



东海证券

NEEQ : 832970

东海证券股份有限公司



年度报告

— 2020 —

公司年度大事记



2021年2月18日，东海证券在2020年度常州市“提质增效、创新争星”活动中荣获“现代服务业星级企业-五星企业”、“重大贡献奖”和“纳税百强企业奖”。



2020年4月，中国扶贫基金会向东海证券授予2019年作出突出贡献奖。



2020年12月3日，东海证券被香港交易所评为“港股通投资者教育模范券商”。

2020年1月2日，东海证券获得中央国债登记结算有限责任公司颁发的“中债绿色债券指数样本券优秀承销机构”。

2020年1月2日，全国银行间同业拆借中心公布了2019年度银行间本币市场评优结果，东海证券获得全国银行间同业拆借中心颁发的“2019年度银行间本币市场优秀债券市场交易商”、“2019年度银行间本币市场核心交易商”、“2019年度银行间本币市场交易机制创新奖：X-Bond”、“2019年度银行间本币市场市场创新奖”和“2019年度银行间本币市场自动化交易创新奖”。

2020年6月24日，东海证券投教基地在2019-2020年度全国证券期货投教基地考核中获“优秀”评级。

2020年11月23日，东海证券荣获江苏省证券业协会颁发的2020年度投资者教育先进单位。

2020年12月17日，在“国家开发银行2020年金融债承销做市获奖机构”评选中，东海证券获得“银行间市场优秀做市商”称号。

目 录

第一节	重要提示、目录和释义	4
第二节	公司概况	6
第三节	会计数据和财务指标	15
第四节	管理层讨论与分析	20
第五节	重大事件	43
第六节	股份变动、融资和利润分配	52
第七节	董事、监事、高级管理人员及核心员工情况	63
第八节	行业信息	76
第九节	公司治理、内部控制和投资者保护	77
第十节	财务会计报告	89
第十一节	备查文件目录	238

第一节 重要提示、目录和释义

【声明】

公司控股股东、实际控制人、董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

公司负责人钱俊文、主管会计工作负责人郭晋炜及会计机构负责人（会计主管人员）郭晋炜保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）对公司出具了标准无保留意见的审计报告。

本年度报告涉及未来计划等前瞻性陈述，不构成公司对投资者的实质承诺，投资者及相关人士均应对此保持足够的风险认识，并且应当理解计划、预测与承诺之间的差异。

事项	是或否
是否存在控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员对年度报告内容存在异议或无法保证其真实、准确、完整	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在未出席董事会审议年度报告的董事	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
是否存在未按要求披露的事项	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

【重大风险提示表】

重大风险事项名称	重大风险事项描述及分析
1、合规风险	因公司经营管理或工作人员的执业行为违反法律、法规或准则而使公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。
2、市场风险	因市场价格、价差变化或其他市场因子变化对公司资产、负债或收入可能产生不利影响或损失的风险。
3、流动性风险	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。
4、信用风险	由于债券发行人、交易对手、债务人违约或信用评级、履约能力下降，给公司带来损失的风险。
5、操作风险	由于不完善的流程、人员、信息系统和外部事件因素给公司造成损失的风险。
6、声誉风险	因公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方对公司负面评价的风险。
本期重大风险是否发生重大变化：	本期重大风险未发生重大变化

是否存在被调出创新层的风险

是 否

释义

释义项目		释义
《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	《东海证券股份有限公司章程》
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
股转系统	指	全国中小企业股份转让系统
江苏证监局	指	中国证券监督管理委员会江苏监管局
东海证券、公司、本公司、母公司	指	东海证券股份有限公司
东证有限	指	东海证券有限责任公司
东海期货	指	东海期货有限责任公司，公司一级子公司
东海投资	指	东海投资有限责任公司，公司一级子公司
东海创新投	指	东海证券创新产品投资有限公司，公司一级子公司
东海资本	指	东海资本管理有限公司，公司二级子公司
东海基金	指	东海基金管理有限责任公司
东吴证券	指	东吴证券股份有限公司
常投集团	指	常州投资集团有限公司
山金金控	指	山金金控资本管理有限公司
山南华闻	指	山南华闻创业投资有限公司
总裁、执行委员会主任（总裁）	指	《证券公司治理准则》对高级管理人员定义中的总经理
副总裁、执行委员会委员	指	《证券公司治理准则》对高级管理人员定义中的副总经理
报告期、本期	指	2020 年度
元、万元、亿元	指	人民币元、人民币万元、人民币亿元

第二节 公司概况

一、 基本信息

公司中文全称	东海证券股份有限公司
中文名称缩写	东海证券
英文名称及缩写	DONGHAI SECURITIES CO., LTD. DONGHAI SECURITIES
证券简称	东海证券
证券代码	832970
法定代表人	钱俊文
执行委员会主任（总裁）	殷建华

二、 联系方式

董事会秘书姓名	杨茂智
是否具备全国股转系统董事会秘书任职资格	是
联系地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层
电话	0519-81595100
传真	021-50498876
电子邮箱	dhzqmb@longone.com.cn
公司网址	www.longone.com.cn
办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层
邮政编码	213003
公司指定信息披露平台的网址	www.neeq.com.cn
公司年度报告备置地	东海证券股份有限公司董事会办公室

三、 企业信息

股票交易场所	全国中小企业股份转让系统
成立时间	1993 年 1 月 16 日
挂牌时间	2015 年 7 月 27 日
分层情况	基础层
行业（挂牌公司管理型行业分类）	金融业(J)-资本市场服务(J67)-证券市场服务(J671)-证券经纪交易服务(J6712)
主要产品与服务项目	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；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。
普通股股票交易方式	<input type="checkbox"/> 连续竞价交易 <input checked="" type="checkbox"/> 集合竞价交易 <input type="checkbox"/> 做市交易
普通股总股本（股）	1,670,000,000
优先股总股本（股）	0

净资本（元）	7,600,360,327.39
控股股东	常州投资集团有限公司
实际控制人及其一致行动人	实际控制人为常州投资集团有限公司，无一致行动人

四、注册情况

项目	内容	报告期内是否变更
统一社会信用代码	91320400137180719N	否
注册地址	常州市 延陵西路 23 号投资广场 18 层	否
注册资本（元）	1,670,000,000	否

五、中介机构

主办券商（报告期内）	东吴证券	
主办券商办公地址	江苏省苏州工业园区星阳街 5 号	
报告期内主办券商是否发生变化	否	
主办券商（报告披露日）	东吴证券	
会计师事务所	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）	
签字注册会计师姓名及连续签字年限	丁启新	户永红
	3 年	1 年
会计师事务所办公地址	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼	

六、报告期后更新情况

适用 不适用

七、公司经营范围和单项业务资格

适用 不适用

（一）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；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。

（二）单项业务资格情况

- 1、2003 年 3 月 14 日，经中国证监会核准为比照综合类证券公司（证监机构字[2003]65 号）；
- 2、2003 年 9 月 27 日，中国证监会核准公司网上证券委托业务资格（证监信息字[2003]2 号）；
- 3、2004 年 3 月 5 日，中国证监会核准公司股票主承销商业资格（证监机构字[2004]24 号）；
- 4、2004 年 9 月 14 日，中国证监会核准公司开放式证券投资基金代销业务资格（证监基金字[2004]136 号）；
- 5、2004 年 11 月 15 日，中国人民银行批准公司全国银行间同业拆借市场成员资格（银复[2004]75 号）；
- 6、2005 年 3 月，中国证券业协会从事相关创新活动证券公司评审委员会第四次会议评审通过了公司的创新试点申请；

- 7、2005年7月29日，中国证监会核准公司客户资产管理业务资格（证监机构字[2005]77号）；
- 8、2005年9月27日，中国人民银行核准公司从事短期融资券承销业务资格（银发[2005]265号）；
- 9、2006年5月29日，中国证券业协会授予公司从事代办股份转让主办券商业务资格（中证协函[2006]157号）；
- 10、2008年1月2日，获得中国人民银行远期利率协定交易备案资格；
- 11、2008年3月4日，获得中国人民银行利率互换业务备案资格；
- 12、2008年4月1日，中国证监会核准公司为期货公司提供中间介绍业务资格（证监许可[2008]480号）；
- 13、2009年2月9日，江苏证监局核准公司开展定向资产管理业务（苏证监函[2009]20号）；
- 14、2009年9月4日，中国证监会核准公司开展直接投资业务试点（机构部部函[2009]401号）；
- 15、2011年5月31日，江苏证监局核准公司开展客户资金第三方存管下单客户多银行服务（苏证监函[2011]216号）；
- 16、2012年11月1日，江苏证监局核准公司自营业务参与利率互换交易（苏证监函[2012]489号）；
- 17、2012年11月7日，江苏证监局核准公司变更公司章程重要条款，公司可依法成立全资子公司开展证券公司证券自营投资品种清单以外的金融产品投资业务（苏证监机构字[2012]525号）；
- 18、2012年11月15日，中国证券业协会同意公司开展中小企业私募债券承销业务试点（中证协函[2012]737号）；
- 19、2013年2月2日，深圳证券交易所同意公司开通约定购回式证券交易权限（深证会字[2013]21号）；
- 20、2013年2月28日，上海证券交易所确认公司约定购回式证券交易权限（上证会字[2013]24号）；
- 21、2013年3月15日，中国证监会核准公司融资融券业务资格（证监许可[2013]252号）；
- 22、2013年3月21日，获得全国股份转让系统主办券商资格（颁发单位：全国中小企业股份转让系统有限责任公司）；
- 23、2013年3月22日，江苏证监局核准公司增加代销金融产品业务资格（苏证监机构字[2013]98号）；
- 24、2013年7月15日，中国证监会同意公司开展客户证券资金消费支付服务试点（机构部部函[2013]490号）；
- 25、2013年8月2日，上海证券交易所确认公司股票质押式回购业务交易权限（上证会字[2013]128号）；
- 26、2013年8月9日，深圳证券交易所同意公司开通股票质押式回购交易权限（深证会字[2013]73号）；
- 27、2013年8月9日，中国证监会换发《中华人民共和国经营证券业务许可证》（编号：Z23432000）；
- 28、2013年9月，中国证券监督管理委员会对公司国债期货业务进行备案；
- 29、2013年11月19日，国家外汇管理局换发《中华人民共和国证券业务外汇经营许可证》（编号：SC201329）；
- 30、2014年1月22日，获准与互联网公司合作开展开放式证券投资基金销售（机构部部函[2014]91号）；
- 31、2014年2月26日，中国证券业协会对公司收益互换业务进行备案（中证协函[2014]76号）；
- 32、2014年2月，获得受托管理保险资金业务资格（颁发单位：中国保险监督管理委员会）；
- 33、2014年4月2日，中国人民银行上海总部同意公司在全国银行间同业拆借市场变更名称及限额调整（银总部函[2014]19号）；
- 34、2014年4月24日，中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心对公司银行间债券市场尝试做市机构进行备案；
- 35、2014年7月2日，获准主办券商业务-做市业务（股转系统函【2014】774号）；

- 36、2014年10月10日，获得港股通业务交易权限（上证函[2014]584号）；
- 37、2014年11月1日，成为首批参与港股通业务证券公司（中投信[2014]1号）；
- 38、2014年11月29日，中国证券金融股份有限公司同意公司办理转融资业务（中证金函[2014]354号）；
- 39、2015年1月13日，获准开展私募基金综合托管业务（证保函[2015]20号）；
- 40、2015年1月16日，获得期权结算业务资格（中国结算函字[2015]12号）；
- 41、2015年1月20日，获准成为上海证券交易所股票期权交易参与者（上证函[2015]104号）；
- 42、2015年1月26日，获准开通股票期权自营交易权限（上证函[2015]165号）；
- 43、2015年4月22日，获准成为网上开户创新方案试点（中国结算办字[2015]324号）；
- 44、2015年5月28日，银行间市场清算所股份有限公司对公司标准债券远期业务进行备案（清算所会员准字【2015】125号）；
- 45、2016年8月24日，中国证监会换发《经营证券期货业务许可证》（统一社会信用代码：91320400137180719N）；
- 46、2016年11月7日，获得首批深港通下港股通业务资格（深圳会[2016]335号）；
- 47、2016年12月26日，获准开通转融券业务资格（中证金函[2016]234号）；
- 48、2017年1月17日，获准开通深圳证券交易所转融通证券出借交易权限；
- 49、2017年1月20日，获准开通上海证券交易所转融通证券出借交易权限（上证函[2017]94号）；
- 50、2017年，获得军工涉密业务咨询服务安全保密条件备案证书（颁发单位：国家国防科技工业局）；
- 51、2018年5月11日，中国银行间市场交易商协会对公司信用风险缓释工具业务资格进行备案；
- 52、2019年，中国银行间市场交易商协会对公司非金融企业债务融资工具分销业务进行备案；
- 53、2018年8月30日，加入“上海市智能制造产业会”，成为理事单位；
- 54、2019年2月14日，成为上交所ETF一般做市商资格（上证函【2019】230号）；
- 55、2019年7月3日，成为“债券通”报价机构（颁布单位：中国银行间市场交易商协会和中国外汇交易中心）；
- 56、2019年8月19日，人民银行征信系统个人及企业征信数据报送资格（股票质押式回购交易业务）（颁布单位：中国人民银行江苏省分中心）；
- 57、2020年3月13日，获批为首批利率期权入市机构（颁布单位：中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心）；
- 58、2020年8月5日，获得发行短期融资券业务资格（机构部函【2020】2098号）；
- 59、2020年8月10日，获得创业板转融券业务资格（中证金函[2020]145号）。

八、 公司历史沿革

√适用 □不适用

东海证券股份有限公司的前身为常州市证券公司，系经中国人民银行银复[1992]362号文批准，于1993年1月16日成立，成立时注册资本为人民币3,000万元。

1998年，经中国证监会证监机字[1998]36号文批准，原常州市证券公司注册资本增加至8,000万元，同时更名为“常州证券有限责任公司”。

2003年，经中国证监会证监机构字[2003]65号文批准，原常州证券有限责任公司注册资本从8,000万元增至101,000万元，同时更名为“东海证券有限责任公司”，并于2003年5月19日完成了工商变更登记。

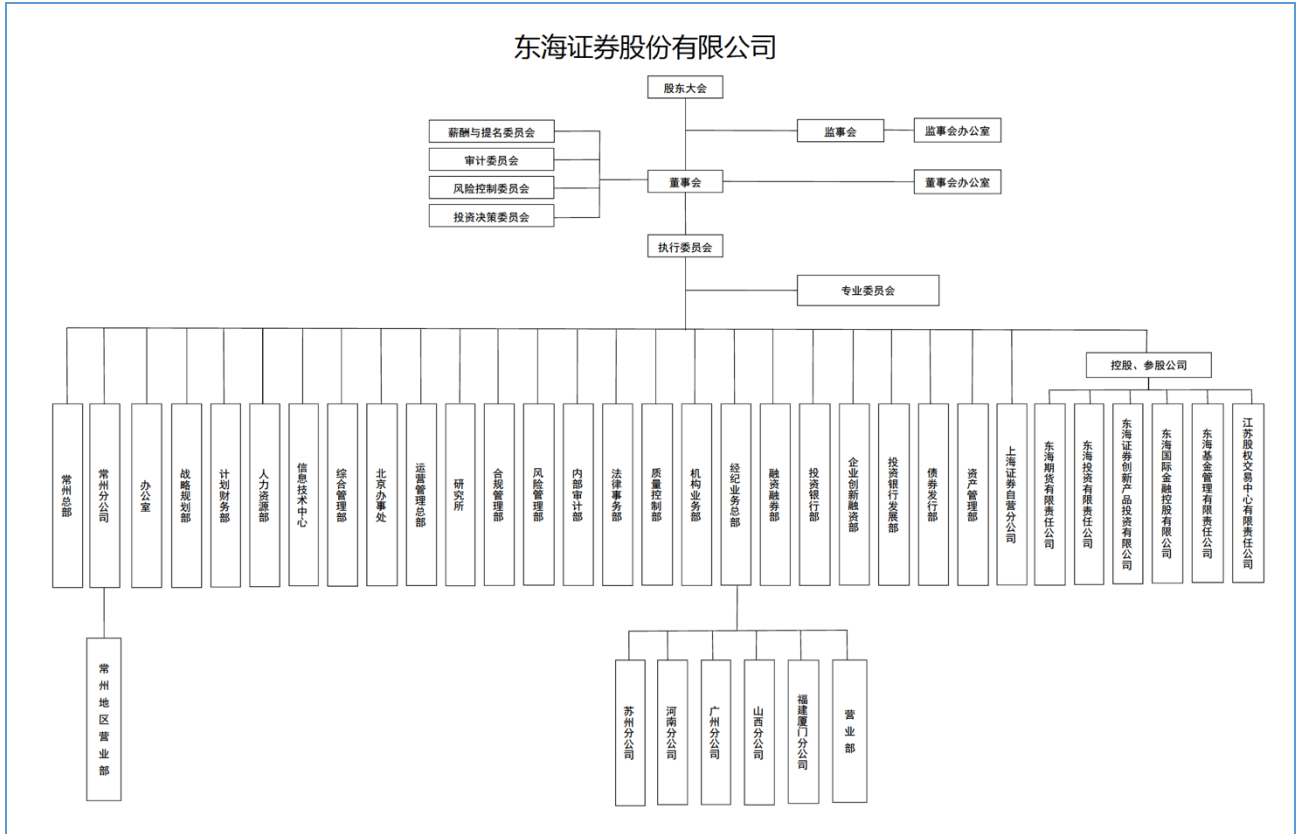
2008年，经中国证监会证监许可[2008]866号文批准，公司注册资本由101,000万元变更为167,000万元，并于2008年9月12日完成了工商变更登记。

2013年，经中国证监会证监许可[2013]622号文批准，公司变更为股份有限公司，更名为“东海证

券股份有限公司”，注册资本为 167,000 万元，并于 2013 年 7 月 10 日完成了工商变更登记。
2015 年，经股转系统函[2015]3636 号文批准，公司在全国中小企业股份转让系统挂牌。

九、 公司组织结构

√适用 □不适用



十、 公司证券营业部数量和分布情况

√适用 □不适用

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共拥有 70 家证券营业部，分布在全国 20 个省（直辖市/自治区），其中，江苏 22 家，河南 12 家，上海 7 家，福建、浙江各 4 家、湖南 3 家，广东、北京、辽宁、山东各 2 家、吉林、安徽、天津、湖北、重庆、陕西、山西、广西、贵州、云南等各 1 家。

序号	营业部	负责人	营业地址	工商登记时间
1	常州博爱路证券营业部	姜准	江苏省常州市博爱路 129 号	2008/8/2
2	常州劳动西路证券营业部	陶陶	江苏省常州市劳动西路 3 号	2000/8/2
3	常州通江中路证券营业部	朱飏	江苏省常州市新北区通江中路 88 号万达广场 5 号楼 8 楼 801-806、814-824 室	1994/4/6
4	常州延陵中路证券营业部	蒋琤	江苏省常州市延陵中路 498 号	2000/8/2
5	溧阳南大街证券营业部	王晶	江苏省溧阳市溧城镇南大街 12 号	1994/12/8
6	溧阳育华路证券营业部	黄鹏	江苏省溧阳市溧城镇育华路 40 号	2015/2/11
7	上海长宁区水城南路证券营业部	任勇钟	上海市水城南路 27-33 号二层 B 室	1998/11/11
8	深圳深南大道证券营业部	刘建英	深圳市福田区深南大道 2003 号岗厦华嵘大厦 8 楼	1995/6/5

9	北京西三环北路证券营业部	高航	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 9 层 4-902, 903, 904, 905, 906	2004/8/11
10	长沙韶山北路证券营业部	罗东术	湖南省长沙市韶山北路 139 号湖南文化大厦主楼 11 层	2005/7/5
11	长沙岳麓大道证券营业部	汤剑	长沙市岳麓区岳麓大道 57 号奥克斯广场 3 栋 18 楼 18028 号	2014/4/10
12	青岛香港中路证券营业部	薛松林	青岛市市南区香港中路 77 号香岛大厦 6 楼	2006/1/17
13	南京洪武北路证券营业部	张维	江苏省南京市玄武区洪武北路 16 号 1203 室	2006/5/8
14	昆山白马泾路证券营业部	王荣彪	江苏省苏州市昆山玉山镇白马泾路 52 号楼 1611 室	2014/4/2
15	苏州吴江中山南路证券营业部	曹妍	江苏省苏州市吴江区松陵镇中山南路 1729 号上领大厦 610 室	2014/4/1
16	常熟海虞北路证券营业部	陆晓丹	江苏省常熟市海虞北路 33 号裕坤美城大厦 904	2014/3/31
17	重庆新华路证券营业部	陈堂	重庆市渝中区新华路 222 号十层 3 号	2007/8/7
18	洛阳周山路证券营业部	宁书峰	河南省洛阳市涧西区周山路 12 号上元国际大厦一至三层	2006/4/5
19	洛阳九都东路证券营业部	王婴	洛阳市老城区九都东路 321 号曼哈顿广场 1#楼 4 楼	2006/4/5
20	洛阳凯旋西路证券营业部	张炜	河南省洛阳市西工区凯旋西路 19 号	2006/4/5
21	洛宁永宁大道证券营业部	王亚	河南省洛阳市洛宁县永宁大道北侧紫竹大厦 1 楼	2017/7/7
22	洛阳河阳路证券营业部	张国威	河南省洛阳市吉利区河阳路 479 号	2006/4/5
23	洛阳青岛路证券营业部	贾晓浩	河南省洛阳市涧西区青岛路 29 号	2006/4/5
24	上海浦东新区苗圃路证券营业部	李董明	中国(上海)自由贸易试验区苗圃路 63 号 2 层 202 室	2006/6/10
25	上海虹口区中山北一路证券营业部	范皓光	上海市虹口区中山北一路 121 号 B8-1006、1012、1013、1017、1018、1020-1023、1025-1027	2008/7/29
26	焦作建设西路证券营业部	林召	河南省焦作市解放区建设西路 148 号物贸大厦	2008/7/23
27	北京安苑北里证券营业部	李婷	北京朝阳区安苑北里 25 号长白山国际酒店内三层	2007/2/15
28	天津友谊路证券营业部	魏国强	天津市河西区友谊路与黑牛城道交口西北侧友谊大厦 3-902、903 室	2007/7/20
29	武汉云彩路证券营业部	苏琳芳	武汉市江江区王家墩地区原空军汉口机场内泛海城市广场一期 15 层 1、2 室	2007/7/10
30	上海静安区新闻路证券营业部	陈宏发	上海市静安区新闻路 1418 号 6 幢 301 室	2007/5/24
31	上海长宁区长顺路证券营业部	孙树芳	上海市长宁区长顺路 11 号 1 幢一层门厅 1、101、102、106 室。	2007/5/23
32	长春前进大街证券营业部	何艳华	吉林省长春市高新区前进大街 1889 号欢乐城写字间 12 层 1202 室	2008/3/31
33	焦作塔南路证券营业部	杜萍	河南省焦作市山阳区塔南路 918 号石化小区 5#商住楼下 1496 号	2010/1/13
34	栾川君山中路证券营业部	才智	河南省洛阳市栾川县君山中路 47 号	2006/4/9
35	偃师商都路证券营业部	顾飞	河南省偃师市槐新街道办事处商都路北侧(全民健身中心 1 幢 202 室)	2006/4/26
36	洛阳展览路证券营业部	徐萌	河南省洛阳市洛龙区展览路 211 号 1 幢 102 泉舜豪	2006/5/26

			生国际商务中心 2 楼 202 号铺	
37	杭州大关路证券营业部	陈学	浙江省杭州市拱墅区绿地运河商务中心 10 幢 405 室	2008/11/7
38	泉州丰泽街证券营业部	林琼虹	福建省泉州市丰泽街 560 号保险大厦十四层	2009/6/2
39	金坛二环东路证券营业部	张旭	江苏省常州市金坛区东环二路 168 号	2010/4/14
40	郴州五岭大道证券营业部	曹晟	湖南省郴州市北湖区五岭大道 1 号林邑财富中心五楼	2010/4/19
41	靖江江平路证券营业部	黄燕	江苏省靖江市江平路 258 号天伦商务大厦西侧 D-B 轴与 1-4 轴	2010/4/16
42	杭州紫霞街证券营业部	曹科峰	浙江省杭州市西湖区蒋村街道紫霞街 155 号西溪诚品商务中心六号楼裙楼 116 室	2010/4/13
43	郑州经七路证券营业部	孙辉	河南省郑州市金水区经七路 50 号海通大厦三楼	2006/5/25
44	徐州建国东路证券营业部	张卫国	江苏省徐州市云龙区建国东路 111 号 16 层	2010/9/2
45	盐城迎宾南路证券营业部	孙余民	盐城市城南新区黄海街道迎宾南路 188 号 1 幢 1001 室 (CNH)	2010/9/7
46	厦门祥福路证券营业部	李春明	厦门市翔安区祥福路祥福五里 20 号	2010/9/27
47	珠海吉大路证券营业部	曲晶辉	广东省珠海市吉大路 63 号一层商场	2010/9/13
48	扬州文汇东路证券营业部	李敬东	江苏省扬州市文汇东路 180 号	2011/12/15
49	无锡钟书路证券营业部	吴鹏	江苏省无锡市梁溪区钟书路 99 号无锡国金中心 905 室	2011/4/28
50	大连黄浦路证券营业部	才德	辽宁省大连高新技术产业园区黄浦路 537 号 06 层 04 号	2011/12/9
51	常州延政中路证券营业部	张琦	江苏省常州市武进区湖塘镇延政中路 5 号-3B01	2011/4/29
52	常州延陵东路证券营业部	林彬	江苏省常州市戚墅堰区延陵东路 184 号	2011/12/2
53	晋中中都北路证券营业部	郑建峰	山西省晋中市榆次区中都北路 12 号	2012/7/10
54	泰州东风路证券营业部	贾斌	江苏省泰州市医药高新区东风路 289 号	2019/4/16
55	南宁东葛路证券营业部	张林刚	南宁市青秀区东葛路 118 号万达广场东 6 栋 151 号	2012/7/19
56	如皋中山东路证券营业部	沙晨	如皋市如城镇中山东路浅水湾 31-104、31-105 号	2012/7/3
57	西安科技路证券营业部	刘新华	西安市高新区科技路海星城市广场 A 座 11512 室、11513 室、11514 室	2014/1/13
58	江阴香山路证券营业部	陆克曼	江阴市香山路 29 号	2014/4/30
59	沈阳青年大街证券营业部	李彤	辽宁省沈阳市和平区青年大街 390 号(1701、1725)	2014/5/13
60	宁波达升路证券营业部	王合	宁波市江东区达升路 7 号 010 幢 (1-2)	2014/5/7
61	贵阳延安东路证券营业部	李志	贵州省贵阳市云岩区延安东路 1 号邮政大厦 8 楼	2014/6/11
62	福清清昌大道证券营业部	杨小忠	福建省福州市福清市音西街道清昌大道福清万达广场 A1 号楼 20 层 2003 室、2005 室	2015/4/3
63	昆明东风东路证券营业部	杨欣婷	云南省昆明市盘龙区东风东路 47 号	2016/1/7
64	临沂金雀山路证券营业部	张同安	山东省临沂市兰山区金雀山路开元上城国际 B 座 1 层 106 室	2017/8/22
65	合肥濉溪路证券营业部	赵文	安徽省合肥市庐阳区濉溪路 287 号金鼎广场 2-1806 室	2017/8/14
66	淮安深圳路证券营业部	张宏建	淮安市经济技术开发区深圳路 1-1 号 1 幢 111	2017/7/13
67	上海松江区新松江路证券营	童彬	上海市松江区新松江路 1234 号 409 室	2017/7/14

	业部			
68	杭州金城路证券营业部	金小东	杭州市萧山区北干街道华瑞汇金中心 1106 室	2017/7/26
69	上海杨浦区杨树浦路证券营业部	王丕达	上海市杨浦区杨树浦路 1062 号 505 室	2017/9/13
70	福州营迹路证券营业部	郑子健	福州市鼓楼区鼓东街道营迹路 69 号恒力创富中心 14 层 27、28、29、30、31 商务办公	2017/12/1

十一、 自愿披露

√适用 □不适用

(一) 下属分公司

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共拥有 7 家分公司，分布在全国 6 个省份及地区：上海 1 家，江苏 2 家，河南、广东、福建、山西等各 1 家。公司下属分公司情况如下表：

名称	地址	工商登记时间	营运资本 (万元)	负责人	联系电话
东海证券股份有限公司上海证券自营分公司	上海市东方路 1928 号 901 室	2009 年 7 月 1 日	10000	汪劲松	021-20333772
东海证券股份有限公司河南分公司	郑州市金水区经七路 50 号海通大厦三楼	2013 年 9 月 29 日	500	孔祥宇	0371-68103997
东海证券股份有限公司常州分公司	常州市新北区通江中路 88 号万达广场 5 号楼 8 楼	2013 年 10 月 29 日	-	陈颖	0519-86634002
东海证券股份有限公司广州分公司	广州市天河区珠江东路 16 号 4101 房之自编 03B、04A 单元	2014 年 1 月 9 日	2000	杨星洲	020-22198200
东海证券股份有限公司苏州分公司	苏州工业园区苏州大道西 2 号国际大厦 709、710B、1909、1910 单元	2013 年 10 月 15 日	500	章戩	0512-62881606
东海证券股份有限公司福建厦门分公司	福建省厦门市思明区厦禾路 189 号 3306、3307 室	2014 年 4 月 9 日	-	马超	0592-3187996
东海证券股份有限公司山西分公司	山西省太原市小店区亲贤北街 38 号中国工商银行三营盘支行二层东办公区	2014 年 5 月 12 日	-	王先	0351-7180709

(二) 主要控股、参股公司

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共拥有 6 家主要控股、参股公司，分布在全国 3 个省份及地区：上海 3 家，江苏 2 家，香港特别行政区 1 家。主要控股、参股公司情况如下表：

名称	地址	工商登记时间	注册资本	法定代表人	联系电话	持股比例
东海期货有限责任公司	江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号	1995 年 2 月 25 日	5 亿元	陈太康	0519-88115814	60%
东海投资有限责任公司	上海市浦东新区东方路 1928 号 306 室	2009 年 11 月 27 日	6 亿元	冯文敏	021-20333679	100%
东海证券创新产品投资有限公司	中国（上海）自由贸易试验区北张家浜路 128 号 203-C	2012 年 12 月 17 日	8 亿元	翟志坚（注 1）	021-20333463	100%

东海国际金融控股有限公司	香港中环皇后大道中12号上海商业银行大厦20楼	2015年8月11日	10亿元港币	韩雨(注2)	85231806000	100%
东海基金管理有限责任公司	上海市虹口区丰镇路806号3幢360室	2013年2月25日	1.5亿元	赵俊	021-60586900	45%
江苏股权交易中心有限责任公司	南京市庐山路188号11层	2013年7月4日	2亿元	李筠(注3)	025-89620288	12%

注:

- 1、2021年4月,东海证券创新产品投资有限公司法定代表人变更为许让磊,目前尚在办理工商变更登记中。
- 2、在香港注册的公司没有法定代表人,报告期末,韩雨为东海国际金融控股有限公司行政总裁。
- 3、2021年3月,江苏股权交易中心有限责任公司法定代表人由李筠变更为孙含林。

第三节 会计数据和财务指标

一、 盈利能力

单位：元

	本期	上年同期	增减比例%
营业收入	2,269,334,464.02	1,641,699,281.58	38.23%
利润总额	718,484,425.98	218,778,493.48	228.41%
归属于挂牌公司股东的净利润	438,947,347.47	49,416,556.04	788.26%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	424,454,766.61	23,611,699.33	1,697.65%
其他综合收益	19,044,015.27	32,917,717.18	-42.15%
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的净利润计算）	5.17%	0.60%	-
加权平均净资产收益率%（依据归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算）	5.00%	0.29%	-
基本每股收益（元/股）	0.263	0.030	776.67%
经营活动产生的现金流量净额	2,845,806,047.63	4,888,975,079.78	-41.79%

二、 偿债能力

单位：元

	本期期末	上年期末	增减比例%
资产总计	42,323,477,230.65	37,339,799,706.72	13.35%
负债总计	33,346,893,148.67	28,795,907,592.26	15.80%
归属于挂牌公司股东的净资产	8,697,767,546.28	8,272,693,900.72	5.14%
归属于挂牌公司股东的每股净资产	5.21	4.95	5.25%
资产负债率%（母公司）	65.08%	55.46%	-
资产负债率%（合并）	68.39%	67.34%	-
流动比率	2.27	3.10	-
利息保障倍数	2.22	1.32	-

三、 成长情况

	本期	上年同期	增减比例%
总资产增长率%	13.35%	5.90%	-
营业收入增长率%	38.23%	10.01%	-
净利润增长率%	624.35%	-32.20%	-

四、 股本情况

单位：股

	本期期末	本期期初	增减比例%
--	------	------	-------

普通股总股本	1,670,000,000	1,670,000,000	0%
计入权益的优先股数量	0	0	-
计入负债的优先股数量	0	0	-
带有转股条款的债券	0	0	-
期权数量	0	0	-

五、 境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

六、 与业绩预告/业绩快报中披露的财务数据差异

适用 不适用

七、 非经常性损益

单位：元

项目	金额
非流动资产处置损益	14,584.73
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	25,036,667.04
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-6,377,083.02
其他符合非经常性损益定义的损益项目	-
非经常性损益合计	18,674,168.75
所得税影响数	4,582,887.20
少数股东权益影响额（税后）	-401,299.31
非经常性损益净额	14,492,580.86

八、 净资本及风险控制指标

单位：元

	本期期末	本期期初	增减比例%
净资本	7,600,360,327.39	6,664,461,624.12	14.04%
其中：核心净资本	6,540,360,327.39	5,914,461,624.12	10.58%
附属净资本	1,060,000,000.00	750,000,000.00	41.33%
净资产	8,793,261,680.17	8,438,672,763.38	4.20%
各项风险资本准备之和	2,678,621,680.86	1,611,460,249.10	66.22%
表内外资产总额	25,826,295,747.73	19,657,206,217.79	31.38%
风险覆盖率(%)	283.74%	413.57%	-
资本杠杆率(%)	25.32%	30.09%	-
流动性覆盖率(%)	269.12%	673.82%	-
净稳定资金率(%)	181.74%	210.47%	-
净资本/净资产(%)	86.43%	78.98%	-
净资本/负债(%)	46.38%	63.43%	-
净资产/负债(%)	53.66%	80.32%	-
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	27.72%	12.88%	-

自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%)	132.56%	113.95%	-
----------------------	---------	---------	---

九、 补充财务指标

√适用 □不适用

(一) 资产负债表主要数据及财务指标

单位：万元

项目	2020年12月31日		2019年12月31日		增减百分比	
	合并数	母公司	合并数	母公司	合并数	母公司
货币资金	1,113,840.15	753,708.57	1,087,052.13	788,614.41	2.46%	-4.43%
结算备付金	581,390.78	270,278.58	421,563.53	247,485.46	37.91%	9.21%
融出资金	749,592.60	749,181.51	395,017.08	394,015.61	89.76%	90.14%
衍生金融资产	544.14	158.54	154.89	21.16	251.31%	649.24%
交易性金融资产	1,473,936.00	1,154,186.61	1,442,962.03	793,663.40	2.15%	45.43%
应收款项	2,122.34	7,869.19	6,948.67	1,798.16	-69.46%	337.62%
债权投资	14,066.95	0.00	51,825.47	0.00	-72.86%	不适用
其他权益工具投资	4,421.59	4,281.59	2,540.00	2,400.00	74.08%	78.40%
递延所得税资产	23,018.61	41,761.80	19,102.51	29,745.89	20.50%	40.40%
其他资产	12,766.57	10,936.60	19,533.46	8,915.32	-34.64%	22.67%
资产总额	4,232,347.72	3,328,638.52	3,733,979.97	2,633,169.51	13.35%	26.41%
应付短期融资款	254,889.92	254,889.92	69,390.52	69,390.52	267.33%	267.33%
衍生金融负债	1,289.36	0.00	196.09	0.00	557.53%	不适用
卖出回购金融资产款	626,907.00	622,906.51	444,739.40	444,739.40	40.96%	40.06%
应付职工薪酬	50,413.23	45,903.86	36,014.56	32,430.55	39.98%	41.55%
应交税费	2,407.57	2,065.77	4,605.36	4,224.45	-47.72%	-51.10%
应付款项	41,586.36	13,262.92	30,912.07	21,145.74	34.53%	-37.28%
应付债券	542,798.13	542,798.13	455,217.80	350,491.96	19.24%	54.87%
递延所得税负债	16,557.26	15,979.12	4,584.05	3,763.01	261.19%	324.64%
其他负债	188,522.62	108.43	510,297.10	164.91	-63.06%	-34.25%
负债总额	3,334,689.31	2,449,312.35	2,879,590.76	1,789,302.23	15.80%	36.89%
其他综合收益	1,904.40	1,480.83	3,291.77	978.23	-42.15%	51.38%
所有者权益合计	897,658.41	879,326.17	854,389.21	843,867.28	5.06%	4.20%
归属于挂牌公司股东的净资产	869,776.75	879,326.17	827,269.39	843,867.28	5.14%	4.20%
归属于挂牌公司股东的每股净资产(元/股)	5.21	5.27	4.95	5.05	5.25%	4.36%
归属于母公司股东的权益	869,776.75	879,326.17	827,269.39	843,867.28	5.14%	4.20%
资产负债率%	68.39	65.08	67.34	55.46	-	-
流动比率	2.27	2.13	3.10	2.38	-	-
利息保障倍数	2.22	2.25	1.32	1.60	-	-

(二) 利润表主要数据及财务指标

单位：万元

项目	2020 年度		2019 年度		增减百分比	
	合并数	母公司	合并数	母公司	合并数	母公司
营业收入	226,933.45	211,283.56	164,169.93	141,357.85	38.23%	49.47%
手续费及佣金净收入	101,978.88	91,104.59	83,591.51	74,669.83	22.00%	22.01%
投资收益	91,335.59	55,468.44	40,842.36	11,019.46	123.63%	403.37%
公允价值变动收益	22,528.00	47,229.43	36,838.41	36,513.85	-38.85%	29.35%
汇兑收益	22.79	-217.57	161.27	45.43	-85.87%	不适用
营业支出	154,420.11	158,765.36	143,180.60	122,390.76	7.85%	29.72%
业务及管理费	124,179.25	100,287.12	93,223.12	69,885.26	33.21%	43.50%
信用减值损失	27,745.38	2,086.88	47,692.80	9,265.70	-41.82%	-77.48%
其他资产减值损失	47.16	54,336.24	14.44	41,452.98	226.59%	31.08%
营业利润	72,513.34	52,518.20	20,989.33	18,967.09	245.48%	176.89%
营业外收入	151.63	139.22	1,199.79	195.07	-87.36%	-28.63%
营业外支出	816.52	600.47	311.27	204.47	162.32%	193.67%
利润总额	71,848.44	52,056.96	21,877.85	18,957.70	228.41%	174.60%
所得税费用	26,191.88	17,100.66	15,574.76	4,406.66	68.17%	288.06%
净利润	45,656.57	34,956.29	6,303.09	14,551.04	624.35%	140.23%
归属于挂牌公司股东的净利润	43,894.73	34,956.29	4,941.66	14,551.04	788.26%	140.23%
归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润	42,445.48	33,581.45	2,361.17	12,716.15	1697.65%	164.09%
其他综合收益	-1,387.37	502.60	887.81	345.60	不适用	45.43%
营业收入增长率%	38.23	49.47	10.01	21.23	-	-
净利润增长率%	624.35	140.23	-32.20	36.14	-	-
营业费用率%	54.72	47.47	56.78	49.44	-	-
总资产收益率%	1.15	1.17	0.17	0.59	-	-
加权平均净资产收益率% (依据归属于挂牌公司股东的净利润计算)	5.17	4.06	0.60	1.74	-	-
加权平均净资产收益率% (依据归属于挂牌公司股东的扣除非经常性损益后的净利润计算)	5.00	3.90	0.29	1.52	-	-
基本每股收益 (元/股)	0.263	0.209	0.030	0.087	776.67%	140.23%

(三) 代理销售金融产品情况

单位：元

项目	2020 年代理销售金融产品的销售金额	2020 年代理销售金融产品总收入
基金	1,279,740,690.33	8,885,550.43
信托	808,230,000.00	1,930,300.16
其他	0.00	0.00
合计	2,087,970,690.33	10,815,850.59

十、 会计数据追溯调整或重述情况

会计政策变更 会计差错更正 其他原因 不适用

第四节 管理层讨论与分析

一、 业务概要

商业模式:

1、根据《挂牌公司管理型行业分类指引》，本公司所处的行业属于“J6712 证券经纪交易服务”，经中国证监会批准，公司从事的主要业务为：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；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。公司积极推行以“差异化竞争”为“一体”，业务协同和科技赋能为“两翼”的“一体两翼”总体战略方向，以“规范经营、严控风险”为基石，坚持“以客户需求为导向”的理念，坚定不移地打造具有东海证券自身特色的核心竞争力，推进公司的长足发展。公司致力于为各类投资者提供优质的财富管理服务，努力把握证券市场发展机遇，积极开展各项业务，已经发展成为一家中型综合类证券公司。报告期内，按照经营分部口径，公司收入来源主要是证券投资、证券经纪等业务收入。

2、报告期内及报告期后至报告披露日，公司的商业模式未发生较大的变化。

报告期内变化情况:

事项	是或否
所处行业是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
主营业务是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
主要产品或服务是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
客户类型是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
关键资源是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
销售渠道是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
收入来源是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否
商业模式是否发生变化	<input type="checkbox"/> 是 <input checked="" type="checkbox"/> 否

二、 经营情况回顾

(一) 经营计划

报告期内，公司全年实现营业收入226,933.45万元，实现利润总额71,848.44万元，实现归属于母公司股东的净利润43,894.73万元，公司主要业务经营情况如下：

1、证券自营业务

2020年，公司权益投资业务始终坚持以研究为基石的投资理念，以研究发现机会，深入研究宏观政策、行业及公司基本面，以研究支持决策，审慎投资。投资于二级市场、港股、基金等多个品种，实现投资策略和投资风格多元化，以分散和降低整体投资风险。及时把握市场投资机会，将核心资产作为中长期配置方向，同时重点布局景气度上行的行业。

2020年，公司固定收益业务克服了市场不利因素影响，销售、交易、做市、投资等各项业务健康发展，取得了良好的业绩回报和市场口碑。销售业务巩固优势，交易业务开疆拓土，做市业务精益求精，投资业务博采众长，在传统固定收益资产回报率持续走低的行情下，积极践行“固收+”策略，整体投资回报表现出相当的抗风险能力。

报告期内，公司证券自营业务实现营业收入94,149.80万元，同比增长100.57%。

2、证券经纪业务

2020年，上证综指收于3,473.07点，较年初上涨422.95点，累计涨幅13.87%。从全年来看，沪深两市股票成交总额206.83万亿元，同比增长62.32%，市场交易活跃度上升明显。（数据来源：沪深两市交易所）

2020年，公司持续推进经纪业务财富管理转型，优化调整经纪业务分支机构组织架构，在稳固传统经纪业务的基础上，加大金融产品销售、融资融券业务及机构业务的拓展，扎实做好合规风控管理和投资者教育工作。

公司代理买卖证券业务情况

项目	2020年度			2019年度		
	公司数值（亿元）	行业份额（%）	行业排名	公司数值（亿元）	行业份额（%）	行业排名
代理买卖证券业务净收入	4.92	0.4953	48	3.64	0.5296	49
股票债券等产品代理交易额	21,604.77	0.3955	55	21,341.82	0.5579	43

资料来源：中国证监会 CISP 系统

报告期内，公司实现证券经纪业务营业收入63,370.41万元，同比上升26.13%。

3、信用交易业务

2020年，融资融券业务市场规模攀升，截至2020年末，全市场融资融券余额为16,189.68亿元，相较于去年同期上升58.85%。（数据来源：中国证券金融股份有限公司官网）

报告期内，公司持续推进经纪业务向财富管理转型，采取积极有效的经营举措提升融资融券业务规模，支持经纪业务发展，同时，加强业务各环节风险管控和主动性风险管理。报告期末，公司融资融券余额为736,617.05万元，同比上升93.18%，其中融出资金余额为735,975.93万元，融出证券余额为641.12万元。

报告期内，公司实现信用交易业务收入34,467.72万元，同比上升34.83%。

4、投资银行业务

2020年，证券市场改革亮点频出，各个板块均迎来关键制度性改革，2020年沪深两市股权融资总额为16,676.54亿元。（数据来源：Wind 资讯）

面对行业竞争加剧的客观环境，公司继续大力发展优势产品、深挖优势领域竞争力，进一步明确重点行业、重点地域、重点客户群体，同时严把项目节点，严控项目质量，提高风控水平，在合规且高效的基础上，为目标客户提供定制化、专业化的投行综合服务。

报告期内，公司完成股权承销家数共计4单，承销金额186,693.04万元。

报告期内，公司债券业务定位专业化、有特色、有品牌的精品债券承销商。坚持做大做强企业债、公司债等核心业务，同时稳健探索创新品种，进一步丰富产品体系。深耕存量区域的同时，积极拓展新业务区域，提高客户覆盖度并开发优质客户。强化风控和利润导向的目标，继续加大项目储备力度和深度，保证了债券发行业务稳定可持续发展。报告期内，公司债券总承销16只，债券总承销金额为114.80亿元。（数据来源：Wind 资讯）

公司主承销业务情况

发行类型	承销次数（次）		承销金额（万元）	
	2020年度	2019年度	2020年度	2019年度
新股发行	1	0	45,939.74	0.00
增发新股	3	1	140,753.30	74,750.00
债券发行	16	28	1,148,000.00	1,304,200.00

小计	20	29	1,334,693.04	1,378,950.00
----	----	----	--------------	--------------

报告期内，公司投资银行业务实现营业收入 34,223.36 万元，同比上升 10.90%。

5、资产管理业务

《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》过渡期延期至 2021 年底，为公司资管大集合业务改造提供了有利的契机。面对规模下降的不利形势，公司通过盘活存量资产，充分抓住债券一季度向好的时间窗口，稳健运作；坚持“以研究驱动投资、投研融合”的基本理念，通过市场化引进与内部挖潜相结合，搭建了新的资管投研团队，构建完善新的投研决策、风险控制体系。

公司资产管理业务情况

业务类别	2020 年度			2019 年度		
	期末受托资金 (万元)	当期业务净 收入(万元)	期末产 品数量	期末受托资金 (万元)	当期业务净 收入(万元)	期末产 品数量
集合资产管理业务	667,564.86	4,425.54	25	1,426,380.91	3,814.02	25
单一资产管理业务	1,145,611.06	1,430.83	23	3,972,607.93	2,495.47	30
专项资产管理业务	6,700.00	67.20	1	131,000.00	118.11	2
合计	1,819,875.92	5,923.57	49	5,529,988.84	6,427.60	57

报告期内，公司资产管理业务实现营业收入 7,464.04 万元，同比下降 5.46%。

6、期货经纪业务

2020 年，是中国期货市场的“丰收之年”，上市 12 个新的期货期权品种。目前，我国期货市场上品种数量达到 87 个，其中有 7 个国际化品种，进一步完善了商品金融、期货期权、场内场外、境内境外协同发展的局面。

2020 年，以单边计算全国期货市场累计成交量为 61.53 亿手、累计成交额为 437.53 万亿元，同比分别增长 55.29% 和 50.56%。（数据来源：中国期货业协会）

2020 年公司上期所品种成交量和成交额分别为 14,769,699 手和 8,904.60 亿元，同比分别减少 8.34% 和 16.48%，市场份额为 0.36%，同比下降 25.76%。

报告期内，公司期货经纪业务实现营业收入 22,238.83 万元，同比增长 15.44%。

(二) 行业情况

2020 年，面对严峻复杂的国内外形势，在党中央坚强领导下，资本市场持续推进疫情防控、深化改革、防范风险等各项工作，证券行业抓住机遇加快业务转型，加强能力建设，积极服务实体经济和居民财富管理，经营情况整体向好。

2020 年，沪深两市股票成交总额 206.83 万亿元，同比增长 62.32%；上证综指与深证成指分别较上年末上涨 13.87% 和 38.73%。受资本市场改革、市场回暖等因素影响，证券行业整体经营业绩增幅明显。（数据来源：上海证券交易所和深圳证券交易所）

根据中国证券业协会发布的证券公司未经审计的 2020 年经营数据，证券行业 2020 年度实现营业收入 4,484.79 亿元，实现代理买卖证券业务净收入（含交易单元席位租赁）1,161.10 亿元、实现投资银行净收入 672.11 亿元、实现代理销售金融产品净收入 134.38 亿元、实现投资咨询业务净收入 48.03 亿元、实现资产管理业务净收入 299.60 亿元，2020 年度实现净利润 1,575.34 亿元，127 家公司实现盈利。截至 2020 年 12 月 31 日，证券行业总资产为 8.90 万亿元，净资产为 2.31 万亿元，净资本为 1.82 万亿元，客户交易结算资金余额（含信用交易资金）1.66 万亿元，受托管理资金本金总额 10.51 万亿元。其中：营业收入同比增长 24.41%，净利润同比增长 27.98%，总资产同比增长 22.50%，净资产同比增长 14.10%。（数据来源：中国证券业协会）

(三) 财务分析

1. 资产负债结构分析

单位：元

项目	本期期末		上年期末		变动比例%
	金额	占总资产的比重%	金额	占总资产的比重%	
货币资金	11,138,401,528.62	26.32%	10,870,521,278.94	29.11%	2.46%
结算备付金	5,813,907,769.11	13.74%	4,215,635,340.51	11.29%	37.91%
拆出资金	-	0.00%	-	0.00%	不适用
融出资金	7,495,925,997.01	17.71%	3,950,170,756.01	10.58%	89.76%
衍生金融资产	5,441,376.20	0.01%	1,548,914.03	0.00%	251.30%
应收款项	21,223,404.18	0.05%	69,486,662.05	0.19%	-69.46%
持有待售资产	868,600.00	0.00%	-	0.00%	不适用
债权投资	140,669,481.86	0.33%	518,254,688.89	1.39%	-72.86%
其他权益工具投资	44,215,881.86	0.10%	25,400,000.00	0.07%	74.08%
其他资产	127,665,717.25	0.30%	195,334,626.10	0.52%	-34.64%
资产总计	42,323,477,230.65	100.00%	37,339,799,706.72	100.00%	13.35%
应付短期融资款	2,548,899,240.71	6.02%	693,905,221.89	1.86%	267.33%
衍生金融负债	12,893,591.20	0.03%	1,960,906.57	0.01%	557.53%
卖出回购金融资产款	6,269,069,951.80	14.81%	4,447,394,022.50	11.91%	40.96%
应付职工薪酬	504,132,331.95	1.19%	360,145,615.81	0.96%	39.98%
应交税费	24,075,662.46	0.06%	46,053,607.08	0.12%	-47.72%
应付款项	415,863,603.38	0.98%	309,120,687.11	0.83%	34.53%
合同负债	6,663,806.16	0.02%	-	0.00%	不适用
递延所得税负债	165,572,595.70	0.39%	45,840,481.66	0.12%	261.19%
其他负债	1,885,226,234.56	4.45%	5,102,971,011.71	13.67%	-63.06%
负债合计	33,346,893,148.67	78.79%	28,795,907,592.26	77.12%	15.80%

资产负债项目重大变动原因：

截至2020年12月31日，公司总资产423.23亿元，较年初增长13.35%。从公司资产结构分析，结算备付金、融出资金增幅较大。扣除代理买卖证券款139.27亿元，截至2020年12月31日，公司自有总资产283.96亿元，公司自有负债总额为194.20亿元，自有负债率68.39%，较期初增加1.05个百分点，公司具备持续经营的稳定性与安全性。

负债对公司现金流的影响主要表现在，代理买卖证券收到现金净额6.78亿元，拆入资金增加现金净额1.28亿元，回购业务增加现金净额19.89亿元，偿还债务支付现金114.49亿元，取得借款增加现

金 72.16 亿元，发行债券收到现金 69.19 亿元。

其中，公司货币形态的自有现金为 13.46 亿元，占资产总额（扣除代理买卖证券款）的 4.74%，交易性金融资产 147.39 亿元，占资产总额（扣除代理买卖证券款）51.91%，融出资金 74.96 亿元，占资产总额（扣除代理买卖证券款）26.40%。上述资产流动性较好，结构合理，质量优良。

变动幅度较大的资产负债表科目如下：

本期结算备付金增长 37.91%，主要原因是客户结算备付金增加；

本期融出资金增长 89.76%，主要原因是客户融资规模增加；

本期衍生金融资产增长 251.30%，主要原因是商品期权公允价值变动；

本期应收款项减少 69.46%，主要原因是其他应收款项减少；

本期持有待售资产增加，主要原因是下属子公司待处置资产；

本期债权投资减少 72.86%，主要原因是债权投资减值增加；

本期其他权益工具投资增长 74.08%，主要原因是其他权益工具投资公允价值变动增加；

本期其他资产减少 34.64%，主要原因是预付款项减少；

本期应付短期融资款增长 267.33%，主要原因是短期融资款增加；

本期衍生金融负债增长 557.53%，主要原因是商品期权增加；

本期卖出回购金融资产款增长 40.96%，主要原因是正回购规模增加；

本期应付职工薪酬增长 39.98%，主要原因是薪酬计提数增加；

本期应交税费减少 47.72%，主要原因是应交增值税减少；

本期应付款项增长 34.53%，主要原因是应付押金及保证金增加；

本期合同负债增加，主要原因是适用新收入准则；

本期递延所得税负债增长 261.19%，主要原因是交易性金融资产公允价值变动；

本期其他负债减少 63.06%，主要原因是取得固定收益的结构化主体其他持有人权益减少。

2. 营业情况分析

(1) 利润构成

单位：元

项目	本期		上年同期		变动比例%
	金额	占营业收入的比重%	金额	占营业收入的比重%	
一、营业收入	2,269,334,464.02	-	1,641,699,281.58	-	38.23%
手续费及佣金净收入	1,019,788,757.25	44.94%	835,915,118.06	50.92%	22.00%
利息净收入	61,345,597.15	2.70%	-25,475,993.51	-1.55%	不适用
投资收益	913,355,881.16	40.25%	408,423,611.78	24.88%	123.63%
净敞口套期收益					
公允价值变动收益	225,279,969.59	9.93%	368,384,062.56	22.44%	-38.85%
汇兑收益	227,878.74	0.01%	1,612,746.16	0.10%	-85.87%
其他业务收入	24,013,241.22	1.06%	27,190,495.83	1.66%	-11.69%
资产处置收益	406,471.87	0.02%	-267,794.62	-0.02%	不适用
其他收益	24,916,667.04	1.10%	25,917,035.32	1.58%	-3.86%
二、营业支出	1,544,201,067.88	68.05%	1,431,805,978.10	87.21%	7.85%
税金及附加	21,021,257.12	0.93%	19,040,446.43	1.16%	10.40%

业务及管理费	1,241,792,499.55	54.72%	932,231,187.15	56.78%	33.21%
信用减值损失	277,453,764.29	12.23%	476,927,985.44	29.05%	-41.82%
其他资产减值损失	471,587.84	0.02%	144,400.00	0.01%	226.58%
其他业务成本	3,461,959.08	0.15%	3,461,959.08	0.21%	0.00%
三、营业利润（亏损以“－”号填列）	725,133,396.14	31.95%	209,893,303.48	12.79%	245.48%

项目重大变动原因：

本期利息净收入为正数，上期为负，主要原因是并表结构化主体其他持有人损益减少；
 本期投资收益增长 123.63%，主要原因是金融工具投资收益增加；
 本期公允价值变动收益减少 38.85%，主要原因是衍生金融工具公允价值减少；
 本期汇兑收益减少 85.87%，主要原因是汇率变动；
 本期资产处置收益为正数，上期为负，主要原因是资产处置利得增加；
 本期业务及管理费增长 33.21%，主要原因是职工薪酬增加；
 本期信用减值损失减少 41.82%，主要原因是债权投资减值损失减少；
 本期其他资产减值损失增长 226.58%，主要原因是持有待售资产减值损失增加。

(2) 收入构成

本期经纪业务营业收入较上期增长26.13%，主要原因是受市场行情影响。
 本期证券自营业务营业收入较上期增长 100.57%，主要原因是公司自营业务准确把握两市机会，及时调整投资策略。
 本期信用业务营业收入较上期增长 34.83%，主要原因是信用业务规模增加。
 本期直投业务营业收入较上期减少 61.32%，主要原因是本期直投业务减少。
 本期其他业务营业收入为负数，上期为正，主要原因是纳入合并范围资管产品收入减少及债券利息支出增加。

按业务分类分析：

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例%
	金额	占营业收入的比重%	金额	占营业收入的比重%	
证券经纪业务	633,704,148.03	27.92%	502,409,543.86	30.60%	26.13%
证券自营业务	941,498,029.28	41.49%	469,420,676.40	28.59%	100.57%
投资银行业务	342,233,586.39	15.08%	308,590,729.53	18.80%	10.90%
其中：证券保荐与承销业务	330,154,647.89	14.55%	297,506,586.15	18.12%	10.97%
财务顾问业务	12,071,607.17	0.53%	10,788,024.01	0.66%	11.90%
资产管理业务	74,640,419.94	3.29%	78,954,886.80	4.81%	-5.46%
信用交易业务	344,677,169.09	15.19%	255,629,622.00	15.57%	34.83%
其中：融资融券业务	344,677,169.09	15.19%	254,517,860.23	15.50%	35.42%
股票质押回购式交	-	0.00%	-	0.00%	不适用

易业务					
约定购回式证券交易业务	-	0.00%	23,779.88	0.00%	不适用
期货经纪业务	222,388,296.97	9.80%	192,636,526.21	11.73%	15.44%
直投业务	18,226,254.34	0.80%	47,116,437.58	2.87%	-61.32%
其他业务	-76,387,193.56	-3.37%	247,143,424.35	15.05%	不适用
合并抵消	-231,646,246.46	-10.20%	-460,202,565.15	-28.02%	49.66%
合计	2,269,334,464.02	-	1,641,699,281.58	-	-

