

中国对外经济贸易信托有限公司

**2019 年年度报告**

## 中国对外经济贸易信托有限公司 2019 年年度报告

## 目录

1、重要提示.....	2
2、公司概况.....	3
2.1 公司简介.....	3
2.2 组织结构图.....	5
3、公司治理.....	6
3.1 公司治理结构.....	6
3.2 公司治理信息.....	14
4、经营管理.....	19
4.1 经营目标、方针、战略规划.....	19
4.2 所经营业务的主要内容.....	19
4.3 市场分析.....	20
4.4 内部控制.....	22
4.5 风险管理.....	27
5、报告期末及上一年度末的比较式会计报表.....	34
5.1 自营资产.....	34
5.2 信托资产.....	41
6、会计报表附注.....	42
6.1 会计报表编制基准说明.....	42
6.2 重要会计政策和会计估计说明.....	43
6.3 或有事项说明.....	48
6.4 重要资产转让及其出售的说明.....	48
6.5 会计报表中重要项目的明细资料.....	48
6.6 关联方关系及其交易的披露.....	52
6.7 会计制度的披露.....	54
7、财务情况说明书.....	55
7.1 利润实现和分配情况.....	55
7.2 主要财务指标.....	55
7.3 对本公司财务状况、经营成果有重大影响的其他事项.....	55
7.4 本公司净资本情况.....	55
8、特别事项简要揭示.....	57

## 中国对外经济贸易信托有限公司 2019 年年度报告

### 1、重要提示

1.1 中国对外经济贸易信托有限公司（以下简称“公司”、“中国外贸信托”或“外贸信托”）董事会及董事保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

#### 1.2 个别董事声明

无。

1.3 本公司独立董事张向东、成长青、卢力平声明：保证本报告内容的真实性、准确性、完整性。

1.4 毕马威华振会计师事务所对本公司年度财务报告进行审计，出具了标准无保留意见的审计报告。

1.5 本公司董事长杨林、财务总监帅立新声明：保证年度报告中财务报告的真实、完整。

## 2、公司概况

### 2.1 公司简介

#### 2.1.1 公司历史沿革

中国对外经济贸易信托有限公司（以下简称“公司”、“中国外贸信托”或“外贸信托”）于 1987 年 9 月 30 日经中国人民银行批准在北京成立，同年 12 月 18 日正式开业。前身是中国对外经济贸易信托投资有限公司。

1994 年 12 月 31 日，国务院批准外贸信托加入中国化工进出口总公司（2003 年 11 月更名为中国中化集团公司，2017 年 12 月更名为中国中化集团有限公司，以下简称“中化集团”），与原中化财务公司合并。

2002 年 9 月，外贸信托经中国人民银行批准重新登记，并获颁《信托机构法人许可证》，成为受中国银行业监督管理委员会直接监管的信托投资公司。重新登记后的外贸信托股东为中国中化集团有限公司（持股比例 90%）和中化化肥公司（持股比例 10%）。公司注册资本 8.32 亿元人民币（含 3,400 万美元）。

2005 年 6 月 1 日，根据中国银行业监督管理委员会（银监复【2005】141 号文）的批复，远东国际租赁有限公司获准受让中化化肥公司所持外贸信托 10% 的股权。此次股东变更后，公司股东为中国中化集团有限公司（持股比例 90%）和远东国际租赁有限公司（持股比例 10%）。

2007 年 9 月，《中国银监会关于中国对外经济贸易信托投资有限公司变更公司名称和业务范围的批复》（银监复【2007】391 号文）同意外贸信托变更业务范围，依据新办法开展业务，并同意外贸信托将公司名称变更为“中国对外经济贸易信托有限公司”。外贸信托换领了新的金融许可证。根据中国银行业监督管理委员会（银监复【2008】8 号文）批复，公司注册资本金增至 12 亿元人民币（含 3,400 万美元）。此次注册资本金变更后，公司股东中国中化集团有限公司持股比例为 93.07%，远东国际租赁有限公司持股比例为 6.93%。

2009 年 7 月 24 日，根据中国银行业监督管理委员会（银监复【2009】262 号文）批复，中国中化股份有限公司（以下简称“中化股份”）获准受让中国中化集团公司所持外贸信托 93.07% 的股权。此次股东变更后，公司股东为中国中化

股份有限公司（持股比例 93.07%）和远东国际租赁有限公司（持股比例为 6.93%）。

2010 年 3 月 23 日，根据中国银行业监督管理委员会（银监复【2010】127 号文）批复，中化集团财务有限责任公司获准受让远东国际租赁有限公司所持有的外贸信托 6.93% 的股权。此次变更后，公司股权结构变更为：中国中化股份有限公司持股 93.07%、中化集团财务有限责任公司持股 6.93%。

2010 年 7 月 30 日，根据中国银行业监督管理委员会（银监复【2010】360 号文）批复，公司注册资本金增至 22 亿元人民币（含 3,400 万美元）。此次注册资本金变更后，中国中化股份有限公司持股 96.22%，中化集团财务有限责任公司持股 3.78%。

2018 年 9 月 10 日，经中国银行保险监督管理委员会北京监管局核准（京银监复【2018】450 号文）批复，中国中化股份有限公司将其持有的外贸信托 96.22% 股权无偿划转给中化资本有限公司，外贸信托注册资本由人民币 22 亿元增至人民币 2,740,621,140.33 元（含 3,400 万美元），由中化资本有限公司出资。经变更股权及增资后，中化资本有限公司持股 96.97%；中化集团财务有限责任公司持股 3.03%。

2019 年 9 月 30 日，经中国银行保险监督管理委员会北京监管局核准（京银保监复【2019】791 号），外贸信托注册资本由人民币 2,740,621,140.33 元增加至人民币 80 亿元。增资后，股东中化资本有限公司持股 97.26%，中化集团财务有限责任公司持股 2.74%。

#### 2.1.2 法定名称

中文：中国对外经济贸易信托有限公司（缩写：中国外贸信托/外贸信托）

英文：CHINA FOREIGN ECONOMY AND TRADE TRUST CO.,LTD.（缩写：FOTIC）

#### 2.1.3 法定代表人：杨林

2.1.4 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心中座 6 层

邮政编码：100031

国际互联网网址：[www.fotic.com.cn](http://www.fotic.com.cn)

电子信箱：[fotic@sinochem.com](mailto:fotic@sinochem.com)

2.1.5 信息披露事务负责人：屈鹏

联系电话：010—59567790

传真：010—59569888

电子信箱：qupeng@sinochem.com

2.1.6 信息披露报纸：《上海证券报》、《金融时报》

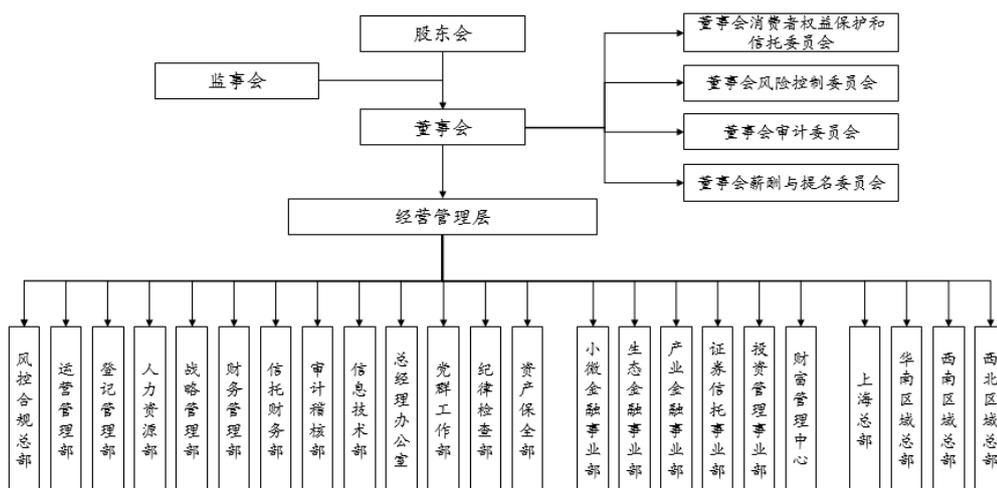
2.1.7 年度报告备置地点：中国外贸信托总经理办公室

2.1.8 聘请会计师事务所：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：中国北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2.2 组织结构图

图 2.2



### 3、公司治理

#### 3.1 公司治理结构

##### 3.1.1 股东

股东总数：2

股东结构

表 3.1.1

股东名称	持股比例	法人代表	注册资本	注册地址	主要经营业务及主要财务情况
中化资本有限公司	97.26%	杨林	人民币 7,781,053,953.26 元（其中包含 34,000,728.61 美 元）	中国（上海）自由贸 易试验区华申路 218 号 B3 楼东南部位	投资管理；资产管理；实业投 资；企业管理咨询；投资咨询。 截至 2019 年 12 月 31 日，公 司资产总额（合并）232.32 亿 元人民币。2019 年度，公司实 现营业收入（合并）31.03 亿 元人民币，利润总额（合并） 25.32 亿元人民币。
中化集团财 务有限责任 公司	2.74%	杨林	人民币 218,946,046.74 元	北京市西城区复兴门 内大街 28 号凯晨世 贸中心中座	对成员单位办理财务和融资 顾问、信用鉴证及相关的咨 询、代理业务；协助成员单位 实现交易款项的收付；对成员 单位提供担保；办理成员单位 之间的委托贷款及委托投资； 对成员单位办理票据承兑与 贴现；办理成员单位之间的内 部转账结算及相应的结算、清 算方案设计；吸收成员单位的 存款；对成员单位办理贷款及 融资租赁；从事同业拆借；承 销成员单位的企业债券；经批 准发行财务公司债券；对金融 机构的股权投资；有价证券投资； 对成员单位产品的买方信 贷。 截至 2019 年 12 月 31 日，公 司资产总额 310.77 亿元人民 币。2019 年，公司实现营业收 入 8.48 亿元人民币，利润总额 7.07 亿元人民币。

备注：中国外贸信托主要股东为中化资本有限公司，中化资本有限公司的控股股东、最终受益人为中国中化股份有限公司，实际控制人为中国中化集团有限公司，且无一致行动人；中化资本有限公司的关联方为实际控制人、控股股东控制或者参股的 600 多家企业；中化资本有限公司未出质我司股权。

### 3.1.2 董事、董事会及其下属委员会（截至 2019 年 12 月 31 日）

#### 3.1.2.1 董事会成员

表 3.1.2.1

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	所推举的股东名称	该股东持股比例	简要履历
杨林	董事长	男	56	2014 年 8 月	中化资本有限公司	97.26%	曾任商业部管理干部培训中心教员，德国西门子公司西南分公司职员，德国威拉公司中国总部产品部经理，中国化工进出口总公司计财本部财务处科员、财务科科长、总经理助理，中国化工进出口总公司财务部副总经理，中国化工进出口总公司资金管理部部长，中国中化集团公司资金管理部部长兼投资发展部副总经理，中国中化集团公司副总会计师兼中国中化股份有限公司财务副总监。现任中国中化集团有限公司副总会计师兼中国中化股份有限公司财务总监，中化集团金融事业部总裁，中国对外经济贸易信托有限公司董事长。
李强	董事	男	48	2019 年 4 月	中化资本有限公司	97.26%	曾任中国中化集团有限公司经办室职员、企业发展部规划科副科长、企业发展部规划科经理、战略规划部副总经理、中化管理学院副院长(主持工作)、党组书记、董事会秘书、办公厅主任，并曾任中国外贸信托总经理助理、中国中化股份有限公司办公厅主任；现任中化集团金融事业部党委委员、常务副总裁，并兼任中化资本投资管理有限责任公司总经理、中国对外经济贸易信托有限公司董事。
伊力扎提	董事	男	44	2017 年 2 月	中化资本有限公司	97.26%	曾任吉通网络通信股份有限公司人力资源部副总经理，中国中化集团公司石油中心人力资源部副总经理、总经理，中化国际石油

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	所推举的股东名称	该股东持股比例	简要履历
							公司总经理助理、副总经理，中国对外经济贸易信托有限公司副总经理；报告期内任中国对外经济贸易信托有限公司党委书记、董事、总经理，中化集团金融事业部副总裁。
程永	董事	男	46	2019年4月	中化资本有限公司	97.26%	历任中化集团有限公司战略规划部规划科副经理、经理，战略规划部总经理助理、副总经理、总经理，中化现代农业有限公司党总支书记、总经理，中化集团农业事业部党委委员、党委副书记、副总裁，并曾任中国对外经济贸易信托有限公司；现任中化集团人力资源部副总监（主持工作，部门正职待遇），并兼任中国对外经济贸易信托有限公司董事。

