

公司代码：601555

公司简称：东吴证券

# 东吴证券股份有限公司

## 2015 年年度报告

### 重要提示

一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证年度报告内容的真实、准确、完整，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、未出席董事情况

| 未出席董事职务 | 未出席董事姓名 | 未出席董事的原因说明 | 被委托人姓名 |
|---------|---------|------------|--------|
| 独立董事    | 杨瑞龙     | 公务原因       | 韩晓梅    |

三、天衡会计师事务所（特殊普通合伙）为本公司出具了标准无保留意见的审计报告。

四、公司负责人范力、主管会计工作负责人马震亚及会计机构负责人（会计主管人员）王菁声明：保证年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

#### 五、经董事会审议的报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

公司以非公开发行股票后的总股本30亿股为基数，向全体股东每10股派送现金红利3元（含税），共派送现金红利9亿元（含税），占当年母公司可供股东现金分配的利润的57.24%。

#### 六、前瞻性陈述的风险声明

本报告中所涉及的未来计划等前瞻性描述不构成公司对投资者的实质承诺，敬请投资者注意投资风险。

#### 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况

否

**八、 是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？**

否

**九、 重大风险提示**

公司主营业务与国内宏观经济环境、资本市场走势高度相关，证券行业的监管政策调整和资本市场的剧烈波动都将对公司经营业绩产生重大影响。

公司已在本报告中详细描述在日常经营活动中可能面临的风险，本公司面临的重大风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险以及合规风险等。敬请查阅本报告第四节 三、（四）可能面对的风险及应对措施。

## 目录

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| 第一节  | 释义.....                | 4   |
| 第二节  | 公司简介和主要财务指标.....       | 4   |
| 第三节  | 公司业务概要.....            | 22  |
| 第四节  | 管理层讨论与分析.....          | 25  |
| 第五节  | 重要事项.....              | 48  |
| 第六节  | 普通股股份变动及股东情况.....      | 56  |
| 第七节  | 优先股相关情况.....           | 62  |
| 第八节  | 董事、监事、高级管理人员和员工情况..... | 63  |
| 第九节  | 公司治理.....              | 71  |
| 第十节  | 公司债券相关情况.....          | 80  |
| 第十一节 | 财务报告.....              | 83  |
| 第十二节 | 备查文件目录.....            | 243 |
| 第十三节 | 证券公司信息披露.....          | 243 |

## 第一节 释义

### 一、 释义

在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

| 常用词语释义      |   |                  |
|-------------|---|------------------|
| 东吴证券/本公司/公司 | 指 | 东吴证券股份有限公司       |
| 苏州证券/苏州证券公司 | 指 | 苏州证券有限责任公司       |
| 中国证监会/证监会   | 指 | 中国证券监督管理委员会      |
| 江苏证监局       | 指 | 中国证券监督管理委员会江苏监管局 |
| 国发集团        | 指 | 苏州国际发展集团有限公司     |
| 《章程》        | 指 | 《东吴证券股份有限公司章程》   |
| 上交所         | 指 | 上海证券交易所          |
| 东吴创投        | 指 | 东吴创业投资有限公司       |
| 东吴创新资本      | 指 | 东吴创新资本管理有限责任公司   |
| 东吴期货        | 指 | 东吴期货有限公司         |
| 东吴基金        | 指 | 东吴基金管理有限公司       |
| 东吴新加坡       | 指 | 东吴证券中新（新加坡）有限公司  |
| 元           | 指 | 人民币元             |

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、 公司信息

|           |                              |
|-----------|------------------------------|
| 公司的中文名称   | 东吴证券股份有限公司                   |
| 公司的中文简称   | 东吴证券                         |
| 公司的外文名称   | Soochow Securities Co., Ltd. |
| 公司的外文名称缩写 | SCS                          |
| 公司的法定代表人  | 范力                           |
| 公司总经理     | 范力                           |

### 公司注册资本和净资产

|      | 本报告期末             | 上年度末             |
|------|-------------------|------------------|
| 注册资本 | 2,700,000,000     | 2,700,000,000    |
| 净资产  | 14,458,387,480.79 | 8,723,266,309.44 |

### 公司的各单项业务资格情况

公司经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务、融资融券业务，代销金融产品业务。

公司的主要业务资格如下：

1、2001年5月6日，中国证券监督管理委员会以“证监信息字[2001]5号”文批准公司网上证券委托业务资格。

2、2002年8月1日，中国证券监督管理委员会以“证监机构字[2002]231号”文《关于东吴证券有限责任公司股票主承销商资格的批复》，核准公司股票主承销商资格。

3、2002年8月13日，中国证券监督管理委员会以“证监机构字[2002]244号”文《关于核准东吴证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》，核准公司受托投资管理业务资格。

4、2003年4月1日，中国人民银行以“银复[2003]68号”文，中国人民银行《关于东吴证券有限责任公司等7家证券公司成为全国银行间同业拆借市场成员的批复》，批准公司成为全国银行间同业拆借市场成员资格。

5、2003年12月12日，中国证券监督管理委员会以“证监基金字[2003]141号”文《关于东吴证券有限责任公司开放式证券投资基金代销业务资格的批复》，批准公司开放式证券投资基金代销业务资格。

6、2004年11月25日，上海证券交易所“上证会字[2004]44号”文，《关于上海证券交易所国债买断式回购交易参与主体认定的通知》，批准公司为上海证券交易所国债买断式回购交易参与主体。

7、2005年5月30日，中国证监会以“机构部部函[2005]208号”《关于同意东吴证券有限责任公司申请企业年金基金投资管理人资格的函》，核准企业年金基金投资管理人资格。

8、2008年7月10日，中国证券监督管理委员会以“证监许可[2008]909号”《关于核准东吴证券有限责任公司为期货公司提供中间介绍业务资格的批复》，核准公司为期货公司提供中间介绍业务资格。

9、2009年3月9日，中国证券业协会以“中证协函[2009]78号”《关于授予从事代办股份转让主办券商业务资格的函》，授予公司从事代办股份转让主办券商业务资格。

10、2009年3月9日，中国证券业协会以“中证协函[2009]79号”《关于授予东吴证券有限责任公司报价转让业务资格的函》，授予公司报价转让业务资格。

11、2009年9月9日，中国证监会以“机构部部函[2009]416号”《关于对东吴证券有限责任公司开展直接投资业务试点的无异议函》，批准公司可设立全资专业子公司开展直接投资业务。

12、2010年5月28日，江苏证监局批准公司自营参与股指期货交易。

13、2012年4月26日，中国证券监督管理委员会以“机构部部函[2012]206号”《关于东吴证券股份有限公司从事债券质押式报价回购业务试点方案的无异议函》，核准公司从事债券质押式报价回购业务。

14、2012年4月27日，中国证券监督管理委员会以“证监许可[2012]604号”《关于核准东吴证券股份有限公司融资融券业务资格的批复》，批准公司开展融资融券业务资格。

15、2012年6月11日，中国证券业协会，中证协函[2012]373号《关于反馈证券公司中小企业私募债券承销业务试点实施方案专业评价结果的函》，批准公司小企业私募债券承销业务试点资格。

16、2012年7月6日，中国证券监督管理委员会江苏监管局以“苏证监机构函[2012]293号”《关于东吴证券资产管理业务参与股指期货交易的备案函》，批准公司资产管理业务参与股指期货交易资格。

17、2012年9月27日，上海证券交易所以“上证会字（2012）191号”《关于确认东吴证券股份有限公司约定购回式证券交易权限的通知》批准公司开展约定购回式证券交易业务。

18、2012年9月19日，中国保险监督管理委员会以“资金部函[2012]20号”《关于向保险机构投资者提供综合服务的评估函》，批准公司向保险机构投资者提供交易单元。

19、2012年11月8日，中国证券金融股份有限公司以“中证金函（2012）154号”《关于申请参与转融通业务的复函》，批准公司参与转融通业务。

20、2013年1月12日，深圳证券交易所“深证会（2013）15号”《关于约定购回式证券交易权限开通的通知》，批准公司开展约定购回式证券交易业务。

21、2013年1月28日，中国证券监督管理委员会江苏监管局以“苏证监机构字[2013]37号”《关于核准东吴证券股份有限公司代销金融产品业务资格的批复》，批准公司代销金融产品业务资格

22、2013年7月1日，上海证券交易所以“上证会字（2013）73号”《关于确认东吴证券股份有限公司股票质押式回购业务交易权限的通知》，核准公司开展股票质押式回购业务

23、2013年11月8日，公司提交的《投资管理人受托管理保险资金报告材料》获得中国保

险监督管理委员会备案通知，公司可以开展受托管理保险资金业务。

24、2014年2月14日，中国证券登记结算有限责任公司以《关于代理证券质押登记业务资格确认函》，批准公司代理证券质押登记业务资格。

25、2014年6月24日，全国中小企业股份转让系统有限责任公司以“股转系统函[2014]727号”《关于主办券商业务备案函》，核准公司全国中小企业股份转让系统做市商资格。

26、2014年10月10日，上海证券交易所“上证函[2014]599号”《关于同意开通东吴证券股份有限公司港股通业务交易权限的通知》，同意开通公司A股交易单元的港通业务交易权限。

27、2014年11月24日，中国证券投资者保护基金公司以“证保函[2014]277号”《关于东吴证券股份有限公司开展私募基金综合托管业务的无异议函》，批准公司开展私募基金综合托管业务。

28、2014年12月16日，中国证券业协会以“中证协函[2014]776号”《关于同意开展柜台市场试点的函》，同意公司开展柜台市场试点。

29、2015年1月23日，上海证券交易所“上证函[2015]135号”《关于东吴证券股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知》，同意公司成为上海证券交易所股票期权交易参与者，获准开通股票期权经纪业务。

30、2015年1月28日，上海证券交易所“上证函[2015]197号”《关于开通股票期权自营交易权限的通知》，开通公司自营业务交易权限。

31、2015年3月3日，中国证券业协会以“中证协函[2015]115号”《关于同意开展互联网证券业务试点的函》，同意公司开展互联网证券业务试点。

32、2015年6月1日，中国证券登记结算有限责任公司以“中国结算办字[2015]451号”《关于东吴证券单项视频开户创新方案的无异议函》，同意公司单向视频开户试点资格。

33、2015年6月1日，中国证券登记结算有限责任公司以“中国结算办字[2015]457号”《关于东吴证券H5引流开户方案的无异议函》，同意公司非现场开户试点资格。

34、公司还具备上海证券交易所会员资格、深圳证券交易所会员资格、中国国债协会会员资格、中国证券业协会会员资格、江苏省证券业协会会员资格，中国证券登记结算有限责任公司结算参与者资格、中国证券投资基金业协会资格。

## 二、 联系人和联系方式

|      | 董事会秘书             | 证券事务代表             |
|------|-------------------|--------------------|
| 姓名   | 魏纯                | 李明娟                |
| 联系地址 | 江苏省苏州工业园区星阳街5号    | 江苏省苏州工业园区星阳街5号     |
| 电话   | 0512-62601555     | 0512-62601555      |
| 传真   | 0512-62938812     | 0512-62938812      |
| 电子信箱 | weich@dwzq.com.cn | dwzqdb@dwzq.com.cn |

