</li> <li>6. 2021年度独立董事工作报告；</li> <li>7. 关于2021年度战略重点工作、风险控制情况和重大风险事项考核评价的议案；</li> <li>8. 2021年度董事履职考核和薪酬情况专项说明；</li> <li>9. 2021年度高级管理人员履职情况、绩效考核和薪酬情况专项说明；</li> <li>10. 2021年度合规总监考核报告；</li> <li>11. 2021年度合规报告；</li> <li>12. 2021年度风险管理报告；</li> <li>13. 2021年度内部控制评价报告；</li> <li>14. 2021年度合规管理有效性评估报告；</li> <li>15. 2021年度廉洁从业管理情况报告；</li> <li>16. 2021年度流动性风险管理报告；</li> <li>17. 2021年度社会责任报告；</li> <li>18. 关于2021年度关联交易及预计2022年度日常关联交易的议案；</li> <li>19. 关于公司2021年度募集资金存放与使用情况的专项报告的议案；</li> <li>20. 关于国信香港2022年度为其全资子公司常规性业务提供担保事宜的议案；</li> <li>21. 关于向国信弘盛私募基金管理有限公司委派董事的议案。</li> </ol> <p>此外，董事会审阅了如下议题：2021年董事会审计委员会履职情况报告、2021年度内部控制审计报告、2021年度反洗钱工作报告、公司反洗钱专项执法检查处罚结果有关情况的报告。</p>

会议届次	召开日期	披露日期	会议决议
第五届董事会第七次会议	2022年4月29日	2022年4月30日	审议通过如下议案： 1.2022年第一季度报告； 2.2022年第一季度风险管理报告； 3.2022年度重大风险评估报告； 4.2022年第一季度流动性风险报告； 5.2021年度内控体系工作报告； 6.关于确定2022年度战略重点工作目标的议案； 7.关于聘请2022年度审计机构及其报酬的议案； 8.关于公司开展科创板股票做市交易业务的议案； 9.关于设立资产管理子公司的议案； 10.关于为公司及公司董事、监事及高级管理人员购买董监高责任保险的议案； 11.关于提议召开公司2021年度股东大会的议案。 此外，董事会审阅了如下议题：2022年度财务预算方案、董事会审计委员会2022年第一季度履职情况报告。
第五届董事会第八次会议	2022年5月31日	2022年6月1日	审议通过如下议案： 1.关于国信证券深圳北综合金融服务中心工程立项的议案； 2.关于修订《国信证券股份有限公司经理层成员岗位聘任协议》的议案。 此外，董事会审阅了如下议题：关于2021年度投资后评价工作报告的议案、国信证券股份有限公司薪酬管理情况报告。
第五届董事会第九次会议	2022年6月30日	2022年7月1日	审议通过如下议案： 1.关于设立纪检办公室的议案； 2.关于公司2021年度环境信息披露报告的议案。
第五届董事会第十次会议	2022年8月26日	2022年8月27日	审议通过如下议案： 1.2022年半年度经营工作报告； 2.2022年半年度报告及其摘要； 3.2022年半年度合规报告； 4.2022年半年度风险管理报告； 5.2022年半年度流动性风险管理报告； 6.关于审议参公大集合2022年中期报告的议案； 7.关于审议《国信证券股份有限公司合规管理有效性评估办法》的议案； 8.关于国信证券入驻龙华汇隆商务中心并与深圳市龙华区政府物业管理中心签订《房屋租赁合同》的议案； 9.关于向国信证券资产管理有限公司（筹）委派董事、监事及推荐高级管理人员人选的议案； 10.关于向青岛蓝海股权交易中心有限责任公司推荐董事人选的议案。 此外，董事会审阅了董事会审计委员会2022年半年度履职情况报告、2022年半年度反洗钱工作报告；集体学习了2022年上半年监管新规动态。

会议届次	召开日期	披露日期	会议决议
第五届董事会第十一次会议	2022年10月28日	2022年10月29日	<p>审议通过如下议案：</p> <p>1.2022年第三季度报告；</p> <p>2.2022年第三季度风险管理报告；</p> <p>3.2022年第三季度流动性风险管理报告；</p> <p>4.关于公司申请增加上市证券做市交易业务种类的议案；</p> <p>5.关于审议《提请公司董事会授权公司经营管理层委托外部专业机构对公司2022年度合规管理有效性进行全面评估》的议案；</p> <p>6.关于审议国信香港向国信香港融资公司增资3亿港元以及向国信香港经纪公司增资1亿港元的议案；</p> <p>7.关于向国信期货有限责任公司委派董事并推荐总经理人选的议案。</p> <p>此外，董事会审阅了如下议题：2022年前三季度经营工作报告、信息系统安全运行专项报告、董事会审计委员会2022年第三季度履职情况报告。</p>
第五届董事会第十二次会议	2022年11月10日	2022年11月11日	<p>审议通过如下议案：</p> <p>1.关于优化公司组织架构及职能的议案；</p> <p>2.关于向前海股交投资控股（深圳）有限公司推荐董事人选的议案；</p> <p>3.关于聘请国信证券大厦（义乌）物业服务公司招标立项的议案。</p>
第五届董事会第十三次会议	2022年12月30日	2022年12月31日	<p>审议通过如下议案：</p> <p>1.关于公司2022年度有关薪酬事项的议案；</p> <p>2.关于深圳市前海弘泰基金管理有限公司国有股转让的议案。</p>

## （二）董事出席董事会及股东大会的情况

董事出席董事会及股东大会的情况							
董事姓名	本报告期应参加董事会次数	现场出席董事会次数	以通讯方式参加董事会次数	委托出席董事会次数	缺席董事会次数	是否连续两次未亲自参加董事会会议	出席股东大会次数
张纳沙	9	5	4	-	-	否	1
邓 舸	9	5	4	-	-	否	1
姚 飞	9	-	9	-	-	否	1
刘小腊	9	1	8	-	-	否	1
李双友	9	-	9	-	-	否	1
赵 军	9	-	9	-	-	否	1
白 涛	9	-	9	-	-	否	1
郑学定	9	5	4	-	-	否	1
金 李	9	-	9	-	-	否	1

报告期内，不存在董事连续两次未亲自出席董事会的情况。

## （三）董事对公司有关事项提出异议的情况

报告期内，董事对公司有关事项未提出异议。

#### (四) 董事履行职责的其他说明

##### 1. 董事对公司有关建议是否被采纳

报告期内，董事对公司有关建议已被采纳。

##### 2. 董事对公司有关建议被采纳或未被采纳的说明

第五届董事会审计委员会 2022 年第二次会议上，与会董事提出建议：一、建议外部审计工作总结要完整列示审计过程中重点关注的问题，要对内控、舞弊、期后事项等问题作出说明，并尽快提交管理建议书；二、建议公司要对《2021 年度反洗钱工作专项审计报告》及《公司重大事项 2021 年专项检查报告》所披露问题及内部审计工作报告的整改情况在后续审计委员会上做专题汇报。

公司采纳董事提出的重要意见和建议，并予以落实。第五届董事会审计委员会 2022 年第四次会议审阅了《天健会计师事务所 2022 年半年度审阅工作总结》《国信证券 2021 年度内部控制审计管理建议书》《2021 年度内部控制一般缺陷整改情况跟踪检查报告》《2021 年反洗钱专项审计整改情况跟踪检查报告》。

## 七、董事会下设专门委员会在报告期内的情况

委员会名称	成员情况	召开会议次数	召开日期	会议内容	提出的重要意见和建议	其他履行职责的情况	异议事项具体情况(如有)
战略委员会	张纳沙、刘小腊、李双友、金李	第五届董事会战略委员会 2022 年第一次会议	2022 年 3 月 25 日	审议通过如下议案： 1. 关于审议《国信证券股份有限公司“十四五”发展战略规划》的议案； 2. 关于审议《国信证券股份有限公司金融科技“十四五”战略规划》的议案。	公司战略规划编制科学，具有前瞻性，建议公司抓好落实。同时，建议公司持续大力发展金融科技，把金融科技赋能业务作为公司高质量发展的重要推动力，打造创新驱动发展的核心动力。	无	无
		第五届董事会战略委员会 2022 年第二次会议	2022 年 4 月 26 日	审议通过《关于设立资产管理子公司的议案》。	建议公司把握资管行业快速发展的机遇，抓紧推动资管子公司设立进程。	无	无
审计委员会	郑学定、姚飞、赵军、白涛、金李	第五届董事会审计委员会 2022 年第一次会议	2022 年 1 月 24 日	审议通过如下议案： 1. 关于 2021 年度外部审计工作方案的汇报。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无

委员会名称	成员情况	召开会议次数	召开日期	会议内容	提出的重要意见和建议	其他履行职务的情况	异议事项具体情况(如有)
				审议通过如下议案： 1.2021 年度财务报告（经审计）； 2.2021 年度财务决算报告； 3.2021 年度利润分配方案； 4. 关于聘请 2022 年度审计机构及其报酬的议案； 5. 关于 2021 年度关联交易及预计 2022 年度日常关联交易的议案； 6.2021 年年度报告； 7. 天健会计师事务所 2021 年度审计工作总结； 8.2021 年度募集资金存放与使用情况的专项报告； 9.2021 年度募集资金存放及使用情况检查报告； 10.2021 年度内部控制审计报告； 11.2021 年度内部控制评价报告； 12.2021 年度反洗钱工作专项审计报告； 13. 公司重大事项 2021 年专项检查报告； 14.2021 年度内部审计工作报告； 15.2022 年度内部审计工作计划； 16.2021 年度董事会审计委员会履职情况报告。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。建议外部审计工作总结要完整列示审计过程中重点关注的问题，要对内控、舞弊、期后事项等问题作出说明，并尽快提交管理建议书。建议公司要对《2021 年度反洗钱工作专项审计报告》及《公司重大事项 2021 年专项检查报告》所披露问题及内部审计工作报告的整改情况在后续审计委员会上做专题汇报。	无	无
				审议通过如下议案： 1.2022 年第一季度报告； 2.2022 年度财务预算方案； 3.2022 年第一季度内部审计工作报告； 4. 董事会审计委员会 2022 年第一季度履职情况报告。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无
				审议通过如下议案： 1.2022 年半年度报告； 2.2022 年半年度内部审计工作报告； 3. 董事会审计委员会 2022 年半年度履职情况报告。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。建议管理建议书仍需要进一步完善加强，进行相关补充后，再次会上讨论。	听取天健会计师事务所 2022 年半年度审阅工作总结、国信证券 2021 年度内部控制审计管理建议书、2021 年度内部控制一般缺陷整改情况跟踪检查报告、2021 年反洗钱专项审计整改情况跟踪检查报告。	无

委员会名称	成员情况	召开会议次数	召开日期	会议内容	提出的重要意见和建议	其他履行职责的情况	异议事项具体情况(如有)
	郑学定、姚飞、赵军、白涛、金李	第五届董事会审计委员会2022年第五次会议	2022年10月24日	审议通过如下议案： 1.2022年三季度报告； 2.2022年三季度内部审计工作报告； 3.董事会审计委员会2022年三季度履职情况报告； 4.关于2022年债务专项审计报告的议案。	审计委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。 与会委员对管理建议书提出如下要求：一是对子公司中一些长期存在问题，从内控角度提出意见建议；二是要从更高站位，提出一些系统性的意见，审计小组应专题研究管理建议书的内容，提升管理建议书质量。	听取国信证券2021年度内部控制审计管理建议书（修订稿）。	无
	邓舸、姚飞、刘小腊、郑学定	第五届董事会风险管理委员会2022年第一次会议	2022年4月18日	审议通过如下议案： 1.关于审议公司2021年度合规报告的议案； 2.关于审议公司2021年度合规管理有效性评估报告的议案； 3.关于审议公司2021年度风险管理报告的议案； 4.关于审议公司2021年度流动性风险管理报告的议案； 5.关于审议公司2021年度廉洁从业管理情况报告的议案。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取公司2021年度反洗钱工作报告、公司反洗钱专项执法检查处罚结果有关情况报告。	无
风险管理委员会	邓舸、姚飞、刘小腊、郑学定	第五届董事会风险管理委员会2022年第二次会议	2022年4月29日	审议通过如下议案： 1.2022年第一季度风险管理报告； 2.2022年第一季度流动性风险管理报告； 3.2022年度重大风险评估报告。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无
	邓舸、姚飞、刘小腊、郑学定	第五届董事会风险管理委员会2022年第三次会议	2022年8月26日	审议通过如下议案： 1.2022年半年度合规报告； 2.2022年半年度风险管理报告； 3.2022年半年度流动性风险管理报告。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取公司2022年半年度反洗钱工作报告。	无
	邓舸、姚飞、刘小腊、郑学定	第五届董事会风险管理委员会2022年第四次会议	2022年10月28日	审议通过如下议案： 1.2022年三季度风险管理报告； 2.2022年三季度流动性风险管理报告。	风险管理委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	无	无

委员会名称	成员情况	召开会议次数	召开日期	会议内容	提出的重要意见和建议	其他履行职务的情况	异议事项具体情况(如有)
		第五届董事会薪酬与考核委员会	2022年4月8日	审议通过如下议案： 1.2021年度高级管理人员履职情况报告； 2.2021年度高级管理人员履职情况、绩效考核和薪酬情况专项说明； 3.2021年度合规总监考核报告； 4.关于2021年度战略重点工作、风险控制情况和重大风险事项考核评价的议案； 5.关于确定2022年度战略重点工作目标的议案； 6.2021年度独立董事工作报告； 7.2021年度董事履职考核和薪酬情况专项说明。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查董事、高级管理人员的履职履行情况，并对其进行年度考核。	无
薪酬与考核委员会	白涛、郑学定、金李	第五届董事会薪酬与考核委员会	2022年5月26日	审议通过《关于修订〈国信证券股份有限公司经理层成员岗位聘任协议〉的议案》。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	听取公司薪酬管理情况报告。	无
		第五届董事会薪酬与考核委员会	2022年12月23日	审议通过《关于公司2022年度有关薪酬事项的议案》。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查公司2022年度薪酬方案。	无
		第五届董事会薪酬与考核委员会	2022年12月30日	审议通过《关于公司高级管理人员2022年度有关薪酬事项的议案》。	薪酬与考核委员会按照监管法规和议事规则等，同意议案并对相关工作提出意见和建议。	审查公司高级管理人员2022年度薪酬事项。	无

## 八、监事会工作情况

报告期内，监事会对监督事项无异议。

## 九、公司员工情况

### (一) 员工数量、专业构成及教育程度

单位：人

母公司在职员工的数量	11,546
子公司在职员工的数量	643
在职员工的数量合计	12,189
当期领取薪酬员工总人数	12,189
母公司及子公司需承担费用的离退休职工人数	-
专业构成	
类别	人数
财富管理与机构业务	9,198
投资银行	1,115
资产管理	221
投资与交易	239
研究	214
资金财务	140
信息技术	585
法律、合规、风控、稽核	245
其他	232
合计	12,189
教育程度	
类别	人数
博士	79
硕士	3,534
本科	7,814
大专及以下	762
合计	12,189

注：上述员工情况包含公司内退人员 5 人，公司无额外需要承担费用的离退休员工。

### (二) 薪酬政策

公司依据“贯彻稳健经营理念、确保合规底线要求、促进形成正向激励、提升公司长期价值”的原则，持续优化薪酬激励约束机制，将员工专业胜任能力、执业质量、合规情况、业绩情况以及市场水平作为薪酬分配的重要依据；严格落实各项监管要求，根据不同业务风险收益特征、业务周期、岗位重要性等制定差异化的递延支付政策，通过风险扣减、递延发放等机制，实现风险收益的有效捆绑，避免短期激励、过度激励，推动公司稳健长远发展。

公司员工薪酬由工资、津贴补贴与福利构成。公司按照国家有关规定为员工缴纳各项社会保险和住房公积金，同时为提高员工的福利保障水平，公司还为员工提供企业年金。

### （三）培训计划

根据公司“加强多层次、高质量培训,打造学习型组织”的战略要求,以培训为抓手提升组织能力,落实人才队伍培育工程,进一步完善培训体系、提升培训质量、建立柔性培养机制,持续打造具有国信特色的全程培养体系,切实提升人才队伍的政治素养、综合能力和专业水平。将培训作为企业文化传播的重要载体,通过培训促进交流协同、营造柔性合作氛围、赋能组织能力提升,在培训过程中识别和发现人才,提升人才对公司文化的认同感,强化公司的凝聚力和战斗力。

2022年,在公司党委的统筹部署下,积极开展“国信大讲堂”之“高管课堂”系列学习活动、“研究创造价值”专题培训,近15万人次参加学习;坚持多元化创新开展线上“扬帆计划”新员工训练营,助力新人快速融入公司文化,提高职业素质和职业技能,提升企业认同感和归属感;举办公司首届金融科技文化节及“攀登计划(产品经理)训练营”专题培训,旨在激发员工科技创新动力,赋能业务,助力公司推进数字化转型战略,打造一批专业化产品经理队伍;认真选派管理人员及骨干参加上级主管部门、监管部门、培训机构举办的各类学习培训项目,全面提升政治素养和各项业务能力。公司积极运作“国信互学E”在线学习平台,加大线上培训力度,完善知识管理体系,强化组织学习氛围,为人才队伍持续成长发展提供有力保障。

### （四）劳务外包情况

公司不存在劳务外包数量较大的情况。

## 十、委托经纪人从事客户招揽、客户服务相关情况

公司无证券经纪人。

## 十一、公司利润分配及资本公积金转增股本情况

### （一）报告期内利润分配政策，特别是现金分红政策的制定、执行或调整情况

#### 1. 公司股利分配的原则

公司重视对投资者的合理投资回报,保护投资者合法权益,制定持续、稳定、科学的利润分配政策,其中,在制定现金分红政策时,公司将结合所处行业特点、发展阶段和自身经营模式、盈利水平、资金需求等因素,选择有利于投资者分享公司成长和发展结果、取得合理投资回报的现金分红政策。

#### 2. 公司股利分配政策的具体内容和条件

公司实行同股同利的股利分配政策。公司可以采取现金、股票、或者现金和股票相结合的方式分配股利,但应优先采用现金分红的利润分配方式。公司应保持利润分配政策的连续性和稳定性,在具备现金分红条件的情况下,公司将积极采取现金分红政策。在具备利润分配的条件下,公司原则上每年度进行一次利润分配。经董事会和股东大会审议决定,公司可以进行中期利润分配。公司进行现金分红应同时具备以下条件:(1)公司该年度实现的可供现金分配的利润为正值且累计未分配利润为正值;(2)未来十二个月内公司无重大投资计划或重大现金支出等特殊状况发生;(3)公司现金分红方案实施后公司各项风险控制指标符合监管部门规定。在具备上述现金分红条件的情况下,公司每年以现金方式分配的利润不少于当年实现的可供现金分配利润的百分之二十,且在任何三个连续年度内以现金方式累计分配的利润不少于该三年实现的年均可分配利润的百分之三十。若现金充裕,经董事会和股东大会审议决定,公司可根据实际情况提高现金分红比例。

公司可根据需要采取股票股利的方式进行利润分配。公司采取股票方式分配股利的条件为：（1）公司经营情况良好；（2）因公司股票价格与公司股本规模不匹配或者公司有重大投资计划或重大现金支出、公司具有成长性、每股净资产的摊薄等真实合理因素，以股票方式分配股利有利于公司和股东整体利益；（3）公司的现金分红符合有关法律法规及《公司章程》的规定。

#### 现金分红政策的专项说明

是否符合公司章程的规定或股东大会决议的要求：	是
分红标准和比例是否明确和清晰：	是
相关的决策程序和机制是否完备：	是
独立董事是否履职尽责并发挥了应有的作用：	是
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：	是
现金分红政策进行调整或变更的，条件及程序是否合规、透明：	是

#### 1. 公司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红利分配预案

不适用。

#### 2. 董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

每 10 股送红股数（股）	-
每 10 股派息数（元）（含税）	2.70
每 10 股转增数（股）	-
分配预案的股本基数（股）	9,612,429,377
现金分红金额（元）（含税）	2,595,355,931.79
以其他方式（如回购股份）现金分红金额（元）	-
现金分红总额（含其他方式）（元）	2,595,355,931.79
可分配利润（元）	24,083,194,642.51
现金分红总额（含其他方式）占利润分配总额的比例	100%

#### 本次现金分红情况

以 2022 年末总股本 9,612,429,377 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 2.70 元（含税），共派送现金红利 2,595,355,931.79 元，尚未分配的利润 21,487,838,710.72 元转入下一年度。

#### 利润分配或资本公积金转增预案的详细情况说明

经天健会计师事务所（特殊普通合伙）审计，母公司 2022 年度实现净利润 6,200,818,119.96 元。根据《公司法》《证券法》《金融企业财务规则》及公司章程等有关规定，分别提取 10% 的一般风险准备金、10% 的交易风险准备金共计 1,240,163,624.00 元；计提永续次级债券利息 911,500,000.00 元；根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，按照公募基金托管费收入的 2.5% 提取一般风险准备金 411,824.91 元；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，按不低于大集合资产管理业务管理费收入的 10% 计提一般风险准备金 108,090,973.20 元。进行上述利润分配事项后，本年度实现可供投资者分配的利润为 3,940,651,697.85 元。

加上年初未分配利润 24,985,664,357.49 元，减去 2022 年度指定的非交易性权益工具处置转出未分配利润 36,906,724.33 元，减去公司 2022 年已实施的 2021 年度利润分配方案分配的股利 4,806,214,688.50 元，年末累计可供投资者分配的利润 24,083,194,642.51 元。根据相关规定，可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得向股东进行现金分配，年末累计可供分配利润中公允价值变动（税后）为负数，因此，公司 2022 年末可供投资者现金分红部分为 24,083,194,642.51 元。

从公司发展和股东利益等综合因素考虑，公司 2022 年度利润分配方案如下：以 2022 年末总股本 9,612,429,377 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 2.70 元（含税），共派送现金红利 2,595,355,931.79 元，尚未分配的利润 21,487,838,710.72 元转入下一年度。

## 十二、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

报告期内，公司无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

## 十三、报告期内的内部控制制度建设及实施情况

### （一）内部控制建设及实施情况

报告期内，公司根据《公司法》《证券法》《企业内部控制基本规范》及其应用指引、《证券公司内部控制指引》《证券公司监督管理条例》等法律、法规及规章制度，持续推进内部控制制度和体系的建设和完善。公司内部控制体系建设与经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，内部控制制度建设能够合理保证涵盖业务开展的事前、事中、事后等过程，合理保证对重点领域、关键环节的设计健全、执行有效和适时改进。

公司董事会督促、检查和评价公司内部控制制度的建立与执行情况，对内部控制体系的有效性负责。公司监事会对董事会建立和实施内部控制情况进行监督。公司内部控制部门及业务管理部门按照有效制衡、协同配合的原则，对业务开展发挥监督、保障等作用。公司建立内控联席会议机制，对涉及全局性的内控管理事项以及涉及内控部门协同配合的事项进行研究和讨论，并提出解决方案或措施。

公司建立以内控体系建设与监督制度为统领，各项具体操作规范为支撑的内控制度体系，并建立制度定期跟踪评估机制，持续评估管理制度的有效性和全面性，及时做好内控制度的废、改、立工作。

公司开展新业务时，依照法律法规和监管要求，全面评估风险，完善管理制度，优化操作流程，确保主要风险保持可控、可测、可承受。公司各项业务在合规运营的前提下持续、稳定、健康地发展。

公司董事会对公司内部控制评价工作负责，公司内部控制评价工作组由公司内控部门、相关管理部门的业务骨干人员组成，对业务经营、组织管理相关的制度设计及其实际运行的有效性，以及对内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督相关的内控机制设计、运行情况是否完整、持续及适时等情况进行核查及认定。

报告期内，公司内部控制体系在完整性、合规性、有效性等方面不存在重大缺陷。

### （二）报告期内发现的内部控制重大缺陷的具体情况

无。

## 十四、公司报告期内对子公司的管理控制情况

公司已建立完备的子公司管理制度，包括《国信证券股份有限公司子公司管理办法》《国信证券股份有限公司子公司合规管理工作指引》《国信证券股份有限公司子公司风险管理工作指引》《国信证券股份有限公司子公司财务管理办法》《国信证券股份有限公司内部审计制度》，将子公司管理纳入公司统一财务管理和内部审计体系以及统一合规、风险管理体系，从合规、风控、财务、审计等方面对子公司进行有效管控。

报告期内，公司不存在新增子公司的情况。

## 十五、内部控制评价报告或内部控制审计报告

### (一) 内控评价报告

内部控制评价报告全文披露日期	2023年4月29日	
内部控制评价报告全文披露索引	详见2023年4月29日刊登于深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> ) 的《2022年度内部控制评价报告》	
纳入评价范围单位资产总额占公司合并财务报表资产总额的比例	100%	
纳入评价范围单位营业收入占公司合并财务报表营业收入的比例	100%	
<b>缺陷认定标准</b>		
<b>类别</b>	<b>财务报告</b>	<b>非财务报告</b>
定性标准	1. 重大缺陷 A. 董事、监事和高级管理人员的舞弊行为； B. 注册会计师已发现，未被内部控制所识别的当期财务报告的严重错报； C. 对财务报告的内部控制监督为无效。 2. 重要缺陷 A. 没有依照公认会计准则选择和应用会计政策； B. 没有建立和执行反舞弊机制，导致或者未能及时发现关键岗位的舞弊行为； C. 对期末财务报告的内部控制存在缺陷，不能合理保证财务报表的真实、完整。 3. 一般缺陷 未构成重大缺陷、重要缺陷的其他控制缺陷。	1. 重大缺陷 A. 业务经营和内部管理违反法律法规，并且造成严重后果； B. 中高层管理人员流失严重； C. 内部控制系统地严重失效； D. 重要的分公司、子公司缺乏内部控制建设，管理散乱； E. 在内部控制过程中发现的重大或者重要缺陷没有获得整改； F. 对信息披露的内部控制严重失效，导致被监管部门予以严重处罚。 2. 重要缺陷 A. 关键岗位或者关键技能人员流失严重； B. 主要业务存在严重的制度缺陷和执行偏差。 3. 一般缺陷 未构成重大缺陷、重要缺陷的其他控制缺陷。
定量标准	1. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过税前利润的5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入的2%），并且反映为严重偏离公司内部控制目标的，则为重大缺陷； 2. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果超过税前利润的3%但小于5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入1%但小于2%），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的，则为重要缺陷； 3. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的错报金额，如果小于税前利润的3%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为小于营业收入的1%），则为一般缺陷。	1. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过税前利润的5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入的2%），并且反映为严重偏离公司内部控制目标的，则为重大缺陷； 2. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果超过税前利润的3%但小于5%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为超过营业收入1%但小于2%），并且反映为明显偏离公司内部控制目标的，则为重要缺陷； 3. 一项缺陷单独或者连同其他缺陷所导致的损失金额，如果小于税前利润的3%（由于市场环境、行业政策等外部条件而出现利润波动趋势下行时，为小于营业收入的1%），则为一般缺陷。
财务报告重大缺陷数量（个）	无	
非财务报告重大缺陷数量（个）	无	
财务报告重要缺陷数量（个）	无	
非财务报告重要缺陷数量（个）	无	

## （二）内部控制审计报告

### 内部控制审计报告中的审议意见段

国信证券于 2022 年 12 月 31 日按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

内控审计报告披露情况	披露
内部控制审计报告全文披露日期	2023 年 4 月 29 日
内部控制审计报告全文披露索引	详见 2023 年 4 月 29 日刊登于深交所网站 ( <a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.cn</a> ) 的内部控制审计报告 (天健审 [2023]7-435 号)
内控审计报告意见类型	标准无保留意见
非财务报告是否存在重大缺陷	否

会计师事务所未出具非标准意见的内部控制审计报告，出具的内部控制审计报告与董事会的内部控制评价报告意见一致。

## 十六、动态风险控制指标监控和补足机制建立情况

### （一）公司动态的风险控制指标监控机制建立情况

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常监控与分析，及时向监管部门报告风险指标变动及超预警、超标情况；按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等；将新开展业务及时纳入风控指标计算；对监控系统的有效性、准确性进行校对及维护。

### （二）风险控制指标敏感性分析和压力测试情况

公司每年于年初就未来一年业务状况对母公司和集团进行综合性的压力测试，考察风险控制指标承压情况。另外，为做好事前业务规模风险控制，保证公司净资本和流动性风险控制指标任一时点均在安全标准之内，公司设定涵盖多项业务及投资决策的压力测试情景库，并根据风控指标和公司业务状况每半年更新一次。2022 年公司共开展了一次集团年度综合压力测试、一次母公司年度综合压力测试及数次专项压力测试。压力测试结果显示公司和集团各项风控指标在压力情景下处于安全范围内，整体风险可承受。

### （三）资本补足机制

公司正积极按照制定的资本补足规划，有计划地推动公司各类债券发行，积极研究创新债务融资工具，丰富融资方式，以支持业务创新发展并确保净资本等各项风险控制指标持续符合监管要求。

### （四）报告期内风险控制指标达标情况

2022 年，公司以净资本和流动性为核心的风险控制指标整体运行良好。报告期末，母公司净资产为 1,043.84 亿元，较上年末增加 100.55 亿元；净资本为 794.35 亿元，较上年末增加 34.67 亿元；各项风险资本准备之和为 192.28 亿元，较上年末增加 18.81 亿元。风险覆盖率为 413.12%，较上年末减少 24.80 个百分点；资本杠杆率为 15.97%，较上年末减少 3.69 个百分点；流动性覆盖率为 236.62%，较上年末减少 81.63 个百分点；净稳定资金率为 171.89%，较上年末减少 6.64 个百分点。公司各项风险控制指标均符合监管要求。

## 十七、风险管理情况

### （一）全面风险管理概况

报告期内，公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》和《证券公司全面风险管理规范》等监管文件要求，不断提升风险管理工作的专业性，加大合规风控体系建设投入，持续完善全面风险管理工作。在风险计量方面，引入“经济资本”有效计量和评估公司总体风险水平。在限额管理方面，从业务层级精细到投资策略层级，建立规模、风险值、止损、压力测试限额、敏感性等多维度的限额体系。在内部评级方面，采取优化内部评级模型、负面清单管理和授信管理等措施，为公司和客户避免了投资损失。公司定期开展各项风险排查和专项检查，独立研判重大风险；推进风险管理系统建设、数据治理和信息技术风险管理；子公司风险垂直管理不断深入，持续完善并表管理内规制度体系，公司层面制定发布了《子公司风险管理工作指引》《子公司风险管理负责人管理办法》，并向各子公司派出风险管理负责人及监事等，整体达到并表监管各项要求。公司注重培育风险管理文化，不断加大风险管理人财物投入，持续扩大风险管理专业人才队伍。

#### 1. 风险管理组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

##### （1）董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

##### （2）经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

##### （3）独立的风险管理机构

公司风险管理总部、合规管理总部、监察稽核总部等部门作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的全面风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，起草公司整体的风险偏好和容忍度方案，合理配置风险限额。对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行检查和考评。资金运营部、信息技术部门、党群办公室分别牵头开展流动性风险管理、信息技术风险管理、声誉风险管理工作。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对内部控制制度的完整性、合理性及其实施的有效性进行检查和评估。

##### （4）业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

## 2. 风险管理机制

### (1) 全方位的风险管理机制

为推动公司风险管理体系的有效运作，确保公司各项业务经营活动在合规运作及风险可测、可控、可承受的前提下开展，公司制定并实施了涵盖各项业务运营和管理的一整套规章制度，明确了风险管理的目标、原则、组织架构、授权体系、相关职责、基本程序等，并通过事前审核、事中监控、事后检查的一系列执行机制，实现了对公司各项业务的合法性、合规性、风险程度的全方位和系统化的监控、预警、报告和处理。

### (2) 风险管理量化指标体系建设

公司自上而下建立了风险偏好、风险容忍度和风险限额的风险管理量化指标体系。公司董事会负责审批公司风险偏好和风险容忍度（含重大风险限额）。根据董事会确定的风险容忍度，公司建立覆盖“集团-部门及子公司-业务-投资策略”的多层次的风险限额体系，引导资源向收益风险比高的业务配置，有效提升公司风险管理水平和企业价值。

### (3) 压力测试机制

根据《证券公司压力测试指引》，公司制订了《压力测试管理办法》和《压力测试情景库》，明确压力测试触发情景的定性定量标准、压力测试频率、压力测试方案确定、压力测试数据收集方法、压力测试结果分析与反馈、压力测试相关资料的保存与管理均进行了规范，通过建立常规化的压力测试机制有效评估压力情况下公司风险控制指标、各类型风险限额指标的状况。

### (4) 专业人才

公司风险管理总部、各业务部门配备了熟悉证券业务与风险管理技能的专业人员，并提供相应的资源支持。积极引进风险管理高层次人才，不断提升团队专业化水平。

### (5) 系统建设

公司十分重视风险管理系统建设，持续推进各类风险管理信息系统的开发和升级工作，建立并完善与业务复杂程度及风险指标体系相适应的风险管理信息系统，逐步实现对各类风险的准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。报告期内，公司完成了市场风险管理系统五期、信用风险管理系统五期和风险数据集市二期的建设，持续推进风险管理工作平台一期、债券信息平台一期和“鑫智控”企业全景风控平台二期的建设，推进风险数据库建设以及风险数据治理，开展信息技术风险管理、业务连续性体系建设和交易运维管理等。公司将继续加强底层系统建设和集团层面数据治理工作，进一步贯彻和落实全面风险管理以及并表监管的要求。

## 3. 风险管理指标体系

公司对以净资本和流动性为核心的风险控制指标进行日常实时监控与分析，并按月向监管机构上报综合业务报表，包括核心监管报表、自营、资产管理的业务监管报表及专项监管报表等。

公司积极开展并表监管试点申报工作，建立并表口径下的风险控制指标管理体系，进一步提升集团公司层面风险管理能力。

### (二) 公司面临的风险因素及对策

#### 1. 市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益投资业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的

利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，根据各业务的特点不断丰富限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和风险价值（VaR）限额的基础上，逐渐增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母、集中度等限额并进行日常监控。另外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过 VaR 等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR 值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR 模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

## 2. 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或发行人等违约导致损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

- (1) 具有债权性质的债券等投资交易业务；
- (2) 融资融券、约定购回和股票质押式回购等资本中介业务；
- (3) 场外衍生品业务；
- (4) 存放银行的活期存款及定期存款；
- (5) 其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、舆情监控、信用风险计量、限额管理、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务的主要信用风险为发行人违约导致损失的风险。公司通过建立内评系统并采用定性与定量相结合的方法对发行人进行风险评估、对发行人设定投资等级准入标准、持续监控报告发行人资信状况、及时调整负面清单债券的持仓、明确违约处置流程等措施对信用风险进行全程管理。

融资融券、股票质押式回购交易等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理，并适时进行逆周期调节；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 260.77%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 217.39%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 187.42%。

衍生品交易业务存在交易对手于约定日期未履行支付义务的信用风险。对此，公司对交易对手进行评级并授信；寻求资质好的担保方项目进行交易；利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等措施进行风险缓释；明确违约事件、

提前终止事件的处理流程等措施。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中登公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

### 3. 操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面的负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格遵守监管要求，落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理流程相关风险；三是运用关键风险指标开展日常监控，及时预警、处置风险，并加强业务风险检查；四是持续完善风险事件收集机制，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是积极开展风险管理文化宣导，以案例分析、现场培训等多种形式组织公司各部门风险教育培训。

### 4. 流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司流动性风险管理组织架构包括董事会、经理层、资金运营部、风险管理总部、相关部门及子公司等，公司董事会承担流动性风险管理的最终责任，资金运营部是公司流动性风险管理的负责部门，统筹公司资金来源与融资管理。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：（1）积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平。（2）加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。（3）持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。（4）持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。（5）适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和薄弱环节，并制定应对措施。（6）持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

### （三）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控制，不断完善合规管理体系和制度建设，持续提升全面风险管理的能力与水平。2022年，公司合规风控投入为 4.34 亿元，主要包括合规风控人员薪酬、日常运营支出及相关系统建设投入等。

公司以“创新驱动、科技引领、打造世界一流投行信息技术”为战略愿景，金融科技驱动经纪、投行、投资、资本中介、资管等业务数字化转型成效不断显现，信息技术品牌影响力持续提升。2022年，母公司信息技术投入为 10.25 亿元，同比增长 15.13%，主要包括信息系统建设投入、信息技术日常支出及人员薪酬等。

## 十八、合规管理体系建设情况和稽核部门稽核情况

### （一）合规管理体系建设情况

报告期内，公司以持续提高合规管理有效性为目标，推动合规管控机制的完善，不断推进合规管理体系和制度建设。为跟进落实监管规则，制定、修订了多项公司层面的合规内控管理制度，包括《国信证券股份有限公司证券交易行为管理办法》《国信证券股份有限公司经纪类客户证券交易行为管理工作细则》《国信证券股份有限公司各部门、分支机构及子公司合规性专项考核实施细则》《国信证券股份有限公司投资银行类业务聘请第三方机构规范指引》等制度。为进一步落实中国人民银行关于反洗钱的要求，公司制定、修订了《国信证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理制度》《国信证券股份有限公司业务及产品洗钱风险评估实施指引》等反洗钱内控制度。

报告期内，公司持续加强各业务合规管理工作，推动落实各项监管要求。对重点监管规则，组织相关部门进行研究讨论，开展合规培训，及时组织修订相关合规管理制度，督促相关部门完善业务管理制度和流程。公司制定或修订了资管业务、投资银行类业务、融资融券业务、公募基金销售业务、私募产品投资业务、证券投资顾问业务等业务内控管理制度，进一步加强对相关业务条线的合规管理。

报告期内，公司高度重视子公司的合规管理工作，通过合规审查、合规咨询、合规检查、合规培训等措施，有效防范、控制子公司合规管理风险。

报告期内，公司为及时发现和化解风险，开展了多次合规检查，检查事项主要包括客户交易行为管理、反洗钱、适当性管理、员工执业行为、研究业务、投资银行类业务、托管业务等。

报告期内，公司根据日常业务需要及合规风险预防重点，就《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》《中华人民共和国个人信息保护法》、经纪类客户交易行为管理制度修订等开展了法规解读培训，还围绕投资银行类业务、研究业务、场外衍生品业务、公募基金投顾业务、员工执业行为管理、廉洁从业、反洗钱、适当性管理等举行了多场合规培训。

### （二）稽核审计部门的履职情况

公司稽核审计部门作为公司内控监督体系的主要组成部分，对公司财务收支、经济行为、内部控制、风险管理等情况实施独立、客观的检查监督并作出评价和建议，对发现的问题及时进行反映并提出整改意见，对整改落实情况进行跟踪及督导。

报告期内，公司稽核审计部门检查监督覆盖经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资产管理业务等公司主要业务，按照监管规定及公司要求，高质高效地完成稽核审计任务，通过例行审计、离任审计、离岗稽核、专项审计、联合检查、委托审计等方式，保持对公司总部部门、分支机构、子公司的审计覆盖。

报告期内，公司稽核审计部门贯彻风险控制原则，以发现问题、推进整改为目标，加强对公司重要部门的监督，完善对重要岗位及关键人员在履职行为、职业操作、廉洁从业等方面的核查及评价，完善对重要领域及重大风险的深入核查。

报告期内，公司稽核审计部门充分履行内部审计部门在公司治理方面的职责，持续推进公司内部控制体系建设。

报告期内，公司稽核审计部门严格遵循审计程序和质量标准，独立、客观地审查和评价业务经营及内部控制的真实性、合规性、有效性，推进公司完善制度及提升效率。

## 十九、董事会关于内部控制责任的声明

按照企业内部控制规范体系等规定，建立健全和有效实施内部控制，评价其有效性，并如实披露内部控制评价报告是公司董事会的责任。公司监事会对董事会建立和实施内部控制进行监督。公司经营管理层负责组织领导内部控制的日常运行。董事会审计委员会负责审查企业内部控制，监督内部控制的有效实施和内部控制自我评价情况，协调内部控制审计及其他相关事宜等。

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证内部控制评价报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并且对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

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

## 二十、建立财务报告内部控制的依据

公司重视与财务报告相关内部控制制度的建设和完善，根据《会计法》《企业会计准则》及相关财务制度的要求，在业务核算、成本费用支出、财务管理、会计信息系统管理等方面建立了相应的管理制度，并且根据监管要求及时进行修订和完善。

公司采取了建立适当的财务会计组织架构、配备合格的财务会计专业人员、选用恰当的会计政策和合理的会计估计、使用安全的会计核算信息系统等控制措施，保证公司编制的财务报告符合会计准则的要求，能够真实、准确、完整地反映公司财务状况、经营成果等有关信息。

公司财务报告由公司法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名盖章，并且聘请会计师事务所出具独立审计报告。

公司根据财政部、中国证监会 2022 年 3 月 2 日颁布的《关于进一步提升上市公司财务报告内部控制有效性的通知》，结合内部控制缺陷的认定标准，将资金资产活动、收入、成本费用、投资活动、关联交易、重要风险业务和重大风险事件、财务报告编制等 7 个领域纳入财务报告内部控制有效性的评价范围，评价重点包括相关舞弊、错报风险及其控制情况。

报告期内，公司财务报告相关内部控制制度健全，运行情况良好。根据公司财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷的认定情况，于内部控制评价报告基准日，公司不存在财务报告内部控制重大缺陷及重要缺陷。

董事会认为，公司已按照企业内部控制规范体系和相关规定的要求，在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。

## 二十一、上市公司治理专项行动自查问题整改情况

根据中国证监会《关于开展上市公司治理专项行动的公告》（证监会公告[2020]69号）的要求，公司对照上市公司治理专项自查清单，认真梳理查摆存在问题，于 2021 年完成了相关整改工作。详见《国信证券股份有限公司 2021 年年度报告》第四节“二十一、上市公司治理专项行动自查问题整改情况”。

05

环境和  
社会责任



## 一、重大环保问题

### (一) 基本情况

公司及子公司为金融类企业，不属于环境保护部门公布的重点排污单位。报告期内，公司未因环境问题受到行政处罚。

### (二) 报告期内，公司为减少碳排放所采取的措施及效果

国信证券将助力绿色产业发展、创新绿色金融产品和服务确定为战略目标，积极为相关政策规则制定建言献策，发挥研究业务专业优势开展相关产业研究，全方位、多途径满足各级政府及企业的绿色金融需求。详细情况请参见公司于 2023 年 4 月 29 日在深交所网站 (<http://www.szse.cn>) 披露的《国信证券股份有限公司 2022 年度环境、社会及管治报告》。

#### 1. 发挥金融专业作用，促进绿色经济发展

为助力国家“双碳”目标实现，公司不断完善绿色金融产品体系和服务模式，依靠专业优势、不断探索绿色金融创新工作，为经济社会绿色低碳转型提供金融保障。

公司坚持金融服务实体经济，紧盯科技创新企业，通过高质量、全方位的投资银行服务重点支持新一代高新技术产业和战略性新兴产业，包括新能源、节能环保等产业。2022 年，公司开拓绿色股权承销保荐业务、债券承销业务，为污染防治、低碳环保等绿色项目提供融资服务，助力实体经济实现高质量发展。在股权融资服务方面，国信证券完成绿色金融股权融资项目 3 个，募集资金超过 80 亿元，主要涉及新能源、新材料行业，旨在为绿色环保型企业发展提供重要的资金支持。在债权融资服务方面，公司成功发行 17 只绿色债券及清洁能源行业公募 REITs，融资规模约 480 亿元，引导社会资本加大绿色资产投资，为促进绿色经济发展做出贡献。

公司积极参与绿色股权和债券投资，以金融力量实现绿色经济效益，有效服务于国家能源结构转型和绿色发展战略，推动我国碳中和目标的实现。截至 2022 年 12 月 31 日，公司共计持有交易所确认的贴标绿色债券市值规模总计 20.32 亿元，涉及行业主要为交通运输、电力、工业、建筑业、公共事业等。2022 年，国信资本投资于新材料、新能源等绿色领域的资金共 3.18 亿元，为绿色低碳技术发展提供资金支持。