## 3.1.2.2 独立董事

表 3.1.2.2

姓名	所在单位及职务	性别	年龄	选任日期	所推举的股东名称	该股东持股比例	简要履历
张向东	退休	男	62	2019年6月	中化资本有限公司	97.26%	曾任国家外汇管理局条法处副主任科员、主任科员，国家外汇管理局外资司投资处副处长、综合处处长、投资处处长，国家外汇管理局资本司外债处处长，中国人民银行海口中心支行副行长/国家外汇管理局海南省分局副局长，国家外汇管理局综合司副司长（负责国家外汇管理局外汇管理的法规建设工作）、局级巡视员；中央汇金公司派驻中国建设银行董事、董事会风险委员会主席，中央汇金公司候任董事，中央

姓名	所在单位及职务	性别	年龄	选任日期	所推举的股东名称	该股东持股比例	简要履历
							汇金公司派驻中国银行董事、董事会人事与薪酬委员会副主席。现任中国对外经济贸易信托有限公司独立董事。
成长青	驰卓投资有限公司执行董事	男	57	2015年4月	中化资本有限公司	97.26%	曾任美国亚历山大咨询有限公司管理咨询员，加拿大多伦多道明银行客户经理，美国第一银行大中华信贷审批主管、中国市场部总经理，英国渣打银行北京分行副行长、中国企业部主管、企业咨询董事总经理，高盛高华证券有限责任公司董事总经理、驰卓投资有限公司执行董事。现任拜腾公司首席资本与投资官，中国对外经济贸易信托有限公司独立董事。
卢力平	北京国家会计学院教授、金融系主任	男	63	2015年4月	中化资本有限公司	97.26%	曾任天津电子仪表局公务员、处长，天津中环集团处长。现任北京国家会计学院教授，中国对外经济贸易信托有限公司独立董事。

## 3.1.2.3 董事会下属委员会

表 3.1.2.3

董事会下属委员会名称	职责	组成人员姓名	职务
董事会风险控制委员会	以全面风险管理为目的，对公司经理层风险管理工作进行指导及监督，为董事会提供决策支持意见和管理改善建议，并在授权范围内进行审批决策。	李强	主席
		程永	委员
		张向东	委员

董事会消费者权益保护和信托委员会	督促公司依法履行信托职责；对公司信托业务运行情况进行定期评估；针对中国银监会及其派出机构检查公司信托业务后提出的整改意见，研究提出具体措施；当股东利益、公司利益与受益人利益发生冲突时，研究提出维护受益人利益的具体措施。	成长青	主席
		李强	委员
		程永	委员
董事会审计委员会	负责内部及外部审计工作，对公司内部控制管理工作进行监督，核查财务信息披露等。	张向东	主席
		成长青	委员
		卢力平	委员
董事会薪酬与提名委员会	负责研究、制定公司高级管理人员的选择标准、程序和方法以及总经理继任计划；负责拟订公司高级管理人员的经营业绩考核办法和薪酬管理办法。对提名的高级管理人员人选进行考察。	卢力平	主席
		张向东	委员
		成长青	委员

## 3.1.3 监事、监事会及其下属委员会（截至 2019 年 12 月 31 日）

## 监事会成员

表 3.1.3

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	所推举的股东名称	该股东持股比例	简要履历
刘剑	监事会主席	男	53	2019 年 1 月	中化资本有限公司	97.26%	曾任中国工业机械进出口公司财务部职员、副科长、科长，中机海川公司财务部经理，中化化肥公司财务部职员、副总经理，中国中化集团公司保险部副总经理、总经理，中化集团财务有限责任公司总经理。现任中化集团金融事业部副总裁，中国对外经济贸易信托有限公司监事会主席。

付强强	监事	男	42	2019 年 1 月	中化资本有 限公司	97.26%	曾任招商银行武汉分行公司银行部客户经理,中化财务会计咨询有限公司财务顾问部高级咨询顾问,中化国际(控股)股份有限公司冶金能源事业总部投资与项目管理部投资经理、战略管理总部业务发展部业务发展经理,中国中化集团公司人力资源部关键岗位管理部职员、副经理、经理与业务合作部经理,中化国际(控股)股份有限公司人力资源部总经理、中化集团化工事业部人力资源部总经理。现任中国中化集团有限公司金融事业部人力资源部总经理,中国对外经济贸易信托有限公司监事。
刘郁飞	监事	男	46	2019 年 1 月	职工代表	—	曾任中国林业科学研究院审计处职员,中林绿源科技有限责任公司财务资金部经理,同新会计师事务所有限公司主任会计师,中国林业科学研究院计划财务处副总会计师,中国德仁集团有限公司财务副总裁,毕马威华振会计师事务所助理审计经理、审计经理,中国对外经济贸易信托有限公司稽核法律部总经理助理、内控稽核部副总经理、运营稽核部总经理、审计稽核部总经理。现任中国对外经济贸易信托有限公司生态金融事业部副总经理,中国对外经济贸易信托有限公司监事。

3.1.4 高级管理人员 (截至 2019 年 12 月 31 日)

表 3.1.4

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	金融从业年限	学历	专业	简要履历
伊力扎提	总经理	男	44	2017 年 2 月	9 年	硕 士 研 究 生	工 商 管 理	曾任吉通网络通信股份有限公司人力资源部副总经理;中国中化集团公司石油中心人力资源部副总经理、总经理;中化国际石油公司总经理助理、副总经理;中国对外经济贸易信托有限公司副总经理;报告期内任中国对外经济贸易信托有限公司总经理,中化集团金融事业部副总裁,中共中国对外经济贸易信托有限公司委员会委员、书记。

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	金融从业年限	学历	专业	简要履历
黄文波	纪委书记	男	57	2015年8月	4年	大专	会计学	曾任北京油泵油嘴厂财务部会计，副科长；中化海南有限公司计财部经理，公司总经理助理、副总经理、常务副总经理；中国化工进出口总公司财务本部风险管理部总经理，清欠办公室主任，财务部特派巡视员；中国中化集团公司/中国中化股份有限公司财务综合部总经理；现任中共中国对外经济贸易信托有限公司纪律检查委员会委员、书记，中共中化集团金融事业部纪律检查委员会委员、书记，中共中国对外经济贸易信托有限公司委员会委员。
帅立新	财务总监	女	53	2009年7月	11年	硕士研究生	工商管理	曾任中国化工进出口总公司石油财会处会计科科长；中化香港石油国际有限公司财务部总经理；中国中化集团公司会计管理部副总经理；现任中国对外经济贸易信托有限公司财务总监、绩效评价委员会主任（兼），中共中国对外经济贸易信托有限公司委员会委员。
张一冰	副总经理	女	52	2018年11月	29年	硕士研究生	金融学	曾就职于中国华大理工技术公司，任计财部职员；1990年起至今就职于中国对外经济贸易信托有限公司，先后担任证券部总经理助理，综合业务部经营管理科副科长，投资银行部总经理助理、总经理，稽核法律部总经理、投资发展部总经理，董事会秘书；1999年6月至2001年3月期间担任香港第一太平银行投资银行部副总裁；现任中共中国对外经济贸易信托有限公司委员会委员、副书记，中国对外经济贸易信托有限公司副总经理（兼）。
赵照	副总经理	男	46	2017年12月	25年	博士研究生	金融学	曾任中国电力信托投资有限公司投资发展部项目经理，北京证券营业部交易部经理；中国电力财务有限公司四川业务部副主任，总经理工作部副主任，法律及合规部主任，发展策划部主任；英大国际控股集团有限公司发展策划部主任，英大基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，兼任英

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	金融从业年限	学历	专业	简要履历
								大资本管理有限公司总经理。现任中国对外经济贸易信托有限公司副总经理，中共中国对外经济贸易信托有限公司委员会委员。
王晓丽	总经理助理	女	38	2017年11月	17年	硕士研究生	工商管理	曾任中国对外经济贸易信托有限公司计划财务部职员、总经理助理，金融产品二部副总经理、副总经理（主持工作）、总经理，金融市场总部常务副总经理，金融市场事业部总经理。现任中国对外经济贸易信托有限公司总经理助理。
卫濛濛	总经理助理	女	38	2017年11月	14年	硕士研究生	金融学	曾任中国对外经济贸易信托有限公司理财服务中心职员，资产管理五部职员，产品管理部总经理助理（主持工作）、副总经理（主持工作），证券产品部总经理，证券信托事业部总经理（期间曾兼任证券信托事业部综合部总经理），财富管理中心总经理（期间曾兼任财富中心管理部总经理）。现任中国对外经济贸易信托有限公司总经理助理，财富管理中心总经理（兼）。
秦江卫	总法律顾问、首席风控官	男	47	2018年11月	16年	硕士研究生	法学	曾在太原双喜轮胎工业股份有限公司全面质量管理处任职；2004年7月起至今任职于中国对外经济贸易信托有限公司，历任稽核法律部职员、稽核法律部总经理助理、稽核法律部副总经理、风险法规部总经理（期间曾兼任公司第二总部副总经理）、公司副总法律顾问；现任中国对外经济贸易信托有限公司总法律顾问，首席风控官，风控合规总部总经理（兼）。
王大为	董事会秘书	男	40	2018年11月	9年	硕士研究生	市场营销	曾任中化国际冶金能源事业总部销售经理；中化集团战略规划部企业管理部职员；2011年7月起任职于中国对外经济贸易信托有限公司，历任财富管理二部职员，财富管理中心山西分部总经理助理，资产保全工作组副组长，西北区域总部总经理；现任中国对外经济贸易信托有限公司董事会秘书，总经理办公室主任（兼）。

姓名	职务	性别	年龄	选任日期	金融从业年限	学历	专业	简要履历
柳元鑫	首席信息官 (CIO)	男	42	2017年11月	18年	硕士研究生	计算机软件与理论	曾任中国工商银行数据中心(北京)应用部开放平台职员、部门副经理、测试二部部室总经理,中国工商银行数据中心(上海)总经理助理。现任中国对外经济贸易信托有限公司首席信息官(CIO)。

## 3.1.5 公司员工

表 3.1.5

项目	报告期年度		上年度		
	人数	比例	人数	比例	
年龄分布	25 以下	11	1.98%	11	2.18%
	25-29	152	27.44%	213	42.18%
	30-39	340	61.37%	240	47.52%
	40 以上	51	9.21%	41	8.12%
学历分布	博士	8	1.44%	7	1.39%
	硕士	334	60.29%	308	60.99%
	本科	199	35.92%	178	35.25%
	专科	13	2.35%	12	2.38%
	其他	0	0.00%	0	0.00%
岗位分布	董事、监事及其高管人员	10	1.81%	11	2.18%
	自营业务人员	9	1.62%	8	1.58%
	信托业务人员	378	68.23%	347	68.71%
	其他人员	157	28.34%	139	27.52%

## 3.2 公司治理信息

## 3.2.1 年度内召开股东大会(股东会)情况

会议名称	召开时间	审议议题
2019 年第一次 股东会议	2019 年 1 月 31 日	1.关于调整中国对外经济贸易信托有限公司董事、监事的议案; 2.关于中国对外经济贸易信托有限公司董事会、监事会换届选举的议案。
2019 年第二次 股东会议	2019 年 4 月 28 日	审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2018 年年度报告》

2019 年第三次 股东会议	2019 年 7 月 16 日	关于审议增加外贸信托注册资本的议案
2019 年第四次 股东会议	2019 年 10 月 18 日	1.关于审议《外贸信托 2018 年度财务决算报告》的议案； 2.关于审议《外贸信托 2019 年度财务预算报告》的议案； 3.关于修订《外贸信托董事会议事规则》的议案； 4.关于修订《外贸信托监事会议事规则》的议案； 5.关于审议《外贸信托董事会 2018 年度工作报告》的议案； 6.关于审议《外贸信托监事会 2018 年度工作报告》的议案； 7.关于审议《外贸信托 2018 年信托受益人利益实现情况报告》的议案。
2019 年第五次 股东会议	2019 年 10 月 25 日	关于修订《中国对外经济贸易信托有限公司章程》的议案
2019 年第六次 股东会议	2019 年 12 月 26 日	关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2019 年度第一次利润分配方案》的议案

### 3.2.2 董事会及其下属委员会履行职责情况

#### 3.2.2.1 董事会召开会议情况

会议名称	召开时间	审议议题
第七届董事 会第一次会议	2019 年 3 月 29 日	1.《关于选举杨林同志担任中国对外经济贸易信托有限公司第七届 董事会董事长的议案》； 2.《关于审议董事会对经营班子 2019 年度业务授权的议案》； 3.《关于设立资产保全部的议案》。
第七届董事 会第二次会议	2019 年 4 月 28 日	1.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2018 年年度报告》 的议案； 2.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2018 年主要股东评 估报告》的议案； 3.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2018 年度内部控制 评价报告》的议案。
第七届董事 会第三次会议	2019 年 6 月 14 日	1.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2019 年风险偏好陈 述书》的议案； 2.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2018 年度全面风险 管理报告》的议案； 3.关于审议《外贸信托信息披露管理规定》等 5 个体系文件的议案。
第七届董事 会第四次会议	2019 年 7 月 15 日	1.《关于审议增加外贸信托注册资本的议案》； 2.《关于修订〈外贸信托机构管理规定〉的议案》。
第七届董事 会第五次会议	2019 年 7 月 17 日	1.外贸信托经营与战略规划汇报 2.关于审议《外贸信托 2018 年度财务决算报告》的议案 3.关于审议《外贸信托 2019 年度财务预算报告》的议案 4.关于修订《外贸信托董事会议事规则》的议案 5.关于审议《外贸信托董事会 2018 年度工作报告》的议案