## 三、 基本情况简介

|             |                    |
|-------------|--------------------|
| 公司注册地址      | 江苏省苏州工业园区星阳街5号     |
| 公司注册地址的邮政编码 | 215021             |
| 公司办公地址      | 江苏省苏州工业园区星阳街5号     |
| 公司办公地址的邮政编码 | 215021             |
| 公司网址        | www.dwzq.com.cn    |
| 电子信箱        | dwzqdb@dwzq.com.cn |

## 四、 信息披露及备置地点

|                     |                        |
|---------------------|------------------------|
| 公司选定的信息披露媒体名称       | 中国证券报、上海证券报、证券时报       |
| 登载年度报告的中国证监会指定网站的网址 | http://www.sse.com.cn  |
| 公司年度报告备置地点          | 江苏省苏州工业园区星阳街5号公司董事会办公室 |

## 五、 公司股票简况

| 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     | 上海证券交易所 | 东吴证券 | 601555 |

## 六、 公司其他情况

### (一) 公司历史沿革的情况，主要包括以前年度经历的改制重组、增资扩股等情况

东吴证券股份有限公司系由东吴证券有限责任公司整体变更设立，东吴证券有限责任公司的前身为苏州证券公司。1992年9月4日，中国人民银行以“银复[1992]361号”文批准设立苏州证券公司。1993年4月10日，苏州证券公司取得了苏州市工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》，注册号为13772051-9，注册资金3,000万元。

1997年2月14日，中国人民银行以“非银证[1997]11号”文同意苏州证券公司与中国人民银行脱钩改制并增资扩股；公司名称变更为“苏州证券有限责任公司”，注册资本增至10,400万元。1998年4月16日，公司完成了工商变更登记手续，注册号变更为3205001103389。



2001年12月18日，中国证监会以“证监机构字[2001]308号”文核准苏州证券有限责任公司增资扩股至10亿元，并更名为“东吴证券有限责任公司”。2002年4月12日，公司完成了工商变更登记手续。

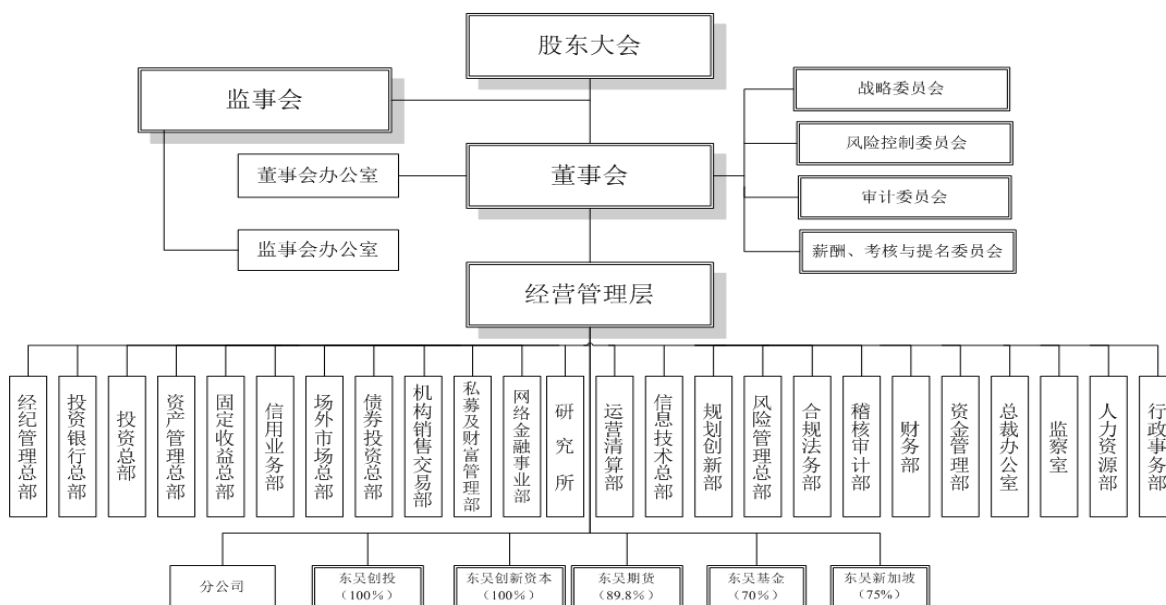
2008年6月23日，中国证监会以“证监许可[2008]831号”文核准东吴证券有限责任公司增资扩股至15亿元。2008年8月8日，公司完成了工商变更登记手续，注册号变更为32050000004432。2010年3月17日，中国证监会以“证监许可[2010]310号”文核准东吴证券有限责任公司整体变更为东吴证券股份有限公司。2010年5月28日，公司完成了工商变更登记手续，并取得了江苏省工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》。

2011年11月23日，经中国证监会“证监许可[2011]1887号”《关于核准东吴证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》核准，公司以6.50元/股的价格首次公开发行了50,000万股A股。经上海证券交易所“上证发字[2011]48号”文核准，公司股票于2011年12月12日起上市交易。公司注册资本增加至20亿元，并于2012年2月21日完成了工商变更登记手续。

2014年2月13日，经中国证监会“证监许可[2014]200号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》核准，公司非公开发行不超过70,000万股新股。2014年8月5日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量7亿股，公司注册资本增加至27亿元，并于2014年8月12日完成了工商变更登记手续。

## （二）公司组织机构情况

### 1、公司组织架构图



注：本公司还设有党委、党委办公室、纪委、工会和团委。

## 2、公司主要控股、参股公司情况

### (1) 东吴基金管理有限公司

注册地址：上海浦东新区源深路 279 号

成立时间：2004 年 9 月

注册资本：人民币 10,000 万元

持股比例：70%

法定代表人：王炯

联系电话：021-5050 9888

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。

### (2) 东吴期货有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 1208 号 6 楼

成立时间：1993 年 3 月

注册资本：人民币 50,000 万元

持股比例：93.80%

法定代表人：朱卫国

联系电话：021-6312 3019

经营范围：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询，资产管理。【依法须经审批的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

### (3) 东吴创业投资有限公司

注册地址：花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦

成立时间：2010 年 1 月

注册资本：人民币 120,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：衡敏

联系电话：0512-6293 8022

经营范围：创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。

#### **(4) 东吴创新资本管理有限责任公司**

注册地址：花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦

成立时间：2012 年 6 月

注册资本：人民币 200,000 万元

持股比例：100%

法定代表人：成军

联系电话：0512-6293 8925

经营范围：资产管理、投资管理、投资咨询；项目投资、实业投资、股权投资；贵金属、金属材料、食用农产品、化工原料及产品（不含危险化学品）销售。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

#### **(5) 东吴证券中新（新加坡）有限公司**

英文名称：Soochow Securities CSSD (Singapore) Pte. Ltd.

注册地址：77 Robinson Road, #15-01, Robinson 77, Singapore 068896

成立时间：2015 年 8 月 28 日

注册资本：1000 万新加坡元

持股比例：75%

董事长：范力

经营范围：资产管理

注：2016 年 1 月 5 日，东吴创投注册资本变更为“120,000 万元”；2016 年 1 月 14 日，公司持有东吴期货股份增加至“93.8%”。

### **3、公司设立分公司情况**

截止报告期末，公司共设立 16 家分公司，具体情况见下表：

| 名称     | 公司地址                                      | 成立日期       | 营运资金<br>(单位:万元) | 负责人 | 联系电话          |
|--------|---|------------|-----------------|-----|---------------|
| 吴江分公司  | 江苏省吴江市中山北路172号                            | 2009.6.19  | 2000            | 刘先雁 | 0512-63427860 |
| 昆山分公司  | 江苏省昆山市前进中路269号                            | 2009.6.22  | 2000            | 汪健  | 0512-57312926 |
| 张家港分公司 | 江苏省张家港市杨舍镇新风桥东堍                           | 2009.6.22  | 2000            | 郭淳  | 0512-58211473 |
| 常熟分公司  | 江苏省常熟市阜湖路9号                               | 2009.6.23  | 2000            | 徐明  | 0512-52705000 |
| 太仓分公司  | 江苏省太仓市城厢镇上海东路6号                           | 2009.6.24  | 2000            | 董伟年 | 0512-53593539 |
| 北京分公司  | 北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座1003室                  | 2009.7.3   | 2500            | 刘辉  | 010-66573700  |
| 上海分公司  | 上海市黄浦区西藏南路1208号19-20层                     | 2009.7.10  | 2000            | 叶犇  | 021-63122796  |
| 南京分公司  | 南京市中山南路501号江苏通服大厦7楼                       | 2011.12.16 | 2000            | 杨淮  | 025-83226660  |
| 常州分公司  | 常州市新北区通江中路266号                            | 2013.6.26  | 2000            | 郑中巧 | 0519-88153791 |
| 无锡分公司  | 无锡市锡山区东亭街道东亭中路20号晶石国际中心1601-1603号         | 2013.7.4   | 2000            | 王振亚 | 0510-88229901 |
| 泰州分公司  | 江苏省泰州市海陵南路360-6、360-7号                    | 2013.9.17  | 2000            | 秦国军 | 0523-86336333 |
| 徐州分公司  | 江苏省徐州市建国西路锦绣嘉园8号1-1503~1506室              | 2013.11.4  | 2000            | 张希斌 | 0516-66601555 |
| 南通分公司  | 江苏省南通市苏通科技产业园江成路1088号8号楼8403室             | 2013.11.4  | 2000            | 阮金阳 | 0513-55010310 |
| 深圳分公司  | 深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室 | 2013.12.9  | 2000            | 汤迎旭 | 0755-86561999 |
| 嘉兴分公司  | 嘉兴市花园路886号-A室                             | 2013.12.13 | 2000            | 叶晓晖 | 0573-82850255 |
| 福建分公司  | 福建省福州市鼓楼区五四路19号国泰大厦三楼A区                   | 2015.11.26 | 2000            | 吴智俊 | 0591-87502720 |