按区域分类分析：

√适用 □不适用

单位：元

类别/项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例%
	收入金额	占营业收入的比重%	收入金额	占营业收入的比重%	
江苏地区	1,061,751,282.65	46.79%	875,216,470.84	53.31%	21.31%
上海地区	1,195,630,130.04	52.69%	976,412,365.53	59.48%	22.45%
其他地区	243,599,297.79	10.73%	250,273,010.36	15.24%	-2.67%
合并抵消	-231,646,246.46	-10.21%	-460,202,565.15	-28.03%	49.66%
合计	2,269,334,464.02	-	1,641,699,281.58	-	38.23%

收入构成变动的原因：

本期收入构成按区域分类未发生重大变动。

(3) 营业成本构成

单位：元

项目	本期		上年同期		本期与上年同期金额变动比例%
	金额	占营业收入的比重%	金额	占营业收入的比重%	
证券经纪业务	330,686,826.80	14.57%	318,105,693.77	19.38%	3.96%
证券自营业务	351,211,932.86	15.48%	85,309,973.14	5.20%	311.69%
投资银行业务	84,486,615.51	3.72%	67,033,006.82	4.08%	26.04%
其中：证券保荐与承销业务		0.00%		0.00%	不适用
财务顾问业务		0.00%		0.00%	不适用
资产管理业务	35,163,674.56	1.55%	93,942,871.52	5.72%	-62.57%
信用交易业务	25,368,572.09	1.12%	14,921,917.77	0.91%	70.01%
其中：融资融券业务		0.00%		0.00%	不适用
股票质押回购式交易业务		0.00%		0.00%	不适用
约定购回式证券交易业务		0.00%		0.00%	不适用

期货经纪业务	164,535,131.17	7.25%	141,395,401.70	8.61%	16.37%
直投业务	29,291,846.43	1.29%	446,176,044.84	27.18%	-93.43%
其他业务	1,056,047,159.59	46.54%	730,794,578.55	44.51%	44.51%
合并抵消	-532,590,691.13	-23.47%	-465,873,510.01	-28.38%	-14.32%
合计	1,544,201,067.88	68.05%	1,431,805,978.10	87.21%	7.85%

营业成本构成变动的的原因:

本期证券自营业务营业成本增长 311.69%，主要原因是信用减值损失增加。
 本期资产管理业务营业成本减少 62.57%，主要原因是信用减值损失减少。
 本期信用交易业务营业成本增长 70.01%，主要原因是业务规模增加导致计提信用减值损失增加。
 本期直投业务营业成本减少 93.43%，主要原因是本期直投业务减少。
 本期其他营业成本增长 44.51%，主要原因是薪酬费用增加。

3. 现金流量状况

单位：元

项目	本期金额	上期金额	变动比例%
经营活动产生的现金流量净额	2,845,806,047.63	4,888,975,079.78	-41.79%
投资活动产生的现金流量净额	-49,849,882.42	-44,322,686.39	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	-925,402,895.00	-1,475,357,684.52	不适用

现金流量分析:

报告期内，经营活动产生的现金流量净额为 28.46 亿元，较上期减少 20.43 亿元。其中经营活动现金流入 83.87 亿元，经营活动现金流出 55.41 亿元。较上期相比变动较多的主要是：

- (1) 为交易目的而持有的金融资产净减少产生的现金流入减少 4.54 亿元；
- (2) 拆入资金净增加产生的现金流入减少 3.55 亿元；
- (3) 回购业务资金现金流入增加 14.62 亿元；
- (4) 代理买卖证券款现金流入减少 10.68 亿元；
- (5) 收到其他与经营活动现金流入增加 8.94 亿元，主要原因是期货公司收到客户保证金增加；
- (6) 融出资金现金流出增加 25.53 亿元。

报告期内，投资活动产生的现金流量净额为-0.50 亿元，主要原因是本期构建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金增加。

报告期内，筹资活动产生的现金流量净额为-9.25 亿元，较上期增加 5.50 亿元。其中，取得借款收到的现金流入增加 37.40 亿元；发行债券收到的现金流入增加 50.39 亿元；偿还债务支付的现金流出增加 73.21 亿元；支付其他与筹资活动有关的现金流出增加 8.78 亿元，主要原因是并表结构化主体中其他份额持有人赎回。

报告期经营活动产生现金流量净额与净利润差异情况如下：

项目	金额	说明
经营活动产生的现金流量净额：	2,845,806,047.63	
净利润	456,565,669.43	
差异	2,389,240,378.20	
加：其他资产减值损失/信用减值损失	277,925,352.13	本期计提应收账款、债权投资减值准备

固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	41,669,712.19	本期计提房屋折旧、电子设备折旧、办公设备折旧
无形资产摊销	26,077,749.05	本期软件摊销
长期待摊费用摊销	5,715,996.22	本期摊销装修费用
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-406,471.87	本期处置非流动资产损失
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	391,887.14	本期报废固定资产损失
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-225,279,969.59	本期金融资产公允价值上升
财务费用（收益以“-”号填列）	413,884,166.80	本期公司债券、短期融资券、转融通、回购利息支出及结构化主体其他持有人收益
汇兑损失（收益以“-”号填列）	-227,878.74	本期外币汇兑收益
投资损失（收益以“-”号填列）	-1,404,453.85	本期应享联营企业投资损益份额
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-32,180,393.40	本期费用时间性差异及金融资产公允价值变动
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	115,028,143.58	本期交易性金融资产公允价值变动
交易性金融资产的减少（增加以“-”号填列）	-48,590,343.87	本期金融工具投资增加
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-3,177,385,651.46	本期融出资金增长 35.46 亿元，买入返售金融资产减少 2.81 亿元，其他经营性应收项目合计减少 0.88 亿元。
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	4,994,022,533.87	本期卖出回购金融资产款增长 18.22 亿元，代理买卖证券款增增长 27.44 亿元，应付款项增长 1.07 亿元，拆入资金增长 1.61 亿元，其他经营性应付项目合计增长 1.60 亿元。

（四） 投资状况分析

1. 主要控股子公司、参股公司情况

√适用 □不适用

单位：元

公司名称	公司类型	主要业务	总资产	净资产	营业收入	净利润
东海期货有限责任公司	控股子公司	期货经纪	6,879,588,012.77	698,295,928.71	237,873,903.10	44,298,146.43

东海投资有限责任公司	控股子公司	股权投资	503,524,214.54	499,749,343.03	19,252,476.46	-11,213,935.80
东海证券创新产品投资有限公司	控股子公司	金融投资	82,133,537.64	82,096,394.56	-32,771,411.91	-35,058,231.21
东海国际金融控股有限公司	控股子公司	投资管理	660,495,559.96	133,173,314.66	-68,689,332.03	-341,381,345.35
东海基金管理有限公司	参股公司	公募基金管理	244,998,431.58	132,734,985.16	127,504,571.88	4,431,367.14
江苏股权交易中心有限责任公司	参股公司	资本市场服务	461,176,850.47	356,799,015.50	109,469,656.38	45,778,406.23

主要控股参股公司情况说明

(1) 主要控股子公司东海期货经营情况

东海期货实收资本 5 亿元，为东海证券的控股子公司，是公司重要的期货业务平台，经营范围为：商品期货经纪、金融期货经纪，期货投资咨询、资产管理、基金销售。

2020 年，公司不存在新设或处置分支机构的情况。截至 2020 年 12 月底，公司已有分支机构 22 家，分布在全国四大交易所所在地和各大中型发达城市及沿海城市。

截至 2020 年 12 月 31 日，东海期货总资产 687,958.80 万元，净资产 69,829.59 万元；全年实现营业收入 23,787.39 万元，净利润 4,429.81 万元。

(2) 主要全资子公司东海投资的经营情况

东海投资注册资本 6 亿元，为本公司的全资控股子公司，是公司重要的对外投资业务平台，主要业务为通过募集资金进行对外投资以及为客户提供股权投资的财务顾问服务等。

截至 2020 年 12 月 31 日，东海投资总资产 50,352.42 万元，净资产 49,974.93 万元；全年实现营业收入 1,925.25 万元，净利润-1,121.39 万元。

(3) 参股公司投资目的

公司与上表所列参股公司同属资本市场服务行业，投资上述参股公司有利于公司业务拓展。

公司控制的结构化主体情况

√适用 □不适用

公司控制的结构化主体情况详见本报告所附财务报表附注 八、(二) 在纳入合并范围的结构化主体中的权益。

2. 合并财务报表的合并范围内是否包含私募基金管理人

√是 □否

(1) 基金管理人资质及业务的合规性

东海投资是东海证券的全资私募基金子公司，从事私募投资基金业务。东海投资已在中国证券投资基金业协会登记为私募基金管理人，会员编码：GC2600011590，东海投资具备从事私募投资基金业务的资质。东海投资严格按照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券公司私募基金子公司管理规范》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及东海投资内部规章制度等规定，在法律法规规范性文件框架内合规展业。截至本报告期末，东海投资管理的存续基金均为有限合伙制基金，东海投资担任基金管理人的同时担任该等有限合伙基金的普通合伙人。根据《合伙企业法》规定及合伙协议约定，普通合伙人对基金债务承担无限连带责任。在法律层面上，公司存在着因从事基金管理业务而对合伙企业债务承担无限连带责任；但公司签署的合伙协议或相关文件均设置了“禁止基金对外举债或对外提供担保”等条款，从此禁止了基金对外承担债务的风险。东海投资在基金中担任普通合伙人对公司财务没有不良影响，也不会对公司的持续经营造成影响。

(2) 基金设立与日常管理情况

1) 存续基金综述

①截至报告期末，存续基金产品2支，东海投资认缴金额3000万元，实缴金额1801万元。报告期内无清算完毕基金产品。认缴金额与实缴金额存在差异的原因是，在管基金均为合伙制基金，依据与客户签署的基金合同，采用分期出资方式。公司在管基金系根据投资进度、投资项目需要由基金管理人向投资人发出后续缴款通知。截至目前，东海投资在管基金尚未出现投资人首次或后续出资违约情形。如未来发生投资人违约出资情形，公司将积极与投资人沟通，依据与投资人签署的合伙协议采取措施，维护包括公司在内的所有投资人的合法权益。投资人后续出资违约有可能造成基金不能按原有投资计划执行而错失投资机会，不会对公司财务造成较大风险，不会影响公司的持续经营。公司所管理基金采用的收益分配机制为，先依据实缴出资比例向全体投资人分配投资本金，如有余额，再依据实缴出资比例向全体投资人分配基金门槛收益，完成上述分配后如仍有余额，依据基金合同约定的分配比例向全体投资人分配超额收益。

②关于各基金管理费用的收取对象、收取年限、收取标准、收取方式、收取金额的情况及管理人出资额及投资收益情况如下：基金管理人依据基金合同向报告期内存续产品收取管理费，按基金列示如下：

苏州东建驿和创业投资中心（有限合伙），管理费在基金存续期内收取，每年为实缴出资额的0.2%，实缴出资到位，且合伙企业财产投资于投资项目后，执行事务合伙人有权满十个工作日内收取。报告期内累计应收管理费金额为16.20万元，实际收取金额为16.20万元，管理人实际出资1800万元，无对应投资收益。

苏州东海可观创业投资中心（有限合伙），管理费在基金存续期内收取，每年为实缴出资额（扣除已退出投资本金）的1%，第一年管理费在全部实缴出资到账后十五个工作日内支付，基金运作第二年（按基金全部实缴到账日对日）开始，按基金实缴规模，每日计提管理费，于每个季度结束后十五个工作日内一次性支付上一运作季度管理费。报告期内累计应收管理费金额为10.08万元，实际收取金额为10.08万元，管理人实际出资1万元，无对应投资收益。

2) 资产负债表日仍存续的且未进行清算的全部基金基本情况

名称	类型	组织形式	成立时	存续期间		币种	资金来源	投资方向	管理人	托管人
				投资期	退出					

			间	(年)	期					
					(年)					
苏州东建驿和创业投资中心(有限合伙)	股权投资基金	有限合伙企业	2018/11/06	3	--	人民币	自有资金、社会资本	未上市公司股权	东海投资有限责任公司	兴业银行股份有限公司
苏州东海可观创业投资中心(有限合伙)	股权投资基金	有限合伙企业	2019/10/22	3	--	人民币	自有资金、社会资本	未上市公司股权	东海投资有限责任公司	中信证券股份有限公司

3) 重点基金情况

不适用。

4) 结构化基金产品

适用 不适用

5) 基金募集推介方式

东海投资目前存续产品共 2 支，均为自行销售。截至报告期末，2 支基金投资者均为专业投资者，全部投资者已按照投资者适当性要求提供了资产证明、投资经验证明，并对投资收益风险自担进行了承诺。

6) 对当期收入贡献最大的前五支基金

单位：万元

基金名称	认缴金额	实缴金额	未退出投资		已退出投资		总投资		内部收益率 (IRR)	
			估值	回报倍数	估值	回报倍数	估值	回报倍数	已退出投资	总投资
苏州东建驿和创业投资中心(有限合伙)	2000	1800	1690.69	0	0	0	1690.69	0	-	-
苏州东海可观创业投资中心(有限合伙)	1000	1	0.19	0	0	0	0.19	0	-	-

东海投资管理的私募股权投资基金的估值方法如下：

①投资于非上市公司股权的，遵照中基协《非上市股权投资估值指引》的相关要求，根据投资标的的资产特征，结合估值方式的适用条件，选用市场法、收益法、成本法进行估值；

②投资于有限合伙型、契约型私募股权投资子基金的，以估值日的最新净值估值；

③投资于货币市场基金、短期理财产品的，非证券交易所上市的资产管理产品，估值日资产管理人提供单位净值的，按资产管理人提供的估值日单位净值估值；估值日资产管理人未提供单位净值，且从最近净值提供日到估值日整体市场环境及投资标的未发生重大变化的，可参考最近可获取的单位净值确定公允价值；若有充足证据表明最近可获取的单位净值不能真实反映公允价值的，可采用估值技术确定公允价值。

7) 基金备案情况

截至报告期末，东海投资已备案私募基金 2 支。

(3) 基金投资情况

1) 基金投资的项目基本情况

①报告期内，东海投资投资决策委员会由5名东海投资高管及具备丰富专业经验的投资总监组成，投资决策委员会是对外出资设立基金和退出的最高决策机构。未经投资决策委员会决策，东海投资不得对外签署任何有关基金投资或投资承诺的协议和文件。截至报告期末，投资决策流程均按制度执行，无违反投资决策流程的情况。基金层面由全体合伙人委派代表参与设立投资决策委员会，对基金投资进行具体决策。东海投资在投资决策委员会中占多数席位，并具有一票否决权。

②截至报告期末，在投项目数量2个，对所投项目均为财务投资。

③基金与被投资标的及其关联方不存在特殊利益安排。

④截至报告期末，基金募集成立日期及累计投资项目数量、累计投资总额；在管项目数量和在被管项目投资总额如下表：

投资基金名称	基金募集成立日期	累计投资项目数量	累计投资总额（万元）	在管项目数量	在管项目投资总额（万元）
苏州东建驿和创业投资中心（有限合伙）	2018年11月6日	1	8999.90	1	8999.90
苏州东海可观创业投资中心（有限合伙）	2019年10月22日	1	999.99	1	999.99

⑤报告期内，基金已投项目无聘请外部专家参与尽职调查或投资顾问提供服务的情形。

2) 重点项目基本情况

不适用。

(4) 报告期内清算基金的情况

报告期内无清算完毕基金产品。

(5) 合作设立并运营投资基金共同担任基金管理人的基金情况

无合作设立并运营投资基金共同担任基金管理人的基金情况。

(6) 以自有资产投资的情况

1) 报告期内，不存在投资金额占当期期末净资产5%以上的自有资产投资项目情况；

2) 公司自有资产投资所管理的私募股权投资基金（在基金中的占比不超过20%），通过基金形式运作；公司管理的基金中包含自有资产与受托资产，在投资运作方式上无差异，在收益分配方面，按照合伙协议约定执行。

3) 报告期内收入分别来自于自有资产管理与受托资产管理的金额及比例：

收入类型	金额（万元）	比例
受托资产管理/基金管理费	21.58	82.11%
自有资产管理/公允价值变动损益等	-75.30	100%
合计	-53.72	

4) 东海投资目前已建立内部专业化管理制度，涉及投资决策的管理机制为《东海投资业务管理办法》和《东海投资投资决策委员会议事规则》；风险隔离机制、防范利益输送与利益冲突的机制为《东海投资风险基本制度》和《东海投资防范利益冲突管理办法》等。

5) 公司可披露所投项目均为财务型投资。

(五) 融资渠道和融资能力

1、融资渠道

公司目前的短期债务融资渠道主要包括：债券回购、同业拆借、转融通、法人账户透支、发行收益凭证以及两融收益权转让融资等，中长期债务融资渠道主要包括发行证券公司债、发行长期次级债等。长短期融资渠道丰富，对公司业务的发展发挥着重要作用。

2、公司的负债结构

截至 2020 年底，公司总负债 333.47 亿元，扣除代理买卖证券款和代理证券承销款后，公司自有负债为 194.20 亿元，其中其他负债 18.85 亿元（主要为结构化主体其他持有人权益），交易性金融负债 4.69 亿元（主要为不分级结构化主体其他持有人权益），应付债券 54.28 亿元，卖出回购金融资产款为 62.69 亿元，拆入资金 14.03 亿元，应付短期融资款 25.49 亿元，短期借款 2.87 亿元，其余为应交税费、应付利息、应付职工薪酬等。公司自有负债结构合理，满足公司流动性管理目标。目前，公司无重大到期未偿还的债务，公司整体偿债能力较强，流动性风险可控。

3、公司为维护流动性水平所采取的措施和相关管理政策

公司一贯重视流动性管理，强调安全性、流动性、收益性相统一的资金管理原则，在经营发展战略上注重业务规模与负债相匹配，通过合理的资产配置和多元化的负债融资，确保负债的期限、规模的合理配比，确保公司保持适度流动性。遵循全面性、审慎性、预见性、集中性的总体原则进行流动性风险管理，逐步建立健全与公司战略相适应的流动性风险管理体系，贯彻实施偏好为“稳健安全”的流动性风险管理政策。报告期内，公司流动性风险监管指标均持续达标，没有发生不符合监管标准的情况。公司积极拓展融资渠道，可通过多种融资方式，补充资本及流动资金；通过预算管理、资金计划管理和压力测试等内部管理手段，控制业务拓展进度，把握公司融资节奏，提高公司整体流动性，保障业务合规稳健发展。公司实行流动性风险限额管理与监控预警机制，持续监控短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的优质流动性储备，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求，同时，公司不断完善流动性风险管理系统，提高流动性风险管理效率，防范公司流动性风险。

4、融资能力

公司经营规范，信誉良好，资本实力、盈利能力和偿债能力较强，与商业银行保持良好的合作关系，有充足的银行授信额度，具备较强的短期和中长期融资能力，可以通过多种监管许可的融资方式，筹集经营所需资金。

(六) 审计情况

1. 非标准审计意见说明：

适用 不适用

2. 关键审计事项说明：

适用 不适用

(七) 会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正

适用 不适用

会计政策变更情况详见本报告所附财务报表附注 五、会计政策和会计估计变更以及前期差错更正的说明。

(八) 合并报表范围的变化情况

适用 不适用

合并报表范围的变化情况详见本报告所附财务报表附注 七、其他原因的合并范围变动。

（九） 企业社会责任

1. 精准扶贫工作情况

√适用 □不适用

（1）精准扶贫规划

公司坚持以新时代中国特色社会主义思想为指引，全面贯彻落实党的十九大精神，积极落实《中共中央国务院关于打赢脱贫攻坚战的决定》《“十三五”脱贫攻坚规划》和《中国证监会关于发挥资本市场作用服务国家脱贫攻坚战略的意见》，响应资本市场服务国家脱贫攻坚战略，将精准扶贫工作作为一项重要的政治任务抓牢抓实抓出成效。

公司认真制定了精准扶贫工作方案，明确工作主要任务，在 2020 年新结对了 1 家国家级贫困县，与对口帮扶地区签订战略合作协议，保障扶贫工作的落实。开展教育扶贫，继续推进“自强班”项目，资助建档立卡贫困家庭学子完成学业；增加对贫困地区教育基础设施建设投入，支持贫困地区幼儿园、小学办公教学设备、线路检修、食堂设备改造等。依托金融领域专业优势，与当地政府建立长效帮扶机制，完善当地金融业布局，支持贫困地区企业利用多层次资本市场融资，帮助当地居民投资理财和开展投资者教育工作等。

（2）精准扶贫概要

报告期内，公司多措并举扎实推进各项扶贫工作，以“一司一县”结对帮扶为重点，从产业扶贫、金融扶贫、消费扶贫、公益扶贫、智力扶贫等方面，共同打好精准扶贫“组合拳”，提高扶贫工作的专业性、针对性和精准度。

扶贫工作小组成员赴贫困地区走访当地困难群众，调研当地企业，利用自身专业优势，充分挖掘、提升当地企业的潜力，支持当地企业利用多层次资本市场进行融资，同时开展多个精准扶贫项目。全年，公司累计公益性支出款项 756.63 万元，取得了较好的救助效果，通过发行扶贫专项公司债券，共募集资金 5 亿元。

（3）精准扶贫成效

1) 扎实推进“一司一县”结对帮扶工作。2020 年 8 月，公司与陕西白河县结成“一司一县”帮扶关系，积极做好河南洛宁县、河南嵩县、湖南汝城县、贵州黄平县等七个国家级贫困县的帮扶工作。一是分别在陕西白河县、新疆维吾尔自治区麦盖提县、河南嵩县开展消费扶贫，采购当地特色农产品合计 205.9 万元；二是在河南洛宁县、河南嵩县、湖南汝城县，积极开展智力扶贫，进行资本市场教育、培训、沟通交流活动；三是出资 30 万元，在新疆维吾尔自治区麦盖提县、湖南保靖县、陕西白河县开展高中生“自强班”资助项目，帮助共 150 名贫困高中生完成学业；四是在河南洛宁县、河南嵩县、湖南汝城县、贵州黄平县等 7 个帮扶贫困县推进“希望工程”舞蹈教室项目建设；五是持续为对口帮扶地区的贫困家庭提供唇腭裂患儿的医疗救助。

2) 积极参与其他扶贫工作。报告期内，公司作为簿记管理人及主承销商发行贵州安龙县宏源国有资产经营有限责任公司 2020 年非公开发行扶贫专项公司债券（保障性住房）（第一期），共募集资金 5 亿元，对促进当地人口向城镇集聚、改善居民住房条件发挥了重要作用。继续为金晋农牧（湖南汝城县）、利民生物（安徽金寨县）两家新三板挂牌公司提供持续督导服务。为切实增加山西隰县贫困户收入，在当地开展消费扶贫，推进玉露香梨产业发展，采购玉露香梨合计 30.78 万元。

3) 积极做好各类公益帮扶活动。一是全力助力打赢防疫攻坚战。2020 年初，面对新冠肺炎疫情带来的挑战，东海证券在认真做好员工防护工作的前提下，联合东海基金、东海期货，通过常州慈善总会捐款 500 万元，其中 300 万元用于驰援湖北武汉抗疫前线，200 万元用于常州本地的抗疫工作。同时，公司党委广泛号召各级党组织、广大党员、员工全力筹集口罩、防护服等医疗物资支援疫区，向甘肃甘南地区中心小学捐助 7 万元用于购置防疫物资；二是积极支持贫困地区教育事业，改善学习环境。东海证券共出资 19 万元，分别在青海玉树地区小学建立爱心食堂，帮助甘肃甘南地区小学进行教育基础设

施建设，向上述地区儿童捐赠中秋月饼等；在云南永平县两所小学开展对口帮扶，捐赠款项 4 万元；三是在江苏常州地区，积极投入新一轮茅山老区“百千万”帮扶工程，从土地和环境治理、促进农户增产增收、盘活闲置资源等方面入手，持续开展对溧阳上兴镇毛家村的结对帮扶工作；四是响应常州慈善总会号召，大力弘扬慈善精神，参与“慈善一日捐”活动，捐款 33200 元；响应江苏省证券行业协会号召，出资 43.9 万元采购湖北滞销农产品，向湖北农户伸出援手。

（4）后续精准扶贫计划

2020 年是我国现行标准下人口脱贫、贫困县摘帽、解决区域性整体贫困的收官之年，至 2020 年 11 月 23 日，全国 832 个国家级贫困县全部脱贫摘帽。公司将认真贯彻党中央、国务院的扶贫攻坚精神，认真谋划巩固拓展脱贫攻坚成果，全力做好后续扶持工作，以实际行动为服务国家脱贫攻坚战贡献力量。

1) 扎实做好“一司一县”帮扶工作。以“一司一县”结对帮扶为扶贫工作落脚点，继续保持人员与物力的投入。对帮扶贫困县持续开展高中生“自强班”、“希望工程”音乐舞蹈教室、“唇腭裂”儿童救助、资本市场教育与消费扶贫等项目，打好精准扶贫“组合拳”，提高扶贫工作的专业性、针对性和精准度。

2) 持续开展公益帮扶工作。加大对贫困人口及存在返贫风险、致贫风险人群的帮扶力度，在青海玉树、甘肃甘南等地，牵手帮扶贫困学区进行爱心物资及款项捐助。支持贫困地区特色产品，充分利用消费扶贫平台帮助贫困地区特色产品拓宽销售市场，支持当地产业发展。

3) 以金融扶贫创新发展模式，服务国家战略实施。通过投资银行业务加强对贫困地区重点企业的辅导、培育和发展特色产业，借助资本市场支持当地产业升级和经济结构转型；帮助贫困地区拟上市企业规范公司治理，支持贫困地区企业进行 IPO 融资和并购重组，在股权融资、债券融资、并购重组、资本投资等各个领域，提高贫困地区利用资本市场促进经济发展的能力。利用集固定收益、证券发行、承销、投资研究于一体的专业能力，承销贫困地区包括企业债、公司债、地方政府债券等在内的各类债券；协助地方政府规范举债融资行为，解决债务问题，促进地方经济发展，该项工作也是近年来党中央、国务院高度重视的工作之一。

2. 其他社会责任履行情况

在保护股东合法权益方面，公司严格按照规章制度进行信息披露工作，《东海证券股份有限公司信息披露管理制度》、《东海证券股份有限公司投资者关系管理制度》、《东海证券股份有限公司内幕信息知情人登记制度》等规章制度得以有效实施，切实保护中小股东权益，保证其充分的知情权，确保信息披露的公平性，确保所有股东尤其是中小股东能够充分行使自己的权利。

在保护债权人合法权益方面，公司制定了具有针对性、可行性的偿债计划，采取了多项有效的偿债保障措施，以确保债券本息的按时、足额偿付，最大限度的保护债券持有人权益，未出现债务违约或延期支付债券本息的情况。

在保护客户合法权益方面，公司根据相关法律法规要求，缴纳投资者保护基金，积极开展投资者教育，充分揭示市场风险，引导投资者树立正确的投资理念，加强投资者适当性管理培训，对网上交易客户端持续优化升级，保护投资者合法权益。

在保护职工合法权益方面，公司工会注重维护职工合法权益，坚持职工代表大会制度。职工通过职工代表大会参与公司经营管理，劳动关系和谐，切实保障职工权益。公司还积极开展各类文体活动，关注职工身心健康。

在日常办公方面，公司坚持贯彻使用信息化管理平台、在线学习平台等，充分利用网络平台、视频系统等开展日常工作，降低办公支出。此外，公司还倡导节能减排，推行绿色办公，严格控制水电、耗材使用，降低不必要的照明亮度，优化空调开启时间。

三、 持续经营评价

报告期内，公司法人治理结构完善，内部控制机制健全有效，公司的经营状况稳健，财务比率健康，营业收入、营业利润等财务指标正常。不存在可能对公司未来持续经营假设产生重大影响的事项或者情况。

四、 未来展望

是否自愿披露

是 否

五、 风险因素

(一) 持续到本年度的风险因素

1、公司经营活动中面临的具体风险

公司业务经营活动中面临的风险主要有合规风险、市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、声誉风险等，具体如下：

(1) 合规风险

合规风险是指因公司的经营管理或工作人员的执业行为违反法律、法规或准则而使公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。

根据《证券法》、《证券公司监督管理条例》等法律、法规和监管政策规定，证券公司在开展证券经纪、保荐与承销、自营业务、资产管理、投资咨询以及创新业务等业务时都要受到中国证监会等监管机构的监管。如公司在经营中违反有关的法律、法规和监管政策，可能会受到罚款、暂停或取消业务资格等方面的行政处罚，也可能因业务经营违法、违规等引起民事诉讼并导致承担民事赔偿责任。随着监管要求趋严，行业合规风险越显突出。

(2) 市场风险

市场风险是指因市场价格、价差变化或其它市场因子变化对公司资产、负债或收入可能产生不利影响或损失的风险。证券市场受宏观经济、政治、国际市场以及投资者心理等诸多因素的影响，市场波动频繁。公司自营业务以股票投资、债券投资、衍生品投资为主，收益来源主要依靠低买高卖，对市场单边上涨依赖较强，在市场单边下跌的情况下，公司投资收益将面临减少的风险。

(3) 流动性风险

流动性风险是指证券公司无法以合理成本及时获得充足资金，以满足偿付到期债务、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。若公司对自有资金流动性缺乏统一规划和安排，发生投资银行业务大额包销、自营业务投资规模过大、长期投资权重过高等事项，又不能及时获得足额融资款项，将会给公司带来流动性风险。

(4) 信用风险

信用风险是指由于债券发行人、交易对手、债务人违约或信用评级、履约能力下降，给公司带来损失的风险。公司的信用风险主要来自资金拆借、债券投资、融资融券、约定购回、股票质押式回购、债权投资、代理买卖证券和金融衍生品投资等业务。受到国内债券市场违约日趋常态化、特定领域风险集中爆发和部分行业景气度下滑等因素影响，公司承担的各类信用风险也日趋复杂，信用风险日益增大，对公司信用风险管理提出了更大的挑战。

(5) 操作风险

操作风险，是指由于不完善的流程、人员、信息系统和外部事件因素给公司造成损失的风险。操作风险贯穿于公司各部门及业务条线（包括前台业务部门和中后台支持部门），具有覆盖面广、种类多样的特点。公司虽然积极优化公司内部制度流程，加强员工培训，完善系统建设和安全防范措施，但仍面

临一定的操作风险。

(6) 声誉风险

声誉风险是指因公司经营管理及其他行为或外部事件导致公司股东、员工、客户、第三方合作机构、监管机构、媒体及公众等对公司负面评价的风险。近年来证券市场声誉事件逐渐增多，随着互联网快速发展，新闻和信息传播方式发生巨大变化，舆情信息更加多元化，隐蔽性、不可控性、交互性均显著增强，对公司声誉风险管理工作提出了新的挑战。

2、防范风险因素的对策和措施

报告期内，公司持续推进全面风险管理体系建设，围绕监管要求，继续贯彻落实债券投资交易业务、投资银行类业务内控指引和信用风险管理指引等要求，公司重点落实新的《证券公司风险控制指标计算标准规定》，顺利完成风险控制指标动态监控系统升级改造项目，保障新规实施。公司积极推进内部信评体系建设，制定、修订内评管理制度，完善内部信用评级系统功能，为信用风险管理提供有效管理工具。公司优化风险管理组织架构，修订完善专项风险管理制度，为风险管理提供制度保障。针对新业务、新产品建立内部评估论证和审查机制，在管理制度和操作流程中明确风险控制措施，同时加强各类业务的事前评估、事中监测、事后排查，及时预警并积极处理存量风险。报告期内，公司风险控制指标持续达标，各项业务持续健康发展。

(1) 全面风险管理体系推进工作

有效落实全面风险管理，既是监管要求，更是公司长期稳定发展的需要。公司从战略发展角度出发，结合实际情况，积极落实全面风险管理建设的相关要求，从组织架构、制度政策、人员配备和系统建设等方面持续加大投入。

1) 风险管理组织体系

公司建立组织健全、职责边界清晰的四级风险管理组织架构体系，由董事会及其风险控制委员会、监事会、经营管理层及其下设的各专业委员会、风险管理部门（风险管理部及其他各类专业风险管理部门）、其他各部门、分支机构及子公司组成，形成多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制。公司首席风险官负责全面风险管理工作，风险管理部门在首席风险官的领导下推动全面风险管理体系建设，根据法律法规要求和职责定位履行相应风险管理职能，实现各风险类型管理全覆盖。各业务和职能部门负责本部门的风险自控，履行一线风险管理职责，在各自职责范围内承担风险管理责任。

2) 风险管理制度

公司风险管理制度自上至下覆盖各风险类型、各业务条线的风险管理制度。主要包括：

董事会层级的《东海证券股份有限公司全面风险管理制度》，明确了全面风险管理目标、管理原则、组织架构及职责、管理政策与机制等；

公司层级的《东海证券股份有限公司市场风险管理办法》《东海证券股份有限公司信用风险管理办法》《东海证券股份有限公司流动性风险管理办法》《东海证券股份有限公司操作风险管理办法》《东海证券股份有限公司声誉风险管理办法》等专项风险管理制度，明确了各类风险管理的规范和方法；同时，公司根据实际情况制定《东海证券股份有限公司子公司全面风险管理工作指引》《东海证券股份有限公司压力测试指引》《东海证券股份有限公司内部信用评级管理办法》《东海证券股份有限公司非标投资业务投后管理指引》等具体管理指引和细则，明确具体风险管理流程和主要管控措施；

在业务条线层级，公司各部门结合实际工作和业务开展情况，制定了相应业务风险管理办法和管控细则，包括但不限于自营业务、融资融券业务、股票质押业务、资产管理业务等，完善了公司全面风险管理制度体系。

3) 风险管理人员配备

2020年，公司继续加强风险管理人才队伍建设，公司按照《证券公司全面风险管理规范》要求，结合行业内风险管理部门设置和自身实际情况，在子公司设立风险管理负责人，在资产管理部、权益投资部和固定收益部等重要部门派驻专职风控人员，在其他部门指派风险管理兼职人员。公司重新规划了风险管理部门的组织架构，在风险管理部下设总量风险管理、市场风险管理、信用风险管理等六个团队，构

建了多层次风险管理人员体系。公司通过修订《东海证券股份有限公司风险管理人员管理办法》进一步明确风险管理人员任职要求、工作职责和行为规范，通过内外部风险培训提高风险管理人员对风险的敏锐度和预判能力。

4) 风险管理指标体系

公司风险管理部门不断完善公司风险管理指标体系建设，在公司层面，结合自身发展战略、市场情况及风险状况变化，自上而下建立了涵盖年度风险偏好、风险容忍度及重大风险限额的风险管理指标体系，并经董事会、经营管理层或其授权委员会审批后，逐级分解至各部门、分支机构及控股子公司。在业务层面，公司在各业务部门、业务条线和交易策略等不同层级均设置了相应风险限额指标。公司目前已建立包括监管限额、止损限额、敏感性指标限额、交易限额、资金限额、集中度限额等在内的风险限额体系，基本涵盖了市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险等重要风险类型。

5) 风险管理信息技术系统建设

高效的信息技术系统在提升风险识别效率、扩大风险监测范围、提高风险管理工作效率方面能够发挥巨大作用。2020年，根据《证券公司全面风险管理规范》的要求，公司通过自主研发和外部引进的方式建立了覆盖各风险类型、各业务条线、各部门、分支机构及控股子公司的风险管理信息系统，主要包括业务系统风险控制功能模块、专项风险管理平台、风险监控综合管理平台、风险管理驾驶舱平台等各类风险管理系统。公司完成了风控指标动态监控系统升级改造和信用风险内评系统升级等重点项目，同时根据监管政策不断拓展现有风险管理系统监控范围，根据监管政策进一步完善债券监控系统功能，自主设计研发债券类风险监测功能模块，持续提升公司风险监测水平，确保风险管理系统的有效性和监控全面性。

公司积极探索信息技术与日常风险管理工作的有效结合，不断梳理优化风险管理流程，并致力于借助金融信息技术手段不断提升风险管理工作效率。

6) 风险应急与应对

公司在风险识别和风险评估的基础上，综合平衡风险与收益情况，选择与公司风险偏好和风险容忍度相适应的风险回避、降低、转移和承受等应对策略。建立合理、有效的资产减值、风险对冲、资本补充、规模调整、资产负债管理等风险应急应对机制。

对于突发风险事件，公司制订了突发事件应急处理办法，明确突发事件类型、应急管理组织架构和应急处理流程。公司各部门制定突发事件应急处理流程或方案，按照统一领导、统一组织、快速反应、协同应对原则，积极处置突发风险事件，并通过定期或不定期应急演练不断提高风险应对能力。

(2) 各类风险的具体管理

1) 合规风险管理

公司通过建立切实可行的合规管理体系，实现对合规风险的有效识别、评估和管理，形成合规考核、培训等长效机制，为公司各项业务依法合规经营提供有效支持和监督。

2) 市场风险管理

主要从授权管理、风险评估、风控指标监测、风险对冲与隔离等方面来控制公司的市场风险。

授权管理：董事会每年确定公司总体风险偏好、风险容忍度和总体风险限额；公司风险管理委员会每年下达各业务风险限额补充指标；公司各业务条线投资决策委员会、投资决策小组制定具有可操作性的风控指标，确保业务开展中的权利有效制衡。

风险评估：公司主要采取计算灵敏度指标及压力测试等方式定期或不定期对公司的市场风险承受能力进行测试，针对市场大幅波动带来的风险，加大测算频率，确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。

风控指标监测：通过生产系统和风险管理系统对市场风险的动态变化进行逐日监控和报告。重点关注风险限额、投资集中度、止盈止损等关键风控指标的变动情况，以及特定头寸、组合的风险价值、极端不利情况下可能承受的损失等，并就超限额情况及时汇报，并作出相应处理措施。

风险对冲与隔离：公司积极研究多因子量化投资等市场中性策略，加强对新业务的研究，灵活使用

金融衍生品对冲系统性市场风险；公司还通过建立隔离墙制度，对公司各业务的人员、信息、物理、财务账户等进行隔离，防止市场风险蔓延到公司其他业务模块。

报告期内，公司未发生重大市场风险事件。

3) 流动性风险管理

主要通过加强风控指标监测、日间流动性管理、融资管理等措施防范流动性风险。

风控指标监测：公司严格按照监管风控指标要求开展业务，并设定了严格的预警指标。定期开展流动性风险专项压力测试，监测公司对流动性风险的承受能力。

流动性日常管理：每日编制资金头寸日报、定期汇总资金计划表、进行日间资金盯市、完成自营业务交收工作；按日监控流动性覆盖率、净稳定资金率两项流动性监管指标；编制公司现金流预测表，关注资金缺口并进行及时补充。

融资管理：公司积极拓展融资渠道，及时补充资本及流动资金，提高资金实力。通过增加授信、收益权转让、发行收益凭证和同业拆借等方式及时融入资金。持续监控短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的现金储备和可供随时变现的有价证券，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求，防范公司流动性风险。

报告期内，公司未发生重大流动性风险事件。

4) 信用风险管理

主要采取信用评估、交易对手管理、尽职调查、指标监测、合同管理等方式控制信用风险。

信用评估：在融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易等信用交易业务中，重点加强客户适当性管理，通过征信评级全面了解客户资信水平和风险承受能力，综合确定客户信用评级及授信额度；在债券投资、债券回购等业务中，持续推进内部信用评级体系建设，完善信用风险管理系统，主要体现在舆情监测、负面清单管理、信用风险预警和信用评级模型等方面。报告期内，公司成功实施信用风险内部评级咨询项目，通过引进专业信用评级解决方案，结合公司业务开展情况，完善公司内评体系。

交易对手管理：选择资本实力强，盈利状况好，管理和运作规范、信用良好的交易对手进行交易，减少不良交易对手产生的风险；对融资融券等信用交易业务客户，建立客户准入和征信标准，通过对客户的身份特征、资产情况、投资偏好、投资能力、资信状况进行评价，严格执行信用授信和跟踪管理，建立信用客户灰名单及黑名单制度等；在债券回购业务中，建立交易对手管理制度，定期更新白名单，并对不同交易对手实行额度管控。报告期内，公司与各个交易对手方的业务开展规模均未出现超出限额的情形，未出现交易对手违约。

尽职调查：在固定收益证券承销与投资中，对债券的发行人进行分析，跟踪研究发行人的偿债能力，规避兑付风险。信用类融资业务方面，业务人员加强前期尽职调查，提交全面的项目可行性分析报告、尽职调查报告，经公司审核通过后方可实施。

风控指标监测：在固定收益证券投资中，债券持有量严格控制在公司及监管机构规定的范围内，尽可能减少发行人的偿付风险；在信用交易业务中，通过规模、集中度等控制，减少单一品种、单一业务或单一客户的信用风险。针对市场大幅波动带来的系统性风险，公司及时调整监测指标与阈值，并进一步加强融出资券履约保障比例的监控，发现异常时及时与客户沟通反馈，避免客户违约给公司造成损失。

合同管理：公司在合同订立的过程中严格贯彻公司的有关制度，实行分级审批，防止欺诈或不公平条款产生的合同风险。

存续期管理：公司重视投行类业务项目风险，组织人员研究业务监管规则，加强存续期项目信用风险管理。建立了日报送机制，要求相关部门通过多重渠道定期跟踪反馈，分析评估债券项目情况并提供分析模板，切实防范信用风险。

报告期内，公司的信用类业务未出现新增违约情形。

5) 操作风险管理

主要通过制度流程、授权与制衡、系统建设、内部培训等措施控制操作风险。

制度流程：对传统业务与新业务，公司建立和完善各项业务制度、操作流程和对应的业务表单，梳理各业务的操作风险点，制定相应的控制措施并通过流程予以固化；同时通过部门自查、合规风控复查，内部稽查不断查漏补缺，优化完善内部流程。

授权与制衡：明确界定部门、分支机构及不同工作岗位的目标、职责和权限，体现重要部门、关键岗位之间分离、制衡及相互监督的原则；建立健全授权管理制度，明确授权的范围、方式、权限、时效和责任，并建立相应的授权反馈制度，确保授权管理的有效落实。

内部培训：组织操作风险系统培训，重点讲解关键风险指标和系统操作，增强风控人员操作风险管理意识，提升操作风险防控及应对能力。

报告期内，公司未发生重大操作风险事件。

6) 声誉风险管理

主要通过制度流程、舆情监控等措施控制声誉风险。

组织架构：为加强公司声誉风险管理，公司将二级部门新闻媒体部从综合管理部移至办公室，统一加强对外宣传。

制度流程：公司修订了《东海证券股份有限公司新闻宣传工作管理办法》，规范新闻发布及媒体沟通机制，强化声誉风险舆论引导。

舆情监控：做好日常舆情监测与危机处理工作，持续加强对负面舆情的监控能力，舆情监控频率从过去的一日一次，调整为实时监控；积极开展媒体关系搭建工作，主动维护媒体关系。

(二) 报告期内新增的风险因素

无。

六、 动态风险控制指标监控及补足机制建立、达标情况

根据《证券公司风险控制指标管理办法》的相关规定，公司在不断完善以净资本和流动性为核心的风险控制指标体系的基础上，加强对净资本等主要风险控制指标的动态监控，按月向监管机构报送月度净资本计算表、风险资本准备计算表、表内外资产总额计算表、流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表和风险控制指标计算表。在报告期内，公司净资本等主要风险控制指标均持续达标。

(一) 风险控制指标动态监控情况

公司建立了风险控制指标动态监控机制，主要通过风险控制指标动态监控系统实施监控，同时根据变化情况及时采取有效措施，实现对风险控制指标准确计量、动态监控和及时预警的管理目标。报告期内，公司按照《证券公司风险控制指标计算标准规定》新规要求，顺利完成风险控制指标动态监控系统的升级改造，保障了风险控制指标的动态监控。报告期内，净资本等主要风险控制指标与上月相比变动发生不利变化超过 20% 的情形共出现 19 次，上述指标变化均为常规报告，属于正常指标变动范围，对公司风险控制指标无重大影响，公司均已按照相关规定及时向监管机构书面报告说明情况。

(二) 风险控制指标压力测试情况

公司建立健全了压力测试机制，定期或不定期组织开展综合压力测试和专项压力测试工作，覆盖余额包销、增资、限额调整、新业务开展等事项，测算压力情景下净资本和流动性等风险控制指标、财务指标、内部风险限额及业务指标的变化情况，评估风险承受能力。报告期内，公司风险管理部门进一步梳理各类风险因子、完善风险压力测试参数，共实施综合压力测试 1 次，开展专项压力测试 40 余次，出具分析报告并提出应对建议。为业务规模调整、子公司增资等提供了决策依据。

(三) 净资本补足机制

报告期内，公司积极拓展融资渠道，及时补充流动资金，完善资本补足机制。通过增加授信、发行

次级债券、收益权转让、发行收益凭证和同业拆借方式及时融入资金。同时通过不断优化资产负债结构，调整净资本高消耗性的业务规模，以满足公司业务发展及监管指标需要。2020年6月，公司发行了8亿元三年期次级债，补充公司净资本，为公司业务发展提供持续支撑。

七、 合规风控、信息技术投入情况

公司重视合规风控体系建设，加强系统投入和合规风控人员配备，保障公司经营业务的合法合规，按照母公司口径，公司合规风控投入主要包括：合规风控相关系统购置和开发支出、合规风控部门日常运营费用以及合规风控人员投入等。2020年，公司合规风控投入总额为4,219.5万元。

公司投入大量资源提高信息技术、优化信息系统，以提供安全、稳定及个性化的服务，保障和支持业务发展。公司信息技术投入主要包括（按照证券公司信息系统建设投入指标统计口径）：IT投入固定资产和无形资产的折旧摊销费用、IT日常运营费用、机房租赁费用、IT线路租赁、IT自主研发费用以及IT人员投入等。2020年，公司信息技术投入总额为10,627.03万元。

八、 其他重要经营情况

（一）子公司、分公司、营业部和特殊目的主体等设立和处置情况

1、营业部设立和处置情况

（1）2020年9月，公司撤销洛阳嵩县白云大道证券营业部。

（2）2020年9月，公司撤销石狮宝岛中路证券营业部。

（3）2020年6月，公司临沂金雀山路证券营业部同城迁址至山东省临沂市兰山区金雀山路10号开元上城国际B座1层106室。

（4）2020年6月，公司洛阳中州东路证券营业部同城迁址至洛阳市老城区九都东路321号曼哈顿广场1#楼4楼，同时更名为：东海证券股份有限公司洛阳九都东路证券营业部。

（5）2020年8月，公司珠海吉大路证券营业部同城迁址至广东省珠海市吉大路63号一层商场。

（6）2020年12月，公司洛宁永宁大道证券营业部同城迁址至河南省洛阳市洛宁县永宁大道北侧紫竹大厦一楼。

（7）2020年12月，公司上海浦东新区世纪大道证券营业部同城迁址至中国（上海）自由贸易试验区苗圃路63号2层202室，同时更名为：东海证券股份有限公司上海浦东新区苗圃路证券营业部。

2、分公司设立和处置情况

因经营发展需要，经第三届董事会第五次（临时）会议审议通过《关于成立资产管理部的议案》，公司撤销了东海证券股份有限公司上海证券资产管理分公司并新设资产管理部，上海证券资产管理分公司职能由资产管理部承接，并于2020年6月22日在上海市浦东新区市场监督管理局完成正式注销。

3、子公司设立和处置情况

2019年9月12日，公司第二届董事会第四十八次（临时）会议审议通过了《关于向全资子公司东海国际金融控股有限公司增资的议案》，同意公司对全资子公司东海国际金融控股有限公司增资7亿元港币，将东海国际金融控股有限公司注册资本由3亿元港币增加至10亿元港币。2020年3月，上述事项在香港公司注册处完成注册登记手续。

2019年11月14日，公司第二届董事会第五十二次（临时）会议审议通过《关于全资子公司东海投资有限责任公司减资的议案》，同意将公司全资子公司东海投资有限责任公司注册资本由人民币10.2亿元减少至人民币6亿元。2020年2月，上述事项在上海完成工商变更登记。

2020年3月27日，公司三级全资子公司东海国际期货（香港）有限公司在香港公司注册处完成注册撤销并解散。

2020年4月20日，东海证券第三届董事会第四次会议审议通过了《关于注销东海投资有限责任公司下属子公司常州东海产业投资管理有限公司的议案》，2020年7月，上述事项在常州完成注销登记手续。

2020年5月15日，公司三级全资子公司东海国际财务（香港）有限公司在香港公司注册处完成注册撤销并解散。

2020年8月6日，东海证券第三届董事会第八次（临时）会议审议通过了《关于转让深圳市东海天富投资有限公司股权的议案》，目前转让事项正在办理过程中。

2020年9月24日，公司三级全资子公司东海全球科技（深圳）有限公司在深圳完成工商注销并解散。

2020年10月22日，东海证券第三届董事会第十次（临时）会议审议通过了《关于向全资子公司东海证券创新产品投资有限公司增资的议案》，同意对全资子公司东海证券创新投增加5亿元注册资本的事项，2020年11月，上述事项在上海完成工商变更登记。

4、公司控制的特殊目的主体情况

无。

（二）业务创新情况

无。

（三）其他

报告期内，公司无破产重整，兼并购或分立情况；无重大的资产处置、收购、置换、剥离情况；无重组其他公司情况。

第五节 重大事件

一、 重大事件索引

事项	是或否	索引
是否存在诉讼、仲裁事项	√是 □否	五.二.(一)
是否存在对外担保事项	□是 √否	
是否对外提供借款	□是 √否	
是否存在股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况	□是 √否	五.二.(二)
是否存在日常性关联交易事项	√是 □否	五.二.(三)
是否存在其他重大关联交易事项	□是 √否	
是否存在经股东大会审议过的收购、出售资产、对外投资事项以及报告期内发生的企业合并事项	□是 √否	
是否存在股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施	□是 √否	
是否存在股份回购事项	□是 √否	
是否存在已披露的承诺事项	√是 □否	五.二.(四)
是否存在资产被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的情况	√是 □否	五.二.(五)
是否存在被调查处罚的事项	√是 □否	五.二.(六)
是否存在失信情况	□是 √否	
是否存在应当披露的其他重大事项	□是 √否	
是否存在自愿披露的其他事项	√是 □否	五.二.(七)

二、 重大事件详情（如事项存在选择以下表格填列）

（一） 诉讼、仲裁事项

1、 报告期内发生的诉讼、仲裁事项

□是 √否

单位：元

性质	累计金额		合计	占期末净资产比例%
	作为原告/申请人	作为被告/被申请人		
诉讼或仲裁	622,471,800	145,948,000	768,419,800	8.83%

报告期内，未发生达到净资产 10%及以上的重大诉讼、仲裁事项。

报告期内，涉案金额 5000 万元以上的诉讼、仲裁事项情况如下：

（1） 东海证券与大连机床集团有限责任公司证券纠纷案

1) 公司管理的“东海证券月月盈集合资产管理计划”持有“15 机床 CP004”票面金额 2,000 万元，因大连机床集团有限责任公司（以下简称“大连机床”）未能到期支付债券本息，公司于 2017 年 10 月向常州市天宁区人民法院提起诉讼。2018 年 4 月 19 日，法院判决公司胜诉，判决大连机床向公司支付债券本金 2,000 万元及利息 140 万元。

2) 公司管理的“东海证券月月盈集合资产管理计划”持有“16 大机床 SCP003”票面金额 5,000 万元，因大连机床未能到期支付债券本息，公司于 2017 年 10 月向常州市中级人民法院提起诉讼。2018

年 12 月 20 日，法院判决公司胜诉，判决确认公司对大连机床享有债权 53,795,402.08 元。之后对方提起上诉，江苏省高级人民法院于 2019 年 6 月 14 日对本案开庭审理，并于 2020 年 5 月 29 日作出判决，判决维持一审判决中第一项、第三项及案件受理费部分，撤销一审判决中第二项。

鉴于大连机床系列企业处于破产重整阶段，报告期内，公司债权尚未得到清偿。

(2) 东海证券与中科建设开发总公司证券纠纷案

公司管理的“东海证券月月盈集合资产管理计划”于 2018 年 10 月 20 日购入中科建设开发总公司（以下简称“中科建设”）发行的“16 中科建设 PPN001”票面金额 5000 万元，以及“16 中科建设 PPN002”票面金额 5000 万元。2018 年 11 月 19 日，中科建设未按期支付债券利息并相应发布公告后，公司向中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。中国国际经济贸易仲裁委员会于 2018 年 11 月 29 日受理仲裁申请。2019 年 5 月，公司收到仲裁委员会作出的胜诉裁决，并向法院申请执行。2019 年 12 月 5 日，上海金融法院出具《执行裁定书》，法院认为经穷尽财产调查措施，未发现被执行人有可供执行的财产，故裁定终结本次执行程序。2020 年 10 月 10 日，上海市第三中级人民法院受理中科建设破产重整一案。2021 年 1 月 15 日通过网络视频会议召开了第一次债权人会议。

报告期内，公司债权尚未得到清偿。

(3) 东海证券与凯迪生态环境科技股份有限公司公司债券交易纠纷案

1) 公司管理的“盈多多集合资产管理计划”认购了凯迪生态环境科技股份有限公司（以下简称“凯迪公司”）发行的“16 凯迪 01”债券，券面金额为人民币 5,000 万元。后凯迪公司未按时足额支付回售款及利息，公司已向湖北省武汉市中级人民法院提起诉讼。法院于 2018 年 12 月 03 日受理立案，2019 年 4 月 22 日，武汉市中级人民法院出具（2018）鄂 01 民初 5009 号判决书，判决中法院支持了公司所有的诉讼请求，要求凯迪生态环境科技股份有限公司与判决生效之日十日内向公司支付债券本金 5,000 万元、利息 305 万元、律师费 15 万元以及自 2018 年 9 月 8 日起至债券还本付息的利息（5,000 万为本金，年利率为 6.10%），本案已结案进入执行阶段，目前未执行到款项。

2) 东海证券月月盈产品持有凯迪公司发行的“11 凯迪 MTN1”债券，券面总额共计人民币 4,000 万元。后凯迪公司发布未按期支付债券本息公告，公司已向常州市天宁区法院提起诉讼。法院于 2018 年 9 月 26 日受理立案，2019 年 6 月 14 日天宁区法院开庭审理，2019 年 9 月 12 日，常州市天宁区人民法院出具（2018）苏 0402 民初 5231 号判决书，判决中法院支持了东海证券诉讼请求，要求凯迪生态环境科技股份有限公司与判决生效之日十日内向东海证券支付债券本金 4000 万元和债券利息 250.8 万元及相关损失（以 4250.8 万元为基数，按年利率 6.27% 的标准自 2018 年 5 月 8 日起计算至实际清偿之日止），本案已结案进入执行阶段，目前未执行到款项。

(4) 东海证券与辅仁药业集团有限公司公司债券交易纠纷案

辅仁药业集团有限公司（下称“辅仁集团”）于 2016 年 10 月 17 日在银行间债券市场公开发行了金额为 3 亿元的“辅仁药业集团有限公司 2016 年度第三期非公开定向债务融资工具”，公司于 2018 年购入该债券共计面值人民币 48,000,000 元。之后辅仁集团未严格履约，公司向中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。中国国际经济贸易仲裁委员会已于 2020 年 1 月 17 日开庭审理，并于 2020 年 6 月 5 日作出裁决书，裁决公司胜诉，辅仁集团应向公司支付债券本金 4,800 万元及利息、违约金。公司向法院申请强制执行。报告期内，本案尚未执行完毕。

(5) 东海国际金融控股有限公司与优源国际控股有限公司、柯文托金融借款合同纠纷案

优源国际控股有限公司（以下简称“优源国际”）系由柯文托作为创始人在开曼设立，并于 2010 年在香港交易所主板上市（股票代码：2268）。2018 年 1 月 23 日，优源国际因资金使用需要向东海国际金融控股有限公司（以下简称“东海国际”）发行了本金总额为 22,000,000 美元的有担保可换股债券（下称“债券”），东海国际金融控股有限公司、优源国际控股有限公司、柯文托就此债券发行分别签订了《Subscription Agreement》《Deed of Guarantee》，同意就优源国际向东海国际发行的债券提供不可撤销的且无条件的保证责任。优源国际就债券发行事项在香港交易所进行公告。协议签订后，东海国际依约提供相应款项，优源国际未能按期归还全部款项。经各方协商，就债券延期事项，优源

国际于 2019 年 1 月 31 日向东海国际出具了书面的无条件的《Promissory Note》，同时柯文托向东海国际出具了书面的《Guarantee》，优源国际承诺将根据《承兑付款票据》所列条件于 2019 年 4 月 30 日向东海国际支付 23,800,000 美元、利息及其他应付款项用于偿还未赎回的债券本金、东海国际持有期间的全部利息及其他相关费用。

之后，优源国际仅于 2019 年 4 月 18 日归还过 500,000 美元后再未支付任何款项。因优源国际未能按约履行，东海国际向法院提起诉讼。福建省泉州市中级人民法院已于 2019 年 11 月 1 日受理本案，并于 2020 年 11 月 19 日作出（2019）闽 05 民初 1968 号民事判决书，判决：（1）优源国际于判决生效之日起十日内向东海国际偿还本金美元 2330 万元及相应利息；（2）优源国际于判决生效之日起十日内向东海国际支付为实现本案债权支出的费用人民币 550,440.87 元；（3）柯文托对优源国际前述两项债务的清偿承担连带保证责任。本案受理费人民币 1,012,276.3 元及财产保全费人民币 5,000 元由优源国际、柯文托共同负担。该判决于 2021 年 2 月 12 日已生效，已开始准备执行程序。

（6）东海证券与博道基金管理有限公司证券虚假陈述责任纠纷案

洪业化工集团股份有限公司（以下简称“洪业化工”）于 2016 年 12 月 2 日发行洪业化工集团股份有限公司公开发行 2016 年公司债券（第一期）（债券简称：16 洪业 02，证券代码：136853，以下简称“系争债券”或“16 洪业 02”），东海证券为系争债券主承销商和受托管理人。博道基金管理有限公司（以下简称“博道基金”）通过管理的产品持有面值为人民币 59,898,000 元的系争债券。后因洪业化工与其他 28 家关联企业进入合并重整程序，根据重整计划，博道基金作为普通债权人，按其债权金额，可获偿人民币 7,123,707.14 元，博道基金向江苏省南京市中级人民法院提起诉讼，要求东海证券向其支付系争债券的本金和利息合计人民币 55,283,904.19 元。本案于 2020 年 4 月 1 日被江苏省南京市中级人民法院受理，分别于 2020 年 8 月 28 日在江苏省南京中级人民法院进行证据交换、2020 年 9 月 23 日、2021 年 2 月 23 日在江苏省南京中级人民法院开庭审理，目前尚未判决。

