



## 中国国际金融股份有限公司

(于中华人民共和国注册成立的股份有限公司)

股份代号: 601995



半年度报告

2022

# 企业文化

## 以人为本，以国为怀

---

人才是我们最有价值的资源。我们努力吸引、培养并留住最优秀的人才。“做中国自己的国际投行”是中金公司成立之初便肩负的历史使命。我们始终以推动和服务于国家经济体制改革和中国资本市场的发展为己任。

## 勤奋专业

---

我们以最高的职业标准发展业务，培养一支具有国际化视野、勤勉尽责、对企业文化有高度认同感的高素质金融人才队伍。

## 积极进取

---

创新是引领中金公司持续发展的动力。优秀的人才、开阔的视野、与客户的紧密合作以及丰富的经验，使我们总能牢牢把握市场最新脉搏，为客户提供创新型产品和高质量的服务。

## 客户至上

---

客户服务是我们业务的重中之重。我们致力于与客户保持长期、信赖的关系并为他们提供增值服务。

## 至诚至信

---

我们的声誉建立在最高的职业诚信和道德标准之上。它是我们最大的资产。在诚信方面，我们从不妥协。

## 植根中国，融通世界

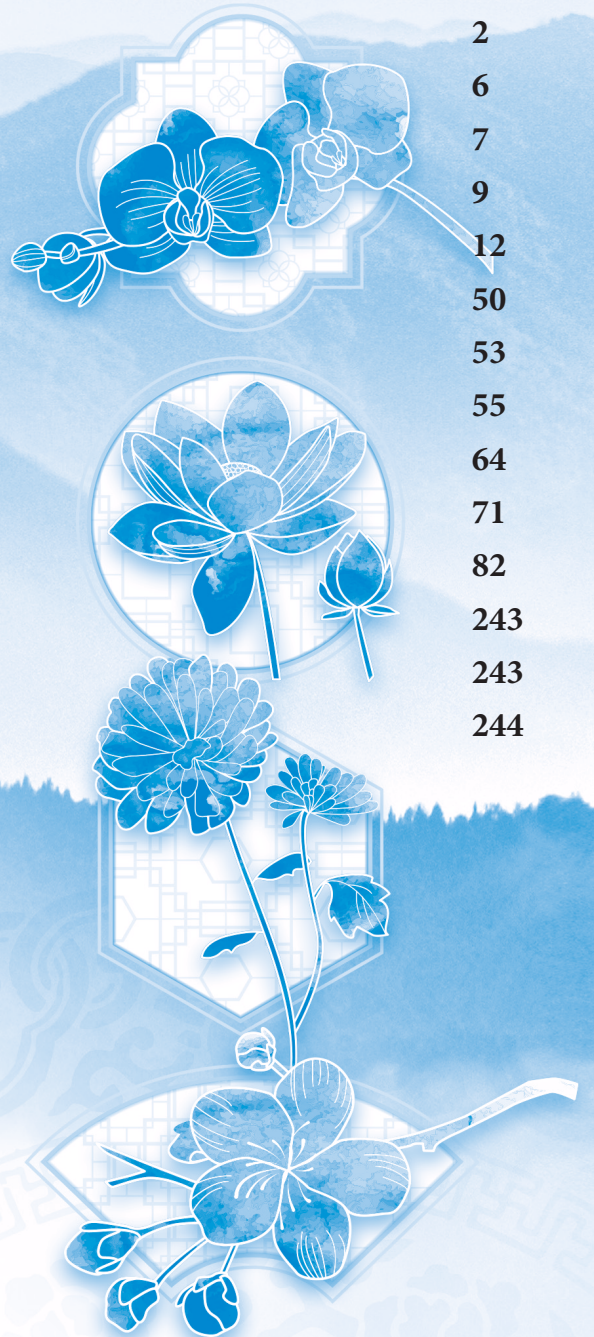
---

作为植根中国的全球性投资银行，我们的中国根基及国际基因让我们引以为豪。通过向国内外客户提供最优质的服务，我们成为中国与世界的桥梁。



# 目 录

释义	2
重要提示	6
公司简介	7
会计数据及财务指标摘要	9
管理层讨论与分析	12
公司治理	50
环境与社会责任	53
重要事项	55
股份变动及股东情况	64
债券相关情况	71
财务报告	82
备查文件目录	243
证券公司信息披露	243
附录	244



# 释义

在本报告内，除非文义另有所指，否则下列词汇具有以下涵义。

“A股”	指	本公司股本中每股面值人民币1.00元的普通股，以人民币认购及买卖并于上海证券交易所上市
“A股发行上市”	指	本公司首次公开发行人民币普通股(A股)股票并在上海证券交易所上市
“《公司章程》”	指	《中国国际金融股份有限公司章程》
“AUM”或“资产管理规模”	指	受托管理的资产金额
“董事会”	指	本公司董事会
“中国企业会计准则”	指	中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定
“央行”或“中国人民银行”	指	中国人民银行，为中国的中央银行
“中国投资咨询”	指	中国投资咨询有限责任公司，一间于1986年3月在中国注册成立的公司，为中国建投的全资子公司及本公司股东
“创业板”	指	深圳证券交易所创业板
“中金资本”	指	中金资本运营有限公司，一间于2017年3月在中国注册成立的公司，为本公司全资子公司
“中金基金”	指	中金基金管理有限公司，一间于2014年2月在中国注册成立的公司，为本公司全资子公司
“中金期货”	指	中金期货有限公司，一间于2004年7月在中国注册成立的公司，为本公司全资子公司
“中金国际”	指	中国国际金融(国际)有限公司，一间于1997年4月在香港注册成立的公司，为本公司全资子公司(曾用名：中国国际金融(香港)有限公司)
“中金私募股权”	指	中金私募股权投资管理有限公司，一间于2020年10月在中国注册成立的公司，为本公司全资子公司
“中金浦成”	指	中金浦成投资有限公司，一间于2012年4月在中国注册成立的公司，为本公司全资子公司
“中金(新加坡)”	指	China International Capital Corporation (Singapore) Pte. Limited，一间于2008年7月在新加坡注册成立的公司，为本公司全资子公司



## 释义

“中金(英国)”	指	China International Capital Corporation (UK) Limited, 一间于2009年8月在英国注册成立的公司, 为本公司的全资子公司
“中金(美国)”	指	CICC US Securities, Inc., 一间于2005年8月在美国注册成立的公司, 为本公司的全资子公司
“中金财富”或“中金财富证券”	指	中国中金财富证券有限公司, 一间于2005年9月在中国注册成立的公司, 为本公司的全资子公司(曾用名: 中国中投证券有限责任公司)
“本公司”、“公司”或“中金公司”	指	中国国际金融股份有限公司, 于2015年6月1日由中国国际金融有限公司从中外合资经营企业改制为股份有限公司, 本公司H股于香港联交所上市(股份代号: 03908), 本公司A股于上海证券交易所上市(股份代号: 601995)
“《公司法》”	指	《中华人民共和国公司法》
“《企业管治守则》”	指	《联交所上市规则》附录十四《企业管治守则》
“中国证监会”	指	中国证券监督管理委员会
“董事”	指	本公司董事
“ETF”	指	交易所交易基金
“固定收益”	指	固定收益、大宗商品及货币
“FoF”	指	基金的基金(Fund of Fund)
“GDR(s)”	指	全球存托凭证
“本集团”、“集团”或“我们”	指	本公司及其子公司(或按文义所指, 本公司及其任何一间或多间子公司)
“H股”	指	本公司股本中每股面值人民币1.00元的普通股, 以港元认购及买卖并于香港联交所上市
“海尔金盈”	指	海尔集团(青岛)金盈控股有限公司, 一间于2014年2月在中国注册成立的公司, 为本公司股东(曾用名: 海尔集团(青岛)金融控股有限公司)
“港元”	指	香港法定货币港元
“香港”	指	中国香港特别行政区
“香港联交所”或“联交所”	指	香港联合交易所有限公司, 为香港交易及结算所有限公司的全资子公司

# 释义

“汇金”、“汇金公司”或“中央汇金”	指	中央汇金投资有限责任公司，一间由中国政府最终拥有的全资国有公司，为本公司股东
“国际财务报告准则”	指	国际财务报告准则，包括国际会计准则理事会颁布的准则、修订及诠释，以及国际会计准则委员会(IASC)颁布的国际会计准则(IAS)及诠释
“中国建投”	指	中国建银投资有限责任公司，一间于1986年6月在中国注册成立的公司，为汇金的全资子公司及本公司股东
“建投投资”	指	建投投资有限责任公司，一间于2012年10月在中国注册成立的公司，为中国建投的全资子公司及本公司股东
“最后实际可行日期”	指	2022年8月30日
“《联交所上市规则》”	指	《香港联合交易所有限公司证券上市规则》
“《上交所上市规则》”	指	《上海证券交易所股票上市规则》，与《联交所上市规则》合称“上市规则”
“财政部”	指	中华人民共和国财政部
“《标准守则》”	指	《联交所上市规则》附录十之《上市公司董事进行证券交易的标准守则》
“净资产”	指	根据《证券公司风险控制指标计算标准规定》中的规定在净资产的基础上针对某些资产进行风险调整后的金额
“全国社保基金”	指	中国全国社会保障基金理事会
“中国”	指	中华人民共和国
“中国政府”	指	中国中央政府，包括各级政府部门(包括省、市及其他地区或地方政府实体)与机构
“QFII”	指	合格境外机构投资者
“REITs”	指	房地产信托投资基金
“报告期”	指	自2022年1月1日起至2022年6月30日
“人民币”	指	中国法定货币人民币
“科创板”	指	上海证券交易所科创板

## 释义

“《证券法》”	指	《中华人民共和国证券法》
“香港证监会”	指	香港证券及期货事务监察委员会
“《证券及期货条例》”	指	《证券及期货条例》(香港法例第571章)
“上海证券交易所”或“上交所”	指	上海证券交易所
“股份”	指	本公司股本中每股面值人民币1.00元的普通股
“股东”	指	股份持有人
“深圳证券交易所”或“深交所”	指	深圳证券交易所
“国企”	指	国有企业
“监事”	指	本公司监事
“监事会”	指	本公司监事会
“腾讯控股”	指	腾讯控股有限公司，一家在开曼群岛注册成立的有限公司，其股份于香港联交所上市(股份代号：00700)
“Tencent Mobility Limited”	指	Tencent Mobility Limited，一家在香港设立的有限责任公司，是腾讯控股的全资附属公司及本公司股东
“UNPRI”	指	联合国负责任投资原则组织
“美元”	指	美国法定货币美元
“万得资讯”	指	万得信息技术股份有限公司
“%”	指	百分比

# 重要提示

- 一、 公司董事会、监事会及全体董事、监事、高级管理人员保证半年度报告内容的真实性、准确性、完整性，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。
- 二、 本报告经公司董事会审议通过，除以下董事外，公司董事均亲自出席董事会会议。未有董事对本报告提出异议。

姓名	职务	未亲自出席原因	被委托人
彼得·诺兰	独立非执行董事	个人原因	刘力

- 三、 本半年度报告未经审计。本公司按照中国企业会计准则编制的2022年度中期财务报表，已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审阅。
- 四、 公司负责人沈如军、主管会计工作负责人黄劲峰及会计机构负责人(会计主管人员)田汀声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。
- 五、 本公司2022年半年度不进行利润分配，亦不进行公积金转增股本。

## 六、 前瞻性陈述的风险声明

本报告所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请各投资者注意投资风险。

七、 本公司不存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况。

八、 本公司不存在违反规定决策程序对外提供担保的情况。

九、 本公司的业务运营与中国及公司业务所处其他司法辖区的宏观经济、货币政策及市场状况密切相关，中国及国际资本市场的波动，均可能会对本公司经营业绩产生影响。

本公司面临的主要风险包括：战略风险、经营管理风险、市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、信息科技风险、合规风险、法律风险、洗钱风险、声誉风险等。

针对上述风险，本公司从组织架构、管理机制、信息技术系统、风险指标体系、人才队伍建设以及风险应对机制等各方面进行防范和管理。对于各类风险的具体分析及公司采取的具体措施，请参见“管理层讨论与分析—六、风险管理”部分的内容。

十、 本报告所载的若干金额及百分比数字已作出四舍五入。因此，若干图表内所示的算术合计结果未必为其之前数字计算所得。任何表格或图表中若出现算术合计结果与所列金额计算所得不符，均为四舍五入所致。除特别说明外，本报告所列数据以人民币为单位。



# 公司简介

(截至2022年6月30日)

## 一、公司基本信息

中文名称	中国国际金融股份有限公司
中文简称	中金公司
英文名称	China International Capital Corporation Limited
英文简称	CICC
法定代表人	沈如军
董事长	沈如军
首席执行官	黄朝晖
授权代表	黄朝晖、周佳兴
联席公司秘书	孙男、周佳兴
注册及办公地址	中国北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码	100004
香港营业地址	中国香港中环港景街1号国际金融中心第一期29楼
公司网址	<a href="http://www.cicc.com">http://www.cicc.com</a>
电子信箱	<a href="mailto:Investorrelations@cicc.com.cn">Investorrelations@cicc.com.cn</a>
注册资本	人民币4,827,256,868元
净资产	人民币47,582,045,557元

# 公司简介

公司的各单项业务资格情况

公司经营范围包括：(一)人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的经纪业务；(二)人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的自营业务；(三)人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的承销业务；(四)基金的发起和管理；(五)企业重组、收购与合并顾问；(六)项目融资顾问；(七)投资顾问及其他顾问业务；(八)外汇买卖；(九)境外企业、境内外商投资企业的外汇资产管理；(十)同业拆借；(十一)客户资产管理；(十二)网上证券委托业务；(十三)融资融券业务；(十四)代销金融产品；(十五)证券投资基金代销；(十六)为期货公司提供中间介绍业务；(十七)证券投资基金托管业务；(十八)股票期权做市业务；(十九)经金融监管机构批准的其他业务。

公司主要业务资格请参阅本报告“附录：公司主要业务资格”。

## 二、联系人和联系方式

联系人	董事会秘书：孙男 证券事务代表：周岑
联系地址	中国北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
电话	+86-10-65051166
传真	+86-10-65051156
电子信箱	Investorrelations@cicc.com.cn

## 三、信息披露及备置地点

披露半年度报告的媒体名称及网址	中国证券报( <a href="http://www.cs.com.cn">www.cs.com.cn</a> )、上海证券报( <a href="http://www.cnstock.com">www.cnstock.com</a> )、证券时报( <a href="http://www.stcn.com">www.stcn.com</a> )、证券日报( <a href="http://www.zqrb.cn">www.zqrb.cn</a> )
披露半年度报告的网站	上交所网站： <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> 香港联交所披露易网站： <a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>
半年度报告备置地点	中国北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

## 四、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码
A股	上交所	中金公司	601995
H股	联交所	中金公司	03908

# 会计数据及财务指标摘要

## 一、主要会计数据和财务指标

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	2022年1-6月	2021年1-6月	变动比例(%)
营业收入	12,131,585,605	14,461,053,892	(16.11)
归属于母公司股东的净利润	3,841,640,437	5,007,028,294	(23.28)
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	3,764,063,250	4,952,414,436	(24.00)
经营活动产生/(使用)的现金流量净额	23,964,842,509	(5,531,197,500)	不适用
其他综合收益的税后净额	584,040,417	(89,090,081)	不适用

主要会计数据	2022年6月30日	2021年12月31日	变动比例(%)
资产总额	679,994,367,645	649,795,489,215	4.65
负债总额	588,904,733,260	565,064,652,788	4.22
归属于母公司股东的权益总额	90,773,025,068	84,422,121,274	7.52
股东权益总额	91,089,634,385	84,730,836,427	7.50

单位：元 币种：人民币

主要财务指标	2022年1-6月	2021年1-6月	变动比例(%)
基本每股收益(元/股)	0.743	1.004	(26.04)
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.727	0.993	(26.82)
加权平均净资产收益率(%)	4.59	7.04	下降2.45个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	4.49	6.96	下降2.47个百分点

注：以上每股收益和加权平均净资产收益率系根据中国证监会《公开发行证券的公司信息披露编报规则第9号—净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010年修订)的相关规定进行计算。



# 会计数据及财务指标摘要

## 二、境内外会计准则下会计数据差异

本集团按照国际财务报告准则编制的简明合并财务报表及按照中国企业会计准则编制的合并财务报表中列示的截至2022年6月30日止六个月期间及截至2021年6月30日止六个月期间的归属于母公司股东的净利润和截至2022年6月30日及2021年12月31日的归属于母公司股东的净资产并无差异。

## 三、净资本及相关风险控制指标

截至2022年6月30日，母公司净资本为人民币47,582,045,557元，较2021年12月31日的净资本人民币48,228,680,303元，下降1.34%。报告期内，母公司净资本等各项风险控制指标均符合监管要求。

单位：元 币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
核心净资本	31,721,363,705	32,528,680,303
附属净资本	15,860,681,852	15,700,000,000
净资本	47,582,045,557	48,228,680,303
净资产	71,736,708,353	66,656,606,220
各项风险资本准备之和	29,222,365,246	31,807,971,527
风险覆盖率(%)	162.83	151.62
资本杠杆率(%)	11.73	12.81
流动性覆盖率(%)	497.48	316.68
净稳定资金率(%)	149.92	136.45
净资本/净资产(%)	66.33	72.35
净资本/负债(%)	17.82	19.67
净资产/负债(%)	26.86	27.19
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	43.24	58.01
自营非权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	347.00	306.44

# 会计数据及财务指标摘要

## 四、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额
非流动资产处置收益	1,434,630
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	119,726,176
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	(16,783,281)
其他符合非经常性损益定义的损益项目	(122,676)
归属于少数股东的非经常性损益的影响额	(643,677)
所得税影响额	(26,033,985)
<b>合计</b>	<b>77,577,187</b>

## 五、采用公允价值计量的项目

单位：元 币种：人民币

项目名称	2022年6月30日	2021年12月31日	当期变动	对当期利润的影响金额
交易性金融资产	296,686,462,225	301,174,215,104	(4,487,752,879)	(12,484,874,581)
交易性金融负债	(42,543,566,051)	(38,926,786,684)	(3,616,779,367)	5,023,851,106
其他债权投资	47,955,748,059	43,009,969,681	4,945,778,378	686,611,729
衍生金融工具	6,076,673,057	(3,569,778,845)	9,646,451,902	12,616,096,790
<b>合计</b>	<b>308,175,317,290</b>	<b>301,687,619,256</b>	<b>6,487,698,034</b>	<b>5,841,685,044</b>

# 管理层讨论与分析

## 一、企业战略与经营

### 市场环境

中国2022年上半年经受住了疫情反弹的考验，经济保持正增长。年初以来，国际环境更趋复杂严峻，国内疫情多发散发，不利影响明显加大。在此背景下，中国政府加强防控能力建设，及时完善防控措施，取得了积极成效。同时，中国政府高效统筹疫情防控和经济社会发展，加大宏观政策调节力度，有效实施稳经济一揽子政策措施，二季度经济顶住压力实现正增长，上半年国内生产总值同比增长2.5%。

宏观政策将着力巩固经济复苏基础。5月主要经济指标跌幅收窄，6月经济企稳回升，但发展环境中的不确定因素仍然较多。5月以来，中国政府靠前实施中央经济工作会议和《政府工作报告》政策举措，推出稳经济33条一揽子政策措施等，召开全国电视电话会议部署稳住经济大盘工作。稳经济一揽子政策仍有较大的实施空间，宏观政策大概率将保持延续性，继续支持经济复苏。

经济转型升级继续有力推进，新动能保持较快增长。今年上半年，规模以上高技术制造业保持快速发展，增加值同比增长9.6%，增速比全部规模以上工业增加值高6.2个百分点。高技术产业投资同比增长20.2%，比全国固定资产投资增速高14.1个百分点，成为推动经济结构转型升级的重要驱动力。与此同时，绿色转型持续推进，今年上半年，清洁能源消费占能源消费总量的比重同比提高1.3个百分点，新能源汽车、太阳能电池产量同比分别增长111.2%和31.8%。

2022年中国资本市场改革重点在于“注册制”与“开放”。“全面实行股票发行注册制”写入2022年两会政府工作报告，标志着继科创板和创业板注册制试验相继取得成功后，A股注册制改革将迎来最后的攻坚，也将成为资本市场发行制度改革的又一里程碑。对外开放

方面，2022年中国证监会发布《境外证券交易所互联互通存托凭证业务监管规定》，将原有“沪伦通”进行了双向扩容，标志着中国资本市场“走出去”和“引进来”的双向开放新进展。此外中国证监会及香港证监会同意两地交易所将符合条件的ETF纳入互联互通，不仅为外资投资中国资本市场提供更多便利，同时也促进两地资本市场相互融合以及中国资本市场进一步开放。

2022年中国资本市场在全球具备相对韧性。2022年年初中国的“稳增长”遭遇国内疫情以及海外地缘风险的供给冲击，中国市场出现大幅波动；但是在中外周期错位，“内滞外胀”和“内松外紧”的大环境下，中国市场整体跑赢海外并呈现出相对韧性。上半年在全球市场表现不佳的背景下，国内和海外机构的资金流向也较为波动。国内方面，2022年上半年公募基金新增份额1.4万亿份，较2021年同期有所回落，私募基金证券管理规模也较2021年末有所下降；海外方面，尽管年初内外风险导致互联互通北向资金一度净流出，但随着中国市场逐渐在基本面、估值和政策环境具备相对吸引力，北向资金明显回流中国市场，2022年上半年累计净流入人民币545亿元。随着更多稳增长政策落地支持中国经济基本面重新向好，中国市场仍是全球成长机遇最好的市场之一，也有望成为海外资金的避风港，中国资本市场“机构化、国际化”趋势仍将踏浪前行。

金融服务实体经济质效不断提升。持续加强存款利率监管，着力稳定银行负债成本；2022年6月新发放企业贷款利率为4.2%，比上年同期降低34个基点，企业综合融资成本稳中有降；2022年6月末普惠小微贷款余额同比增长23.8%，比各项贷款增速高13个百分点，普惠小微授信户数达5,239万户，同比增长36.8%，对中小微企业支持力度进一步提高。截至6月末，制造业中长期贷款余额同比增长29.7%，碳减排支持工具累计发放人民币1,827亿元，已带动减少碳排放超过6,000万吨，金融对重点领域的支持进一步加大。



# 管理层讨论与分析

打好防范化解重大金融风险攻坚战已取得重要成果。高风险集团风险稳妥处置，存量高风险机构持续压降，2021年四季度央行评级结果显示，当前99%的银行业资产处在安全边界内，绝大部分中小银行的央行评级处于安全边界内；维护金融稳定的长效机制持续建立，《金融稳定法（征求意见稿）》已于4月公开征求意见，金融稳定保障基金设立以用于化解具有系统性影响的重大金融风险，我国金融安全网得到了进一步筑牢。

## 证券行业格局

2022年上半年境内外资本市场呈现波动的背景下，证券行业盈利有所回落、头部综合券商更具韧性。今年上半年沪深300指数下跌9.2%、创业板指数下跌15.4%、恒生指数下跌6.6%，A股股票日均成交额同比增长7.4%至人民币9,760亿元，融资融券期末余额较年初下滑12.5%至人民币1.6万亿元；市场主要指数回调使得券商投资相关业务表现承压，对行业整体盈利造成一定拖累。从各业务线表现来看，考虑市场成交额同比小幅增长、行业佣金率边际仍有下行以及财富管理转型有序推进的综合影响，预计行业经纪业务收入表现平稳；注册制改革及多层次资本市场建设持续深化下，今年上半年IPO融资额同比增长明显，有望带动投行业务收入同比提升；券商资管主动管理占比持续提升、公募基金管理规模同比增长或使得资管业务收入表现稳健；市场指数调整使得方向性股票自营及跟投收入回落较大，同时客需驱动的资本中介类业务活跃度有所降低，整体投资相关收入上半年表现承压。整体而言，方向性投资敞口较低、综合客户服务能力领先的头部公司业务表现更具韧性。

资本市场改革持续深化、证券行业转型发展加快，行业集中度提升与专业化、特色化发展并举。2022年政府工作报告提出“全面实行股票发行注册制，促进资本市场平稳健康发展”、中国证监会2022年系统工作会议

强调“以全面实行股票发行注册制为主线，深入推进资本市场改革”，市场改革深化为证券行业的高质量发展提供土壤。行业正由传统的“通道+自营”为主的业务结构向“以客户为中心”的综合服务模式转型，依托于零售客户、企业客户以及机构客户日益丰富的需求，推动财富管理和主动资管业务的转型，大投行业务的扩容及资本化发展，自营业务转向基于客户需求的资本中介业务等，并通过各业务线协同作战以及数字化赋能提升综合金融服务能力。我们认为，行业转型发展的过程中，头部券商凭借其在资本实力、业务能力、合规风控水平、品牌形象、文化建设等多方面的综合竞争优势，将带动行业集中度持续提升，并形成专业化、差异化、特色化发展的行业格局。

更高水平推进金融双向开放，打造中资国际一流投行。中国金融业全面扩大开放的背景下，国际投行加速布局中国，并重点布局跨境并购、跨境融资、资产管理、财富管理等业务，与中资投行在资本实力、人才与专业能力、系统与资源网络等方面比拼实力，中资投行面临来自国际投行的激烈竞争；以开放促改革，推进行业竞争力提升及格局优化。同时，在国家实施供给侧改革、倡议“一带一路”建设等战略的背景下，国内产业和金融投资“走出去”步伐加快，双向跨境资本流动日趋频繁，对高端、复杂、跨境服务的需求不断增长。加快打造具有影响力、竞争力的国际一流投行对于配合国家战略、服务实体经济、提高直接融资比重、坚持改革开放、提升中国的国际影响力等具有重要战略意义。

## 发展战略

展望未来，中国经济与资本市场新一轮深化改革开放，为中金公司实现跨越式发展提供了难得的历史性机遇，公司将着眼中长期发展，着力提升市场份额、扩大收入规模，加速向国际一流投资银行迈进。

# 管理层讨论与分析

## 经营计划

2022年是中金公司深化战略落实和数字化转型的关键之年，公司将以推进落实“数字化、区域化、国际化”和“中金一家”的“三化一家”战略部署为重点，加大资源投入、完善网络布局、加快转型发展、夯实中后台能力，力争规模体量和高质量发展再上新台阶。

## 二、核心竞争力分析

### (一) 优良的品牌形象

公司在金融服务行业树立了优良的品牌形象。自设立之初，公司即借鉴国际一流投资银行的先进管理模式，并结合本土最佳实践，秉承“以人为本、以国为怀、勤奋专业、积极进取、客户至上、至诚至信”的经营理念，在境内外赢得了稳固的市场声誉。多年来，公司在维持高标准执业的同时，积极参与资本市场改革和制度建设，激发业务创新活力，多项业务连续多年处于领先地位、摘得“中国最佳”桂冠。

品牌培育和文化建设是公司持续强化市场领先地位的重要举措。公司良好的品牌声誉和专业进取、精益求精的核心价值观，使得公司在保持现有员工和客户稳定的基础上，能够不断汇聚优秀人才、吸引新客户，拓展业务范围并赢得重要商机。

### (二) 高质量的客户基础

公司拥有高质量、广泛深厚的客户基础。公司凭借优良的服务质量和专业的服务能力，形成了深厚的客户积累，广泛覆盖在国民经济和资本市场中发挥重要作用的大型企业、优秀的成长企业、专业的机构客户与持续增长的财富客户。公司通过提供综合、定制化、跨境服务，满足客户复杂多样、高质量的业务服务需求。公司与客户建立长期合作，并致力为其提供全面的产品和服务。

### (三) 具有前瞻性且发展均衡的业务布局

公司凭借对全球资本市场发展动态的敏锐洞察，前瞻性地布局各项业务。近年来资本市场的国际化、机构化进程持续加速，大量传统通道性业务面临巨大压力。对此，公司围绕“机构化”、“国际化”、“产品化”持续进行能力建设，提早布局新赛道，紧密围绕科技创新、绿色发展等国家重点部署领域，推动以科创板业务、私募股权业务及财富管理业务为代表的新兴业务持续发展。

### (四) 突出的跨境业务能力

凭借独特的国际化基因和较早的国际化布局，公司形成了突出的跨境业务能力，具有领先的跨境业务市场地位，较好发挥了服务跨境资本往来、推动金融市场双向开放的积极作用。

国际布局方面，公司建立了覆盖中国香港、纽约、伦敦、新加坡、旧金山、法兰克福和东京七个金融中心在内的国际网络，按照业务线条垂直统一管理，能够充分调动境内外的研究、团队、产品等资源，为客户提供一站式的跨境服务。公司境内外业务无缝衔接，团队同时具备境内和境外业务经验，公司绝大多数的投资银行及研究团队成员拥有国内及海外若干地区的从业资格。

跨境业务方面，公司长期服务于产业资本、金融资本的“引进来”、“走出去”，在中资企业境外IPO、境外债发行、跨境并购等领域取得了一定优势地位，在跨境交易、互联互通等新兴领域保持良好发展势头，沪港通、深港通交易额市场领先，在国际资本市场赢得更多话语权和定价权。此外，公司通过收购美国金瑞基金等举措，不断延展跨境业务能力。2021年，公司基于对国际形势的研判，同时结合公司自身战略需要，进一步坚定推进国际业务布局，制定了发展路线图。



# 管理层讨论与分析

## (五) 领先和具有影响力的研究

研究是公司业务的重要基础。公司拥有一支专业、富有才干和经验丰富的研究团队，通过覆盖全球市场的研究平台为境内外客户提供客观、独立、严谨和专业的研究服务。公司研究团队对中国企业和各行各业深入的了解、透彻的分析和独特的见解为公司赢得了“中国专家”的声誉。

公司的研究能力获得具有国际影响力机构的广泛认可。公司于2006年至2021年连续十六年被《亚洲货币》评为“最佳中国研究(第一名)”;公司亦于2012年至2021年连续十年被《机构投资者》授予“大中华区最佳分析师团队奖(第一名)”。2020年,公司设立中金研究院,专注于公共政策研究,致力于打造新时代的新型智库。中金研究院与研究部双轮驱动,为促进经济发展和社会发展提供全方位的研究支持。

## (六) 优秀的管理层和高素质的员工队伍

公司拥有具备全球视角、勇于开拓的高级管理团队,拥有遍布境内外、具备全牌照执业能力的优质员工队伍。

公司高级管理团队成员大多来自于知名的境内外金融机构,具备全球化的视角;同时,公司高级管理团队成员均经历了我国证券行业发展的主要阶段和多个周期,对于境内外资本市场及证券行业有着丰富的经验和深刻的理解。公司高级管理团队始终秉承“植根中国,融通世界”的理念,不断将先进的管理经验与我国的金融改革实践相结合,勇于率先开发新产品,敢于大力开拓新市场。

凭借着卓越的品牌和优质的平台带来的号召力,公司吸引了来自境内外知名大学的优秀毕业生,

为公司境内外的分支机构源源不断地补充最优质的人才。凭借着完善的员工培养和培训体系,公司为不同层级、不同岗位的员工提供全方位、系统性的培训,能够持续提升员工专业能力,赋予员工全牌照执业能力。同时,公司借鉴国际经验,建立了先进的人才选拔和培育机制,辅以市场化的激励体制,为公司长期可持续发展储备了大批优秀的人才。通过上述措施打造的优质员工队伍,是公司保持快速、健康、稳健发展的基础保障。

## (七) 高效的管理模式和审慎的风险管理机制

公司拥有高效、合理的管理模式和全面、审慎的风险管理机制。公司从设立之初,就秉承将国际最佳实践与我国实际情况相结合的理念,构建起了一整套与国际标准接轨的治理架构和管理流程,从而建立起覆盖公司全部业务经营及内部控制的垂直管理模式,确保管理的高效、合理。同时,公司始终坚持并不断夯实“全员、全程、全覆盖、穿透式”的风控合规体系和运行机制,实现了母公司对境内外子公司及分支机构的一体化垂直管理,以及对集团内同一业务、同一客户的统一风险管控,确保公司可形成集中、有效的业务管理和风控支持效应,统一决策、管理和调度资源,保障了业务的平稳有序开展和风控体系的稳健运行。

## (八) 先进的信息技术能力

公司视信息技术为公司竞争力的核心组成部分。公司具有完善的信息技术管理架构和业界领先的自主研发能力。公司构建的基础交易、产品和服务、风控和运营管理三大基础技术体系,能够为客户及各业务部门提供全流程、端到端的复杂金融产品服务,以及全球范围内全方位的业务运营和管理能力支持。公司采用先进技术自主研发的核心业务系统及平台,稳健运营、业内领先。



# 管理层讨论与分析

公司将以信息技术为基础持续推动业务发展。近年来，随着信息技术的不断进步，公司亦加大资本投入、重视人才培养和能力建设，持续优化组织架构和运作模式，积极研究并探索新技术在投资银行各业务领域的应用，促进业务和技术融合。公司充分抓住中国金融科技蓬勃发展的优势条件，积极与中国领先的科技企业开展战略合作，以数据和技术拓展新产品、新业务、新模式。2020年，公司启动数字化转型，致力于打造“最具有互联网基因的国际一流投资银行”。

## 三、主营业务情况分析

本公司的投资银行业务主要为境内外企业和机构客户提供股权融资、债务及结构化融资和财务顾问等投资银行服务，具体包括境内外首次公开发行股票并上市的保荐与承销，境内外上市公司再融资的保荐与承销，境内外各类固定收益融资工具的承销，企业并购重组、战略入股、上市公司私有化以及分立等交易的财务顾问服务。

本公司的股票业务主要为境内外专业投资者提供“投研、销售、交易、产品、跨境”的一站式股票业务综合金融服务，具体主要包括机构交易服务和资本业务等，其中资本业务主要包括为专业投资者提供主经纪商、场外衍生品、资本引荐、做市交易等多种创新产品及资本服务。

本公司的固定收益业务主要为境内外企业和机构客户提供固定收益类、大宗商品类和外汇类证券及衍生品的销售、交易、研究、咨询和产品开发等一体化综合服务，具体包括利率业务、信用业务、结构化业务（含证券化产品和非标产品等）、外汇业务、大宗商品业务（含期货业务）等。

本公司的资产管理业务牌照齐全、产品丰富，参照国际行业标准与国内监管要求，构建了面向境内外市场统一的资产管理业务平台，主要为境内外投资者设计及提供多元化的资产管理产品及服务，包括社保及年金投资管理业务、机构委托投资管理业务、境外资产管理业务、零售及公募基金业务等。

本公司的私募股权业务服务于境内外投资者，为其设计及提供一体化的私募股权投资基金产品及服务，主要包括企业股权投资基金、母基金、美元基金、实物资产基金、基础设施基金等。通过本公司的私募基金子公司统一管理境内外私募股权投资基金业务，投资于具有长期增长潜力、核心竞争力和优秀管理团队的高品质企业。

本公司的财富管理业务主要为个人、家族及企业客户提供范围广泛的财富管理产品及服务，满足客户的交易、投资和资产配置需求，具体包括交易服务、资本服务、产品配置服务等，其中资本服务主要包括融资融券业务及股票质押式回购业务等。

本公司的研究业务主要通过为境内外客户提供客观、独立、严谨和专业的研究服务，支持公司各项业务发展。2020年，公司设立中金研究院，专注于公共政策研究，致力于打造新时代的新型智库。

# 管理层讨论与分析

## (一) 投资银行

### 股权融资

#### 市场环境

2022年上半年，A股IPO共完成176单，融资规模人民币2,600.76亿元，同比增加19.0%；A股再融资共完成121单，融资规模人民币2,670.29亿元，同比下降12.3%。

港股一级市场方面，港股IPO共完成27单，融资规模26.87亿美元，同比下降91.2%；港股再融资和减持共完成79单，交易规模55.08亿美元，同比下降90.1%。

美股一级市场方面，中资企业美股IPO共完成5单，融资规模1.48亿美元，同比下降98.9%。中资企业美股再融资和减持共完成11单，交易规模2.07亿美元，同比下降96.7%。

#### 经营举措及业绩

2022年上半年，本公司作为主承销商完成了A股IPO项目14单，主承销金额人民币222.25亿元，牵头完成了包括中一科技、凌云光在内的A股

IPO项目。本公司作为主承销商完成A股再融资项目21单，主承销金额人民币480.66亿元，市场排名第一，完成了东方证券配股、大全能源非公开发行等标杆项目。

2022年上半年，本公司作为保荐人主承销港股IPO项目9单，主承销规模6.44亿美元，完成汇通达、法拉帝等项目，市场排名第一；作为全球协调人主承销港股IPO项目12单，主承销规模5.77亿美元，市场排名第一；作为账簿管理人主承销港股IPO项目12单，主承销规模2.27亿美元，市场排名第二。本公司作为账簿管理人主承销港股再融资及减持项目6单，主承销规模3.18亿美元。

2022年上半年，我们围绕党中央重大决策部署，多措并举助力稳经济大盘，不断增强服务实体经济的能力。支持国家科技自强，参与科创板、创业板IPO融资规模超人民币170亿元，包括中复神鹰科创板IPO、仁度生物科创板IPO、万凯新材创业板IPO等项目。保双链畅通稳定，完成东微半导体科创板IPO、沪硅产业A股非公开发行等项目，交易规模超人民币980亿元。服务能源企业融资，完成中国海油A股IPO、石化机械A股非公开发行等项目，交易规模近人民币300亿元。

# 管理层讨论与分析

项目	2022年1-6月		2021年1-6月	
	主承销金额 (人民币百万元)	发行数量	主承销金额 (人民币百万元)	发行数量
A股				
首次公开发行	22,225	14	11,576	8
再融资发行	48,066	21	35,078	14

项目	2022年1-6月		2021年1-6月	
	主承销金额 (百万美元)	发行数量	主承销金额 (百万美元)	发行数量
港股				
首次公开发行	227	12	1,966	15
再融资发行	318	6	2,703	12

数据来源：公司统计，A股市场为万得资讯，境外市场为Dealogic数据库。

注：境内再融资包括定向增发、公开增发和配股；港股再融资包括增发、配股和大宗减持交易。

## 2022年下半年展望

2022年下半年，本公司将持续发挥专业优势，聚焦服务实体经济、防控金融风险、深化金融改革三项任务，在服务国家发展大局中推动投行业务高质量发展；我们将把握全面注册制改革和境内外市场互联互通等带来的机遇，加大客户覆盖广度和深度，提高项目储备数量；充分利用自身市场经验，助力全面注册制改革平稳落地；深耕区域战略，支持粤港澳大湾区、长三角一体化等重点区域实体经济融资；助推资本市场高水平开放，把握GDR等业务机会，不断提升国际业务能力。



# 管理层讨论与分析

## 债务及结构化融资

### 市场环境

2022年上半年，境内方面，受到疫情等因素冲击，货币政策偏向宽松，加大实体经济支持力度。利率债短端收益率下行，长端收益率走势呈现区间震荡态势。上半年信用债发行规模约人民币9.10万亿元，同比下降3.3%，其中资产证券化产品发行规模为人民币0.96万亿元，同比下降32.6%。上半年地方政府债发行规模为人民币5.25万亿元，同比增长57.1%。境外方面，受美联储加息及通胀预期的持续升温影响，利率水平上行。中资企业境外债市场发行规模较去年明显回落，中长期债券发行规模为682.61亿美元，同比下降37.4%。

### 经营举措及业绩

2022年上半年，中金公司境内债券承销规模为人民币4,947.42亿元；境外债券承销规模为36.87亿美元。

2022年上半年，中金公司债务及结构化融资业务在严格控制风险底线的基础上，以服务实体经济为目标，在服务国家科技自强、支持国家双碳战略、助力乡村振兴等方面取得了突出成绩。2022年上半年，中金公司境内债券承销规模排名行业第四、利率债承销规模排名行业第三、资产支持证券承销规模排名行业第三。境外方面，中金公司中资企业境外债承销规模排名中资券商第一，细分领域中，境外ESG债券市场份额显著提升，

承销规模排名中资券商第一，并连续超过6年保持中资企业投资级美元债承销规模中资券商第一。

2022年上半年，公司完成诸多代表性项目及产品创新。科技创新债券领域，公司协助小米通讯完成全国首单智慧制造产业科技创新公司债券发行，协助广州港股份完成全国首单“一带一路科技创新”公司债、暨上交所首批科创公司债发行，协助深圳高新投小贷完成全国首单科技创新ABS发行，协助国新控股完成交易所首单数字经济科技创新永续期公司债发行；绿色债券领域，公司协助中节能股份完成全国首单“碳中和”+“乡村振兴”双贴标公司债发行，协助招商银行完成全国首单乡村振兴主题绿色金融债发行，协助中国金茂完成全国首单碳中和写字楼类REITs发行，协助华能集团完成交易所首单低碳转型挂钩债券发行；此外，公司协助华能天成发行全国首单民营经济发展支持债，协助东方资管完成全国首单AMC房地产风险化解及处置主题金融债发行，协助新开发银行完成迄今为止超主权机构最大发行规模的熊猫债券发行。在境外方面，中金公司协助德清文旅完成上海自贸区人民币债券发行，协助济南能源完成由澳门中央证券托管系统(MCSD)结算的莲花债发行，协助信银国际完成其他一级资本补充工具(AT1)次级永续债发行，协助东亚银行完成非优先损失吸收票据发行；ESG债券领域，协助山东高速、湖北联投、杭州水务等企业完成境外绿色债券发行，协助甘肃公航旅集团完成境外可持续债券发行。

# 管理层讨论与分析

## 2022年下半年展望

2022年下半年，本公司将紧紧围绕服务国家及区域经济发展目标，在政策引导领域继续加大投入，敏捷应对市场变化，积极把握市场机遇；响应稳住经济大盘的系列政策、支持实体经济扩大有效投资，在保障产业链供应链、中小微企业融资、助力乡村振兴和促进低碳转型方面持续开展债券承销业务；国际业务中积极拓宽全球覆盖网络，利用中金跨境平台优势，为企业提供定制化融资和风险管理方案；持续打造并完善全周期服务链条，积极开拓债务管理与信用修复业务机会。此外，本公司也将进一步强化风险防控意识，全面提高固收业务承揽质量，增强项目甄别和执行能力。

## 财务顾问服务

### 市场环境

根据Dealogic数据，2022年上半年，中国并购市场共公告并购交易1,452宗，合计交易规模约1,991.92亿美元，同比下降26.8%。其中：境内并购交易1,282宗，交易规模约1,723.60亿美元，同比下降25.7%；跨境并购交易170宗，交易规模约268.32亿美元，同比下降33.5%。

## 经营举措及业绩

根据Dealogic数据，2022年上半年，中金公司并购业务继续位列中国并购市场第一，保持领先地位。2022年上半年，本公司已公告并购交易49宗，涉及交易总额约667.88亿美元，其中境内并购交易42宗，涉及交易总额约638.31亿美元，跨境及境外并购交易7宗，涉及交易总额约29.57亿美元。

2022年上半年，并购业务紧密围绕国家战略布局，助力深化国企改革、稳市场主体、促进交运基建投资，公告江西国控整合四家省属企业、中原银行吸收合并三家区域性城商行、中国国航收购山航集团控制权并触发对山航B强制要约、厦门港务私有化等项目；持续推动高科技、新经济及市场化并购交易，公告长飞光纤收购博创科技、立讯精密收购汇聚科技等项目；保持跨境、港股及美股市场领先优势，公告英飞特收购欧司朗数字系统事业部、飞利浦战略投资创业惠康、中国宏泰发展港股私有化、耀世星辉美股私有化等项目；助力政府和企业化解风险，保障职工就业，牵头完成紫光集团债务重组、青海省投资集团债务重组、盛京能源债务重组、新楚风汽车债务重组等项目。



# 管理层讨论与分析

2022年上半年公告/完成的标志性项目包括：

项目	规模	亮点
江西国控整合江西交投、江铜集团、江西水投及江西铁航四家省属企业	395亿美元	服务地方国企改革，做优做强做大江西省属国有资本运营平台，助力中部地区开创高质量发展新格局，是江西地区近十年来总规模最大的交易
中原银行吸收合并三家区域性城商行	45亿美元	服务河南地区区域化整合标杆项目，打造万亿规模城商行，近十年来港股上市金融企业规模最大的对外收购交易
中国电力收购国家电投集团新能源资产	11亿美元	积极响应“双碳”政策，推动优质新能源发电资产上市，加快落实清洁能源战略发展目标
立讯精密收购汇聚科技控股权并触发强制要约	3亿美元	大湾区高端制造行业龙头产业并购实现战略布局，A股上市公司市场化收购整合港股上市公司代表性交易
长飞光纤收购博创科技	2亿美元	横跨沪港深三地、同时涉及3家A股上市公司的控制权转让交易，实现光器件领域强强联合
飞利浦战略投资创业惠康	2亿美元	近五年来首单外资跨国企业战略投资A股医疗健康产业上市公司交易
中国国航收购山航集团控制权并触发对山航B强制要约	尚未披露	响应六稳六保战略，落实民航业纾困，深化央地合作，首单以退市为目的的B股要约收购
紫光集团债务重组项目	1,507亿元人民币	有史以来中国最大规模的半导体产业债务重组交易，涉及多个战略性新兴产业，引入资金600亿元人民币
青海省投资集团债务重组项目	641亿元人民币	助力地方国企化解风险，把握市场窗口，挖掘资产价值，引入战略投资者，助力区域产业发展，妥善安置职工就业
盛京能源债务重组项目	128亿元人民币	我国供暖行业最大规模债务重组交易，深化服务东北地区国资国企改革、化解风险、助力东北振兴，保障地方基本民生
新楚风汽车债务重组项目	40亿元人民币	中金公司担任债务重组管理人完成的首单交易，深化服务地方政府，实现产业转型升级与新旧动能转化，支持“双碳”发展

注：债务重组项目规模均为涉及债务规模



# 管理层讨论与分析

## 2022年下半年展望

2022年下半年，本公司将继续把握在不断变动的宏观经济与境内外资本市场趋势中蕴含的并购业务机会，助力实体经济高质量发展与境内外资本市场互联互通，加强区域布局，争取进一步提高市场份额。

## (二) 股票业务

### 市场环境

2022年上半年，全球股市在地缘冲突与货币环境变化的扰动下剧烈波动，整体走势较弱，全球股票市场主要指数均呈现下行趋势。A股市场震荡调整，活跃度较去年同期有所提升。截至上半年，上证综指较年初下跌6.6%、深证成指下跌13.2%，创业板指下跌15.4%；恒生指数下跌6.6%，恒生中国企业指数下跌6.9%，恒生科技指数下跌14.1%。2022年上半年，A股日均交易额人民币9,760亿元，同比上升7.4%；港股市场日均交易额1,382.63亿港元，同比下降26.5%<sup>1</sup>；沪深港通北向净流入人民币717.99亿元，南向净流入2,076.32亿港元。

### 经营举措及业绩

2022年上半年，公司继续推动股票业务高质量发展，机构覆盖、创新产品、跨境业务排名保持市场前列。

积极推动“机构化”。深耕机构客群，以客户为中心，全面覆盖多元客群，为境内外机构投资者提供“投研、销售、交易、产品、跨境”等一站式综合金融服务。2022年上半年，新开户数量持续增长，经纪业务交易额和市场份额保持高位；QFII交易佣金分仓市场份额约55%，客户覆盖率连续

19年排名市场首位；公募及保险客户投研服务能力持续提升，市场排名居前；重点私募客群全面覆盖，外资私募(WFOE)客群覆盖率市场排名领先；与银行理财子公司构建全方位合作，多家银行客户投研排名第一。

深入推进“产品化”。作为衍生品核心交易商，境内产品业务持续提升全生命周期产品服务能力，保持市场优势地位，深化产品创新，积极落实国家战略，加强支持区域发展、绿色金融、科技创新等方面的产品布局，推出中金低碳领先指数、中金战略硬科技指数等。境外产品业务不断丰富产品及客户结构，形成具有国际竞争力的产品线，在境外中资券商中名列前茅。资本引荐业务品牌效应逐步显现。

持续拓展“国际化”。加大国际布局力度，中金国际跨境业务持续领先，为客户提供一流的全球资本市场服务，互联互通交易份额保持市场前列；中金(新加坡)交易平台已正式展业；中金(美国)在当地市场进一步确立中资机构领导地位；中金(英国)成为广大欧洲机构客户的主要中资券商合作伙伴，并成为首家互联互通机制全枢纽交易所(英国、德国、瑞士)布局的中资公司。境外团队配合执行20余个一级、二级市场项目，为上市公司引入境外战略、基石投资者，积极吸引长线资金入市。

持续发挥中控平台功能，以客户为中心，提升运营效率。2022年上半年未发生重大风险事件，持续筑牢部门合规风险防线，形成全链条全覆盖的风险管控体系，保障股票业务发展行稳致远；加快构建平台化开放生态服务体系，拓展数智能力，打造数据资产，实现科技赋能。

<sup>1</sup> 港股日均交易额数据源自香港联交所，数据包含权证。

# 管理层讨论与分析

## 2022年下半年展望

本公司将依托领先的国际布局和坚实的客户基础，大力推进跨部门交叉销售，在波动的市场环境中坚持稳健经营，进一步打造全球领先、跨境联通、一站服务的股票业务平台。持续完善业务系统，提升运营管理效率和客户体验，强化风险管理能力，牢牢守住不发生重大风险的底线，努力为客户创造更大价值。

## (三) 固定收益

### 市场环境

2022年上半年疫情反复以及地缘政治冲突等因素增加了全球宏观经济的不确定性，全球利率和汇率波动加剧。境内债券市场以我为主，表现出一定韧性；海外债券市场受美债带动普遍走弱。境内市场年初在经济下行压力增加和较强的降准降息预期下，收益率走出上半年最大下行波段，1月底下探至低点，后随着稳增长政策、美联储加息缩表进度超预期等因素影响，收益率上行至年初水平。4月起受国内疫情反复等因素影响，持续下行。6月随疫情恢复及复产复工政策市场收益率整体上行。境外市场中资美元债上半年受美联储加息影响，整体震荡走弱，信用利差受到地缘政治等事件引发的避险情绪影响震荡走阔。跨境投融资方面，由于美债利率上行导致中美利差倒挂，2022年上半年境外机构对我国债券的持有规模小幅下降。2022年上半年，银行间市场现券交易总量达人民币80.1万亿元，其中债券通业务累计交易量达人民币3.8万亿元，同比上升21.5%。