**（三）公司证券营业部的数量和分布情况**

截止报告期末，公司共有营业部 101 家，其中 A 类 33 家，B 类 14 家，C 类 54 家，具体情况见下表：

| 序号 | 证券营业部名称           | 地区分布 | 负责人 |
|----|-------------------|------|-----|
| 1  | 苏州狮山路证券营业部        | 江苏省  | 景振新 |
| 2  | 苏州西北街证券营业部        |      | 陈正晖 |
| 3  | 苏州石路证券营业部         |      | 倪 伟 |
| 4  | 苏州工业园区现代大道证券营业部   |      | 崔 檬 |
| 5  | 苏州竹辉路证券营业部        |      | 苏文全 |
| 6  | 苏州干将东路证券营业部       |      | 李庆宇 |
| 7  | 苏州胥江路证券营业部        |      | 陈卫明 |
| 8  | 苏州吴中区木渎镇证券营业部     |      | 王跃建 |
| 9  | 苏州相城区采莲路证券营业部     |      | 王南雁 |
| 10 | 苏州滨河路证券营业部        |      | 辛宏文 |
| 11 | 苏州广济北路证券营业部       |      | 朱淳亚 |
| 12 | 苏州宝带西路证券营业部       |      | 张建新 |
| 13 | 苏州工业园区敦煌路证券营业部    |      | 孙禹言 |
| 14 | 苏州望亭镇牡丹路证券营业部     |      | 顾文博 |
| 15 | 苏州虎丘区科技城证券营业部     |      | 张吴月 |
| 16 | 苏州星湖街证券营业部        |      | 朱 飏 |
| 17 | 苏州浒关镇证券营业部        |      | 陆 冰 |
| 18 | 苏州宝带东路证券营业部       |      | 朱 亮 |
| 19 | 昆山前进中路证券营业部       |      | 王月秋 |
| 20 | 昆山环城北路证券营业部       |      | 印 磊 |
| 21 | 昆山陆家镇童泾路证券营业部     |      | 季 清 |
| 22 | 昆山周市镇萧林东路证券营业部    |      | 王向阳 |
| 23 | 昆山高新区前进西路证券营业部    |      | 朱 剑 |
| 24 | 常熟阜湖路证券营业部        |      | 郭 力 |
| 25 | 常熟商城中路证券营业部       |      | 周金根 |
| 26 | 常熟海虞镇证券营业部        |      | 张 翊 |
| 27 | 常熟碧溪新区证券营业部       |      | 石沁艳 |
| 28 | 常熟梅李镇证券营业部        |      | 王 洁 |
| 29 | 太仓上海东路证券营业部       |      | 林 玲 |
| 30 | 太仓人民南路证券营业部       |      | 赵 洪 |
| 31 | 太仓沙溪镇白云中路证券营业部    |      | 顾卫东 |
| 32 | 太仓港经济技术开发区浮桥证券营业部 |      | 陆红益 |
| 33 | 太仓浏河镇证券营业部        |      | 戴 伟 |
| 34 | 张家港杨舍证券营业部        |      | 管春鸣 |
| 35 | 张家港金港镇证券营业部       |      | 苏 张 |
| 36 | 张家港锦丰镇证券营业部       |      | 林 懿 |
| 37 | 张家港杨舍镇沙中中路证券营业部   |      | 朱爱敏 |
| 38 | 张家港塘桥镇证券营业部       |      | 汤 伟 |

|    |                |     |     |
|----|----------------|-----|-----|
| 39 | 吴江中山北路证券营业部    |     | 唐征东 |
| 40 | 吴江盛泽镇西环路证券营业部  |     | 顾雁飞 |
| 41 | 吴江汾湖证券营业部      |     | 陈 健 |
| 42 | 吴江鲈乡南路证券营业部    |     | 周林凤 |
| 43 | 吴江震泽证券营业部      |     | 庄胜祥 |
| 44 | 无锡东亭中路证券营业部    |     | 吕冠勋 |
| 45 | 常州通江中路证券营业部    |     | 王 坚 |
| 46 | 泰州海陵南路证券营业部    |     | 秦国军 |
| 47 | 盐城人民南路证券营业部    |     | 陈 喆 |
| 48 | 南京中山南路证券营业部    |     | 李 斌 |
| 49 | 仪征真州西路证券营业部    |     | 李友林 |
| 50 | 镇江黄山北路证券营业部    |     | 王永兴 |
| 51 | 徐州北京北路证券营业部    |     | 赵 艳 |
| 52 | 淮安淮海南路证券营业部    |     | 张 峰 |
| 53 | 南京迈化路证券营业部     |     | 卞爱亮 |
| 54 | 姜堰人民中路证券营业部    |     | 赵 非 |
| 55 | 江阴长江路证券营业部     |     | 丁 键 |
| 56 | 苏州甬直迎宾路证券营业部   |     | 宗军荣 |
| 57 | 苏州虎池路证券营业部     |     | 张 强 |
| 58 | 苏州长江路证券营业部     |     | 薛 佳 |
| 59 | 苏州工业园区胜浦证券营业部  |     | 王 校 |
| 60 | 苏州相城黄埭中市路证券营业部 |     | 陈 伟 |
| 61 | 苏州相城太平证券营业部    |     | 滕亮华 |
| 62 | 苏州吴中大道证券营业部    |     | 戴震凯 |
| 63 | 苏州胥口孙武路证券营业部   |     | 张志超 |
| 64 | 太仓璜泾镇证券营业部     |     | 沈国强 |
| 65 | 昆山张浦证券营业部      |     | 张 勇 |
| 66 | 昆山千灯证券营业部      |     | 徐仁森 |
| 67 | 昆山花桥证券营业部      |     | 莫雪岗 |
| 68 | 吴江平望证券营业部      |     | 卢建明 |
| 69 | 吴江盛泽镇强武路证券营业部  |     | 钮建冬 |
| 70 | 吴江七都证券营业部      |     | 倪春华 |
| 71 | 扬州徐凝门路证券营业部    |     | 刘官军 |
| 72 | 苏州吴中区校场路证券营业部  |     | 余雪敏 |
| 73 | 无锡荡口鹅湖路证券营业部   |     | 浦晴岷 |
| 74 | 宜兴解放东路证券营业部    |     | 卢黎鸣 |
| 75 | 北京安德里北街证券营业部   | 北京市 | 张汉彬 |
| 76 | 北京东三环中路证券营业部   |     | 石少杰 |
| 77 | 上海西藏南路证券营业部    | 上海市 | 孙 捷 |
| 78 | 上海奉贤环城东路证券营业部  |     | 吕 威 |
| 79 | 东莞鸿福路证券营业部     | 广东省 | 江 楠 |
| 80 | 深圳龟山路证券营业部     |     | 李洪全 |

|     |               |      |     |
|-----|---------------|------|-----|
| 81  | 东莞大朗证券营业部     |      | 周沃权 |
| 82  | 中山小榄民安南路证券营业部 |      | 郭 嵘 |
| 83  | 福州五四路证券营业部    | 福建省  | 段万强 |
| 84  | 沈阳滂江街证券营业部    | 辽宁省  | 杨德双 |
| 85  | 大连中山路证券营业部    |      | 汤 放 |
| 86  | 营口辽河老街证券营业部   |      | 吴曙光 |
| 87  | 杭州文晖路证券营业部    | 浙江省  | 杨 运 |
| 88  | 嘉善体育南路证券营业部   |      | 潘 魏 |
| 89  | 新昌鼓山西路证券营业部   |      | 王德中 |
| 90  | 嘉善西塘镇证券营业部    |      | 杭国兴 |
| 91  | 嘉兴常秀街证券营业部    |      | 郭家安 |
| 92  | 昆明春城路证券营业部    | 云南省  | 许 波 |
| 93  | 瑞丽人民路证券营业部    |      | 熊 辉 |
| 94  | 三亚凤凰路证券营业部    | 海南省  | 吴 俊 |
| 95  | 海口金贸西路证券营业部   |      | 崔魁凰 |
| 96  | 济南明湖东路证券营业部   | 山东省  | 杨晓冬 |
| 97  | 重庆聚贤岩广场证券营业部  | 重庆市  | 李 宏 |
| 98  | 长沙人民中路证券营业部   | 湖南省  | 王海宇 |
| 99  | 合肥黄山路证券营业部    | 安徽省  | 张 英 |
| 100 | 郑州商务内环路证券营业部  | 河南   | 鲍晓宾 |
| 101 | 哈尔滨闽江路证券营业部   | 黑龙江省 | 秦 伟 |

## 七、其他相关资料

|                   |            |                                |
|-------------------|------------|--------------------------------|
| 公司聘请的会计师事务所（境内）   | 名称         | 天衡会计师事务所（特殊普通合伙）               |
|                   | 办公地址       | 南京市建邺区江东中路 106 号万达商务楼 B 座 19 楼 |
|                   | 签字会计师姓名    | 谈建忠、陆德忠                        |
| 报告期内履行持续督导职责的保荐机构 | 名称         | 西部证券股份有限公司                     |
|                   | 办公地址       | 西安东大街 232 号陕西信托大厦 7 层          |
|                   | 签字的保荐代表人姓名 | 祝健、张亮                          |
|                   | 持续督导的期间    | 2015.9.14-2015.12.31           |

## 八、近三年主要会计数据和财务指标

### （一）主要会计数据

单位：元 币种：人民币

| 主要会计数据 | 2015年            | 2014年            | 本期比上年同期增减 (%) | 2013年            |                  |
|--------|------------------|------------------|---------------|------------------|------------------|
|        |                  |                  |               | 调整后              | 调整前              |
| 营业收入   | 6,830,161,925.32 | 3,240,982,527.87 | 110.74        | 1,609,668,051.56 | 1,598,708,590.09 |

|                       |                   |                   |                |                   |                   |
|-----------------------|-------------------|-------------------|----------------|-------------------|-------------------|
| 归属于母公司股东的净利润          | 2,708,494,901.88  | 1,115,452,050.88  | 142.82         | 392,166,585.94    | 382,636,197.28    |
| 归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润 | 2,698,193,970.77  | 952,793,505.61    | 183.19         | 382,587,738.57    | 378,141,743.16    |
| 经营活动产生的现金流量净额         | -1,806,012,545.99 | 1,006,467,334.46  | -279.44        | -3,105,480,410.70 | -3,127,645,057.46 |
| 其他综合收益                | 90,185,067.40     | 255,447,836.03    | -64.70         | -40,062,445.96    | -30,532,057.30    |
|                       | 2015年末            | 2014年末            | 本期末比上年同期末增减(%) | 2013年末            |                   |
|                       |                   |                   |                | 调整后               | 调整前               |
| 资产总额                  | 80,589,136,533.56 | 57,461,111,012.63 | 40.25          | 19,640,602,644.63 | 18,844,057,289.97 |
| 负债总额                  | 63,836,767,667.55 | 43,227,729,598.61 | 47.68          | 11,743,457,615.42 | 10,946,912,260.76 |
| 归属于母公司股东的权益           | 16,539,917,099.39 | 14,078,857,196.50 | 17.48          | 7,829,075,087.99  | 7,829,075,087.99  |
| 所有者权益总额               | 16,752,368,866.01 | 14,233,381,414.02 | 17.70          | 7,897,145,029.21  | 7,897,145,029.21  |
| 期末总股本                 | 2,700,000,000.00  | 2,700,000,000.00  | -              | 2,000,000,000.00  | 2,000,000,000.00  |

## (二) 主要财务指标

| 主要财务指标                  | 2015年 | 2014年 | 本期比上年同期增减(%) | 2013年 |      |
|-------------------------|-------|-------|--------------|-------|------|
|                         |       |       |              | 调整后   | 调整前  |
| 基本每股收益(元/股)             | 1.00  | 0.49  | 104.08       | 0.20  | 0.19 |
| 稀释每股收益(元/股)             | 1.00  | 0.49  | 104.08       | 0.20  | 0.19 |
| 扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)   | 1.00  | 0.42  | 138.10       | 0.19  | 0.19 |
| 加权平均净资产收益率(%)           | 17.69 | 10.60 | 增加7.09个百分点   | 5.09  | 4.97 |
| 扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%) | 17.62 | 9.05  | 增加8.57个百分点   | 4.97  | 4.91 |