2022 年，国信证券经济研究所积极开展绿色金融、环境分析相关课题研究，对多个 ESG 领域前沿问题进行深入分析，举办多场绿色低碳主题策略会、新能源行业投资论坛、ESG 主题论坛等，邀请学术机构教授、ESG 实践领域专家、投资人和上市公司等，共同探讨 ESG 领域投资机遇及发展展望，为探索完善我国 ESG 体系建设发挥积极作用。

#### 2. 树立绿色经营理念，践行低碳节能环保

国信证券将绿色经营作为目标，积极打造绿色办公环境，提升智能化办公水平，倡导节能减排，做好公司办公场所的治污保洁工作，鼓励员工绿色出行，组织绿色公益行动等，积极创建绿色低碳金融机构。

倡导绿色办公，推进低碳运营。公司积极倡导绿色环保理念，将绿色环保意识贯穿到公司日常经营管理中，持续优化内部资源管控措施。深圳国信金融大厦均使用 LED 照明灯具且实现智能控制，合理布局照明光源，节约用电能耗。大厦的空调系统采用冰蓄冷节能设计，充分利用夜间电网低谷电能进行制冰，白天在用电高峰期融冰放冷，调荷避峰；空调末端采用 VAV 变风量系统并设计计费系统，根据现场人员需求自动有偿供冷，实现高效节能。大厦各楼层公共区域减少灯光开启数量及时间，科学管控电梯运行模式，最大程度节约能源；公共茶室、洗手间、车库水阀等均安装新型节水器，有效避免浪费，实现节约用水。

推进数字化运营，践行节能环保。公司积极推广数字化办公，倡导使用高清视频会议系统、线上培训系统，优化会议和培训管理模式，在提升工作效率的同时，降低运营过程中的能源消耗。公司积极推行无纸化办公，提倡使用电子签名以减少打印，持续推进会计凭证无纸化建设；在服务客户流程中，为投资者开立账户提供无纸化业务，打造绿色高效服务。

## 二、社会责任情况

作为一家上市证券公司，国信证券主动承担金融企业与上市公司的双重社会责任，秉承“合规自律、专业务实、诚信稳健、和谐担当”的文化理念和“创造价值、成就你我、服务社会”的价值观念，在经济、社会、环境等各方面积极履行企业社会责任。

详细情况请参见公司于2023年4月29日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）披露的《国信证券股份有限公司2022年度环境、社会及管治报告》。

## 三、巩固拓展脱贫攻坚成果、助力推进乡村振兴的情况

2022年是我国全面推进乡村振兴关键之年。公司切实提高政治站位，全面贯彻习近平总书记重要讲话精神，坚决落实党和政府及监管部门工作要求，有效地发挥行业特色优势和公司专业优势，积极投身公益帮扶事业，有力支持脱贫攻坚成果巩固，推进乡村振兴战略实施。

2022年，公司积极组织开展8县1镇1村结对帮扶工作，明确帮扶重点和帮扶措施，致力于实施更具实效性、延续性、成长性的帮扶项目。同时，公司持续选派1名第一书记、2名工作队员到汕尾市海丰县大湖镇开展驻镇帮镇扶村工作，扎实推进与深汕合作区赤石镇明热村党支部结对帮扶。报告期内，公司累计实施150个公益帮扶项目，投入公益帮扶资金合计2,118.43万元，切实担当起国有金融企业与上市公司的双重社会责任。

### （一）发挥公司专业优势，创新实施金融帮扶

公司充分利用投行业务优势，发挥资本市场中介机构职能，以产业帮扶为主导，通过加强对帮扶地区重点企业的辅导，继续培育和发展当地特色产业，借助资本市场支持当地产业升级和经济结构转型。2022年，助力贵州省长顺县安达科技新三板定增项目1项，已核准发行金额3.54亿元，正在服务推进脱贫地区IPO项目3个，可转债项目1个，服务县区分布在贵州、西藏、江西等地。

子公司国信期货充分利用期货行业风险管理专长，分散农业生产者的价格风险，稳定基本收益，实现产业精准帮扶。2022年，累计在广西、海南等9省开展24个“保险+期货”项目，承保货值超6亿元，赔付金额近1,400万元。同时，为进一步增强“保险+期货”专业能力，子公司国信期货与西南财经大学大数据研究院建立战略合作关系，依托各自优势资源，共同推动“保险+期货”项目开展，全面推进产教深度融合。在金融扶智方面，子公司国信期货采用“线上+线下”方式在安徽、云南、河南等地脱贫县开展近10场“期货市场服务三农”专题培训，累计培训农户200人次，助力当地农户利用期货工具增强防御市场风险的能力。

2022年，公司还发挥行业研究优势，组建专业调研队伍，在结对帮扶的新疆麦盖提县开展县域经济发展调研，撰写完成专业报告《麦盖提县经济高质量发展研究》，为麦盖提县落实国家乡村振兴战略和促进经济发展贡献国信智慧。

## （二）多元模式开展帮扶，助力实现共同富裕

在多年的帮扶工作中，国信证券始终坚持创新，努力探索多元化的帮扶工作模式，积极开辟新的帮扶路径。2022年，公司继续按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路开展公益帮扶工作，持续在经济、社会、环境等各方面履行企业社会责任。

### 1. 深耕教育帮扶，助推帮扶地区教育事业发展

公司一贯重视教育帮扶工作，积极发挥教育帮扶在巩固脱贫攻坚成果，接续推进乡村振兴工作中的重要作用。2022年，公司继续推进员工志愿者支教项目的落地实施，通过内部自愿报名选拔的方式，派出第八、九批共11名员工志愿者赴新疆麦盖提县开展支教活动。截至2022年末，已累计派出9批共53名员工志愿者，持续加强教育帮扶力度，以先进的教育教学理念和扎实的业务知识，推动提高当地国家通用语言教学水平，提升教学质量，进一步促进民族团结进步和交流交往交融。

此外，公司继续加强对帮扶地区的教育投入，开展了贵州三都县水根村“春晖助学基金”资助项目、新疆麦盖提县乡村学校基层党组织建设及党员培训项目、内蒙古兴和县一中与北京优质高中结对项目等5个教育帮扶项目，投入公益帮扶资金530万元，积极助力帮扶地区改善教育教学条件，提升教育发展水平。2022年4月，公司还积极参与中国证券业协会组织的“中证-爱心成就梦想”志愿者支教活动，选派广州分公司员工为山西省隰县黄土中学学生在线讲授国学课程，有力支持当地教育教学建设。

### 2. 深化产业帮扶，促进帮扶地区发展增收

公司针对部分帮扶地区农副产品缺少规模化、产业化条件及经营管理层面智力支持的情况，通过开展产业帮扶，积极促进各帮扶地区发展增收。2022年，公司向陕西省延长县，河南省桐柏县，云南省西盟佤族自治县、福贡县，新疆英吉沙县、塔什库尔干县及内蒙古兴和县捐赠产业帮扶资金共计409.76万元，进一步加大对当地苹果产业、奶制品加工、安格斯肉牛养殖等产业的精准帮扶力度，助力当地巩固产业振兴成效，助推集体经济发展，促进农户稳定增收。

### 3. 推进消费帮扶，拓宽帮扶地区特色产品销售

公司结合脱贫地区资源优势，着力从拓宽销售渠道、发展特色农业、支持企业生产等方面开展消费帮扶工作，有效助力脱贫地区特色产业发展。2022年公司共计采购脱贫地区特色产品789.98万元，以消费帮扶方式，积极助力广西河池、百色，广东湛江、河源、汕尾，新疆喀什等13省19地的特色产品销售。

### 4. 提振文化帮扶，支持帮扶地区发挥文化建设效能

围绕帮扶地区文化建设，2022年，公司共计捐赠171.60万元，用于支持贵州三都县水各村卯文化风情园基础设施修缮建设项目、三都县里勇民族文化活动场建设项目、新疆塔县提孜那甫乡文化阵地改造提升项目及新疆英吉沙县克孜勒乡库木艾日克村民文化广场提升改造项目，通过改善当地文化设施基础设施建设，进一步支持当地文化振兴，积极开发旅游文化资源，拓展当地集体收入来源。

### 5. 开展民生帮扶，改善帮扶地区生产生活水平

针对部分帮扶地区民生建设需求，2022年公司共计投入资金217.09万元，用于重庆、甘肃、新疆等地民生帮扶，包括道路拓宽和基建工程建设、生活必需品采购、爱心送农资、文化广场提升改造、儿童福利院设备购置、农贸市场改造等，持续助力各帮扶地区短板弱项建设，进一步改善当地人民生产生活水平，为帮扶地区民生事业发展添砖加瓦。

### (三) 精准帮扶成效及其他公益捐赠情况

单位：万元

指标	数量 / 开展情况
<b>一、总体情况</b>	
其中：1. 资金	2,105.73
2. 物资折款	12.70
<b>二、分项投入</b>	
1. 产业发展帮扶	
其中：1.1 产业发展帮扶项目类型（注 1）	农林牧等产业帮扶项目
1.2 产业发展帮扶项目个数	9
1.3 产业发展帮扶项目投入金额	409.76
2. 教育帮扶	
其中：2.1 奖励优秀学生、资助困难学生投入金额	10
2.2 改善帮扶地区教育资源投入金额	520
3. 消费帮扶	
其中：3.1 项目类型（注 2）	认购农副产品
3.2 投入金额	789.98
4. 其他项目	
其中：5.1 项目类型（注 3）	文化、民生及其他公益项目
5.2 投入金额	388.69
<b>三、所获奖项</b>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>🏆 2022 年 1 月，中国网财经发布“2021 中国企业 ESG 实践调研”成果，公司被评为“ESG 最佳社会责任实践企业”。</li> <li>🏆 2022 年 11 月，公司在投资者网主办的“2022 年金桥奖”评选中，荣获 2022 年度杰出社会责任企业奖。</li> <li>🏆 2022 年 12 月，公司在《投资时报》主办的“2022 金禧奖”评选中，荣获 2022 卓越社会责任企业奖。</li> <li>🏆 2022 年 12 月，公司在《中国证券报》主办的“2022 中国证券公司金牛奖”评选中，荣获“证券公司社会责任金牛奖”。</li> <li>🏆 2023 年 1 月，中国网财经发布“中国企业 ESG 实践调研”结果，公司入选“2022 年度 ESG 最佳社会责任（S）实践企业优秀案例”；“支教帮扶新思路，照亮边远地区振兴路”项目获评“2022 年度中国企业 ESG 实践优秀案例”。</li> </ul>	

注 1：公司开展的产业帮扶项目为陕西省延长县苹果产业发展项目、河南省桐柏县埠江镇付楼村有机蔬菜育苗基地建设项目、云南省西盟佤族自治县茶产业发展项目、云南省福贡县黄精种植帮扶项目、新疆英吉沙县英也尔乡荒地村奶制品加工产业发展项目、新疆英吉沙县乌恰镇巴格艾日克村果园更新改造项目、新疆塔什库尔干县班迪尔乡沙棘加工厂建设项目、内蒙古兴和县安格斯肉牛养殖示范基地二期建设项目、内蒙古兴和县养殖技能培训与长期实训项目。

注 2：公司开展的消费帮扶项目主要包括认购公司结对帮扶的新疆麦盖提县、内蒙古兴和县、广东省汕尾市海丰县大湖镇农副产品，认购深圳市对口帮扶地区广西河池、百色特色农副产品及采购其他脱贫地区的农副产品。

注 3：公司开展的文化、民生及其他公益项目主要包括改善乡村基础设施建设，开展文化活动场所修缮，救助自然灾害造成的损害，关心关爱基层困难群众，帮扶孤儿与特殊家庭未成年人等公益项目。

### (四) 后续计划

作为资本市场的建设者和国民经济发展的参与者、推动者，公司将以习近平新时代中国特色社会主义思想为指引，牢记国之大者，继续按照“精准帮扶”与“多元帮扶”双渠道、共提升的思路开展公益帮扶工作，深入实施更具实效性、延续性、成长性的帮扶项目，全面推进乡村振兴，不断增强帮扶地区自我发展能力，助力实现农业农村现代化，在新的征程上更好地履行社会责任。

06

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履行完毕及截至报告期末尚未履行完毕的承诺事项

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
股改承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
资产重组时所作承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
		避免同业竞争的承诺 (首次公开发行)	作为公司控股股东，深投控已向公司出具《避免同业竞争及利益冲突的承诺及约束措施》，承诺：1. 不在中国境内或境外，直接或间接从事与公司相同或相似并构成竞争关系的业务，亦不会直接或间接拥有从事前述业务的企业、其他组织、经济实体的控制权；2. 保证国信证券在资产、业务、财务、人员、机构等方面的独立性，并保证不会利用股东地位促使国信证券股东大会、董事会、监事会、管理层等机构或人员做出损害国信证券及其他股东合法权益的决定或行为；3. 保证不会发生显失公平的关联交易或者通过关联交易损害国信证券及其他股东的合法权益；4. 深投控将促使深投控控制的其他企业按照与深投控同样的标准遵守以上承诺事项。	2014年4月15日	长期	严格履行
首次公开发行或再融资时所作承诺	深投控	股份限售的承诺 (首次公开发行)	如深投控在锁定期满后的两年内减持所持有的国信证券首次公开发行A股股票前已发行股份的，则减持价格不低于发行价，且每年的减持股份数量不超过深投控持有的国信证券首次公开发行A股股票前已发行股份数量的5%。自国信证券上市之日起至深投控减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的，则深投控减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。在锁定期满两年后，如深投控因各种原因需要减持所持有的国信证券首次公开发行A股股票前已发行股份，深投控将严格遵守中国法律法规关于控股股东持股及股份变动的有关规定，规范诚信履行控股股东的义务，并在确定减持时间、方式和价格时充分考虑国信证券股价稳定和中小投资者合法权益。如深投控减持国信证券A股股票的，深投控将在减持前4个交易日通知国信证券，并在减持前3个交易日公告。	2014年4月16日	长期	严格履行

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
		其他承诺 (首次公开发行)	<p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的，深投控将依法购回已转让的原限售股份。深投控将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效之日起 10 个工作日内制定购回已转让的原限售股份的具体方案，并在该方案取得有权机构批准（如需要）后依法实施。深投控购回已转让的原限售股份的价格按照市场情况确定，但每股购回价格将不低于国信证券首次公开发行股票时的发行价并加算同期银行活期存款利息（若需购回的股票有派息、送股、资本公积金转增股本等除权、除息事项的，购回的股份将包括已转让的原限售股份及其派生股份，发行价格将相应进行除权、除息调整）。</p> <p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并致使投资者在证券交易中遭受损失的，深投控将依法赔偿投资者损失。深投控将在有权监管机构或司法机构作出的认定生效后，本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则，按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。如经中国证监会等有权监管机构或司法机构认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的或者致使投资者在证券交易中遭受损失的，并因此触发国信证券回购首次公开发行的全部新股的义务、责任的，或者触发国信证券实际控制人、董事、监事和高级管理人员的赔偿义务、责任的，深投控保证在国信证券股东大会上与上述回购、赔偿有关的议案投票赞成，并将依法督促国信证券及其实际控制人、董事、监事和高级管理人员履行其相关义务和承担相关责任。</p>	2014 年 12 月 17 日	长期	严格履行
	深投控	切实履行填补即期回报措施的承诺 (再融资)	深投控承诺不越权干预公司的经营管理活动，不侵占公司利益。	2018 年 11 月 27 日	长期	严格履行
	深投控	股份锁定的承诺 (再融资)	承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日（2020 年 8 月 14 日）起 60 个月内不进行转让。	2020 年 7 月 24 日	60 个月	严格履行

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
		规范关联交易的承诺 (首次公开发行)	作为公司第二大股东, 华润信托已向公司出具了《关于规范关联交易的承诺函》, 承诺: 1. 不利用股东地位及与公司之间的关联关系损害公司和其他股东的利益; 2. 在与公司发生关联交易时, 将按照公平合理和正常的商业交易条件进行, 将不会要求或接受公司给予比在任何一项市场公平交易中第三者更优惠的条件; 3. 将严格和善意地履行与公司签订的各种关联交易协议, 不会向公司谋求任何超出上述规定以外的利益或收益。	2014年7月 22日	长期	严格履行
	华润信托	股份限售的承诺 (首次公开发行)	如华润信托在锁定期满后两年后需要减持的, 可以任意价格自由减持任何数量的股份。华润信托将在减持前4个交易日通知国信证券, 并在减持前3个交易日公告。自国信证券上市之日起至华润信托减持期间如华润信托有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的, 则华润信托减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。	2014年4月 16日	长期	严格履行
		股份锁定的承诺 (再融资)	承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日(2020年8月14日)起36个月内不进行转让。	2020年7月 24日	36个月	严格履行
	云南合和	股份限售的承诺 (首次公开发行)	如云南合和在锁定期满两年后需要减持的, 可以任意价格自由减持。云南合和将在减持前4个交易日通知国信证券, 并在减持前3个交易日公告。自国信证券上市之日起至云南合和减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的, 则云南合和减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。	2014年4月 16日	长期	严格履行
		股份锁定的承诺 (再融资)	承诺认购国信证券非公开发行股票的获配股份自上市首日(2020年8月14日)起36个月内不进行转让。	2020年7月 23日	36个月	严格履行
	一汽投资	股份限售的承诺 (首次公开发行)	如在锁定期满两年后需要减持的, 可以任意价格自由减持。一汽投资将在减持前4个交易日通知国信证券, 并在减持前3个交易日公告。自国信证券上市之日起至一汽投资减持期间如国信证券有派息、送股、公积金转增股本、配股等情况的, 则一汽投资减持价格下限、减持股份数量上限将根据除权除息情况进行相应调整。	2014年4月 24日	长期	严格履行

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
	国信证券及董事、监事、高级管理人员	其他承诺	<p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，导致对判断国信证券是否符合法律规定的发行条件构成重大、实质影响的，国信证券将依法回购首次公开发行的全部新股。国信证券将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效之日起 10 个工作日内制订回购全部新股的方案，并按照有关法律法规和国信证券章程的规定提交董事会审议，董事会在审议通过后及时提交股东大会审议。国信证券回购股份的价格按照市场情况确定，但每股回购价格将不低于首次公开发行股票时的发行价并加算同期银行活期存款利息之和（若国信证券在首次公开发行股票后有派息、送股、资本公积金转增股本等除权、除息事项的，则回购的股份将包括首次公开发行的全部新股及其派生股份，发行价格将相应进行除权、除息调整）。国信证券将按照届时有效的法律法规及股东大会决议实施回购方案。如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定，国信证券首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并致使投资者在证券交易中遭受损失的，国信证券将依法赔偿投资者损失。国信证券将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效后，本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则，按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。</p> <p>国信证券全体董事、监事和高级管理人员对首次公开发行股票的招股说明书作出如下声明和承诺：</p> <p>“本人确认发行人首次公开发行股票的招股说明书不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。</p> <p>如经中国证监会等有权监管机构或司法机关认定，发行人首次公开发行股票的招股说明书有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并致使投资者在证券交易中遭受损失的，本人将依法赔偿投资者损失。本人将在有权监管机构或司法机关作出的认定生效后，本着简化程序、积极协商、先行赔付、切实保障投资者特别是中小投资者利益的原则，按照投资者直接遭受的可测算的经济损失选择与投资者和解、通过第三方与投资者调解及设立投资者赔偿基金等方式积极赔偿投资者由此遭受的直接经济损失。”</p>	2014 年 4 月 16 日	长期	严格履行

承诺事由	承诺方	承诺类型	承诺内容	承诺时间	承诺期限	履行情况
	国信证券全体董事、高级管理人员	切实履行填补即期回报措施的承诺（再融资）	公司全体董事、高级管理人员承诺： “1、本人承诺不无偿或以不公平条件向其他单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益； 2、本人承诺对个人的职务消费行为进行约束； 3、本人承诺不动用公司资产从事与履行职责无关的投资、消费活动； 4、本人承诺由董事会或薪酬委员会制订的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 5、若公司后续推出股权激励计划，本人承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩； 6、自本承诺出具日至公司非公开发行股票实施完毕前，若中国证监会作出关于填补回报措施及其承诺的其他新的监管规定的，且上述承诺不能满足中国证监会该等规定时，本人承诺届时将按照中国证监会的最新规定出具补充承诺。”	2018年11月26日	长期	严格履行
股权激励承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
其他对公司中小股东所作承诺	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
承诺是否按时履行	是					
如承诺超期未履行完毕的，应当详细说明未完成履行的具体原因及下一步的工作计划	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，公司就资产或项目达到原盈利预测及其原因做出说明**

不适用。

## 二、控股股东及其他关联方对上市公司的非经营性占用资金情况

报告期内，不存在控股股东及其关联方非经营性占用公司资金的情形。

## 三、违规对外担保情况

报告期内，公司不存在违规对外担保情况。

## 四、董事会对最近一期“非标准审计报告”相关情况的说明

不适用。

## 五、董事会、监事会、独立董事对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

不适用。

## 六、与上年度财务报告相比，会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的情况说明

报告期内，公司无重大会计差错更正的情况。因企业会计准则变化引起的会计政策变更如下：

1. 公司自 2022 年 1 月 1 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 15 号》“关于企业将固定资产达到预定可使用状态前或者研发过程中产出的产品或副产品对外销售的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

2. 公司自 2022 年 1 月 1 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 15 号》“关于亏损合同的判断”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

3. 公司自 2022 年 11 月 30 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 16 号》“关于发行方分类为权益工具的金融工具相关股利的所得税影响的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无重大影响。

4. 公司自 2022 年 11 月 30 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 16 号》“关于企业将以现金结算的股份支付修改为以权益结算的股份支付的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

## 七、与上年度财务报告相比，合并报表范围发生变化的情况说明

### （一）合并范围减少情况

报告期内，子公司国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司、深圳市国信大族机器人产业投资基金管理有限公司、深圳市国信众创基金管理有限公司、深圳市国信运通基金管理有限公司及华文弘盛基金管理（珠海）有限公司完成注销，合并范围因此减少。

### （二）纳入合并范围的结构化主体变动情况

公司纳入合并范围的结构化主体主要包括公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。公司综合评估公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使公司面临可变回报的影响重大，并据此判断公司是否为资产管理计划的主要责任人。公司 2022 年度新增 14 个结构化主体纳入合并报表范围，8 个结构化主体清算或持有份额比例下降丧失控制权不再纳入合并报表范围。

## 八、聘任、解聘会计师事务所情况

### （一）现聘任的会计师事务所情况

境内会计师事务所名称	天健会计师事务所（特殊普通合伙）
境内会计师事务所报酬（注）	170 万元
境内会计师事务所审计服务的连续年限	4 年
境内会计师事务所注册会计师姓名	燕玉嵩、黄燕
境内会计师事务所注册会计师审计服务的连续年限	燕玉嵩 2 年、黄燕 4 年

注：为公司年度审计费用，未包括子公司的相关费用。

### （二）聘请内部控制审计会计师事务所、财务顾问或保荐人情况

公司聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）担任公司 2022 年度内部控制审计会计师事务所，审计费用为人民币 40 万元。

## 九、年度报告披露后面临退市情况

不适用。

## 十、公司破产重整，兼并、分立以及子公司、分公司、营业部新设和处置等重大情况

### （一）破产重整相关事项

不适用。

### （二）公司兼并或分立情况

不适用。

### （三）子公司、分公司、营业部新设和处置情况

截至报告期末，公司共设有 4 家全资子公司，相关情况具体请参见第三节“十一、主要控股参股公司分析”；公司共设有 58 家分公司，183 家证券营业部，分布于全国 117 个城市和地区。相关变化情况具体请参见第六节“十六、其他重大事项的说明”。

#### （四）重大的资产处置、收购、置换、剥离情况

不适用。

#### （五）重组其他公司情况

不适用。

## 十一、重大诉讼、仲裁事项

### （一）重大诉讼仲裁事项

报告期内，公司不存在涉及金额占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上且绝对金额超过 1,000 万元的重大诉讼、仲裁事项。

### （二）其他诉讼仲裁事项

自报告期初至本报告披露日，公司新增或前期已披露并发生新进展的、涉案金额超过人民币 1,000 万元的与公司经营业务相关的诉讼、仲裁事项，具体如下：

#### 1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2018 年 10 月起，成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称“华泽钴镍”）部分投资者分别向成都市中级人民法院（以下简称“成都中院”）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。成都中院于 2019 年 8 月 1 日起一审开庭审理，公司于 2020 年 1 月起收到部分案件一审判决后提起上诉。四川省高级人民法院（以下简称“四川高院”）于 2020 年 7 月 7 日对 3 起示范案件二审开庭审理，公司于 2021 年 4 月收到四川高院对 3 起示范案件的二审判决，二审对揭露日等相关认定作出改判，其中，1 起案件判决公司等对华泽钴镍赔付义务 0.33 万元承担连带赔偿责任，2 起案件判决驳回原告诉讼请求。2021 年 12 月 27 日，公司收到最高人民法院驳回 3 名原告再审申请的裁定。依照终审判决的标准，成都中院、四川高院陆续作出 1,737 起生效判决，要求华泽钴镍相关人员、公司等中介机构对华泽钴镍赔付义务合计 12,663.94 万元及诉讼费 231.29 万元承担连带赔偿责任；公司另收到部分案件撤诉裁定。目前有 2 起案件尚未生效，其中：1 起案件（涉诉金额 15,291.92 万元）一审判决驳回原告全部诉讼请求，尚未作出二审判决；1 起案件（涉诉金额 51.68 万元）尚未作出一审判决。另收到 1 起案件原告再审申请（二审判决金额 67.39 万元）。2022 年 3 月起，公司陆续收到成都中院及相关法院对部分案件的执行通知，公司目前已支付合计 12,038.45 万元。

#### 2. 海口农商行与刚泰集团及公司债券交易纠纷案

刚泰集团有限公司（以下简称“刚泰集团”）公开发行 2016 年公司债券（第二期）（以下简称“16 刚集 02”），发行规模为 5 亿元，起息日期为 2016 年 11 月 3 日，期限为 3 年，附第 2 年末投资者回售选择权，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为 5 亿元。2018 年 11 月 3 日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。2019 年 1 月，“16 刚集 02”投资者海口农村商业银行股份有限公司向海南省高级人民法院提起诉讼，要求刚泰集团支付本金、利息、复利及相关费用合计人民币 1.07 亿元，并要求公司承担连带赔偿责任。2022 年 11 月 25 日，本案开庭审理。2023 年 2 月，公司收到海口市中级人民法院《民事裁定书》，准许原告撤回对公司的起诉。

### 3. 公司与刚泰集团债券交易纠纷案

刚泰集团公开发行 2016 年公司债券（第一期），发行规模为 5 亿元，起息日期为 2016 年 9 月 26 日，期限为 3 年，附第 2 年末投资者回售选择权，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为 5 亿元。2018 年 9 月 26 日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。2019 年 1 月 25 日，公司作为授权代表向深圳国际仲裁院提起仲裁，要求刚泰集团支付债券本金、利息、逾期利息等费用合计人民币 5.37 亿元。2019 年 7 月 17 日，本案开庭审理。2019 年 10 月 29 日，深圳国际仲裁院作出裁决，公司胜诉。2020 年 1 月 4 日，公司向上海金融法院申请强制执行。2020 年 5 月 8 日，上海金融法院作出终结本次执行裁定。2020 年 11 月，经公司申请，上海市第三中级人民法院裁定受理刚泰集团破产清算案，公司向破产管理人申报债权并已被确认。2023 年 1 月，公司收到上海市第三中级人民法院《民事裁定书》，宣告刚泰集团破产。

### 4. 公司管理的资产管理计划与康得新集团公司债券交易纠纷案

康得新复合材料集团股份有限公司（以下简称“康得新集团”）2018 年度第一期超短期融资券“18 康得新 SCP001”未按时兑付本金及利息。根据委托人的指令及相关法律法规，公司作为资产管理计划管理人，于 2019 年 7 月 31 日向深圳市罗湖区人民法院代两项资产管理计划提起诉讼，要求康得新集团兑付债券本金、利息及违约金等相关费用合计 6,247.5 万元，案件的最终诉讼结果由委托人承担。2020 年 5 月 9 日，公司收到胜诉判决。案件已进入强制执行程序，2020 年 10 月，执行案件由深圳市罗湖区法院移交至江苏省张家港市人民法院处理。2021 年 12 月 15 日，苏州市中级人民法院公告受理康得新集团破产重整一案，公司向破产管理人申报债权并已被确认。目前康得新集团正在破产重整进程中，尚未确认投资人。

### 5. 公司与腾邦集团股票质押式回购交易纠纷案

2016 年 9 月 29 日、2017 年 8 月 25 日，腾邦集团有限公司（以下简称“腾邦集团”）分别与公司签署《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易，将其所持有的 5,010 万股腾邦国际股票（证券代码：300178）质押给公司，融资人民币 3.17 亿元。腾邦集团未能按期偿还本息，其质押的腾邦国际股票已跌破平仓线并被司法冻结，已构成多重违约。2019 年 8 月 1 日，公司向深圳国际仲裁院提起仲裁，要求腾邦集团偿还未付本金、利息及违约金等合计人民币 3.29 亿元。2020 年 5 月 31 日，本案开庭审理。2020 年 8 月 19 日，公司收到胜诉裁决。2021 年 3 月，腾邦集团收到深圳市中级人民法院《决定书》，决定对腾邦集团启动预重整程序。2021 年 12 月，深圳市中级人民法院裁定不予受理对腾邦集团的破产重整申请。2022 年 4 月，深圳市中级人民法院恢复执行程序。2022 年 8 月，公司收到部分执行款 634.56 万元，目前该案正在继续执行。

### 6. 公司与余某股票质押式回购交易纠纷案

2017 年，公司为浙江聚力文化发展股份有限公司（以下简称“聚力文化”）大股东余某承做 3 笔股票质押业务。该业务由余某持有的约 6,643 万股聚力文化（证券代码：002247）股票作质押担保，由聚力控股集团有限公司作连带责任保证担保。后因余某及聚力控股集团有限公司未能按时偿还本金及利息，公司于 2019 年 8 月向深圳国际仲裁院递交了仲裁申请材料并立案，要求余某、聚力控股支付本金、利息及罚息等合计 4.47 亿元。2020 年 9 月，深圳国际仲裁院对本案作出裁决，支持了公司仲裁请求。2021 年 10 月，该案质押物成功拍卖，共回收款项约 1.19 亿元。目前，公司正通过其他途径、方式继续追偿。

### 7. 公司与钟某股票质押式回购交易纠纷案

北京金一文化发展股份有限公司（以下简称“金一文化”）董事长钟某，于 2016 年 6 月 22 日以其持有的 1,600 万股金一文化股票（证券代码：002721）质押给公司，融资人民币 1 亿元。金一文化股票因价格跌破平仓线构成违约。公司于

2020年1月22日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求钟某偿还本金、利息及违约金等合计10,590万元。案件已于2020年6月29日开庭，因双方无法达成调解协议，仲裁院于7月23日作出生效裁决，支持我方全部仲裁请求。由于钟某在法定履行期内未履行付款义务，公司已于2020年8月6日向北京市第一中级人民法院提出强制执行申请。案件进入执行程序后，通过司法拍卖涉案股票回款5,131.8万元。由于被执行人名下暂无其他可供执行的财产，目前该案已终结本次执行。

#### 8. 公司与何某股票质押式回购交易纠纷案

杭州联络互动信息科技股份有限公司实际控制人何某以其持有的2.86亿股联络互动（证券代码：002280）质押给公司，合计融资8.8亿元。因何某未能按期偿还本息，其质押的联络互动股票价格已跌破平仓线，已构成多重违约。公司于2020年6月30日向深圳国际仲裁院申请仲裁，要求何某偿还本金、利息、违约金等合计9.9亿元，并向湖南省汝城县人民法院提出仲裁财产保全申请。目前，何某名下的财产已被采取保全措施，案件于2020年12月8日开庭，仲裁院于2021年3月31日作出裁决，要求何某向公司支付本金、利息、违约金及仲裁费用约10亿元。因何某怠于履行清偿义务，公司于2021年5月向浙江省杭州市中级人民法院申请强制执行。执行期间，何某向广东省深圳市中级人民法院申请撤销上述仲裁裁决。该案已于2021年6月25日开庭，深圳市中级人民法院于7月3日作出裁定，驳回何某的申请。案件恢复执行后，进入司法拍卖涉案股票阶段。期间，何某与公司达成将部分案涉股票转让后优先清偿欠款的协议。2021年12月下旬，何某以每股3.55元的价格将案涉7,680万股股票转让给第三方，第三方代为清偿欠款本金2.10亿元。2022年12月下旬，何某又分别以每股2.64元和每股2.48元的价格，先后转让47,900,000股和9,753,398股联络互动的股票给第三方，第三方代为向公司清偿本金共计1.44亿元。目前，该案已终结本次执行。

#### 9. 公司与陈某某股票质押式回购交易纠纷案

2016年8月，陈某某及其一致行动人分别与公司签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易，将其所持有的ST柏龙股票（原“柏堡龙”，证券代码：002776）合计约1.69亿股质押给公司，合计融资6.29亿元。因陈某某及其一致行动人履约保障比例跌破警戒线未按时补仓，且未能按期偿还本息，已构成违约，公司于2021年3月向深圳国际仲裁院提起仲裁。2022年1月，公司收到深圳国际仲裁院作出的支持公司仲裁请求的生效裁决。公司已于2022年6月申请强制执行。

#### 10. 公司与刘某等2人基金合同纠纷案

2018年6月，委托人刘某等2人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称“天和盈泰”）、基金托管人国信证券签订了《天和盈泰山一号私募投资基金合同》，刘某等2人出资认购了该基金份额。2019年12月，刘某等2人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计2,204万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于2021年7月9日开庭审理，尚未裁决。

#### 11. 公司与新疆嘉酿投资有限公司融资融券纠纷案

2018年公司作为新疆嘉酿投资有限公司（以下简称“新疆嘉酿”）承做融资融券业务。由于新疆嘉酿信用账户维持担保比例跌破并长期低于平仓线，构成违约。公司于2020年9月16日向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求新疆嘉酿偿还本金、利息、违约金合计人民币14,582万元。案件已于2021年8月4日开庭，公司于2021年12月收到胜诉判决。债务人随后向广东省高级人民法院上诉，目前案件正处于二审阶段。

## 12. 公司与浙江亚厦幕墙有限公司建设工程施工合同纠纷

2013年4月,公司与浙江亚厦幕墙有限公司(以下简称“亚厦公司”)签订了《国信证券大厦(义乌)幕墙工程施工合同》(以下简称“施工合同”),合同总价款5,369.35万元。该工程项目于2014年4月25日开工,并于2016年11月13日竣工,公司已累计支付工程款4,456.26万元。在尾款结算过程中,因双方对减少的工程款是否可以提取30%的奖励,一直存在分歧,导致工程尾款无法结算。亚厦公司于2021年5月起诉公司,要求公司支付工程尾款、变更(增加)工程的造价、优化奖励、现场签证费、利息等费用,合计1,031.82万元。2021年8月2日,该案件在浙江省义乌市人民法院开庭审理,后一审判决公司向亚厦公司支付629.39万元。公司不服该判决,已向浙江省金华市中级人民法院提起上诉,二审法院2022年5月26日出具《民事判决书》维持原判。

## 13. 公司与杭州福安实业有限公司基金合同纠纷案

2017年10月,委托人杭州福安实业有限公司与基金管理人上海拉曼资产管理中心(有限合伙)、基金托管人国信证券签订了《海银拉曼1号债券私募投资基金基金合同》,杭州福安实业有限公司出资认购了该基金份额。2021年5月,杭州福安实业有限公司向上海仲裁委员会提起仲裁,认为管理人利用证券账户进行利益输送、关联交易,管理人的内部人员利用内幕消息提前赎回退出,上述行为严重损害了投资者利益。托管人国信证券对上述行为未尽到托管监督职责。杭州福安实业有限公司要求管理人上海拉曼资产管理中心(有限合伙)、托管人国信证券共同返还投资本金、赔偿投资利息等合计1,479万元。2021年8月10日,该案件在上海仲裁委员会开庭审理。2022年6月7日,仲裁委作出裁决,驳回申请人全部仲裁请求,公司不承担责任。

## 14. 公司与邹平市供电公司保证合同纠纷案

公司以“邹平电力购售电合同债权资产支持专项计划”管理人的名义在深圳市中级人民法院立案起诉邹平市供电公司(以下简称“邹平供电”),请求法院确认专项计划中《担保函》合法有效,邹平供电向公司支付16.42亿元。法院于2021年6月、8月两次组织开庭审理。2022年1月6日,公司收到深圳市中级人民法院送达的(2020)粤03民初4632号民事判决书,判决被告邹平供电于判决生效之日起十五日内支付款项7.05亿元。2022年1月17日,公司收到被告邹平供电上诉状。目前该案仍在广东省高级人民法院二审审理中。

## 15. 亿阳信通投资者与亿阳信通及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年1月起,亿阳信通股份有限公司(以下简称“亿阳信通”)部分投资者分别向北京金融法院、哈尔滨市中级人民法院对亿阳信通及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼,要求亿阳信通赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用,并要求亿阳信通相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至本报告披露日,公司共收到案件182起,涉诉金额合计4,305.93万元。目前案件尚未开庭。

## 16. 柏堡龙投资者与柏堡龙及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022年6月起,广东柏堡龙股份有限公司(以下简称“柏堡龙”)部分投资者分别向广州市中级人民法院对柏堡龙及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼,要求柏堡龙赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用,并要求柏堡龙相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至本报告披露日,公司共收到案件71起,涉诉金额合计8,353.51万元。2023年3月21日,广州中院对部分案件开庭审理。2023年4月21日,公司收到广州中院对6起案件的一审判决,认定公司不承担责任。

### 17. 公司与刘某股票质押式回购交易纠纷案

2017年8月，刘某与公司签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关协议，与公司开展股票质押式回购交易，将其所持有的节能铁汉股票（证券代码：300197.SZ）质押给公司，融资6.97亿元，质押数量约3.4亿股。因刘某未能按期偿还本息，已构成违约，公司于2022年8月向深圳国际仲裁院提起仲裁。2023年2月，公司收到深圳国际仲裁院作出的支持公司仲裁请求的生效裁决。

### 18. 公司与万某等8人、浙江新三板资产管理有限公司基金合同纠纷案

2017年2月，公司为“方际六号并购私募股权投资基金”提供托管服务。2022年10月，公司收到深圳国际仲裁院案件材料，该产品8名投资人为案件申请人，被申请人方为基金管理人浙江新三板资产管理有限公司及基金托管人国信证券。申请人认为基金未按约定投资并因基金管理人挪用而实际损失，基金托管人未履行托管人职责，申请仲裁，请求浙江新三板资产管理有限公司及国信证券连带赔偿各项损失1,375.02万元。目前系列案在仲裁审理过程中，尚未作出裁决。

### 19. 国信金阳与青岛交运仓储合同纠纷案

国信期货全资子公司国信金阳资本管理有限公司（以下简称“国信金阳”）与青岛交运国际物流发展有限公司（以下简称“青岛交运”）签订《仓储保管合同》，合同约定由青岛交运为国信金阳购入的一批天然橡胶提供仓储保管服务。由于青岛交运存在不配合提货的行为已构成违约，国信金阳于2020年8月向青岛市中级人民法院提起诉讼，要求其返还案涉橡胶或赔偿损失合计3,460.36万元。青岛市中级人民法院于2022年2月14日送达一审判决，判令被告青岛交运赔偿国信金阳的损失合计2,768.03万元并负担相应比例的诉讼费用。后双方均提起上诉，山东省高级人民法院于2022年8月12日送达终审民事判决书，判决驳回上诉，维持原判。因青岛交运怠于履行付款义务，国信金阳已于2022年8月23日申请强制执行，案件进入执行程序后，已收到法院划拨的554.22万元执行款。目前案件尚未执行完毕。

### 20. 国信香港与中原实业公司等保证合同纠纷案

云南中原实业集团有限公司（以下简称“中原实业公司”）实际控制人闫泰丞控股的香港SPV公司治吉实业有限公司向国信证券（香港）金融控股有限公司（以下简称“国信香港”）借款，借款金额为6,300万港币，中原实业公司、闫泰丞、闫政柏、闫静兰为保证人。债务人于2016年2月逾期后，多次催收未果，国信香港于2017年1月向云南省高级人民法院提起诉讼，要求中原实业公司、闫泰丞、闫政柏、闫静兰承担保证责任，偿还本息及各类费用合计人民币7,017万元。案件一审于2018年9月29日开庭，2019年9月16日，国信香港收到一审胜诉判决。中原实业公司不服上诉到最高人民法院，案件二审于2020年10月13日开庭，2022年6月15日，国信香港收到终审胜诉判决，案件公告期与履行期于2022年8月届满后，国信香港向云南省高级人民法院申请强制执行。目前案件正处于强制执行阶段，已查封冻结部分财产，收到执行回款人民币24.66万元。

### 21. 国信弘盛与王某股权回购纠纷案

国信弘盛于2010年10月通过直接股权投资的方式，投资河北联冠智能环保设备股份有限公司（曾用名：河北联冠电极股份有限公司），并与王某签署《关于河北联冠电极股份有限公司业绩承诺及投资补偿合同》及相关《补充协议》（以下统称“《股权回购协议》”）。在上述《股权回购协议》约定的股份回购条件成就后，王某未能依约进行回购。国信弘盛向中国国际贸易仲裁委员会（以下简称“贸仲委”）申请仲裁，请求被申请人王某支付股份回购款、逾期付款违约金及律师费等合计10,828.11万元。贸仲委已于2023年1月3日受理仲裁申请立案。

## 十二、处罚及整改情况

1.2022年2月11日，中国人民银行深圳市中心支行对公司出具《行政处罚决定书》（深人银罚[2022]9号）。因公司未按规定对高风险客户采取强化识别措施、与身份不明客户进行交易，中国人民银行深圳市中心支行对公司处以罚款人民币105万元并责令改正。

整改情况：针对发现的问题，公司已按照“严要求、高标准”原则组织相关单位切实整改，完善反洗钱机制建设、制定整改通知与方案、发送合规工作提示函、开展专项检查与培训、组织反洗钱工作全面排查整改、完善反洗钱信息系统等，并已向中国人民银行深圳市中心支行提交整改工作报告。

2.2022年12月13日，浙江证监局对公司出具《关于对国信证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2022]150号），公司作为浙江长兴经开建设开发有限责任公司、桐庐县国有资本投资运营控股集团有限公司公司债券的受托管理人，未严格履行募集资金监督义务，未能发现前述发行人部分公司债券募集资金未按约定用途使用，浙江证监局决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。

整改情况：针对以上事件，公司高度重视、积极部署，第一时间成立专项应急工作小组，及时制定自查整改方案，切实落实整改工作要求，全面排查存量项目募集资金使用及其他潜在风险，全力防范后续监管风险；组织全体员工进行相关法律法规培训，进一步强化员工尽职履责、风险防控意识；加强发行人日常沟通，力争有效提升发行人规范运作水平，并已向浙江证监局提交整改工作报告。

3.国信香港之子公司国信证券（香港）经纪有限公司（以下简称“经纪公司”）于2020年至2021年期间自查发现两起信息技术故障，尽管经纪公司随即采取了补救和整改措施，没有造成不良影响和不利后果，但仍严格遵照香港证券监管规定，主动向香港证监会做了报告。香港证监会对该事项开展了例行调查，并于2022年12月21日正式发布纪律行动声明，对经纪公司作出公开谴责并罚款280万港币。

整改情况：上述事项发生后，国信证券要求国信香港立即进行整改，通过事故复盘、自查、外部审计等多种方式，梳理、排查运营和系统管理方面存在的漏洞，对该事项进行了妥善处理。一是查明原因，主动采取措施及时补救。二是积极应对，聘请外部律师协助处理香港证监会调查。三是引以为戒，聘请专业机构全面排查信息系统风险隐患。四是加大投入，推进国信香港与母公司的信息技术一体化进程。五是严肃问责，坚决杜绝同类情况再次发生。

## 十三、公司及其控股股东、实际控制人的诚信状况

报告期内，公司及控股股东、实际控制人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。

## 十四、重大关联交易

公司严格按照《深圳证券交易所股票上市规则》《国信证券股份有限公司关联交易管理制度》和《国信证券股份有限公司信息披露事务管理制度》等要求规范管理关联交易。公司的关联交易遵循诚实信用、平等自愿、等价有偿、公开、公平、公允的原则。报告期内，公司对2022年度关联交易进行了检查，未发现公司在关联交易管理制度建设、决策程序和信息披露等方面存在不符合现行相关法律法规、规章制度的情况。