（7）北京千为投资管理有限公司与东海证券之证券虚假陈述责任纠纷案

洪业化工于 2016 年 12 月 2 日发行洪业化工集团股份有限公司公开发行 2016 年公司债券（第一期）（债券简称：16 洪业 02，证券代码：136853，以下简称“系争债券”），东海证券为系争债券主承销商和受托管理人。北京千为投资管理有限公司（以下简称“千为投资”）通过其管理的产品持有面值为人民币 63,000,000 元的系争债券。后因洪业化工与其他 28 家关联企业合并破产重整，千为投资所持债券未能全额兑付。千为投资向江苏省南京市中级人民法院提起诉讼，要求东海证券向其支付系争债券的本金、利息以及律师费合计人民币 65,948,756.10 元。本案已被江苏省南京市中级人民法院受理后于 2020 年 8 月 12 日通知东海证券应诉，并于 2020 年 9 月 23 日、2021 年 2 月 23 日在江苏省南京市中级人民法院开庭审理，目前尚未判决。

（8）东海证券与中信国安集团有限公司公司债券交易纠纷案

公司管理的“盈多多集合资产管理计划”于 2016 年 12 月 16 日购入中信国安集团有限公司（以下简称“中信国安”）发行的债券“16 中信国安 MTN002”票面金额 5,000 万元，后中信国安严重违反《募集说明书》约定的义务，公司已向常州市中级人民法院提起诉讼。法院于 2019 年 6 月 4 日受理立案。2020 年 5 月 29 日，常州市中院开庭审理本案，并于当日作出判决，判决中信国安向公司支付债券本金 5,000 万元、利息及违约金。公司向法院申请强制执行。报告期内，本案尚未执行完毕。

（9）东海证券与天津航空有限责任公司公司债券交易纠纷案

天津航空有限责任公司（下称“天津航空”）于 2016 年 10 月 17 日在银行间债券市场公开发行了金额为 10 亿元的“天津航空有限责任公司 2016 年度第二期非公开定向债务融资工具”，公司管理的“盈多多集合资产管理计划”于 2017 年 5 月 10 日购入该债券共计面值人民币 50,000,000 元。之后由于天津航空未严格履约，公司向中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，中国国际经济贸易仲裁委员会已于 2020 年 7 月 8 日受理此案，目前尚未开庭，后因天津航空因确认仲裁协议效力无效一案向海南省第一中院提起诉讼，导致本仲裁的仲裁程序中止。

2、以临时公告形式披露且在报告期内未结案件的重大的诉讼、仲裁事项

报告期内，未发生以临时公告形式披露且在报告期内未结案件的、达到净资产 10%及以上的重大诉讼、仲裁事项。公司以临时公告形式披露且在报告期内未结案件的涉案金额 5000 万元以上的诉讼、仲裁事项情况如下：

√适用 □不适用

单位：元

原告/申请人	被告/被申请人	案由	涉及金额	占期末净资产比例%	是否形成预计负债	临时公告报告披露时间
东海证券股份有限公司	辅仁药业集团有限公司	公司债券交易纠纷	50,640,000.00	0.58%	否	2019年11月6日
博道基金管理有限公司	东海证券股份有限公司	证券虚假陈述责任纠纷案	55,283,904.19	0.64%	否	2020年4月8日
东海证券股份有限公司	天津航空有限责任公司	债券交易纠纷案	50,000,000.00	0.56%	否	2020年7月14日
北京千为投资管理有限公司	东海证券股份有限公司	证券虚假陈述责任纠纷案	65,948,756.10	0.76%	否	2020年8月18日
东海国际金融控股有限公司	优源国际控股有限公司	债券纠纷案	171,249,056.57	1.97%	否	2020年12月3日
总计	-	-	393,121,716.86	4.52%	-	-

未结案件的重大诉讼、仲裁事项的进展情况及对公司的影响：

详见本报告“第五节 重大事件 二、重大事件详情（一）重大、诉讼仲裁事项 1、报告期内发生的诉讼、仲裁事项。”

3、以临时公告形式披露且在报告期内结案的重大诉讼、仲裁事项

□适用 √不适用

（二） 股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况

本报告期公司无股东及其关联方占用或转移公司资金、资产及其他资源的情况

（三） 报告期内公司发生的日常性关联交易情况

单位：元

具体事项类型	预计金额	发生金额
财务顾问与投资咨询业务（注1）		200,000.00
存款利息支出（注1）		99,882.75
代销金融产品（注1）		403,748.91
购买或赎回关联方管理的金融产品（注1）		390,809,486.06
固定收益业务中的债券交易和认购、一级市场债券承销（注1）		51,120,000,000.00
关联方认购或赎回公司管理的金融产品（注1）		1,139,964,290.79

手续费及佣金收入（注1）		547,402.47
席位租赁（注1）		0
租赁收入（注2）	253,128.00	281,252.83
总计	253,128.00	52,652,306,063.81

注：

1、东海证券2019年年度股东大会审议同意，因业务的发生及规模的不确定性不能合理预计，2020年度该项关联交易预计金额以实际发生数计算。

2、租赁收入包括报告期内收到的2019年11-12月租赁收入。

（四） 承诺事项的履行情况

承诺主体	承诺开始日期	承诺结束日期	承诺来源	承诺类型	承诺具体内容	承诺履行情况
实际控制人或控股股东	2015年1月8日	-	挂牌	同业竞争承诺	详见《东海证券股份有限公司公开转让说明书》	正在履行中

承诺事项详细情况：

2015年，为避免与本公司之间的同业竞争，常投集团已出具《有关消除或避免同业竞争的承诺函》。承诺事项详见《东海证券股份有限公司公开转让说明书》。报告期内，未出现违反上述承诺的事项。

（五） 被查封、扣押、冻结或者被抵押、质押的资产情况

单位：元

资产名称	资产类别	权利受限类型	账面价值	占总资产的比例%	发生原因
交易性金融资产	交易性金融资产	质押	6,666,798,508.66	15.75%	质押
其他债权投资	其他债权投资	质押	55,599,720.00	0.13%	质押
总计	-	-	6,722,398,228.66	15.88%	-

资产权利受限事项对公司的影响：

交易性金融资产、其他债权投资受限原因是为卖出回购业务、债券借贷业务设定质押，均为正常业务，对公司无重大影响。

（六） 调查处罚事项

1、2020年2月26日，公司收到江苏证监局出具的《关于对彭华采取监管谈话措施的决定》（[2020]26号），主要内容为：彭华担任产品经理期间，公司资产管理业务展业过程中存在个别业务开展过程中未勤勉尽责、信息披露不及时的情形，上述问题违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》（证监会令第93号）第三条、第四十条的规定，彭华为上述问题其他直接责任人员，江苏证监局对彭华采取了

监管谈话的行政监管措施。

2、2020年2月26日,公司收到江苏证监局出具的《关于对彭晓星采取监管谈话措施的决定》([2020]27号),主要内容为:彭晓星担任公司分管资产管理业务的副总裁及资产管理分公司负责人期间,公司资产管理业务展业过程中存在个别业务开展过程中未勤勉尽责、信息披露不及时的情形,上述问题违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》(证监会令第93号)第三条、第四十条的规定,彭晓星为上述问题直接负责的主管人员,江苏证监局对彭晓星采取了监管谈话的行政监管措施。

3、2020年2月26日,公司收到江苏证监局出具的《关于对赵俊采取监管谈话措施的决定》([2020]29号),主要内容为:赵俊担任公司负责人期间,公司资产管理业务展业过程中存在风险控制制度和合规管理制度不健全、个别业务开展过程中未勤勉尽责的情形,上述问题违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》(证监会令第93号)第三条、第七条的规定,赵俊为对上述问题负有责任的高级管理人员,江苏证监局对赵俊采取了监管谈话的行政监管措施。

4、2020年4月29日,公司收到江苏证监局出具的《关于对东海证券股份有限公司采取限制业务活动行政监管措施的决定》([2020]43号),认为公司未有效执行相关业务规则,内部控制存在缺陷。具体表现为:公司在2014年至2017年资产管理业务展业过程中,一是个别业务开展过程中未勤勉尽责;二是风险控制制度和合规管理制度不健全;三是信息披露不及时。上述情况违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》(证监会令第93号)第三条、第七条和第四十条的有关规定,江苏证监局对公司采取了暂停新增私募资管产品6个月的行政监管措施(为接续存量产品所投资的未到期资产而新发行的产品除外)。详见公告(公告编号:2020-043)。

针对江苏证监局提出的问题,公司管理层高度重视,对资产管理业务进行全面梳理自查,认真分析原因,进行了专项整改,完善内部控制机制,全面加强合规及风险管理,积极推进有关资产管理计划的处置。目前,公司已于2021年2月4日收到江苏证监局出具的《关于同意东海证券股份有限公司恢复私募资管业务的函》,公司将持续加强私募资管业务的合规管理与风险控制,严格按计划对私募资管业务进行规范整改。

5、2020年11月4日,公司收到中国证券监督管理委员会浙江监管局(以下简称“浙江证监局”)出具的《关于对东海证券股份有限公司及张宜生、吴逊先采取出具警示函措施的决定》([2020]93号),主要内容为:公司作为华仪电气股份有限公司(以下简称“华仪电气”)持续督导机构,2018年及2019年,华仪电气未按规定用途使用募集资金合计4.94亿元,2018年涉及金额3.07亿元,2019年涉及金额1.87亿元。其中,2.36亿元被控股股东华仪集团有限公司及关联方非经营性资金占用,其余用于华仪电气归还借款及日常经营支出。公司及张宜生、吴逊先在持续督导期间未按规定履行持续督导工作,未发现前述违规使用募集资金情形,在募集资金使用与存放专项核查报告中做出合规的结论性意见,违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》第四条、第三十一条以及《上市公司监管指引第2号——上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第十三条的相关规定。浙江证监局对公司及张宜生、吴逊先采取出具警示函的监督管理措施,并记入证券期货市场诚信档案。详见公告(公告编号:2020-088)。

针对浙江证监局提出的问题,公司高度重视,一方面对项目情况进行全面梳理自查,加强完善内部控制机制,认真分析原因,制订了切实可行的应对及整改措施;另一方面责成投行等相关业务部门强化制度执行,举一反三,堵塞漏洞,同时加强公司质量控制部对投行项目风险全流程进行督促检查,实行检查常态化,防范此类问题再次发生。

(七) 自愿披露其他事项

1、关联方往来

截至报告期末,公司关联方往来情况详见本报告所附财务报表附注十、(六)关联方应收应付款项。

2、报告期内各单项业务资格的变化情况

(1) 2020年3月13日,获批为首批利率期权入市机构(颁布单位:中国外汇交易中心暨全国银行

间同业拆借中心)；

(2) 2020年8月5日，获得发行短期融资券业务资格（机构部函【2020】2098号）；

(3) 2020年8月10日，获得创业板转融券业务资格（中证金函[2020]145号）。

3、主要表外项目情况

报告期内，公司无主要表外项目。

4、会计师事务所

经公司2019年年度股东大会审议批准，公司续聘天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）为公司2020年度年报审计机构，为公司提供2020年度财务报告审计服务。天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）本次系连续第五年为本公司提供审计服务，签字会计师丁启新本次系连续第三年为公司提供审计服务，签字会计师户永红本次系第一年为公司提供审计服务。公司与天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）约定的2020年度审计费用合计95万元，报告期内，公司向其实际支付的2019年度年报相关审计费用95万元。

5、重大资产重组事项

报告期内，公司无重大资产重组事项。

6、重大资产负债表日后事项

(1) 公司股东、董事、监事及高级管理人员变动情况

1) 公司股东变动情况

东海证券股票在全国中小企业股份转让系统挂牌公开转让，转让方式为集合竞价转让方式。2021年1月1日至今，东海证券股东主要变动情况为：

2021年2月，常州吉瑞创投管理合伙企业（有限合伙）受让施艳芳持有的东海证券3,000万股、袁宗顺持有的东海证券2,500万股，交易后，常州吉瑞创投管理合伙企业（有限合伙）持有东海证券5,500万股，持股比例为3.2934%。

2021年3月，山南华闻与常投集团、常州市城市建设（集团）有限公司和常州交通建设投资开发有限公司签订协议，拟以每股7.67元人民币的价格将其持有的东海证券15,674.54万股股份（占东海证券总股本的9.3860%）通过全国中小企业股份转让系统进行大宗交易，转让给常投集团3,984.54万股股份（占东海证券总股本的2.3860%）、常州市城市建设（集团）有限公司5,845.00万股股份（占东海证券总股本的3.5%）和常州交通建设投资开发有限公司5,845.00万股股份（占东海证券总股本的3.5%），根据山南华闻提供的《股份转让协议》，本次转让最迟不晚于2021年9月30日完成全部股份交割。详见公告（公告编号：2021-013）。

2021年3月，常投集团受让山南华闻持有的东海证券370.8万股，交易后，常投集团持有东海证券38,433.9万股，持股比例为23.0143%。山南华闻持有东海证券股份数减至16,700万股，持股比例为10.0000%；江阴新扬船企业管理中心（有限合伙）受让刘锋、苏庆各其持有的东海证券4,000万股，交易后，江阴新扬船企业管理中心（有限合伙）持有东海证券8,000万股，持股比例为4.7904%，刘锋、苏庆不再持有东海证券股份；袁宗顺受让常州吉瑞创投管理合伙企业（有限合伙）持有的东海证券5,500万股，交易后，袁宗顺持有东海证券5,500万股，持股比例为3.2934%，常州吉瑞创投管理合伙企业（有限合伙）不再持有东海证券股份。

2021年4月，常州市城市建设（集团）有限公司和常州交通建设投资开发有限公司分别受让山南华闻持有的东海证券5,845万股。交易后，山南华闻持有东海证券股份数减至5,010万股股份，持股比例3%，常州市城市建设（集团）有限公司和常州交通建设投资开发有限公司分别持有的东海证券5,845万股，持股比例分别为3.5%。

2) 董事、监事变动情况

公司董事会于2020年11月18日收到独立董事胡志浩先生递交的辞职报告，自股东大会选举产生新任独立董事之日起辞职生效。2021年2月3日，公司2021年第一次临时股东大会审议通过《关于选举刘世安先生为公司独立董事的议案》，刘世安先生自此任公司独立董事，任期与第三届董事会一致。

胡志浩先生不再担任公司独立董事。

公司董事会于 2021 年 4 月 30 日收到董事周娟女士递交的辞职报告，自 2021 年 4 月 30 日起辞职生效。公司监事会于 2021 年 4 月 30 日收到监事金日先生递交的辞职报告，自 2021 年 4 月 30 日起辞职生效。

3) 高级管理人员变动情况

无。

(2) 年度分配预案

经天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）审计，母公司 2020 年实现净利润 349,562,918.18 元，分别按照净利润的 10%提取法定盈余公积 34,956,291.82 元、10%提取一般风险准备金 34,956,291.82 元、10%提取交易风险准备金 34,956,291.82 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》之规定，按大集合资产管理产品管理费收入的 10%计提风险准备金 4,956,299.10 元。母公司 2020 年年初未分配利润 2,209,576,046.27 元，2020 年未分配现金股利，2020 年期末可供全体股东分配的利润为 2,449,313,789.89 元。

根据公司发展和实际经营情况，本年度拟不进行股利分配，期末未分配利润 2,449,313,789.89 元结转到下一年度。

(3) 重大投融资行为

无。

(4) 经纪业务营业部、分公司新设、处置、迁址情况

2021 年 2 月，上海松江区新松江路证券营业部名称变更为：东海证券股份有限公司上海浦东新区东方路证券营业部，地址变更为：上海市浦东新区东方路 1928 号 601 室 B 区。

2021 年 3 月，上海虹口区中山北一路营业部名称变更为：东海证券股份有限公司上海普陀区中潭路证券营业部，地址变更为：上海普陀区中潭路 51 号 202、203 室。

2021 年 4 月，公司撤销晋中中都北路证券营业部。

(5) 重大诉讼、仲裁事项

无。

(6) 行政监管措施情况

无。

(7) 企业合并或处置子公司

2021 年 1 月 15 日，东海证券第三届董事会第十二次（临时）会议审议通过了《关于东海投资有限责任公司转让下属子公司北京东海中矿投资管理有限公司全部股份的议案》，同意东海投资转让持有的下属子公司北京东海中矿投资管理有限公司 51%股权，目前上述事项正在办理相关程序。

2021 年 1 月 18 日，东海期货第五届董事会第一次会议审议通过了《关于对东海资本增资 3000 万元的议案》，同意对全资子公司东海资本增加 3,000 万元注册资本的事项，2021 年 1 月，上述事项在上海完成工商变更登记。

(8) 其他可能对公司的财务状况、经营成果和现金流量发生重大影响的情况

无。

7、对不合格账户、司法冻结账户、风险处置账户、纯资金账户等账户规范情况的专项说明

截至 2020 年 12 月 31 日，公司所属证券分支机构托管的证券账户数共计 2,655,008 户，存疑账户 5,349 户、不合格证券账户 537 户，休眠证券账户 599,730 户，风险处置证券账户（含被处置公司的休眠账户）8,010 户，纯资金账户 24,785 户；2020 年新增小额休眠账户下线共 0 户。

除存疑账户、休眠证券账户、剩余不合格证券账户、司法冻结账户、风险处置账户等被限制使用外，正常交易的账户均为合格账户，且均已建立客户资金第三方存管关系；自营证券账户规范率为 100%；2020 年 1 月 1 日以后开立的证券账户，均为合格证券账户；此前未规范的不合格证券账户，凡是具备规范条件的账户已经全部规范。剩余不合格证券账户数量（不含司法冻结账户和风险处置账户）占本公司全部

客户证券账户（包括休眠证券账户）总数的比例为 0.0221%。

8、公司文化建设情况

公司高度重视文化建设工作，制定了《东海证券股份有限公司文化建设纲要》，明确了文化建设的指导思想、基本原则和主要任务，形成了“选择东海 人生精彩”的经营口号，坚持“务实、创新、规范、协同”的核心价值观，构建了“一个统领、两个未来、三大支撑、四层回报、五项坚持”的“12345”企业文化理念体系，即坚持“党建统领”；树立“规范创新”与“绿色发展”的理念，使公司走上一条创新、可持续的未来发展道路；“差异化竞争”的战略文化、“贡献为王”的选人用人文化和“科技赋能”的技术文化；建立“回报社会、回报股东、回报客户、回报员工”的社会责任文化；坚持“稳健规范、诚信合规、专业专注、高效协同、特色发展”的经营文化。

此外，公司为加强文化建设，还制定了《文化建设专项考核制度》；组建了文化建设团队；设立了文化建设专项经费，为文化建设提供必要的资金支持和物质保障。

9、公司存在重大的信用减值损失，详见本报告所附财务报表附注六、（四十九）信用减值损失。

第六节 股份变动、融资和利润分配

一、股权转让情况

东海证券股票在全国中小企业股份转让系统挂牌公开转让，转让方式为集合竞价转让方式。报告期内，常州投资集团通过股转系统集合竞价转让方式增持公司 0.1 万股，通过司法拍卖增持公司 2000 万股，合计增持公司 2000.1 万股。

二、普通股股本情况

(一) 普通股股本结构

单位：股

股份性质	期初		本期变动	期末		
	数量	比例%		数量	比例%	
无限售条件股份	无限售股份总数	1,430,000,000	85.63%	240,000,000	1,670,000,000	100%
	其中：控股股东、实际控制人	360,630,000	21.59%	20,001,000	380,631,000	22.79%
	董事、监事、高管	13,750,000	0.82%	-13,750,000	0	0%
	核心员工	-	-	-	-	-
有限售条件股份	有限售股份总数	240,000,000	14.37%	-240,000,000	0	0%
	其中：控股股东、实际控制人	-	-	-	-	-
	董事、监事、高管	41,250,000	2.47%	-41,250,000	0	0%
	核心员工	-	-	-	-	-
总股本		1,670,000,000	-	0	1,670,000,000	-
普通股股东人数		184				

股本结构变动情况：

√适用 □不适用

- 1、报告期内，公司股本未发生变化。
- 2、2020年3月，公司为山金金控所持的10,613.5万股办理了解除限售手续，可转让时间为2020年3月24日。
- 3、2020年6月，公司为山南华闻所持的9,261.5万股办理了解除限售手续，可转让时间为2020年6月19日。
- 4、2020年8月，公司为原董事袁怀东先生所持4,125万股办理了解除限售手续，可转让时间为2020年8月12日。

(二) 普通股前十名股东情况

截至2020年12月31日，公司共有股东184名，持股数前十名股东及其持股变动、限售股份数量、无限售股份数量、股权质押及司法冻结情况如下：

单位：股

序号	股东名称	期初持股数	持股变动	期末持股数	期末持股比例%	期末持有有限售股份数量	期末持有无限售股份数量	期末持有的质押股份数量	期末持有的司法冻结股份数量
1	常州投资集团有限公司	360,630,000	20,001,000	380,631,000	22.79%	0	380,631,000	140,000,000	0
2	山南华闻创业投资有限公司	170,708,000	0	170,708,000	10.22%	0	170,708,000	167,000,000	13,962,523
3	山金金控资本管理有限公司	140,080,000	0	140,080,000	8.39%	0	140,080,000	0	0
4	上海珠池资产管理有限公司—珠池新三板灵活配置1期基金	83,385,000	0	83,385,000	4.99%	0	83,385,000	0	0
5	首誉光控资管—浙商银行—首誉光控东海证券1号新三板专项资产管理计划	83,000,000	0	83,000,000	4.97%	0	83,000,000	0	83,000,000
6	银川聚信信德资产管理合伙企业（有限合伙）	83,000,000	0	83,000,000	4.97%	0	83,000,000	83,000,000	83,000,000
7	利得股权投资管理有限公司—康嘉金智私募股权投资基金	78,442,000	0	78,442,000	4.70%	0	78,442,000	0	0
8	苏庆	40,000,000	0	40,000,000	2.40%	0	40,000,000	0	0
9	刘锋	40,000,000	0	40,000,000	2.40%	0	40,000,000	0	0

10	广东比邻投资基金管理有限公司—比邻瑞丰私募证券投资基金	38,600,000	0	38,600,000	2.31%	0	38,600,000	0	0
合计		1,117,845,000	20,001,000	1,137,846,000	68.13%	0	1,137,846,000	390,000,000	179,962,523

普通股前十名股东间相互关系说明：

根据股东提供的相关材料，除下列情况外，前十大股东之间不存在关联关系：

山金金控直接持有东海证券 14,008 万股，山金金控母公司的控股股东山东黄金集团有限公司持有利得股权投资管理有限公司—康嘉金智私募股权投资基金的全部份额；山金金控与其全资子公司山金金控（上海）贵金属投资有限公司持有上海珠池资产管理有限公司—珠池新三板灵活配置 1 期基金的全部份额；山金金控全资子公司山金金控（上海）贵金属投资有限公司持有广东比邻投资基金管理有限公司—比邻瑞丰私募证券投资基金的全部份额。

目前上述股东正在根据《证券公司股权管理规定》进行规范。

报告期末持股 10%（含 10%）以上的股东为常投集团、山南华闻。

1、常投集团具体情况详见本报告“第六节股份变动、融资和利润分配 四、控股股东、实际控制人情况”。

2、报告期末，山南华闻持有东海证券 17,070.80 万股股份，持股比例 10.22%。

山南华闻的基本情况如下：

法定代表人：周娟

总经理：周娟

注册资本：50,000 万元

经营范围：创业投资（不得以公开方式募集资金，吸收公众存款，发放贷款，不得从事证券、期货类投资、担保业务；不得公开交易证券类投资产品或金融衍生产品；不得经营金融产品，理财产品和相关衍生业务）；创业投资管理；经济贸易咨询；企业策划；企业管理咨询；市场调查；其他科技推广和应用服务业；技术服务；技术转让；技术咨询。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

三、 优先股股本基本情况

适用 不适用

四、 控股股东、实际控制人情况

是否合并披露：

是 否

东海证券控股股东及实际控制人常州投资集团有限公司基本情况如下：

法定代表人：陈利民

总裁：陈利民

成立日期：2002 年 6 月 20 日

统一社会信用代码：91320400467283980X

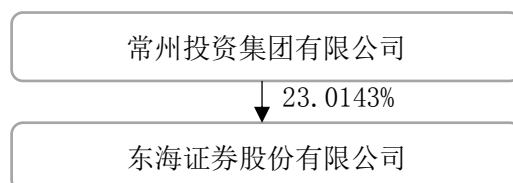
注册资本：120,000 万元

常州投资集团有限公司是公司控股股东及实际控制人，截至本报告披露日，常州投资集团有限公司持有本公司 38,433.9 万股股份，占比为 23.0143%。该公司是经常州市人民政府（常政发[2002]23 号文

件) 批准, 由常州市人民政府出资并授权经营的投资主体, 整体接收常州市信托投资公司、常州市投资公司和常州常信集团公司, 于 2002 年 10 月 6 日取得企业法人营业执照。常州投资集团有限公司法定代表人为陈利民, 注册资本为 120,000 万元, 主要从事国有资产投资经营、资产管理 (除金融业务)、投资咨询 (除证券、期货投资咨询); 企业财产保险代理 (凭许可证经营); 自有房屋租赁服务; 工业生产资料 (除专项规定)、建筑材料、装饰材料销售。(依法须经批准的项目, 经相关部门批准后方可开展经营活动)

报告期内, 公司控股股东、实际控制人未发生变化。

公司与实际控制人之间的关系如下图所示:



五、 报告期内普通股股票发行及募集资金使用情况

(一) 报告期内普通股股票发行情况

适用 不适用

(二) 存续至报告期的募集资金使用情况

适用 不适用

六、 存续至本期的优先股股票相关情况

适用 不适用

七、 存续至本期的债券融资情况

适用 不适用

单位: 元

代码	简称	债券类型	融资金额	票面利率%	存续时间		是否违约
					起始日期	终止日期	
125991	15 东海债	公司债券 (大公募、小公募、非公开)	1,000,000,000.00	5.7%	2015年6月11日	2020年6月11日	否
135691	16 东海债	公司债券 (大公募、小公募、非公开)	1,500,000,000.00	3.9%	2016年7月28日	2021年7月28日	否
XS1621491999	Project Bud	公司债券 (大公募、小公募、非公开)	1,062,975,000.00	4.90%	2017年6月12日	2020年6月12日	否

		公开)					
162850	19 东海 债	公司债券 (大公募、 小公募、非 公开)	1,000,000,000.00	5.5%	2019年 12月 30日	2022年 12月 30日	否
166966	20 东海 债	公司债券 (大公募、 小公募、非 公开)	800,000,000.00	4.8%	2020年 6月9 日	2023年 6月9 日	否
163713	20 东海 01	公司债券 (大公募、 小公募、非 公开)	1,000,000,000.00	4.0%	2020年 7月14 日	2022年 7月14 日	否
163714	20 东海 02	公司债券 (大公募、 小公募、非 公开)	1,000,000,000.00	4.2%	2020年 7月14 日	2023年 7月14 日	否
SAU201	龙融 16 号	长期收益 凭证	200,000,000.00	4.00%	2019年 4月10 日	2020年 8月3 日	否
SMV600	龙盈 15 月型第 1期	长期收益 凭证	8,720,000.00	4.10%	2020年 12月 18日	2022年 3月15 日	否
SMV601	龙盈 12 月型定 制第1 期	长期收益 凭证	8,000,000.00	4.40%	2020年 12月 18日	2021年 12月 21日	否
SMY796	龙盈 18 月型第 1期	长期收益 凭证	7,240,000.00	4.30%	2020年 12月 25日	2022年 6月21 日	否
SMV534	龙盈 12 月型第 3期	长期收益 凭证	15,860,000.00	4.00%	2020年 12月4 日	2021年 12月7 日	否
SPA027	龙盈 18 月型第 2期	长期收益 凭证	10,700,000.00	4.30%	2020年 12月 31日	2022年 6月28 日	否
合计	-	-	7,613,495,000.00	-	-	-	-

注:

1、2015年发行的15东海次级债系在上海证券交易所非公开发行，为5年期固定利率债券，附第3年末发行人赎回选择权及投资者回售选择权。若投资者行使回售选择权，则回售部分债券兑付日为2018年6月11日。于2018年，部分投资者行使回售选择权，回售债券金额共计250,000,000.00元；“15东海债”2020年6月11日到期按时足额兑付。

2、2016年发行的16东海次级债系在上海证券交易所非公开发行，为5年期固定利率债券。

3、Project Bud 为东海证券股份有限公司全资子公司东海国际金融控股有限公司下属境外全资特殊目的公司 OCEAN BRIGHT CAPITAL HOLDINGS LIMITED 于境外发行的固定利率私募债券，融资金额为1.5亿美元，2020年6月12日到期

按时足额兑付，按照到期兑付日美元对人民币折算汇率 7.0865 折算人民币 1,062,975,000.00 元。

4、2019 年发行的 19 东海次级债系在上海证券交易所非公开发行，为 3 年期固定利率债券。

5、2020 年发行的 20 东海次级债系在上海证券交易所非公开发行，为 3 年期固定利率债券。

6、2020 年发行的 20 东海 01 公司债系在上海证券交易所面向专业投资者公开发行，为 2 年期固定利率债券。

7、2020 年发行的 20 东海 02 公司债系在上海证券交易所面向专业投资者公开发行，为 3 年期固定利率债券。

债券违约情况

适用 不适用

公开发行债券的特殊披露要求

适用 不适用

（一）公开发行债券基本情况

1、债券名称：东海证券股份有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）。

2、债券简称及代码：品种一债券简称：20 东海 01，债券代码 163713；品种二债券简称：20 东海 02，债券代码 163714

3、债券期限：本期债券设两个品种，品种一的期限为 2 年；品种二的期限为 3 年。

4、发行总额：本期债券实际发行规模为 20 亿元。

5、债券利率：品种一的票面利率为 4.0%；品种二的票面利率为 4.2%。

6、起息日、到期日、计息期限：本期债券品种一起息日为 2020 年 7 月 14 日，到期日为 2022 年 7 月 14 日（如遇非交易日，则顺延至其后的第 1 个交易日；顺延期间兑付款项不另计息）。本期债券品种二起息日为 2020 年 7 月 14 日，到期日为 2023 年 7 月 14 日（如遇非交易日，则顺延至其后的第 1 个交易日；顺延期间兑付款项不另计息）。

7、还本付息方式：本期债券采用单利按年计息，不计复利。本期债券按年付息、到期一次还本。利息每年支付一次，最后一期利息随本金一起支付。本期债券本息支付将按照债券登记机构的有关规定来统计债券持有人名单，本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。

8、上市时间和地点：本期债券于 2020 年 7 月 21 日在上海证券交易所上市交易。

9、发行对象：本期债券面向在登记公司开立合格证券账户的专业投资者（法律、法规禁止购买者除外）网下发行。本期债券不安排向公司股东优先配售。

10、2020 年公司债券的付息兑付情况

无。

11、债券附特殊条款及执行情况

无。

（二）债券发行中介机构情况

牵头主承销商、簿记管理人、债券受托管理人：浙商证券股份有限公司

住所：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

项目组成员：贾东霞、冯佳慧、范静

联系地址：北京市海淀区北方地产大厦 718

联系电话：010-65546328

联席主承销商：东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

项目负责人：贝一飞

项目组成员：金韬恂、钱尧、邱添

联系地址：苏州工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦

联系电话：0512-62938667

律师事务所：国浩律师（上海）事务所

住所：上海市静安区北京西路 968 号嘉地中心 23 层

负责人：李强

项目联系人：林祯

联系地址：上海市静安区北京西路 968 号嘉地中心 23 层

联系电话：021-52341668

会计师事务所：天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼

首席执行事务合伙人：邱靖之

签字会计师：王兴华、丁启新、户永红

联系地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 13 层

联系电话：021-51028018

资信评级机构：上海新世纪资信评估投资服务有限公司

住所：上海市杨浦区控江路 1555 号 A 座 103 室 K-22

法定代表人：朱荣恩

项目联系人：刘兴堂

联系地址：上海市黄浦区汉口路 398 号华盛大厦 14 层

联系电话：021-63501349

（三）募集资金使用情况

募集资金使用的调拨审批严格按照公司的资金调拨管理办法的规定执行。募集资金专项账户运行正常，公司债券募集资金均按披露的使用用途专款专用，与募集说明书承诺的用途、使用计划及其他约定一致。

（四）评级情况

2020 年 5 月，根据上海新世纪资信评估投资服务有限公司出具的《东海证券股份有限公司 2020 年公开发行公司债券（第一期）信用评级报告》，本期债券信用等级为 AA+，发行人的主体信用等级为 AA+，评级展望为稳定。在本次公司债存续期（本次公司债发行日至到期兑付日止）内，上海新世纪将进行跟踪评级，定期跟踪评级报告每年出具一次，跟踪评级结果和报告于发行人年度报告披露后 2 个月内出具，且不晚于每一会计年度结束之日起 6 个月内。在持续跟踪评级报告出具 5 个工作日内，上海新世纪将把跟踪评级报告发送至发行人，并同时发送至交易所网站公告，且交易所网站公告披露时间将不晚于在其他交易场所、媒体或者其他场合公开披露的时间。

（五）增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施的执行情况、变化情况

无。

（六）债券持有人会议的召开情况

报告期内未召开债券持有人会议。

（七）受托管理人履行职责情况

浙商证券作为债券受托管理人，对公司资信状况、募集资金管理运用情况、公司债券本息偿付情况等进行了持续跟踪，并督促公司履行公司债券募集说明书中约定义务，积极行使了债券受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。

（八）公司主要会计数据和财务指标

项目	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日	变动幅度	变动原因
----	------------------	------------------	------	------

息税折旧摊销前利润（元）	1,382,230,300.71	978,670,663.54	41.24%	主要原因是：利润总额增加。
投资活动产生的现金流量净额（元）	-49,849,882.42	-44,322,686.39	不适用	
筹资活动产生的现金流量净额（元）	-925,402,895.00	-1,475,357,684.52	不适用	主要原因是：取得借款、发行债券收到现金增加。
期末现金及现金等价物余额（元）	16,927,051,171.55	15,064,775,442.84	12.36%	
流动比率	2.27	3.10	-26.77%	
速动比率	2.27	3.10	-26.77%	
资产负债率	68.39%	67.34%	1.56%	
EBITDA 全部债务比（息税折旧摊销前利润/全部债务）	8.42%	8.33%	1.08%	
利息保障倍数[息税前利润/（计入财务费用的利息支出+资本化的利息支出）]	2.22	1.32	68.18%	主要原因是：利润总额增加。
现金利息保障倍数[（经营活动产生的现金流量净额+现金利息支出+所得税付现）/现金利息支出]	6.18	7.88	-21.57%	
EBITDA 利息保障倍数[息税折旧摊销前利润/（计入财务费用的利息支出+资本化的利息支出）]	2.34	1.42	64.79%	主要原因是：利润总额增加。
贷款偿还率（实际贷款偿还额/应偿还贷款额）	不适用	不适用	不适用	
利息偿付率（实际支付利息/应付利息）	100.00%	100.00%	0.00%	

（九）其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

公司不存在逾期未偿还债项。

2015年6月，公司以非公开方式发行了东海证券股份有限公司2015年次级债券，计息期限自2015年6月11日起至2020年6月10日止；公司于2020年6月11日已按时足额完成兑付兑息。

2017年6月，公司全资子公司东海国际金融控股有限公司下属境外全资特殊目的公司 OCEAN BRIGHT CAPITAL HOLDINGS LIMITED 已于境外完成了总额为1.5亿美元固定利率私募债券的发行，债券期限3年，每半年支付一次利息。2020年6月12日，东海国际金融控股有限公司已按时足额完成兑付兑息。

（十）银行授信及使用情况

公司根据经营需要，主动优化授信结构，积极利用授信与主要商业银行保持着良好的业务合作关系。

银行	授信额度（亿元）	主要融资品种	授信余额（亿元）
农业银行	1.9	两融收益权转让、债券投资、股票质押回购、收益凭证等	0.0
交通银行	9.5	两融收益权转让、债券投资、债券借贷、同业拆借等	3.1

邮储银行	2.0	同业拆借、两融收益权转让、债券投资、券商管理资产池等	2.0
招商银行	11.0	同业拆借、债券投资、买入返售股票担保资产等	11.0
兴业银行	28.0	同业拆借、债券投资、债券回购、债券借贷、收益凭证、法人账户透支等	3.5
浦发银行	13.0	同业拆借、法人账户透支、两融收益权转让、债券投资、债券回购、利率互换、债券借贷等	6.0
光大理财	7.2	债券投资等	1.8
江苏银行	4.0	债券投资等	3.0
上海银行	16.0	同业拆借、债券借贷、债券回购、收益凭证、债券投资等	0.5
苏州银行	3.0	债券投资、债券回购、两融收益权转让等	0.0
江南农商行	3.2	债券投资等	0.0
紫金农商行	1.0	债券回购等	1.0
江西银行	3.0	同业拆借、债券回购等	1.0
青岛银行	1.0	债券投资等	0.0
湖北省农联社	5.0	债券回购、债券分销买卖等	5.0
洛阳农商行	2.0	资金现券、同业拆借等	2.0
汕头潮阳农联社	2.2	债券回购和利率债投标	2.2
成都农商行	5.0	同业拆借、债券回购等	3.0
宜阳农商行	1.5	同业拆借、债券回购等	1.5
摩根士丹利国际银行	10.0	综合授信	10.0
株洲珠江农商行	1.0	债券回购，同业拆借和票据等	1.0
长春发展农商行	1.0	同业拆借	0.0
合计	131.5	-	57.6

(十一) 债券募集说明书相关约定或承诺执行情况

公司在报告期内严格按照债券募集说明书约定及承诺执行，不存在对债券投资者利益产生不利影响的事件发生。

(十二) 重大事项情况

报告期内本公司未发生可能影响公司偿债能力或债券价格的重大事项。

(十三) 保证人报告期财务报告

不适用。

(十四) 募集资金用途变更情况

公司于 2019 年 12 月 30 日非公开发行东海证券股份有限公司 2019 年证券公司次级债券，债券简称为“19 东海债”，债券代码为“162850”，债券发行总额为人民币 10 亿元。由于公司用款计划的调整和资金调度的变化，需将 6.5 亿元募集资金的所偿还的负债项目进行调整。

根据《东海证券股份有限公司 2019 年非公开发行证券公司次级债券募集说明书》“本期债券募集资金不超过人民币 10 亿元（含），拟主要用于偿还公司有息债务，进一步优化负债结构和改善财务结构。若发行人外部经营环境发生变化，发行人调整募集资金用途，应经过董事会一般决议通过并及时进行临时信息披露。”的有关约定，公司于 2020 年 2 月 26 日第三届董事会第二次（临时）会议决议，通过了《关于申请调整 19 东海债募集资金用途的专项议案》。详见公告（公告编号：2020-011）。

八、 存续至本期的可转换债券情况

适用 不适用

九、 银行及非银行金融机构间接融资发生情况

适用 不适用

单位：元

序号	贷款方式	贷款提供方	贷款提供方类型	贷款规模	存续期间		利息率
					起始日期	终止日期	
1	信用贷款、抵/质押贷款	兴业银行（香港分行）	银行	286,443,110.00	2020年6月9日	2021年6月8日	4.6525% & 5.6525%
2	其他方式	中国长城资产（国际）控股有限公司	非银行金融机构	214,850,069.02	2020年5月28日	2022年5月27日	6%
合计	-	-	-	501,293,179.02	-	-	-

注：

1、银行授信，含 USD49,000,000 美元债质押。2020 年 12 月 31 日实际贷款规模为 43,900,000.00 美元，按照资产负债表日美元对人民币折算汇率 6.52490 折算人民币 286,443,110.00 元。

2、不良资产处置协议款。2020 年 12 月 31 日实际贷款规模为 255,275,496.67 港元，按照资产负债表日港元对人民币折算汇率 0.84164 折算人民币 214,850,069.02 元。

十、 权益分派情况

(一) 报告期内的利润分配与公积金转增股本情况

适用 不适用

报告期内未执行完毕的利润分配与公积金转增股本的情况：

适用 不适用

(二) 权益分派预案

适用 不适用

十一、特别表决权安排情况

适用 不适用

第七节 董事、监事、高级管理人员及员工情况

一、 董事、监事、高级管理人员情况

(一) 基本情况

姓名	职务	性别	出生年月	任职起止日期	
				起始日期	终止日期
钱俊文	董事长	男	1964年10月	2020年1月15日	2023年1月14日
陈耀庭	董事	男	1960年5月	2020年1月15日	2023年1月14日
	董事长(代)			2019年7月18日	2020年1月14日
林田	董事	男	1963年3月	2020年1月15日	2023年1月14日
陆建荣	董事	男	1964年7月	2020年1月15日	2023年1月14日
李军锋	董事	男	1977年10月	2020年1月15日	2023年1月14日
周娟	董事	女	1984年3月	2020年1月15日	2021年4月30日
殷建华	职工董事	男	1962年11月	2020年1月15日	2023年1月14日
	执行委员会主任 (总裁)			2020年6月29日	2023年1月14日
	总裁			2020年1月15日	2020年6月29日
	合规总监兼首席风 险官(代)			2020年1月15日	2020年3月5日
李颖琦	独立董事	女	1976年7月	2020年1月15日	2023年1月14日
韩长印	独立董事	男	1963年8月	2020年1月15日	2023年1月14日
胡海峰	独立董事	男	1965年10月	2020年1月15日	2023年1月14日
胡志浩	独立董事	男	1977年11月	2020年1月15日	2021年2月2日
袁怀东	董事(已离任)	男	1965年8月	2016年5月19日	2020年1月14日
刘洪君	董事(已离任)	男	1968年12月	2019年3月27日	2020年1月14日
杨瑞龙	独立董事(已离任)	男	1957年5月	2018年7月16日	2020年1月14日
赵俊	职工董事(已离任)	男	1970年1月	2017年3月29日	2020年1月14日
	总裁(已离任)			2016年5月19日	2020年1月14日
	合规总监兼首席风 险官(代)(已离任)			2019年9月12日	2020年1月14日
韩斌	监事会主席、职工 监事	男	1967年2月	2020年1月15日	2023年1月14日
张峰	监事	男	1974年3月	2020年1月15日	2023年1月14日
金日	监事	男	1971年8月	2020年1月15日	2021年4月30日
汤晓云	监事	女	1969年11月	2020年1月15日	2023年1月14日
宣秀芳	职工监事	女	1972年10月	2020年1月15日	2023年1月14日
沈彩芬	监事(已离任)	女	1969年11月	2016年5月19日	2020年1月14日
李勇田	执行委员会委员	男	1965年10月	2020年7月21日	2023年1月14日
冯文敏	执行委员会委员	男	1972年12月	2020年6月29日	2023年1月14日
马芸	执行委员会委员	女	1977年8月	2020年6月29日	2023年1月14日
	合规总监兼首席风 险官			2020年3月6日	2023年1月14日

汪劲松	副总裁	男	1970年4月	2020年1月15日	2020年6月29日
	履行执行委员会委员职责			2020年6月29日	2023年1月14日
杨茂智	副总裁	男	1975年10月	2020年1月15日	2020年6月29日
	董事会秘书			2020年1月15日	2023年1月14日
	履行执行委员会委员职责			2020年6月29日	2023年1月14日
杜曙光	副总裁	男	1970年8月	2020年1月15日	2020年6月29日
	履行执行委员会委员职责			2020年6月29日	2023年1月14日
郭晋炜	财务总监	男	1968年11月	2020年1月15日	2023年1月14日
王一军	副总裁（已离任）	男	1960年5月	2020年1月15日	2020年6月29日
董事会人数：				11	
监事会人数：				5	
高级管理人员人数：				8	

董事、监事、高级管理人员与股东之间的关系：

林田先生为常投集团董事兼副总裁，陆建荣先生为常投集团证券部总经理，陈耀庭先生原为常投集团副总裁（已退休）；

周娟女士原为华闻传媒投资集团股份有限公司副总裁（已于2021年4月离职），金日先生为华闻传媒投资集团股份有限公司副总裁兼董事会秘书；

张峰先生为山金金控董事长，李军锋先生为山金金控副总经理；

其他董事、监事、高级管理人员相互间不存在关联关系。

董事、监事、高级管理人员薪酬管理信息：

1. 薪酬管理基本制度及决策程序

公司董事、监事的报酬由董事会薪酬与提名委员会、董事会、监事会审议通过后，报股东大会审议决定。公司高级管理人员的报酬由董事会薪酬与提名委员会审议后，由公司董事会审议决定。

公司内部董事、监事和高级管理人员的报酬根据公司薪酬考核等有关制度执行；独立董事津贴参照行业水平及公司实际情况确定。

2. 董事、监事和高级管理人员的薪酬情况

报告期内，全体董事、监事和高级管理人员（含离任）实际获得的报酬合计 2277.78 万元，不存在非现金薪酬的情况。公司高级管理人员绩效年薪的 40%采取延期支付的方式，延期支付的年限为 3 年，每年均等发放。

类别	领取报酬人数	报告期内从公司获得的税前报酬总额（万元）
董事	10	230.38
其中：独立董事	5	68.96
监事	6	279.99
高级管理人员	10	1445.00
总计	26	1955.38

注：

- 1、报告期内另支付以前年度高级管理人员递延薪酬税前金额 322.4 万元；
- 2、董事报酬总额中不含兼任高管的职工董事报酬；
- 3、公司内部董事、监事会主席以及高级管理人员 2020 年度薪酬仍在确认过程中，待确认后另行审议。

(二) 持股情况

单位：股

姓名	职务	期初持普通股股数	数量变动	期末持普通股股数	期末普通股持股比例%	期末持有股票期权数量	期末被授予的限制性股票数量
钱俊文	董事长	0	0	0	0%	0	0
陈耀庭	董事	0	0	0	0%	0	0
林田	董事	0	0	0	0%	0	0
陆建荣	董事	0	0	0	0%	0	0
周娟	董事	0	0	0	0%	0	0
李军锋	董事	0	0	0	0%	0	0
殷建华	职工董事、 执行委员会主任（总裁）	0	0	0	0%	0	0
李颖琦	独立董事	0	0	0	0%	0	0
韩长印	独立董事	0	0	0	0%	0	0
胡志浩	独立董事	0	0	0	0%	0	0
胡海峰	独立董事	0	0	0	0%	0	0
韩斌	监事会主席、 职工监事	0	0	0	0%	0	0
张峰	监事	0	0	0	0%	0	0
金日	监事	0	0	0	0%	0	0
汤晓云	监事	0	0	0	0%	0	0
宣秀芳	职工监事	0	0	0	0%	0	0
李勇田	执行委员会 委员	0	0	0	0%	0	0
冯文敏	执行委员会 委员	0	0	0	0%	0	0
马芸	执行委员会 委员、合规 总监兼首席 风险官	0	0	0	0%	0	0
汪劲松	履行执行委 员会委员职 责	0	0	0	0%	0	0
杨茂智	履行执行委 员会委员职 责、董事会 秘书	0	0	0	0%	0	0
杜曙光	履行执行委 员会委员职	0	0	0	0%	0	0

	责						
郭晋炜	财务总监	0	0	0	0%	0	0
合计	-	0	-	0	0%	0	0

(三) 变动情况

信息统计	董事长是否发生变动	√是 □否
	总经理是否发生变动	√是 □否
	董事会秘书是否发生变动	□是 √否
	财务总监是否发生变动	□是 √否

报告期内董事、监事、高级管理人员变动详细情况：

√适用 □不适用

姓名	期初职务	变动类型	期末职务	变动原因
钱俊文	党委书记	新任	党委书记、董事长	董事会换届及经营管理工作需要
陈耀庭	董事长（代）、 董事	离任	董事	董事会换届
林田	无	新任	董事	董事会换届
李军锋	无	新任	董事	董事会换届
殷建华	无	新任	职工董事、执行委员会 主任（总裁）	董事会换届及经营管理工作需要
胡海峰	无	新任	独立董事	董事会换届
汤晓云	无	新任	监事	监事会换届
李勇田	无	新任	执行委员会委员	经营管理工作需要
冯文敏	无	新任	执行委员会委员	经营管理工作需要
马芸	无	新任	执行委员会委员、合 规总监兼首席风险 官	经营管理工作需要
汪劲松	副总裁	新任	履行执行委员会委 员职责	经营管理工作需要
杨茂智	副总裁兼任董 事会秘书	新任	履行执行委员会委 员职责、董事会秘书	经营管理工作需要
杜曙光	副总裁	新任	履行执行委员会委 员职责	经营管理工作需要
袁怀东	董事	离任	无	董事会换届
刘洪君	董事	离任	无	董事会换届
赵俊	职工董事、总 裁，合规总监兼 首席风险官 （代）	离任	无	董事会换届及经营管理工作需要
杨瑞龙	独立董事	离任	无	董事会换届
沈彩芬	监事	离任	无	监事会换届

王一军	副总裁	离任	无	退休
-----	-----	----	---	----

报告期内新任董事、监事、高级管理人员专业背景、主要工作经历等情况：

√适用 □不适用

详见全体董事、监事、高级管理人员简历。

全体董事、监事、高级管理人员简历

- 1、钱俊文先生，1964年10月出生，博士研究生文化。曾任溧阳市法院戴埠法庭书记员，溧阳市政府办公室秘书、副科长、科长、办公室副主任，溧阳市地方税务局副局长、党组成员、局长、党组书记，溧阳市政府副市长，江苏省地方税务局征管与科技处处长，江苏省常州地方税务局党组书记、局长，国家税务总局常州市税务局党委副书记、副局长(正处长级)，现任东海证券党委书记、董事长。
- 2、陈耀庭先生，1960年5月出生，硕士研究生。曾任常州市信托投资公司信贷部主任、常州市信托投资公司经理助理、常投集团总裁助理、常投集团副总裁。
- 3、林田先生，1963年3月出生，硕士研究生文化，经济师职称。曾任中科院南京地质古生物研究所实习研究员，常州市信托投资公司信贷部科员、证券部主任助理、副主任、研究发展部副主任，常州投资集团有限公司企业发展部副主任、投资管理二部总经理、一部总经理、总裁助理。现任常投集团董事、副总裁。
- 4、陆建荣先生，1964年7月出生，大学本科。曾任常州建材机械厂助理工程师、工程师，常州财政证券公司投资主管、经济师，常州财政证券公司营业部投资咨询主管、经济师，信泰证券常州营业部市场部副经理、办公室主任、高级经济师，信泰证券沈阳光荣街营业部副总经理、高级经济师，华泰证券沈阳光荣街营业部副总经理、高级经济师，2010年5月至今担任常投集团证券部总经理、高级经济师。
- 5、李军锋先生，1977年10月出生，本科文化，会计师职称。曾任莱芜市医药有限公司会计、山东万隆齐鲁会计师事务所有限责任公司项目经理、济南高新控股集团有限公司预算主管、中国电信股份有限公司莱芜分公司财务主管、山东黄金集团有限公司风险内控管理主管、山金金控资本管理有限公司审计与风险管理部部门经理、山金金控(深圳)黄金投资发展有限公司常务副总经理兼财务总监、山东黄金金控集团(香港)有限公司财务总监、山金金控资本管理有限公司财务总监，现任山金金控资本管理有限公司副总经理。
- 6、周娟女士，1984年3月出生，硕士。曾任福建省泉州理工学院会计学教师(助教职称)、上海瑞盈投资管理有限公司总裁助理、中融国际信托有限公司总经理助理、上海财通资产管理有限公司副总裁、丰汇租赁有限公司副总裁。2017年3月至2021年4月担任华闻传媒投资集团股份有限公司副总裁。
- 7、殷建华先生，1962年11月出生，大专文化，中共党员。曾任航空兵第37师110团正排职飞行员、独立大队副连职飞行员，青岛警备区后勤部正连职参谋、正连职助理员，青岛市体改委科员、副主任科员、生产体制处主任科员，青岛装饰布总厂副厂长，青岛体改委综合调研处副处长，中国证监会青岛特派员办事处上市处负责人、副处长、处长，中国证监会青岛监管局上市处处长、党委委员、局长助理、副局长；2016年10月至2019年12月，曾任中国证监会江苏监管局党委委员、纪委书记；2020年1月至2020年6月任东海证券总裁。2020年1月起任东海证券职工董事，2020年6月起任东海证券执行委员会主任(总裁)。
- 8、李颖琦女士，1976年7月出生，博士研究生。曾任上海立信会计学院会计学助教、讲师、副教授、教授，2017年3月至今担任上海国家会计学院会计学教授。
- 9、韩长印先生，1963年8月出生，博士研究生学历。曾任河南大学法学院讲师、副教授、教授，2003年2月至今担任上海交通大学法学院教授、博士生导师、民商法研究所所长。
- 10、胡志浩先生，1977年11月出生，博士研究生。曾任中国社会科学院金融研究所助理研究员、副

研究员、研究员，国际经济与金融研究室副主任、主任，中国社会科学院国家金融与发展实验室全球经济与金融研究中心主任。2017年6月至今，任中国社会科学院金融研究所研究员、博士生导师、中国社会科学院国家金融与发展实验室副主任。

- 11、胡海峰先生，1965年10月出生，博士研究生文化。曾任首钢研究与开发公司助理研究员、光大证券有限公司投资银行部副总经理、国海证券有限公司副总裁。现任北京师范大学经济与工商管理学院教授。
- 12、韩斌先生，1967年2月出生，硕士研究生。曾任中南大学化学系教师、机关总支干部，湖南省招商局干部，长沙维大公司总经理，泰阳证券人力资源培训部经理、综合文秘部经理、公共关系部总经理，东证有限办公室副主任、东海证券综合管理部总经理、党委办公室主任。2011年9月起任东海证券工会主席，2012年6月起任东海证券监事会主席。
- 13、张峰先生，1974年3月出生，大学本科。曾任山东黄金集团有限公司计划财务部副部长、财务部经理助理、山东黄金集团有限公司资本运营部经理。2012年11月至2016年1月担任山金金控资本管理有限公司董事、常务副总经理。2016年2月至2018年7月担任山金金控资本管理有限公司董事、总经理。2018年6月至今担任山金金控资本管理有限公司党委书记。2018年8月至今担任山金金控资本管理有限公司董事长。
- 14、金日先生，1971年8月出生，大学本科。2001年7月取得董事会秘书资格证书。曾任海南民生燃气（集团）股份有限公司投资管理部经理助理、发展计划部副经理、证券事务代表。2000年5月至12月期间借调中国证监会海口特派办上市公司监管处工作。2008年7月至2015年10月兼任上海鸿立股权投资有限公司副总经理。2003年2月至今担任华闻传媒投资集团股份有限公司董事会秘书，2017年4月至今担任华闻传媒投资集团股份有限公司副总裁。
- 15、汤晓云女士，1969年11月出生，大专文化。曾任常州橡胶厂材料会计、出纳；常州长兴集团有限公司稽核、出纳、主办；常州市友邦置业有限公司财务主管；常州华星银河湾房地产开发有限公司会计主管；常州华光房地产开发有限公司清算小组会计主管。现任巨凝集团有限公司会计主管。
- 16、宣秀芳女士，1972年10月出生，大学本科，经济学学士，信息工程师，会计师。历任常州证券营业部电脑部主管、东证有限营业部电脑部经理、信息技术中心副经理、东海证券合规与风险管理部经理、总经理助理。现任东海证券风险管理部副总经理（主持工作），2016年6月起任东海证券职工监事。
- 17、李勇田先生，1965年10月生，博士研究生文化，中共党员。1988年7月至1994年11月，任山东滨州地区物资学校教师、团委书记；1994年11月至1996年6月，任山东滨州地区城市信用社中心社职员；1996年6月至2006年8月，历任中信万通证券滨州营业部副总经理、天津营业部总经理、济南管理总部副总经理、滨州中心营业部总经理、淄博共青团营业部总经理、美食街营业部总经理；2006年8月至2008年12月，任中信万通证券经纪业务总部总经理；2008年12月至2013年9月，历任中信万通证券合规总监、运营总监、营销总监；2013年9月至2016年4月，任中信证券（山东）副总经理，青岛证券期货业协会会长；2016年4月至2017年7月，任中信证券广东分公司总经理；2017年7月至2020年7月，任国融证券副总裁、财富管理业务委员会主任。2020年7月起任东海证券执行委员会委员。
- 18、冯文敏先生，1972年12月生，硕士研究生文化，中共党员。1996年7月至1997年9月，任建设银行常州分行国际业务部信贷员；1997年10月至2000年4月，任京华山一（国际）上海代表处融资科长；2000年9月至2002年4月，任国通证券（现招商证券）投资银行部项目经理；2002年12月至2003年5月，任香港顺隆集团上海办事处高级经理；2003年6月至2013年6月，历任东海证券投资银行部副总经理、总经理、总裁助理；2013年7月至2020年1月，任天风证券副总裁。2020年6月起任东海证券执行委员会委员。
- 19、马芸女士，1977年8月出生，硕士研究生文化，中共党员。曾任南京审计大学教师、助教；中国

证监会江苏监管局干部；中国证监会江苏监管局办公室四级专业助手、副主任科员、主任科员、副主任；中国证监会江苏监管局会计监管处副处长、调研员；中国证监会江苏监管局办公室调研员；2017年6月至2020年1月，曾任中国证监会江苏监管局会计监管处调研员、处长。2020年3月起任东海证券合规总监兼任首席风险官，2020年6月起任东海证券执行委员会委员。