## (三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

| 项目                   | 本报告期末             | 上年度末              |
|----------------------|-------------------|-------------------|
| 净资本                  | 14,458,387,480.79 | 8,723,266,309.44  |
| 净资产                  | 16,238,764,267.81 | 13,807,821,790.68 |
| 净资本/各项风险准备之和(%)      | 509.94            | 316.42            |
| 净资本/净资产(%)           | 89.04             | 63.18             |
| 净资本/负债(%)            | 45.66             | 34.95             |
| 净资产/负债(%)            | 51.29             | 55.31             |
| 自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%) | 76.36             | 48.70             |
| 自营固定收益类证券/净资本(%)     | 90.04             | 178.73            |

近三年主要会计数据和财务指标的说明：

- 1、因2014年会计政策变更，对公司以前年度相关数据作追溯调整。
- 2、以净资本为核心的各项风险控制指标以母公司数据计算。截至报告期末，公司各项指标满足监



管要求。

## 九、境内外会计准则下会计数据差异

### (一) 同时按照国际会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

适用 不适用

### (二) 同时按照境外会计准则与按中国会计准则披露的财务报告中净利润和归属于上市公司股东的净资产差异情况

适用 不适用

## 十、2015 年分季度主要财务数据

单位：元 币种：人民币

|                         | 第一季度<br>(1-3 月份) | 第二季度<br>(4-6 月份)  | 第三季度<br>(7-9 月份)   | 第四季度<br>(10-12 月份) |
|-------------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| 营业收入                    | 1,392,586,592.68 | 2,577,395,920.19  | 1,101,718,567.76   | 1,758,460,844.69   |
| 归属于上市公司股东的净利润           | 613,680,984.73   | 1,214,600,984.03  | 355,686,301.30     | 524,526,631.82     |
| 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润 | 611,803,018.18   | 1,212,820,788.93  | 348,332,300.49     | 525,237,863.17     |
| 经营活动产生的现金流量净额           | 5,150,202,286.71 | 17,020,394,259.70 | -16,002,100,336.88 | -7,974,508,755.52  |

季度数据与已披露定期报告数据差异说明

适用 不适用

## 十一、非经常性损益项目和金额

适用 不适用

单位：元 币种：人民币

| 非经常性损益项目   | 2015 年金额      | 附注（如适用） | 2014 年金额      | 2013 年金额      |
|--|---------------|---------|---------------|---------------|
| 非流动资产处置损益  | -1,507,762.21 |         | 2,731,972.18  | -2,019,799.44 |
| 越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免                                 |               |         |               |               |
| 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 | 18,492,164.47 |         | 16,974,400.00 | 16,155,097.81 |

|   |               |  |                |               |
|---|---------------|--|----------------|---------------|
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费   |               |  |                |               |
| 企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益                                    |               |  |                |               |
| 非货币性资产交换损益  |               |  |                |               |
| 委托他人投资或管理资产的损益  |               |  |                |               |
| 因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备   |               |  |                |               |
| 债务重组损益  |               |  |                |               |
| 企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等   |               |  |                |               |
| 交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益   |               |  |                |               |
| 同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益   |               |  |                |               |
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益   |               |  |                |               |
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益 |               |  |                |               |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回   |               |  |                |               |
| 对外委托贷款取得的损益   |               |  |                |               |
| 采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益  |               |  |                |               |
| 根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响  |               |  |                |               |
| 受托经营取得的托管费收入  |               |  |                |               |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出  | -2,104,598.68 |  | -1,516,242.00  | -2,642,793.17 |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目   |               |  | 149,177,980.96 |               |
| 少数股东权益影响额   | -858,921.57   |  | -162,033.32    | -311,629.84   |

|        |               |  |                |               |
|--------|---------------|--|----------------|---------------|
| 所得税影响额 | -3,719,950.90 |  | -4,547,532.55  | -1,602,027.99 |
| 合计     | 10,300,931.11 |  | 162,658,545.27 | 9,578,847.37  |

## 十二、 采用公允价值计量的项目

单位：元 币种：人民币

| 项目名称                   | 期初余额              | 期末余额              | 当期变动              | 对当期利润的影响金额       |
|------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 17,315,854,448.80 | 14,222,827,510.80 | -3,093,026,938.00 | 1,473,403,534.70 |
| 可供出售金融资产               | 5,590,487,463.87  | 13,474,446,385.59 | 7,883,958,921.72  | 1,206,448,243.50 |
| 衍生金融工具                 | -                 | -5,701,352.15     | -5,701,352.15     | -11,380,109.45   |
| 合计                     | 22,906,341,912.67 | 27,691,572,544.24 | 4,785,230,631.57  | 2,668,471,668.75 |

## 十三、 根据《证券公司年度报告内容与格式准则（2013年修订）》的要求，公司合并财务报表和母公司财务报表主要项目会计数据

## （一）合并财务报表数据

单位：（人民币）元

| 项目名称      | 2015 年末           | 2014 年末           | 增减百分比 (%) |
|-----------|-------------------|-------------------|-----------|
| 货币资金      | 23,454,179,048.36 | 10,249,789,646.59 | 128.83    |
| 融出资金      | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47  | 37.86     |
| 衍生金融资产    | 3,620.00          | 0.00              | -         |
| 买入返售金融资产  | 8,923,142,748.05  | 6,582,668,335.27  | 35.56     |
| 应收款项      | 333,743,476.04    | 44,871,017.11     | 643.78    |
| 应收利息      | 357,047,813.24    | 235,740,507.88    | 51.46     |
| 可供出售金融资产  | 14,337,888,888.16 | 5,962,900,341.44  | 140.45    |
| 长期股权投资    | 122,232,522.20    | 10,483,110.25     | 1065.99   |
| 在建工程      | 751,888.44        | 0.00              | -         |
| 递延所得税资产   | 167,302,236.93    | 59,595,719.83     | 180.73    |
| 资产总计      | 80,589,136,533.56 | 57,461,111,012.63 | 40.25     |
| 短期借款      | 93,684,509.36     | 0.00              | -         |
| 应付短期融资款   | 4,567,350,000.00  | 3,313,738,000.00  | 37.83     |
| 拆入资金      | 350,000,000.00    | 1,918,000,000.00  | -81.75    |
| 衍生金融负债    | 5,704,972.15      | 0.00              | -         |
| 卖出回购金融资产款 | 8,926,452,635.46  | 16,361,955,658.47 | -45.44    |
| 代理买卖证券款   | 24,025,978,380.26 | 13,579,472,286.92 | 76.93     |
| 应付职工薪酬    | 1,505,489,727.11  | 651,274,014.09    | 131.16    |

|                      |                   |                   |                 |
|----------------------|-------------------|-------------------|-----------------|
| 应交税费                 | 401,483,551.42    | 304,415,837.08    | 31.89           |
| 应付利息                 | 536,703,397.67    | 97,768,819.16     | 448.95          |
| 应付债券                 | 16,466,882,811.73 | 2,975,791,937.06  | 453.36          |
| 递延所得税负债              | 9,617,062.63      | 2,689,891.59      | 257.53          |
| 其他负债                 | 6,877,015,079.34  | 3,952,206,040.35  | 74.00           |
| 负债合计                 | 63,836,767,667.55 | 43,227,729,598.61 | 47.68           |
| 其他综合收益               | 345,269,489.80    | 255,204,488.79    | 35.29           |
| 盈余公积                 | 518,669,879.51    | 252,801,672.22    | 105.17          |
| 一般风险准备               | 1,364,956,056.45  | 820,738,196.95    | 66.31           |
| 未分配利润                | 3,046,345,459.70  | 1,485,436,624.61  | 105.08          |
| 少数股东权益               | 212,451,766.62    | 154,524,217.52    | 37.49           |
| <b>项目名称</b>          | <b>2015 年度</b>    | <b>2014 年度</b>    | <b>增减百分 (%)</b> |
| 营业收入                 | 6,830,161,925.32  | 3,240,982,527.87  | 110.74          |
| 手续费及佣金净收入            | 3,821,609,158.46  | 1,678,372,503.40  | 127.70          |
| 其中：经纪业务手续费净收入        | 2,646,254,123.37  | 1,047,928,710.47  | 152.52          |
| 投资银行业务手续费净收入         | 757,556,414.50    | 468,393,502.38    | 61.74           |
| 资产管理业务手续费净收入         | 206,675,731.33    | 109,442,468.81    | 88.84           |
| 利息净收入                | 286,555,551.49    | 142,354,207.83    | 101.30          |
| 投资收益                 | 2,383,976,752.02  | 1,332,045,196.37  | 78.97           |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益   | 2,643,966.52      | 7,202,544.72      | -63.29          |
| 公允价值变动收益             | 306,628,570.68    | 73,847,954.88     | 315.22          |
| 汇兑收益                 | 1,162,645.34      | 34,513.68         | 3268.65         |
| 其他业务收入               | 30,229,247.33     | 14,328,151.71     | 110.98          |
| 营业支出                 | 3,106,021,314.08  | 1,810,381,759.33  | 71.57           |
| 营业税金及附加              | 414,691,579.49    | 179,059,507.04    | 131.59          |
| 业务及管理费               | 2,656,099,023.42  | 1,579,192,330.95  | 68.19           |
| 资产减值损失               | 22,797,025.87     | 52,129,921.34     | -56.27          |
| 其他业务成本               | 12,433,685.30     | 0.00              | -               |
| 营业利润                 | 3,724,140,611.24  | 1,430,600,768.54  | 160.32          |
| 营业外支出                | 85,774,425.93     | 3,927,403.75      | 2084.00         |
| 利润总额                 | 3,657,266,414.82  | 1,448,790,898.72  | 152.44          |
| 所得税费用                | 923,973,390.23    | 324,231,545.03    | 184.97          |
| 净利润                  | 2,733,293,024.59  | 1,124,559,353.69  | 143.05          |
| 其中：归属于母公司股东的净利润      | 2,708,494,901.88  | 1,115,452,050.88  | 142.82          |
| 少数股东损益               | 24,798,122.71     | 9,107,302.81      | 172.29          |
| 其他综合收益的税后净额          | 90,185,067.40     | 255,447,836.03    | -64.70          |
| 归属于母公司所有者的其他综合收益税后净额 | 90,065,001.01     | 255,200,596.45    | -64.71          |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额  | 120,066.39        | 247,239.58        | -51.44          |

|                  |                  |                  |        |
|------------------|------------------|------------------|--------|
| 综合收益总额           | 2,823,478,091.99 | 1,380,007,189.72 | 104.60 |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额 | 2,798,559,902.89 | 1,370,652,647.33 | 104.18 |
| 归属于少数股东的综合收益总额   | 24,918,189.10    | 9,354,542.39     | 166.38 |