		<p>6.关于外贸信托董事会消费者权益保护和信托委员会换届选举的议案</p> <p>7.关于外贸信托董事会薪酬与提名委员会换届选举的议案</p> <p>8.关于外贸信托董事会审计委员会换届选举的议案</p> <p>9.关于外贸信托董事会风险控制委员会换届选举的议案</p> <p>10.关于设立登记管理部的议案</p>
第七届董事会第六次会议	2019年10月15日	<p>1.关于修订《外贸信托独立董事管理办法》、《外贸信托董事会秘书工作条例》的议案；</p> <p>2.关于审议董事会各专门委员会2018年度工作报告的议案；</p> <p>3.关于修订《外贸信托消费者权益保护管理办法》的议案；</p> <p>4.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司2019年消费者权益保护工作计划》的议案；</p> <p>5.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司2018年度消费者权益保护工作自评报告》的议案；</p> <p>6.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司2018年金融消费者权益保护自评报告》的议案；</p> <p>7.关于审议《外贸信托2018年信托受益人利益实现情况报告》的议案。</p>
第七届董事会第七次会议	2019年10月24日	审议《关于修订<中国对外经济贸易信托有限公司章程>的议案》。
第七届董事会第八次会议	2019年12月26日	<p>1.关于审议《中国对外经济贸易信托有限公司2019年度第一次利润分配方案》的议案；</p> <p>2.关于外贸信托组织结构调整的议案。</p>

### 3.2.2.2 董事会专门委员会召开会议情况

会议名称	召开时间	审议议题
董事会风险控制委员会2019年第一次会议	2019年8月5日	审议外贸信托关于修订《外贸信托全面风险管理规定》的请示
董事会风险控制委员会2019年第二次会议	2019年8月22日	审议《外贸信托董事会风险控制委员会2018年度工作报告》
董事会风险控制委员会2019年第三次会议	2019年9月12日	审议《2019年外贸信托反洗钱工作计划》
董事会风险控制委员会2019年第四次会议	2019年10月23日	审议《外贸信托2019年压力测试的报告》
董事会风险控制委员会2019年第五次会议	2019年11月12日	审议外贸信托关于新增《外贸信托信息科技风险管理办法》、《外贸信托战略风险管理办法》，修订《外贸信托声誉风险管理办法》、《外贸信托反洗钱工作管理办法》的请示

会议名称	召开时间	审议议题
董事会消费者权益保护和信托委员会2019年第一次会议	2019年8月7日	<p>1.审议《外贸信托消费者权益保护管理办法》；</p> <p>2.审议《中国对外经济贸易信托有限公司2018年度消费者权益保护工作自评报告》；</p> <p>3.审议《中国对外经济贸易信托有限公司2018年金融消费者权益保</p>

		护自评估报告》； 4.审议《外贸信托 2018 年信托受益人利益实现情况报告》； 5.审议《外贸信托董事会消费者权益保护和信托委员会 2018 年度工作报告》； 6.审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2019 年消费者权益保护工作计划》。
--	--	---

会议名称	召开时间	审议议题
董事会审计委员会 2019 年第一次会议	2019 年 1 月 15 日	1. 审议《外贸信托 2018 年消费者权益保护工作内部审计报告》； 2. 审议《外贸信托 2018 年反洗钱工作内部审计报告》； 3. 审议《外贸信托 2018 年征信业务内部审计报告》。
董事会审计委员会 2019 年第二次会议	2019 年 8 月 26 日	审议《外贸信托董事会审计委员会 2018 年度工作报告》
董事会审计委员会 2019 年第三次会议	2019 年 12 月 26 日	1. 审议《外贸信托 2017 年度 中国银行 满堂红教育慈善信托（2018 年）内部审计报告》； 2. 审议《外贸信托 2019 年产业金融信托业务内部审计报告》； 3. 审议《外贸信托 2019 年反洗钱工作内部审计报告》； 4. 审议《外贸信托 2019 年家族信托业务内部审计报告》； 5. 审议《外贸信托 2019 年授权管理内部审计报告》； 6. 审议《外贸信托 2019 年主动管理类风险项目受托责任履行情况专项审计报告》； 7. 审议修订《外贸信托内部审计管理规定》。

会议名称	召开时间	审议议题
董事会薪酬与提名委员会 2019 年第一次会议	2019 年 8 月 26 日	外贸信托董事会薪酬与提名委员会 2018 年工作报告

### 3.2.3 监事会及其下属委员会履行职责情况

#### 3.2.3.1 报告期内监事会会议情况及决议内容

会议名称	召开时间	审议议题
第五届监事会第一次会议	2019 年 2 月 21 日	1. 审议《关于第五届监事会换届选举的议案》； 2. 审议《关于〈中国对外经济贸易信托有限公司监事会 2018 年度工作报告〉的议案》。
第五届监事会第二次会议	2019 年 4 月 28 日	审议《中国对外经济贸易信托有限公司 2018 年年度报告》
第五届监事会第三次会议	2019 年 8 月 20 日	审议《关于修订〈外贸信托监事会议事规则〉的议案》

#### 3.2.3.2 监事会独立意见

报告期内，公司的决策程序符合国家法律、法规和公司的章程及相关制度，建立健全了比较有效的内控制度，董事会全体成员及董事会聘任的高级管理人员认真履行了职责，未发现有违法、违规、违章的行为，也没有损害公司利益、股东利益和委托人利益的行为。

报告期内，公司财务报告真实反映了公司财务状况和经营成果。

#### 3.2.4 高级管理人员履职情况

报告期内，公司高级管理层忠实履行诚信和勤勉的义务，未发生违反国家法律法规、《公司章程》或损害公司和股东利益的行为。

#### 3.2.5 公司履行社会责任情况

报告期内，公司严格遵守国家法律法规、监管部门规章、规范性文件以及公司章程；坚持诚信经营，自觉履行纳税义务；关注社会整体利益，坚决履行反洗钱义务，维护国家金融秩序和金融安全。公司始终恪守社会公德和商业道德，自觉遵守信托业自律规则和业务相关领域的各项规定，积极维护信托业市场竞争秩序，秉承“受人之托，代人理财”的信托精神，积极履行应尽的社会责任。公司积极响应党和国家的号召，切实履行央企政治责任和社会责任，积极践行“金融好社会”宗旨，通过发挥金融工具的优势，服务实体经济发展和人民美好生活，大力支持绿色行业发展，助力精准扶贫和慈善事业开展。2019年1月，由公司全额捐赠的北京信诺公益基金会正式成立，将通过“基金会+慈善信托”双平台公益慈善运营模式，深入探索扶贫公益新路径。

## 4、经营管理

### 4.1 经营目标、方针、战略规划

经营目标：以实现“金融好社会”为宗旨，致力于打造“创新引领、服务实体、以人为本的现代金融公司”。

经营方针：拓展信托“服务+”商业模式，坚持打造“以客户为中心的产品力和组织力”，强化综合金融服务能力。

战略规划：公司坚持“聚焦、竞争、数字化”为核心的增长战略，聚焦于小微金融、产业金融、资本市场、财富管理四大领域，推进价值导向、激发活力的竞争机制，同时全面推进数字化转型引领公司高质量发展，积极服务实体经济发展和人民美好生活需要。

### 4.2 所经营业务的主要内容

公司聚焦小微金融、产业金融、资本市场、财富管理四大领域：

小微金融领域，以构建“绿色、共享小微金融生态圈”为目标，紧抓消费金融市场发展机遇，开拓梯队客户，加快产品创新迭代，提升科技能力。同时，围绕小微企业在生产经营、销售流通等环节的上下游融资需求，积极开拓经营贷和场景金融业务，打造小微企业新型融资模式。

产业金融领域，坚持聚焦头部客户，丰富产业金融业务内涵，为实体经济注入金融活力，致力于成为细分领先的资产管理者。坚持地产业务高举高打、夯实债权融资基石，同时创新探索地产股权、地产基金、ABS 等模式。持续丰富产金内涵，发力基础设施等领域，聚焦民生发展，进一步服务实体经济。

资本市场领域，坚持证券信托服务类业务加资管类业务的双翼发展体系。服务类业务以渠道客户和私募管理人客户为根基，植入科技基因，打造独立、专业、高效、领先的基金行政服务商；资管类业务持续丰富产品线，布局“固收+”、FOF 等产品体系，夯实投研能力，打造特色化的资管业务。同时，运用多种金融工具对接公开市场，在资产证券化领域，聚焦受托规模，提升市场影响，推动核心资产转标，成为跨市场资产证券化业务解决方案提供商。

财富管理领域，公司坚持“线上+线下”战略，持续以客户为中心，扩展区域布局，升级线上营销，提升服务效率和客户体验，打造行业领先的财富管理平台。家族信托领域，积极拓展多层次客户，提供丰富产品线，打造成为行业领先的家族信托服务商。

(单位：万元人民币) 自营资产运用与分布表

资产运用	金额	占比 (%)	资产分布	金额	占比 (%)
货币资产	28,037.25	1.52%	基础产业	68,916.98	3.74%
贷款及应收款	63,463.32	3.45%	房地产	215,848.75	11.72%
交易性金融资产	11,412.61	0.62%	证券市场	412,323.79	22.39%
可供出售金融资产	1,607,047.32	87.28%	实业	-	-
持有至到期投资	-	-	金融机构	95,522.63	5.19%
长期股权投资	92,714.63	5.04%	其他	1,048,731.10	56.96%
其他	38,668.12	2.09%			
资产总计	1,841,343.25	100.00%	资产总计	1,841,343.25	100.00%

(单位：万元人民币) 信托资产运用与分布表

资产运用	金额	占比 (%)	资产分布	金额	占比 (%)
货币资产	1,503,734.15	3.37%	基础产业	518,701.78	1.16%
贷款	13,133,092.39	29.46%	房地产	3,099,457.06	6.95%
交易性金融资产	23,445,330.38	52.59%	证券市场	23,076,172.27	51.77%
可供出售金融资产	546,379.11	1.23%	实业	822,031.53	1.84%
持有至到期投资	4,131,510.18	9.27%	金融机构	7,985,998.10	17.92%
长期股权投资	374,163.80	0.84%	其他	9,074,141.43	20.36%
买入返售金融资产	903,875.82	2.03%			
其他	538,416.34	1.21%			
信托资产总计	44,576,502.17	100.00%	信托资产总计	44,576,502.17	100.00%

## 4.3 市场分析

### 4.3.1 宏观环境

2019年，中国宏观经济受到世界经济增长放缓、全球动荡源和风险点增多、中美贸易摩擦持续等因素影响，经济增长面临较大下行压力。但同时，中国人均GDP首次站上1万美元新台阶，稳中向好、长期向好的基本趋势没有改变。

围绕金融支持实体经济，防范化解重大风险、深化金融体制改革，监管部门出台“资管新规”细则及相关政策文件，并在地产、供应链金融、金融科技等领域

加强规范与引导，促进和保障了金融业的平稳运行，引导社会资金转化为长期投资，推动金融机构提升服务实体经济的质效。在监管引导下，信托业坚持回归本源、提质增效、加快转型步伐，服务实体经济的能力进一步提升。新兴产业的蓬勃发展催生新的金融服务需求；建立多层次资本市场为资产管理创造广阔的市场空间；金融科技的深度应用为创新业务的开展提供了基础。在这些大背景下，信托公司应进一步依托资源禀赋，明确自身定位，紧抓市场需求，培育主动管理能力，在细分领域深耕，多元应用金融工具服务实体经济发展和人民美好生活需要。2019 年，信托业开启高质量转型发展，信托公司应持续加强信托文化建设，严守合规底线，不断完善风险防控体系，积极推动传统融资类业务的转型，积极开拓服务信托、财富管理、慈善信托等本源业务，为投资者与客户创造更多价值，为全面完成 2020 年经济社会目标，贡献行业力量。

#### 4.3.2 影响公司发展的因素

##### 4.3.2.1 有利因素

(1) 当前资本市场建设被提升到新的高度。加快资本市场改革，促进多层次资本市场健康发展，大力发展直接融资既是监管鼓励与引导的方向，也是金融服务实体重要方式。信托公司应通过培养标准化产品投资团队和投资能力，努力提升资产判断和把控能力，加大股权类投资业务的拓展力度，逐步提升主动投资管理能力。