- 20、汪劲松先生，1970年4月出生，硕士研究生文化。曾任泰阳证券股份有限公司营业部总经理，东证有限经纪业务总部总经理、总监兼综合管理部总经理、公司工会主席，东海证券董事长助理、副总裁，2014年6月至2020年6月任东海证券副总裁。2020年6月起履行公司执行委员会委员职责。
- 21、杨茂智先生，1975年10月出生，大学本科文化。曾任江苏省会计师事务所审计员，深圳信德会计师事务所项目经理，平安证券有限责任公司项目经理，中富证券有限责任公司项目经理，东证有限部门副总经理、部门总经理、合规总监、总裁助理、董事长助理、副总裁、副总裁兼董事会秘书，2014年10月至2015年9月兼任东海证券合规总监，2013年5月至2020年6月任东海证券副总裁。2013年5月起任东海证券董事会秘书，2020年6月起履行公司执行委员会委员职责。
- 22、杜曙光先生，1970年8月出生，硕士研究生文化。曾任重庆设计院助理工程师，重庆经济体制改革委员会副主任科员，中国证监会重庆监管局机构处副处长（主持工作）、机构处处长、稽查处处长、上市处处长，中国节能集团重庆公司副总裁，东证有限董事长助理，2014年10月至2020年6月任东海证券副总裁。2020年6月起履行公司执行委员会委员职责。
- 23、郭晋炜先生，1968年11月出生，硕士研究生，中国注册会计师协会非执业会员，高级经济师。曾任湖南晨光化工厂财务主管，泰阳证券有限责任公司投资银行部高级经理、稽核部副总经理，东证有限稽核部副总经理，万联证券有限责任公司稽核部总经理，东海期货副总经理、东证有限内审部总经理、东海证券计划财务部总经理，2015年8月起任东海证券财务总监兼计划财务部总经理。

（四） 董事会专门委员会

公司董事会下设投资决策委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会、风险控制委员会，截止本报告披露日，成员如下：

委员会	主任委员（召集人）	成员
投资决策委员会	钱俊文	胡海峰（独立董事）、陈耀庭
审计委员会	李颖琦（独立董事）	韩长印（独立董事）、刘世安（独立董事）、李军锋
薪酬与提名委员会	刘世安（独立董事）	林田、胡海峰（独立董事）
风险控制委员会	韩长印（独立董事）	殷建华、陆建荣

（五） 董事、监事和高级管理人员在其他单位的兼职情况

姓名	兼职单位名称	职务	任职期间
钱俊文	东海期货有限责任公司	董事长	2020年4月至今
	东海国际金融控股有限公司	董事长	2020年3月至今
陈耀庭	常州金融投资集团有限公司	总经理	2013年12月至2020年12月
	江苏华电戚墅堰发电有限公司	董事	2013年4月至2020年4月
	常州宝祥典当行有限公司	董事长	2006年4月至2020年7月
	常州信辉创业投资有限公司	董事长	2013年5月至2020年7月
	常州投资集团融资担保有限公司	董事长	2009年11月至2020年7月
	新疆信辉股权投资有限公司	董事长	2011年7月至2020年7月
	常州国际机场有限公司	董事	2006年2月至2020年7月
林田	常州投资集团融资担保有限公司	董事	2009年11月至今

	常柴股份有限公司	董事	2018年12月至今
	江苏旅通商务有限公司	董事长	2016年11月至今
	常州宝祥典当行有限公司	董事	2006年4月至今
	江苏华电戚墅堰发电有限公司	董事	2020年7月至今
	常州市中科龙城股权投资有限公司	董事	2011年1月至今
	常州信辉商业保理有限公司	董事长	2013年10月至今
	江苏联常资产管理有限公司	董事长	2017年11月至今
	新疆信辉股权投资有限公司	董事长	2020年7月至今
	常州投资基金管理有限公司	董事长	2017年10月至今
	常州市市民卡建设有限公司	董事长	2013年12月至今
	常州信辉能源科技有限公司	董事长	2012年2月至今
	常州信辉创业投资有限公司	董事长	2020年7月至今
	常州中小微企业金融服务有限公司	董事	2015年12月至2020年7月
	常州市资产管理有限公司	董事长	2015年6月至2020年7月
	常州信辉融资租赁有限公司	董事长	2013年10月至2020年7月
	常州产业投资集团有限公司	董事	2016年10月至2020年4月
陆建荣	常州信辉创业投资有限公司	副总经理	2019年1月至今
李军锋	山东黄金金控集团（香港）有限公司	董事	2020年5月至今
	山金金控（深圳）黄金投资发展有限公司	董事	2017年9月至2020年9月
	山金期货有限公司	监事	2014年8月至今
	山金金泉（上海）投资管理有限公司	董事	2020年5月至今
	山金金控（上海）贵金属投资有限公司	执行监事	2013年3月至今
	山金国际资产管理有限公司	董事	2018年12月至今
	山金金控（上海）投资管理有限公司	董事	2020年5月至今
	山金金泉（上海）资产管理有限公司	董事	2020年5月19日至今
	上海金岚投资有限公司	董事	2021年2月19日至今
	上海惠岚房地产开发有限公司	董事	2021年2月19日至今
周娟	海南新海岸置业有限公司	董事	2017年4月至今
	海南国文产业基金投资管理有限公司	董事	2017年7月至今
	山南华闻创业投资有限公司	执行董事兼总经理	2018年1月至今
	海南丰泽投资开发有限公司	董事	2018年3月至今
	海南省农旅文产业集团有限公司	董事	2019年10月至今
	上海智慧蓝海文化旅游集团有限公司	董事	2019年12月至今
殷建华	东海证券创新产品投资有限公司	董事长	2020年5月至今
李颖琦	深圳市广聚能源股份有限公司	独立董事	2018年4月至今
	上海国际机场股份有限公司	独立董事	2019年6月至今
	东方航空物流股份有限公司	独立董事	2018年12月至今
	上海昊海生物科技股份有限公司	独立董事	2020年6月至今
	陆家嘴国际信托有限公司	独立董事	2018年4月至今
	芜湖佳宏新材料股份有限公司	独立董事	2017年5月至2020年11月
韩长印	中曼石油天然气集团股份有限公司	独立董事	2013年12月至2020年8月
	宁波横河模具股份有限公司	独立董事	2018年11月至今
	浙江鸿禧能源股份有限公司	独立董事	2020年10月至今

	华维节水科技集团股份有限公司	独立董事	2020年12月至今
	芜湖佳宏新材料股份有限公司	独立董事	2020年12月至今
胡志浩	太平基金管理有限公司	独立董事	2016年8月至2020年11月
	天津农村商业银行股份有限公司	独立董事	2017年1月至2020年8月
	华安财产保险股份有限公司	独立董事	2018年11月至今
张峰	山金期货有限公司	董事长	2018年12月至今
	山金金泉（上海）投资管理有限公司	董事长	2020年5月至今
	山东黄金创业投资有限公司	执行董事	2018年9月至今
	山金金控（深圳）黄金投资发展有限公司	董事长	2017年9月至今
	雅诚投资有限公司	董事长	2018年12月至今
	山东黄金金融控股集团（香港）有限公司	董事长	2018年12月至今
	上海盛钜资产经营管理有限公司	董事长	2014年3月至今
	上海利得山金资产管理有限公司	董事	2015年10月至今
	上海金岚投资有限公司	董事长	2021年2月19日至今
	上海惠岚房地产开发有限公司	董事长	2021年2月19日至今
金日	山南华闻创业投资有限公司	监事	2016年10月至今
	陕西华商传媒集团有限责任公司	董事	2014年1月至2020年12月
	北京国广光荣广告有限公司	董事	2013年3月至今
	国视通讯（上海）有限公司	董事	2014年12月至今
	天津掌视亿通信息技术有限公司	董事	2014年12月至今
	海南新海岸置业有限公司	董事长	2017年4月至今
	海南丰泽投资开发有限公司	董事长	2017年7月至今
	北京华闻创新传媒文化研究院有限责任公司	董事	2015年12月至今
	深圳证券时报传媒有限公司	监事	2014年12月至2020年5月
	上海鸿立股权投资有限公司	监事	2015年10月至今
	国广华屏网络传媒（北京）有限公司	监事	2016年7月至2020年1月
	海南华闻民享投资有限公司	监事	2014年6月至今
	国广东方网络（北京）有限公司	监事	2013年9月至今
	国广环球在线文化传媒（北京）有限公司	监事	2014年6月至今
	甘肃公航旅首金文化发展有限公司	监事	2016年7月至2020年3月
	海南省文创旅游产业园集团有限公司	董事	2018年6月至今
	深圳市麦游互动科技有限公司	董事	2018年4月至今
	深圳爱玩网络科技股份有限公司	董事	2018年8月至今
	北京华闻视讯新媒体科技有限公司	董事	2017年11月至2020年7月
	上海奇势信息科技有限公司	董事	2017年3月至今
	湖北省资产管理有限公司	董事	2019年1月至今
	海南省农旅文产业集团有限公司	董事、总经理	2019年10月至今
	车音智能科技有限公司	董事	2019年6月至今
	上海智慧蓝海文化旅游集团有限公司	董事	2019年12月至今
	三亚辉途文化旅游投资发展有限公司	董事长、总经理	2019年12月至今
	海南华闻文化旅游发展有限公司	执行董事、总经理	2020年2月至今
	海南华闻互娱科技发展有限公司	执行董事、总经理	2020年2月至今
	深圳市新财富多媒体经营有限公司	董事	2020年7月至今

	海南华闻健康产业投资有限公司	董事	2020年4月至今
	三亚凤凰岭文化旅游有限公司	董事长	2020年5月至今
	海南盛世蓝海投资管理有限公司	董事	2021年1月至今
宣秀芳	东海证券创新产品投资有限公司	监事	2017年2月至今
冯文敏	东海投资有限责任公司	董事长、总经理	2020年7月至今
汪劲松	东海证券创新产品投资有限公司	董事	2020年5月至今

(六) 董事、高级管理人员的股权激励情况

适用 不适用

二、 员工情况

(一) 在职员工（公司及控股子公司）基本情况

截至报告期末，东海证券（母公司）在职员工合计 1579 人，其构成情况见下表：

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
经纪业务人员	947	62	110	899
投行人员	79	138	62	155
研究人员	35	1	7	29
资产管理业务人员	53	5	15	43
财务人员	87	2	12	77
信息技术人员	102	2	15	89
审计及合规人员	40	5	6	39
其他业务人员	241	36	88	189
行政人员	62	37	40	59
员工总计	1,646	288	355	1,579

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	11	13
硕士	414	406
本科	1,035	983
专科	165	159
专科以下	21	18
员工总计	1,646	1,579

截至报告期末，东海期货在职员工合计 323 人（含全资子公司东海资本 23 人），其构成情况见下表：

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
经纪业务人员	101	5	10	96
研究人员	14	5	3	16
资产管理业务人员	8	5	3	10
行政人员	7	3	0	10
审计及合规人员	7	2	1	8
财务人员	25	0	2	23
信息技术人员	20	0	0	20

其他业务人员	146	15	21	140
员工总计	328	35	40	323

按教育程度分类	期初人数	期末人数
硕士	65	58
本科	192	203
专科	65	56
专科以下	6	6
员工总计	328	323

截至报告期末，东海投资在职员工合计 19 人，其构成情况见下表：

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
高级管理人员	1	0	0	1
业务人员	21	2	5	18
员工总计	22	2	5	19

按教育程度分类	期初人数	期末人数
硕士	20	17
本科	2	2
员工总计	22	19

截至报告期末，东海创新投在职员工合计 4 人，其构成情况见下表：

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
高级管理人员	1	1	1	1
业务人员	3	1	1	3
员工总计	4	2	2	4

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	0	1
硕士	3	3
本科	1	0
员工总计	4	4

截至报告期末，东海国际金融控股有限公司在职员工合计 27 人，其构成情况见下表：

按工作性质分类	期初人数	本期新增	本期减少	期末人数
公司高管	2	1	2	1
资产管理业务人员	4	0	1	3
投资银行人员	6	2	4	4
经纪业务人员	4	8	3	9
法律合规人员	2	2	2	2
财务人员	3	0	1	2

人力资源人员	2	1	1	2
信息技术人员	1	0	0	1
行政人员	3	0	0	3
员工总计	27	14	14	27

按教育程度分类	期初人数	期末人数
博士	0	0
硕士	16	14
本科	7	8
专科	1	2
专科以下	3	3
员工总计	27	27

员工薪酬政策、培训计划以及需公司承担费用的离退休职工人数等情况：

截至报告期末，公司及主要子公司共有员工 1952 人，总人数相比去年同期减少 75 人，其中母公司减少 67 人，东海投资减少 3 人，东海期货减少 5 人，东海国际金融控股有限公司、东海创新投人数没有变化。

公司根据发展需求，通过校园招聘及社会招聘等多种方式引进人才，公司积极组织员工参加各种内部、外部培训，内容涉及相关业务及员工素质技能提升培训。

公司的薪酬由固定薪酬、变动薪酬和福利三部分组成。其中固定薪酬包括基本工资和津贴；变动薪酬采用月度绩效奖金与年度绩效奖金相结合的形式发放。固定薪酬与变动薪酬共同构成年度现金总收入，年度现金总收入与福利共同构成年度总薪酬。

公司定期对证券行业薪酬进行市场调研，以保持公司薪酬水平对外具有竞争力，对内具有公平性；公司实施全员劳动合同制，依据《中华人民共和国劳动法》和地方相关法规、规范性文件，与所有员工签订《劳动合同书》，向员工支付的薪酬包括薪金、津贴及奖金；公司依据国家有关法律、法规及地方相关社会保险政策，为员工办理养老、医疗、工伤、失业、生育等社会保险和住房公积金，为员工代缴代扣个人所得税。

截至报告期末，需公司承担费用的离退休职工人数为 0。

（二）核心人员（公司及控股子公司）基本情况及变动情况

适用 不适用

三、 证券经纪人相关情况

截止报告期末，公司运营的证券经纪业务分支机构中，有证券经纪人的分支机构为 69 家，在合同期内的证券经纪人数量合计 582 名。

证券经纪人直接隶属证券经纪业务分支机构，公司根据中国证监会相关要求制定公司证券经纪人管理办法，管理、监督、协调分支机构证券经纪人工作。

公司对证券经纪人一直按照相关制度进行严格管理，证券经纪人在公司的授权范围内从事客户招揽和客户服务等相关活动。公司对证券经纪人招揽和服务的客户进行回访，并在运营服务平台中对异常情况进行监控，及时提示相关风险。

四、 报告期后更新情况

√适用 □不适用

公司董事会于 2020 年 11 月 18 日收到独立董事胡志浩先生递交的辞职报告，自股东大会选举产生新任独立董事之日起辞职生效。2021 年 2 月 3 日，公司 2021 年第一次临时股东大会审议通过《关于选举刘世安先生为公司独立董事的议案》，自此，刘世安先生任公司独立董事，任期与第三届董事会一致。胡志浩先生不再担任公司独立董事。

公司董事会于 2021 年 4 月 30 日收到董事周娟女士递交的辞职报告，自 2021 年 4 月 30 日起辞职生效。公司监事会于 2021 年 4 月 30 日收到监事金日先生递交的辞职报告，自 2021 年 4 月 30 日起辞职生效。

第八节 行业信息

是否自愿披露

是 否

第九节 公司治理、内部控制和投资者保护

事项	是或否
年度内是否建立新的公司治理制度	√是 □否
投资机构是否派驻董事	√是 □否
监事会对本年监督事项是否存在异议	□是 √否
管理层是否引入职业经理人	√是 □否
会计核算体系、财务管理、风险控制及其他重大内部管理制度本年是否发现重大缺陷	□是 √否
是否建立年度报告重大差错责任追究制度	√是 □否

一、 公司治理

(一) 制度与评估

1、 公司治理基本状况

股东大会是公司的最高权力机构。公司每年按规定时间召开年度股东大会，在有临时需要表决的事项时召开临时股东大会，股东大会的通知方式、召开方式、表决程序和决议内容均符合《公司法》和《公司章程》的规定。《公司章程》对控股股东、实际控制人的权责进行了明确约定，给所有股东提供合适的保护和平等权利。公司控股股东、实际控制人严格按照《公司法》、《证券法》、《公司章程》等有关规定规范自己的行为，依法行使其权利并承担相应义务，没有超越股东大会授权范围行使职权、直接或间接干预本公司的决策和经营活动。公司控股股东、实际控制人与公司在人员、财务、资产、机构和业务方面做到相互独立、各自分开，保证了公司运作的独立性。

董事会是公司的常设决策机构，对股东大会负责，对公司经营活动中的重大决策问题进行审议并做出决定，或提交股东大会审议。董事会的通知方式、召开方式、表决程序和决议内容均符合《公司法》和《公司章程》的规定。公司董事会设立投资决策委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会、风险控制委员会，专门委员会在相关事项作出决议前及时审议并发表意见。公司所有董事均符合法律法规规定的任职条件。同时，公司保障董事的知情权，为董事履行职责提供必要条件。

监事会是公司的监督机构，负责对董事、高级管理人员履行职务的行为及公司财务进行监督。

公司执行委员会主任（总裁）由董事会聘任，对董事会负责，主持公司的经营管理工作 and 组织实施董事会决议。

公司按相关法律法规规范了法人治理结构，制定了议事规则，明确决策、执行、监督等方面的职责权限，形成科学有效的职责分工和制衡机制，保障了公司所有股东的平等权利和内部控制的有效运行。公司长期以来致力于法人治理结构和制度建设的不断完善。报告期内，公司严格遵守《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》等法律法规和规范性文件的有关规定，建立健全了公司的规章制度和内控管理体系，建立了完善的法人治理结构。通过制度和授权体系，不断完善法人治理结构，规范公司运作。公司股东大会、董事会、监事会和经营管理层各负其责、各尽其职。公司股东大会、董事会、监事会的召开程序、表决程序合法有效。

为完善公司内部控制管理制度，规范决策流程，保证科学决策，公司根据法律、法规、中国证券监督管理委员会相关规章制度的要求，以及全国中小企业股份转让系统有限责任公司对挂牌公司的规范要求，结合公司实际情况，制定了《东海证券股份有限公司董事长工作细则》，修订了《东海证券股份有限公司章程》、《东海证券股份有限公司股东大会议事规则》、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》、《东海证券股份有限公司信息披露管理制度》、《东海证券股份有限公司内幕信息知情人登记制度》等公司相关制度。

2、公司治理机制是否给所有股东提供合适的保护和平等权利的评估意见

公司严格按照《公司法》、《公司章程》、《股东大会议事规则》等相关规定，召集、召开股东大会，平等对待所有股东，确保全体股东能充分行使自己的合法权利，所有股东按其所持有股份的种类享有权利，承担义务。公司董事会认真执行股东大会的审议事项，监事会有效地实行监督检查机制，公司治理机制给所有股东提供了合适的保护和平等权利。

3、公司重大决策是否履行规定程序的评估意见

公司重大决策均按照《公司法》等法律法规及《公司章程》等内部管理制度的相关规定履行了程序。

4、公司章程的修改情况

为贯彻落实《证券法》、《证券公司股权管理规定》、《全国中小企业股份转让系统挂牌公司治理规则》等法律法规和中国证监会相关规定的要求，结合公司实际经营管理需要，公司对《东海证券股份有限公司章程》相关内容进行修订。2020年6月29日，东海证券2019年年度股东大会审议通过了《关于修订〈东海证券股份有限公司章程〉的议案》，详见公告（公告编号：2020-033、2020-053）。

(二) 三会运作情况

1、三会召开情况

会议类型	报告期内会议召开的次数	经审议的重大事项（简要描述）
董事会	11	详见第九节公司治理、内部控制和投资者保护一、公司治理（二）三会运作情况 1、三会召开情况（1）董事会情况
监事会	4	详见第九节公司治理、内部控制和投资者保护一、公司治理（二）三会运作情况 1、三会召开情况（2）监事会情况
股东大会	4	详见第九节公司治理、内部控制和投资者保护一、公司治理（二）三会运作情况 1、三会召开情况（3）股东大会情况

(1) 董事会情况

董事会届次	召开日期	表决通过事项
第三届董事会第一次会议	2020年1月15日	1、《关于选举公司第三届董事会董事长的议案》； 2、《关于公司第三届董事会专门委员会组成方案的议案》； 3、《关于聘任殷建华先生为公司总裁的议案》； 4、《关于指定殷建华先生代行公司合规总监兼首席风险官职务的议案》； 5、《关于聘任公司高级管理人员的议案》； 6、《关于聘任公司证券事务代表的议案》； 7、《关于启动职业经理人改革的议案》。
第三届董事会第二次（临时）会议	2020年2月26日	1、《关于聘任马芸女士为公司合规总监兼首席风险官的议案》； 2、《关于申请调整19东海债募集资金用途的专项议案》。
第三届董事会第三次（临时）会议	2020年3月16日	1、《关于申请授权发行境内债务融资工具的议案》； 2、《关于召开2020年第一次临时股东大会的议案》。
第三届董事会第四次会议	2020年4月20日	1、《关于审议〈东海证券股份有限公司2019年年度报告〉及摘要

		<p>的议案》；</p> <p>2、《东海证券股份有限公司 2019 年度管理层工作报告》；</p> <p>3、《东海证券股份有限公司 2019 年度董事会工作报告》；</p> <p>4、《东海证券股份有限公司 2019 年度独立董事工作报告》；</p> <p>5、《关于 2019 年度财务决算、2020 年度财务预算的议案》；</p> <p>6、《关于 2019 年度利润分配的议案》；</p> <p>7、《关于续聘天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）为公司审计机构的议案》；</p> <p>8、《关于修订会计政策的议案》；</p> <p>9、《关于公司 2019 年度日常关联交易执行情况及预计 2020 年度日常关联交易的议案》；</p> <p>10、《关于审议〈东海证券股份有限公司关于二〇一九年合规情况的报告〉的议案》；</p> <p>11、《关于审议东海证券股份有限公司 2019 年风险控制指标报告、风险控制指标监管报表、风险评估及风险管理工作报告的议案》；</p> <p>12、《关于公司 2020 年 5 月 1 日至 2021 年 4 月 30 日期间风险偏好、风险容忍度和重大风险限额议案》；</p> <p>13、《关于审议〈东海证券股份有限公司 2019 年度内部控制自我评价报告〉的议案》；</p> <p>14、《关于审议〈东海证券股份有限公司 2019 年度重大关联交易专项审计报告〉的议案》；</p> <p>15、《关于审议〈东海证券股份有限公司 2019 年度合规管理有效性评估报告〉的议案》；</p> <p>16、《关于修订〈东海证券股份有限公司章程〉的议案》；</p> <p>17、《关于修订〈东海证券股份有限公司股东大会事规则〉的议案》；</p> <p>18、《关于修订〈东海证券股份有限公司对外担保管理制度〉的议案》；</p> <p>19、《关于修订〈东海证券股份有限公司关联交易管理制度〉的议案》；</p> <p>20、《关于修订〈东海证券股份有限公司信息披露管理制度〉的议案》；</p> <p>21、《关于撤销和设立分支机构的议案》；</p> <p>22、《关于注销东海投资有限责任公司下属子公司常州东海产业投资管理有限公司的议案》；</p> <p>23、《关于优化调整公司一级部门的议案》；</p> <p>24、《关于金融机构授信的议案》；</p> <p>25、《关于审议东海证券股份有限公司 2019 年信息技术工作报告、2020 年信息技术工作计划的议案》；</p> <p>26、《关于召开 2019 年年度股东大会的议案》。</p>
第三届董事会第五次（临时）会议	2020 年 5 月 29 日	《关于成立资产管理部的议案》。
第三届董事会第六次（临时）会议	2020 年 6 月 29 日	<p>1、《关于修订〈东海证券股份有限公司内幕信息知情人登记制度〉的议案》；</p> <p>2、《关于制定〈东海证券股份有限公司董事长工作细则〉的议案》；</p> <p>3、《关于审议〈东海证券股份有限公司执行委员会和执行委员会主任(总裁)工作细则〉的议案》；</p> <p>4、《关于聘任公司高级管理人员的议案》；</p> <p>5、《关于公司高级管理人员职责分工的议案》。</p>

第三届董事会第七次（临时）会议	2020年7月21日	1、《关于聘任李勇田同志为公司执行委员会委员的议案》； 2、《关于李勇田同志职责分工的议案》。
第三届董事会第八次（临时）会议	2020年8月6日	1、《关于巫兰同志2018年度绩效考核与变动薪酬分配的议案》； 2、《关于常州总部职能调整的议案》； 3、《关于转让深圳市东海天富投资有限公司股权的议案》。
第三届董事会第九次（临时）会议	2020年8月28日	1、《关于审议〈东海证券股份有限公司2020年半年度报告〉的议案》； 2、《关于审议〈东海证券股份有限公司关于2020年上半年度合规情况的报告〉的议案》； 3、《关于审议东海证券股份有限公司2020年上半年风险控制指标报告、风险控制指标监管报表、风险评估及风险管理工作报告的议案》； 4、《关于申请授权发行债券的议案》； 5、《关于审议〈东海证券股份有限公司平稳推进资产管理业务规范整改工作方案〉的议案》； 6、《关于召开2020年第二次临时股东大会的议案》。
第三届董事会第十次（临时）会议	2020年10月22日	1、《关于修订〈东海证券股份有限公司全面风险管理制度〉的议案》； 2、《关于修订〈东海证券股份有限公司廉洁从业管理制度〉的议案》； 3、《关于向全资子公司东海证券创新产品投资有限公司增资的议案》； 4、《关于设立投资银行发展部的议案》； 5、《关于资产托管部变更为机构业务部的议案》。
第三届董事会第十一次（临时）会议	2020年12月4日	1、《关于修订〈东海证券股份有限公司合规管理基本制度〉的议案》； 2、《关于修订〈东海证券股份有限公司融资融券业务管理办法〉的议案》； 3、《关于公司高级管理人员职责分工调整的议案》。

（2）监事会情况

监事会届次	召开日期	表决通过事项
第三届监事会第一次会议	2020年1月15日	《关于选举公司第三届监事会主席的议案》。
第三届监事会第二次会议	2020年2月28日	《关于审议〈内部审计部2019年度工作总结〉的议案》。
第三届监事会第三次会议	2020年4月20日	1、《关于审议〈东海证券股份有限公司2019年年度报告〉及摘要的议案》； 2、《东海证券股份有限公司2019年度监事会工作报告》； 3、《关于审议〈东海证券股份有限公司关于二〇一九年合规情况的报告〉的议案》； 4、《关于审议东海证券股份有限公司2019年风险控制指标报告、风险控制指标监管报表、风险评估及风险管理工作报告的议案》； 5、《关于发放监事会主席变动薪酬的议案》。
第三届监事会第四次会议	2020年8月28日	1、《关于审议〈东海证券股份有限公司2020年半年度报告〉的议案》；

		2、《关于审议〈东海证券股份有限公司关于2020年上半年度合规情况的报告〉的议案》； 3、《关于审议东海证券股份有限公司2020年上半年风险控制指标报告、风险控制指标监管报表、风险评估及风险管理工作报告的议案》。
--	--	---

(3) 股东大会情况

股东大会届次	召开日期	表决通过事项
2019年第四次临时股东大会	2020年1月15日	1、《关于选举第三届董事会成员（非职工代表董事）的议案》； 2、《关于选举第三届监事会成员（非职工代表监事）的议案》； 3、《关于调整公司董事、监事津贴标准的议案》。
2020年第一次临时股东大会	2020年3月31日	《关于申请授权发行境内债务融资工具的议案》。
2019年年度股东大会	2020年6月29日	1、《关于审议〈东海证券股份有限公司2019年年度报告〉及摘要的议案》； 2、《东海证券股份有限公司2019年度董事会工作报告》； 3、《东海证券股份有限公司2019年度监事会工作报告》； 4、《东海证券股份有限公司2019年度独立董事工作报告》； 5、《关于2019年度财务决算、2020年度财务预算的议案》； 6、《关于2019年度利润分配的议案》； 7、《关于续聘天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）为公司审计机构的议案》； 8、《关于公司2019年度日常关联交易执行情况及预计2020年度日常关联交易的议案》； 9、《关于修订〈东海证券股份有限公司章程〉的议案》； 10、《关于修订〈东海证券股份有限公司股东大会议事规则〉的议案》； 11、《关于修订〈东海证券股份有限公司对外担保管理制度〉的议案》； 12、《关于修订〈东海证券股份有限公司关联交易管理制度〉的议案》； 13、《关于金融机构授信的议案》； 14、《关于发放监事会主席变动薪酬的议案》。
2020年第二次临时股东大会	2020年9月15日	《关于申请授权发行债券的议案》。

2、三会的召集、召开、表决程序是否符合法律法规要求的评估意见

公司股东大会、董事会、监事会的召集、提案审议、通知时间、召开程序、授权委托、表决和决议等均符合法律法规及《公司章程》的规定。

(三) 公司治理改进情况

截至报告期末，公司董事11人，其中独立董事4名，非独立董事7名，包括2名由控股股东及实际控制人以外的股东或其代表委派的非独立董事和1名职工董事。董事会下设薪酬与提名委员会、审计委员会、风险控制委员会和投资决策委员会四个专门委员会，实行董事会的内部分工。

截至报告期末，公司监事 5 人，其中 2 名为职工监事，其他 3 名均来自控股股东及实际控制人以外的股东或其代表。

公司通过制定和修订一系列制度，进一步完善了公司的治理结构。

(四) 投资者关系管理情况

公司高度重视投资者关系管理工作，董事会秘书负责信息披露事务，建立了较为完善的与股东沟通的有效渠道。报告期内，公司严格按照规章制度进行信息披露工作，《东海证券股份有限公司信息披露管理制度》、《东海证券股份有限公司投资者关系管理制度》、《东海证券股份有限公司内幕信息知情人登记制度》等规章制度得以有效实施，公司信息披露事务管理水平和信息披露质量不断提高，维护了信息披露的公平原则，保护了广大投资者的合法权益。除法律规定的信息披露途径外，公司主要通过电话、电子邮件、公司网站等形式与投资者进行互动交流。公司不断优化投资者热线、信箱和网站的功能，以便投资者方便、快捷、及时和全面地了解公司情况，切实保护中小股东权益，保证其充分的知情权，确保信息披露的公平性，确保所有股东尤其是中小股东能够充分行使自己的权利。

(五) 董事履行职责情况

1、报告期内董事履行职责情况

董事姓名	是否独立董事	本报告期内应参加董事会次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参会且未委托参会
钱俊文	否	11	11	0	0	否
陈耀庭	否	11	10	1	0	否
林田	否	11	10	1	0	否
陆建荣	否	11	11	0	0	否
李军锋	否	11	9	2	0	否
周娟	否	11	11	0	0	否
殷建华	否	11	10	1	0	否
李颖琦	是	11	10	1	0	否
韩长印	是	11	9	2	0	否
胡志浩	是	11	10	1	0	否
胡海峰	是	11	11	0	0	否
袁怀东（已离任）	否	0	0	0	0	否
刘洪君（已离任）	否	0	0	0	0	否
赵俊（已离任）	否	0	0	0	0	否
杨瑞龙（已离任）	是	0	0	0	0	否

年内召开董事会会议次数	11
其中：现场或现场结合通讯方式召开会议次数	11
通讯方式召开会议次数	0

报告期内，独立董事李颖琦女士在第三届董事会第一次会议上对《关于启动职业经理人改革的议案》投弃权票。除上述情况外，公司董事未对公司本年度的其他董事会议案及其他非董事会议案事项提出异议，公司董事勤勉尽责地履行了董事的职责。

2、报告期内独立董事履行职责情况

姓名	本年应参加董事会次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数
李颖琦	11	10	1	0
韩长印	11	9	2	0
胡志浩	11	10	1	0
胡海峰	11	11	0	0
杨瑞龙（已离任）	0	0	0	0

报告期内，公司独立董事严格按照《公司法》、《证券公司监督管理条例》、《公司章程》、《独立董事工作制度》等相关要求，勤勉工作，忠实尽责，充分发挥独立董事的专业性和独立性，切实维护公司及公司全体股东的合法利益。

报告期内，公司共召开了 11 次董事会会议、4 次股东大会。各位独立董事均参加了报告期内历次董事会会议，李颖琦女士参加了东海证券 2019 年年度股东大会和 2020 年第二次临时股东大会；韩长印先生参加了东海证券 2019 年第四次临时股东大会、2020 年第一次临时股东大会、2019 年年度股东大会和 2020 年第二次临时股东大会；胡志浩先生参加了东海证券 2019 年年度股东大会和 2020 年第二次临时股东大会；胡海峰先生参加了东海证券 2019 年年度股东大会和 2020 年第二次临时股东大会。各位独立董事在会议召开前均能主动了解相关情况，仔细阅读会议材料，为董事会决策做好充分准备；各位独立董事在会议中认真审议各项议案，发表自身专业意见，为董事会决策发挥积极重要作用。

公司独立董事在东海证券第三届董事会第四次会议上就关联交易事项发表了事先认可意见和独立意见。

独立董事勤勉尽责地履行了独立董事的职责。

（六） 监事履行职责情况

监事姓名	报告期内应参加监事会次数	出席次数	亲自出席次数	委托出席次数	缺席次数	是否连续两次未亲自参会且未委托参会
韩斌	4	4	4	0	0	否
张峰	4	4	1	3	0	否
金日	4	4	4	0	0	否
汤晓云	4	4	4	0	0	否
宣秀芳	4	4	4	0	0	否
沈彩芬（已离任）	0	0	0	0	0	否

年内召开监事会会议次数	4
其中：现场或现场结合通讯方式召开会议次数	4
通讯方式召开会议次数	0

报告期内，公司监事未对公司本年度的监事会议案及非监事会议案事项提出异议，公司监事勤勉尽责地履行了监事的职责。

报告期内，公司监事会派监事列席了各次董事会现场会议和股东大会，监督检查了公司依法运作情况、重大决策、重大经营活动情况及公司的财务状况。监事会对公司 2019 年年度报告、2020 年半年度报告进行了审核，认为公司 2019 年年度报告、2020 年半年度报告的编制和审核程序符合法律、法规、中国证监会及全国中小企业股份转让系统的规定和《公司章程》的要求，报告的内容能够真实、准确、完整地反映公司实际情况，监事会对报告期内的监督事项无异议。

(七) 董事会下设专门委员会在本年度内履行职责时所提出的重要意见和建议

投资决策委员会就东海证券第三届董事会第二次（临时）、第三次（临时）、第四次、第九次（临时）、第十次（临时）会议审议的议案进行了预审议；

审计委员会就东海证券第三届董事会第四次会议审议的议案进行了预审议；

薪酬与提名委员会就东海证券第三届董事会第二次（临时）、第六次（临时）、第八次（临时）会议审议的议案进行了预审议；

风险控制委员会就东海证券第三届董事会第四次、第九次（临时）、第十次（临时）、第十一次（临时）会议审议的议案进行了预审议。

董事会各专门委员会严格按照《公司章程》、《董事会议事规则》及各专门委员会工作细则召开会议履行职责，依法合规运作，分别对公司发展战略、财务报告、内部控制、风险管理、高管薪酬与考核等事项提出意见与建议，为董事会高效、科学决策发挥重要作用。

二、 内部控制

(一) 监事会就年度内监督事项的意见

公司监事会对本年度内的监督事项无异议。

(二) 公司保持独立性、自主经营能力的说明

公司与控股股东在业务、人员、资产、机构、财务等方面能保证独立性和自主经营能力。

(三) 对重大内部管理制度的评价

1、公司合规管理体系建设情况

2020年，公司继续坚持合法合规的经营理念，坚持全面性、主动性、独立性基本原则，根据新的监管要求扎实开展各项合规管理基础性工作，认真履行合规咨询、合规审核、合规检查、合规培训、信息隔离、反洗钱及合规人员管理等职责。同时，积极培育公司合规管理文化，树立合规从高层做起、合规创造价值的合规管理理念，努力实现创新与风控的动态平衡，促使公司健康稳定的发展。

(1) 建立健全公司各项规章制度

公司根据有关监管规定与公司业务发展需要，不断完善合规管理制度体系，2020年，修订了包括《东海证券股份有限公司合规管理基本制度》《东海证券股份有限公司合规审查办法》等在内的8项制度，新增包括《东海证券股份有限公司廉洁从业实施细则》《东海证券股份有限公司工作人员执业行为合规管理办法》在内的4项制度，进一步完善了合规管理制度及流程，确保公司合规管理及内部控制机制健全有效，符合法律规定的条件和要求。同时，公司严格按照制度管理要求，对照法律法规、监管规定和行业规范，组织开展制度梳理工作，并要求各部门主动制定和修订与本部门业务相关的各项制度，以匹配本部门的业务发展需要，持续完善公司制度体系建设。

根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》要求，公司建立了与自身经营范围、组织结构和业务规模相适应的四级合规管理组织体系。第一级，由公司董事会、董事会下设的风险控制委员会对公司合规管理的有效性承担责任；监事会对履行合规管理职责的情况进行监督；第二级，由公司高级管理人员和各部门、分支机构及各层级子公司（以下简称“各单位”）负责人组成，落实合规管理目标，对合规运营承担责任；第三级为合规总监和合规管理部，对公司的经营管理及其工作人员的执业行为的合规性进行审查、监督和检查，督导和协助高级管理人员、各单位负责人有效管理合规风险。第四级，由公司全体工作人员组成，负责遵守并具体执行公司的合规管理政策和制度安排，并对其执业行为的合规性承担责任。各部门负责人担任部门合规管理第一责任人，各部门及分支机构均设有合规管理人

员，重要业务部门设专职合规管理人员。各业务部门运作与中后台管理支持相互分离，各业务部门、分支机构合规管理组织架构健全，保障公司合规管理工作有序运行。

（2）持续开展合规管理各项基础工作

1) 组织合规培训

公司积极开展合规培训，按照 2020 年计划积极开展公司合规培训，开展有针对性的合规培训 7 次，其中包括《证券经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》宣导培训、《员工执业行为合规管理办法》制度培训、反洗钱相关主题培训等；组织开展内部培训 23 次，包括股转改革专项业务培训、《全国法院审理债券纠纷案件座谈会纪要》解读、新《证券法》学习、《证券公司分类监管规定》学习等。

2) 及时落实监管部门要求，认真开展自查工作

公司及时落实监管要求，传达和处理监管部门下发的函件等，并与证券监管部门、自律组织保持良好的联系沟通，认真处理证券监管机构和自律组织要求调查的事项，并积极配合、跟踪和评估监管意见和监管要求的落实。同时，按照监管部门要求和公司自身发展需要，不断推动各部门开展自查自纠工作，对于合规风险早发现、早整改，持续规范公司各项工作。

3) 继续加强合规考核工作

报告期内，公司根据《合规考核管理办法》和合规考核表，共开展了 1 次合规考核。公司合规管理部采取自评、初评和复评的考核方式，对各单位和合规管理人员进行全面合规考核。公司各单位合规管理人员积极开展本部门合规考核工作，按照考核表中的内容进行自查梳理并撰写合规考核报告，填写考核表。同时，公司合规管理部对各单位的合规管理工作进行评价和指导，由合规督导员负责各单位的考核初评工作，经合规管理部讨论复评后确定合规考核的分数，体现了合规考核工作的公平、公正。

4) 开展信息隔离墙工作

公司制定了《东海证券股份有限公司信息隔离墙管理办法》对信息隔离墙管理进行了规范，明确信息隔离及利益冲突的基本要求及使用范围，对公司开展各类业务需进行利益冲突审查及主要审查事项以及信息隔离专线管理的措施进行了规定。公司合规管理部开展信息隔离墙检测和限制工作，并对其进行监控和限制，履行研究报告审查、跨回墙管理、从业人员账户清查、电话监控等职能。2020 年共审查研究报告 278 篇，相关部门共进行隔离检测 19421 次，未通过限制名单、观察名单检测的次数为 94 次，共发生跨墙业务申请 13 起。

5) 不断加强和完善反洗钱专项工作

2020 年，公司继续深化落实《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》（银反洗发[2018]19 号）《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》（银发[2017]235 号）《中国人民银行办公厅关于进一步加强反洗钱和反恐怖融资工作的通知》（银发[2018]164 号）等法律法规及监管要求，制定了《东海证券股份有限公司反洗钱考核工作指引》，对各单位和反洗钱管理人员绩效考核的程序、内容、结果的运用以制度的形式予以固化，为反洗钱绩效考核提供制度保障。同时根据法律法规和公司实际情况修订了《东海证券股份有限公司反洗钱工作管理办法》，进一步完善了反洗钱制度，增加了反洗钱领导小组和工作小组成员的内容，并明确了相关职责。

公司根据反洗钱监管思路和工作重点，积极开展反洗钱各项基础工作，履行证券公司反洗钱工作义务，重点开展了客户风险等级划分及分类管理体系建设、落实和强化可疑交易报告、客户身份重新识别等工作，建立了公司反洗钱管理岗、复核岗，营业部反洗钱工作岗、复核岗的四级工作体系。此外，公司不断从人员配置、制度建设、客户身份识别工作、可疑交易报送、客户风险等级划分、反洗钱系统建设、培训和宣传等方面进行反洗钱自评估工作，并切实落实发现问题的整改措施，加强反洗钱工作的有效性，维护正常的金融秩序。

6) 完成合规检查及审计稽核工作

报告期内，公司合规管理部进一步完善合规检查机制，各相关部门就合规检查工作进行明确的分工与协作，并根据上述部门职责分工情况确定检查重点。同时，公司制定了合规检查年度计划，并得到有效执行，针对监管重点关注事项、新政策法规落实情况、新产品和新业务开展情况等开展了合规检查，

及时处理发现的风险隐患。

公司合规管理部采取现场抽查、复查以及非现场检查方式，2020年完成对公司资产管理部、东海投资有限责任公司、东海证券创新产品投资有限公司的现场合规检查以及对9家分支机构的反洗钱非现场专项检查。内部审计部完成各项审计、检查、评估工作共计58项。

(四) 年度报告差错责任追究制度相关情况

报告期内，公司信息披露负责人及相关人员严格遵守《东海证券股份有限公司年度报告重大差错责任追究制度》，公司认真履行信息披露义务，保证年度报告信息披露的质量，未发生年度报告事项需问责情形。

(五) 其他自愿披露事项

是否自愿披露

√是 □否

1、内部控制制度建设及责任声明

公司根据《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》等法律法规的要求，参照中华人民共和国财政部、证监会、审计署、银监会、保监会联合发布的《企业内部控制基本规范》及其配套指引，建立健全了公司内部控制制度，并将内部控制建设始终贯穿于公司的经营发展之中，在业务开展过程中始终坚持制度、流程先行的原则，不断完善内部控制制度，规范制度执行，强化监督检查，促进公司持续健康发展。

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。公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并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。

2、内部控制自我评价报告

(1) 公司内部控制制度

公司根据《公司法》、《证券法》、《证券公司治理准则》及中国证券监督管理委员会相关规章制度的要求，制定了公司章程、股东大会、董事会、监事会及董事会各专门委员会议事规则、信息披露、关联交易等重大规章制度，明确了股东大会、董事会、监事会的工作程序。公司按照监管要求，在合规管理方面，建立了合规管理基本制度、合规咨询、合规报告、合规审查、合规检查、合规考核、合规问责、反洗钱、信息隔离墙、子公司合规管理、廉洁从业、工作人员执业行为合规管理等基本制度；在风险管理方面，建立了全面风险管理、风险管理专业委员会议事规则、风险控制指标管理、压力测试、市场风险管理、信用风险管理、流动性风险管理、风控人员管理、风险管理考核、风险报告等基本制度；在人力资源管理方面，建立了招聘录用、考勤、培训、绩效管理、薪酬管理、管理干部选拔任用、专业序列职级体系管理等方面的管理制度；在行政综合管理方面，建立了印章、公文、档案、固定资产及低值易耗品管理、办公大楼管理、采购管理委员会议事规则等方面的管理制度；在运营管理方面，建立了账户管理、集中运营、清算交收、适当性管理、回访、投诉等方面的管理制度；在财务管理方面，建立了会计核算、全面预算管理、资金管理、费用报销、财务分析、会计档案管理、账户管理、发票管理等方面的管理制度；在信息技术管理方面，建立了金融科技决策委员会、信息系统运行管理、信息安全事件应急处理、信息技术类资产采购、信息技术供应商管理等方面的管理制度；在内部审计方面，建立了内部审计工作制度、离任审计、反洗钱审计、子公司审计等方面的管理制度；在法律事务方面，建立了法律事务管理、子公司法律事务实施细则等管理制度。公司针对各项业务均建立了相应的内部控制制度。

(2) 公司的法人治理结构

股东大会是公司的最高权力机构，公司每年按规定的时间召开年度股东大会，在有临时需要表决的

事项时召开临时股东大会，股东大会的通知方式、召开方式、表决程序和决议内容均符合《公司法》和公司章程的规定。董事会是公司的常设决策机构，向股东大会负责，对公司经营活动中的重大决策问题进行审议并做出决定或提交股东大会审议。公司董事现有 11 人，其中独立董事 4 名。董事会下设薪酬与提名委员会、审计委员会、风险控制委员会和投资决策委员会四个专门委员会，实行董事会的内部分工。监事会是公司的监督机构，负责对公司董事会以及对董事、高级管理人员履行职务的行为及公司财务进行监督。公司执行委员会主任（总裁）由董事会聘任，对董事会负责，主持公司的经营管理工作 and 组织实施董事会决议。公司按照相关法律法规规范了法人治理结构，制定了议事规则，明确决策、执行、监督等方面的职责权限，形成科学的职责分工和制衡机制，保障了内部控制的有效运行。

报告期内，公司严格遵守《公司法》、《证券法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司治理准则》等法律法规和规范性文件的有关规定，建立健全了公司的规章制度和内控管理体系，建立了完善的法人治理结构。

（3）公司的授权控制

公司建立了清晰的授权体系，在法人治理层面，公司股东大会、董事会和监事会根据公司章程及议事规则履行职权；在业务层面，公司执行委员会及下设专业委员会按照工作细则、议事规则等规定履行职权，各业务部门、各分支机构在部门职责范围内履行相应的职责；在人员层面，工作人员在岗位职责范围内按照公司制定的各项制度和操作规程履行职责。

（4）内部隔离墙机制

公司制定了《东海证券股份有限公司信息隔离墙管理办法》对信息隔离墙管理进行规范，明确信息隔离及利益冲突的基本要求及使用范围，对公司开展各类业务需进行利益冲突审查及主要审查事项以及信息隔离专线管理的措施进行了规定。公司从事证券经纪业务、证券自营业务、证券资产管理业务、投资银行类业务、证券研究咨询业务、另类投资业务的部门或子公司均拥有各自独立的办公场地，配有独立的专业人员，无相互交叉兼职情形。公司将客户资金与自有资金严格分开，严格按照法律法规和监管部门的要求强化资金的集中管理。公司已对存在潜在利益冲突的各类业务在业务、物理、人员、信息系统、资金与账户等方面实施隔离，分开管理。公司建设了信息隔离墙管理系统，根据信息隔离墙制度的要求进行清单管理，开展信息隔离墙检测和限制工作。

3、内部控制自我评价结论与内部控制审计报告意见

（1）内部控制自我评价结论

本公司按照《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》以及中国证监会相关规章制度的要求，通过建立、健全和执行各项内部控制制度，不断完善内部控制机制，将内部控制覆盖公司所有业务、各部门、分支机构、子公司及全体员工，形成了事前防范、事中监控、事后检查的内部控制体系。公司在内部控制机制和制度方面不存在重大缺陷，实际执行中也不存在重大偏差。

（2）内部控制审计报告意见

根据天职业字[2021]20891号《内部控制鉴证报告》，东海证券按照《证券公司内部控制指引》及相关规定于2020年12月31日在所有重大方面保持了有效的与财务报告有关的内部控制。

4、关联交易专项审计报告

根据《关于进一步加强证券公司关联交易监管有关事项的通知》（苏证监机构字〔2018〕64号）要求，公司对与控股股东、实际控制人及其控制企业以及上述企业的重要上下游企业（以下简称“控股股东及其关联方”）2020年度进行的重大关联交易实施了专项审计，经审计，公司与控股股东及其相关方的重大关联交易符合监管通知要求。

三、 投资者保护

(一) 公司股东大会实行累积投票制和网络投票安排的情况

适用 不适用

(二) 特别表决权股份

适用 不适用

第十节 财务会计报告

一、 审计报告

是否审计	是	
审计意见	无保留意见	
审计报告中的特别段落	<input checked="" type="checkbox"/> 无 <input type="checkbox"/>强调事项段 <input type="checkbox"/> 其他事项段 <input type="checkbox"/> 持续经营重大不确定性段落 <input type="checkbox"/> 其他信息段落中包含其他信息存在未更正重大错报说明	
审计报告编号	天职业字[2021]15023号	
审计机构名称	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）	
审计机构地址	北京市海淀区车公庄西路19号外文文化创意园12号楼	
审计报告日期	2021年4月29日	
签字注册会计师姓名及连续签字年限	丁启新	户永红
	3年	1年
会计师事务所是否变更	否	
会计师事务所连续服务年限	5年	
会计师事务所审计报酬	95万元	
审计报告		
天职业字[2021]15023号		
东海证券股份有限公司全体股东：		
<h3>一、 审计意见</h3> <p>我们审计了后附的东海证券股份有限公司（以下简称“东海证券”）财务报表，包括2020年12月31日的合并及母公司资产负债表，2020年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东权益变动表，以及财务报表附注。</p> <p>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，公允反映了东海证券2020年12月31日的合并及母公司财务状况以及2020年度的合并及母公司经营成果和现金流量。</p>		
<h3>二、 形成审计意见的基础</h3> <p>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，我们独立于东海证券，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。</p>		

三、其他信息

东海证券管理层（以下简称“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。

四、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，管理层负责评估东海证券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理层计划清算东海证券、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督东海证券的财务报告过程。

五、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对

东海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东海证券不能持续经营。

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

(6) 就东海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。

中国注册会计师

丁启新

中国·北京

(项目合伙人):

二〇二一年四月二十九日

中国注册会计师:

户永红

二、 财务报表

(一) 合并资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年12月31日	2019年12月31日
资产：			
货币资金	六、(一)	11,138,401,528.62	10,870,521,278.94
其中：客户资金存款	六、(一)	9,791,992,199.28	8,333,155,425.55
结算备付金	六、(二)	5,813,907,769.11	4,215,635,340.51
其中：客户备付金	六、(二)	4,711,838,877.06	3,469,940,446.69
贵金属		0.00	0.00
拆出资金		-	-
融出资金	六、(三)	7,495,925,997.01	3,950,170,756.01
衍生金融资产	六、(四)	5,441,376.20	1,548,914.03
存出保证金	六、(五)	393,078,948.62	360,781,609.57
应收款项	六、(六)	21,223,404.18	69,486,662.05
合同资产		0.00	0.00
买入返售金融资产	六、(七)	1,313,839,054.43	1,594,509,603.50
持有待售资产	六、(八)	868,600.00	0.00
金融投资：		15,032,206,841.82	15,117,170,048.88
交易性金融资产	六、(九)	14,739,360,008.10	14,429,620,254.00

债权投资	六、(十)	140,669,481.86	518,254,688.89
其他债权投资	六、(十一)	107,961,470.00	143,895,105.99
其他权益工具投资	六、(十二)	44,215,881.86	25,400,000.00
长期应收款		0.00	0.00
长期股权投资	六、(十四)	50,861,396.64	50,941,530.63
投资性房地产	六、(十五)	98,371,458.74	101,833,417.82
固定资产	六、(十六)	563,922,361.07	585,374,454.56
在建工程		0.00	0.00
使用权资产		0.00	0.00
无形资产	六、(十七)	37,576,677.39	35,466,397.33
开发支出		0.00	0.00
商誉		0.00	0.00
递延所得税资产	六、(十八)	230,186,099.57	191,025,066.79
其他资产	六、(十九)	127,665,717.25	195,334,626.10
资产总计		42,323,477,230.65	37,339,799,706.72
负债：			
短期借款	六、(二十一)	287,061,481.28	347,626,026.57
应付短期融资款	六、(二十二)	2,548,899,240.71	693,905,221.89
拆入资金	六、(二十三)	1,402,978,888.89	1,242,383,333.32
交易性金融负债	六、(二十四)	468,624,761.80	462,933,924.65
衍生金融负债	六、(四)	12,893,591.20	1,960,906.57
卖出回购金融资产款	六、(二十五)	6,269,069,951.80	4,447,394,022.50
代理买卖证券款	六、(二十六)	13,927,227,177.12	11,182,776,794.26
代理承销证券款		0.00	0.00
应付职工薪酬	六、(二十七)	504,132,331.95	360,145,615.81
应交税费	六、(二十八)	24,075,662.46	46,053,607.08
应付款项	六、(二十九)	415,863,603.38	309,120,687.11
合同负债	六、(三十)	6,663,806.16	0.00
持有待售负债		0.00	0.00
预计负债	六、(三十一)	622,490.82	617,939.18
长期借款		0.00	0.00
应付债券	六、(三十二)	5,427,981,330.84	4,552,178,019.95

其中： 优先股		0.00	0.00
永续债		0.00	0.00
租赁负债		0.00	0.00
长期应付款		0.00	0.00
长期应付职工薪酬		0.00	0.00
递延所得税负债	六、(十八)	165,572,595.70	45,840,481.66
递延收益		267,178.64	831,942.04
其他负债	六、(三十三)	1,884,959,055.92	5,102,139,069.67
负债合计		33,346,893,148.67	28,795,907,592.26
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）	六、(三十四)	1,670,000,000.00	1,670,000,000.00
其他权益工具		0.00	0.00
其中： 优先股		0.00	0.00
永续债		0.00	0.00
资本公积	六、(三十五)	2,614,957,581.49	2,614,957,581.49
减： 库存股		0.00	0.00
其他综合收益	六、(三十六)	19,044,015.27	32,917,717.18
专项储备		0.00	0.00
盈余公积	六、(三十七)	477,218,931.83	442,262,640.01
一般风险准备	六、(三十八)	1,639,281,044.23	1,561,773,578.35
未分配利润	六、(三十九)	2,277,265,973.46	1,950,782,383.69
归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计		8,697,767,546.28	8,272,693,900.72
少数股东权益		278,816,535.70	271,198,213.74
所有者权益（或股东权益）合计		8,976,584,081.98	8,543,892,114.46
负债和所有者权益（或股东权益）总计		42,323,477,230.65	37,339,799,706.72

法定代表人：钱俊文

主管会计工作负责人：郭晋炜

会计机构负责人：郭晋炜

(二) 母公司资产负债表

单位：元

项目	附注	2020年12月31日	2019年12月31日
资产：			
货币资金	十五、(一)	7,537,085,708.24	7,886,144,095.93
其中： 客户资金存款	十五、(一)	6,278,407,222.56	5,589,250,125.28
结算备付金	十五、(二)	2,702,785,776.87	2,474,854,646.98

其中：客户备付金	十五、(二)	2,076,214,605.99	2,168,061,434.33
贵金属		0.00	0.00
拆出资金		0.00	0.00
融出资金		7,491,815,131.73	3,940,156,080.76
衍生金融资产		1,585,415.37	211,598.00
存出保证金		418,932,308.37	378,806,616.73
应收款项		78,691,876.89	17,981,596.25
合同资产		0.00	0.00
买入返售金融资产		1,253,977,892.69	1,262,785,235.63
持有待售资产		0.00	0.00
金融投资：		11,692,643,461.89	8,104,529,112.18
交易性金融资产		11,541,866,110.03	7,936,634,006.19
债权投资		0.00	0.00
其他债权投资		107,961,470.00	143,895,105.99
其他权益工具投资		42,815,881.86	24,000,000.00
长期应收款		0.00	0.00
长期股权投资	十五、(三)	1,107,462,976.22	1,391,983,129.21
投资性房地产		98,371,458.74	101,833,417.82
固定资产		338,754,101.83	350,622,192.05
在建工程		0.00	0.00
使用权资产		0.00	0.00
无形资产		37,295,019.88	35,175,268.83
开发支出		0.00	0.00
商誉		0.00	0.00
递延所得税资产		417,618,004.58	297,458,876.24
其他资产		109,366,032.37	89,153,193.49
资产总计		33,286,385,165.67	26,331,695,060.10
负债：			
短期借款		0.00	0.00
应付短期融资款		2,548,899,240.71	693,905,221.89
拆入资金		1,402,978,888.89	1,242,383,333.32
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债		0.00	0.00
卖出回购金融资产款		6,229,065,124.40	4,447,394,022.50
代理买卖证券款		8,105,781,353.60	7,386,515,513.27
代理承销证券款		0.00	0.00
应付职工薪酬	十五、(四)	459,038,641.75	324,305,545.23
应交税费		20,657,742.05	42,244,502.24
应付款项		132,629,174.63	211,457,420.43
合同负债		4,593,990.50	0.00
持有待售负债		0.00	0.00
预计负债		622,490.82	617,939.18
长期借款		0.00	0.00

应付债券		5,427,981,330.84	3,504,919,603.06
其中：优先股		0.00	0.00
永续债		0.00	0.00
租赁负债		0.00	0.00
长期应付款		0.00	0.00
长期应付职工薪酬		0.00	0.00
递延所得税负债		159,791,188.56	37,630,113.45
递延收益		267,178.64	831,942.04
其他负债		817,140.11	817,140.11
负债合计		24,493,123,485.50	17,893,022,296.72
所有者权益（或股东权益）：			
实收资本（或股本）		1,670,000,000.00	1,670,000,000.00
其他权益工具		0.00	0.00
其中：优先股		0.00	0.00
永续债		0.00	0.00
资本公积		2,555,618,293.53	2,555,618,293.53
减：库存股		0.00	0.00
其他综合收益		14,808,278.04	9,782,279.43
专项储备		0.00	0.00
盈余公积		477,218,931.83	442,262,640.01
一般风险准备		1,626,302,386.88	1,551,433,504.14
未分配利润		2,449,313,789.89	2,209,576,046.27
所有者权益（或股东权益）合计		8,793,261,680.17	8,438,672,763.38
负债和所有者权益（或股东权益）总计		33,286,385,165.67	26,331,695,060.10

（三） 合并利润表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
一、营业收入		2,269,334,464.02	1,641,699,281.58
利息净收入	六、（四十一）	61,345,597.15	-25,475,993.51
其中：利息收入		683,337,578.10	690,497,440.54
利息支出		621,991,980.95	715,973,434.05
手续费及佣金净收入	六、（四十）	1,019,788,757.25	835,915,118.06
其中：经纪业务手续费净收入		609,950,885.05	457,207,674.01
投资银行业务手续费净收入		342,226,255.06	308,294,610.16
资产管理业务手续费净收入		59,235,640.20	64,276,007.97
投资收益（损失以“-”号填列）	六、（四十二）	913,355,881.16	408,423,611.78
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		1,404,453.85	-243,216.48
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（损失以“-”号填列）		0.00	0.00