## (二) 母公司财务报表数据

单位：（人民币）元

| 项目名称               | 2015 年末           | 2014 年末           | 增减百分比(%) |
|--------------------|-------------------|-------------------|----------|
| 货币资金               | 21,827,877,826.47 | 8,526,988,470.45  | 155.99   |
| 融出资金               | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47  | 37.86    |
| 衍生金融资产             | 3,620.00          | 0.00              | -        |
| 应收款项               | 248,448,188.51    | 31,284,847.72     | 694.15   |
| 应收利息               | 220,941,972.04    | 134,928,901.00    | 63.75    |
| 可供出售金融资产           | 13,215,748,503.52 | 6,479,027,528.43  | 103.98   |
| 在建工程               | 751,888.44        | 0.00              | -        |
| 递延所得税资产            | 159,744,426.74    | 46,162,959.09     | 246.04   |
| 资产总计               | 70,523,438,827.31 | 50,621,534,883.62 | 39.32    |
| 拆入资金               | 350,000,000.00    | 1,918,000,000.00  | -81.75   |
| 衍生金融负债             | 4,245,522.15      | 0.00              | -        |
| 卖出回购金融资产款          | 8,321,817,684.26  | 15,629,722,312.09 | -46.76   |
| 代理买卖证券款            | 22,621,633,084.67 | 11,851,331,967.28 | 90.88    |
| 应付职工薪酬             | 1,413,860,035.04  | 589,524,747.69    | 139.83   |
| 应交税费               | 377,690,536.76    | 260,508,925.70    | 44.98    |
| 应付款项               | 33,035,400.59     | 5,627,101.86      | 487.08   |
| 应付利息               | 536,643,200.34    | 97,559,443.32     | 450.07   |
| 预计负债               | 1,004,000.00      | 8,544,879.45      | -88.25   |
| 应付债券               | 16,466,882,811.73 | 2,975,791,937.06  | 453.36   |
| 负债合计               | 54,284,674,559.50 | 36,813,713,092.94 | 47.46    |
| 其他综合收益             | 410,093,725.87    | 300,333,321.64    | 36.55    |
| 盈余公积               | 518,669,879.51    | 252,801,672.22    | 105.17   |
| 一般风险准备             | 1,283,170,657.84  | 751,434,243.26    | 70.76    |
| 未分配利润              | 2,763,189,156.40  | 1,239,611,705.37  | 122.91   |
| 项目名称               | 2015 年度           | 2014 年度           | 增减百分比(%) |
| 营业收入               | 6,282,781,739.63  | 2,746,251,786.19  | 128.78   |
| 手续费及佣金净收入          | 3,627,018,864.30  | 1,598,425,673.45  | 126.91   |
| 其中：经纪业务手续费净收入      | 2,577,600,916.69  | 984,972,252.52    | 161.69   |
| 投资银行业务手续费净收入       | 757,556,414.50    | 468,393,502.38    | 61.74    |
| 资产管理业务手续费净收入       | 254,425,174.20    | 132,156,432.36    | 92.52    |
| 利息净收入              | 283,890,756.38    | 161,455,824.04    | 75.83    |
| 投资收益               | 2,114,401,606.17  | 959,036,867.09    | 120.47   |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益 | 0.00              | 6,635,940.33      | -100.00  |

|             |                  |                  |         |
|-------------|------------------|------------------|---------|
| 公允价值变动收益    | 251,315,092.33   | 21,315,420.14    | 1079.03 |
| 汇兑收益        | 1,162,645.34     | 34,513.68        | 3268.65 |
| 营业支出        | 2,736,566,684.83 | 1,605,425,680.52 | 70.46   |
| 营业税金及附加     | 385,952,277.72   | 165,356,703.50   | 133.41  |
| 业务及管理费      | 2,327,817,381.24 | 1,403,300,455.68 | 65.88   |
| 资产减值损失      | 22,797,025.87    | 36,768,521.34    | -38.00  |
| 营业利润        | 3,546,215,054.80 | 1,140,826,105.67 | 210.85  |
| 营业外收入       | 5,429,243.23     | 16,516,345.34    | -67.13  |
| 营业外支出       | 64,497,011.86    | 7,323,272.59     | 780.71  |
| 利润总额        | 3,487,147,286.17 | 1,150,019,178.42 | 203.23  |
| 所得税费用       | 828,465,213.27   | 270,129,146.86   | 206.69  |
| 净利润         | 2,658,682,072.90 | 879,890,031.56   | 202.16  |
| 其他综合收益的税后净额 | 109,760,404.23   | 291,090,846.55   | -62.29  |
| 综合收益总额      | 2,768,442,477.13 | 1,170,980,878.11 | 136.42  |

### 第三节 公司业务概要

#### 一、报告期内公司所从事的主要业务、经营模式及行业情况说明

##### (一) 报告期内公司从事的主要业务及经营模式

报告期内，公司积极适应新常态，以“努力实现互联网财富管理的实质性突破、资本中介业务的跨越式突破、资本投资业务的专业性突破”为目标，主要从事业务如下：

##### (1) 经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要是代理客户(包括通过互联网)买卖股票、基金、债券、期货等，通过提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。

##### (2) 投资银行业务

投资银行业务主要是向机构客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务。

##### (3) 投资与交易业务

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。

##### (4) 资管及基金管理业务

资管及基金管理业务是提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。

#### （5）信用交易业务

信用交易业务主要为个人及机构客户提供包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等资本中介业务。

公司还通过下属分支机构开展各项创新业务及综合金融服务。公司通过控股子公司东吴基金开展基金管理业务，通过控股子公司东吴期货开展期货经纪业务，通过全资子公司东吴创新资本开展另类投资业务，通过全资子公司东吴创投开展直接投资业务。此外，公司控股子公司东吴新加坡在境外市场亦开展资产管理业务。

报告期内，公司紧扣资本与人才两大重点，努力提升资产负债管理能力、风险合规管理能力、企业文化凝聚能力，向以互联网财富管理为核心的现代证券控股集团大踏步迈进。各项工作成效显著、亮点纷呈，经营业绩迈上新台阶：

一、创新转型打开新局面。正式组建网络金融事业部，成功注册“东吴在线（苏州）互联网金融科技服务有限公司”。双平台、双体系同时发力，以一系列创新举措加快发展互联网金融，有力促进了公司传统业务的转型发展。加快实施“走出去”战略，坐落在陆家嘴金融广场的上海业务总部完成扩容搬迁，国际业务布局实现突破，新加坡资产管理子公司获准筹建已完成海外注册，香港子公司已启动筹备。

二、服务发展取得新成效。全力以赴帮助实体企业通过资本市场开展直接融资，合计融资额创历史最高纪录。围绕地方中心工作创新服务举措，承接了苏州市并购引导基金管理任务，积极推进苏州公积金资产证券化业务，采取创新举措为地方主导设立了全省首个城乡一体化基金，在省内产生较大影响力。

三、市场机制实现新突破。在国内券商中率先提出改制研究所、成立子公司，并积极开展混合所有制改革，推进员工持股。在新的机制下，研究所已聚集了一批行业高端人才，实力显著提升，有力支持了公司业务的发展。

四、资本补充达到新高度。完成公司 100 亿次级债券和 25 亿公司债券的发行，融入中短期资金 107.5 亿元，力度空前，有效补充了公司运营资金、保障了公司业务的发展。通过不懈努力和

精心安排，公司上市以来第二次非公开发行事项获得通过，并于 2016 年 1 月顺利实施，新募集资金 35.4 亿元，为公司下一步发展奠定了坚实基础。

## （二）报告期内公司所属行业的发展阶段、周期性特点以及公司所处的行业地位

报告期内，受益于市场活跃和行业景气度提升，证券行业总体经营规模和盈利能力快速增长。全年二级市场交易活跃，日均成交额创历史新高。市场出现较大波动，投资者风险偏好随之变动。在行业整体高速发展的同时，证券公司收益水平与证券市场周期高度相关的特性仍将持续。根据国家金融助推供给侧改革的战略方向，证券行业在服务实体经济、完善融资渠道、管理居民财富等方面肩负重要使命，具有较大的发展机遇。报告期内，公司总体市场地位稳步提升，核心竞争力继续保持市场领先，新三板推荐挂牌新增数、累计数排名分别位列行业第 9、第 10 位，公司主要业务行业排名均有所提升。

## 二、报告期内公司主要资产发生重大变化情况的说明

报告期公司的资产变化情况详见第四节 二、（三）资产、负债情况分析。

其中：境外资产 45,233,596.26（单位：元 币种：人民币），占总资产的比例为 0.06%。

## 三、报告期内核心竞争力分析

1. 立足证券业务核心，打造金融集团架构，布局海外资本市场。公司证券业务区域优势明显，在立足苏州的基础上，形成了辐射全国的网络格局。依托母公司的全业务牌照，东吴基金、东吴期货、东吴创投、东吴创新资本等子公司均衡发展，形成了全面的金融集团化架构。报告期内，公司充分利用地处中新苏州工业园区的地缘优势，成功注册了新加坡资产管理子公司，并已取得相关资质，海外业务布局取得实质突破。

2. 以客户需求为导向，重塑公司业务架构。公司按照条块结合原则，推进组织架构创新转型，重构形成经纪业务线、证券投资线、投资银行线、资产管理线、互联网金融线、证券金融线六大业务线，推动分公司“小型券商”化。通过组织架构重塑，公司以强大的客户综合服务能力，连通客户的投融资需求，打造包括地方政府、上市公司、金融机构和中小企业等在内的客户全面服务体系，实现抢抓地方客户、服务实体经济发展、满足居民理财需求的目标。

3. 围绕互联网财富管理，推进各项业务转型升级。报告期内，公司正式组建网络金融事业部，主导成立东吴在线（苏州）互联网金融科技服务有限公司，互联网财富管理品牌“东吴秀财”正



式启航，以秀财 APP 为核心，不断优化产品体验，丰富产品功能，加大公众号、网厅和掌厅运营推广力度，打造投资社交平台，互联网财富管理的基本架构已经实现。

4、坚持合规务实的管理风格，传承以人为本的企业文化。公司管理团队人员稳定，经验丰富，多数高管人员已服务公司 10 年以上，中层管理骨干保持稳定，基层员工忠诚度高。公司不断完善全面风险管理体系以及流动性风险应对机制和问责机制，实现了风险合规管理与业务发展的动态均衡。同时，以东吴行动纲领为指引，以人为本的家园文化，“三满意、一放心”的核心价值观构成了公司的企业文化，这是东吴证券长远可持续发展的重要基础之一，是东吴证券多年积累的宝贵财富。

5、创新人才机制，释放人才活力，提升公司竞争实力。公司不断完善用人机制和激励机制，加大人才引进力度，加强人才素质培养，为优秀人才成长提供广阔空间，人才机制优势不断积淀。在国内券商中率先提出改制研究所、成立子公司，并积极开展混合所有制改革、推进员工持股计划，塑造公司人才机制的核心竞争力。

## 第四节 管理层讨论与分析

### 一、管理层讨论与分析

2015 年，全球经济继续复苏，但经济增速低于预期，美国及各主要经济体在经济和政策周期方面的分化更加明显。国内宏观经济总体保持了平稳运行的态势。在经济“新常态”背景下，中国经济正处在新旧产业和发展动能转换的接续关键期。短期看，经济运行中的矛盾和问题依然突出，经济面临下行调整的压力，但供给侧结构性改革为中长期经济增长注入动力，中国经济进入中高速增长的新常态。

2015 年，证券行业改革创新力度加大，在新股发行制度、优先股试点、国企改革、沪港通、再融资审核机制、并购重组配套融资政策、公司债券市场化改革等方面取得了进展，营造了良好的市场环境，持续为证券行业注入发展活力。2015 年国内资本市场波动较大，市场交易量大幅增长，两融活跃度提升，全年上证综指上涨 9.41%，深圳成指上涨 14.98%，根据中证协统计，沪深两市股票日均成交额为 10,453 亿元，同比增长 244.26%，创出历史新高。