报告期内，公司不存在与某一关联方累计关联交易总额在 3,000 万元以上且占公司报告期末净资产值 5% 以上的关联交易。公司根据企业会计准则披露的关联交易情况详见公司 2022 年度财务报表附注“十一、关联方及关联交易”。

### （一）与日常经营相关的关联交易

公司与日常经营相关的关联交易，主要是由于公司向关联方提供证券、期货和金融产品服务等，与关联方开展证券和金融产品交易，承租关联方房屋、通信管道、及接受关联方物业管理服务等。公司 2022 年度日常关联交易根据 2021 年度股东大会审议通过的《关于 2021 年度关联交易及预计 2022 年度日常关联交易的议案》执行。公司 2022 年度预计日常关联交易事项在报告期内的执行情况详见公司于 2023 年 4 月 29 日在深交所网站 (<http://www.szse.cn>) 及指定媒体披露的《2023 年度日常关联交易预计公告》。

### （二）资产或股权收购、出售发生的关联交易

报告期内，公司未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

### （三）共同对外投资的关联交易

报告期内，公司未发生共同对外投资的重大关联交易。

### （四）关联债权债务往来

报告期内，公司与关联方不存在非经营性债权债务往来。

### （五）与存在关联关系的财务公司的往来情况

公司不存在有关联关系的财务公司。

### （六）公司控股的财务公司与关联方的往来情况

公司不存在控股的财务公司。

### （七）其他重大关联交易

报告期内，公司无其他重大关联交易。

## 十五、重大合同及其履行情况

### （一）托管、承包、租赁事项情况

报告期内，公司不存在重大托管、承包、租赁的情况。

## (二) 担保情况

单位：万港元

公司及其子公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）										
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期	实际担保金额	担保类型	担保物（如有）	反担保情况（如有）	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
无	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
公司与子公司之间担保情况										
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期	实际担保金额	担保类型	担保物（如有）	反担保情况（如有）	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
无	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
子公司对子公司的担保情况										
担保对象名称	担保额度相关公告披露日期	担保额度	实际发生日期	实际担保金额	担保类型	担保物（如有）	反担保情况（如有）	担保期	是否履行完毕	是否为关联方担保
国信证券（香港）经纪有限公司	2022年4月19日	25,000	2015年3月23日、2017年7月10日	3,500	一般保证	无	无	自协议签署之日起，至被担保人履行完毕责任为止。	否	否
国信证券（香港）金融产品有限公司	2022年4月19日	20,000	2015年3月23日、2015年6月30日、2017年7月10日、2018年8月2日、2018年7月28日、2019年4月23日	16,500	一般保证	无	无	自协议签署之日起，至被担保人履行完毕责任为止。	否	否
报告期内审批对子公司担保额度合计		45,000		报告期内对子公司担保实际发生额合计			-			
报告期末已审批的对子公司担保额度合计		45,000		报告期末对子公司实际担保余额合计			20,000			
公司担保总额										
报告期内审批担保额度合计		45,000		报告期内担保实际发生额合计			-			
报告期末已审批的担保额度合计		45,000		报告期末实际担保余额合计			20,000			
实际担保总额占公司净资产的比例				0.17%						
其中：										
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（1）				-						
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（2）				20,000						
担保总额超过净资产50%部分的金额（3）				-						
上述三项担保金额合计（1+2+3）				20,000						
对未到期担保，报告期内已发生担保责任或可能承担连带清偿责任的情况说明				不适用						
违反规定程序对外提供担保的说明				不适用						

公司第五届董事会第七次会议于 2022 年 4 月 29 日审议通过《关于设立资产管理子公司的议案》，同意根据监管要求与资管子公司风险控制指标情况，为拟设立的资管子公司提供累计不超过人民币 30 亿元（含）的净资本担保承诺。净资本担保承诺的有效期自资管子公司成立之日起至其资本状况能够持续满足监管机构要求时止。

公司不存在采用复合方式担保的情况。

### （三）委托他人进行现金资产管理情况

#### 1. 委托理财情况

不适用。

#### 2. 委托贷款情况

报告期内，公司不存在委托贷款。

### （四）其他重大合同

报告期内，公司不存在其他重大合同。

## 十六、其他重大事项的说明

### （一）公司主要办公地址的变更情况

公司于 2022 年 1 月 22 日将主要办公地址搬迁至深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦。具体内容详见公司于 2022 年 1 月 22 日在深交所网站（<http://www.szse.cn>）及指定媒体披露的相关信息。

### （二）证券营业网点的情况

截至报告期末，公司共设有 58 家分公司，183 家证券营业部，分布于全国 117 个城市和地区。报告期内，公司营业网点的新设和变更情况如下：

#### 1. 营业网点的新设

报告期内，公司完成 1 家分公司的筹建，并获得《经营证券期货业务许可证》，具体情况如下：

序号	分公司名称	营业地址	《经营证券期货业务许可证》获取时间
1	浙江自贸区分公司	中国（浙江）自由贸易试验区舟山市普陀区东港街道文康街 53 号、55 号	2022 年 6 月 1 日
2	成都天府三街证券营业部	中国（四川）自由贸易试验区成都高新区天府三街 199 号 1 栋 A 区 1 层 101-2 单元、B 区 5 层 B6 单元	2022 年 4 月 1 日
3	深圳光明证券营业部	深圳市光明区凤凰街道东坑社区光明大道 481 号乐府广场购物城 W-1007、乐府广场 1B2509-2510	2022 年 9 月 28 日

## 2. 营业网点的变更

序号	变更类型	变更后	变更前
1		广州东风中路证券营业部 地址：广州市越秀区东风中路 389 号 1501-1508 房	广州东风中路证券营业部 地址：广州市越秀区东风中路 439 号 504 至 510 房
2		乐清旭阳路证券营业部 地址：浙江省乐清市城南街道旭阳路 777 号国宾 1 号花园 6 幢二楼 201 室	乐清旭阳路证券营业部 地址：浙江省乐清市乐成街道阳光大厦 1 幢 7 至 9 号
3	迁址	长沙五一大道证券营业部 地址：湖南省长沙市芙蓉区五一大道 766 号中天广场 10050、10051 号房	长沙五一大道证券营业部 地址：湖南省长沙市五一大道 766 号中天广场写字楼 8 楼
4		烟台分公司 地址：山东省烟台市经济技术开发区珠江路 66 号正海大厦 104、1709、1710 室	烟台分公司 地址：山东省烟台市高新技术产业开发区科技大道 69 号创业大厦西塔 2 层
5		深圳分公司 地址：深圳市福田区华强北街道华航社区华富路 1018 号中航中心西座 21 层 01、03-08 单元	深圳分公司 地址：深圳市南山区粤海街道海珠区海德三道 126 号卓越前海金融中心 2504-2508
6		梅州彬芳大道证券营业部 地址：梅州市江南彬芳大道变电站侧 B 栋第一层	梅州人民南路证券营业部 地址：广东省梅州市梅县区大新城人民南路华益花园 B4 栋、B5 栋 18 号复式店铺、B4 栋 501、502 房
7		深圳滨海大道证券营业部 地址：深圳市南山区粤海街道滨海社区海天二路 19 号盈峰中心 101、十层 1001 号	深圳中心路证券营业部 地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路 3233 号深圳湾一号 T1C 座 6A602
8		重庆泰昌路证券营业部 地址：重庆市南岸区泰昌路 64 号 3-15、3-16、3-17 号	重庆江南大道证券营业部 地址：重庆市南岸区江南大道 8 号 2 栋 27 层办公 1 号 -2 号
9		佛山顺德乐从大道证券营业部 地址：广东省佛山市顺德区乐从镇乐从社区居民委员会乐从大道东 B268 号佛山奥园奥林匹克中心 8、9、28、29 号商铺	佛山平洲南港路证券营业部 地址：广东省佛山市南海区桂城街道平洲南港路 4 号南港名轩 135、136、137 铺
10	迁址并更名	北京自贸试验区永丰证券营业部 地址：北京市海淀区丰豪东路 9 号院 2 号楼 5 单元 1 层 102 号、3 单元 3 层 301	北京甘家口证券营业部 地址：北京市海淀区三里河路 13 号 10 层
11		岳阳大道证券营业部 地址：湖南省岳阳市岳阳楼区金鹗东路 70 号邹源综合楼 101 室	岳阳建湘路证券营业部 地址：湖南省岳阳市岳阳楼区建湘路 366 号中建岳阳中心第 003 栋 21 层
12		烟台环山路证券营业部 地址：山东省烟台市芝罘区环山路 96 号第一国际 2405-2412 室	烟台南大街证券营业部 地址：山东省烟台市芝罘区南大街 213 号华天大厦 5 楼
13		宜宾戎州路营业部 地址：四川省宜宾市叙州区南岸航天路中段宜都莱茵河畔丽江湾戎州路东段 39-40 幢 1-2 层 16 号商铺	宜宾航天路营业部 地址：四川省宜宾市叙州区南岸航天路中段宜都莱茵河畔小区叙府东路雪 1 幢 2 楼 83-1 号
14		韶关惠民南路证券营业部 地址：广东省韶关市武江区惠民南路 50 号中环广场一楼临街商铺 A1、四楼东北商铺 D1	韶关沿江西路证券营业部 地址：广东省韶关市武江区沿江西路芙蓉新城鸿泰花园 A1 幢首层 6 号商铺
15		佛山南海大沥证券营业部 地址：广东省佛山市南海区大沥镇竹基南路 1 号华亚国际金融大厦十三楼 1303、1304、1305 单元及一楼大堂南区（住所申报）	广东南海分公司 地址：广东省佛山市南海区大沥镇竹基南路 1 号华亚国际金融大厦十三楼 1303、1304、1305 单元及一楼大堂南区（住所申报）
16	更名	粤西分公司 地址：广东省佛山市顺德区大良德和居委会国泰南路 3 号保利商贸中心 1 栋 10 层办公室 1001-1012 单元	顺德分公司 地址：广东省佛山市顺德区大良德和居委会国泰南路 3 号保利商贸中心 1 栋 10 层办公室 1001-1003 及 1008-1012 单元
17		佛山分公司 地址：广东省佛山市禅城区季华六路三号一区 2 座 24 楼	佛山禅城分公司 地址：广东省佛山市禅城区季华六路三号一区 2 座 24 楼

### 3. 营业网点的撤销

序号	营业网点名称	地址
1	瓦房店五一路证券营业部	辽宁省瓦房店市文兰办事处五一路一段 77-6 幢 7 号
2	齐齐哈尔兴隆路证券营业部	黑龙江省齐齐哈尔市建华区玉坤小区 13 号楼 2-3 层 2 号
3	乌鲁木齐中山路证券营业部	新疆乌鲁木齐市天山区中山路 433 号旺德福大酒店十六层南向半层
4	银川天平街证券营业部	宁夏银川市兴庆区上海路北侧,天平街西侧粹园 12 号商业楼 110(复式)室二层、111(复式)室二层

### (三) 账户规范情况

公司严格执行中国人民银行、中国证监会、证券登记结算机构及公司内部的各项账户管理规定。在证券账户及资金账户开销户各环节,严格落实账户实名制管理、认真履行客户身份识别义务、税收居民身份识别等要求及风险控制措施,杜绝新增不合格账户;明确各类特殊个人、机构或产品开户的要求,确保各类账户开户规范;进一步优化手机、VTM 及柜台操作系统中的关键控制节点,有效防范账户业务风险。

报告期内公司持续推进不合格账户、休眠账户、风险处置账户等账户规范工作,截至 2022 年末,公司不合格证券账户 3,878 户,比去年同期减少 12 户;不合格资金账户 30,189 户,比去年同期减少 41 户;休眠证券账户 608,473 户,比去年同期减少 468 户;休眠资金账户 551,549 户,比去年同期减少 385 户;风险处置证券账户 1,179 户,风险处置资金账户 33 户,与去年同期相比无新增风险处置账户。

## 十七、公司子公司重大事项

### (一) 国信弘盛

2022 年 3 月 30 日,国信弘盛住所变更为“深圳市罗湖区桂园街道红村社区红岭中路 1012 号国信证券 1601”;2022 年 4 月 20 日,国信弘盛召开董事会审议通过《关于选举公司董事长并任命公司法定代表人的议案》,选举成飞先生为国信弘盛董事长,并根据《国信弘盛私募基金管理有限公司章程》规定由其担任法定代表人。上述工商变更登记手续已完成,并取得了新的营业执照。

根据国信弘盛第五届董事会第三次会议审议通过的《国信弘盛私募基金管理有限公司自有资金直接投资项目规范整改方案》(以下简称《方案》),国信弘盛《方案》所列范围内的自有资金投资项目,按不超过 2021 年 10 月 31 日资产账面净值 125,229.37 万元,实质性转移给国信资本。报告期内,国信弘盛已完成相关划转工作。

### (二) 国信期货

2022 年 11 月 23 日,国信期货召开董事会审议通过《关于更换董事的说明暨聘任总经理的议案》,聘任黄巍先生担任国信期货总经理,余晓东先生不再担任国信期货总经理职务。根据《国信期货有限责任公司章程》,自黄巍先生担任国信期货总经理之日起,同时担任国信期货法定代表人。上述工商变更登记手续已完成,并取得了新的营业执照。

截至报告期末,国信期货共设有 22 家期货营业网点,包括 7 家期货分公司、15 家期货营业部,分布于全国 19 个城市。报告期内,国信期货营业网点的变更情况如下:

### 1. 营业网点的新设

序号	营业网点名称	营业地址	《经营证券期货业务许可证》获取时间
1	重庆分公司	重庆市两江新区大竹林街道黄山大道中段 53 号 双鱼座 A 座 9 层 907 号	2022 年 9 月 14 日
2	青岛分公司	山东省青岛市崂山区仙霞岭路 31 号国信金融中心 2 号楼 1609 室	2022 年 11 月 22 日

### 2. 营业网点的变更

序号	变更类型	变更后	变更前
1		南阳营业部 河南省南阳市宛城区孔明路以西建业凯旋广场 20 号楼 6 层 615-A	南阳营业部 南阳市卧龙区卧龙路 382 号 5 层西区
2	迁址	武汉营业部 武汉市江汉区中央商务区泛海国际 SOHO 城第 3,4,6 栋 4 号楼 9 层 9 号房	武汉营业部 武汉市江汉区泛海国际 SOHO 城（一期）2 幢 12 层 5 号房
3		郑州营业部 河南省郑州市金水区未来路街道未来路 69 号未 来公寓 1205、1216、1303、1402、1507 房间	郑州营业部 郑州市未来路 69 号未来公寓 12 层 1205、 1216 房间

### （三）拟设立资管子公司的相关事项

经公司 2021 年度股东大会审议，同意公司出资不超过人民币 15 亿元（含）（其中初始注册资本人民币 10 亿元），设立全资子公司国信证券资产管理有限公司（暂定名，以下简称“资管子公司”），从事证券资产管理业务、公开募集证券投资基金管理业务以及监管机构核准的其他业务，其中公开募集证券投资基金管理业务资格待相关法规出台后予以申请。资管子公司的名称及经营范围以监管机构和登记机关核准内容为准。目前，中国证监会已受理公司设立资管子公司的申请，相关工作正在稳步推进中。

## 十八、报告期内各单项业务资格的变化情况

详见本报告第二节“五、各单项业务资格”。

07

股份变动  
及股东情况



## 一、股份变动情况

### (一) 股份变动情况

单位：股

项目	本次变动前		本次变动增减(+,-)					本次变动后	
	数量	比例	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例
<b>一、有限售条件股份</b>	785,310,733	8.17%	-	-	-	-	-	785,310,733	8.17%
1. 国家持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 国有法人持股	785,310,733	8.17%	-	-	-	-	-	785,310,733	8.17%
3. 其他内资持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：境内法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 外资持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>二、无限售条件股份</b>	8,827,118,644	91.83%	-	-	-	-	-	8,827,118,644	91.83%
1. 人民币普通股	8,827,118,644	91.83%	-	-	-	-	-	8,827,118,644	91.83%
2. 境内上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 境外上市的外资股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>三、股份总数</b>	9,612,429,377	100.00%	-	-	-	-	-	9,612,429,377	100.00%

#### 1. 股份变动的的原因

不适用。

#### 2. 股份变动的批准情况

不适用。

#### 3. 股份变动的过户情况

不适用。

4. 股份变动对最近一年和最近一期基本每股收益和稀释每股收益、归属于公司普通股股东的每股净资产等财务指标的影响

不适用。

#### 5. 公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

不适用。

### (二) 限售股份变动情况

不适用。

## 二、证券发行与上市情况

### (一) 报告期内证券发行（不含优先股）情况

不适用。

### (二) 公司股份总数及股东结构的变动、公司资产和负债结构的变动情况说明

不适用。

### (三) 现存的内部职工股情况

不适用。

## 三、股东和实际控制人情况

### (一) 公司股东数量及持股情况

单位：股

报告期末 普通股股东总数	108,505 户	年度报告 披露日前 上一月末 普通股股 东总数	103,655 户	报告期末表 决权恢复的 优先股股东 总数	-	年度报告披露日前 上一月末表决权恢 复的优先股股东总 数	-
前 10 名股东持股情况							
股东名称	股东性质	持股 比例	报告期末持股 数量	报告期内增 减变动情况	持有有限售条件 的股份数量	持有无限售条件 的股份数量	质押、标 记或冻结 情况
深投控	国有法人	33.53%	3,223,114,384	-	473,587,570	2,749,526,814	无
华润信托	国有法人	22.22%	2,136,079,467	81,192,600	74,858,757	2,061,220,710	无
云南合和	国有法人	16.77%	1,611,627,813	-	236,864,406	1,374,763,407	无
全国社会保障基金 理事会	国有法人	4.75%	456,690,209	-	-	456,690,209	无
北京城建	国有法人	2.94%	282,550,000	-	-	282,550,000	无
一汽投资	国有法人	2.67%	256,579,219	-	-	256,579,219	无
香港中央结算有限 公司	境外法人	0.92%	88,121,221	7,341,758	-	88,121,221	无
中国证券金融股份 有限公司	国有法人	0.78%	75,086,423	-	-	75,086,423	无

中国建设银行股份有限公司 - 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	其他	0.60%	57,658,592	191,400	-	57,658,592	无
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	0.50%	48,429,503	-	-	48,429,503	无
战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东的情况	全国社会保障基金理事会因认购公司非公开发行 A 股股票 456,690,209 股，认购股数占公司发行后总股本的 4.75%，于 2020 年 8 月成为公司前 10 名股东。						
上述股东关联关系或一致行动的说明	公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49% 的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。						
上述股东涉及委托 / 受托表决权、放弃表决权情况的说明	不适用。						
前 10 名股东中存在回购专户的特别说明	无。						
其他情况说明	公司第二大股东华润信托以其持有的公司无限售流通股与证券公司开展转融通证券出借交易。截至 2022 年末，华润信托已开展的尚在出借期限内交易合计出借股数为 918,400 股，较 2021 年年末尚在出借期限内的出借股数 82,111,000 股减少 81,192,600 股。						
<b>前 10 名无限售条件股东持股情况</b>							
股东名称	报告期末持有无限售条件股份数量	股份种类					
		股份种类	数量				
深投控	2,749,526,814	人民币普通股	2,749,526,814				
华润信托	2,061,220,710	人民币普通股	2,061,220,710				
云南合和	1,374,763,407	人民币普通股	1,374,763,407				
全国社会保障基金理事会	456,690,209	人民币普通股	456,690,209				
北京城建	282,550,000	人民币普通股	282,550,000				
一汽投资	256,579,219	人民币普通股	256,579,219				
香港中央结算有限公司	88,121,221	人民币普通股	88,121,221				
中国证券金融股份有限公司	75,086,423	人民币普通股	75,086,423				
中国建设银行股份有限公司 - 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	57,658,592	人民币普通股	57,658,592				
中央汇金资产管理有限责任公司	48,429,503	人民币普通股	48,429,503				
前 10 名无限售流通股股东之间，以及前 10 名无限售流通股股东和前 10 名股东之间关联关系或一致行动的说明	公司控股股东深投控持有公司第二大股东华润信托 49% 的股权。因此，深投控与华润信托具有关联关系。除上述内容以外，公司未获知其余股东是否存在关联关系或一致行动。						
前 10 名普通股股东参与融资融券业务情况说明	公司前 10 名普通股股东未参与融资融券业务。						

公司前 10 名普通股股东、前 10 名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

## (二) 持股 10% (含 10%) 以上的前 5 名股东情况

### 1. 法人

股东名称	法定代表人	总经理	成立日期	统一社会信用代码	注册资本 (万元)	主营业务
深投控	何建锋	王文杰	2004年10月13日	914403007675664218	3,050,900	银行、证券、保险、基金、担保等金融和类金融股权投资的投资与并购；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营业务；开展战略性新兴产业领域投资与服务；通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理；市国资委授权开展的其他业务。
华润信托	刘小腊	-	1982年8月24日	914403001921759713	1,100,000	资金信托；动产信托；不动产信托；有价证券信托；其他财产或财产权信托；作为投资基金或者基金管理公司的发起人从事投资基金业务；经营企业资产的重组、购并及项目融资、公司理财、财务顾问等业务；受托经营国务院有关部门批准的证券承销业务；办理居间、咨询、资信调查等业务；代保管及保管箱业务；以存放同业、拆放同业、贷款、租赁、投资方式运用固有财产；以固有财产为他人提供担保；从事同业拆借；法律法规规定或中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。
云南合和	毕凤林	李泓燊	2014年12月31日	915300003253027445	600,000	实业投资、项目投资及对所投资项目进行管理。

### 2. 自然人

报告期内持股 10% (含 10%) 以上的前 5 名股东无自然人。

## (三) 公司控股股东情况

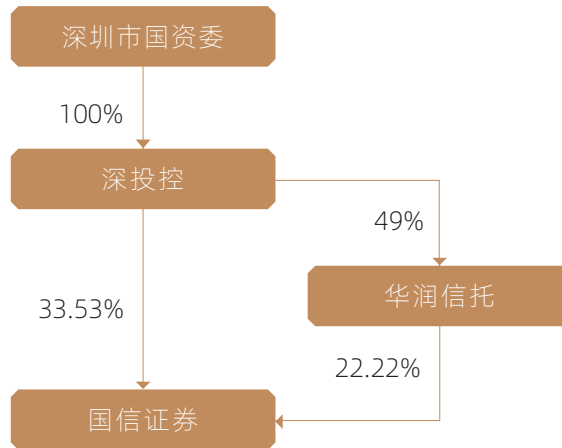
控股股东名称	控股股东性质	控股股东类型	法定代表人 / 单位负责人	成立日期	统一社会信用代码	主要经营业务
深投控	地方国有控股	法人	何建锋	2004年10月13日	914403007675664218	银行、证券、保险、基金、担保等金融和类金融股权投资的投资与并购；在合法取得土地使用权范围内从事房地产开发经营业务；开展战略性新兴产业领域投资与服务；通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理；市国资委授权开展的其他业务。
控股股东报告期内控股和参股其他境内外上市公司的情况 湾区发展 (0737.HK)，持股比例 71.83%；深深房 (000029.SZ)，持股比例 62.13%；深物业 (000011.SZ)，持股比例 50.57%；深高速 (600548.SH)，持股比例 74.39%；深纺织 (000045.SZ)，持股比例 46.21%；深圳国际 (0152.HK)，持股比例 44.35%；深赛格 (000058.SZ)，持股比例 24.22%；深水规院 (301038)，持股比例 37.50%；英飞拓 (002528.SZ)，持股比例 26.35%；怡亚通 (002183.SZ)，持股比例 14.96%；天音控股 (000829.SZ)，持股比例 19.03%；深天地 A (000023.SZ)，持股比例 5.91%；国泰君安 (601211.SH, 2611.HK)，持股比例 8.00%；中国平安 (601318.SH)，持股比例 5.27%；铁汉生态 (300197.SZ)，持股比例 4.04%；深圳能源 (000027.SZ)，持股比例 0.14%；交通银行 (601328.SH)，持股比例 0.01%。						

报告期内，公司控股股东未发生变更。

#### (四) 公司实际控制人及其一致行动人

实际控制人名称	实际控制人性质	实际控制人类型	法定代表人 / 单位负责人	成立日期	统一社会信用代码	主要经营业务
深圳市国资委	地方国资管理机构	法人	王勇健	2004年7月30日	11440300K317280672	不适用。
实际控制人报告期内控制的其他境内外上市公司的股权情况		不适用。				

报告期内，公司实际控制人未发生变更。截至报告期末，公司与实际控制人之间的产权及控制关系图如下：



实际控制人未通过信托或其他资产管理方式控制公司。

#### (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%

不适用。

#### (六) 其他持股在 10% 以上的法人股东

公司无其他持股在 10% 以上的法人股东。

#### (七) 控股股东、实际控制人、重组方及其他承诺主体股份限制减持情况

公司控股股东深投控，股东华润信托、云南合和、一汽投资等承诺主体已作出相关股份限售、不减持承诺，详见本报告第六节“一、承诺事项履行情况”。

## 四、股份回购在报告期的具体实施情况

### (一) 股份回购的实施进展情况

不适用。

### (二) 采用集中竞价交易方式减持回购股份的实施进展情况

不适用。

08

## 优先股 相关情况



公司未发行优先股。

09

债券  
相关情况



## 一、企业债券

报告期内，公司不存在企业债券。

## 二、公司债券

### (一) 公司债券基本信息

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第一期)	19国信01	114429	2019年3月7日	2019年3月11日	2022年3月11日	-	4.05	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第二期)	19国信02	114457	2019年4月3日	2019年4月8日	2022年4月8日	-	4.00	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第三期)	19国信03	114512	2019年7月3日	2019年7月4日	2022年7月4日	-	4.00	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司2020年非公开发行公司债券(第一期)	20国信01	114650	2020年1月9日	2020年1月13日	2023年1月13日	-	3.60	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司2020年非公开发行公司债券(第二期)	20国信02	114673	2020年2月27日	2020年3月2日	2023年3月2日	-	3.17	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司2020年非公开发行永续次级债券(第一期)	20国信Y1	115117	2020年7月9日	2020年7月13日	-	50	4.50	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司非公开发行2020年永续次级债券(第二期)	20国信Y2	115119	2020年9月15日	2020年9月17日	-	50	4.80	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	20国信04	149326	2020年12月9日	2020年12月14日	2022年12月14日	-	3.60	已按时兑付本金及利息。	深交所

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司2020年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	20国信06	149335	2020年12月17日	2020年12月22日	2023年12月22日	20	3.70	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	21国信01	149374	2021年1月27日	2021年2月1日	2022年2月11日	-	3.15	已按时兑付本金及利息。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	21国信02	149375	2021年1月27日	2021年2月1日	2024年2月1日	20	3.64	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司非公开发行2021年永续次级债券(第一期)	21国信Y1	115123	2021年4月8日	2021年4月12日	-	50	4.55	在不行使递延支付利息权的情况下,每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司非公开发行2021年永续次级债券(第二期)	21国信Y2	115124	2021年4月22日	2021年4月26日	-	50	4.38	在不行使递延支付利息权的情况下,每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	21国信03	149535	2021年7月2日	2021年7月6日	2024年7月6日	20	3.35	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	21国信04	149536	2021年7月2日	2021年7月6日	2026年7月6日	30	3.68	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	21国信05	149557	2021年7月19日	2021年7月21日	2024年7月21日	24	3.16	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	21国信06	149558	2021年7月19日	2021年7月21日	2026年7月21日	33	3.48	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	21国信07	149544	2021年9月13日	2021年9月15日	2024年9月15日	27	3.09	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种一)	21国信10	149673	2021年10月20日	2021年10月22日	2024年10月22日	40	3.28	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第五期)(品种二)	21国信11	149674	2021年10月20日	2021年10月22日	2026年10月22日	10	3.63	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	21国信12	149709	2021年11月19日	2021年11月23日	2024年11月23日	30	3.09	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	21国信13	149710	2021年11月19日	2021年11月23日	2026年11月23日	20	3.43	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	22国信01	149775	2022年1月7日	2022年1月11日	2025年1月11日	30	2.92	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	22国信02	149776	2022年1月7日	2022年1月11日	2027年1月11日	10	3.28	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	22国信03	149807	2022年2月22日	2022年2月24日	2025年2月24日	5	2.95	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	22国信04	149849	2022年3月23日	2022年3月25日	2025年3月25日	21	3.17	采用单利按年计息,不计复利。每年付息一次,最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第一期)	22国信D1	149872	2022年4月1日	2022年4月6日	2023年4月6日	-	2.58	已按时兑付本金及利息。	深交所

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (亿元)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第一期）	22 国信 Y1	149954	2022 年 6 月 17 日	2022 年 6 月 21 日	-	50	3.63	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第二期）	22 国信 Y2	149974	2022 年 7 月 6 日	2022 年 7 月 8 日	-	50	3.67	在不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次。在行使赎回选择权前长期存续。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）	22 国信 05	148029	2022 年 8 月 12 日	2022 年 8 月 16 日	2025 年 8 月 16 日	29	2.64	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）	22 国信 06	148087	2022 年 10 月 14 日	2022 年 10 月 18 日	2025 年 10 月 18 日	30	2.58	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	23 国证 02	148179	2023 年 2 月 3 日	2023 年 2 月 7 日	2026 年 2 月 7 日	45	3.22	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）	23 国证 03	148227	2023 年 3 月 23 日	2023 年 3 月 27 日	2025 年 3 月 27 日	25	2.97	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）	23 国信 D1	148242	2023 年 4 月 7 日	2023 年 4 月 11 日	2024 年 4 月 11 日	30	2.69	到期一次还本付息。	深交所
国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）	23 国证 04	148282	2023 年 4 月 26 日	2023 年 4 月 28 日	2026 年 4 月 28 日	30	2.99	采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，最后一期利息随本金的兑付一起支付。	深交所
投资者适当性安排（如有）	上述债券面向拥有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的合格 A 股证券账户的专业投资者（法律、法规禁止购买者除外）公开发行。								
公司债券上市或转让的交易场所	深交所								
是否存在终止上市交易的风险（如有）和应对措施	不适用。								

公司不存在逾期未偿还债券。

## (二) 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

不适用。

## (三) 中介机构的情况

中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	中介机构联系人	联系电话
广发证券股份有限公司	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦	-	祝磊	020-66338888
中泰证券股份有限公司	北京市东城区朝阳门北大街 9 号泓晟国际中心 17 层	-	廖青云、李越	010-59013962
中国银河证券股份有限公司	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦	-	陈曲、邓小霞	010-80927231
中信证券股份有限公司	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座	-	冯源、张陈灵	0755-23835062
国泰君安证券股份有限公司	上海市静安区新闻路 669 博华广场 33 楼	-	戴蕴乐	13761888977
平安证券股份有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层	-	周顺强	0755-22625403
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	-	张帆、陈凝	010-85679696
中诚信国际信用评级有限责任公司	北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101	-	张璐、高阳	010-66428877
天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区西溪路 128 号 6 楼	张云鹤、谢军、崔永强、黄燕	黄燕	020-37600380
北京市天元律师事务所	北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 B 座 10 层	-	支毅、敖华芳、曾雪莹	010-57763888
北京德恒律师事务所	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层	-	罗元清、龚东旭	0755-88286488
广东信达律师事务所	广东省深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 11、12 楼	-	石之恒、叶子	0755-88265288

报告期内因发行债券“22 国信 05”“22 国信 06”新增中介机构平安证券股份有限公司，其他机构未发生变化。

## (四) 募集资金使用情况

债券名称	募集资金总金额 (亿元)	已使用金额 (亿元)	未使用金额 (亿元)	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
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第一期）	15	15	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第二期）	35	35	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券（第三期）	40	40	-	无	无	是

债券名称	募集资金 总金额 (亿元)	已使用 金额 (亿元)	未使用 金额 (亿元)	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
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发 行公司债券(第一期)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发 行公司债券(第二期)	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第一期) (品种二)	25	25	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第二期) (品种二)	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第一期) (品种一)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第一期) (品种二)	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第二期) (品种一)	20	20	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第二期) (品种二)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第三期) (品种一)	24	24	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第三期) (品种二)	33	33	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第四期) (品种一)	27	27	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第五期) (品种一)	40	40	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第五期) (品种二)	10	10	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第六期) (品种一)	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2021 年面向专 业投资者公开发行公司债券(第六期) (品种二)	20	20	-	无	无	是

债券名称	募集资金 总金额 (亿元)	已使用 金额 (亿元)	未使用 金额 (亿元)	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
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	10	10	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）	5	5	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）	21	21	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）	29	29	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券（第五期）	30	30	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行永续次级债券（第一期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司非公开发行 2020 年永续次级债券（第二期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第一期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司非公开发行 2021 年永续次级债券（第二期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第一期）	50	50	-	无	无	是
国信证券股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券（第二期）	50	50	-	无	无	是

报告期内，公司募集资金未用于建设项目，未变更上述债券募集资金用途。

#### （五）报告期内信用评级结果调整情况

无。

#### （六）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情况和变化情况及对债券投资者权益的影响

不适用。

### 三、非金融企业债务融资工具

报告期内，公司不存在非金融企业债务融资工具。

### 四、可转换公司债券

报告期内，公司不存在可转换公司债券。

### 五、报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10% 的情况

不适用。

### 六、报告期末除债券外的有息债务逾期情况

不适用。

### 七、报告期内是否有违反规章制度的情况

报告期内，公司无违反法律法规、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。

### 八、截至报告期末公司近两年的主要会计数据和财务指标

单位：万元

项目	本报告期末	上年末	本报告期末比上年末增减
流动比率	1.82	1.96	-71.4%
资产负债率	68.09%	67.15%	上升 0.94 个百分点
速动比率	1.82	1.96	-71.4%
项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
扣除非经常性损益后净利润	594,847.83	985,236.05	-39.62%
EBITDA 全部债务比	6.06%	10.44%	下降 4.38 个百分点
利息保障倍数	2.24	3.59	-37.60%
现金利息保障倍数	-0.31	0.13	-338.46%
EBITDA 利息保障倍数	2.36	3.69	-36.04%
贷款偿还率	100.00%	100.00%	-
利息偿付率	100.00%	100.00%	-

## 九、公司其他债务融资工具

### (一) 短期融资券

债券简称	起息日	到期日	发行规模(亿元)	利率(%)	付息兑付情况
21 国信证券 CP012	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日	20	2.70	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP013	2021 年 10 月 13 日	2022 年 1 月 12 日	7	2.55	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP014	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 12 日	30	2.70	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP015	2021 年 10 月 21 日	2022 年 1 月 20 日	10	2.60	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP016	2021 年 10 月 21 日	2022 年 4 月 21 日	20	2.77	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP017	2021 年 11 月 1 日	2022 年 11 月 1 日	45	2.86	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP018	2021 年 11 月 4 日	2022 年 3 月 4 日	20	2.65	已按时兑付本金及利息
21 国信证券 CP019	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 10 日	20	2.73	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP001	2022 年 2 月 10 日	2023 年 2 月 10 日	30	2.50	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP002	2022 年 2 月 15 日	2022 年 6 月 15 日	10	2.33	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP003	2022 年 2 月 17 日	2022 年 6 月 17 日	25	2.32	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP004	2022 年 2 月 21 日	2023 年 2 月 21 日	15	2.49	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP005	2022 年 3 月 1 日	2022 年 8 月 5 日	17	2.45	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP006	2022 年 3 月 1 日	2023 年 3 月 1 日	23	2.58	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP007	2022 年 3 月 7 日	2022 年 9 月 14 日	15	2.47	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP008	2022 年 3 月 14 日	2022 年 6 月 14 日	15	2.40	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP009	2022 年 4 月 12 日	2022 年 11 月 11 日	15	2.40	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP010	2022 年 4 月 12 日	2023 年 4 月 12 日	15	2.52	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP011	2022 年 4 月 25 日	2022 年 8 月 26 日	15	2.20	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP012	2022 年 4 月 25 日	2023 年 4 月 25 日	15	2.47	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP013	2022 年 4 月 28 日	2022 年 11 月 25 日	20	2.28	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP014	2022 年 4 月 28 日	2023 年 4 月 28 日	15	2.42	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP015	2022 年 5 月 16 日	2022 年 8 月 19 日	15	1.98	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP016	2022 年 5 月 16 日	2023 年 5 月 16 日	15	2.37	未到兑息兑付日
22 国信证券 CP017	2022 年 6 月 24 日	2022 年 9 月 28 日	30	1.87	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP018	2022 年 6 月 28 日	2022 年 12 月 28 日	20	1.98	已按时兑付本金及利息
22 国信证券 CP019	2022 年 12 月 26 日	2023 年 3 月 24 日	30	2.55	已按时兑付本金及利息
23 国信证券 CP001	2023 年 1 月 16 日	2023 年 5 月 19 日	50	2.50	未到兑息兑付日

债券简称	起息日	到期日	发行规模(亿元)	利率(%)	付息兑付情况
23 国信证券 CP002	2023 年 1 月 18 日	2023 年 5 月 26 日	15	2.50	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP003	2023 年 3 月 13 日	2023 年 6 月 9 日	10	2.55	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP004	2023 年 3 月 13 日	2023 年 9 月 8 日	40	2.65	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP005	2023 年 3 月 20 日	2023 年 9 月 15 日	30	2.62	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP006	2023 年 3 月 29 日	2023 年 6 月 27 日	20	2.47	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP007	2023 年 3 月 29 日	2024 年 3 月 28 日	20	2.73	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP008	2023 年 4 月 17 日	2023 年 10 月 13 日	20	2.56	未到兑息兑付日
23 国信证券 CP009	2023 年 4 月 18 日	2023 年 7 月 18 日	25	2.48	未到兑息兑付日

## (二) 收益凭证

报告期内，公司累计发行 931 期收益凭证，募集资金 118 亿元，均按时兑付本金及利息。收益凭证期末存量规模为 42 亿元。

10

财务报告



# 审计报告

天健审〔2023〕7-434号

国信证券股份有限公司全体股东：

## 一、审计意见

我们审计了国信证券股份有限公司（以下简称国信证券）财务报表，包括2022年12月31日的合并及母公司资产负债表，2022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，公允反映了国信证券2022年12月31日的合并及母公司财务状况，以及2022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，我们独立于国信证券，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 三、关键审计事项

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

### （一）融出资金及买入返售金融资产的减值

#### 1. 事项描述

详见财务报表附注三（十）和五（一）3、7。

截至2022年12月31日，国信证券融出资金及买入返售金融资产账面价值合计人民币684.97亿元，占总资产的17.37%；减值准备合计为人民币14.49亿元。

国信证券管理层（以下简称管理层）运用预期信用损失模型确定融出资金及买入返售金融资产减值准备的过程中涉及较多关键参数和假设的应用，包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露等，这些参数的选取和假设的应用涉及及管理层的判断。

由于上述金融资产金额重大，预期信用损失模型涉及较多参数和假设，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

#### 2. 审计应对

针对融出资金、买入返售金融资产减值，我们实施的审计程序主要包括：

（1）了解与金融工具投资审批、投后管理、信用评级、质押品管理以及金融工具减值准备计提相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，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）对预期信用损失模型及相关参数和假设的合理性进行评估，包括阶段划分、违约概率、违约损失率、违约风险暴露等，并评估其中所涉及的关键管理层判断的合理性；

(3) 选取样本，检查预期信用损失模型的主要输入值是否正确，包括信用风险敞口和损失率等；

(4) 对于已发生信用减值的金融资产，抽取样本，检查管理层基于相关债务人的财务信息以及担保物的最新评估价值计算的预期信用损失是否适当；

(5) 检查与融出资金及买入返售金融资产减值准备相关的信息是否已在财务报表中作出恰当列报。

## (二) 金融工具公允价值的计量

### 1. 事项描述

详见财务报表附注三（十）和附注十。

截至 2022 年 12 月 31 日，国信证券公允价值属于第二层次的金融资产账面价值计人民币 1,964.06 亿元、属于第三层次的金融资产账面价值计人民币 92.48 亿元，该等金融资产账面价值合计人民币 2,056.54 亿元；公允价值属于第二层次、第三层次的金融负债账面价值合计人民币 17.94 亿元。

管理层对该等金融资产及金融负债的估值以市场数据和估值模型为基础，估值模型通常需要大量可观察或不可观察的输入值，输入值的确定涉及管理层的重大判断和估计。

由于该等金融资产和金融负债的估值较为复杂，且该等金融资产和金融负债对财务报表的影响重大，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

### 2. 审计应对

针对金融工具公允价值的计量，我们实施的审计程序主要包括：

(1) 了解与金融工具公允价值评估相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，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) 针对公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具，抽取样本检查合同，了解合同条款并识别与金融工具估值相关的条款；

(3) 评价国信证券用于公允价值属于第二层次和第三层次的金融工具的估值模型，并抽取样本检查估值结果是否正确；

(4) 评价财务报表附注中的相关披露是否符合企业会计准则披露要求，恰当反映了金融工具的估值风险。

## (三) 结构化主体合并的判断

### 1. 事项描述

详见财务报表附注八（一）2。

截至 2022 年 12 月 31 日，国信证券纳入合并财务报表合并范围的结构化主体总资产计人民币 109.19 亿元。

国信证券投资了若干结构化主体，包括资产管理计划、信托计划和有限合伙企业等。国信证券对结构化主体合并的判断主要是从是否对结构化主体拥有权力、通过参与结构化主体的相关活动而享有可变回报、并且有能力运用对结构化主体的权力影响其回报三要素进行分析。管理层通过综合评估其持有的份额相应享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬，其由此获取的可变回报的影响是否重大，判断是否对结构化主体形成控制，进而确定是否纳入财务报表的合并范围。

由于对结构化主体是否形成控制涉及管理层的重大判断，因此我们将该事项确定为关键审计事项。

## 2. 审计应对

针对结构化主体合并事项的判断，我们实施的审计程序主要包括：

- (1) 了解相关的关键内部控制，评价这些控制的设计，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) 获取结构化主体相关合同，从国信证券对结构化产品拥有的权力、结构化主体享有的可变回报以及运用权力影响回报金额的能力等方面评价管理层做出的判断是否合理；
- (3) 选取样本复核国信证券在结构化主体中享有的收益情况，检查国信证券运用对结构化主体的权力影响其回报金额；
- (4) 评价国信证券是否已按照企业会计准则的要求对已合并的结构化主体予以恰当列报。

## 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，管理层负责评估国信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。

国信证券治理层（以下简称治理层）负责监督国信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，就可能导致对国信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国信证券不能持续经营。

(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) 就国信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：燕玉嵩