## 经营举措及业绩

2022年上半年，固定收益业务以客户为中心，做大做强市场规模，债券承销和交易量持续快速增长，保持市场领先地位。保持中资美元债承销全市场第一，记账式国债承销团成员国债现货交易量全市场第一；不断加强国际业务客户覆盖和交易服务能力，以境内和香港为双中心，搭建纽约、伦敦、新加坡、东京等地的全球化销售网络，跨境结算量持续增加。

积极把握机遇，加强产品创新和客户服务，持续发展衍生品业务。持续布局公募REITs、碳交易、绿色金融、专精特新等领域，积极把握市场机会；加强境内外产品创新，实现诸多创新业务落地，打造定制化服务能力；持续发展跨境衍生品业务，拓展利率和外汇业务范围，大宗商品做市重点品种排名市场前列。

大力推进业务和科技的融合，积极探索前沿金融科技创新，持续加强风控能力和运营体系建设。

## 2022年下半年展望

2022年下半年，公司将继续推进固定收益业务的战略转型，继续提升综合客户服务能力，打造跨国界、跨市场、跨平台的一流固收产品做市平台，持续扩大影响力。继续提升做市交易能力，持续优化风控体系，加强风险控制，争取实现较好的回报；进一步加强产品定制化创设能力，持续推动产品创新，提升服务实体经济能力，构建全产品、一站式客户服务平台；提高跨境业务能力，深化国内国际双循环联动，提速国际业务布局；继续推进数字化转型，加强数字经济能力建设，着力打造一流的FICC金融科技平台。



# 管理层讨论与分析

## (四) 资产管理

### 资产管理

#### 市场环境

2022年是资管新规正式实施的元年，资管行业在经历转型后提速换挡，正逐步迈入高质量发展新阶段。新规规范下，资管行业总体规模稳步攀升，结构持续优化，资金来源日趋多元，产品供给不断丰富，净值化转型取得阶段性成果，行业新格局、新生态逐步确立。与此同时，经济发展环境复杂性的提升也向行业提出了更高要求，新形势下，资管机构应聚焦主责主业、强化责任担当，履行支持实体经济转型、助稳全国经济大盘的使命，把握好财富管理、养老三支柱等历史性机遇，锻造差异化核心竞争力，积极探寻新的业务发展方向及战略布局，打造创新优质的产品谱系，并严守金融风险。

#### 经营举措及业绩

2022年，公司持续丰富产品线，加强普惠金融、绿色金融、科技创新等方面的产品布局，结合市场环境、围绕客户需求加大力度研发创新策略、创新产品及综合解决方案，客户综合服务能力不断加强；进一步强化投研能力建设，改进投研管理体系，加强团队建设与人才培养，提升投资研究能力；进一步加强客户覆盖，延伸客户服务深度和广度，加大央企、行业性客户年金业务开发及维护力度，深挖银行理财子公司需求，大力开拓城农商行及企业客户投资管理业务，加强与零售渠道的深度合作，提升客户响应及增值服务能力，不断加强国际客户及海外中资机构覆盖，拓

展境外渠道。公司加快推动资产管理业务系统建设，上线资管产品生命周期管理系统，持续优化迭代机构服务平台、投研一体化平台和数据中台，加速金融科技转型，通过数字化服务增强客户黏性，助力业务发展。同时，公司全面加强风险管理能力建设，进一步提升全员合规意识，严守合规风控底线。

截至2022年6月30日，本公司资产管理部的业务规模为人民币8,248.51亿元。产品类别方面，集合资管计划和单一资管计划管理规模（含社保、企业年金、养老金及职业年金）分别为人民币3,145.61亿元和人民币5,102.90亿元，管理产品数量788只。

#### 2022年下半年展望

2022年下半年，公司将立足于助力实体经济的发展站位，把握行业重大发展机遇，大力推进常规业务发展与战略业务布局，践行新发展理念、推动高质量发展，加快打造紧扣时代脉搏、紧贴客户需求的国际一流资管机构。

2022年下半年，公司将持续夯实资管业务能力，积极提升服务居民财富管理需求、服务资本市场改革发展、服务实体经济与国家战略的能力，推进完善投研体系建设，持续优化产品布局，丰富产品种类，加强客户覆盖，推进金融科技建设，提升为各类客户提供综合性资管服务的能力，促进向更高附加值的业务模式转化。坚定对关键领域的战略投入，打造高质量发展新引擎。



# 管理层讨论与分析

## 中金基金

### 市场环境

2022年上半年，地缘冲突不断、通胀加剧，全球主要资本市场均出现较大幅度下跌，国内受新冠疫情反复袭扰，经济增长乏力，股票市场出现较大幅度调整。上半年公募基金行业规模增速放缓，新产品发行热度骤降。截至2022年5月末公募基金规模较上年末稍增至人民币26.3万亿元，上半年新发不足人民币7,000亿元，仅为去年同期四成。4月，中国证监会发布《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，多举措引导公募基金行业高质量发展。

### 经营举措及业绩

2022年上半年，中金基金继续着力投研核心能力建设，补充人才团队、提升研究覆盖与深度，强化投资风格定型。继续优化产品布局，积极参与行业创新。上半年新发公募产品6支，包括公司的首支FoF基金、同业存单指数基金等。业务总体运行平稳，无重大违法违规情况或重大合规风险隐患。

截至2022年6月30日，中金基金管理资产规模为人民币967.22亿元，较去年末增长人民币115.31亿元，增幅13.54%。其中，公募基金规模增长至人民币914.35亿元，较去年末增长12.46%。

### 2022年下半年展望

2022年下半年，中金基金继续聚焦投研队伍和能力建设，扎实积累产品业绩；围绕服务零售投资者财富管理需求的目标，积极探索中低波动型产品、合理让利型产品创新，加快权益类产品布局，构建多元化销售服务能力；积极推进公募REITs在执行项目，提升运营管理能力；继续加强合规风控管理，坚守不发生重大风险的底线。

## (五) 私募股权

### 市场环境

2022年上半年，受疫情反复和宏观环境影响，中国私募股权市场募资活跃度下降。同时，增量资金加速向头部管理机构聚集，市场募资结构分化趋势延续。随着监管政策鼓励机构投资者参与私募股权市场，未来保险资金、银行理财资金的活力有望得到进一步释放。在国家政策的支持下，中国私募股权投资行业的发展有效增加社会直接融资、加速促进创新资本形成、全面支持中国经济的高质量发展。

投资方面，2022年上半年，受俄乌冲突、国际金融与商品市场波动，以及国内疫情反复的影响，中国私募股权投资市场投资节奏整体放缓，投资机构风险偏好下降，对项目估值更为审慎。分行业来看，新能源、半导体、产业互联网等赛道是2022年上半年的投资热点，新兴行业生态蓬勃发展，优质项目受到投资人的青睐。随着近年来国家对“专精特新”中小企业的大力扶持，私募股权投资机构对早期科技创新类企业的支持力度也在稳步提升。

退出方面，随着注册制改革迈向高质量发展新阶段，中国私募股权市场的企业IPO退出渠道保持通畅。2022年上半年，受全球宏观环境波动影响，中国私募股权投资市场退出有所放缓。虽然中企赴美上市受阻，但香港联交所推进多项改革措施，使得港股市场吸引力进一步增强。同时，多项政策积极推动私募股权基金二手份额转让落地，为股权投资提供了新的退出渠道。

# 管理层讨论与分析

## 经营举措及业绩

截至2022年6月30日，中金资本管理部通过多种方式在管的资产规模达到人民币3,317亿元。2022年上半年，中金资本管理部围绕“科技创新”、“碳中和”等国家战略完成多支基金的募集，并运用综合型基金以及行业主题基金系统性布局科技创新、高端制造、生命健康、产业互联网和绿色环保等战略性新兴产业，多家被投资企业实现上市。

中金资本管理部秉承中金公司“以国为怀”的理念，引导和撬动大量社会资本，助力国家科技自强、绿色发展、区域协调发展、普惠金融等战略。中金资本管理部通过直投基金与母基金投向早中期和初创期的创新型企业，投资主题紧扣半导体、高新技术、大健康、碳中和等战略新兴产业，助力科技自强、产业优化升级和区域协调发展。同时，中金资本管理部以股权投资形式助力中小微企业解决融资难融资贵问题，支持中小微企业在不增加杠杆的前提下实现高质量发展。

在市场地位方面，中金资本管理部在私募股权投资行业龙头地位稳固，拥有强大的行业影响力。根据中国证券投资基金业协会数据，中金资本管理部月均实缴规模稳居券商私募子公司之首。从全私募股权市场来看，中金资本管理部在管认缴规模处于行业领先地位。从第三方机构评价来看，中金资本管理部多次获得清科、投中、全球母基金协会的奖项，市场影响力持续提升。

在赋能方面，中金资本管理部践行“双向赋能”，一方面以客户为中心，依托“中金一家”平台优势，为政府、产业集团、企业家提供多元服务；另一方面将投行思维与投资业务相结合，为被投资企业提供全生命周期的多样化赋能与支持。

## 2022年下半年展望

中金资本管理部将坚持服务国家“十四五”战略布局，聚焦中国创新前沿，支撑经济发展的新领域新赛道，助力我国形成国际竞争新优势，在更好地履行金融服务实体经济使命的同时，为投资者创造良好回报。中金资本管理部将继续坚持稳中求进的工作总基调，切实贯彻落实“三化一家”的整体部署，充分发挥自身优势，进一步提升市场影响力。

具体来看，一是强化与各级政府与产业集团等客户密切合作，围绕国家战略、围绕创新产业纵深布局，加速多支行业主题基金和区域性基金的落地和投资；二是继续推进美元旗舰基金的设立，调动平台资源，面向全球出资人推进合作，提升中金资本管理部的全球影响力；三是加强投后赋能，为出资人和被投资企业提供多元化、全生命周期的赋能与支持；四是着力做大做强基建基金，积极探索发展二手份额投资基金等新产品，实现产品矩阵的多元化；五是进一步推动系统建设，深度支持业务发展；六是持续推进跨部门合作，进一步加强部门间业务协同；七是牢牢守住不发生重大风险的底线。中金资本管理部将不断夯实自身组织能力建设，全力打造中国领先、具有国际影响力的综合性另类资产投资管理平台。



# 管理层讨论与分析

## 集团管理资产规模

截至2022年6月30日，集团各业务部门及子公司所管理的资产规模合计如下：

单位：人民币百万元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日	变动比例(%)
<b>与手续费及佣金收入相关的AUM(全资)</b>			
集合资管计划	319,116	572,635	(44.3)
单一资管计划	559,635	607,445	(7.9)
专项资管计划	164,279	171,963	(4.5)
公募基金	96,722	85,191	13.5
私募股权投资基金	244,816	220,737	10.9
<b>小计</b>	<b>1,384,568</b>	<b>1,657,972</b>	<b>(16.5)</b>
<b>与应占联营及合营企业利润相关的AUM(合资)</b>			
私募股权投资基金	100,907	121,067	(16.7)
非私募股权投资基金	95,827	86,666	10.6
<b>小计</b>	<b>196,734</b>	<b>207,733</b>	<b>(5.3)</b>
<b>合计</b>	<b>1,581,302</b>	<b>1,865,704</b>	<b>(15.2)</b>

注：公募基金包括中金基金管理的公募证券投资基金及私募资产管理计划。



# 管理层讨论与分析

## (六) 财富管理

### 市场环境

2022年上半年，在海外局势动荡、通胀持续高企冲击下，我国资本市场基本保持稳健发展。虽然受市场情绪影响，沪深股票成交金额人民币114.09万亿元，环比下降23.8%，但市场投资者稳定新增883.05万人，环比微升0.4%。此外，2022年资管新规全面落地，财富管理正式迈入净值化时代，公募基金规模突破人民币26.3万亿元。随着净值化转型步伐加快，财富管理行业逐步迎来高质量、高层次的发展。

### 经营举措及业绩

产品配置业务逆势进阶，聚焦供给侧改革升级买方投顾。买方投顾业务继2019年创新推出“中国50”、2021年推出“微50”后，2022年上半年“公募50”全新升级，从“投”与“顾”两端满足更广大普惠投资者的财富管理需求。2022年上半年，产品保有规模以及买方投顾类产品保有规模继续稳步提升，进一步巩固了公司在财富管理模式和规模上的领先地位。

客户规模稳定增长，聚焦普惠加大全渠道获客力度。2022年上半年，公司财富管理业务稳定增长，强调金融普惠性，“全渠道、多场景、数字化”获客模式见成效，财富管理客户数量达547万户，客户总资产达人民币2.70万亿元，新开户占市场新增投资者比例持续提高。

多渠道延揽人才，团队规模稳定增长。随着财富管理行业转型发展趋势快速发展，公司基于全国布局的超200余家营业网点提供各类就业机会。2022年继续吸纳财富管理投顾人才，投资经理梯队建设实现规模化、差异化增长，随团队规模持续扩张，人均产能稳中有升。

## 2022年下半年展望

展望下半年，在国内政策支持延续、宏观环境边际转好的背景下，资本市场将逐步回暖，为个人投资者财富管理提供了更大的市场空间。公司将继续在客户体验上聚焦全光谱客群，提升全渠道客户体验；在解决方案上，聚焦买方投顾与产品创新，稳步提升解决方案质量与效率；投顾规模上，吸纳市场优秀人才，持续建设财富管理人才队伍；在系统建设上，全面科技赋能，提升场景化创新服务能力。

## (七) 研究

公司研究团队关注全球市场，通过公司的全球机构及平台向国内及国际客户提供服务。公司的研究产品及投资分析涵盖宏观经济、市场策略、固定收益、金融工程、资产配置、股票、大宗商品及外汇。截至2022年6月30日，公司的研究团队由逾300名经验丰富的专业人士组成，覆盖40多个行业及在中国内地、香港特区、纽约、新加坡、法兰克福、伦敦及巴黎证券交易所上市的1,400余家公司。

中金研究部因为独立性、客观性及透彻性获得国内及国际投资者的认可。2022年上半年，公司共发表中外文研究报告9,000余篇。在大量的行业和公司报告基础之上，还发布了“2022年下半年展望”、“去金融化”、“元宇宙”、“物业行业观察”、“大消费赛道研究(第三季)”等专题报告合集，展现了公司对中国的深刻理解。正是基于在研究报告广度和深度上的双重优势，公司在客户中赢得了“中国专家”的声誉。2022年6月，成功举办为期一个月的线上“疫后经济重启与重构——中金公司2022年中期策略会”，获得机构客户广泛关注与一致好评。

## 管理层讨论与分析

中金研究院积极开展各项工作，全方位打造公共政策研究品牌及社会影响力。继2021年中金研究院联合研究部推出《碳中和经济学》中文书后，英文版《Guidebook to Carbon Neutrality in China》于2022年2月全球发布，仅4个月电子版下载量突破5万。2022年6月，举办“新发展阶段包容性增长论坛暨《迈向橄榄型社会》新书发布会”，重磅推出《迈向橄榄型社会》一书，围绕橄榄型社会的目标与内涵、市场机制、公共政策等多个视角探讨未来发展的路径和可能面临的挑战。2022年6月，与“一带一路”绿色发展国际联盟、能源基金会联合承办国合会2022年会主题论坛——共建绿色丝绸之路，助力全球低碳转型。

(八) 报告期内公司经营情况无重大变化，未发生对公司经营情况有重大影响和预计未来会有重大影响的事项。

### 四、主要经营情况及财务报表分析

#### (一) 主营业务分析

2022年上半年，在疫情、地缘冲突及货币环境变化的影响下，全球资本市场震荡，整体走势较弱。受市场环境影响，本集团实现营业收入人民币12,131,585,605元，较2021年同期减少人民币2,329,468,287元，下降16.11%，主要是由于在市场行情整体走势较弱的影响下，本集团以公允价值计量的金融投资产生的收益减少。

2022年上半年，本集团营业支出为人民币7,593,895,471元，较2021年同期减少人民币735,635,372元，下降8.83%，主要是由于业务及管理费因员工成本下降而减少；受2022年上半年全球资本市场震荡下行的影响，本集团经营业绩较2021年同期有所下降，员工成本随之相应下降。

单位：元 币种：人民币

科目	2022年1-6月	2021年1-6月	变动比例(%)	主要变动原因
投资收益及公允价值变动损益	<b>5,060,504,814</b>	8,197,438,020	(38.27)	以公允价值计量的金融投资产生的收益净额减少。
汇兑收益/(损失)	<b>214,030,830</b>	(512,279,446)	不适用	外币交易因汇率波动而产生的损益变动。
其他收益	<b>119,726,176</b>	82,092,695	45.84	为限售股减持代扣代缴客户个人所得税的纳税手续费返还增加。
信用减值转回	<b>(68,267,500)</b>	(29,502,853)	不适用	变动主要为对应收款项确认的减值转回。
所得税费用	<b>668,873,137</b>	1,103,142,914	(39.37)	利润总额减少。
经营活动产生/(使用)的现金流量净额	<b>23,964,842,509</b>	(5,531,197,500)	不适用	为交易目的而持有的金融工具带来的现金净流入较2021年同期的现金净流出导致的现金流量净额变化；卖出回购金融资产款增幅较2021年同期增加；上述现金净流入的增加被衍生品业务交易款项导致的现金净流出部分抵消。
投资活动(使用)/产生的现金流量净额	<b>(5,114,680,066)</b>	512,621,491	不适用	投资支付的现金增加，该增加被收回投资收到的现金增加所部分抵消。
筹资活动(使用)/产生的现金流量净额	<b>(13,188,806,390)</b>	32,600,433,109	不适用	发行债务工具收到的现金减少，偿还债务工具支付的现金增加。



# 管理层讨论与分析

## (二) 资产、负债情况分析

### 1. 资产及负债状况

截至2022年6月30日，本集团归属于母公司股东的权益总额为人民币90,773,025,068元，较2021年末增加人民币6,350,903,794元，增长7.52%，主要为本报告期实现归属于母公司股东的净利润及新增发行永续次级债券。

资产结构保持相对稳定，资产质量和流动性保持良好水平。截至2022年6月30日，本集团资产总额为人民币679,994,367,645元，较2021年末增加人民币30,198,878,430元，增长4.65%。其中，交易性金融资产及衍生金融资产共计人民币315,720,922,793元，占资产总额的46.43%；其他债权投资为人民币47,955,748,059元，占资产总额的7.05%；货币资金及结算备付金共计人民币163,437,577,051元，占资产总额的24.04%；存出保证金为人民币12,063,601,058元，占资产总额的1.77%；融出资金及买入返售金融资产共计人民币73,657,505,169元，占资产总额的10.83%；长期股权投资为人民币1,092,904,165元，占资产总额的0.16%；其他类型的资产共计人民币66,066,109,350元，占资产总额的9.72%。

截至2022年6月30日，本集团负债总额为人民币588,904,733,260元，较2021年末增加人民币23,840,080,472元，增长4.22%。其中，卖出回购金融资产款为人民币56,286,047,663元，占负债总额的9.56%；应付短期融资款及应付债券共计人民币171,443,141,142元，占负债总额的29.11%；交易性金融负债及衍生金融负债共计人民币55,501,353,562元，占负债总额的9.42%；拆入资金为人民币44,912,256,024元，占负债总额的7.63%；代理买卖证券款及代理承销证券款共计人民币106,361,217,663元，占负债总额的18.06%；其他类型的负债共计人民币154,400,717,206元，占负债总额的26.22%。

资产负债率<sup>2</sup>水平相对平稳。截至2022年6月30日，剔除代理买卖证券款及代理承销证券款的影响后，本集团经调整资产总额为人民币573,633,149,982元，经调整负债总额为人民币482,543,515,597元。本集团资产负债率为84.12%，较2021年末的资产负债率84.57%，下降0.45个百分点。

单位：元 币种：人民币

项目名称	本期期末数		上期期末数		变动比例(%)	情况说明
	2022年 6月30日	占总资产的 比例(%)	2021年 12月31日	占总资产的 比例(%)		
衍生金融资产	19,034,460,568	2.80	14,564,228,663	2.24	30.69	权益合约项下衍生金融资产增加。
买入返售金融资产	38,509,752,865	5.66	25,858,494,059	3.98	48.92	债券质押式逆回购业务规模增加。
在建工程	255,876,685	0.04	189,436,852	0.03	35.07	办公楼建造投入增加。
其他资产	2,223,234,325	0.33	1,521,992,617	0.23	46.07	应退所得税款增加。
卖出回购金融资产款	56,286,047,663	8.28	16,376,070,951	2.52	243.71	质押式卖出回购业务规模增加。
代理承销证券款	386,055,000	0.06	7,304,310,900	1.12	(94.71)	应付承销业务客户款项减少。
应付职工薪酬	6,558,281,330	0.96	11,168,865,080	1.72	(41.28)	待支付的职工薪酬减少。
其他负债	7,190,630,767	1.06	5,380,225,891	0.83	33.65	应付股利增加。

<sup>2</sup> 资产负债率 = (负债总额 - 代理买卖证券款及代理承销证券款) / (资产总额 - 代理买卖证券款及代理承销证券款)。



# 管理层讨论与分析

## 2. 境外资产情况

境外资产人民币191,688,313,914元，占总资产的比例为28.19%。

## 3. 截至报告期末主要资产受限情况

单位：元 币种：人民币

受限资产	受限资产账面价值	受限原因
货币资金	1,022,869,580	主要为本集团为资产管理业务持有的风险准备金存款和代非经纪业务客户持有的临时性存款。
交易性金融资产	49,105,195,196	
其中：债券	38,808,411,785	为卖出回购、央票互换、充抵保证金及债券借贷业务而设定的质押。
股票	9,180,070,605	为卖出回购业务而设定的质押，证券出借业务中已借出证券，融券业务中已融出证券，转融通业务相关担保物，或存在限售期。
基金及其他	1,116,712,806	融券业务中已融出证券，转融通业务相关担保物，存在限售期，或认购的资管计划份额承诺不退出。
其他债权投资	30,408,659,488	为卖出回购、充抵保证金及债券借贷业务而设定的质押。
合计	80,536,724,264	

# 管理层讨论与分析

## 4. 其他说明

2022年上半年，本集团投资收益及公允价值变动损益构成如下：

单位：元 币种：人民币

项目	2022年1-6月	2021年1-6月	变动比例(%)
处置其他债权投资的收益净额	109,299,789	28,540,222	282.97
交易性金融工具及衍生金融工具的收益净额	4,935,243,467	8,134,680,688	(39.33)
— 权益投资	2,518,072,416	4,610,008,193	(45.38)
— 债权投资	1,531,198,086	1,682,608,510	(9.00)
— 其他投资	885,972,965	1,842,063,985	(51.90)
权益法核算的长期股权投资收益	15,961,558	33,963,901	(53.00)
处置长期股权投资产生的投资收益	-	253,209	(100.00)
<b>投资收益及公允价值变动损益合计</b>	<b>5,060,504,814</b>	<b>8,197,438,020</b>	<b>(38.27)</b>

处置其他债权投资的收益净额为人民币109,299,789元，同比增长282.97%，主要是由于处置以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债券投资产生的收益大幅增加。

交易性金融工具及衍生金融工具的收益净额为人民币4,935,243,467元，同比下降39.33%，主要来源于以下投资类别：

- 权益投资产生的收益净额下降45.38%，主要是由于2022年上半年全球资本市场波动加剧，本集团场外衍生品交易规模下降，同时，科创板跟投持有证券的市值及私募股权投资基金的估值随市场行情变化而下降；
- 债权投资产生的收益净额下降9.00%；
- 其他投资产生的收益净额下降51.90%，主要是由于受市场行情下行影响，本集团持有的公募基金资产净值下降，导致产生的收益净额减少。

# 管理层讨论与分析

## 五、投融资状况分析

### (一) 对外股权投资总体分析

截至2022年6月30日，本集团长期股权投资为人民币10.93亿元，较上年末人民币10.87亿元增加人民币0.06亿元，增幅0.55%。本集团重大的股权投资情况请参阅本报告“中期财务报表附注七、10”，本集团无重大的非股权投资。

### (二) 以公允价值计量的金融资产

截至2022年6月30日，本集团以公允价值计量的金融资产请参阅本报告“会计数据及财务指标摘要五”。

### (三) 股权融资

报告期内，本公司无重大股权融资。

### (四) 重大资产和股权出售

报告期内，本公司无重大资产和股权出售。



# 管理层讨论与分析

## (五) 本公司主要控参股公司及结构化主体情况

### 1. 主要控参股公司情况

截至报告期末，公司现有主要子公司8家，其基本情况如下：

名称	公司 持股比例	设立时间	注册资本 (或营运资金)	负责人	联系电话	注册地址	主营业务
中国国际金融(国际)有限公司	100%	1997/04/04	已发行股本金额 3,900,000,000 港元	刘晴川、徐翌成、黄劲峰、楚钢、黄海洲、夏星汉、马葵	(852)28722000	香港中环港景街1号国际金融中心第一期29楼	境外投资控股业务
中国中金财富证券有限公司	100%	2005/09/28	人民币80亿元	高涛	(0755)82026676	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L4601-L4608	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；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；融资融券；代销金融产品
中金资本运营有限公司	100%	2017/03/06	人民币20亿元	黄朝晖	(010)65051166	北京市朝阳区建国门外大街1号(二期)9层09-11单元	资产管理；投资管理；项目投资；投资咨询
中金基金管理有限公司	100%	2014/02/10	人民币5亿元	胡长生	(010)63211122	北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室	基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务
中金浦成投资有限公司	100%	2012/04/10	人民币60亿元	刘健	(021)58796226	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1233号汇亚大厦29层2904A单元	投资管理，投资咨询，从事货物及技术的进出口业务，国内货物运输代理服务，仓储(除危险品)
中金期货有限公司	100%	2004/07/22	人民币3.5亿元	隋友	(0971)8224987	青海省西宁市城西区胜利路21号蓝宝石大酒店1811号和1813号	商品期货经纪、金融期货经纪、资产管理业务
中金私募股权投资管理有限公司	100%	2020/10/30	人民币5亿元	单俊葆	(010)65051166	上海市黄浦区中山南路100号八层03单元	股权投资管理，投资管理，资产管理，投资咨询
CICC Financial Trading Limited	CICC Financial Holdings Limited 100%持股	2012/04/10	已发行股本金额 1港元	刁智海、林宁、冀燕彬、列皓敏、冯思博、王可、张永诚、于维疆、刘晴川、周学韬、黄海洲、贾嘉、刘子颖、王瑾、彭骏、谈宾	(852)28722000	香港中环港景街1号国际金融中心第一期29楼	为客户便利交易、上市证券交易、交易所交易基金(ETF)及衍生金融工具

# 管理层讨论与分析

公司主要子公司主要财务状况及经营业绩如下：

## 中金国际：

截至2022年6月30日，香港财务报告准则下，总资产为20,922,208.85万港元，净资产为2,001,469.30万港元，2022年上半年实现收入总额395,712.09万港元，净利润143,138.51万港元。

## 中金财富证券：

截至2022年6月30日，总资产为人民币16,294,781.07万元，净资产为人民币1,793,722.18万元，2022年上半年实现营业收入人民币280,339.13万元，净利润人民币69,521.23万元。

## 中金资本：

截至2022年6月30日，总资产为人民币547,115.72万元，净资产为人民币265,507.51万元，2022年上半年实现营业收入人民币64,496.79万元，净利润人民币26,952.61万元。

## 中金基金：

截至2022年6月30日，总资产为人民币62,501.75万元，净资产为人民币39,765.64万元，2022年上半年实现营业收入人民币14,240.68万元，净利润人民币2,926.71万元。

## 中金浦成：

截至2022年6月30日，总资产为人民币870,071.61万元，净资产为人民币567,241.86

万元，2022年上半年实现营业收入人民币31,048.42万元，净利润人民币23,053.22万元。

## 中金期货：

截至2022年6月30日，总资产为人民币627,507.59万元，净资产为人民币68,690.55万元，2022年上半年实现营业收入人民币6,063.29万元，净利润人民币3,003.11万元。

## 中金私募股权：

截至2022年6月30日，总资产为人民币52,924.96万元，净资产为人民币33,999.94万元，2022年上半年实现营业收入人民币26,469.24万元，净利润人民币17,076.14万元。

## CICC Financial Trading Limited：

截至2022年6月30日，香港财务报告准则下，总资产为1,813,594.86万美元，净资产为87,236.80万美元，2022年上半年实现收入及其他收益25,866.33万美元，净利润17,437.55万美元。

## 2. 结构化主体情况

报告期内，公司控制的结构化主体情况请参阅本报告“中期财务报表附注五及附注十四”。

## 3. 合并范围及其变动情况

报告期内，公司财务报表合并范围及其变动情况请参阅本报告“中期财务报表附注五”。

# 管理层讨论与分析

## 六、风险管理

### (一) 概况

本公司始终相信风险管理创造价值。本公司的风险管理旨在有效配置风险资本，将风险限制在可控范围，使企业价值最大化，并不断强化本公司稳定和可持续发展的根基。本公司具有良好的企业管治、有效的风险管理措施及严格的内部控制体系。

根据相关法律法规及监管要求，本公司建立了完善的治理结构体系。公司股东大会、董事会和监事会根据《公司法》《证券法》《证券公司内部控制指引》《证券公司全面风险管理规范》《公司章程》履行职责，对公司的经营运作进行监督管理。董事会通过加强和完善公司内部控制结构、合规和风险管理文化，使内部控制与风险管理成为本公司经营管理的必要环节。

### (二) 风险管理架构

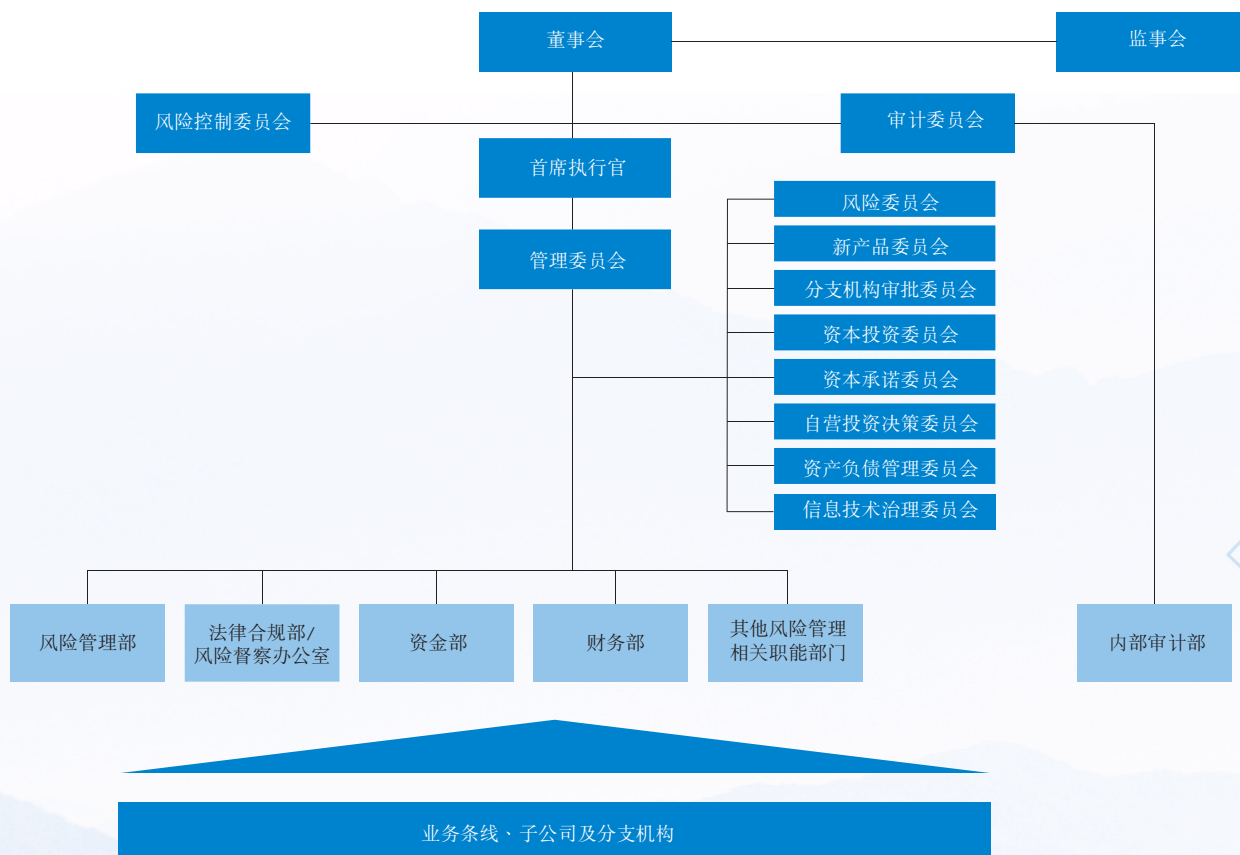
本公司建立了包括董事会、监事会、高级管理层、风险管理相关职能部门、业务部门及分支机构在内的多层级的风险管理组织架构。其中，(i) 董事会为本公司风险管理及内部控制治理架构的最高层级，负责推进公司风险文化建设，审议公司风险管理总体目标、风险偏好、风险容忍度、重大风险限额、风险管理制度。董事会主要通过其下设的风险控制委员会及审计委员会履行其风

险管理职责；(ii) 监事会承担本公司全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改；(iii) 在董事会之下，本公司设立由首席执行官担任主席的管理委员会。管理委员会根据董事会设定的风险管理总体目标确定本公司的风险偏好，对本公司全面风险管理的有效性承担主要责任；(iv) 管理委员会下设的风险委员会向管理委员会汇报风险事务，重大事项向董事会风险控制委员会汇报。风险委员会由首席运营官担任主席，首席风险官和合规总监共同担任执行主席，其他成员包括首席财务官、各业务部门负责人及风险管理相关职能部门负责人。管理委员会同时下设新产品委员会、分支机构审批委员会、资本投资委员会、资本承诺委员会、自营投资决策委员会、资产负债管理委员会以及信息技术治理委员会，分别从新业务/新产品审批、分支机构设立审批、自有资金出资活动审批、投资银行业务中发行承销风险控制、自营业务投资决策流程管理、公司资产负债管理以及信息技术管理等方面履行相应职责；(v) 风险管理相关职能部门，包括风险管理部、法律合规部、资金部、财务部、运作部、信息技术部、公共关系部等部门，从各自角度相互配合管理各类风险；及(vi) 业务部门负责人和分支机构负责人承担风险管理有效性的直接责任。在日常业务运营中，业务部门及分支机构参与业务经营的所有员工都被要求履行风险管理职能。



# 管理层讨论与分析

本公司风险管理的组织架构如下图所示：



### (三) 本公司经营活动可能面临的风险和管理措施

本公司业务经营活动面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、信息科技风险、合规风险、法律风险、洗钱风险及声誉风险等。报告期内，前述各项风险因素未对本公司当期及未来经营业绩产生重大影响，本公司通过有效的风险防范措施，积极主动应对和管理风险，总体防范了重大风险事件的发生，确保了本公司经营活动的平稳开展。

2022年上半年，全球经济增长放缓，地缘政治冲突持续，能源和粮食价格上涨加剧通胀压力，供应链受阻问题进一步加重，金融市场和资本流动波动性增加，外部环境更趋复杂严峻；国内全面贯彻落实“疫情要防住、经济要稳住、发展要安全”的重要决策部署，高效统筹疫情防控和经济社会发展，但经济发展仍面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力。面对严峻复杂的市场环境挑战，本公司坚持贯彻实行“全覆盖、穿透式、全流程”的风险管控要求，不断夯实覆盖子公司及分支机构的一体化垂直风险管理体系，通过三道防线的风险管控工作相结合，主动识别、审慎评估、动态监控、及时报告、积极应对风险；深入宣导风险管理文化，持续提升风险管理能力，统筹公司业务规划与风险偏好，从前瞻性角度梳理完善多维度、多层级的风险管理体系，优化管理机制和流程，并不断推动业务模式的优化和可持续发展。报告期内，本公司业务运行稳健，未发生重大风险事件和大额损失，整体风险可控、可承受。

## 管理层讨论与分析

报告期内，本公司持续强化同一业务、同一客户的风险管控。本公司制定了同一业务的认定标准，对同一业务实行相对一致的风险管理标准和措施，对公司内同一业务的风险进行统一识别、评估、计量、监测和汇总管理；本公司制定了同一客户的认定标准，加强公司内对同一客户信息的标准化、规范化管理，对同一客户在各业务线与公司发生的业务往来进行汇总和监控管理，贯穿于业务开展的各关键环节。同时，本公司对经认定需要按关联关系管理的客户的相关风险进行统一管理。

### 市场风险

市场风险指因股票价格、利率水平、汇率及大宗商品价格等的波动而导致本公司所持有的金融资产的公允价值变动的风险。

本公司已采取以下措施管理市场风险：

- 本公司业务部门作为市场风险的直接承担者，动态管理其持仓所暴露出的市场风险，通过分散风险敞口、控制持仓规模，并利用对冲工具来管理市场风险；
- 本公司风险管理部对整体的市场风险进行全面评估、监测和管理。市场风险管理主要涉及风险计量、限额制定、风险监控等环节：
  - 本公司主要通过风险价值(VaR)分析、压力测试及敏感度分析等方法计量市场风险。风险价值为本公司计量及监测市场风险的主要工具。风险价值衡量的是在一定的持有期、一定的置信水平下，市场风险因子发生变化对资产组合造成的潜在最大损失。本公司基于三年历史数据，采用历史模拟法来计算置信水平为95%的单一风险价值，并定期通过回溯测试的方法检验模型的有效性；同时，本公司采用压力测试作为风险价值分析的补充，通过压力测试来衡量股票价格、利率水平、汇率及商品价格等市场风险因素出现极端情形时，本公司的投资损失是否在可承受范围内；此外，本公司针对不同资产的敏感性因子，通过计算相应的敏感性指标以衡量特定因子发生变化对资产价值的影响。

## 管理层讨论与分析

- 本公司制定了以限额为主的风险指标体系。风险限额既是风险控制手段，也代表本公司的风险偏好和风险容忍度。本公司根据业务性质设定适当的市场风险限额，如规模限额、风险价值限额、集中度限额、敏感度限额、压力测试限额及止损限额等。
- 本公司对风险限额的执行情况进行实时或逐日监控。风险管理部编制每日风险报告，监控限额使用情况，并提交至管理层及业务部门。当限额使用率触发预警阈值时，风险管理部会向业务部门发出预警提示。风险指标一旦超出限额，业务部门须将超限原因及拟采取的措施向首席风险官或其授权人报告，并负责在规定时间内将风险敞口减少至限额内。如无法实施，业务部门需向首席风险官或其授权人申请临时限额，必要时，首席风险官会将申请提交至管理层。

### 风险价值(VaR)

本公司设定了总投资组合的风险价值限额，并将风险价值限额分解到不同业务条线。风险管理部每日计算和监控该等金融工具的风险价值，以确保每日的风险价值维持在限额之内。下表列示于所示日期及期间本公司按风险因子（价格、利率、汇率及商品）计算的风险价值以及分散化效应：(i)截至相应期间末的每日风险价值；(ii)于相应期间每日风险价值的平均值；及(iii)于相应期间的最高及最低每日风险价值。

### 本公司

(人民币百万元)	2022年 6月30日	2021年 12月31日	截至2022年6月30日止六个月期间			截至2021年12月31日止十二个月期间		
			平均	最高	最低	平均	最高	最低
价格敏感金融工具 <sup>(1)</sup>	152.9	185.7	141.8	187.3	110.9	180.1	215.7	132.5
利率敏感金融工具 <sup>(2)</sup>	68.4	51.7	68.3	83.0	50.9	54.6	79.3	35.8
汇率敏感金融工具 <sup>(3)</sup>	35.8	39.1	33.5	39.1	21.5	33.8	44.3	19.0
商品敏感金融工具 <sup>(4)</sup>	0.7	1.0	1.4	2.7	0.6	0.6	1.5	0.1
分散化效应	(88.2)	(97.2)	(89.2)			(83.7)		
<b>组合总额</b>	<b>169.6</b>	<b>180.3</b>	<b>155.8</b>	<b>186.1</b>	<b>135.2</b>	<b>185.4</b>	<b>220.8</b>	<b>151.3</b>

注：

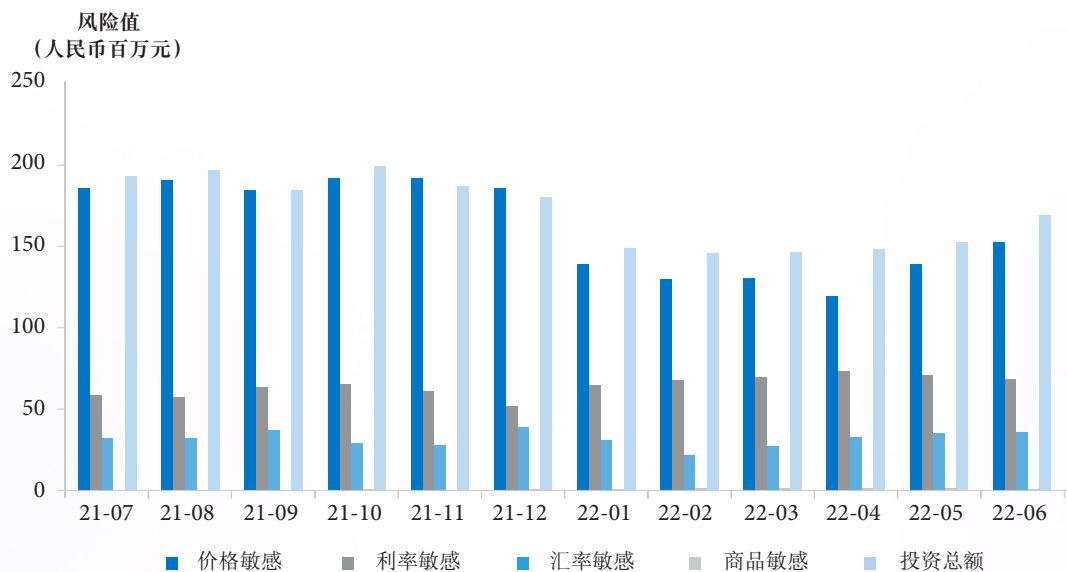
- (1) 包括股票及衍生产品的价格敏感部分
- (2) 包括固定收益产品及衍生产品的利率敏感部分
- (3) 包括受汇率变动影响的金融产品（包括衍生品）
- (4) 包括商品及衍生品的价格敏感部分



# 管理层讨论与分析

下表列示过去一年各月末本公司按照风险类别计算的风险价值：

### 月度风险值图



## 管理层讨论与分析

本公司为价格类相关业务设置价格类敏感度敞口限额，并逐日计量和监控。报告期内，权益类市场呈震荡态势，通过调整头寸、使用衍生品对冲和控制集中度等方式，管理价格类市场风险。

本公司密切追踪境内外市场利率、信用利差等变动情况，并逐日计量及监控利率风险敞口及限额使用情况，并通过国债期货、利率互换等工具，管理固定收益类投资组合的利率风险。

本公司对于涉及汇率风险的境内外资产进行汇率风险管理，每日计量及监控汇率风险敞口及限额使用情况，并通过调整外汇头寸、使用外汇衍生品对冲等方式，管理汇率风险。

本公司商品类市场风险敞口相对较低，报告期内境内外部分商品价格波动剧烈，本公司通过商品期货、期权、互换等工具进行对冲，管理商品风险。

### 信用风险

信用风险指来自交易对手、融资方及证券发行人信用度下降或违约导致损失的风险。

### 债券投资业务

本公司对信用类固定收益证券投资注重分散投资，投资的信用产品主要为较高信用评级产品。本公司通过设定投资规模限额，分投资品种、信用评级限额及集中度限额，开展前瞻性风险研判等措施控制市场及信用风险暴露，并通过监测、预警、风险排查等手段持续跟踪评估债券发行人的经营情况和信用评级变化。

报告期内，针对信用债风险事件频发的市场情况，固定收益部与风险管理部紧密配合，审慎识别、评估、监控和应对债券投资的信用风险，通过采取有效的风险防范措施，本公司报告期内未出现重大损失事件。

# 管理层讨论与分析

截至2022年6月30日(单位：人民币百万元)

本公司	信用持仓	DV01	Spread DV01
境外评级			
— AAA	197.4	0.01	0.01
— AA-至AA+	287.2	0.03	0.03
— A-至A+	6,376.6	0.90	0.88
— BBB-至BBB+	3,393.8	0.68	0.68
— 低于BBB-	480.1	0.05	0.05
— NR	3,577.3	0.25	0.25
<b>小计</b>	<b>14,312.4</b>	<b>1.93</b>	<b>1.91</b>
中国境内评级			
— AAA	77,946.4	12.77	9.51
— AA-至AA+	9,167.4	1.33	1.33
— A-至A+	1,144.3	0.12	0.12
— 低于A-	761.2	0.06	0.06
<b>小计</b>	<b>89,019.2</b>	<b>14.28</b>	<b>11.02</b>
— 未评级1	30,507.3	6.74	0.00
— 未评级2	12,522.5	0.01	0.01
<b>总计</b>	<b>146,361.5</b>	<b>22.96</b>	<b>12.95</b>

注：风险管理部选取基点价值(DV01)和利差基点价值(Spread DV01)来衡量债券的利率敏感度和信用利差敏感度。基点价值(DV01)衡量市场利率曲线每平行移动一个基点时利率敏感类产品价值的变动金额。利差基点价值(Spread DV01)衡量信用利差每平行移动一个基点时，信用敏感类产品价值的变动金额。

- (1) 债务工具评级参照彭博综合评级或证券发行人所在地主要评级机构对债务工具或债务工具发行人的评级。
- (2) 未评级1：此类未评级的金融资产主要包括国债和政策性金融债。
- (3) 未评级2：此类未评级的金融资产主要为其他未由独立评级机构评级的债务工具和交易性证券。



# 管理层讨论与分析

## 资本业务

对于融资融券、股票质押式回购等资本业务的信用风险，本公司建立了一套严格的全流程风控体系，包括客户征授信、担保品管理、标的证券管理、风险限额管理、盯市与平仓等。本公司重视客户准入，建立并执行严格的客户甄选及信用评估机制，营业部负责初步审核客户的信用资料，以了解客户的基本信息、财务状况、证券投资经验、信用记录及风险承受能力，并提交经初步判断合格的客户信用数据至总部相关业务部门进行再次审核，经审核通过后的客户数据将被提交至风险管理部门独立评估客户资质并确定客户信用评级及信用额度。

报告期内，本公司融资融券、股票质押式回购业务未发生重大损失事件。本公司重点通过以下方面加强融资融券业务和股票质押式回购业务的风险管控：

### 1. 融资融券业务

报告期内，本公司严控融资融券业务单一客户、单一标的集中度，重点关注和评估担保品集中度较高以及持仓标的风险较大的账户，及时与客户沟通并采取相应措施以缓释风险；重视加强担保品管理，动态调整担保品标的范围及折算率；综合考虑持仓标的集中度及风险情况以及维持担保

比例等因素审慎评估和审批交易展期申请；以及开展定期和不定期压力测试，并对高风险客户重点关注。

### 2. 股票质押式回购业务

报告期内，本公司严格把控质押业务项目筛选和审批，采取的风控措施包括但不限于：加强项目风险评估与管理，结合融资人资信情况以及质押标的的基本面情况（包括大股东质押比例、全体股东质押比例、流动性及历史停牌记录、股东结构、控股股东资金链、退市风险、负面新闻等），综合判断项目风险，审慎测算及确定质押率，严控标的减持受限融资人的融资规模；本公司重视控制个股集中度、建立黑名单制度，严控单一标的公司整体敞口。此外，加强对大额融资需求项目的质押标的和融资人的现场尽职调查和评估分析，并提高风控要素要求以保障项目风险可控。

同时，本公司持续对存续合约进行风险监控，并开展定期和不定期压力测试，根据风险情况进行分级管理，对可能发生风险的合约进行重点跟踪；重视对大额质押项目融资人的信用风险监控及定期评估；动态监控质押标的情况，持续跟踪存续大额、重点项目的标的的基本面以及价格波动情况等，如发现标的出现异常情况，及时做好风险预案，并采取相应处理措施。

# 管理层讨论与分析

## a. 融资融券业务数据

本公司融资融券业务的融资融券余额、抵押品市值以及维持担保比例数据列示如下：

单位：人民币百万元

项目	截至2022年 6月30日	截至2021年 12月31日
融资融券金额	43,574.5	50,211.4
抵押品市值	121,921.8	143,029.3
维持担保比例	279.8%	284.9%

注：维持担保比例为客户账户资产余额（包含所持现金及证券）与客户自本公司取得的融资融券余额（即所取得的融资买入证券金额、融券卖出证券市值及任何应计利息与费用之和）之比。

截至2022年6月30日，本公司融资融券业务的维持担保比例为279.8%，假设作为本公司融资融券业务的抵押品的全部证券市值分别下跌10%及20%，并且融券负债分别上升10%及20%，则截至2022年6月30日本公司的融资融券业务的维持担保比例将分别为248.8%和217.8%。

## b. 股票质押式回购业务数据

本公司股票质押式回购业务的回购金额、抵押品市值以及履约保障比例数据列示如下：

单位：人民币百万元

项目	截至2022年 6月30日	截至2021年 12月31日
股票质押式回购金额	6,844.4	8,269.2
抵押品市值	24,858.3	29,556.2
履约保障比例	363.2%	357.4%

注：履约保障比例是指初始交易与对应的补充质押，在扣除部分解除质押后的标的证券及孳息市值与融入方应付金额的比值。



# 管理层讨论与分析

## 流动性风险

流动性风险指本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。

本公司实行垂直管理，集中管理境内外各分支机构的流动性风险。本公司已采取以下方法管理流动性风险：

- 密切监控本公司及其分支机构的资产负债表，管理资产与负债的匹配情况；
- 根据本公司整体情况及监管要求设定流动性风险限额；
- 开展现金流预测，定期或不定期进行流动性风险压力测试，分析评估流动性风险水平；
- 维持充足的高流动性资产，制订流动性风险应急计划，以应对潜在的流动性紧急情况。