为了进一步提升资本实力，保障发展战略顺利实施，报告期内公司顺利推进了上市以来第二次非公开发行工作，并通过公司债、次级债、短期融资券、收益凭证等多种渠道融入资金，保障了公司业务发展。公司创新转型打开新局面，互联网财富管理的基本架构已经实现，互联网财富

管理品牌“东吴秀财”正式起航，国际化战略布局稳步推进，新加坡资产管理子公司取得业务资格，香港子公司已启动筹备。在国内券商中率先提出改制研究所、成立子公司，并积极开展混合所有制改革。报告期内，公司不断加快推进业务创新，拓宽盈利渠道，积极应对市场变化，坚决防范各类风险，切实强化管理能力，公司各项业务收入同比大幅提升，取得历史最好经营业绩，进入新的发展阶段。

## 二、报告期内主要经营情况

2015 年，公司努力把握发展机遇，各项业务全面拓展，实现营业收入 68.30 亿元，同比增长 110.74%；实现利润总额 36.57 亿元，同比增长 152.44%；实现净利润 27.33 亿元，同比增长 143.05%，公司各项业绩记录均被大幅刷新；加权平均净资产收益率达到 17.69%，为公司上市以来最高值。与上一年末相比，母公司营业收入上升 4 位列行业 22 名，利润总额上升 7 位列行业 21 名。在 2015 年证券公司分类监管评级中，公司获得 A 类 A 级券商评级。

### (一) 主营业务分析

#### 利润表及现金流量表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

| 科目            | 本期数               | 上年同期数            | 变动比例 (%) |
|---------------|-------------------|------------------|----------|
| 营业收入          | 6,830,161,925.32  | 3,240,982,527.87 | 110.74   |
| 营业成本          | 3,106,021,314.08  | 1,810,381,759.33 | 71.57    |
| 经营活动产生的现金流量净额 | -1,806,012,545.99 | 1,006,467,334.46 | -279.44  |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -261,507,863.61   | -157,187,681.11  | -        |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 14,194,144,284.80 | 7,954,478,124.94 | 78.44    |
| 研发支出          | 17,966,374.99     | 0                | -        |

#### 1. 收入和成本分析

公司营业收入增长了 110.74%，主要是因为 2015 年度市场交易量大幅增长，公司加快推进业务创新，不断拓宽盈利渠道，积极应对市场变化，坚决防范各类风险，切实强化管理能力，报告期内公司各项业务收入同比大幅提升。

#### (1). 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位：元 币种：人民币

| 主营业务分行业情况 |      |      |         |               |               |              |
|-----------|------|------|---------|---------------|---------------|--------------|
| 分行业       | 营业收入 | 营业成本 | 毛利率 (%) | 营业收入比上年增减 (%) | 营业成本比上年增减 (%) | 毛利率比上年增减 (%) |
|           |      |      |         |               |               |              |

|           |                  |                  |       |        |       |               |
|-----------|------------------|------------------|-------|--------|-------|---------------|
| 经纪及财富管理业务 | 3,025,988,863.82 | 1,125,216,918.35 | 62.81 | 153.36 | 72.30 | 增加 17.49 个百分点 |
| 投行银行业务    | 806,570,370.75   | 468,563,237.90   | 41.91 | 70.19  | 61.04 | 增加 3.30 个百分点  |
| 投资与交易业务   | 1,778,531,955.89 | 361,987,538.10   | 79.65 | 132.08 | 62.22 | 减少 8.77 个百分点  |
| 资管及基金管理业务 | 430,205,335.90   | 305,870,536.21   | 28.90 | 130.96 | 73.35 | 增加 23.63 个百分点 |
| 信用交易业务    | 695,660,177.68   | 147,196,596.05   | 78.84 | 93.02  | 60.03 | 增加 4.36 个百分点  |

主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

### ①经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要是代理客户（包括通过互联网）买卖股票、基金、债券、期货等，通过提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。报告期内，公司经纪及财富管理业务紧紧抓住市场机遇，在稳定传统业务的同时，积极推进网络金融，拓展综合金融，取得了靓丽的经营业绩。报告期内，公司经纪业务客户数量增长 0.86 倍，市场占有率从 0.865% 上升为 1.047%。全年代理买卖业务成交量（A 股+基金）56,547 亿，同比增长 315%。经纪及财富管理业务实现营业收入 30.26 亿元，同比增长 153.36%，其中，代销金融产品业务收入 1,126.33 万元。

报告期内，公司转变服务观念改进业务流程，以客户的需求为导向，提升响应速度，在产品引进、设计方面，充分征求需求前端意见；公司通过后台集中工作，释放营业部的创新活力，为营业部转型为销售平台奠定基础。公司建立四级管理体系，对分支机构进行分类管理，改善体制机制，鼓励分支机构向多元化业务方向发展。公司通过加强信息系统建设，整合各类交易软件，建立快速交易平台，简化视频开户流程，有效提升了经纪及财富管理业务竞争实力。公司还充分应用互联网技术，构建新型的线上线下协作运营模式，积极推广秀财 APP 等营销渠道，增强客户体验。

报告期内，公司顺利推出了个股期权业务，沪港通业务平稳发展，深港通业务也在有序准备。在网点建设方面，优化网点布局，形成激励约束机制。报告期内，公司对网点布局进行了调整，5 家营业部完成迁址，关闭南宁营业部；顺利完成了 3 家营业部的筹建，2016 年初完成福建分公司筹建，目前公司拥有 16 家分公司 101 营业部。

公司通过控股子公司东吴期货有限公司开展期货经纪业务。报告期内，东吴期货抢抓市场机遇、应对挑战，不断夯实经纪业务基础，年内客户数、客户权益、成交量与成交金额等主要指标

同比实现较快增长。资产管理、期货子公司的业务实现平稳发展并初具规模，互联网金融和场外衍生品业务开局良好并加速推进。截至报告期末，东吴期货全年实现营业收入 1.88 亿元，实现利润总额 0.61 亿元。

#### 代理买卖证券情况：

金额单位：（人民币）亿元

| 项目  | 2015 年   |        | 2014 年度   |       |
|-----|----------|--------|-----------|-------|
|     | 交易金额     | 市场份额   | 交易金额      | 市场份额  |
| A 股 | 54340.6  | 1.067% | 13,308.48 | 0.90% |
| B 股 | 62.8     | 0.849% | 12.4      | 0.62% |
| 基金  | 2206.51  | 0.723% | 327.25    | 0.35% |
| 其他  | 8419.53  | 0.320% | 7,663.04  | 0.41% |
| 合计  | 65029.44 | 0.809% | 21311.17  | 0.62% |

#### 代理销售金融产品情况：

金额单位：（人民币）元

| 代销金融产品业务 | 本期金额              |               | 上期金额              |               |
|----------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|
|          | 销售总金额             | 销售总收入         | 销售总金额             | 销售总收入         |
| 基金       | 4,375,388,805.42  | 5,780,225.80  | 2,030,091,447.21  | 3,442,091.00  |
| 资产管理计划   | 64,367,588,850.93 | 5,483,093.99  | 32,396,149,939.39 | 10,965,700.00 |
| 合计       | 68,742,977,656.35 | 11,263,319.79 | 34,426,241,386.60 | 14,407,791.00 |

#### ②投资银行业务

投资银行业务主要是向机构客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、新三板业务、并购重组、其他财务顾问、金融创新服务。

报告期内，公司在稳步推进传统业务品种的同时，充分整合公司内外部资源，拓展并购基金、产业基金、其他财务顾问等业务。公司以客户为中心，形成了全方位、全价值链的业务模式和以“资本+中介”的盈利模式，IPO、定增、配股、新三板、公司债、企业债、项目收益债、金融债、并购重组等多业务品种齐头并进。报告期内，公司投资银行业务实现收入 8.74 亿元，同比增长 86.5%。

在股权融资方面，完成苏试试验、天孚通信、柯利达、高科石化等 4 单 IPO 项目，合计承销金额 12.84 亿元；完成同方股份、雏鹰农牧、苏州高新、宏达矿业、江苏吴中、东方电热等 6 单 A 股增发项目，合计承销金额 71.28 亿元；完成南京银行优先股增发项目 1 单，承销金额 24.5 亿元；完成新万泉河新三板定增 1 单。

在债券融资方面，完成 14 西南 01、15 京城建、15 西部 01、15 东北债等 6 单公司债项目，合计承销金额 142.07 亿元；完成 15 联丰债、15 丹开债、15 吴江债、15 太科债、15 沛城投、15 锡创投等 6 单企业债券发行，合计承销金额 45.8 亿元。公司非上市公司公司债券延续了中小企业私募债的优势，报告期内完成 15 锡东债、15 句福地、15 富滇银行 02 等 26 单非上市公司公司债券项目，合计承销金额 106.65 亿元。

报告期内，公司采取创新举措为地方主导设立了全省首个城乡一体化基金，开创了不动用市级财政承诺或支持函，不动用各区级财政存款反担保，不动用银行流动性支持，直接创设城市发展基金的先河。公司还大力发展资产证券化业务，报告期内成功挂牌并销售嘉兴天然气收费收益权资产支持证券 1 单，目前“太仓协鑫”资产证券化产品也已取得无异议函。拓展并购基金、产业基金等业务模式，报告期内，徐州产业基金、吴中产业基金、南通城市发展基金、爱尔眼科并购基金已成立，另有多家基金正在有序推进中。

公司的新三板业务一直处于行业前列，借助在国内资本市场的影响力，立足苏州根据地优势，逐步将业务半径向成熟地区扩张。报告期内，公司新增新三板推荐挂牌企业 105 家，累计挂牌推荐的企业数为 149 家，新增数、累计数排名分别位列行业第 9、第 10 名。新三板做市业务迅速壮大，做市股票数量增加至 86 家，排名位列行业第 21 名。

单位（万元）

| 项目  |          | 2015 年       | 2014 年       |
|-----|----------|--------------|--------------|
| IPO | 承销金额     | 128,379.79   | 86,096.40    |
|     | 保荐及主承销收入 | 9,647.07     | 5,735.91     |
| 再融资 | 承销金额     | 957,849.67   | 1,020,220.30 |
|     | 保荐及主承销收入 | 10,072.68    | 17,425.28    |
| 债券  | 承销金额     | 3,066,666.67 | 1,013,000.00 |
|     | 主承销收入    | 28,426.875   | 12,860.80    |

### ③投资与交易业务

投资与交易业务是以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。

在权益性证券方面，公司始终把“绝对收益”摆在第一位，坚持价值投资的理念、采取稳健经营的策略，在严格投资流程管理，控制系统性风险的前提下，通过重点投资和组合投资相结合的方式，加强研究跟踪，发现投资机会，采用多种投资手段，进行多元化资产配置，获取了相对