（项目合伙人）

中国·杭州

中国注册会计师：黄 燕

二〇二三年四月二十八日

## 合并资产负债表

2022年12月31日

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

资产	注释号	期末数	上年年末数	负债和所有者权益	注释号	期末数	上年年末数
资产：				负债：			
货币资金	1	64,977,826,272.53	67,721,741,037.30	短期借款	21	225,270,000.00	
其中：客户资金存款		55,997,913,160.31	61,981,679,320.72	应付短期融资款	22	22,515,995,310.97	19,800,032,805.99
结算备付金	2	15,734,799,287.70	17,087,824,020.77	拆入资金	23	9,006,162,483.33	4,456,797,971.98
其中：客户备付金		12,835,634,057.03	13,271,519,488.47	交易性金融负债	24	1,789,847,354.62	460,982,751.10
贵金属				衍生金融负债	4	324,672,439.60	226,049,508.29
拆出资金				卖出回购金融资产款	25	114,183,859,383.17	96,524,929,451.62
融出资金	3	52,672,094,624.02	61,973,311,849.43	代理买卖证券款	26	59,413,814,509.13	67,280,292,116.73
衍生金融资产	4	164,204,033.62	57,966,861.36	代理承销证券款			27,000,000.00
存出保证金	5	7,900,221,491.14	7,587,572,329.43	应付职工薪酬	27	5,863,698,182.25	6,491,980,890.61
应收款项	6	4,728,934,871.75	1,432,595,710.21	应交税费	28	471,244,694.61	831,179,119.44
应收款项融资				应付款项	29	12,698,831,315.61	5,274,979,125.00
合同资产				合同负债		433,018.86	38,695,953.33
买入返售金融资产	7	15,824,517,431.75	6,770,994,407.11	持有待售负债			
持有待售资产				预计负债	30	39,999,376.78	193,658,275.07
金融投资：				长期借款			
交易性金融资产	8	159,472,573,237.44	152,312,123,275.04	应付债券	31	48,850,436,652.29	51,002,487,491.65
债权投资		69,266,211.57		其中：优先股			
其他债权投资	9	51,501,472,752.05	29,644,274,446.31	永续债			
其他权益工具投资	10	10,429,791,008.15	7,186,022,265.21	租赁负债	32	412,129,927.57	447,016,739.86
长期股权投资	11	3,468,468,220.21	3,561,339,626.20	递延收益	33	122,813,793.48	126,289,655.52
投资性房地产	12	279,122,466.32	288,437,302.31	递延所得税负债	18	390,274,752.92	696,692,082.18
固定资产	13	2,648,915,554.79	2,679,899,426.29	其他负债	34	11,361,533,333.39	11,270,188,929.29
在建工程	14	20,569,441.48	23,856,786.53	负债合计		287,445,746,528.58	265,374,522,867.66
使用权资产	15	417,880,205.16	459,797,270.46	所有者权益：			
无形资产	16	708,403,163.91	683,511,764.96	股本	35	9,612,429,377.00	9,612,429,377.00
其中：交易席位费		29,752,745.38	29,752,745.38	其他权益工具	36	30,000,000,000.00	20,000,000,000.00
商誉	17	10,260,249.61	10,260,249.61	其中：优先股			
递延所得税资产	18	2,848,152,868.05	2,352,914,477.11	永续债		30,000,000,000.00	20,000,000,000.00
其他资产	19	453,305,540.30	466,999,213.28	资本公积	37	20,146,238,607.58	20,155,672,569.84
				减：库存股			
				其他综合收益	38	-359,835,343.82	-57,553,022.01
				盈余公积	39	4,867,817,456.10	4,867,817,456.10
				一般风险准备	40	16,330,816,087.88	14,748,272,660.25
				未分配利润	41	26,287,566,218.23	27,583,471,105.99
				归属于母公司所有者权益合计		106,885,032,402.97	96,910,110,147.17
				少数股东权益			16,809,304.09
				所有者权益合计		106,885,032,402.97	96,926,919,451.26
资产总计		394,330,778,931.55	362,301,442,318.92	负债和所有者权益总计		394,330,778,931.55	362,301,442,318.92

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 母公司资产负债表

2022年12月31日

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

资产	注释号	期末数	上年年末数	负债和所有者权益	注释号	期末数	上年年末数
资产：				负债：			
货币资金		51,347,069,178.01	57,278,391,282.14	短期借款			
其中：客户资金存款		46,878,617,105.40	53,362,210,916.47	应付短期融资款		22,515,995,310.97	19,800,032,805.99
结算备付金		14,558,502,055.56	16,125,066,899.89	拆入资金		9,006,162,483.33	4,456,797,971.98
其中：客户备付金		10,875,829,663.62	11,987,961,729.38	交易性金融负债		1,337,467,274.50	295,918,604.98
贵金属				衍生金融负债		323,480,541.35	224,145,498.63
拆出资金				卖出回购金融资产款		114,183,859,383.17	96,524,929,451.62
融出资金		52,421,873,900.14	61,589,558,853.70	代理买卖证券款		57,849,764,776.70	65,706,354,305.07
衍生金融资产		164,204,033.62	27,794,294.99	代理承销证券款			27,000,000.00
存出保证金		3,335,062,661.73	2,918,235,647.08	应付职工薪酬	2	5,511,574,420.29	6,130,416,109.62
应收款项		4,427,387,008.07	1,204,642,509.49	应交税费		387,740,660.17	667,451,942.94
应收款项融资				应付款项		9,332,450,614.95	3,688,333,863.70
合同资产				合同负债			
买入返售金融资产		15,162,728,003.09	6,705,815,751.94	持有待售负债			
持有待售资产				预计负债		39,999,376.78	185,482,275.07
金融投资：				长期借款			
交易性金融资产		151,058,135,776.53	142,789,934,508.61	应付债券		48,850,436,652.29	51,002,487,491.65
债权投资				其中：优先股			
其他债权投资		51,501,472,752.05	29,644,274,446.31	永续债			
其他权益工具投资		12,286,816,441.63	9,336,723,716.55	租赁负债		373,366,610.72	386,086,403.74
长期股权投资	1	11,943,045,161.33	10,772,737,983.91	递延收益		122,813,793.48	126,289,655.52
投资性房地产		365,782,045.02	308,015,431.32	递延所得税负债		48,696,290.62	444,214,710.51
固定资产		2,532,862,672.38	2,628,663,982.14	其他负债		839,473,667.19	1,004,728,484.13
在建工程		20,569,441.48	23,856,786.53	负债合计		270,723,281,856.51	250,670,669,575.15
使用权资产		379,582,832.77	398,952,605.83	所有者权益：			
无形资产		698,276,895.14	673,390,769.71	股本		9,612,429,377.00	9,612,429,377.00
其中：交易席位费		29,752,745.38	29,752,745.38	其他权益工具		30,000,000,000.00	20,000,000,000.00
商誉				其中：优先股			
递延所得税资产		2,490,705,363.70	2,198,255,042.86	永续债		30,000,000,000.00	20,000,000,000.00
其他资产		413,554,776.18	375,365,156.94	资本公积		20,145,856,411.46	20,155,290,373.72
				减：库存股			
				其他综合收益		-421,887,827.51	-40,468,129.77
				盈余公积		4,867,817,456.10	4,867,817,456.10
				一般风险准备		16,096,939,082.36	14,748,272,660.25
				未分配利润		24,083,194,642.51	24,985,664,357.49
				所有者权益合计		104,384,349,141.92	94,329,006,094.79
资产总计		375,107,630,998.43	344,999,675,669.94	负债和所有者权益总计		375,107,630,998.43	344,999,675,669.94

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 合并利润表

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、营业总收入		15,875,768,261.85	23,818,037,003.89
利息净收入	1	1,829,626,770.68	2,410,623,946.47
其中：利息收入		7,072,845,943.40	7,521,117,559.58
利息支出		5,243,219,172.72	5,110,493,613.11
手续费及佣金净收入	2	7,577,259,640.42	10,032,871,608.65
其中：经纪业务手续费净收入		5,129,294,976.16	7,194,547,317.39
投资银行业务手续费净收入		1,815,715,414.70	1,979,271,263.30
资产管理业务手续费净收入		321,244,982.02	242,758,990.76
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	3	7,272,208,200.33	7,436,131,228.53
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		482,932,846.97	879,545,654.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			
净敞口套期收益			
其他收益	4	44,949,772.78	26,672,382.03
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5	-2,970,734,030.62	1,740,440,175.39
汇兑收益（损失以“-”号填列）		3,426,328.32	-637,899.25
其他业务收入	6	2,116,933,142.59	2,172,196,369.91
资产处置收益（损失以“-”号填列）		2,098,437.35	-260,807.84
二、营业总支出		9,780,682,878.94	11,524,145,787.29
税金及附加	7	125,581,225.36	143,353,979.51
业务及管理费	8	7,317,440,687.21	9,732,464,216.38
信用减值损失	9	250,845,439.24	-521,450,633.96
其他资产减值损失	10	2,191,066.98	96,261.07
其他业务成本	11	2,084,624,460.15	2,169,681,964.29
三、营业利润（亏损总额以“-”号填列）		6,095,085,382.91	12,293,891,216.60
加：营业外收入	12	82,949,064.35	47,859,922.67
减：营业外支出	13	-44,130,817.08	-292,741,019.70
四、利润总额（净亏损以“-”号填列）		6,222,165,264.34	12,634,492,158.97
减：所得税费用	14	137,575,465.57	2,517,436,992.87

项 目	注释号	本期数	上年同期数
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,084,589,798.77	10,117,055,166.10
（一）按经营持续性分类：			
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		6,084,589,798.77	10,117,055,166.10
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. 归属于母公司所有者的净利润（净亏损以“-”号填列）		6,087,994,695.35	10,114,758,795.89
2. 少数股东损益（净亏损以“-”号填列）		-3,404,896.58	2,296,370.21
六、其他综合收益的税后净额		-385,923,788.79	-989,773,100.12
归属于母公司所有者的其他综合收益的税后净额	15	-385,923,788.79	-989,773,100.12
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-439,992,935.50	-1,101,664,269.57
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动		-439,992,935.50	-1,101,664,269.57
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		54,069,146.71	111,891,169.45
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		821,378.50	-37,259,514.75
2. 其他债权投资公允价值变动		42,689,062.37	117,990,784.13
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用减值准备		-84,561,914.04	49,397,654.52
5. 现金流量套期储备		-15,537,974.68	15,537,974.68
6. 外币财务报表折算差额		110,658,594.56	-33,775,729.13
7. 其他			
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额			
七、综合收益总额		5,698,666,009.98	9,127,282,065.98
归属于母公司所有者的综合收益总额		5,702,070,906.56	9,124,985,695.77
归属于少数股东的综合收益总额		-3,404,896.58	2,296,370.21
八、每股收益：			
（一）基本每股收益		0.52	0.97
（二）稀释每股收益		0.52	0.97

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 母公司利润表

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、营业总收入		13,340,769,767.26	19,319,474,142.84
利息净收入	1	1,544,612,737.67	2,217,114,146.24
其中：利息收入		6,775,811,647.50	7,245,046,397.74
利息支出		5,231,198,909.83	5,027,932,251.50
手续费及佣金净收入	2	7,201,565,697.86	9,199,816,671.79
其中：经纪业务手续费净收入		4,834,906,276.98	6,698,357,083.32
投资银行业务手续费净收入		1,783,895,521.04	1,958,519,029.91
资产管理业务手续费净收入		319,213,777.41	215,252,820.65
投资收益（亏损总额以“-”号填列）	3	7,097,801,280.62	6,600,415,580.21
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		494,810,235.12	510,891,840.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			
净敞口套期收益			
其他收益		44,113,040.58	25,995,834.40
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4	-2,614,649,931.70	1,240,226,559.72
汇兑收益（损失以“-”号填列）		10,981,865.27	-2,920,246.58
其他业务收入		54,417,224.43	39,178,485.21
资产处置收益（损失以“-”号填列）		1,927,852.53	-352,888.15
二、营业总支出		7,240,007,251.31	8,931,905,311.24
税金及附加		117,219,940.13	134,569,352.30
业务及管理费	5	6,849,008,107.61	9,003,513,900.86
信用减值损失		261,241,006.75	-217,538,746.30
其他资产减值损失			
其他业务成本		12,538,196.82	11,360,804.38
三、营业利润（亏损总额以“-”号填列）		6,100,762,515.95	10,387,568,831.60
加：营业外收入		47,180,203.72	39,708,225.69
减：营业外支出		-39,014,042.71	-302,705,506.55
四、利润总额（净亏损以“-”号填列）		6,186,956,762.38	10,729,982,563.84
减：所得税费用		-13,861,357.58	2,049,886,905.37

项目	注释号	本期数	上年同期数
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,200,818,119.96	8,680,095,658.47
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		6,200,818,119.96	8,680,095,658.47
（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		-418,326,422.07	-784,954,798.53
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		-377,274,948.90	-950,239,595.44
1. 重新计量设定受益计划变动额			
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益			
3. 其他权益工具投资公允价值变动		-377,274,948.90	-950,239,595.44
4. 企业自身信用风险公允价值变动			
5. 其他			
（二）将重分类进损益的其他综合收益		-41,051,473.17	165,284,796.91
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		821,378.50	-2,103,641.74
2. 其他债权投资公允价值变动		42,689,062.37	117,990,784.13
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额			
4. 其他债权投资信用减值准备		-84,561,914.04	49,397,654.52
5. 现金流量套期储备			
6. 外币财务报表折算差额			
7. 其他			
七、综合收益总额		5,782,491,697.89	7,895,140,859.94

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 合并现金流量表

2022年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		2,971,760,916.19	
其他权益工具投资净减少额			4,298,995,275.24
收取利息、手续费及佣金的现金		15,991,875,317.46	18,917,863,890.58
拆入资金净增加额		4,555,000,000.00	
融出资金净减少额		9,366,599,012.04	
回购业务资金净增加额		8,510,918,688.41	34,429,984,709.98
代理买卖证券收到的现金净额			7,532,458,629.50
代理承销证券收到的现金净额			27,000,000.00
收到其他与经营活动有关的现金	1	3,059,354,299.49	5,900,788,965.09
经营活动现金流入小计		44,455,508,233.59	71,107,091,470.39
为交易目的而持有的金融资产净增加额			36,239,559,355.89
债权投资净增加额		71,354,630.48	
其他债权投资净增加额		20,742,134,631.48	3,778,655,061.81
拆入资金净减少额			1,975,000,000.00
融出资金净增加额			12,030,664,789.79
其他权益工具投资净增加额		2,998,251,896.64	
代理买卖证券支付的现金净额		8,016,057,485.03	
代理承销证券支付的现金净额		27,000,000.00	
支付利息、手续费及佣金的现金		4,461,253,580.76	4,143,227,241.92
支付给职工以及为职工支付的现金		6,033,072,086.65	6,057,685,882.62
支付的各项税费		2,028,973,041.83	3,748,188,377.98
支付其他与经营活动有关的现金	2	7,418,927,219.74	9,849,498,590.69
经营活动现金流出小计		51,797,024,572.61	77,822,479,300.70
经营活动产生的现金流量净额	4	-7,341,516,339.02	-6,715,387,830.31
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		109,145,350.34	862,693,692.50
取得投资收益收到的现金		526,670,921.27	279,059,166.45
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		6,539,711.01	5,295,248.64
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额			
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		642,355,982.62	1,147,048,107.59

项 目	注释号	本期数	上年同期数
投资支付的现金		59,250,000.00	135,963,905.72
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		595,852,178.91	603,905,378.52
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额			
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		655,102,178.91	739,869,284.24
投资活动产生的现金流量净额		-12,746,196.29	407,178,823.35
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		10,000,000,000.00	10,000,000,000.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金			
取得借款收到的现金		524,892,926.84	6,071,868,755.90
发行债券收到的现金		62,326,927,000.00	101,292,171,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		72,851,819,926.84	117,364,039,755.90
偿还债务支付的现金		62,651,956,578.89	98,248,279,667.24
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		8,091,907,147.00	4,646,344,379.57
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		4,569,686.67	1,127,000.00
支付其他与筹资活动有关的现金	3	262,331,617.94	267,220,827.47
筹资活动现金流出小计		71,006,195,343.83	103,161,844,874.28
筹资活动产生的现金流量净额		1,845,624,583.01	14,202,194,881.62
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		251,809,092.40	-61,758,223.12
五、现金及现金等价物净增加额	4	-5,256,828,859.90	7,832,227,651.54
加：期初现金及现金等价物余额	4	84,614,253,311.11	76,782,025,659.57
六、期末现金及现金等价物余额	4	79,357,424,451.21	84,614,253,311.11

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 母公司现金流量表

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	注释号	本期数	上年同期数
一、经营活动产生的现金流量：			
为交易目的而持有的金融资产净减少额		4,791,209,102.02	
其他权益工具投资净减少额			4,323,355,275.24
收取利息、手续费及佣金的现金		14,698,209,430.63	17,807,336,647.42
拆入资金净增加额		4,555,000,000.00	
融出资金净减少额		9,233,077,394.19	
回购业务资金净增加额		9,106,554,367.63	33,794,379,235.80
代理承销证券收到的现金净额			27,000,000.00
代理买卖证券收到的现金净额			7,401,562,329.60
收到其他与经营活动有关的现金		301,626,538.85	158,300,585.33
经营活动现金流入小计		42,685,676,833.32	63,511,934,073.39
为交易目的而持有的金融资产净增加额			36,224,141,721.08
其他债权投资净增加额		20,742,134,631.48	3,778,655,061.81
其他权益工具投资净增加额		2,998,251,896.64	
拆入资金净减少额			1,975,000,000.00
融出资金净增加额			12,062,127,530.74
代理承销证券支付的现金净额		27,000,000.00	
代理买卖证券支付的现金净额		7,855,053,329.96	
支付利息、手续费及佣金的现金		3,868,067,168.03	4,089,516,919.22
支付给职工以及为职工支付的现金		5,702,499,314.44	5,749,722,042.14
支付的各项税费		1,627,869,873.55	3,431,588,257.04
支付其他与经营活动有关的现金		5,728,189,183.13	2,950,894,279.56
经营活动现金流出小计		48,549,065,397.23	70,261,645,811.59
经营活动产生的现金流量净额		-5,863,388,563.91	-6,749,711,738.20
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		1,368,527,946.99	2,783,081,030.19
取得投资收益收到的现金		975,324,436.20	279,059,166.45
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		6,301,218.30	5,064,946.84
收到其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流入小计		2,350,153,601.49	3,067,205,143.48

项目	注释号	本期数	上年同期数
投资支付的现金		5,699,300,000.01	4,229,564,044.50
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		579,262,030.67	587,938,494.31
支付其他与投资活动有关的现金			
投资活动现金流出小计		6,278,562,030.68	4,817,502,538.81
投资活动产生的现金流量净额		-3,928,408,429.19	-1,750,297,395.33
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		10,000,000,000.00	10,000,000,000.00
取得借款收到的现金			
发行债券收到的现金		62,326,927,000.00	101,292,171,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金			
筹资活动现金流入小计		72,326,927,000.00	111,292,171,000.00
偿还债务支付的现金		61,897,188,000.00	92,066,721,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		8,061,820,611.75	4,640,639,397.55
支付其他与筹资活动有关的现金		232,669,847.08	236,492,426.06
筹资活动现金流出小计		70,191,678,458.83	96,943,852,823.61
筹资活动产生的现金流量净额		2,135,248,541.17	14,348,318,176.39
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		10,981,865.27	-2,920,246.58
五、现金及现金等价物净增加额		-7,645,566,586.66	5,845,388,796.28
加：期初现金及现金等价物余额		73,280,300,805.38	67,434,912,009.10
六、期末现金及现金等价物余额		65,634,734,218.72	73,280,300,805.38

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 合并所有者权益变动表

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	本 期 数									
	归属于母公司所有者权益					少数股东权益		所有者权益合计		
	股本	其他权益工具	资本公积	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	少数股东权益	
	优先股	永续债	其他							
一、上年年末余额	9,612,429,377.00	20,000,000,000.00	201,556,725,699.84		-57,553,022.01	4,867,817,456.10	14,748,272,660.25	27,583,471,105.99	16,809,304.09	96,926,919,451.26
加：会计政策变更										
前期差错更正										
同一控制下企业合并										
其他										
二、本年年初余额	9,612,429,377.00	20,000,000,000.00	201,556,725,699.84		-57,553,022.01	4,867,817,456.10	14,748,272,660.25	27,583,471,105.99	16,809,304.09	96,926,919,451.26
三、本期增减变动金额										
（一）综合收益总额					-302,282,321.81		1,582,543,427.63	-1,295,904,887.76		9,958,112,951.71
（二）所有者投入和减少资本		10,000,000,000.00	-9,433,962.26							
（一）综合收益总额					-385,923,788.79			6,087,994,695.35	-3,404,896.58	5,698,666,009.98
（二）所有者投入和减少资本		10,000,000,000.00							-8,834,720.84	9,991,165,279.16

项 目	本期末数							少数股东权益	所有者权益合计
	归属于母公司所有者权益								
	股本	其他权益工具	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
优先股	永续债	其他							
1.所有者投入的普通股								-8,834,720.84	-8,834,720.84
2.其他权益工具持有者投入资本		10,000,000,000.00							10,000,000,000.00
3.股份支付计入所有者权益的金额									
4.其他									
(三) 利润分配					1,582,543,427.63	-7,300,258,116.13		-4,569,686.67	-5,222,284,375.17
1.提取盈余公积									
2.提取一般风险准备					1,582,543,427.63	-1,582,543,427.63			
3.对所有者(或股东)的分配						-4,806,214,688.50		-4,569,686.67	-4,810,784,375.17
4.其他						-911,500,000.00			-911,500,000.00
(四) 所有者权益内部结转					83,641,466.98				-83,641,466.98
1.资本公积转增资本(或股本)									
2.盈余公积转增资本(或股本)									

项 目	本期数														
	归属于母公司所有者权益					少数股东权益	所有者权益合计								
	股本	其他权益工具	资本公积	减：库存股	其他综合收益		盈余公积	一般风险准备	未分配利润	权益					
优先股	永续债	其他													
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					83,641,466.98										-83,641,466.98
6. 其他															
(五) 其他					-9,433,962.26										-9,433,962.26
四、本期末余额	9,612,429,377.00	30,000,000,000.00	20,146,238,607.58		-359,635,343.82	4,867,817,456.10	16,330,816,087.88	26,287,566,218.23							106,885,032,402.97

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 合并所有者权益变动表

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项 目	上年同期数							所有者权益合计	
	股本	优先股	其他权益工具	归属于母公司所有者权益	减：	库存股	其他综合收益		少数股东权益
			永续债	资本公积	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、上年年末余额	9,612,429,377.00		10,000,000,000.00	20,155,606,605.47	4,867,817,456.10	12,997,499,548.86	22,864,880,451.81	17,052,200.00	80,924,469,443.74
加：会计政策变更									
前期差错更正									
同一控制下企业合并									
其他									
二、本年初余额	9,612,429,377.00		10,000,000,000.00	20,155,606,605.47	4,867,817,456.10	12,997,499,548.86	22,864,880,451.81	17,052,200.00	80,924,469,443.74
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)			10,000,000,000.00	65,964.37	-466,736,826.51	1,750,773,111.39	4,718,590,654.18	-242,895.91	16,002,450,007.52
(一) 综合收益总额							10,114,758,795.89	2,296,370.21	9,127,282,065.98
(二) 所有者投入和减少资本			10,000,000,000.00					-1,544,066.68	9,998,455,933.32
1. 所有者投入的普通股								-1,544,066.68	-1,544,066.68
2. 其他权益工具持有者投入资本			10,000,000,000.00						10,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额									
4. 其他									

项 目	上年同期数							少数股东权益	所有者权益合计	
	归属于母公司所有者权益									
	股本	优先股	其他权益工具	减：库存股	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
			永续债							
			其他							
(三) 利润分配										
1. 提取盈余公积										
2. 提取一般风险准备										
3. 对所有者(或股东)的分配										
4. 其他										
(四) 所有者权益内部结转										
1. 资本公积转增资本(或股本)										
2. 盈余公积转增资本(或股本)										
3. 盈余公积弥补亏损										
4. 设定受益计划变动额结转留存收益										
5. 其他综合收益结转留存收益										
6. 其他										
(五) 其他										
四、本期末余额	9,612,429,377.00		20,000,000,000.00	201,556,725,569.84	-57,553,022.01	4,867,817,456.10	14,748,272,660.25	27,583,471,105.99	16,809,304.09	96,926,919,451.26
				65,964.37						65,964.37

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

**母公司所有者权益变动表**

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	本期数					所有者权益合计		
	股本	其他权益工具 优先股 永续债 其他	资本公积	减：库存股	其他综合收益		盈余公积	一般风险准备
一、上年年末余额	9,612,429,377.00	20,000,000,000.00	20,155,290,373.72	-40,468,129.77	4,867,817,456.10	14,748,272,660.25	24,985,664,357.49	94,329,006,094.79
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年年初余额	9,612,429,377.00	20,000,000,000.00	20,155,290,373.72	-40,468,129.77	4,867,817,456.10	14,748,272,660.25	24,985,664,357.49	94,329,006,094.79
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)		10,000,000,000.00	-9,433,962.26	-381,419,697.74		1,348,666,422.11	-902,469,714.98	10,055,343,047.13
(一) 综合收益总额				-418,326,422.07			6,200,818,119.96	5,782,491,697.89
(二) 所有者投入和减少资本		10,000,000,000.00						10,000,000,000.00
1. 所有者投入的普通股								
2. 其他权益工具持有者投入资本		10,000,000,000.00						10,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额								
4. 其他								
(三) 利润分配						1,348,666,422.11	-7,066,381,110.61	-5,717,714,688.50
1. 提取盈余公积								
2. 提取一般风险准备						1,348,666,422.11	-1,348,666,422.11	
3. 对所有者(或股东)的分配							-4,806,214,688.50	-4,806,214,688.50
4. 其他							-911,500,000.00	-911,500,000.00
(四) 所有者权益内部结转				36,906,724.33			-36,906,724.33	
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				36,906,724.33			-36,906,724.33	
6. 其他								
(五) 其他					-9,433,962.26			-9,433,962.26
四、本期末余额	9,612,429,377.00	30,000,000,000.00	20,145,856,411.46	-421,887,827.51	4,867,817,456.10	16,096,939,082.36	24,083,194,642.51	104,384,349,141.92

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

## 母公司所有者权益变动表

2022 年度

编制单位：国信证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	上年同期数				减：库 存股	未分配利润	所有者权益合计
	股本	其他权益工具 — 优先股 — 永续债 — 其他	资本公积	其他综合收益			
一、上年年末余额	9,612,429,377.00	10,000,000,000.00	20,155,224,409.35	113,780,261.14	4,867,817,456.10	21,809,406,974.74	79,556,158,027.19
加：会计政策变更							
前期差错更正							
其他							
二、本年期初余额	9,612,429,377.00	10,000,000,000.00	20,155,224,409.35	113,780,261.14	4,867,817,456.10	21,809,406,974.74	79,556,158,027.19
三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)			65,964.37	-154,248,390.91	1,750,773,111.39	3,176,257,382.75	14,772,848,067.60
(一) 综合收益总额				-784,954,798.53		8,680,095,658.47	7,895,140,859.94
(二) 所有者投入和减少资本		10,000,000,000.00					10,000,000,000.00
1. 所有者投入的普通股							
2. 其他权益工具持有者投入资本		10,000,000,000.00					10,000,000,000.00
3. 股份支付计入所有者权益的金额							
4. 其他							
(三) 利润分配					1,750,773,111.39	-4,873,131,868.10	-3,122,358,756.71
1. 提取盈余公积							
2. 提取一般风险准备					1,750,773,111.39	-1,750,773,111.39	
3. 对所有者(或股东)的分配						-2,210,858,756.71	-2,210,858,756.71
4. 其他						-911,500,000.00	-911,500,000.00
(四) 所有者权益内部结转				630,706,407.62		-630,706,407.62	
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				630,706,407.62		-630,706,407.62	
6. 其他							
(五) 其他			65,964.37				65,964.37
四、本期期末余额	9,612,429,377.00	20,000,000,000.00	20,155,290,373.72	-40,468,129.77	4,867,817,456.10	24,985,664,357.49	94,329,006,094.79

法定代表人：张纳沙

主管会计工作的负责人：周中国

会计机构负责人：周中国

# 国信证券股份有限公司 财务报表附注 2022 年度

金额单位：人民币元

## 一、公司基本情况

国信证券股份有限公司（以下简称公司或本公司）系经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准，由国信证券有限责任公司整体改制设立，于 2008 年 3 月 25 日在深圳市工商行政管理局登记注册，总部位于广东省深圳市。公司现持有统一社会信用代码为 914403001922784445 的营业执照，注册资本为人民币 9,612,429,377.00 元，股本总数 9,612,429,377 股（每股面值 1 元）。其中，有限售条件的 A 股流通股份 785,310,733 股；无限售条件的 A 股流通股份 8,827,118,644 股。公司股票已于 2014 年 12 月 29 日在深圳证券交易所挂牌交易。

本公司主要经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品；股票期权做市；上市证券做市交易。

本公司的母公司为深圳市投资控股有限公司（以下简称深圳投控公司）。

截至 2022 年 12 月 31 日，公司拥有 10 家子公司（含全资子公司），58 家分公司，183 家证券营业部；拥有员工 12,189 人，其中关键高级管理人员 13 人。

本财务报表业经公司 2023 年 4 月 28 日第五届第十五次董事会批准对外报出。

本公司将国信弘盛私募基金管理有限公司（以下简称国信弘盛公司）、国信期货有限责任公司（以下简称国信期货公司）、国信证券（香港）金融控股有限公司（以下简称国信香港公司）、国信资本有限责任公司（以下简称国信资本公司）等 10 家子公司纳入本期合并财务报表范围，情况详见本财务报表附注七和八之说明。

## 二、财务报表的编制基础

### （一）编制基础

本公司财务报表以持续经营为编制基础。

### （二）持续经营能力评价

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。

### 三、重要会计政策及会计估计

重要提示：本公司根据实际生产经营特点针对金融工具减值、收入确认、买入返售及卖出回购金融资产、融资融券业务的核算、转融通业务等交易或事项制定了具体会计政策和会计估计。

#### （一）遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了企业的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

#### （二）会计期间

会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

#### （三）记账本位币

本公司及境内子公司采用人民币为记账本位币，国信香港公司等境外子公司从事境外经营，选择其经营所处的主要经济环境中的货币为记账本位币。

#### （四）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。

#### （五）合并财务报表的编制方法

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。

#### （六）合营安排分类及共同经营会计处理方法

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。

## （七）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。

## （八）外币业务和外币报表折算

### 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。

## （九）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。

## （十）金融工具

### 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：① 按照金融工具的减值规定确定的损失准备金额；② 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：

① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 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。

对于由《企业会计准则第 14 号——收入》规范的交易形成，且不含重大融资成分或者公司不考虑不超过一年的合同中的融资成分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。如果金融工具逾期超过 30 天，则公司将其界定为违约。

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。

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并采用三阶段模型计量预期信用损失的金融工具

项目	确定组合的依据	计提预期信用损失的方法
融出资金——融资融券业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、预期信用损失率和前瞻性信息计算预期信用损失。
买入返售金融资产——约定购回、行权融资和小微通	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。
融出资金——孖展业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。
融出资金——限制性股票融资业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率和前瞻性信息，计算预期信用损失。
买入返售金融资产——股票质押回购业务	业务性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他债权投资——国债、政策性金融债、央票	风险特征	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口、违约率、违约损失率、折现因子和前瞻性信息，计算预期信用损失。
其他债权投资——信用债以及地方政府债	风险特征	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。
其他应收款——应收往来款组合	款项性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。
其他应收款——应收押金保证金组合	款项性质	根据初始确认后信用风险是否显著增加或是否已发生信用减值，按照未来 12 个月内或整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；通过风险敞口和预期信用损失率，计算预期信用损失。

(3) 采用简化计量方法，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	计提预期信用损失的方法
应收款项——账龄组合	应收款账龄	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，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
应收款项——特定款项组合	款项性质	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，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
合同资产——账龄组合	合同账龄	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，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。
合同资产——特定款项组合	款项性质	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，通过风险敞口和整个存续期预期信用损失率，计算预期信用损失。

## 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。

### （十一）合同成本

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。如果合同取得成本的摊销期限不超过一年，在发生时直接计入当期损益。

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。

## （十二）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。

公司将发行相关的费用计入当期损益。

## （十三）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。

## （十四）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，详见本财务报表附注五（四）4之说明。

## （十五）融资融券业务

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。

## （十六）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。

## （十七）长期股权投资

### 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。

#### (十八) 投资性房地产

1. 投资性房地产包括已出租的建筑物。

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。房屋及建筑物预计可使用年限及残值率分别为:

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	30-50	5	1.9- 3.17

#### (十九) 固定资产

##### 1. 固定资产确认条件

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. 各类固定资产的折旧方法

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	30-50	5	1.9- 3.17
交通工具	年限平均法	10	5	9.5
电子设备	年限平均法	3-5	5	19-31.67
办公设备及其他	年限平均法	5	5	19

#### (二十) 在建工程

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。

## （二十一）借款费用

### 1. 借款费用资本化的确认原则

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

### 2. 借款费用资本化期间

（1）当借款费用同时满足下列条件时，开始资本化：1）资产支出已经发生；2）借款费用已经发生；3）为使资产达到预定可使用或可销售状态所必要的购建或者生产活动已经开始。

（2）若符合资本化条件的资产在购建或者生产过程中发生非正常中断，并且中断时间连续超过3个月，暂停借款费用的资本化；中断期间发生的借款费用确认为当期费用，直至资产的购建或者生产活动重新开始。

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

### 3. 借款费用资本化金额

为购建或者生产符合资本化条件的资产而借入专门借款的，以专门借款当期实际发生的利息费用（包括按照实际利率法确定的折价或溢价的摊销），减去将尚未动用的借款资金存入银行取得的利息收入或进行暂时性投资取得的投资收益后的金额，确定应予资本化的利息金额；为购建或者生产符合资本化条件的资产占用了一般借款的，根据累计资产支出超过专门借款的资产支出加权平均数乘以占用一般借款的资本化率，计算确定一般借款应予资本化的利息金额。

## （二十二）无形资产

1. 无形资产包括土地使用权、计算机软件及交易席位费等，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：

（1）计算机软件按5年摊销；

（2）土地使用权，按照房地产证上的土地使用年限摊销；

本公司将交易席位费视为使用寿命不确定的无形资产。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。对使用寿命不确定的无形资产，使用寿命不确定的判断依据是：是否在不确定的期间内为企业产生现金流量。

## （二十三）部分长期资产减值

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。

## （二十四）长期待摊费用

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。

## （二十五）职工薪酬

1. 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。

2. 短期薪酬的会计处理方法

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。

3. 离职后福利的会计处理方法

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。

4. 辞退福利的会计处理方法

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。

5. 其他长期职工福利的会计处理方法

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。

## （二十六）预计负债

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。

## （二十七）永续债等其他金融工具

根据金融工具相关准则、《金融负债与权益工具的区分及相关会计处理规定》（财会〔2014〕13号）和《永续债相关会计处理的规定》（财会〔2019〕2号），对发行的永续债，公司依据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融资产、金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该等金融工具或其组成部分分类为金融资产、金融负债或权益工具。

在资产负债表日，对于归类为权益工具的金融工具，其利息支出或股利分配作为公司的利润分配，其回购、注销等作为权益的变动处理；对于归类为金融负债的金融工具，其利息支出或股利分配按照借款费用进行处理，其回购或赎回产生的利得或损失等计入当期损益。

## （二十八）收入

### 1. 收入确认原则

于合同开始日，公司对合同进行评估，识别合同所包含的各单项履约义务，并确定各单项履约义务是在某一时段内履行，还是在某一时点履行。

满足下列条件之一时，属于在某一时段内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：（1）客户在公司履约的同时即取得并消耗公司履约所带来的经济利益；（2）客户能够控制公司履约过程中在建商品或服务；（3）公司履约过程中所产出的商品或服务具有不可替代用途，且公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，公司在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。对于在某一时点履行的履约义务，在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。在判断客户是否已取得商品控制权时，公司考虑下列迹象：（1）公司就该商品享有现时收款权利，即客户就该商品负有现时付款义务；（2）公司已将该商品的法定所有权转移给客户，即客户已拥有该商品的法定所有权；（3）公司已将该商品实物转移给客户，即客户已实物占有该商品；（4）公司已将该商品所有权上的主要风险和报酬转移给客户，即客户已取得该商品所有权上的主要风险和报酬；（5）客户已接受该商品；（6）其他表明客户已取得商品控制权的迹象。

### 2. 收入计量原则

（1）公司按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。交易价格是公司因向客户转让商品或服务而预期有权收取的对价金额，不包括代第三方收取的款项以及预期将退还给客户的款项。

（2）合同中存在可变对价的，公司按照期望值或最可能发生金额确定可变对价的最佳估计数，但包含可变对价的交易价格，不超过在相关不确定性消除时累计已确认收入极可能不会发生重大转回的金额。

(3) 合同中存在重大融资成分的，公司按照假定客户在取得商品或服务控制权时即以现金支付的应付金额确定交易价格。该交易价格与合同对价之间的差额，在合同期间内采用实际利率法摊销。合同开始日，公司预计客户取得商品或服务控制权与客户支付价款间隔不超过一年的，不考虑合同中存在的重大融资成分。

(4) 合同中包含两项或多项履约义务的，公司于合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务。

### 3. 收入确认的具体方法

#### (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，在保荐服务和财务顾问服务完成且取得收款证据时确认为收入。

##### 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，在投资咨询服务完成且取得收款证据时确认为收入。

#### (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。

### (3) 让渡资产使用权的收入

公司在同时满足相关的经济利益很可能流入、收入金额能够可靠计量时，确认让渡资产使用权的收入。

## (二十九) 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

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

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。

## (三十) 合同资产、合同负债

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。

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。

## (三十一) 递延所得税资产、递延所得税负债

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。

## （三十二）租赁

### 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：1）租赁负债的初始计量金额；2）在租赁期开始日或之前支付的租赁付款额，存在租赁激励的，扣除已享受的租赁激励相关金额；3）承租人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

公司的租赁均为经营租赁。

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。

### （三十三）一般风险准备金和交易风险准备金

公司按当年实现净利润的 10% 分别计提一般风险准备金和交易风险准备金。根据《公开募集证券投资基金风险准备金监督管理暂行办法》的规定，每月按照不低于公募基金托管费收入的 2.5% 提取一般风险准备金；根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，每月按照不低于大集合资产管理业务管理费收入的 10% 计提一般风险准备金。

### （三十四）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。

### （三十五）其他重要的会计政策和会计估计

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。

（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) 公允价值套期

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。

## 2) 现金流量套期

① 套期工具利得或损失中属于有效套期的部分，作为现金流量套期储备，计入其他综合收益，无效部分计入当期损益。现金流量套期储备的金额按照以下两项的绝对额中较低者确认：A. 套期工具自套期开始的累计利得或损失；B. 被套期项目自套期开始的预计未来现金流量现值的累计变动额。

② 被套期项目为预期交易，且该预期交易使公司随后确认一项非金融资产或非金融负债的，或者非金融资产和非金融负债的预期交易形成一项适用于公允价值套期会计的确定承诺时，将原在其他综合收益中确认的现金流量套期储备金额转出，计入该资产或负债的初始确认金额。

③ 其他现金流量套期，原计入其他综合收益的现金流量套期储备金额，在被套期预期交易影响损益的相同期间转出，计入当期损益。

## （三十六）重要会计政策变更说明

### 企业会计准则变化引起的会计政策变更

1. 公司自 2022 年 1 月 1 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 15 号》“关于企业将固定资产达到预定可使用状态前或者研发过程中产出的产品或副产品对外销售的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

2. 公司自 2022 年 1 月 1 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 15 号》“关于亏损合同的判断”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

3. 公司自 2022 年 11 月 30 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 16 号》“关于发行方分类为权益工具的金融工具相关股利的所得税影响的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无重大影响。

4. 公司自 2022 年 11 月 30 日起执行财政部颁布的《企业会计准则解释第 16 号》“关于企业将以现金结算的股份支付修改为以权益结算的股份支付的会计处理”规定，该项会计政策变更对公司财务报表无影响。

## 四、税项

### (一) 主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	以按税法规定计算的销售货物和应税劳务收入为基础计算销项税额，扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应交增值税	3%、6%、9% 和 13%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%、20%、16.5%

不同税率的纳税主体企业所得税税率说明

纳税主体名称	所得税税率
国信香港公司	16.5%
国信证券（香港）经纪有限公司	16.5%
国信证券（香港）融资有限公司	16.5%
国信证券（香港）资产管理有限公司	16.5%
国信（香港）金融产品有限公司	16.5%
国信咨询服务（深圳）有限公司（以下简称国信咨询公司）	20%
除上述以外的其他纳税主体	25%

### (二) 税收优惠

#### 1. 增值税税收优惠

根据《财政部 国家税务总局关于将铁路运输和邮政业纳入营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2013〕106号）、《国家税务总局关于发布〈营业税改征增值税跨境应税行为增值税免税管理办法（试行）〉的公告》（国家税务总局公告2016年第29号），国信咨询公司从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免税优惠政策，国信咨询公司于2014年完成跨境应税服务增值税优惠税收备案登记，自2014年11月1日起至2017年8月31日止享受增值税减免税优惠政策，国信咨询公司于优惠期限到期前申请应税服务增值税优惠备案并完成备案登记，从事离岸服务外包业务中提供的应税服务享受增值税减免税优惠政策延长至2023年8月31日。

#### 2. 企业所得税税收优惠

根据财政部、国家税务总局《关于实施小微企业普惠性税收减免政策的通知》（财税〔2019〕13号）和《关于实施小微企业和个体工商户所得税优惠政策的公告》（财政部 税务总局公告2021年第12号），国信咨询公司的年应纳税所得额不超过100万元的部分，减按12.5%计入应纳税所得额，按20%的税率缴纳企业所得税；对年应纳税所得额超过100万元到不超过300万元的部分，减按50%计入应纳税所得额，按20%的税率缴纳企业所得税。

### (三) 其他说明

根据《国家税务总局关于印发〈跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法〉的公告》（国家税务总局公告 2012 年第 57 号），本公司先汇总公司本部和下属分支机构应纳税所得额，其中 50% 应纳税所得额在本部预缴，50% 应纳税所得额按经营收入、职工工资薪金费用和资产总额三因素计算各所属分支机构应分摊所得税额的比例。本公司所属分支机构按分摊的当期应纳税所得额和各自适用税率计缴企业所得税。

## 五、合并财务报表项目注释

### (一) 合并资产负债表项目注释

#### 1. 货币资金

##### (1) 类别明细

项目	期末数	期初数
库存现金	140,842.95	111,697.21
银行存款	64,936,992,136.61	67,713,455,838.53
其中：自有资金存款	8,939,078,976.30	5,731,776,517.81
客户资金存款	55,997,913,160.31	61,981,679,320.72
其他货币资金	40,693,292.97	8,173,501.56
合计	64,977,826,272.53	67,721,741,037.30
其中：存放在境外的款项总额	2,525,291,407.78	2,236,699,324.88

##### (2) 币种明细

项目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
库存现金：						
人民币			62,560.43			48,238.01
美元	2,203.00	6.9646	15,343.01	2,203.00	6.3757	14,045.67
港元	70,457.30	0.8933	62,939.51	60,437.30	0.8176	49,413.53
小计			140,842.95			111,697.21
银行存款：						
其中：自有资金存款						
人民币			7,821,551,654.12			4,944,098,868.59
美元	53,606,984.73	6.9646	373,351,205.85	48,250,675.02	6.3757	307,631,828.73
港元	830,193,375.51	0.8933	741,611,742.34	584,089,589.23	0.8176	477,551,648.15
欧元	345,467.84	7.4229	2,564,373.23	345,467.48	7.2197	2,494,171.57
英镑	0.09	8.3941	0.76	0.09	8.6064	0.77
小计			8,939,078,976.30			5,731,776,517.81

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
客户资金存款						
人民币			53,639,862,984.13			59,866,030,319.50
美元	115,817,012.46	6.9646	806,619,165.00	128,751,768.11	6.3757	820,882,647.94
港元	1,736,741,308.80	0.8933	1,551,431,011.18	1,583,618,338.15	0.8176	1,294,766,353.28
小 计			55,997,913,160.31			61,981,679,320.72
银行存款小计			64,936,992,136.61			67,713,455,838.53
其他货币资金：						
人民币			40,693,292.97			8,173,501.56
合 计			64,977,826,272.53			67,721,741,037.30

### (3) 融资融券业务信用资金明细情况

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
自有信用资金：						
人民币			452,025.45			231,063.10
客户信用资金：						
人民币			5,479,172,700.97			5,017,759,448.14
美元	13,949,038.51	6.9646	97,149,473.61	12,010,303.05	6.3757	76,574,089.16
港元	358,058,600.12	0.8933	319,853,747.49	419,609,694.05	0.8176	343,072,885.86
小 计			5,896,175,922.07			5,437,406,423.16
总 计			5,896,627,947.52			5,437,637,486.26

### (4) 其他说明

2022年12月31日，本公司使用受限的货币资金为人民币1,228,187,600.13元（期初本公司使用受限的货币资金为人民币82,630,050.90元）。

## 2. 结算备付金

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
公司自有备付金：						
人民币			2,899,165,230.67			3,816,304,532.30
公司备付金总计			2,899,165,230.67			3,816,304,532.30
客户普通备付金：						
人民币			11,226,355,641.05			10,940,968,569.26
美元	3,227,496.65	6.9646	22,478,223.17	5,132,181.34	6.3757	32,721,248.57
港币	380,699,729.48	0.8933	340,079,068.34	597,080,821.79	0.8176	488,173,279.90
小 计			11,588,912,932.56			11,461,863,097.73

