

(上接A50版)

7.次级债券投资资产
买入返售交易是按照合同约定的定价向受托人支付相同的金额。买入返售长期债券、本公司持有的

资金类产品的或以收取权利为基础的定价向受托人支付相同的金额。

报告期末,本公司持有的次级债券投资资产的公允价值变动情况如下:

单位:亿元

项目 2019年12月31日 2018年12月31日 2017年12月31日

股票质押式回购 2,106,898.22 2,283,969.48 3,069,593.88

债息票券式回购 1,489,034.00 929,430.27 431,685.00

买入返售式回购 - 106,640.00 122,710.00

应付利息 3,272.22 6,412.72 14,030.10

长期应收款 33,230.00 19,073.36 14,030.10

短期投资准备金 3,567,982.46 3,304,386.01 3,609,932.37

应收票据及应收账款合 计 3,606,932.46 3,304,386.01 3,609,932.37

截至2017年12月31日,本公司持有的,适用减值准备的金融资产包括融资融券款、买入返售金融资产、可供出售金融资产、应收款项目和其组合、买入返售长期债券、本公司持有的,适用减值准备的金融资产的公允价值变动情况如下:

单位:亿元

项目 2019年12月31日 2018年12月31日 2017年12月31日

股票质押式回购 2,106,898.22 2,283,969.48 3,069,593.88

债息票券式回购 1,489,034.00 929,430.27 431,685.00

买入返售式回购 - 106,640.00 122,710.00

应付利息 3,272.22 6,412.72 14,030.10

长期应收款 33,230.00 19,073.36 14,030.10

短期投资准备金 3,567,982.46 3,304,386.01 3,609,932.37

截至2017年12月31日,本公司持有的,适用减值准备的金融资产包括融资融券款、买入返售金融资产、可供出售金融资产、应收款项目和其组合、买入返售长期债券、本公司持有的,适用减值准备的金融资产的公允价值变动情况如下:

单位:亿元

项目 2019年12月31日 2018年12月31日 2017年12月31日

债券投资 67,676.50

存放同业款项 7,893.70

融资融券 100,463.00

买入返售 13,454.77

合计 189,497.07

截至2018年12月31日和2019年12月31日,本公司债券工具产生的应收利息已计入相关应付债券面值,单位:万元

项目 2017年12月31日 2018年12月31日

债券投资 3,660,642.27

其中: 初期成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

2.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司可供出售金融资产主要包括股票、基金、证券公司理财产品、应付债券等,其中,"其他"主要是本公司委托给证券金融股份有限公司管理的客户投资,具体构成情况如下:

单位:万元

项目 2017年12月31日

债券 3,660,642.27

其中: 初始成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

3.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司可供出售金融资产主要包括股票、基金、证券公司理财产品、应付债券等,其中,"其他"主要是本公司委托给证券金融股份有限公司管理的客户投资,具体构成情况如下:

单位:万元

项目 2017年12月31日

债券 3,660,642.27

其中: 初始成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

4.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司可供出售金融资产主要包括股票、基金、证券公司理财产品、应付债券等,其中,"其他"主要是本公司委托给证券金融股份有限公司管理的客户投资,具体构成情况如下:

单位:万元

项目 2017年12月31日

债券 3,660,642.27

其中: 初始成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

5.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司可供出售金融资产主要包括股票、基金、证券公司理财产品、应付债券等,其中,"其他"主要是本公司委托给证券金融股份有限公司管理的客户投资,具体构成情况如下:

单位:万元

项目 2017年12月31日

债券 3,660,642.27

其中: 初始成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

6.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司可供出售金融资产主要包括股票、基金、证券公司理财产品、应付债券等,其中,"其他"主要是本公司委托给证券金融股份有限公司管理的客户投资,具体构成情况如下:

单位:万元

项目 2017年12月31日

债券 3,660,642.27

其中: 初始成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

7.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司可供出售金融资产主要包括股票、基金、证券公司理财产品、应付债券等,其中,"其他"主要是本公司委托给证券金融股份有限公司管理的客户投资,具体构成情况如下:

单位:万元

项目 2017年12月31日

债券 3,660,642.27

其中: 初始成本 3,652,126.58

公允价值变动 -21,484.31

税 费 1,256,331.02

其中: 初始成本 1,222,190.37

公允价值变动 34,141.65

基金 2,069,396.93

其中: 初始成本 2,064,095.93

公允价值变动 4,307.40

其他 321,667.92

其中: 初始成本 313,723.97

公允价值变动 7,933.20

公允价值合计 7,307,027.47

8.可供出售金融资产

截至2017年12月31日,本公司应收利息的构成情况如下:

</div