本公司长期持有充足的未被抵押的、高流动性的优质资产作为流动性储备，以抵御流动性风险、满足本公司短期流动性需求。流动性储备由资金部持有，独立于业务部门进行管理。为满足流动性储备的统一调配，本公司对流动性储备进行垂直管理。同时，考虑到跨境和各实体间的流动性转移限制，本公司持有多种币种的流动性储备并留存于各主要境内外实体，确保

及时满足各实体的流动性需求。本公司考虑包括公司债务到期情况、公司资产规模及构成、业务和运营的资金需求、压力测试结果、监管要求等因素，对流动性储备的规模和构成进行主动管理，限定流动性储备的投向和风险限额，将流动性储备配置于现金及现金等价物、利率债、货币基金等高流动性优质资产。

本公司不断拓宽融资渠道，通过公司债券、中期票据计划、银行贷款、短期融资券、收益凭证、转融通、收益权转让、同业拆借和回购等方式进行融资，优化负债结构；与银行保持着良好的合作关系，有充裕的银行授信以满足业务开展的资金需求。截至最后实际可行日期，经中诚信国际信用评级有限责任公司综合评定，本公司主体信用等级为AAA，评级展望为稳定。截至最后实际可行日期，经标准普尔综合评定，本公司主体长期评级为BBB+，短期评级为A-2，评级展望为稳定；经穆迪综合评定，本公司主体长期评级为Baa1，短期评级为P-2，评级展望为稳定；经惠誉综合评定，本公司主体长期评级为BBB+，短期评级为F2，评级展望为稳定。

本公司总体流动性风险管理情况良好，优质流动性资产储备充足，流动性风险可控。

报告期内，本公司流动性风险监管指标持续符合监管标准，截至2022年6月30日，本公司的流动性覆盖率和净稳定资金率分别为497.48%和149.92%。



# 管理层讨论与分析

## 操作风险

操作风险指由于不完善或有问题的内部程序、人员、信息技术系统，以及外部事件造成损失的风险。操作风险贯穿于公司业务开展和日常运营过程中的各个环节，最终可能导致包括但不限于法律风险、合规风险、声誉风险等其他风险。

本公司已采取以下措施管理操作风险：

- 培育全员操作风险理念，提升员工操作风险意识；
- 建立清晰的组织架构，制定适当的决策机制，明确业务流程管控的职责与分工；
- 推动重点领域和关键环节风险管理，优化完善制度、流程、机制；
- 开展新业务、新产品风险评估及后续审阅，有效管控新业务新产品操作风险；
- 持续加强操作风险管控工具对操作风险的识别、评估、监控和应对，强化操作风险事前、事中和事后管理；
- 优化操作风险信息的沟通、汇报和处理机制，增强风险防控的主动性和前瞻性；
- 推进业务连续性管理体系建设，提升业务持续运营能力。

本公司持续从信息技术系统建设和业务流程梳理等方面加强操作风险的管理工作，通过完善信息技术系统、梳理并规范业务开展流程，进一步提高业务运作效率，防范业务操作风险。

## 信息科技风险

信息科技风险是指信息技术在中金公司运用过程中，由于自然因素、人为因素、技术漏洞和管理缺陷产生的操作、法律和声誉等风险。

本公司主要采取以下措施管控及防范信息科技风险：

- 建立有效的信息技术治理机制，保持信息科技建设与业务目标一致；
- 明确信息科技风险管理机制，从制度层面明确三道防线在信息科技风险管理中的职责划分，定义并规范管理策略与方法；
- 实施信息科技风险评估，全面识别、分析风险点，分析风险发生的可能性和潜在影响，实施风险防范措施；建立信息科技关键风险指标体系及监控机制；培育信息科技风险文化，提高员工信息科技风险防控意识；
- 通过对信息科技项目立项、审批和控制环节进行管理，确保信息系统的可靠性、完整性、可用性和可维护性；
- 建立信息安全管理机制，制定和实施信息安全计划，监控信息安全威胁；
- 建立数据治理组织架构，确保数据统一管理、持续可控和安全存储；
- 通过建立有效的问题管理流程，追踪、响应、分析和处置信息系统问题及信息技术突发事件；
- 通过建立信息技术应急管理机制，制定应急预案，开展应急演练，持续优化信息技术应急管理，保证系统持续、稳定地支持公司业务运营。

# 管理层讨论与分析

## 合规风险

合规风险指因本公司的经营管理活动或员工的执业行为违反法律法规、行业自律规则或本公司内部政策而使本公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或者商业信誉损失的风险。

本公司主要采取以下措施管理和防范合规风险：

- 根据法律、法规及行业规范的变动制定及更新本公司的合规政策及流程；
- 专业的合规团队负责审查各类业务的合规性及提供合规意见；从新业务前期开始时即提出有效的合规风险防控措施并在新业务开展过程中进行合规审查和监督；
- 通过开展信息交流监控工作及建设动态信息隔离墙管理模式，管控敏感信息流动，以防范内幕交易风险及管理利益冲突；
- 根据法律法规及其他规范性文件、自律准则、行业规范及本公司规章制度等规定组织开展合规监督和检查，以监测本公司业务经营及员工执业行为的合规性，主动识别及防范合规风险；
- 通过多种途径在每条业务线、每个职能部门及分支机构培育合规文化，并向员工提供合规培训以提升员工的合规意识；
- 本公司已建立关于本公司员工违反法律法规及内部规章制度行为的内部问责机制，以落实对违规人员的惩戒。

## 法律风险

法律风险指因违约、侵权相关争议、诉讼或其他法律纠纷，从而可能对本公司造成经济损失或声誉损失的风险。

本公司主要通过以下措施来管控及防范法律风险：

- 不断从法律角度完善本公司制度体系及业务流程，将适用法律、法规的要求落实到规范本公司经营管理活动各环节；
- 制订各类业务合同的标准模版，并要求各类业务部门尽量使用本公司标准版本的合同。本公司亦在订立有关合同前对对手方起草或提供的合同进行审查，以减少因履行合同导致的法律风险；
- 通过开展法律培训活动，提高员工的法律意识；
- 申请、维护及保护本公司商标，保护本公司商誉及商业秘密以及对侵犯本公司声誉或利益的行为提起诉讼；
- 当争议及诉讼真实发生时，本公司采取积极的措施降低相关法律风险。

## 洗钱风险

洗钱风险是指公司在开展业务和经营管理过程中可能被洗钱、恐怖融资和扩散融资及相关违法犯罪活动利用，给公司带来监管处罚、法律纠纷、经济损失或声誉损失的风险。

# 管理层讨论与分析

本公司主要采取以下措施管理和防范洗钱风险：

- 建立洗钱风险管理组织架构，做好反洗钱人力资源保障；
- 根据法律法规及监管规定制定及更新反洗钱政策；
- 定期及不定期开展洗钱风险评估；
- 结合客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、可疑交易监测和报告、名单监控、资产冻结等反洗钱义务，将风险控制措施融入相关业务操作流程；
- 持续开展反洗钱宣传与培训，促进洗钱风险管理文化的充分传导；
- 建立完善反洗钱监测系统与数据质量控制机制；
- 开展反洗钱检查与内部审计工作、反洗钱绩效考核与奖惩及应急管理等工作。

## 声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件及公司工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害公司品牌价值，不利公司正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。

本公司主要采取以下措施管理和防范声誉风险：

- 各部门在业务经营的重要环节采取措施防范和管控声誉风险，认真落实“了解你的客户”的要求，加强尽职调查工作，强化项目执行质量，防范和及时处理潜在声誉风险问题；
- 建立健全声誉风险管理制度与细则，明确声誉风险管理组织架构及职责分工，风险管理部和公共关系部作为声誉风险牵头管理部门，共同开展声誉风险管理工作；
- 识别、监测可能影响公司声誉的风险信息或风险来源，开展声誉风险年度排查、声誉风险事前评估，根据评估结果采取相应的风控措施，不断完善声誉风险事件评估、应对与处置机制；
- 通过建立有效的舆情监测系统，支持声誉风险的及时识别、预警和研判，提出舆情应对方案并组织实施，及时对外发布和沟通公司观点和立场，避免误读误报等错误信息在公众舆论环境的扩散和恶化；
- 明确声誉风险的报告内容、形式、频率和报送范围，确保董事会、管理层及时了解公司声誉风险水平及其管理状况，并根据监管部门或其派出机构等的要求报送与重大声誉事件有关的报告；
- 加强工作人员声誉风险管理，通过制度建设和培训机制，培育全员声誉风险意识以及员工良好的职业操守，完善工作人员声誉信息登记机制，将工作人员声誉情况纳入人事管理体系，并强化对公司声誉造成负面影响人员的考核与问责。



# 管理层讨论与分析

## (四) 公司风险控制指标监控和补足机制建立等情况

### 风险控制指标监控建立情况

公司建立了完善的风险控制指标监控及管理机制，以中国证监会规定的证券公司风险控制指标监管标准和预警标准为基础，通过实施限额管理、每日监控及报告、常规压力测试、异常事项报告等措施，并不断优化完善公司全面风险管理系统，确保公司净资本和流动性等各项风险控制指标始终符合监管要求。

### 补足机制

针对风险控制指标，公司建立了动态的净资本和流动性补足机制。公司补足净资本的渠道方式包括但不限于暂停或压缩高资本占用的业务规模、发行次级债券、增资扩股、减少或暂停利润分配等；补足流动性的渠道方式包括但不限于募集外部资金（如公司债券、金融债券、中期票据计划、银行贷款、短期融资券、收益凭证、转融通、收益权转让、拆借和回购等方式）、暂停或压缩部分业务规模、变现公司持有的流动性储备、处置公司其他资产等。

# 公司治理

## 一、股东大会情况

报告期内，本公司共召开一次股东大会，会议情况和决议内容如下：

2022年6月23日，公司召开2021年年度股东大会，审议并通过以下议案：《关于修订〈公司章程〉的议案》《关于〈2021年度董事会工作报告〉的议案》《关于〈2021年度监事会工作报告〉的议案》《关于〈2021年年度报告〉的议案》《关于2021年度利润分配方案的议案》《关于续聘会计师事务所的议案》《关于预计2022年度日常关联交易的议案》《关于选举吴港平先生为独立非执行董事的议案》《关于选举陆正飞先生为独立非执行董事的议案》。

以上股东大会的决议公告亦于会议召开当日刊登于 <http://www.hkexnews.hk> (香港联交所披露易网站)、<http://www.sse.com.cn> (上交所网站) 及 <http://www.cicc.com> (公司网站)。

公司不存在表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会的情况。

## 二、董事、监事、高级管理人员变动情况

### (一) 董事、监事、高级管理人员变动情况

报告期初至最后实际可行日期，公司董事、监事、高级管理人员的变动情况如下：

#### 1. 董事变动

截至最后实际可行日期，本公司董事会由8名董事组成，其中包括1名执行董事(黄朝晖先生)、3名非执行董事(沈如军先生、谭丽霞女士及段文务先生)及4名独立非执行董事(刘力先生、吴港平先生、陆正飞先生及彼得·诺兰先生)。报告期初至最后实际可行日期，公司董事变动情况如下：

- (1) 经公司于2022年6月23日举行的2021年年度股东大会批准，吴港平先生、陆正飞先生获委任为公司独立非执行董事，任期自2022年6月23日起，至公司第二届董事会任期结束之日止，届时可以连选连任。经公司董事会审议通过，自同日起，吴港平先生获委任为公司董事会审计委员会主席、关联交易控制委员会主席、薪酬委员会成员、风险控制委员会成员，陆正飞先生获委任为公司董事会风险控制委员会主席、提名与公司治理委员会成员、审计委员会成员。
- (2) 萧伟强先生、贲圣林先生在公司连续任职已满六年，已辞去公司独立非执行董事及董事会相关专门委员会职务，其辞任于2022年6月23日起生效。
- (3) 由于工作变动，朱海林先生于2022年7月27日向董事会提出辞去公司非执行董事、董事会战略与ESG委员会委员、董事会审计委员会委员及董事会风险控制委员会委员职务，其辞任自同日起生效。

## 2. 监事变动

截至最后实际可行日期，本公司监事会由3名监事组成，包括1名职工代表监事（高涛先生）和2名非职工代表监事（金立佐先生及崔铮先生）。

报告期初至最后实际可行日期，公司监事任职情况并无变动。

## 3. 高级管理人员变动

- (1) 经公司董事会审议通过，因年龄原因，黄海洲先生不再担任公司管理委员会成员职务，自2022年6月23日起生效。
- (2) 经公司董事会审议通过，因工作变动，王晟先生不再担任公司管理委员会成员职务，自2022年7月13日起生效。

除上述变动外，报告期初至最后实际可行日期，本公司董事、监事及高级管理人员并无其他变动。

## (二) 董事及监事简历变动

刘力先生自2022年1月起担任中国冶金科工股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：601618）和香港联交所（股份代号：01618）两地上市的公司）的独立非执行董事，吴港平先生自2022年8月起担任阿里巴巴集团控股有限公司（一间于香港联交所（股份代号：09988）及纽约证券交易所（股份代号：BABA）上市的公司）的独立非执行董事。

除上述披露外，概无其他公司董事、监事的资料须根据《联交所上市规则》第13.51B(1)条予以披露。

## 三、利润分配或资本公积金转增方案

公司董事会在审议半年度报告时，未拟定利润分配预案、资本公积金转增股本预案。

## 四、股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

报告期内，本公司未实施股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施。

## 五、遵守《企业管治守则》

报告期内，本公司严格遵守《企业管治守则》，遵守了全部守则条文，并达到了《企业管治守则》中所列明的部分建议最佳常规条文的要求。



# 公司治理

## 六、遵守《标准守则》

本公司已采纳一套有关董事和监事进行证券交易的行为守则，条款并不逊于证券交易的《标准守则》所载规定。本公司已就遵守《标准守则》的事宜向所有董事、监事作出具体查询。所有董事、监事皆已确认：在报告期内，其已严格遵守本公司有关董事和监事进行证券交易的行为准则所载全部准则。

## 七、员工及薪酬情况

截至2022年6月30日，集团有14,250名雇员，其中13,273名雇员位于中国大陆及977名雇员位于中国香港、新加坡、美国、英国及德国，分别占集团雇员总数的93%及7%。集团约43%和53%的雇员分别拥有学士或硕士及以上学位。此外，集团大约30%的雇员及42%的董事总经理拥有海外留学或工作经验。

报告期内，本公司的薪酬政策、培训计划未有变化，相关信息参见本公司2021年年度报告“董事、监事、高级管理人员和员工情况”。

# 环境与社会责任

## 一、环境信息情况

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

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明：不适用

(三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明：不适用

(四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

公司大力发展绿色债券、绿色基金，积极布局ESG主题策略产品，助力实现“双碳”目标。2022年上半年，公司共助力发行33单绿色债券，规模超人民币1,400亿元，如公司协助国家开发银行成功发行首只“清洁能源装备制造”专题“债券通”绿色金融债券，协助中国农业发展银行成功发行2022年首单绿色金融债券，协助中节能太阳能股份有限公司发行绿色乡村振兴公司债等。2022年3月，中金协鑫碳中和产业投资基金设立，管理规模人民币25亿元，基金将全方位围绕碳中和领域进行投资布局，促进产业和金融相结合，共同推动优秀绿色企业和绿色技术的规模化和商业化。此外，公司积极推动产品与策略布局，开发ESG债券指数、绿债指数、碳中和债指数、沪深港通ESG股票组合、沪深300 ESG股票组合等产品策略，满足不同投资者ESG投资需求。2022年3月，公司在香港联交所成功上市中金碳期货ETF，为大中华区首支以碳资产为主要配置对象的ETF产品。公司于2022年7月正式加入UNPRI。

公司积极响应“双碳”目标，助力生态环境保护。公司通过中金公益基金会向中国绿色碳汇基金会捐赠启动“中金公益生态碳汇林云南兰坪项目”，预计在云南省怒江州兰坪县栽植62,000株云杉、50,000株冷杉，合计经营面积1,054亩，助力有效修复生态、着力构建西南生态安全屏障，增汇抵排，修复和重建滇金丝猴为代表旗舰种的栖息地，保护生物多样性，为当地生态环境的改善和可持续发展发挥积极作用。

(五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

公司践行绿色发展理念，推行绿色办公、节能减排，积极组织和倡导环保活动。绿色建筑方面，公司按照二星级绿色建筑、LEED金级标准推动中金大厦建设落地。低碳办公方面，公司积极推行共享办公，倡导线上办公、会议，降低能源耗用，公司首个共享办公试点于年初投入使用。为进一步践行节能减排理念，公司在茶水间新增可降解纸杯，将逐步实现对普通纸杯的完全替换，并倡导减少一次性餐具的使用。低碳出行方面，2022年4月，公司差旅系统实现可记录各国内航班碳排放及计算碳排放/里程，助力差旅减排。

# 环境与社会责任

## 二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

公司认真贯彻落实中央关于脱贫攻坚与乡村振兴有效衔接的决策部署，召开2次党委会审议制定年度帮扶举措。2022年上半年，公司完成拨付人民币2,400万元，支持会宁县巩固脱贫攻坚成果，促进乡村振兴；通过采购会宁等帮扶县的产品共人民币600万元，支持当地特色产业发展；积极与公益基金会、被投资企业联系，引入有偿及无偿帮扶资金。2022年6月，公司通过中金公益基金会向甘肃省会宁县人民政府捐赠人民币1,700万元，用于建设会宁县一中项目；捐赠人民币300万元用于开展“慧育中国”儿童早期发展项目，通过教育帮扶助力阻断贫困的代际传递。

## 三、积极履行社会责任的其他工作

公司积极做好疫情防控、纾困解难工作，支持餐饮、零售、旅游、民航、公路水路铁路运输企业等特困行业。2022年上半年，公司完成快狗打车香港主板IPO、雅迪控股港股配售、辽宁港口2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)、广州港2022年面向专业投资者公开发行科技创新公司债券等项目，交易规模超人民币420亿元。在上海疫情日趋严重之际，公司与进出口银行合作，共同定制发行了首支上海抗疫保供专题的金融债券人民币50亿元。2022年上半年，公司疫情防控相关资产证券化产品投资金额为人民币1.16亿。此外，公司积极号召被投资企业调动防疫物资，在生物医药、消费物流等多个领域的被投资企业持续加大对疫情防控的支持，助力防疫攻坚战。

公司通过多种方式支持服务中小微企业。2022年上半年支持小微类资产证券化项目融资规模超人民币360亿元，承销规模近人民币百亿元。“中金云投行”线上平台免费帮助中小企业推介股权融资需求，截至6月末，累计服务约85家来自信息技术、新能源、高端制造等多个行业的中小企业，近270位投资人通过平台对接相关项目。中金资本以直接投资助力中小微企业解决融资难融资贵问题、支持中小微企业在不增加杠杆的前提下实现稳定经营，前六个月完成对中小微企业投资超过人民币16亿元，投资中小微企业30笔。

公司参与困难企业资产重组、不良资产处置，协助化解债务风险，助力稳就业。2022年上半年，完成新楚风汽车、盛京能源、隆鑫系企业等标杆项目，涉及债务规模近人民币600亿元，保障就业近3万人。其中，盛京能源集团是沈阳市最大的供暖企业，通过司法重组引入华润电力与盛京资产近人民币8亿元重组投资款，重组完成后，保障超4,000名职工就业岗位，创造年产值超人民币20亿元。

公司发挥金融主业优势，探索创新公益促发展模式。公司2022年上半年发起并成立了首都医疗科技成果转化公益基金会，通过建立公益性经费筹集机制与医疗成果转化专业支撑体系，推动医院、医学院校医疗成果转化改革工作。上述基金会于2022年6月正式获批成立，通过科学、规范的支持成果转化项目、相关人才建设、医疗成果转化平台建设等工作，全面促进首都医疗科技成果转化，推动北京卫生健康创新发展。

此外，公司充分依托志愿服务管理平台，组织员工志愿者开展形式多样的志愿活动，践行志愿服务精神。“中金公益疫情防控志愿先锋队”积极响应公司总部所在地北京市建外街道的倡议，以实际行动助力北京疫情防控。



## 重要事项

## 一、承诺事项履行情况

承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项均得到及时严格履行，不存在未能及时履行的情况，具体如下：

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限
与首次公开发行 相关的承诺	股份限售	中央汇金、中国建投、建投投资、 中国投资咨询	关于持股流通限制的承诺	公司A股上市之日 起36个月	是
	股份限售	中央汇金、中国建投、建投投资、 中国投资咨询	关于持股流通限制期满后 两年内股份减持价格的 承诺	持股流通限制期满 后两年	是
	其他	中央汇金、中国建投、建投投资、 中国投资咨询、海尔金盈	关于持股意向及减持意向 的承诺	长期	是
	其他	公司、除独立董事和不在公司领取 薪酬的董事以外的董事、高级管 理人员	稳定股价的承诺	公司A股上市之日 起三年	是
	其他	董事、高级管理人员	摊薄即期回报采取填补措 施的承诺	长期	是
	其他	公司、中央汇金、董事、监事、高 级管理人员、联席保荐机构、联 席主承销商、发行人律师、发行 人会计师、发行人资产评估机构	招股说明书不存在虚假记 载、误导性陈述或者重 大遗漏的承诺	长期	是
	其他	公司、中央汇金、中国建投、建 投投资、中国投资咨询、海尔金 盈、董事、监事、高级管理人员	未履行承诺的约束措施的 承诺	长期	是
	其他	中央汇金	关于避免同业竞争的承诺	长期	是
	其他	海尔金盈	关于减少和规范关联交 易的承诺	长期	是
	其他承诺	其他	海尔金盈	关于持股流通限制的承诺	取得公司股份之日 起36个月

# 重要事项

## 二、控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

报告期内，公司无控股股东及其他关联方非经营性占用资金的情况。

## 三、违规担保情况

报告期内，公司无违规担保事项。

## 四、会计师事务所变更情况

报告期内，公司未变更会计师事务所。

## 五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

公司2021年年度报告不存在非标准审计意见。

## 六、审计或审阅情况

本公司2022年半年度报告所载的财务资料未经审计。本公司董事会审计委员会已审阅本公司自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间的未经审计的中期业绩，未对本公司所采用的会计政策及会计实务提出异议。本公司外聘审计机构已根据《中国注册会计师审阅准则第2101号—财务报表审阅》审阅本公司自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间的中期财务报表。

## 七、公司对会计政策、会计估计变更或重大会计差错更正的原因和影响的分析说明

报告期内，本集团会计政策变更情况请参阅本报告“中期财务报表附注三”。

报告期内，公司不存在重大会计估计变更及会计差错更正。

## 八、破产重整相关事项

报告期内，公司不存在破产重整相关事项。

## 九、重大诉讼及仲裁事项

报告期内，公司无根据《上交所上市规则》需要披露的重大诉讼、仲裁事项。

# 重要事项

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

报告期内，本公司及本公司的董事、监事、高级管理人员、控股股东概不存在以下情况：涉嫌犯罪被依法立案调查或被依法采取强制措施；受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有权机关重大行政处罚；涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责；因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责；被证券交易所采取纪律处分。

报告期内，公司被中国证监会采取行政监管措施的情况包括：

### 1. 中国证监会对公司采取出具警示函的行政监管措施

2022年5月27日，中国证监会向公司出具了《关于对中国国际金融股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2022]23号）。因中金公司1笔场外期权合约对手方为非专业投资者，违反了《证券公司场外期权业务管理办法》相关规定，中国证监会决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

针对该行政监管措施，公司积极落实整改：固定收益部对外汇、利率场外期权存量客户进行自查，要求不符合场外期权投资者适当性要求的客户补充提交适当性证明材料，如仍不符合准入要求，存量交易到期了结，不展期，不新开交易。目前自查整改均已完成。新增场外期权交易对手方将严格按照场外期权投资者适当性要求进行准入核查，严把入口关。

### 2. 中国证监会对公司采取出具警示函的行政监管措施

2022年6月2日，中国证监会向公司出具了《关于对中国国际金融股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2022]32号）。就公司返程子公司天津佳成投资管理有限公司从事中金公司自用房地产投资开发项目；有46家冗余的特殊目的实体（SPV）未在规定期限内完成清理、22家SPV未在规定期限内完成层级上翻；未按照《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》相关规定修改境外子公司的章程的情况，中国证监会对公司采取出具警示函的行政监管措施。

针对该行政监管措施，公司积极整改，截至报告期末，中金公司境外特殊目的实体简化层级整改工作已完成，天津佳成投资管理有限公司已注销，境外非SPV子公司的章程在当地法律允许的范围内已完成修改。



# 重要事项

## 十一、公司及控股股东、实际控制人诚信状况及独立性的说明

报告期内，公司及控股股东均不存在未履行法院生效法律文书确定的义务、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

报告期内，公司不存在与控股股东以及其他关联方之间不能保证独立性、不能保持自主经营能力的情况。

## 十二、重大关联/连交易事项

本集团严格遵守相关法律法规、上市规则、监管机构要求和内部管理制度开展关联(连)交易，本集团的关联(连)交易遵循公平、公开、公允的原则，相关交易协定的签订遵循平等、自愿、等价、有偿的原则。报告期内，本集团概无根据《联交所上市规则》所进行的非豁免关联交易或持续关联交易。

报告期内，公司日常关联交易(按照《上交所上市规则》定义)按照2020年年度股东大会审议通过的《关于预计2021年度日常关联交易的议案》以及2021年年度股东大会审议通过的《关于预计2022年度日常关联交易的议案》执行。日常经营中发生相关关联交易时，公司严格按照价格公允的原则与关联方确定交易价格，定价参照市场化价格水平、行业惯例、第三方定价确定，不存在实际交易价与市价存在较大差异的情况，具体执行情况如下表，其与依据中国企业会计准则编制的载列于“中期财务报表附注九”的关联方关系及其交易可能存在差异：

1. 已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项：不适用
2. 已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项：

单位：人民币万元

交易类别	交易内容	关联方	相关业务或事项简介	预计金额	实际金额
证券和金融产品服务		Global Bridge Capital Management, LLC	提供投资咨询服务		57.23
	手续费及佣金收入	中国投融资担保股份有限公司	提供证券经纪业务服务		5.92
			提供基金管理服务		553.55
			提供证券经纪业务服务	因业务的发生及规模的不确定性，以实际发生数计算	112.95
	手续费及佣金支出	中国银行股份有限公司浙江省分行	接受资产托管服务		0.09
	利息支出	中国投融资担保股份有限公司	客户交易结算资金利息支出		3.01
证券和金融产品交易	共同投资	中国投融资担保股份有限公司	与关联方共同投资基金		2,538.85
	债券交易	青岛银行股份有限公司	向关联方出售债券		5,000.00

# 重要事项

### 3. 临时公告未披露的事项：不适用

报告期内，除以上与日常经营相关的关联交易以外，公司不存在应当披露的下列情况：

资产或股权收购、出售发生的关联交易；共同对外投资的重大关联交易；关联债权债务往来；与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务；其他重大关联交易。

## 十三、重大合同及其履行情况

### (一) 报告期公司无重大托管、承包、租赁事项

### (二) 担保情况

单位：人民币亿元

#### 公司对外担保情况(不包括对子公司的担保)

报告期内担保发生额合计(不包括对子公司的担保)	-
报告期末担保余额合计(A)(不包括对子公司的担保)	-

#### 公司及其子公司对子公司的担保情况

报告期内对子公司担保发生额合计	43.74
报告期末对子公司担保余额合计(B)	271.88

#### 公司担保总额情况(包括对子公司的担保)

担保总额(A+B)	271.88
担保总额占公司净资产的比例(%)	30.0
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额(C)	-
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额(D)	271.83
担保总额超过净资产50%部分的金额(E)	-
上述三项担保金额合计(C+D+E)	271.83
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	-

注：

1. 上表中净资产指截至报告期末，公司合并财务报表中归属于母公司股东的权益合计。
2. 上表涉及汇率的，按照2022年6月30日人民币兑美元、人民币兑港元汇率折算。

# 重要事项

报告期内，公司及子公司新增及存续的担保事项如下：

## 1. 为间接全资子公司根据境外中期票据计划进行发行提供担保

公司全资子公司中金国际为公司间接全资子公司CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited设立的境外中期票据计划下发行的中期票据，提供无条件及不可撤销的保证担保，担保范围包括票据本金、利息及票据和信托契据下的其他付款义务。

报告期内，CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited根据该次中期票据计划进行了1次发行，发行3年期品种规模6亿美元，以仅售予专业投资者之债务证券方式于2022年3月22日在香港联交所上市及买卖。中金国际为CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited根据该次中期票据计划的前述发行项下的偿付义务，提供无条件及不可撤销的保证担保，截至报告期末，担保金额约合人民币43.74亿元。

除前述报告期内新增的担保外，截至报告期末，该中期票据计划下尚未到期的其他发行及相关担保情况为：2020年，CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited根据该次中期票据计划进行的2次发行，发行规模共计15亿美元，全部为3年期品种。2021年，CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited根据该次中期票据计划进行的2次发行，发行规模共计15亿美元，其中3年期品种发行规模10亿美元；5年期品种发行规模5亿美元。中金国际为CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited根据境外中期票据计划于2020年至2021年期间进行的前述发行提供担保，截至报告期末，担保余额约合人民币207.09亿元。

## 2. 为间接全资子公司境外银行贷款提供担保

中金国际为其下属公司的银行贷款提供担保。报告期内无新增，截至报告期末，担保余额约合人民币21.05亿元。

报告期内，公司其他授权担保事项情况如下：

根据公司2020年年度股东大会决议，公司为拟设立的全资资管子公司提供累计不超过人民币30亿元（含）净资本担保承诺，有效期自资管子公司成立之日起至其资本状况能够持续满足监管要求时止。截至报告期末，该资管子公司暂未成立，该担保承诺暂未履行。

## (三) 其他重大合同

除本报告另有披露外，报告期内，本公司未签署其他重大合同。



## 十四、其他重大事项的说明

## (一) 分支机构变更情况

报告期内，本集团共完成1家证券分公司/营业部新设，具体情况如下：

序号	分公司/营业部名称	注册日期	注册地址
1	中国国际金融股份有限公司苏州分公司	2022-04-20	中国(江苏)自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区苏州中心广场1幢2201室苏州中心办公楼D座22层05、06号

报告期内，本集团共完成22家分公司/证券营业部变更，具体情况如下：

序号	分公司/营业部原称	分公司/营业部现名称	变更前地址	变更后地址
1	不涉及名称变更	中国国际金融股份有限公司山东分公司	济南市历下区龙奥西路1号银丰财富广场D座7层704室	山东省济南市历下区龙奥西路1号银丰财富广场D座17楼1717、1718、1719室
2	不涉及名称变更	中国国际金融股份有限公司重庆分公司	重庆市两江新区财富东路8号1幢即星汇财富国际商务中心10层	重庆市两江新区财富东路8号1幢即星汇财富国际商务中心10层第6#、7#、8#、9-1#单元
3	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司北京建国门外大街证券营业部	北京市朝阳区建国门外大街甲6号爱思开大厦3层02A室	北京市朝阳区建国门外大街2号院3号楼36层3601内01室
4	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司辽宁分公司	辽宁省沈阳市沈河区友好街10号新地中心1号楼33层01、08单元	辽宁省沈阳市和平区青年大街286号15层01-02单元
5	中国中金财富证券有限公司南京太平南路证券营业部	中国中金财富证券有限公司南京龙蟠中路证券营业部	江苏省南京市秦淮区太平南路450号601室	江苏省南京市秦淮区龙蟠中路218号中航科技大厦33层06、07、08室
6	中国中金财富证券有限公司深圳深南中路证券营业部	中国中金财富证券有限公司深圳深业上城证券营业部	广东省深圳市深南中路28A华能大厦19层	广东省深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路5001号深业上城(南区)T1栋18层1803、1804
7	中国中金财富证券有限公司杭州环球中心证券营业部	中国中金财富证券有限公司杭州江河汇证券营业部	浙江省杭州市下城区西湖文化广场19号环球中心20楼	浙江省杭州市上城区之江路1300号中天钱塘银座11层1111、1112室

# 重要事项

序号	分公司/营业部原称	分公司/营业部现名称	变更前地址	变更后地址
8	中国中金财富证券有限公司金华婺江西路证券营业部	中国中金财富证券有限公司金华光南路证券营业部	浙江省金华市婺城区婺江西路28号时代商务中心1幢604室	浙江省金华市金东区多湖街道光南路8号大昌汽车俱乐部总部中心大楼2304室
9	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司广州珠江新城证券营业部	广东省广州市天河区珠江新城洗村路5号凯华国际中心第28层2804、2805、2806、2807、2808房	广东省广州市天河区珠江新城洗村路5号凯华国际中心第29层2901、2902、2903、2904、2907、2908、2909、2910、2911、2912房
10	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司广东分公司	广东省广州市越秀区广州大道中307号901-902房	广东省广州市天河区珠江新城洗村路5号凯华国际中心第28层2804、2805、2806、2807、2808房
11	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司佛山分公司	广东省佛山市顺德区大良镇东乐路266号万邦商业广场1座4-5楼	广东省佛山市顺德区大良街道办事处德和社区居委会国泰南路3号保利商贸中心4栋3101、3102、3103、3104
12	中国中金财富证券有限公司天津南马路证券营业部	中国中金财富证券有限公司天津南京路证券营业部	天津市和平区南市街南马路11号、13号麦购国际大厦一层114号、十层1060、1061号	天津市和平区南营门街南京路219号天津环贸商务中心1001、1006室
13	中国中金财富证券有限公司北京中关村南大街证券营业部	中国中金财富证券有限公司北京万柳中路证券营业部	北京市海淀区中关村南大街乙12号院1号楼22层2601	北京市海淀区万柳蜂鸟家园2号楼1层201
14	中国中金财富证券有限公司湖州龙溪北路证券营业部	中国中金财富证券有限公司湖州仁皇山路证券营业部	浙江省湖州市龙溪北路353号丽阳商务大厦11楼1101-1102室	浙江省湖州市湖盛大厦501室、514室、515室、518室、519室
15	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司深圳分公司	广东省深圳市福田区福田街道福安社区深南大道4009号投资大厦302、303	广东省深圳市福田区福田街道福安社区中心四路1-1号嘉里建设广场第三座T3座903、904



## 重要事项

序号	分公司/营业部原称	分公司/营业部现名称	变更前地址	变更后地址
16	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司济南龙奥西路证券营业部	山东省济南市历下区龙奥西路1号银丰财富广场D座17楼1717、1718、1719室	山东省济南市历下区龙奥西路1号银丰财富广场D座7楼704室
17	中国中金财富证券有限公司广州花都凤凰北路证券营业部	中国中金财富证券有限公司广州花都保利金融中心证券营业部	广东省广州市花都区凤凰北路41号永愉花园酒店1005室	广东省广州市花都区保利金融中心自编9、10、11、15栋天贵路103号(自编15栋)22层2202房
18	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司上海长宁区红宝石路证券营业部	上海市长宁区红宝石路188号1幢33层(实际楼层29层)3306、3307室	上海市长宁区红宝石路188号1幢3306、3307、3205室
19	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司长沙湘江中路证券营业部	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心5号楼3301、3302	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心5号楼3302、3303
20	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司深圳市深圳湾一号证券营业部	广东省深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区科苑南路2233号深圳湾1号广场T1-17A	广东省深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区科苑南路2233号深圳湾1号广场T1-17A、18A
21	不涉及名称变更	中国中金财富证券有限公司厦门湖滨东路证券营业部	福建省厦门市思明区湖滨东路95号1502-1504单元	福建省厦门市思明区湖滨东路95号华润大厦B座1502-1504、1507单元
22	中国中金财富证券有限公司无锡人民中路证券营业部	中国中金财富证券有限公司无锡分公司	不涉及地址变更	江苏省无锡市梁溪区人民中路139号恒隆广场办公楼2座28层2803-2805单元

## (二) 境内外重要子公司信息

截至报告期末，本公司直接控股1家境外子公司，为中金国际；直接控股6家境内子公司，分别为中金财富证券、中金资本、中金基金、中金浦成、中金期货、中金私募股权。详情请参见本报告“管理层讨论与分析—五”。



# 股份变动及股东情况

## 一、股份变动情况

### (一) 股份变动情况

截至报告期末，公司已发行股份总数为4,827,256,868股，其中，A股2,923,542,440股，H股1,903,714,428股。

报告期内及至最后实际可行日期，公司不存在优先股。

报告期内，公司股份总数未发生变化，股份结构的变化详见下表。

#### 1、 股份结构变动情况表

单位：股

	本次变动前		变动数量	本次变动后	
	数量	比例(%)		数量	比例(%)
一、有限售条件股份	2,392,421,159	49.56	-398,500,000	1,993,921,159	41.31
1、国家持股	1,936,155,680	40.11	-	1,936,155,680	40.11
2、国有法人持股	2,734,800	0.06	-	2,734,800	0.06
3、其他内资持股	429,454,757	8.90	-398,500,000	30,954,757	0.64
其中：境内非国有法人持股	429,454,757	8.90	-398,500,000	30,954,757	0.64
境内自然人持股	-	0.00	-	-	0.00
4、外资持股	24,075,922	0.50	-	24,075,922	0.50
其中：境外法人持股	24,075,922	0.50	-	24,075,922	0.50
境外自然人持股	-	0.00	-	-	0.00
二、无限售条件流通股	2,434,835,709	50.44	+398,500,000	2,833,335,709	58.69
1、人民币普通股	531,121,281	11.00	+398,500,000	929,621,281	19.26
2、境内上市的外资股	-	0.00	-	-	0.00
3、境外上市的外资股	1,903,714,428	39.44	-	1,903,714,428	39.44
4、其他	-	0.00	-	-	0.00
三、股份总数	4,827,256,868	100.00	-	4,827,256,868	100.00

注：

- (1) 上表根据公司自股份登记机构取得的在册信息编制。
- (2) 本章节“有限售条件股份”“无限售条件流通股”系根据中国证监会相关规则界定，“境外上市的外资股”即H股。

# 股份变动及股东情况

## 2、 股份结构变动情况说明

海尔金盈持有的398,500,000股首次公开发行A股股票限售股于2022年3月11日起上市流通，详情请参见公司在上交所网站披露的相关公告。公司有限售条件股份与无限售条件流通股份的数量相应变化。

## 3、 报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、每股净资产等财务指标的影响

报告期及至半年报披露日期间，公司股份总数未发生变动，不适用。

## (二) 有限售条件股份变动情况

报告期内，公司有限售条件股份的变动情况如下：

单位：股

股东名称	期初 限售股数	报告期解除 限售股数	报告期增加 限售股数	报告期末 限售股数	限售原因	解除 限售日期
海尔集团(青岛)金盈控股有限公司	398,500,000	398,500,000	-	-	A股发行上市及股东承诺	2022年3月11日
合计	398,500,000	398,500,000	-	-	/	/

## 二、 证券发行与上市情况

报告期内，公司未发行普通股股票、可转换公司债、分离交易可转债和其他衍生证券。

报告期内，公司的债券发行与上市情况请参阅本报告“债券相关情况”及公司在上交所网站披露的债券信息。

## 三、 股东情况

### 1. 股东总数

截至报告期末，公司共有普通股股东109,885户，其中A股股东109,497户，H股登记股东388户。

# 股份变动及股东情况

## 2. 前十名股东、前十名无限售条件股东持股情况

### (1) 前十名股东持股情况

单位：股

股东名称	报告期末 持股数量	占总股本 的比例 (%)	报告期内 增减	持有有限售 条件股份 数量	股份类别	质押、 标记或 冻结情况	股东性质
中央汇金投资有限责任公司	1,936,155,680	40.11	-	1,936,155,680	A股	无	国家
香港中央结算(代理人)有限公司	1,902,951,849	39.42	-3,600	-	H股	未知	境外法人
海尔集团(青岛)金盈控股有限公司	304,950,000	6.32	-93,550,000	-	A股	无	境内非国有法人
中国投融资担保股份有限公司	127,562,960	2.64	-	-	A股	无	国有法人
香港中央结算有限公司	28,903,194	0.60	+13,288,194	-	A股	无	境外法人
中国人寿资管-中国银行-国寿资产-鼎坤优势甄选2232保险资产管理产品	20,670,000	0.43	+20,670,000	-	A股	无	其他
中国人寿资管-中国银行-国寿资产-鼎坤优势甄选2265保险资产管理产品	20,670,000	0.43	+20,670,000	-	A股	无	其他
中国人寿资管-中国银行-国寿资产-鼎坤优势甄选2231保险资产管理产品	20,545,000	0.43	+20,545,000	-	A股	无	其他
中国人寿资管-中国银行-国寿资产-鼎坤优势甄选2266保险资产管理产品	18,625,000	0.39	+18,625,000	-	A股	无	其他
阿布达比投资局	14,567,126	0.30	+655,873	13,757,670	A股	无	境外法人

注：

1. 上表报告期末持股数量、报告期内增减以及股份质押、标记或冻结情况等来源于公司自股份登记机构取得的在册信息或根据该等信息计算。
2. 香港中央结算(代理人)有限公司为公司H股非登记股东所持股份的名义持有人，其持股中包括Tencent Mobility Limited及Des Voeux Investment Company Limited登记在其名下的股份。
3. 香港中央结算有限公司为沪股通投资者所持公司A股股份的名义持有人。
4. 据公司合理查询所知，Des Voeux Investment Company Limited为阿里巴巴集团控股有限公司的全资子公司，其通过香港中央结算(代理人)有限公司持有公司202,844,235股H股非登记股份。阿里巴巴集团控股有限公司亦通过全资子公司阿里巴巴(中国)网络技术有限公司持有公司13,757,670股A股。相关主体于本公司股份及相关股份拥有权益的情况详见本报告本节“六、权益披露”。
5. 据公司合理查询所知，Tencent Mobility Limited为腾讯控股的全资子公司，其通过香港中央结算(代理人)有限公司持有公司216,249,059股H股非登记股份。相关主体于本公司股份及相关股份拥有权益的情况详见本报告本节“六、权益披露”。



# 股份变动及股东情况

## (2) 前十名无限售条件股东持股情况

单位：股

股东名称	持有无限售条件		持股数量
	流通股的数量	股份类别	
香港中央结算(代理人)有限公司	1,902,951,849	H股	1,902,951,849
海尔集团(青岛)金盈控股有限公司	304,950,000	A股	304,950,000
中国投融资担保股份有限公司	127,562,960	A股	127,562,960
香港中央结算有限公司	28,903,194	A股	28,903,194
中国人寿资管－中国银行－国寿资产－鼎坤优势甄选2232保险资产管理产品	20,670,000	A股	20,670,000
中国人寿资管－中国银行－国寿资产－鼎坤优势甄选2265保险资产管理产品	20,670,000	A股	20,670,000
中国人寿资管－中国银行－国寿资产－鼎坤优势甄选2231保险资产管理产品	20,545,000	A股	20,545,000
中国人寿资管－中国银行－国寿资产－鼎坤优势甄选2266保险资产管理产品	18,625,000	A股	18,625,000
国新投资有限公司	14,107,380	A股	14,107,380
中国建设银行股份有限公司－国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	13,153,084	A股	13,153,084

## (3) 其他说明

上述前十名股东中不存在回购专户。

公司未知前十名股东存在委托表决权、受托表决权、放弃表决权的相关安排，亦未知其之间存在关联关系或具有一致行动安排。

# 股份变动及股东情况

## 3. 有限售条件股东持股情况

单位：股

序号	名称	持有的有限售 条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		
			可上市 交易时间	新增可上市交易 股份数量	限售期限
1	中央汇金投资有限责任公司	1,936,155,680			
2	阿布达比投资局	13,757,670			
3	阿里巴巴(中国)网络技术有限公司	13,757,670			
4	中国人寿保险股份有限公司－传统－ 普通保险产品－005L-CT001沪	10,318,252			
5	汶莱投资局	10,318,252	2023年11月2日	-	本公司A股上市 之日起36个月
6	太平人寿保险有限公司－传统－普通 保险产品－022L-CT001沪	6,878,835			
7	中国投资咨询有限责任公司	911,600			
8	中国建银投资有限责任公司	911,600			
9	建投投资有限责任公司	911,600			

上述股东关联关系或一致行动的说明：中国建投、建投投资及中国投资咨询为汇金公司的直接或间接全资子公司。

## 4. 战略投资者或一般法人因配售新股成为前十名股东的情况

名称	获配售股数	约定持股起始日期	约定持股终止日期
阿布达比投资局	13,757,670	2020年11月2日	不适用

# 股份变动及股东情况

## 四、董事、监事和高级管理人员情况

1. 报告期内，现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员不存在持股变动情况
2. 报告期内，董事、监事、高级管理人员不存在被授予股权激励的情况
3. 董事及监事购入股份或债权证的权利

截至报告期末，公司概无授予任何董事、监事或其配偶或未成年子女通过购入本公司股份或债权证的方式而获益的权利，或由其行使任何该等权利；亦无由本公司或其任何附属公司作出安排以令董事、监事或其配偶或未成年子女于任何其他法人团体获得该等权利。

## 五、控股股东或实际控制人变更情况

不适用。

## 六、权益披露

### 1. 董事、监事和最高行政人员拥有之权益及淡仓

截至报告期末，本公司董事、监事和最高行政人员在本公司及其相联法团（按《证券及期货条例》第XV部所指的定义）的股份、相关股份或债权证中拥有以下权益或淡仓，该等权益或淡仓是本公司根据《证券及期货条例》第352条须备存的登记册所记录或根据《联交所上市规则》附录十所载《标准守则》须知会本公司及香港联交所的权益或淡仓：

姓名	股份类别	身份	证券数目／ 所持权益性质	占总股本 的比例(%)	占相关类别股 总数的比例(%)
黄朝晖	H股	其他 <sup>(注1)</sup>	7,240,173／好仓	0.15	0.38

注：

(1) 黄朝晖先生通过认购基金及资产管理计划间接持有权益。



# 股份变动及股东情况

## 2. 主要股东拥有之权益及淡仓

截至报告期末，就本公司和董事合理查询后所知，以下人士（并非上述披露的本公司董事、监事或最高行政人员）于股份或相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第XV部第2及3分部须向本公司披露并根据《证券及期货条例》第336条已记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓：

名称	股份类别	身份	证券数目/ 所持权益性质	占总股本 的比例(%)	占相关类别股 总数的比例(%)
汇金公司 <sup>(注1)</sup>	A股	实益拥有人	1,936,155,680 / 好仓	40.11	66.23
		受控法团权益	2,734,800 / 好仓	0.06	0.09
海尔集团公司 <sup>(注2)</sup>	A股	受控法团权益	304,950,000 / 好仓	6.32	10.43
阿里巴巴集团控股有限公司 <sup>(注3)</sup>	H股	受控法团权益	202,844,235 / 好仓	4.20	10.66
	A股	受控法团权益	13,757,670 / 好仓	0.28	0.47
腾讯控股 <sup>(注4)</sup>	H股	受控法团权益	216,249,059 / 好仓	4.48	11.36

注：

- (1) 中国建投、建投投资及中国投资咨询均由汇金公司全资拥有。因此，根据《证券及期货条例》，汇金公司被视为于中国建投、建投投资及中国投资咨询持有的2,734,800股A股中拥有权益。
- (2) 截至报告期末，海尔卡奥斯股份有限公司（作为海尔集团（青岛）金盈控股有限公司的唯一股东）、青岛海创客管理咨询企业（有限合伙）（拥有海尔卡奥斯股份有限公司48.8%的权益）、海尔集团公司（拥有海尔卡奥斯股份有限公司51.2%的权益）及青岛海创客投资管理有限公司（作为青岛海创客管理咨询企业（有限合伙）的普通合伙人拥有其0.5%的权益），在《证券及期货条例》下均被视为于海尔集团（青岛）金盈控股有限公司持有的A股股份中拥有权益。
- (3) 截至报告期末，Des Voeux Investment Company Limited持有本公司202,844,235股H股。Des Voeux Investment Company Limited由Alibaba Group Treasury Limited全资拥有，而Alibaba Group Treasury Limited由阿里巴巴集团控股有限公司全资拥有。因此，Alibaba Group Treasury Limited及阿里巴巴集团控股有限公司在《证券及期货条例》下均被视为于Des Voeux Investment Company Limited持有的202,844,235股H股中拥有权益。此外，阿里巴巴（中国）网络技术有限公司持有本公司13,757,670股A股。阿里巴巴（中国）网络技术有限公司由阿里巴巴集团控股有限公司全资拥有。因此，阿里巴巴集团控股有限公司在《证券及期货条例》下被视为于阿里巴巴（中国）网络技术有限公司持有的13,757,670股A股中拥有权益。
- (4) 截至报告期末，Tencent Mobility Limited为腾讯控股的全资子公司，腾讯控股被视为在Tencent Mobility Limited持有的H股中拥有权益，Tencent Mobility Limited直接于216,249,059股H股拥有权益。

## 七、购买、出售或赎回本公司之证券

报告期内，除本报告另有披露外，本公司或其附属公司概无购买、出售或赎回本公司任何证券。

# 债券相关情况

## 一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

### (一) 报告期内，公司无企业债券

### (二) 公司债券

#### 1. 结构情况

截至报告期末，本公司有息债务余额人民币1,713.92亿元，其中公司信用类债券<sup>3</sup>余额人民币1,005.45亿元，占有息债务余额的58.66%；其他有息债务余额人民币708.48亿元，占有息债务余额的41.34%。

单位：亿元 币种：人民币

有息债务类别	已逾期	到期时间 <sup>4</sup>			合计
		6个月以内(含)	6个月(不含)至1年(含)	超过1年以上(不含)	
应付短期融资款	-	59.13	5.07	-	64.20
拆入资金	-	229.96	67.28	-	297.24
卖出回购金融资产款	-	347.04	-	-	347.04
公司信用类债券	-	143.82	194.45	667.17	1,005.45
合计	-	779.94	266.81	667.17	1,713.92