(2) 随着我国高净值客群的持续增长，可投资资产规模不断攀升，财富管理需求呈现多元化趋势，我国财富管理市场的发展具有强大的内生动力。信托公司应充分利用自身风险隔离等制度优势，以客户为中心，提升自身的专业能力与服务水平，为信托投资人匹配风险收益相适配的资产，满足客户特色的、个性化的财富管理需求。

(3) 移动互联、大数据、云计算等前沿技术快速发展，为金融业带来巨大而深远的影响。信托公司应加速金融科技布局，以金融科技手段赋能公司经营管理与业务开展，通过对大数据、智能投顾等金融科技的应用，实现产品与服务的创新和主动管理、风险防控等方面能力的提升。

##### 4.3.2.2 不利因素

2019 年，中央经济工作会议指出“我国金融体系总体健康，具备化解各类风

险的能力”。但同时，打好防范化解重大金融风险攻坚战，牢牢守住不发生系统性金融风险的底线仍然是重中之重，信托行业发展的风险隐患不容忽视。宏观层面，“三期叠加”影响持续深化，经济下行压力加大，世界大变局加速演变的特征更趋明显，全球动荡源和风险点显著增多。实体经济领域，新旧动能转换期，部分企业出现了经营困难，信用风险仍时有发生。信托公司未来发展必须高度关注、妥善处置风险，平衡好稳增长和防风险的关系，加强对资产质量的把控能力，培养不良资产处置能力，深化服务内涵、改善服务质量，更好地满足实体经济的综合金融服务需求。

## 4.4 内部控制

### 4.4.1 内部控制环境和内部控制文化

公司已建立比较完善的公司治理机制，股东会、董事会、独立董事、监事会及高管层之间权责分明、各司其职。

股东会是公司的最高权力机构，代表股东对公司行使最终的控制权和决策权。

董事会是经营决策的最高权力机构，对股东会负责。

董事会下设风险控制委员会、消费者权益保护和信托委员会、审计委员会、薪酬与提名委员会等专业委员会。其中：风险控制委员会负责制定公司业务决策授权范围，审批超出公司管理层权限的业务事项，审议公司主要风险管理制度，并监督、检查公司风险管理制度、业务流程规范的执行情况；消费者权益保护和信托委员会负责消费者权益保护工作并监督、评价消费者权益工作的全面性、及时性和有效性，督促公司依法履行受托职责，对公司信托业务运行情况进行定期评估，当股东利益、公司利益与受益人利益发生冲突时，应保证公司为受益人利益服务，研究提出维护受益人利益的具体措施；审计委员会负责公司内部及外部审计工作，对公司内部控制管理工作进行监督，核查财务信息披露，并协同董事会风险控制委员会工作，指导内部审计部门开展风险管理评价审计等；薪酬与提名委员会代表董事会行使高级管理人员人选提名、考核及薪酬管理等管理职能。

监事会是公司的监督机构。公司监事会向股东会负责，对公司财务以及公司董事、经理和其他高级管理人员履行职责的合法性进行监督，维护公司及股东的

合法权益。监事会依法享有法律法规赋予的知情权、建议权和报告权。公司采取有效措施保障监事的知情权，及时向监事提供必要的信息和资料，以便监事会对公司财务状况和经营管理情况进行有效的监督、检查和评价。

公司高管层是公司的决策执行机构，对董事会负责，在公司章程和董事会授权范围内行使职权，牢固树立了内控优先的风险管理理念，使风险防范意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和工作的各个环节。

公司所构建的股东会、董事会、监事会和高管层之间的权力制衡结构，能切实发挥科学激励和约束监督的治理机制，有效抑制“道德风险”的发生，为公司内部控制建设提供良好的环境。

公司始终秉承“稳健思变，诚客礼才”的经营理念，树立“国内理财市场的金字招牌，国际金融市场的百年老店”的愿景，强化合规经营和尽职管理，重视全面风险管理、内部控制以及相关文化的建设，建立充分的信息交流和共享机制，强化内控制度约束。2019年，公司持续完善内部控制体系，包括根据业务实际不断滚动修订和完善相关体系文件，大力提升公司风险管理能力，以及提升员工经营管理的质量意识和程序意识，对巩固和提高公司经营质量发挥积极作用。

公司通过培训和学习等多种途径，不断提升员工的风控合规意识和职业道德，使全体员工熟悉监管法律法规和公司规章制度以及业务操作流程。通过建立实施风险管理问责制，公司对风险管理过程中的违规、不尽职以及过失等行为进行责任追究。公司将风险管理的执行情况与绩效评价相结合，强化“合规先行”的内控导向。全体员工对内控制度和机制已充分理解并达成共识。

#### 4.4.2 内部控制措施

公司内部控制的主要政策导向为合规经营、严控风险，在提升业务开拓能力、实现公司经营战略目标的同时，不断提高公司的业务风险管控能力。公司已建立一套以战略管理、业务管理、财务管理、信息系统、风险管理和稽核为核心的较为完善的内部控制制度和操作流程，形成职责明确、分工合理、相互制衡的组织结构和内部牵制机制。

##### (1) 基本控制制度

在公司治理方面，公司已建立比较完善的公司治理结构，包括董事会、监事会和董事会下设的消费者权益保护和信托委员会、风险控制委员会、薪酬与提名

委员会、审计委员会等专门委员会，以及引入独立董事制度，制定股东会和董事会及专门委员会的各项议事规则和工作条例，进一步完善相关制度和流程。

在会计核算和财务管理方面，公司已制定自营和信托业务的财务会计管理制度，建立有效的内部财务管理级次，负责自营和信托业务的日常会计核算、财务管理、资金管理和全面预算等工作。公司严格遵循各项法律法规及内部管理制度，通过有效的会计核算和会计监督，确认、计量和报告各项经济活动，提供真实、准确和及时的会计信息，实现资金的合理、高效使用和分配。

在人力资源方面，公司已制定《外贸信托人力资源管理规定》、《外贸信托招聘录用管理办法》、《外贸信托培训管理办法》、《外贸信托劳动合同管理办法》、《外贸信托员工绩效管理办法》等人力资源管理制度和流程，并通过召开职代会、《员工手册》签收等举措，确保每一位员工知晓相关规章制度，并严格遵守。

在信息系统方面，公司已制定《外贸信托信息化管理规定》、《外贸信托信息化委员会工作条例》、《外贸信托信息安全管理办法》、《外贸信托信息化项目管理办法》、《外贸信托信息化运维管理办法》等信息系统方面的管理制度和流程。公司严格按照规范及流程开展信息化工作，并根据业务开展状况持续修订。

在行政管理方面，公司已制定公文管理、印章管理、档案管理和保密管理等行政管理制度和流程，并及时进行梳理和完善。

## （2）业务控制制度

在项目和合同文本审核、资金拨付和执行过程管理方面，公司已制定自营和信托两大系列业务管理规章制度。在业务前期审核、资金拨付和执行过程管理等环节，制定了《外贸信托信托业务管理规定》、《外贸信托证券投资信托业务管理办法》、《外贸信托融资类信托业务管理办法》、《外贸信托项目登记清算管理办法》、《外贸信托业务运营管理办法》、《外贸信托合同管理办法》等制度，规范项目和合同文本审核、资金拨付和执行过程管理的工作和流程，配套公布合同范本并不定期进行修订，并能根据信托行业发展及时予以修订和完善。

在信托计划发行和信息披露方面，公司已制定《外贸信托自主发行组织管理办法》、《外贸信托项目信息披露管理办法》等信托计划发行和信息披露方面的管理制度和流程。

## （3）对外投资管理

公司在《公司章程》中明确股东会、董事会关于对外投资事项的审批权限，已制定《中国对外经济贸易信托有限公司董事会风险控制委员会工作条例》、《外贸信托自营业务管理规定》、《外贸信托股权投资项目评审委员会工作管理规定》等决策与管理制度和流程，规范各类投资权限与流程，强化对投资项目的内部控制和投后管理，有效地控制投资风险。

#### （4）关联交易控制制度

为规范公司关联交易行为，控制关联交易风险，促进公司安全、稳健、合规运行，公司已制定《外贸信托关联交易管理办法》。公司按照监管政策和内部管理制度，遵循诚实信用、平等自愿、公平公开的原则开展关联交易，保证关联交易的公允性。

#### （5）对外担保制度

为规范公司对外担保行为，防范公司对外担保风险，公司在《公司章程》中对对外担保的权限和信息披露做出明确规定。

#### （6）工资费用控制制度

公司已制定《外贸信托薪酬福利管理办法》，严格按照中化股份规章制度采取逐级核定、逐级审批、总额控制的原则进行薪酬管理，薪酬核定及发放流程严谨，在操作上以 E-HR 方式实现，并且提供员工自助查询服务。

#### （7）风险信息制度

公司已制定《外贸信托全面风险管理规定》、《外贸信托资产风险分类管理办法》、《外贸信托项目重大风险事件应急管理办法》、《外贸信托业务风险管理问责管理办法》等风险信息制度和流程。

#### （8）内部监督控制制度

公司已制定《外贸信托内部审计管理规定》，定期开展内部审计工作并及时将内部审计报告报送董事会审计委员会。

公司根据宏观经济环境的变化和监管政策的调整以及业务和管理的实际需要，对上述内控制度和操作流程体系进行审阅并滚动修订。

### 4.4.3 信息交流与反馈

公司建立和设置实时跟踪报告公司内控情况的信息反馈机制，内容包括项目审批决策报告体系、项目执行过程管理报告体系以及证券自营业务报表体系等报

告机制，并通过包括 SharePoint 平台、财务软件、电子业务台账等在内的电子化信息交流渠道的建立，实现信息在各部门之间的共享与交流，确保公司董事会和高管层能够及时了解公司的经营和内控情况。

此外，通过公开信息披露机制的建立以及客户关系管理软件、公司网站等多渠道建设，公司增进了与监管部门、委托人、受益人的信息沟通与交流。

#### 4.4.4 消费者权益保护

公司高度重视消费者权益保护工作，将实现客户利益及保护消费者合法权益融入企业文化建设和公司治理，构建与公司组织架构、经营业务相匹配的消费者权益保护机制体制，建立健全消费者权益保护规章制度，切实贯彻落实消费者权益保护工作要求。

2019 年，公司积极推进消费者权益保护工作。第一，完善消费者权益保护工作机制体制建设，深化顶层设计，加强高层指导，强化消费者权益保护职能部门的统筹作用，进一步提升消费者权益保护工作重要地位。加强消费者权益保护内部监督考核力度，提升全员消费者权益保护意识，确保消费者权益保护工作得到有效落实。持续建立健全消费者权益保护规章制度，修订《外贸信托消费者权益保护管理办法》等 8 项制度规范。第二，在产品设立、营销推介、信息披露等各个业务环节落实消费者权益保护要求，完善消费者权益保护事前审查机制，加强事后评价管理。第三，开展形式多样、层次丰富的金融知识宣传教育活动。公司针对不同客户群体特征开展了大型论坛、财富私塾、金融知识进社区、金融知识进校园等 20 余次金融知识普及宣教活动，并通过公司官方网站、微信公众号、APP 等线上渠道开展“立体化”金融知识普及，取得了良好的效果。第四，妥善做好投诉管理。不断完善投诉管理机制及处理流程，在官网、合同、营业场所等公示咨询投诉电话，确保咨询投诉渠道便捷、畅通、有效，加强投诉总结分析，不断完善产品和服务。

公司将始终秉承实现“金融好社会”为宗旨，坚持以客户为中心，贯彻消费者权益保护工作要求，切实维护消费者合法权益。

#### 4.4.5 监督评价与纠正

公司审计稽核部负责内部审计工作，依照有关国家政策、法律法规及公司各项规章制度，遵循独立性、客观性原则行使对公司内部控制情况的监督、评价和

纠正职责，并有权直接向董事会及审计委员会、监事会和公司管理层进行报告。审计稽核部紧贴公司重点战略、关键业务、重要职能查错纠弊，从问题出发，由点带面，推动预防性改善型整改措施及建议的落地实施，不断完善公司内部控制体系。

通过开展内部审计，审计稽核部对信托业务尽职调查、合同审批、资金拨付、执行过程管理等全过程进行分析和复核，找出存在的问题，总结经验教训，提出改进措施与建议，并监督相关部门及时整改。

## 4.5 风险管理

### 4.5.1 风险管理概况

2019 年公司始终贯彻“合规先行、稳中求进”的风控文化，坚守底线、不碰红线。公司不断顺应“新时代”下经济高质量发展趋势，遵循全覆盖、相匹配与动态调整、审慎性等风险管理基本原则，严格执行防控金融风险的总体要求，紧密围绕公司战略转型方向，扎实推进全面风险管理体系建设工作，不断强化公司风险管理能力，公司整体抗风险能力有所提高。