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
客户信用备付金：						
人民币			1,246,721,124.47			1,809,656,390.74
客户备付金总计			12,835,634,057.03			13,271,519,488.47
合 计			15,734,799,287.70			17,087,824,020.77

### 3. 融出资金

#### (1) 明细情况——按类别

项 目	期末数	期初数
境内		
其中：个人	49,240,677,848.54	56,670,011,963.68
机构	3,322,956,492.03	5,104,200,709.88
减：减值准备	141,760,440.43	184,653,819.86
账面价值小计	52,421,873,900.14	61,589,558,853.70
境外		
其中：个人	237,691,468.77	366,046,066.69
机构	14,296,201.50	18,707,590.78
减：减值准备	1,766,946.39	1,000,661.74
账面价值小计	250,220,723.88	383,752,995.73
合 计	52,672,094,624.02	61,973,311,849.43

#### (2) 担保物情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
股票	153,309,197,256.70	203,029,348,589.90
资金	6,934,664,621.32	6,938,863,758.76
基金	5,083,701,370.47	4,538,000,091.87
债券	262,823,555.68	188,259,177.65
合 计	165,590,386,804.17	214,694,471,618.18

注：担保物包含融出资金、融出证券、孖展融资及限制性股票融资的担保物

## (3) 减值准备变动情况

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
期初数	175,889,772.56		9,764,709.04	185,654,481.60
本期计提	-38,319,434.23		-3,826,099.60	-42,145,533.83
本期转销				
其他	60,875.05		-42,436.00	18,439.05
期末数	137,631,213.38		5,896,173.44	143,527,386.82

## 4. 衍生金融资产、衍生金融负债

## (1) 明细情况

项目	期末数			期初数		
	非套期工具			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						
利率互换	155,310,000,000.00	2,762,965.10		96,800,000,000.00		508,848.58
利率期权				210,000,000.00		67,674.49
小计	155,310,000,000.00	2,762,965.10		97,010,000,000.00		576,523.07
权益衍生工具						
收益互换	8,529,686,351.75	16,674,964.08		7,786,021,581.72		118,207,886.15
收益凭证	3,595,584,000.00	584,576.34		2,588,811,000.00		26,255.62
股指期货	15,623,176,920.80			5,341,983,231.94		
股票期权	1,717,901,080.87		101,365,316.25	533,419,598.00		33,621,508.46
股指期权	6,007,595,000.00		219,352,260.00	414,180,000.00		65,016,000.00
小计	35,473,943,353.42	17,259,540.42	320,717,576.25	16,664,415,411.66		216,871,650.23
其他衍生工具						
商品期货	2,417,805,454.66			2,994,375.00		
信用缓释工具	1,677,000,000.00	38,747,234.30		1,348,000,000.00	27,794,294.99	
场外期权	27,015,046,321.74	108,197,258.90	1,191,898.25	3,029,100,783.47		6,876,198.99
远期合约				292,695,000.00	30,172,566.37	1,725,136.00
小计	31,109,851,776.40	146,944,493.20	1,191,898.25	4,672,790,158.47	57,966,861.36	8,601,334.99
合计	221,893,795,129.82	164,204,033.62	324,672,439.60	118,347,205,570.13	57,966,861.36	226,049,508.29

## (2) 股指期货合约和商品期货合约

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本公司于 2022 年 12 月 31 日所持有的股指期货合约和商品期货合约产生的持仓损益，衍生金融负债项下的股指期货合约和商品期货合约与相关的股指期货暂收暂付款和商品期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额列示，2022 年 12 月 31 日抵销后的净额为人民币零元，公允价值变动损失为人民币 87,143,395.10 元（期初本公司股指期货合约和商品期货合约公允价值变动损失为人民币 52,869,917.70 元）。

### 5. 存出保证金

项 目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
交易保证金：						
人民币			7,426,234,993.72			6,091,233,351.00
美元	270,000.00	6.9646	1,880,442.00	270,000.00	6.3757	1,721,439.00
港币	13,272,757.74	0.8933	11,856,554.49	18,122,623.88	0.8176	14,817,057.28
小 计			7,439,971,990.21			6,107,771,847.28
信用保证金：						
人民币			460,249,500.93			1,479,800,482.15
合 计			7,900,221,491.14			7,587,572,329.43

### 6. 应收款项

#### (1) 明细情况

项 目	期末数	期初数
应收清算款项	3,034,359,842.36	612,562,580.41
应收逾期融资款	1,204,127,753.04	1,112,678,810.23
场外期权预付金	579,533,572.22	
应收手续费及佣金	573,709,946.33	556,943,910.26
应收代垫款项	192,321,168.57	192,920,040.68
应收利率互换款项	183,386,907.61	141,605,363.90
应收期权费	116,315,929.84	12,721,222.26
应收融资融券客户款	101,062,052.52	103,365,026.41
应收违约债券	143,186,803.04	30,000,000.00
收益互换预付金	67,100,000.00	1,599,952.00
应收期货交易款	42,878,167.28	27,299,447.90
应收结算担保金	31,387,620.93	48,804,430.10
应收大宗商品销售款	25,087,414.32	55,862,524.73
其他	35,611,826.56	31,368,615.13
减：坏账准备（按简化模型计提）	1,601,134,132.87	1,495,136,213.80
合 计	4,728,934,871.75	1,432,595,710.21

## (2) 账龄分析

项 目	期末数		期初数	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内	4,718,244,502.09	74.54	1,930,248,452.02	65.93
1-2年	633,621,181.71	10.01	44,660,359.34	1.53
2-3年	35,497,266.42	0.56	253,081,383.44	8.64
3年以上	942,706,054.40	14.89	699,741,729.21	23.90
合 计	6,330,069,004.62	100.00	2,927,731,924.01	100.00

## (3) 坏账准备计提明细情况

## 1) 类别明细情况

种 类	期末数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额 合计比例 (%)	金额	坏账准备 计提比例 (%)
单项计提坏账准备				
—应收逾期融资款	1,204,127,753.04	19.02	1,204,127,753.04	100.00
—应收违约债券	143,186,803.04	2.26	45,353,968.82	31.67
—应收代垫款项	192,321,168.57	3.04	192,043,188.90	99.86
—应收融资融券款	101,062,052.52	1.60	101,032,348.63	99.97
—其他	34,695,189.93	0.55	34,695,189.93	100.00
小 计	1,675,392,967.1	26.47	1,577,252,449.32	94.14
组合计提坏账准备				
账龄组合	412,150,208.54	6.51	23,881,683.55	5.79
特定款项组合	4,242,525,828.98	67.02		
小 计	4,654,676,037.52	73.53	23,881,683.55	0.51
合 计	6,330,069,004.62	100.00	1,601,134,132.87	25.29

(续上表)

种类	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	占账面余额 合计比例 (%)	金额	坏账准备 计提比例 (%)
单项计提坏账准备				
—应收逾期融资款	1,112,678,810.23	38.00	1,112,678,810.23	100.00
—应收违约债券	30,000,000.00	1.02	30,000,000.00	100.00
—应收代垫款项	192,920,040.68	6.59	192,013,485.01	99.53
—应收融资融券款	103,365,026.41	3.53	103,335,322.52	99.97
—其他	39,440,697.11	1.35	39,440,697.11	100.00
小计	1,478,404,574.43	50.50	1,477,468,314.87	99.94
组合计提坏账准备				
账龄组合	411,445,981.26	14.05	17,667,898.93	4.29
特定款项组合	1,037,881,368.32	35.45		
小计	1,449,327,349.58	49.50	17,667,898.93	1.22
合计	2,927,731,924.01	100.00	1,495,136,213.80	51.07

## 2) 按账龄组合计提坏账准备的应收账款

账龄	期末数		坏账准备	期初数		坏账准备
	账面金额	比例 (%)		账面金额	比例 (%)	
1年以内	302,896,977.90	73.49	1,490,982.96	320,308,126.28	77.85	1,535,381.65
1至2年	28,918,875.66	7.02	1,445,943.78	22,389,258.25	5.44	1,119,462.91
2至3年	16,394,543.27	3.98	1,639,454.33	28,560,287.80	6.94	2,856,028.78
3年以上	63,939,811.71	15.51	19,305,302.48	40,188,308.93	9.77	12,157,025.59
合计	412,150,208.54	100.00	23,881,683.55	411,445,981.26	100.00	17,667,898.93

## (4) 应收款项金额前五名情况

项目	款项性质	期末余额 [注 4]	账龄	占应收款项总额的比例 (%)
客户 A	[注 1]	278,747,120.97	1-2年	4.40
客户 B	[注 2]	224,966,208.14	3年以上	3.55
客户 C	[注 3]	192,013,485.01	3年以上	3.03
客户 D	[注 1]	186,292,000.00	1-2年	2.94
客户 E	[注 2]	157,407,207.26	3年以上	2.49
合计		1,039,426,021.38		16.42

[注 1] 系股票质押回购业务逾期本金

[注 2] 系国信香港公司开展的融资业务逾期本金及利息

[注 3] 系垫付的和解款

[注 4] 期末余额前五名应收账款相应计提的坏账准备期末余额汇总金额为人民币 1,039,426,021.38 元

(5) 应收款项坏账准备变动情况

详见本财务报表附注五（一）20 之说明。

(6) 报告期应收款项中应收持本公司 5%（含 5%）以上有表决权股份的股东单位的款项及关联方的款项

详见本财务报表附注十一（三）之说明。

## 7. 买入返售金融资产

(1) 明细情况——按业务类别

项目	期末数	期初数
债券质押式回购	11,069,642,034.26	2,465,447,560.67
股票质押式回购	5,721,712,124.81	5,323,601,200.41
行权融资	300,134,417.38	206,344,832.53
约定购回式回购	38,778,507.45	53,361,074.64
减：减值准备	1,305,749,652.15	1,277,760,261.14
合计	15,824,517,431.75	6,770,994,407.11

(2) 明细情况——按金融资产种类

项目	期末数	期初数
债券	11,069,642,034.26	2,465,447,560.67
股票	5,760,490,632.26	5,376,962,275.05
其他	300,134,417.38	206,344,832.53
减：减值准备	1,305,749,652.15	1,277,760,261.14
合计	15,824,517,431.75	6,770,994,407.11

(3) 担保物情况

项目	期末公允价值	期初公允价值
担保物	14,157,080,721.92	19,215,968,525.23
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物		
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物		

注：上述担保物不包括交易所质押式逆回购交易取得的担保物的公允价值。

(4) 约定购回融出资金

剩余期限	期末数	期初数
1 个月内	7,441,469.78	4,942,345.20
1 个月至 3 个月内	5,468,079.89	4,395,675.77
3 个月至 1 年内	25,868,957.78	44,023,053.67
1 年以上		
小计	38,778,507.45	53,361,074.64

## (5) 股票质押式回购融出资金

剩余期限	期末数	期初数
1 个月内	3,009,394,234.88	3,116,244,891.39
1 个月至 3 个月内	135,352,771.35	367,588,762.09
3 个月至 1 年内	2,576,965,118.58	1,712,954,333.82
1 年以上		126,813,213.11
小 计	5,721,712,124.81	5,323,601,200.41

## (6) 减值准备变动情况

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小计
	未来 12 个月 预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
期初数	6,185,274.12		1,271,574,987.02	1,277,760,261.14
期初数在本期	—	—	—	
-- 转入第二阶段				
-- 转入第三阶段	-1,104,239.41		1,104,239.41	
-- 转回第一阶段				
本期计提	-1,208,243.17		29,197,634.18	27,989,391.01
本期转回				
期末数	3,872,791.54		1,301,876,860.61	1,305,749,652.15

## 8. 交易性金融资产

## (1) 明细情况

项 目	期末数			
	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	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
	公允价值小计		初始成本小计	
债券	119,739,042,711.12	119,739,042,711.12	119,090,969,047.61	119,090,969,047.61
公募基金	16,727,868,981.52	16,727,868,981.52	17,298,045,187.64	17,298,045,187.64
股票	4,389,698,479.05	4,389,698,479.05	4,360,471,575.19	4,360,471,575.19
银行理财产品	6,330,475,561.97	6,330,475,561.97	6,314,600,000.00	6,314,600,000.00
券商资管产品	1,733,867,258.15	1,733,867,258.15	1,725,206,254.04	1,725,206,254.04
信托计划	220,493,801.58	220,493,801.58	191,754,430.85	191,754,430.85
私募基金及专户	8,693,185,323.87	8,693,185,323.87	8,224,202,070.77	8,224,202,070.77
其他股权投资	1,637,041,120.18	1,637,041,120.18	1,562,393,930.47	1,562,393,930.47
其他	900,000.00	900,000.00	900,000.00	900,000.00
合 计	159,472,573,237.44	159,472,573,237.44	158,768,542,496.57	158,768,542,496.57

(续上表)

项 目	期初数			
	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	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
	公允价值小计		初始成本小计	
债券	107,281,729,196.51	107,281,729,196.51	105,712,535,595.09	105,712,535,595.09
公募基金	23,109,626,726.13	23,109,626,726.13	22,781,999,082.92	22,781,999,082.92
股票	4,917,854,505.12	4,917,854,505.12	4,017,891,492.21	4,017,891,492.21
银行理财产品	2,359,071,808.45	2,359,071,808.45	2,344,000,000.00	2,344,000,000.00
券商资管产品	6,100,221,051.49	6,100,221,051.49	5,886,466,002.59	5,886,466,002.59
信托计划	264,276,340.84	264,276,340.84	223,834,630.85	223,834,630.85
私募基金及专户	7,234,125,344.83	7,234,125,344.83	6,652,621,606.30	6,652,621,606.30
其他股权投资	1,044,318,301.67	1,044,318,301.67	984,730,748.87	984,730,748.87
其他	900,000.00	900,000.00	900,000.00	900,000.00
合 计	152,312,123,275.04	152,312,123,275.04	148,604,979,158.83	148,604,979,158.83

## (2) 其他说明

1) 2022年12月31日, 本公司为回购交易设定质押或过户的债券的公允价值计人民币 74,507,012,374.44 元, 为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币 11,578,050,552.00 元, 为期货业务充抵保证金设定质押的债券的公允价值计人民币 5,329,114,874.00 元。

2) 2022年12月31日, 本公司持有的限售股的公允价值计人民币 1,218,725,204.49 元。

**9. 其他债权投资**

## (1) 明细情况

项 目	期末数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	2,607,104,455.74	33,420,150.61	8,645,919.01	2,649,170,525.36	
地方债	25,284,328,996.15	414,821,168.84	81,626,040.74	25,780,776,205.73	6,730,808.71
金融债	1,876,401,177.45	35,631,765.47	4,425,437.68	1,916,458,380.60	229,733.18
企业债	7,076,590,637.42	141,289,192.15	-239,818,082.42	6,978,061,747.15	253,635,813.61
中期票据	11,882,585,278.91	180,961,287.66	36,803,941.09	12,100,350,507.66	13,014,298.19
非公开定向债务融资工具	19,614,004.17	690,350.68	81,035.83	20,385,390.68	62,115.53
资产支持证券	1,365,181,824.59	9,582,437.78	6,950,121.41	1,381,714,383.78	2,099,401.02
其他	662,571,207.48	12,187,841.09	-203,437.48	674,555,611.09	474,888.41
合计	50,774,377,581.91	828,584,194.28	-101,489,024.14	51,501,472,752.05	276,247,058.65

(续上表)

项目	期初数				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	2,186,178,919.14	27,505,011.89	9,375,271.06	2,223,059,202.09	
地方债	16,795,265,515.27	260,767,274.25	125,841,657.65	17,181,874,447.17	4,932,049.44
金融债	2,041,339,495.49	43,482,602.14	16,358,518.65	2,101,180,616.28	
企业债	5,729,765,601.05	118,449,496.22	-332,425,426.87	5,515,789,670.40	364,485,960.37
中期票据	2,042,327,698.24	40,097,123.30	13,755,401.76	2,096,180,223.30	8,201,764.81
次级债	30,001,837.47	1,080,780.82	43,042.53	31,125,660.82	66,741.89
非公开定向债务融资工具	320,104,842.81	6,265,945.20	4,057,947.19	330,428,735.20	2,653,811.73
资产支持证券	159,454,805.93	595,271.05	4,585,814.07	164,635,891.05	8,655,949.14
合计	29,304,438,715.40	498,243,504.87	-158,407,773.96	29,644,274,446.31	388,996,277.38

注：2022年12月31日，本公司为回购交易设定质押的债券的公允价值计人民币41,656,481,476.92元，为债券借贷业务设定质押的债券的公允价值计人民币2,438,557,570.00元，为期货业务充抵保证金设定质押的债券的公允价值计人民币3,045,642,030.00元。

## (2) 减值准备变动情况

项目	第一阶段		第二阶段		第三阶段		小计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期信用损失（未 发生信用减值）	整个存续期预期信用损失（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）	整个存续期预期信用损失 （已发生信用减值）	整个存续期预期信用损失 （已发生信用减值）	
期初数	29,490,334.13		77,568,993.25		281,936,950.00		388,996,277.38
期初数在本期	—		—		—		
-- 转入第二阶段	-1,927,438.37		1,927,438.37				
-- 转入第三阶段	-888,726.40				888,726.40		
本期计提	208,104,826.92		152,833,412.97		-151,208,882.56		209,729,357.33
本期转销	209,198,342.07		46,311,283.99		66,968,950.00		322,478,576.06
期末数	25,580,654.21		186,018,560.60		64,647,843.84		276,247,058.65

## 10. 其他权益工具投资

## (1) 明细情况

项目	期末数		
	初始成本	公允价值	本期确认的 股利收入
非交易性权益工具	11,149,557,465.26	10,429,791,008.15	830,660,000.30

(续上表)

项目	期初数		本期确认的股利收入
	初始成本	公允价值	
非交易性权益工具	7,430,653,430.96	7,186,022,265.21	1,217,035,075.24

(2) 指定为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的原因

本公司将部分权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资，主要包括以融出证券为目的持有的证券投资、策略投资持有的证券投资。

上述其他权益工具投资包含本公司以融出证券为目的持有的证券投资，2022年12月31日该部分非交易性权益工具成本计人民币140,218,754.28元，公允价值计人民币167,719,186.89元。

上述其他权益工具投资包含本公司策略投资持有的证券投资，2022年12月31日该部分非交易性权益工具成本计人民币11,009,338,710.98元，公允价值计人民币10,262,071,821.26元。

(3) 本期终止确认的其他权益工具投资

1) 明细情况

项目	终止确认时公允价值	本期股利收入	终止确认时从其他综合收益转入留存收益的累计利得和损失
股票	1,367,816,934.45	39,462,342.90	-111,357,152.95
小计	1,367,816,934.45	39,462,342.90	-111,357,152.95

2) 处置权益工具投资的原因

其他权益工具投资处置的原因主要系本公司根据融券客户的需求调整融券证券持仓和投资策略调整所致。

## 11. 长期股权投资

(1) 分类情况

项目	期末数		期初数			
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对联营企业投资	2,953,052,871.67		2,953,052,871.67	2,963,816,037.14		2,963,816,037.14
对合营企业投资	515,415,348.54		515,415,348.54	597,523,589.06		597,523,589.06
合计	3,468,468,220.21		3,468,468,220.21	3,561,339,626.20		3,561,339,626.20

(2) 明细情况

被投资单位	期初数	本期增减变动							期末数	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		
联营企业:										
鹏华基金管理有限公司(鹏华基金公司)	1,856,178,206.53			506,228,903.96			323,000,000.00			2,039,407,110.49
前海股交投资控股(深圳)有限公司	207,845,525.01			-13,029,785.60		821,378.50	1,324,436.20			194,312,681.71
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	31,514,105.95			1,611,116.76			1,000,000.00			32,125,222.71
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金(有限合伙)	218,293,651.98		3,116,681.15	-96,418,909.63			39,083,318.85			79,674,742.35
常州高新创业投资有限公司	92,176,675.89		24,649,039.51	25,231,327.91			7,228,223.42			85,530,740.87
深圳市前海弘泰基金管理有限公司	9,436,691.92			-173,121.20						9,263,570.72
深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司	4,508,887.47									4,508,887.47
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	79,023,666.26		2,857,627.12	-35,901,697.52			2,951,443.11			37,312,898.51
深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙)	30,951,605.72		11,455,426.35	-7,649,214.79			-10,499,291.76			22,346,256.34
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	55,748,775.91			-10,293,808.36						45,454,967.55
深圳弘盛道格体育投资合伙企业(有限合伙)	7,369,245.29		9,481,478.03	2,112,232.74						
国信弘盛(珠海)能源产业基金(有限合伙)	117,060,000.00			-44,710,020.02						116,612,897.98
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	63,505,324.90			-21,892,082.23			1,259,930.88			40,353,311.79
深圳市五色检测技术服务有限公司	2,500,647.71			-114,784.01						2,385,863.70
华润宝塔股权投资(延安)有限公司	614,402.91			-76,890.08						537,512.83
华润(延安)新产业经济投资合伙企业(有限合伙)	876,165.93		876,165.93							
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	67,657,782.41			2,443,604.52						70,101,386.93
国铁盛芯(青岛)股权投资合伙企业(有限合伙)	46,418,589.89			31,374,725.96						77,793,315.85
国铁盛和(青岛)私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	35,136,085.46		20,580,868.00	-5,416,532.37			8,773,007.96			365,677.13
深圳市天使一号创业投资合伙企业(有限合伙)	15,000,000.00	15,000,000.00		-214,377.59						29,785,622.41
盈科值得普泽(平潭)股权投资合伙企业(有限合伙)	5,000,000.00			-75,298.57						4,924,701.43
深圳市创东方长辉投资企业(有限合伙)	17,000,000.00			-1,036,643.98						15,963,356.02
深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)		14,250,000.00		-478.53						14,249,521.47
江门市倚锋骏马二期创业投资合伙企业(有限合伙)		10,000,000.00		42,625.41						10,042,625.41
佛山司南碳伍股权投资合伙企业(有限合伙)		20,000,000.00								20,000,000.00
小计	2,963,816,037.14	59,250,000.00	73,017,286.09	376,303,810.78		821,378.50	374,121,068.66			2,953,052,871.67
合营企业:										
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金(有限合伙)	43,718,386.39		31,087,424.10	95,687,630.40			108,318,592.69			
深圳市国信蓝思基金管理有限公司	9,454,033.60		5,100,000.00	2,678.84			4,356,712.44			
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业(有限合伙)	80,625,768.52			2,471,279.33			39,874,547.48			43,222,500.37
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	432,411,383.17			19,501,251.57						451,912,634.74
珠海国信运通股权投资基金(有限合伙)	20,190,200.74			-10,032,736.07						10,157,464.67
珠海联发安科股权投资基金合伙企业(有限合伙)	11,123,816.64			-1,001,067.88						10,122,748.76
小计	597,523,589.06		36,187,424.10	106,629,036.19			152,549,852.61			515,415,348.54
合计	3,561,339,626.20	59,250,000.00	109,204,710.19	482,932,846.97		821,378.50	526,670,921.27			3,468,468,220.21

## 12. 投资性房地产

项目	房屋及建筑物	合计
账面原值		
期初数	359,257,802.01	359,257,802.01
本期增加金额	42,211,609.03	42,211,609.03
1) 外购		
2) 固定资产转入	42,211,609.03	42,211,609.03
本期减少金额	44,942,991.42	44,942,991.42
1) 处置		
2) 转出至固定资产	42,479,914.97	42,479,914.97
3) 其他	2,463,076.45	2,463,076.45
期末数	356,526,419.62	356,526,419.62
累计折旧和累计摊销		
期初数	70,820,499.70	70,820,499.70
本期增加金额	9,949,945.90	9,949,945.90
1) 计提或摊销	9,924,377.28	9,924,377.28
2) 固定资产转入	25,568.62	25,568.62
本期减少金额	3,366,492.30	3,366,492.30
1) 处置		
2) 其他转出	3,366,492.30	3,366,492.30
期末数	77,403,953.30	77,403,953.30
账面价值		
期末账面价值	279,122,466.32	279,122,466.32
期初账面价值	288,437,302.31	288,437,302.31

## 13. 固定资产

### (1) 账面价值

项目	期末数	期初数
固定资产原价	3,983,909,228.97	3,791,881,295.16
减：累计折旧	1,334,993,674.18	1,111,981,868.87
固定资产减值准备		
加：固定资产清理		
固定资产合计	2,648,915,554.79	2,679,899,426.29

## (2) 固定资产增减变动表

项 目	房屋及建筑物	交通工具	电子设备	办公设备及其他	合 计
账面原值					
期初数	2,670,600,764.70	83,495,182.87	1,006,691,951.39	31,093,396.20	3,791,881,295.16
本期增加金额	42,479,914.97	3,880,140.00	254,081,070.91	5,980,763.07	306,421,888.95
1) 购置		3,777,535.09	73,729,232.17	4,772,037.49	82,278,804.75
2) 在建工程转入			177,807,066.25	1,186,664.60	178,993,730.85
3) 投资性房地产转入	42,479,914.97				42,479,914.97
4) 外币报表折算差额		102,604.91	2,544,772.49	22,060.98	2,669,438.38
本期减少金额	43,021,590.08	3,249,964.00	64,341,739.96	3,780,661.10	114,393,955.14
1) 处置或报废		3,249,964.00	64,341,739.96	3,780,661.10	71,372,365.06
2) 转入投资性房地产	42,211,609.03				42,211,609.03
3) 其他	809,981.05				809,981.05
期末数	2,670,059,089.59	84,125,358.87	1,196,431,282.34	33,293,498.17	3,983,909,228.97
累计折旧					
期初数	412,896,212.12	54,879,045.13	626,010,211.69	18,196,399.93	1,111,981,868.87
本期增加金额	127,623,961.81	6,211,417.53	152,278,606.44	2,660,759.30	288,774,745.08
1) 计提	124,257,469.51	6,112,296.92	150,255,156.22	2,653,256.57	283,278,179.22
2) 投资性房地产转入	3,366,492.30				3,366,492.30
3) 外币报表折算差额		99,120.61	2,023,450.22	7,502.73	2,130,073.56
本期减少金额	25,568.62	3,088,375.80	61,771,081.40	877,913.95	65,762,939.77
1) 处置或报废		3,088,375.80	61,771,081.40	877,913.95	65,737,371.15
2) 转入投资性房地产	25,568.62				25,568.62
3) 其他					
期末数	540,494,605.31	58,002,086.86	716,517,736.73	19,979,245.28	1,334,993,674.18
减值准备					
期初数					
本期增加金额					
本期减少金额					
期末数					
账面价值					
期末账面价值	2,129,564,484.28	26,123,272.01	479,913,545.61	13,314,252.89	2,648,915,554.79
期初账面价值	2,257,704,552.58	28,616,137.74	380,681,739.70	12,896,996.27	2,679,899,426.29

## (3) 未办妥产权证书的固定资产的情况

项目	账面价值	未办妥产权证书原因
深圳市福田区红树福苑小区 20 套人才房	4,680,955.81	人才安居住房为有限产权，仅有购房合同，不予办理房产证
深圳市南山区松坪村三期 4 套人才房	1,021,755.57	
深圳市罗湖区莲馨家园 6 套人才房	4,018,176.62	
深圳市福田区信托花园 8 栋 202 房	436,775.93	因历史原因未办理房产证
绵阳中大财富广场 20-22 层商品房	19,935,614.08	因开发商涉及诉讼
国信金融大厦	1,701,841,272.87	正在办理中
小计	1,731,934,550.88	

## 14. 在建工程

工程名称	期末数		期初数			
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
国信金融大厦装修项目	5,469,608.06		5,469,608.06	12,938,016.90		12,938,016.90
机房设备建设	6,242,398.62		6,242,398.62	6,926,823.40		6,926,823.40
分支机构装修项目	906,415.91		906,415.91	1,993,659.02		1,993,659.02
深圳北综合金融服务中心项目	2,061,777.72		2,061,777.72			
其他项目	5,889,241.17		5,889,241.17	1,998,287.21		1,998,287.21
合计	20,569,441.48		20,569,441.48	23,856,786.53		23,856,786.53

## 15. 使用权资产

项目	房屋及建筑物	合计
成本		
期初数	609,463,725.65	609,463,725.65
本期增加金额	170,857,332.44	170,857,332.44
本期减少金额	65,159,586.08	65,159,586.08
期末数	715,161,472.01	715,161,472.01
累计折旧		
期初数	149,666,455.19	149,666,455.19
本期增加金额	176,801,786.09	176,801,786.09
(1) 计提	176,801,786.09	176,801,786.09
本期减少金额	29,186,974.43	29,186,974.43
期末数	297,281,266.85	297,281,266.85
减值准备		
期初数		
本期增加金额		
(1) 计提		
本期减少金额		
期末数		
账面价值		
期末账面价值	417,880,205.16	417,880,205.16
期初账面价值	459,797,270.46	459,797,270.46

## 16. 无形资产

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合计
账面原值					
期初数	598,127,957.00	587,715,383.20	66,577,562.50	9,115,698.71	1,261,536,601.41
本期增加金额		118,232,922.22		13.93	118,232,936.15
(1) 购置		118,232,922.22			118,232,922.22
(2) 外币报表折算差额				13.93	13.93
本期减少金额		100,000.00			100,000.00
(1) 处置		100,000.00			100,000.00
(2) 外币报表折算差额					
期末数	598,127,957.00	705,848,305.42	66,577,562.50	9,115,712.64	1,379,669,537.56
累计摊销					
期初数	162,304,491.84	376,068,793.28	36,824,817.12	2,823,248.10	578,021,350.34
本期增加金额	13,017,519.68	80,050,936.14		273,081.38	93,341,537.20
(1) 计提	13,017,519.68	79,153,104.36		273,072.13	92,443,696.17
(2) 外币报表折算差额		897,831.78		9.25	897,841.03
本期减少金额		100,000.00			100,000.00
(1) 处置		100,000.00			100,000.00
期末数	175,322,011.52	456,019,729.42	36,824,817.12	3,096,329.48	671,262,887.54
减值准备					
期初数		3,486.11			3,486.11
本期增加金额					
本期减少金额					
期末数		3,486.11			3,486.11
账面价值					
期末账面价值	422,805,945.48	249,825,089.89	29,752,745.38	6,019,383.16	708,403,163.91
期初账面价值	435,823,465.16	211,643,103.81	29,752,745.38	6,292,450.61	683,511,764.96

## 17. 商誉

## (1) 商誉账面原值

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初数	本期企业合并形成	本期减少		期末数
			处置	其他	
收购证券营业部	22,135,974.26				22,135,974.26
收购子公司	10,260,249.61				10,260,249.61
其中：国信期货公司	10,260,249.61				10,260,249.61
合计	32,396,223.87				32,396,223.87

## (2) 商誉减值准备

被投资单位名称或形成商誉的事项	期初数	本期增加		本期减少		期末数
		计提	其他	处置	其他	
收购证券营业部	22,135,974.26					22,135,974.26
小计	22,135,974.26					22,135,974.26

## (3) 商誉减值测试过程

### 1) 收购证券营业部

本公司收购民安证券有限责任公司（以下简称民安证券）17家营业部计提的商誉减值。本公司于2006年1月收购民安证券17家营业部，收购对价与民安证券17家营业部净资产账面价值的差额12,501,991.26元计入商誉。其余9,633,983.00元系本公司历年收购其他证券营业部形成的商誉。

2008年本公司对上述商誉余额进行减值测试，计提商誉减值准备22,135,974.26元。

### 2) 收购国信期货公司

本公司于2007年8月收购国信期货公司，收购对价与国信期货公司净资产账面价值的差额10,260,249.61元计入商誉。

目前国内商品期货市场呈现出快速发展的趋势，市场的影响力越来越大，上市品种越来越丰富，相关的资金正不断地进入期货市场，套期保值的能力被越来越多的投资者所接受。在未来较长的时间内，商品期货的发展依然延续。随着期货新品种的不断推出，期货市场的发展空间巨大。国信期货公司业已取得商品期货及金融期货的业务资格，预计国信期货公司的可收回金额高于其账面价值，本公司由此判断该商誉不存在减值迹象。

## 18. 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

项目	期末数		期初数	
	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
计提未付的应付职工薪酬	5,478,422,955.23	1,369,605,738.81	6,065,627,821.21	1,516,406,955.31
资产减值准备	2,349,441,458.19	587,360,364.55	2,303,050,239.40	575,762,559.85
金融工具公允价值变动	2,842,084,836.76	710,521,209.15	675,083,538.94	168,770,884.68
预计负债	39,999,376.78	9,999,844.20	185,482,275.07	46,370,568.77
递延收益	122,813,793.48	30,703,448.52	126,289,655.52	31,572,414.00
其他	559,849,051.28	139,962,262.82	56,124,378.00	14,031,094.50
合计	11,392,611,471.72	2,848,152,868.05	9,411,657,908.14	2,352,914,477.11

## (2) 未经抵销的递延所得税负债

项目	期末数		期初数	
	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
金融工具公允价值变动	1,417,392,307.90	354,348,077.04	2,483,084,919.74	620,771,230.02
合营 / 联营企业损益变动	137,490,481.46	34,372,620.37	303,683,408.60	75,920,852.16
其他	6,216,222.04	1,554,055.51		
合计	1,561,099,011.40	390,274,752.92	2,786,768,328.34	696,692,082.18

## (3) 未确认递延所得税资产明细

项目	期末数	期初数
可抵扣暂时性差异	592,448,392.08	706,827,257.85
可抵扣亏损	583,048,937.31	504,421,707.32
小计	1,175,497,329.39	1,211,248,965.17

## (4) 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

未确认递延所得税资产的可抵扣亏损系本公司之子公司国信香港公司尚在可补亏年度内的亏损额，预计该公司短期难以补亏，故未确认递延所得税资产，且该亏损额无抵扣时间限制。

## 19. 其他资产

## (1) 明细情况

项目	期末数	期初数
长期待摊费用	144,823,319.83	142,692,230.12
预付款项	99,499,914.52	124,158,407.79
待认证进项税	95,728,819.40	88,191,193.46
其他应收款	95,681,952.89	88,545,790.21
应收股利	8,370,280.34	7,714,252.26
预缴税金	7,334,367.67	8,188,393.17
期货会员资格	1,400,000.00	1,400,000.00
待抵扣进项税	466,885.65	6,108,946.27
合计	453,305,540.30	466,999,213.28

## (2) 其他应收款

## 1) 类别明细情况

种 类	期末数					账面价值
	账面余额		坏账准备			
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)		
单项计提坏账准备	7,300,000.00	6.62	7,300,000.00	100.00		
按组合计提坏账准备	102,898,504.66	93.38	7,216,551.77	7.01	95,681,952.89	
其中：应收往来款组合	30,994,641.95	28.13	7,216,551.77	23.28	23,778,090.18	
应收押金保证金组合	71,903,862.71	65.25			71,903,862.71	
合 计	110,198,504.66	100.00	14,516,551.77	13.17	95,681,952.89	

(续上表)

种 类	期初数					账面价值
	账面余额		坏账准备			
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)		
单项计提坏账准备	7,300,000.00	7.24	7,300,000.00	100.00		
按组合计提坏账准备	93,595,668.98	92.76	5,049,878.77	5.40	88,545,790.21	
其中：应收往来款组合	28,242,175.85	27.99	5,049,878.77	17.88	23,192,297.08	
应收押金保证金组合	65,353,493.13	64.77			65,353,493.13	
合 计	100,895,668.98	100.00	12,349,878.77	12.24	88,545,790.21	

## 2) 期末单项计提坏账准备的其他应收款

其他应收款内容	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
中国华兴(集团)公司	7,300,000.00	7,300,000.00	100.00	处于关停状态

## 3) 按组合计提坏账准备的其他应收款

种 类	期末数				
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	
应收押金保证金	71,903,862.71	69.88			
应收往来款组合	30,994,641.95	30.12	7,216,551.77	23.28	
其中：1 年以内	6,805,355.86	6.61	34,026.78	0.50	
1 至 2 年	197,047.16	0.19	9,852.36	5.00	
2 至 3 年	9,325,719.17	9.06	932,571.92	10.00	
3 年以上	14,666,519.76	14.26	6,240,100.71	42.55	
合 计	102,898,504.66	100.00	7,216,551.77	7.01	

(续上表)

种类	期初数			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
应收押金保证金	65,353,493.13	69.83		
应收往来款组合	28,242,175.85	30.17	5,049,878.77	17.88
其中：1年以内	2,873,134.72	3.07	14,365.67	0.50
1至2年	9,697,023.40	10.36	484,851.17	5.00
2至3年	754,716.96	0.80	75,471.70	10.00
3年以上	14,917,300.77	15.94	4,475,190.23	30.00
合计	93,595,668.98	100.00	5,049,878.77	5.40

## 4) 坏账准备变动情况

项目	第一阶段	第二阶段	第三阶段	小计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
期初数	5,049,878.77		7,300,000.00	12,349,878.77
本期计提	2,166,673.00			2,166,673.00
本期转回				
期末数	7,216,551.77		7,300,000.00	14,516,551.77

## (3) 长期待摊费用

项目	期初数	本期增加	本期摊销	其他减少	期末数	其他减少的原因
办公家私	18,551,867.13	7,376,044.42	7,116,570.33	185,882.12	18,625,459.10	报废
装修费及其他	124,140,362.99	51,536,206.81	49,489,926.65	-11,217.58	126,197,860.73	外币报表折算
合计	142,692,230.12	58,912,251.23	56,606,496.98	174,664.54	144,823,319.83	

## 20. 资产减值准备明细

## (1) 明细情况

项目	期初数	本期计提	本期减少		外币报表 折算差额	期末数
			转回	转销 / 核销		
融出资金减值准备	185,654,481.60	-42,145,533.83			18,439.05	143,527,386.82
应收款项坏账准备	1,495,136,213.80	67,324,500.43	14,523,160.43		53,196,579.07	1,601,134,132.87
买入返售金融资产减值准备	1,277,760,261.14	27,989,391.01				1,305,749,652.15

项 目	期初数	本期计提	本期减少		外币报表折算差额	期末数
			转回	转销 / 核销		
债权投资减值准备		304,211.73			-4,579.27	299,632.46
其他债权投资减值准备	388,996,277.38	209,729,357.33		322,478,576.06		276,247,058.65
其他应收款坏账准备	12,349,878.77	2,166,673.00				14,516,551.77
金融工具及其他项目信用减值准备小计	3,359,897,112.69	265,368,599.67	14,523,160.43	322,478,576.06	53,210,438.85	3,341,474,414.72
商誉减值准备	22,135,974.26					22,135,974.26
大宗商品跌价准备		2,191,066.98		2,191,066.98		
无形资产减值准备	3,486.11					3,486.11
其他资产减值准备小计	22,139,460.37	2,191,066.98		2,191,066.98		22,139,460.37
合 计	3,382,036,573.06	267,559,666.65	14,523,160.43	324,669,643.04	53,210,438.85	3,363,613,875.09

(2) 金融工具及其他项目预期信用损失准备

项 目	期末数			小计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
买入返售金融资产减值准备	3,872,791.54		1,301,876,860.61	1,305,749,652.15
应收款项坏账准备 (简化模型)		23,881,683.55	1,577,252,449.32	1,601,134,132.87
融出资金减值准备	137,631,213.38		5,896,173.44	143,527,386.82
债权投资	299,632.46			299,632.46
其他债权投资减值准备	25,580,654.21	186,018,560.60	64,647,843.84	276,247,058.65
其他应收款减值准备 (一般模型)	7,216,551.77		7,300,000.00	14,516,551.77
合 计	174,600,843.36	209,900,244.15	2,956,973,327.21	3,341,474,414.72

21. 短期借款

项 目	期末数	期初数
信用借款		225,270,000.00
合 计		225,270,000.00

## 22. 应付短期融资款

项目	面值	起息日期	债券 期限	发行金额	票面 利率	期初数	本期增加	本期减少	期末数
21 国信 CP012	2,000,000,000.00	2021/9/8	365 天	2,000,000,000.00	2.70%	2,017,013,698.63	36,986,301.37	2,054,000,000.00	
21 国信 CP013	700,000,000.00	2021/10/13	91 天	700,000,000.00	2.55%	703,912,328.77	537,945.20	704,450,273.97	
21 国信 CP014	3,000,000,000.00	2021/10/13	181 天	3,000,000,000.00	2.70%	3,017,753,424.66	22,413,698.63	3,040,167,123.29	
21 国信 CP015	1,000,000,000.00	2021/10/21	91 天	1,000,000,000.00	2.60%	1,005,128,767.12	1,353,424.66	1,006,482,191.78	
21 国信 CP016	2,000,000,000.00	2021/10/21	182 天	2,000,000,000.00	2.77%	2,010,928,219.18	16,695,890.41	2,027,624,109.59	
21 国信 CP017	4,500,000,000.00	2021/11/1	365 天	4,500,000,000.00	2.86%	4,521,508,767.12	107,191,232.88	4,628,700,000.00	
21 国信 CP018	2,000,000,000.00	2021/11/4	120 天	2,000,000,000.00	2.65%	2,008,421,917.81	9,002,739.72	2,017,424,657.53	
21 国信 CP019	2,000,000,000.00	2021/11/4	187 天	2,000,000,000.00	2.73%	2,008,676,164.38	19,296,986.30	2,027,973,150.68	
22 国信 D1	3,000,000,000.00	2022/4/6	365 天	3,000,000,000.00	2.58%		3,057,254,794.52		3,057,254,794.52
22 国信 CP001	3,000,000,000.00	2022/2/10	365 天	3,000,000,000.00	2.50%		3,066,780,821.92		3,066,780,821.92
22 国信 CP002	1,000,000,000.00	2022/2/15	120 天	1,000,000,000.00	2.33%		1,007,660,273.97	1,007,660,273.97	
22 国信 CP003	2,500,000,000.00	2022/2/17	120 天	2,500,000,000.00	2.32%		2,519,068,493.15	2,519,068,493.15	
22 国信 CP004	1,500,000,000.00	2022/2/21	365 天	1,500,000,000.00	2.49%		1,532,131,232.88		1,532,131,232.88
22 国信 CP005	1,700,000,000.00	2022/3/1	157 天	1,700,000,000.00	2.45%		1,717,915,205.48	1,717,915,205.48	
22 国信 CP006	2,300,000,000.00	2022/3/1	365 天	2,300,000,000.00	2.58%		2,349,748,054.79		2,349,748,054.79
22 国信 CP007	1,500,000,000.00	2022/3/7	191 天	1,500,000,000.00	2.47%		1,519,387,808.22	1,519,387,808.22	
22 国信 CP008	1,500,000,000.00	2022/3/14	92 天	1,500,000,000.00	2.40%		1,509,073,972.60	1,509,073,972.60	
22 国信 CP009	1,500,000,000.00	2022/4/12	213 天	1,500,000,000.00	2.40%		1,521,008,219.18	1,521,008,219.18	
22 国信 CP010	1,500,000,000.00	2022/4/12	365 天	1,500,000,000.00	2.52%		1,527,340,273.97		1,527,340,273.97
22 国信 CP011	1,500,000,000.00	2022/4/25	123 天	1,500,000,000.00	2.20%		1,511,120,547.95	1,511,120,547.95	
22 国信 CP012	1,500,000,000.00	2022/4/25	365 天	1,500,000,000.00	2.47%		1,525,478,219.18		1,525,478,219.18
22 国信 CP013	2,000,000,000.00	2022/4/28	211 天	2,000,000,000.00	2.28%		2,026,360,547.95	2,026,360,547.95	
22 国信 CP014	1,500,000,000.00	2022/4/28	365 天	1,500,000,000.00	2.42%		1,524,664,109.59		1,524,664,109.59
22 国信 CP015	1,500,000,000.00	2022/5/16	95 天	1,500,000,000.00	1.98%		1,507,730,136.99	1,507,730,136.99	
22 国信 CP016	1,500,000,000.00	2022/5/16	365 天	1,500,000,000.00	2.37%		1,522,401,369.86		1,522,401,369.86
22 国信 CP017	3,000,000,000.00	2022/6/24	96 天	3,000,000,000.00	1.87%		3,014,755,068.49	3,014,755,068.49	
22 国信 CP018	2,000,000,000.00	2022/6/28	183 天	2,000,000,000.00	1.98%		2,019,854,246.58	2,019,854,246.58	
22 国信 CP019	3,000,000,000.00	2022/12/26	88 天	3,000,000,000.00	2.55%		3,001,257,534.25		3,001,257,534.25
收益凭证 [注]	13,419,320,000.00			13,419,320,000.00		2,506,689,518.32	11,078,630,989.40	10,176,381,607.71	3,408,938,900.01
合计	69,119,320,000.00			69,119,320,000.00		19,800,032,805.99	50,273,100,140.09	47,557,137,635.11	22,515,995,310.97

