

【上海C31】
 2019年1月1日,根据修订后的金融工具准则,本行可供出售金融资产重分类6.12亿元至其他权益工具投资,重分类影响金额为0.12亿元,重新计量调整账面价值0.01亿元。截至2019年1月1日,本行其他权益工具投资的公允价值为4.14亿元。
 截至2019年12月31日和2018年6月30日,本行其他权益工具投资金额分别为5.15亿元和4.46亿元,公允价值变动分别为0.06%和0.85%,均高于上市股权投资公允价值。
 (6)公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产分别为115.54亿元和178.21亿元,公允价值变动分别为13.96%和23.08%。截至2018年12月31日,本行以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产余额较2017年末增长54.70%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资规模所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行可供出售金融资产当期损益的金融资产的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
政府债券	888	0.85	0	0.00
政策性银行债券	13,557	12.74	18,728	14.21
企业债券	458	0.43	-	-
金融债券	12,698	11.74	8,993	6.78
其他权益工具	1,127	1.05	1,206	0.91
基金投资	168	0.16	215	1.66
股权投资	292	0.27	1,950	16.88
其他股权投资	15,132	13.95	8,975	6.78
其他	101	0.12	600	4.52
合计	117,874	100.00	115,544	100.00

本行持有以公允价值计量的且其变动计入当期损益的金融资产,主要是股票型基金,其损益计入当期损益并结转至所有者权益。截至2019年12月31日和2017年12月31日,本行持有以公允价值计量的且其变动计入当期损益的金融资产的比例分别为95.92%和91.45%。
 (7)可供出售金融资产
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行持有的可供出售金融资产余额分别为4,206.85亿元和4,017.67亿元,公允价值变动分别为50.49%和33.61%。截至2019年12月31日,本行可供出售金融资产余额较2017年末增长4.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资规模所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行可供出售金融资产的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
政府债券	3,134	6.79	2,647	6.63
政策性银行债券	15,885	34.54	16,770	41.90
企业债券	15,885	34.54	15,842	40.01
金融债券	15,885	34.54	15,842	40.01
其他权益工具	1,127	2.37	1,206	3.02
基金投资	168	0.36	215	0.54
股权投资	292	0.64	1,950	48.88
其他股权投资	15,132	31.81	8,975	22.35
其他	101	0.12	600	15.00
合计	47,976	100.00	42,069	100.00

本行持有的可供出售金融资产主要是以权益类投资为主的非保本理财产品等。截至2019年12月31日和2018年12月31日,合计可供出售金融资产余额占比分别为81.24%和81.60%。
 (8)持有至到期投资
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行持有的持有至到期投资余额分别为2,642.63亿元和3,106.43亿元,公允价值变动分别为31.71%和36.16%。截至2019年12月31日,本行持有至到期投资较2017年末增长17.55%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资和企业债券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行持有至到期投资的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
政府债券	262,851	84.39	211,228	87.50
政策性银行债券	18,485	5.62	16,770	7.10
企业债券	15,886	4.93	15,534	5.47
金融债券	14,838	4.76	3,750	1.42
其他权益工具	1,127	0.34	1,206	0.45
基金投资	11,471	3.49	28,565	10.80
股权投资	827	0.25	40	0.01
其他股权投资	10,643	3.18	24,263	8.77
合计	310,990	100.00	240,685	100.00

本行持有至到期投资主要包括以权益类投资为主的非保本理财产品等。截至2019年12月31日和2018年12月31日,合计持有至到期投资余额占比分别为94.60%和90.31%。
 (9)应收款项类投资
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行应收款项类投资余额分别为1,367.01亿元和1,887.65亿元,公允价值变动分别为16.41%和14.99%。截至2019年12月31日,本行应收款项类投资较2017年末增长2.81%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行应收款项类投资的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
政府债券	7,736	5.74	8,390	5.81
金融债券	6,648	4.93	500	0.35
企业债券	300	0.22	100	0.07
合计	12,684	89.10	13,522	95.77
其他权益工具	11,175	100.00	14,443	100.00
其他	6,011	43.72	7,612	55.00
减值准备	128,765	-	136,703	-

本行应收款项类投资主要为权益类信托计划及资产管理计划。截至2019年12月31日和2018年12月31日,合计应收款项类投资余额占比分别为93.77%和89.10%。
 (10)存放同业及其他金融机构款项
 本行存放同业及其他金融机构款项主要包括存放中央银行法定存款准备金、超额存款准备金、存放同业款项、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放同业及其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元和1,643.40亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放同业及其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放同业及其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项,均属于存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额分别为1,451.06亿元、1,402.57亿元、1,643.40亿元、1,402.57亿元和1,402.57亿元,公允价值变动分别为7.53%、7.66%、6.27%和6.88%。报告期内,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项余额较2017年末增长1.99%,主要原因系本行调整资产配置结构,扩大证券投资所致。
 截至2019年12月31日和2018年12月31日,本行存放中央银行法定存款准备金、存放中央银行超额存款准备金、存放其他金融机构款项、存放境外中央银行款项、存放其他金融机构款项的结构如下表所示:

项目	2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比
存放中央银行法定存款准备金	1,043,200	72.25	1,043,200	72.25
存放中央银行超额存款准备金	1,147,000	80.33	1,147,000	80.33
存放其他金融机构	1,451,060	100.00	1,451,060	100.00
存放境外中央银行	1,402,570	99.31	1,402,570	99.31
其他	1,643,400	100.00	1,643,400	100.00
合计	1,451,060	100.00	1,402,570	99.31

报告期内,本行卖出回购金融资产款项的主要原因是本行为满足自身经营需要及对资金的需求,实施债券质押式回购并转入自有资金。
 (4)发行债券
 本行发行债券分为公募和私募,主要用于补充资本和补充流动性。本行发行债券的资产实力和良好的偿付能力,均得到市场认可,不存在违约或偿付困难的情况。截至报告期末,本行已发行债券余额分别为1,681.48亿元、1,893.76亿元、1,907.12亿元和1,779.38亿元。
 截至报告期末,本行已发行债券的结构如下表所示:

项目	2020年6月30日		2019年12月31日		2018年12月31日		2017年12月31日	
	金额	占比	金额	占比	金额	占比	金额	占比
已发行债券	1,403.07	78.74	1,494.41	78.34	1,663.95	87.85	1,580.86	89.59
未发行债券	29.97	16.86	34.96	18.35	143.93	7.92	143.93	8.91
其他	3,532	1.99	3,464	1.82	3,425	1.81	651	0.39
合计	1,733.08	100.00	1,937.32	100.00	2,032.33	100.00	1,868.72	100.00

报告期内,本行的净利润分别为153.37亿元、180.68亿元、203.33亿元和111.48亿元,2017年至2019年年均复合增长率为15.14%。
 报告期内,本行净利润的结构如下表所示:

项目	2020年1-6月	
----	-----------	--