### 4.5.2 风险状况

2019 年，监管进入“严监管”，市场面临“强竞争”，公司将安全性、盈利性有机结合，坚持资本、风险、收益之间的平衡，审慎展业，严控风险，公司未出现重大监管处罚事件或重大风险。

公司在日常经营中所面临的主要风险包括信用风险、市场风险、操作风险、合规风险、流动性风险及其他风险等。

#### (1) 信用风险

公司面临的信用风险主要是指债务人或交易对手未能履行合同所规定的义务或信用质量发生变化，影响金融产品价值，从而给公司造成损失的风险。

按照《非银行金融机构资产风险分类指导原则（试行）》确定的资产风险分类标准，将资产分为正常、关注、次级、可疑和损失五类，其中后三类合称为不良资产。固有业务层面，2019 年公司保持较低不良资产水平，并严格按照有关规定计提信托赔偿准备金及风险准备。

信托业务层面，公司认真履行受托人责任，有效管理信托项目，定期监测融

资类信托规模占比、客户集中度等指标，信用风险可控。

### （2）市场风险

公司面临的市场风险主要体现为在开展信贷业务中由于利率水平的不利变动以及证券投资业务中由于投资标的市场价格的不利变动给公司经营业绩带来的风险。

在信贷类信托业务方面，公司开展的信托类信贷业务，主要为中短期信贷，公司严格执行中国人民银行的利率政策，能较好地消化利率波动可能产生的风险。

在证券投资业务领域，公司严格区分自营证券投资和证券投资类信托业务，并根据资金属性和风险偏好，针对利率、汇率和股价波动风险设置差异化管理策略。

### （3）操作风险

公司面临的操作风险主要是指由不完善或有问题的内部程序、员工和信息科技系统，以及外部事件所造成直接或间接损失的风险。

目前，公司已对各项业务活动和管理活动制定系统、规范的业务管理制度和实施细则。在各类信托业务的项目筛选、可行性分析、项目审批、合同签署和账户设立、信托发行、信托资金发放、执行管理等环节，均已建立内部控制制度，总体上执行良好，操作风险可知可控。

### （4）流动性风险

公司流动性风险包括公司整体和信托项目两个层面。

公司整体流动性风险主要是指清偿能力不足或虽然有清偿能力，但无法及时获得充足资金或无法以合理成本及时获得充足资金以应对资产增长或支付到期债务的风险，主要产生于风险事件突发或公司资产负债变化而导致的流动性困难。对此，公司通过合理的进行资产配置及负债管理，加强资金预测和筹划，保持充分而持续的融资能力，对流动性风险进行控制。目前，公司各项财务风险量化指标均在正常监控范围内，公司现金流足够覆盖长短期资金需求、监管要求，以及满足必要的投资收益率。

信托项目层面的流动性风险主要是指公司无法以合理的市场价格变现信托资产，或者无法以合理的成本及时募集充足的资金或转让信托份额，从而导致信托项目无法按合同约定支付投资者赎回或到期款项的风险。针对该风险，公司通

过动态平衡发行节奏、审慎选择交易对手、合理设计交易结构、持续优化资产配置,对信托项目未来现金流进行安排,保证信托业务发展的资金需要和兑付需求,并防止表外流动性风险向表内转化。2019年,信托项目层面流动性风险可控。

#### (5) 法律合规风险

法律风险主要包括合规风险和法律风险。

针对合规风险,公司根据监管政策变化,强化合规统筹管理,持续完善合规管理制度、管理流程、合规培训和宣贯工作,加强项目合规性审查,增强全员合规意识。同时加大合规检查力度,加强项目审核及过程管理,避免执行中出现偏差,确保合规底线。外贸信托始终秉持依法合规经营理念,坚决杜绝合规风险。

针对法律风险,外贸信托严格执行公司相关诉讼仲裁管理制度,在项目诉讼及处置过程中,及时采取财产保全、证据保全等措施,提前做好诉讼准备,及时提起诉讼,保证实体及程序权利;对于被动涉诉,外贸信托积极主动采取应对措施,积极化解诉讼风险。

公司 2019 年度未发生监管处罚、群体性诉讼事件、全国范围长期名誉损害事件,整体合规法律风险可控。

#### (6) 交叉金融产品风险

针对交叉金融产品风险和创新业务,外贸信托通过全面风险管理三道防线层层把控,坚守合规底线,把握实质风险,同时,规范业务开展,未发生交叉金融产品风险。

#### (7) 信息科技风险

信息科技风险是指信息技术在公司运行过程中,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。信息科技风险主要包含信息安全、信息系统开发测试和维护、信息科技运行、业务连续性、外包业务管理领域。

为加强信息科技风险管理,公司编制《外贸信托信息科技风险管理办法》,明确了信息科技各类风险领域的管理要求以及应对策略,为信息科技风险管理提供有效抓手与保障。2019年信息科技风险整体可控。

#### (8) 声誉风险

声誉风险是指由于公司经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方

对公司负面评价的风险。外贸信托将声誉风险管理纳入公司治理及全面风险管理体系，建立声誉风险管理机制，进行声誉风险主动管理。2019 年公司未发生重大声誉事件，保持良好的品牌声誉。

#### 4.5.3 风险管理

##### (1) 信用风险管理

2019 年，公司持续完善信用风险管理相关制度，在《信用风险管理办法》的基础上，制订《2019 年风险偏好陈述书》和《战略客户管理办法》，对重点监测指标进行动态监测。规范信用风险管理思路和实施路径：

一是摸清风险底数。公司已严格按照监管法规和内控机制，落实信托产品的分类标准和操作流程，真实、准确和动态地反映资产风险状况；建立健全信用风险预警体系，首次启动信息化舆情监测，密切监测分析重点领域信用风险的生成和迁徙变化情况，定期开展房地产、小微金融等项目信用风险压力测试。

二是严控增量风险。公司已实行统一管理，严格不同层级的审批权限；加强信用风险审查，有效甄别高风险客户。在信用风险多发业务领域，制订准入政策及额度管理相关制度，严格业务准入并落实监管要求，确保业务合法合规开展。

三是处置存量风险。公司综合运用多种手段加快处置存量不良资产，并缓释潜在风险，提升风险缓释能力。

##### (2) 市场风险管理

在自营证券方面，公司由专业部门负责境内外权益类投资业务管理，严格按照公司规章制度开展相关业务。2019 年的 A 股和港股证券市场受到境内宏观经济下行，以及中美贸易战影响，市场波动加大，整体震荡下行。针对证券市场的风险，通过控制总体投资预算、减少新增投资、抓住市场结构性机会和个股机会减持以降低整体投资规模；并且通过加强对持仓标的的基本面跟踪等措施，将证券市场下行风险保持在可控范围内。在证券投资类信托业务方面，公司调整组织架构，采取对业务开发、交易、估值、清算、风控、运营管理、信息技术专业化划分，分设团队，实现全流程管理的专业化，提高工作效率。通过对业务流程中的潜在风险事件定制通知和实时针对性复核或监控的方式防范和管理市场风险，不断提高业务信息系统对业务的支持水平，提高系统监控的覆盖面，2019 年完成“自动化估值体系”更新迭代，有力地保障了证券信托业务合法、合规运行。

### （3）操作风险管理

公司已建立一套以战略管理、业务管理、财务管理、信息系统、风险管理和稽核为核心的较为完善的内部控制制度和操作流程，形成职责明确、分工合理、相互制衡的组织结构和内部牵制机制。明确执行风险的责任部门和监督部门，并对业务实施环节、事项做出明确的规范。

与此同时，为适应业务发展变化需要，提高风险管理和内部控制水平，不断完善各项内部控制制度和流程。通过内控自评、内部审计及全面风险评估等方式实现对公司内部控制运行现状及时、有效地监控，并以此为基础形成内部控制的持续改进机制。

2019 年外贸信托在原有内控体系框架的基础上，引入操作风险管理框架，制订《外贸信托操作风险管理办法》，引入操作风险识别和管理工具，探索建立我司在既定的资本配置和风险承受能力范围内各项业务发展的风险管理底线。尝试建立操作风险监测指标，定期监测操作关键指标，关注关键指标变化，及时进行原因分析。

另外，从执行层面上，强化检查跟踪落实，定期开展业务操作流程执行状况检查，跟踪检查公司的各项操作流程的执行情况，保障业务操作流程的有效执行，持续跟踪项目运行情况，强化尽职管理。

### （4）流动性风险管理

对于固有业务流动性风险管理，公司建立有完善的流动性风险管理体系，并根据全面、审慎、可持续原则，结合内外部环境变化，动态调整流动性管理策略，加强流动性及流动性风险管理。一是通过提前规划资产资金结构、逐日盘点流动性余缺等方式，合理安排资金头寸，满足业务和经营需要；二强化流动性风险日常监测，健全流动性风险偏好监控指标体系建设，通过资金头寸匡算、限额管控、风险预警指标等，滚动预测，定期、全面评估流动性及流动性风险状况。三是提高应急处理能力，开展流动性风险压力测试，提高流动性风险管理水平。

对于信托项目层面的流动性管理，公司开展了信托项目流动性风险排查，对各类信托项目的流动性风险进行全面排查。根据排查结果对部分重点项目进行分析及调查，并完成流动性风险五级分类评定，综合分析公司信托项目整体流动性风险情况。在对存续信托项目流动性风险情况有较为全面掌握的基础上，通过总

结整理问题和应对措施，进一步强化信托项目流动性风险管理。

#### （5）法律合规风险管理

作为央企下属全资信托公司，公司高度重视合规价值培养和合规文化塑造，积极倡导“合规优先、主动合规、全员合规、全过程合规”的合规文化，在公司上下树立合规经营理念。严格遵守各项政策法规开展合规管理工作，坚持合规统筹管理，合规要求覆盖所有业务类型，贯穿业务开展全流程，并追求各项工作的持续合规。合规审查中按照“实质重于形式”审查原则，审慎判断项目合规风险，明确合规是底线并要求全员坚守。

合规管理方面，公司建设性提出合规法律意见建议，积极支持业务合规发展。严格执行法律及监管政策要求，公司通过持续补充、修订内部规定确保外规内化及时、全面，将各项监管要求通过项目合规审查落实为具体执行前提，加强合同文本管理，持续完善业务合规管理制度流程，保障业务开展事前、事中和事后全过程合规。同时，公司定期或不定期发布监管动态及政策解读，通过移动端推送、内部分享、专题培训、全员竞赛等方式持续推进合规文化宣贯，加强合规知识学习。

法律风险管理方面，公司围绕专业化、可视化、体系化诉讼管理及风险防范机制建设，通过强化专业支持、加强体系管理、引导全员学习，在能力提升、体系管理、资源协同、风险宣贯、团队建设上加强探索，综合运用债务重组、和解调解、司法处置等手段，筑牢风险防控长城。

#### （6）交叉金融产品风险管理

针对交叉金融产品风险和创新业务，公司通过全面风险管理三道防线层层把控，坚守合规底线，把握实质风险，同时，规范业务开展，未发生交叉金融产品风险。公司已发布《外贸信托交叉金融产品业务管理办法》，为有效把控交叉金融产品风险提供制度依据。

一是控制业务增量。公司已完善同业业务内部管理架构，确保业务复杂程度与风险管理能力相匹配，审慎开展交叉金融业务。公司制定了同业业务交易对手负面清单，审慎选择交易对手，并对法律法规及监管政策禁止的业务领域，公司在业务开展过程中均予以回避。

二是做实穿透管理。公司根据业务开展事前、事中、事后的规范审慎的操作，

能准确把握业务规模、业务品种、基础资产性质、风险状况、资本和拨备等相关信息。新开展的同业投资业务均未进行多层嵌套，已根据基础资产性质，准确计量风险，足额计提资本和拨备。

三是消化存量风险。公司已全面排查存量同业业务，所有业务均按照信托合同规范化开展，不存在多层架构、复杂程度高的业务。对风险高的同业投资业务，公司持续关注运营情况，必要时制定应对策略和退出时间表。

#### （7）信息科技风险管理

根据全面风险管理要求，公司大力推进信息科技风险体系与制度的建设与完善。2019 年根据《商业银行信息科技风险管理指引》，结合公司信息化现状，编制完成《外贸信托信息科技风险管理办法》，为公司信息科技风险管理提供有效抓手与保障。

公司定期开展信息科技风险偏好指标监测，包含系统可用率、信息安全事件、应用系统事件等，有效保障信息系统安全与平稳运行。此外，公司针对网络安全方面进行应急演练，并持续推动灾备建设。2019 年，公司进一步提升了科技风险管理水平，对信息科技风险提供有效缓释。

#### （8）声誉风险管理

2019 年，公司进一步完善品牌管理和声誉管理。通过修订《外贸信托声誉风险管理办法》，进一步明确公司各部门对声誉风险管理负有的责任；运用科技手段强化对舆情的监测与识别，实现 7\*24 小时不间断的舆情监测与预警，确保公司及时掌握舆情动态，科学研判舆情走势；加大正面宣传引导舆论，将主动防范风险和应急处置相结合，有效避免重大声誉风险事件的发生。

## 5、报告期末及上一年度末的比较式会计报表

### 5.1 自营资产

#### 5.1.1 会计师事务所审计结论



KPMG Huazhen LLP  
8th Floor, KPMG Tower  
Oriental Plaza  
1 East Chang An Avenue  
Beijing 100738  
China  
Telephone +86 (10) 8508 5000  
Fax +86 (10) 8518 5111  
Internet kpmg.com/cn

毕马威华振会计师事务所  
(特殊普通合伙)  
中国北京  
东长安街1号  
东方广场毕马威大楼8层  
邮政编码: 100738  
电话 +86 (10) 8508 5000  
传真 +86 (10) 8518 5111  
网址 kpmg.com/cn

#### 审计报告

毕马威华振审字第 2002393 号

中国对外经济贸易信托有限公司董事会:

##### 一、 审计意见

我们审计了后附的第 1 页至第 56 页的中国对外经济贸易信托有限公司 (以下简称“外贸信托”) 财务报表, 包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表, 2019 年度的利润表、现金流量表和所有者权益变动表以及相关财务报表附注。

我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)的规定编制, 公允反映了外贸信托 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和现金流量。

##### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于外贸信托, 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

##### 三、 其他信息

外贸信托管理层对其他信息负责。其他信息包括外贸信托 2019 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

第 1 页, 共 3 页

KPMG Huazhen LLP, a People's Republic of China partnership and a member firm of the KPMG network of independent member firms affiliated with KPMG International Cooperative (“KPMG International”), a Swiss entity.