截至报告期末，本公司发行的公司信用类债券中，公司债券余额人民币855.72亿元，金融债券余额人民币25.73亿元，永续次级债券余额人民币124.00亿元；其中，共有人民币143.82亿元公司信用类债券在2022年下半年到期或可回售偿付。

#### 2. 有息债务及其变动情况

- (1) 报告期初本集团有息债务总额为人民币2,598.52亿元，报告期末本集团有息债务总额人民币2,850.41亿元，增长9.69%。

报告期末本集团的有息债务中，公司信用类债券<sup>3</sup>余额人民币1,462.55亿元，占有息债务余额的51.31%，其中2022年下半年到期或可回售的公司信用类债券为人民币236.17亿元；其他有息债务余额人民币1,387.86亿元，占有息债务余额的48.69%。

单位：亿元 币种：人民币

有息债务类别	已逾期	到期时间 <sup>4</sup>			合计
		6个月以内(含)	6个月(不含)至1年(含)	超过1年以上(不含)	
收益凭证	-	111.15	8.48	-	119.62
结构性票据	-	8.47	5.24	-	13.71
拆入资金	-	374.08	75.04	-	449.12
卖出回购金融资产款	-	562.86	-	-	562.86
公司信用类债券	-	236.17	265.12	961.26	1,462.55
中期票据	-	-	67.27	175.27	242.54
合计	-	1,292.73	421.15	1,136.54	2,850.41

- (2) 截至报告期末，本集团发行的境外中期票据余额人民币242.54亿元；本集团发行的境外结构性票据余额人民币13.71亿元，其中，将在2022年下半年内到期的境外结构性票据余额为人民币8.47亿元。

<sup>3</sup> 包含余额为人民币124亿元计入权益的永续次级债券。

<sup>4</sup> 剩余期限的计算基准为提前赎回/回售选择权行权日，带有可随时终止条款的债务工具划分至6个月以内(含)。

# 债券相关情况

单位：亿元 币种：人民币

是否存在  
终止上市  
交易的  
风险及  
其应对措施

投资者  
适当性  
安排 交易机制

受托管理人

主承销商

交易所

还本付息方式

债券利率

余额 (%)

到期日

起息日

发行日

代码

简称

债券名称

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	余额 (%)	债券利率	还本付息方式	交易所	主承销商	受托管理人	投资者适当性安排	交易机制	是否存在终止上市交易的风险及其应对措施
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向专业投资者)(第六期)(品种一)	20中金11	175262.SH	2020/10/16	2020/10/19	2023/10/19	25	3.50	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向专业投资者)(第七期)(品种一)	20中金13	175325.SH	2020/10/27	2020/10/28	2023/10/28	20	3.48	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2017年次级债券(第三期)	17中金C3	145689.SH	2017/11/15	2017/11/16	2022/11/16	15	5.50	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、建投证券	中信证券	面向合格机构投资者	匹配成交、询价成交、竞买成交、点击成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2019年公司债券(面向合格投资者)(第一期)	19中金04	163019.SH	2019/11/20	2019/11/21	2025/11/21	15	3.52	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、建投证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(面向专业机构投资者)(第四期)(品种一)	20中金F4	177385.SH	2020/12/11	2020/12/14	2023/12/14	25	3.85	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	匹配成交、询价成交、询价成交、点击成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2021年公司债券(面向专业机构投资者)(第一期)(品种一)	21中金F1	177614.SH	2021/1/15	2021/1/18	2024/1/18	25	3.55	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	匹配成交、询价成交、询价成交、点击成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(第一期)(疫情防控债)	20中金F1	166132.SH	2020/2/25	2020/2/26	2025/2/26	40	3.20	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向合格机构投资者	匹配成交、询价成交、询价成交、点击成交和协商成交	否

### 3. 公司债券基本情况



## 债券相关情况

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券利率 余额 (%)	还本付息方式	交易场所	主承销商	受托管理人	投资者 适当性 安排	交易机制	是否存在 终止上市 交易的 风险及 其应对措施
中国国际金融股份有限公司非公开发行2021年公司债券(面向专业机构投资者)(第二期)(品种一)	21中金F3	178000.SH	2021/3/3	2021/3/4	2024/3/4	15	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、 中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(面向合格投资者)(第一期)(品种一)	20中金G1	163361.SH	2020/4/2	2020/4/3	2026/4/3	15	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、 中信建投证券	中信证券	面向合格投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2021年公司债券(面向专业机构投资者)(第三期)(品种一)	21中金F5	178338.SH	2021/4/12	2021/4/13	2024/4/13	10	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、 中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2018年次级债券(第一期)	18中金C1	150315.SH	2018/4/19	2018/4/20	2023/4/20	10	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、 建投证券	中信证券	面向合格机构投资者	点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(面向合格投资者)(第二期)(品种一)	20中金G3	163513.SH	2020/4/30	2020/5/6	2026/5/6	33	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、 建投证券	中信证券	面向合格投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(第二期)	20中金F2	166857.SH	2020/5/27	2020/5/28	2025/5/28	30	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、 华泰联合证券	中信证券	面向合格机构投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(面向合格投资者)(第三期)(品种一)	20中金G5	163610.SH	2020/6/19	2020/6/22	2026/6/22	15	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、 建投证券	中信证券	面向合格投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(第三期)	20中金F3	167287.SH	2020/7/23	2020/7/24	2025/7/24	30	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、 华泰联合证券	中信证券	面向合格机构投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交和协商成交	否

# 债券相关情况

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券利率		还本付息方式	交易场所	主承销商	受托管理人	投资者适当性安排	交易机制	是否存在终止上市交易的风险及其应对措施
						余额 (%)	利率							

中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向专业投资者)(第四期)(品种一)	20中金07	175122.SH	2020/9/9	2020/9/10	2025/9/10	50	3.78	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向专业投资者)(第五期)(品种一)	20中金09	175190.SH	2020/9/22	2020/9/23	2025/9/23	50	3.80	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向专业投资者)(第六期)(品种一)	20中金12	175263.SH	2020/10/16	2020/10/19	2025/10/19	25	3.74	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向专业投资者)(第七期)(品种二)	20中金14	175326.SH	2020/10/27	2020/10/28	2025/10/28	30	3.68	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年公司债券(面向专业机构投资者)(第四期)(品种二)	20中金F5	177386.SH	2020/12/11	2020/12/14	2025/12/14	25	4.09	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2021年公司债券(面向专业机构投资者)(第一期)(品种二)	21中金F2	177615.SH	2021/1/15	2021/1/18	2026/1/18	25	3.75	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年次级债券(面向专业投资者)(第一期)(品种一)	21中金C1	175749.SH	2021/2/5	2021/2/8	2024/2/8	10	3.90	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰联合证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2021年公司债券(面向专业机构投资者)(第二期)(品种二)	21中金F4	178001.SH	2021/3/3	2021/3/4	2026/3/4	20	3.82	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否

## 债券相关情况

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (%)	利率	还本付息方式	交易场所	主承销商	受托管理人	投资者适当性安排	交易机制	是否存在终止上市交易的风险及其应对措施
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年公司债券(面向专业投资者)(第一期)(品种一)	21中金G1	175856.SH	2021/3/15	2021/3/16	2026/3/16	20	3.58	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年公司债券(面向专业投资者)(第二期)(品种一)	21中金G3	175905.SH	2021/3/24	2021/3/25	2026/3/25	15	3.51	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2021年公司债券(面向专业机构投资者)(第三期)(品种二)	21中金T6	178339.SH	2021/4/12	2021/4/13	2026/4/13	35	3.70	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、中信建投证券	华泰联合证券	面向专业机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年公司债券(面向专业投资者)(第三期)(品种一)	21中金G5	188575.SH	2021/8/13	2021/8/16	2026/8/16	10	3.04	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2019年次级债券(第二期)	19中金C3	162273.SH	2019/10/11	2019/10/14	2024/10/14	15	4.09	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	中信证券、东吴证券	中信证券	面向合格机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2019年次级债券(第三期)	19中金C4	162470.SH	2019/11/8	2019/11/11	2024/11/11	15	4.12	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	中信证券、东吴证券	中信证券	面向合格机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司非公开发行2019年次级债券(第四期)	19中金C5	162645.SH	2019/12/4	2019/12/5	2024/12/5	20	4.20	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	中信证券、东吴证券	中信证券	面向合格机构投资者	点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否
中国国际金融股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	21中金G7	185097.SH	2021/12/7	2021/12/8	2024/12/8	25	2.97	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本息的兑付一起支付	上交所	兴业证券、华泰联合证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交和协商成交	否



# 债券相关情况

是否存在  
终止上市  
交易的  
风险及  
其应对措施

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券利率		还本付息方式	交易场所	主承销商	受托管理人	投资者 适当性 安排	交易机制	是否存 在 终止 上市 交易 的 风 险 及 其 对 应 措 施
						余额	(%)							
中国国际金融股份有限公司非公开发行2020年次级债券(第一期)	20中金C1	166069.SH	2020/2/14	2020/2/17	2025/2/17	15	3.85	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、东吴证券	中信证券	面向合格机构投资者	点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向合格投资者)(第一期)(品种二)	20中金G2	163362.SH	2020/4/2	2020/4/3	2027/4/3	10	3.25	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、中信建投证券	中信证券	面向合格投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2020年公司债券(面向合格投资者)(第二期)(品种二)	20中金G4	163514.SH	2020/4/30	2020/5/6	2027/5/6	7	2.88	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、中信建投证券	中信证券	面向合格投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年次级债券(面向合格投资者)(第一期)(品种二)	21中金C2	175750.SH	2021/2/5	2021/2/8	2026/2/8	10	4.49	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰证券	中信证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年公司债券(面向合格投资者)(第二期)(品种二)	21中金G6	188576.SH	2021/8/13	2021/8/16	2028/8/16	15	3.39	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年公司债券(面向合格投资者)(第三期)(品种二)	21中金G2	175857.SH	2021/3/15	2021/3/16	2031/3/16	20	4.10	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行2021年公司债券(面向合格投资者)(第二期)(品种二)	21中金G4	175906.SH	2021/3/24	2021/3/25	2031/3/25	25	4.07	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否
中国国际金融股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种二)	21中金G8	185091.SH	2021/12/7	2021/12/8	2031/12/8	10	3.68	每年付息一次,到期一次还本,最后一期利息随本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券、兴业证券	华泰联合证券	面向专业投资者	匹配成交、点击成交、询价成交、竞价成交、买成交、协商成交	否

## 债券相关情况

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券利率 余额 (%)	还本付息方式	交易所	主承销商	受托管理人	投资者 适当性 安排	交易机制	是否存在 终止上市 交易的 风险及 其应对措施
中国国际金融股份有限公司公开发行 2020年永续次级债券(面向专业机构 投资者)(第一期)	20中金Y1	175075.SH	2020/8/27	2020/8/28	-	50	每年付息一次,到期一次 还本,最后一期利息随 本金的兑付一起支付	上交所	华泰联合证券	华泰联合证券	面向专业机 构投资者	匹配成交、点击成交、询 价成交、竞买成交和协 商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行 2021年永续次级债券(面向专业投资 者)(第一期)	21中金Y1	175720.SH	2021/1/28	2021/1/29	-	15	每年付息一次,到期一次 还本,最后一期利息随 本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰 联合证券	中信证券	面向专业投 资者	匹配成交、点击成交、询 价成交、竞买成交和协 商成交	否
中国国际金融股份有限公司公开发行 2021年永续次级债券(面向专业投资 者)(第二期)	21中金Y2	188054.SH	2021/4/23	2021/4/26	-	20	每年付息一次,到期一次 还本,最后一期利息随 本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰 联合证券	中信证券	面向专业投 资者	匹配成交、点击成交、询 价成交、竞买成交和协 商成交	否
中国国际金融股份有限公司2022年面 向专业投资者公开发行永续次级债 券(第一期)	22中金Y1	185245.SH	2022/1/12	2022/1/13	-	39	每年付息一次,到期一次 还本,最后一期利息随 本金的兑付一起支付	上交所	中信证券、华泰 联合证券	中信证券	面向专业投 资者	匹配成交、点击成交、询 价成交、竞买成交和协 商成交	否

注：报告期内，公司无逾期未偿还债券。

## 债券相关情况

### 4. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款等特殊条款的触发和执行情况

#### (1) 公司债券选择权条款在报告期内的触发和执行情况

##### a. 包括调整票面利率选择权、回售选择权的债券列示如下：

债券代码：163019.SH、166132.SH、163361.SH、163362.SH、163513.SH、163514.SH、166857.SH、163610.SH、167287.SH、175122.SH、175190.SH、175262.SH、175263.SH、175325.SH、175326.SH、177385.SH、177386.SH、177614.SH、177615.SH、178000.SH、178001.SH、175856.SH、175905.SH、178338.SH、178339.SH、188575.SH、188576.SH

债券简称：19中金04、20中金F1、20中金G1、20中金G2、20中金G3、20中金G4、20中金F2、20中金G5、20中金F3、20中金07、20中金09、20中金11、20中金12、20中金13、20中金14、20中金F4、20中金F5、21中金F1、21中金F2、21中金F3、21中金F4、21中金G1、21中金G3、21中金F5、21中金F6、21中金G5、21中金G6

选择权条款的触发和执行情况：报告期内，上述债券未到行权期。

##### b. 包括发行人满足特定条件的赎回选择权、递延支付利息权、赎回权、续期选择权的债券列示如下：

债券代码：175075.SH、175720.SH、188054.SH、185245.SH

债券简称：20中金Y1、21中金Y1、21中金Y2、22中金Y1

选择权条款的触发和执行情况：报告期内，上述债券未到行权期。

#### (2) 公司债券投资者保护条款在报告期内的触发和执行情况

包括投资者保护条款的债券列示如下：

债券代码：185097.SH、185091.SH、185245.SH

债券简称：21中金G7、21中金G8、22中金Y1



## 债券相关情况

债券约定的投资者保护条款：

### （一）资信维持承诺

1. 发行人承诺，在本期债券存续期内，不发生如下情形：发行人发生一个自然年度内减资超过原注册资本20%以上、分立、被责令停产停业的情形。
2. 发行人在债券存续期内，出现违反上述第1条约定的资信维持承诺情形的，发行人将及时采取措施以在半年内恢复承诺相关要求。
3. 当发行人发生违反资信维持承诺、发生或预计发生将影响偿债能力相关事项的，发行人将在2个交易日内告知受托管理人并履行信息披露义务。
4. 发行人违反资信维持承诺且未在上述第2条约定期限内恢复承诺的，持有人有权要求发行人按照救济措施的约定采取负面事项救济措施。

### （二）救济措施

1. 如发行人违反相关承诺要求且未能在资信维持承诺第2条约定期限恢复相关承诺要求或采取相关措施的，经持有本期债券30%以上的持有人要求，发行人将于收到要求后的次日立即采取如下救济措施之一，争取通过债券持有人会议等形式与债券持有人就违反承诺事项达成和解：
  - 在30个自然日内为本期债券增加担保或其他增信措施。
  - 在30个自然日内提供并落实经本期债券持有人认可的其他和解方案。
2. 持有人要求发行人实施救济措施的，发行人应当在2个交易日内告知受托管理人并履行信息披露义务，并及时披露救济措施的落实进展。

投资者保护条款的触发和执行情况：报告期内未触发投资者保护条款。

## 5. 报告期内，境内评级公司对公司的信用评级未发生调整

# 债券相关情况

## 6. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响：

现状	执行情况	是否发生变更
公司存续的公司债券均采用无担保方式发行，根据公司债券募集说明书的约定，履行偿债计划。根据募集说明书的约定，公司偿债保障措施包括设立专门的偿付工作小组、切实做到专款专用、充分发挥债券受托管理人的作用、制定债券持有人会议规则、严格的信息披露等。	报告期内，公司严格履行募集说明书中有关偿债计划和偿债保障措施的约定，按时足额支付各项债券利息和本金，专项账户运转规范，相关计划和措施与募集说明书的相关承诺保持一致。	否

## 7. 公司债券报告期内募集资金使用情况

报告期内公司使用债券募集资金的情况如下：

单位：亿元 币种：人民币

债券简称	募集	资金总额	募集资金		报告期内募集资金专户运作情况	是否调整或改变募集资金用途	报告期内募集资金是否存在违规使用	报告期内募集资金使用是否符合地方政府债务管理规定	截至报告期末实际的募集资金使用用途	报告期内募集资金使用情况是否与募集说明书的约定一致	募集资金用途是否包含用于项目建设，项目的进展情况及运营效益(如有)
			报告期内使用金额	募集资金期末余额							
22中金Y1	39	31	0	正常	本期债券募集资金扣除发行费用后，拟全部用于偿还或置换到期公司债券。	否	否	是	本期债券募集资金扣除发行费用后，全部用于偿还或置换到期公司债券。	是	否

注：22中金Y1(185245.SH)于2021年度已使用人民币8亿元募集资金。

## 8. 公司及公司发行的债券不存在违反法律法规、《公司章程》、信息披露事务管理制度等规定的情况以及债券募集说明书约定或者承诺的情况。

## 债券相关情况

(三) 报告期内，公司无银行间债券市场非金融企业债务融资工具

(四) 报告期内，公司无合并报表范围亏损超过上年末净资产10%的情况

(五) 主要会计数据和财务指标

单位：元 币种：人民币

主要指标	2022年 6月30日	2021年 12月31日	变动比例(%)
流动比率	1.76	1.82	(3.35)
速动比率	1.76	1.82	(3.35)
资产负债率(%)	84.12	84.57	下降0.45个百分点

主要指标	2022年1-6月	2021年1-6月	变动比例(%)	变动原因
归属于母公司股东的扣除 非经常性损益的净利润	3,764,063,250	4,952,414,436	(24.00)	
EBITDA全部债务比(%)	3.42	4.27	下降0.84个 百分点	
利息保障倍数	2.09	2.61	(19.64)	
现金利息保障倍数	6.53	(0.50)	不适用	主要是由于2022年上半年 经营活动相关的现金为 净流入，2021年同期为 净流出。
EBITDA利息保障倍数	2.28	2.75	(17.09)	
贷款偿还率(%)	100.00	100.00	-	
利息偿付率(%)	100.00	100.00	-	

二、报告期内，公司无可转换公司债券



# 审阅报告

德师报(阅)字(22)第R00051号

中国国际金融股份有限公司全体股东：

我们审阅了后附第83至241页的中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)中期财务报表,包括2022年6月30日的合并及母公司资产负债表,自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司股东权益变动表以及相关财务报表附注。上述中期财务报表的编制是中金公司管理层的责任,我们的责任是在实施审阅工作的基础上对中期财务报表出具审阅报告。

我们按照《中国注册会计师审阅准则第2101号—财务报表审阅》的规定执行了审阅业务。该准则要求我们计划和实施审阅工作,以对财务报表是否不存在重大错报获取有限保证。审阅主要限于询问中金公司有关人员和财务数据实施分析程序,提供的保证程度低于审计。我们没有实施审计,因而不发表审计意见。

根据我们的审阅,我们没有注意到任何事项使我们相信上述中期财务报表没有在所有重大方面按照《企业会计准则第32号—中期财务报告》的要求编制。

中国注册会计师：马庆辉

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
中国·上海

中国注册会计师：韩云飞

2022年8月30日

## 合并资产负债表

2022年6月30日 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

资产	附注	2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)
货币资金	七、1	142,917,637,312	135,106,058,236
其中: 客户资金存款		80,600,707,695	75,342,109,051
结算备付金	七、2	20,519,939,739	22,074,426,966
其中: 客户备付金		13,864,855,962	15,695,281,262
融出资金	七、3	35,147,752,304	39,479,056,714
衍生金融资产	七、4	19,034,460,568	14,564,228,663
存出保证金	七、5	12,063,601,058	12,631,912,764
应收款项	七、6	55,974,007,114	45,742,880,588
买入返售金融资产	七、7	38,509,752,865	25,858,494,059
金融投资:			
交易性金融资产	七、8	296,686,462,225	301,174,215,104
其他债权投资	七、9	47,955,748,059	43,009,969,681
长期股权投资	七、10	1,092,904,165	1,086,935,585
固定资产	七、11	725,701,556	680,473,112
在建工程	七、12	255,876,685	189,436,852
使用权资产	七、13	1,995,250,759	1,945,816,108
无形资产	七、14	1,540,733,056	1,478,289,491
商誉	七、15	1,622,663,283	1,622,663,283
递延所得税资产	七、16	1,728,642,572	1,628,639,392
其他资产	七、17	2,223,234,325	1,521,992,617
资产总计		679,994,367,645	649,795,489,215

# 合并资产负债表(续)

2022年6月30日(除特别注明外,金额单位:人民币元)

负债及股东权益	附注	2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)
<b>负债</b>			
应付短期融资款	七、19	18,445,942,406	22,989,857,489
拆入资金	七、20	44,912,256,024	51,477,278,678
交易性金融负债	七、21	42,543,566,051	38,926,786,684
衍生金融负债	七、4	12,957,787,511	18,134,007,508
卖出回购金融资产款	七、22	56,286,047,663	16,376,070,951
代理买卖证券款	七、23	105,975,162,663	93,445,165,307
代理承销证券款	七、24	386,055,000	7,304,310,900
应付职工薪酬	七、25	6,558,281,330	11,168,865,080
应交税费	七、26	1,536,811,099	1,597,169,578
应付款项	七、27	135,956,714,734	134,908,863,413
合同负债	七、28	530,151,219	412,950,874
租赁负债	七、29	2,082,303,570	2,002,895,426
应付债券	七、30	152,997,198,736	160,508,549,775
递延所得税负债	七、16	545,824,487	431,655,234
其他负债	七、31	7,190,630,767	5,380,225,891
<b>负债合计</b>		<b>588,904,733,260</b>	<b>565,064,652,788</b>
<b>股东权益</b>			
股本	七、32	4,827,256,868	4,827,256,868
其他权益工具	七、33	12,400,000,000	8,500,000,000
其中:永续次级债券		12,400,000,000	8,500,000,000
资本公积	七、34	39,531,886,525	39,531,886,525
其他综合收益	七、35	(244,400,640)	(828,441,057)
盈余公积	七、36	1,392,448,797	1,392,448,797
一般风险准备	七、37	5,620,776,023	5,470,061,175
未分配利润		27,245,057,495	25,528,908,966
<b>归属于母公司股东的权益合计</b>		<b>90,773,025,068</b>	<b>84,422,121,274</b>
<b>少数股东权益</b>		<b>316,609,317</b>	<b>308,715,153</b>
<b>股东权益合计</b>		<b>91,089,634,385</b>	<b>84,730,836,427</b>
<b>负债及股东权益总计</b>		<b>679,994,367,645</b>	<b>649,795,489,215</b>

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

第83页至第241页的中期财务报表已于2022年8月30日获本公司董事会批准。

沈如军

法定代表人

黄劲峰

主管会计工作负责人

田汀

会计机构负责人



# 母公司资产负债表

2022年6月30日（除特别注明外，金额单位：人民币元）

资产	附注	2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)
货币资金		52,302,808,642	40,486,353,389
其中：客户资金存款		13,333,292,404	14,600,955,429
结算备付金		8,243,837,413	8,116,043,582
其中：客户备付金		3,664,020,432	3,707,954,387
融出资金		2,450,728,220	3,001,822,335
衍生金融资产		14,148,496,400	12,348,351,195
存出保证金		1,233,639,884	1,184,105,034
应收款项		27,322,454,852	38,074,249,428
买入返售金融资产		33,600,662,836	21,370,217,935
金融投资：			
交易性金融资产		154,292,370,973	148,144,757,401
其他债权投资		28,820,763,582	25,515,241,608
长期股权投资	八、1	27,930,477,427	27,460,301,227
固定资产		504,264,723	480,929,364
使用权资产		480,748,066	558,563,929
无形资产		271,387,552	224,087,056
递延所得税资产		996,139,941	1,027,518,156
其他资产		3,338,535,983	2,368,880,309
资产总计		355,937,316,494	330,361,421,948

# 母公司资产负债表(续)

2022年6月30日(除特别注明外,金额单位:人民币元)

负债及股东权益	附注	2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)
<b>负债</b>			
应付短期融资款		6,420,167,179	9,518,576,154
拆入资金		29,723,596,179	31,203,985,700
交易性金融负债		10,173,898,991	530,502,335
衍生金融负债		12,278,708,663	14,133,736,779
卖出回购金融资产款		34,703,862,510	4,271,897,912
代理买卖证券款		16,749,550,878	11,205,854,169
代理承销证券款		386,055,000	7,304,310,900
应付职工薪酬		4,363,747,605	7,155,376,942
应交税费		221,486,281	239,339,917
应付款项		77,230,509,567	85,000,991,604
合同负债		143,053,130	117,421,490
租赁负债		503,513,886	576,921,556
应付债券		88,144,608,281	91,192,385,388
其他负债		3,157,849,991	1,253,514,882
<b>负债合计</b>		<b>284,200,608,141</b>	<b>263,704,815,728</b>
<b>股东权益</b>			
股本	七、32	4,827,256,868	4,827,256,868
其他权益工具	七、33	12,400,000,000	8,500,000,000
其中:永续次级债券		12,400,000,000	8,500,000,000
资本公积		41,698,292,045	41,698,292,045
其他综合收益		80,615,965	106,826,215
盈余公积	七、36	1,392,448,797	1,392,448,797
一般风险准备		3,922,956,277	3,919,804,534
未分配利润		7,415,138,401	6,211,977,761
<b>股东权益合计</b>		<b>71,736,708,353</b>	<b>66,656,606,220</b>
<b>负债及股东权益总计</b>		<b>355,937,316,494</b>	<b>330,361,421,948</b>

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军

法定代表人

黄劲峰

主管会计工作负责人

田汀

会计机构负责人

## 合并利润表

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
营业收入		12,131,585,605	14,461,053,892
手续费及佣金净收入	七、38	7,097,565,948	7,191,585,123
其中: 经纪业务手续费净收入		2,582,278,020	2,798,152,293
投资银行业务手续费净收入		2,681,017,822	2,694,005,205
资产管理业务手续费净收入		705,155,995	628,093,309
利息净支出	七、39	(371,363,592)	(511,072,887)
其中: 利息收入		3,920,342,897	3,431,922,995
利息支出		(4,291,706,489)	(3,942,995,882)
投资损失	七、40	(1,140,528,456)	(2,925,062,801)
其中: 对联营企业和合营企业投资收益		15,961,558	33,963,901
其他收益	七、41	119,726,176	82,092,695
公允价值变动收益	七、42	6,201,033,270	11,122,500,821
汇兑收益/(损失)		214,030,830	(512,279,446)
其他业务收入	七、43	7,187,494	9,980,040
资产处置收益		3,933,935	3,310,347
营业支出		7,593,895,471	8,329,530,843
税金及附加	七、44	65,934,659	59,437,226
业务及管理费	七、45	7,595,890,300	8,299,259,394
信用减值转回	七、46	(68,267,500)	(29,502,853)
其他业务成本		338,012	337,076
营业利润		4,537,690,134	6,131,523,049
加: 营业外收入		4,351,527	3,647,508
减: 营业外支出	七、47	23,634,113	16,100,067
利润总额		4,518,407,548	6,119,070,490
减: 所得税费用	七、48	668,873,137	1,103,142,914
净利润		3,849,534,411	5,015,927,576



# 合并利润表(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
按经营持续性分类:			
持续经营净利润		3,849,534,411	5,015,927,576
按所有权归属分类:			
归属于母公司股东的净利润	七、49	3,841,640,437	5,007,028,294
归属于少数股东的净利润		7,893,974	8,899,282
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		584,040,417	(89,090,081)
将重分类进损益的其他综合收益:			
— 其他债权投资公允价值变动		(265,628,055)	41,290,542
— 其他债权投资信用减值准备		58,520,765	(5,571,478)
— 外币财务报表折算差额		787,724,987	(124,809,145)
— 其他		3,422,720	—
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		—	—
其他综合收益的税后净额	七、35	584,040,417	(89,090,081)
综合收益总额		4,433,574,828	4,926,837,495
归属于母公司股东的综合收益总额		4,425,680,854	4,917,938,213
归属于少数股东的综合收益总额		7,893,974	8,899,282
基本每股收益(元/股)	七、49	0.74	1.00

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军	黄劲峰	田汀
法定代表人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

# 母公司利润表

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
营业收入		7,692,189,491	7,064,639,388
手续费及佣金净收入	八、2	4,053,686,225	3,774,260,839
其中: 经纪业务手续费净收入		1,075,643,065	1,263,162,565
投资银行业务手续费净收入		2,220,660,216	1,611,508,762
资产管理业务手续费净收入		473,101,741	548,785,145
利息净支出	八、3	(946,479,218)	(928,768,940)
其中: 利息收入		1,563,552,535	1,478,884,312
利息支出		(2,510,031,753)	(2,407,653,252)
投资收益	八、4	577,218,380	1,434,491,688
其中: 对联营企业和合营企业投资损失		(29,823,800)	(8,563,178)
其他收益		51,581,687	60,577,833
公允价值变动收益	八、5	3,755,610,188	2,750,251,329
汇兑收益/(损失)		198,783,510	(29,042,598)
其他业务收入		525,933	566,038
资产处置收益		1,262,786	2,303,199
营业支出		4,483,492,823	4,868,977,832
税金及附加		28,873,358	34,290,042
业务及管理费	八、6	4,473,600,446	4,825,081,391
信用减值(转回)/损失		(18,980,981)	9,606,399
营业利润		3,208,696,668	2,195,661,556
加: 营业外收入		4,107,282	2,543,752
减: 营业外支出		16,735,937	3,348,067
利润总额		3,196,068,013	2,194,857,241
减: 所得税费用		14,978,570	42,630,304
净利润		3,181,089,443	2,152,226,937
按经营持续性分类:			
持续经营净利润		3,181,089,443	2,152,226,937
将重分类进损益的其他综合收益:			
— 其他债权投资公允价值变动		(28,151,878)	57,311,918
— 其他债权投资信用减值准备		1,941,628	(1,003,714)
其他综合收益的税后净额		(26,210,250)	56,308,204
综合收益总额		3,154,879,193	2,208,535,141

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军

法定代表人

黄劲峰

主管会计工作负责人

田汀

会计机构负责人

# 合并现金流量表

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
<b>经营活动产生的现金流量</b>			
融出资金净减少额		4,534,437,506	-
为交易目的而持有的金融工具净减少额		25,830,507,049	-
代理买卖证券收到的现金净额		12,530,002,111	15,398,710,183
收取利息、手续费及佣金的现金		11,928,298,225	10,908,452,201
回购业务资金净增加额		27,246,516,299	-
收到其他与经营活动有关的现金		6,285,850,978	34,995,606,645
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>88,355,612,168</b>	<b>61,302,769,029</b>
<b>融出资金净增加额</b>			
融出资金净增加额		-	2,414,854,663
为交易目的而持有的金融工具净增加额		-	36,944,960,983
支付利息、手续费及佣金的现金		2,554,454,083	2,153,237,070
拆入资金净减少额		6,542,429,153	10,809,408,450
回购业务资金净减少额		-	1,126,349,734
支付给职工以及为职工支付的现金		10,030,148,533	7,305,313,571
支付的各项税费		1,144,078,530	1,425,057,921
支付其他与经营活动有关的现金		44,119,659,360	4,654,784,137
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>64,390,769,659</b>	<b>66,833,966,529</b>
<b>经营活动产生/(使用)的现金流量净额</b>	七、50(1)	<b>23,964,842,509</b>	<b>(5,531,197,500)</b>
<b>投资活动产生的现金流量</b>			
收回投资收到的现金		73,166,927,351	20,405,635,264
取得投资收益收到的现金		597,057,406	800,715,840
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额		3,762,885	5,090,063
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>73,767,747,642</b>	<b>21,211,441,167</b>
投资支付的现金		78,274,114,885	20,290,554,526
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		608,312,823	408,265,150
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>78,882,427,708</b>	<b>20,698,819,676</b>
<b>投资活动(使用)/产生的现金流量净额</b>		<b>(5,114,680,066)</b>	<b>512,621,491</b>



## 合并现金流量表(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
筹资活动产生的现金流量			
发行收益凭证收到的现金		31,834,054,086	23,247,087,747
发行永续次级债券收到的现金		3,900,000,000	3,500,000,000
发行中期票据收到的现金		3,820,620,000	9,727,050,000
发行公司债券收到的现金		2,000,000,000	31,000,000,000
发行次级债券收到的现金		2,000,000,000	7,000,000,000
发行结构性票据收到的现金		1,285,260,477	1,598,726,701
吸收投资收到的现金		190	-
其中:子公司吸收少数股东投资收到的现金		190	-
筹资活动现金流入小计		44,839,934,753	76,072,864,448
偿还收益凭证支付的现金		35,047,633,003	29,413,201,138
偿还次级债券支付的现金		6,900,000,000	-
偿还中期票据支付的现金		6,567,200,000	3,894,780,000
偿还公司债券支付的现金		3,000,000,000	4,000,000,000
偿还结构性票据支付的现金		1,763,832,134	3,831,407,461
偿还短期融资券支付的现金		1,000,000,000	-
偿还租赁负债支付的现金		367,222,498	310,442,736
分配股利或偿付利息支付的现金		3,329,727,964	2,018,816,183
其中:子公司支付给少数股东的股利、利润		63,947,434	-
支付其他与筹资活动有关的现金		53,125,544	3,783,821
筹资活动现金流出小计		58,028,741,143	43,472,431,339
筹资活动(使用)/产生的现金流量净额		(13,188,806,390)	32,600,433,109
汇率变动对现金及现金等价物的影响		361,517,075	(778,595,672)
现金及现金等价物净增加额	七、50(2)	6,022,873,128	26,803,261,428
加:期初现金及现金等价物余额		156,214,305,943	107,601,477,403
期末现金及现金等价物余额	七、50(3)	162,237,179,071	134,404,738,831

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军

法定代表人

黄劲峰

主管会计工作负责人

田汀

会计机构负责人

# 母公司现金流量表

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
<b>经营活动产生的现金流量</b>			
融出资金净减少额		550,484,811	-
为交易目的而持有的金融工具净减少额		3,346,364,353	-
代理买卖证券收到的现金净额		5,543,830,854	4,507,370,844
收取利息、手续费及佣金的现金		5,816,278,240	5,103,133,570
回购业务资金净增加额		18,180,354,262	-
收到其他与经营活动有关的现金		2,440,225,667	19,677,419,622
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>35,877,538,187</b>	<b>29,287,924,036</b>
<b>融出资金净增加额</b>			
融出资金净增加额		-	382,188,131
为交易目的而持有的金融工具净增加额		-	19,908,245,669
支付利息、手续费及佣金的现金		1,258,682,732	993,103,087
拆入资金净减少额		1,460,034,500	4,927,095,575
回购业务资金净减少额		-	3,221,261,777
支付给职工以及为职工支付的现金		6,005,200,749	4,330,662,878
支付的各项税费		292,792,450	849,686,921
支付其他与经营活动有关的现金		8,157,622,827	1,000,920,358
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>17,174,333,258</b>	<b>35,613,164,396</b>
<b>经营活动产生/(使用)的现金流量净额</b>	<b>八、7(1)</b>	<b>18,703,204,929</b>	<b>(6,325,240,360)</b>
<b>投资活动产生的现金流量</b>			
收回投资收到的现金		61,842,209,273	10,776,118,091
取得投资收益收到的现金		1,633,298,880	1,337,272,631
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额		3,307,601	35,419
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>63,478,815,754</b>	<b>12,113,426,141</b>
<b>投资支付的现金</b>			
投资支付的现金		65,693,723,000	9,452,529,800
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		336,252,388	220,632,669
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>66,029,975,388</b>	<b>9,673,162,469</b>
<b>投资活动(使用)/产生的现金流量净额</b>		<b>(2,551,159,634)</b>	<b>2,440,263,672</b>

# 母公司现金流量表(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

	附注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年 (未经审计)	2021年 (未经审计)
<b>筹资活动产生的现金流量</b>			
发行收益凭证收到的现金		11,965,106,086	9,553,844,747
发行永续次级债券收到的现金		3,900,000,000	3,500,000,000
发行公司债券收到的现金		-	21,000,000,000
发行次级债券收到的现金		-	2,000,000,000
<b>筹资活动现金流入小计</b>		<b>15,865,106,086</b>	<b>36,053,844,747</b>
<b>偿还债务支付的现金流量</b>			
偿还收益凭证支付的现金		14,066,902,003	15,010,156,138
偿还次级债券支付的现金		2,100,000,000	-
偿还短期融资券支付的现金		1,000,000,000	-
偿还公司债券支付的现金		1,000,000,000	3,000,000,000
偿还租赁负债支付的现金		176,969,221	170,108,673
分配股利或偿付利息支付的现金		1,782,268,010	993,451,973
支付其他与筹资活动有关的现金		52,269,390	3,658,697
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>20,178,408,624</b>	<b>19,177,375,481</b>
<b>筹资活动(使用)/产生的现金流量净额</b>		<b>(4,313,302,538)</b>	<b>16,876,469,266</b>
汇率变动对现金及现金等价物的影响		111,951,674	(6,445,175)
现金及现金等价物净增加额	八、7(2)	11,950,694,431	12,985,047,403
加:期初现金及现金等价物余额		48,059,468,628	38,662,044,995
<b>期末现金及现金等价物余额</b>	八、7(3)	<b>60,010,163,059</b>	<b>51,647,092,398</b>

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军

法定代表人

黄劲峰

主管会计工作负责人

田汀

会计机构负责人



# 合并股东权益变动表

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	归属于母公司股东的权益							小计	少数股东权益	股东权益合计
	股本 (附注七、32)	其他权益工具 (附注七、33)	资本公积 (附注七、34)	其他综合收益 (附注七、35)	盈余公积 (附注七、36)	一般风险准备 (附注七、37)	未分配利润			
2022年1月1日余额(经审计)	4,827,256,868	8,500,000,000	39,531,886,525	(828,441,057)	1,392,448,797	5,470,061,175	25,528,908,966	84,422,121,274	308,715,153	84,730,836,427
本期增减变动金额										
1.综合收益总额	-	-	-	584,040,417	-	-	3,841,640,437	4,425,680,854	7,893,974	4,433,574,828
2.股本变动										
- 少数股东投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-	190	190
3.其他权益工具变动										
- 发行永续次级债券	-	3,900,000,000	-	-	-	-	-	3,900,000,000	-	3,900,000,000
4.利润分配										
- 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	150,714,848	(150,714,848)	-	-	-
- 向股东分配股利	-	-	-	-	-	-	(1,448,177,060)	(1,448,177,060)	-	(1,448,177,060)
- 向永续次级债券 持有人分配	-	-	-	-	-	-	(526,600,000)	(526,600,000)	-	(526,600,000)
上述1至4项小计	-	3,900,000,000	-	584,040,417	-	150,714,848	1,716,148,529	6,350,903,794	7,894,164	6,358,797,958
2022年6月30日余额(未经审计)	4,827,256,868	12,400,000,000	39,531,886,525	(244,400,640)	1,392,448,797	5,620,776,023	27,245,057,495	90,773,025,068	316,609,317	91,089,634,385

## 合并股东权益变动表(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

	股本	其他权益工具	资本公积	其他综合收益	归属于母公司股东的权益			小计	少数股东权益	股东权益合计
					盈余公积	一般风险准备	未分配利润			
2021年1月1日余额(经审计)	4,827,256,868	5,000,000,000	39,533,272,979	(594,402,852)	995,576,479	4,074,311,372	17,798,924,176	71,634,939,022	180,193,972	71,815,132,994
本期增减变动金额										
1.综合收益总额	-	-	-	(89,090,081)	-	-	5,007,028,294	4,917,938,213	8,899,282	4,926,837,495
2.其他权益工具变动										
-发行永续次级债券	-	3,500,000,000	-	-	-	-	-	3,500,000,000	-	3,500,000,000
3.利润分配										
-提取一般风险准备	-	-	-	-	-	70,296,059	(70,296,059)	-	-	-
-向股东分配股利	-	-	-	-	-	-	(868,906,236)	(868,906,236)	-	(868,906,236)
-向永续次级债券持有人分配	-	-	-	-	-	-	(386,200,000)	(386,200,000)	-	(386,200,000)
上述1至3项小计	-	3,500,000,000	-	(89,090,081)	-	70,296,059	3,681,625,999	7,162,831,977	8,899,282	7,171,731,259
2021年6月30日余额(未经审计)	4,827,256,868	8,500,000,000	39,533,272,979	(683,492,933)	995,576,479	4,144,607,431	21,480,550,175	78,797,770,999	189,093,254	78,986,864,253

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军

法定代表人

黄劲峰

主管会计工作负责人

田汀

会计机构负责人

# 母公司股东权益变动表

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	股本 (附注七、32)	其他权益工具 (附注七、33)	资本公积	其他综合收益	盈余公积 (附注七、36)	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
2022年1月1日余额(经审计)	4,827,256,868	8,500,000,000	41,698,292,045	106,826,215	1,392,448,797	3,919,804,534	6,211,977,761	66,656,606,220
本期增减变动金额								
1. 综合收益总额	-	-	-	(26,210,250)	-	-	3,181,089,443	3,154,879,193
2. 其他权益工具变动								
- 发行永续次级债券	-	3,900,000,000	-	-	-	-	-	3,900,000,000
3. 利润分配								
- 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	3,151,743	(3,151,743)	-
- 向股东分配股利	-	-	-	-	-	-	(1,448,177,060)	(1,448,177,060)
- 向永续次级债券持有人分配	-	-	-	-	-	-	(526,600,000)	(526,600,000)
上述1至3项小计	-	3,900,000,000	-	(26,210,250)	-	3,151,743	1,203,160,640	5,080,102,133
2022年6月30日余额(未经审计)	4,827,256,868	12,400,000,000	41,698,292,045	80,615,965	1,392,448,797	3,922,956,277	7,415,138,401	71,736,708,353



# 母公司股东权益变动表(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

	股本	其他权益工具	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
2021年1月1日余额(经审计)	4,827,256,868	5,000,000,000	41,699,678,499	(17,519,696)	995,576,479	3,118,978,079	4,696,059,588	60,320,029,817
本期增减变动金额								
1. 综合收益总额	-	-	-	56,308,204	-	-	2,152,226,937	2,208,535,141
2. 其他权益工具变动								
- 发行永续次级债券	-	3,500,000,000	-	-	-	-	-	3,500,000,000
3. 利润分配								
- 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	3,523,244	(3,523,244)	-
- 向股东分配股利	-	-	-	-	-	-	(868,906,236)	(868,906,236)
- 向永续次级债券持有人分配	-	-	-	-	-	-	(386,200,000)	(386,200,000)
上述1至3项小计	-	3,500,000,000	-	56,308,204	-	3,523,244	893,597,457	4,453,428,905
2021年6月30日余额(未经审计)	4,827,256,868	8,500,000,000	41,699,678,499	38,788,508	995,576,479	3,122,501,323	5,589,657,045	64,773,458,722

中期财务报表附注为本中期财务报表的组成部分。

沈如军	黄劲峰	田汀
法定代表人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

# 中期财务报表附注

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间（除特别注明外，金额单位：人民币元）

## 一、基本情况

中国国际金融股份有限公司（即原中国国际金融有限公司，以下简称“本公司”）于1995年6月25日获得中国人民银行的设立批准，并于1995年7月31日领取了中华人民共和国国家工商行政管理局颁发的企合国字第000599号中华人民共和国企业法人营业执照。

本公司于2015年6月1日改制为股份有限公司，于2015年11月9日在香港联合交易所有限公司主板挂牌上市（股票代码为：3908），于2020年11月2日在上海证券交易所主板挂牌上市（股票代码为：601995）。

本公司统一社会信用代码为91110000625909986U，注册地址为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27、28层。于2022年6月30日，本公司共设有4家证券营业部和11家分公司。本公司下设子公司的情况参见附注五、1。

本公司及子公司（以下合称“本集团”）主要经营范围为：从事投资银行业务、股票业务、固定收益业务、资产管理业务、私募股权业务、财富管理业务及其他业务活动。

## 二、中期财务报表编制基础

本中期财务报表按照中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则及相关规定的要求编制。

本中期财务报表根据财政部颁布的《企业会计准则第32号—中期财务报告》、中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）颁布的《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第3号—半年度报告的内容与格式》（2021年修订）及《证券公司财务报表附注编制的特别规定（2018）》（会计部函[2018]590号）的要求进行列报和披露，并不包括在年度财务报表中列示的所有信息和披露内容。本中期财务报表应与本集团2021年度财务报表一并阅读。

本集团对自2022年6月30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，本中期财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 三、会计政策变更

财政部于2022年5月27日颁布了《关于适用<新冠肺炎疫情相关租金减让会计处理规定>相关问题的通知》(财会[2022]13号),自发布之日起施行。财会[2022]13号对本集团的财务状况和经营成果未产生重大影响。

财政部于2021年12月31日颁布了《关于印发<企业会计准则解释第15号>的通知》(财会[2021]35号),其中“关于资金集中管理相关列报”内容自发布之日起施行,“关于企业将固定资产达到预定可使用状态前或者研发过程中产出的产品或副产品对外销售的会计处理”、“关于亏损合同的判断”内容自2022年1月1日起施行。财会[2021]35号对本集团的财务状况和经营成果未产生重大影响。

除上述会计政策外,本中期财务报表中本集团采用的重要会计政策与编制2021年度财务报表时采用的重要会计政策一致。

## 四、遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本公司于2022年6月30日的合并及母公司财务状况,以及自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间的合并及母公司经营成果和合并及母公司现金流量。

## 五、企业合并及合并财务报表

本集团合并财务报表的合并范围以控制为基础确定,包括本公司及本公司控制的子公司(包括结构化主体)。控制,是指本集团拥有对被投资方的权力,通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报,并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本集团是否拥有对被投资方的权力时,本集团仅考虑与被投资方相关的实质性权利(包括本集团自身所享有的及其他方所享有的实质性权利)。



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司:

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日

以下为直接持股的子公司:

中国国际金融(国际)有限公司 ("中金国际")(原中国国际金融 (香港)有限公司)		香港	海外投资控股业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-
中金资本运营有限公司 ("中金资本")		北京	私募股权投资业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-
中金浦成投资有限公司 ("中金浦成")		上海	金融产品、股权等 另类投资业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-
中金基金管理有限公司 ("中金基金")		北京	基金管理业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-
中金私募股权投资管理有限公司 ("中金私募")		上海	私募股权投资业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司:											
中金智德股权投资管理有限公司	注2	上海	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
中金祺智(上海)股权投资管理有限公司		上海	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金祺德(上海)股权投资管理有限公司		上海	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金启元国家新兴产业私募创业投资基金管理有限公司		武汉	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金瑞德(上海)股权投资管理有限公司		上海	私募股权投资业务	-	-	70%	70%	-	-	70%	70%
中金正祥(上海)股权投资管理中心(有限合伙)		上海	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中国国际金融香港证券有限公司		香港	综合持牌业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Financial Products Ltd.		英属维京群岛	金融产品投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司: (续)											
中国国际金融香港资产管理 有限公司		香港	资产管理业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
China International Capital Corporation (Singapore) Pte. Limited		新加坡	投资银行及证券经纪业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
China International Capital Corporation (UK) Limited		英国	投资银行及证券经纪业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
China International Capital Corporation (USA) Holdings Inc.		美国	投资控股业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC US Securities, Inc.		美国	投资银行及证券经纪业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC US Securities (Hong Kong) Limited		香港	证券经纪业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Investment Management (USA), Inc.		美国	资产管理业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中国国际金融香港期货有限公司		香港	期货经纪业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司:(续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司:(续)											
CICC Private Wealth Management Holdings Ltd.		英属开曼群岛	投资控股业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Investors KKR NA XI GP, Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Customer Trading Limited		香港	证券交易业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Financial Trading Limited		香港	证券交易业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Sun Company Limited		英属维京群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Perpetual Treasure Investment Management Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Alternative Investment Management Ltd.	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Profit Insight Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
天津佳成投资管理有限公司	注2	天津	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司: (续)											
CICC Investment Management Co. Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Investment Advisory Company Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Growth Capital Fund GP, Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Growth Capital Fund GP, L.P.	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Fintech Investment Co. Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金佳盟(天津)股权投资基金管理有限公司		天津	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PFG Holding Ltd		英属开曼群岛	投资控股业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Alternative Investments Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PFG Cayman Ltd		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PFG HK Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

## 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

## (1) 通过自行设立方式取得的子公司:(续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司:(续)											
CICC PFG LP		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
深圳中金恒辰投资管理有限公司		深圳	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Evergreen Fund GP, Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Investment (Hong Kong) Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Healthtech Two Investment Co. Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Wealth Investment Limited		香港	证券交易业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
绿汇(上海)股权投资管理有限公司	注2	上海	私募股权投资业务	-	-	-	70%	-	-	-	70%
中金浦泰投资管理有限公司	注2	上海	资产管理业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
置展(上海)创业投资中心(有限合伙)		上海	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Limited		英属维京群岛	债券发行	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
祺瀚(上海)投资管理有限公司		上海	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司: (续)											
CICC Hong Kong Finance (Cayman) Limited		英属开曼群岛	融资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Wealth Investment Management Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PWHK Advisor Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Ehealthcare Investment GP, Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金祺瓴(上海)股权投资中心(有限合伙)		上海	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Capital (Cayman) Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Silicon Valley Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金启誉(苏州)股权投资基金管理有限公司		常熟	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Ehealthcare Investment Limited	注2	英属维京群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Prosper Sun Limited	注2	英属开曼群岛	融资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司:(续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司:(续)											
FICC YMT Limited		英属维京群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PFM HK Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Credit GP Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Alternative Investment Cayman Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Alternative Investment GP Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Alternative Investment LP	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
宁波日星投资管理有限公司		宁波	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金康智(宁波)股权投资管理有限公司		宁波	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Real Estate GP Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Zhide One Investment Co. Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司: (续)											
CICC Zhide GP Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Zhide EV GP Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Private Funds Management Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Capital Investment Advisory Company Limited (原CICC Capital Real Estate Fund Management Co. Ltd)		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PFM Cayman Ltd		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC PFM LP		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
宁波梅山保税港区中金瀚德股权投资管理有限公司	注2	宁波	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司: (续)											
宁波梅山保税港区中金慧芯股权投资管理有限公司	注2	宁波	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
China World Investment Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Biopharma GP Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Global Industrial Fund Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Sail-Regal Co. Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Equity GP Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Artificial Intelligence Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Global Industry and Infrastructure Fund Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Industrial Fund A Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Industrial Fund B Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Rock Technology Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Hero Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司: (续)											
Sail-Sunshine Co. Ltd.	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Sailing Co. Ltd.	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Capital Real Estate Holdings Co. Ltd.	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Synergy Investment Co. Ltd	注3	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Healthcare Investment Management Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Capital Healthcare Investment Management Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Private Equity II GP Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Transpacific Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Transpacific Investment Management Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Capital Transpacific Investment Management Limited	注2	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司:(续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司:(续)											
Demeter Partners Ltd		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中国国际金融日本株式会社		日本	证券媒介业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Auto Hub Investment Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Autotiger Investment Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Bluesail Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Jin Rui Investment Co. Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Adlai Nortye Investment Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
MP CRM Investment Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