[注] 本公司 2022 年共发行 931 期收益凭证，其中一年期以下 738 期，一年期以上 193 期；一年期以下收益凭证未到期产品 170 期，固定收益率为 0.00%-3.00%；一年期以上收益凭证未到期产品 200 期，固定收益率为 0.00%-2.85%

## 23. 拆入资金

## (1) 明细情况

项目	期末数	期初数
银行拆入资金	9,003,096,388.97	2,445,382,847.23
转融通拆入资金	3,066,094.36	2,011,415,124.75
合计	9,006,162,483.33	4,456,797,971.98

## (2) 转融通拆入资金

剩余期限	期末数		期初数	
	金额	利率区间	金额	利率区间
1个月以内	3,066,094.36	——		
1至3个月			2,011,415,124.75	2.80%
3至12个月				
1年以上				
合计	3,066,094.36		2,011,415,124.75	

## 24. 交易性金融负债

项目	期末数		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	
债券借贷	703,343,959.76		703,343,959.76
收益凭证	634,123,314.74		634,123,314.74
第三方在结构化主体中享有的权益	430,387,133.47		430,387,133.47
融入证券	21,992,946.65		21,992,946.65
合计	1,789,847,354.62		1,789,847,354.62

(续上表)

项目	期初数		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	
债券借贷	295,918,604.98		295,918,604.98
收益凭证			
第三方在结构化主体中享有的权益	98,547,262.54		98,547,262.54
融入证券	66,516,883.58		66,516,883.58
合计	460,982,751.10		460,982,751.10

## 25. 卖出回购金融资产款

## (1) 明细情况——按业务类型

项目	期末数	期初数
质押式卖出回购	109,185,313,445.70	89,875,041,390.31
质押式报价回购	4,580,114,046.73	5,570,191,067.94
买断式卖出回购	418,431,890.74	1,079,696,993.37
合计	114,183,859,383.17	96,524,929,451.62

## (2) 明细情况——按金融资产种类

项目	期末数	期初数
债券	114,183,859,383.17	96,524,929,451.62
合计	114,183,859,383.17	96,524,929,451.62

## (3) 担保物情况

项目	期末公允价值	期初公允价值
债券	128,983,026,571.36	110,816,570,630.53
合计	128,983,026,571.36	110,816,570,630.53

## (4) 报价回购融入资金按剩余期限分类

剩余期限	期末数	利率区间	期初数	利率区间
1个月内	4,338,458,294.43		5,433,779,726.84	
1个月至3个月内	157,160,286.95		97,898,161.37	
3个月至1年内	84,495,465.35	1.4%-8.18%	38,513,179.73	1.70%-8.18%
1年以上				
小计	4,580,114,046.73		5,570,191,067.94	

## 26. 代理买卖证券款

## (1) 明细情况

项目	期末数	期初数
普通经纪业务		
其中：个人	39,526,716,492.42	46,100,495,089.51
机构	12,715,154,376.88	13,886,430,348.17
小计	52,241,870,869.30	59,986,925,437.68
信用业务		
其中：个人	5,084,705,483.13	5,356,899,623.33
机构	2,087,238,156.70	1,936,467,055.72
小计	7,171,943,639.83	7,293,366,679.05
合计	59,413,814,509.13	67,280,292,116.73

## (2) 分币种列示

项目	期末数			期初数		
	原币金额	汇率	人民币金额	原币金额	汇率	人民币金额
人民币			56,670,477,210.72			64,626,383,704.04
美元	120,734,342.62	6.9646	840,866,403.29	135,945,859.87	6.3757	866,750,018.77
港币	2,129,711,065.67	0.8933	1,902,470,895.12	2,185,859,092.40	0.8176	1,787,158,393.92
合计			59,413,814,509.13			67,280,292,116.73

## 27. 应付职工薪酬

### (1) 明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	6,487,040,686.54	4,856,065,109.13	5,484,263,994.47	5,858,841,801.20
离职后福利—设定提存计划	4,940,204.07	507,388,537.05	507,472,360.07	4,856,381.05
合计	6,491,980,890.61	5,363,453,646.18	5,991,736,354.54	5,863,698,182.25

### (2) 短期薪酬明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	6,165,931,825.56	4,141,937,171.80	4,756,252,325.04	5,551,616,672.32
职工福利费		106,301,555.35	106,301,555.35	
社会保险费	1,241,207.68	190,840,504.21	190,219,810.15	1,861,901.74
其中：医疗保险费	1,100,880.73	178,013,204.74	177,520,365.40	1,593,720.07
工伤保险费	47,062.10	3,954,969.92	3,951,304.72	50,727.30
生育保险费	93,264.85	8,872,329.55	8,748,140.03	217,454.37
住房公积金	388,038.23	302,988,731.02	302,955,231.13	421,538.12
工会经费和职工教育经费	319,479,015.07	99,584,691.32	114,122,017.37	304,941,689.02
其他短期薪酬	600.00	14,412,455.43	14,413,055.43	
小计	6,487,040,686.54	4,856,065,109.13	5,484,263,994.47	5,858,841,801.20

### (3) 设定提存计划明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	2,407,636.33	350,774,368.33	350,921,552.25	2,260,452.41
失业保险费	51,827.28	208,399.58	197,242.31	62,984.55
补充养老保险（企业年金）	2,480,740.46	156,405,769.14	156,353,565.51	2,532,944.09
小计	4,940,204.07	507,388,537.05	507,472,360.07	4,856,381.05

## 28. 应交税费

项目	期末数	期初数
企业所得税	221,275,525.62	408,924,985.41
代扣代缴税金	162,927,929.41	299,288,182.76
其中：代扣代缴个人所得税	108,025,313.38	141,616,600.34
增值税	74,120,184.62	106,262,284.25
城市维护建设税	5,207,191.86	7,477,263.02
教育费附加及地方教育附加	3,720,338.48	5,347,036.98
房产税	2,697,475.26	2,598,475.34
其他	1,296,049.36	1,280,891.68
合计	471,244,694.61	831,179,119.44

## 29. 应付款项

项目	期末数	期初数
收益互换业务相关款项	8,394,044,472.30	1,821,175,304.98
待交付清算款	2,866,487,556.95	3,186,971,188.37
应付银行承兑汇票	990,152,898.21	
应付场外业务结算款	182,487,861.65	5,541,067.05
应付资管产品增值税及附加	57,098,673.58	46,567,356.66
应付投行手续费支出	32,253,697.51	48,645,713.61
应付投资者保护基金	29,012,856.06	54,917,741.78
利率互换集中清算结算资金	20,540,869.53	
应付银行三方存管费	18,313,864.42	16,805,926.97
应付外单位往来款	15,346,869.33	16,629,908.59
银行中间业务费	668,009.53	6,335,789.47
应付大宗商品货款	121,768.05	24,119,060.58
其他	92,301,918.49	47,270,066.94
合计	12,698,831,315.61	5,274,979,125.00

## 30. 预计负债

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
未决诉讼	185,482,275.07		145,482,898.29	39,999,376.78
行政罚款	8,176,000.00		8,176,000.00	
合计	193,658,275.07		153,658,898.29	39,999,376.78

## 31. 应付债券

类型	债券名称	面值	起息日期	债券 期限	发行金额	票面 利率	期初数	本期增加	本期减少	期末余额
公司债	19 国信 01	1,500,000,000.00	2019/3/11	3 年	1,500,000,000.00	4.05%	1,549,246,099.20	11,503,900.80	1,560,750,000.00	
公司债	19 国信 02	3,500,000,000.00	2019/4/8	3 年	3,500,000,000.00	4.00%	3,602,725,731.26	37,274,268.74	3,640,000,000.00	
公司债	19 国信 03	4,000,000,000.00	2019/7/4	3 年	4,000,000,000.00	4.00%	4,079,185,233.02	80,814,766.98	4,160,000,000.00	
公司债	20 国信 01	3,000,000,000.00	2020/1/13	3 年	3,000,000,000.00	3.60%	3,100,675,730.19	111,773,584.88	108,000,000.00	3,104,449,315.07
公司债	20 国信 02	5,000,000,000.00	2020/3/2	3 年	5,000,000,000.00	3.17%	5,125,107,679.17	164,789,308.12	158,500,000.00	5,131,396,987.29
公司债	20 国信 04	2,500,000,000.00	2020/12/14	2 年	2,500,000,000.00	3.60%	2,501,581,843.41	88,418,156.59	2,590,000,000.00	
公司债	20 国信 06	2,000,000,000.00	2020/12/22	3 年	2,000,000,000.00	3.70%	1,993,679,770.04	78,521,631.40	74,000,000.00	1,998,201,401.44
公司债	21 国信 01	3,000,000,000.00	2021/2/1	375 天	3,000,000,000.00	3.15%	3,085,530,576.42	11,558,462.58	3,097,089,039.00	
公司债	21 国信 02	2,000,000,000.00	2021/2/1	3 年	2,000,000,000.00	3.64%	2,061,375,896.20	75,315,723.32	72,800,000.00	2,063,891,619.52
公司债	21 国信 03	2,000,000,000.00	2021/7/6	3 年	2,000,000,000.00	3.35%	2,027,892,290.95	68,986,097.32	67,000,000.00	2,029,878,388.27
公司债	21 国信 04	3,000,000,000.00	2021/7/6	5 年	3,000,000,000.00	3.68%	3,040,735,212.95	113,379,145.93	110,400,000.00	3,043,714,358.88
公司债	21 国信 05	2,400,000,000.00	2021/7/21	3 年	2,400,000,000.00	3.16%	2,434,076,054.79	78,104,150.93	80,368,301.89	2,431,811,903.83
公司债	21 国信 06	3,300,000,000.00	2021/7/21	5 年	3,300,000,000.00	3.48%	3,351,599,342.47	116,707,924.52	121,066,415.09	3,347,240,851.90
公司债	21 国信 07	2,700,000,000.00	2021/9/15	3 年	2,700,000,000.00	3.09%	2,724,686,136.99	85,694,150.94	88,524,339.62	2,721,855,948.31

类型	债券名称	面值	起息日期	债券期限	发行金额	票面利率	期初数	本期增加	本期减少	期末余额
公司债	21 国信 10	4,000,000,000.00	2021/10/22	3 年	4,000,000,000.00	3.28%	4,014,597,560.63	135,172,194.64	131,200,000.00	4,018,569,755.27
公司债	21 国信 11	1,000,000,000.00	2021/10/22	5 年	1,000,000,000.00	3.63%	1,002,344,114.77	37,293,048.72	36,300,000.00	1,003,337,163.49
公司债	21 国信 12	3,000,000,000.00	2021/11/23	3 年	3,000,000,000.00	3.09%	3,009,904,931.51	94,901,257.84	98,360,377.36	3,006,445,811.99
公司债	21 国信 13	2,000,000,000.00	2021/11/23	5 年	2,000,000,000.00	3.43%	2,007,329,863.01	72,122,012.60	83,694,339.62	1,995,757,535.99
公司债	22 国信 01	3,000,000,000.00	2022/1/11	3 年	3,000,000,000.00	2.92%		3,087,086,792.44	5,660,377.36	3,081,426,415.08
公司债	22 国信 02	1,000,000,000.00	2022/1/11	5 年	1,000,000,000.00	3.28%		1,032,278,728.35	1,886,792.45	1,030,391,935.90
公司债	22 国信 03	500,000,000.00	2022/2/24	3 年	500,000,000.00	2.95%		513,720,848.03	3,773,584.91	509,947,263.12
公司债	22 国信 04	2,100,000,000.00	2022/3/25	3 年	2,100,000,000.00	3.17%		2,155,834,680.09	15,849,056.60	2,139,985,623.49
公司债	22 国信 05	2,900,000,000.00	2022/8/16	3 年	2,900,000,000.00	2.64%		2,928,945,972.60		2,928,945,972.60
公司债	22 国信 06	3,000,000,000.00	2022/10/18	3 年	3,000,000,000.00	2.58%		3,015,904,109.59		3,015,904,109.59
收益凭证	[注]	673,452,000.00			673,452,000.00		290,213,424.67	394,108,304.45	437,037,437.86	247,284,291.26
合计		63,073,452,000.00			63,073,452,000.00		51,002,487,491.65	14,590,209,222.40	16,742,260,061.76	48,850,436,652.29

[注] 详见本财务报表附注五（一）22 应付短期融资款 [注] 之说明，期末未到期一年期以上收益凭证未到期产品 200 期，固定收益率为 0.00%-2.85%

### 32. 租赁负债

项目	期末数	期初数
尚未支付的租赁付款额	439,366,922.65	474,596,201.70
减：未确认融资费用	27,236,995.08	27,579,461.84
合计	412,129,927.57	447,016,739.86

### 33. 递延收益

#### （1）明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数	形成原因
政府补助	126,289,655.52		3,475,862.04	122,813,793.48	[注]
合计	126,289,655.52		3,475,862.04	122,813,793.48	

[注] 系本公司 2010 年度收到的深圳市人民政府的金融发展专项资金。根据深圳市人民政府发布的《深圳市人民政府关于印发深圳市支持金融业发展若干规定的通知》及《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》，本公司于 2010 年度收到深圳市人民政府金融发展专项资金计人民币 168,000,000.00 元，截至 2022 年 12 月 31 日，本公司按照剩余土地使用年限摊销累计结转计人民币 45,186,206.52 元。根据《深圳市支持金融业发展若干规定实施细则》的相关规定，本公司取得该项金融发展专项资金的前提是承诺 10 年内不迁离深圳

#### （2）政府补助明细情况

项目	期初数	本期新增补助金额	本期计入当期损益 [注]	期末数	与资产相关 / 与收益相关
购地补偿款	126,289,655.52		3,475,862.04	122,813,793.48	与资产相关
小计	126,289,655.52		3,475,862.04	122,813,793.48	

[注] 政府补助本期计入当期损益情况详见本财务报表附注五（四）2 之说明

### 34. 其他负债

项目	期末数	期初数
应付货币保证金 [注 1]	9,801,450,632.68	10,029,318,538.62
应付质押保证金 [注 1]	513,889,832.00	106,006,080.00
应付股利 [注 2]	446,500,000.00	446,500,000.00
其他应付款	386,466,484.93	545,312,326.04
期货风险准备金	127,213,624.50	115,136,712.17
应付利息	13,977,788.23	18,599,556.90
代理兑付债券款	323,800.00	323,800.00
其他	71,711,171.05	8,991,915.56
合计	11,361,533,333.39	11,270,188,929.29

[注 1] 系本公司之子公司国信期货公司应付个人及法人的客户保证金

[注 2] 系应付本公司发行的永续次级债利息

### 35. 股本

项目	期初数	本期增减变动（减少以“-”表示）					期末数
		发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	
股份总数	9,612,429,377.00						9,612,429,377.00

### 36. 其他权益工具

#### (1) 期末发行在外的永续债基本情况

经本公司第三届董事会第四十四次会议审议通过，并经公司 2017 年第一次临时股东大会审议通过《关于公司发行境内外公司债务融资工具的议案》，公司可以一次或多次或多期发行境内债务融资工具和境外债务融资工具，公司境内外公司债务融资工具规模合计不超过人民币 800 亿元。根据中国证监会出具的《关于国信证券股份有限公司非公开发行永续次级债券有关意见的复函》（机构部函〔2020〕1372 号），中国证监会对本公司非公开发行永续次级债券无异议。

2020 年 7 月 13 日，本公司完成了 2020 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.50%；2020 年 9 月 17 日，本公司完成了 2020 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.80%；2021 年 4 月 12 日，本公司完成 2021 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.55%；2021 年 4 月 26 日，本公司完成 2021 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 4.38%；2022 年 6 月 21 日，本公司完成 2022 年永续次级债券（第一期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率 3.63%；2022 年 7 月 7 日，本公司完成 2022 年永续次级债券（第二期）发行，发行规模计人民币 5,000,000,000.00 元，票面利率为 3.67%。

本公司发行的上述永续次级债券，于本公司依照发行条款的约定赎回之前长期存续，并在本公司依据发行条款的约定赎回时到期；以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期，第 5 个和其后每个付息日发行人都可无条件行使续期选择权；在第 5 个和其后每个付息日，本公司有权按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回本息。上述永续次级债券

采用浮动利率形式，单利按年计息，前 5 个计息年度内保持不变，自第 6 个计息年度起，每 5 年重置一次票面利率；如果本公司不行使赎回权，则从第 2 个重定价周期（即第 6 个计息年度）开始票面利率调整为当期基准利率加上基本利差再加上 300 个基点（当期基准利率 + 基本利差 + 300BP）。

除非发生强制付息事件，上述永续次级债的每个付息日发行人可自行选择将当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受任何递延支付利息次数的限制；递延支付的金额将按照当期执行的利率计算复息。在下个利息支付日，若本公司继续选择延后支付，则上述递延支付的金额产生的复息将加入已经递延的所有利息及其孳息中继续计算利息。强制付息事件包括：付息日前 12 个月，发生以下事件的，发行人不得递延当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息：（1）向普通股股东分红，（2）减少注册资本。

2022 年度，本公司宣告分配永续次级债券利息合计人民币 911,500,000.00 元。

#### （2）期末发行在外的优先股、永续债等金融工具变动情况

项目	期初数		本期增加		本期减少		期末数	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
2020 年永续次级债券（第一期）		5,000,000,000.00						5,000,000,000.00
2020 年永续次级债券（第二期）		5,000,000,000.00						5,000,000,000.00
2021 年永续次级债券（第一期）		5,000,000,000.00						5,000,000,000.00
2021 年永续次级债券（第二期）		5,000,000,000.00						5,000,000,000.00
2022 年永续次级债券（第一期）				5,000,000,000.00				5,000,000,000.00
2022 年永续次级债券（第二期）				5,000,000,000.00				5,000,000,000.00
合计		20,000,000,000.00		10,000,000,000.00				30,000,000,000.00

#### 37. 资本公积

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
股本溢价	20,051,541,942.88			20,051,541,942.88
其他资本公积 [注]	104,130,626.96		9,433,962.26	94,696,664.70
合计	20,155,672,569.84		9,433,962.26	20,146,238,607.58

[注] 其他资本公积本期变动系本期发行作为其他权益工具核算的永续次级债支付的发行费用。

## 38. 其他综合收益

项 目	期初数	本期发生额				减：其他综合收益 结转留存收益	期末数
		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	税后归属于母公司		
不能重分类进损益的其他综合收益	-183,473,374.38	-586,657,247.32	-146,664,311.82		-439,992,935.50	-83,641,466.98	-539,824,842.90
其中：其他权益工具投资公允价值变动	-183,473,374.38	-586,657,247.32	-146,664,311.82		-439,992,935.50	-83,641,466.98	-539,824,842.90
以后将重分类进损益的其他综合收益	125,920,352.37	80,545,172.31	-13,957,617.22	40,433,642.82	54,069,146.71		179,989,499.08
其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额	-5,004,493.32	821,378.50			821,378.50		-4,183,114.82
其他债权投资公允价值变动	-118,805,830.47	70,111,775.60	14,229,687.46	13,193,025.77	42,689,062.37		-76,116,768.10
其他债权投资信用减值准备	291,747,207.94	-101,046,576.35	-28,187,304.68	11,702,642.37	-84,561,914.04		207,185,293.90
现金流量套期储备	15,537,974.68			15,537,974.68	-15,537,974.68		
外币财务报表折算差额	-57,554,506.46	110,658,594.56			110,658,594.56		53,104,088.10
合 计	-57,553,022.01	-506,112,075.01	-160,621,929.04	40,433,642.82	-385,923,788.79	-83,641,466.98	-359,835,343.82

## 39. 盈余公积

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
法定盈余公积	4,867,817,456.10			4,867,817,456.10
合 计	4,867,817,456.10			4,867,817,456.10

## 40. 一般风险准备

项 目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
一般风险准备	7,484,212,267.41	962,461,615.63		8,446,673,883.04
交易风险准备	7,264,060,392.84	620,081,812.00		7,884,142,204.84
合 计	14,748,272,660.25	1,582,543,427.63		16,330,816,087.88

#### 41. 未分配利润

项目	本期数	上年同期数
调整前上期末未分配利润	27,583,471,105.99	22,864,880,451.81
调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-）		
调整后期初未分配利润	27,583,471,105.99	22,864,880,451.81
加：本期归属于母公司所有者的净利润	6,087,994,695.35	10,114,758,795.89
减：提取法定盈余公积		
提取一般风险准备	1,582,543,427.63	1,750,773,111.39
应付普通股股利	4,806,214,688.50	2,210,858,756.71
永续次级债券利息支出	911,500,000.00	911,500,000.00
其他综合收益结转留存收益	83,641,466.98	523,036,273.61
期末未分配利润	26,287,566,218.23	27,583,471,105.99

### （二）合并利润表项目注释

#### 1. 利息净收入

项目	本期数	上年同期数
利息收入	7,072,845,943.40	7,521,117,559.58
货币资金及结算备付金利息收入	1,679,176,856.69	1,573,102,707.44
融资融券利息收入	3,899,206,074.70	4,324,662,728.90
买入返售金融资产利息收入	236,817,721.24	636,645,258.99
其中：约定购回利息收入	2,943,779.03	10,916,361.85
股权质押回购利息收入	188,509,648.91	552,371,335.85
其他债权投资利息收入	1,128,290,524.45	927,007,817.12
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	129,354,766.32	59,699,047.13
利息支出	5,243,219,172.72	5,110,493,613.11
短期借款利息支出	2,754,504.87	6,389,681.11
应付短期融资券利息支出	838,193,951.41	708,233,614.09
拆入资金利息支出	184,811,997.93	239,095,545.27
其中：转融通利息支出	122,791,497.77	215,017,411.93
卖出回购金融资产利息支出	2,186,500,704.71	2,123,281,449.68
其中：报价回购利息支出	98,668,662.80	95,198,314.69
代理买卖证券款利息支出	217,045,450.68	234,864,950.60
应付债券利息支出	1,703,858,222.36	1,633,356,056.05
其中：次级债券利息支出		
份额 A 持有人利息支出		63,195,326.07
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	110,054,340.76	102,076,990.24
利息净收入	1,829,626,770.68	2,410,623,946.47

## 2. 手续费及佣金净收入

## (1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
证券经纪业务净收入	4,870,843,679.99	6,769,738,627.24
证券经纪业务收入	5,952,585,815.23	8,058,799,916.42
代理买卖证券业务	5,046,542,632.92	6,518,518,926.05
交易单元席位租赁	362,991,905.72	589,436,292.57
代销金融产品业务	543,051,276.59	950,844,697.80
证券经纪业务支出	1,081,742,135.24	1,289,061,289.18
代理买卖证券业务	1,081,742,135.24	1,289,061,289.18
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
期货经纪业务净收入	258,451,296.17	424,808,690.15
期货经纪业务收入	761,474,717.56	426,465,955.46
期货经纪业务支出	503,023,421.39	1,657,265.31
投资银行业务净收入	1,815,715,414.70	1,979,271,263.30
投资银行业务收入	1,868,237,594.91	2,029,901,846.80
证券承销业务	1,734,263,809.22	1,826,134,336.02
证券保荐业务	65,508,734.75	119,245,943.15
财务顾问业务	68,465,050.94	84,521,567.63
投资银行业务支出	52,522,180.21	50,630,583.50
证券承销业务	52,437,274.55	50,573,979.73
证券保荐业务		
财务顾问业务	84,905.66	56,603.77
资产管理业务净收入	321,244,982.02	242,758,990.76
资产管理业务收入	324,418,651.07	249,425,243.26
资产管理业务支出	3,173,669.05	6,666,252.50
基金管理业务净收入	36,463,955.02	271,799,325.87
基金管理业务收入	63,304,076.28	292,363,152.68
基金管理业务支出	26,840,121.26	20,563,826.81
投资咨询业务净收入	52,874,806.01	66,143,147.54
投资咨询业务收入	53,615,022.18	66,143,147.54
投资咨询业务支出	740,216.17	
其他手续费及佣金净收入	221,665,506.51	278,351,563.79
其他手续费及佣金收入	221,665,506.51	281,274,912.85
其他手续费及佣金支出		2,923,349.06
合计	7,577,259,640.42	10,032,871,608.65
其中：手续费及佣金收入总计	9,245,301,383.74	11,404,374,175.01
手续费及佣金支出总计	1,668,041,743.32	1,371,502,566.36

## (2) 财务顾问业务净收入

项目	本期数	上年同期数
并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司	8,113,490.57	19,464,150.97
并购重组财务顾问业务净收入——其他	613,207.54	2,490,566.05
其他财务顾问业务净收入	59,653,447.17	62,510,246.84
小计	68,380,145.28	84,464,963.86

## (3) 代理销售金融产品情况

项目	本期数		上年同期数	
	销售总金额	代销收入	销售总金额	代销收入
基金	25,142,729,111.73	352,230,723.35	67,494,208,119.00	638,669,543.30
其他金融产品	3,471,047,711.44	190,820,553.24	18,436,406,281.60	312,175,154.50
合计	28,613,776,823.17	543,051,276.59	85,930,614,400.60	950,844,697.80

## (4) 资产管理业务开展及收入明细情况

项目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	135	145	28
期末客户数量	250,196	145	433
其中：个人客户	249,301	73	
机构客户	895	72	433
期初受托资金	69,165,128,146.59	39,496,278,094.42	29,932,914,990.98
其中：自有资金投入	2,084,727,377.99		
个人客户	10,370,809,760.25	7,179,788,084.45	197,654,288.48
机构客户	56,709,591,008.35	32,316,490,009.97	29,735,260,702.50
期末受托资金	62,711,817,230.07	52,083,278,237.95	32,055,422,300.00
其中：自有资金投入	3,328,141,781.53		
个人客户	24,902,663,686.20	7,127,051,020.71	
机构客户	34,481,011,762.34	44,956,227,217.24	32,055,422,300.00
期末主要受托资产初始成本	70,170,131,517.54	43,369,104,292.42	31,908,985,539.52
其中：股票	2,665,315,506.80	13,939,155,072.92	
国债	41,033,581.88		
其他债券	56,822,407,371.05	14,423,432,776.06	2,457,483,834.57
基金	3,452,737,567.01	714,863,538.19	40,146,647.34
其他	7,188,637,490.80	14,291,652,905.25	29,411,355,057.61
本期资产管理业务净收入	236,818,297.87	82,931,628.64	1,495,055.51

### 3. 投资收益

#### (1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
权益法核算的长期股权投资收益	482,932,846.97	879,545,654.36
处置长期股权投资产生的投资收益	-59,359.85	
金融工具投资收益	7,010,553,313.99	6,748,692,564.38
其中：持有期间取得的收益	6,144,180,966.60	5,536,794,655.29
- 交易性金融工具	5,313,520,966.30	4,319,759,580.05
- 其他权益工具投资	830,660,000.30	1,217,035,075.24
- 衍生金融工具		
处置金融工具取得的收益	866,372,347.39	1,211,897,909.09
- 交易性金融工具	1,117,012,694.26	1,729,547,065.05
- 债权投资	452,780.67	
- 其他债权投资	252,332,976.05	40,308,045.57
- 衍生金融工具	-503,426,103.59	-557,957,201.53
其他	-221,218,600.78	-192,106,990.21
合计	7,272,208,200.33	7,436,131,228.53

#### (2) 按权益法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期 增减变动的的原因
联营企业：			
鹏华基金公司	506,228,903.96	505,652,607.89	被投资单位净利润变化
前海股交投资控股（深圳）有限公司	-13,029,785.60	3,013,737.10	被投资单位净利润变化
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	1,611,116.76	2,225,495.35	被投资单位净利润变化
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金（有限合伙）	-96,418,909.63	188,285,536.28	被投资单位净利润变化
常州高新投创业投资有限公司	25,231,327.91	38,091,964.28	被投资单位净利润变化
深圳市前海弘泰基金管理有限公司	-173,121.20	214,712.92	被投资单位净利润变化
深圳市前海清控弘泰投资发展有限公司		-17.96	被投资单位净利润变化
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	-35,901,697.52	15,508,953.16	被投资单位净利润变化
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	-7,649,214.79	-1,773,396.25	被投资单位净利润变化
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	-10,293,808.36	-809,671.74	被投资单位净利润变化
深圳弘盛道格体育投资合伙企业（有限合伙）	2,112,232.74	-361,057.95	被投资单位净利润变化
深圳市中亚亿百投资企业（有限合伙）		2,978,181.97	被投资单位净利润变化
国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙）	-447,102.02		被投资单位净利润变化
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	-21,892,082.23	17,447,020.90	被投资单位净利润变化

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期 增减变动的原因
深圳市五色检测技术服务有限公司	-114,784.01	-191,026.69	被投资单位净利润变化
华润宝塔股权投资(延安)有限公司	-76,890.08	-333,438.52	被投资单位净利润变化
华润(延安)新产业经济投资合伙企业(有限合伙)		-124,317.63	被投资单位净利润变化
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	2,443,604.52	384,498.38	被投资单位净利润变化
国铁盛芯(青岛)股权投资企业(有限合伙)	31,374,725.96	14,142.78	被投资单位净利润变化
国铁盛和(青岛)私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	-5,416,532.37	14,555,217.46	被投资单位净利润变化
深圳市天使一号创业投资合伙企业(有限合伙)	-214,377.59		被投资单位净利润变化
盈科值得普泽(平潭)股权投资合伙企业(有限合伙)	-75,298.57		被投资单位净利润变化
深圳市创东方长辉投资企业(有限合伙)	-1,036,643.98		被投资单位净利润变化
深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	-478.53		被投资单位净利润变化
江门市倚锋骏马二期创业投资合伙企业(有限合伙)	42,625.41		被投资单位净利润变化
小计	376,303,810.78	784,779,141.73	
合营企业:			
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金(有限合伙)	95,687,630.40	-4,479,695.32	被投资单位净利润变化
深圳市国信蓝思基金管理有限公司	2,678.84	1,876,620.40	被投资单位净利润变化
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业(有限合伙)	2,471,279.33	81,077,565.91	被投资单位净利润变化
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	19,501,251.57	15,282,665.91	被投资单位净利润变化
珠海国信运通股权投资基金(有限合伙)	-10,032,736.07	-184,628.33	被投资单位净利润变化
珠海联发安科股权投资基金合伙企业(有限合伙)	-1,001,067.88	1,193,984.06	被投资单位净利润变化
小计	106,629,036.19	94,766,512.63	
合计	482,932,846.97	879,545,654.36	

### (3) 交易性金融工具投资收益

交易性金融工具		本期数	上年同期数
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	5,313,520,966.30	4,319,759,580.05
	处置期间收益	1,149,852,437.25	1,731,998,016.55
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益		
	处置期间收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置期间收益	-32,839,742.99	-2,450,951.50
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置期间收益		
小计		6,430,533,660.56	6,049,306,645.10

#### 4. 其他收益

项目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
与资产相关的政府补助 [注]	3,475,862.04	3,475,862.04	3,475,862.04
与收益相关的政府补助 [注]	1,471,700.54	1,482,416.61	1,471,700.54
代扣个人所得税手续费返还	40,002,210.20	21,714,103.38	
合计	44,949,772.78	26,672,382.03	4,947,562.58

[注] 本期计入其他收益的政府补助情况详见本财务报表附注五（四）2 之说明

#### 5. 公允价值变动收益

项目	本期数	上年同期数
交易性金融资产	-3,293,781,981.14	1,666,756,136.08
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债	12,137,831.67	-14,006,599.26
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	310,910,118.85	87,690,638.57
合计	-2,970,734,030.62	1,740,440,175.39

#### 6. 其他业务收入

项目	本期数	上年同期数
大宗商品销售收入	2,060,465,376.36	2,135,187,160.34
房租收入	36,634,394.56	32,299,753.35
其他	19,833,371.67	4,709,456.22
合计	2,116,933,142.59	2,172,196,369.91

#### 7. 税金及附加

项目	本期数	上年同期数
城市维护建设税	61,549,594.01	71,384,788.43
教育费附加及地方教育附加	43,983,430.77	51,064,027.10
房产税	15,476,162.48	16,678,229.63
印花税	3,709,775.09	3,349,773.96
土地使用税	366,028.28	389,937.99
车船税	158,115.83	172,071.47
其他	338,118.90	315,150.93
合计	125,581,225.36	143,353,979.51

## 8. 业务及管理费

项目	本期数	上年同期数
职工费用	5,363,453,646.18	7,981,407,495.97
固定资产折旧费	281,763,365.23	168,139,315.72
通讯费	221,644,784.35	211,680,913.82
使用权资产折旧费	176,555,073.27	165,721,990.38
电子设备运转费	171,574,251.51	151,156,634.60
交易所席位年费	142,932,321.44	111,480,529.78
业务宣传费	133,593,713.59	96,862,874.55
无形资产摊销	92,443,696.17	81,021,077.63
咨询费	84,540,772.66	61,444,698.25
差旅费	76,861,911.42	96,011,753.15
业务活动费	71,435,114.14	87,409,277.20
投资者保护基金支出	64,103,976.51	92,273,463.62
长期待摊费用摊销	56,606,496.98	52,836,714.98
其他	379,931,563.76	375,017,476.73
合计	7,317,440,687.21	9,732,464,216.38

## 9. 信用减值损失

项目	本期数	上年同期数
其他债权投资减值损失	209,729,357.33	72,117,232.57
应收款项坏账损失	52,801,340.00	326,590,364.48
融出资金坏账准备	-42,145,533.83	-46,726,400.70
买入返售金融资产坏账准备	27,989,391.01	-873,703,615.63
其他应收款减值损失	2,166,673.00	271,785.32
债权投资减值	304,211.73	
合计	250,845,439.24	-521,450,633.96

## 10. 其他资产减值损失

项目	本期数	上年同期数
大宗商品跌价准备	2,191,066.98	96,261.07
合计	2,191,066.98	96,261.07

## 11. 其他业务成本

项目	本期数	上年同期数
大宗商品销售成本	2,062,623,170.54	2,138,065,697.50
投资性房地产折旧	9,924,377.28	10,600,915.26
其他	12,076,912.33	21,015,351.53
合计	2,084,624,460.15	2,169,681,964.29

## 12. 营业外收入

项目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
政府补助 [注]	80,363,550.91	43,141,407.56	80,363,550.91
违约赔偿收入	2,207,279.35	4,549,716.05	2,207,279.35
非流动资产毁损报废利得	43,786.62		43,786.62
其他	334,447.47	168,799.06	334,447.47
合计	82,949,064.35	47,859,922.67	82,949,064.35

[注] 本期计入营业外收入的政府补助情况详见本财务报表附注五（四）2之说明

## 13. 营业外支出

项目	本期数	上年同期数	计入本期非经常性损益的金额
非常损失	-54,390,809.73	-329,233,274.59	-54,390,809.73
对外捐赠	13,290,536.15	16,700,777.65	13,290,536.15
罚款支出	-5,475,350.00	8,178,300.00	-5,475,350.00
其他	2,444,806.50	11,613,177.24	2,444,806.50
合计	-44,130,817.08	-292,741,019.70	-44,130,817.08

## 14. 所得税费用

### (1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
当期所得税费用	806,489,745.68	2,294,352,819.60
递延所得税费用	-668,914,280.11	223,084,173.27
合计	137,575,465.57	2,517,436,992.87

### (2) 会计利润与所得税费用调整过程

项目	本期数	上年同期数
利润总额	6,222,165,264.34	12,634,492,158.97
按母公司税率计算的所得税费用	1,555,541,316.08	3,158,623,039.74
子公司适用不同税率的影响	-965,293.72	-1,024,766.70
调整以前期间所得税的影响	-6,502,047.27	5,655,270.01
非应税收入的影响	-1,103,413,851.43	-606,193,549.48
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	27,023,708.39	88,454,321.43
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-2,022,515.09	-20,031,022.56
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	5,715,012.86	5,290,282.92
其他	-337,800,864.25	-113,336,582.49
所得税费用	137,575,465.57	2,517,436,992.87

## 15. 其他综合收益的税后净额

其他综合收益的税后净额详见本财务报表附注五（一）38 之说明。

### （三）合并现金流量表项目注释

#### 1. 收到其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
大宗商品销售收到的现金	2,334,307,014.43	2,449,226,493.37
应付质押保证金净增加额	407,883,752.00	
收到政府补助	110,731,386.12	58,249,905.82
代扣代缴手续费收入	40,002,210.20	21,714,103.38
租赁收入	36,674,871.13	37,088,840.86
应付货币保证金净增加额		3,232,551,310.27
应收期货交易款净减少额		55,346,244.69
其他	129,755,065.61	46,612,066.70
合 计	3,059,354,299.49	5,900,788,965.09

#### 2. 支付其他与经营活动有关的现金

项 目	本期数	上年同期数
清算资金交收金额净减少	2,745,041,944.87	213,116,018.19
现金支付的业务及管理费	1,436,292,390.64	1,338,504,179.42
使用受限的货币资金增加额	1,146,134,406.71	
购买大宗商品支付的现金	1,257,876,213.26	2,423,402,468.02
存出保证金净增加额	313,155,612.51	2,008,505,669.98
应付货币保证金净减少额	227,867,905.94	
代扣代缴税费收到现金净减少金额	113,086,101.51	28,867,333.66
支付诉讼赔偿	87,828,265.98	
捐赠支出	13,290,536.15	16,700,777.65
罚款支出	1,050,000.00	8,178,300.00
资产管理计划优先级参与人款项净减少额		2,317,874,492.38
应付质押保证金净减少额		1,399,307,432.00
应收结算担保金净增加		23,013,216.33
支付股票借贷保证金净额		21,695,984.64
其他	77,303,842.17	50,332,718.42
合 计	7,418,927,219.74	9,849,498,590.69

## 3. 支付其他与筹资活动有关的现金

项目	本期数	上年同期数
支付租赁费	175,896,897.10	177,220,827.47
支付发行费用	77,600,000.00	90,000,000.00
子公司少数股东退资支付的现金	8,834,720.84	
合计	262,331,617.94	267,220,827.47

## 4. 现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

补充资料	本期数	上年同期数
1) 将净利润调节为经营活动现金流量:		
净利润	6,084,589,798.77	10,117,055,166.10
加: 资产减值准备	253,036,506.22	-521,354,372.89
固定资产、使用权资产及投资性房地产折旧	468,242,815.78	344,462,221.36
无形资产摊销	92,443,696.17	81,021,077.63
长期待摊费用摊销	56,606,496.98	52,836,714.98
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减: 收益)	175,319.21	260,807.84
公允价值变动损失(减: 收益)	2,970,734,030.62	-1,740,440,175.39
利息支出	2,566,152,326.10	2,366,863,081.80
汇兑损失(减: 收益)	-3,426,328.32	637,899.25
投资损失(减: 收益)	-482,873,487.12	-879,545,654.36
递延所得税资产减少(减: 增加)	-390,684,255.55	-48,735,303.21
递延所得税负债增加(减: 减少)	-306,417,329.26	287,997,361.32
交易性金融资产减少(减: 增加)	-10,311,796,579.71	-43,717,008,021.17
交易性金融负债增加(减: 减少)	1,341,587,502.03	395,794,790.24
其他权益工具投资减少(减: 增加)	-3,718,904,034.30	3,805,363,885.54
债权投资减少(减: 增加)	-69,565,844.03	
其他债权投资减少(减: 增加)	-21,800,279,555.92	-4,745,970,924.50
衍生金融资产减少(减: 增加)	137,513,852.58	-26,435,856.09
衍生金融负债增加(减: 减少)	203,950,608.60	-21,297,219.26
买入返售金融资产减少(减: 增加)	-9,081,512,415.65	10,283,179,746.90
卖出回购金融资产款增加(减: 减少)	17,658,929,931.55	24,437,759,153.31
融出资金减少(减: 增加)	9,343,344,320.19	-12,166,111,696.36
代理买卖证券款增加(减: 减少)	-7,866,477,607.60	7,534,026,886.74
经营性应收项目的减少(减: 增加)	-3,795,928,325.19	-2,501,312,143.98
经营性应付项目的增加(减: 减少)	9,309,042,218.83	-54,435,256.11
经营活动产生的现金流量净额	-7,341,516,339.02	-6,715,387,830.31

补充资料	本期数	上年同期数
2) 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:		
债务转为资本		
一年内到期的可转换公司债券		
融资租入固定资产		
3) 现金及现金等价物净变动情况:		
现金的期末余额	79,357,424,451.21	84,614,253,311.11
减: 现金的期初余额	84,614,253,311.11	76,782,025,659.57
加: 现金等价物的期末余额		
减: 现金等价物的期初余额		
现金及现金等价物净增加额	-5,256,828,859.90	7,832,227,651.54

#### (2) 现金和现金等价物的构成

项目	期末数	期初数
1) 现金	79,357,424,451.21	84,614,253,311.11
其中: 库存现金	140,842.95	111,697.21
可随时用于支付的银行存款	63,626,831,783.48	67,532,854,030.58
可随时用于支付的其他货币资金	3,844,825.47	2,174,748.36
可用于支付的结算备付金	15,726,606,999.31	17,079,112,834.96
2) 现金等价物		
其中: 三个月内到期的债券投资		
3) 期末现金及现金等价物余额	79,357,424,451.21	84,614,253,311.11

#### (四) 其他

##### 1. 所有权或使用权受到限制的资产

项目	期末账面价值	受限原因
货币资金	1,228,187,600.13	风险准备金、司法冻结等
交易性金融资产	74,507,012,374.44	为回购业务设定质押或过户
交易性金融资产	11,578,050,552.00	为债券借贷业务设定质押
交易性金融资产	5,329,114,874.00	为期货业务充抵保证金设定质押
交易性金融资产	1,218,725,204.49	限售股
交易性金融资产	1,023,552,825.96	融出证券
其他债权投资	41,656,481,476.92	为回购业务设定质押
其他债权投资	2,438,557,570.00	为债券借贷业务设定质押
其他债权投资	3,045,642,030.00	为期货业务充抵保证金设定质押
其他权益工具投资	146,735,038.90	融出证券
合计	142,172,059,546.84	

## 2. 政府补助

### (1) 明细情况

#### 1) 与资产相关的政府补助

##### 总额法

项目	期初 递延收益	本期新增补助	本期摊销	期末 递延收益	本期摊销 列报项目	说明
购地补贴	126,289,655.52		3,475,862.04	122,813,793.48	其他收益	
小计	126,289,655.52		3,475,862.04	122,813,793.48		

#### 2) 与收益相关，且用于补偿公司已发生的相关成本费用或损失的政府补助

项目	金额	列报项目	说明
金融业发展促进	25,000,000.00	营业外收入	深龙华府规〔2021〕6号
经济发展贡献奖	18,700,700.00	营业外收入	深府规〔2021〕5号
产业财政扶持	15,665,000.00	营业外收入	浦财扶陆〔2018〕00197号
金融机构补贴和绩效奖励	10,050,000.00	营业外收入	沪府发〔2009〕40号
税收贡献奖励	6,905,400.00	营业外收入	海行规发〔2018〕11号海行规发〔2018〕12号海行规发〔2018〕13号海金融〔2020〕3号
生育津贴	11,627,950.34	业务及管理费	
房租补贴	9,247,100.00	业务及管理费	
稳岗补贴	8,021,084.33	业务及管理费	
金融机构补助及产业扶持	652,862.60	其他收益	津河西政办发〔2019〕1号
创新奖励	450,000.00	其他收益	深金监发〔2021〕37号
其他与经营活动相关的政府补助	368,837.94	其他收益	其他与经营活动相关的政府补助
其他与经营活动无关的政府补助	4,042,450.91	营业外收入	
小计	110,731,386.12		