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) 一家中国注册会计师事务所, 是 KPMG 网络的一员, 该网络由独立成员所组成, 并与 KPMG 国际合作组织 (“KPMG 国际”) 相关联, 该组织并非实体。



## 审计报告 (续)

毕马威华振审字第 2002393 号

### 三、其他信息 (续)

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 四、管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估外贸信托的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非外贸信托计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督外贸信托的财务报告过程。

### 五、注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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



## 审计报告 (续)

毕马威华振审字第 2002393 号

## 五、注册会计师对财务报表审计的责任 (续)

- (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。
- (3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。
- (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对外贸信托持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致外贸信托不能持续经营。
- (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师


 龚凯 


中国北京

胡东方




2020 年 4 月 23 日

第 3 页，共 3 页

## 5.1.2 资产负债表

编制单位：中国对外经济贸易信托有限公司

2019 年 12 月 31 日

单位：人民币万元

项 目	年末数	年初数
流动资产：	-	-

货币资金	28,037.25	43,367.85
拆出资金	-	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	11,412.61	27,138.05
衍生金融产品	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收票据	-	-
应收账款	47,241.24	49,185.50
预付款项	2,993.05	1,056.39
应收利息	-	-
其他应收款	13,229.02	6,266.44
持有待售资产	-	-
一年内到期的非流动资产	-	-
其他流动资产	1,003.56	-
<b>流动资产合计</b>	<b>103,916.73</b>	<b>127,014.23</b>
<b>非流动资产：</b>		
发放贷款及垫款	-	-
可供出售金融资产	1,607,047.32	1,239,009.55
持有至到期投资	-	-
长期应收款	-	-
长期股权投资	92,714.63	87,382.06
投资性房地产	-	-
固定资产	3,558.11	2,883.22
在建工程	-	-
生产性生物资产	-	-
油气资产	-	-
无形资产	15,223.96	11,566.68
开发支出	-	-
商誉	-	-
长期待摊费用	1,155.83	1,272.54
递延所得税资产	17,726.67	31,190.27
其他非流动资产	-	-
<b>非流动资产合计</b>	<b>1,737,426.52</b>	<b>1,373,304.32</b>
<b>资产总计</b>	<b>1,841,343.25</b>	<b>1,500,318.55</b>
<b>流动负债：</b>		
短期借款	15,000.00	70,000.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付票据	-	-
应付账款	-	-
预收款项	1,270.89	512.66

应付职工薪酬	4,433.83	4,099.64
应交税费	2,263.82	14,640.20
其他应付款	46,709.85	152,201.03
一年内到期的非流动负债	-	-
其他流动负债	-	-
<b>流动负债合计</b>	<b>69,678.39</b>	<b>241,453.53</b>
<b>非流动负债：</b>		
长期借款	-	-
应付债券	-	-
长期应付款	-	-
预计负债	-	-
递延收益	-	-
递延所得税负债	-	-
其他非流动负债	-	-
<b>非流动负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>负债合计</b>	<b>69,678.39</b>	<b>241,453.53</b>
<b>所有者权益（或股东权益）：</b>		
实收资本（或股本）	800,000.00	274,062.11
资本公积	286,591.70	170,903.65
减：库存股	-	-
其他综合收益	-16,787.77	-26,729.37
盈余公积	142,293.30	124,382.83
一般风险准备	96,746.00	83,214.86
未分配利润	462,821.63	633,030.94
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,771,664.86</b>	<b>1,258,865.02</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,841,343.25</b>	<b>1,500,318.55</b>

### 5.1.3 利润表

编制单位：中国对外经济贸易信托有限公司

2019 年度

单位：人民币万元

项目	本年数	上年数
<b>一、营业收入</b>	<b>278,872.85</b>	<b>299,775.72</b>
利息净收入	-1,056.23	-1,258.54
利息收入	996.63	1,931.38
利息支出	2,052.86	3,189.92
手续费及佣金净收入	160,328.23	237,693.94
手续费及佣金收入	160,328.23	237,693.94
手续费及佣金支出	-	-
租赁收益	-	-
投资收益	119,796.99	62,927.75
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-210.31	363.71
汇兑收益（损失以“-”号填列）	14.93	42.73
其他业务收入	-	-
其他收益	0.35	3.67

资产处置收益（损失以“-”号填列）	-1.11	2.46
<b>二、营业支出</b>	<b>44,207.33</b>	<b>43,979.45</b>
税金及附加	1,153.59	1,486.97
业务及管理费	57,780.80	47,771.81
资产减值损失	-16,682.42	-7,038.29
其他业务成本	1,955.36	1,758.96
<b>三、营业利润（亏损以“-”号填列）</b>	<b>234,665.52</b>	<b>255,796.27</b>
加：营业外收入	917.64	8.67
减：营业外支出	387.88	205.14
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>235,195.28</b>	<b>255,599.80</b>
减：所得税费用	56,090.62	60,986.12
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>179,104.66</b>	<b>194,613.68</b>
（一）按所有权归属分类：		
归属于母公司所有者的净利润	179,104.66	194,613.68
*少数股东损益	-	-
（二）按经营持续性分类：		
持续经营净利润	179,104.66	194,613.68
终止经营净利润	-	-
六、其他综合收益的税后净额	9,941.60	-45,858.94
（一）以后不能重分类进损益的其他综合收益	-	-
其中：1.重新计量设定受益计划净负债或净资产导致的变动	-	-
2.权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	-	-
（二）以后将重分类进损益的其他综合收益	9,941.60	-45,858.94
其中：1.权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中所享有的份额	511.85	-3,929.84
2.可供出售金融资产公允价值变动损益	9,429.75	-41,929.10
3.持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益	-	-
4.现金流量套期损益的有效部分	-	-
5.外币财务报表折算差额	-	-
七、综合收益总额	189,046.26	148,754.74
归属于母公司所有者的综合收益总额	189,046.26	148,754.74
*归属于少数股东的综合收益总额		
八、每股收益：		
（一）基本每股收益	-	-
（二）稀释每股收益	-	-

## 5.1.4 所有者权益变动表

编制单位：中国对外经济贸易信托有限公司

2019/12/31

单位：人民币万元

项目	本金额								
	实收资本	资本公积	减：库存	其他综合	专项	盈余公	一般风险	未分配利润	所有者权

			股	收益	储备	积	准备		益合计
一、上年年末余额	274,062.11	170,903.65	-	-26,729.37	-	124,382.83	83,214.86	633,030.94	1,258,865.02
加： 1. 会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本年初余额	274,062.11	170,903.65	-	-26,729.37	-	124,382.83	83,214.86	633,030.94	1,258,865.02
三、本年增减变动金额 (减少以“-”号填列)	525,937.89	115,688.05	-	9,941.60	-	17,910.47	13,531.14	-170,209.31	512,799.84
(一) 综合收益总额	-	-	-	9,941.60	-	-	-	179,104.66	189,046.26
(二) 所有者投入和减少资本	78,374.06	281,625.94	-	-	-	-	-	-	360,000.00
1. 所有者投入资本	78,374.06	281,625.94	-	-	-	-	-	-	360,000.00
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	281,625.94	-	-	-	-	17,910.47	13,531.14	-349,313.97	-36,246.42
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	17,910.47	-	-17,910.47	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	13,531.14	-13,531.14	-
3. 对所有者(或股东)的分配	-	-	-	-	-	-	-	-36,246.42	-36,246.42
4. 其他	281,625.94	-	-	-	-	-	-	-281,625.94	-
(四) 所有者权益内部结转	165,937.89	-165,937.89	-	-	-	-	-	-	-
1. 资本公积转增资本(或股本)	165,937.89	-165,937.89	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增资本(或股本)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-	-

4. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(五) 专项储备提取和使用	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1. 提取专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 使用专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>四、本年年末余额</b>	800,000.00	286,591.70	-	-16,787.77	-	142,293.30	96,746.00	462,821.63	1,771,664.86

## 5.2 信托资产

### 5.2.1 信托项目资产负债汇总表

编制单位：中国对外经济贸易信托有限公司

2019/12/31

单位：人民币万元

信托资产	年末数	年初数	信托负债和信托权益	年末数	年初数
<b>信托资产：</b>			<b>信托负债：</b>		
现金及存放中央银行款项	-	-	拆入资金	-	-
存放同业款项	1,503,734.15	1,910,045.69	交易性金融负债	-	-
拆出资金	-	23,000.00	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	23,445,330.38	18,550,079.90	卖出回购金融资产款	-	-
衍生金融资产	-	-	应付职工薪酬	-	-
买入返售金融资产	903,875.82	889,003.42	应交税金	36,818.45	22,424.19
应收票据	-	-	应付利息	-	-
应收帐款	673.02	29,413.55	应付股利	77,645.00	91,845.20
预付帐款	-	-	应付账款	78,042.07	71,744.88
应收利息	87,865.01	118,924.48	其他应付款	387,117.12	733,611.47
应收股利	17,562.23	30,723.59	代理业务负债	-	-
其他应收款	53,587.69	35,557.49	长期应付款	-	-
发放贷款及垫款	13,133,092.39	12,667,523.10	预计负债	-	-
代理业务资产	-	-	递延所得税负债	-	-
可供出售金融资产	546,379.11	576,000.00	<b>信托负债合计</b>	<b>579,622.64</b>	<b>919,625.74</b>
长期应收款	-	-			
持有至到期投资	4,131,510.18	9,054,653.37			
长期股权投资	374,163.80	468,508.80	<b>信托权益：</b>		
固定资产	-	-	实收信托	40,714,422.69	42,906,857.24
固定资产清理	-	-	资本公积	67,354.61	102,651.85
无形资产	-	-	其他综合收益	-	-
商誉	-	-	盈余公积	-	-
长期待摊费用	-	-	信托赔偿准备金	-	-
递延所得税资产	-	-	未分配利润	3,215,102.23	976,843.94

其他资产	378,728.39	552,545.38	信托权益合计	43,996,879.53	43,986,353.03
信托资产合计	44,576,502.17	44,905,978.77	信托负债和信托权益合计	44,576,502.17	44,905,978.77

## 5.2.2 信托项目利润及利润分配表

编制单位:中国对外经济贸易信托有限公司

2019 年度

单位:人民币万元

项目	本年实际数	上年实际数
<b>一、营业收入</b>	<b>4,931,726.95</b>	<b>-153,908.12</b>
利息收入	1,753,458.69	1,784,227.94
租赁收益	-	-
投资收益(损失以“-”号填列)	1,226,406.46	759,979.61
其中:对联营企业合营企业的投资收益	14,452.15	5,391.59
公允价值变动损益(损失以“-”号填列)	1,942,898.08	-2,704,390.09
汇兑损益(损失以“-”号填列)	558.60	535.60
其他业务收入	8,405.12	5,738.82
<b>二、营业支出</b>	<b>641,709.26</b>	<b>686,361.76</b>
税金及附加	8,697.68	6,757.97
业务及管理费	631,294.96	670,607.13
资产减值损失	1,716.62	8,996.66
其他业务成本	-	-
<b>三、营业利润(亏损以“-”号填列)</b>	<b>4,290,017.69</b>	<b>-840,269.88</b>
加:营业外收入	28,133.35	35,466.95
减:营业外支出	-	2,066.59
<b>四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>4,318,151.04</b>	<b>-806,869.52</b>
减:所得税费用	-	-
<b>五、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>4,318,151.04</b>	<b>-806,869.52</b>
<b>六、其他综合收益</b>	-	-
<b>七、综合收益总额</b>	<b>4,318,151.04</b>	<b>-806,869.52</b>
加:期初未分配信托利润	976,843.94	4,080,328.13
<b>八、可供分配的信托利润</b>	<b>5,294,994.98</b>	<b>3,273,458.61</b>
减:本期已分配的信托利润	2,079,892.75	2,296,614.67
<b>九、期末未分配信托利润</b>	<b>3,215,102.23</b>	<b>976,843.94</b>