#### (1) 通过自行设立方式取得的子公司:(续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为间接持股的子公司:(续)											
Swan Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
LWSPV		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Ascent Capital Management Co., Ltd.	注1	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	不适用	70%	不适用	-	不适用	70%	不适用
HRWJTZ SPV	注1	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	不适用	100%	不适用	-	不适用	100%	不适用
CICC-QILU BIOTECH COMPANY	注1	英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	不适用	100%	不适用	-	不适用	100%	不适用

注1: 这些子公司为自2022年开始纳入合并财务报表范围的子公司。

注2: 这些子公司已于2022年办理注销。

注3: 本集团对该子公司的间接持股比例为持有其管理股份比例。

注4: 子公司Zhide Two Investment Co., Limited(原CICC Zhide Two Investment Co., Limited)已于2022年处置,不再纳入合并范围。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

#### (2) 非同一控制下企业合并取得的子公司:

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日

以下为直接持股的子公司:

中金期货有限公司(“中金期货”)		西宁	期货经纪及资产管理业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-
中国中金财富证券有限公司(“中金财富”)		深圳	财富管理及证券经纪业务	100%	100%	-	-	100%	100%	-	-

以下为间接持股的子公司:

中金瑞石投资管理有限责任公司 (原中投瑞石投资管理 有限责任公司)		深圳	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中投证券投资有限公司		北京	金融产品、股权等 另类投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
中金财富期货有限公司 (原中投天琪期货有限公司)		深圳	期货经纪业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表 (续)

### 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下: (续)

#### (2) 非同一控制下企业合并取得的子公司: (续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为直接持股的子公司: (续)											
深圳前海中投天琪资本管理 有限公司		深圳	期货风险管理试点业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
Ciccjazi Holdings Limited	注1	英属维京群岛	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
CICC Securities (HK) Limited	注1	香港	私募股权投资业务	-	-	-	100%	-	-	-	100%
Oceanfront Investments V Limited		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Financial Holdings Limited		英属维京群岛	投资控股业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
CICC Commodity Trading Limited		英属维京群岛	商品交易业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
China International Capital Corporation (Europe) GmbH (原CICC Deutschland GmbH)		德国	投资银行业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

## 1、纳入本公司合并财务报表范围的子公司如下:(续)

## (2) 非同一控制下企业合并取得的子公司:(续)

被投资单位名称	注	注册地	业务性质	本公司持股比例				本公司表决权比例			
				直接		间接		直接		间接	
				2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日	2022年 6月30日	2021年 12月31日
以下为直接持股的子公司:(续)											
中金前海(深圳)私募股权基金管 理有限公司		深圳	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
中金前海(深圳)股权投资基金管 理有限公司		深圳	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
深圳前海金桥高成长壹号基金中心 (有限合伙)		深圳	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
深圳市中金前海睿麟基金管理中心 (有限合伙)		深圳	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
Qian Hai Golden Bridge Co., Limited		香港	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
Qian Hai Golden Bridge Management Ltd.		英属开曼群岛	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
Qianhai Golden Bridge Beta Co., Limited		英属维京群岛	私募股权投资业务	-	-	55%	55%	-	-	55%	55%
Novo Developments Société à responsabilité limitée		卢森堡	私募股权投资业务	-	-	100%	100%	-	-	100%	100%
北京科技创新投资管理有限公司 (“北京科创”)		北京	私募股权投资业务	-	-	51%	51%	-	-	51%	51%

注1: 这些子公司已于2022年办理注销。



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 五、企业合并及合并财务报表(续)

### 2、纳入本公司合并财务报表范围的结构化主体

本集团纳入合并范围的结构化主体信息披露于附注十四、1。

### 3、合并范围发生变动的说明

#### 3.1 新设子公司

截至2022年6月30日止6个月期间,本公司的全资子公司设立若干下属子公司,披露于附注五、1。本公司管理层认为本公司对这些新设立的子公司具有实际控制,故采用长期股权投资成本法进行核算,并将其纳入合并范围。于2022年6月30日,合并该等新设子公司的财务报表对本集团的财务状况及经营成果无重大影响。

#### 3.2 减少子公司

截至2022年6月30日止6个月期间,本公司全资子公司的若干下属子公司清算注销或处置,披露于附注五、1。

#### 3.3 合并结构化主体

本集团考虑对结构化主体是否存在控制时,基于本集团的决策范围、结构化主体其他方的权力和面临的可变动收益风险敞口等因素来判断本集团是主要责任人还是代理人。本集团将本集团作为主要责任人身份行使投资决策权且所享有的可变回报在结构化主体总回报中占比较大的结构化主体纳入合并范围。由于以上考虑因素变动,导致每个会计期间纳入合并范围的结构化主体发生变动。于2022年6月30日,共有184个结构化主体纳入本集团财务报表的合并范围(2021年12月31日:168个)。本集团在纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益信息参见附注十四、1。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 六、税项

### 1、 增值税及附加

本公司及中国境内子公司本期间主要适用的与提供服务相关的税金为增值税, 主要按应税收入的6%计算销项税额, 在扣除当期允许抵扣的进项税额后, 差额部分为应交增值税。本公司及中国境内子公司主要按已缴纳增值税的7%、3%及2%分别缴纳城市维护建设税、教育费附加及地方教育附加。

本公司及中国境内子公司作为资产管理产品管理人运营资产管理产品过程中发生增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

### 2、 所得税

本公司及中国境内子公司适用《中华人民共和国企业所得税法》、《中华人民共和国企业所得税法实施条例》和《国家税务总局关于印发<跨地区经营汇总纳税企业所得税征收管理办法>的公告》(国家税务总局公告[2012]57号), 本期间法定税率为25% (截至2021年6月30日止6个月期间: 25%)。

本公司在中国香港的子公司本期间适用的利得税税率为16.5% (截至2021年6月30日止6个月期间: 16.5%)。其他境外的子公司按当地规定缴纳所得税。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释

### 1、货币资金

#### (1) 按类别列示:

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
库存现金	137,826	146,897
银行存款	142,615,684,177	134,923,545,452
其中: 客户存款	80,584,681,356	75,326,077,957
公司存款	62,031,002,821	59,597,467,495
其他货币资金	129,270,768	57,536,917
小计	142,745,092,771	134,981,229,266
加: 计提利息	172,819,329	125,108,799
减: 减值准备	(274,788)	(279,829)
合计	142,917,637,312	135,106,058,236

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 1、货币资金(续)

## (2) 按币种列示:

	原币金额	2022年6月30日 折算汇率	折人民币金额
库存现金:			
人民币	21,566	1.00000	21,566
美元	13,850	6.71140	92,953
港币	7,134	0.85519	6,101
其他(注)			17,206
小计			137,826
客户资金存款:			
人民币	61,255,690,705	1.00000	61,255,690,705
美元	899,023,640	6.71140	6,033,707,257
港币	6,514,846,629	0.85519	5,571,431,689
其他(注)			44,747,311
小计			72,905,576,962
客户信用资金存款:			
人民币	7,679,104,394	1.00000	7,679,104,394
小计			7,679,104,394
客户存款合计			80,584,681,356
公司自有资金存款:			
人民币	50,099,136,607	1.00000	50,099,136,607
美元	1,226,156,745	6.71140	8,229,228,378
港币	3,034,618,340	0.85519	2,595,175,258
其他(注)			513,962,151
小计			61,437,502,394
公司信用资金存款:			
人民币	593,500,427	1.00000	593,500,427
小计			593,500,427
公司存款合计			62,031,002,821
银行存款合计			142,615,684,177
其他货币资金:			
人民币	129,270,768	1.00000	129,270,768
小计			129,270,768
加: 计提利息			172,819,329
减: 减值准备			(274,788)
合计			142,917,637,312



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 1、货币资金 (续)

#### (2) 按币种列示: (续)

	原币金额	2021年12月31日 折算汇率	折人民币金额
库存现金:			
人民币	32,616	1.00000	32,616
美元	13,850	6.37570	88,303
港币	10,554	0.81760	8,629
其他(注)			17,349
小计			146,897
客户资金存款:			
人民币	57,466,230,943	1.00000	57,466,230,943
美元	817,359,641	6.37570	5,211,239,863
港币	8,624,137,441	0.81760	7,051,094,772
其他(注)			90,813,581
小计			69,819,379,159
客户信用资金存款:			
人民币	5,506,698,798	1.00000	5,506,698,798
小计			5,506,698,798
客户存款合计			75,326,077,957
公司自有资金存款:			
人民币	37,654,815,523	1.00000	37,654,815,523
美元	2,588,548,178	6.37570	16,503,806,618
港币	3,518,176,745	0.81760	2,876,461,307
其他(注)			2,040,108,500
小计			59,075,191,948
公司信用资金存款:			
人民币	522,275,547	1.00000	522,275,547
小计			522,275,547
公司存款合计			59,597,467,495
银行存款合计			134,923,545,452
其他货币资金:			
人民币	57,536,917	1.00000	57,536,917
小计			57,536,917
加: 计提利息			125,108,799
减: 减值准备			(279,829)
合计			135,106,058,236

注: 其他外币主要为英镑、欧元、新加坡元、日元、澳元、加拿大元、瑞士法郎等。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 1、货币资金(续)

#### (2) 按币种列示:(续)

于2022年6月30日,本集团自有资金存款中使用受限制的银行存款为人民币1,022,869,580元(2021年12月31日:人民币835,105,292元)。使用受限制的银行存款主要包括本集团为资产管理业务持有的风险准备金存款和代非经纪业务客户持有的临时性存款。

于2022年6月30日,本集团存放在境外的货币资金折合人民币24,092,032,960元(2021年12月31日:折合人民币33,978,729,681元),主要是本公司及子公司在境外的银行存款。

### 2、结算备付金

#### (1) 按类别列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
客户备付金	13,864,855,962	15,695,281,262
公司备付金	6,650,099,918	6,372,900,707
小计	20,514,955,880	22,068,181,969
加:计提利息	4,983,859	6,244,997
合计	20,519,939,739	22,074,426,966

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 2、 结算备付金 (续)

#### (2) 按币种列示:

	2022年6月30日		折人民币金额
	原币金额	折算汇率	
客户普通备付金:			
人民币	12,563,886,130	1.00000	12,563,886,130
美元	19,464,013	6.71140	130,630,777
港币	554,956,804	0.85519	474,593,509
小计			13,169,110,416
客户信用备付金:			
人民币	695,745,546	1.00000	695,745,546
小计			695,745,546
客户备付金合计			13,864,855,962
公司普通备付金:			
人民币	6,158,944,421	1.00000	6,158,944,421
美元	7,638,318	6.71140	51,263,807
港币	171,473,765	0.85519	146,642,649
小计			6,356,850,877
公司信用备付金:			
人民币	293,249,041	1.00000	293,249,041
小计			293,249,041
公司备付金合计			6,650,099,918
加: 计提利息			4,983,859
合计			20,519,939,739

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 2、 结算备付金(续)

#### (2) 按币种列示:(续)

	2021年12月31日		折人民币金额
	原币金额	折算汇率	
客户普通备付金:			
人民币	14,104,197,463	1.00000	14,104,197,463
美元	23,012,022	6.37570	146,717,749
港币	266,084,750	0.81760	217,550,892
小计			14,468,466,104
客户信用备付金:			
人民币	1,226,815,158	1.00000	1,226,815,158
小计			1,226,815,158
客户备付金合计			15,695,281,262
公司普通备付金:			
人民币	6,049,115,592	1.00000	6,049,115,592
美元	7,567,120	6.37570	48,245,687
港币	150,131,541	0.81760	122,747,548
小计			6,220,108,827
公司信用备付金:			
人民币	152,791,880	1.00000	152,791,880
小计			152,791,880
公司备付金合计			6,372,900,707
加: 计提利息			6,244,997
合计			22,074,426,966



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 3、融资融券业务

#### (1) 融出资金

按交易对手分析:

	2022年6月30日	2021年12月31日
境内		
— 个人	27,971,286,960	32,149,370,756
— 机构	4,387,247,995	4,384,565,389
小计	32,358,534,955	36,533,936,145
境外		
— 个人	707,813,668	1,051,146,241
— 机构	1,038,847,541	1,054,551,284
小计	1,746,661,209	2,105,697,525
加: 计提利息	1,189,153,194	1,001,389,159
减: 减值准备	(146,597,054)	(161,966,115)
合计	35,147,752,304	39,479,056,714



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 3、融资融券业务(续)

#### (2) 融出证券

	2022年6月30日	2021年12月31日
以自有证券作为融出证券的交易性金融资产	1,823,921,229	2,753,557,470
以转融通融入证券作为融出证券	6,680,374,881	8,508,509,784
合计	8,504,296,110	11,262,067,254

于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团融券业务无违约情况。

#### (3) 融资融券业务收到的担保物信息

	担保物公允价值	
	2022年6月30日	2021年12月31日
股票	103,002,144,149	124,939,879,833
基金	9,099,587,669	11,192,319,708
资金	6,453,932,089	7,441,888,372
债券	331,972,724	247,429,455
合计	118,887,636,631	143,821,517,368

于2022年6月30日,本集团融出资金业务强制平仓后客户尚未归还款项金额为人民币23,264,048元(2021年12月31日:人民币21,197,120元)。





# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 4、衍生金融工具(续)

衍生金融工具的名义本金仅指在资产负债表日尚未完成的交易量,并不代表本集团所承担的风险数额。

在当日无负债结算制度下,本集团于中国大陆交易的期货合约的持仓损益已于当日结算。于2022年6月30日,本集团持有的未到期商品期货合约形成的衍生金融资产为人民币27,131,364元(2021年12月31日:未到期商品期货合约和国债期货合约形成的衍生金融资产为人民币183,326,996元);持有的未到期国债期货合约和股指期货合约形成的衍生金融负债为人民币109,842,396元(2021年12月31日:未到期股指期货合约形成的衍生金融负债为人民币110,966,130元)。

#### (1) 套期工具

##### (a) 公允价值套期

本集团利用公允价值套期来规避由于市场利率波动导致金融负债公允价值变化所带来的影响,对部分已发行的公司债券及次级债券的利率风险以利率互换合约作为套期工具。

公允价值套期产生的损益如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
净收益:		
— 利率衍生工具	(1,141,874)	2,294,668
— 被套期风险对应的被套期项目	12,336,707	19,866,324
合计	11,194,833	22,160,992

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 4、衍生金融工具(续)

#### (1) 套期工具(续)

##### (a) 公允价值套期(续)

本集团指定为公允价值套期的套期工具名义金额按剩余到期日分析如下:

	2022年6月30日			合计
	6个月以内 (含6个月)	6至12个月 (含12个月)	12个月以上	
利率衍生工具	2,920,000,000	920,000,000	1,000,000,000	4,840,000,000

	2021年12月31日			合计
	6个月以内 (含6个月)	6至12个月 (含12个月)	12个月以上	
利率衍生工具	1,550,000,000	2,920,000,000	1,920,000,000	6,390,000,000

本集团在公允价值套期策略中被套期风险敞口的具体信息列示如下:

应付债券	2022年6月30日	2021年12月31日
被套期项目账面价值	4,986,879,839	6,559,631,222
被套期项目公允价值调整的累计金额	82,418,771	122,669,430

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 4、衍生金融工具 (续)

#### (1) 套期工具 (续)

##### (b) 境外经营净投资套期

由于本公司记账本位币与子公司记账本位币不同, 本集团的合并资产负债表受到外汇汇率变动产生的折算差额的影响。本集团在有限的情况下对此类外汇敞口进行套期保值。本集团利用外汇远期合约对部分境外经营进行净投资套期。在套期关系中, 本集团将远期合约的远期要素和即期要素分开, 只将即期要素的价值变动指定为套期工具。截至2022年6月30日止6个月期间无套期无效部分(截至2021年6月30日止6个月期间: 不适用)。

截至2022年6月30日止6个月期间, 套期工具产生的净收益共计人民币4,198,631元(截至2021年6月30日止6个月期间: 不适用), 计入其他综合收益; 截至2022年6月30日止6个月期间, 远期合约远期要素相关的净收益共计人民币189,396元(截至2021年6月30日止6个月期间: 不适用), 计入当期损益。

截至2022年6月30日, 本集团指定为境外经营净投资套期的套期工具名义金额为人民币168,177,509元(2021年12月31日: 人民币565,774,000元), 剩余到期日在1年以内。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 5、存出保证金

#### (1) 按类别列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
交易保证金	11,555,979,000	12,189,337,311
履约保证金	433,037,702	348,088,248
信用保证金	74,116,607	93,851,130
小计	12,063,133,309	12,631,276,689
加: 计提利息	467,749	636,075
合计	12,063,601,058	12,631,912,764

#### (2) 按币种列示:

	2022年6月30日		
	原币金额	折算汇率	折人民币金额
交易保证金:			
人民币	10,908,148,679	1.00000	10,908,148,679
美元	5,176,083	6.71140	34,738,763
港币	712,908,203	0.85519	609,671,966
其他(注)			3,419,592
小计			11,555,979,000
履约保证金:			
人民币	433,037,702	1.00000	433,037,702
小计			433,037,702
信用保证金:			
人民币	74,116,607	1.00000	74,116,607
小计			74,116,607
加: 计提利息			467,749
合计			12,063,601,058



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 5、存出保证金 (续)

#### (2) 按币种列示: (续)

	2021年12月31日		折人民币金额
	原币金额	折算汇率	
交易保证金:			
人民币	11,558,686,855	1.00000	11,558,686,855
美元	3,352,747	6.37570	21,376,109
港币	741,503,394	0.81760	606,253,175
其他(注)			3,021,172
小计			12,189,337,311
履约保证金:			
人民币	348,088,248	1.00000	348,088,248
小计			348,088,248
信用保证金:			
人民币	93,851,130	1.00000	93,851,130
小计			93,851,130
加: 计提利息			636,075
合计			12,631,912,764

注: 其他外币主要为新加坡元等。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 6、应收款项

#### (1) 按性质分析:

	2022年6月30日	2021年12月31日
应收交易款项	53,011,601,110	43,111,765,949
其中: 应收经纪商及结算所	35,900,153,177	15,703,026,871
应收衍生品交易款	13,280,250,131	25,359,108,397
应收证券借贷保证金	3,784,726,492	1,997,173,863
应收资产及基金管理费	1,604,431,992	1,448,802,510
应收承销及咨询费	1,285,728,440	1,178,055,128
应收席位租金	280,921,606	262,339,248
其他	244,901,180	319,639,028
小计	56,427,584,328	46,320,601,863
减: 减值准备	(453,577,214)	(577,721,275)
账面价值	55,974,007,114	45,742,880,588

#### (2) 按账龄分析:

账龄	2022年6月30日				2021年12月31日			
	账面余额		减值准备		账面余额		减值准备	
	金额	比例	金额	比例	金额	比例	金额	比例
1年以内(含1年)	55,512,035,402	98.38%	(71,888,516)	15.85%	45,024,675,488	97.21%	(218,683,813)	37.86%
1-2年(含2年)	387,387,222	0.69%	(53,516,115)	11.80%	770,316,421	1.66%	(63,912,118)	11.06%
2-3年(含3年)	171,790,810	0.30%	(94,615,437)	20.86%	227,291,657	0.49%	(105,037,551)	18.18%
3年以上	356,370,894	0.63%	(233,557,146)	51.49%	298,318,297	0.64%	(190,087,793)	32.90%
合计	56,427,584,328	100.00%	(453,577,214)	100.00%	46,320,601,863	100.00%	(577,721,275)	100.00%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 7、 买入返售金融资产

#### (1) 按金融资产种类列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
股票	6,800,390,199	8,183,892,199
债券	31,578,475,724	17,543,357,356
其中: 标准券	18,992,868,253	11,270,516,914
金融债	5,623,479,474	2,215,462,035
企业债	523,818,318	649,884,442
中期票据	58,000,000	304,040,000
同业存单	4,857,688,000	2,302,328,000
国债和地方债	1,522,621,679	801,125,965
小计	38,378,865,923	25,727,249,555
加: 计提利息	193,171,749	200,697,853
减: 减值准备	(62,284,807)	(69,453,349)
账面价值	38,509,752,865	25,858,494,059

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 7、买入返售金融资产(续)

#### (2) 按业务类别列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
股票质押式回购	6,511,439,314	7,869,409,359
债券质押式回购	30,378,863,653	16,853,472,913
债券买断式回购	1,199,612,071	689,884,443
其他	288,950,885	314,482,840
小计	38,378,865,923	25,727,249,555
加: 计提利息	193,171,749	200,697,853
减: 减值准备	(62,284,807)	(69,453,349)
账面价值	38,509,752,865	25,858,494,059

#### (3) 按担保物的公允价值列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
担保物	58,555,099,885	48,706,057,222
其中: 可出售或可再次向外抵押的担保物	1,174,049,485	685,372,663
其中: 已再次向外抵押的担保物	847,040,339	589,729,851



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 7、买入返售金融资产(续)

#### (4) 股票质押式回购、约定购回式证券交易按剩余期限分析:

	2022年6月30日	2021年12月31日
1个月内(含1个月)	1,505,910,876	1,071,523,626
1-3个月(含3个月)	576,060,000	1,067,800,000
3个月-1年(含1年)	4,429,468,438	5,680,085,733
1年以上	-	50,000,000
小计	6,511,439,314	7,869,409,359
加:计提利息	161,366,230	180,806,098
减:减值准备	(62,228,077)	(69,354,557)
账面价值	6,610,577,467	7,980,860,900

### 8、交易性金融资产

#### (1) 按类别列示:

	2022年6月30日		2021年12月31日	
	分类为以公允价值 计量且其变动 计入当期损益的 金融资产的 公允价值	分类为以公允价值 计量且其变动 计入当期损益 的金融资产的 初始投资成本	分类为以公允价值 计量且其变动 计入当期损益的 金融资产的 公允价值	分类为以公允价值 计量且其变动 计入当期损益 的金融资产的 初始投资成本
债券	98,405,739,637	98,903,840,366	82,090,098,250	82,394,749,799
基金	80,553,221,582	77,524,668,309	83,775,430,234	80,010,077,360
股票/股权	111,521,508,624	108,271,039,791	127,749,329,593	124,208,254,114
其他	6,205,992,382	6,505,071,528	7,559,357,027	7,868,999,765
合计	296,686,462,225	291,204,619,994	301,174,215,104	294,482,081,038

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 8、交易性金融资产(续)

(2) 于资产负债表日,存在限售期限或有承诺条件的交易性金融资产的账面价值按投资品种列示如下:

种类	限制条件	2022年6月30日	2021年12月31日
债券	质押	38,808,411,785	16,021,755,499
股票	质押	4,836,635,351	3,246,631,339
基金	质押	988,625,355	1,086,418,729
股票	存在限售期限	4,343,435,254	6,279,417,920
基金	存在限售期限	66,167,000	662,589,549
基金	以管理人身份认购的基金份额 承诺不退出	52,559,451	54,975,000
其他	以管理人身份认购的资产管理 计划份额在存续期内承诺不退出	9,361,000	9,683,000
合计		49,105,195,196	27,361,471,036

本集团持有的交易性金融资产用于融出证券的金额披露于附注七、3(2)。

### 9、其他债权投资

(1) 按类别列示:

	2022年6月30日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
国债	16,084,298,000	373,735,175	46,951,761	16,504,984,936	-
地方债	3,094,000,000	58,767,391	34,269,055	3,187,036,446	(1,226,680)
企业债	11,162,377,737	284,775,222	(201,447,064)	11,245,705,895	(75,810,161)
同业存单	3,063,354,900	39,312,089	5,178,601	3,107,845,590	(905,275)
中期票据	3,530,000,000	69,538,715	21,305,814	3,620,844,529	(7,149,289)
金融债	10,053,740,637	206,050,984	(74,025,618)	10,185,766,003	(4,102,830)
其他	100,000,000	2,125,395	1,439,265	103,564,660	(184,324)
合计	47,087,771,274	1,034,304,971	(166,328,186)	47,955,748,059	(89,378,559)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 9、其他债权投资(续)

#### (1) 按类别列示:(续)

	初始成本	2021年12月31日		账面价值	累计减值准备
		利息	公允价值变动		
国债	8,688,000,000	156,185,840	34,954,899	8,879,140,739	-
地方债	2,553,967,920	64,109,758	27,267,893	2,645,345,571	(715,159)
企业债	13,921,099,891	420,485,946	35,383,400	14,376,969,237	(7,989,460)
同业存单	4,040,961,750	33,780,689	3,572,789	4,078,315,228	(1,913,884)
中期票据	5,665,000,000	116,659,335	32,379,447	5,814,038,782	(4,815,995)
金融债	6,888,461,274	190,354,696	33,952,798	7,112,768,768	(3,272,978)
其他	100,000,000	2,633,710	757,646	103,391,356	(67,561)
合计	41,857,490,835	984,209,974	168,268,872	43,009,969,681	(18,775,037)

其他债权投资的减值准备,在其他综合收益中确认,并将减值损失或利得计入当期损益,且不减少在资产负债表中列示的账面价值。

- (2) 于2022年6月30日,用于质押的其他债权投资的账面价值为人民币30,408,659,488元(2021年12月31日:人民币15,260,811,156元)。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 10、长期股权投资

#### (1) 按类别列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
对联营企业的投资	512,623,317	497,800,566
对合营企业的投资	580,280,848	589,135,019
合计	1,092,904,165	1,086,935,585

#### (2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团的长期股权投资情况如下:

##### (a) 联营企业:

被投资单位	核算方法	2022年		增加/ (减少)	权益法下确认 的投资收益/ (损失)	其他 权益变动	其他综合 收益调整	宣告 发放现金 股利或利润	其他	2022年 6月30日余额
		投资成本 人民币百万元	余额 人民币百万元							
浙商金汇信托股份 有限公司	权益法	298	431	-	12	-	-	-	-	443
北京金通港房地产 开发有限公司	权益法	28	27	-	(0)	-	-	-	-	27
佳成新泰(北京)投资 有限公司	权益法	10	-	-	4	-	-	-	-	4
Trail Management	权益法	2	1	-	0	-	-	-	(0)	1
国新央企运营投资基金 管理(广州)有限公司	权益法	10	27	-	(1)	-	-	-	-	26
陕西股权交易中心 股份有限公司	权益法	13	12	-	(0)	-	-	-	-	12
合计		361	498	-	15	-	-	-	(0)	513



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 10、长期股权投资(续)

(2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团的长期股权投资情况如下:(续)

#### (a) 联营企业:(续)

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2021年	增加/	权益法下确认	其他 权益变动 人民币百万元	其他综合	宣告	其他	2021年
			1月1日 余额 人民币百万元	(减少) 投资成本 人民币百万元	的投资收益/ (损失) 人民币百万元		收益调整 人民币百万元	发放现金 股利或利润 人民币百万元		12月31日 余额 人民币百万元
浙商金汇信托股份有限公司	权益法	298	399	-	33	(1)	-	-	0	431
北京金通港房地产开发有限公司	权益法	28	27	-	(0)	-	-	-	-	27
佳成新泰(北京)投资有限公司	权益法	10	6	-	(6)	-	-	-	-	-
Trail Management	权益法	2	1	-	0	-	-	-	(0)	1
国新央企运营投资基金管理 (广州)有限公司	权益法	10	24	-	8	-	-	(5)	-	27
陕西股权交易中心股份有限公司	权益法	13	13	-	(1)	-	-	-	-	12
中投长春国家光电信息创业 投资基金(有限合伙)	权益法	-	28	(51)	1	-	-	-	22	-
深圳市中投金圆股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	权益法	-	0	(0)	-	-	-	-	-	-
北京中投金达投资管理中心 (有限合伙)	权益法	-	0	(0)	-	-	-	-	-	-
长春中投金盛投资合伙企业 (有限合伙)	权益法	-	112	(51)	9	-	-	-	(70)	-
合计		361	610	(102)	44	(1)	-	(5)	(48)	498

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 10、长期股权投资(续)

(2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团的长期股权投资情况如下:(续)

## (b) 合营企业:

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2022年		权益法下确认 的投资收益/ (损失) 人民币百万元	其他权益变动 人民币百万元	其他综合 收益调整 人民币百万元	宣告		2022年 6月30日余额 人民币百万元
			1月1日余额 人民币百万元	增加/(减少) 投资成本 人民币百万元				发放现金 股利或利润 人民币百万元	其他 人民币百万元	
金腾科技信息(深圳)有限公司	权益法	153	49	-	(42)	-	-	-	-	7
中金甲子(北京)私募投资基金管理有限公司 (“中金甲子”)	权益法	13	103	-	5	-	-	(8)	(0)	100
CICC ALPHA Investment Group Limited	权益法	-	14	-	3	-	-	-	1	18
金建(深圳)投资管理中心(有限合伙)	权益法	25	45	-	(0)	-	-	-	-	45
国药中金(上海)私募股权投资管理有限公司	权益法	3	26	-	3	-	-	-	-	29
浦泰宽立投资管理有限公司	权益法	1	0	-	(0)	-	-	-	-	0
KCA Capital Partners	权益法	0	1	-	0	-	-	-	0	1
中金鑫智(上海)私募股权投资管理有限公司	权益法	7	10	-	11	-	-	-	-	21
河南中金汇融私募基金管理有限公司	权益法	10	16	-	0	-	-	-	-	16
Krane Funds Advisors, LLC	权益法	258	204	-	16	-	-	(16)	10	214
Global Bridge Capital I GP, LLC	权益法	6	54	-	(10)	-	-	-	2	46
Global Bridge Capital Management, LLC	权益法	-	27	-	4	-	-	-	1	32
宁波厚文投资管理有限公司	权益法	8	8	-	0	-	-	-	-	8
中电中金(厦门)电子产业私募股权投资管理有限公司	权益法	5	15	-	7	-	-	-	-	22
联通中金私募股权投资管理(深圳)有限公司	权益法	8	9	3	0	-	-	(1)	(2)	9
财信中金(湖南)私募股权投资管理有限公司	权益法	10	8	-	4	-	-	-	-	12
合计		507	589	3	1	-	-	(25)	12	580

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 10、长期股权投资(续)

(2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团的长期股权投资情况如下:(续)

#### (b) 合营企业:(续)

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2021年		权益法下确认		其他综合 收益调整	宣告发放现金 股利或利润	其他	2021年 12月31日余额 人民币百万元
			1月1日余额 人民币百万元	增加/(减少) 投资成本 人民币百万元	的投资收益/ (损失) 人民币百万元	其他权益变动 人民币百万元				
金腾科技信息(深圳)有限公司	权益法	153	62	51	(64)	-	-	-	-	49
中金甲子	权益法	13	41	-	62	-	-	-	-	103
CICC ALPHA Investment Group Limited	权益法	-	9	-	5	-	-	-	(0)	14
金建(深圳)投资管理中心(有限合伙)	权益法	25	42	-	3	-	-	-	-	45
国药中金(上海)私募股权投资管理有限公司	权益法	3	35	-	1	-	-	(10)	-	26
浦泰宽立投资管理有限公司	权益法	1	0	-	(0)	-	-	-	-	0
KCA Capital Partners	权益法	0	1	-	(0)	-	-	-	(0)	1
中金鑫智(上海)私募股权投资管理有限公司	权益法	7	6	1	6	-	-	(3)	-	10
河南中金汇融私募基金管理有限公司	权益法	10	12	-	4	-	-	-	-	16
Krane Funds Advisors, LLC	权益法	258	169	-	39	-	-	-	(4)	204
Global Bridge Capital I GP, LLC	权益法	6	36	-	19	-	-	-	(1)	54
Global Bridge Capital Management, LLC	权益法	-	20	-	7	-	-	-	(0)	27
宁波厚文投资管理有限公司	权益法	8	8	-	0	-	-	-	-	8
中电中金(厦门)电子产业私募股权投资管理有限公司	权益法	5	12	-	3	-	-	-	-	15
联通中金私募股权投资管理(深圳)有限公司	权益法	5	7	-	2	-	-	-	-	9
财信中金(湖南)私募股权投资管理有限公司	权益法	10	-	10	(2)	-	-	-	-	8
深圳市中投金瑞新兴产业股权投资合伙企业(有限合伙)	权益法	-	68	(52)	17	-	-	-	(33)	-
吉林中投科技成果转化创业投资合伙企业(有限合伙)	权益法	-	50	(54)	2	-	-	-	2	-
合计		504	578	(44)	104	-	-	(13)	(36)	589

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 11、固定资产

#### (1) 账面价值

	2022年6月30日	2021年12月31日
固定资产原价	2,271,723,514	2,117,275,483
减:累计折旧	(1,546,021,958)	(1,436,802,371)
合计	725,701,556	680,473,112

#### (2) 固定资产增减变动表

	办公设备	家具及 其他设备	运输工具	房屋及建筑物	合计
原值					
2021年1月1日余额	1,600,593,892	105,571,362	21,250,345	92,721,687	1,820,137,286
收购子公司转入	1,303,344	917,435	-	-	2,220,779
本年增加	411,826,489	25,086,388	-	-	436,912,877
本年减少	(118,562,250)	(6,854,388)	(10,854,540)	-	(136,271,178)
汇率变动的影响	(4,416,986)	(1,307,295)	-	-	(5,724,281)
2021年12月31日及 2022年1月1日余额	1,890,744,489	123,413,502	10,395,805	92,721,687	2,117,275,483
本期增加	176,354,765	22,091,185	-	-	198,445,950
本期减少	(43,612,689)	(6,468,197)	(286,400)	-	(50,367,286)
汇率变动的影响	5,775,157	594,210	-	-	6,369,367
2022年6月30日余额	2,029,261,722	139,630,700	10,109,405	92,721,687	2,271,723,514



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 11、固定资产(续)

#### (2) 固定资产增减变动表(续)

	办公设备	家具及 其他设备	运输工具	房屋及建筑物	合计
累计折旧					
2021年1月1日余额	(1,167,366,201)	(78,923,235)	(17,163,812)	(41,485,338)	(1,304,938,586)
收购子公司转入	(979,879)	(389,617)	-	-	(1,369,496)
本年计提	(244,230,810)	(12,794,005)	(344,880)	(4,450,571)	(261,820,266)
本年减少	111,529,437	6,309,389	9,128,295	-	126,967,121
汇率变动的影响	3,929,987	428,869	-	-	4,358,856
2021年12月31日及					
2022年1月1日余额	(1,297,117,466)	(85,368,599)	(8,380,397)	(45,935,909)	(1,436,802,371)
本期计提					
本期减少	(140,446,792)	(8,947,828)	(142,297)	(2,072,554)	(151,609,471)
本期减少	41,681,710	5,988,092	277,808	-	47,947,610
汇率变动的影响	(5,075,339)	(482,387)	-	-	(5,557,726)
2022年6月30日余额					
	(1,400,957,887)	(88,810,722)	(8,244,886)	(48,008,463)	(1,546,021,958)
账面价值					
2022年6月30日余额	<b>628,303,835</b>	<b>50,819,978</b>	<b>1,864,519</b>	<b>44,713,224</b>	<b>725,701,556</b>
2021年12月31日余额	593,627,023	38,044,903	2,015,408	46,785,778	680,473,112

- (a) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团尚未办理产权手续的房屋及建筑物的账面价值分别为人民币181万元和人民币185万元。
- (b) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团不存在重大的所有权受到限制的固定资产,不存在重大的持有待售的固定资产。
- (c) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团在建工程完工转入固定资产的原值分别为人民币264万元和人民币473万元。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 12、在建工程

	装修、改造工程	办公楼	合计
2021年1月1日余额	16,119,493	21,217,791	37,337,284
本年增加	110,162,878	135,366,734	245,529,612
本年转出	(93,430,044)	-	(93,430,044)
2021年12月31日及2022年1月1日余额	32,852,327	156,584,525	189,436,852
本期增加	25,883,850	75,393,398	101,277,248
本期转出	(34,837,415)	-	(34,837,415)
2022年6月30日余额	23,898,762	231,977,923	255,876,685
2022年6月30日账面价值	23,898,762	231,977,923	255,876,685
2021年12月31日账面价值	32,852,327	156,584,525	189,436,852

### 13、使用权资产

	房屋及建筑物	设备	合计
原值			
2021年1月1日余额	2,192,003,536	877,867	2,192,881,403
收购子公司转入	58,017,322	-	58,017,322
处置子公司转出	(2,066,509)	-	(2,066,509)
本年增加	1,609,171,350	-	1,609,171,350
本年减少	(609,719,980)	-	(609,719,980)
汇率变动的影响	(15,266,792)	(23,022)	(15,289,814)
2021年12月31日及2022年1月1日余额	3,232,138,927	854,845	3,232,993,772

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 13、使用权资产(续)

	房屋及建筑物	设备	合计
本期增加	501,991,248	-	501,991,248
本期减少	(245,119,264)	-	(245,119,264)
汇率变动的影响	28,214,932	18,439	28,233,371
2022年6月30日余额	<b>3,517,225,843</b>	<b>873,284</b>	<b>3,518,099,127</b>
累计折旧			
2021年1月1日余额	(1,002,613,003)	(453,157)	(1,003,066,160)
收购子公司转入	(30,620,253)	-	(30,620,253)
处置子公司转出	1,606,446	-	1,606,446
本年增加	(658,081,165)	(156,625)	(658,237,790)
本年减少	395,439,400	-	395,439,400
汇率变动的影响	7,687,383	13,310	7,700,693
2021年12月31日及2022年1月1日余额	(1,286,581,192)	(596,472)	(1,287,177,664)
本期增加	(415,777,013)	(84,882)	(415,861,895)
本期减少	186,950,713	-	186,950,713
汇率变动的影响	(6,754,683)	(4,839)	(6,759,522)
2022年6月30日余额	<b>(1,522,162,175)</b>	<b>(686,193)</b>	<b>(1,522,848,368)</b>
账面价值			
2022年6月30日余额	<b>1,995,063,668</b>	<b>187,091</b>	<b>1,995,250,759</b>
2021年12月31日余额	1,945,557,735	258,373	1,945,816,108

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 14、无形资产

	土地使用权	交易席位费	其他无形资产	合计
原值				
2021年1月1日余额	1,266,558,879	163,112,847	597,728,751	2,027,400,477
收购子公司转入	-	-	1,259,638	1,259,638
本年增加	-	-	277,487,101	277,487,101
本年减少	-	-	(5,536,526)	(5,536,526)
汇率变动的影响	-	(12,020)	(30,225)	(42,245)
2021年12月31日及 2022年1月1日余额	1,266,558,879	163,100,827	870,908,739	2,300,568,445
本期增加	-	-	195,761,174	195,761,174
本期减少	-	-	(641,441)	(641,441)
汇率变动的影响	-	12,020	156,862	168,882
2022年6月30日余额	<b>1,266,558,879</b>	<b>163,112,847</b>	<b>1,066,185,334</b>	<b>2,495,857,060</b>
累计摊销				
2021年1月1日余额	(184,821,786)	(109,487,844)	(346,476,553)	(640,786,183)
收购子公司转入	-	-	(315,970)	(315,970)
本年计提	(32,910,658)	(8,580,000)	(144,934,193)	(186,424,851)
本年减少	-	-	5,228,358	5,228,358
汇率变动的影响	-	-	19,692	19,692
2021年12月31日及 2022年1月1日余额	(217,732,444)	(118,067,844)	(486,478,666)	(822,278,954)
本期计提	(16,455,329)	(4,290,000)	(112,665,543)	(133,410,872)
本期减少	-	-	641,441	641,441
汇率变动的影响	-	-	(75,619)	(75,619)
2022年6月30日余额	<b>(234,187,773)</b>	<b>(122,357,844)</b>	<b>(598,578,387)</b>	<b>(955,124,004)</b>
账面价值				
2022年6月30日余额	<b>1,032,371,106</b>	<b>40,755,003</b>	<b>467,606,947</b>	<b>1,540,733,056</b>
2021年12月31日余额	1,048,826,435	45,032,983	384,430,073	1,478,289,491

于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团不存在重大的所有权受到限制的无形资产。



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 15、商誉

#### (1) 商誉变动情况

被投资单位名称	2022年			2022年	
	1月1日	本期增加	本期减少	6月30日	减值准备
中金财富(注1)	1,582,678,646	-	-	1,582,678,646	-
北京科创(注2)	39,984,637	-	-	39,984,637	-
合计	1,622,663,283	-	-	1,622,663,283	-

被投资单位名称	2021年			2021年	
	1月1日	本年增加	本年减少	12月31日	减值准备
中金财富(注1)	1,582,678,646	-	-	1,582,678,646	-
北京科创(注2)	-	39,984,637	-	39,984,637	-
合计	1,582,678,646	39,984,637	-	1,622,663,283	-

注1: 本公司于2017年支付股份对价人民币16,700,695,000元作为合并成本收购了中金财富。对价与本公司享有的中金财富可辨认净资产公允价值的差额为人民币1,582,678,646元,确认为与财富管理资产组相关的商誉。

注2: 本公司之子公司中金资本于2021年以人民币220,129,947元对北京科创进行现金增资,增资后占北京科创股权比例为51%。对价与中金资本享有的北京科创可辨认净资产公允价值的差额为人民币39,984,637元,确认为商誉。

#### (2) 商誉的减值

于2022年6月30日,管理层未注意到商誉存在减值迹象。

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 16、递延所得税资产/(负债)

## (1) 已确认递延所得税资产/(负债)

	2022年 1月1日	本期增减 计入损益	本期增减		递延 所得税合计	2022年6月30日				
			计入权益	汇率变动的影响		递延 所得税资产	可抵扣 暂时性差异	递延 所得税负债	应纳税 暂时性差异	
抵销前递延所得税										
员工成本	1,761,498,689	(390,935,113)	-	1,084,686	1,371,648,262	1,371,648,262	5,630,756,745	-	-	-
可抵扣亏损	23,774,576	987,234,492	-	(92,521)	1,010,916,547	1,010,916,547	4,318,067,250	-	-	-
固定资产累计折旧 及其他资产摊销	(64,417,337)	(5,142,435)	-	(799,676)	(70,359,448)	384,431	1,537,724	(70,743,879)	(284,272,708)	
交易性金融工具 公允价值变动	(795,536,477)	(737,177,748)	-	932,158	(1,531,782,067)	82,803,169	331,212,676	(1,614,585,236)	(6,520,105,404)	
其他债权投资 公允价值变动	(46,804,645)	-	57,045,416	1,972,622	12,213,393	59,877,072	362,599,043	(47,663,679)	(190,654,716)	
减值准备	121,941,266	(9,815,447)	(12,082,757)	(852,001)	99,191,061	99,191,061	411,527,612	-	-	
收购子公司产生的 公允价值调整	(163,989,062)	1,288,091	-	-	(162,700,971)	-	-	(162,700,971)	(650,803,884)	
其他	360,517,148	93,210,615	-	(36,455)	453,691,308	457,939,852	1,855,174,436	(4,248,544)	(16,994,176)	
小计	1,196,984,158	(61,337,545)	44,962,659	2,208,813	1,182,818,085	3,082,760,394	12,910,875,486	(1,899,942,309)	(7,662,830,888)	
递延所得税抵销						(1,354,117,822)	(5,479,032,504)	1,354,117,822	5,479,032,504	
合计						1,728,642,572	7,431,842,982	(545,824,487)	(2,183,798,384)	

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 16、递延所得税资产/(负债) (续)

#### (1) 已确认递延所得税资产/(负债) (续)

	2021年12月31日									
	2021年 1月1日	本年增减 计入损益	本年增减 计入权益	收购子公司 转入/产生	汇率变动 的影响	递延所得税 合计	递延 所得税资产	可抵扣 暂时性差异	递延 所得税负债	应纳税 暂时性差异
抵销前递延所得税										
员工成本	1,286,938,753	469,560,114	-	5,259,609	(259,787)	1,761,498,689	1,761,498,689	7,327,471,102	-	-
可抵扣亏损	65,048,404	(55,693,352)	-	15,516,134	(1,096,610)	23,774,576	23,774,576	369,680,591	-	-
固定资产累计折旧及 其他资产摊销	(29,798,976)	(34,582,015)	-	-	(36,346)	(64,417,337)	1,966,994	11,115,954	(66,384,331)	(265,537,324)
交易性金融工具 公允价值变动	(282,134,833)	(512,782,147)	-	(608,438)	(11,059)	(795,536,477)	37,931,705	151,751,623	(833,468,182)	(3,395,979,569)
其他股权投资公允 价值变动	(4,795,623)	-	(42,162,889)	-	153,867	(46,804,645)	11,904,446	72,148,158	(58,709,091)	(234,836,364)
减值准备	192,516,052	(69,759,884)	(444,878)	-	(370,024)	121,941,266	121,941,266	529,237,465	-	-
收购子公司产生的 公允价值调整	(167,194,386)	3,252,243	-	(46,919)	-	(163,989,062)	-	-	(163,989,062)	(655,956,248)
其他	220,367,309	140,147,605	-	-	2,234	360,517,148	364,844,020	1,470,381,316	(4,326,872)	(17,307,488)
小计	1,280,946,700	(59,857,436)	(42,607,767)	20,120,386	(1,617,725)	1,196,984,158	2,323,861,696	9,931,786,209	(1,126,877,538)	(4,569,616,993)
递延所得税抵销							(695,222,304)	(2,840,247,380)	695,222,304	2,840,247,380
合计							1,628,639,392	7,091,538,829	(431,655,234)	(1,729,369,613)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 16、递延所得税资产/(负债)(续)

#### (2) 未确认递延所得税资产明细

	可抵扣暂时性差异	
	2022年6月30日	2021年12月31日
可抵扣亏损	1,621,883,107	1,363,035,550
其他	274,628,184	170,303,739
合计	1,896,511,291	1,533,339,289

### 17、其他资产

	注	2022年6月30日	2021年12月31日
长期待摊费用	(1)	276,913,309	266,319,599
待摊费用		98,115,655	86,721,425
其他应收款	(2)	993,277,254	816,712,732
其他		854,928,107	352,238,861
合计		2,223,234,325	1,521,992,617

#### (1) 长期待摊费用

	截至2022年6月30日止6个月期间			
	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额
经营租入固定资产改良支出	261,957,559	84,196,152	(74,321,525)	271,832,186
其他	4,362,040	1,500,967	(781,884)	5,081,123
合计	266,319,599	85,697,119	(75,103,409)	276,913,309

	2021年度			
	年初余额	本年增加	本年减少	年末余额
经营租入固定资产改良支出	195,862,340	173,885,813	(107,790,594)	261,957,559
其他	1,460,508	4,269,785	(1,368,253)	4,362,040
合计	197,322,848	178,155,598	(109,158,847)	266,319,599



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 17、其他资产 (续)

#### (2) 其他应收款

##### (a) 按性质分析:

	2022年6月30日	2021年12月31日
应收租赁及其他押金	265,793,140	242,435,920
贷款	238,282,414	279,892,051
其他	516,224,530	311,960,861
小计	1,020,300,084	834,288,832
减: 减值准备	(27,022,830)	(17,576,100)
账面价值	993,277,254	816,712,732

##### (b) 按账龄分析:

账龄	2022年6月30日			
	账面余额 金额	比例	减值准备 金额	比例
1年以内(含1年)	717,385,822	70.31%	(955,683)	3.54%
1-2年(含2年)	162,829,327	15.96%	(11,339,776)	41.96%
2-3年(含3年)	28,914,831	2.83%	(8,277,156)	30.63%
3年以上	111,170,104	10.90%	(6,450,215)	23.87%
合计	1,020,300,084	100.00%	(27,022,830)	100.00%

账龄	2021年12月31日			
	账面余额 金额	比例	减值准备 金额	比例
1年以内(含1年)	683,371,264	81.91%	(1,503,003)	8.55%
1-2年(含2年)	20,883,721	2.50%	(1,195,127)	6.80%
2-3年(含3年)	16,322,470	1.96%	(8,561,007)	48.71%
3年以上	113,711,377	13.63%	(6,316,963)	35.94%
合计	834,288,832	100.00%	(17,576,100)	100.00%

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 18、减值准备

#### (1) 按项目划分:

	附注	2022年				汇率变动 及其他	2022年 6月30日余额
		1月1日余额	本期计提	本期转回	本期核销		
货币资金减值准备	七、1	279,829	241,240	(246,756)	-	475	274,788
融出资金减值准备	七、3	161,966,115	34,446,422	(50,233,065)	-	417,582	146,597,054
应收款项减值准备	七、6	577,721,275	81,388,677	(206,513,831)	-	981,093	453,577,214
买入返售金融资产减值准备	七、7	69,453,349	2,511,656	(9,680,198)	-	-	62,284,807
其他债权投资减值准备	七、9	18,775,037	78,351,551	(8,073,913)	-	325,884	89,378,559
其他应收款减值准备	七、17(2)	17,576,100	10,895,415	(1,354,698)	-	(93,987)	27,022,830
信用减值准备合计		845,771,705	207,834,961	(276,102,461)	-	1,631,047	779,135,252
	附注	2021年				汇率变动 及其他	2021年 12月31日余额
		1月1余额	本年计提	本年转回	本年核销		
货币资金减值准备	七、1	168,508	279,726	(168,317)	-	(88)	279,829
融出资金减值准备	七、3	136,803,436	71,125,958	(45,629,316)	-	(333,963)	161,966,115
应收款项减值准备	七、6	624,931,217	253,643,525	(299,664,287)	(17)	(1,189,163)	577,721,275
买入返售金融资产减值准备	七、7	302,616,780	18,560,403	(251,723,834)	-	-	69,453,349
其他债权投资减值准备	七、9	18,166,922	15,387,896	(14,618,527)	-	(161,254)	18,775,037
其他应收款减值准备	七、17(2)	176,651,066	404,358	(155,631,895)	(151,672)	(3,695,757)	17,576,100
信用减值准备合计		1,259,337,929	359,401,866	(767,436,176)	(151,689)	(5,380,225)	845,771,705