本期计入当期损益的政府补助金额为 114,207,248.16 元。

### 3. 金融工具计量基础

#### (1) 金融资产计量基础分类表

项 目	期末数			
	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
		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	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
货币资金	64,977,826,272.53			
结算备付金	15,734,799,287.70			
融出资金	52,672,094,624.02			
衍生金融资产				164,204,033.62
存出保证金	7,900,221,491.14			
应收款项	4,728,934,871.75			
买入返售金融资产	15,824,517,431.75			
交易性金融资产				159,472,573,237.44
债权投资	69,266,211.57			
其他债权投资		51,501,472,752.05		
其他权益工具投资			10,429,791,008.15	
其他资产	203,552,147.75			
合 计	162,111,212,338.21	51,501,472,752.05	10,429,791,008.15	159,636,777,271.06

(续上表)

项 目	期初数			
	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		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
		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	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
货币资金	67,721,741,037.30			
结算备付金	17,087,824,020.77			
融出资金	61,973,311,849.43			
衍生金融资产				57,966,861.36
存出保证金	7,587,572,329.43			
应收款项	1,432,595,710.21			
买入返售金融资产	6,770,994,407.11			
交易性金融资产				152,312,123,275.04
其他债权投资		29,644,274,446.31		
其他权益工具投资			7,186,022,265.21	
其他资产	220,418,450.26			
合 计	162,794,457,804.51	29,644,274,446.31	7,186,022,265.21	152,370,090,136.40

## (2) 金融负债计量基础分类表

项 目	期末数			
	以摊余成本计量的金融 负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且 其变动计入当期损益的金 融负债	按照《金融工具确认和计 量》准则指定为以公允价 值计量且其变动计入当期 损益的金融负债	按照《套期会计》准 则指定为以公允价值 计量且其变动计入当 期损益的金融负债
短期借款				
应付短期融资款	22,515,995,310.97			
拆入资金	9,006,162,483.33			
交易性金融负债		1,789,847,354.62		
衍生金融负债		324,672,439.60		
卖出回购金融资产款	114,183,859,383.17			
代理买卖证券款	59,413,814,509.13			
代理承销证券款				
应付款项	12,698,831,315.61			
租赁负债	412,129,927.57			
应付债券	48,850,436,652.29			
其他负债	10,787,819,708.89			
合 计	277,869,049,290.96	2,114,519,794.22		

(续上表)

项 目	期初数			
	以摊余成本计量的金融 负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量 且其变动计入当期损益的 金融负债	按照《金融工具确认和计 量》准则指定为以公允价 值计量且其变动计入当期 损益的金融负债	按照《套期会计》准 则指定为以公允价值 计量且其变动计入当 期损益的金融负债
短期借款	225,270,000.00			
应付短期融资款	19,800,032,805.99			
拆入资金	4,456,797,971.98			
交易性金融负债		460,982,751.10		
衍生金融负债		226,049,508.29		
卖出回购金融资产款	96,524,929,451.62			
代理买卖证券款	67,280,292,116.73			
代理承销证券款	27,000,000.00			
应付款项	5,274,979,125.00			
租赁负债	447,016,739.86			
应付债券	51,002,487,491.65			
其他负债	10,703,287,629.13			
合 计	255,742,093,331.96	687,032,259.39		

#### 4. 受托客户资产管理业务

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	8,309,859,585.43	3,137,241,435.10	受托管理资金	135,230,386,610.65	147,650,950,049.47
客户结算备付金	466,046,501.02	602,042,007.42	应付款项	19,409,979,079.65	780,444,272.18
存出保证金	56,621,401.40	28,012,680.03			
应收款项	1,431,438,201.95	736,514,031.05			
受托投资	144,376,400,000.50	143,927,584,168.05			
其中：投资成本	142,911,630,391.29	143,203,743,719.21			
已实现未 结转损益	1,464,769,609.21	723,840,448.84			
合 计	154,640,365,690.30	148,431,394,321.65	合 计	154,640,365,690.30	148,431,394,321.65

#### 5. 融资融券业务

##### (1) 融券业务明细情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
融出证券	2,269,427,076.07	3,099,488,484.02
其中：其他权益工具投资	146,735,038.90	305,638,318.80
交易性金融资产	1,023,552,825.96	1,469,097,357.77
转融通融入证券	1,099,139,211.21	1,324,752,807.45
转融通融入证券总额	1,979,764,611.94	4,024,240,655.96

##### (2) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

项 目	期末公允价值	期初公允价值
股票	152,150,591,313.61	201,470,302,657.08
资金	6,934,664,621.32	6,938,862,194.25
基金	5,083,701,370.47	4,538,000,091.87
债券	262,823,555.68	188,259,177.65
合 计	164,431,780,861.08	213,135,424,120.85

## 六、母公司财务报表项目注释

### (一) 母公司资产负债表项目注释

#### 1. 长期股权投资

##### (1) 明细情况

项目	期末数			期初数		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	9,677,200,146.42		9,677,200,146.42	8,677,200,146.42		8,677,200,146.42
对联营、合营企业投资	2,265,845,014.91		2,265,845,014.91	2,095,537,837.49		2,095,537,837.49
合计	11,943,045,161.33		11,943,045,161.33	10,772,737,983.91		10,772,737,983.91

##### (2) 对子公司投资

被投资单位	期初数	本期增加	本期减少	期末数	本期计提减值准备	减值准备期末数
国信期货公司	1,890,915,346.42			1,890,915,346.42		
国信弘盛公司	1,843,819,465.30		37,566,792.00	1,806,252,673.30		
国信香港公司	2,236,284,800.00			2,236,284,800.00		
国信资本公司	2,706,180,534.70	1,037,566,792.00		3,743,747,326.70		
小计	8,677,200,146.42	1,037,566,792.00	37,566,792.00	9,677,200,146.42		

##### (3) 对联营、合营企业投资

被投资单位	期初数	本期增减变动			
		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
联营企业					
鹏华基金公司	1,856,178,206.53			506,228,903.96	
前海股交投资控股(深圳)有限公司	207,845,525.01			-13,029,785.60	
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	31,514,105.95			1,611,116.76	
合计	2,095,537,837.49			494,810,235.12	

(续上表)

被投资单位	本期增减变动				期末数	减值准备 期末余额
	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						
鹏华基金公司		323,000,000.00			2,039,407,110.49	
前海股交投资控股(深圳)有限公司	821,378.50	1,324,436.20			194,312,681.71	
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司		1,000,000.00			32,125,222.71	
合计	821,378.50	325,324,436.20			2,265,845,014.91	

## 2. 应付职工薪酬

### (1) 明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
短期薪酬	6,128,508,185.12	4,557,923,047.04	5,176,586,528.65	5,509,844,703.51
离职后福利—设定提存计划	1,907,924.50	482,604,676.57	482,782,884.29	1,729,716.78
合计	6,130,416,109.62	5,040,527,723.61	5,659,369,412.94	5,511,574,420.29

### (2) 短期薪酬明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
工资、奖金、津贴和补贴	5,820,941,746.36	3,877,358,405.23	4,481,053,457.06	5,217,246,694.53
职工福利费		100,289,924.91	100,289,924.91	
社会保险费	1,062,610.12	182,332,192.71	182,369,768.00	1,025,034.83
其中：医疗保险费	940,550.07	170,243,672.85	170,346,544.03	837,678.89
工伤保险费	44,035.59	3,779,588.07	3,777,604.12	46,019.54
生育保险费	78,024.46	8,308,931.79	8,245,619.85	141,336.40
住房公积金	219,375.83	289,897,010.33	289,923,777.04	192,609.12
工会经费和职工教育经费	306,283,852.81	95,835,652.40	110,739,140.18	291,380,365.03
其他	600.00	12,209,861.46	12,210,461.46	
小计	6,128,508,185.12	4,557,923,047.04	5,176,586,528.65	5,509,844,703.51

### (3) 设定提存计划明细情况

项目	期初数	本期增加	本期减少	期末数
基本养老保险	1,864,577.02	333,895,778.43	334,168,710.31	1,591,645.14
失业保险费	43,347.48	124,289.84	117,498.33	50,138.99
企业年金缴费		148,584,608.30	148,496,675.65	87,932.65
小计	1,907,924.50	482,604,676.57	482,782,884.29	1,729,716.78

## (二) 母公司利润表项目注释

### 1. 利息净收入

项目	本期数	上年同期数
利息收入	6,775,811,647.50	7,245,046,397.74
货币资金及结算备付金利息收入	1,419,162,092.97	1,357,443,653.17
拆出资金利息收入		
融资融券利息收入	3,876,016,006.40	4,267,543,346.14
买入返售金融资产利息收入	233,824,700.57	634,105,556.73
其中：约定购回利息收入	2,943,779.03	10,916,361.85
股权质押回购利息收入	188,509,648.91	552,371,335.85
债权投资利息收入		
其他债权投资利息收入	1,128,290,524.45	927,007,817.12
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	118,518,323.11	58,946,024.58
利息支出	5,231,198,909.83	5,027,932,251.50
短期借款利息支出	477,280.48	1,381,213.43
应付短期融资券利息支出	838,193,951.41	708,233,614.09
拆入资金利息支出	184,811,997.93	239,095,545.27
其中：转融通利息支出	122,791,497.77	215,017,411.93
卖出回购金融资产利息支出	2,186,384,717.70	2,119,377,759.21
其中：报价回购利息支出	98,668,662.80	95,198,314.69
代理买卖证券款利息支出	217,045,450.68	234,864,950.60
应付债券利息支出	1,703,858,222.36	1,633,356,056.05
其中：次级债券利息支出		
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	100,427,289.27	91,623,112.85
利息净收入	1,544,612,737.67	2,217,114,146.24

### 2. 手续费及佣金净收入

#### (1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
证券经纪业务净收入	4,834,906,276.98	6,698,357,083.32
证券经纪业务收入	5,913,458,501.08	7,981,439,699.40
代理买卖证券业务	5,007,415,318.77	6,441,158,709.03
交易单元席位租赁	362,991,905.72	589,436,292.57
代销金融产品业务	543,051,276.59	950,844,697.80

项 目	本期数	上年同期数
证券经纪业务支出	1,078,552,224.10	1,283,082,616.08
代理买卖证券业务	1,078,552,224.10	1,283,082,616.08
交易单元席位租赁		
代销金融产品业务		
投资银行业务净收入	1,783,895,521.04	1,958,519,029.91
投资银行业务收入	1,836,384,304.58	2,009,149,613.41
证券承销业务	1,708,743,848.41	1,810,712,464.71
证券保荐业务	63,532,075.45	118,136,640.22
财务顾问业务	64,108,380.72	80,300,508.48
投资银行业务支出	52,488,783.54	50,630,583.50
证券承销业务	52,403,877.88	50,573,979.73
证券保荐业务		
财务顾问业务	84,905.66	56,603.77
资产管理业务净收入	319,213,777.41	215,252,820.65
资产管理业务收入	319,226,726.45	265,935,512.70
资产管理业务支出	12,949.04	50,682,692.05
投资咨询业务	41,500,380.64	49,669,866.70
投资咨询业务收入	42,240,596.81	49,669,866.70
投资咨询业务支出	740,216.17	
其他手续费及佣金净收入	222,049,741.79	278,017,871.21
其他手续费及佣金收入	222,049,741.79	280,941,220.27
其他手续费及佣金支出		2,923,349.06
合 计	7,201,565,697.86	9,199,816,671.79
其中：手续费及佣金收入总计	8,333,359,870.71	10,587,135,912.48
手续费及佣金支出总计	1,131,794,172.85	1,387,319,240.69

(2) 财务顾问业务净收入

项 目	本期数	上年同期数
并购重组财务顾问业务净收入——境内上市公司	8,113,490.57	19,464,150.97
并购重组财务顾问业务净收入——其他	613,207.54	2,490,566.05
其他财务顾问业务净收入	55,296,776.95	58,289,187.69
小 计	64,023,475.06	80,243,904.71

## (3) 代理销售金融产品情况

项目	期末数		期初数	
	销售总金额	代销收入	销售总金额	代销收入
基金	25,142,729,111.73	352,230,723.35	67,494,208,119.00	638,669,543.30
其他金融产品	3,471,047,711.44	190,820,553.24	18,436,406,281.60	312,175,154.50
合计	28,613,776,823.17	543,051,276.59	85,930,614,400.60	950,844,697.80

## (4) 资产管理业务开展及收入明细情况

项目	集合资产管理业务	单一资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	126	120	28
期末客户数量	250,062	120	433
其中：个人客户	249,171	56	
机构客户	891	64	433
期初受托资金	68,808,357,303.33	39,476,278,094.42	29,618,155,000.00
其中：自有资金投入	2,084,727,377.99		
个人客户	10,040,038,916.99	7,174,788,084.45	
机构客户	56,683,591,008.35	32,301,490,009.97	29,618,155,000.00
期末受托资金	62,451,900,651.25	50,939,768,746.19	32,055,422,300.00
其中：自有资金投入	3,328,141,781.53		
个人客户	24,672,747,107.38	6,820,258,360.35	
机构客户	34,451,011,762.34	44,119,510,385.84	32,055,422,300.00
期末主要受托资产初始成本	69,916,047,043.52	42,126,745,766.81	31,908,985,539.52
其中：股票	2,665,315,506.80	13,542,114,106.46	
国债	41,033,581.88		
其他债券	56,822,407,371.05	14,419,964,297.98	2,457,483,834.57
基金	3,451,483,684.09	164,146,225.32	40,146,647.34
其他	6,935,806,899.70	14,000,521,137.05	29,411,355,057.61
本期资产管理业务净收入	241,613,629.89	76,105,092.01	1,495,055.51

### 3. 投资收益

#### (1) 明细情况

项目	本期数	上年同期数
成本法核算的长期股权投资收益	650,000,000.00	
权益法核算的长期股权投资收益	494,810,235.12	510,891,840.34
金融工具投资收益	6,174,207,410.75	6,098,535,863.34
其中：持有期间取得的收益	5,984,032,080.94	5,318,618,588.59
- 交易性金融工具	5,153,372,080.64	4,101,583,513.35
- 其他权益工具投资	830,660,000.30	1,217,035,075.24
处置金融工具取得的收益	190,175,329.81	779,917,274.75
- 交易性金融工具	479,177,267.64	1,230,009,003.81
- 其他债权投资	252,332,976.05	40,308,045.57
- 衍生金融工具	-541,334,913.88	-490,399,774.63
其他	-221,216,365.25	-9,012,123.47
合计	7,097,801,280.62	6,600,415,580.21

#### (2) 按权益法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期数	上年同期数	本期比上期增减变动的原因
鹏华基金公司	506,228,903.96	505,652,607.89	被投资单位净利润变化
前海股交投资控股（深圳）有限公司	-13,029,785.60	3,013,737.10	被投资单位净利润变化
青岛蓝海股权交易中心有限责任公司	1,611,116.76	2,225,495.35	被投资单位净利润变化
小计	494,810,235.12	510,891,840.34	

#### (3) 交易性金融工具投资收益

交易性金融工具		本期数	上年同期数
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	5,153,372,080.64	4,101,583,513.35
	处置期间收益	512,017,010.63	1,233,584,259.52
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	持有期间收益		
	处置期间收益	-32,839,742.99	-3,575,255.71
小计		5,632,549,348.28	5,331,592,517.16

#### 4. 公允价值变动收益

项目	本期数	上年同期数
交易性金融资产	-2,965,140,310.90	1,200,493,749.14
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产		
交易性金融负债	13,519,930.38	-2,112,974.29
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		
衍生金融工具	336,970,448.82	41,845,784.87
合计	-2,614,649,931.70	1,240,226,559.72

#### 5. 业务及管理费

项目	本期数	上年同期数
职工薪酬	5,040,527,723.61	7,503,029,803.67
通讯费	207,803,217.21	199,243,817.93
固定资产折旧费	266,958,838.03	156,203,971.15
使用权资产折旧费	148,471,107.30	136,686,828.85
电子设备运转费	139,919,201.54	124,638,542.23
交易所席位年费	141,952,321.28	109,072,200.27
业务宣传费	132,537,168.50	94,499,337.97
差旅费	74,239,902.50	91,175,066.39
投资者保护基金支出	62,928,159.28	91,158,796.16
无形资产摊销	88,434,042.12	76,799,762.63
租赁费	8,790,632.61	37,919,939.44
其他	536,445,793.63	383,085,834.17
合计	6,849,008,107.61	9,003,513,900.86

## 七、合并范围的变更

### (一) 其他原因的合并范围减少

公司名称	股权处置方式	股权处置时点	处置日净资产	期初至处置日 净利润
国信海外（深圳）股权投资基金管理有限公司	注销	2022年1月		
深圳市国信大族机器人产业投资基金管理有限公司	注销	2022年2月		28,581.62
深圳市国信众创基金管理有限公司	注销	2022年3月		-4,944,871.34
深圳市国信运通基金管理有限公司	注销	2022年2月		12,530.63
华文弘盛基金管理（珠海）有限公司	注销	2022年2月		563.89

## （二）纳入合并范围的结构化主体变动情况

本公司纳入合并范围的结构化主体主要包括本公司同时作为管理人或投资顾问和投资人、单一投资人的资产管理计划。本公司综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及因作为管理人或投资顾问获得的薪酬水平是否使本公司面临可变回报的影响重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。本公司 2022 年度新增 14 个结构化主体纳入合并报表范围，8 个结构化主体清算或持有份额比例下降丧失控制权不再纳入合并报表范围。

## 八、在其他主体中的权益

### （一）在重要子公司中的权益

#### 1. 子公司的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 / 表决权比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
国信弘盛公司	深圳	深圳	股权投资基金管理	100.00		自行设立
国信香港公司	香港	香港	金融控股公司	100.00		自行设立
国信资本公司	深圳	深圳	科创板跟投；创业投资	100.00		自行设立
国信期货公司	上海	上海	期货经纪、期货投资咨询、资产管理	100.00		非同一控制下企业合并
国信证券（香港）经纪有限公司 [注 1]	香港	香港	证券及期货经纪业务		100.00	自行设立
国信证券（香港）融资有限公司 [注 1]	香港	香港	投资银行		100.00	自行设立
国信证券（香港）资产管理有限公司 [注 1]	香港	香港	资产管理		100.00	自行设立
国信咨询公司 [注 1]	深圳	深圳	提供咨询和支持服务		100.00	自行设立
国信（香港）金融产品有限公司 [注 1]	香港	香港	金融产品		100.00	自行设立
国信金阳资本管理有限公司 [注 2]	上海	上海	现货和期货交易		100.00	自行设立

[注 1] 国信香港公司的下设子公司

[注 2] 国信期货公司的下设子公司

#### 2. 对于纳入合并范围的重要的结构化主体，控制的依据

本公司在评估控制时，需考虑：1) 投资方对被投资方的权利；2) 参与被投资方的相关活动而享有的可变回报；3) 有能力运用对被投资方的权利影响其回报的金额。

本公司在判断是否控制结构化主体时，还需要考虑本公司之决策行为是以主要责任人的身份进行还是以代理人的身份进行。考虑的因素通常包括本公司对结构化主体的决策权范围、其他方享有的实质性权利、本公司的报酬水平以及本公司持有结构化主体的其他利益而承担可变回报的风险等。对于本公司担任资产管理方的资产管理计划，本公司会持续评估因

管理该资产管理计划而获得的薪酬水平和面临的可变回报风险程度是否表明本公司为该资产管理计划的主要责任人。如本公司为该资产管理计划的主要责任人，应将上述资产管理计划纳入合并范围。

本公司合并的结构化主体包括本公司同时作为管理人及投资者的集合资产管理计划和本公司作为唯一投资者的定向资产管理计划。本公司通过综合评估本公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响是否重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。

2022年12月31日，纳入本公司财务报表合并范围的结构化主体共40个，合并的结构化主体的总资产为人民币10,918,945,307.09元。本公司在上述合并结构化主体中的权益体现在资产负债表中交易性金融资产和其他权益工具投资的金额为人民币10,266,282,163.79元。

## (二) 在合营企业或联营企业中的权益

### 1. 重要的合营企业或联营企业

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	
鹏华基金公司	深圳	深圳	基金管理	50.00		权益法
深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	深圳	深圳	私募股权投资		28.58	权益法
北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金(有限合伙)	北京	北京	私募股权投资		25.00	权益法

### 2. 重要联营企业的主要财务信息

项目	期末数 / 本期数			期初数 / 上年同期数		
	鹏华基金公司	深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金(有限合伙)	鹏华基金公司	深圳市国信弘盛股权投资基金(有限合伙)	北京航天科工军民融合科技成果转化创业投资基金(有限合伙)
资产	7,555,698,734.80	155,845,702.93	414,187,759.49	6,950,716,202.10	300,214,429.15	1,026,073,396.90
负债	3,456,974,518.75	25,272,689.15	74,853,340.31	3,207,244,679.02	25,413,349.47	-3,238,889.25
少数股东权益	19,902,571.86			21,072,483.36		
归属于母公司所有者权益	4,078,821,644.19	130,573,013.78	339,334,419.18	3,722,399,039.72	274,801,079.68	1,029,312,286.15
按持股比例计算的净资产份额	2,039,410,822.10	37,312,898.51	84,833,604.80	1,861,199,519.86	78,527,901.75	218,293,651.98
调整事项	-3,711.61		-5,158,862.45	-5,021,313.33	495,764.51	
对联营企业权益投资的账面价值	2,039,407,110.49	37,312,898.51	79,674,742.35	1,856,178,206.53	79,023,666.26	218,293,651.98
营业总收入	4,364,096,385.13	-124,825,936.11	-394,015,972.24	4,436,778,313.94	661,456.91	926,755,709.18
净利润	1,001,252,692.97	-128,563,168.35	-521,203,022.89	1,007,647,787.56	-114,896.27	613,310,108.63
终止经营的净利润						
其他综合收益						
综合收益总额	1,001,252,692.97	-128,563,168.35	-521,203,022.89	1,007,647,787.56	-114,896.27	613,310,108.63
本期收到的来自联营企业的股利	323,000,000.00	2,951,443.11	39,083,318.85	178,000,000.00		

### 3. 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息

项目	期末数 / 本期数	期初数 / 上年同期数
合营企业		
投资账面价值合计	515,415,348.54	597,523,589.06
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	106,629,036.19	94,766,512.63
其他综合收益		
综合收益总额	106,629,036.19	94,766,512.63
联营企业		
投资账面价值合计	796,658,120.32	810,320,512.37
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	2,336,154.12	75,332,044.40
其他综合收益		-37,259,514.75
综合收益总额	2,336,154.12	38,072,529.65

#### (三) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本公司未纳入合并财务报表范围的结构化主体主要包括本公司发起设立的资产管理计划和第三方机构发起设立的资产管理计划、基金等结构化主体。

##### 1. 在本公司发起设立的资产管理计划和投资基金中的权益

本公司发起设立的资产管理计划和投资基金的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。本公司在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资或通过管理这些结构化主体赚取管理费收入。

期末本公司通过直接持有本公司发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项目	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
券商资管产品	交易性金融资产	1,695,716,161.79	92,230,091.68	1,695,716,161.79	92,230,091.68

本期本公司从由本公司发起设立但未纳入合并财务报表范围的资产管理计划及投资基金中获取的管理费及业绩报酬为人民币 387,722,727.35 元。

##### 2. 在第三方机构发起设立的资产管理计划中享有的权益

本公司直接持有的第三方机构发起设立的结构化主体，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括证券公司资产管理计划、基金专户产品和信托产品等。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。

期末本公司通过直接持有第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益在本公司资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大损失风险敞口列示如下：

项 目	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
基金	交易性金融资产	16,727,868,981.52	23,109,626,726.13	16,727,868,981.52	23,109,626,726.13
银行理财产品	交易性金融资产	6,330,475,561.97	2,359,071,808.45	6,330,475,561.97	2,359,071,808.45
券商理财产品	交易性金融资产	38,151,096.36	6,007,990,959.81	38,151,096.36	6,007,990,959.81
信托计划	交易性金融资产	220,493,801.58	264,276,340.84	220,493,801.58	264,276,340.84
私募基金及专户	交易性金融资产	8,693,185,323.87	7,234,125,344.83	8,693,185,323.87	7,234,125,344.83

## 九、与金融工具相关的风险

### （一）风险管理政策及组织架构

目前公司建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

#### 1. 董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

#### 2. 经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司首席风险官按照公司相关风险管理制度负责全面风险管理工作，公司下设风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策。

#### 3. 独立的风险管理机构

公司风险管理总部作为独立的风险管理机构，在事前、事中、事后的环节中，对各业务领域、相关部门和主要岗位的风险管理情况予以评估、监测、检查、反馈等。风险管理总部根据首席风险官授权及部门职责履行制衡性的全面风险管理职能，按照全面、适时、审慎的原则，起草公司整体的风险偏好和容忍度方案，合理配置风险限额。对业务风险进行事前识别和评估、事中计量和监控、事后报告和处置，对业务部门的风险管理工作进行检查和考评。资金运营部、信息技术部门、党群办公室分别牵头开展流动性风险管理、信息技术风险管理、声誉风险管理工作。合规管理总部对公司经营与管理活动的合法合规性进行独立控制，负责指导、检查和督促公司及其所属机构履行法定责任与合规义务。公司投资银行质量控制总部作为独立机构，统筹把关投资银行领域项目质量，与风险管理总部及其二级部门投资银行内核部、合规管理总部等部门共同把控投行业务风险，健全了投行业务内控体系。监察稽核总部通过事后稽核审计等方式，对公司内部控制制度设计的完整性、合理性及其实施的有效性进行检查及评价，以及组织开展相关的审计、评价、鉴证等工作。

#### 4. 业务部门的风险管理岗位

公司明确业务部门负责人为本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的经营风险承担责任。业务部门根据业务特点制定了相应的业务风险管理规则制度，并指定相关人员从事风险管理岗位工作，具体负责本部门风险管理制度的落实、日常检查和督促工作，发现问题后及时与公司风险管理部门进行沟通。

##### (二) 信用风险

信用风险一般是指因客户、交易对手或证券发行人未履行合约责任而引致公司损失的风险。公司的信用风险主要集中在以下业务：

- 1、具有债权性质的债券等交易业务；
- 2、融资融券业务、约定购回和股票质押式回购等有证券抵押的资本中介业务；
- 3、场外衍生品业务；
- 4、经纪业务模式下的债券质押式回购业务；
- 5、存放银行的活期存款及定期存款；
- 6、其他可能产生信用风险的业务或活动。

针对上述业务风险，公司按照《证券公司信用风险管理指引》的要求，已建立了覆盖信用风险环节的风险管理机制和相关制度，做实风险识别、评估、测量、监控、报告等管理流程，不断完善信用风险的管理手段和方法。其中，公司信用风险管理采用的管理手段和方法包括：尽职调查、内部评级、授信管理、风险限额管理、信用风险计量、风险指标监测和后续管理、风险缓释措施以及风险管理信息系统建设等。

债券交易业务中存在发行人违约的信用风险。公司建立具有自主知识产权的内部评级体系，采用财务指标与经营指标相结合的方法对发行人、交易对手进行风险评估，通过债券负面清单管理、同一发行人授信管理等措施对债券投资实施前端准入控制；持续监控发行人资信状况；及时调整负面清单债券的持仓；明确违约司法追索程序等措施。

股票质押、融资融券等资本中介业务存在融资客户到期未能履约的信用风险。公司采取的风险管理措施包括：通过尽职调查、审查等手段对交易对手进行信用评估和授信管理；依据定性和定量评估进行担保物和标的准入管理；对客户融资规模、提交担保物实施集中度控制；严密监控交易的履约保障比例；在客户信用状况出现重大变化、交易标的发生重大风险事项时及时进行客户信用风险重估或标的估值调整；定期或不定期开展业务压力测试；对风险客户、项目及时通知追保，必要时采取强制平仓、启动司法追索程序等，控制信用风险。报告期末，公司融资融券业务存量负债客户平均维持担保比例为 260.77%；公司约定购回式证券交易负债客户平均维持担保比例为 217.39%；公司股票质押式回购交易负债客户平均维持担保比例为 187.42%。

衍生品交易业务存在交易对手于约定日期未履行支付义务的信用风险。对此，公司对交易对手进行评级并授信；寻求资质好的担保方项目进行交易；利用净额结算、衍生对冲工具、提前终止交易选择权等措施进行风险缓释；明确违约事件、提前终止事件的处理流程等措施。

经纪业务模式下的债券质押式回购业务公司对中国证券登记结算有限责任公司承担交收责任。公司采取投资者适当性管理、风险限额、内部评级、授信管理、集中度管理、系统监控等措施，控制因承担客户回购还款交收责任所带来的信用风险。

公司持有的银行存款及存出保证金主要存放于具有良好信用评级的金融机构；结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

若不考虑担保品或其他信用增级，最大信用风险敞口为金融资产的账面余额。本公司最大信用风险敞口列示如下：

项目	期末数	期初数
货币资金	64,977,826,272.53	67,721,741,037.30
结算备付金	15,734,799,287.70	17,087,824,020.77
存出保证金	7,900,221,491.14	7,587,572,329.43
融出资金	52,672,094,624.02	61,973,311,849.43
衍生金融资产	164,204,033.62	57,966,861.36
交易性金融资产 [注 1]	120,894,809,734.67	108,960,116,031.28
债权投资	69,266,211.57	
其他债权投资	51,501,472,752.05	29,644,274,446.31
其他权益工具投资 [注 2]	146,735,038.90	305,638,318.80
买入返售金融资产	15,824,517,431.75	6,770,994,407.11
应收款项	4,728,934,871.75	1,432,595,710.21
其他资产	203,552,147.75	220,418,450.26
合计	334,818,433,897.45	301,762,453,462.26

[注 1] 交易性金融资产为债券投资、融出证券业务下融出给客户的证券以及向证金公司借出的证券

[注 2] 其他权益工具投资为融出证券业务下融出给客户的证券

### （三）操作风险

操作风险是指不完善或有缺陷的内部流程、人员管理、信息技术系统，以及外部事件所造成潜在或已发生损失的风险。操作风险存在于公司各部门各流程，涉及范围广、表现形式多样化，如操作风险管理不善，可能引起风险的转化，或与其他风险相互交叠，扩大损失或对公司其他方面造成负面影响。公司操作风险管理遵循有效性、全面性及审慎性原则，秉承审慎、持续稳健经营的理念，通过大力开展风险文化宣导，积极推动操作风险三大管理工具和系统建设，减少操作风险的发生。

为有效防范操作风险，公司现已采取以下措施：一是严格遵守监管要求，落实《国信证券股份有限公司操作风险管理办法》及其配套管理细则；二是开展操作风险与控制自我评估，识别、评估公司各业务和管理流程相关风险；三是运用关键风险指标开展日常监控，及时预警、处置风险，并加强业务风险检查；四是持续完善风险事件收集机制，及时向经营层报告重大操作风险事项，并采取应对措施；五是积极开展风险管理文化宣导，以案例分析、现场培训等多种形式组织公司各部门风险教育培训。

### （四）流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。可能引发流动性风险的因素和事件包括但不限于重要融资渠道受限、融资成本大幅上行、来自其他风险因素的传导（如声誉风险）等。

公司流动性风险管理组织架构包括董事会、经理层、资金运营部、风险管理总部及相关部门等，公司董事会承担流动性风险管理的最终责任，资金运营部是公司流动性风险管理的负责部门，统筹公司资金来源与融资管理。

公司实施审慎且全面的资产负债管理和流动性风险管理，通过合理的资产配置、多元化的融资渠道、审慎的负债构成、适当的财务杠杆、充足的流动性储备、动态的指标及限额监控、前瞻的流动性管理等措施与机制，有效防范和化解流动性风险。公司持续完善资产负债约束和流动性风险管理长效机制，具体措施包括但不限于：

1. 积极拓展融资渠道，提高融资来源的多元化，运用合适的债务融资工具，持续优化负债结构，保持合理的财务杠杆水平。
2. 加强优质流动性资产和流动性储备的配置与监控，确保在压力情景下能够及时满足公司流动性需求。
3. 持续完善流动性风险指标及限额，并动态监测与评估，确保流动性风险监管指标持续满足监管和公司自身要求，并留有一定的弹性与余地。
4. 持续优化现金流管理，每日动态计量未来不同时间段的现金流，根据市场利率水平、公司融资能力等提前做好融资安排，有效控制未来不同时间段的现金流缺口。
5. 适时开展流动性风险压力测试和应急演练，确定风险点和脆弱环节，并制定应对措施。
6. 持续推动信息系统升级优化，科技赋能公司流动性风险管理。

2022年12月31日，本公司各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

项目	即期	小于3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	合计
应付短期融资款		21,255,634,746.73	1,386,537,412.00			22,642,172,158.73
拆入资金		9,007,387,205.48				9,007,387,205.48
交易性金融负债		1,319,333,950.72	377,109,317.97	20,379,088.88	73,024,997.05	1,789,847,354.62
衍生金融负债		161,773,414.23	160,637,815.35	2,261,210.02		324,672,439.60
应付款项	2,894,684,286.16	1,343,083,454.61	3,055,930,137.54	5,405,133,437.30		12,698,831,315.61
卖出回购金融资产款		114,145,821,616.77	85,171,692.82			114,230,993,309.59
代理买卖证券款	59,413,814,509.13					59,413,814,509.13
应付债券		8,611,662,783.88	3,184,512,372.14	40,192,739,769.82		51,988,914,925.84
租赁负债		42,858,468.67	122,993,403.92	252,170,366.30	21,344,683.76	439,366,922.65
其他金融负债	10,315,340,464.68					10,315,340,464.68
合计	72,623,839,259.97	155,887,555,641.09	8,372,892,151.74	45,872,683,872.32	94,369,680.81	282,851,340,605.93

## （五）市场风险

市场风险是指因市场价格、波动率或相关性的变动而造成持仓损失的风险，市场价格包括利率、汇率、股票价格和商品价格。公司面临市场风险的业务包括但不限于：固定收益投资业务面临因市场利率变动而导致债券投资持仓资产减值的利率风险；股票自营投资业务面临股票价格变动而导致股票自营投资持仓资产减值的股票价格风险；柜台市场业务面临因场外衍生品交易中协议标的价格的不利变动所带来的价格风险等。随着证券公司及其子公司业务的快速发展，其所承受的各类市场风险正在不断增大，而市场经济波动、投资范围受限、国际化推进以及金融衍生品市场的不完善等因素加剧了市场风险的形成。

公司在已构建的四级风险管理架构下，制定了市场风险管理的具体流程，涵盖公司董事会、资产负债委员会、风险控制委员会、风险管理总部及各业务部门，各组织分工明确，各负其责。

公司根据董事会每年审议通过的整体市场风险限额，综合考虑各业务的风险收益特征和相关性等因素，将风险限额细化并分配至各业务部门及相关策略。风险限额主要包括投资规模、损失比例、风险价值（VaR）、压力测试限额等指标。风险管理总部通过市场风险管理系统等专业的风险管理工具和方法对风险限额进行每日监控，当指标达到预警限额时，风险管理总部对触发预警限额部门进行预警提示，并要求其在规定时间内进行反馈，说明触发预警限额原因和后续的调整计划；当指标突破风险限额时，风险管理总部对超限部门进行提示，要求超限部门在规定时间内进行反馈，说明超限原因和后续调整计划，并要求超限部门在反馈期间原则上不能继续增加风险敞口。风险管理总部会持续监督业务部门风险应对措施的实施情况，并与业务部门沟通讨论风险信息 and 可能出现的极端压力情景。

公司不断规范和完善风险限额管理体系，根据各业务的特点不断丰富限额指标，使业务能在公司既定的风险偏好下保持良性发展。例如，对于固收类及其衍生品业务，在投资规模和 VaR 限额的基础上，增加组合久期、基点价值等限额管理；对于权益类衍生品业务，设定希腊字母、集中度等限额并进行日常监控。此外，公司将子公司风险限额体系纳入统一管理，要求子公司日常提供包括限额使用情况、各类风险事项信息等内容的风险管理报表。

公司使用多种方法和工具测量和分析可能面临的市场风险损失。对于正常市场波动下的可能损失，公司主要通过 VaR 等指标进行测量；对于极端情况下的可能损失，公司采取压力测试等方式进行评估。

VaR 值是指在一定置信区间下，因市场价格变动，相应证券组合在未来一定时间内可能产生的最大损失金额。VaR 模型考虑了利率风险、汇率风险、权益价格风险和商品价格风险等主要风险类型对公司投资组合的影响，并考虑了组合间的分散化效应。压力测试是对公司持仓面临极端冲击下的可能损失状况进行评估的一种方法，日常用于测量和管控尾部风险。

母公司和集团以期末为基期的 VaR 值（1 天，99%）分析概况如下：

单位：万元

VaR	母公司层面	合并层面
权益类市场风险	48,212	54,247
利率类市场风险	22,031	22,060
商品类市场风险		33
外汇类市场风险	4,941	5,143
整体风险值	47,612	51,324

价格敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，股票、基金、可转换债券、衍生品等资产类型的价格增加或减少对集团和公司综合收益的影响。假设以 2022 年 12 月 31 日为基期，在其他变量固定的情况下市场权益类及商品价格发生变动，且不考虑管理层为市场价格变化而可能采取的风险管理活动，价格敏感性分析如下：

金额单位：人民币万元

价格变动对综合收益影响	母公司层面	合并层面
股票、基金、商品价格上浮 10%	119,326	126,831
股票、基金、商品价格下跌 10%	-106,095	-113,579

下表汇总了本公司涉及的市场风险敞口：

项目	期末数	期初数
股票	14,819,489,487.20	12,103,876,770.33
公募基金	16,727,868,981.52	23,109,626,726.13
债券	171,309,781,674.74	136,926,003,642.82
券商资管产品	1,733,867,258.15	6,100,221,051.49
银行理财产品	6,330,475,561.97	2,359,071,808.45
信托计划	220,493,801.58	264,276,340.84
其他股权投资	1,637,041,120.18	1,044,318,301.67
其他	8,694,085,323.87	7,235,025,344.83
合计	221,473,103,209.21	189,142,419,986.56

利率敏感性分析是在假设其他变量不变的情况下，市场整体利率平行变动对集团和公司综合收益的影响。假设以2022年12月31日为基期，在其他变量固定的情况下市场整体利率发生平行变动，且不考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动，利率敏感性分析如下：

金额单位：人民币万元

收益率曲线变动对综合收益影响	母公司层面	合并层面
上升 100 个基点	-252,947	-256,874
下降 100 个基点	271,709	275,653

下表汇总了本公司涉及利率风险的金融资产或金融负债：

### 1. 期末数

项目	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	非生息	合计
金融资产							
货币资金	55,315,015,268.80	4,574,265,129.80	4,869,724,541.97	100,000,000.00		118,821,331.96	64,977,826,272.53
结算备付金	15,723,198,799.10					11,600,488.60	15,734,799,287.70
融出资金	250,220,723.88	51,389,110,165.18				1,032,763,734.96	52,672,094,624.02
交易性金融资产	2,137,729,963.14	4,074,730,863.66	42,825,817,976.39	60,196,893,944.02	10,416,097,283.98	39,821,303,206.25	159,472,573,237.44
衍生金融资产						164,204,033.62	164,204,033.62
买入返售金融资产	11,061,342,331.22	323,074,261.19	4,356,486,947.59			83,613,891.75	15,824,517,431.75
存出保证金	7,898,323,637.82					1,897,853.32	7,900,221,491.14
其他权益工具投资			146,735,038.90			10,283,055,969.25	10,429,791,008.15
其他债权投资	50,007,250.00	390,964,870.00	8,459,838,094.40	35,215,707,566.36	6,556,370,777.01	828,584,194.28	51,501,472,752.05

项目	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	非生息	合计
债权投资		24,066,732.47	29,550,582.11	15,459,581.01		189,315.98	69,266,211.57
小计	92,435,837,973.96	60,776,212,022.30	60,688,153,181.36	95,528,061,091.39	16,972,468,060.99	52,346,034,019.98	378,746,766,349.98
金融负债							
短期借款							
应付短期融资款	9,867,721,000.00	11,155,499,000.00	1,127,068,000.00			365,707,310.97	22,515,995,310.97
拆入资金	9,000,000,000.00					6,162,483.33	9,006,162,483.33
交易性金融负债	35,230,000.00	1,276,797,860.96	18,133,323.78			459,686,169.88	1,789,847,354.62
衍生金融负债	49,551,705.92	110,203,242.82	160,637,815.35	2,261,210.02		2,018,465.49	324,672,439.60
应付款项						12,698,831,315.61	12,698,831,315.61
卖出回购金融资产款	112,467,883,987.72	1,527,285,000.00	84,272,000.00			104,418,395.45	114,183,859,383.17
代理买卖证券款	59,406,410,931.29					7,403,577.84	59,413,814,509.13
代理承销证券款							
应付债券	3,009,661,000.00	5,059,721,000.00	2,173,589,000.00	37,902,325,000.00		705,140,652.29	48,850,436,652.29
租赁负债	14,885,610.42	24,415,823.80	114,370,693.22	238,628,537.71	19,829,262.42		412,129,927.57
其他金融负债	10,315,340,464.68						10,315,340,464.68
小计	204,166,684,700.03	19,153,921,927.58	3,678,070,832.35	38,143,214,747.73	19,829,262.42	14,349,368,370.86	279,511,089,840.97
净头寸	-111,730,846,726.07	41,622,290,094.72	57,010,082,349.01	57,384,846,343.66	16,952,638,798.57	37,996,665,649.12	99,235,676,509.01

## 2. 期初数

项目	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	非生息	合计
金融资产							
货币资金	61,380,778,997.02	1,101,711,467.21	5,135,280,000.00			103,970,573.07	67,721,741,037.30
结算备付金	17,071,532,526.84					16,291,493.93	17,087,824,020.77
融出资金	383,752,995.73	60,576,093,609.99				1,013,465,243.71	61,973,311,849.43
交易性金融资产	2,540,663,438.66	3,002,679,044.59	33,433,980,588.44	60,083,182,576.93	11,332,071,978.57	41,919,545,647.85	152,312,123,275.04
衍生金融资产						57,966,861.36	57,966,861.36
买入返售金融资产	2,465,178,655.17	250,272,930.12	3,990,149,575.90			65,393,245.92	6,770,994,407.11
存出保证金	7,580,372,879.29	28,321.29	3,491,255.05	1,389,072.49		2,290,801.31	7,587,572,329.43
其他权益工具投资			305,638,318.80			6,880,383,946.41	7,186,022,265.21

项目	1个月以内	1至3个月	3个月至1年	1至5年	5年以上	非生息	合计
其他债权投资	70,042,620.00	407,928,509.28	3,616,534,501.93	19,368,523,584.59	5,683,001,725.64	498,243,504.87	29,644,274,446.31
小计	91,492,322,112.71	65,338,713,882.48	46,485,074,240.12	79,453,095,234.01	17,015,073,704.21	50,557,551,318.43	350,341,830,491.96
<b>金融负债</b>							
短期借款	225,000,000.00					270,000.00	225,270,000.00
应付短期融资款	1,752,935,000.00	4,192,570,000.00	13,733,239,000.00			121,288,805.99	19,800,032,805.99
拆入资金	2,445,000,000.00	2,000,000,000.00				11,797,971.98	4,456,797,971.98
交易性金融负债		294,314,660.00	65,028,486.13			101,639,604.97	460,982,751.10
衍生金融负债	3,738,588.31	21,688,905.71	30,098,704.31	103,014,624.25	-8,237.86	67,516,923.57	226,049,508.29
应付款项	1,503,009,464.00					3,771,969,661.00	5,274,979,125.00
卖出回购金融资产款	94,527,035,013.83	1,891,753,000.00	38,548,000.00			67,593,437.79	96,524,929,451.62
代理买卖证券款	67,271,352,340.48					8,939,776.25	67,280,292,116.73
代理承销证券款						27,000,000.00	27,000,000.00
应付债券	25,022,000.00	4,511,417,000.00	10,246,977,000.00	35,403,685,000.00		815,386,491.65	51,002,487,491.65
租赁负债	16,456,966.17	22,861,650.27	275,345,263.39	130,901,536.28	1,451,323.75		447,016,739.86
其他金融负债	10,135,324,618.62						10,135,324,618.62
小计	177,904,873,991.41	12,934,605,215.98	24,389,236,453.83	35,637,601,160.53	1,443,085.89	4,993,402,673.20	255,861,162,580.84
净头寸	-86,412,551,878.70	52,404,108,666.50	22,095,837,786.29	43,815,494,073.48	17,013,630,618.32	45,564,148,645.23	94,480,667,911.12