## 6、会计报表附注

### 6.1 会计报表编制基准说明

#### 6.1.1 会计报表不符合会计核算基本前提的事项

本公司报告期内会计报表编制基准无不符合会计核算基本前提的事项。

#### 6.1.2 合并报表的并表范围说明

本公司无合并会计报表。

## 6.2 重要会计政策和会计估计说明

本公司于 2019 年度，执行了财政部颁布的以下企业会计准则解释及修订：《关于修订印发 2019 年度一般企业财务报表格式的通知》（财会 [2019] 6 号），《企业会计准则第 7 号——非货币性资产交换（修订）》（“准则 7 号(2019)”），《企业会计准则第 12 号——债务重组（修订）》（“准则 12 号(2019)”），以上会计政策变更未对本公司财务状况和经营成果产生重大影响。

### 6.2.1 计提资产减值准备的范围和方法

根据财金[2012]20 号《金融企业准备金计提管理办法》规定，本公司于 2014 年重新修订了《中国对外经济贸易信托有限公司资产（减值）准备计提和资产核销管理办法》。

计提资产减值准备的范围：应收款项和其它应收款、可供出售金融资产、长期股权投资、固定资产、无形资产。

计提资产减值准备的方法：本公司在资产负债表日，以单项资产为基础判断资产是否存在可能发生减值的迹象。存在减值迹象的，按单项资产估计其可收回金额；难以对单项资产的可收回金额进行估计的，以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。当资产或资产组的可收回金额低于其账面价值时，公司将其账面价值减记至可收回金额，减记部分计提资产减值准备。

### 6.2.2 金融资产四分类的范围和标准

金融资产分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；可供出售的金融资产；持有至到期的投资；贷款和应收款项。

### 6.2.3 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产核算方法

取得时以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按公允价值（扣除已宣告但尚未发放的现金股利或已到付息期但尚未领取的债券利息）作为初始确认金额。

持有期间将取得的利息或现金股利确认为投资收益。期末将公允价值变动计入当期损益。

处置时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。

### 6.2.4 可供出售金融资产核算方法

取得时按公允价值（扣除已到付息期但尚未领取的债券利息或已宣告但尚未发放的现金股利）和相关交易费用之和作为初始确认金额。

持有期间取得的利息或现金股利确认为投资收益。期末将公允价值变动计入其他综合收益。

处置时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资损益；同时，将原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资损益。

#### 6.2.5 持有至到期投资核算方法

取得时按公允价值（扣除已到付息期但尚未领取的债券利息）和相关交易费用之和作为初始确认金额。

持有期间按照摊余成本和实际利率（如实际利率与票面利率差别较小的，按票面利率）计算确认利息收入，计入投资收益。实际利率在取得时确定，在该预期存续期间或适用的更短期间内保持不变。处置时，将所取得价款与该投资账面价值之间差额计入投资收益。

如果公司于到期日前出售或重分类了较大金额的可供出售持有至到期投资（较大金额是指相对于该类投资在出售或重分类前的总额金额而言），则公司将该类投资的剩余部分重分类为可供出售金融资产，且在本会计年度及以后两个完整的会计年度内不再将任何金融资产分类为持有至到期投资。但是，下列情况除外：出售日或重分类日距离该项投资到期日或赎回日较近（如到期前三个月内），市场利率变化对该项投资的公允价值没有显著影响；根据合同约定的定期偿付或提前还款方式收回该投资几乎所有初始本金后，将剩余部分予以出售或重分类；出售或重分类是由于企业无法控制、预期不会重复发生且难以合理预计的独立事项所引起。

金融资产公允价值的确定方法。存在活跃市场的金融资产或金融负债，以活跃市场的报价确定其公允价值，活跃市场的报价包括易于定期从交易所、经纪商、行业协会、定价服务机构等获得的价格，且代表了在公平交易中实际发生的市场交易的价格；不存在活跃市场的金融资产或金融负债，采用估值技术确定其公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融资产或金融负债的当前公允价值、现金流量

折现法和期权定价模型等。

## 6.2.6 长期股权投资核算方法

### (1) 投资成本的计量

#### ①企业合并形成的长期股权投资

同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，公司以支付现金、转让非现金资产或承担债务方式作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。长期股权投资初始投资成本与支付的现金、转让的非现金资产以及所承担债务账面价值之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。公司以发行权益性证券作为合并对价的，在合并日按照取得被合并方所有者权益账面价值的份额作为长期股权投资的初始投资成本。按照发行股份的面值总额作为股本，长期股权投资初始投资成本与所发行股份面值总额之间的差额，调整资本公积；资本公积不足冲减的，调整留存收益。为企业合并发生的各项直接相关费用，包括为进行企业合并而支付的审计费用、评估费用、法律服务费用等，于发生时计入当期损益。

非同一控制下的企业合并取得的长期股权投资，合并成本为在购买日为取得对被购买方的控制权而付出的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券的公允价值。采用吸收合并时，企业合并成本与取得被购买方可辨认净资产公允价值的差额，确认为商誉。采用控股合并时，企业合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为合并资产负债表中的商誉。企业合并成本小于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，计入当期损益（营业外收入）。为进行企业合并发生的各项直接相关费用计入企业合并成本（债券及权益工具的发行费用除外）。

#### ②其他方式取得的长期股权投资

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

以发行权益性证券取得的长期股权投资，按照发行权益性证券的公允价值作为初始投资成本。

投资者投入的长期股权投资，按照投资合同或协议约定的价值作为初始投资

成本，但合同或协议约定价值不公允的除外。

以非货币资产交换方式取得的长期股权投资，如果该项交换具有商业实质且换入资产或换出资产的公允价值能可靠计量，则以换出资产的公允价值和相关税费作为初始投资成本，换出资产的公允价值与账面价值之间的差额计入当期损益；若非货币资产交换不同时具备上述两个条件，则按换出资产的账面价值和相关税费作为初始投资成本。

以债务重组方式取得的长期股权投资，按取得的股权的公允价值作为初始投资成本，初始投资成本与债权账面价值之间的差额计入当期损益。

## (2) 后续计量

对子公司的长期股权投资采用的成本法核算,编制合并财务报表时按照权益法进行调整。

对被投资单位不具有共同控制或重大影响且在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的长期股权投资，采用的成本法核算。

对被投资单位具有共同控制或重大影响的长期股权投资，采用权益法核算。

①采用成本法核算时，追加或收回投资调整长期股权投资的成本。取得被投资单位宣告发放的现金股利或利润，除取得投资时实际支付的价款或对价中包含的已宣告但尚未发放的现金股利或利润外，按照享有被投资单位宣告发放的现金股利或利润确认当期投资收益。

②采用权益法核算时，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益的份额，确认投资损益并调整长期股权投资的账面价值。当期投资损益为按应享有或应分担的被投资单位当年实现的净利润或发生的净亏损的份额。在确认应分担的被投资单位发生的净亏损时，以投资账面价值减记至零为限（投资企业负有承担额外损失义务的除外）；如果被投资单位以后各期实现净利润，在收益分享额超过未确认的亏损分担额以后，按超过未确认的亏损分担额的金额，恢复投资的账面价值。

## 6.2.7 固定资产计价和折旧方法

### (1) 固定资产确认条件

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

项固定资产有关的经济利益很可能流入企业；该固定资产的成本能够可靠地计量。

#### (2) 固定资产分类

固定资产分类为：运输设备、办公设备及其他。

#### (3) 固定资产计量

固定资产通常按照实际成本作为初始计量。与固定资产有关的后续支出，在使该固定资产可能流入企业的经济利益超过了原先的估计时，计入固定资产账面价值，其增计后的金额不超过该固定资产的可收回金额。

#### (4) 固定资产折旧方法

本公司固定资产从其达到预定可使用状态的次月起，采用年限平均法提取折旧。各类固定资产的预计残值率、折旧年限和年折旧率如下：

固定资产类别	折旧年限（年）	预计残值率	年折旧率
运输设备	8	5%	12%
办公设备及其他	3-5	3%	19%-32%

已计提减值准备的固定资产在计提折旧时，按照该项固定资产的账面价值，以及尚可使用年限重新计算确定折旧率和折旧额；已全额计提减值准备的固定资产，不再计提折旧。

#### 6.2.8 无形资产计价及摊销政策

计价方法：按实际成本计价。

摊销方法：使用寿命有限的无形资产，其应摊销金额在使用寿命内系统合理摊销，本公司预计使用寿命有限的无形资产摊销期限为 10 年。使用寿命不确定的无形资产不摊销。

#### 6.2.9 长期待摊费用的摊销政策

长期待摊费用按实际发生额入账，在受益期或规定的期限内分期平均摊销。如果长期待摊的费用项目不能使以后会计期间受益则将尚未摊销的该项目的摊余价值全部转入当期损益。

#### 6.2.10 收入确认原则和方法

本公司主要收入包括利息收入、手续费及佣金收入、及其他收入等。收入在满足以下条件时予以确认：

(1) 与交易相关的经济利益能够流入企业；

(2) 收入的金额能够可靠的计量。

各项业务收入确认的具体方法：

贷款利息收入：按未偿还本金及适用利率以时间比例为计算基础按权责发生制确认。发放贷款到期（含展期，下同）90 天以上尚未收回的，或在应收利息逾期 90 天后仍未收到的，其应计利息停止计入当期利息收入，纳入表外核算，已计提的贷款应收利息，应冲减原已计入损益的利息收入，转作表外核算。收到非应计贷款的还款时，首先冲减未偿还的贷款本金，待本金全部收回后，超出部分计入当期利息收入。

手续费及佣金收入：依照信托合同约定确认收入。

其他收入：按权责发生制原则确认。

#### 6.2.11 所得税的会计处理方法

本公司采用资产负债表债务法进行所得税核算。

#### 6.2.12 信托报酬确认原则和方法

信托报酬确认原则和方法：按照权责发生制、收入确认原则，在相关经济利益能够流入、收入金额能够可靠计量的情况下，依据信托协议的约定确认信托报酬。

### 6.3 或有事项说明

本公司报告期内无或有事项。

### 6.4 重要资产转让及其出售的说明

本公司报告期内无重要资产转让及其出售的事项。

### 6.5 会计报表中重要项目的明细资料

#### 6.5.1 自营资产经营情况

##### 6.5.1.1 资产风险分类结果（以净值列示）

单位：人民币万元

表 6.5.1.1

信用风险资产五级分类	正常类	关注类	次级类	可疑类	损失类	信用风险资产合计	不良资产合计	不良资产率 (%)

期初数	1,475,765.60	4,452.44	305.62	131.35	-	1,480,655.01	436.07	0.03%
期末数	1,764,420.75	38,207.08	2,447.68	36.13	-	1,805,111.64	2,483.81	0.14%

## 6.5.1.2 资产损失准备计提转回情况

单位：人民币万元

表 6.5.1.2

	期初数	本期计提	本期转回	本期核销	期末数
贷款损失准备	-	-	-	-	-
一般准备	-	-	-	-	-
专项准备	-	-	-	-	-
其他资产减值准备	-	-	-	-	-
可供出售金融资产减值准备	88,037.37	21,500.00	39,086.08	24,809.28	45,642.01
持有至到期投资减值准备	-	-	-	-	-
长期股权投资减值准备	401.79	-	-	-	401.79
坏账准备	1,197.92	903.65	-	-	2,101.57
投资性房地产减值准备	-	-	-	-	-

## 6.5.1.3 金融资产和长期股权投资

单位：人民币万元

表 6.5.1.3

	自营股票	基金	债券	持有至到期投资	长期股权投资
期初数	119,765.73	40,863.98	-	-	87,382.06
期末数	144,999.03	52,651.19	-	-	92,714.63