稳健的投资收益。报告期内，公司获得股票期权自营业务资格，进一步拓展了权益类投资领域，实现多市场、跨品种的多元化投资。

在固定收益证券方面，公司坚持“调结构、控杠杆、防风险”投资思路，以大类资产配置结合市场交易为主要操作方式，加强量化系统开发建设，努力提升投研水平，在抓好主营投资业务的同时，大力发展资本中介业务，并注重创新业务品种的培育。报告期内，公司申请了利率互换和黄金现期货的交易资格，并积极布局境外债券投资。

公司通过全资子公司东吴创新资本开展另类投资业务。东吴创新以对冲投资、非标投资、实业投资、大宗商品投资和创新型金融产品投资等“五大平台”为职能定位。报告期内，东吴创新将私募基金组合投资、新三板投资作为重点投资方向，充分运用对外融资手段，全年实现利润总额 11,820.69 万元，净利润 8,860.91 万元。

公司通过全资子公司东吴创投开展直接投资业务。东吴创投在传统 Pre-IP0 项目基础上，尝试 VC 投资、企业并购等多方向的复合业务模式。报告期内，通过设立直投资基金放大管理资产规模，通过参与产业基金实现强强联合；为推动产业整合与升级，分享企业成长价值，相继设立并购基金管理公司和并购有限合伙企业。东吴创投全年实现利润总额 3,823.39 万元，净利润 2,885.40 万元。

#### ④资管及基金管理业务

资管及基金管理业务是提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。

公司资产管理业务围绕“上规模、树品牌、创业绩”三步走的发展目标，充分发挥资管平台优势，业务收入和管理规模大幅提升。报告期内，公司的定向业务升级提速，品种愈加丰富，合作机构更为广泛，撮合业务量逐步增多，客户集中度明显下降。截至报告期末，公司定向业务规模接近 2000 亿元。公司集合产品扩张加速，回归财富管理本源，深耕主动管理领域，主动投资业绩得到客户认可。在资产收益率下滑的背景下，公司汇信系列主动融资类业务继续稳步发展，满足了客户的理财需求。资产管理业务条线还获得报价系统产品做市资格，并拓展布局券商权益类收益互换。报告期内，资产管理业务受托管理资产日均规模 1720 亿元，同比增长 100.00%，年末受托管理总规模为 2049.96 亿元，增长 64.81%。全年资产管理业务实现收入 2.60 亿元，同比增长 99.94%。

| 项目             | 2015 年度      | 2014 年度    |
|----------------|--------------|------------|
| 期末受托管理资金（亿元）   | 2049.96      | 1,243.87   |
| 期内平均受托管理资金（亿元） | 1720.00      | 860.00     |
| 受托资金总体损益（万元）   | 1,063,883.46 | 580,900.43 |
| 平均受托资产管理收益率    | 6.19%        | 6.75%      |

公司通过控股子公司东吴基金开展基金管理业务。报告期内，东吴基金以财富管理多元化、业务拓展平台化、营销服务网络化、运营管理规范化为抓手，管理产品线日臻完善，有效提升投资业绩，公募品牌价值得到提升。报告期内，东吴基金管理的资产总规模达 438.37 亿，其中公募基金规模 81.81 亿，专户资产规模 58.53 亿，子公司专项资产规模 298.03 亿。全年实现营业收入 25,937.20 万元，利润总额 6,946.04 万元。

#### ⑤信用交易业务

信用交易业务主要为个人及机构客户提供包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等资本中介业务。

报告期内，公司信用交易业务在良好的市场环境下获得了快速稳健的发展，积极开展业务创新和转型，加强风险控制，信用交易业务总体规模进一步增大，增强了公司盈利能力。截至报告期末，信用交易业务总规模达 298.7 亿元，同比增长 66.91%，实现营业收入 13.67 亿元，同比增长 163.47%。

在融资融券业务方面，公司以控制风险为前提，以精细化管理为重点，业务保持了快速增长的势头。报告期内，公司顺利通过证监会两融业务的检查，在业务规模爆发增长的背景下，坚持合规风控底线，业务得到平稳发展。而在市场的大幅波动中积累了丰富的应对经验。截至报告期末，公司融资融券业务规模达 108.98 亿元，同比增长 37.06%。在股票质押业务方面，公司以服务实体经济为指导，重点服务苏州本地区上市公司。报告期末，公司股票质押业务余额为 187.61 亿元，同比增长 90.33%，公司约定式购回业务余额 2.11 亿元，同比增幅 140.40%。在业务研究和创新方面，积极探索开展新三板、非上市公司股权质押业务，大力开拓两融业务专业机构客户。

#### ⑥创新业务开展情况

报告期内，公司加快研究和积极拓展各类创新业务，取得了较好的成果。

公司互联网金融业务发展势头迅猛。公司大力建设和推广“东吴秀财”这一互联网财富管理品牌，年初公司成立网络金融事业部，增加互联网金融业务的人才投入和资源配置，在市场交易

量放大的情况下，积累了大量的交易理财客户。报告期内，公司获得互联网证券业务试点资格并在行业内率先实施单向视频开户创新方案，“秀财”一站式移动理财APP完成开发并正式上线，银行二维码开户等渠道有效铺开，率先推出具有投顾分享功能与在线交流功能的“五牛组合”社交投资平台，成功开发能够实现行情交易的QQ公众号和微信公众号，公司互联网财富管理的基本构架已经实现。

公司将私募基金主经纪商（PB）业务列为年度重点工作。公司正式成立了私募及财富管理部一级部门，从基础服务、孵化扶持等多方面提供服务，根据资产管理机构发展的需求进行了相应的布局，并借助苏州私募集聚区的地缘优势积极拓展客户资源。继2014年获得私募基金综合托管业务资格之后，报告期内公司完成私募基金业务外包服务机构备案，构建多维度一体化的交易服务体系，为私募机构提供服务。2015年已成立并运行产品49只，累计成立规模43.97亿元。公司进一步完善和提升对私募资产管理机构多元化、一站式的服务能力和孵化能力，构建资产管理生态圈，众筹各类投资能力，培养差异化竞争优势。

公司积极拓展跨境业务、逐步实施国际化战略，提升公司跨境金融服务能力。报告期内，公司成功在新加坡注册成立东吴证券中新（新加坡）有限公司，目前已经获得业务牌照。同时开始筹备香港子公司，公司的国际化步伐再进一步。

#### ⑦账户规范情况

公司严格按照中国证监会、中国证券登记结算有限公司关于账户管理相关要求推进账户管理工作，不断完善账户规范管理的规章制度和业务流程，进一步健全完善账户规范管理的长效机制。

统计数据截止2015年12月31日，公司剩余不合格证券账户153户，不合格资金账户数133户；小额休眠证券账户242094户，休眠资金账户数131743户，纯资金账户36677户；司法冻结资金账户数19户，司法冻结证券账户数3户。

公司将进一步加强账户规范管理工作，采取有效措施对营业部账户规范工作进行督导及检查，严格执行账户规范管理内部问责机制，以有效落实账户规范管理的各项工作

## (2). 成本分析表

单位：元

| 分行业情况 |        |      |             |        |        |           |      |
|-------|--------|------|-------------|--------|--------|-----------|------|
| 分行业   | 成本构成项目 | 本期金额 | 本期占总成本比例(%) | 上年同期金额 | 上年同期占总 | 本期金额较上年同期 | 情况说明 |
|       |        |      |             |        |        |           |      |



|           |                |                  |       |                | 成本比例 (%) | 变动比例 (%) |                                   |
|-----------|----------------|------------------|-------|----------------|----------|----------|-----------------------------------|
| 经纪及财富管理业务 | 业务及管理费、营业税金及附加 | 1,112,783,233.05 | 36.24 | 653,056,765.57 | 37.14    | 70.40    | 报告期内,公司各项业务规模及收入大幅增长,相关费用和税金相应增加。 |
| 投资银行业务    |                | 468,563,237.90   | 15.26 | 290,951,868.02 | 16.55    | 61.04    |                                   |
| 投资与交易业务   |                | 339,190,512.23   | 11.05 | 186,104,358.43 | 10.58    | 82.26    |                                   |
| 资管及基金管理业务 |                | 305,870,536.21   | 9.96  | 176,445,385.25 | 10.04    | 73.35    |                                   |
| 信用交易业务    |                | 147,196,596.05   | 4.79  | 91,977,819.51  | 5.23     | 60.03    |                                   |

### (3) 主营业务分地区情况

①报告期内公司营业收入地区分部情况表 (合并口径)

单位: (人民币) 元

| 地区     | 2015 年 |                  | 2014 年 |                  | 营业收入增减百分比 (%) |
|--------|--------|------------------|--------|------------------|---------------|
|        | 营业部数量  | 营业收入             | 营业部数量  | 营业收入             |               |
| 江苏省内   | 82     | 2,441,130,391.75 | 81     | 978,672,804.40   | 149.43        |
| 江苏省外   | 34     | 489,079,418.96   | 32     | 216,629,107.29   | 125.77        |
| 总部及子公司 |        | 3,899,952,114.61 |        | 2,045,680,616.18 | 90.64         |
| 合计     | 116    | 6,830,161,925.32 | 113    | 3,240,982,527.87 | 110.74        |

②报告期内营业利润地区分部情况 (合并口径)

单位: (人民币) 元

| 地区     | 2015 年 |                  | 2014 年 |                  | 营业利润增减百分比 (%) |
|--------|--------|------------------|--------|------------------|---------------|
|        | 营业部数量  | 营业利润             | 营业部数量  | 营业利润             |               |
| 江苏省内   | 82     | 1,661,888,369.77 | 81     | 517,718,594.20   | 221.00        |
| 江苏省外   | 34     | 293,819,440.35   | 32     | 32,704,035.97    | 798.42        |
| 总部及子公司 |        | 1,768,432,801.12 |        | 880,178,138.37   | 100.92        |
| 合计     | 116    | 3,724,140,611.24 | 113    | 1,430,600,768.54 | 160.32        |

注: 截止 2015 年 12 月 31 日证券公司所属营业部 101 家, 期货公司所属营业部 12 家, 合计营业部 113 家; 本期证券公司注销 1 家江苏省外营业部, 期货公司注销 2 家江苏省外营业部。

## 2. 费用

业务及管理费、营业税金及附加

单位：（人民币）元

| 项目名称    | 2015 年           | 2014 年           | 增减百分比 (%) |
|---------|------------------|------------------|-----------|
| 业务及管理费  | 2,656,099,023.42 | 1,579,192,330.95 | 68.19     |
| 营业税金及附加 | 414,691,579.49   | 179,059,507.04   | 131.59    |

## 3. 研发投入

研发投入情况表

单位：元

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 本期费用化研发投入           | 17,966,374.99 |
| 本期资本化研发投入           | -             |
| 研发投入合计              | 17,966,374.99 |
| 研发投入总额占营业收入比例 (%)   | 0.26          |
| 公司研发人员的数量           | 60            |
| 研发人员数量占公司总人数的比例 (%) | 2.6           |
| 研发投入资本化的比重 (%)      | -             |

为坚决贯彻落实公司“建设以互联网财富管理为核心的现代证券控股集团”的战略目标，公司通过自行开发、合作开发、委托开发等方式研发了东吴证券秀财 APP 财富管理平台、秀财网财富管理平台、微信、QQ 公众服务平台、掌上营业厅、综合运营管理平台、新一代千万级用户高并发交易系统，为支持公司创新业务提供技术支持，合计研发支出 1796.64 万元。