于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团无其他资产减值准备。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 18、减值准备(续)

#### (2) 金融工具及其他项目预期信用损失准备情况:

	2022年6月30日			合计
	未来12个月	整个存续期	整个存续期	
	预期信用损失	预期信用损失 (未发生信用减值)	预期信用损失 (已发生信用减值)	
货币资金减值准备	274,788	-	-	274,788
融出资金减值准备	146,585,824	11,230	-	146,597,054
应收款项减值准备	80,266,229	59,485,875	313,825,110	453,577,214
买入返售金融资产减值准备	34,035,558	-	28,249,249	62,284,807
其他债权投资减值准备	24,266,071	2,533,024	62,579,464	89,378,559
其他应收款减值准备	509,322	5,184,726	21,328,782	27,022,830
合计	285,937,792	67,214,855	425,982,605	779,135,252

	2021年12月31日			合计
	未来12个月	整个存续期	整个存续期	
	预期信用损失	预期信用损失 (未发生信用减值)	预期信用损失 (已发生信用减值)	
货币资金减值准备	279,829	-	-	279,829
融出资金减值准备	161,966,115	-	-	161,966,115
应收款项减值准备	205,226,414	53,744,945	318,749,916	577,721,275
买入返售金融资产减值准备	41,204,100	-	28,249,249	69,453,349
其他债权投资减值准备	18,216,690	558,347	-	18,775,037
其他应收款减值准备	515,946	6,223,027	10,837,127	17,576,100
合计	427,409,094	60,526,319	357,836,292	845,771,705

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 19、应付短期融资款

	注	2022年6月30日	2021年12月31日
收益凭证	(1)	11,907,898,953	15,121,477,870
短期公司债券	(2)	5,000,000,000	5,000,000,000
结构性票据	(3)	1,366,311,202	1,762,243,471
短期融资券	(4)	-	1,000,000,000
小计		18,274,210,155	22,883,721,341
加: 计提利息			
其中: 收益凭证		54,509,536	51,422,773
短期公司债券		112,515,162	40,963,789
结构性票据		4,707,553	11,513,970
短期融资券		-	2,235,616
合计		18,445,942,406	22,989,857,489

#### (1) 收益凭证

票面利率	2022年		利息计提/		重分类至		2022年 6月30日余额
	1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	应付债券(注)		
0.00% - 7.42%	15,172,900,643	31,834,054,086	3,086,763	(35,047,633,003)	-		11,962,408,489
票面利率	2021年		利息计提/		重分类至		2021年 12月31日余额
	1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	应付债券(注)		
0.00% - 11.02%	19,775,706,657	47,872,317,839	(38,391,344)	(52,234,509,769)	(202,222,740)		15,172,900,643

注: 已发行的短期收益凭证因收益凭证持有人行使展期权而重分类至已发行的长期收益凭证。



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 19、应付短期融资款(续)

#### (1) 收益凭证(续)

本集团发行的收益凭证的票面利率分为:

- 固定利率, 年利率为1.65%至7.90%不等;
- 固定利率加浮动利率;
- 浮动利率。

浮动利率基于沪深300指数、中证500指数等股票指数、个股、大宗商品价格或美元指数计算。此类收益凭证的收益率基于挂钩标的在合约规定期间的市场表现, 浮动收益划分至衍生金融工具核算。

#### (2) 短期公司债券

债券名称	起息日期	到期日期	发行金额	票面利率	2022年		利息计提/		2022年	
					1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	摊销及其他	6月30日余额
21中财S1	09/08/2021	09/08/2022	2,000,000,000	2.68%	2,020,042,181	-	27,608,933	-	-	2,047,651,114
21中财S2	24/09/2021	24/09/2022	3,000,000,000	2.85%	3,020,921,608	-	43,942,440	-	-	3,064,864,048
合计					5,040,963,789	-	71,551,373	-	-	5,112,515,162

债券名称	起息日期	到期日期	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/		2021年	
					1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	摊销及其他	12月31日余额
21中财S1	09/08/2021	09/08/2022	2,000,000,000	2.68%	-	2,000,000,000	20,042,181	-	-	2,020,042,181
21中财S2	24/09/2021	24/09/2022	3,000,000,000	2.85%	-	3,000,000,000	20,921,608	-	-	3,020,921,608
合计					-	5,000,000,000	40,963,789	-	-	5,040,963,789

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 19、应付短期融资款(续)

#### (3) 结构性票据

名称	2022年		利息计提/		汇率变动 及其他	2022年 6月30日余额
	1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付		
结构性票据(注)	1,773,757,441	1,285,260,477	(6,806,417)	(1,763,832,134)	82,639,388	1,371,018,755

名称	2021年		利息计提/		汇率变动 及其他	2021年 12月31日余额
	1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付		
结构性票据(注)	5,911,352,270	2,232,650,401	(15,568,973)	(6,268,914,105)	(85,762,152)	1,773,757,441

注: 该等结构性票据票面年利率范围为0.21%至3.27%不等,发行期限为14天至365天不等。

#### (4) 短期融资券

债券名称	起息日期	到期日期	发行金额	票面利率	2022年		利息计提/		摊销及其他	2022年 6月30日余额
					1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付		
21中金公司CP001	29/11/2021	25/02/2022	1,000,000,000	2.55%	1,002,235,616	-	(2,235,616)	(1,000,000,000)	-	-

债券名称	起息日期	到期日期	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/		摊销及其他	2021年 12月31日余额
					1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付		
21中金公司CP001	29/11/2021	25/02/2022	1,000,000,000	2.55%	-	1,000,000,000	2,235,616	-	-	1,002,235,616

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 20、拆入资金

	注	2022年6月30日	2021年12月31日
从银行拆入的资金		44,173,770,177	50,516,199,330
转融通融入资金	(1)	500,000,000	500,000,000
从非银行金融机构拆入的资金		-	200,000,000
小计		44,673,770,177	51,216,199,330
加: 计提利息		238,485,847	261,079,348
合计		44,912,256,024	51,477,278,678

#### (1) 转融通融入资金的剩余期限和利率区间分析:

	2022年6月30日		2021年12月31日	
	期末余额	利率区间	年末余额	利率区间
1个月内(含1个月)	100,000,000	2.80%	100,000,000	2.80%
1-3个月(含3个月)	400,000,000	2.80%	400,000,000	2.80%
小计	500,000,000		500,000,000	
加: 计提利息	754,444		793,333	
合计	500,754,444		500,793,333	

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 21、交易性金融负债

	2022年6月30日		合计
	分类为以公允价值计量 且其变动计入当期 损益的金融负债	指定为以公允价值计量 且其变动计入当期 损益的金融负债	
权益	3,544,089,809	34,480,523,978	38,024,613,787
债权	2,111,692,347	2,298,832,231	4,410,524,578
基金及其他	108,427,686	-	108,427,686
合计	5,764,209,842	36,779,356,209	42,543,566,051

	2021年12月31日		合计
	分类为以公允价值计量 且其变动计入当期 损益的金融负债	指定为以公允价值计量 且其变动计入当期 损益的金融负债	
权益	2,755,876,401	34,162,624,317	36,918,500,718
债权	823,345,819	526,215,128	1,349,560,947
基金及其他	658,725,019	-	658,725,019
合计	4,237,947,239	34,688,839,445	38,926,786,684

注: 交易性金融负债中的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的标的的主要是权益工具,且公允价值与股票、指数挂钩。

于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值并未发生由于本集团自身信用风险变化导致的重大变动。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 22、卖出回购金融资产款

#### (1) 按金融资产种类列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
企业债	5,851,212,713	1,857,523,312
中期票据	7,261,798,971	1,417,293,958
同业存单	1,773,840,000	1,647,000,000
金融债	12,930,947,536	3,577,550,167
国债和地方债	13,603,155,837	1,461,349,382
其他	14,848,198,442	6,410,304,013
小计	56,269,153,499	16,371,020,832
加: 计提利息	16,894,164	5,050,119
合计	56,286,047,663	16,376,070,951

#### (2) 按业务类别列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
质押式卖出回购	44,244,012,877	10,833,699,510
买断式卖出回购	9,308,855,722	4,936,415,322
债券质押式报价回购	2,716,284,900	600,906,000
小计	56,269,153,499	16,371,020,832
加: 计提利息	16,894,164	5,050,119
合计	56,286,047,663	16,376,070,951



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 22、卖出回购金融资产款(续)

#### (3) 债券质押式报价回购的剩余期限和利率区间分析:

	2022年6月30日		2021年12月31日	
	期末余额	利率区间	年末余额	利率区间
1个月内(含1个月)	2,716,284,900	1.60%-9.15%	600,906,000	1.60%-9.15%
加: 计提利息	4,606,366		614,651	
合计	2,720,891,266		601,520,651	

#### (4) 按担保物的公允价值列示:

	2022年6月30日	2021年12月31日
债券	52,777,338,133	14,471,305,962
股票	4,761,975,149	3,235,356,339
合计	57,539,313,282	17,706,662,301

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 23、代理买卖证券款

	2022年6月30日	2021年12月31日
普通经纪业务		
— 个人	38,199,775,633	33,581,982,873
— 机构	57,188,869,158	51,224,518,628
小计	95,388,644,791	84,806,501,501
信用业务		
— 个人	4,801,381,368	4,338,345,138
— 机构	5,769,110,165	4,284,287,574
小计	10,570,491,533	8,622,632,712
加: 计提利息	16,026,339	16,031,094
合计	105,975,162,663	93,445,165,307

### 24、代理承销证券款

	2022年6月30日	2021年12月31日
股票	386,055,000	7,304,310,900

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 25、应付职工薪酬

	截至2022年6月30日止6个月期间			期末余额
	期初余额	本期增加	本期减少	
短期及长期薪酬：				
工资、奖金、津贴和补贴	10,927,098,524	4,493,704,388	(9,136,546,541)	6,284,256,371
社会保险费	9,255,023	251,620,324	(248,465,398)	12,409,949
其中：医疗保险费	8,123,623	140,960,229	(140,802,003)	8,281,849
补充医疗保险费	-	99,558,303	(99,558,303)	-
工伤医疗保险费	514,469	3,033,117	(3,024,153)	523,433
生育保险费	616,931	4,404,462	(4,460,326)	561,067
其他	-	3,664,213	(620,613)	3,043,600
住房公积金	28,451,598	200,662,774	(200,163,575)	28,950,797
工会经费和职工教育经费	51,630,448	135,338,931	(130,066,759)	56,902,620
其他	7,794,613	40,468,715	(47,884,651)	378,677
小计	11,024,230,206	5,121,795,132	(9,763,126,924)	6,382,898,414
设定提存计划：				
其中：基本养老保险费	36,008,276	268,877,907	(267,898,053)	36,988,130
失业保险费	1,570,042	7,227,896	(7,017,093)	1,780,845
企业年金缴费	20,340,968	86,008,504	(56,566,353)	49,783,119
小计	57,919,286	362,114,307	(331,481,499)	88,552,094
辞退福利	86,715,588	15,887,101	(15,771,867)	86,830,822
合计	11,168,865,080	5,499,796,540	(10,110,380,290)	6,558,281,330

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 25、应付职工薪酬 (续)

	2021年度			年末余额
	年初余额	本年增加	本年减少	
短期及长期薪酬：				
工资、奖金、津贴和补贴	8,414,585,031	12,007,792,241	(9,495,278,748)	10,927,098,524
社会保险费	19,248,456	331,101,789	(341,095,222)	9,255,023
其中：医疗保险费	18,261,312	213,684,637	(223,822,326)	8,123,623
补充医疗保险费	-	105,183,564	(105,183,564)	-
工伤医疗保险费	361,518	4,422,413	(4,269,462)	514,469
生育保险费	625,626	7,720,113	(7,728,808)	616,931
其他	-	91,062	(91,062)	-
住房公积金	17,930,023	305,875,920	(295,354,345)	28,451,598
工会经费和职工教育经费	37,615,458	47,347,031	(33,332,041)	51,630,448
其他	202,946	59,429,301	(51,837,634)	7,794,613
小计	8,489,581,914	12,751,546,282	(10,216,897,990)	11,024,230,206
设定提存计划：				
其中：基本养老保险费	13,616,817	403,214,698	(380,823,239)	36,008,276
失业保险费	1,000,657	11,940,932	(11,371,547)	1,570,042
企业年金缴费	1,095,583	125,895,790	(106,650,405)	20,340,968
小计	15,713,057	541,051,420	(498,845,191)	57,919,286
辞退福利	81,669,404	33,933,298	(28,887,114)	86,715,588
合计	8,586,964,375	13,326,531,000	(10,744,630,295)	11,168,865,080

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 26、应交税费

	2022年6月30日	2021年12月31日
企业所得税	1,056,454,567	979,703,792
个人所得税	253,256,428	171,644,373
增值税	143,679,822	166,496,703
城市维护建设税	9,413,121	12,084,321
教育费附加及地方教育附加	6,731,652	8,639,350
代扣代缴客户个人所得税及其他	67,275,509	258,601,039
合计	1,536,811,099	1,597,169,578

### 27、应付款项

	2022年6月30日	2021年12月31日
应付交易款项	135,829,873,954	134,781,241,379
其中: 应付衍生业务款项	108,926,911,467	122,114,401,362
其他	126,840,780	127,622,034
合计	135,956,714,734	134,908,863,413

### 28、合同负债

	2022年6月30日	2021年12月31日
投资银行业务	234,304,700	200,707,492
资产及基金管理业务	271,588,849	192,423,929
其他	24,257,670	19,819,453
合计	530,151,219	412,950,874



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 29、租赁负债

	2022年6月30日	2021年12月31日
房屋及建筑物	2,082,116,512	2,002,637,088
办公设备	187,058	258,338
合计	2,082,303,570	2,002,895,426

### 30、应付债券

	注	2022年6月30日	2021年12月31日
公司债券	(1)	102,522,821,729	103,538,574,669
中期票据	(2)	24,103,560,781	25,461,182,563
次级债券	(3)	21,594,056,785	26,516,690,620
金融债券	(4)	2,500,000,000	2,500,000,000
小计		150,720,439,295	158,016,447,852
加: 计提利息			
其中: 公司债券		1,741,335,508	1,770,852,575
中期票据		150,863,176	121,842,249
次级债券		311,652,538	568,525,592
金融债券		72,908,219	30,881,507
合计		152,997,198,736	160,508,549,775
公允价值		154,005,703,572	163,078,293,731

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 30、应付债券(续)

## (1) 公司债券:

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2022年		利息计提/		2022年	
						1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	摊销及其他	6月30日余额
17中金03(e)	08/05/2017	08/05/2022	按年支付	1,000,000,000	5.19%	1,030,720,703	-	(12,131,207)	(1,000,000,000)	(18,589,496)	-
19中金04(g)	21/11/2019	21/11/2025	按年支付	1,500,000,000	3.52%	1,505,930,959	-	26,183,014	-	-	1,532,113,973
20中金F1(h)	26/02/2020	26/02/2025	按年支付	4,000,000,000	3.20%	4,108,361,644	-	(64,526,027)	-	-	4,043,835,617
20中金G1(i)	03/04/2020	03/04/2026	按年支付	1,500,000,000	2.89%	1,532,304,658	-	(21,853,151)	-	-	1,510,451,507
20中金G2(j)	03/04/2020	03/04/2027	按年支付	1,000,000,000	3.25%	1,024,219,178	-	(16,383,562)	-	-	1,007,835,616
20中金G3(k)	06/05/2020	06/05/2026	按年支付	3,300,000,000	2.37%	3,351,211,479	-	(39,426,410)	-	-	3,311,785,069
20中金G4(l)	06/05/2020	06/05/2027	按年支付	700,000,000	2.88%	713,200,658	-	(10,162,850)	-	-	703,037,808
20中金F2(m)	28/05/2020	28/05/2025	按年支付	3,000,000,000	2.95%	3,052,615,069	-	(44,613,699)	-	-	3,008,001,370
20中金G5(n)	22/06/2020	22/06/2026	按年支付	1,500,000,000	3.10%	1,524,460,274	-	(23,441,096)	-	-	1,501,019,178
20中金F3(o)	24/07/2020	24/07/2025	按年支付	3,000,000,000	3.80%	3,049,972,603	-	56,531,507	-	-	3,106,504,110
20中金07(p)	10/09/2020	10/09/2025	按年支付	5,000,000,000	3.78%	5,057,476,712	-	93,723,288	-	-	5,151,200,000
20中金09(q)	23/09/2020	23/09/2025	按年支付	5,000,000,000	3.80%	5,051,013,699	-	94,219,178	-	-	5,145,232,877
20中金11(r)	19/10/2020	19/10/2023	按年支付	2,500,000,000	3.50%	2,517,500,000	-	43,390,411	-	-	2,560,890,411
20中金12(s)	19/10/2020	19/10/2025	按年支付	2,500,000,000	3.74%	2,518,700,000	-	46,365,753	-	-	2,565,065,753
20中金13(t)	28/10/2020	28/10/2023	按年支付	2,000,000,000	3.48%	2,012,203,836	-	34,513,972	-	-	2,046,717,808
20中金14(u)	28/10/2020	28/10/2025	按年支付	3,000,000,000	3.68%	3,019,357,808	-	54,746,302	-	-	3,074,104,110
20中金F4(v)	14/12/2020	14/12/2023	按年支付	2,500,000,000	3.85%	2,504,482,877	-	47,729,452	-	-	2,552,212,329
20中金F5(w)	14/12/2020	14/12/2025	按年支付	2,500,000,000	4.09%	2,504,762,329	-	50,704,794	-	-	2,555,467,123
21中金F1(x)	18/01/2021	18/01/2024	按年支付	2,500,000,000	3.55%	2,584,373,288	-	(44,739,726)	-	-	2,539,633,562
21中金F2(y)	18/01/2021	18/01/2026	按年支付	2,500,000,000	3.75%	2,589,126,712	-	(47,260,274)	-	-	2,541,866,438
21中金F3(z)	04/03/2021	04/03/2024	按年支付	1,500,000,000	3.60%	1,544,679,452	-	(27,221,918)	-	-	1,517,457,534
21中金F4(aa)	04/03/2021	04/03/2026	按年支付	2,000,000,000	3.82%	2,063,213,151	-	(38,513,973)	-	-	2,024,699,178
21中金G1(ab)	16/03/2021	16/03/2026	按年支付	2,000,000,000	3.58%	2,056,887,671	-	(36,094,246)	-	-	2,020,793,425
21中金G2	16/03/2021	16/03/2031	按年支付	2,000,000,000	4.10%	2,065,150,685	-	(41,336,986)	-	-	2,023,813,699
21中金G3(ac)	25/03/2021	25/03/2026	按年支付	1,500,000,000	3.51%	1,540,533,288	-	(26,541,370)	-	-	1,513,991,918
21中金G4	25/03/2021	25/03/2031	按年支付	2,500,000,000	4.07%	2,578,333,562	-	(51,293,151)	-	-	2,527,040,411
21中金F5(ad)	13/04/2021	13/04/2024	按年支付	1,000,000,000	3.43%	1,024,620,822	-	(17,290,959)	-	-	1,007,329,863
21中金F6(ae)	13/04/2021	13/04/2026	按年支付	3,500,000,000	3.70%	3,592,601,370	-	(65,282,192)	-	-	3,527,319,178

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 30、应付债券(续)

#### (1) 公司债券:(续)

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2022年		利息计提/		2022年	
						1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	摊销及其他	6月30日余额
21中金G5(af)	16/08/2021	16/08/2026	按年支付	1,000,000,000	3.04%	1,011,410,411	-	15,075,068	-	-	1,026,485,479
21中金G6(ag)	16/08/2021	16/08/2028	按年支付	1,500,000,000	3.39%	1,519,086,164	-	25,216,028	-	-	1,544,302,192
21中金G7	08/12/2021	08/12/2024	按年支付	2,500,000,000	2.97%	2,504,678,767	-	36,819,863	-	-	2,541,498,630
21中金G8	08/12/2021	08/12/2031	按年支付	1,000,000,000	3.68%	1,002,318,904	-	18,248,767	-	-	1,020,567,671
17中投F2	18/07/2017	18/07/2022	按年支付	1,000,000,000	5.10%	1,023,334,247	-	25,290,411	-	-	1,048,624,658
19中投01	22/04/2019	22/04/2022	按年支付	2,000,000,000	4.22%	2,058,692,682	-	(58,733,151)	(2,000,000,000)	40,469	-
19中财01(ai)	16/10/2019	16/10/2024	按年支付	3,000,000,000	3.58%	3,020,468,577	-	53,258,630	-	373,203	3,074,100,410
20中财G1(aj)	16/01/2020	16/01/2025	按年支付	2,000,000,000	3.44%	2,064,489,835	-	(34,685,985)	-	234,509	2,030,038,359
20中财F1(ak)	09/04/2020	09/04/2025	按年支付	3,000,000,000	3.17%	3,067,665,617	-	(47,940,822)	-	275,788	3,020,000,583
20中财F2	28/07/2020	28/07/2023	按年支付	2,000,000,000	3.80%	2,031,676,085	-	37,687,671	-	313,846	2,069,677,602
20中财G2(al)	21/10/2020	21/10/2025	按年支付	2,000,000,000	3.77%	2,013,595,069	-	37,390,137	-	156,464	2,051,141,670
20中财G3	21/10/2020	21/10/2025	按年支付	1,000,000,000	4.20%	1,007,644,244	-	20,827,397	-	77,848	1,028,549,489
20中财G5(am)	24/11/2020	24/11/2025	按年支付	1,000,000,000	3.98%	1,003,542,799	-	19,736,438	-	71,383	1,023,350,620
20中财G6(an)	15/12/2020	15/12/2025	按年支付	1,000,000,000	3.85%	1,001,184,587	-	19,091,781	-	71,337	1,020,347,705
21中财G1(ao)	26/03/2021	26/03/2024	按年支付	2,000,000,000	3.44%	2,050,763,623	-	(34,682,740)	-	475,146	2,016,556,029
21中财G2(ap)	26/03/2021	26/03/2026	按年支付	3,000,000,000	3.65%	3,082,964,938	-	(55,200,000)	-	146,037	3,027,910,975
21中财G3(aq)	22/04/2021	22/04/2026	按年支付	3,000,000,000	3.55%	3,072,756,153	-	(53,687,671)	-	145,880	3,019,214,362
21中财G4	22/04/2021	22/04/2026	按年支付	2,000,000,000	3.84%	2,050,893,827	-	(38,715,616)	-	272,694	2,012,450,905
21中财G5(ar)	09/12/2021	09/12/2026	按年支付	3,000,000,000	3.06%	3,004,246,228	-	45,522,740	-	144,216	3,049,913,184
22中财G1	08/03/2022	08/03/2025	按年支付	1,500,000,000	3.07%	-	1,500,000,000	14,480,602	-	28,302	1,514,508,904
22中财G2	08/03/2022	08/03/2027	按年支付	500,000,000	3.49%	-	500,000,000	5,488,511	-	9,434	505,497,945
合计						105,309,427,244	2,000,000,000	(29,517,067)	(3,000,000,000)	(15,752,940)	104,264,157,237

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 30、应付债券(续)

## (1) 公司债券:(续)

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/			2021年	
						1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	摊销及其他	12月31日余额	
16中金01(b)	18/07/2016	18/07/2021	按年支付	3,000,000,000	3.58%	2,923,108,092	-	(47,108,092)	(2,876,000,000)	-	-	-
16中金02(c)	18/07/2016	18/07/2023	按年支付	1,000,000,000	3.29%	1,015,052,877	-	(15,052,877)	(1,000,000,000)	-	-	-
16中金04(d)	27/10/2016	27/10/2023	按年支付	900,000,000	3.13%	905,093,753	-	(5,093,753)	(900,000,000)	-	-	-
17中金03(e)	08/05/2017	08/05/2022	按年支付	1,000,000,000	5.19%	1,039,819,840	-	5,070,214	-	(14,169,351)	1,030,720,703	-
18中金02	26/01/2018	26/01/2021	按年支付	1,000,000,000	5.70%	1,053,487,398	-	(37,421,339)	(1,000,000,000)	(16,066,059)	-	-
18中金04(f)	24/04/2018	24/04/2021	按年支付	1,000,000,000	4.94%	1,034,778,011	-	(21,214,544)	(1,000,000,000)	(13,563,467)	-	-
18中金06	28/06/2018	28/06/2021	按年支付	1,000,000,000	5.30%	1,026,731,144	-	(18,438,798)	(1,000,000,000)	(8,292,346)	-	-
19中金04(g)	21/11/2019	21/11/2025	按年支付	1,500,000,000	3.52%	1,505,930,959	-	-	-	-	1,505,930,959	-
20中金F1(h)	26/02/2020	26/02/2025	按年支付	4,000,000,000	3.20%	4,108,361,644	-	-	-	-	4,108,361,644	-
20中金G1(i)	03/04/2020	03/04/2026	按年支付	1,500,000,000	2.89%	1,532,304,658	-	-	-	-	1,532,304,658	-
20中金G2(j)	03/04/2020	03/04/2027	按年支付	1,000,000,000	3.25%	1,024,219,178	-	-	-	-	1,024,219,178	-
20中金G3(k)	06/05/2020	06/05/2026	按年支付	3,300,000,000	2.37%	3,351,211,479	-	-	-	-	3,351,211,479	-
20中金G4(l)	06/05/2020	06/05/2027	按年支付	700,000,000	2.88%	713,200,658	-	-	-	-	713,200,658	-
20中金F2(m)	28/05/2020	28/05/2025	按年支付	3,000,000,000	2.95%	3,052,615,069	-	-	-	-	3,052,615,069	-
20中金G5(n)	22/06/2020	22/06/2026	按年支付	1,500,000,000	3.10%	1,524,460,274	-	-	-	-	1,524,460,274	-
20中金F3(o)	24/07/2020	24/07/2025	按年支付	3,000,000,000	3.80%	3,049,972,603	-	-	-	-	3,049,972,603	-
20中金07(p)	10/09/2020	10/09/2025	按年支付	5,000,000,000	3.78%	5,057,476,712	-	-	-	-	5,057,476,712	-
20中金09(q)	23/09/2020	23/09/2025	按年支付	5,000,000,000	3.80%	5,051,013,699	-	-	-	-	5,051,013,699	-
20中金11(r)	19/10/2020	19/10/2023	按年支付	2,500,000,000	3.50%	2,517,500,000	-	-	-	-	2,517,500,000	-
20中金12(s)	19/10/2020	19/10/2025	按年支付	2,500,000,000	3.74%	2,518,700,000	-	-	-	-	2,518,700,000	-
20中金13(t)	28/10/2020	28/10/2023	按年支付	2,000,000,000	3.48%	2,012,203,836	-	-	-	-	2,012,203,836	-
20中金14(u)	28/10/2020	28/10/2025	按年支付	3,000,000,000	3.68%	3,019,357,808	-	-	-	-	3,019,357,808	-
20中金F4(v)	14/12/2020	14/12/2023	按年支付	2,500,000,000	3.85%	2,504,482,877	-	-	-	-	2,504,482,877	-
20中金F5(w)	14/12/2020	14/12/2025	按年支付	2,500,000,000	4.09%	2,504,762,329	-	-	-	-	2,504,762,329	-
21中金F1(x)	18/01/2021	18/01/2024	按年支付	2,500,000,000	3.55%	-	2,500,000,000	84,373,288	-	-	2,584,373,288	-
21中金F2(y)	18/01/2021	18/01/2026	按年支付	2,500,000,000	3.75%	-	2,500,000,000	89,126,712	-	-	2,589,126,712	-
21中金F3(z)	04/03/2021	04/03/2024	按年支付	1,500,000,000	3.60%	-	1,500,000,000	44,679,452	-	-	1,544,679,452	-
21中金F4(aa)	04/03/2021	04/03/2026	按年支付	2,000,000,000	3.82%	-	2,000,000,000	63,213,151	-	-	2,063,213,151	-
21中金G1(ab)	16/03/2021	16/03/2026	按年支付	2,000,000,000	3.58%	-	2,000,000,000	56,887,671	-	-	2,056,887,671	-

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 30、应付债券 (续)

#### (1) 公司债券: (续)

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/		2021年	
						1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	摊销及其他	12月31日余额
21中金G2	16/03/2021	16/03/2031	按年支付	2,000,000,000	4.10%	-	2,000,000,000	65,150,685	-	-	2,065,150,685
21中金G3(ac)	25/03/2021	25/03/2026	按年支付	1,500,000,000	3.51%	-	1,500,000,000	40,533,288	-	-	1,540,533,288
21中金G4	25/03/2021	25/03/2031	按年支付	2,500,000,000	4.07%	-	2,500,000,000	78,333,562	-	-	2,578,333,562
21中金F5(ad)	13/04/2021	13/04/2024	按年支付	1,000,000,000	3.43%	-	1,000,000,000	24,620,822	-	-	1,024,620,822
21中金F6(ae)	13/04/2021	13/04/2026	按年支付	3,500,000,000	3.70%	-	3,500,000,000	92,601,370	-	-	3,592,601,370
21中金G5(af)	16/08/2021	16/08/2026	按年支付	1,000,000,000	3.04%	-	1,000,000,000	11,410,411	-	-	1,011,410,411
21中金G6(ag)	16/08/2021	16/08/2028	按年支付	1,500,000,000	3.39%	-	1,500,000,000	19,086,164	-	-	1,519,086,164
21中金G7	08/12/2021	08/12/2024	按年支付	2,500,000,000	2.97%	-	2,500,000,000	4,678,767	-	-	2,504,678,767
21中金G8	08/12/2021	08/12/2031	按年支付	1,000,000,000	3.68%	-	1,000,000,000	2,318,904	-	-	1,002,318,904
17中投F2	18/07/2017	18/07/2022	按年支付	1,000,000,000	5.10%	1,023,334,247	-	(2,407)	-	2,407	1,023,334,247
18中投01	23/03/2018	23/03/2021	按年支付	1,000,000,000	5.95%	1,046,280,749	-	(46,345,867)	(1,000,000,000)	65,118	-
18中投03(ah)	21/09/2018	21/09/2021	按年支付	1,000,000,000	4.99%	1,013,896,731	-	(13,994,182)	(1,000,000,000)	97,451	-
19中投01	22/04/2019	22/04/2022	按年支付	2,000,000,000	4.22%	2,058,563,227	-	(3,981)	-	133,436	2,058,692,682
19中财01(ai)	16/10/2019	16/10/2024	按年支付	3,000,000,000	3.58%	3,020,477,755	-	(948,462)	-	939,284	3,020,468,577
20中财G1(aj)	16/01/2020	16/01/2025	按年支付	2,000,000,000	3.44%	2,065,594,368	-	(1,897,763)	-	793,230	2,064,489,835
20中财F1(ak)	09/04/2020	09/04/2025	按年支付	3,000,000,000	3.17%	3,069,566,301	-	(2,834,675)	-	933,991	3,067,665,617
20中财F2	28/07/2020	28/07/2023	按年支付	2,000,000,000	3.80%	2,032,690,411	-	(1,890,377)	-	876,051	2,031,676,085
20中财G2(al)	21/10/2020	21/10/2025	按年支付	2,000,000,000	3.77%	2,014,873,425	-	(1,647,802)	-	369,446	2,013,595,069
20中财G3	21/10/2020	21/10/2025	按年支付	1,000,000,000	4.20%	1,008,284,932	-	(824,057)	-	183,369	1,007,644,244
20中财G5(am)	24/11/2020	24/11/2025	按年支付	1,000,000,000	3.98%	1,004,143,562	-	(756,594)	-	155,831	1,003,542,799
20中财G6(an)	15/12/2020	15/12/2025	按年支付	1,000,000,000	3.85%	1,001,793,151	-	(756,533)	-	147,969	1,001,184,587
21中财G1(ao)	26/03/2021	26/03/2024	按年支付	2,000,000,000	3.44%	-	2,000,000,000	50,004,311	-	759,312	2,050,763,623
21中财G2(ap)	26/03/2021	26/03/2026	按年支付	3,000,000,000	3.65%	-	3,000,000,000	82,686,792	-	278,146	3,082,964,938
21中财G3(aq)	22/04/2021	22/04/2026	按年支付	3,000,000,000	3.55%	-	3,000,000,000	72,499,121	-	257,032	3,072,756,153
21中财G4	22/04/2021	22/04/2026	按年支付	2,000,000,000	3.84%	-	2,000,000,000	50,482,119	-	411,708	2,050,893,827
21中财G5(ar)	09/12/2021	09/12/2026	按年支付	3,000,000,000	3.06%	-	3,000,000,000	4,171,450	-	74,778	3,004,246,228
合计						74,405,343,757	40,000,000,000	725,696,151	(9,776,000,000)	(45,612,664)	105,309,427,244



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 30、应付债券(续)

#### (1) 公司债券:(续)

- (a) 本集团发行的公司债券面值为每张人民币100元。
- (b) 本公司已于2021年7月19日兑付该公司债券。
- (c) 本公司可选择于2021年7月18日赎回该公司债券。若本公司未行使赎回选择权,本公司可选择上调利率,投资者亦享有回售选择权。本公司已于2021年7月19日赎回该公司债券。
- (d) 本公司可选择于2021年10月27日赎回该公司债券。若本公司未行使赎回选择权,本公司可选择上调利率,投资者亦享有回售选择权。本公司已于2021年10月27日赎回该公司债券。
- (e) 本公司已于2022年5月9日兑付该公司债券。
- (f) 本公司已于2021年4月26日兑付该公司债券。
- (g) 本公司可选择于2022年11月21日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (h) 本公司可选择于2023年2月26日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (i) 本公司可选择于2023年4月3日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (j) 本公司可选择于2025年4月3日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (k) 本公司可选择于2023年5月6日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (l) 本公司可选择于2025年5月6日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (m) 本公司可选择于2023年5月28日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (n) 本公司可选择于2023年6月22日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (o) 本公司可选择于2023年7月24日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (p) 本公司可选择于2023年9月10日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (q) 本公司可选择于2023年9月23日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (r) 本公司可选择于2022年10月19日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (s) 本公司可选择于2023年10月19日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (t) 本公司可选择于2022年10月28日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (u) 本公司可选择于2023年10月28日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 30、应付债券(续)

#### (1) 公司债券:(续)

- (v) 本公司可选择于2022年12月14日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (w) 本公司可选择于2023年12月14日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (x) 本公司可选择于2023年1月18日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (y) 本公司可选择于2024年1月18日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (z) 本公司可选择于2023年3月4日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (aa) 本公司可选择于2024年3月4日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ab) 本公司可选择于2024年3月16日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ac) 本公司可选择于2024年3月25日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ad) 本公司可选择于2023年4月13日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ae) 本公司可选择于2024年4月13日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (af) 本公司可选择于2024年8月16日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ag) 本公司可选择于2026年8月16日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ah) 中金财富已于2021年9月22日兑付该公司债券。
- (ai) 中金财富可选择于2022年10月16日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (aj) 中金财富可选择于2023年1月16日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ak) 中金财富可选择于2023年4月9日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (al) 中金财富可选择于2023年10月21日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (am) 中金财富可选择于2023年11月24日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (an) 中金财富可选择于2023年12月15日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ao) 中金财富可选择于2023年3月26日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ap) 中金财富可选择于2024年3月26日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (aq) 中金财富可选择于2024年4月22日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。
- (ar) 中金财富可选择于2024年12月9日调整票面利率,投资者亦享有回售选择权。

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 30、应付债券(续)

## (2) 中期票据:

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2022年	利息计提/		汇率变动	2022年	
						1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	及其他	6月30日余额
中期票据	03/05/2019	03/05/2022	按季支付	7.00亿美元	3个月	4,469,976,363	-	(9,450,866)	(4,597,040,000)	136,514,503	-
					LIBOR+1.175%						
中期票据	03/05/2019	03/05/2022	按半年支付	3.00亿美元	3.375%	1,921,749,977	-	(10,221,044)	(1,970,160,000)	58,631,067	-
中期票据	18/02/2020	18/02/2023	按季支付	10.00亿美元	3个月	6,376,848,366	-	11,123,365	-	339,022,122	6,726,993,853
					LIBOR+0.90%						
中期票据	10/08/2020	10/08/2023	按半年支付	5.00亿美元	1.75%	3,200,440,688	-	677,418	-	170,427,608	3,371,545,714
中期票据	26/01/2021	26/01/2024	按半年支付	10.00亿美元	1.625%	6,406,973,741	-	2,633,302	-	338,277,459	6,747,884,502
中期票据	26/01/2021	26/01/2026	按半年支付	5.00亿美元	2.00%	3,207,035,677	-	1,445,375	-	168,438,428	3,376,919,480
中期票据	21/03/2022	21/03/2025	按半年支付	6.00亿美元	2.875%	-	3,820,620,000	32,813,377	-	177,647,031	4,031,080,408
合计						25,583,024,812	3,820,620,000	29,020,927	(6,567,200,000)	1,388,958,218	24,254,423,957

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 30、应付债券(续)

#### (2) 中期票据:(续)

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/		汇率变动		2021年
						1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	及其他	12月31日余额	
中期票据(c)	25/04/2018	25/04/2021	按季支付	6.00亿美元	3个月 LIBOR+1.20%	3,923,367,904	-	(10,263,951)	(3,894,780,000)	(18,323,953)	-	-
中期票据(d)	11/09/2018	11/09/2021	按季支付	4.00亿美元	3个月 LIBOR+1.20%	2,609,690,057	-	(2,024,642)	(2,579,880,000)	(27,785,415)	-	-
中期票据	03/05/2019	03/05/2022	按季支付	7.00亿美元	3个月 LIBOR+1.175%	4,569,141,336	-	(636,040)	-	(98,528,933)	4,469,976,363	
中期票据	03/05/2019	03/05/2022	按半年支付	3.00亿美元	3.375%	1,963,183,847	-	(239,186)	-	(41,194,684)	1,921,749,977	
中期票据	18/02/2020	18/02/2023	按季支付	10.00亿美元	3个月 LIBOR+0.90%	6,519,649,063	-	(509,910)	-	(142,290,787)	6,376,848,366	
中期票据	10/08/2020	10/08/2023	按半年支付	5.00亿美元	1.75%	3,269,428,314	-	(201,391)	-	(68,786,235)	3,200,440,688	
中期票据	26/01/2021	26/01/2024	按半年支付	10.00亿美元	1.625%	-	6,484,700,000	44,347,244	-	(122,073,503)	6,406,973,741	
中期票据	26/01/2021	26/01/2026	按半年支付	5.00亿美元	2.00%	-	3,242,350,000	27,450,931	-	(62,765,254)	3,207,035,677	
合计						22,854,460,521	9,727,050,000	57,923,055	(6,474,660,000)	(581,748,764)	25,583,024,812	

- (a) 本集团发行的中期票据面值为每张1,000美元。
- (b) 浮动利率中期票据实际到期日为上表中到期日期或离该日期最近的付息日。
- (c) 本集团已于2021年4月26日兑付该中期票据。
- (d) 本集团已于2021年9月13日兑付该中期票据。

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 30、应付债券(续)

## (3) 次级债券:

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2022年		利息计提/		2022年	
						1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	摊销及其他	6月30日余额
17中金C1(c)	22/05/2017	22/05/2022	按年支付	600,000,000	5.39%	618,319,699	-	(6,742,553)	(600,000,000)	(11,577,146)	-
17中金C2	24/07/2017	24/07/2022	按年支付	1,500,000,000	4.98%	1,528,932,820	-	39,495,019	-	1,449,883	1,569,877,722
17中金C3	16/11/2017	16/11/2022	按年支付	1,500,000,000	5.50%	1,496,418,005	-	48,059,275	-	2,706,294	1,547,183,574
18中金C1	20/04/2018	20/04/2023	按年支付	1,000,000,000	5.30%	1,044,136,555	-	(27,604,467)	-	(10,739,863)	1,005,792,225
19中金C1	19/04/2019	19/04/2022	按年支付	1,500,000,000	4.20%	1,544,358,904	-	(44,358,904)	(1,500,000,000)	-	-
19中金C3	14/10/2019	14/10/2024	按年支付	1,500,000,000	4.09%	1,513,110,411	-	30,422,877	-	-	1,543,533,288
19中金C4	11/11/2019	11/11/2024	按年支付	1,500,000,000	4.12%	1,508,465,753	-	30,646,028	-	-	1,539,111,781
19中金C5	05/12/2019	05/12/2024	按年支付	2,000,000,000	4.20%	2,005,983,562	-	41,654,794	-	-	2,047,638,356
20中金C1	17/02/2020	17/02/2025	按年支付	1,500,000,000	3.85%	1,550,155,479	-	(29,112,328)	-	-	1,521,043,151
21中金C1	08/02/2021	08/02/2024	按年支付	1,000,000,000	3.90%	1,042,432,613	-	(21,047,694)	-	(2,307,967)	1,019,076,952
21中金C2	08/02/2021	08/02/2026	按年支付	1,000,000,000	4.49%	1,053,681,347	-	(24,067,116)	-	(3,445,054)	1,026,169,177
17中投02	23/02/2017	23/02/2022	按年支付	1,800,000,000	5.00%	1,876,820,331	-	(77,020,658)	(1,800,000,000)	200,327	-
19中投C1	25/04/2019	25/04/2022	按年支付	3,000,000,000	4.50%	3,092,460,087	-	(92,835,616)	(3,000,000,000)	375,529	-
20中财C1	17/04/2020	17/04/2025	按年支付	2,000,000,000	3.80%	2,052,390,656	-	(38,312,329)	-	219,619	2,014,297,946
21中财C1	09/03/2021	09/03/2024	按年支付	1,000,000,000	3.98%	1,031,726,681	-	(20,065,439)	-	170,340	1,011,831,582
21中财C2	09/03/2021	09/03/2026	按年支付	1,000,000,000	4.58%	1,036,508,737	-	(23,090,380)	-	98,302	1,013,516,659
21中财C3	09/04/2021	09/04/2024	按年支付	2,000,000,000	3.94%	2,056,846,818	-	(39,723,836)	-	167,946	2,017,290,928
21中财C4	09/04/2021	09/04/2026	按年支付	1,000,000,000	4.50%	1,032,467,754	-	(22,684,932)	-	47,955	1,009,830,777
22中财C1	24/03/2022	24/03/2025	按年支付	1,500,000,000	3.50%	-	1,500,000,000	14,239,726	-	-	1,514,239,726
22中财C2	24/03/2022	24/03/2027	按年支付	500,000,000	3.89%	-	500,000,000	5,275,479	-	-	505,275,479
合计						27,085,216,212	2,000,000,000	(256,873,054)	(6,900,000,000)	(22,633,835)	21,905,709,323



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 30、应付债券(续)

#### (3) 次级债券:(续)

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/		2021年	
						1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	摊销及其他	12月31日余额
16中金C2	15/12/2016	15/12/2021	按年支付	3,400,000,000	4.60%	3,406,855,890	-	(6,855,890)	(3,400,000,000)	-	-
16中金期(b)	16/12/2016	16/12/2024	按年支付	100,000,000	1-5年5.00% 6-8年8.00%	100,219,178	-	(219,178)	(100,000,000)	-	-
17中金C1(c)	22/05/2017	22/05/2022	按年支付	600,000,000	5.39%	624,072,690	-	1,721,543	-	(7,474,534)	618,319,699
17中金C2	24/07/2017	24/07/2022	按年支付	1,500,000,000	4.98%	1,541,393,843	-	632,098	-	(13,093,121)	1,528,932,820
17中金C3	16/11/2017	16/11/2022	按年支付	1,500,000,000	5.50%	1,514,165,601	-	(2,327,379)	-	(15,420,217)	1,496,418,005
18中金C1	20/04/2018	20/04/2023	按年支付	1,000,000,000	5.30%	1,051,682,141	-	(3,478,752)	-	(4,066,834)	1,044,136,555
18中金C2(d)	29/08/2018	29/08/2021	按年支付	1,500,000,000	4.70%	1,522,573,405	-	(13,883,743)	(1,500,000,000)	(8,689,662)	-
19中金C1	19/04/2019	19/04/2022	按年支付	1,500,000,000	4.20%	1,544,358,904	-	-	-	-	1,544,358,904
19中金C3	14/10/2019	14/10/2024	按年支付	1,500,000,000	4.09%	1,513,110,411	-	-	-	-	1,513,110,411
19中金C4	11/11/2019	11/11/2024	按年支付	1,500,000,000	4.12%	1,508,465,753	-	-	-	-	1,508,465,753
19中金C5	05/12/2019	05/12/2024	按年支付	2,000,000,000	4.20%	2,005,983,562	-	-	-	-	2,005,983,562
20中金C1	17/02/2020	17/02/2025	按年支付	1,500,000,000	3.85%	1,550,155,479	-	-	-	-	1,550,155,479
21中金C1	08/02/2021	08/02/2024	按年支付	1,000,000,000	3.90%	-	1,000,000,000	33,609,951	-	8,822,662	1,042,432,613
21中金C2	08/02/2021	08/02/2026	按年支付	1,000,000,000	4.49%	-	1,000,000,000	39,005,787	-	14,675,560	1,053,681,347
17中投02	23/02/2017	23/02/2022	按年支付	1,800,000,000	5.00%	1,876,112,521	-	(39,952)	-	747,762	1,876,820,331
19中投C1	25/04/2019	25/04/2022	按年支付	3,000,000,000	4.50%	3,091,333,871	-	(6,367)	-	1,132,583	3,092,460,087
20中财C1	17/04/2020	17/04/2025	按年支付	2,000,000,000	3.80%	2,051,965,880	-	(3,585)	-	428,361	2,052,390,656
21中财C1	09/03/2021	09/03/2024	按年支付	1,000,000,000	3.98%	-	1,000,000,000	31,437,643	-	289,038	1,031,726,681
21中财C2	09/03/2021	09/03/2026	按年支付	1,000,000,000	4.58%	-	1,000,000,000	36,336,272	-	172,465	1,036,508,737
21中财C3	09/04/2021	09/04/2024	按年支付	2,000,000,000	3.94%	-	2,000,000,000	56,567,267	-	279,551	2,056,846,818
21中财C4	09/04/2021	09/04/2026	按年支付	1,000,000,000	4.50%	-	1,000,000,000	32,380,072	-	87,682	1,032,467,754
合计						24,902,449,129	7,000,000,000	204,875,787	(5,000,000,000)	(22,108,704)	27,085,216,212

(a) 本集团发行的次级债券面值为每张人民币100元。

(b) 中金期货已于2021年12月16日赎回该次级债券。

(c) 本公司已于2022年5月23日兑付该次级债券。

(d) 本公司已于2021年8月30日兑付该次级债券。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 30、应付债券(续)

#### (4) 金融债券:

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2022年		利息计提/		2022年	
						1月1日余额	本期发行	支付净额	本期兑付	6月30日余额	
19中金公司金融债01	22/08/2019	22/08/2022	按年支付	2,500,000,000	3.39%	2,530,881,507	-	42,026,712	-	-	2,572,908,219

债券名称	起息日期	到期日期	付息方式	发行金额	票面利率	2021年		利息计提/		2021年	
						1月1日余额	本年发行	支付净额	本年兑付	12月31日余额	
19中金公司金融债01	22/08/2019	22/08/2022	按年支付	2,500,000,000	3.39%	2,530,881,507	-	-	-	-	2,530,881,507

(a) 本集团发行的金融债券面值为每张人民币100元。

### 31、其他负债

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
应付纳入合并范围的结构化主体的其他持有人的款项(注1)	3,076,329,697	3,043,550,185
应付股利(注2)	1,974,777,060	218,147,434
预提费用	1,228,021,438	966,024,464
其他应付款	728,834,638	945,206,253
递延收益	146,982,000	146,982,000
长期借款	10,200,000	10,200,000
小计	7,165,144,833	5,330,110,336
加: 计提利息	25,485,934	50,115,555
合计	7,190,630,767	5,380,225,891

注1: 于每个报告期间, 新增满足合并条件的结构化主体、原合并范围内结构化主体的清算或本集团在其中持有权益的变化等事项会导致合并范围的变更。

注2: 截至2022年6月30日, 应付股利包括应付普通股股东现金股利人民币1,448,177,060元及应付永续次级债券持有人利息人民币526,600,000元(2021年12月31日: 人民币154,200,000元)。截至2021年12月31日, 应付股利包括应付少数股东股利人民币63,947,434元。经2022年6月23日股东大会审议通过, 本公司采用现金分红的方式对2021年度利润派发现金股利, 宣告派发现金股利总额为人民币1,448,177,060元(即每10股派发现金股利人民币3.00元(含税))。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 32、股本

	2022年 1月1日	发行新股	送股	公积金转股	其他	2022年 6月30日
有限售条件股份						
A股						
其中：国家股	1,936,155,680	-	-	-	-	1,936,155,680
国有法人股	2,734,800	-	-	-	-	2,734,800
其他内资股	429,454,757	-	-	-	(398,500,000)	30,954,757
外资股	24,075,922	-	-	-	-	24,075,922
有限售条件股份合计	2,392,421,159	-	-	-	(398,500,000)	1,993,921,159
无限售条件股份						
A股	531,121,281	-	-	-	398,500,000	929,621,281
H股	1,903,714,428	-	-	-	-	1,903,714,428
无限售条件股份合计	2,434,835,709	-	-	-	398,500,000	2,833,335,709
股份合计	4,827,256,868	-	-	-	-	4,827,256,868

本公司发行股份产生的溢价(扣除满足资本化条件的发行成本)计入资本公积。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 33、其他权益工具