注：净值列示

6.5.1.4 前三名的自营长期股权投资的企业名称、占被投资企业权益的比例、主要经营活动及投资收益情况（按持股比例排列）

表 6.5.1.4

企业名称	占被投资企业权益的比例	主要经营活动	投资收益 (单位：人民币万元)
1.冠通期货股份有限公司	48.72%	期货	670.30
2.诺安基金管理有限公司	40.00%	基金管理	7,585.47
3.宝盈基金管理有限公司	25.00%	基金管理	1,364.95

## 6.5.1.5 前五名的自营贷款的企业名称、占贷款总额的比例和还款情况

表 6.5.1.5

企业名称	占贷款总额的比例	还款情况
-	-	-

## 6.5.1.6 代理业务的期初数、期末数

单位：人民币万元

表 6.5.1.6

	期初数	期末数
代理业务（委托业务）	-	-
其他	-	-
合计	-	-

### 6.5.1.7 公司当年的收入结构

单位：人民币万元

表 6.5.1.7

收入结构	金额
手续费及佣金收入	160,328.23
其中：信托手续费收入	160,328.23
投资银行业务收入	-
利息收入	996.63
其他业务收入	-
其中：计入信托业务收入部分	-
投资收益	119,796.99
其中：股权投资收益	9,620.72
证券投资收益	11,682.67
其他投资收益	98,493.60
公允价值变动收益	-210.31
汇兑收益	14.93
其他收益	0.35
资产处置收益	-1.11
营业外收入	917.64
收入合计	281,843.35

### 6.5.2 信托资产管理情况

#### 6.5.2.1 信托资产情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.1

信托资产	期初数	期末数
集合	32,548,350.40	31,384,926.24
单一	7,680,797.30	6,687,253.95
财产权	4,676,831.07	6,504,321.98
合计	44,905,978.77	44,576,502.17

#### 6.5.2.1.1 主动管理型信托业务情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.1.1

主动管理型信托资产	期初数	期末数
证券投资类	1,552,121.18	16,490,610.30
股权投资类	7,748,372.16	2,608,525.92
融资类	7,561,139.13	9,884,545.68
事务管理类	992,617.86	1,618,443.34

合计	17,854,250.33	30,602,125.24
----	---------------	---------------

## 6.5.2.1.2 被动管理型信托业务情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.1.2

被动管理型信托资产	期初数	期末数
证券投资类	18,601,822.09	6,585,561.97
股权投资类	144,558.51	136,384.56
融资类	-	-
事务管理类	8,305,347.84	7,252,430.40
合计	27,051,728.44	13,974,376.93

注：根据资管新规规定，对部分证券类信托项目进行分类调整。

## 6.5.2.2 本年度已清算结束的信托项目情况

## 6.5.2.2.1 本年度已经清算结束信托项目情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.2.1

已清算结束信托项目	项目个数	实收信托合计金额	加权平均实际年化收益率
集合类	389	6,904,424.99	6.03%
单一类	59	3,558,313.01	7.53%
财产管理类	27	745,460.14	8.09%

## 6.5.2.2.2 本年度已经清算结束的主动管理型信托项目情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.2.2

已清算结束信托项目	项目个数	实收信托合计金额	加权平均实际年化信托报酬率	加权平均实际年化收益率
证券投资类	26	852,441.76	0.18%	6.94%
股权投资类	51	2,120,592.27	0.39%	4.90%
融资类	20	1,123,930.21	0.93%	6.95%
事务管理类	19	20,856.90	0.50%	3.54%

## 6.5.2.2.3 本年度已经清算结束的被动管理型信托项目情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.2.3

已清算结束信托项目	项目个数	实收信托合计金额	加权平均实际年化信托报酬率	加权平均实际年化收益率
证券投资类	299	2,879,149.04	0.20%	5.29%
股权投资类	1	2,042,572.74	0.10%	7.59%
融资类	-	-	-	-
事务管理类	59	2,168,655.22	0.24%	8.09%

## 6.5.2.3 本年度新增信托项目情况

单位：人民币万元

表 6.5.2.3

新增信托项目	项目个数	实收信托合计金额
集合类	726	13,546,591.16

单一类	48	1,115,375.33
财产管理类	325	5,342,677.15
新增合计	1099	20,004,643.64
其中：主动管理型	899	12,390,860.72
被动管理型	200	7,613,782.92

6.5.2.4 本公司履行受托人义务情况及因本公司自身责任而导致的信托资产损失情况

公司管理信托财产恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务。没有因公司自身责任而导致信托资产损失的情况。

#### 6.5.2.5 信托赔偿准备金的提取、使用和管理情况

本公司按照税后利润的 5% 计提信托赔偿准备金。截至 2019 年 12 月 31 日，信托赔偿准备金余额 69,024.45 万元人民币。本年度公司未发生信托赔偿准备金使用情况。

## 6.6 关联方关系及其交易的披露

### 6.6.1 关联交易方的数量、关联交易的总金额及关联交易的定价政策

#### 固有业务关联方情况表

单位：人民币万元、美元万元

表 6.6.1.1

	关联交易数量	关联交易金额 (人民币万元)	定价政策
合计	9	6,502.48	公允价值定价

#### 信托业务关联方情况

单位：人民币万元、美元万元

表 6.6.1.2

	关联交易数量	关联交易金额 (人民币万元)	定价政策
合计	-	-	-

6.6.2 关联交易方与本公司的关系性质、关联交易方的名称、法定代表人、注册地址、注册资本及主营业务

#### 固有业务关联方情况

单位：人民币万元、美元万元

表 6.6.2.1

关系性质	关联方名称	法定代表人	注册地	注册资本	主营业务
实际控制人	中国中化股份有限公司	宁高宁	北京	3,980,000.00	石油、化肥、化工、金融等行业投资

股东	中化资本有限公司	杨林	上海	601,708.11	投资管理；资产管理；实业投资；企业管理咨询；投资咨询
股东	中化集团财务有限责任公司	杨林	北京	300,000.00	财务和融资顾问
同受母公司控制	北京凯晨置业有限公司	李从瑞	北京	美元 10,240.00	房地产开发
同受母公司控制	中化金茂物业管理(北京)有限公司	谢炜	北京	500.00	物业管理
同受母公司控制	中化国际物业酒店管理有限公司	谢炜	北京	38,760.00	房地产开发
同受母公司控制	中化聚缘企业管理(北京)有限公司	杨宏	北京	1,000.00	物业管理、餐饮服务、其他企业服务
同受母公司控制	中化信息技术有限公司	赵洋	北京	5,000.00	互联网信息服务、技术开发、技术转让、基数咨询、技术服务等

## 信托业务关联方情况

单位:人民币万元、美元万元

表 6.6.2.2

关系性质	关联方名称	法定代表人	注册地	注册资本	主营业务
-	-	-	-	-	-

## 6.6.3 本公司与关联方的重大交易事项

6.6.3.1 固有财产与关联方：贷款、投资、租赁、应收账款、担保、其他方式等期初汇总数、本期发生额汇总数、期末汇总数

## 固有财产与关联方关联交易

单位:人民币万元

表 6.6.3.1

	期初数	借方发生额	贷方发生额	期末数
贷款	-	-	-	-
投资	-	-	-	-
租赁	-	-	-	-
担保	-	-	-	-
应收账款	-	-	-	-
其他	1,481.24		340.60	1,821.84
合计	1,481.24		340.60	1,821.84

注：固有财产与关联方关联交易主要是房屋租赁费、物业管理费用等。

## 6.6.3.2 信托资产与关联方：贷款、投资、租赁、应收账款、担保、其他方

式等期初汇总数、本期发生额汇总数、期末汇总数

信托资产与关联方关联交易

单位:人民币万元

表 6.6.3.2

	期初数	借方发生额	贷方发生额	期末数
贷款	-	-	-	-
投资	-	-	-	-
租赁	-	-	-	-
担保	-	-	-	-
应收账款	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

6.6.3.3 信托公司自有资金运用于自己管理的信托项目（固信交易）、信托公司管理的信托项目之间的相互交易金额

6.6.3.3.1 固有财产与信托财产之间的交易金额期初汇总数、本期发生额汇总数、期末汇总数

固有财产与信托财产相互交易

单位:人民币万元

表 6.6.3.3.1

	期初数	本期发生额	期末数
合计	863,627.40	405,560.76	1,269,188.16

6.6.3.3.2 信托资产与信托财产之间的交易金额期初汇总数、本期发生额汇总数、期末汇总数

信托资产与信托财产相互交易

单位:人民币万元

表 6.6.3.3.2

	期初数	本期发生额	期末数
合计	2,612,914.00	362,464.98	2,975,378.98

6.6.4 关联方逾期未偿还本公司资金的详细情况以及本公司为关联方担保发生或即将发生垫款的详细情况

固有财产没有关联方逾期未偿还本公司资金及本公司为关联方担保发生或即将发生垫款的事项。

## 6.7 会计制度的披露

本公司固有业务和信托业务自 2008 年 1 月 1 日起均执行中华人民共和国财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》。

## 7、财务情况说明书

### 7.1 利润实现和分配情况

2019 年本公司实现净利润 179,104.66 万元，分配方案如下：

- (1) 按当年净利润的 10% 提取法定公积金 17,910.47 万元人民币；
- (2) 按当年净利润的 5% 提取信托赔偿准备金 8,955.23 万元人民币；
- (3) 提取一般准备 4,575.91 万元人民币。

可供股东分配的利润 147,663.05 万元人民币。

### 7.2 主要财务指标

表 7.2

指标名称	指标值
资本利润率	11.82%
加权年化信托报酬率	0.40%
人均利润	424.54 万元人民币

资本利润率 = 净利润 / 所有者权益平均余额 × 100%

人均利润 = 利润总额 / 年平均人数

### 7.3 对本公司财务状况、经营成果有重大影响的其他事项

本公司没有对财务状况、经营成果有重大影响的其他事项。

### 7.4 本公司净资本情况

信托公司净资本风险控制指标报表

单位：人民币万元

表 7.4

项目	期末余额	监管标准
净资本	1,535,151.76	≥2 亿元
固有业务风险资本	303,949.42	
信托业务风险资本	323,902.01	
其他业务风险资本		
各项业务风险资本之和	627,851.43	
净资本/各项业务风险资本之和	244.51%	≥100%
净资本/净资产	86.91%	≥40%



## 8、特别事项简要揭示

### 8.1 前五名股东报告期内变动情况及原因

无

### 8.2 董事、监事及高级管理人员变动情况及原因

2019 年 1 月 31 日，中国外贸信托 2019 年第一次股东会议通过决议：同意选举李强、程永担任中国对外经济贸易信托有限公司董事，张宝红、贾彤不再担任中国对外经济贸易信托有限公司董事职务；同意选举张向东担任中国对外经济贸易信托有限公司独立董事，孙向东不再担任中国对外经济贸易信托有限公司独立董事；同意选举付强强担任中国对外经济贸易信托有限公司监事，宋玉增不再担任中国对外经济贸易信托有限公司监事会主席、监事职务；同意选举经公司职代会选举的职工监事刘郁飞担任中国对外经济贸易信托有限公司职工监事，梁虹不再担任中国对外经济贸易信托有限公司职工监事。李强、程永的任职资格于 2019 年 4 月获北京银保监局核准，张向东的任职资格于 2019 年 6 月获北京银保监局核准。

### 8.3 本公司报告期内变更注册资本金、变更注册地或公司名称、公司分立合并事项

经中国外贸信托 2019 年第三次股东会议审议通过，并经北京银保监局核准（京银保监复〔2019〕791 号），中国外贸信托注册资本由人民币 2,740,621,140.33 元增至人民币 80 亿元整；增加的注册资本中，人民币 783,740,588.64 元由中化资本有限公司出资，人民币 4,475,638,271.03 元由中国外贸信托资本公积和未分配利润转增。中国外贸信托已就上述事项完成工商变更登记备案手续。增资后，中国外贸信托的股东名称、出资金额和出资比例为：中化资本有限公司出资人民币 7,781,053,953.26 元，出资比例 97.26%；中化集团财务有限责任公司出资人民币 218,946,046.74 元，出资比例 2.74%。

### 8.4 公司重大诉讼事项

#### 8.4.1 重大未决诉讼事项

无。

#### 8.4.2 以前年度发生，于本报告年度内终结的诉讼事项

无。

8.4.3 本报告年度发生，于本报告年度内终结的诉讼事项

无。

8.5 公司及其董事、监事和高级管理人员受到处罚的情况

公司无董事、监事或高级管理人员受到处罚

8.6 银保监会及其派出机构对公司检查情况

无。

8.7 本报告期内公司重大事项临时报告

因公司增加注册资本、调整股权结构和变更公司章程，公司在事项完成后于 2019 年 11 月 20 日在《上海证券报》第 83 版和公司官网同时进行重大临时事项的信息披露，发布《中国对外经济贸易信托有限公司关于增加注册资本及调整股权结构的公告》。

8.8 本报告期内公司无银保监会及其省级派出机构认定的其他有必要让客户及相关利益人了解的重要信息。

无。