净敞口套期收益		0.00	0.00
其他收益	六、(四十三)	24,916,667.04	25,917,035.32
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	六、(四十四)	225,279,969.59	368,384,062.56
汇兑收益(损失以“-”号填列)		227,878.74	1,612,746.16
其他业务收入	六、(四十五)	24,013,241.22	27,190,495.83
资产处置收益(损失以“-”号填列)	六、(四十六)	406,471.87	-267,794.62
二、营业支出		1,544,201,067.88	1,431,805,978.10
税金及附加	六、(四十七)	21,021,257.12	19,040,446.43
业务及管理费	六、(四十八)	1,241,792,499.55	932,231,187.15
信用减值损失	六、(四十九)	277,453,764.29	476,927,985.44
其他资产减值损失	六、(五十)	471,587.84	144,400.00
其他业务成本	六、(四十五)	3,461,959.08	3,461,959.08
三、营业利润(亏损以“-”号填列)		725,133,396.14	209,893,303.48
加:营业外收入	六、(五十一)	1,516,273.12	11,997,851.56
减:营业外支出	六、(五十二)	8,165,243.28	3,112,661.56
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		718,484,425.98	218,778,493.48
减:所得税费用	六、(五十三)	261,918,756.55	155,747,574.38
五、净利润(净亏损以“-”号填列)		456,565,669.43	63,030,919.10
其中:被合并方在合并前实现的净利润			
(一)按经营持续性分类:	-	-	-
1.持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)		456,565,669.43	63,030,919.10
2.终止经营净利润(净亏损以“-”号填列)		0.00	0.00
(二)按所有权归属分类:	-	-	-
1.归属于母公司股东的净利润(净亏损以“-”号填列)		438,947,347.47	49,416,556.04
2.少数股东损益(净亏损以“-”号填列)		17,618,321.96	13,614,363.06
六、其他综合收益的税后净额		-13,873,701.91	8,878,094.15
(一)归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额		-13,873,701.91	8,878,094.15

1. 不能重分类进损益的其他综合收益		14,111,911.40	0.00
(1) 重新计量设定受益计划变动额		0.00	0.00
(2) 权益法不能转损益的其他综合收益		0.00	0.00
(3) 其他权益工具投资公允价值变动		14,111,911.40	0.00
(4) 企业自身信用风险公允价值变动		0.00	0.00
(5) 其他		0.00	0.00
2. 将重分类进损益的其他综合收益		-27,985,613.31	8,878,094.15
(1) 权益法下可转损益的其他综合收益		0.00	136,213.64
(2) 其他债权投资公允价值变动		-20,941,917.88	-22,393,973.74
(3) 金融资产重分类计入其他综合收益的金额		0.00	0.00
(4) 其他债权投资信用损失准备		11,856,005.09	25,713,725.64
(5) 现金流量套期储备		0.00	0.00
(6) 外币财务报表折算差额		-18,899,700.52	5,422,128.61
(7) 其他		0.00	0.00
(二) 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		0.00	0.00
七、综合收益总额		442,691,967.52	71,909,013.25
(一) 归属于母公司所有者的综合收益总额		425,073,645.56	58,294,650.19
(二) 归属于少数股东的综合收益总额		17,618,321.96	13,614,363.06
八、每股收益：			
(一) 基本每股收益(元/股)		0.263	0.030
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.263	0.030

法定代表人：钱俊文

主管会计工作负责人：郭晋炜

会计机构负责人：郭晋炜

(四) 母公司利润表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
一、营业收入		2,112,835,616.85	1,413,578,503.59
利息净收入	十五、(六)	131,050,543.76	142,418,250.72
其中：利息收入		578,043,218.46	486,144,915.77
利息支出		446,992,674.70	343,726,665.05
手续费及佣金净收入	十五、(五)	911,045,941.39	746,698,306.64
其中：经纪业务手续费净收入		506,007,288.70	380,549,481.19
投资银行业务手续费净收入		341,829,817.27	305,999,607.15
资产管理业务手续费净收入		58,391,326.33	57,592,865.12
投资收益（损失以“-”号填列）	十五、(七)	554,684,435.33	110,194,569.02
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		1,971,288.04	796,066.48
以摊余成本计量的金融资产终止		0.00	0.00

确认产生的收益（损失以“-”号填列）			
净敞口套期收益		0.00	0.00
其他收益		22,788,390.65	24,556,914.82
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	十五、（八）	472,294,263.72	365,138,493.20
汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,175,652.76	454,298.06
其他业务收入		22,992,494.32	24,115,439.35
资产处置收益（损失以“-”号填列）		155,200.44	2,231.78
二、营业支出		1,587,653,643.38	1,223,907,587.02
税金及附加		17,089,315.71	14,406,193.67
业务及管理费	十五、（九）	1,002,871,156.07	698,852,561.19
信用减值损失		20,868,771.49	92,657,023.33
其他资产减值损失		543,362,441.03	414,529,849.75
其他业务成本		3,461,959.08	3,461,959.08
三、营业利润（亏损以“-”号填列）		525,181,973.47	189,670,916.57
加：营业外收入		1,392,249.68	1,950,743.20
减：营业外支出		6,004,659.37	2,044,654.02
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		520,569,563.78	189,577,005.75
减：所得税费用		171,006,645.60	44,066,610.31
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		349,562,918.18	145,510,395.44
（一）持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		349,562,918.18	145,510,395.44
（二）终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）		0.00	0.00
六、其他综合收益的税后净额		5,025,998.61	3,455,965.54
（一）不能重分类进损益的其他综合收益		14,111,911.40	0.00
1. 重新计量设定受益计划变动额		0.00	0.00
2. 权益法下不能转损益的其他综合收益		0.00	0.00
3. 其他权益工具投资公允价值变动		14,111,911.40	0.00
4. 企业自身信用风险公允价值变动		0.00	0.00
5. 其他		0.00	0.00
（二）将重分类进损益的其他综合收益		-9,085,912.79	3,455,965.54
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		0.00	136,213.64
2. 其他债权投资公允价值变动		-20,941,917.88	-22,393,973.74
3. 金融资产重分类计入其他综合收益的金额		0.00	0.00
4. 其他债权投资信用损失准备		11,856,005.09	25,713,725.64
5. 现金流量套期储备		0.00	0.00
6. 外币财务报表折算差额		0.00	0.00
7. 其他		0.00	0.00
七、综合收益总额		354,588,916.79	148,966,360.98
八、每股收益：			
（一）基本每股收益（元/股）		0.209	0.087

(二) 稀释每股收益(元/股)		0.209	0.087
-----------------	--	-------	-------

(五) 合并现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
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		835,716,807.36	1,290,289,939.62
销售商品、提供劳务收到的现金		0.00	0.00
收取利息、手续费及佣金的现金		2,140,640,424.36	1,916,290,252.72
拆入资金净增加额		127,755,661.06	482,896,738.57
拆出资金净减少额		0.00	0.00
回购业务资金净增加额		1,988,781,948.77	526,508,652.91
返售业务资金净减少额		0.00	0.00
融出资金净减少额		0.00	0.00
代理买卖证券收到的现金净额		678,341,151.53	1,746,377,534.10
收到其他与经营活动有关的现金	六、(五十五)	2,615,445,208.22	1,720,997,524.43
经营活动现金流入小计		8,386,681,201.30	7,683,360,642.35
为交易目的而持有的金融资产净增加额		0.00	0.00
拆入资金净减少额		0.00	0.00
拆出资金净增加额		0.00	0.00
回购业务资金净减少额		0.00	0.00
返售业务资金净增加额		0.00	0.00
融出资金净增加额		3,544,290,266.65	990,633,841.92
代理买卖证券支付的现金净额		0.00	0.00
支付利息、手续费及佣金的现金		415,785,453.39	447,656,622.48
支付给职工以及为职工支付的现金		686,451,241.00	638,518,005.00
支付的各项税费		350,271,155.48	202,316,863.09
支付其他与经营活动有关的现金	六、(五十五)	544,077,037.15	515,260,230.08
经营活动现金流出小计		5,540,875,153.67	2,794,385,562.57
经营活动产生的现金流量净额	六、(五十六)	2,845,806,047.63	4,888,975,079.78
二、投资活动产生的现金流量：			
收回投资收到的现金		0.00	0.00
取得投资收益收到的现金		0.00	0.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		0.00	0.00
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		0.00	0.00
收到其他与投资活动有关的现金	六、(五十五)	960,731.08	639,900.20
投资活动现金流入小计		960,731.08	639,900.20

投资支付的现金		0.00	0.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		50,810,613.50	44,962,586.59
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		0.00	0.00
支付其他与投资活动有关的现金		0.00	0.00
投资活动现金流出小计		50,810,613.50	44,962,586.59
投资活动产生的现金流量净额		-49,849,882.42	-44,322,686.39
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		0.00	0.00
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		0.00	0.00
取得借款收到的现金		7,216,174,052.12	3,475,626,400.00
发行债券收到的现金		6,919,150,000.00	1,880,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金		0.00	0.00
筹资活动现金流入小计		14,135,324,052.12	5,355,626,400.00
偿还债务支付的现金		11,448,616,493.08	4,128,062,760.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		262,672,341.17	232,018,041.04
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		10,000,000.00	912,826.16
支付其他与筹资活动有关的现金	六、(五十五)	3,349,438,112.87	2,470,903,283.48
筹资活动现金流出小计		15,060,726,947.12	6,830,984,084.52
筹资活动产生的现金流量净额		-925,402,895.00	-1,475,357,684.52
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-8,277,541.50	6,569,121.45
五、现金及现金等价物净增加额	六、(五十六)	1,862,275,728.71	3,375,863,830.32
加：期初现金及现金等价物余额	六、(五十六)	15,064,775,442.84	11,688,911,612.52
六、期末现金及现金等价物余额	六、(五十六)	16,927,051,171.55	15,064,775,442.84

法定代表人：钱俊文

主管会计工作负责人：郭晋炜

会计机构负责人：郭晋炜

(六) 母公司现金流量表

单位：元

项目	附注	2020年	2019年
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		0.00	0.00
销售商品、提供劳务收到的现金		0.00	0.00
收取利息、手续费及佣金的现金		1,737,472,420.34	1,359,522,349.91
拆入资金净增加额		127,755,661.06	482,896,738.57
拆出资金净减少额		0.00	0.00
回购业务资金净增加额		1,671,847,169.23	393,505,786.97
返售业务资金净减少额		0.00	0.00
融出资金净减少额		0.00	0.00

代理买卖证券收到的现金净额		718,854,285.01	1,803,169,383.74
收到其他与经营活动有关的现金		82,883,834.94	360,578,071.11
经营活动现金流入小计		4,338,813,370.58	4,399,672,330.30
为交易目的而持有的金融资产净增加额		2,596,599,063.32	666,767,306.71
拆入资金净减少额		0.00	0.00
拆出资金净增加额		0.00	0.00
回购业务资金净减少额		0.00	0.00
返售业务资金净增加额		0.00	0.00
融出资金净增加额		3,550,184,598.22	911,320,045.60
代理买卖证券支付的现金净额		0.00	0.00
支付利息、手续费及佣金的现金		220,272,377.21	171,698,011.24
支付给职工以及为职工支付的现金		570,760,622.81	507,507,947.36
支付的各项税费		322,302,452.71	170,322,686.56
支付其他与经营活动有关的现金		440,365,811.02	352,205,886.93
经营活动现金流出小计		7,700,484,925.29	2,779,821,884.40
经营活动产生的现金流量净额	十五、(十)	-3,361,671,554.71	1,619,850,445.90
二、投资活动产生的现金流量：		0.00	0.00
收回投资收到的现金		370,000,000.00	0.00
取得投资收益收到的现金		15,000,000.00	0.00
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		0.00	0.00
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		0.00	0.00
收到其他与投资活动有关的现金		590,995.47	402,991.14
投资活动现金流入小计		385,590,995.47	402,991.14
投资支付的现金		626,871,000.00	0.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		46,348,661.53	43,053,028.97
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		0.00	0.00
支付其他与投资活动有关的现金		0.00	0.00
投资活动现金流出小计		673,219,661.53	43,053,028.97
投资活动产生的现金流量净额		-287,628,666.06	-42,650,037.83
三、筹资活动产生的现金流量：			
吸收投资收到的现金		0.00	0.00
取得借款收到的现金		0.00	0.00
发行债券收到的现金		6,919,150,000.00	1,880,000,000.00
收到其他与筹资活动有关的现金		0.00	0.00
筹资活动现金流入小计		6,919,150,000.00	1,880,000,000.00
偿还债务支付的现金		3,177,990,000.00	999,999,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		210,811,384.27	158,673,232.17
支付其他与筹资活动有关的现金		0.00	0.00
筹资活动现金流出小计		3,388,801,384.27	1,158,672,232.17
筹资活动产生的现金流量净额		3,530,348,615.73	721,327,767.83
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-2,175,652.76	454,298.06

五、现金及现金等价物净增加额	十五、(十)	-121,127,257.80	2,298,982,473.96
加：期初现金及现金等价物余额	十五、(十)	10,360,998,742.91	8,062,016,268.95
六、期末现金及现金等价物余额	十五、(十)	10,239,871,485.11	10,360,998,742.91

(七) 合并股东权益变动表

单位：元

项目	2020年												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益	
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
优先股		永续债	其他										
一、上年期末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,614,957,581.49	-	32,917,717.18		442,262,640.01	1,561,773,578.35	1,950,782,383.69	271,198,213.74	8,543,892,114.46
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、本年期初余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,614,957,581.49	-	32,917,717.18		442,262,640.01	1,561,773,578.35	1,950,782,383.69	271,198,213.74	8,543,892,114.46
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填	-	-	-	-	-	-	-13,873,701.91		34,956,291.82	77,507,465.88	326,483,589.77	7,618,321.96	432,691,967.52

列)													
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	-13,873,701.91	-	-	438,947,347.47	17,618,321.96	442,691,967.52	
(二) 所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
3. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	34,956,291.82	77,507,465.88	-112,463,757.70	-10,000,000.00	-10,000,000.00	
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	34,956,291.82	-	-34,956,291.82	-	-	
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-	77,507,465.88	-77,507,465.88	-	-	
3. 对所有者(或股东)的分配	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-10,000,000.00	-10,000,000.00	
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) 专项 储备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本年期 末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,614,957,581.49	-	19,044,015.27	477,218,931.83	1,639,281,044.23	2,277,265,973.46	278,816,535.70	8,976,584,081.98	

项目	2019年												
	归属于母公司所有者权益										少数股东权益	所有者权益	
	股本	其他权益工具			资本公积	减：库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备			未分配利润
优先股		永续债	其他										
一、上年期末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,614,957,581.49	-	-69,387,019.92		435,738,482.67	1,543,488,682.88	2,019,853,010.40	258,496,676.84	8,473,147,414.36
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	93,426,642.95		-8,026,882.20	-15,324,047.79	-70,327,199.95	-	-251,486.99
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-	-
二、本年期初余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,614,957,581.49	-	24,039,623.03		427,711,600.47	1,528,164,635.09	1,949,525,810.45	258,496,676.84	8,472,895,927.37
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-	-	-	8,878,094.15		14,551,039.54	33,608,943.26	1,256,573.24	12,701,536.90	70,996,187.09
（一）综合	-	-	-	-	-	-	8,878,094.15		-	-	49,416,556.04	13,614,363.06	71,909,013.25

收益总额													
(二) 所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	14,551,039.54	33,608,943.26	-48,159,982.80	-912,826.16	-912,826.16	-912,826.16
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	14,551,039.54	-	-14,551,039.54	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-	33,608,943.26	-33,608,943.26	-	-	-
3. 对所有者(或股东)的分配	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-912,826.16	-912,826.16	-912,826.16
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) 专项 储备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本年期 末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,614,957,581.49	-	32,917,717.18	442,262,640.01	1,561,773,578.35	1,950,782,383.69	271,198,213.74	8,543,892,114.46	

法定代表人：钱俊文

主管会计工作负责人：郭晋炜

会计机构负责人：郭晋炜

(八) 母公司股东权益变动表

单位：元

项目	2020年											
	股本	其他权益工具			资本公积	减： 库存股	其他综合收益	专项储备	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计
		优先股	永续债	其他								
一、上年期末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,555,618,293.53	-	9,782,279.43		442,262,640.01	1,551,433,504.14	2,209,576,046.27	8,438,672,763.38
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
二、本年期初余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,555,618,293.53	-	9,782,279.43		442,262,640.01	1,551,433,504.14	2,209,576,046.27	8,438,672,763.38
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-	5,025,998.61		34,956,291.82	74,868,882.74	239,737,743.62	354,588,916.79
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	5,025,998.61		-	-	349,562,918.18	354,588,916.79
(二) 所有者投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
3. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-		34,956,291.82	74,868,882.74	-109,825,174.56	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-		34,956,291.82	-	-34,956,291.82	-

2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	74,868,882.74	-74,868,882.74	-
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）专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
（六）其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本年期末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,555,618,293.53	-	14,808,278.04	477,218,931.83	1,626,302,386.88	2,449,313,789.89	8,793,261,680.17	

项目	2019年										
	股本	其他权益工具	资本公积	减：库存	其他综合收益	专项	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	所有者权益合计	

		优 先 股	永 续 债	其 他		股		储 备				
一、上年期末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,555,618,293.53	-	-66,896,794.22		435,738,482.67	1,535,151,252.16	2,159,843,716.44	8,289,454,950.58
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	73,223,108.11		-8,026,882.20	-15,324,047.79	-49,620,726.30	251,451.82
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
二、本年期初余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,555,618,293.53	-	6,326,313.89		427,711,600.47	1,519,827,204.37	2,110,222,990.14	8,289,706,402.40
三、本期增减变动金额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-	3,455,965.54		14,551,039.54	31,606,299.77	99,353,056.13	148,966,360.98
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	3,455,965.54		-	-	145,510,395.44	148,966,360.98
(二) 所有者投入和减少 资本	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者 投入资本	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
3. 股份支付计入所有者 权益的金额	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-		14,551,039.54	31,606,299.77	-46,157,339.31	-
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-		14,551,039.54	-	-14,551,039.54	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-		-	31,606,299.77	-31,606,299.77	-
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)专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(六)其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本年期末余额	1,670,000,000.00	-	-	-	2,555,618,293.53	-	9,782,279.43	442,262,640.01	1,551,433,504.14	2,209,576,046.27	8,438,672,763.38	

东海证券股份有限公司

2020 年度财务报表附注

(除另有注明外, 所有金额均以人民币元为货币单位)

一、公司的基本情况

(一) 公司简介

中文名称: 东海证券股份有限公司

成立日期: 1993 年 1 月 16 日

注册资本: 167,000 万元

法定代表人: 钱俊文

法定住所: 常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

统一社会信用代码: 91320400137180719N

(二) 公司的行业性质、经营范围

公司行业性质: 证券、期货业。

公司经营范围: 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; 证券投资基金代销; 为期货公司提供中间介绍业务; 融资融券业务; 代销金融产品业务。

(三) 公司历史沿革

东海证券股份有限公司(以下简称“本公司”或“公司”)的前身为常州市证券公司, 系经中国人民银行总行银复[1992]362 号文批准, 于 1993 年 1 月 16 日成立, 注册资本为人民币 3,000 万元。

1998 年 11 月, 经中国证监会证监机字[1998]36 号文批准, 原常州市证券公司注册资本增加至 8,000 万元, 同时更名为常州证券有限责任公司。

2003 年, 经中国证监会证监机构字[2003]65 号“关于同意常州证券有限责任公司股权变更增资扩股并更名的批复”批准, 公司注册资本增加到 101,000 万元, 同时更名为东海证券有

限责任公司，并于 2003 年 5 月 19 日完成了工商变更登记。

2008 年，经中国证监会证监许可[2008]866 号“关于核准东海证券有限责任公司变更注册资本的批复”批准，公司增加注册资本 66,000 万元，注册资本增加至 167,000 万元。

根据中国证监会证监许可[2013]622 号“关于核准东海证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复”，公司整体变更为股份有限公司，注册资本为 167,000 万元，并于 2013 年 7 月 10 日完成了工商变更登记。

2015 年 7 月 27 日，公司在新三板挂牌，股票代码：832970。

截至 2020 年 12 月 31 日，东海证券在北京、上海、江苏、河南等地拥有 70 家批准设立的证券营业部和上海证券自营分公司、东海证券股份有限公司常州分公司、东海证券股份有限公司河南分公司、东海证券股份有限公司苏州分公司、东海证券股份有限公司山西分公司、东海证券股份有限公司广州分公司、东海证券股份有限公司福建厦门分公司 7 个分公司。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司共有员工 1579 名，其中高级管理人员 8 名；另外，主要子公司共有员工 373 名，合计 1952 人。

本公司的第一大股东和实际控制人是常州投资集团有限公司。

（四） 财务报告的批准报出者和财务报告批准报出日

本公司财务报告于 2021 年 4 月 29 日经本公司董事会批准报出。

（五） 营业期限：

本公司营业期限为 1993 年 01 月 16 日至*****。

本公司合并财务报表的合并范围以控制为基础确定，包括本公司及全部子公司的财务报表。子公司，是指被本公司控制的企业或主体。

二、 财务报表的编制基础

（一） 编制基础

本财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》和 42 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下简称“企业会计准则”）编制。

本财务报表以持续经营为基础列报。编制本财务报表时，除某些金融工具外，均以历史成本为计价原则。资产如果发生减值，则按照相关规定计提相应的减值准备。

（二）持续经营

本公司对自 2020 年 12 月 31 日起 12 个月的持续经营能力进行了评价，未发现对持续经营能力产生重大怀疑的事项和情况。因此，本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

三、重要会计政策及会计估计

（一）遵循企业会计准则的声明

本公司基于下述编制基础编制的财务报表符合财政部已颁布的最新企业会计准则及其应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)的要求，真实完整地反映了公司的财务状况、经营成果和现金流量等有关信息。

此外，本财务报表参照了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号-财务报告的一般规定》(2014 年修订)(以下简称“第 15 号文(2014 年修订)”)的列报和披露要求。

（二）会计期间及经营周期

会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。

（三）记账本位币

本公司以人民币为记账本位币。

（四）计量属性在本期发生变化的报表项目及其本期采用的计量属性

本公司采用的计量属性包括历史成本、重置成本、可变现净值、现值和公允价值。本期报表项目的计量属性未发生变化。

（五）同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

1、同一控制下企业合并

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

被合并各方采用的会计政策与本公司不一致的，被合并方在合并日按照本公司的会计政策进行调整，并在此基础上按照调整后的账面价值确认。

合并方为进行企业合并发生的各项直接相关费用，包括为进行企业合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益。

企业合并中发行权益性证券所发生的手续费、佣金等，抵减权益性证券溢价收入，溢价收入不足冲减的，冲减留存收益。

2、非同一控制下的企业合并

本公司在购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值加上各项直接相关费用为合并成本。在购买日对作为企业合并对价付出的资产、发生或承担的负债按照公允价值计量，公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。

本公司对合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉；对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时，应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。

企业合并中取得的被合并方除无形资产外的其他各项资产（不仅限于被合并方原已确认的资产），其所带来的经济利益很可能流入本公司且公允价值能够可靠计量的，单独确认并按公允价值计量；公允价值能够可靠计量的无形资产，单独确认为无形资产并按照公允价值计量；取得的被购买方除或有负债以外的其他各项负债，履行有关义务很可能导致经济利益流出本公司且公允价值能够可靠计量的，单独确认并按照公允价值计量；取得的被购买方或有负债，其公允价值能够可靠计量的，单独确认为负债并按照公允价值计量。

企业合并形成母子公司关系的，母公司编制购买日的合并资产负债表，因企业合并取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债以公允价值列示。

（六）合并财务报表的编制方法

1、合并范围

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定，本公司将其所控制的全部主体（包括企业、被投资单位中可分割的部分，以及企业所控制的结构化主体等）纳入合并财务报表的合并范围。

2、合并财务报表编制方法

本公司以母公司和纳入合并范围的子公司的个别会计报表及其他相关资料为依据，在抵销母公司与子公司、子公司相互间的债权与债务项目、内部销售收入和未实现的内部销售利润等项目，以及母公司对子公司权益性资本投资项目的数额与子公司所有者权益中母公司所持有的份额的基础上，合并各报表项目数额编制。

在编制合并财务报表时，子公司与本公司采用的会计政策或会计期间不一致的，按照本公司的会计政策和会计期间对子公司财务报表进行必要的调整。对于非同一控制下企业合并取得的子公司，以购买日可辨认净资产公允价值为基础对其财务报表进行调整。

3、少数股东权益和损益的列报

子公司所有者权益中不属于母公司的份额，作为少数股东权益，在合并资产负债表中所有者权益项目下以“少数股东权益”项目列示。

子公司当期净损益中属于少数股东权益的份额，在合并利润表中净利润项目下以“少数股

东损益”项目列示。

子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的，其余额仍冲减少数股东权益。4、当期增加减少子公司的合并报表处理

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

因非同一控制下企业合并或其他方式增加的子公司以及业务，不调整合并资产负债表的期初数，将该子公司以及业务购买日至报告期末的收入、费用、利润纳入合并利润表，将该子公司以及业务购买日至报告期末的现金流量纳入合并现金流量表。通过多次交易分步实现非同一控制下企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方股权，本公司按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益。购买日之前持有的被购买方的股权涉及其他综合收益以及其他所有者权益变动的，与其相关的其他综合收益、其他所有者权益转为购买日所属当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

本公司在报告期内处置子公司以及业务，不调整合并资产负债表的期初数；将该子公司以及业务期初至处置日的收入、费用、利润纳入合并利润表；将该子公司期初至处置日的现金流量纳入合并现金流量表。因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，对于处置后的剩余股权投资，本公司按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司自购买日或合并日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益、其他所有者权益等，在丧失控制权时转为当期投资收益。

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

本公司因购买少数股权新取得的长期股权投资与按照新增持股比例计算应享有子公司的可辨认净资产份额之间的差额，以及在不丧失控制权的情况下因部分处置对子公司的股权投资而取得的处置价款与处置长期股权投资相对应享有子公司净资产份额的差额，均调整合并资产负债表中的资本公积的股本溢价，资本公积中的股本溢价不足冲减的，调整留存收益。

（七） 现金及现金等价物的确定标准

现金为公司库存现金、可以随时用于支付的存款及其他货币资金；现金等价物为公司持有的期限短（从购买日起三个月内到期）、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险

很小的投资。

（八） 外币业务和外币报表折算

1、 外币交易

外币业务采用交易发生日的即期汇率作为折算汇率折合成人民币记账。

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

2、 外币财务报表的折算

资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算；所有者权益项目除“未分配利润”项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。利润表中的收入和费用项目，采用按照系统合理的方法确定的、与交易发生日即期汇率近似的汇率折算。按照上述折算产生的外币财务报表折算差额，在编制合并财务报表时，在合并资产负债表中所有者权益项目下“其他综合收益”项目中列示。

处置境外经营时，将资产负债表中所有者权益项目下列示的、与该境外经营相关的外币财务报表折算差额，自所有者权益项目转入处置当期损益；部分处置境外经营的，按处置的比例计算处置部分的外币财务报表折算差额，转入处置当期损益。

（九） 客户交易结算资金

公司接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等有价值证券而收到的款项，全额存入公司指定的银行账户，同时确认为一项负债，与客户进行相关的结算。

公司接受客户委托，代理客户买卖股票、债券和基金等有价值证券时，如买入证券成交总额大于卖出证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额加上代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用之和减少客户交易结算资金；如卖出证券成交总额大于买入证券成交总额的，应按买卖证券成交价的差额减去代扣代交的相关税费和应向客户收取的佣金等费用后的余额增加客户交易结算资金。

（十） 金融工具

金融工具的核算方法

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。

1、 金融资产及金融负债的确认和初始计量

本公司成为金融工具合同的一方时，确认为一项金融资产或金融负债。

初始确认金融资产或金融负债，均按照公允价值计量。

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，相关交易费用应当直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用应当计入初始确认金额。

2、金融资产的分类和后续计量

(1) 金融资产的分类

本公司根据其管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为：以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金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

1) 以摊余成本计量的金融资产

金融资产同时符合下列条件的，应当分类为以摊余成本计量的金融资产：

- ①本公司管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

金融资产同时符合下列条件的，应当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：

- ①本公司管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标。
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

对于非交易性权益工具投资，本公司可在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

分类为以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产之外的金融资产，分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本公司可以将本应以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产不可撤销地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。

(2) 金融资产的后续计量

1) 以摊余成本计量的金融资产

持有期间采用实际利率法计算的利息计入当期损益。

该金融资产收回或处置时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额计入当期损益。

2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

该金融资产以公允价值进行后续计量，所产生的利得或损失，除减值损失或利得和汇兑损益外，均计入其他综合收益。

3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

该金融资产以公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失，除与套期会计有关外均计入当期损益。

3、金融负债的分类和后续计量

本公司将金融负债分类为以下几种：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）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。该类金融负债，按照公允价值进行后续计量。

(2) 不符合终止确认条件的金融资产转移或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。

(3) 不属于上述第 1 项或第 2 项情形的财务担保合同，以及不属于上述第 1 项的、以低于市场利率贷款的贷款承诺。本公司作为此类金融负债发行方的，在初始确认后按照依据损失准备金额以及初始确认金额扣除依据《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孰高进行计量。在非同一控制下的企业合并中，本公司作为购买方确认的或有对价形成金融负债的，该金融负债应当按照以公允价值计量且其变动计入当期损益进行会计处理。

(4) 除上述各项外，本公司将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。

该类金融负债按摊余成本进行后续计量。

4、金融资产及金融负债的抵销

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

(1) 本公司具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的。

(2) 本公司计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

5、金融资产和金融负债的终止确认

(1) 金融资产的终止确认

1) 金融资产终止确认，是指本公司将之前确认的金融资产从其资产负债表中予以转出。金融资产满足下列条件之一的，应当终止确认：

- ①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- ②该金融资产已转移，且本公司将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- ③该金融资产已转移，虽然本公司既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产的控制。

2) 金融资产转移整体满足终止确认条件的，本公司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根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》第十八条分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的情形)之和。

(2) 金融负债的终止确认

金融负债终止确认，是指企业将之前确认的金融负债从其资产负债表中予以转出。金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，企业应当终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

出现以下两种情况之一时，金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除：

1) 本公司通过履行义务(如偿付债权人)解除了金融负债(或其一部分)的现时义务。本公司通常使用现金、其他金融资产等方式偿债。

2) 本公司通过法定程序(如法院裁定)或债权人(如债务豁免)，合法解除了本公司对金融负债(或其一部分)的主要责任。

金融负债全部或部分终止确认时，终止确认的金融负债账面价值与支付对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。在某些情况下，债权人解除了本公司对金融负债的主要责任，但要求本公司提供担保(承诺在合同主要责任方拖欠时进行支付)的，本公司以其担保义务的公允价值为基础确认一项新的金融负债，并按支付的价款加上新金融负债公允价值之和与原金融负债账面价值的差额确认利得和损失。

6、金融工具的减值

(1) 本公司以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 1) 以摊余成本计量的金融资产；
- 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。

本公司持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型，包括以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资或权益工具投资，指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资，以及衍生金融资产。

(2) 预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本公司按照原实际利率折现的、根据合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本公司需考虑的最长期间为企业面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收款项，本公司采用简化计量方法，始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。本公司基于历史信用损失经验计算上述金融资产的预期信用损失，相关历史经验根据资产负债表日借款人的特定因素、以及对当前状况和未来经济状况预测的评估进行调整。

除应收款项外，本公司对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

1) 具有较低的信用风险

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，并且即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

2) 信用风险显著增加

本公司通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本公司考虑无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。本公司考虑的信息包括但不限于：

-债务人未能按合同到期日支付本金和利息的情况；

-已发生的或预期的金融工具的外部或内部信用评级(如有)的显著恶化；

-已发生的或预期的债务人经营成果的显著恶化；

-现存的或预期的技术、市场、经济或法律环境变化，并将对债务人对本公司的还款能力产生显著不利影响。

如果逾期超过 30 日，本公司通常确定金融工具的信用风险已经显著增加。除非本公司以合理成本即可获得合理且有依据的信息，证明即使逾期超过 30 日，信用风险仍未显著增加。

3) 根据金融工具的性质，本公司以单项金融工具或金融工具组合为基础评估信用风险是否显著增加。以金融工具组合为基础进行评估时，本公司可基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，例如逾期信息和信用风险评级。

4) 已发生信用减值的金融资产

本公司在资产负债表日评估以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资是否已发生信用减值。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

-发行方或债务人发生重大财务困难；

-债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；

-本公司出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；

-债务人很可能破产或进行其他财务重组；

-发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失。

如果逾期超过(含)90日，则本公司通常推定金融资产已发生违约，除非本公司有合理且有依据的信息，表明以更长的逾期时间作为违约标准更为恰当。

(3) 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本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，应当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，本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。

（4）核销

如果本公司不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本公司确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本公司催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

（十一） 应收款项

应收款项包括应收账款、其他应收款等。

本公司应收款项坏账准备的确认标准和计提方法详见本附注三、（十）

（十二） 合同资产

1、 合同资产的确认方法及标准

本公司根据履行履约义务与客户付款之间的关系在资产负债表中列示合同资产或合同负债。本公司已向客户转让商品或提供服务而有权收取的对价（除应收款项）列示为合同资产。

2、 合同资产预期信用损失的确定方法及会计处理方法

对于合同资产，无论是否包含重大融资成分，本公司均采用预期信用损失的简化模型，即始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备，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。

（十三） 买入返售金融资产和卖出回购金融资产款

1、 买入返售金融资产

买入返售交易分为买断式或质押式，买断式是指按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括债券和票据），合同或协议到期日，再以约定价格返售相同之金融产品。质押式是指作为质押权人，在交易对手将债券出质时，融出资金，质押到期日，以约定价格收回资金并返还出质债券。买入返售业务按买入返售相关资产时实际支付的款项入账，在资产负债表“买入返售金融资产”列示。约定购回和质押回购融出资金业务其实质是为客户提供融资业务，参照质押式买入返售业务会计核算处理。

本公司买入返售证券业务减值的确认标准和计提方法详见本附注三、（十）。

2、 卖出回购金融资产款

卖出回购交易分为买断式或质押式，买断式是按照合同或协议的约定，以一定的价格将相关资产（包括债券和票据）出售给交易对手，合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。质押式是指将债券向交易对手出质时，获取资金，质押到期日，以约定价格支付资金并收回出质债券。卖出回购业务按卖出回购相关资产时实际收到的款项入账，在资产负债表“卖

出回购金融资产款”列示。卖出的金融产品仍按原分类列于资产负债表的相关科目内，并按照相关的会计政策核算。报价回购融入资金业务其实质是质押融资业务，参照质押式卖出回购业务会计核算处理。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）长期股权投资核算方法

1、确定对被投资单位具有共同控制、重大影响的判断标准

共同控制，是指按照相关约定对某项安排所共有的控制，并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。本公司与其他合营方一同对被投资单位实施共同控制且对被投资单位净资产享有权利的，被投资单位为本公司的合营企业。

重大影响，是指对一个企业的财务和经营决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。投资企业能够对被投资单位施加重大影响的，被投资单位为本公司联营企业。

2、投资成本的初始计量

（1）企业合并中形成的长期股权投资

1) 如果是同一控制下的企业合并，公司以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式作为合并对价的，在合并日按照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长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的合并对价之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

合并方以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长期股权投资的初始投资成本。按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。

合并发生的各项直接相关费用，包括为进行合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益。

2) 非同一控制下企业合并形成的长期股权投资，以企业合并成本作为初始投资成本。企业合并成本包括购买日购买方为取得被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债、发行的权益性证券的公允价值之和。

购买方为企业合并而发生的审计费用、评估费用、法律服务费用等中介费用以及其他相关管理费用于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。

通过多次交易分步实现的非同一控制下企业合并，以购买日之前所持所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和，作为该项投资的的初始投资成本。

（2）其他方式取得的长期股权投资

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

以发行权益性证券取得的长期股权投资，按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。为发行权益性工具支付给有关证券承销机构等的手续费、佣金等与工具发行直接相关的费用，不构成取得长期股权投资的成本。该部分费用应自所发行证券的溢价发行收入中扣除，溢价收入不足冲减的，应依次冲减盈余公积和未分配利润。

通过非货币性资产交换取得的长期股权投资，如非货币性资产交换具有商业实质或换出资产的公允价值能够可靠计量的情况下，换入的长期股权投资按照换出资产的公允价值和应支付的相关税费作为初始投资成本；不满足上述前提的非货币性资产交换，换入的长期股权投资以换出资产的账面价值和应支付的相关税费作为初始投资成本。

通过债务重组取得的长期股权投资，企业应当将享有股份的公允价值确认为投资成本，重组债权的账面余额与股份的公允价值之间的差额，计入当期损益。企业已对债权计提减值准备的，应当先将该差额冲减减值准备，减值准备不足以冲减的部分，计入当期损益。

3、后续计量及损益确认：

（1）后续计量

本公司对子公司投资采用成本法核算，按照初始投资成本计价。追加或收回投资时调整长期股权投资的成本。

本公司对被投资单位具有共同控制或重大影响的长期股权投资，采用权益法核算，除非投资符合持有待售的条件。长期股权投资的初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，不调整长期股权投资的初始投资成本；长期股权投资的初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资的成本。

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

本公司因追加投资等原因能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的，在编制个别财务报表时，按照原持有的股权投资账面价值加上新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本。购买日之前持有的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，应当在处置该项投资时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。购买日之前持有的股权投资按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的有关规定进行会计处理的，原计入其他综合收益的累计公允价值变动应当在改按成本法核算时转入当期损益。

本公司因处置部分股权投资等原因丧失了对被投资单位的共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权应当改按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》核算，其在丧失共同

控制或重大影响之日的公允价值与账面价值之间的差额计入当期损益。原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，应当在终止采用权益法核算时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。

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

权益法核算的被投资单位除净收益和其他综合收益以外所有者权益其他变动的处理：对于被投资单位除净收益和其他综合收益以外所有者权益的其他变动，在持股比例不变的情况下，公司按照持股比例计算应享有或应承担的部分，调整长期股权投资的账面价值，同时增加或减少资本公积（其他资本公积）。

（2）损益调整

成本法下，除取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润外，本公司按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认投资收益，不管有关利润分配是属于对取得投资前还是取得投资后被投资单位实现净利润的分配。

权益法下，本公司取得长期股权投资后，应当按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资收益和其他综合收益，同时调整长期股权投资的账面价值。投资企业按照被投资单位宣告分派的利润或现金股利计算应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。投资企业确认被投资单位发生的净亏损，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限，投资企业负有承担额外损失义务的除外。被投资单位以后实现净利润的，投资企业在其收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

投资企业在确认应享有被投资单位净损益的份额时，应在被投资单位账面净利润的基础上考虑以下因素：被投资单位与本公司采用的会计政策或会计期间不一致，按本公司会计政策或会计期间对被投资单位的财务报表进行调整；以取得投资时被投资单位各项可辨认资产等的公允价值为基础，对被投资单位的净利润进行调整后确认；对本公司与联营企业及合营企业之间发生的未实现内部交易损益按照应享有的比例计算归属于本公司的部分予以抵销。本公司与被投资单位发生的未实现内部交易损失，属于资产减值损失的，应当全额确认。

在持有投资期间，被投资单位能够提供合并财务报表的，应当以合并财务报表中的净利润和其他权益变动为基础核算。

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

（十五）投资性房地产

投资性房地产是指公司为赚取租金或资本增值，或两者兼有而持有的房地产，包括已出租的土地使用权、持有并准备增值后转让的土地使用权、已出租的建筑物。公司对投资性房地产采用成本模式计量和与公司固定资产相同的折旧政策。期末存在减值迹象的，估计可回收金额，可回收金额低于其账面价值的，确认其减值损失。

（十六） 固定资产

1、固定资产的确认条件：

固定资产指为生产商品、提供劳务、出租或经营管理而持有，并且使用寿命超过一个会计年度的有形资产。固定资产在同时满足下列条件时予以确认：

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

2、固定资产的计价方法：

（1）购入的固定资产，以实际支付的买价、包装费、运输费、安装成本、交纳的有关税金以及为使固定资产达到预定可使用状态前发生的可直接归属于该资产的其他支出计价；

（2）自行建造的固定资产，按建造过程中实际发生的全部支出计价；

（3）投资者投入的固定资产，按投资各方确认的价值入账；

（4）固定资产的后续支出，根据这些后续支出是否能够提高相关固定资产原先预计的创利能力，确定是否将其予以资本化；

（5）盘盈的固定资产，按同类或类似固定资产的市场价格，减去按该项资产的新旧程度估计的价值损耗后的余额，作为入账价值。如果同类或类似固定资产不存在活跃市场的，按该项固定资产的预计未来现金流量现值，作为入账价值；

（6）接受捐赠的固定资产，按同类资产的市场价格，或根据所提供的有关凭证计价；接受捐赠固定资产时发生的各项费用，计入固定资产价值。

3、固定资产折旧采用直线法计算，残值率 5%，各类固定资产折旧年限和折旧率如下：

固定资产折旧采用年限平均法分类计提，根据固定资产类别、预计使用寿命和预计净残值率确定折旧率。如固定资产各组成部分的使用寿命不同或者以不同方式为本公司提供经济效益，则选择不同折旧率或折旧方法，分别计提折旧。

融资租赁方式租入的固定资产，能够合理确定租赁期届满时将会取得租赁资产所有权的，在租赁资产尚可使用年限内计提折旧；无法合理确定租赁期届满时能够取得租赁资产所有权的，在租赁期与租赁资产尚可使用年限两者中较短的期间内计提折旧。

类别	折旧年限（年）	预计残值率（%）	年折旧率（%）
----	---------	----------	---------

类别	折旧年限（年）	预计残值率（%）	年折旧率（%）
房屋建筑物	20-40	5	2.375-4.75
运输设备	5	5	19.00
电子设备	3	5	31.67
办公设备及其他	5	5	19.00

（十七） 在建工程

1、 在建工程核算原则

在建工程按实际成本核算。

2、 在建工程结转固定资产的标准和时点

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

（十八） 无形资产

1、 无形资产的计价方法

（1） 初始计量

无形资产按取得时的实际成本计量，包括购买价款、相关税费以及直接归属于使该项资产达到预定用途所发生的其他支出。

（2） 后续计量

取得无形资产时分析判断其使用寿命。

对于使用寿命有限的无形资产，在为本公司带来经济利益的期限内按直线法摊销；无法预见无形资产为公司带来经济利益期限的，视为使用寿命不确定的无形资产，不予摊销。

在每个会计期间对使用寿命不确定的无形资产的使用寿命进行复核。如果有证据表明无形资产的使用寿命是有限的，估计其使用寿命，并在为本公司带来经济利益的期限内按直线法摊销。

2、 对于使用寿命有限的无形资产的使用寿命的估计

项目	预计使用寿命(年)
交易席位费	10
软件	2

3、内部研究开发支出会计政策

内部研究开发项目研究阶段的支出，于发生时计入当期损益。内部研究开发项目开发阶段的支出，同时满足下列条件的，确认为无形资产：

(1) 完成该无形资产以使其能够使用或出售在技术上具有可行性；

(2) 具有完成该无形资产并使用或出售的意图；

(3) 无形资产产生经济利益的方式，包括能够证明运用该无形资产生产的产品存在市场或无形资产自身存在市场，无形资产将在内部使用的，能证明其有用性；

(4) 有足够的技术、财务资源和其他资源支持，以完成该无形资产的开发，并有能力使用或出售该无形资产；

(5) 归属于该无形资产开发阶段的支出能够可靠地计量。

(十九) 长期待摊费用

1、长期待摊费用的定义和计价方法

长期待摊费用是指已经发生但应由本期和以后期间负担的摊销期限在一年以上的各项费用。长期待摊费用按实际成本计价。

2、摊销方法

长期待摊费用在受益期限内平均摊销。租入固定资产改良支出在租赁期限与租赁资产尚可使用年限两者孰短的期限内平均摊销。对不能使以后会计期间受益的长期待摊费用项目，则将该项的摊余价值全部计入当期损益。

(二十) 非金融资产减值

对于长期股权投资、以成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、使用寿命有限的无形资产等长期资产，本公司于资产负债表日判断是否存在减值迹象。如存在减值迹象的，则估计其可收回金额，进行减值测试。商誉、使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

减值测试结果表明资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额计提减值准备并计入减值损失。可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。资产的公允价值根据公平交易中销售协议价格确定；不存在销售协议但存在资产活跃市场的，公允价值按照该资产的买方出价确定；不存在销售协议和资产活跃市场的，则以可获取的最佳信息为基础估计资产的公允价值。处置费用包括与资产处置有关的法律费用、相关税费、搬运费以及为使资产达到可销售状态所发生的直接费用。资产预计未来现金流量的现值，按照资产在持续使用过程中和最终处置时所产生的预计未来现金流量，选择恰当的折现率对其进行折现后的金额加以确定。资产减值准备按单项资产为基础计算并确认，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，以该资产所属的资产组确定资产组的可收回金额。资产组

是能够独立产生现金流入的最小资产组合。

在财务报表中单独列示的商誉，在进行减值测试时，将商誉的账面价值分摊至预期从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合。测试结果表明包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额先抵减分摊至该资产组或资产组组合的商誉的账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，以后会计期间不再转回。

（二十一） 职工薪酬

职工薪酬，是指企业为获得职工提供的服务或解除劳动关系而给予的各种形式的报酬或补偿。公司的职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。

1、短期薪酬的会计处理方法

本公司在职工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，职工福利费为非货币性福利的，按照公允价值计量。

2、离职后福利的会计处理方法

（1）设定提存计划

本公司按当地政府的相关规定为职工缴纳基本养老保险和失业保险，在职工为本公司提供服务的会计期间，按以当地规定的缴纳基数和比例计算应缴纳金额，确认为负债，并计入当期损益或相关资产成本。

（2）设定受益计划

本公司根据预期累计福利单位法确定的公式将设定受益计划产生的福利义务归属于职工提供服务的期间，并计入当期损益或相关资产成本。

设定受益计划义务现值减去设定受益计划资产公允价值所形成的赤字或盈余确认为一项设定受益计划净负债或净资产。设定受益计划存在盈余的，本公司以设定受益计划的盈余和资产上限两项的孰低者计量设定受益计划净资产。

所有设定受益计划义务，包括预期在职工提供服务的年度报告期间结束后的十二个月内支付的义务，根据资产负债表日与设定受益计划义务期限和币种相匹配的国债或活跃市场上的高质量公司债券的市场收益率予以折现。

设定受益计划产生的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转回至损益。

在设定受益计划结算时，按在结算日确定的设定受益计划义务现值和结算价格两者的差额，确认结算利得或损失。

3、辞退福利的会计处理方法

本公司向职工提供辞退福利的，在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：（1）本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）本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。本公司按照辞退计划条款的规定，合理预计并确认辞退福利产生的应付职工薪酬。辞退福利预期在其确认的年度报告期结束后十二个月内完全支付的，适用短期薪酬的相关规定；辞退福利预期在年度报告期结束后十二个月内不能完全支付的，适用其他长期职工福利的有关规定。

4、其他长期职工福利的会计处理方法

本公司向职工提供的其他长期职工福利，符合设定提存计划条件的，适用关于设定提存计划的有关规定进行处理。除此情形外，适用关于设定受益计划的有关规定，确认和计量其他长期职工福利净负债或净资产。在报告期末，将其他长期职工福利产生的职工薪酬成本确认为下列组成部分：（1）服务成本。（2）其他长期职工福利净负债或净资产的利息净额。（3）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。上述项目的总净额应计入当期损益或相关资产成本。

（二十二） 合同负债

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

（二十三） 预计负债

若与或有事项相关的义务同时符合以下条件，确认为预计负债：

- 1、该义务是企业承担的现时义务；
- 2、该义务的履行很可能导致经济利益流出企业；
- 3、该义务的金额能够可靠地计量。

预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量，企业清偿预计负债所需支出全部或部分预期由第三方补偿的，补偿金额只有在基本确定能够收到时才能作为资产单独确认。确认的补偿金额不超过预计负债的账面价值。

本公司亏损合同产生的义务和因重组而承担的重组义务同时符合上述条件的，确认为预计负债。只有在承诺出售部分业务（即签订约束性出售协议）时，才能确认因重组而承担了重组义务。

（二十四） 收入（适用于 2020 年 1 月 1 日之后）

本公司在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务的控制权时，确认收入。

合同中包含两项或多项履约义务的，本公司在合同开始日，按照各单项履约义务所承诺商品或服务的单独售价的相对比例，将交易价格分摊至各单项履约义务，按照分摊至各单项履约义务的交易价格计量收入。

满足下列条件之一时，本公司属于在某一段时间内履行履约义务，否则，属于在某一时点履行履约义务：

1) 客户在本公司履约的同时即取得并消耗本公司履约所带来的经济利益；

2) 客户能够控制本公司履约过程中在建的商品；

3) 本公司履约过程中所产出的商品具有不可替代用途，且本公司在整个合同期间内有权就累计至今已完成的履约部分收取款项。

对于在某一时段内履行的履约义务，本公司在该段时间内按照履约进度确认收入。履约进度不能合理确定时，本公司已经发生的成本预计能够得到补偿的，按照已经发生的成本金额确认收入，直到履约进度能够合理确定为止。

对于在某一时点履行的履约义务，本公司在客户取得相关商品或服务控制权时点确认收入。

与本公司取得收入的主要活动相关的具体会计政策描述如下：

1、手续费及佣金收入

（1）经纪业务收入

代理买卖证券业务手续费收入及期货经纪业务手续费收入在交易日确认为收入。

（2）投资银行业务收入

证券承销收入，按证券发行方式分别确认：1) 全额包销方式，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) 余额包销、代销方式，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。

（3）资产管理业务收入

资产管理业务收入，在资产管理合同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，确认为受托投资管理手续费及佣金收入。

（4）其他手续费收入

在完成合同义务并确认服务佣金实际可以收到时确认收入。

2、利息收入

利息收入和利息支出是按借出和借入货币资金的时间和实际利率计算确定的。

3、投资收益

本公司持有的交易性金融资产及其他权益工具投资在持有期间取得的利息、红利、股息或现金股利确认当期收益。

金融资产转移满足终止确认条件的，应当将下列两项金额的差额计入投资收益：

(1) 被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金融资产)之和。

采用成本法核算长期股权投资的，按被投资单位宣告发放的现金股利或利润中属于本公司的部分确认收益；采用权益法核算长期股权投资的，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确认投资收益。

(二十五) 收入（适用于 2020 年 1 月 1 日之前）

1、各项手续费及佣金收入同时满足下列条件的，才能予以确认：

- (1) 提供的相关服务完成；
- (2) 收入的金额能够可靠地计量；
- (3) 相关的经济利益很可能流入企业。

各项业务收入的确认方法如下：

- (1) 代理客户买卖证券的手续费收入，在代理买卖证券交易日确认为收入。
- (2) 代理兑付证券业务的手续费收入，在代理兑付证券业务提供的相关服务完成时确认收入。
- (3) 代理保管证券业务的手续费收入，在代理保管服务完成时确认收入。
- (4) 证券承销收入，按证券发行方式分别确认：1) 全额包销方式，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) 余额包销、代销方式，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。
- (5) 资产管理业务收入，在资产管理合同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，确认为受托投资管理手续费及佣金收入。
- (6) 其他手续费收入，在完成合同义务并确认服务佣金实际可以收到时确认收入。

2、利息收入

在相关的收入能够可靠计量，相关的经济利益可以收到时，按资金使用时间和约定的利率确认利息收入。

存款利息收入：在相关的收入金额能够可靠地计量，相关的经济利益可以收到时，按资金使用时间和实际利率确认利息收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率计算利息收入。

融资融券业务利息收入：根据与客户合约的约定，按出借资金或证券的时间和约定利率确认收入。

买入返售金融资产在当期到期返售的，按返售价格与买入价格的差额确认当期利息收入；在当期没有到期的，期末按权责发生制原则计提利息，确认为当期利息收入。

3、投资收益

公司持有交易性金融资产、其他权益工具投资期间取得的红息或现金股利确认为当期收益；处置交易性金融资产时其公允价值与初始入账金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；处置其他债权投资时，取得的价款与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额和与该金融资产账面价值的差额，计入投资收益；处置债权投资时按所取得价款与该金融资产的账面价值之间的差额，确认当期投资收益。

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

4、其他业务收入

在业务相关的服务完成时按合同的规定确认当期收入。

（二十六） 合同成本（适用于 2020 年 1 月 1 日之后）

合同成本分为合同履约成本与合同取得成本。

本公司企业为履行合同发生的成本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、该成本增加了企业未来用于履行履约义务的资源；

3、该成本预期能够收回。

本公司为取得合同发生的增量成本预期能够收回的，作为合同取得成本确认为一项资产；但是，该资产摊销不超过一年的可以在发生时计入当期损益。

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。

与合同成本有关的资产，其账面价值高于下列两项的差额的，本公司将对于超出部分计提减值准备，并确认为资产减值损失：

- 1、因转让与该资产相关的商品或服务预期能够取得的剩余对价；
- 2、为转让该相关商品或服务估计将要发生的成本。

上述资产减值准备后续发生转回的，转回后的资产账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该资产在转回日的账面价值。

（二十七） 政府补助

1、政府补助包括与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。

2、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。

3、公司政府补助采用总额法：

（1）与资产相关的政府补助，确认为递延收益，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。相关资产在使用寿命结束前被出售、转让、报废或发生毁损的，将尚未分配的相关递延收益余额转入资产处置当期的损益。

（2）与收益相关的政府补助，用于补偿以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，在确认相关费用的期间，计入当期损益；用于补偿已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

4、对于同时包含与资产相关部分和与收益相关部分的政府补助，区分不同部分分别进行会计处理；难以区分的，整体归类为与收益相关的政府补助。

5、本公司将与本公司日常活动相关的政府补助按照经济业务实质计入其他收益或冲减相关成本费用；将与本公司日常活动无关的政府补助，应当计入营业外收支。

（二十八） 递延所得税资产和递延所得税负债

本公司的所得税费用采用资产负债表债务法核算。递延所得税资产和递延所得税负债根据资产和负债的计税基础与账面价值的差额（暂时性差异），于资产负债表日按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量确认递延所得税资产和递延所得税负债。

对子公司及联营企业及合营企业投资相关的应纳税暂时性差异确认相应的递延所得税负债，但能够控制暂时性差异转回时间且该暂时性差异在可预见的未来很可能不会转回的，不予确认。

递延所得税资产的确认以本公司未来期间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。

对子公司及联营企业及合营企业投资相关的可抵扣暂时性差异同时满足暂时性差异在可预见的未来很可能转回且未来很可能获得用来抵扣暂时性差异的应纳税所得额时确认相应的递延所得税资产。

对于能够结转以后年度的可抵扣亏损和税款抵减，以很可能获得用来抵扣可抵扣亏损和税款抵减的未来应纳税所得额为限，确认相应的递延所得税资产。

（二十九） 经营租赁、融资租赁

1、经营租赁的会计处理

（1）本公司租入资产所支付的租赁费，在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法进行分摊，计入当期费用。其他方法更为系统合理的，可以采用其他方法。支付的与租赁交易相关的初始直接费用，计入当期费用。

资产出租方承担了应由本公司承担的与租赁相关的费用时，将该部分费用从租金总额中扣除，按扣除后的租金费用在租赁期内分摊，计入当期费用。

（2）本公司出租资产所收取的租赁费，在不扣除免租期的整个租赁期内，按直线法进行分摊，确认为租赁收入。其他方法更为系统合理的，可以采用其他方法。支付的与租赁交易相关的初始直接费用，计入当期费用；如金额较大的，则予以资本化，在整个租赁期间内按照与租赁收入确认相同的基础分期计入当期收益。

本公司承担了应由承租方承担的与租赁相关的费用时，将该部分费用从租金收入总额中扣除，按扣除后的租金收入余额在租赁期内分配。

2、融资租赁的会计处理

（1）融资租入资产：本公司按租赁开始日租赁资产的公允价值与最低租赁付款额的现值中较低者作为租入资产的入账价值，按自有固定资产的折旧政策计提折旧；将最低租赁付款额作为长期应付款的入账价值，其差额作为未确认的融资费用。采用实际利率法对未确认融资费用，在资产租赁期内摊销，计入财务费用。发生的初始直接费用计入租入资产价值。

（2）融资租出资产：本公司在租赁开始日，将应收融资租赁款和未担保余值之和与其现值的差额确认为未实现融资收益，在将来收到租金的各期间内确认为租赁收入。发生的与出租交易相关的初始直接费用，计入应收融资租赁款的初始计量中，并减少租赁期内确认的收益金额。

（三十） 持有待售

本公司将同时满足下列条件的企业组成部分（或非流动资产）划分为持有待售：（1）根据类似交易中出售此类资产或处置组的惯例，在当前状况下即可立即出售；（2）出售极可能发生，已经就一项出售计划作出决议且获得确定的购买承诺（确定的购买承诺，是指企业与其他方签订的具有法律约束力的购买协议，该协议包含交易价格、时间和足够严厉的违约惩罚等重要条款，使协议出现重大调整或者撤销的可能性极小。）预计出售将在一年内完成。已经获得按照

有关规定需得到相关权力机构或者监管部门的批准。

本公司将持有待售的账面价值调整为反映其公允价值减去出售费用后的净额（但不得超过该项持有待售的原账面价值），原账面价值高于公允价值减去出售费用后的净额的差额，作为资产减值损失计入当期损益，同时计提持有待售资产减值准备。对于持有待售的处置组确认的资产减值损失金额，应当先抵减处置组中商誉的账面价值，再根据处置组中适用本准则计量规定的各项非流动资产账面价值所占比重，按比例抵减其账面价值。

后续资产负债表日持有待售的非流动资产公允价值减去出售费用后的净额增加的，以前减记的金额应当予以恢复，并在划分为持有待售类别后确认的资产减值损失金额内转回，转回金额计入当期损益。划分为持有待售类别前确认的资产减值损失不得转回。后续资产负债表日持有待售的处置组公允价值减去出售费用后的净额增加的，以前减记的金额应当予以恢复，并在划分为持有待售类别后适用本准则计量规定的非流动资产确认的资产减值损失金额内转回，转回金额计入当期损益。已抵减的商誉账面价值，以及适用本准则计量规定的非流动资产在划分为持有待售类别前确认的资产减值损失不得转回。持有待售的处置组确认的资产减值损失后续转回金额，应当根据处置组中除商誉外适用本准则计量规定的各项非流动资产账面价值所占比重，按比例增加其账面价值。