#### (1) 发行在外的永续次级债券

发行在外的金融工具	起息日期	会计分类	股利率		发行价格	数量	金额	到期日或 续期情况	转股 条件	转换 情况
			或利息率							
20中金Y1	28/08/2020	权益工具	注		100	50,000,000	5,000,000,000	重置周期 为5年	不适用	无
21中金Y1	29/01/2021	权益工具	注		100	15,000,000	1,500,000,000	重置周期 为5年	不适用	无
21中金Y2	26/04/2021	权益工具	注		100	20,000,000	2,000,000,000	重置周期 为5年	不适用	无
22中金Y1	13/01/2022	权益工具	注		100	39,000,000	3,900,000,000	重置周期 为5年	不适用	无

注：上述永续次级债券的相关发行条款列示如下：

- 本期债券采用固定利率计息；
- 本期债券前5个计息年度的票面利率将通过簿记建档方式确定，在前5个计息年度内保持不变。自第6个计息年度起，每5年重置一次票面利率；
- 附设发行人递延支付利息权，除非发生强制付息事件，每个付息日，发行人可自行选择将当期利息以及按照递延支付利息条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制；前述利息递延不属于发行人未能按照约定足额支付利息的行为。强制付息事件仅限于发行人向普通股股东分红和减少注册资本的情形。

对于上述本公司发行的永续次级债券，本公司并无交付现金或其他金融工具结算的合同义务，同时该永续次级债券的赎回亦由本公司控制。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 33、其他权益工具 (续)

#### (2) 变动情况表

发行在外的金融工具	2022年1月1日		本期增加		本期减少		2022年6月30日	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
20中金Y1	50,000,000	5,000,000,000	-	-	-	-	50,000,000	5,000,000,000
21中金Y1	15,000,000	1,500,000,000	-	-	-	-	15,000,000	1,500,000,000
21中金Y2	20,000,000	2,000,000,000	-	-	-	-	20,000,000	2,000,000,000
22中金Y1	-	-	39,000,000	3,900,000,000	-	-	39,000,000	3,900,000,000
合计	85,000,000	8,500,000,000	39,000,000	3,900,000,000	-	-	124,000,000	12,400,000,000

发行在外的金融工具	2021年1月1日		本年增加		本年减少		2021年12月31日	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
20中金Y1	50,000,000	5,000,000,000	-	-	-	-	50,000,000	5,000,000,000
21中金Y1	-	-	15,000,000	1,500,000,000	-	-	15,000,000	1,500,000,000
21中金Y2	-	-	20,000,000	2,000,000,000	-	-	20,000,000	2,000,000,000
合计	50,000,000	5,000,000,000	35,000,000	3,500,000,000	-	-	85,000,000	8,500,000,000



## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

## 34、资本公积

	2022年1月1日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
股本溢价(注)	39,458,384,639	-	-	39,458,384,639
其他	73,501,886	-	-	73,501,886
合计	39,531,886,525	-	-	39,531,886,525

	2021年1月1日	本年增加	本年减少	2021年12月31日
股本溢价(注)	39,458,384,639	-	-	39,458,384,639
其他	74,888,340	-	(1,386,454)	73,501,886
合计	39,533,272,979	-	(1,386,454)	39,531,886,525

注：本公司发行股份(参见附注七、32)形成的溢价(扣除满足资本化条件的发行成本)计入股本溢价。

## 35、其他综合收益

	2022年		截至2022年6月30日止6个月期间				2022年	
	1月1日		归属于		归属于		6月30日	
	母公司股东		减：前期计入		母公司股东		归属于	
的其他综合	所得税前	减：	其他综合收益	税后归属于	税后归属于	的其他综合		
收益余额	发生额	所得税费用	当期转入损益	合计	母公司股东	少数股东	收益余额	
将重分类进损益的其他综合收益								
其中：								
其他债权投资公允价值变动	115,328,916	(213,373,682)	57,045,416	(109,299,789)	(265,628,055)	(265,628,055)	-	(150,299,139)
其他债权投资信用减值准备	14,417,506	70,603,522	(12,082,757)	-	58,520,765	58,520,765	-	72,938,271
外币财务报表折算差额	(955,513,381)	787,724,987	-	-	787,724,987	787,724,987	-	(167,788,394)
其他	(2,674,098)	3,422,720	-	-	3,422,720	3,422,720	-	748,622
合计	(828,441,057)	648,377,547	44,962,659	(109,299,789)	584,040,417	584,040,417	-	(244,400,640)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 35、其他综合收益(续)

	2021年		2021年度				2021年	
	1月1日						12月31日	
归属于	归属于		减:前期计入				归属于	
母公司股东	母公司股东		母公司股东				母公司股东	
的其他综合	所得税前	减:	其他综合收益	税后归属于	税后归属于	的其他综合		
收益余额	发生额	所得税费用	当期转入损益	母公司股东	少数股东	收益余额		
将重分类进损益的其他综合收益								
其中:								
其他债权投资公允价值变动	23,693,618	194,218,652	(41,840,498)	(60,742,856)	91,635,298	91,635,298	-	115,328,916
其他债权投资信用减值准备	14,233,798	608,115	(424,407)	-	183,708	183,708	-	14,417,506
外币财务报表折算差额	(632,330,268)	(323,183,113)	-	-	(323,183,113)	(323,183,113)	-	(955,513,381)
其他	-	(2,674,098)	-	-	(2,674,098)	(2,674,098)	-	(2,674,098)
合计	(594,402,852)	(131,030,444)	(42,264,905)	(60,742,856)	(234,038,205)	(234,038,205)	-	(828,441,057)

### 36、盈余公积

	截至2022年	2021年度
	6月30日止	
	6个月期间	
期/年初余额	1,392,448,797	995,576,479
本期/年增加	-	396,872,318
期/年末余额	1,392,448,797	1,392,448,797

于资产负债表日的盈余公积全部为法定公积金。本公司根据《中华人民共和国公司法》和证监会制定的《证券公司年报监管工作指引》的规定,按当年税后利润的10%提取法定公积金。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 37、一般风险准备

	截至2022年6月30日止6个月期间			期末余额
	期初余额	本期增加	本期减少	
一般风险准备	2,998,759,328	150,714,848	-	3,149,474,176
交易风险准备	2,471,301,847	-	-	2,471,301,847
合计	5,470,061,175	150,714,848	-	5,620,776,023

	2021年度			年末余额
	年初余额	本年增加	本年减少	
一般风险准备	2,209,125,226	789,634,102	-	2,998,759,328
交易风险准备	1,865,186,146	606,115,701	-	2,471,301,847
合计	4,074,311,372	1,395,749,803	-	5,470,061,175

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 38、手续费及佣金净收入

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
证券经纪业务净收入	2,517,923,572	2,745,551,705
证券经纪业务收入	3,403,011,314	3,566,397,288
其中: 代理买卖证券业务	2,206,292,247	2,432,684,840
交易单元席位租赁	588,926,694	535,078,553
代销金融产品业务(1)	607,792,373	598,633,895
证券经纪业务支出	(885,087,742)	(820,845,583)
其中: 代理买卖证券业务	(885,087,742)	(820,845,583)
期货经纪业务净收入	64,354,448	52,600,588
期货经纪业务收入	146,262,004	144,952,074
期货经纪业务支出	(81,907,556)	(92,351,486)
投资银行业务净收入	2,681,017,822	2,694,005,205
投资银行业务收入	2,841,457,690	2,780,766,031
其中: 证券承销业务	2,211,756,827	2,192,131,376
证券保荐业务	177,869,811	111,652,597
财务顾问业务(2)	451,831,052	476,982,058
投资银行业务支出	(160,439,868)	(86,760,826)
其中: 证券承销业务	(160,439,868)	(86,760,826)
资产管理业务净收入(3)	705,155,995	628,093,309
资产管理业务收入	723,531,046	656,012,873
资产管理业务支出	(18,375,051)	(27,919,564)
基金管理业务净收入	740,361,027	723,382,199
基金管理业务收入	832,967,620	800,971,804
基金管理业务支出	(92,606,593)	(77,589,605)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 38、手续费及佣金净收入(续)

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
投资咨询业务净收入	316,085,489	318,258,051
投资咨询业务收入	316,204,856	318,258,051
投资咨询业务支出	(119,367)	-
其他手续费及佣金净收入	72,667,595	29,694,066
托管及其他综合服务收入	72,667,595	29,694,066
合计	7,097,565,948	7,191,585,123
其中: 手续费及佣金收入合计	8,336,102,125	8,297,052,187
手续费及佣金支出合计	(1,238,536,177)	(1,105,467,064)

#### (1) 代销金融产品业务收入

	截至2022年6月30日止6个月期间		截至2021年6月30日止6个月期间	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	116,446,088,057	390,504,920	71,288,225,005	334,916,360
其他	35,639,361,648	217,287,453	54,535,524,208	263,717,535
合计	152,085,449,705	607,792,373	125,823,749,213	598,633,895

#### (2) 财务顾问业务净收入

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
并购重组财务顾问业务净收入		
境内上市公司	57,559,913	43,858,899
其他	182,243,191	190,620,613
其他财务顾问业务净收入	212,027,948	242,502,546
合计	451,831,052	476,982,058



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 38、手续费及佣金净收入 (续)

#### (3) 资产管理业务

本集团的受托客户资产管理业务资金独立建账、独立核算, 相关资产、负债、净资产、收入和费用等均按照企业会计准则的规定进行确认、计量和报告, 以下为本集团全部受托资产管理业务的汇总信息:

	截至2022年6月30日止6个月期间			合计
	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	294	2,918	118	3,330
期末客户数量	86,805	2,904	1,844	91,553
其中: 个人客户	84,440	1,794	-	86,234
机构客户	2,365	1,110	1,844	5,319
期初受托资金	534,278,519,506	479,715,929,350	167,871,134,807	1,181,865,583,663
其中: 自有资金投入	558,728,734	9,760,094	2,672,920,070	3,241,408,898
个人客户	17,520,515,257	25,203,393,387	-	42,723,908,644
机构客户	516,199,275,515	454,502,775,869	165,198,214,737	1,135,900,266,121
期末受托资金	299,260,581,246	450,313,393,860	159,492,228,480	909,066,203,586
其中: 自有资金投入	595,626,126	294,698,706	2,079,447,984	2,969,772,816
个人客户	29,401,854,076	27,567,341,968	-	56,969,196,044
机构客户	269,263,101,044	422,451,353,186	157,412,780,496	849,127,234,726
期末主要受托资产				
初始成本	342,900,334,351	550,736,712,548	158,819,735,860	1,052,456,782,759
其中: 股票	17,058,402,495	39,509,918,034	-	56,568,320,529
债券	279,182,428,824	300,841,920,791	-	580,024,349,615
基金	20,304,763,655	54,879,910,772	163,126,789	75,347,801,216
其他	26,354,739,377	155,504,962,951	158,656,609,071	340,516,311,399
本期资产管理业务净收入	178,156,020	479,739,316	47,260,659	705,155,995

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 38、手续费及佣金净收入(续)

#### (3) 资产管理业务(续)

	截至2021年6月30日止6个月期间			合计
	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	205	1,924	145	2,274
期末客户数量	49,190	1,908	1,805	52,903
其中:个人客户	47,188	1,117	-	48,305
机构客户	2,002	791	1,805	4,598
期初受托资金	153,797,319,371	298,507,984,937	205,910,460,360	658,215,764,668
其中:自有资金投入	96,920,997	70,000,000	3,207,818,000	3,374,738,997
个人客户	10,255,425,411	11,715,127,205	-	21,970,552,616
机构客户	143,444,972,963	286,722,857,732	202,702,642,360	632,870,473,055
期末受托资金	423,550,977,053	436,901,317,691	181,195,808,120	1,041,648,102,864
其中:自有资金投入	93,328,712	87,479,638	1,849,505,276	2,030,313,626
个人客户	9,419,044,457	17,122,680,273	-	26,541,724,730
机构客户	414,038,603,884	419,691,157,780	179,346,302,844	1,013,076,064,508
期末主要受托资产				
初始成本	457,451,896,143	526,203,726,513	180,514,223,356	1,164,169,846,012
其中:股票	74,695,227,340	43,917,577,969	-	118,612,805,309
债券	224,115,726,176	175,214,527,350	-	399,330,253,526
基金	13,926,873,783	28,175,711,035	958,910,758	43,061,495,576
其他	144,714,068,844	278,895,910,159	179,555,312,598	603,165,291,601
本期资产管理业务净收入	110,149,009	489,622,250	28,322,050	628,093,309

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释 (续)

### 39、利息净支出

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
利息收入		
存放金融同业利息收入	1,344,333,656	979,587,282
其中: 自有资金存款利息收入	631,182,513	400,248,854
客户资金存款利息收入	713,151,143	579,338,428
融资融券利息收入	1,327,423,328	1,343,409,905
其他债权投资利息收入	647,589,578	595,687,051
买入返售金融资产利息收入	497,236,664	464,117,796
其中: 股票质押式回购利息收入	200,672,791	277,696,816
约定购回利息收入	-	1,036
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	103,759,671	49,120,961
小计	3,920,342,897	3,431,922,995
利息支出		
客户资金存款利息支出	(165,060,155)	(135,186,037)
卖出回购金融资产款利息支出	(418,646,821)	(373,709,395)
其中: 报价回购利息支出	(34,531,678)	(6,387,672)
拆入资金利息支出	(602,243,847)	(441,409,092)
其中: 转融通融入资金利息支出	(136,476,975)	(127,030,879)
短期融资券利息支出	(3,912,329)	-
收益凭证利息支出	(157,792,668)	(231,447,121)
中期票据利息支出	(256,486,565)	(254,728,421)
公司债券利息支出	(1,909,810,605)	(1,616,351,055)
次级债券利息支出	(533,100,956)	(629,972,895)
结构性票据利息支出	(6,538,367)	(38,776,688)
金融债券利息支出	(42,026,712)	(42,026,712)
租赁负债利息支出	(37,041,409)	(27,376,647)
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	(159,046,055)	(152,011,819)
小计	(4,291,706,489)	(3,942,995,882)
利息净支出	(371,363,592)	(511,072,887)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 40、投资损失

	注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年	2021年
权益法核算的长期股权投资收益		15,961,558	33,963,901
处置长期股权投资产生的投资收益		-	253,209
金融工具投资损失		(1,156,490,014)	(2,959,279,911)
其中:持有期间取得的收益		2,436,357,938	2,281,682,382
— 交易性金融工具	(1)	2,352,070,853	2,218,435,041
— 衍生金融工具		84,287,085	63,247,341
处置金融工具取得的损失		(3,592,847,952)	(5,240,962,293)
— 交易性金融工具	(1)	(7,151,389,451)	8,657,942,310
— 衍生金融工具		3,449,241,710	(13,927,444,825)
— 其他债权投资		109,299,789	28,540,222
合计		(1,140,528,456)	(2,925,062,801)

#### (1) 交易性金融工具投资收益/(损失)明细表:

交易性金融工具		截至6月30日止6个月期间	
		2022年	2021年
分类为以公允价值计量且其变动	持有期间收益	2,382,018,022	2,254,061,937
计入当期损益的金融资产	处置取得(损失)/收益	(10,585,796,227)	13,159,351,985
分类为以公允价值计量且其变动	持有期间损失	(25,163,365)	(31,619,362)
计入当期损益的金融负债	处置取得收益/(损失)	136,385,666	(107,835,795)
指定为以公允价值计量且其变动	持有期间损失	(4,783,804)	(4,007,534)
计入当期损益的金融负债	处置取得收益/(损失)	3,298,021,110	(4,393,573,880)
	持有期间收益小计	2,352,070,853	2,218,435,041
	处置取得(损失)/收益小计	(7,151,389,451)	8,657,942,310

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 41、其他收益

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
与收益相关的政府补助	119,726,176	82,092,695

### 42、公允价值变动收益

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
交易性金融资产	(4,281,096,376)	1,789,488,913
衍生金融工具	8,862,738,147	5,471,947,017
交易性金融负债	1,619,391,499	3,861,064,891
其中:指定为以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	1,512,491,624	3,841,891,350
合计	6,201,033,270	11,122,500,821

### 43、其他业务收入

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
服务费	118,464	1,367,123
其他	7,069,030	8,612,917
合计	7,187,494	9,980,040



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 44、税金及附加

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
城市维护建设税	35,047,344	32,923,109
教育费附加	15,023,161	14,101,372
地方教育附加及其他	15,864,154	12,412,745
合计	65,934,659	59,437,226

### 45、业务及管理费

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
员工成本	5,499,796,540	6,560,611,199
折旧及摊销费	759,501,970	540,395,348
业务拓展费	466,255,841	392,283,859
信息系统相关费用	341,165,937	263,973,101
专业服务费	131,174,768	87,708,531
差旅费	90,591,781	150,686,187
租赁费	64,989,448	28,208,302
证券及期货投资者保护基金	48,781,533	48,645,180
公共设施及维护费	47,764,081	38,480,768
其他	145,868,401	188,266,919
合计	7,595,890,300	8,299,259,394

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 46、信用减值转回

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
应收款项及其他资产信用减值(转回)/损失	(115,584,437)	39,708,909
融出资金信用减值(转回)/损失	(15,786,643)	10,623,450
买入返售金融资产信用减值转回	(7,168,542)	(72,721,631)
其他债权投资信用减值损失/(转回)	70,277,638	(7,001,160)
货币资金信用减值转回	(5,516)	(112,421)
合计	(68,267,500)	(29,502,853)

### 47、营业外支出

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
捐赠支出	12,350,000	9,257,760
非流动资产报废损失	2,579,020	2,231,931
其他	8,705,093	4,610,376
合计	23,634,113	16,100,067

### 48、所得税费用

#### (1) 本期所得税费用:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
本期所得税	607,535,592	744,562,358
递延所得税	61,337,545	358,580,556
合计	668,873,137	1,103,142,914

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 48、所得税费用(续)

#### (2) 所得税费用与会计利润的关系:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
税前利润	4,518,407,548	6,119,070,490
适用所得税税率	25%	25%
按适用所得税税率计算的预期所得税	1,129,601,887	1,529,767,623
不可作纳税抵扣的支出的影响	14,671,167	17,689,003
免税收入的影响	(248,181,478)	(221,598,682)
子公司适用税率差异的影响	(119,919,746)	(298,310,179)
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异的影响	40,111,451	38,590,919
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异的影响	(7,762,433)	(4,987,742)
其他	(139,647,711)	41,991,972
所得税费用	668,873,137	1,103,142,914

本集团于2022年6月30日未确认递延所得税资产的累积可抵扣暂时性差异为人民币18.97亿元(2021年12月31日:人民币15.33亿元),主要为本集团海外子公司的税务亏损。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 49、基本每股收益

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
归属于母公司股东的净利润	3,841,640,437	5,007,028,294
永续次级债券持有人本期利息	(256,520,000)	(159,661,918)
合计	3,585,120,437	4,847,366,376
已发行普通股加权平均数	4,827,256,868	4,827,256,868
基本每股收益(以每股人民币元呈列)	0.74	1.00

基本每股收益按归属于母公司普通股股东的当期净利润除以已发行普通股加权平均数计算。

截至2022年6月30日及2021年6月30日止6个月期间,本公司不存在发行在外的潜在普通股,故无需披露稀释每股收益。

### 50、现金流量表补充资料

#### (1) 将净利润调节为经营活动产生的现金流量净额:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
净利润	3,849,534,411	5,015,927,576
加:信用减值转回	(68,267,500)	(29,502,853)
固定资产折旧	151,609,471	121,075,874
使用权资产折旧	415,299,940	304,092,999
无形资产摊销	117,489,150	68,036,590
长期待摊费用摊销	75,103,409	47,189,885
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的净收益	(1,434,630)	(1,427,204)
公允价值变动收益	(6,201,033,270)	(11,122,500,821)
利息净支出	2,345,122,771	2,246,487,203
投资收益	(155,813,263)	(265,043,815)
递延所得税费用	61,337,545	358,580,556
以公允价值计量的金融工具净减少/(增加)	7,414,206,222	(40,763,403,217)
买入返售金融资产增加	(12,651,616,368)	(10,032,936,419)
卖出回购金融资产款增加	39,898,132,667	8,906,586,685
经营性应收项目增加	(4,303,997,450)	(17,699,477,466)
经营性应付项目(减少)/增加	(6,864,057,744)	58,290,615,771
汇兑收益	(116,772,852)	(975,498,844)
经营活动产生/(使用)的现金流量净额	23,964,842,509	(5,531,197,500)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 七、合并财务报表主要项目注释(续)

### 50、现金流量表补充资料(续)

#### (2) 现金及现金等价物的变动情况:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
现金及现金等价物的期末余额	162,237,179,071	134,404,738,831
减: 现金及现金等价物的期初余额	(156,214,305,943)	(107,601,477,403)
现金及现金等价物净增加额	6,022,873,128	26,803,261,428

#### (3) 现金及现金等价物:

	2022年	2021年
	6月30日	12月31日
货币资金	142,745,092,771	134,981,229,266
结算备付金	20,514,955,880	22,068,181,969
减: 使用受限制的银行存款(附注七、1)	(1,022,869,580)	(835,105,292)
合计	162,237,179,071	156,214,305,943
其中: 客户资金	94,449,537,318	91,021,359,219

## 八、母公司财务报表主要项目注释

### 1、长期股权投资

#### (1) 按类别列示:

	2022年	2021年
	6月30日	12月31日
对子公司的投资	27,453,277,514	26,953,277,514
对联营企业的投资	469,870,347	457,704,104
对合营企业的投资	7,329,566	49,319,609
合计	27,930,477,427	27,460,301,227



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 1、长期股权投资(续)

(2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本公司的长期股权投资情况如下:

#### (a) 子公司:

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2022年1月1日 人民币百万元	增加/(减少)投资 人民币百万元	2022年6月30日 人民币百万元
中金资本	成本法	872	872	-	872
中金财富	成本法	16,701	16,701	-	16,701
中金国际	成本法	5,412	5,412	-	5,412
中金浦成	成本法	3,505	3,005	500	3,505
中金基金	成本法	466	466	-	466
中金期货	成本法	398	398	-	398
中金私募股权	成本法	99	99	-	99
合计		27,453	26,953	500	27,453

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2021年1月1日 人民币百万元	增加/(减少)投资 人民币百万元	2021年12月31日 人民币百万元
中金资本	成本法	872	872	-	872
中金财富	成本法	16,701	16,701	-	16,701
中金国际	成本法	5,412	5,412	-	5,412
中金浦成	成本法	3,005	1,205	1,800	3,005
中金基金	成本法	466	366	100	466
中金期货	成本法	398	398	-	398
中金私募股权	成本法	99	-	99	99
合计		26,953	24,954	1,999	26,953

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

## 1、长期股权投资(续)

(2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本公司的长期股权投资投资情况如下:(续)

## (b) 联营企业:

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2022年 1月1日 人民币百万元	增加/ (减少)投资 人民币百万元	权益法下		其他 权益变动 人民币百万元	其他综合 收益调整 人民币百万元	宣告发放 现金股利 或利润 人民币百万元	2022年 6月30日	
					确认的 投资收益 人民币百万元	投资 人民币百万元				其他 人民币百万元	其他 人民币百万元
浙商金汇信托股份有限公司	权益法	298	431	-	12	-	-	-	-	-	443
北京金通港房地产开发有限 公司	权益法	28	27	-	(0)	-	-	-	-	-	27
合计		326	458	-	12	-	-	-	-	-	470

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2021年1月1日 人民币百万元	增加/ (减少)投资 人民币百万元	权益法下		其他 权益变动 人民币百万元	其他综合 收益调整 人民币百万元	宣告发放 现金股利 或利润 人民币百万元	2021年 12月31日	
					确认的 投资收益 人民币百万元	投资 人民币百万元				其他 人民币百万元	其他 人民币百万元
浙商金汇信托股份有限公司	权益法	298	399	-	33	(1)	-	-	-	0	431
北京金通港房地产开发有限 公司	权益法	28	27	-	(0)	-	-	-	-	-	27
合计		326	426	-	33	(1)	-	-	-	0	458

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 1、长期股权投资(续)

(2) 于2022年6月30日及2021年12月31日,本公司的长期股权投资投资情况如下:(续)

#### (c) 合营企业:

被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2022年 1月1日 人民币百万元	增加/ (减少)投资 人民币百万元	权益法下 确认的 投资收益 人民币百万元	其他 权益变动 人民币百万元	其他综合 收益调整 人民币百万元	宣告发放 现金股利 或利润 人民币百万元	2022年 6月30日	
									人民币百万元	人民币百万元
金腾科技信息(深圳)有限公司	权益法	153	49	-	(42)	-	-	-	-	7
被投资单位	核算方法	投资成本 人民币百万元	2021年 1月1日 人民币百万元	增加/ (减少)投资 人民币百万元	权益法下 确认的 投资收益 人民币百万元	其他 权益变动 人民币百万元	其他综合 收益调整 人民币百万元	宣告发放 现金股利 或利润 人民币百万元	其他 人民币百万元	2021年 12月31日 人民币百万元
金腾科技信息(深圳)有限公司	权益法	153	62	51	(64)	-	-	-	-	49

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 2、手续费及佣金净收入

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
证券经纪业务净收入	1,075,643,065	1,263,162,565
证券经纪业务收入	1,196,631,510	1,396,574,615
其中:代理买卖证券业务	601,950,947	627,745,735
交易单元席位租赁	551,090,507	476,959,138
代销金融产品业务(1)	43,590,056	291,869,742
证券经纪业务支出	(120,988,445)	(133,412,050)
其中:代理买卖证券业务	(120,988,445)	(133,412,050)
投资银行业务净收入	2,220,660,216	1,611,508,762
投资银行业务收入	2,380,422,875	1,725,854,276
其中:证券承销业务	1,923,918,551	1,314,851,759
证券保荐业务	128,603,774	70,605,566
财务顾问业务(2)	327,900,550	340,396,951
投资银行业务支出	(159,762,659)	(114,345,514)
其中:证券承销业务	(159,762,659)	(114,345,514)
资产管理业务净收入(3)	473,101,741	548,785,145
资产管理业务收入	518,139,998	591,880,134
资产管理业务支出	(45,038,257)	(43,094,989)
投资咨询业务净收入	223,945,038	198,668,814
投资咨询业务收入	223,945,038	198,668,814
其他手续费及佣金净收入	60,336,165	152,135,553
托管及其他综合服务收入	60,336,165	152,135,553
合计	4,053,686,225	3,774,260,839
其中:手续费及佣金收入合计	4,379,475,586	4,065,113,392
手续费及佣金支出合计	(325,789,361)	(290,852,553)

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 2、手续费及佣金净收入(续)

#### (1) 代销金融产品业务收入

	截至2022年6月30日止6个月期间		截至2021年6月30日止6个月期间	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	225,582,054	18,417,624	24,621,135,517	144,539,182
其他	19,532,797,289	25,172,432	35,104,632,576	147,330,560
合计	19,758,379,343	43,590,056	59,725,768,093	291,869,742

#### (2) 财务顾问业务净收入

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
并购重组财务顾问业务净收入		
境内上市公司	55,452,830	32,399,101
其他	104,319,132	117,018,443
其他财务顾问业务净收入	168,128,588	190,979,407
合计	327,900,550	340,396,951



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 2、手续费及佣金净收入(续)

#### (3) 资产管理业务

本公司的受托客户资产管理业务资金独立建账、独立核算,相关资产、负债、净资产、收入和费用等均按照企业会计准则的规定进行确认、计量和报告,以下为本公司全部受托资产管理业务的汇总信息:

	截至2022年6月30日止6个月期间			合计
	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	275	445	109	829
期末客户数量	86,186	441	1,730	88,357
其中:个人客户	83,971	3	-	83,974
机构客户	2,215	438	1,730	4,383
期初受托资金	524,135,187,564	412,286,733,611	161,495,197,407	1,097,917,118,582
其中:自有资金投入	41,735,562	-	1,367,860,410	1,409,595,972
个人客户	16,033,463,682	148,798,223	-	16,182,261,905
机构客户	508,059,988,320	412,137,935,388	160,127,336,997	1,080,325,260,705
期末受托资金	283,757,401,987	377,606,514,503	154,182,092,780	815,546,009,270
其中:自有资金投入	37,237,944	-	1,267,275,324	1,304,513,268
个人客户	22,305,112,794	155,299,569	-	22,460,412,363
机构客户	261,415,051,249	377,451,214,934	152,914,817,456	791,781,083,639
期末主要受托资产				
初始成本	330,598,594,938	475,545,544,696	154,397,714,250	960,541,853,884
其中:股票	15,740,724,513	38,044,778,587	-	53,785,503,100
债券	276,727,855,584	279,094,100,279	-	555,821,955,863
基金	19,189,115,012	13,241,314,670	150,256,790	32,580,686,472
其他	18,940,899,829	145,165,351,160	154,247,457,460	318,353,708,449
本期资产管理业务净收入	140,787,724	284,634,289	47,679,728	473,101,741

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 2、手续费及佣金净收入(续)

#### (3) 资产管理业务(续)

	截至2021年6月30日止6个月期间			合计
	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	189	1,383	128	1,700
期末客户数量	48,709	1,377	1,604	51,690
其中:个人客户	46,750	734	-	47,484
机构客户	1,959	643	1,604	4,206
期初受托资金	147,462,716,107	271,442,983,994	187,566,859,960	606,472,560,061
其中:自有资金投入	78,015,561	-	3,207,818,000	3,285,833,561
个人客户	9,133,281,167	8,650,118,655	-	17,783,399,822
机构客户	138,251,419,379	262,792,865,339	184,359,041,960	585,403,326,678
期末受托资金	415,067,602,868	401,065,511,177	169,175,015,120	985,308,129,165
其中:自有资金投入	85,848,174	-	1,849,505,276	1,935,353,450
个人客户	8,296,631,348	11,985,893,247	-	20,282,524,595
机构客户	406,685,123,346	389,079,617,930	167,325,509,844	963,090,251,120
期末主要受托资产				
初始成本	449,519,802,624	494,580,784,216	168,420,111,424	1,112,520,698,264
其中:股票	74,161,058,832	40,430,360,098	-	114,591,418,930
债券	219,298,686,677	163,365,650,915	-	382,664,337,592
基金	13,915,886,521	17,728,919,824	917,705,758	32,562,512,103
其他	142,144,170,594	273,055,853,379	167,502,405,666	582,702,429,639
本期资产管理业务净收入	95,400,590	429,176,303	24,208,252	548,785,145

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 3、利息净支出

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
利息收入		
存放金融同业利息收入	580,953,512	459,232,610
其中:自有资金存款利息收入	451,977,413	245,398,822
客户资金存款利息收入	128,976,099	213,833,788
融资融券利息收入	138,791,673	295,802,571
其他债权投资利息收入	388,059,605	378,315,092
买入返售金融资产利息收入	394,132,860	337,280,289
其中:股票质押式回购利息收入	127,131,678	167,305,055
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	61,614,885	8,253,750
小计	1,563,552,535	1,478,884,312
利息支出		
客户资金存款利息支出	(40,238,294)	(64,491,489)
卖出回购金融资产款利息支出	(269,875,876)	(204,582,669)
其中:报价回购利息支出	(8,574)	(2,197,532)
拆入资金利息支出	(381,456,211)	(269,192,634)
其中:转融通融入资金利息支出	(7,038,889)	(5,172,222)
短期融资券利息支出	(3,912,329)	-
收益凭证利息支出	(53,240,383)	(126,553,059)
公司债券利息支出	(1,270,353,363)	(1,158,796,787)
次级债券利息支出	(315,545,733)	(422,169,573)
金融债券利息支出	(42,026,712)	(42,026,712)
租赁负债利息支出	(10,492,240)	(10,785,416)
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	(122,890,612)	(109,054,913)
小计	(2,510,031,753)	(2,407,653,252)
利息净支出	(946,479,218)	(928,768,940)

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释 (续)

### 4、投资收益

	注	截至6月30日止6个月期间	
		2022年	2021年
权益法核算的长期股权投资损失		(29,823,800)	(8,563,178)
成本法核算的长期股权投资收益		1,916,500,000	1,280,000,000
金融工具投资(损失)/收益		(1,309,457,820)	163,054,866
其中: 持有期间取得的收益		1,721,971,409	1,370,712,380
— 交易性金融工具	(1)	1,642,843,002	1,346,380,977
— 衍生金融工具		79,128,407	24,331,403
处置金融工具取得的损失		(3,031,429,229)	(1,207,657,514)
— 交易性金融工具	(1)	(2,845,362,028)	2,087,966,994
— 衍生金融工具		(296,017,474)	(3,309,409,599)
— 其他债权投资		109,950,273	13,785,091
合计		577,218,380	1,434,491,688

#### (1) 交易性金融工具投资收益/(损失)明细表:

交易性金融工具		截至6月30日止6个月期间	
		2022年	2021年
分类为以公允价值计量且其变动	持有期间收益	1,649,643,087	1,372,707,317
计入当期损益的金融资产	处置取得(损失)/收益	(2,835,154,714)	2,080,671,268
分类为以公允价值计量且其变动	持有期间损失	(5,199,279)	(22,318,806)
计入当期损益的金融负债	处置取得(损失)/收益	(8,182,314)	10,711,097
指定为以公允价值计量且其变动	持有期间损失	(1,600,806)	(4,007,534)
计入当期损益的金融负债	处置取得损失	(2,025,000)	(3,415,371)
	持有期间收益小计	1,642,843,002	1,346,380,977
	处置取得(损失)/收益小计	(2,845,362,028)	2,087,966,994

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 5、公允价值变动收益

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
交易性金融资产	234,371,007	2,546,680,304
衍生金融工具	3,656,567,828	205,884,139
交易性金融负债	(135,328,647)	(2,313,114)
其中:指定为以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	(136,803,643)	(3,539,379)
合计	3,755,610,188	2,750,251,329

### 6、业务及管理费

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
员工成本	3,247,630,164	3,825,658,822
折旧及摊销费	379,394,053	286,791,876
业务拓展费	321,746,466	257,846,425
信息系统相关费用	207,110,390	164,355,079
专业服务费	77,774,954	51,136,830
差旅费	76,290,474	129,916,910
租赁费	43,236,739	15,081,337
证券及期货投资者保护基金	36,143,486	33,722,516
公共设施及维护费	28,012,873	26,886,313
其他	56,260,847	33,685,283
合计	4,473,600,446	4,825,081,391



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 7、现金流量表补充资料

#### (1) 将净利润调节为经营活动产生的现金流量净额:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
净利润	3,181,089,443	2,152,226,937
加:信用减值(转回)/损失	(18,980,981)	9,606,399
固定资产折旧	96,738,307	79,012,453
使用权资产折旧	174,835,228	147,611,284
无形资产摊销	82,719,446	40,855,628
长期待摊费用摊销	25,101,072	19,312,511
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的净损失/(收益)	666,720	(1,092,451)
公允价值变动收益	(3,755,610,188)	(2,750,251,329)
利息净支出	1,358,738,575	1,385,336,338
投资收益	(1,996,626,474)	(1,285,221,913)
递延所得税费用	40,114,965	61,366,130
以公允价值计量的金融工具净减少/(增加)	3,634,962,974	(21,308,629,192)
买入返售金融资产增加	(12,249,973,888)	(10,347,739,371)
卖出回购金融资产款增加	30,430,328,150	7,126,477,594
经营性应收项目减少/(增加)	11,079,058,651	(8,771,369,472)
经营性应付项目(减少)/增加	(13,322,395,347)	27,229,462,739
汇兑收益	(57,561,724)	(112,204,645)
经营活动产生/(使用)的现金流量净额	18,703,204,929	(6,325,240,360)

#### (2) 现金及现金等价物的变动情况:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
现金及现金等价物的期末余额	60,010,163,059	51,647,092,398
减:现金及现金等价物的期初余额	(48,059,468,628)	(38,662,044,995)
现金及现金等价物净增加额	11,950,694,431	12,985,047,403

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 八、母公司财务报表主要项目注释(续)

### 7、现金流量表补充资料(续)

#### (3) 现金及现金等价物:

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
货币资金	52,238,257,158	40,439,606,084
结算备付金	8,243,837,413	8,116,043,582
减:使用受限制的银行存款	(471,931,512)	(496,181,038)
合计	<b>60,010,163,059</b>	48,059,468,628
其中:客户资金	<b>16,994,772,327</b>	18,306,235,162

## 九、关联方关系及其交易

### 1、与控股股东及其附属公司之间的交易

本公司控股股东的信息如下:

名称	注册地	业务性质	注册资本	2022年6月30日 对本公司的直接和 间接持股比例	2021年12月31日 对本公司的直接和 间接持股比例
中央汇金投资有限责任公 司(以下简称“汇金”)	北京	接受国务院授权,对国有重点金 融企业进行股权投资;国务 院批准的其他相关业务	人民币 8,282.09亿元	40.17%	40.17%

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 九、关联方关系及其交易 (续)

### 1、与控股股东及其附属公司之间的交易 (续)

汇金不开展其他任何商业性经营活动, 不干预其控股的国有重点金融企业的日常经营活动。本集团与汇金及其旗下公司进行的日常业务交易, 按正常商业条款进行。主要交易及余额情况如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
经纪业务收入	7,860,176	25,934,732
投资银行业务收入	13,064,776	5,061,673
资产管理业务收入	222,086	-
投资咨询业务收入	-	566,038
基金管理业务收入	4,919,704	-
利息收入	607,005,200	494,329,186
投资收益/(损失)	107,967,054	(58,338,964)
公允价值变动(损失)/收益	(472,194,503)	268,964,456
其他业务收入	517,101	494,872
经纪业务支出	32,806,264	28,710,198
资产管理业务支出	15,512,239	16,009,508
投资银行业务支出	557,250	-
利息支出	237,832,715	196,003,629
业务及管理费	3,288,454	3,408,005
汇兑收益/(损失)	41,670,359	(2,258,705)
信用减值损失	56,000	-

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 九、关联方关系及其交易(续)

### 1、与控股股东及其附属公司之间的交易(续)

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
银行存款	68,682,540,734	60,132,857,289
衍生金融资产	282,326,721	808,971,579
存出保证金	40,967,715	31,593,102
应收款项	626,166,969	103,906,491
买入返售金融资产	200,083,836	-
交易性金融资产	8,093,770,415	8,909,393,809
其他债权投资	5,897,672,884	4,721,292,896
使用权资产	2,126,810	-
其他资产	-	3,526,859
应付短期融资款	-	19,701,000
拆入资金	10,984,766,972	14,550,235,866
交易性金融负债	9,740,630	40,332,880
卖出回购金融资产款	13,543,385,148	3,160,809,973
代理买卖证券款	14,933,156	6,895,535
衍生金融负债	326,585,257	336,215,231
应付款项	573,095,679	798,965,993
租赁负债	2,165,424	-
应付债券	1,594,708,274	2,157,387,672
其他负债	18,160,183	19,893,669

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 九、关联方关系及其交易 (续)

### 2、与其他持有本公司5%以上股份股东之间的交易

与本集团发生关联交易的其他持有本公司5%以上股份股东如下:

企业名称	与本集团的关系
海尔集团(青岛)金盈控股有限公司	报告期内持有本公司5%以上股份股东

本集团与其他股东的主要交易及余额情况如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
经纪业务收入	1,129,523	-
利息支出	-	211
	2022年	2021年
	6月30日	12月31日
代理买卖证券款	99,600,282	47
其他负债	28,032	3,996

### 3、与子公司之间的交易

有关本公司之子公司的信息参见附注五、1。本公司与子公司之间的交易及余额情况如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
经纪业务收入	176,209,229	7,294,261
投资咨询业务收入	-	1,820,020
托管及其他综合服务收入	28,034,669	123,806,850
利息收入	785,364	34,851
投资收益	984,786,764	1,702,183,416
公允价值变动(损失)/收益	(206,812,649)	412,310,872
投资银行业务支出	33,092,729	42,455,599
资产管理业务支出	31,458,689	19,669,965
利息支出	86,065	248,292
业务及管理费	116,691,324	76,377,185
信用减值损失	297,621	-



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 九、关联方关系及其交易 (续)

### 3、与子公司之间的交易 (续)

本公司与子公司之间的交易及余额情况如下:(续)

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
结算备付金	(80,078,403)	485,957,310
衍生金融资产	993,662,600	1,111,161,637
存出保证金	441,955	540,799,980
应收款项	3,327,967,900	4,907,720,585
其他资产	2,450,923,935	1,815,654,327
衍生金融负债	322,176,124	225,429,099
代理买卖证券款	469,545	1,081,346
应付款项	301,281,935	331,111,137
其他负债	7,614,156	188,442

注: 除以上交易外,于2022年6月30日,本公司之子公司持有的由本公司管理的单一资产管理计划共计人民币709,780,741元(2021年12月31日:人民币920,184,662元),子公司中金财富对本公司的资本担保承诺共计人民币3,000,000,000元(2021年12月31日:人民币4,300,000,000元)。

### 4、关键管理人员报酬

关键管理人员指有权及责任直接或间接规划、指示及控制本集团经营活动的人士,包括本公司董事会及监事会成员以及其他高级管理人员。关键管理人员自本集团取得报酬如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
关键管理人员报酬	17,095,028	14,236,792

注: 截至2022年6月30日止6个月期间,本集团关键管理人员的奖金尚未确定。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 九、关联方关系及其交易 (续)

### 5、与合营、联营企业之间的交易

本集团与合营、联营企业之间的交易及余额情况如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
经纪业务收入	6,476,108	4,201,943
投资咨询业务收入	7,756,132	5,489,867
基金管理业务收入	-	3,835,014
利息收入	2,170,016	2,181,209
利息支出	1,950	1,447
	2022年	2021年
	6月30日	12月31日
应收款项	6,728,579	19,576,095
其他资产	133,662,975	184,365,488
代理买卖证券款	44,863,877	448,379
应付款项	-	12,480,000
合同负债	4,009,434	-

### 6、与本公司关联自然人控制或担任董事、高管的其他企业之间的交易

报告期内,与本公司发生关联交易的该类关联法人如下:

企业名称	与本集团的关系
海尔智家股份有限公司	公司董事曾担任该公司董事
海尔金融保理(重庆)有限公司	公司董事担任该公司董事
海尔集团财务有限责任公司	公司董事曾担任该公司董事
青岛银行股份有限公司	公司董事担任该公司董事
中国投融资担保股份有限公司	公司董事担任该公司董事
神州租车有限公司	公司曾任高级管理人员兼任该公司独立董事
中国财政经济出版社	关联自然人控制或者担任董高的其他企业

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 九、关联方关系及其交易(续)

### 6、与本公司关联自然人控制或担任董事、高管的其他企业之间的交易(续)

主要交易及余额情况如下:

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
经纪业务收入	59,160	7,170
投资银行业务收入	1,225,569	8,279,819
基金管理业务收入	5,535,460	-
投资收益	242,140	14,608,797
公允价值变动收益	654,066	-
利息收入	-	77,339,518
经纪业务支出	-	5,685,919
资产管理业务支出	-	60,419
利息支出	30,065	5,235,056
业务及管理费	68,332	111

	2022年	2021年
	6月30日	12月31日
银行存款	-	11,691,323,073
衍生金融资产	-	25,253,797
交易性金融资产	35,995,764	406,497,360
其他债权投资	-	963,084,491
应收款项	80,000	220,080,000
其他资产	-	7,097,760
拆入资金	-	300,085,479
衍生金融负债	-	5,892,709
代理买卖证券款	922	15,555
应付债券	-	50,069,524
应付款项	-	2,569
其他负债	-	3,180,796

除上述交易外,截至2022年6月30日止6个月期间,本公司向本公司关联自然人控制或担任董事、高管的其他企业出售持有的债券投资的交易总金额为人民币50,000,000元(截至2021年6月30日止6个月期间:无)。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十、分部报告

本集团以内部组织结构、管理要求及内部报告机制为依据确定经营分部, 以经营分部为基础确定报告分部。经营分部指本集团内满足下列条件的组成部分:

- 开展能赚取收入及产生支出的业务活动;
- 经营业绩由本集团管理层定期复核以进行资源分配及业绩评估;
- 有关财务状况、经营业绩及现金流量的财务信息可以取得。

若两个或多个经营分部存在以下相似经济特征, 可以合并为一个经营分部:

- 业务性质;
- 业务的客户类型或类别;
- 开展业务的方式;
- 监管环境的性质。

出于管理的目的, 本集团的业务按业务运营和提供服务的性质区分为不同的分部进行管理。本集团各经营分部各代表一个战略性业务单元, 其所提供服务的风险及回报均区别于其他经营分部。经营分部的概述如下:

- 投资银行分部主要向境内外企业和机构客户提供投资银行服务, 包括股权融资、债务及结构化融资、财务顾问服务等。
- 股票业务分部主要向境内外专业投资者提供“投研、销售、交易、产品、跨境”等一站式综合金融服务, 包括机构交易服务和主经纪商、场外衍生品、资本引荐、做市交易等资本服务。
- 固定收益分部主要为境内外机构和企业客户, 就利率、信用、结构化等固定收益产品以及外汇和大宗商品提供做市及融资等一揽子服务和支持。
- 资产管理分部主要为境内外投资者设计及提供多元化的资产管理产品及服务, 包括社保及年金投资管理业务、机构委托投资管理业务、境外资产管理业务、零售及公募基金业务等。
- 私募股权分部主要为境内外投资者设计及提供一体化的私募股权投资基金产品及服务, 主要包括企业股权投资基金、母基金、美元基金、实物资产基金、基础设施基金等。
- 财富管理分部主要为个人、家族及企业客户提供范围广泛的财富管理产品及服务, 包括交易服务、资本服务、产品配置服务等。
- 其他分部主要包括其他业务部门及后台职能部门。

## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十、分部报告(续)

## 1、分部业绩

	截至2022年6月30日止6个月期间						总计
	投资银行	股票业务	固定收益	资产管理	私募股权	财富管理	
手续费及佣金净收入(注1)	2,154,846,718	959,205,926	504,021,777	677,077,403	653,640,940	2,193,805,841	7,097,565,948
利息净(支出)/收入	(153,202,310)	(187,394,333)	(923,557,730)	(52,053,834)	(128,724,624)	1,007,970,258	(371,363,592)
投资收益及公允价值变动损益	(557,608,783)	2,967,377,676	2,108,102,222	9,202,472	106,062,064	155,473,339	5,060,504,814
其他收入/(支出)	440,299	(305,336,559)	177,997,568	1,795,240	8,384,131	91,158,430	344,878,435
营业收入	1,444,475,924	3,433,852,710	1,866,363,837	636,021,281	639,362,511	3,448,407,868	12,131,585,605
营业支出	1,738,377,657	513,744,656	566,079,350	391,123,222	442,393,451	2,046,324,518	7,593,895,471
营业(亏损)/利润	(293,901,733)	2,920,108,054	1,300,284,487	244,898,059	196,969,060	1,402,083,350	4,537,690,134
营业外(支出)/收入	(78,035)	3,459,096	(231,605)	(3,079,803)	(1,154)	(6,445,710)	(19,282,586)
税前(亏损)/利润	(293,979,768)	2,923,567,150	1,300,052,882	241,818,256	196,967,906	1,395,637,640	4,518,407,548
分部资产	9,104,842,222	229,479,820,602	143,975,240,785	4,361,842,157	6,918,574,514	141,655,626,179	678,265,725,073
递延所得税资产							1,728,642,572
资产总额							679,994,367,645
分部负债	8,285,038,970	217,904,700,673	128,896,763,441	3,483,441,673	3,552,993,770	126,996,950,640	588,358,908,773
递延所得税负债							545,824,487
负债总额							588,904,733,260
利息支出(注2)	172,668,384	602,591,794	1,570,801,426	77,894,847	133,905,209	1,087,517,296	4,291,706,489
折旧及摊销费	53,459,170	50,868,209	44,424,345	32,512,558	30,048,888	278,638,623	759,501,970
信用减值(转回)/损失	(12,671,220)	(104,701,854)	71,993,631	1,139,528	12,302,656	(35,383,712)	(68,267,500)



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十、分部报告 (续)

### 1、分部业绩 (续)

	截至2021年6月30日止6个月期间						总计	
	投资银行	股票业务	固定收益	资产管理	私募股权	财富管理		其他
手续费及佣金净收入(注1)	2,173,170,793	1,353,115,059	409,868,298	526,322,917	662,750,818	2,054,479,106	11,878,132	7,191,585,123
利息净(支出)/收入	(81,811,282)	(122,634,650)	(891,046,697)	1,696,112	(46,344,808)	849,237,813	(220,169,375)	(511,072,887)
投资收益及公允价值变动损益	731,857,075	3,534,382,686	2,170,994,275	44,751,469	509,973,850	318,577,236	886,901,429	8,197,438,020
其他收入/(支出)	1,464,207	(367,105,315)	(108,934,982)	(492,150)	7,742,175	34,351,580	16,078,121	(416,896,364)
营业收入	2,824,680,793	4,397,757,780	1,580,880,894	572,278,348	1,134,122,035	3,256,645,735	694,688,307	14,461,053,892
营业支出	2,045,108,625	712,427,745	465,181,221	505,780,146	504,758,286	1,637,851,355	2,458,423,465	8,329,530,843
营业利润/(亏损)	779,572,168	3,685,330,035	1,115,699,673	66,498,202	629,363,749	1,618,794,380	(1,763,735,158)	6,131,523,049
营业外收入/(支出)	82,053	1,533,154	(235,346)	(62,605)	18,266	(3,636,463)	(10,151,618)	(12,452,559)
税前利润/(亏损)	779,654,221	3,686,863,189	1,115,464,327	66,435,597	629,382,015	1,615,157,917	(1,773,886,776)	6,119,070,490
分部资产	9,267,835,379	220,636,765,786	121,391,069,327	2,708,346,364	5,779,732,002	120,981,971,921	135,732,508,028	616,498,228,807
递延所得税资产								1,578,548,383
资产总额								618,076,777,190
分部负债	7,879,487,669	213,999,373,463	111,560,904,355	2,090,517,020	3,209,624,358	109,699,054,881	89,977,779,207	538,416,740,953
递延所得税负债								673,171,984
负债总额								539,089,912,937
利息支出(注2)	108,385,386	533,280,677	1,533,175,791	31,278,939	57,566,177	1,099,480,221	579,826,691	3,942,995,882
折旧及摊销费	46,755,645	36,994,789	29,330,389	30,338,002	22,416,278	196,052,469	178,507,776	540,395,348
信用减值损失/(转回)	5,727,696	(19,297,747)	(2,282,667)	34,121,856	677,112	(48,392,728)	(56,375)	(29,502,853)