## 十、公允价值的披露

### (一) 以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值明细情况

项目	期末公允价值			合计
	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	
持续的公允价值计量				
1. 交易性金融资产	5,505,071,034.63	144,740,113,417.57	9,227,388,785.24	159,472,573,237.44
(1) 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	5,505,071,034.63	144,740,113,417.57	9,227,388,785.24	159,472,573,237.44
债务工具投资		116,436,758,151.79	3,302,284,559.33	119,739,042,711.12
权益工具投资	5,505,071,034.63	28,303,355,265.78	5,925,104,225.91	39,733,530,526.32

项 目	期末公允价值			合 计
	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	
(2) 指定为以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产				
债务工具投资				
2. 衍生金融资产		164,204,033.62		164,204,033.62
3. 其他债权投资		51,501,472,752.05		51,501,472,752.05
4. 其他权益工具投资	10,409,084,508.15		20,706,500.00	10,429,791,008.15
持续以公允价值计量的资产总额	15,914,155,542.78	196,405,790,203.24	9,248,095,285.24	221,568,041,031.26
5. 交易性金融负债				
(1) 交易性金融负债		1,758,515,203.42	31,332,151.20	1,789,847,354.62
(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				
6. 衍生金融负债	320,717,576.25	3,954,863.35		324,672,439.60
持续以公允价值计量的负债总额	320,717,576.25	1,762,470,066.77	31,332,151.20	2,114,519,794.22

## (二) 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

对于存在活跃市场的金融资产或金融负债，本公司采用活跃市场中的报价确定其公允价值。

## (三) 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

债券投资的公允价值是采用第三方估值机构估值系统的报价，第三方估值机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。场外期权、收益互换、收益凭证的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

## (四) 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

项 目	2022 年 12 月 31 日 公允价值	估值技术	重大不可观察输入值	对公允价值的影响
流通受限的上市公司股票	1,218,725,204.49	期权定价模型	波动率	波动率越高，公允价值越低
非活跃市场的股票 / 非上市公司股权	1,758,409,183.91	市值折扣法 / 协议转让价格 / 净资产调整法等	流动性折扣	折扣越高，公允价值越低
理财产品、私募债、可交债等	6,302,293,048.04	现金流量折现法 / 期权定价模型	风险调整折现率 / 波动率	风险调整折现率 / 波动率越高，公允价值越低
合 计	9,279,427,436.44			

### (五) 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

项目	期初余额	转入第三层次	转出第三层次	当年利得或损失总额	
				计入损益	计入其他综合收益
交易性金融资产	6,922,224,292.15	45,110,832.73	2,736,813,374.96	862,226,057.68	
其他权益工具投资	222,053,033.73		201,346,533.73		
交易性金融负债	20,034,234.50			11,297,916.70	
合计	7,164,311,560.38	45,110,832.73	2,938,159,908.69	873,523,974.38	

(续上表)

项目	购买、发行、出售和结算				期末余额	对于在报告期末持有的资产， 计入损益的当期未实现利得 或损失的变动
	购买	发行	出售	结算		
交易性金融资产	7,361,806,879.71		3,227,165,902.07		9,227,388,785.24	218,556,248.23
其他权益工具投资					20,706,500.00	
交易性金融负债					31,332,151.20	11,297,916.70
合计	7,361,806,879.71		3,227,165,902.07		9,279,427,436.44	229,854,164.93

### (六) 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

2022 年度，本公司公允价值计量的项目由第三层次转出主要是限售股解禁所致。

### (七) 本期发生的估值技术变更及变更原因

2022 年度，本公司公允价值计量所使用的估值技术并未发生变更。

### (八) 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

本公司管理层认为，于 2022 年 12 月 31 日除应付短期融资款、应付债券外，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。截至 2022 年 12 月 31 日，本公司所持有的应付短期融资款账面价值为人民币 22,515,995,310.97 元，公允价值为人民币 22,533,991,200.01 元；本公司所持有的应付债券账面价值人民币为 48,850,436,652.29 元，公允价值为人民币 48,974,741,991.26 元。

## 十一、关联方及关联交易

### (一) 关联方情况

#### 1. 本公司的母公司情况

##### (1) 本公司的母公司

母公司名称	注册地	业务性质	注册资本 (万元)	母公司对本公司的 持股比例 (%)	母公司对本公司的 表决权比例 (%)
深圳投控公司	深圳	通过重组整合、资本运作、资产处置等手段，对全资、控股和参股企业国有股权进行投资、运营和管理	3,050,900	33.53	33.53

(2) 本公司最终控制方是深圳市人民政府国有资产监督管理委员会。

2. 本公司的子公司情况详见本财务报表附注八（一）之说明。

### 3. 本公司的合营和联营企业情况

本公司重要的合营或联营企业详见本财务报表附注八（二）之说明。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：

合营或联营企业名称	与本公司关系
鹏华基金公司	本公司之联营企业
国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	本公司之联营企业
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	本公司之联营企业
深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之联营企业
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	本公司之合营企业
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙）	本公司之合营企业
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	本公司之合营企业

### 4. 本公司的其他关联方情况

其他关联方名称	与本公司关系
华润深国投信托有限公司（以下简称华润深国投公司）	持有本公司 5% 以上股份的法人
深圳国际控股有限公司	受同一方控制
深圳市体育中心运营管理有限公司	受同一方控制
深圳大剧院运营管理有限责任公司	受同一方控制
深圳市天使投资引导基金管理有限公司	受同一方控制
深圳市天使投资引导基金有限公司	受同一方控制
深圳千里马国际猎头有限公司	受同一方控制
深圳人大干部培训中心有限公司	受同一方控制
深圳市通产集团有限公司	受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事
深圳市高新投集团有限公司	受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事
深圳市建筑设计研究总院有限公司	受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事
深圳市投控资本有限公司	受同一方控制、公司董事担任该公司总经理
深圳英飞拓科技股份有限公司	受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事
国任财产保险股份有限公司	受同一方控制、深圳投控公司高管担任该公司董事
深圳市怡亚通供应链股份有限公司	受同一方控制、公司董事担任该公司董事
深圳担保集团有限公司	受同一方控制、公司董事担任该公司董事

其他关联方名称	与本公司关系
深圳市会计协会	深圳投控公司高管担任该协会副会长
深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司	深圳投控公司高管担任该公司董事
南方基金管理股份有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
深圳市地铁集团有限公司	深圳投控公司监事担任该公司董事
深圳市特发集团有限公司	深圳投控公司董事、高管担任该公司董事
深圳市盐田港集团有限公司	深圳投控公司董事担任该公司董事
国泰君安证券股份有限公司	深圳投控公司董事及监事担任该公司董事
深圳市明达资产管理有限公司	公司高管之亲属担任该公司董事
云南红塔银行股份有限公司	公司董事担任该公司董事
红塔证券股份有限公司	公司董事担任该公司董事
云南白药集团股份有限公司	公司董事担任该公司董事
北京城建投资发展股份有限公司	过去 12 个月公司监事担任该公司董事
深圳投控共赢股权投资基金合伙企业	过去 12 个月深投控董事担任执行事务合伙人委派代表
深圳市信息管线有限公司	2022 年结束“过去 12 个月曾受同一方控制”
深圳市荔园酒店有限公司	2022 年结束“过去 12 个月曾受同一方控制”
深圳银湖会议中心（酒店）有限公司	2022 年结束“过去 12 个月曾受同一方控制”
深圳市国贸科技园服务有限公司	2021 年结束“过去 12 个月曾受同一方控制”
深圳市创新投资集团有限公司	2021 年 5 月结束“深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事” 关联关系
安信证券股份有限公司	2021 年 6 月结束“深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事” 关联关系
深圳市资本运营集团有限公司	2021 年 7 月结束“深圳投控公司董事过去 12 个月曾在该公司担任董事” 关联关系

## （二）关联交易情况

### 1. 购销商品、提供和接受劳务的关联交易

#### （1）佣金收入

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
华润深国投公司	证券代理买卖交易佣金	8,555,789.50	18,671,148.99
深圳投控共赢股权投资基金合伙企业	证券代理买卖交易佣金	198,656.36	285,661.60
深圳投控公司	证券代理买卖交易佣金	158,496.24	19.92
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙）	证券代理买卖交易佣金	77,275.67	
云南白药集团股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	41,272.72	463,690.23
深圳市特发集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	40,230.37	6,669.79
国任财产保险股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	34,113.20	
深圳市高新投集团有限公司	证券代理买卖交易佣金	36,353.42	17,826.24
关联自然人	证券代理买卖交易佣金	17,627.39	55,932.90

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市怡亚通供应链股份有限公司	证券代理买卖交易佣金	1,504.68	
深圳市明达资产管理有限公司	证券代理买卖交易佣金		94,431.95
北京城建投资发展股份有限公司	证券代理买卖交易佣金		76,343.46
鹏华基金公司	席位佣金收入	94,856,739.41	101,222,143.26
南方基金管理股份有限公司	席位佣金收入	10,152,758.06	24,593,872.19
合计		114,170,817.02	145,487,740.53

## (2) 提供咨询服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	咨询服务费	235,849.06	
合计		235,849.06	

## (3) 提供顾问服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
华润深国投公司	投资顾问收入	1,532,483.98	6,229,505.90
深圳市通产集团有限公司	财务顾问收入	849,056.60	1,226,415.09
深圳投控公司	财务顾问收入	652,830.19	990,566.04
深圳市投控资本有限公司	财务顾问收入	700,000.00	358,490.57
深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司	财务顾问收入	547,169.81	
深圳市高新投集团有限公司	财务顾问收入	424,528.30	
深圳英飞拓科技股份有限公司	财务顾问收入	92,452.83	94,339.62
深圳国际控股有限公司	财务顾问收入		400,000.00
深圳市体育中心运营管理有限公司	财务顾问收入		377,358.49
深圳市资本运营集团有限公司	财务顾问收入		183,962.26
合计		4,798,521.71	9,860,637.97

## (4) 提供金融产品代销服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
鹏华基金公司	代销金融产品收入	42,043,714.65	73,868,800.62
南方基金管理股份有限公司	代销金融产品收入	7,734,273.45	24,166,245.42
华润深国投公司	代销金融产品收入	2,584,969.75	2,875,638.23
深圳市明达资产管理有限公司	代销金融产品收入	1,222,230.06	
合计		53,585,187.91	100,910,684.27

## (5) 提供资产管理服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
深圳市国信蓝思壹号投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	49,001,740.48	17,329,783.03
深圳市国信大族壹号机器人产业投资基金（有限合伙）	基金管理收入	12,276,426.58	772,277.22
深圳市国信众创股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	-11,643,833.48	511,760.12
张家港弘盛产业资本母基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	6,669,940.56	9,622,641.53
深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	4,017,063.69	2,278,170.37
深圳市国信弘盛股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入	1,509,184.58	233,980,887.41
厦门弘盛联发智能技术产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	1,470,018.07	2,830,188.70
深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入	3,535.80	
国信弘盛（珠海）能源产业基金（有限合伙）	基金管理收入		20,539,248.39
深圳投控公司	资产管理收入		4,536,055.83
南京华文弘盛文化产业创业投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理收入		3,515,120.10
珠海国信运通股权投资基金（有限合伙）	基金管理收入		300,596.34
合计		63,304,076.28	296,216,729.04

## (6) 提供承销保荐服务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	债券承销收入	12,343,877.36	
深圳投控公司	债券承销收入	5,811,320.75	7,469,150.94
深圳担保集团有限公司	债券承销收入	1,699,056.60	3,773,584.91
深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司	债券承销收入	1,471,698.11	
深圳市地铁集团有限公司	债券承销收入	478,584.42	532,485.85
深圳市盐田港集团有限公司	债券承销收入	410,566.04	1,796,226.41
国泰君安证券股份有限公司	债券分销收入	272,641.51	299,056.60
北京城建投资发展股份有限公司	债券承销收入		589,622.64
国任财产保险股份有限公司	债券承销收入		389,971.30
深圳市创新投资集团有限公司	债券承销收入		141,509.43
深圳市资本运营集团有限公司	债券受托管理收入		188,679.25
合计		22,487,744.79	15,180,287.33

## (7) 收取利息

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
关联自然人	融出资金利息	10,489.93	12,142.60
合计		10,489.93	12,142.60

## (8) 接受其他劳务

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	债券承销 / 分销支出	9,603,773.58	
深圳千里马国际猎头有限公司	服务费	1,550,446.19	
鹏华基金公司	基金管理费	1,438,181.25	
深圳市建筑设计研究总院有限公司	设计费	1,066,037.74	
国任财产保险股份有限公司	保险费	754,716.98	547,169.81
深圳市会计协会	会费、年费	100,000.00	
深圳人大干部培训中心有限公司	培训费	7,281.55	
深圳市国际招标有限公司	招标代理费		816,956.34
深圳市国贸科技园服务有限公司	物业管理费等		1,448,069.61
深圳市荔园酒店有限公司	会议费、住宿费		359,079.88
深圳银湖会议中心(酒店)有限公司	会议费		58,415.69
深圳大剧院运营管理有限责任公司	场地租赁费		18,867.92
合计		14,520,437.29	3,248,559.25

## (9) 卖出回购交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
南方基金管理股份有限公司	卖出回购利息支出	32,599,484.13	16,811,703.59
华润深国投公司	卖出回购利息支出	3,121,503.01	4,605,953.34
国泰君安证券股份有限公司	卖出回购利息支出	2,534,269.02	4,314,362.94
云南红塔银行股份有限公司	卖出回购利息支出	14,136.99	49,863.01
安信证券股份有限公司	卖出回购利息支出		94,528.77
红塔证券股份有限公司	卖出回购利息支出		23,424.66
合计		38,269,393.15	25,899,836.31

## 2. 关联租赁情况 - 公司承租情况

2022 年度

出租方名称	租赁资产种类	简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额	支付的租金(不包括简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额)	增加的使用权资产	确认的利息支出
华润深国投公司	房屋租赁	2,056,092.71	33,743.55		878.19
深圳市地铁集团有限公司	房屋租赁		806,257.84		83,523.80

2021 年度

出租方名称	租赁资产种类	简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金费用以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额	支付的租金（不包括简化处理的短期租赁和低价值资产租赁的租金以及未纳入租赁负债计量的可变租赁付款额）	增加的使用权资产	确认的利息支出
华润深国投公司	房屋租赁	9,771,516.58	1,256,482.88	1,456,346.62	26,235.09
深圳投控公司	房屋租赁	6,397,777.17			
深圳市地铁集团有限公司	房屋租赁		5,033,915.55		285,851.10
深圳市信息管线有限公司	通信管道租赁	731,126.00			

### 3. 关键管理人员报酬

单位：万元

项目	本期数	上年同期数
关键管理人员报酬	3,972.56	5,608.55
合计	3,972.56	5,608.55

### 4. 其他关联交易

#### (1) 自营交易

单位：万元

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
南方基金管理股份有限公司	自营交易	2,228,831.31	1,440,656.72
华润深国投公司	自营交易	850,559.23	412,330.09
国泰君安证券股份有限公司	自营交易	560,896.03	847,992.43
云南红塔银行股份有限公司	自营交易	34,729.50	
红塔证券股份有限公司	自营交易	16,396.58	75,515.42
安信证券股份有限公司	自营交易		180,108.66
鹏华基金公司	自营交易		47,954.10
合计		3,691,412.65	3,004,557.42

#### (2) 衍生品交易

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	场外期权投资收益 / 公允价值变动损益	11,217,507.23	
国泰君安证券股份有限公司	利率互换投资收益 / 公允价值变动损益	2,261,880.46	
合计		13,479,387.69	

## (3) 债券销售、分销业务

单位：万元

关联方	关联交易内容	本期数	上年同期数
国泰君安证券股份有限公司	本公司分销关联方承销的债券规模	144,000.00	1,034,000.00
国泰君安证券股份有限公司	本公司认购关联方承销的债券规模	31,000.00	59,922.39
南方基金管理股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	168,000.00	174,100.00
华润深国投公司	分销本公司承销的债券规模	135,300.00	192,650.00
国泰君安证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	100,000.00	75,000.00
红塔证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模	9,000.00	
南方基金管理股份有限公司	认购本公司承销的资产支持证券	21,000.00	
华润深国投公司	认购本公司承销的资产支持证券	8,900.00	
南方基金管理股份有限公司	认购本公司发行的债券规模	159,000.00	2,000.00
华润深国投公司	认购本公司发行的债券规模	11,000.00	
国泰君安证券股份有限公司	分销买入关联方承销的债券规模	85,500.00	
深圳市鲲鹏股权投资管理有限公司	本公司认购关联方发行的债券	14,000.00	
安信证券股份有限公司	分销本公司承销的债券规模		18,000.00
深圳市盐田港集团有限公司	认购关联方发行的债券		9,000.00
安信证券股份有限公司	本公司分销关联方承销的债券规模		3,000.00
合计		886,700.00	1,567,672.39

## (4) 持有关联方发行的产品或债券

关联方	期末数 / 本期数			期初数 / 上年同期数		
	份额 / 数量	市值	投资收益 / 公允价值变动损益	份额 / 数量	市值	投资收益 / 公允价值变动损益
南方基金管理股份有限公司	2,471,508,079.20	3,511,360,357.36	1,090,316.76	1,648,924,133.41	2,970,222,928.61	244,402,578.40
鹏华基金公司	1,321,148,924.62	1,467,141,826.37	72,619,665.84	2,961,485,636.95	3,079,813,786.35	47,946,232.88
华润深国投公司						427,892.81
合计	3,792,657,003.82	4,978,502,183.73	73,709,982.60	4,610,409,770.36	6,050,036,714.96	292,776,704.09

## (5) 共同投资

1) 2021年，本公司之子公司国信资本公司与深圳市高新投集团有限公司、深圳市天使投资引导基金管理有限公司、深圳市天使投资引导基金有限公司及其他合伙人共同投资设立深圳市天使一号创业投资合伙企业（有限合伙）（以下简称天使一号直投资基金）。基金组织形式采用有限合伙制，基金总规模为300,000,000.00元，其中深圳市天使投资引导基金管理有限公司（作为普通合伙人和基金管理人）认缴出资3,000,000.00元，深圳市高新投集团有限公司（作为有限合伙人）、国信资本公司（作为有限合伙人）、深圳市天使投资引导基金有限公司（作为有限合伙人）分别认缴出资20,000,000.00元、30,000,000.00元、99,500,000.00元。

截至2022年12月31日，天使一号直投资基金实缴出资总额为240,500,000.00元，其中深圳市天使投资引导基金管理有限公司实缴3,000,000.00元，深圳市高新投集团有限公司实缴20,000,000.00元，国信资本公司实缴30,000,000.00元、

深圳市天使投资引导基金有限公司实缴 49,750,000.00 元。

2) 2022 年, 本公司之子公司国信资本公司与深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)(以下简称国信亿合基金)分别出资 70,000,000.00 元、40,000,000.00 元共同投资爱朵护理(浙江)股份有限公司(以下简称爱朵护理公司)。截至 2022 年 12 月 31 日, 爱朵护理公司注册资本 250,000,000.00 元, 国信资本公司与国信亿合基金持有的股份数分别为 4,108,598.00 股、2,347,636.00 股。

### (三) 关联方应收应付款项

#### 1. 应收关联方款项

项目名称	关联方	期末数		期初数	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	张家港弘盛产业资本母基金合伙企业(有限合伙)	36,215,239.72		29,145,102.74	
应收款项	鹏华基金公司	28,377,916.87		29,828,053.41	
应收款项	深圳市国信亿合新兴产业私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	2,146,542.79		2,146,542.79	
应收款项	南方基金管理股份有限公司	1,280,335.07		6,537,916.60	
应收款项	华润深国投公司	168,417.57		2,002,462.49	
应收款项	深圳市国信弘盛蔡屋围私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	3,747.95			
应收款项	深圳投控公司			9,819,422.32	
应收款项	深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙)			3,550,684.93	
应收款项	深圳市国贸科技园服务有限公司			226,299.42	
小计		68,192,199.97		83,256,484.70	
其他应收款	南方基金管理股份有限公司	500,000.00			
其他应收款	深圳市地铁集团有限公司	283,294.08			
小计		783,294.08			
融出资金	关联自然人			25,820.97	
小计				25,820.97	
合计		68,975,494.05		83,282,305.67	

#### 2. 应付关联方款项

项目名称	关联方	期末数	期初数
卖出回购金融资产	南方基金管理股份有限公司	992,733,622.03	1,623,605,659.32
卖出回购金融资产	华润深国投公司	851,135,194.52	526,803,355.62
卖出回购金融资产	国泰君安证券股份有限公司	796,778,592.58	398,974,038.14
应付款项	深圳市国信众创股权投资基金(有限合伙)	5,773,662.16	
应付款项	鹏华基金公司	597,670.92	
合计		2,647,018,742.21	2,549,383,053.08

## 十二、承诺及或有事项

### (一) 或有事项

截至 2022 年 12 月 31 日，本公司作为被告涉诉金额较大的未决诉讼、未决仲裁如下：

#### 1. 华泽钴镍投资者与华泽钴镍及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2018 年 10 月起，成都华泽钴镍材料股份有限公司（以下简称华泽钴镍）部分投资者分别向成都市中级人民法院（以下简称成都中院）对华泽钴镍及其董事等相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求华泽钴镍赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求华泽钴镍董事等人员及相关中介机构承担连带赔偿责任。成都中院于 2019 年 8 月 1 日起一审开庭审理，公司于 2020 年 1 月起收到部分案件一审判决后提起上诉。四川省高级人民法院（以下简称四川高院）于 2020 年 7 月 7 日对 3 起示范案件二审开庭审理，公司于 2021 年 4 月收到四川高院对 3 起示范案件的二审判决，二审对揭露日等相关认定作出改判，其中，1 起案件判决公司等对华泽钴镍赔付义务 0.33 万元承担连带赔偿责任，2 起案件判决驳回原告诉讼请求。2021 年 12 月 27 日，公司收到最高人民法院驳回 3 名原告再审申请的裁定。依照终审判决的标准，成都中院、四川高院陆续作出 1,737 起生效判决，要求华泽钴镍相关人员、公司等中介机构对华泽钴镍赔付义务合计 12,663.94 万元及诉讼费 231.29 万元承担连带赔偿责任；公司另收到部分案件撤诉裁定。目前有 2 起案件尚未生效，其中：1 起案件（涉诉金额 15,291.92 万元）一审判决驳回原告全部诉讼请求，尚未作出二审判决；1 起案件（涉诉金额 51.68 万元）尚未作出一审判决。另收到 1 起案件原告再审申请（二审判决金额 67.39 万元）。2022 年 3 月起，公司陆续收到成都中院及相关法院对部分案件的执行通知，公司目前已支付合计 12,038.45 万元。

#### 2. 海口农商行与刚泰集团及公司债券交易纠纷案

刚泰集团有限公司（以下简称刚泰集团）公开发行 2016 年公司债券（第二期）（以下简称 16 刚集 02），发行规模为 500,000,000 元，期限为 3 年，附第 2 年末投资者回售选择权，起息日期为 2016 年 11 月 3 日，公司担任主承销商及受托管理人。根据回售实施结果，投资者有效登记的回售金额为 500,000,000 元。2018 年 11 月 3 日，刚泰集团未能按时偿付债券本金和利息，已构成违约。2019 年 1 月，16 刚集 02 投资者海口农村商业银行股份有限公司（以下简称海口农商行）向海南省高级人民法院提起诉讼，要求刚泰集团支付本金、利息、复利及相关费用合计人民币 10,709.95 万元，并要求公司对刚泰集团上述债务承担连带赔偿责任。2022 年 11 月 25 日，本案开庭审理。2023 年 2 月，公司收到海口市中级人民法院《民事裁定书》，准许原告撤回对公司的起诉。

#### 3. 公司与刘某等 2 人基金合同纠纷案

2018 年 6 月，委托人刘某等 2 人与基金管理人北京天和盈泰投资管理有限公司（以下简称天和盈泰）及基金托管人本公司签订了《天和盈泰天山一号私募投资基金合同》，刘某等 2 人出资认购了该基金份额。2019 年 12 月，刘某等 2 人向深圳国际仲裁院提起仲裁，认为其购买的基金份额已到期，但天和盈泰在没有经过投资者书面同意的情况下擅自延长投资者购买份额的基金存续期，要求解除合同及天和盈泰返还本金、利息等合计 2,204 万元，并要求公司承担连带赔偿责任。案件于 2021 年 7 月 9 日开庭，截至目前尚未裁决。

#### 4. 亿阳信通投资者与亿阳信通及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022 年 1 月起，亿阳信通股份有限公司（以下简称亿阳信通）部分投资者分别向北京金融法院、哈尔滨市中级人民法院对亿阳信通及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求亿阳信通赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求亿阳信通相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至目前，公司共收到案件 182 起，

涉诉金额合计 4,305.93 万元。目前案件尚未开庭。

#### 5. 柏堡龙投资者与柏堡龙及公司等证券虚假陈述责任纠纷案

2022 年 6 月起，广东柏堡龙股份有限公司（以下简称柏堡龙）部分投资者分别向广州市中级人民法院对柏堡龙及其相关公司和相关人员、公司等中介机构提起诉讼，要求柏堡龙赔偿因证券虚假陈述造成的投资损失及相关费用，并要求柏堡龙相关公司和相关人员、公司等中介机构承担连带赔偿责任。截至目前，公司共收到案件 71 起，涉诉金额合计 8,353.51 万元。2023 年 3 月 21 日，广州中院对部分案件开庭审理。2023 年 4 月 21 日，公司收到广州中院对 6 起案件的一审判决，认定公司不承担责任。

#### 6. 公司与王某等 8 人、浙江新三板资产管理有限公司基金合同纠纷案

2017 年 2 月，公司为方际六号并购私募股权投资基金提供托管服务。2022 年 10 月，公司收到深圳国际仲裁院案件材料，该产品 8 名投资人为案件申请人，被申请人方为基金管理人浙江新三板资产管理有限公司及基金托管人本公司。申请人认为基金未按约定投资并因基金管理人挪用而实际损失，基金托管人未履行托管人职责，申请仲裁，请求浙江新三板资产管理有限公司及本公司连带赔偿各项损失 1,375.02 万元。目前系列案在仲裁审理过程中，尚未作出裁决。

## 十三、资产负债表日后事项

### （一）资产负债表日后利润分配情况

拟分配的利润或股利	以 2022 年末总股本 9,612,429,377 股为基数，向全体股东每 10 股派送现金红利 2.7 元（含税）
经审议批准宣告发放的利润或股利	尚需提交股东大会审议

### （二）其他资产负债表日后事项说明

序号	日期	事项说明
1	2023 年 1 月 13 日	国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第一期）兑付合计人民币 3,108,000,000.00 元。
2	2023 年 1 月 16 日	国信证券股份有限公司 2023 年度第一期短期融资券发行结束，债券简称 23 国信证券 CP001，实际发行规模 50 亿元人民币，票面利率 2.5%，期限为 123 天。
3	2023 年 1 月 18 日	国信证券股份有限公司 2023 年度第二期短期融资券发行结束，债券简称 23 国信证券 CP002，实际发行规模 15 亿元人民币，票面利率 2.5%，期限为 128 天。
4	2023 年 2 月 7 日	国信证券股份有限公司 2023 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）发行结束，债券简称 23 国证 02，实际发行规模 45 亿元人民币，票面利率 3.22%，期限为 3 年。
5	2023 年 2 月 10 日	国信证券股份有限公司 2022 年度第一期短期融资券兑付合计人民币 3,075,000,000.00 元。
6	2023 年 2 月 21 日	国信证券股份有限公司 2022 年度第四期短期融资券兑付合计人民币 1,537,350,000.00 元。
7	2023 年 3 月 1 日	国信证券股份有限公司 2022 年度第六期短期融资券兑付合计人民币 2,359,340,000.00 元。
8	2023 年 3 月 2 日	国信证券股份有限公司 2020 年非公开发行公司债券（第二期）兑付合计人民币 5,158,500,000.00 元。
9	2023 年 3 月 13 日	国信证券股份有限公司 2023 年度第三期短期融资券发行结束，债券简称 23 国信证券 CP003，实际发行规模 10 亿元人民币，票面利率 2.55%，期限为 88 天。
10	2023 年 3 月 13 日	国信证券股份有限公司 2023 年度第四期短期融资券发行结束，债券简称 23 国信证券 CP004，实际发行规模 40 亿元人民币，票面利率 2.65%，期限为 179 天。

序号	日期	事项说明
11	2023年3月20日	国信证券股份有限公司2023年度第五期短期融资券发行结束，债券简称23国信证券CP005，实际发行规模30亿元人民币，票面利率2.65%，期限为179天。
12	2023年3月24日	国信证券股份有限公司2022年度第十九期短期融资券兑付合计人民币3,018,443,835.62元。
13	2023年3月27日	国信证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）发行结束，债券简称23国证03，实际发行规模25亿元人民币，票面利率2.97%，期限为2年。
14	2023年3月29日	国信证券股份有限公司2023年度第六期短期融资券发行结束，债券简称23国信证券CP006，实际发行规模20亿元人民币，票面利率2.47%，期限为90天。
15	2023年3月29日	国信证券股份有限公司2023年度第七期短期融资券发行结束，债券简称23国信证券CP007，实际发行规模20亿元人民币，票面利率2.73%，期限为365天。
16	2023年4月6日	国信证券股份有限公司2022年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第一期）兑付合计人民币3,077,400,000.00元。
17	2023年4月12日	国信证券股份有限公司2022年度第十期短期融资券兑付合计人民币1,537,800,000.00元。
18	2023年4月17日	国信证券股份有限公司2023年度第八期短期融资券发行结束，债券简称23国信证券CP008，实际发行规模20亿元人民币，票面利率2.56%，期限为179天。
19	2023年4月18日	国信证券股份有限公司2023年度第九期短期融资券发行结束，债券简称23国信证券CP009，实际发行规模25亿元人民币，票面利率2.48%，期限为91天。
20	2023年4月25日	国信证券股份有限公司2022年度第十二期短期融资券兑付合计人民币1,537,050,000.00元。
21	2023年4月28日	国信证券股份有限公司2022年度第十四期短期融资券兑付合计人民币1,536,300,000.00元。
22	2023年4月28日	国信证券股份有限公司2023年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）发行结束，债券简称23国证04，实际发行规模30亿元人民币，票面利率2.99%，期限为3年。

## 十四、其他重要事项

### （一）年金计划

本公司依据相关政策建立了企业年金计划，按照参与企业年金职工当年度工资总额及规定的计提比例确定企业年金缴费总额，并为符合年金方案条件的员工缴纳企业年金。

本公司企业年金计划于2012年12月正式成立。该年金计划受托管理人和账户管理人为泰康养老保险股份有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司，投资管理人为泰康资产管理有限责任公司。

根据本公司与泰康养老保险股份有限公司签订的《企业年金计划受托管理合同》，在合同存续期内，受托人根据法律法规规定制定企业年金基金投资政策。

### （二）分部信息

#### 1. 本公司确定报告分部考虑的因素

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业务分部，划分为5个业务分部：经纪及财富管理业务分部；投资银行业务分部；投资与交易业务分部；资产管理业务分部；其他分部。每个业务分部为单独的业务分部，提供不同的劳务。本公司的管理层定期审阅这些分部的经营成果，以决定向其配置资源。本公司各个业务分部提供的主要服务分别如下：

(1) 财富管理与机构业务分部，主要包括：向个人及机构投资者提供证券经纪、期货经纪、代销金融产品、资产托管、投资咨询、融资融券及其他资本中介等服务。

(2) 投资银行业务分部，主要包括：为机构客户提供包括股票承销保荐、债券承销、并购重组、新三板推荐等金融服务。

(3) 投资与交易业务分部，主要包括：从事权益类、固定收益类、另类投资类、衍生类产品及其他金融产品的交易和做市业务。

(4) 资产管理业务分部，主要包括：根据客户需求开发资产管理产品并提供相关服务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务以及基金管理业务等。

(5) 其他分部，主要包括：以上分部业务之外的其他业务以及公司总部运营。

## 2. 各报告分部利润（亏损）、资产及负债信息

### (1) 2022 年度

项目	财富管理与机构业务	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
1) 营业收入	8,300,348,928.74	1,881,855,680.10	2,746,734,038.64	365,436,789.54	2,581,392,824.83	15,875,768,261.85
手续费及佣金净收入	5,347,909,434.69	1,871,641,268.69		361,313,232.14	-3,604,295.10	7,577,259,640.42
投资收益（损失）			6,777,397,965.21		494,810,235.12	7,272,208,200.33
其他收入	2,952,439,494.05	10,214,411.41	-4,030,663,926.57	4,123,557.40	2,090,186,884.81	1,026,300,421.10
2) 营业支出	4,412,676,808.28	1,231,659,789.16	774,423,234.10	180,533,299.15	3,181,389,748.25	9,780,682,878.94
业务及管理费	4,311,219,771.94	1,218,413,075.26	508,828,999.36	177,947,318.04	1,101,031,522.61	7,317,440,687.21
3) 营业利润	3,887,672,120.46	650,195,890.94	1,972,310,804.54	184,903,490.39	-599,996,923.42	6,095,085,382.91
4) 利润总额	3,981,918,443.24	646,743,173.86	1,971,988,757.76	184,903,490.39	-563,388,600.91	6,222,165,264.34
5) 资产总额	141,910,959,752.19	1,486,653,216.38	242,515,551,899.50	804,218,611.62	7,613,395,451.86	394,330,778,931.55
递延所得税资产						2,848,152,868.05
6) 负债总额	131,955,432,117.83	818,554,049.74	148,643,720,610.84	201,653,009.26	5,826,386,740.91	287,445,746,528.58
递延所得税负债						390,274,752.92
7) 补充信息						
① 折旧与摊销费用	314,361,517.56	46,757,367.18	15,049,734.02	7,317,029.00	233,807,361.17	617,293,008.93
② 资本性支出	131,232,461.77	6,198,498.87	2,939,598.23	3,853,456.46	290,906,362.60	435,130,377.93
③ 信用减值损失	32,071,711.16		225,556,485.63		-6,782,757.55	250,845,439.24
④ 其他资产减值损失					2,191,066.98	2,191,066.98

### (2) 2021 年度

项目	财富管理与机构业务	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
1) 营业收入	10,769,070,008.12	2,066,376,925.27	7,415,919,537.19	541,697,431.80	3,024,973,101.51	23,818,037,003.89
手续费及佣金净收入	7,453,084,295.93	2,065,624,065.84		538,219,075.80	-24,055,828.92	10,032,871,608.65
投资收益（损失）			6,925,239,388.19		510,891,840.34	7,436,131,228.53
其他收入	3,315,985,712.19	752,859.43	490,680,149.00	3,478,356.00	2,538,137,090.09	6,349,034,166.71
2) 营业支出	4,361,596,961.94	1,332,225,410.75	811,474,623.17	251,659,521.03	4,767,189,270.40	11,524,145,787.29
业务及管理费	4,863,867,699.24	1,317,502,333.56	696,816,530.40	248,131,301.55	2,606,146,351.63	9,732,464,216.38

项目	财富管理与机构业务	投资银行	投资与交易	资产管理	其他	合并数
3) 营业利润	6,407,473,046.18	734,151,514.52	6,604,444,914.02	290,037,910.77	-1,742,216,168.89	12,293,891,216.60
4) 利润总额	6,345,260,262.88	1,131,251,876.74	6,604,423,604.85	290,037,910.77	-1,736,481,496.27	12,634,492,158.97
5) 资产总额	156,709,162,072.74	1,522,965,330.44	198,330,096,927.57	293,945,851.07	5,445,272,137.10	362,301,442,318.92
递延所得税资产						2,352,914,477.11
6) 负债总额	150,646,111,984.03	854,777,977.31	107,515,648,556.95	189,578,354.65	6,168,405,994.72	265,374,522,867.66
递延所得税负债						696,692,082.18
7) 补充信息						
① 折旧与摊销费用	247,276,032.92	37,430,123.72	13,321,923.31	3,093,114.46	177,198,819.56	478,320,013.97
② 资本性支出	153,373,527.30	7,724,591.82	3,830,529.75	6,503,479.70	599,708,551.96	771,140,680.53
③ 信用减值损失	-597,456,933.92		75,721,166.93		285,133.03	-521,450,633.96
④ 其他资产减值损失					96,261.07	96,261.07

### (三) 租赁

#### 1. 公司作为承租人

(1) 使用权资产相关信息详见本财务报表附注五（一）15 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财务报表附注三（三十二）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：

项目	本期数	上年同期数
短期租赁费用	7,539,291.63	37,381,631.64
低价值资产租赁费用（短期租赁除外）	2,179,076.36	2,262,154.35
合计	9,718,367.99	39,643,785.99

(3) 与租赁相关的当期损益及现金流

项目	本期数	上年同期数
租赁负债的利息费用	16,037,470.92	20,264,943.98
与租赁相关的总现金流出	185,615,265.09	177,220,827.47

(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财务报表附注九（四）之说明。

#### 2. 公司作为出租人

(1) 经营租赁

##### 1) 租赁收入

项目	本期数	上年同期数
租赁收入	36,634,394.56	32,299,753.35
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

项目	期末数	上年年末数
投资性房地产	279,122,466.32	288,437,302.31
小计	279,122,466.32	288,437,302.31

## 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

剩余期限	期末数	上年年末数
1年以内	36,012,680.97	21,508,134.82
1-2年	29,185,923.52	15,308,884.93
2-3年	24,294,642.63	10,804,111.53
3-4年	16,047,995.51	8,380,196.40
4-5年	11,203,792.80	3,324,332.90
5年以后	19,827,889.00	181,796.40
合计	136,572,924.43	59,507,456.98

## (四) 其他对投资者决策有影响的重要交易和事项

### 1. 出具告慰函

本公司于2021年10月就国信香港公司融资事项向渣打银行（香港）有限公司出具告慰函，本公司确认知渣打银行（香港）有限公司、其关联方（包括总行及分行）（合称银行）现时提供予本公司之一个或多个子公司（子公司）以及将来会提供予子公司的一切融资，且本公司知晓子公司与银行会在现时以及将来进行外汇交易和金融衍生产品交易（交易），本公司确认该等安排符合本公司批准程序，并且鉴于银行提供和/或继续提供前述融资、给与子公司任何信贷或其他融资、或进行和/或继续进行交易或其他交易，本公司向银行保证，不允许子公司在完全清偿其对银行之负债、或履行其对银行之义务之前，进行清算（无论自愿清算或强制清算）或与其债权人达成任何债务重组协议或安排。子公司将作为一项持续经营始终存续。本公司确认，本告慰函将适用于银行今后可能向子公司提供之全新的或额外新增的任何融资或交易。本公司确认，本公司将尽最大努力督促子公司及时偿还其在一切融资和交易项下的债务。本公司亦确认，在未收到银行书面同意或确保子公司对银行之负债完全清偿或确保履行其对银行之义务前，不得处置任何本公司持有的子公司股权以致导致本公司持有的子公司股权减为少数及非控股之股权。本函适用于香港特别行政区法律。

本公司于2015年9月29日就国信香港公司融资事项向大新银行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会大新银行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对大新银行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对大新银行应尽义务的行动，对将影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会大新银行；本公司和国信香港公司将向大新银行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供大新银行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对大新银行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于2020年7月就国信香港公司的融资事项向南洋商业银行有限公司出具了承诺函，主要内容为国信证券继续直接或间接地拥有及持有国信香港的全部股份，并且维持对国信香港的最终管理控制权；就合理认为会影响国信香港持续性经营的情况实时通知银行，并督促国信香港履行还款责任。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于2019年8月就国信香港公司的融资事项向上海银行（香港）出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港100%股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港按照银行的要求及时履行并偿付相关债务。安慰函将一直维持有效，直至国信香港在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效。函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于2020年10月就国信香港公司的融资事项向招商永隆银行有限公司出具了安慰函，主要内容为国信证券继续维持拥有国信香港100%股本权益及控制权，将督促国信香港业务运作正常，将促使并监督国信香港公司按照银行的要求及时履行并偿付相关债务；安慰函将一直维持有效，直至国信香港公司在该额度内的债务全部还清之日或完全偿付在银行的所有债务之日（以较后发生者为准）失效；函件内容不构成对授信额度的偿还及/或担保的责任。

本公司于2022年7月就国信香港公司融资事项向浙商银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信香港公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会浙商银行香港分行；本公司将关注国信香港公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对浙商银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信香港公司无法经营或无法履行对浙商银行香港分行应尽义务的行动，将对影响国信香港公司持续经营的情况，本公司将知会浙商银行香港分行；本公司和国信香港公司将向浙商银行香港分行提供经审计的财务报表，国信香港公司还将在合理情况下提供浙商银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信香港公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信香港公司履行对浙商银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

本公司于2022年3月就国信证券（香港）经纪有限公司融资事项向中国信托商业银行香港分行出具安慰函，本公司声明并确认：本公司将维持对国信证券（香港）经纪有限公司100%的控股，如控股权情况发生重大变动，将知会中国信托商业银行香港分行；本公司将关注国信证券（香港）经纪有限公司持续合规经营、充分偿付能力，履行对中国信托商业银行香港分行应尽的义务；本公司将不采取令国信证券（香港）经纪有限公司无法经营或无法履行对中国信托商业银行香港分行应尽义务的行动，将对影响国信证券（香港）经纪有限公司持续经营的情况，本公司将知会中国信托商业银行香港分行；本公司和国信证券（香港）经纪有限公司将向中国信托商业银行香港分行提供经审计的财务报表，国信证券（香港）经纪有限公司还将在合理情况下提供中国信托商业银行香港分行所要求的其它财务资料；本公司将对国信证券（香港）经纪有限公司经营进行检查并将尽力提供支持和协助，以使国信证券（香港）经纪有限公司履行对中国信托商业银行香港分行的应尽义务；此安慰函并不对本公司构成担保责任和义务。

## 2. 国信香港公司为全资子公司提供担保

截至2022年12月31日，国信香港公司为其全资子公司的常规业务提供的担保金额计港币20,000万元。

## 3. 债券借贷

本公司借入债券的类别及公允价值具体如下：

债券类别	期末公允价值	期初公允价值
国债	13,245,537,200.00	9,978,653,220.00
地方政府债	2,453,548,870.00	4,049,963,210.00
金融债	4,148,808,940.00	
合计	19,847,895,010.00	14,028,616,430.00

注：本公司通过借入方式取得的债券为卖出回购业务而设定质押的期末公允价值计人民币12,819,532,720元，用于期货业务充抵保证金而设定质押的期末公允价值计人民币6,312,694,720元，用于出售的期末公允价值计人民币703,343,959.76元

## 十五、其他补充资料

### (一) 非经常性损益

项 目	金 额	说 明
非流动性资产处置损益，包括已计提资产减值准备的冲销部分	2,098,437.35	
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助（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）	114,207,248.16	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	54,297,809.73	
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益		
单独进行减值测试的应收款项、合同资产减值准备转回	14,523,160.43	
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-7,581,479.21	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
小 计	177,545,176.46	
减：企业所得税影响数（所得税减少以“-”表示）	41,433,710.63	
少数股东权益影响额（税后）		
归属于母公司所有者的非经常性损益净额	136,111,465.83	

### (二) 净资产收益率及每股收益

报告期利润	加权平均净资产收益率（%）	每股收益（元 / 股）	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	6.50	0.52	0.52
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	6.32	0.51	0.51

11

证券公司  
信息披露



## 一、报告期内公司重大行政许可事项的相关情况

序号	发文日期	批复文件	文号
1	2022年6月7日	中国证监会《关于同意国信证券股份有限公司向专业投资者公开发行永续次级公司债券注册的批复》	证监许可[2022]1181号
2	2022年6月10日	中国证监会《关于同意国信证券股份有限公司向专业投资者公开发行公司债券注册的批复》	证监许可[2022]1207号
3	2022年9月15日	中国证监会《关于核准国信证券股份有限公司上市证券做市交易业务资格的批复》	证监许可[2022]2174号

国信证券股份有限公司

法定代表人：张纳沙

董事会批准报送日期：2023年4月28日