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

（三十一） 终止经营

终止经营，是指企业满足下列条件之一的、能够单独区分的组成部分，且该组成部分已经处置或划分为持有待售类别：

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

企业应当在利润表中分别列示持续经营损益和终止经营损益。不符合终止经营定义的持有待售的非流动资产或处置组，其减值损失和转回金额及处置损益应当作为持续经营损益列报。终止经营的减值损失和转回金额等经营损益及处置损益应当作为终止经营损益列报。

（三十二） 利润分配

根据《公司章程》及监管部门规定，公司利润按以下顺序分配：

- 1、弥补以前年度亏损。
- 2、根据《公司法》的规定，提取 10%的法定公积金；根据《证券法》、《金融企业财务规则》

和《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》(证监机构字[2007]320 号)的规定,按照当期净利润的 10%提取一般风险准备金,按照当期净利润的 10%提取交易风险准备金,用于弥补证券交易损失。

3、剩余利润根据股东大会决议予以分配。

公司的公积金用于弥补公司的亏损、扩大公司生产经营或者转为增加公司股本,但资本公积金不得用于弥补公司的亏损。当公司法定公积金累计额为公司注册资本的 50%以上的,可以不再提取。法定公积金转为股本时,所留存的该项公积金不得少于转增前公司注册资本的 25%。

(三十三) 关联方

一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响,以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制的,构成关联方。下列各方构成本公司的关联方:

- 1、母公司\实际控制人;
- 2、子公司;
- 3、受同一母公司\实际控制人控制的其他企业;
- 4、实施共同控制的投资方;
- 5、施加重大影响的投资方;
- 6、合营企业及其子公司;
- 7、联营企业及其子公司;
- 8、主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员;
- 9、本公司或其母公司\实际控制人关键管理人员,以及与其关系密切的家庭成员;
- 10、主要投资者个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制或共同控制的其他企业;

(三十四) 分部报告政策

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础,结合经营分部规模,确定报告分部并披露分部信息。经营分部,是指本公司内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、本公司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、本公司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） 重大会计判断和估计

本公司根据历史经验和其他因素，包括对未来事项的合理预期，对所采用的重要会计估计和关键判断进行持续的评价。管理层在报告期末就主要未来不确定事项做出下列的判断及主要假设，实际的结果可能与本公司的估计存在误差。

1、金融工具的公允价值

金融工具不存在活跃市场的，本公司采用估值技术确定其公允价值。本公司使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。估值技术的应用中，本公司优先使用相关可观察输入值，只有在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。这些相关估计具有不确定性，其变化会对金融工具公允价值产生影响。

2、应收款项减值

如附注三、（十）所述，对于应收款项，本公司采用简化计量方法，始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。本公司基于历史信用损失经验计算上述金融资产的预期信用损失，相关历史经验根据资产负债表日借款人的特定因素、以及对当前状况和未来经济状况预测的评估进行调整。

3、除金融资产外的其他资产减值

如附注三、（二十）所述，对于长期股权投资、以成本模式计量的投资性房地产、固定资产、在建工程、使用寿命有限的无形资产等长期资产，本公司于资产负债表日判断是否存在减值迹象。本公司在资产负债表日进行减值评估，以确定资产可收回金额是否下跌至低于其账面价值。减值测试结果表明资产的可收回金额低于其账面价值的，按其差额计提减值准备并计入减值损失。

可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。在预计未来现金流量现值时，需要对该资产（或资产组）生产产品的产量、售价、相关经营成本以及计算现值时使用的折现率等作出重大判断。本公司在估计可收回金额时会采用所有能够获得的相关资料，包括根据合理和可支持的假设所作出有关产量、售价和相关经营成本的预测。

4、固定资产、无形资产等资产的折旧和摊销

如附注三、（十六）及（十八）所述，本公司对固定资产和无形资产等资产在考虑其残值后，在使用寿命内计提折旧和摊销。资产使用寿命是本公司根据对同类资产的已往经验并结合预期的技术改变而确定。如果以前的估计发生重大变化，则会在未来期间对折旧和摊销费用进行调整。

5、递延所得税

在估计未来期间能够取得足够的应纳税所得额用以利用可抵扣暂时性差异时，本公司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，并以预期收回该资产期间的适用所得税税率为基础计算并确认相关递延所得税资产。本公司需要运用判断来估计未来取得应纳税所得额的时间和金额，并根据现行的税收政策及其他相关政策对未来的适用所得税税率进行合理的估计和判断，以决定应确认的递延所得税资产的金额。如果未来期间实际产生的利润的时间和金额或者实际适用所得税税率与管理层的估计存在差异，该差异将对递延所得税资产的金额产生影响。

6、合并范围的确定

在评估本公司作为投资方是否控制了被投资方时需考虑所有事实和情况。判断是否存在控制的原则包括三个要素：（1）拥有对被投资方的权力；（2）因参与被投资方的相关活动而享有可变回报；（3）有能力运用其对被投资方的权力影响其回报的金额。在有情况表明上述三个要素的一个或多个要素发生变动时，本公司会对本公司是否对被投资方依然存在控制进行重新评估。

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报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。

四、税项

（一）主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	手续费收入等应税收入	3%、5%、6%、13%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	5%
企业所得税	应纳税所得额	25%、16.5%
其他税种	按税法规定应纳税额	

（二）税收情况说明

1、增值税

根据财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36号）、《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》（财税[2016]46号）以及《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》（财税[2016]70号）等规定，自2016年5月1日起，本公司的主营业务收入适用增值税，税率为6%。

根据财政部和国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税

政策的通知》(财税[2016]140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号),2018年1月1日起,资管产品管理人(以下称“管理人”)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

根据财政部、国家税务总局《关于调整增值税税率的通知》(财税[2018]32号)的规定,自2018年5月1日起,纳税人发生增值税应税销售行为或者进口货物,原适用17%和11%税率的,税率分别调整为16%和10%。

根据《财政部税务总局海关总署关于深化增值税改革有关政策的公告》(财政部税务总局海关总署公告2019年第39号)的规定,自2019年4月1日起,纳税人发生增值税应税销售行为或者进口货物,原适用16%和10%税率的,税率分别调整为13%和9%。

2、企业所得税

本公司及主要境内子公司所得税税率为25%;中国境外子公司按当地规定缴纳所得税。

五、会计政策和会计估计变更以及前期差错更正的说明

(一) 重要会计政策变更

2017年财政部修订印发《企业会计准则第14号——收入》(以下简称“新收入准则”),要求在境内外同时上市的企业以及在境外上市并采用国际财务报告准则或企业会计准则编制财务报表的企业,自2018年1月1日起施行;其他境内上市企业,自2020年1月1日起施行;执行企业会计准则的非上市企业,自2021年1月1日起施行。同时,允许企业提前执行。

根据《关于做好挂牌公司2020年半年度报告披露相关工作的通知》(股转系统公告(2020)537号),挂牌公司应自2020年1月1日起执行新收入准则。

本公司自2020年1月1日起执行上述企业会计准则修订,对会计政策相关内容进行调整。

新收入准则的采用,未对公司的财务状况和经营成果产生重大影响。

(二) 重要会计估计变更

无。

(三) 前期差错更正的说明

无。

六、合并财务报表主要项目注释

说明：期初指 2019 年 12 月 31 日，期末指 2020 年 12 月 31 日，上期指 2019 年度，本期指 2020 年度。

（一）货币资金

1、分类列示

项目	期末余额	期初余额
现金	4,988.46	10,899.90
银行存款	11,108,430,632.06	10,848,738,362.20
其中：客户存款	9,791,992,199.28	8,333,155,425.55
公司存款	1,316,438,432.78	2,515,582,936.65
其他货币资金	4,708,097.95	391,169.53
小计	<u>11,113,143,718.47</u>	<u>10,849,140,431.63</u>
加：应收利息	25,257,810.15	21,380,847.31
合计	<u>11,138,401,528.62</u>	<u>10,870,521,278.94</u>
其中：存放在境外的款项总额	44,792,041.98	181,888,336.97

2、按币种列示

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
库存现金：						
其中：人民币			4,300.00			2,106.30
港币	818.00	0.8416	688.46	9,816.70	0.8958	8,793.60
小计			<u>4,988.46</u>			<u>10,899.90</u>
银行存款：						
客户资金存款						
其中：人民币			9,339,403,547.68			7,921,545,449.85
港币	19,810,100.92	0.8416	16,672,973.34	11,794,369.95	0.8958	10,565,160.71
美元	3,121,563.46	6.5249	20,367,889.41	3,446,299.89	6.9762	24,042,077.30
小计			<u>9,376,444,410.43</u>			<u>7,956,152,687.86</u>
客户信用资金存款						
其中：人民币			415,547,788.85			377,002,737.69
小计			<u>415,547,788.85</u>			<u>377,002,737.69</u>
客户存款合计			<u>9,791,992,199.28</u>			<u>8,333,155,425.55</u>

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
公司自有资金						
存款						
其中：人民币			989,710,512.97			2,170,517,761.72
港币	23,947,972.80	0.8416	20,155,571.83	60,442,101.58	0.8958	54,142,825.76
美元	1,118,458.13	6.5249	7,297,827.42	18,305,822.91	6.9762	127,705,081.78
欧元				10.56	7.8170	82.53
小计			<u>1,017,163,912.22</u>			<u>2,352,365,751.79</u>
公司信用资金						
存款						
其中：人民币			299,274,520.56			163,217,184.86
小计			<u>299,274,520.56</u>			<u>163,217,184.86</u>
公司存款合计			<u>1,316,438,432.78</u>			<u>2,515,582,936.65</u>
其他货币资金：						
其中：人民币			1,057.06			
港币	783,726.75	0.8416	659,615.78	140,798.35	0.8958	126,124.35
美元	620,304.54	6.5249	4,047,425.11	37,995.83	6.9762	265,045.18
小计			<u>4,708,097.95</u>			<u>391,169.53</u>
货币资金小计			<u>11,113,143,718.47</u>			<u>10,849,140,431.63</u>
加：应收利息			25,257,810.15			21,380,847.31
合计			<u>11,138,401,528.62</u>			<u>10,870,521,278.94</u>

其中：融资融券业务

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
公司信用资金存款			299,274,520.56			163,217,184.86
其中：人民币			299,274,520.56			163,217,184.86
客户信用资金存款			415,547,788.85			377,002,737.69
其中：人民币			415,547,788.85			377,002,737.69
合计			<u>714,822,309.41</u>			<u>540,219,922.55</u>

3、2020年12月31日以及2019年12月31日货币资金不存在抵押、冻结等对变现有限制及潜在回收风险的重大款项。

(二) 结算备付金

1、按类别列示

项目	期末余额	期初余额
客户备付金	4,711,838,877.06	3,469,940,446.69
公司备付金	1,102,068,576.02	745,694,564.52
小计	<u>5,813,907,453.08</u>	<u>4,215,635,011.21</u>
加：应收利息	316.03	329.30
合计	<u>5,813,907,769.11</u>	<u>4,215,635,340.51</u>

2、按币种列示

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
客户备付金：						
客户普通备付金			4,508,275,715.48			3,198,515,102.41
其中：人民币			4,476,138,041.48			3,163,678,239.24
港币	15,585,410.35	0.8416	13,117,304.77	21,101,899.26	0.8958	18,902,659.32
美元	2,915,043.79	6.5249	19,020,369.23	2,284,080.71	6.9762	15,934,203.85
客户信用备付金			203,563,161.58			271,425,344.28
其中：人民币			203,563,161.58			271,425,344.28
客户备付金合计			<u>4,711,838,877.06</u>			<u>3,469,940,446.69</u>
公司备付金：						
公司自有备付金			1,102,068,576.02			745,694,564.52
其中：人民币			1,065,503,455.74			715,953,015.96
港币	29,335,461.48	0.8416	24,689,897.80	19,386,134.59	0.8958	17,365,711.65
美元	1,819,985.36	6.5249	11,875,222.48	1,774,008.33	6.9762	12,375,836.91
公司备付金合计			<u>1,102,068,576.02</u>			<u>745,694,564.52</u>
结算备付金小计			5,813,907,453.08			4,215,635,011.21
加：应收利息			316.03			329.30
合计			<u>5,813,907,769.11</u>			<u>4,215,635,340.51</u>

(三) 融出资金

1、按类别列示

项目	期末余额	期初余额
境内		
其中：个人	5,476,593,719.17	3,743,313,173.44

项目	期末余额	期初余额
机构	1,883,165,560.61	66,261,508.12
小计	<u>7,359,759,279.78</u>	<u>3,809,574,681.56</u>
境外		
其中：个人	4,122,502.14	10,023,148.56
机构	6,314.85	
小计	<u>4,128,816.99</u>	<u>10,023,148.56</u>
融出资金小计	<u>7,363,888,096.77</u>	<u>3,819,597,830.12</u>
加：应收利息	168,825,867.39	149,927,660.90
减：减值准备	36,787,967.15	19,354,735.01
合计	<u>7,495,925,997.01</u>	<u>3,950,170,756.01</u>

2、客户因融资融券业务提供的担保物公允价值

担保物类别	担保物公允价值	
	期末余额	期初余额
资金	403,506,334.39	398,527,325.83
债券	14,316,751.63	2,572,734.61
股票	22,044,148,743.35	11,258,310,810.14
基金	216,441,379.42	52,468,101.54
合计	<u>22,678,413,208.79</u>	<u>11,711,878,972.12</u>

除融出资金外，上述担保物公允价值信息还包含了融出证券的担保物情况。

3、于2020年12月31日以及2019年12月31日本公司均无逾期的融出资金。

4、于2020年12月31日，公司融资融券业务融出资金为本公司开展的卖出回购业务提供担保金额为418,531,527.65元。于2019年12月31日，公司无质押的融出资金。

(四) 衍生金融工具

1、分类

类别	期末余额					
	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				<u>11,104,612,850.00</u>	<u>1,585,415.37</u>	
国债期货				4,199,363,850.00	484,700.00	546,950.00
抵销：国债期货暂收 暂付款					-484,700.00	-546,950.00

类别	期末余额					
	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	
利率互换				6,600,000,000.00		4,720,918.72
抵销：利率互换暂收						-4,720,918.72
暂付款						
债券远期				240,000,000.00		510,920.00
抵销：利率互换暂收						-510,920.00
暂付款						
收益互换				65,249,000.00	1,585,415.37	
权益衍生工具				<u>15,643,080.00</u>		
股指期货				15,643,080.00	188,100.00	417,780.00
抵销：股指期货暂收						-417,780.00
暂付款					-188,100.00	
个股期权						
其他衍生工具				<u>2,930,571,048.00</u>	<u>3,855,960.83</u>	<u>12,893,591.20</u>
商品期权				840,389,343.00	3,855,960.83	12,893,591.20
商品期货				2,090,181,705.00	6,984,515.00	8,051,260.00
抵销：商品期货暂收						-8,051,260.00
暂付款					-6,984,515.00	
合计				<u>14,050,826,978.00</u>	<u>5,441,376.20</u>	<u>12,893,591.20</u>

续表

类别	期初余额					
	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				<u>8,814,613,850.00</u>		
国债期货				3,094,613,850.00	840,600.00	1,986,650.00
抵销：国债期货暂收						-1,986,650.00
暂付款					-840,600.00	
利率互换				5,720,000,000.00		2,303,301.55
抵销：利率互换暂收						-2,303,301.55
暂付款						
权益衍生工具				<u>41,572,600.00</u>	<u>211,598.00</u>	

类别	期初余额					
	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	
股指期货				12,900,600.00	133,180.00	
抵销：股指期货暂收 暂付款					-133,180.00	
个股期权				28,672,000.00	211,598.00	
其他衍生工具				<u>666,332,730.00</u>	<u>1,337,316.03</u>	<u>1,960,906.57</u>
商品期权				169,421,120.00	1,337,316.03	1,960,906.57
商品期货				496,911,610.00	3,140,637.00	50,573.19
抵销：商品期货暂收 暂付款					-3,140,637.00	-50,573.19
合计				<u>9,522,519,180.00</u>	<u>1,548,914.03</u>	<u>1,960,906.57</u>

2、本公司开展的国债期货交易为每日无负债结算。2020年12月31日，本公司持有的用于非套保的未到期国债期货合约的公允价值变动收益为484,700.00元，公允价值变动损失为546,950.00元（2019年12月31日：公允价值变动收益为840,600.00元，公允价值变动损失为1,986,650.00元），与本公司因参与国债期货交易所确认的暂收暂付款相互抵销，抵销后净额为人民币0.00元。

3、本公司开展的利率互换交易为每日无负债结算。2020年12月31日，本公司持有的用于非套保的未到期利率互换合约的公允价值变动损失为4,720,918.72元（2019年12月31日：公允价值变动损失为2,303,301.55元），与本公司因参与利率互换交易所确认的暂收暂付款相互抵销，抵销后净额为人民币0.00元。

4、本公司开展的债券远期交易为每日无负债结算。2020年12月31日，本公司持有的用于非套保的未到期债券远期合约的公允价值变动损失为510,920.00元。与本公司因参与债券远期交易所确认的暂收暂付款相互抵销，抵销后净额为人民币0.00元。

5、本公司开展的股指期货交易为每日无负债结算。2020年12月31日，本公司持有的用于非套保的未到期股指期货合约的公允价值变动收益为188,100.00元，公允价值变动损失为417,780.00元（2019年12月31日：公允价值变动收益为133,180.00元），与本公司因参与股指期货交易所确认的暂收暂付款相互抵销，抵销后净额为人民币0.00元。

6、本公司开展的商品期货交易为每日无负债结算。2020年12月31日，本公司持有的用于非套保的未到期商品期货合约的公允价值变动收益为6,984,515.00元，公允价值变动损失为8,051,260.00元（2019年12月31日：公允价值变动收益为3,140,637.00元，公允价值变动损失为50,573.19元），与本公司因参与商品期货交易所确认的暂收暂付款相互抵销，抵销后净额为人民币0.00元。

(五) 存出保证金

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
交易保证金			67,215,938.74			58,085,912.10
其中：人民币			64,608,367.54			55,754,448.10
港币	1,005,000.00	0.8416	845,848.20	500,000.00	0.8958	447,890.00
美元	270,000.00	6.5249	1,761,723.00	270,000.00	6.9762	1,883,574.00
债券远期保证金			2,612,000.00			
其中：人民币			2,612,000.00			
信用保证金			9,876,667.23			4,728,484.15
其中：人民币			9,876,667.23			4,728,484.15
期货业务保证金			20,106,040.61			20,113,915.70
其中：人民币			20,106,040.61			20,113,915.70
利率互换保证金			94,230,000.00			94,230,000.00
其中：人民币			94,230,000.00			94,230,000.00
转融通保证金			156,442,920.11			183,623,277.27
其中：人民币			156,442,920.11			183,623,277.27
收益互换			42,595,375.00			
其中：人民币			42,595,375.00			
小计			<u>393,078,941.69</u>			<u>360,781,589.22</u>
加：应收利息			6.93			20.35
合计			<u>393,078,948.62</u>			<u>360,781,609.57</u>

(六) 应收款项

1、按明细列示

项目	期末余额	期初余额
往来款项	126,068,178.08	126,068,178.08
押金	10,380,098.51	9,849,679.89
集合理财管理费	9,229,764.67	11,585,036.78
应收证券清算款	893,475.25	5,000,868.49
应收席位佣金	609,791.75	5,737,328.47
其他	15,534,378.49	54,505,742.06
小计	<u>162,715,686.75</u>	<u>212,746,833.77</u>
减：减值准备	141,492,282.57	143,260,171.72

项目	期末余额	期初余额
合计	<u>21,223,404.18</u>	<u>69,486,662.05</u>

2、按减值准备评估方式列示

类别	金额	期末余额		坏账准备计提比例 (%)
		占总额比例 (%)	坏账准备	
单项计提减值准备	126,453,491.94	77.71	126,453,491.94	100
组合计提减值准备	36,262,194.81	22.29	15,038,790.63	41.47
合计	<u>162,715,686.75</u>	<u>100</u>	<u>141,492,282.57</u>	

续表

类别	金额	期初余额		坏账准备计提比例 (%)
		占总额比例 (%)	坏账准备	
单项计提减值准备	126,174,669.94	59.31	126,174,669.94	100.00
组合计提减值准备	86,572,163.83	40.69	17,085,501.78	19.74
合计	<u>212,746,833.77</u>	<u>100</u>	<u>143,260,171.72</u>	

3、按账龄分析

账龄	期末余额	比例 (%)	坏账准备	计提比例 (%)
1年以内(含1年)	18,467,490.79	11.35	1,748,253.62	9.47
1-2年(含2年)	4,531,733.02	2.79	1,129,404.21	24.92
2-3年(含3年)	31,652,676.40	19.45	30,550,838.20	96.52
3年以上	108,063,786.54	66.41	108,063,786.54	100.00
合计	<u>162,715,686.75</u>	<u>100</u>	<u>141,492,282.57</u>	

续表

账龄	期初余额	比例 (%)	坏账准备	计提比例 (%)
1年以内(含1年)	63,967,909.06	30.07	2,021,761.36	3.16
1-2年(含2年)	38,260,014.12	17.98	31,221,939.94	81.60
2-3年(含3年)	1,111,372.19	0.52	608,932.02	54.79
3年以上	109,407,538.40	51.43	109,407,538.40	100.00
合计	<u>212,746,833.77</u>	<u>100</u>	<u>143,260,171.72</u>	

4、于2020年12月31日，应收款项无持有本公司5%(含5%)以上表决权股份的股东单位欠款。

5、于2020年12月31日存在应收关联方单位款项，详见十、（六）关联方应收应付款项。

6、单项计提减值准备中重大的应收款项

应收款项内容	期末余额	坏账准备期末余额	计提比例(%)	计提理由
大连机床集团有限责任公司	73,619,178.08	73,619,178.08	100.00	预计不可收回
大兴安岭依莓饮品有限公司	29,449,000.00	29,449,000.00	100.00	预计不可收回
中视丰德影视版权代理有限公司	23,000,000.00	23,000,000.00	100.00	预计不可收回
合计	<u>126,068,178.08</u>	<u>126,068,178.08</u>		

续表

应收款项内容	期初余额	坏账准备期末余额	计提比例(%)	计提理由
大连机床集团有限责任公司	73,619,178.08	73,619,178.08	100.00	预计不可收回
大兴安岭依莓饮品有限公司	29,449,000.00	29,449,000.00	100.00	预计不可收回
中视丰德影视版权代理有限公司	23,000,000.00	23,000,000.00	100.00	预计不可收回
合计	<u>126,068,178.08</u>	<u>126,068,178.08</u>		

7、本期计提、收回或转回的坏账准备情况

(1) 本期应收款项坏账变动情况

项目	本期发生额
本期计提应收款项坏账准备	-1,493,387.08

(2) 本期重要的坏账准备转回或收回：无。

(3) 本期重要的应收款项核销情况：无。

8、于2020年12月31日，应收款项金额前五名情况

单位名称	金额	比例(%)	账龄
大连机床集团有限责任公司	73,619,178.08	45.24	3年以上
大兴安岭依莓饮品有限公司	29,449,000.00	18.10	3年以上
中视丰德影视版权代理有限公司	23,000,000.00	14.14	3年以上
Shanghai Commercial Bank Limited	2,786,264.37	1.71	1-2年(含2年), 3年以上
Donghai Overseas Stable Income Fund SP	1,793,945.62	1.10	1年以内(含1年), 2-3年(含3年), 3年以上
合计	<u>130,648,388.07</u>	<u>80.29</u>	

9、因金融资产转移而终止确认的应收账款情况：无。

(七) 买入返售金融资产

1、按标的物类别列示

标的物类别	期末余额	期初余额
债券	1,313,478,101.78	1,594,070,442.02
小计	<u>1,313,478,101.78</u>	<u>1,594,070,442.02</u>
加：应收利息	360,952.65	439,161.48
减：减值准备		
合计	<u>1,313,839,054.43</u>	<u>1,594,509,603.50</u>

2、按业务类别分类

项目	期末余额	期初余额
债券质押式回购	1,313,478,101.78	1,594,070,442.02
小计	<u>1,313,478,101.78</u>	<u>1,594,070,442.02</u>
加：应收利息	360,952.65	439,161.48
减：减值准备		
合计	<u>1,313,839,054.43</u>	<u>1,594,509,603.50</u>

3、买入返售金融资产收取的担保物公允价值

担保物类别	期末余额	期初余额
担保物	1,108,926,088.40	1,529,589,357.80
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		

4、对于通过交易所操作的债券逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足额，无法获知对手方质押物信息，因此上述收取的担保物公允价值未包括交易所债券逆回购取得的担保物公允价值。2020年12月31日和2019年12月31日，交易所债券逆回购的金额分别为321,123,066.10元和225,300,000.00元。

5、于2020年12月31日，上述公司买入返售金融资产无债券买断式回购业务。

(八) 持有待售资产

项目	期末账面 余额	减值准备	期末账面价值	期末公允 价值	预计处置 费用	预计处置 时间
深圳市东海天富投资有限公司	1,484,587.84	615,987.84	868,600.00	868,600.00		2021年
合计	<u>1,484,587.84</u>	<u>615,987.84</u>	<u>868,600.00</u>	<u>868,600.00</u>		

(九) 交易性金融资产

1、按项目列示

项目	期末余额					
	分类为以公允价值计量 且其变动计入当期损益 的金融资产	初始投资成本	初始投资成本合计	分类为以公允价值计量 且其变动计入当期损益 的金融资产	公允价值	公允价值合计
		指定为以公			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			允价值计量 且其变动计 入当期损益 的金融资产	
债券	10,471,809,415.39	10,471,809,415.39	10,280,955,280.29	10,280,955,280.29		
公募基金	1,084,396,679.23	1,084,396,679.23	1,081,503,765.59	1,081,503,765.59		
股票	1,573,545,637.59	1,573,545,637.59	1,992,387,017.27	1,992,387,017.27		
银行理财产品	114,000,000.00	114,000,000.00	116,820,150.19	116,820,150.19		
券商资管产品	11,386,733.23	11,386,733.23	28,759,108.41	28,759,108.41		
信托计划						
其他	1,208,848,778.99	1,208,848,778.99	1,238,934,686.35	1,238,934,686.35		
合计	<u>14,463,987,244.43</u>	<u>14,463,987,244.43</u>	<u>14,739,360,008.10</u>	<u>14,739,360,008.10</u>		

续表

项目	期初余额					
	分类为以公允价值计量 且其变动计入当期损益 的金融资产	初始投资成本	初始投资成本合计	分类为以公允价值计量 且其变动计入当期损益 的金融资产	公允价值	公允价值合计
		指定为以公			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			允价值计量 且其变动计 入当期损益 的金融资产	
债券	11,331,794,645.05	11,331,794,645.05	11,312,978,386.62	11,312,978,386.62		
公募基金	1,105,250,972.05	1,105,250,972.05	1,070,624,644.64	1,070,624,644.64		
股票	964,150,249.55	964,150,249.55	999,351,308.29	999,351,308.29		
银行理财产品	40,000,000.00	40,000,000.00	41,021,589.04	41,021,589.04		
券商资管产品	12,930,000.00	12,930,000.00	30,759,746.01	30,759,746.01		
信托计划	7,500,000.00	7,500,000.00	7,453,500.00	7,453,500.00		
其他	957,526,934.43	957,526,934.43	967,431,079.40	967,431,079.40		
合计	<u>14,419,152,801.08</u>	<u>14,419,152,801.08</u>	<u>14,429,620,254.00</u>	<u>14,429,620,254.00</u>		

2、本公司交易性金融资产余额中包含融出证券，详细信息参见附注六、(十三)。本公司

融出证券的担保物情况参见附注六、(三)。

3、于 2020 年 12 月 31 日，本公司交易性金融资产余额中有公允价值为人民币 6,214,995,108.66 元的债券投资为卖出回购业务设定质押。本公司卖出回购业务的情况参见附注六、(二十五)。

4、于 2020 年 12 月 31 日，本公司交易性金融资产余额中有公允价值为人民币 451,803,400.00 元债券投资为债券借贷业务设定质押。本公司债券借贷业务的情况参见附注十四、(五)。

(十) 债权投资

项目	期末余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
其他	872,291,143.71	21,680,569.60	753,302,231.45	140,669,481.86
合计	<u>872,291,143.71</u>	<u>21,680,569.60</u>	<u>753,302,231.45</u>	<u>140,669,481.86</u>

续表

项目	期初余额			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
其他	1,037,005,965.78	19,900,017.09	538,651,293.98	518,254,688.89
合计	<u>1,037,005,965.78</u>	<u>19,900,017.09</u>	<u>538,651,293.98</u>	<u>518,254,688.89</u>

注：债权投资主要是资产管理计划与信托计划及应收款项类投资。

(十一) 其他债权投资

项目	期末余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
企业债	54,194,401.43	927,795.00	477,523.57	55,599,720.00	57,061.40
其他	97,544,463.18	4,764,287.20	-49,947,000.38	52,361,750.00	50,340,904.29
合计	<u>151,738,864.61</u>	<u>5,692,082.20</u>	<u>-49,469,476.81</u>	<u>107,961,470.00</u>	<u>50,397,965.69</u>

续表

项目	期初余额				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
企业债	53,000,574.59	925,260.05	1,370,725.36	55,296,560.00	55,822.95
其他	106,411,109.41	5,105,081.60	-22,917,645.02	88,598,545.99	34,534,135.95
合计	<u>159,411,684.00</u>	<u>6,030,341.65</u>	<u>-21,546,919.66</u>	<u>143,895,105.99</u>	<u>34,589,958.90</u>

1、于 2020 年 12 月 31 日，其他债权投资余额中不存在已融出证券。

2、于 2020 年 12 月 31 日，本公司其他债权投资中有公允价值为人民币 55,599,720.00 元的债券投资为卖出回购业务设定质押。本公司卖出回购业务的情况参见附注六、（二十五）。

（十二）其他权益工具投资

1、其他权益工具投资情况

项目	期末余额		本期确认的股利收入
	初始成本	公允价值	
股权	24,000,000.00	42,815,881.86	
其他	1,400,000.00	1,400,000.00	
合计	<u>25,400,000.00</u>	<u>44,215,881.86</u>	

续表

项目	期初余额		本期确认的股利收入
	初始成本	公允价值	
股权	24,000,000.00	24,000,000.00	
其他	1,400,000.00	1,400,000.00	
合计	<u>25,400,000.00</u>	<u>25,400,000.00</u>	

2、本期终止确认的其他权益工具投资：无

（十三）融出证券

1、按项目分析

项目	期末余额	期初余额
融出证券	7,880,284.82	3,980,938.55
—交易性金融资产	7,880,284.82	3,980,938.55
—转融通融入证券		
融出证券总额	<u>7,880,284.82</u>	<u>3,980,938.55</u>

2、融出证券的担保物情况参见附注六、（三）。

3、融出证券减值参见附注六、（三十一）。

4、融券业务违约情况

于 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日，本公司融券业务无重大合约逾期。

(十四) 长期股权投资

1、按类别列示

项目	期末余额	期初余额
对联营企业的投资		
-重要的联营企业	49,278,338.85	48,796,746.10
-不重要的联营企业	1,583,057.79	2,144,784.53
小计	<u>50,861,396.64</u>	<u>50,941,530.63</u>
减：减值准备		
合计	<u>50,861,396.64</u>	<u>50,941,530.63</u>

2、长期股权投资明细情况

被投资单位名称	期初余额	本期增减变动	
		追加投资	减少投资
东海基金管理有限责任公司	47,307,050.81		
深圳市东海天富投资有限公司	1,489,695.29		
铎龙（上海）投资管理有限公司	2,144,784.53		
合计	<u>50,941,530.63</u>		

续表

被投资单位名称	权益法下确认的投资 损益	本期增减变动		
		其他综合收益调整	其他权益变动	现金红利
东海基金管理有限责任公司	1,971,288.04			
深圳市东海天富投资有限公司	-5,107.45			
铎龙（上海）投资管理有限公司	-561,726.74			
合计	<u>1,404,453.85</u>			

续表

被投资单位名称	本期增减变动		期末余额	资产减值准备
	本期计提 减值准备	其他		
东海基金管理有限责任公司			49,278,338.85	
深圳市东海天富投资有限公司		-1,484,587.84		
铎龙（上海）投资管理有限公司			1,583,057.79	
合计		<u>-1,484,587.84</u>	<u>50,861,396.64</u>	

- 3、长期股权投资不存在向投资企业转移资金的能力受到限制的情况。
- 4、本公司报告期内长期股权投资不存在减值迹象，故未计提长期股权投资减值准备。
- 5、联营企业的重要会计政策、会计估计与公司的会计政策、会计估计不存在重大差异。
- 6、联营企业的财务信息参见八、（三）在合营或联营企业中的权益。

（十五）投资性房地产

1、成本法计量的投资性房地产

项目	房屋建筑物	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	<u>144,013,877.88</u>	<u>144,013,877.88</u>
2. 本期增加金额		
(1) 外购		
(2) 存货、固定资产、在建工程转入		
(3) 企业合并增加		
3. 本期减少金额		
(1) 处置		
(2) 其他转出		
4. 期末余额	<u>144,013,877.88</u>	<u>144,013,877.88</u>
二、累计折旧和累计摊销		
1. 期初余额	<u>42,180,460.06</u>	<u>42,180,460.06</u>
2. 本期增加金额	3,461,959.08	3,461,959.08
(1) 计提或摊销	3,461,959.08	3,461,959.08
3. 本期减少金额		
(1) 处置		
(2) 其他转出		
4. 期末余额	<u>45,642,419.14</u>	<u>45,642,419.14</u>
三、减值准备		
1. 期初余额		
2. 本期增加金额		
(1) 计提		
3. 本期减少金额		
(1) 处置		
(2) 其他转出		
4. 期末余额		

项目	房屋建筑物	合计
四、账面价值		
1. 期末账面价值	<u>98,371,458.74</u>	<u>98,371,458.74</u>
2. 期初账面价值	<u>101,833,417.82</u>	<u>101,833,417.82</u>

2、截至 2020 年 12 月 31 日，本公司无用于抵押担保等所有权受到限制的重大投资性房地产。

(十六) 固定资产

1、分类列示

项目	房屋建筑物	运输设备	电子设备	办公设备及其他	合计
一、账面原值：					
1. 期初余额	690,939,731.99	34,754,778.68	182,182,519.61	43,149,566.49	951,026,596.77
2. 本期增加金额		1,925,407.09	14,121,150.58	1,673,290.95	17,719,848.62
(1) 购置		1,925,407.09	14,121,150.58	1,673,290.95	17,719,848.62
3. 本期减少金额		2,080,679.03	9,191,922.01	2,731,506.50	14,004,107.54
(1) 处置或报废		2,080,679.03	9,191,922.01	2,731,506.50	14,004,107.54
4. 外币报表折算差额		-41,417.09	-76,931.18	-66,954.66	-185,302.93
5. 期末余额	<u>690,939,731.99</u>	<u>34,558,089.65</u>	<u>187,034,817.00</u>	<u>42,024,396.28</u>	<u>954,557,034.92</u>
二、累计折旧					
1. 期初余额	<u>154,457,456.81</u>	<u>25,290,467.62</u>	<u>148,114,953.85</u>	<u>37,405,933.04</u>	<u>365,268,811.32</u>
2. 本期增加金额	18,178,652.92	3,448,409.65	14,296,316.44	2,284,374.10	38,207,753.11
(1) 计提	18,178,652.92	3,448,409.65	14,296,316.44	2,284,374.10	38,207,753.11
3. 本期减少金额		1,919,991.61	8,592,991.23	2,569,375.35	13,082,358.19
(1) 处置或报废		1,919,991.61	8,592,991.23	2,569,375.35	13,082,358.19
4. 外币报表折算差额		-17,257.15	-63,840.53	-61,765.60	-142,863.28
5. 期末余额	<u>172,636,109.73</u>	<u>26,801,628.51</u>	<u>153,754,438.53</u>	<u>37,059,166.19</u>	<u>390,251,342.96</u>
三、减值准备					
1. 期初余额	<u>383,330.89</u>				<u>383,330.89</u>
2. 本期增加金额					
(1) 计提					
3. 本期减少金额					
(1) 处置或报废					
4. 外币报表折算差额					
5. 期末余额	<u>383,330.89</u>				<u>383,330.89</u>
四、账面价值					
1. 期末账面价值	<u>517,920,291.37</u>	<u>7,756,461.14</u>	<u>33,280,378.47</u>	<u>4,965,230.09</u>	<u>563,922,361.07</u>
2. 期初账面价值	<u>536,098,944.29</u>	<u>9,464,311.06</u>	<u>34,067,565.76</u>	<u>5,743,633.45</u>	<u>585,374,454.56</u>

2、截至 2020 年 12 月 31 日，本公司无用于抵押担保等所有权受到限制的重大固定资产。

3、截至 2020 年 12 月 31 日以及截至 2019 年 12 月 31 日，本公司无暂时闲置的重大固定资产。

4、截至 2020 年 12 月 31 日以及截至 2019 年 12 月 31 日，本公司无通过融资租赁租出或租入的重大固定资产。

5、截至 2020 年 12 月 31 日以及截至 2019 年 12 月 31 日，本公司对账面余额为 383,330.89 元的房屋建筑物全额计提了减值准备。

6、截至 2020 年 12 月 30 日以及截至 2019 年 12 月 31 日，本公司无未办妥产证的重大固定资产。

(十七) 无形资产

1、按项目列示

项目	软件	交易席位费	合计
一、账面原值			
1. 期初余额	<u>137,123,937.70</u>	<u>25,272,890.00</u>	<u>162,396,827.70</u>
2. 本期增加金额	28,204,271.11		28,204,271.11
(1) 购置	28,204,271.11		28,204,271.11
3. 本期减少金额	2,168,037.29		2,168,037.29
(1) 处置或报废	2,168,037.29		2,168,037.29
4. 外币报表折算差额		-27,070.00	-27,070.00
5. 期末余额	<u>163,160,171.52</u>	<u>25,245,820.00</u>	<u>188,405,991.52</u>
二、累计摊销			
1. 期初余额	<u>102,169,501.98</u>	<u>24,760,928.39</u>	<u>126,930,430.37</u>
2. 本期增加金额	25,984,313.51	93,435.54	26,077,749.05
(1) 计提	25,984,313.51	93,435.54	26,077,749.05
3. 本期减少金额	2,168,037.29		2,168,037.29
(1) 处置或报废	2,168,037.29		2,168,037.29
4. 外币报表折算差额		-10,828.00	-10,828.00
5. 期末余额	<u>125,985,778.20</u>	<u>24,843,535.93</u>	<u>150,829,314.13</u>
三、减值准备			
1. 期初余额			
2. 本期增加金额			
(1) 计提			
3. 本期减少金额			
(1) 处置或报废			
4. 外币报表折算差额			
5. 期末余额			
四、账面价值			

项目	软件	交易席位费	合计
1. 期末账面价值	<u>37,174,393.32</u>	<u>402,284.07</u>	<u>37,576,677.39</u>
2. 期初账面价值	<u>34,954,435.72</u>	<u>511,961.61</u>	<u>35,466,397.33</u>

2、截至 2020 年 12 月 31 日，本公司无用于抵押担保等所有权受到限制的重大无形资产。

3、截至 2020 年 12 月 31 日以及截至 2019 年 12 月 31 日，本公司无未办妥产权证书的土地使用权。

(十八) 递延所得税资产及递延所得税负债

1、未抵销的递延所得税资产

项目	期末余额		期初余额	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
融出资金减值准备	36,767,792.14	9,191,948.05	19,339,970.16	4,834,992.54
衍生工具公允价值变动	5,005,098.35	1,251,274.57	3,539,964.72	884,991.18
应收款项坏账准备	56,240,681.93	14,060,170.55	56,934,866.77	14,233,716.75
交易性金融工具公允价值变动	181,298,596.09	45,324,649.04	122,832,167.40	30,708,041.85
其他债权投资公允价值变动	49,469,476.81	12,367,369.20	21,546,919.66	5,386,729.82
固定资产减值准备	383,330.89	95,832.73	383,330.89	95,832.73
其他资产-存货跌价准备			144,400.00	36,100.00
预计负债	622,490.82	155,622.10	617,939.18	154,484.80
费用入账税务时间差异	532,946,903.82	133,236,725.94	411,374,727.68	102,843,681.91
其他	58,010,029.54	14,502,507.39	127,385,980.83	31,846,495.21
合计	<u>920,744,400.39</u>	<u>230,186,099.57</u>	<u>764,100,267.29</u>	<u>191,025,066.79</u>

2、未抵销的递延所得税负债

项目	期末余额		期初余额	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
衍生金融工具公允价值变动	4,293,560.44	1,073,390.11	3,357,344.43	839,336.11
交易性金融资产公允价值变动	638,293,261.12	159,573,315.30	174,267,253.69	43,566,813.43
其他权益工具投资公允价值变动	18,815,881.86	4,703,970.46		
其他	887,679.32	221,919.83	5,737,328.47	1,434,332.12
合计	<u>662,290,382.74</u>	<u>165,572,595.70</u>	<u>183,361,926.59</u>	<u>45,840,481.66</u>

3、未确认递延所得税资产情况

项目	期末余额	期初余额
可抵扣亏损	141,917,223.01	106,246,241.01

项目	期末余额	期初余额
融出资金减值准备	20,175.01	14,764.85
衍生金融工具公允价值变动		50,573.19
应收款项坏账准备	85,251,600.64	86,325,304.95
交易性金融资产公允价值变动	232,379,132.23	57,610,816.60
债权投资减值准备	753,302,231.45	538,651,293.98
持有待售资产减值准备	615,987.84	
合计	<u>1,213,486,350.18</u>	<u>788,898,994.58</u>

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

年份	期末余额	期初余额
2020	49,659,276.82	50,628,262.29
2021		
2022	9,870,531.06	9,870,531.06
2023	27,151,212.15	27,151,212.15
2024	33,602,192.71	18,596,235.51
2025	21,634,010.27	
合计	<u>141,917,223.01</u>	<u>106,246,241.01</u>

(十九) 其他资产

项目	期末余额	期初余额
预缴所得税	73,151,404.75	52,782,339.89
预付款项	25,129,384.04	90,135,599.88
待摊费用	10,261,456.08	12,587,030.66
长期待摊费用	10,163,793.97	12,741,713.07
存货	5,742,701.26	21,338,141.44
留抵增值税	1,822,626.87	2,502,899.88
应收股利	1,377,509.99	473,054.00
其他	16,840.29	2,918,247.28
小计	<u>127,665,717.25</u>	<u>195,479,026.10</u>
存货跌价准备		144,400.00
合计	<u>127,665,717.25</u>	<u>195,334,626.10</u>

1、预付款项

(1) 按账龄列示

账龄	期末余额	比例 (%)	期初余额	比例 (%)
1 年以内 (含 1 年)	19,043,513.89	75.78	86,512,378.53	95.98
1-2 年 (含 2 年)	4,844,666.45	19.28	1,343,385.26	1.49
2-3 年 (含 3 年)	170,940.16	0.68	1,824,019.57	2.02
3 年以上	1,070,263.54	4.26	455,816.52	0.51
合计	<u>25,129,384.04</u>	<u>100</u>	<u>90,135,599.88</u>	<u>100</u>

(2) 预付款项金额前五名情况

单位名称	期末余额	比例 (%)	账龄
恒生电子股份有限公司	5,614,210.81	22.34	1 年以内 (含 1 年)、1-2 年 (含 2 年)、3 年以上
福建顶点软件股份有限公司	1,234,471.53	4.91	1 年以内 (含 1 年)
上海四吉计算机信息有限公司	991,140.00	3.94	1 年以内 (含 1 年)
上海思鸿信息技术有限公司	969,900.00	3.86	1 年以内 (含 1 年)、1-2 年 (含 2 年)
深圳市赢时胜信息技术股份有限公司	919,492.64	3.66	1 年以内 (含 1 年)、3 年以上
合计	<u>9,729,214.98</u>	<u>38.72</u>	

(3) 预付款项 2020 年 12 月 31 日、2019 年 12 月 31 日中无预付持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东单位重大款项。

2、存货

项目	期末余额			期初余额		
	账面余额	跌价准备	账面价值	账面余额	跌价准备	账面价值
仓单存货以及存放于第三方仓库的存货	5,742,701.26		5,742,701.26	21,338,141.44	144,400.00	21,193,741.44
合计	<u>5,742,701.26</u>		<u>5,742,701.26</u>	<u>21,338,141.44</u>	<u>144,400.00</u>	<u>21,193,741.44</u>

注：存货是公司向客户提供仓单服务而形成的仓单存货以及存放于第三方仓库的存货。2020 年 12 月 31 日存货余额为 5,742,701.26 元。

3、长期待摊费用

项目	期初余额	本期增加额	本期摊销额	其他减少额	期末余额
装修费用	12,412,683.45	2,141,599.13	5,662,309.24		8,891,973.34
其他	329,029.62	996,477.99	53,686.98		1,271,820.63
合计	<u>12,741,713.07</u>	<u>3,138,077.12</u>	<u>5,715,996.22</u>		<u>10,163,793.97</u>

4、待摊费用

项目	期末余额	期初余额
房屋租赁及物管费	10,046,068.17	10,955,835.91
其他	215,387.91	1,631,194.75
合计	<u>10,261,456.08</u>	<u>12,587,030.66</u>

(二十) 资产减值准备

项目	期初余额	本期增加	本期减少		其他减少	期末余额
			转回	转销		
融出资金减值准备	19,354,735.01	17,434,327.23			1,095.09	36,787,967.15
应收款项减值准备	143,260,171.72		1,493,387.08		274,502.07	141,492,282.57
债权投资减值准备	538,651,293.98	245,700,265.71			31,049,328.24	753,302,231.45
其他债权投资减值准备	34,589,958.90	15,808,006.79				50,397,965.69
融出证券减值准备	9,983.10	4,551.64				14,534.74
金融工具及其他项目信用减值准备小计	<u>735,866,142.71</u>	<u>278,947,151.37</u>	<u>1,493,387.08</u>		<u>31,324,925.40</u>	<u>981,994,981.60</u>
持有待售资产减值准备		615,987.84				615,987.84
固定资产减值准备	383,330.89					383,330.89
其他资产-存货跌价准备	144,400.00		144,400.00			
其他资产减值准备小计	<u>527,730.89</u>	<u>615,987.84</u>	<u>144,400.00</u>			<u>999,318.73</u>
合计	<u>736,393,873.60</u>	<u>279,563,139.21</u>	<u>1,637,787.08</u>		<u>31,324,925.40</u>	<u>982,994,300.33</u>

本公司金融资产三阶段预期信用损失准备情况汇总如下：

类型	期末金额			合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
融出资金	36,485,449.29	302,517.86		36,787,967.15
应收款项		15,038,790.63	126,453,491.94	141,492,282.57
债权投资			753,302,231.45	753,302,231.45
其他债权投资	139,527.83		50,258,437.86	50,397,965.69
融出证券	14,534.74			14,534.74
合计	<u>36,639,511.86</u>	<u>15,341,308.49</u>	<u>930,014,161.25</u>	<u>981,994,981.60</u>

(二十一) 短期借款

项目	期末余额	期初余额
信用借款	161,815,076.59	347,562,640.00
抵押借款	124,623,708.18	
小计	<u>286,438,784.77</u>	<u>347,562,640.00</u>
加：应付利息	622,696.51	63,386.57
合计	<u>287,061,481.28</u>	<u>347,626,026.57</u>

(二十二) 应付短期融资款

类型	发行日期	到期日期	票面利率	期初余额	本期增加额	本期减少额	期末余额
收益凭证	2019年3月 -2020年12月	2020年2月 -2021年12月	2.90%-5.10%	680,000,000.00	4,068,630,000.00	2,227,990,000.00	2,520,640,000.00
加：应付利息				13,905,221.89	49,089,918.47	34,735,899.65	28,259,240.71
合计				<u>693,905,221.89</u>	<u>4,117,719,918.47</u>	<u>2,262,725,899.65</u>	<u>2,548,899,240.71</u>

注：于2020年12月31日，应付短期融资款为原始期限为1年以内的收益凭证。于2020年12月31日及2019年12月31日，本公司发行的收益凭证没有出现本金、利息或赎回款项的违约情况。

(二十三) 拆入资金

类别	期末余额	期初余额
银行拆入资金	700,000,000.00	940,000,000.00
转融通融入资金	700,000,000.00	300,000,000.00
小计	<u>1,400,000,000.00</u>	<u>1,240,000,000.00</u>

类别	期末余额	期初余额
加：应付利息	2,978,888.89	2,383,333.32
合计	<u>1,402,978,888.89</u>	<u>1,242,383,333.32</u>

1、转融通融入资金剩余期限及利率分析

剩余期限	期末余额		期初余额	
	余额	利率区间	余额	利率区间
1个月以内	500,000,000.00	2.8%-3.25%		
1个月以上3个月以内				
3个月以上1年以内	200,000,000.00	2.8%-3.25%	300,000,000.00	3.25%-3.5%
1年以上				
合计	<u>700,000,000.00</u>		<u>300,000,000.00</u>	

(二十四) 交易性金融负债

类别	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	期末余额		期初余额	
		指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	合计
取得浮动收益的结构化主体其他持有人权益	468,624,761.80	468,624,761.80	462,933,924.65	462,933,924.65	
合计	<u>468,624,761.80</u>	<u>468,624,761.80</u>	<u>462,933,924.65</u>	<u>462,933,924.65</u>	

注：取得浮动收益的结构化主体其他持有人权益为本集团外部投资者持有的本集团纳入合并范围内结构化主体所应享有的净权益，这些投资者享有获取浮动收益的权利。纳入合并范围的结构化主体信息参见附注八、(二)在纳入合并范围的结构化主体中的权益。

(二十五) 卖出回购金融资产款

1、按标的物类别列示

标的物类别	期末余额	期初余额
债券	5,925,570,000.00	4,445,351,000.00
融资融券收益权	340,000,000.00	
小计	<u>6,265,570,000.00</u>	<u>4,445,351,000.00</u>
加：应付利息	3,499,951.80	2,043,022.50
合计	<u>6,269,069,951.80</u>	<u>4,447,394,022.50</u>

2、按业务类别列示

项目	期末余额	期初余额
债券质押式回购	5,925,570,000.00	4,445,351,000.00
融资融券收益权回购业务	340,000,000.00	
小计	<u>6,265,570,000.00</u>	<u>4,445,351,000.00</u>
加：应付利息	3,499,951.80	2,043,022.50
合计	<u>6,269,069,951.80</u>	<u>4,447,394,022.50</u>

3、卖出回购金融资产款的担保物公允价值

项目	期末余额	期初余额
债券质押式回购	6,673,336,968.66	4,662,101,041.00
融资融券收益权回购业务	418,531,527.65	
合计	<u>7,091,868,496.31</u>	<u>4,662,101,041.00</u>

2020年12月31日，本公司为卖出回购业务质押的债券信息参见附注六、（三），附注六、（九），附注六、（十一）以及十四、（五）。

（二十六） 代理买卖证券款

项目	期末余额	期初余额
普通经纪业务	13,521,229,575.90	10,781,247,120.09
个人	9,495,124,040.98	8,191,352,629.98
机构	4,026,105,534.92	2,589,894,490.11
信用业务	404,311,291.60	400,254,919.87
个人	375,721,566.36	398,945,817.82
机构	28,589,725.24	1,309,102.05
小计	<u>13,925,540,867.50</u>	<u>11,181,502,039.96</u>
加：应付利息	1,686,309.62	1,274,754.30
合计	<u>13,927,227,177.12</u>	<u>11,182,776,794.26</u>

（二十七） 应付职工薪酬

1、分类列示

项目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
短期薪酬	65,933,387.73	484,527,480.62	471,097,584.46	79,363,283.89
离职后福利中的设定提存计划负债	95,949.14	47,615,812.56	6,850,761.70	40,861,000.00
辞退福利		9,294,422.49	3,086,288.55	6,208,133.94
其他长期职工福利	294,116,278.94	288,201,790.00	204,618,154.82	377,699,914.12

项 目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
合计	<u>360,145,615.81</u>	<u>829,639,505.67</u>	<u>685,652,789.53</u>	<u>504,132,331.95</u>

2、短期薪酬

项 目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	39,876,619.37	396,714,559.64	387,349,210.10	49,241,968.91
二、职工福利费		11,367,109.74	11,367,109.74	
三、社会保险费	69,013.71	23,096,753.23	23,043,708.66	122,058.28
其中：1. 医疗保险费	61,620.46	21,049,063.92	20,997,661.96	113,022.42
2. 工伤保险费	1,217.13	57,217.78	58,434.91	
3. 生育保险费	6,176.12	1,990,471.53	1,987,611.79	9,035.86
四、住房公积金	10,106.00	43,901,152.70	43,907,808.70	3,450.00
五、工会经费和职工教育经费	25,977,648.65	9,193,415.62	5,175,257.57	29,995,806.70
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
八、其他短期薪酬		254,489.69	254,489.69	
合计	<u>65,933,387.73</u>	<u>484,527,480.62</u>	<u>471,097,584.46</u>	<u>79,363,283.89</u>

3、离职后福利中的设定提存计划负债

项目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
基本养老保险	92,128.01	6,616,528.62	6,708,656.63	
失业保险	3,821.13	138,283.94	142,105.07	
企业年金缴费		40,861,000.00		40,861,000.00
合计	<u>95,949.14</u>	<u>47,615,812.56</u>	<u>6,850,761.70</u>	<u>40,861,000.00</u>

4、基本养老保险、失业保险缴费情况

按照中国有关法规，本公司及境内子公司的职工参加了由当地劳动和社会保障部门组织实施的社会基本养老保险和失业保险，本公司及境内子公司以当地规定的社会基本养老保险和失业保险的缴纳基数和比例，向当地社会基本养老保险和失业保险经办机构缴纳保险费。

本公司应付职工薪酬中并无属于拖欠性质的余额。

5、高级管理人员薪酬（税前）

本期发生额		上期发生额	
人数	金额	人数	金额
10	17,674,016.01	8	33,990,803.30

注：截至2020年12月31日，高级管理人员在职8人，离任2人。

(二十八) 应交税费

税费项目	期末余额	期初余额
代扣代缴限售股个人所得税	13,116,823.76	11,600,718.21
代扣代缴个人所得税	5,735,992.21	6,574,450.13
增值税	2,705,295.62	22,673,939.35
企业所得税	1,539,590.95	2,183,282.02
城市维护建设税	292,081.84	1,542,246.26
教育费附加	208,524.43	1,101,910.87
居间人税金	184,423.38	144,416.93
房产税	179,472.21	63,281.92
印花税	46,966.17	89,588.62
土地使用税	3,465.38	2,629.80
河道费	2,247.52	516.61
其他	60,778.99	76,626.36
合计	<u>24,075,662.46</u>	<u>46,053,607.08</u>

(二十九) 应付款项

1、分类列示

项目	期末余额	期初余额
应付押金及保证金	228,353,950.26	5,632,779.88
应付客户资金	42,509,637.05	113,373,848.36
应付票据	34,000,000.00	
预提费用	29,221,934.32	35,728,502.20
经纪人风险金	19,524,653.44	15,063,240.51
应付投资者保护基金	8,518,675.32	4,137,637.42
应付手续费及佣金	7,470,627.16	5,172,527.02
预收租金	5,884,956.91	5,900,575.81
软件系统款	1,719,844.83	3,531,812.94
应付证券清算款	1,148,076.92	988,186.31
工程款	627,323.59	251,648.56
应付期货投资者保障基金	292,297.59	180,831.20
预收互换款		12,500,000.00
预收款项		72,483,130.00
其他	36,591,625.99	34,175,966.90

项目	期末余额	期初余额
合计	415,863,603.38	309,120,687.11

2、应付款项 2020 年 12 月 31 日、2019 年 12 月 31 日中无应付持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东单位重大款项。

3、应付款项 2020 年 12 月 31 日中存在应付关联公司款项, 详见十、（六） 关联方应收应付款项。

4、应付客户资金包括 2020 年 12 月 31 日挂账的集合理财计划申购赎回款、基金交收款等。

（三十） 合同负债

项目	期末余额
投行合同	4,377,821.77
仓单交易合同	1,348,877.36
其他	937,107.03
合计	6,663,806.16

（三十一） 预计负债

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
潜在诉讼损失	607,956.08			607,956.08
融出证券减值准备	9,983.10	4,551.64		14,534.74
合计	617,939.18	4,551.64		622,490.82

（三十二） 应付债券

1、按明细列示

债券名称	类型	票面金额	发行日期	债券期限	票面利率	发行金额
2015 东海债次级债	次级债	1,000,000,000.00	2015-6-11	5 年 (3+2)	5.70%	1,000,000,000.00
2016 东海债次级债	次级债	1,500,000,000.00	2016-7-28	5 年	3.90%	1,500,000,000.00
2019 东海债次级债	次级债	1,000,000,000.00	2019-12-30	3 年	5.50%	1,000,000,000.00
2020 东海债次级债	次级债	800,000,000.00	2020-6-9	3 年	4.80%	800,000,000.00
OceanBrightCapitalLtd	私募债	USD150,000,000.00	2017-6-12	3 年	4.90%	USD150,000,000.00
20 东海公司债 01	普通公司债	1,000,000,000.00	2020-7-14	2 年	4.00%	1,000,000,000.00
20 东海公司债 02	普通公司债	1,000,000,000.00	2020-7-14	3 年	4.20%	1,000,000,000.00
长期收益凭证	长期收益	250,520,000.00	2019 年 4 月	368 天	4.00%-4.	250,520,000.00