注1: 对手续费及佣金净收入的分类在附注七、38披露。经纪业务净收入主要由股票业务分部和财富管理分部产生; 承销保荐业务净收入和财务顾问业务净收入主要由投资银行分部产生; 资产管理业务净收入和基金管理业务净收入主要由资产管理分部、私募股权分部和财富管理分部产生。

注2: 本集团根据报告期间资本占用计算各报告分部的利息支出, 以衡量其经营表现及提高资本管理效率。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十、分部报告(续)

### 2、地区分布

下表列示本集团来自外部客户的营业收入的地区分布,按提供服务或产品所处位置进行划分。

	源于外部客户的营业收入	
	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
中国大陆	9,855,735,275	10,560,686,776
中国大陆以外地区	2,275,850,330	3,900,367,116
合计	12,131,585,605	14,461,053,892

### 3、主要客户

本集团的客户基础多元化,截至2022年6月30日及2021年6月30日止6个月期间,无源于单一客户确认的收入金额超过本集团营业收入10%以上的情况。

## 十一、金融风险管理

本集团的风险管理旨在有效配置风险资本,将风险限制在可控范围,使企业价值最大化,并不断强化本集团稳定和可持续发展的根基。本集团对运用金融工具主要面临的信用风险、流动性风险及市场风险的敞口进行监控。

本集团建立了包括董事会、监事会、高级管理层、风险管理相关职能部门、业务部门及分支机构在内的多层级的风险管理组织架构。其中,(i)董事会为本公司风险管理及内部控制治理架构的最高层级,负责推进公司风险文化建设,审议公司风险管理总体目标、风险偏好、风险容忍度、重大风险限额、风险管理制度。董事会主要通过其下设的风险控制委员会及审计委员会履行其风险管理职责;(ii)监事会承担本公司全面风险管理的监督责任,负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改;(iii)在董事会之下,本公司设立由首席执行官担任主席的管理委员会。管理委员会根据董事会设定的风险管理总体目标确定本公司的风险偏好,对本公司全面风险管理的有效性承担主要责任;(iv)管理委员会下设的风险委员会向管理委员会汇报风险事务,重大事项向董事会风险控制委员会汇报。风险委员会由首席运营官担任主席,首席风险官和合规总监共同担任执行主席,其他成员包括首席财务官、各业务部门负责人及风险管理相关职能部门负责人;(v)风险管理相关职能部门,包括风险管理部、法律合规部、资金部、财务部、运作部、信息技术部、公共关系部等部门,从各自角度相互配合管理各类风险;(vi)业务部门负责人和分支机构负责人承担风险管理有效性的直接责任。在日常业务运营中,业务部门及分支机构参与业务经营的所有员工都被要求履行风险管理职能。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十一、金融风险管理 (续)

### 1、信用风险

信用风险指来自交易对手、融资方及证券发行人信用度下降或违约导致损失的风险。

本集团的信用风险主要来自:(1)融资方的违约信用风险,包括因中介机构违约(如经纪人或者托管银行)产生的损失,风险敞口为未偿还的债务总值;(2)交易对手于场外衍生交易(如远期、掉期、期权等)中,未能按时履行合约规定的义务,或交易对手信用资质下降产生的风险。风险敞口通过衍生工具的现期风险暴露和潜在风险暴露确定;(3)证券发行人信用度下降或违约导致损失的风险。

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金融资产扣除减值准备后的账面价值。

#### 预期信用损失计量

本集团对以摊余成本计量的金融资产(包括融出资金、买入返售金融资产等)和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债券投资通过预期信用损失模型确认减值损失。预期信用损失的计量基于违约概率(PD)、违约损失率(LGD)和违约风险敞口(EAD)。

违约是指客户或投资产品的融资人或发行人未能履行合同约定。违约概率是对给定的一段时间内违约可能性的估计。本集团基于内部评级模型,并综合外部评级信息、宏观经济环境、交易对手或债券发行人定量定性指标的变化等因素估计违约概率。违约损失率是本集团对违约风险敞口可能发生的损失程度作出的估计。在确认违约损失率时,本集团充分考虑基础资产、担保品的流动性和相关历史市场数据,估算基础资产、担保品处置后回收的现金流,并基于回收现金流与合同约定现金流的差异进行估计。违约风险敞口是指当违约发生时,本集团应被偿付的金额。本集团在计量预期损失时,根据相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加,将各资产划分入不同的风险阶段。针对不同的风险阶段,分别以12个月或整个存续期的预期信用损失计量减值准备。

#### 预期信用损失计提方法

本集团以预期信用损失为基础,对债券投资业务和融资类业务确认减值准备。对于纳入预期信用损失计量的金融工具,本集团基于相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加,将各金融工具划入不同的风险阶段。对于在资产负债表日信用风险较低的,或初始确认后未发生信用风险显著增加的金融工具纳入第一阶段;对于自初始确认后信用风险发生显著增加的金融工具纳入第二阶段;对于已发生信用减值的金融工具,则被转移至第三阶段。本集团预期信用损失的计量基于违约概率、违约损失率和违约风险敞口和前瞻性因素等参数,并定期检验、更新预期信用损失模型和假设。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理(续)

### 1、信用风险(续)

#### 预期信用损失计量(续)

##### 信用风险显著增加的判断标准

当触发以下一个或多个定量和定性指标时,本集团认为相应金融工具的信用风险已发生显著增加:(1)针对债券投资业务:债券发行人或债券的最新外部或内部评级较购买日时点债券发行人或债券的评级出现下调,或债券发行人的经营、财务、外部环境等发生重要不利变化,对发行人偿债能力产生重大不利影响;(2)针对融资类业务:履约保障比例大于100%,小于等于约定的平仓线,或本息逾期30日及以内。

##### 已发生信用减值的判断标准

以下情况下本集团认为相应金融工具已发生信用减值:(1)针对债券投资业务:债券发行人不能按约定履行偿付义务、债务人的其他债券违约或债务人发生重大财务困难等可被认定为违约的情况;(2)针对融资类业务:履约保障比例小于等于100%,或本息逾期超过30日。

##### 前瞻性信息

本集团使用无需付出不必要的额外成本或努力就可获得的前瞻性信息来计量预期信用损失。本集团以国内生产总值的累计同比指标预测值及广义货币供应量(M2)预测值为基础,并通过统计模型建立以上两个宏观经济指标和违约概率的关系,设置不同情景权重,确定违约率的总体调整参数。于2022年6月30日,本集团以上两个宏观经济指标预测值取自第三方机构公开可获取的预测数据,预测值分别为4.13%和10.16%,通过乐观、中性和悲观情景下的加权平均,并结合定性分析的方法,最终确定违约率的调整参数。

#### 债券投资

本集团对信用类固定收益证券投资注重分散投资,投资的信用产品主要为较高信用等级的产品。本集团通过设定投资规模限额、分投资品种、信用评级限额及集中度限额,开展前瞻性风险研判等措施控制市场及信用风险敞口,并通过监测、预警、风险排查等手段持续跟踪评估债券发行人的经营情况和信用评级变化。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十一、金融风险管理 (续)

### 1、信用风险 (续)

#### 债券投资 (续)

于资产负债表日, 本集团债券投资的账面价值按照报表项目列示如下:

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
交易性金融资产	98,405,739,637	82,090,098,250
其他债权投资	47,955,748,059	43,009,969,681
合计	146,361,487,696	125,100,067,931

#### 信用风险敞口

于资产负债表日, 本集团债券投资的信用风险敞口按照发行主体所在地列示如下:

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
中国大陆	144,664,265,705	124,997,230,937
中国大陆以外地区	1,697,221,991	102,836,994
合计	146,361,487,696	125,100,067,931



## 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理(续)

## 1、信用风险(续)

## 债券投资(续)

## 信用风险敞口(续)

于资产负债表日,本集团以公允价值计量且其变动计入当期损益及计入其他综合收益的债券投资的信用质量分析列示如下:

信用评级	2022年6月30日				2021年12月31日				合计
	交易性 金融资产	12个月预期 信用损失	其他债权投资		交易性 金融资产	12个月预期 信用损失	其他债权投资		
			整个存续期 -未发生减值 预期信用损失	整个存续期 -已发生减值 预期信用损失			整个存续期 -未发生减值 预期信用损失	整个存续期 -未发生减值 预期信用损失	
中国大陆以外地区 (国际评级)									
- AAA	197,439,259	-	-	-	12,640	-	-	-	-
- AA-至AA+	287,208,109	-	-	-	19,036,790	-	-	-	-
- A-至A+	2,355,604,916	4,020,999,424	-	-	1,000,030,827	3,365,289,987	-	-	3,365,289,987
- BBB-至BBB+	1,309,764,655	2,084,057,047	-	-	928,226,673	1,930,855,974	-	-	1,930,855,974
- 低于BBB-	361,562,404	31,130,475	72,311,577	15,092,130	756,779,413	210,557,746	11,200,033	-	221,757,779
- NR	3,524,654,449	52,615,752	-	-	7,083,813,495	99,266,975	-	-	99,266,975
小计	8,036,233,792	6,188,802,698	72,311,577	15,092,130	9,787,899,838	5,605,970,682	11,200,033	-	5,617,170,715
中国大陆(国内评级)									
- AAA	58,790,955,680	19,155,394,975	-	-	41,383,207,132	26,236,935,997	-	-	26,236,935,997
- AA-至AA+	6,490,956,685	2,676,468,119	-	-	5,164,263,554	1,449,602,872	-	-	1,449,602,872
- A-至A+	1,144,283,709	-	-	-	1,125,912,041	-	-	-	-
- 低于A-	761,169,865	-	-	-	942,942,839	-	-	-	-
小计	67,187,365,939	21,831,863,094	-	-	48,616,325,566	27,686,538,869	-	-	27,686,538,869
未评级I(注1)	10,659,607,709	19,847,678,560	-	-	8,454,699,987	9,685,899,037	-	-	9,685,899,037
未评级II(注2)	12,522,532,197	-	-	-	15,231,172,859	20,361,060	-	-	20,361,060
总计	98,405,739,637	47,868,344,352	72,311,577	15,092,130	82,090,098,250	42,998,769,648	11,200,033	-	43,009,969,681
减值准备		(24,266,071)	(2,533,024)	(62,579,464)	(89,378,559)	(18,216,690)	(558,347)	-	(18,775,037)

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十一、金融风险管理 (续)

### 1、信用风险 (续)

#### 债券投资 (续)

#### 信用风险敞口 (续)

注1: 此类未评级的金融资产主要包括国债、政策性金融债。

注2: 此类未评级的金融资产主要为其他未由独立评级机构评级的债务工具和交易性证券。

#### 其他非衍生金融工具(除债券投资以外)

本集团已采取以下措施管理融资融券、股票质押式回购等资本业务的信用风险: 审批交易对手, 并设置交易对手信用评级及融资融券限额; 管理抵押品(折算率、流动性及集中度)并密切监测保证金比例及/或抵押品覆盖率; 制订并执行追保、强制平仓政策。

于资产负债表日, 本集团以摊余成本计量的其他金融工具(除债券投资以外)的信用风险敞口按照地域列示如下:

	2022年 6月30日	2021年 12月31日
中国大陆	229,200,996,447	205,458,656,185
中国大陆以外地区	77,017,870,355	76,293,494,356
合计	306,218,866,802	281,752,150,541

#### 衍生金融工具

对于场外衍生品业务的交易对手信用风险, 本集团建立了交易对手信用评级体系, 通过定性与定量相结合的方法, 综合评估交易对手资质, 给予其相应的信用评级。在信用评级基础上, 对交易对手设置信用风险敞口限额, 并通过签订场外衍生品交易主协议与履约保障协议及收取履约保障品等方式管理交易对手信用风险。本集团通过设立动态情景, 结合压力测试, 计算场外衍生品交易对手履约保障品最低所需金额和信用风险敞口, 并每日通过系统进行计量和监控。鉴于此, 本集团可实现将衍生品交易的信用风险敞口维持在可接受的范围内。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理(续)

### 2、流动性风险

流动性风险指本集团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。

本集团实行垂直管理,集中管理境内外各分支机构的流动性风险。本集团已采取以下方法管理流动性风险:密切监控本集团及其分支机构的资产负债表,管理资产与负债的匹配情况;根据本集团整体情况及监管要求设定流动性风险限额;开展现金流预测,定期或不定期进行流动性风险压力测试,分析评估流动性风险水平;维持充足的高流动性资产,制订流动性风险应急计划,以应对潜在的流动性紧急情况。

于报告期末,本集团非衍生金融负债未经折现的合同现金流(包括本金和利息)按到期日分析,衍生金融负债按公允价值列示并按照预计到期或可能终止情况列示如下:

	逾期/即时 偿还	2022年6月30日				总计	账面价值
		1年之内 (含1年)	1-5年 (含5年)	超过5年			
金融负债							
应付短期融资款	-	16,236,778,446	2,284,518,449	-	18,521,296,895	18,445,942,406	
拆入资金	-	45,109,772,900	-	-	45,109,772,900	44,912,256,024	
交易性金融负债	-	35,637,368,629	6,907,868,825	-	42,545,237,454	42,543,566,051	
衍生金融负债	-	11,690,947,666	1,259,031,332	7,808,513	12,957,787,511	12,957,787,511	
卖出回购金融资产款	-	56,291,844,390	-	-	56,291,844,390	56,286,047,663	
代理买卖证券款	105,975,162,663	-	-	-	105,975,162,663	105,975,162,663	
代理承销证券款	-	386,055,000	-	-	386,055,000	386,055,000	
租赁负债	-	865,113,948	1,263,343,920	83,228,891	2,211,686,759	2,082,303,570	
应付债券	-	19,253,506,588	140,893,977,647	8,020,700,000	168,168,184,235	152,997,198,736	
其他	113,314,149,096	29,678,353,061	14,337,913	8,751	143,006,848,821	143,000,363,501	
总计	219,289,311,759	215,149,740,628	152,623,078,086	8,111,746,155	595,173,876,628	579,586,683,125	

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理(续)

### 2、流动性风险(续)

	2021年12月31日					总计	账面价值
	逾期/即时 偿还	1年之内 (含1年)	1-5年 (含5年)	超过5年			
金融负债							
应付短期融资款	-	21,653,617,895	1,507,907,732	-	23,161,525,627	22,989,857,489	
拆入资金	-	51,678,428,196	-	-	51,678,428,196	51,477,278,678	
交易性金融负债	-	38,925,007,061	2,252,774	-	38,927,259,835	38,926,786,684	
衍生金融负债	-	16,982,247,611	1,143,550,424	8,209,473	18,134,007,508	18,134,007,508	
卖出回购金融资产款	-	16,379,116,195	-	-	16,379,116,195	16,376,070,951	
代理买卖证券款	93,445,165,307	-	-	-	93,445,165,307	93,445,165,307	
代理承销证券款	-	7,304,310,900	-	-	7,304,310,900	7,304,310,900	
租赁负债	-	768,435,057	1,235,827,786	76,094,482	2,080,357,325	2,002,895,426	
应付债券	-	28,091,584,553	139,400,410,022	9,957,110,000	177,449,104,575	160,508,549,775	
其他	90,791,707,443	49,501,831,392	14,780,088	-	140,308,318,923	140,142,107,304	
总计	184,236,872,750	231,284,578,860	143,304,728,826	10,041,413,955	568,867,594,391	551,307,030,022	

### 3、市场风险

市场风险为本集团的收入及持有的金融工具价值因不利市场变动(如利率、股价及外汇汇率变动等)产生亏损的风险。市场风险管理的目标是监测市场风险并将其控制在可接受范围内并将风险调整后的收益最大化。压力测试会定期进行,并计算不同情景下风险控制和经营指标。

本集团对投资组合及非交易组合的市场风险分别监控。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理(续)

### 3、市场风险(续)

#### (1) 投资组合的市场风险

投资组合包括交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债及其他债权投资。风险敞口的衡量和监控需维持在管理层设定的限额内。本集团采用多种方法(如风险价值(“VaR”)、敏感度限额、投资集中度限额、情景分析及压力测试等)管理市场风险。VaR分析为本集团计量及监测投资组合市场风险所用的主要工具。

VaR为估计所持风险头寸因不利市场变动(如利率、股价及汇率变动等)于特定时间内及按特定置信区间而可能产生的潜在亏损的方法。本集团的独立风险管理人员通过采用历史模拟法计算VaR并对市场风险进行相关控制。历史模拟法用于根据主要市场风险因子过往波动及与该等风险因子有关的现时投资组合的敏感度模拟未来利润或亏损。

本集团基于三年历史数据,采用历史模拟法来计算置信水平为95%的单一VaR值,即对于投资组合,根据历史数据的预计日损失有95%的可能性不会超过VaR值。虽然VaR是衡量市场风险的重要工具,但有关模型所基于的假设却存在一些局限性,包括:

- 由于单一VaR值只覆盖1个交易日,在市场长时期严重流动性不足的情况下,在1个交易日内投资组合的变现价值可能出现不符合预测值的情况;
- 95%的置信水平并不反映在这个水平以外可能引起的亏损。即便在所用的模型内,仍有5%的机会可能亏损超过风险价值;
- VaR按当日收市基准计算,并不反映交易当天持仓变动可能带来的变化;
- 用历史数据来预测将来,不一定能够覆盖可能发生的所有情况,特别是例外事项。



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理(续)

### 3、市场风险(续)

#### (1) 投资组合的市场风险(续)

下表列示于所示日期及期间本集团按风险类别计算的风险价值:

	2022年	截至2022年6月30日止6个月期间		
	6月30日	平均	最高	最低
价格敏感金融工具	152,927,988	141,832,133	187,269,394	110,919,146
利率敏感金融工具	68,394,077	68,305,425	82,950,114	50,930,928
汇率敏感金融工具	35,767,487	33,548,446	39,118,838	21,479,605
商品敏感金融工具	746,075	1,358,863	2,673,152	641,587
分散化效应	(88,222,893)	(89,244,751)		
组合总额	169,612,734	155,800,116	186,055,582	135,246,983
	2021年		2021年度	
	12月31日	平均	最高	最低
价格敏感金融工具	185,696,707	180,086,116	215,684,592	132,532,882
利率敏感金融工具	51,739,456	54,591,702	79,273,858	35,761,912
汇率敏感金融工具	39,091,828	33,845,476	44,258,664	18,989,510
商品敏感金融工具	953,532	559,318	1,548,226	116,233
分散化效应	(97,190,940)	(83,694,087)		
组合总额	180,290,583	185,388,525	220,752,094	151,260,280

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十一、金融风险管理 (续)

### 3、市场风险 (续)

#### (2) 非交易组合的市场风险

##### (a) 利率风险

本集团的非交易组合面临利率波动风险。除通过VaR管理的金融资产及负债外,本集团非交易组合中的主要生息资产包括银行及结算机构存款、融出资金以及买入返售金融资产;其计息负债主要包括拆入资金、卖出回购金融资产款、应付短期融资款及应付债券。

本集团采用敏感度分析计量非交易组合的利率风险。假设所有其他变量保持不变,利率敏感度分析如下:

	净利润的敏感度	
	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
基点变动		
上升50个基点	(368,387,903)	(322,305,191)
下降50个基点或减至0	378,325,489	369,903,976

	权益的敏感度	
	2022年6月30日	2021年12月31日
基点变动		
上升50个基点	(368,387,903)	(294,941,100)
下降50个基点或减至0	378,325,489	371,242,196

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十一、金融风险管理 (续)

### 3、市场风险 (续)

#### (2) 非交易组合的市场风险 (续)

##### (a) 利率风险 (续)

敏感度分析是基于本集团资产及负债的静态利率风险状况。敏感度分析计量未来一年内利率变动的影响, 显示未来一年期间内年化净利润或亏损及权益受本集团资产及负债重新定价的影响情况。敏感度分析乃基于以下假设:

- 于各报告期末利率变动50个基点适用于未来12个月所有非交易性金融工具;
- 收益率曲线随利率变动平移;
- 资产及负债组合并无变动;
- 其他变量(包括外汇汇率)保持不变;
- 并未考虑本集团采取的风险管理措施。

由于利率的实际变动可能有别于上述假设, 利率变动及对本集团净利润及权益的影响可能有别于敏感度分析的估计结果。

##### (b) 外汇风险

外汇风险为外汇汇率波动所致的风险。下表列示了本集团主要币种外汇风险敞口的汇率敏感度分析, 其计算了当其他变量不变的情况下, 外币对人民币汇率的合理可能变动对权益的影响。该分析未考虑不同货币汇率变动之间的相关性, 未考虑外币金融工具公允价值变动的影响, 也未考虑本集团有可能采取的致力于消除外汇敞口对权益带来不利影响的措施(如签订货币衍生合约)。

币种	汇率变动	权益的敏感度	
		2022年6月30日	2021年12月31日
美元	1%	(231,953,679)	(257,894,315)
港元	1%	(7,666,057)	82,566,111
其他	1%	2,846,055	14,302,180

上表列示了美元、港元及其他外币相对人民币升值1%对权益所产生的影响, 若上述币种以相同幅度贬值, 则将对权益产生与上表相同金额方向相反的影响。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十二、公允价值

### 1、金融工具计量基础分类表

本集团的金融资产计量基础分类表汇总如下:

	2022年6月30日						
	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		按照《套期会计》
			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		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	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	142,917,637,312	-	-	-	-	-	
结算备付金	20,519,939,739	-	-	-	-	-	
融出资金	35,147,752,304	-	-	-	-	-	
衍生金融资产	-	-	-	19,034,460,568	-	-	
存出保证金	12,063,601,058	-	-	-	-	-	
应收款项	55,974,007,114	-	-	-	-	-	
买入返售金融资产	38,509,752,865	-	-	-	-	-	
交易性金融资产	-	-	-	296,686,462,225	-	-	
其他债权投资	-	47,955,748,059	-	-	-	-	
其他金融资产	993,277,254	-	-	-	-	-	

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 1、金融工具计量基础分类表(续)

本集团的金融资产计量基础分类表汇总如下:(续)

	2021年12月31日					
	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	135,106,058,236	-	-	-	-	-
结算备付金	22,074,426,966	-	-	-	-	-
融出资金	39,479,056,714	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	14,564,228,663	-	-
存出保证金	12,631,912,764	-	-	-	-	-
应收款项	45,742,880,588	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	25,858,494,059	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	301,174,215,104	-	-
其他债权投资	-	43,009,969,681	-	-	-	-
其他金融资产	816,712,732	-	-	-	-	-

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 1、金融工具计量基础分类表(续)

本集团的金融负债计量基础分类表汇总如下:

	2022年6月30日			
	以公允价值计量且其变动计入当期损益			
	按照《金融工具 确认和计量》准则	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	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
	以摊余成本 计量的金融负债	分类为以公允 价值计量且其 变动计入当期 损益的金融负债	指定为以公允 价值计量且其 变动计入当期 损益的金融负债	按照《套期会计》 准则指定为以 公允价值计量 且其变动计入 当期损益的 金融负债
应付短期融资款	18,445,942,406	-	-	-
拆入资金	44,912,256,024	-	-	-
交易性金融负债	-	5,764,209,842	36,779,356,209	-
衍生金融负债	-	12,957,787,511	-	-
卖出回购金融资产款	56,286,047,663	-	-	-
代理买卖证券款	105,975,162,663	-	-	-
代理承销证券款	386,055,000	-	-	-
应付款项	135,956,714,734	-	-	-
租赁负债	2,082,303,570	-	-	-
应付债券	152,997,198,736	-	-	-
其他金融负债	7,043,648,767	-	-	-



# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十二、公允价值 (续)

### 1、金融工具计量基础分类表 (续)

本集团的金融负债计量基础分类表汇总如下: (续)

		2021年12月31日		
		以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		按照《金融工具 确认和计量》准则 分类为以公允 价值计量且其 变动计入当期 损益的金融负债	按照《金融工具 确认和计量》准则 指定为以公允 价值计量且其 变动计入当期 损益的金融负债	按照《套期会计》 准则指定为以 公允价值计量 且其变动计入 当期损益的 金融负债
应付短期融资款	22,989,857,489	-	-	-
拆入资金	51,477,278,678	-	-	-
交易性金融负债	-	4,237,947,239	34,688,839,445	-
衍生金融负债	-	18,134,007,508	-	-
卖出回购金融资产款	16,376,070,951	-	-	-
代理买卖证券款	93,445,165,307	-	-	-
代理承销证券款	7,304,310,900	-	-	-
应付款项	134,908,863,413	-	-	-
租赁负债	2,002,895,426	-	-	-
应付债券	160,508,549,775	-	-	-
其他金融负债	5,233,243,891	-	-	-

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 2、公允价值确定方法

本集团在估计金融资产及负债于资产负债表日的公允价值时运用了下述主要方法和假设。

#### (1) 股票/股权投资、债券投资及基金及其他投资

对于交易性金融资产及负债(不含衍生金融工具)、其他债权投资,存在活跃市场的,其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的;不存在活跃市场的,其公允价值是以估值技术来确定的。

#### (2) 应收款项、拆入资金、应付债券及其他非衍生金融资产及负债

对于本集团的应收款项、拆入资金、应付债券及其他非衍生金融资产及负债,其公允价值是根据预计未来现金流量的现值进行估计的。折现率为资产负债表日的市场利率。

#### (3) 衍生金融工具

本集团根据每个合同的条款和到期日,主要采用类似衍生金融工具的市场利率将未来现金流折现,以验证报价的合理性。

### 3、公允价值数据

本集团的金融资产主要包括货币资金、结算备付金、融出资金、衍生金融资产、存出保证金、应收款项、买入返售金融资产、交易性金融资产及其他债权投资。交易性金融资产、衍生金融资产和其他债权投资以公允价值列报(附注七、8、4和9),其余金融资产的账面价值与公允价值相似。

本集团的金融负债主要包括应付短期融资款、拆入资金、交易性金融负债、衍生金融负债、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、代理承销证券款、应付款项、应付债券及租赁负债。交易性金融负债和衍生金融负债以公允价值列报(附注七、21和4),应付债券的公允价值参见附注七、30,其余金融负债的账面价值与公允价值相似。

# 中期财务报表附注(续)

自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间 (除特别注明外, 金额单位: 人民币元)

## 十二、公允价值 (续)

### 4、公允价值的三个层次

下表列示了本集团在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。对三个层次的定义如下:

第一层次: 输入值为在计量日能够取得相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次: 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: 相关资产或负债的不可观察输入值。

如果金融工具有可靠的市场报价, 则金融工具的公允价值以市场报价计量。如果没有可靠的市场报价, 则采用估值技术估计金融工具的公允价值。对于第二层次计量的金融工具公允价值, 采用的估值技术包括折现现金流量模型和期权定价模型。估值技术中使用的重大可观察输入值包括基于合同条款预计的未来现金流量、无风险利率、基准利率、信贷利差和外汇汇率等。对于第三层次计量的金融工具公允价值, 基于管理层获取的资本账户报告或使用估值技术确定其公允价值, 包括折现现金流量模型、市场可比公司法及最近融资价格法等估值方法。第三层次公允价值计量的分类, 一般根据不可观察输入值对计量总体公允价值的重要性确定。下表列示第三层次主要金融工具的相关估值技术及输入值, 于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日, 第三层次金融资产公允价值对不可观察输入值的合理变动不具有重大敏感性。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 4、公允价值的三个层次(续)

金融工具	公允价值层次	估值技术及		不可观察输入值	
		主要输入值	重大不可观察输入值	与公允价值的关系	
债权投资	第三层次	折现现金流量模型	预计未来现金流、折现率(注1)	折现率越高,公允价值越低	
股票/股权投资	第三层次	期权定价模型	历史波动率(注2)	波动率越高,公允价值越低	
股票/股权投资	第三层次	市场可比公司	缺乏市场流通性的折扣(注3)	折扣率越高,公允价值越低	

	2022年6月30日				
	附注七	第一层次	第二层次	第三层次	合计
<b>资产</b>					
交易性金融资产	8				
— 股票/股权投资		98,280,526,926	368,575,723	12,872,405,975	111,521,508,624
— 债券投资		3,116,527,644	94,985,640,684	303,571,309	98,405,739,637
— 基金及其他投资		13,820,185,906	72,431,896,279	507,131,779	86,759,213,964
衍生金融资产	4	304,820,143	18,729,640,425	-	19,034,460,568
其他债权投资	9	-	47,955,748,059	-	47,955,748,059
<b>合计</b>		<b>115,522,060,619</b>	<b>234,471,501,170</b>	<b>13,683,109,063</b>	<b>363,676,670,852</b>
<b>负债</b>					
交易性金融负债	21				
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					
— 权益		(3,526,119,667)	(17,970,142)	-	(3,544,089,809)
— 债权		-	(2,111,692,347)	-	(2,111,692,347)
— 基金及其他		(108,427,686)	-	-	(108,427,686)
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					
— 权益		-	(34,480,523,978)	-	(34,480,523,978)
— 债权		-	(2,298,832,231)	-	(2,298,832,231)
衍生金融负债	4	(394,811,945)	(12,562,975,566)	-	(12,957,787,511)
<b>合计</b>		<b>(4,029,359,298)</b>	<b>(51,471,994,264)</b>	<b>-</b>	<b>(55,501,353,562)</b>

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 4、公允价值的三个层次(续)

	附注七	2021年12月31日			合计
		第一层次	第二层次	第三层次	
<b>资产</b>					
交易性金融资产	8				
— 股票/股权投资		112,422,691,042	672,818,230	14,653,820,321	127,749,329,593
— 债券投资		1,150,817,250	80,606,354,975	332,926,025	82,090,098,250
— 基金及其他投资		13,326,241,884	76,623,979,003	1,384,566,374	91,334,787,261
衍生金融资产	4	268,377,960	14,295,850,703	-	14,564,228,663
其他债权投资	9	-	43,009,969,681	-	43,009,969,681
合计		127,168,128,136	215,208,972,592	16,371,312,720	358,748,413,448
<b>负债</b>					
交易性金融负债	21				
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					
— 权益		(2,755,627,220)	(249,181)	-	(2,755,876,401)
— 债权		-	(823,345,819)	-	(823,345,819)
— 基金及其他		(658,725,019)	-	-	(658,725,019)
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					
— 权益		-	(34,162,624,317)	-	(34,162,624,317)
— 债权		-	(526,215,128)	-	(526,215,128)
衍生金融负债	4	(224,649,958)	(17,909,357,550)	-	(18,134,007,508)
合计		(3,639,002,197)	(53,421,791,995)	-	(57,060,794,192)

注1: 折现率介乎2.95% - 5.41%(2021年12月31日: 2.48% - 5.42%)。

注2: 历史波动率介乎5.71% - 125.67%(2021年12月31日: 17.85% - 88.40%)。

注3: 缺乏市场流通性的折扣为20.00% - 60.00%(2021年12月31日: 20.00% - 60.00%)。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 4、公允价值的三个层次(续)

于2022年6月30日,本集团持有的人民币0.59亿元(2021年12月31日:人民币0.01亿元)的股票,因停牌而无法取得公允市场报价导致从第一层次重分类至第二层次。

于2022年6月30日,本集团持有的人民币88,672元(2021年12月31日:人民币1.07亿元)的股票投资因摘牌等原因,未采用可观察市场报价,而使用估值技术确定其公允价值,从第一层次或第二层次重分类至第三层次。

于2022年6月30日,本集团持有的债券投资不存在(2021年12月31日:人民币0.30亿元)因可能存在信用风险等原因,未采用可观察市场报价,而使用估值技术确定其公允价值,从第二层次重分类至第三层次。

于2022年6月30日,本集团持有的基金及其他投资不存在(2021年12月31日:人民币1.81亿元)因可能存在信用风险等原因,未采用可观察市场报价,而使用估值技术确定其公允价值,从第二层次重分类至第三层次。

于2022年6月30日,本集团持有的人民币4.99亿元(2021年12月31日:人民币6.47亿元)的交易性金融资产中因股权或基金解除限售等原因,未使用估值技术,而应用可观察市场报价确定其公允价值,从第三层次重分类至第一层次或第二层次。

除上述调整外,截至2022年6月30日止6个月期间及2021年度,本集团以公允价值计量的资产和负债的三个层次之间没有发生其他重大转换。本集团是在发生转换当期/年的报告期/年末确认各层次之间的转换。



# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十二、公允价值(续)

### 4、公允价值的三个层次(续)

截至2022年6月30日止6个月期间及2021年度,本集团归类为第三层次金融工具的账面价值变动如下:

资产	2022年1月1日		转入		转出		本期利得或损失总额		购买、发行、出售和结算		2022年6月30日		期末所持资产计入当期损益的收益或损失净额
	1月1日	第三层次	第三层次	第三层次	第三层次	第三层次	计入损益	计入其他综合收益	购买	发行	出售	结算	
交易性金融资产													
— 股票/股权投资	14,653,820,321	88,672	(323,207,736)	3,068,506,754	-	(563,189,197)	-	(3,601,399,854)	(362,212,985)	12,872,405,975	(204,337,650)		
— 债券投资	332,926,025	-	-	-	-	(14,434,589)	-	(496,000)	(14,424,127)	303,571,309	(14,434,589)		
— 基金及其他投资	1,384,566,374	-	(17,602,1754)	66,167,000	-	187,060,601	-	(903,707,184)	(50,933,258)	507,131,779	9,043,354		
合计	16,371,312,720	88,672	(499,229,490)	3,134,673,754	-	(390,563,185)	-	(4,505,603,038)	(427,570,370)	13,683,109,063	(209,728,885)		
资产													
交易性金融资产													
— 股票/股权投资	17,567,429,786	107,385,658	(647,377,547)	6,361,917,941	-	1,861,809,723	-	(10,117,248,523)	(480,096,717)	14,653,820,321	2,281,247,681		
— 债券投资	432,695,788	302,486,630	(32,970)	195,228,000	-	(166,507,058)	-	(100,000,000)	(58,706,365)	332,926,025	(242,213,123)		
— 基金及其他投资	333,375,727	180,753,805	-	1,507,557,254	-	(207,569,306)	-	(953,915,925)	(75,635,181)	1,384,566,374	(239,599,087)		
合计	18,333,501,301	318,388,093	(647,410,517)	8,064,703,195	-	1,487,733,359	-	(10,571,164,448)	(614,438,263)	16,371,312,720	1,799,435,471		

截至2022年6月30日止6个月期间及2021年度,本集团公允价值计量所使用的估值技术未发生重大变更。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十三、承诺

### 1、资本承诺

本集团于资产负债表日的资本承诺如下:

	2022年6月30日	2021年12月31日
已订约但未支付	7,599,693,158	3,927,668,725

### 2、承销承诺

根据投标文件,于2022年6月30日,本集团已中标但尚未完成承销项目的承销承诺为人民币45.75亿元(2021年12月31日:人民币2.86亿元)。

## 十四、在结构化主体中的权益

### 1、在纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本集团纳入合并范围的结构化主体资产总额及持有这些结构化主体权益的账面价值如下:

	2022年6月30日	2021年12月31日
资产总额	54,907,175,504	60,543,962,370
账面价值	29,517,272,417	28,605,810,011

本集团在这些结构化主体中的最大损失敞口为本集团所持有的权益的账面价值。

### 2、在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

本集团通过直接持有投资而在第三方机构发起设立的结构化主体中享有权益。这些结构化主体主要包括金融机构理财产品、资产管理计划、基金以及信托计划等。本集团对这些结构化主体不具有控制,因此未将这些结构化主体纳入本集团合并财务报表的合并范围。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十四、在结构化主体中的权益(续)

### 2、在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益(续)

本集团于这些结构化主体中享有的权益的账面价值及最大损失敞口列示如下:

账面价值	2022年6月30日	2021年12月31日
交易性金融资产	129,736,649,682	132,554,971,825

注:截至2022年6月30日,本集团交易性金融资产人民币20,408,398,828元(2021年12月31日:人民币23,978,375,338元)与部分衍生金融工具(涉及衍生金融资产人民币64,520,191元(2021年12月31日:人民币132,629,450元)和衍生金融负债人民币1,733,230,828元(2021年12月31日:人民币2,258,315,881元))构成一揽子相关交易安排,整体对冲了交易性金融资产的损益波动,锁定该类业务的收益。

### 3、在本集团作为发起人但未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益

除已于附注十四、1中所披露的结构化主体之外,本集团在其他由本集团作为普通合伙人或管理人的结构化主体中享有权益,这些结构化主体主要包括基金、信托计划和资产管理计划。本集团对这些结构化主体不具有控制,因此未将这些结构化主体纳入本集团合并财务报表的合并范围。

本集团在这些结构化主体中享有的权益的账面价值及获得的收益列示如下:

账面价值	2022年6月30日	2021年12月31日
交易性金融资产	8,156,615,150	8,699,907,953
应收款项	1,604,431,992	1,448,802,510
长期股权投资	44,758,137	44,863,002

收益	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
资产管理及基金管理业务收入	1,556,498,666	1,456,984,677

本集团在这些结构化主体中的最大损失敞口为本集团所享有的权益的账面价值。

本集团未向上述未合并的结构化主体提供重大的财务支持,并且没有意图在未来为其提供财务或其他支持。

# 中期财务报表附注(续)

自2022年1月1日至2022年6月30日止6个月期间(除特别注明外,金额单位:人民币元)

## 十五、或有事项

本集团开展业务过程中存在因诉讼、仲裁或监管调查而导致经济利益流出本集团的风险。本集团依据企业会计准则评估后认为上述风险发生的可能性较低。于资产负债表日,本集团不存在对合并财务状况具有重大影响的未决或有事项。

## 十六、资产负债表日后事项

### 1、公司债券

2022年7月18日,本集团完成2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)的发行工作,其中品种一简称为“22中财G3”,发行规模为人民币20亿元,期限为3年,票面利率为2.83%;其中品种二简称为“22中财G4”,发行规模为人民币10亿元,期限为5年,票面利率为3.20%。2022年8月11日,本集团完成2022年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第一期)的发行工作,该短期公司债券简称为“22中财S1”,发行规模为人民币20亿元,期限为1年,票面利率为2.04%。2022年8月29日,本集团完成2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)的发行工作,其中品种一简称为“22中财G5”,发行规模为人民币15亿元,期限为3年,票面利率为2.69%;其中品种二简称为“22中财G6”,发行规模为人民币15亿元,期限为5年,票面利率为3.06%。

本集团于2022年7月18日兑付本金为人民币10亿元的公司债券17中投F2,于2022年8月9日兑付本金为人民币20亿元的短期公司债券21中财S1。

### 2、次级债券

本集团于2022年7月25日兑付本金为人民币15亿元的次级债券17中金C2。

### 3、金融债券

本集团于2022年8月22日兑付本金为人民币25亿元的金融债券19中金公司金融债01。

### 4、利润分配

2022年6月23日,本公司2021年度股东大会审议通过了2021年度利润分配方案,宣告派发现金股利总额为人民币1,448,177,060元。本公司已于2022年8月采用现金分红的方式派发相关现金股利。

# 补充资料

## 1、非经常性损益明细表

	截至6月30日止6个月期间	
	2022年	2021年
非流动资产处置收益	1,434,630	1,427,204
计入当期损益的政府补助(与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照国家统一标准定额或定量持续享受的政府补助除外)	119,726,176	82,092,695
除上述各项之外的其他营业外收支净额	(16,783,281)	(10,569,416)
其他符合非经常性损益定义的损益项目	(122,676)	(2,852)
合计	104,254,849	72,947,631
非经常性损益的所得税影响额	(26,033,985)	(18,333,773)
非经常性损益的影响额	78,220,864	54,613,858
归属于母公司股东的非经常性损益的影响额	77,577,187	54,613,858
归属少数股东的非经常性损益的影响额	643,677	-

上述非经常性损益明细表系按照证监会颁布的《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号—非经常性损益(2008)》(证监会公告[2008]43号)的要求确定和披露。

## 2、净资产收益率及每股收益

	报告期利润	加权平均 净资产收益率	每股收益	
			基本每股收益	稀释每股收益
截至2022年6月30日止6个月期间	归属于母公司普通股股东的净利润	4.59%	0.74	不适用
	扣除非经常性损益后归属于母公司普通股股东的净利润	4.49%	0.73	不适用
截至2021年6月30日止6个月期间	归属于母公司普通股股东的净利润	7.04%	1.00	不适用
	扣除非经常性损益后归属于母公司普通股股东的净利润	6.96%	0.99	不适用

上述净资产收益率和每股收益计算表系按照证监会颁布的《公开发行证券的公司信息披露编报规则第9号—净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010年修订)的相关规定编制。

## 3、按企业会计准则编制的财务报表与按国际财务报告准则编制的财务报表的差异

本集团除按照企业会计准则编制合并财务报表外,还按照国际财务报告准则编制合并财务报表,本集团按照企业会计准则编制的合并财务报表与按照国际财务报告准则编制的合并财务报表中列示的2022年1月1日至6月30日期间及2021年1月1日至6月30日止期间的净利润以及于2022年6月30日及2021年12月31日的股东权益并无差异。

## 备查文件目录

- 1、 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。
- 2、 报告期内公司在上交所网站和公司指定信息披露媒体公开披露过的所有文件的正本及公告的原稿。
- 3、 在其他证券市场公布的半年度报告。

## 证券公司信息披露

重大行政许可事项的相关情况：无



# 附录

## 公司主要业务资格

- (1) 1995年，经营外汇业务许可证，国家外汇管理局（2015年更换为证券业务外汇经营许可证）
- (2) 1996年，上海证券交易所会员，上海证券交易所
- (3) 1997年，深圳证券交易所会员，深圳证券交易所
- (4) 1999年，境内外政府债券、公司债券、企业债券的承销、自营和经纪业务资格，中国证监会
- (5) 1999年，获批进入全国银行间同业市场，中国人民银行
- (6) 2000年，中国国债协会会员，中国国债协会
- (7) 2001年，人民币普通股票经纪业务资格，中国证监会
- (8) 2002年，证券投资咨询业务资格，中国证监会
- (9) 2002年，受托投资管理业务资格，中国证监会
- (10) 2004年，获批成为首批保荐机构，中国证监会
- (11) 2004年，网上证券委托业务资格，中国证监会
- (12) 2004年，开放式证券投资基金代销业务资格，中国证监会
- (13) 2004年，从事创新活动证券公司，中国证券业协会
- (14) 2004年，全国社保基金投资管理人资格，全国社会保障基金理事会
- (15) 2005年，获批设立中金短期债券集合资产管理计划，中国证监会
- (16) 2005年，短期融资券承销业务资格，中国人民银行
- (17) 2005年，全国银行间债券市场债券远期交易业务资格，中国人民银行
- (18) 2005年，大宗债券双边报价商资格，上海证券交易所

## 附录

- (19) 2005年，权证交易业务资格，上海证券交易所
- (20) 2005年，企业年金基金管理人资格，中华人民共和国人力资源和社会保障部
- (21) 2005年，外汇资产管理业务资格，中国证券业协会
- (22) 2006年，上证180交易型开放式指数证券投资基金（即ETF）一级交易商资格，上海证券交易所
- (23) 2006年，全国社保基金境外投资管理人资格，全国社会保障基金理事会
- (24) 2006年，中证登结算参与者资格，中国证券登记结算有限公司
- (25) 2007年，客户交易结算资金第三方存管方案获通过，北京证监局
- (26) 2007年，上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格，上海证券交易所
- (27) 2007年，作为合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务，中国证监会
- (28) 2007年，上证基金通业务资格，上海证券交易所
- (29) 2007年，获批开展直接投资业务（通过发起设立全资控股的直投公司），中国证监会
- (30) 2007年，从事银行间市场利率互换业务资格，中国证监会
- (31) 2008年，中证登甲类结算参与者资格，中国证券登记结算有限公司
- (32) 2008年，短期融资券主承销业务资格，中国人民银行
- (33) 2008年，获批设立中金增强型债券收益集合资产管理计划，中国证监会
- (34) 2009年，天津排放权交易所会员，天津排放权交易所
- (35) 2010年，开展人民币普通股票自营业务资格，中国证监会
- (36) 2010年，为期货公司提供中间介绍业务资格，中国证监会
- (37) 2010年，全国银行间债券市场做市商，中国人民银行

# 附录

- (38) 2010年，开展境外证券投资定向资产管理业务资格，中国证监会
- (39) 2010年，银行间市场清算所股份有限公司普通清算会员，银行间市场清算所股份有限公司
- (40) 2010年，融资融券业务资格，中国证监会
- (41) 2011年，三板市场代办系统主办券商业务资格，中国证券业协会
- (42) 2011年，获批增加中金增强型债券收益集合资产管理计划及中金基金优选集合资产管理计划代理推广机构，中国证监会北京监管局
- (43) 2011年，2012-2014年记账式国债承销团成员资格，财政部、中国人民银行、中国证监会
- (44) 2011年，获批发起设立战略性新兴产业投资基金，中国国家发展和改革委员会
- (45) 2012年，开展中小企业私募债业务资格，中国证券业协会
- (46) 2012年，债券质押式报价回购业务，中国证监会
- (47) 2012年，保险资金投资管理人资格，中国保险监督管理委员会
- (48) 2012年，约定购回式证券交易权限，上海证券交易所
- (49) 2012年，转融通、转融资本业务资格，中国证券金融股份有限公司
- (50) 2012年，扩大债券质押式报价回购业务融入资金投资范围，上海证券交易所
- (51) 2012年，设立专业子公司开展不动产直投资基金业务资格，中国证监会
- (52) 2013年，柜台交易业务资格，中国证券业协会
- (53) 2013年，股票质押式回购业务交易权限，上海证券交易所、深圳证券交易所
- (54) 2013年，权益类互换交易业务资格，中国证券业协会
- (55) 2013年，代销金融产品业务资格，中国证监会北京监管局



## 附录

- (56) 2013年，全国中小企业股份转让系统推荐、经纪业务资格，全国中小企业股份转让系统有限责任公司
- (57) 2013年，见证开户业务资格，中国证券登记结算有限责任公司
- (58) 2013年，基金分拆转换及合并转换业务资格，中国证券登记结算有限责任公司
- (59) 2013年，军工涉密业务咨询服务资格，2017年延续该资质，国家国防科技工业局
- (60) 2013年，约定购回式证券交易权限，深圳证券交易所
- (61) 2014年，公募基金业务资格(通过发起设立全资控股的基金公司)，中国证监会
- (62) 2014年，保险机构特殊机构客户业务，中国保险监督管理委员会
- (63) 2014年，网络开户业务资格，中国证券登记结算有限责任公司
- (64) 2014年，全国中小企业股份转让系统做市业务资格，全国中小企业股份转让系统公司
- (65) 2014年，港股通业务资格，上海证券交易所
- (66) 2014年，场外发行收益凭证业务资格，中证机构间报价系统股份有限公司
- (67) 2015年，股票期权经纪业务、自营业务资格，上海证券交易所、深圳证券交易所
- (68) 2015年，互联网金融业务资格，中国证监会
- (69) 2015年，私募基金综合托管业务资格，中国证券投资者保护基金有限责任公司
- (70) 2015年，代理证券远程质押登记业务资格，中国证券登记结算有限责任公司
- (71) 2015年，贵金属现货代理业务、黄金现货自营业务资格、上海黄金交易所会员，中国证监会、上海黄金交易所
- (72) 2015年，证券投资基金托管业务资格，中国证监会
- (73) 2016年，上海清算所标准债券远期集中清算业务资格，银行间市场清算所股份有限公司
- (74) 2016年，深港通下港股通业务资格，深圳证券交易所

# 附录

- (75) 2017年，全国银行间同业拆借中心债券通北向通报机构资格，中国外汇交易中心
- (76) 2017年，原经营证券业务许可证换发为经营证券期货业务许可证，中国证监会
- (77) 2018年，试点开展跨境业务资格，中国证监会
- (78) 2018年，场外期权一级交易商资格，中国证监会
- (79) 2019年，信用保护合约核心交易商资格，上海证券交易所
- (80) 2019年，上市公司股权激励行权融资业务试点资格，深圳证券交易所
- (81) 2019年，私募基金服务资格(包括份额登记业务服务资格、估值核算业务服务资格)，证券投资基金业协会
- (82) 2019年，信用保护合约核心交易商，深圳证券交易所
- (83) 2019年，上市基金主做市商业资格，上海证券交易所
- (84) 2019年，中国银行业协会会员，中国银行业协会
- (85) 2019年，科创板转融券业务资格，中国证券金融公司
- (86) 2019年，商品期权做市业务资格，中国证监会
- (87) 2019年，股票期权业务交易权限，深圳证券交易所
- (88) 2019年，上海证券交易所信用保护凭证创设机构，上海证券交易所
- (89) 2020年，试点开展利率期权业务，中国外汇交易中心
- (90) 2020年，基金投资顾问业务试点资格，中国证监会
- (91) 2020年，热轧卷板期货做市商资格，上海期货交易所
- (92) 2020年，代客外汇业务备案(为合法合规从事跨境投融资交易的客户(含自身)办理结售汇；人民币结构性产品(QUANTO)；代客外汇买卖业务)，国家外汇管理局

## 附录

- (93) 2020年，独立开展非金融企业债务融资工具主承销业务资格，中国银行间市场交易商协会
- (94) 2020年，结售汇业务经营资格，国家外汇管理局
- (95) 2020年，银行间外汇市场会员，中国外汇交易中心
- (96) 2020年，深圳证券交易所信用保护凭证创设机构，深圳证券交易所
- (97) 2021年，开展商品期货做市业务资格，中国证监会
- (98) 2021年，股票期权做市业务资格，中国证监会
- (99) 2021年，北京证券交易所会员资格，北京证券交易所
- (100) 2021年，内地与香港债券市场互联互通南向合作（“南向通”）业务资格，中国人民银行
- (101) 2021年，开展国债期货做市业务资格，中国证监会
- (102) 2021年，非银行金融机构开展代客结售汇试点业务资格，国家外汇管理局
- (103) 2022年，深圳证券交易所沪深300ETF期权一般做市商资格，深圳证券交易所
- (104) 2022年，上海证券交易所上证50ETF期权和沪深300ETF期权一般做市商资格，上海证券交易所





**CICC**  
**中金公司**