债券名称	类型	票面金额	发行日期	债券期限	票面利率	发行金额
	凭证		-2020年12月	-544天	40%	
合计						
续表						
债券名称	期初余额	本期增加	本期减少	外币报表折算差额		期末余额
2015 东海债次级债	750,000,000.00		750,000,000.00			
2016 东海债次级债	1,500,000,000.00					<u>1,500,000,000.00</u>
2019 东海债次级债	1,000,000,000.00					<u>1,000,000,000.00</u>
2020 东海债次级债		800,000,000.00				<u>800,000,000.00</u>
OceanBrightCapitalLtd	1,044,522,876.82		1,012,986,625.26	-31,536,251.56		
20 东海公司债 01		1,000,000,000.00				<u>1,000,000,000.00</u>
20 东海公司债 02		1,000,000,000.00				<u>1,000,000,000.00</u>
长期收益凭证	200,000,000.00	50,520,000.00	200,000,000.00			<u>50,520,000.00</u>
小计	<u>4,494,522,876.82</u>	<u>2,850,520,000.00</u>	<u>1,962,986,625.26</u>	<u>-31,536,251.56</u>		<u>5,350,520,000.00</u>
应付利息	57,655,143.13	222,536,051.15	202,618,516.99	-111,346.45		<u>77,461,330.84</u>
合计	<u>4,552,178,019.95</u>	<u>3,073,056,051.15</u>	<u>2,165,605,142.25</u>	<u>-31,647,598.01</u>		<u>5,427,981,330.84</u>

2、2015年发行的2015东海债次级债系在上海证券交易所非公开发行，为5年期固定利率债券，附第3年末发行人赎回选择权及投资者回售选择权。若投资者行使回售选择权，则回售部分债券兑付日为2018年6月11日。于2018年，部分投资者行使回售选择权，回售债券金额共计250,000,000.00元，剩余债券于2020年到期兑付。

3、2016年发行的2016东海债次级债系在上海证券交易所非公开发行，为5年期固定利率债券。

4、2017年发行的OceanBrightCapitalLtd私募债于2020年到期兑付。

5、2019年发行的2019东海债次级债系在上海证券交易所非公开发行，为3年期固定利率债券。

6、2020年发行的2020东海债次级债系在上海证券交易所非公开发行，为3年期固定利率债券。

7、2020年发行的20东海01公司债系在上海证券交易所公开发行，为2年期固定利率债券。

8、2020年发行的20东海02公司债系在上海证券交易所公开发行，为3年期固定利率债券。

(三十三) 其他负债

1、分类列示

项 目	期末余额	期初余额
取得固定收益的结构化主体其他持有人权益	1,809,437,471.41	5,032,516,485.38
期货风险准备金	74,704,444.40	68,805,444.18
代理兑付债券款	817,140.11	817,140.11
递延收益	267,178.64	831,942.04
合计	<u>1,885,226,234.56</u>	<u>5,102,971,011.71</u>

注：取得固定收益的结构化主体其他持有人权益为本集团外部投资者持有的本集团纳入合并范围内结构化主体所应享有的净权益，这些投资者享有获取固定收益的权利。纳入合并范围的结构化主体信息参见附注八、（二）在纳入合并范围的结构化主体中的权益。

2、期货风险准备金

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
交易风险准备金	68,805,444.18	5,899,000.22		74,704,444.40
合计	<u>68,805,444.18</u>	<u>5,899,000.22</u>		<u>74,704,444.40</u>

注：本公司子公司东海期货有限责任公司根据《商品期货交易财务管理暂行规定》按商品和金融期货经纪业务手续费收入的5%计提期货风险准备并计入当期损益。动用风险准备金弥补因自身原因造成的损失或是按规定核销难以收回的垫付风险损失款时，冲减期货风险准备金余额。

3、代理兑付债券

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
企业债券	443,050.17			443,050.17
国债	374,089.94			374,089.94
合计	<u>817,140.11</u>			<u>817,140.11</u>

注：款项性质为代理客户兑付的不记名债券本金及利息，客户未进行兑付。

(三十四) 股本

项目	期初余额	本期增减变动(+、-)				期末余额
		发行 新股	送股	公积金 转股	其他	
一、有限售条件股份						
1. 国家持股						
2. 国有法人持股	106,135,000.00				-106,135,000.00	-106,135,000.00
3. 其他内资持股	133,865,000.00				-133,865,000.00	-133,865,000.00
其中：境内法人持股	92,615,000.00				-92,615,000.00	-92,615,000.00
境内自然人持股	41,250,000.00				-41,250,000.00	-41,250,000.00
4. 境外持股						
其中：境外法人持股						
境外自然人持股						
二、无限售条件流通股						
1. 人民币普通股	1,430,000,000.00				240,000,000.00	1,670,000,000.00
2. 境内上市外资股						
3. 境外上市外资股						
4. 其他						
股份合计	<u>1,670,000,000.00</u>					<u>1,670,000,000.00</u>

(三十五) 资本公积

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
股本溢价	2,614,957,581.49			2,614,957,581.49
合计	<u>2,614,957,581.49</u>			<u>2,614,957,581.49</u>

(三十六) 其他综合收益

项目	归属于母公司股东		减：前期计入其他综合收益当期转入损益	本期发生金额		归属于母公司股东	
	的其他综合收益期初余额	本期所得税前发生额		减：所得税费用	税后归属于母公司	税后归属于少数股东	的其他综合收益期末余额
一、以后不能重分类进损益的其他综合收益		18,815,881.86		4,703,970.46	14,111,911.40		14,111,911.40
1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动							
2. 权益法下在被长期投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额							
3. 其他权益工具公允价值变动		18,815,881.86		4,703,970.46	14,111,911.40		14,111,911.40
二、以后将重分类进损益的其他综合收益	32,917,717.18	-31,013,697.70	553.12	-3,028,637.51	-27,985,613.31		4,932,103.87
1. 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							
2. 其他债权投资公允价值变动	-16,160,189.75	-27,922,003.97	553.12	-6,980,639.21	-20,941,917.88		-37,102,107.63
3. 其他债权投资减值准备	25,942,469.18	15,808,006.79		3,952,001.70	11,856,005.09		37,798,474.27
4. 现金流量套期损益的有效部分							
5. 外币财务报表折算差额	23,135,437.75	-18,899,700.52			-18,899,700.52		4,235,737.23
合计	<u>32,917,717.18</u>	<u>-12,197,815.84</u>	<u>553.12</u>	<u>1,675,332.95</u>	<u>-13,873,701.91</u>		<u>19,044,015.27</u>

(三十七) 盈余公积

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
法定盈余公积	405,300,616.38	34,956,291.82		440,256,908.20
任意盈余公积	36,962,023.63			36,962,023.63
合计	<u>442,262,640.01</u>	<u>34,956,291.82</u>		<u>477,218,931.83</u>

注：本公司根据《中华人民共和国公司法》及公司章程的规定，按照母公司本期净利润的10%计提法定盈余公积。

(三十八) 一般风险准备

项目	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
一般风险准备	817,593,964.86	42,551,174.06		860,145,138.92
交易风险准备	744,179,613.49	34,956,291.82		779,135,905.31
合计	<u>1,561,773,578.35</u>	<u>77,507,465.88</u>		<u>1,639,281,044.23</u>

注 1: 根据《中华人民共和国证券法》、《金融企业财务规则》(中华人民共和国财政部令第 42 号)、《金融企业财务规则-实施指南》(财金[2007]23 号)及《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》(证监机构字[2007]320 号)等的相关规定, 本公司按照母公司本期净利润的 10%提取一般风险准备。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》(中国证券监督管理委员会公告〔2018〕39 号文)的相关规定, 本公司按照所担任管理人管理的大集合资产管理产品的管理费收入的 10%提取风险准备金, 风险准备金余额达到管理大集合资产管理产品资产净值 1%时可以不再提取。

东海期货有限责任公司根据《金融企业财务规则-实施指南》(财金[2007]23 号)的规定, 按照东海期货有限责任公司本期净利润的 10%提取一般风险准备。

注 2: 根据《中华人民共和国证券法》、《金融企业财务规则》(中华人民共和国财政部令第 42 号)、《金融企业财务规则-实施指南》(财金[2007]23 号)及《关于证券公司 2007 年年度报告工作的通知》(证监机构字[2007]320 号)等的相关规定, 本公司按照母公司本期净利润的 10%提取交易风险准备金, 用于弥补证券交易损失。

(三十九) 未分配利润

项目	本期发生额	上期发生额
上年年末未分配利润	<u>1,950,782,383.69</u>	<u>2,019,853,010.40</u>
期初未分配利润调整合计数(调增+, 调减-)		-70,327,199.95
调整后期初未分配利润	1,950,782,383.69	1,949,525,810.45
加: 本期归属于母公司所有者的净利润	438,947,347.47	49,416,556.04
减: 提取法定盈余公积	34,956,291.82	14,551,039.54
提取任意盈余公积		
应付普通股股利		
提取一般风险准备	42,551,174.06	19,057,903.72
提取交易风险准备	34,956,291.82	14,551,039.54
转作股本的普通股股利		
期末未分配利润	<u>2,277,265,973.46</u>	<u>1,950,782,383.69</u>

(四十) 手续费及佣金净收入

1、按项目列示

项目	本期发生额	上期发生额
证券经纪业务净收入	<u>505,883,006.35</u>	<u>387,854,168.62</u>
——证券经纪业务收入	684,157,020.01	517,839,117.37
——代理买卖证券业务	670,447,524.15	501,289,424.38
交易单元席位租赁	2,893,645.27	9,212,288.54
代销金融产品业务	10,815,850.59	7,337,404.45
——证券经纪业务支出	178,274,013.66	129,984,948.75
——代理买卖证券业务	178,274,013.66	129,984,948.75
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	<u>104,067,878.70</u>	<u>69,353,505.39</u>
——期货经纪业务收入	275,423,219.78	187,647,958.16
——期货经纪业务支出	171,355,341.08	118,294,452.77
投资银行业务净收入	<u>342,226,255.06</u>	<u>308,294,610.16</u>
——投资银行业务收入	353,982,340.65	308,644,466.76
——证券承销业务	333,874,298.89	295,351,344.67
证券保荐业务	8,036,434.59	2,505,098.08
财务顾问业务	12,071,607.17	10,788,024.01
——投资银行业务支出	11,756,085.59	349,856.60
——证券承销业务	11,756,085.59	349,856.60
证券保荐业务		
财务顾问业务		
资产管理业务净收入	<u>59,235,640.20</u>	<u>64,276,007.97</u>
——资产管理业务收入	59,235,640.20	64,276,007.97
——资产管理业务支出		
基金管理业务	<u>1,521,155.76</u>	<u>1,293,577.83</u>
——基金管理业务收入	1,521,155.76	1,293,577.83
——基金管理业务支出		
投资咨询业务	<u>350,847.47</u>	<u>2,812,982.52</u>
——投资咨询业务收入	350,847.47	2,812,982.52
——投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	<u>6,503,973.71</u>	<u>2,030,265.57</u>

项目	本期发生额	上期发生额
—其他手续费及佣金收入	6,504,162.39	2,030,265.57
—其他手续费及佣金支出	188.68	
合计	<u>1,019,788,757.25</u>	<u>835,915,118.06</u>
其中：手续费及佣金收入合计	1,381,174,386.26	1,084,544,376.18
手续费及佣金支出合计	361,385,629.01	248,629,258.12

2、受托客户资产管理业务

本期：

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	25.00	23.00	1.00
期末客户数量	24,499.00	23.00	2.00
其中：个人客户	24,423.00		
机构客户	76.00	23.00	2.00
年初受托资金	14,263,809,143.67	39,726,079,298.17	1,310,000,000.00
其中：自有资金投入	387,846,930.59	100,000,000.00	
个人客户	12,816,772,104.68	10,000,000.00	
机构客户	1,059,190,108.40	39,616,079,298.17	1,310,000,000.00
期末受托资金	6,675,648,564.20	11,456,110,600.46	67,000,000.00
其中：自有资金投入	371,257,960.20	100,000,000.00	
个人客户	5,363,494,369.93		
机构客户	940,896,234.07	11,356,110,600.46	67,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	6,373,172,860.77	11,619,927,651.44	57,511,986.19
其中：股票	498,704,376.80		
债券	4,772,559,958.14	7,301,239,912.00	
基金	630,016,256.73	542,327,479.61	57,511,986.19
其他	471,892,269.10	3,776,360,259.83	
当期资产管理业务净收入	44,255,388.76	14,308,294.85	671,956.59

上期：

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	25.00	30.00	2.00
期末客户数量	81,410.00	30.00	13.00
其中：个人客户	81,313.00	1.00	
机构客户	97.00	29.00	13.00

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
年初受托资金	18,016,412,505.96	50,074,433,860.20	2,398,000,000.00
其中：自有资金投入	341,860,157.50	100,000,000.00	
个人客户	15,814,741,601.33	91,357,298.91	
机构客户	1,859,810,747.13	49,883,076,561.29	2,398,000,000.00
期末受托资金	14,263,809,143.67	39,726,079,298.17	1,310,000,000.00
其中：自有资金投入	387,846,930.59	100,000,000.00	
个人客户	12,816,772,104.68	10,000,000.00	
机构客户	1,059,190,108.40	39,616,079,298.17	1,310,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	13,412,064,632.80	40,694,016,421.49	58,893,642.52
其中：股票	633,511,945.94	2,171,921.54	
债券	11,512,920,227.02	30,523,613,502.47	
基金	440,724,937.39	944,547,090.80	58,893,642.52
其他	824,907,522.45	9,223,683,906.68	
当期资产管理业务净收入	38,140,165.45	24,954,710.42	1,181,132.10

3、财务顾问业务

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	1,509,433.97	471,698.11
并购重组财务顾问业务净收入--其他		
其他财务顾问业务净收入	10,562,173.20	10,316,325.90
合计	<u>12,071,607.17</u>	<u>10,788,024.01</u>

(四十一) 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入		
货币资金及结算备付金利息收入	287,446,701.00	279,580,237.65
拆出资金利息收入		
融资融券利息收入	358,992,724.67	265,623,914.94
买入返售金融资产利息收入	22,447,897.70	36,645,371.39
其中：约定购回利息收入		29,873.71
股票质押回购利息收入		
债权投资利息收入	6,352,769.08	93,854,007.43
其他债权投资利息收入	8,097,485.65	14,793,909.13
利息收入小计	<u>683,337,578.10</u>	<u>690,497,440.54</u>

项目	本期发生额	上期发生额
利息支出		
短期借款利息支出	15,899,098.28	15,659,978.87
应付短期融资款利息支出	49,089,918.47	16,961,112.30
拆入资金利息支出	32,839,894.51	28,027,428.08
其中：转融通利息支出	14,315,555.58	10,024,166.65
卖出回购金融资产款利息支出	136,012,427.30	140,389,859.82
代理买卖证券款利息支出	31,709,563.68	27,967,252.94
应付债券利息支出	222,536,051.15	193,397,022.03
其中：次级债券利息支出	154,545,328.55	101,570,698.93
合并结构化主体优先级持有人收益	126,359,098.90	293,570,780.01
其他	7,545,928.66	
利息支出小计	<u>621,991,980.95</u>	<u>715,973,434.05</u>
利息净收入	<u>61,345,597.15</u>	<u>-25,475,993.51</u>

(四十二) 投资收益

1、投资收益明细情况

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	1,404,453.85	-243,216.48
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	911,951,427.31	408,666,828.26
其中：持有期间取得的收益	<u>582,676,153.30</u>	<u>487,154,526.01</u>
—交易性金融资产	589,092,144.53	488,228,757.25
—交易性金融负债	-1,891,864.38	-4,006,736.95
—其他债权投资		1,908.27
—衍生金融工具	-4,524,126.85	2,930,597.44
处置金融工具取得的收益	<u>329,275,274.01</u>	<u>-78,487,697.75</u>
—交易性金融资产	297,041,716.82	26,068,927.19
—交易性金融负债	-6,253,337.31	-4,672,135.10
—其他债权投资	553.12	2,925,036.56
—衍生金融工具	38,486,341.38	-102,809,526.40
其他		
合计	<u>913,355,881.16</u>	<u>408,423,611.78</u>

2、对联营企业和合营企业的投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额
东海基金管理有限责任公司	1,971,288.04	796,066.48
深圳市东海天富投资有限公司	-5,107.45	-78,867.67
铧龙(上海)投资管理有限公司	-561,726.74	-960,415.29
合计	<u>1,404,453.85</u>	<u>-243,216.48</u>

以上投资收益汇回均无重大限制。

3、按交易性金融工具投资收益明细列示

交易性金融工具	本期发生额	上期发生额
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 持有期间收益	589,092,144.53	488,228,757.25
处置取得收益	297,041,716.82	26,068,927.19
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 持有期间收益		
处置取得收益		
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 持有期间收益	-1,891,864.38	-4,006,736.95
处置取得收益	-6,253,337.31	-4,672,135.10
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 持有期间收益		
处置取得收益		
合计	<u>877,988,659.66</u>	<u>505,618,812.39</u>

(四十三) 其他收益

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额	与资产相关/与收益相关
专项扶持资金	20,699,549.10	22,151,222.15	20,699,549.10	与收益相关
财政奖励与财政补贴	3,463,675.31	3,168,922.90	3,463,675.31	与收益相关
专项扶持资金	564,763.40	596,890.27	564,763.40	与资产相关
交易所补贴	188,679.23		188,679.23	与收益相关
合计	<u>24,916,667.04</u>	<u>25,917,035.32</u>	<u>24,916,667.04</u>	

(四十四) 公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
衍生金融工具	-478,344.43	114,647,955.18
交易性金融资产	261,149,410.23	256,824,500.73
交易性金融负债	-35,391,096.21	-3,088,393.35
合计	<u>225,279,969.59</u>	<u>368,384,062.56</u>

(四十五) 其他业务收支

项目	本期发生额	上期发生额
其他业务收入	24,013,241.22	27,190,495.83
其中：房屋租赁	22,906,018.89	24,112,320.74
其他	1,107,222.33	3,078,175.09
其他业务成本	3,461,959.08	3,461,959.08
其中：房屋租赁	3,461,959.08	3,461,959.08
合计	20,551,282.14	23,728,536.75

(四十六) 资产处置收益

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得小计	452,664.25	168,933.14	452,664.25
其中：固定资产处置利得	452,664.25	168,933.14	452,664.25
非流动资产处置损失小计	-46,192.38	-436,727.76	-46,192.38
其中：固定资产处置损失	-46,192.38	-436,727.76	-46,192.38
合计	406,471.87	-267,794.62	406,471.87

(四十七) 税金及附加

项目	本期发生额	上期发生额
房产税	7,812,782.44	9,002,632.69
城市维护建设税	7,216,374.82	5,391,652.18
教育费附加	5,160,980.08	3,763,937.82
印花税	689,730.96	729,979.07
土地使用税	66,927.31	75,289.38
车船税	53,455.00	62,080.00
河道管理费	15,733.42	11,599.79
其他	5,273.09	3,275.50
合计	21,021,257.12	19,040,446.43

(四十八) 业务及管理费

费用性质	本期发生额	上期发生额
职工薪酬	829,639,505.67	513,269,139.64
折旧及摊销	70,001,498.38	68,424,029.87
其中：固定资产折旧	38,207,753.11	40,683,832.27

费用性质	本期发生额	上期发生额
无形资产摊销	26,077,749.05	20,774,032.88
长期待摊费用摊销	5,715,996.22	6,966,164.72
租赁费	57,273,717.27	57,124,751.37
业务招待费	44,616,285.60	38,648,000.79
咨询费	43,211,142.01	37,512,723.45
系统服务费	42,537,101.28	48,898,362.97
邮电费	20,395,282.08	18,361,641.19
投资者保护基金	13,042,186.63	8,481,471.02
物业管理费	11,238,873.99	10,073,611.51
差旅费	11,209,220.24	16,746,766.41
资产管理计划代销佣金	8,153,797.87	26,914,431.78
期货风险准备金	5,899,000.22	3,777,657.55
其他	84,574,888.31	83,998,599.60
合计	<u>1,241,792,499.55</u>	<u>932,231,187.15</u>

(四十九) 信用减值损失

项 目	本期发生额	上期发生额
融出资金减值损失	17,434,327.23	5,126,470.54
坏账损失	-1,493,387.08	3,723,382.68
债权投资减值损失	245,700,265.71	433,799,365.88
其他债权投资减值损失	15,808,006.79	34,284,967.52
融出证券减值损失	4,551.64	-4,247.40
买入返售金融资产减值损失		-1,953.78
合计	<u>277,453,764.29</u>	<u>476,927,985.44</u>

本期信用减值损失主要是公司持有的债权投资计提的减值准备，其中对境外子公司持有的各类债权投资，计提减值准备 24,570.03 万元。

(五十) 其他资产减值损失

项 目	本期发生额	上期发生额
存货跌价损失	-144,400.00	144,400.00
持有待售资产减值损失	615,987.84	
合计	<u>471,587.84</u>	<u>144,400.00</u>

(五十一) 营业外收入

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产报废利得小计	33,089.19	43,299.14	33,089.19
其中：固定资产报废利得	33,089.19	43,299.14	33,089.19
罚没收入	134,033.33	1,514,862.04	134,033.33
政府补助	120,000.00	299,808.76	120,000.00
减免税款	34,432.12	74,998.75	34,432.12
无需支付的应付款项	272,006.35	10,000,000.00	272,006.35
其他	922,712.13	64,882.87	922,712.13
合计	<u>1,516,273.12</u>	<u>11,997,851.56</u>	<u>1,516,273.12</u>

其中，计入当期损益的政府补助：

补助项目	本期发生额	上期发生额	与资产相关/与收益相关
专项扶持资金	120,000.00	299,808.76	与收益相关
合计	<u>120,000.00</u>	<u>299,808.76</u>	

(五十二) 营业外支出

项目	本期发生额	上期发生额	计入当期非经常性损益的金额
非流动资产报废损失小计	424,976.33	139,494.74	424,976.33
其中：固定资产报废损失	424,976.33	139,494.74	424,976.33
公益性捐赠支出	7,566,262.50	2,048,989.78	7,566,262.50
违约金及赔偿损失	12,660.00	204.17	12,660.00
行政罚款、滞纳金	11,482.01	684,483.20	11,482.01
无法收回的应收款项		24,400.02	
其他	149,862.44	215,089.65	149,862.44
合计	<u>8,165,243.28</u>	<u>3,112,661.56</u>	<u>8,165,243.28</u>

(五十三) 所得税费用

1、分类列示

项目	本期发生额	上期发生额
所得税费用	261,918,756.55	155,747,574.38
其中：当期所得税	185,258,102.87	62,366,963.81

项目	本期发生额	上期发生额
递延所得税	78,895,748.31	93,690,208.38
汇算清缴差异调整	-2,235,094.63	-309,597.81

2、所得税费用（收益）与会计利润关系的说明

项目	本期发生额	上期发生额
利润总额	718,484,425.98	218,778,493.48
按法定税率计算的所得税费用	179,621,106.50	54,694,623.37
某些子公司适用不同税率的影响	29,751,957.45	32,227,165.19
对以前期间当期所得税的调整	-2,235,094.63	-309,597.81
归属于合营企业和联营企业的损益	-351,113.46	60,804.11
无须纳税的收入	-24,100,439.10	-13,500,843.17
不可抵扣的费用	6,484,839.33	6,478,719.93
税率变动对期末递延所得税余额的影响		
以前年度未确认递延所得税的可抵扣暂时性差异和可抵扣亏损的影响	3,253,092.08	-410,215.42
未确认的可抵扣暂时性差异和可抵扣亏损的影响	69,494,408.38	76,506,918.18
其他		
所得税费用合计	<u>261,918,756.55</u>	<u>155,747,574.38</u>

(五十四) 其他综合收益各项目及其所得税影响和转入损益情况

详见“六、合并财务报表主要项目注释（三十六）、其他综合收益”。

(五十五) 现金流量表项目注释

1、收到的其他与经营活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
期货公司收到客户保证金净额	2,065,697,676.01	908,183,238.29
购买及处置债权投资收到的现金净额	34,995,787.36	281,389,564.83
收到的政府补贴	24,351,903.64	25,917,035.32
结构化主体中其他份额持有人申购净额	5,690,837.15	340,753,427.33
收到限售股减持代扣代缴款项	1,516,105.55	
存出保证金净额		19,018,999.49
往来款及其他	483,192,898.51	145,735,259.17
合计	<u>2,615,445,208.22</u>	<u>1,720,997,524.43</u>

2、支付的其他与经营活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
以现金支付的业务及管理费	287,162,810.20	338,089,505.40
支付集合理财、基金申购赎回款净额	70,864,077.71	56,576,395.98
支付的存出保证金	32,297,352.47	
支付的投资者保护基金	8,841,837.56	15,416,441.87
支付限售股减持代扣代缴款项		9,950,003.33
往来款及其他	144,910,959.21	95,227,883.50
合计	<u>544,077,037.15</u>	<u>515,260,230.08</u>

3、收到的其他与投资活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
处置固定资产收回的现金净额	960,731.08	639,900.20
合计	<u>960,731.08</u>	<u>639,900.20</u>

4、支付的其他与筹资活动有关的现金

项目	本期发生额	上期发生额
结构化主体中其他份额持有人赎回净额	3,349,438,112.87	2,470,903,283.48
合计	<u>3,349,438,112.87</u>	<u>2,470,903,283.48</u>

(五十六) 现金流量表补充资料

1、净利润调节为经营活动现金流量

项目	本期发生额	上期发生额
一、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	456,565,669.43	63,030,919.10
加：其他资产减值损失/信用减值损失	277,925,352.13	477,072,385.44
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	41,669,712.19	44,145,791.35
无形资产摊销	26,077,749.05	20,774,032.88
长期待摊费用摊销	5,715,996.22	6,966,164.72
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失 (收益以“－”号填列)	-406,471.87	267,794.62
固定资产报废损失(收益以“－”号填列)	391,887.14	96,195.60
公允价值变动损失(收益以“－”号填列)	-225,279,969.59	-368,384,062.56
财务费用(收益以“－”号填列)	413,884,166.80	519,588,893.21

项目	本期发生额	上期发生额
汇兑损失（收益以“-”号填列）	-227,878.74	-1,612,746.16
投资损失（收益以“-”号填列）	-1,404,453.85	243,216.48
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-32,180,393.40	76,193,281.12
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	115,028,143.58	26,068,169.14
交易性金融资产的减少（增加以“-”号填列）	-48,590,343.87	878,749,805.41
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-3,177,385,651.46	240,223,060.60
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	4,994,022,533.87	2,905,552,178.83
其他		
经营活动产生的现金流量净额	<u>2,845,806,047.63</u>	<u>4,888,975,079.78</u>

二、不涉及现金收支的投资和筹资活动：

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

三、现金及现金等价物净增加情况：

期末现金的账面价值	11,113,143,718.47	10,849,140,431.63
减：期初现金的账面价值	10,849,140,431.63	8,452,780,308.70
加：期末现金等价物的账面价值	5,813,907,453.08	4,215,635,011.21
减：期初现金等价物的的账面价值	4,215,635,011.21	3,236,131,303.82
现金及现金等价物净增加额	<u>1,862,275,728.71</u>	<u>3,375,863,830.32</u>

2、现金和现金等价物的构成

项目	本期发生额	上期发生额
一、现金	11,113,143,718.47	10,849,140,431.63
其中：1. 库存现金	4,988.46	10,899.90
2. 可随时用于支付的银行存款	11,108,430,632.06	10,848,738,362.20
3. 可随时用于支付的其他货币资金	4,708,097.95	391,169.53
4. 可用于支付的存放中央银行款项		
5. 存放同业款项		
6. 拆放同业款项		
二、现金等价物	5,813,907,453.08	4,215,635,011.21
其中：三个月内到期的债券投资		
结算备付金	5,813,907,453.08	4,215,635,011.21
三、期末现金及现金等价物余额	16,927,051,171.55	15,064,775,442.84

项目	本期发生额	上期发生额
其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物		

(五十七) 外币货币性项目

1、分类列示

项目	期末余额外币余额	折算汇率	期末余额折算人民币余额
货币资金			
其中：美元	4,860,326.13	6.5249	31,713,141.94
欧元			
港币	44,542,618.47	0.8416	37,488,849.41
结算备付金			
其中：港币	44,920,871.83	0.8416	37,807,202.57
美元	4,735,029.15	6.5249	30,895,591.71
存出保证金			
其中：港币	1,005,000.00	0.8416	845,848.20
美元	270,000.00	6.5249	1,761,723.00
代理买卖证券款			
其中：港币	34,866,160.47	0.8416	29,344,755.30
美元	6,036,538.65	6.5249	39,387,811.03

(1) 境外经营实体说明

公司	经营地	记账本位币	选择理由
东海国际金融控股有限公司	香港	港币	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
东海国际金融控股(香港)有限公司	香港	港币	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
东海国际(香港)有限公司	香港	港币	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
东海国际证券(香港)有限公司	香港	港币	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
东海国际资产管理(香港)有限公司	香港	港币	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
DonghaiInternationalCapitalLimited	CaymanIslands	美元	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
DonghaiInvestmentFundSeriesSPC	CaymanIslands	美元	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
DonghaiChampionFundSPC	CaymanIslands	美元	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性
OceanBrightCapitalHoldingsLimited	BVI 群岛	美元	境外经营所从事的活动拥有极大的自主性

七、其他原因的合并范围变动

(一) 其他原因的合并范围变动:

1、清算子公司

2020年3月27日,公司三级全资子公司东海国际期货(香港)有限公司在香港公司注册处完成注册撤销并解散。

2020年5月15日,公司三级全资子公司东海国际财务(香港)有限公司在香港公司注册处完成注册撤销并解散。

2020年7月28日,公司二级全资子公司常州东海产业投资管理有限公司经常州市天宁区市场监督管理局核准后注销。

2020年9月24日,东海全球科技(深圳)有限公司经深圳市市场监督管理局核准后注销。

2、结构化主体

结构化主体飞龙1号、翔龙20号、翔龙23号、龙睿5号、龙成稳健1号已清算,期末不再纳入合并。

东风2号,期期盈按照八、(二)的描述,期末不再纳入合并。

慧泮量化1号、灵活配置3号按照八、(二)的描述,期末需纳入合并。

八、在其他主体中的权益

(一) 在子公司中的权益

1、企业集团的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		表决权比例(%)	取得方式
				直接	间接		
东海期货有限责任公司	江苏常州	江苏常州	期货经纪	60.00		60.00	同一控制下合并
东海投资有限责任公司	上海市	上海市	股权投资	100.00		100.00	设立
东海证券创新产品投资有限公司	上海市	上海市	金融投资	100.00		100.00	设立
北京东海中矿投资管理有限公司	北京市	北京市	投资管理		51.00	51.00	设立
东海资本管理有限公司	上海市	上海市	投资管理、 财务咨询		60.00	60.00	设立
东海国际金融控股有限公司	香港	香港	投资管理	100.00		100.00	设立

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		
东海国际金融控股(香港)有限公司	香港	香港	投资管理		100.00	100.00	设立
东海国际(香港)有限公司	香港	香港	综合		100.00	100.00	设立
东海国际证券(香港)有限公司	香港	香港	证券经纪		100.00	100.00	设立
东海国际资产管理(香港)有限公司	香港	香港	资产管理		100.00	100.00	设立
Donghai International Capital Limited	Cayman Islands	Cayman Islands	资产管理		100.00	100.00	设立
Donghai Investment Fund Series SPC	Cayman Islands	Cayman Islands	投资管理		100.00	100.00	设立
Donghai Champion Fund SPC	Cayman Islands	Cayman Islands	投资管理		100.00	100.00	设立
Ocean Bright Capital Holdings Limited	BVI 群岛	BVI 群岛	投资管理		100.00	100.00	设立

2、重要非全资子公司

本期发生额/期末:

子公司名称	少数股东持股比例	本期归属于少数股东损益	本期向少数股东宣告分派股利	期末余额少数股东权益
东海期货有限责任公司	40%	17,719,258.57	10,000,000.00	279,318,371.48

上期发生额/期初:

子公司名称	少数股东持股比例	上期归属于少数股东损益	上期向少数股东宣告分派股利	期初余额少数股东权益
东海期货有限责任公司	40%	13,871,608.99		271,599,112.91

3、重要非全资子公司的主要财务信息

项目	东海期货有限责任公司	
	期末余额	期初余额
资产总额	6,879,588,012.77	4,812,566,256.97
负债总额	6,181,292,084.06	4,133,568,474.69
净资产总额	698,295,928.71	678,997,782.28
营业收入	237,873,903.10	203,663,086.78
净利润	44,298,146.43	34,679,022.47
综合收益总额	44,298,146.43	34,679,022.47

东海期货有限责任公司

项目	期末余额	期初余额
经营活动现金流量	782,080,210.39	326,638,094.07

4、使用企业集团资产和清偿企业集团债务的重大限制：无。

(二) 在纳入合并范围的结构化主体中的权益

结构化主体或通过受托经营等方式形成控制权的经营实体

本公司管理或投资多个结构化主体，主要是资产管理计划。为判断是否控制该类结构化主体，本公司主要评估其通过参与设立相关结构化主体时的决策和参与度及相关合同安排等所享有的对该类结构化主体的整体经济利益(包括直接持有产生的收益以及预期管理费)以及对该类结构化主体的决策权范围。若本公司通过投资合同等安排同时对该类结构化主体拥有权力、通过参与该结构化主体的相关活动而享有可变回报以及有能力运用本公司对该类结构化主体的权力影响可变回报，则本公司认为能够控制该类结构化主体，并将此类结构化主体纳入合并财务报表范围。

于2020年12月31日和2019年12月31日，本公司纳入合并范围的资产管理计划的净资产总额分别为人民币2,612,986,022.33元和人民币5,773,056,748.47元。于2020年12月31日，本公司及其子公司在上述结构化主体中的权益体现在其各自资产负债表中交易性金融资产为人民币356,168,576.15元。于2019年12月31日，本公司及其子公司在上述结构化主体中的权益体现在其各自资产负债表中交易性金融资产为人民币331,628,069.06元。

于2020年12月31日和2019年12月31日，本公司认为上述结构化主体受本公司控制，故将其纳入合并财务报表范围。

(三) 在合营或联营企业中的权益

1、联营企业

联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例(%)		对联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
东海基金管理有限责任公司	上海	上海	基金行业	45.00		权益法
铧龙(上海)投资管理有限公司	上海	上海	投资管理		29.40	权益法

(1) 2013年度，本公司与深圳鹏博实业集团有限公司、苏州市相城区江南化纤集团有限公司共同出资1.5亿元设立东海基金管理有限责任公司，该公司于2013年2月25日办妥工商设立登记手续，本公司出资6,750万元，持有45%的股权。

(2) 本公司之子公司东海资本管理有限公司与上海宝聚昌投资管理有限公司共同出资1,000万元设立铧龙(上海)投资管理有限公司，该公司于2016年2月16日完成工商设立登记手续，东海资本管理有限公司出资490万元，持有49%的股权。

2、重要联营企业的主要财务信息

项目	期末余额/本期发生额	
	东海基金管理有限责任公司	
资产合计	244,998,431.58	
负债合计	112,263,446.42	
少数股东权益	23,227,565.50	
归属于母公司股东权益	109,507,419.66	
按持股比例计算的净资产份额	49,278,338.85	
调整事项		
--商誉		
--内部交易未实现利润		
--其他		
对联营企业权益投资的账面价值	49,278,338.85	
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值	不适用	
营业收入	127,504,571.88	
净利润	4,431,367.14	
终止经营的净利润		
其他综合收益		
综合收益总额	4,431,367.14	
本年度收到的来自联营企业的股利		

续表

项目	期初余额/上期发生额	
	东海基金管理有限责任公司	深圳市东海天富投资有限公司
资产合计	229,677,988.35	1,872,390.03
负债合计	101,374,370.33	148,708.00
少数股东权益	23,176,838.44	
归属于母公司股东权益	105,126,779.58	1,723,682.03
按持股比例计算的净资产份额	47,307,050.81	689,472.81
调整事项		
--商誉		
--内部交易未实现利润		
--其他		
对联营企业权益投资的账面价值	47,307,050.81	1,489,695.29

项目	期初余额/上期发生额	
	东海基金管理有限责任公司	深圳市东海天富投资有限公司
存在公开报价的联营企业权益投资的公允价值	不适用	不适用
营业收入	148,518,775.72	466,019.40
净利润	35,254.89	-174,746.50
终止经营的净利润		
其他综合收益		
综合收益总额	35,254.89	-174,746.50
本年度收到的来自联营企业的股利		

3、不重要联营企业的汇总财务信息

项目	期末余额	期初余额
联营企业		
投资账面价值合计	<u>1,583,057.79</u>	<u>2,144,784.53</u>
下列各项按持股比例计算的合计数		
净利润	-561,726.74	-960,415.29
其他综合收益		
综合收益总额	-561,726.74	-960,415.29

4、本公司联营企业未发生重大超额亏损。

5、本公司无与联营企业投资相关的重大或有负债。

(四) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

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

于 2020 年 12 月 31 日这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体的资产总额为 16,236,417,809.75 元。

于 2020 年 12 月 31 日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	期末余额	
	账面价值	最大损失敞口
交易性金融资产	128,299,462.06	128,299,462.06

项目	期末余额	
	账面价值	最大损失敞口
应收款项	9,408,174.77	9,408,174.77

2020年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、且资产负债表日在该结构化主体中没有权益的资产管理计划中获取的资产管理费收入为59,235,640.20元。

九、金融资产及负债的公允价值管理

(一) 金融工具计量基础分类表

下表汇总披露了本公司所有金融工具项目的计量基础

金融 资产 项目	以摊余成本计量的金 融资产	2020年12月31日账面价值			
		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	
		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	按照《金融工具确认和计量》 准则指定为以公允价值计量 且其变动计入当期损益的金 融资产
货币 资金	11,138,401,528.62				
结算 备付 金	5,813,907,769.11				
融出 资金	7,495,925,997.01				
衍生 金融 资产				5,441,376.20	
存出 保证 金	393,078,948.62				
应收 款项	21,223,404.18				
买入 返售 金融 资产	1,313,839,054.43				

2020年12月31日账面价值

金融资产项目	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		
		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	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
交易性金融资产				14,739,360,008.10		
债权投资	140,669,481.86					
其他债权投资		107,961,470.00				
权益工具投资			44,215,881.86			
其他资产	1,377,509.99					

续表

2019年12月31日账面价值

金融资产项目	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		
		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	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
货币资金	10,870,521,278.94					
结算备付金	4,215,635,340.51					
融出资金	3,950,170,756.01					

2019年12月31日账面价值

金融资产项目	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		
	以摊余成本计量的金融资产	分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的非交易性权益工具投资	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《金融工具确认和计量》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
衍生金融资产				1,548,914.03		
存出保证金	360,781,609.57					
应收款项	69,486,662.05					
买入返售金融资产	1,594,509,603.50					
交易性金融资产				14,429,620,254.00		
股权投资	518,254,688.89					
其他股权投资		143,895,105.99				
其他权益工具投资			25,400,000.00			
其他资产	473,054.00					

续表

2020年12月31日账面价值

金融 负债 项目	以摊余成本计量的金 融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则 指定为以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且 其变动计入当期损益的金融负债
短期 借款	287,061,481.28			
应付 短期 融资 款	2,548,899,240.71			
拆入 资金	1,402,978,888.89			
交易 性金 融负 债		468,624,761.80		
衍生 金融 负债		12,893,591.20		
卖出 回购 金融 资产 款	6,269,069,951.80			
代理 买卖 证券 款	13,927,227,177.12			
应付 款项	415,863,603.38			
应付 债券	5,427,981,330.84			
其他 负债	1,809,437,471.41			

续表

2019年12月31日账面价值

金融 负债 项目	以摊余成本计量的金 融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		分类为以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融负债	按照《金融工具确认和计量》准则 指定为以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融负债	按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且 其变动计入当期损益的金融负债
短期 借款	347,626,026.57			
应付 短期 融资 款	693,905,221.89			
拆入 资金	1,242,383,333.32			
交易 性金 融负 债		462,933,924.65		
衍生 金融 负债		1,960,906.57		
卖出 回购 金融 资产 款	4,447,394,022.50			
代理 买卖 证券 款	11,182,776,794.26			
应付 款项	309,120,687.11			
应付 债券	4,552,178,019.95			
其他 负债	5,032,516,485.38			

(二) 金融工具公允价值计量的层次

公允价值计量所使用的输入值划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定。

项目	期末公允价值			合计
	第一层公允价值计量	第二层公允价值计量	第三层公允价值计量	
一、持续公允价值计量				
(一) 交易性金融资产	5,183,827,415.77	8,968,064,100.30	587,468,492.03	<u>14,739,360,008.10</u>
(1) 债券	2,489,795,771.22	7,781,455,898.00	9,703,611.07	10,280,955,280.29
(2) 公募基金	956,556,504.42	124,947,261.17		1,081,503,765.59
(3) 股票	1,621,414,376.95	7,477,778.44	363,494,861.88	1,992,387,017.27
(4) 银行理财产品	82,104,219.18		34,715,931.01	116,820,150.19
(5) 券商资管产品		28,759,108.41		28,759,108.41
(6) 信托计划				
(7) 其他	33,956,544.00	1,025,424,054.28	179,554,088.07	1,238,934,686.35
(二) 其他债权投资		107,961,470.00		<u>107,961,470.00</u>
(三) 其他权益工具投资			44,215,881.86	<u>44,215,881.86</u>
(四) 衍生金融资产	2,031,750.00		3,409,626.20	<u>5,441,376.20</u>
持续以公允价值计量的资产总额	5,185,859,165.77	9,076,025,570.30	635,094,000.09	<u>14,896,978,736.16</u>
(五) 交易性金融负债		468,624,761.80		<u>468,624,761.80</u>
(六) 衍生金融负债	5,290,900.00		7,602,691.20	<u>12,893,591.20</u>
持续以公允价值计量的负债总额	5,290,900.00	468,624,761.80	7,602,691.20	<u>481,518,353.00</u>

续表

项目	期初公允价值			合计
	第一层公允价值计量	第二层公允价值计量	第三层公允价值计量	
一、持续公允价值计量				
(一) 交易性金融资产	<u>4,900,978,833.37</u>	<u>9,192,731,632.67</u>	<u>335,909,787.96</u>	<u>14,429,620,254.00</u>
(1) 债券	2,410,197,657.37	8,887,778,598.18	15,002,131.07	11,312,978,386.62
(2) 公募基金	1,040,302,258.47	30,322,386.17		1,070,624,644.64
(3) 股票	944,704,612.49	11,517,086.88	43,129,608.92	999,351,308.29

项目	期初公允价值			合计
	第一层公允价值计量	第二层公允价值计量	第三层公允价值计量	
(4) 银行理财产品	41,021,589.04			41,021,589.04
(5) 券商资管产品		30,759,746.01		30,759,746.01
(6) 信托计划		7,453,500.00		7,453,500.00
(7) 其他	464,752,716.00	224,900,315.43	277,778,047.97	967,431,079.40
(二) 其他债权投资		<u>117,820,690.00</u>	<u>26,074,415.99</u>	<u>143,895,105.99</u>
(三) 其他权益工具投资			<u>25,400,000.00</u>	<u>25,400,000.00</u>
(四) 衍生金融资产	<u>606,858.00</u>		<u>942,056.03</u>	<u>1,548,914.03</u>
持续以公允价值计量的资产总额	<u>4,901,585,691.37</u>	<u>9,310,552,322.67</u>	<u>388,326,259.98</u>	<u>14,600,464,274.02</u>
(五) 交易性金融负债		<u>462,933,924.65</u>		<u>462,933,924.65</u>
(六) 衍生金融负债	<u>672,950.00</u>		<u>1,287,956.57</u>	<u>1,960,906.57</u>
持续以公允价值计量的负债总额	<u>672,950.00</u>	<u>462,933,924.65</u>	<u>1,287,956.57</u>	<u>464,894,831.22</u>

(三) 持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

本公司及母公司持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点的收盘价。

(四) 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

以交易性金融资产和其他债权投资中的债券投资的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价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。

以交易性金融资产和其他债权投资中的债券投资中不存在公开市场的权益工具投资及资产管理计划与信托计划投资，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。所采用的折现率取自报告期期末相关的可观察收益率曲线。

收益互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用根据相关证券交易所报价计算的相关权益证券回报与本公司和交易对手互换协议所协定固定收入的差额来确定的。

项目	期末公允价值	期初公允价值	估值技术	输入值
债券	7,889,417,368.00	9,005,599,288.18	现金流量折现法	债券收益率
股票	7,477,778.44	11,517,086.88	投资标的市价组合法	投资标的市价
基金	172,144,032.83	252,162,968.23	投资标的市价组合法	投资标的市价
资产管理计划与信托计划	847,147,221.82	38,213,246.01	投资标的市价组合法	投资标的市价
其他	159,839,169.21	3,059,733.37	投资标的市价组合法	投资标的市价

项目	期末公允价值	期初公允价值	估值技术	输入值
合计	<u>9,076,025,570.30</u>	<u>9,310,552,322.67</u>		
交易性金融负债	468,624,761.80	462,933,924.65	投资标的市价组合法	投资标的市价
合计	<u>468,624,761.80</u>	<u>462,933,924.65</u>		

(五) 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	期末公允价值	期初公允价值	估值技术	重大不可观察输入值	对公允价值的影响
债务工具	9,703,611.07	41,076,547.06	投资标的价值组合法	标的物价值	标的物价值越小，公允价值越低
新三板股票	39,176,192.49	43,129,608.92	上市公司比较法	流动性折价	流动性折价越大，公允价值越低
非上市公司股权	105,069,392.09	114,744,557.00	上市公司比较法	流动性折价	流动性折价越大，公允价值越低
商品期权	-5,778,480.37	-345,900.54	期权定价模型	波动率	标的物价值越小，公允价值越低
其他	153,416,508.85	188,433,490.97	投资标的价值组合法	标的物价值	标的物价值越小，公允价值越低
股票	324,318,669.39		投资标的价值组合法	流动性折价	流动性折价越大，公允价值越低
收益互换	1,585,415.37		投资标的价值组合法	标的物价值	标的物价值越小，公允价值越低
合计	<u>627,491,308.89</u>	<u>387,038,303.41</u>			

(六) 持续第三层次公允价值计量项目，2019年12月31日与2020年12月31日账面价值之间的调节信息

项目	交易性金融资产	其他权益工具	衍生金融资产	衍生金融负债	其他债权投资
期初余额	<u>335,909,787.96</u>	<u>25,400,000.00</u>	<u>942,056.03</u>	<u>1,287,956.57</u>	<u>26,074,415.99</u>
当期利得或损失总额	62,796,721.71	18,815,881.86	2,885,961.57	-3,000,099.98	-26,074,415.99
—计入损益	62,796,721.71		2,885,961.57	-3,000,099.98	
—计入其他综合收益		18,815,881.86			-26,074,415.99
购买	295,749,993.57		52,992,631.90	78,483,043.21	
出售	14,286,127.75				
结算	5,298,520.00		53,411,023.30	69,168,208.60	
转入第三层次	122,442,954.63				
转出第三层次	209,846,318.09				
期末余额	<u>587,468,492.03</u>	<u>44,215,881.86</u>	<u>3,409,626.20</u>	<u>7,602,691.20</u>	
对于在报告期末余额持有的资产，计入损益的当期未实现利得或损失的变动	61,450,633.96		2,885,961.57	-3,000,099.98	

十、关联方及关联交易

（一）本公司的母公司情况

母公司名称	关联关系	企业类型	注册地	法人代表	业务性质	注册资本	母公司对本企业的持股比例 (%)	母公司对本企业的表决权比例 (%)	本企业最终控制方	统一社会信用代码
常州投资集团有限公司	第一大股东	国有独资	常州市	陈利民	投资	12 亿元	22.7923	22.7923	常州投资集团有限公司	91320400467283980X

（二）本公司的子公司情况

本公司子公司的情况详见附注八、（一）。

（三）本公司的联营企业情况

本公司合营或联营企业情况详见附注八、（三）。

（四）其他关联方

其他关联方名称	其他关联方与本公司关系
常州创业投资集团有限公司	受同一实际控制人控制
常州化工厂有限公司	受同一实际控制人控制
常州金融投资集团有限公司	受同一实际控制人控制
常州龙城英才创业投资有限公司	受同一实际控制人控制
常州市常信房地产开发有限公司	受同一实际控制人控制
常州市福隆汽车修理有限公司	受同一实际控制人控制
常州市资产管理有限公司	受同一实际控制人控制
常州信辉创业投资有限公司	受同一实际控制人控制
常州信辉商业保理有限公司	受同一实际控制人控制
常州长城驾驶服务有限公司	受同一实际控制人控制
新疆信辉股权投资有限公司	受同一实际控制人控制
长江龙城科技有限公司	受同一实际控制人控制
常州欣畅和商贸有限公司	受同一实际控制人控制
长江龙城国际贸易有限公司	受同一实际控制人控制
长江龙城置业有限公司	受同一实际控制人控制
常州名昊置业有限公司	其他
常州市常信鑫源房地产开发有限公司	其他
常州信辉融资租赁有限公司	其他
江苏安瑞达新材料有限公司	其他

其他关联方名称	其他关联方与本公司关系
东海瑞京资产管理（上海）有限公司	其他
上药集团常州药业股份有限公司	其他
常州东风农机集团有限公司	其他
常州市市民卡建设有限公司	其他
江苏华西同诚投资控股集团有限公司	其他
江苏江南农村商业银行股份有限公司	其他
九江东海中泰股权投资合伙企业（有限合伙）	其他
江苏昆山农村商业银行股份有限公司	其他
太平基金管理有限公司	其他
天风证券股份有限公司	其他
国融证券股份有限公司	其他
关联自然人	董监高及其亲属

注 1：关联自然人系公司及控股股东的董事、监事、高级管理人员及其关系密切的家庭成员。

（五）关联交易情况

1、关联方交易情况表

（1）基金代销

公司为关联方发行的基金产品提供代销服务，收取代销手续费

关联方	本期发生额		上期发生额	
	代销规模	代销手续费收入	代销规模	代销手续费收入
东海基金管理有限责任公司	153,716.00	1,442.83	6,703.50	40.03
东海瑞京资产管理（上海）有限公司	101,000,000.00	402,306.08	310,500,000.00	2,053,710.69
合计	<u>101,153,716.00</u>	<u>403,748.91</u>	<u>310,506,703.50</u>	<u>2,053,750.72</u>

（2）代理买卖服务

公司为关联方及其发行的产品提供代理买卖服务，取得相关佣金收入，并向客户支付利息。

关联方	本期发生额		上期发生额	
	代理买卖 手续费收入	经纪业务 客户存款利息支出	代理买卖 手续费收入	经纪业务 客户存款利息支出
铎龙（上海）投资管理有限公司			19,218.26	
常州投资集团有限公司及其下属子公司	173,449.60	74,207.96	1,015,628.12	97,555.12

关联方	本期发生额		上期发生额	
	代理买卖	经纪业务	代理买卖	经纪业务
	手续费收入	客户存款利息支出	手续费收入	客户存款利息支出
常州市市民卡建设有限公司			1,222.84	246.27
关联自然人	358,410.58	11,158.07	65,222.46	6,211.15
常州市常信鑫源房地产开发有限公司	2,406.60	6,523.73		
常州名昊置业有限公司	2,468.87	7,157.26		
九江东海中泰股权投资合伙企业（有限合伙）	10,666.82	10.70		29.46
宝博(上海)投资管理有限公司				1.06
江苏安瑞达新材料有限公司		35.07		
常州东风农机集团有限公司		322.65		40.72
江苏江南农村商业银行股份有限公司		269.44		230.82
江苏华西同诚投资控股集团有限公司		57.15		71.83
东海瑞京资产管理（上海）有限公司		0.23		53.79
上药集团常州药业股份有限公司		0.65		
常州市市民卡建设有限公司		0.01		
常州信辉融资租赁有限公司		139.83		
合计	<u>547,402.47</u>	<u>99,882.75</u>	<u>1,101,291.68</u>	<u>104,440.22</u>

（3）席位租赁

公司为关联方提供席位租赁，取得租金收入

关联方	本期发生额	上期发生额
东海基金管理有限责任公司		2,279,380.63
合计		<u>2,279,380.63</u>

（4）投资交易

公司同关联方进行债券回购、同业拆借、现券交易等，产生损益情况（损益金额正数为公司收入，负数为公司支出）

公司名称	业务内容	本期发生额		上期发生额	
		损益	规模	损益	规模
江苏昆山农村商业银行股份有限公司	买入现券		25,220,000,000.00		28,290,000,000.00
江苏江南农村商业银行股份有限公司	买入现券				260,000,000.00
山西榆次农村商业银行股份有限公司	买入现券				
太平基金管理有限公司	买入现券		80,000,000.00		
天风证券股份有限公司	买入现券		40,000,000.00		

公司名称	业务内容	本期发生额		上期发生额	
		损益	规模	损益	规模
江苏昆山农村商业银行股份有限公司	卖出现券	810,755.51	25,440,000,000.00	-3,702,825.81	26,390,000,000.00
太平基金管理有限公司	卖出现券	46,991.65	200,000,000.00		30,000,000.00
江苏江南农村商业银行股份有限公司	卖出现券	-38,348.81	130,000,000.00	-324,529.73	400,000,000.00
山西榆次农村商业银行股份有限公司	卖出现券			3,743.15	186,730,000.00
国融证券股份有限公司	卖出现券	75,490.00	10,000,000.00		
合计		<u>894,888.35</u>	<u>51,120,000,000.00</u>	<u>-4,023,612.39</u>	<u>55,556,730,000.00</u>

(5) 购买和赎回资管产品

1) 公司购买和赎回关联方发行的产品的份额

关联方	期初份额	本期购入	本期赎回	期末份额
东海基金管理有限责任公司		263,404,623.03	63,404,623.03	200,000,000.00
太平基金管理有限公司		32,000,120.00	32,000,120.00	
合计		<u>295,404,743.03</u>	<u>95,404,743.03</u>	<u>200,000,000.00</u>

2) 关联方购买和赎回本公司发行的产品的份额

关联方	期初份额	本期购入	本期赎回	期末份额
常州投资集团有限公司及其下属子公司	100,006,712.32	124,405,622.72	124,405,622.72	100,006,712.32
关联自然人	1,964,780.25	8,390,769.59	8,339,275.76	2,016,274.08
常州名昊置业有限公司		205,000,000.00	140,000,000.00	65,000,000.00
常州市常信鑫源房地产开发有限公司	122,885,000.00	203,269,000.00	326,154,000.00	
合计	<u>224,856,492.57</u>	<u>541,065,392.31</u>	<u>598,898,898.48</u>	<u>167,022,986.40</u>

3) 公司发行的产品投资关联方发行产品的份额

关联方	期初份额	本期购入	本期赎回	期末份额
东海瑞京资产管理（上海）有限公司	166,633,612.79			166,633,612.79
合计	<u>166,633,612.79</u>			<u>166,633,612.79</u>

(6) 财务顾问

公司为关联方发行的产品提供财务顾问服务，公司取得的顾问服务收入

关联方	本期发生额	上期发生额
-----	-------	-------

关联方	本期发生额	上期发生额
常州投资集团有限公司	100,000.00	
常州信辉商业保理有限公司	100,000.00	
合计	<u>200,000.00</u>	

2、关联租赁情况

公司出租情况表：

出租方名称	承租方名称	租赁资产种类	租赁起始日	租赁终止日	租赁费定价依据	本期确认的租赁收入
东海证券股份有限公司	东海基金管理有限责任公司	房屋	2019年11月1日	2022年10月31日	协议定价	281,252.83
合计						<u>281,252.83</u>

(六) 关联方应收应付款项

1、应收关联方款项

项目名称	关联方	期末金额		期初金额	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	东海基金管理有限责任公司	283,180.33	28,318.03	5,095,712.45	1,321,329.78
合计		<u>283,180.33</u>	<u>28,318.03</u>	<u>5,095,712.45</u>	<u>1,321,329.78</u>

2、应付关联方款项

项目名称	关联方	期末金额	期初金额
代理买卖证券款	常州投资集团有限公司及其下属子公司	94,129,013.29	43,469,704.70
代理买卖证券款	铎龙(上海)投资管理有限公司		2,430,282.64
代理买卖证券款	关联自然人	1,334,296.87	1,404,216.67
代理买卖证券款	江苏江南农村商业银行股份有限公司	65,951.78	65,718.90
代理买卖证券款	九江东海中泰股权投资合伙企业(有限合伙)		50,030.18
代理买卖证券款	江苏华西同诚投资控股集团有限公司	9.57	20,451.25
代理买卖证券款	常州东风农机集团有限公司	654.32	331.86
代理买卖证券款	宝博(上海)投资管理有限公司		303.87
代理买卖证券款	东海瑞京资产管理(上海)有限公司	53.88	53.68
代理买卖证券款	常州市常信鑫源房地产开发有限公司	0.21	
代理买卖证券款	上药集团常州药业股份有限公司	1,134.29	
代理买卖证券款	常州信辉融资租赁有限公司	39,098.50	
代理买卖证券款	常州市市民卡建设有限公司	0.01	

项目名称	关联方	期末金额	期初金额
合计		<u>95,570,212.72</u>	<u>47,441,093.75</u>

3、购买和赎回资管产品

(1) 公司购买和赎回关联方发行的产品的公允价值

关联方	期末公允价值	期初公允价值
东海基金管理有限责任公司	200,400,000.00	
合计	<u>200,400,000.00</u>	

(2) 关联方购买和赎回本公司发行的产品的公允价值

关联方	期末公允价值	期初公允价值
常州投资集团有限公司及其下属子公司	109,087,321.80	225,171,865.36
常州名昊置业有限公司	65,000,000.00	
关联自然人	2,016,274.08	1,964,780.25
合计	<u>176,103,595.88</u>	<u>227,136,645.61</u>

(3) 公司发行的产品投资关联方发行产品的公允价值

关联方	期末公允价值	期初公允价值
东海瑞京资产管理（上海）有限公司	3,332,672.26	3,332,672.26
合计	<u>3,332,672.26</u>	<u>3,332,672.26</u>

(七) 关联方承诺事项

无。

(八) 高级管理人员薪酬（税前）

本期发生额		上期发生额	
人数	金额	人数	金额
10	17,674,016.01	8	33,990,803.30

注：截至2020年12月31日，高级管理人员在职8人，离任2人。

十一、或有事项

截止资产负债表日，本公司除“十四、其他重要事项中（二）诉讼事项”外无其他需要披露的或有事项。公司预计上述或有事项不会对财务状况或经营产生重大影响。

十二、承诺事项

经营租赁承诺

截至 2020 年 12 月 31 日，根据本公司已签订的不可撤销的经营性租赁协议，未来应支付的最低租金为：

未来期间	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
1 年以内	42,260,533.29	44,375,192.31
1-2 年	28,368,210.83	33,931,873.94
2-3 年	13,039,925.88	18,878,210.22
3 年以上	29,923,272.33	30,310,252.94
合计	<u>113,591,942.33</u>	<u>127,495,529.41</u>

截至 2020 年 12 月 31 日，本公司不存在其他需要披露的重大承诺事项。

十三、 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本公司未发生影响本财务报告阅读和理解的重大资产负债表日后非调整事项。

十四、 其它重要事项

（一） 分部信息

本公司按照经营业务划分，主要包括证券经纪业务、投资银行业务、资产管理业务、证券自营业务、期货业务、直投业务和其他等经营分部；本公司在中国境内、境外提供服务，根据本公司证券营业机构分布情况，包括江苏地区、上海地区和其他地区。分部间转移价格参照向第三方销售所采用的价格确定，间接归属于各分部的费用按照收入比例在分部之间进行分配。

1、 经营分部

本期发生额：

项目	证券经纪业务	投资银行业务	资产管理业务	证券自营业务	信用交易业务
一、营业收入	633,704,148.03	342,233,586.39	74,640,419.94	941,498,029.28	344,677,169.09
手续费及佣金净收入	505,882,943.52	342,226,255.06	59,235,640.20		
其他收入	127,821,204.51	7,331.33	15,404,779.74	941,498,029.28	344,677,169.09
二、营业支出	330,686,826.80	84,486,615.51	35,163,674.56	351,211,932.86	25,368,572.09
三、营业利润	303,017,321.23	257,746,970.88	39,476,745.38	590,286,096.42	319,308,597.00
四、资产总额	9,420,929,300.99	304,661,151.01	184,745,769.13	8,033,546,909.26	1,068,062,501.79
五、负债总额	8,921,462,416.62	40,748,019.34	58,831,151.36	7,340,723,593.98	740,433,855.74
六、补充信息					
折旧及摊销费用	13,319,429.21	293,102.96	1,248,055.90	5,405,830.75	1,028,671.28

项目	证券经纪业务	投资银行业务	资产管理业务	证券自营业务	信用交易业务
资本性支出	9,308,764.20	-5,667.99	380,394.62	5,633,278.32	301,533.36

续表

项目	期货经纪业务	直投业务	其他	合并抵消	合计
一、营业收入	222,388,296.97	18,226,254.34	-76,387,193.56	-231,646,246.46	<u>2,269,334,464.02</u>
手续费及佣金净收入	104,067,941.53	247,955.97	8,128,020.97		<u>1,019,788,757.25</u>
其他收入	118,320,355.44	17,978,298.37	-84,515,214.53	-231,646,246.46	<u>1,249,545,706.77</u>
二、营业支出	164,535,131.17	29,291,846.43	1,056,047,159.59	-532,590,691.13	<u>1,544,201,067.88</u>
三、营业利润	57,853,165.80	-11,065,592.09	-1,132,434,353.15	300,944,444.67	<u>725,133,396.14</u>
四、资产总额	6,651,438,583.32	503,463,342.74	17,973,998,684.72	-1,817,369,012.31	<u>42,323,477,230.65</u>
五、负债总额	6,111,012,705.33	2,795,245.84	8,124,586,115.03	2,006,300,045.43	<u>33,346,893,148.67</u>
六、补充信息					
折旧及摊销费用	5,829,653.50	5,945,544.07	40,393,169.79		<u>73,463,457.46</u>
资本性支出	2,296,091.52	5,486.73	32,890,732.74		<u>50,810,613.50</u>

上期发生额:

项目	证券经纪业务	投资银行业务	资产管理业务	证券自营业务	信用交易业务
一、营业收入	502,409,543.86	308,590,729.53	78,954,886.80	469,420,676.40	<u>255,629,622.00</u>
手续费及佣金净收入	387,854,168.62	308,294,610.16	64,276,007.97		
其他收入	114,555,375.24	296,119.37	14,678,878.83	469,420,676.40	<u>255,629,622.00</u>
二、营业支出	318,105,693.77	67,033,006.82	93,942,871.52	85,309,973.14	<u>14,921,917.77</u>
三、营业利润	184,303,850.09	241,557,722.71	-14,987,984.72	384,110,703.26	<u>240,707,704.23</u>
四、资产总额	7,925,816,342.50	411,363,761.19	162,063,205.28	5,680,218,855.23	<u>569,030,699.39</u>
五、负债总额	7,565,353,799.39	6,064,545.40	72,399,394.06	5,435,827,276.00	<u>321,143,490.62</u>
六、补充信息					
折旧及摊销费用	14,099,628.88	395,547.61	1,345,290.76	3,071,940.83	<u>1,157,296.40</u>
资本性支出	12,659,819.04	106,101.90	2,227,661.47	5,878,226.92	<u>847,995.13</u>

续表

项目	期货经纪业务	直投业务	其他	合并抵消	合计
一、营业收入	192,636,526.21	47,116,437.58	247,143,424.35	-460,202,565.15	<u>1,641,699,281.58</u>
手续费及佣金净收入	69,353,505.39	140,094.34	5,996,731.58		<u>835,915,118.06</u>
其他收入	123,283,020.82	46,976,343.24	241,146,692.77	-460,202,565.15	<u>805,784,163.52</u>

项目	期货经纪业务	直投业务	其他	合并抵消	合计
二、营业支出	141,395,401.70	446,176,044.84	730,794,578.55	-465,873,510.01	<u>1,431,805,978.10</u>
三、营业利润	51,241,124.51	-399,059,607.26	-483,651,154.20	5,670,944.86	<u>209,893,303.48</u>
四、资产总额	4,554,671,922.54	1,943,743,784.22	17,997,813,929.11	-1,904,922,792.74	<u>37,339,799,706.72</u>
五、负债总额	4,031,176,208.67	1,400,505,573.33	4,672,297,068.53	5,291,140,236.26	<u>28,795,907,592.26</u>
六、补充信息					
折旧及摊销费用	6,834,151.46	5,943,827.16	39,038,305.85		<u>71,885,988.95</u>
资本性支出	1,569,991.83		21,468,470.25		<u>44,758,266.54</u>

2、地区分部

本期发生额：

项目	江苏地区	上海地区	其他地区	合并抵消	合计
一、营业收入	1,061,751,282.65	1,195,630,130.04	243,599,297.79	-231,646,246.46	<u>2,269,334,464.02</u>
手续费及佣金净收入	612,426,557.96	84,919,155.46	322,443,043.83		<u>1,019,788,757.25</u>
其他收入	449,324,724.69	1,110,710,974.58	-78,843,746.04	-231,646,246.46	<u>1,249,545,706.77</u>
二、营业支出	1,440,118,133.10	164,843,934.91	471,829,691.00	-532,590,691.13	<u>1,544,201,067.88</u>
三、营业利润	-378,366,850.45	1,030,786,195.13	-228,230,393.21	300,944,444.67	<u>725,133,396.14</u>
四、资产总额	24,128,464,590.80	12,573,946,196.26	7,438,435,455.90	-1,817,369,012.31	<u>42,323,477,230.65</u>
五、负债总额	15,732,072,095.88	8,582,512,180.56	7,026,008,826.80	2,006,300,045.43	<u>33,346,893,148.67</u>
六、补充信息					
折旧及摊销费用	55,086,138.22	13,442,493.07	4,934,826.17		<u>73,463,457.46</u>
资本性支出	37,901,398.04	8,049,339.10	4,859,876.36		<u>50,810,613.50</u>

上期发生额：

项目	江苏地区	上海地区	其他地区	合并抵消	合计
一、营业收入	875,216,470.84	976,412,365.53	250,273,010.36	-460,202,565.15	<u>1,641,699,281.58</u>
手续费及佣金净收入	476,777,870.42	108,669,676.13	250,467,571.51		<u>835,915,118.06</u>
其他收入	398,438,600.42	867,742,689.40	-194,561.15	-460,202,565.15	<u>805,784,163.52</u>
二、营业支出	933,211,451.72	367,610,950.87	596,857,085.52	-465,873,510.01	<u>1,431,805,978.10</u>
三、营业利润	-57,994,980.88	608,801,414.66	-346,584,075.16	5,670,944.86	<u>209,893,303.48</u>
四、资产总额	18,186,957,208.26	14,032,052,166.66	7,025,713,124.54	-1,904,922,792.74	<u>37,339,799,706.72</u>
五、负债总额	9,758,556,082.83	6,791,185,993.09	6,955,025,280.08	5,291,140,236.26	<u>28,795,907,592.26</u>
六、补充信息					

项目	江苏地区	上海地区	其他地区	合并抵消	合计
折旧及摊销费用	53,517,581.71	11,807,042.08	6,561,365.16		<u>71,885,988.95</u>
资本性支出	32,492,032.27	9,578,433.94	2,687,800.33		<u>44,758,266.54</u>

（二）诉讼事项

1、（1）公司管理的“东海证券月月盈集合资产管理计划”持有“15 机床 CP004”票面金额 2,000.00 万元，因大连机床集团有限责任公司（以下简称“大连机床”）未能到期支付债券本息，公司于 2017 年 10 月向常州市天宁区人民法院提起诉讼。2018 年 4 月 19 日，法院判决公司胜诉，判决大连机床向公司支付债券本金 2,000.00 万元及利息 140.00 万元。

（2）公司管理的“东海证券月月盈集合资产管理计划”持有“16 大机床 SCP003”票面金额 5,000.00 万元，因大连机床未能到期支付债券本息，公司于 2017 年 10 月向常州市中级人民法院提起诉讼。2018 年 12 月 20 日，法院判决公司胜诉，判决确认公司对大连机床享有债权 53,795,402.08 元。之后对方提起上诉，江苏省高级人民法院于 2019 年 6 月 14 日对本案开庭审理，并于 2020 年 5 月 29 日作出判决，判决维持一审判决中第一项、第三项及案件受理费部分，撤销一审判决中第二项。

鉴于大连机床系列企业处于破产重整阶段，报告期内，公司债权尚未得到清偿。

2、公司管理的“东海证券月月盈集合资产管理计划”于 2018 年 10 月 20 日购入中科建设开发总公司（以下简称“中科建设”）发行的“16 中科建设 PPN001”票面金额 5,000.00 万元，以及“16 中科建设 PPN002”票面金额 5,000.00 万元。2018 年 11 月 19 日，中科建设未按期支付债券利息并相应发布公告后，公司向中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。中国国际经济贸易仲裁委员会于 2018 年 11 月 29 日受理仲裁申请。2019 年 5 月，公司收到仲裁委员会作出的胜诉裁决，并向法院申请执行。2019 年 12 月 5 日，上海金融法院出具《执行裁定书》，法院认为经穷尽财产调查措施，未发现被执行人有可供执行的财产，故裁定终结本次执行程序。2020 年 10 月 10 日，上海市第三中级人民法院受理中科建设破产重整一案。2021 年 1 月 15 日通过网络视频会议召开了第一次债权人会议。

报告期内，公司债权尚未得到清偿。

3、东海证券月月盈产品持有凯迪公司发行的“11 凯迪 MTN1”债券，券面总额共计人民币 4,000.00 万元。后凯迪公司发布未按期支付债券本息公告，公司已向常州市天宁区人民法院提起诉讼。法院于 2018 年 9 月 26 日受理立案，2019 年 6 月 14 日天宁区人民法院开庭审理，2019 年 9 月 12 日，常州市天宁区人民法院出具（2018）苏 0402 民初 5231 号判决书，判决中法院支持了公司诉讼请求，要求凯迪生态环境科技股份有限公司与判决生效之日十日内向公司支付债券本金 4,000.00 万元和债券利息 250.80 万元及相关损失（以 4,250.80 万元为基数，按年利率 6.27% 的标准自 2018 年 5 月 8 日起计算至实际清偿之日止），本案已结案进入执行阶段，目前未执行到款项。

4、辅仁药业集团有限公司（下称“辅仁集团”）于 2016 年 10 月 17 日在银行间债券市场

公开发行了金额为 3 亿元的“辅仁药业集团有限公司 2016 年度第三期非公开定向债务融资工具”，公司于 2018 年购入该债券共计面值人民币 48,000,000.00 元。之后辅仁集团未严格履约，公司向中国国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁。中国国际经济贸易仲裁委员会已于 2020 年 1 月 17 日开庭审理，并于 2020 年 6 月 5 日作出裁决书，裁决公司胜诉，辅仁集团应向公司支付债券本金 4,800.00 万元及利息、违约金。公司向法院申请强制执行。报告期内，本案尚未执行完毕。

5、优源国际控股有限公司（以下简称“优源国际”）系由柯文托作为创始人在开曼设立，并于 2010 年在香港交易所主板上市（股票代码：2268）。2018 年 1 月 23 日，优源国际因资金使用需要向东海国际金融控股有限公司（以下简称“东海国际”）发行了本金总额为 22,000,000.00 美元的有担保可换股债券（下称“债券”），东海国际金融控股有限公司、优源国际控股有限公司、柯文托就此债券发行分别签订了《Subscription Agreement》《Deed of Guarantee》，同意就优源国际向东海国际发行的债券提供不可撤销的且无条件的保证责任。优源国际就债券发行事项在香港交易所进行公告。协议签订后，东海国际依约提供相应款项，优源国际未能按期归还全部款项。经各方协商，就债券延期事项，优源国际于 2019 年 1 月 31 日向东海国际出具了书面的无条件的《Promissory Note》，同时柯文托向东海国际出具了书面的《Guarantee》，优源国际承诺将根据《承兑付款票据》所列条件于 2019 年 4 月 30 日向东海国际支付 23,800,000.00 美元、利息及其他应付款项用于偿还未赎回的债券本金、东海国际持有期间的全部利息及其他相关费用。

之后，优源国际仅于 2019 年 4 月 18 日归还过 500,000.00 美元后再未支付任何款项。因优源国际未能按约履行，东海国际向法院提起诉讼。福建省泉州市中级人民法院已于 2019 年 11 月 1 日受理本案，并于 2020 年 11 月 19 日作出（2019）闽 05 民初 1968 号民事判决书，判决：（1）优源国际于判决生效之日起十日内向东海国际偿还本金美元 2,330.00 万元及相应利息；（2）优源国际于判决生效之日起十日内向东海国际支付为实现本案债权支出的费用人民币 550,440.87 元；（3）柯文托对优源国际前述两项债务的清偿承担连带保证责任。本案受理费人民币 1,012,276.30 元及财产保全费人民币 5,000.00 元由优源国际、柯文托共同负担。该判决于 2021 年 2 月 12 日已生效，已开始准备执行程序。

6、洪业化工集团股份有限公司（以下简称“洪业化工”）于 2016 年 12 月 2 日发行洪业化工集团股份有限公司公开发行 2016 年公司债券（第一期）（债券简称：16 洪业 02，证券代码：136853，以下简称“系争债券”或“16 洪业 02”），东海证券为系争债券主承销商和受托管理人。博道基金管理有限公司（以下简称“博道基金”）通过管理的产品持有面值为人民币 59,898,000.00 元的系争债券。后因洪业化工与其他 28 家关联企业进入合并重整程序，根据重整计划，博道基金作为普通债权人，按其债权金额，可获偿人民币 7,123,707.14 元，博道基金向江苏省南京市中级人民法院提起诉讼，要求东海证券向其支付系争债券的本金和利息合计人民币 55,283,904.19 元。本案于 2020 年 4 月 1 日被江苏省南京市中级人民法院受理，分别于 2020 年 8 月 28 日在江苏省南京中级人民法院进行证据交换，并于 2020 年 9 月 23 日、2021 年 2 月 23 日在江苏省南京中级人民法院开庭审理，目前尚未判决。

7、洪业化工集团股份有限公司（以下简称“洪业化工”）于 2016 年 12 月 2 日发行洪业化

工集团股份有限公司公开发行 2016 年公司债券(第一期)(债券简称: 16 洪业 02, 证券代码: 136853, 以下简称“系争债券”), 东海证券为系争债券主承销商和受托管理人。北京千为投资管理有限公司(以下简称“千为投资”)通过其管理的产品持有面值为人民币 63,000,000.00 元的系争债券。后因洪业化工与其他 28 家关联企业合并破产重整, 千为投资所持债券未能全额兑付。千为投资向江苏省南京市中级人民法院提起诉讼, 要求东海证券向其支付系争债券的本金、利息以及律师费合计人民币 65,948,756.10 元。本案已被江苏省南京市中级人民法院受理后于 2020 年 8 月 12 日通知我司应诉, 并于 2020 年 9 月 23 日、2021 年 2 月 23 日在江苏省南京市中级人民法院开庭审理, 目前尚未判决。

(三) 公益性投入情况

本公司为履行社会责任, 在公益广告、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等方面的支出如下:

项目	本期发生额	上期发生额
慈善捐赠	7,566,262.50	2,048,989.78

（四） 融资融券业务情况

1、 业务规模

于 2020 年 12 月 31 日和 2019 年 12 月 31 日，本公司融资融券业务规模如下：

项目	期末余额	期初余额
融出资金	7,363,888,096.77	3,819,597,830.12
融出证券	7,880,284.82	3,980,938.55
合计	<u>7,371,768,381.59</u>	<u>3,823,578,768.67</u>

2、 财务报表列报

公司在编制财务报表时，融出证券在交易性金融资产项目中列示，其核算方法参照交易性金融资产；融出资金在报表中单独列示。

（五） 债券借贷

于 2020 年 12 月 31 日，本公司在银行间债券市场交易平台向商业银行借入债券的类别及公允价值具体如下：

债权类别	期末公允价值
地方政府债	402,742,140.00
合计	<u>402,742,140.00</u>

于 2020 年 12 月 31 日，本公司通过借入方式取得的债券中为卖出回购业务而设定质押的债券公允价值为人民币 402,742,140.00 元。

十五、 母公司财务报表主要项目注释

（一） 货币资金

1、 按类别列示

项目	期末余额	期初余额
库存现金		
银行存款	7,537,085,708.24	7,886,144,095.93
其中：客户存款	6,278,407,222.56	5,589,250,125.28
公司存款	1,258,678,485.68	2,296,893,970.65
合计	<u>7,537,085,708.24</u>	<u>7,886,144,095.93</u>

2、按币种列示

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
库存现金：						
其中：人民币						
小计						
银行存款：						
客户资金存款						
其中：人民币			5,833,615,310.15			5,182,777,383.29
港币	10,546,365.45	0.8416	8,876,243.02	6,059,442.04	0.8958	5,427,927.00
美元	3,121,562.10	6.5249	20,367,880.54	3,446,299.89	6.9762	24,042,077.30
小计			<u>5,862,859,433.71</u>			<u>5,212,247,387.59</u>
客户信用资金存款						
其中：人民币			415,547,788.85			377,002,737.69
小计			<u>415,547,788.85</u>			<u>377,002,737.69</u>
客户存款合计			6,278,407,222.56			5,589,250,125.28
公司自有资金存款						
其中：人民币			957,352,413.32			2,127,641,569.02
港币	2,237,382.40	0.8416	1,883,070.53	2,237,271.16	0.8958	2,004,102.76
美元	25,821.28	6.5249	168,481.27	577,838.08	6.9762	4,031,114.01
小计			<u>959,403,965.12</u>			<u>2,133,676,785.79</u>
公司信用资金存款						
其中：人民币			299,274,520.56			163,217,184.86
小计			<u>299,274,520.56</u>			<u>163,217,184.86</u>
公司存款合计			1,258,678,485.68			2,296,893,970.65
其他货币资金：						
其中：人民币						
小计						
合计			<u>7,537,085,708.24</u>			<u>7,886,144,095.93</u>

其中：融资融券业务

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
公司信用资金存款			299,274,520.56			163,217,184.86
其中：人民币			299,274,520.56			163,217,184.86
客户信用资金存款			415,547,788.85			377,002,737.69
其中：人民币			415,547,788.85			377,002,737.69
合计			<u>714,822,309.41</u>			<u>540,219,922.55</u>

3、2020年12月31日货币资金无存在抵押、冻结等对变现有限制及潜在回收风险的款项。

(二) 结算备付金

1、按类别列示

项目	期末余额	期初余额
客户备付金	2,076,214,605.99	2,168,061,434.33
公司备付金	626,571,170.88	306,793,212.65
合计	<u>2,702,785,776.87</u>	<u>2,474,854,646.98</u>

2、按币种列示

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
客户备付金						
客户普通备付金			1,872,651,444.41			1,896,636,090.05
其中：人民币			1,840,513,770.41			1,861,799,226.88
港币	15,585,410.35	0.8416	13,117,304.77	21,101,899.26	0.8958	18,902,659.32
美元	2,915,043.79	6.5249	19,020,369.23	2,284,080.71	6.9762	15,934,203.85
客户信用备付金			203,563,161.58			271,425,344.28
其中：人民币			203,563,161.58			271,425,344.28
客户备付金合计			<u>2,076,214,605.99</u>			<u>2,168,061,434.33</u>
公司备付金						
公司自有备付金			626,571,170.88			306,793,212.65
其中：人民币			611,306,011.35			290,905,219.34
港币	4,027,775.59	0.8416	3,389,937.05	3,920,780.10	0.8958	3,512,156.40
美元	1,819,985.36	6.5249	11,875,222.48	1,774,008.33	6.9762	12,375,836.91

项目	期末余额			期初余额		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
公司备付金合计			626,571,170.88			306,793,212.65
合计			<u>2,702,785,776.87</u>			<u>2,474,854,646.98</u>

(三) 长期股权投资

1、按类别列示

项目	期末余额	期初余额
对子公司的投资	2,016,076,928.15	1,759,205,928.15
对联营企业投资	49,278,338.85	47,307,050.81
-重要的联营企业	49,278,338.85	47,307,050.81
小计	<u>2,065,355,267.00</u>	<u>1,806,512,978.96</u>
减：减值准备	957,892,290.78	414,529,849.75
合计	<u>1,107,462,976.22</u>	<u>1,391,983,129.21</u>

2、对子公司投资

被投资单位	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减值准备	减值准备期末余额
东海投资有限责任公司	970,000,000.00		370,000,000.00	600,000,000.00		
东海期货有限责任公司	242,914,928.15			242,914,928.15		
东海证券创新产品投资有限公司	131,761,150.25			82,096,394.56	49,664,755.69	217,903,605.44
东海国际金融控股有限公司		626,871,000.00		133,173,314.66	493,697,685.34	739,988,685.34
合计	<u>1,344,676,078.40</u>	<u>626,871,000.00</u>	<u>370,000,000.00</u>	<u>1,058,184,637.37</u>	<u>543,362,441.03</u>	<u>957,892,290.78</u>

3、对联营、合营企业投资

被投资单位	期初余额	本期增减变动			其他权益变动
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资损益	
联营企业					
东海基金管理有限责任公司	47,307,050.81			1,971,288.04	
合计	<u>47,307,050.81</u>			<u>1,971,288.04</u>	

续表

被投资单位	本期增减变动			期末余额	减值准备期末余额
	宣告发放现金股利或利润	计提减值准备	其他		
联营企业					
东海基金管理有限责任公司				49,278,338.85	
合计				<u>49,278,338.85</u>	

4、长期股权投资不存在向投资企业转移资金的能力受到限制的情况。

(四) 应付职工薪酬

1、分类列示

项 目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
短期薪酬	30,093,317.15	360,696,679.49	356,520,402.95	34,269,593.69
离职后福利中的设定提存计划负债	95,949.14	46,538,984.34	5,773,933.48	40,861,000.00
辞退福利		9,206,695.76	2,998,561.82	6,208,133.94
其他长期职工福利	294,116,278.94	288,201,790.00	204,618,154.82	377,699,914.12
合计	<u>324,305,545.23</u>	<u>704,644,149.59</u>	<u>569,911,053.07</u>	<u>459,038,641.75</u>

2、短期薪酬

项 目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
一、工资、奖金、津贴和补贴	4,749,043.77	287,292,966.82	287,292,966.82	4,749,043.77
二、职工福利费		8,527,983.43	8,527,983.43	
三、社会保险费	<u>69,013.71</u>	<u>19,133,799.04</u>	<u>19,152,478.67</u>	<u>50,334.08</u>
其中：1. 医疗保险费	61,620.46	17,442,974.97	17,456,124.71	48,470.72
2. 工伤保险费	1,217.13	50,610.79	51,827.92	
3. 生育保险费	6,176.12	1,640,213.28	1,644,526.04	1,863.36
四、住房公积金	10,106.00	37,743,022.21	37,753,128.21	
五、工会经费和职工教育经费	25,265,153.67	7,998,907.99	3,793,845.82	29,470,215.84
六、短期带薪缺勤				
七、短期利润分享计划				
八、其他短期薪酬				
合计	<u>30,093,317.15</u>	<u>360,696,679.49</u>	<u>356,520,402.95</u>	<u>34,269,593.69</u>

3、离职后福利中的设定提存计划负债

项目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
----	------	------	------	------

项目	期初余额	本期增加	本期支付	期末余额
基本养老保险	92,128.01	5,562,114.16	5,654,242.17	
失业保险	3,821.13	115,870.18	119,691.31	
企业年金缴费		40,861,000.00		40,861,000.00
合计	<u>95,949.14</u>	<u>46,538,984.34</u>	<u>5,773,933.48</u>	<u>40,861,000.00</u>

4、基本养老保险、失业保险缴费情况

按照中国有关法规，本公司的职工参加了由当地劳动和社会保障部门组织实施的社会基本养老保险和失业保险，本公司以当地规定的社会基本养老保险和失业保险的缴纳基数和比例，向当地社会基本养老保险和失业保险经办机构缴纳保险费。

本公司应付职工薪酬中并无属于拖欠性质的余额。

(五) 手续费及佣金净收入

1、按项目列示

项目	本期发生额	上期发生额
证券经纪业务净收入	<u>506,007,288.70</u>	<u>380,549,481.19</u>
——证券经纪业务收入	684,281,302.36	510,536,989.82
——代理买卖证券业务	670,455,453.71	493,607,031.08
交易单元席位租赁	3,010,060.89	9,592,557.49
代销金融产品业务	10,815,787.76	7,337,401.25
——证券经纪业务支出	178,274,013.66	129,987,508.63
——代理买卖证券业务	178,274,013.66	129,987,508.63
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		
——期货经纪业务收入		
——期货经纪业务支出		
投资银行业务净收入	<u>341,829,817.27</u>	<u>305,999,607.15</u>
——投资银行业务收入	346,669,439.90	306,349,463.75
——证券承销业务	326,561,398.14	293,056,341.66
证券保荐业务	8,036,434.59	2,505,098.08
财务顾问业务	12,071,607.17	10,788,024.01
——投资银行业务支出	4,839,622.63	349,856.60
——证券承销业务	4,839,622.63	349,856.60
证券保荐业务		

项目	本期发生额	上期发生额
财务顾问业务		
资产管理业务净收入	58,391,326.33	57,592,865.12
--资产管理业务收入	58,391,326.33	57,592,865.12
--资产管理业务支出		
基金管理业务	1,521,155.76	1,293,577.83
--基金管理业务收入	1,521,155.76	1,293,577.83
--基金管理业务支出		
投资咨询业务	350,847.47	739,814.81
--投资咨询业务收入	350,847.47	739,814.81
--投资咨询业务支出		
其他手续费及佣金净收入	2,945,505.86	522,960.54
--其他手续费及佣金收入	2,945,694.54	522,960.54
--其他手续费及佣金支出	188.68	
合计	911,045,941.39	746,698,306.64
其中：手续费及佣金收入合计	1,094,159,766.36	877,035,671.87
手续费及佣金支出合计	183,113,824.97	130,337,365.23

2、受托客户资产管理业务

本期：

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	20.00	23.00	1.00
期末客户数量	24,413.00	23.00	2.00
其中：个人客户	24,344.00		
机构客户	69.00	23.00	2.00
年初受托资金	13,807,719,209.19	39,716,079,298.17	1,310,000,000.00
其中：自有资金投入	224,502,293.92	100,000,000.00	
个人客户	12,629,728,846.87		
机构客户	953,488,068.40	39,616,079,298.17	1,310,000,000.00
期末受托资金	6,219,781,703.58	11,456,110,600.46	67,000,000.00
其中：自有资金投入	216,604,361.32	100,000,000.00	
个人客户	5,166,594,676.80		
机构客户	836,582,665.46	11,356,110,600.46	67,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	6,025,622,275.56	11,619,927,651.44	57,511,986.19
其中：股票	192,362,791.59		

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
债券	4,772,559,958.14	7,301,239,912.00	
基金	620,026,256.73	542,327,479.61	57,511,986.19
其他	440,673,269.10	3,776,360,259.83	
当期资产管理业务净收入	43,433,080.44	14,286,289.30	671,956.59

上期:

项目	集合资产管理业务	定向资产管理业务	专项资产管理业务
期末产品数量	20.00	29.00	2.00
期末客户数量	81,374.00	29.00	13.00
其中: 个人客户	81,284.00		
机构客户	90.00	29.00	13.00
年初受托资金	17,532,824,793.34	49,983,076,561.29	2,398,000,000.00
其中: 自有资金投入	142,192,873.85	100,000,000.00	
个人客户	15,530,821,172.36		
机构客户	1,859,810,747.13	49,883,076,561.29	2,398,000,000.00
期末受托资金	13,807,719,209.19	39,716,079,298.17	1,310,000,000.00
其中: 自有资金投入	224,502,293.92	100,000,000.00	
个人客户	12,629,728,846.87		
机构客户	953,488,068.40	39,616,079,298.17	1,310,000,000.00
期末主要受托资产初始成本	13,111,086,006.53	40,684,354,229.56	58,893,642.52
其中: 股票	345,526,190.11		
债券	11,512,920,227.02	30,523,609,502.47	
基金	440,217,595.16	937,728,827.09	58,893,642.52
其他	812,421,994.24	9,223,015,900.00	
当期资产管理业务净收入	31,464,803.27	24,946,929.75	1,181,132.10

3、财务顾问业务

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入--境内上市公司	1,509,433.97	471,698.11
其他财务顾问业务净收入	10,562,173.20	10,316,325.90
合计	<u>12,071,607.17</u>	<u>10,788,024.01</u>

(六) 利息净收入

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入		

项目	本期发生额	上期发生额
货币资金及结算备付金利息收入	195,427,932.60	181,656,925.87
拆出资金利息收入		
融资融券利息收入	358,412,990.18	264,542,026.88
买入返售金融资产利息收入	16,104,810.03	25,152,053.89
其中：约定购回利息收入		23,779.88
股票质押回购利息收入		
其他债权投资利息收入	8,097,485.65	14,793,909.13
利息收入小计	<u>578,043,218.46</u>	<u>486,144,915.77</u>
利息支出		
应付短期融资款利息支出	49,089,918.47	16,961,112.30
拆入资金利息支出	32,839,894.51	28,027,428.08
其中：转融通利息支出	14,315,555.58	10,024,166.65
卖出回购金融资产款利息支出	134,736,085.64	132,252,054.59
代理买卖证券款利息支出	31,709,563.68	27,967,252.94
应付债券利息支出	198,617,212.40	138,518,817.14
其中：次级债券利息支出	154,545,328.55	101,570,698.93
利息支出小计	<u>446,992,674.70</u>	<u>343,726,665.05</u>
利息净收入	<u>131,050,543.76</u>	<u>142,418,250.72</u>

（七）投资收益

1、投资收益明细情况

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	1,971,288.04	796,066.48
处置长期股权投资产生的投资收益		
金融工具投资收益	537,713,147.29	109,398,502.54
其中：持有期间取得的收益	<u>271,769,806.00</u>	<u>212,073,251.85</u>
—交易性金融资产	274,906,831.21	216,753,848.71
—交易性金融负债	-1,891,864.38	-4,006,736.95
—其他债权投资		1,908.27
—衍生金融工具	-1,245,160.83	-675,768.18
处置金融工具取得的收益	<u>265,943,341.29</u>	<u>-102,674,749.31</u>
—交易性金融资产	247,629,080.16	2,322,659.83
—交易性金融负债	-7,933,409.26	-3,351,713.43
—其他债权投资	553.12	2,925,036.56

项目	本期发生额	上期发生额
一衍生金融工具	26,247,117.27	-104,570,732.27
其他	15,000,000.00	
合计	<u>554,684,435.33</u>	<u>110,194,569.02</u>

2、对联营企业和合营企业的投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额
东海基金管理有限责任公司	1,971,288.04	796,066.48
合计	<u>1,971,288.04</u>	<u>796,066.48</u>

以上投资收益汇回均无重大限制。

3、按交易性金融工具投资收益明细列示

交易性金融工具		本期发生额	上期发生额
分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	持有期间收益	274,906,831.21	216,753,848.71
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	处置取得收益	247,629,080.16	2,322,659.83
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	-1,891,864.38	-4,006,736.95
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	处置取得收益	-7,933,409.26	-3,351,713.43
合计		<u>512,710,637.73</u>	<u>211,718,058.16</u>

(八) 公允价值变动收益

项目	本期发生额	上期发生额
衍生金融工具	-622,181.80	111,592,954.26
交易性金融资产	472,916,445.52	253,545,538.94
合计	<u>472,294,263.72</u>	<u>365,138,493.20</u>

(九) 业务及管理费

费用性质	本期发生额	上期发生额
职工薪酬	704,644,149.59	386,705,576.45
折旧及摊销	57,306,539.85	53,604,696.87
其中：固定资产折旧	26,293,094.53	27,726,287.23
无形资产摊销	26,026,378.47	20,729,733.38

费用性质	本期发生额	上期发生额
长期待摊费用摊销	4,987,066.85	5,148,676.26
租赁费	40,409,410.88	39,698,601.31
业务招待费	39,527,082.90	33,195,196.37
系统服务费	30,574,101.92	35,610,954.53
邮电费	19,202,222.48	17,196,359.63
投资者保护基金	13,042,186.63	8,481,471.02
物业管理费	10,745,921.70	9,698,173.28
差旅费	8,791,537.87	12,199,311.30
资产管理计划代销佣金	8,153,797.87	26,914,431.78
咨询费	6,650,095.94	11,987,246.81
其他	63,824,108.44	63,560,541.84
合计	<u>1,002,871,156.07</u>	<u>698,852,561.19</u>

(十) 现金流量表补充资料

项目	本期发生额	上期发生额
一、将净利润调节为经营活动现金流量：		
净利润	349,562,918.18	145,510,395.44
加：其他资产减值损失/信用减值损失	564,231,212.52	507,186,873.08
固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧	29,755,053.61	31,188,246.31
无形资产摊销	26,026,378.47	20,729,733.38
长期待摊费用摊销	4,987,066.85	5,148,676.26
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-155,200.44	-2,231.78
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	273,216.96	96,195.60
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-472,294,263.72	-365,138,493.20
财务费用（收益以“-”号填列）	247,707,130.87	155,479,929.44
汇兑损失（收益以“-”号填列）	2,175,652.76	-454,298.06
投资损失（收益以“-”号填列）	-16,971,288.04	-796,066.48
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-113,178,488.96	-24,947,893.38
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	117,457,104.65	30,044,119.83
交易性金融资产的减少（增加以“-”号填列）	-3,132,315,658.32	-778,458,427.59
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	-3,668,805,880.82	-341,872,906.53

项目	本期发生额	上期发生额
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	2,699,873,490.72	2,236,136,593.58
其他		
经营活动产生的现金流量净额	<u>-3,361,671,554.71</u>	<u>1,619,850,445.90</u>
二、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		
三、现金及现金等价物净变动情况：		
现金的期末余额	7,537,085,708.24	7,886,144,095.93
减： 现金的期初余额	7,886,144,095.93	5,877,490,266.55
加： 现金等价物的期末余额	2,702,785,776.87	2,474,854,646.98
减： 现金等价物的期初余额	2,474,854,646.98	2,184,526,002.40
现金及现金等价物净增加额	<u>-121,127,257.80</u>	<u>2,298,982,473.96</u>

十六、 金融工具风险

（一） 风险管理政策及组织架构

1、 风险管理政策

本公司的主要金融工具包括现金、银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、债权投资、其他债权投资、应收款项、长期股权投资、应付款项等。各项金融工具的详细情况说明详见各项目附注。与这些金融工具有关的风险，以及本公司为降低这些风险所采取的风险管理政策如下所述。本公司管理层对这些风险敞口进行管理和监控以确保将上述风险控制在限定的范围之内。

本公司从事风险管理的目标是在风险和收益之间取得适当的平衡，将风险对本公司经营业绩的负面影响降低到最低水平，使股东及其他权益投资者的利益最大化。基于该风险管理目标，本公司风险管理的基本策略是确定和分析本公司所面临的各种风险，建立适当的风险承受底线和进行风险管理，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。

本公司在在经营过程中面临的主要风险包括信用风险、市场风险及流动性风险。本公司制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

2、 风险管理组织架构

本公司全面风险管理组织架构由董事会及下设的风险控制委员会、经理层及下设的风险管理委员会、业务决策委员会、风险管理职能部门、各业务（职能）部门及其风险管理岗位组成，

在经理层设置首席风险官。本公司全面风险管理组织体系职责明确、治理规范，运转正常。

（二）信用风险

信用风险是指由于债券发行人、交易对手、债务人违约或信用评级下降、履约能力下降，给公司带来损失的风险。公司的信用风险主要来自资金拆借、债券投资、融资融券、约定购回、质押式回购、债权投资、代理买卖证券和期货等业务。受到国内债券市场违约日趋常态化、特定领域风险集中爆发和部分行业景气度下滑等因素影响，公司承担的各类信用风险也日趋复杂，信用风险日益增大，对公司信用风险管理提出了更大的挑战。

为了控制自营业务产生的信用风险，本公司在债券投资、债券回购等业务中，通过引进专业信用评级解决方案，结合公司业务开展情况，持续推进内部信用评级体系，进一步完善信用风险管理系统。本公司在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性较小；在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并选择信用等级良好的对手方进行交易，以控制相应的信用风险。

为了控制融资类业务产生的信用风险，本公司依据证券监管部门的相关规定制定了期限、利率、融资融券的保证金比例、授信系数、维持担保比例等标准。为应对今年来的极端行情和黑天鹅事件频发的情况，本公司加强了逐日盯市和追保工作，及时调整信用账户单一证券集中度控制指标，认真做好每一位高风险客户通知预警及贷后跟踪、通过各种方式全力进行追保，引导客户提前化解风险；组织专门团队进行标的证券研判，提前从融资标的、可冲抵担保证券中剔除相关标的，并根据不同情形进行压力测试评估客户风险，对风险客户进行平铺式逐一追保。同时严把股票质押项目入口质量关，审慎开展业务，对于存在瑕疵或者流动性隐患的项目，严格予以杜绝，对于在贷后发生风险异动的融资标的，引导客户提前购回或追加担保。

应收款项及债权投资等在财务报表中以扣除减值准备后的净额列示，对于资产负债表中已确认的公允价值计量的金融工具而言，账面价值反映了其风险敞口，但并非最大敞口，其最大风险敞口将随未来公允价值的变化而改变。

在不考虑担保物或其他信用增级措施的情况下，于资产负债表日最大信用风险敞口是指相关金融资产扣除减值准备后的账面价值。本公司最大信用风险敞口金额列示如下：

项目	期末余额	期初余额
货币资金	11,138,396,540.16	10,870,510,379.04
结算备付金	5,813,907,769.11	4,215,635,340.51
融出资金	7,495,925,997.01	3,950,170,756.01
衍生金融资产	5,441,376.20	1,548,914.03
存出保证金	393,078,948.62	360,781,609.57
应收款项	21,223,404.18	69,486,662.05
买入返售金融资产	1,313,839,054.43	1,594,509,603.50

项目	期末余额	期初余额
交易性金融资产	10,280,955,280.29	11,312,978,386.62
债权投资	140,669,481.86	518,254,688.89
其他债权投资	107,961,470.00	143,895,105.99
其他资产	1,377,509.99	473,054.00
最大信用风险敞口合计	<u>36,712,776,831.85</u>	<u>33,038,244,500.21</u>

(三) 市场风险

市场风险是指因市场价格、价差变化或其它市场因子变化对公司资产、负债或收入产生不利影响或损失的风险，主要体现在因汇率（外汇风险）、市场利率（利率风险）和市场价格波动（价格风险）而引起的金融工具公允价值变动，不论该价格变动是因个别工具或其发行人特有因素所致或因影响在市场上交易的所有工具的因素造成。

本公司主要涉及的市场风险是指在以自有资金进行各类投资时因利率变动、汇率变动和证券市场价格变动而产生盈利或亏损。

本公司管理层制定了本公司所能承担的最大市场风险敞口。该风险敞口的衡量和监测是根据本金及止损额度而制定，并规定整体的市场风险均控制在管理层已制定的范围内。

本公司根据各业务特性设计并监控与业务相匹配的市场风险指标。主要市场风险监控指标包括：总盈亏水平、止盈止损比率、持仓规模、持仓集中度、Delta、久期、基点价值等指标。本公司通过动态管理持仓、风险对冲等措施，将市场风险相关指标控制在合理水平。

本公司对市场风险相关指标实施逐日盯市监控，通过 VaR、压力测试等计量方法，对市场正常波动及极端变动情况下的可能损失进行衡量，全面评估本公司整体面临的市场风险。

本公司的汇率风险主要为其财务状况和现金流量受外汇汇率波动的影响。本公司的绝大部分业务是人民币业务。本公司承受外汇风险的主要外币业务是境外子公司东海国际，其占本公司收入的比重较小，因此无重大外汇风险。

假设所有其他风险变量保持不变且不考虑本公司采用的风险管理措施，于资产负债表日人民币对美元、港币及其他币种的汇率变动使人民币升值 10%将导致本公司的所有者权益及净利润的变动情况如下：

币种	所有者权益的敏感性	
	期末余额	期初余额
美元	-6,024,623.86	32,046,713.80
港币	-11,922,481.54	-19,814,964.11
其他外币		-8.25

币种	净利润的敏感性	
	期末余额	期初余额
美元	-6,024,623.86	32,046,713.80
港币	-11,922,481.54	-19,814,964.11
其他外币		-8.25

除银行存款外，本公司持有较大金额的固定收益类金融资产。本公司的利息支出主要是支付客户代理买卖证券款的利息支出和融资利息支出。因此本公司面临一定程度的利率风险。

下表列示于各资产负债表日本公司的利率风险。表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

项目	期末余额					合计
	3个月以内	3个月至1年	1年至5年	5年以上	不计息	
金融资产						
货币资金	8,943,143,718.47	2,170,000,000.00			25,257,810.15	11,138,401,528.62
结算备付金	5,813,907,453.08				316.03	5,813,907,769.11
融出资金	2,187,398,458.98	5,176,489,637.79			132,037,900.24	7,495,925,997.01
衍生金融资产					5,441,376.20	5,441,376.20
存出保证金	393,078,941.69				6.93	393,078,948.62
应收款项					21,223,404.18	21,223,404.18
买入返售金融资产	1,313,478,101.78				360,952.65	1,313,839,054.43
交易性金融资产	962,266,654.00	1,707,554,841.07	4,945,691,858.95	2,739,664,795.83	4,384,181,858.25	14,739,360,008.10
债权投资					140,669,481.86	140,669,481.86
其他债权投资		52,361,750.00	55,599,720.00			107,961,470.00
其他权益工具投资					44,215,881.86	44,215,881.86
其他资产					1,377,509.99	1,377,509.99
金融资产合计	<u>19,613,273,328.00</u>	<u>9,106,406,228.86</u>	<u>5,001,291,578.95</u>	<u>2,739,664,795.83</u>	<u>4,754,766,498.34</u>	<u>41,215,402,429.98</u>
金融负债						
短期借款		286,438,784.77			622,696.51	287,061,481.28
应付短期融资款	220,400,000.00	2,300,240,000.00			28,259,240.71	2,548,899,240.71
拆入资金	1,400,000,000.00				2,978,888.89	1,402,978,888.89
交易性金融负债					468,624,761.80	468,624,761.80

项目	期末余额					合计
	3个月以内	3个月至1年	1年至5年	5年以上	不计息	
衍生金融负债					12,893,591.20	12,893,591.20
卖出回购金融资产款	5,925,570,000.00	340,000,000.00			3,499,951.80	6,269,069,951.80
代理买卖证券款	7,937,122,983.85				5,990,104,193.27	13,927,227,177.12
应付款项			214,850,069.02		201,013,534.36	415,863,603.38
应付债券		1,523,860,000.00	3,826,660,000.00		77,461,330.84	5,427,981,330.84
其他负债	1,059,290,769.56	738,184,452.94			11,962,248.91	1,809,437,471.41
金融负债合计	<u>16,542,383,753.41</u>	<u>5,188,723,237.71</u>	<u>4,041,510,069.02</u>		<u>6,797,420,438.29</u>	<u>32,570,037,498.43</u>
净敞口	3,070,889,574.59	3,917,682,991.15	959,781,509.93	2,739,664,795.83	-2,042,653,939.95	8,645,364,931.55

续表

项目	期初余额					合计
	3个月以内	3个月至1年	1年至5年	5年以上	不计息	
金融资产						
货币资金	8,839,140,431.63	2,010,000,000.00			21,380,847.31	10,870,521,278.94
结算备付金	4,215,635,011.21				329.30	4,215,635,340.51
融出资金	1,243,838,163.57	2,575,759,666.55			130,572,925.89	3,950,170,756.01
衍生金融资产					1,548,914.03	1,548,914.03
存出保证金	360,781,589.22				20.35	360,781,609.57
应收款项					69,486,662.05	69,486,662.05
买入返售金融资产	1,594,070,442.02				439,161.48	1,594,509,603.50
交易性金融资产	466,579,481.53	1,940,973,560.27	6,665,331,477.15	2,692,904,185.97	2,663,831,549.08	14,429,620,254.00
债权投资					518,254,688.89	518,254,688.89
其他债权投资		10,247,230.00	107,573,460.00		26,074,415.99	143,895,105.99
其他权益工具投资					25,400,000.00	25,400,000.00
其他资产					473,054.00	473,054.00
金融资产合计	<u>16,720,045,119.18</u>	<u>6,536,980,456.82</u>	<u>6,772,904,937.15</u>	<u>2,692,904,185.97</u>	<u>3,457,462,568.37</u>	<u>36,180,297,267.49</u>
金融负债						
短期借款	347,562,640.00				63,386.57	347,626,026.57
应付短期融资款	380,000,000.00	50,000,000.00	250,000,000.00		13,905,221.89	693,905,221.89

项目	期初余额					合计
	3个月以内	3个月至1年	1年至5年	5年以上	不计息	
拆入资金	1,040,000,000.00	200,000,000.00			2,383,333.32	1,242,383,333.32
交易性金融负债					462,933,924.65	462,933,924.65
衍生金融负债					1,960,906.57	1,960,906.57
卖出回购金融资产款	4,445,351,000.00				2,043,022.50	4,447,394,022.50
代理买卖证券款	7,392,067,893.05				3,790,708,901.21	11,182,776,794.26
应付款项					309,120,687.11	309,120,687.11
应付债券		1,794,522,876.82	2,700,000,000.00		57,655,143.13	4,552,178,019.95
其他负债	3,320,254,727.95	1,667,522,053.50			44,739,703.93	5,032,516,485.38
金融负债合计	<u>16,925,236,261.00</u>	<u>3,712,044,930.32</u>	<u>2,950,000,000.00</u>		<u>4,685,514,230.88</u>	<u>28,272,795,422.20</u>
净敞口	-205,191,141.82	2,824,935,526.50	3,822,904,937.15	2,692,904,185.97	-1,228,051,662.51	7,907,501,845.29

市场利率的波动主要影响本公司持有的以公允价值计量的生息资产的估值。在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的情况下，假设收益率曲线平行移动 100 个基点。

对本公司各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

项目	期末余额		期初余额	
	所有者权益	净利润	所有者权益	净利润
收益率曲线向上平移 100 个基点	-384,771,203.31	-383,320,254.16	-377,149,802.29	-374,733,945.31
收益率曲线向下平移 100 个基点	384,818,439.38	383,320,254.16	377,149,802.29	374,733,945.31

其他价格风险是指本公司所持权益类金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本公司因持有以公允价值计量的金融资产而面临价格风险，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本公司主要投资于证券交易所上市的股票和基金类工具，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。因此，本公司承担证券市场价格变动风险。本公司采取持有多种权益证券组合的方式及对持有证券的市场价格实施定期监控来管理其他价格风险。若持有的证券的价格上升（下跌）而其他市场变量保持不变，则本公司当期净利润以及所有者权益也将随之上升（下跌）。

假设上述工具的市价上升或下降 10%，其他变量不变的情况下，基于资产负债表日的上述资产对本公司所有者权益和净利润的影响如下：

变动类型	期末余额	
	所有者权益	净利润
市场价格上升 10%	194,047,642.21	194,047,642.21
市场价格下降 10%	-194,047,642.21	-194,047,642.21

续表

变动类型	期初余额	
	所有者权益	净利润
市场价格上升 10%	99,934,425.97	99,934,425.97
市场价格下降 10%	-99,934,425.97	-99,934,425.97

（四）流动性风险

流动性风险是指证券公司无法以合理成本及时获得充足资金，以满足偿付到期债务、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。而流动性是指资产在不受价值损失的条件下是否具有迅速变现的能力。本公司持有较大金额的交易性金融资产，并积极拓展融资渠道，以及时补充资本及流动资金，在极端市场情况下本公司面临一定程度的流动性风险。

本公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》及《证券公司风险控制指标动态监控系统指引》的要求，建立了以净资本、流动性为核心指标的风险动态监控系统，并定期开展流动性风险专项压力测试，持续监测本公司短期和长期的各类资金需求以及对流动性风险的承受能力，为本公司各项业务正常开展提供了有效的流动性保障。

于资产负债表日，本公司各项金融负债按未折现的合同现金流量(包括按合同利率(如果是浮动利率则资产负债表日的现行利率)计算的利息)的剩余合约期限，以及被要求支付的最早日期如下：

项目	即期偿还	期末余额		
		1个月以内	1个月至3个月	3个月至1年
短期借款				292,897,031.26
应付短期融资款			225,192,648.37	2,385,654,063.74
拆入资金		1,203,566,377.48	201,414,703.19	
交易性金融负债	468,624,761.80			
衍生金融负债	12,893,591.20			
卖出回购金融资产款		5,806,084,866.92	125,193,300.82	347,516,592.08
代理买卖证券款	13,927,227,177.12			
应付款项	193,702,745.71			
应付债券				1,758,776,767.67
其他负债		409,055,067.77	663,613,565.08	752,595,490.18
合计	<u>14,602,448,275.83</u>	<u>7,418,706,312.17</u>	<u>1,215,414,217.46</u>	<u>5,537,439,944.93</u>

续表

项目	期末余额			资产负债表账面价值
	1年至5年	5年以上	合计	
短期借款			292,897,031.26	287,061,481.28
应付短期融资款			2,610,846,712.11	2,548,899,240.71
拆入资金			1,404,981,080.67	1,402,978,888.89
交易性金融负债			468,624,761.80	468,624,761.80
衍生金融负债			12,893,591.20	12,893,591.20
卖出回购金融资产款			6,278,794,759.82	6,269,069,951.80
代理买卖证券款			13,927,227,177.12	13,927,227,177.12
应付款项	241,297,124.42		434,999,870.13	415,863,603.38
应付债券	4,034,270,589.42		5,793,047,357.09	5,427,981,330.84
其他负债			1,825,264,123.03	1,809,437,471.41

项目	期末余额			资产负债表账面价值
	1年至5年	5年以上	合计	
合计	<u>4,275,567,713.84</u>		<u>33,049,576,464.23</u>	<u>32,570,037,498.43</u>

续表

项目	期初余额			
	即期偿还	1个月以内	1个月至3个月	3个月至1年
短期借款		347,886,555.71		
应付短期融资款			392,265,873.94	51,216,849.31
拆入资金		940,000,000.00	101,768,645.36	203,277,701.66
交易性金融负债	462,933,924.65			
衍生金融负债	1,960,906.57			
卖出回购金融资产款		4,448,315,413.51		
代理买卖证券款	11,182,776,794.26			
应付款项	309,120,687.11			
应付债券				1,977,544,465.09
其他负债		1,057,176,976.51	2,312,569,118.68	1,702,845,782.40
合计	<u>11,956,792,312.59</u>	<u>6,793,378,945.73</u>	<u>2,806,603,637.98</u>	<u>3,934,884,798.46</u>

续表

项目	期初余额			资产负债表账面价值
	1年至5年	5年以上	合计	
短期借款			347,886,555.71	347,626,026.57
应付短期融资款	260,261,506.86		703,744,230.11	693,905,221.89
拆入资金			1,245,046,347.02	1,242,383,333.32
交易性金融负债			462,933,924.65	462,933,924.65
衍生金融负债			1,960,906.57	1,960,906.57
卖出回购金融资产款			4,448,315,413.51	4,447,394,022.50
代理买卖证券款			11,182,776,794.26	11,182,776,794.26
应付款项			309,120,687.11	309,120,687.11
应付债券	2,878,800,273.96		4,856,344,739.05	4,552,178,019.95
其他负债			5,072,591,877.59	5,032,516,485.38
合计	<u>3,139,061,780.82</u>		<u>28,630,721,475.58</u>	<u>28,272,795,422.20</u>

（五） 资本管理

本公司资本管理的主要目标为：保障本公司持续经营的能力，以便持续为股东及其他权益投资者带来回报及利益；支持本公司的稳定及增长；维持稳健的资本基础及支持业务发展；及符合监管法规对资本的要求。

本公司采用净资本来管理资本。净资本是指根据证券公司的业务范围和公司资产负债的流动性特点，在净资产的基础上对资产负债等项目和有关业务进行风险调整后得出的综合性风险控制指标。

十七、 补充资料

（一） 非经常性损益明细表

项目	本期发生额	上期发生额
非流动资产处置损益	14,584.73	-363,990.22
计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）	25,036,667.04	26,216,844.08
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-6,377,083.02	8,681,576.84
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
减：所得税影响额	4,582,887.20	8,624,847.74
减：少数股东损益影响额（税后）	-401,299.31	104,726.25
合计	<u>14,492,580.86</u>	<u>25,804,856.71</u>

（二） 净资产收益率及每股收益

1、 本期发生额

报告期利润	加权平均净资产	每股收益	
	收益率（%）	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	5.17	0.263	0.263
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	5.00	0.254	0.254

2、 上期发生额

报告期利润	加权平均净资	每股收益	
	产收益率（%）	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	0.60	0.030	0.030
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	0.29	0.014	0.014

(三) 公司合并财务报表主要项目的变动情况及原因的说明

报表项目	期末余额 (本期发生额)	期初余额 (上期发生额)	本期增减变动	变动幅度(%)	变动原因
结算备付金	5,813,907,769.11	4,215,635,340.51	1,598,272,428.60	37.91	客户结算备付金增加
融出资金	7,495,925,997.01	3,950,170,756.01	3,545,755,241.00	89.76	客户融资规模增加
衍生金融资产	5,441,376.20	1,548,914.03	3,892,462.17	251.30	商品期权公允价值变动
应收款项	21,223,404.18	69,486,662.05	-48,263,257.87	-69.46	其他应收款项减少
持有待售资产	868,600.00		868,600.00	不适用	下属子公司待处置
债权投资	140,669,481.86	518,254,688.89	-377,585,207.03	-72.86	债权投资减值增加
其他权益工具投资	44,215,881.86	25,400,000.00	18,815,881.86	74.08	其他权益工具投资公允价值变动增加
其他资产	127,665,717.25	195,334,626.10	-67,668,908.85	-34.64	预付款项减少
应付短期融资款	2,548,899,240.71	693,905,221.89	1,854,994,018.82	267.33	短期融资款增加
衍生金融负债	12,893,591.20	1,960,906.57	10,932,684.63	557.53	商品期权增加
卖出回购金融资产款	6,269,069,951.80	4,447,394,022.50	1,821,675,929.30	40.96	正回购规模增加
应付职工薪酬	504,132,331.95	360,145,615.81	143,986,716.14	39.98	薪酬计提数增加
应交税费	24,075,662.46	46,053,607.08	-21,977,944.62	-47.72	应交增值税减少
应付款项	415,863,603.38	309,120,687.11	106,742,916.27	34.53	应付押金及保证金增加
合同负债	6,663,806.16		6,663,806.16		适用新收入准则
递延所得税负债	165,572,595.70	45,840,481.66	119,732,114.04	261.19	交易性金融资产公允价值变动
其他负债	1,885,226,234.56	5,102,971,011.71	-3,217,744,777.15	-63.06	取得固定收益的结构化主体其他持有人权益减少
其他综合收益	19,044,015.27	32,917,717.18	-13,873,701.91	-42.15	其他债权投资公允价值变动减少
利息净收入	61,345,597.15	-25,475,993.51	86,821,590.66	不适用	并表结构化主体其他持有人损益减少
投资收益	913,355,881.16	408,423,611.78	504,932,269.38	123.63	金融工具投资收益增加
公允价值变动收益	225,279,969.59	368,384,062.56	-143,104,092.97	-38.85	衍生金融工具公允价值减少
汇兑收益	227,878.74	1,612,746.16	-1,384,867.42	-85.87	汇率变动
资产处置收益	406,471.87	-267,794.62	674,266.49	不适用	资产处置利得增加
业务及管理费用	1,241,792,499.55	932,231,187.15	309,561,312.40	33.21	职工薪酬增加
信用减值损失	277,453,764.29	476,927,985.44	-199,474,221.15	-41.82	债权投资减值损失减少
其他资产减值损失	471,587.84	144,400.00	327,187.84	226.58	持有待售资产减值损失增加

报表项目	期末余额 (本期发生额)	期初余额 (上期发生额)	本期增减变动	变动幅度(%)	变动原因
营业外收入	1,516,273.12	11,997,851.56	-10,481,578.44	-87.36	无需支付的应付款项减少
营业外支出	8,165,243.28	3,112,661.56	5,052,581.72	162.32	公益性捐赠支出增加
所得税费用	261,918,756.55	155,747,574.38	106,171,182.17	68.17	本年利润总额增加

附：

第十一节 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（会计主管人员）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）年度内在指定信息披露平台上公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。

文件备置地址：

东海证券股份有限公司董事会办公室