## 4. 现金流

| 科目            | 本期数               | 上年同期数            | 变动比例 (%) |
|---------------|-------------------|------------------|----------|
| 经营活动产生的现金流量净额 | -1,806,012,545.99 | 1,006,467,334.46 | -279.44  |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -261,507,863.61   | -157,187,681.11  | -        |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 14,194,144,284.80 | 7,954,478,124.94 | 78.44    |

报告期内，公司现金及等价物净增加额为 121.28 亿元。具体分析如下：

(1) 经营活动产生的现金净流出为 18.06 亿元，主要流入项目为：收取利息、手续费及佣金的现金 69.05 亿元，代理买卖证券收到的现金净额 104.47 亿元，收到其他与经营活动有关的现金净额 31.91 亿元；主要流出项目为：处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额 26.22 亿元，融出资金净增加额 29.92 亿元，回购业务资金净减少额 99.90 亿元，支付利息、手续费及佣金的现金 18.11 亿元，拆入资金净减少额 15.68 亿元，支付给职工以及为职工支付的

现金 10.82 亿元，支付的各项税费 13.60 亿元，支付的其他与经营活动有关的现金 9.24 亿元。经营活动产生的现金流量净额比上年减少的主要原因是报告期内回购业务资金净减少额增加。

(2) 投资活动产生的现金净流出为 2.62 亿元，主要流入项目为收到其他与投资活动有关的现金 0.01 亿元；主要流出项目为：购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 1.53 亿元，为取得子公司及其他营业单位而支付的现金 1.09 亿元。投资活动产生的现金流量净额比上年减少的主要原因是购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金、取得子公司及其他营业单位支付的现金净额增加。

(3) 筹资活动产生的现金净流入 141.94 亿元，主要流入项目为：吸收投资收到的现金 0.36 亿元，取得借款收到的现金 0.8 亿元，发行债券收到的现金 226.67 亿元；主要流出项目为：偿还债务支付的现金 79.14 亿元，本期实际分配股利及偿付利息支付的现金 6.67 亿元，支付其他与筹资活动有关的现金 0.23 亿元。筹资活动产生的现金流量净额比上年增长的主要原因是公司报告期内发行债券收到的现金增加。

将净利润调节为经营活动现金流量净额的详细内容见财务报表附注 5.53 现金流量表补充披露。

## (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用  不适用

## (三) 资产、负债情况分析

### 资产及负债状况

单位：元

| 项目名称            | 本期期末数             | 本期期末数占总资产的比例 (%) | 上期期末数             | 上期期末数占总资产的比例 (%) | 本期期末金额较上期期末变动比例 (%) | 情况说明            |
|-----------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|---------------------|-----------------|
| 货币资金            | 23,454,179,048.36 | 29.10            | 10,249,789,646.59 | 17.84            | 128.83              | 股市交易活跃，客户资金存款增加 |
| 融出资金            | 10,875,406,336.00 | 13.49            | 7,888,930,794.47  | 13.73            | 37.86               | 融资业务规模大幅度增加     |
| 以公允价值计量且其变动计入当期 | 14,222,827,510.80 | 17.65            | 17,315,854,448.80 | 30.13            | -17.86              | 期末持有的金融资产规模减少   |

|           |                   |       |                   |       |          |                              |
|-----------|-------------------|-------|-------------------|-------|----------|------------------------------|
| 损益的金融资产   |                   |       |                   |       |          |                              |
| 衍生金融资产    | 3,620.00          | 0.00  | -                 | -     | -        | 股票期权业务增加                     |
| 买入返售金融资产  | 8,923,142,748.05  | 11.07 | 6,582,668,335.27  | 11.46 | 35.56    | 股权质押回购业务规模大幅度增加              |
| 应收款项      | 333,743,476.04    | 0.41  | 44,871,017.11     | 0.08  | 643.78   | 应收清算款和股票质押回购到期转入增加           |
| 应收利息      | 357,047,813.24    | 0.44  | 235,740,507.88    | 0.41  | 51.46    | 主要是期末应收信用业务利息增加              |
| 可供出售金融资产  | 14,337,888,888.16 | 17.79 | 5,962,900,341.44  | 10.38 | 140.45   | 主要是期末持有的债券及股票增加              |
| 长期股权投资    | 122,232,522.20    | 0.15  | 10,483,110.25     | 0.02  | 1,065.99 | 本期增加了对联营企业的投资                |
| 在建工程      | 751,888.44        | 0.00  | -                 | -     | -        | 新增装修工程                       |
| 递延所得税资产   | 167,302,236.93    | 0.21  | 59,595,719.83     | 0.10  | 180.73   | 可抵扣暂时性差异增加                   |
| 短期借款      | 93,684,509.36     | 0.12  | -                 | -     | -        | 子公司借款增加                      |
| 应付短期融资款   | 4,567,350,000.00  | 5.67  | 3,313,738,000.00  | 5.77  | 37.83    | 新发行的短期融资券及收益凭证较期初增加          |
| 拆入资金      | 350,000,000.00    | 0.43  | 1,918,000,000.00  | 3.34  | -81.75   | 本期归还转融资融入资金                  |
| 衍生金融负债    | 5,704,972.15      | 0.01  | -                 | -     | -        | 股票期权和权益互换业务增加                |
| 卖出回购金融资产款 | 8,926,452,635.46  | 11.08 | 16,361,955,658.47 | 28.47 | -45.44   | 卖出回购金融资产业务规模减少               |
| 代理买卖证券款   | 24,025,978,380.26 | 29.81 | 13,579,472,286.92 | 23.63 | 76.93    | 股市交易活跃,客户资金增加                |
| 应付职工薪酬    | 1,505,489,727.11  | 1.87  | 651,274,014.09    | 1.13  | 131.16   | 主要是本期计提的职工薪酬增加               |
| 应交税费      | 401,483,551.42    | 0.50  | 304,415,837.08    | 0.53  | 31.89    | 主要是应交企业所得税增加                 |
| 应付利息      | 536,703,397.67    | 0.67  | 97,768,819.16     | 0.17  | 448.95   | 主要是应付债券利息增加                  |
| 应付债券      | 16,466,882,811.73 | 20.43 | 2,975,791,937.06  | 5.18  | 453.36   | 主要是本期发行次级债增加                 |
| 递延所得税负债   | 9,617,062.63      | 0.01  | 2,689,891.59      | 0.00  | 257.53   | 应纳税暂时性差异增加                   |
| 其他负债      | 6,877,015,079.34  | 8.53  | 3,952,206,040.35  | 6.88  | 74.00    | 主要是纳入合并范围的结构化主体中应付其他投资者的负债增加 |

#### (四) 行业经营性信息分析

详见主营业务分行业、分产品、分地区情况的说明

## (五) 投资状况分析

### 1、 对外股权投资总体分析

报告期内, 公司出资 750 万新加坡元设立东吴证券中新(新加坡)有限公司, 持股比例 75.00%; 出资 2 亿元参股中证信用增进股份有限公司, 持股比例 4.878%; 出资 5000 万元参股中证机构间报价系统股份有限公司, 持股比例 0.66%; 公司子公司东吴期货有限公司出资 1 亿元设立上海东吴玖盈投资管理有限公司, 持股比例 100.00%; 公司子公司东吴创业投资有限公司和东吴创新资本管理有限责任公司出资 2.01 亿元参股苏州市东吴城乡一体化建设引导基金合伙企业(有限合伙), 持股比例 15.20%; 公司子公司东吴创新资本管理有限责任公司出资 8000 万设立东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司, 持股比例 40.00%; 公司子公司东吴创业投资有限公司出资 80 万设立昆山东吴阳澄投资管理有限公司, 持股比例 80.00%; 公司子公司东吴创业投资有限公司和昆山东吴阳澄投资管理有限公司出资 2525 万元设立昆山东吴阳澄创业投资中心(有限合伙), 持股比例 50.50%; 公司子公司东吴创业投资有限公司投资其他股权共计约 7,052.96 万元; 公司子公司东吴创新资本管理有限责任公司投资其他股权共计约 700 万元。

#### (1) 重大的股权投资

金额单位: 万元

| 本年度被投资公司名称         | 主要业务                    | 出资额       | 持股比例     | 报告期投资收益 |
|--------------------|-------------------------|-----------|----------|---------|
| 东吴证券中新(新加坡)有限公司    | 资产管理和财富管理               | 750 万新加坡元 | 75.000%  | 不适用     |
| 上海东吴玖盈投资管理有限公司     | 投资管理及咨询, 资产管理           | 10,000.00 | 100.000% | 不适用     |
| 昆山东吴阳澄创业投资中心(有限合伙) | 创业投资业务                  | 2,525.00  | 50.500%  | 不适用     |
| 中证信用增进股份有限公司       | 各类信用主体及债项产品信用增进         | 20,000.00 | 4.878%   | -       |
| 中证机构间报价系统股份有限公司    | 非公开募集方式设立产品的报价、发行与转让服务等 | 5,000.00  | 0.66%    | -       |

| 本年度被投资公司名称                 | 主要业务              | 出资额       | 持股比例   | 报告期投资收益 |
|----------------------------|-------------------|-----------|--------|---------|
| 苏州市东吴城乡一体化建设引导基金合伙企业（有限合伙） | 城乡一体化创业投资、投资及管理咨询 | 20,100.00 | 15.20% | -       |
| 东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司      | 投融资信息咨询服务         | 8,000.00  | 40.00% | -424.15 |

**(2) 重大的非股权投资**

不适用

**(3) 以公允价值计量的金融资产**

金额单位：万元

| 会计科目                   | 投资成本         | 年末账面余额       | 报告期内购入或出售净额 | 报告期投资收益    | 报告期公允价值变动 |
|------------------------|--------------|--------------|-------------|------------|-----------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 1,382,562.85 | 1,422,282.75 | -338,348.57 | 118,294.48 | 29,045.87 |
| 衍生金融工具                 | 不适用          | -570.14      | 不适用         | -2,754.99  | 1,616.98  |
| 可供出售金融资产               | 1,386,126.37 | 1,433,788.89 | 823,729.91  | 120,644.82 | 47,752.00 |

**(六) 重大资产和股权出售**

不适用

**(七) 主要控股参股公司分析**

(1) 东吴基金管理有限公司，注册资本为1亿元人民币，公司持有70%的股权，经营范围为：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。截止2015年12月31日，东吴基金总资产3.81亿元，净资产3.08亿元，全年实现营业收入25,937.20万元，利润总额6,946.04万元，净利润5,199.93万元。

(2) 东吴期货有限公司，注册资本为5亿元人民币，本公司持有93.8%的股权，其经营范围包括：商品期货经纪，金融期货经纪，期货投资咨询、资产管理等业务。截止2015年12月31日，东吴期货总资产21.22亿元，净资产6.14亿元，全年实现营业收入18,863.54万元，利润总额6,065.76万元，净利润4,701.43万元。

(3) 东吴创业投资有限公司，注册资本为 12 亿元人民币，为公司全资子公司，其经营范围包括：创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。截止 2015 年 12 月 31 日，东吴创投总资产 7.20 亿元，净资产 7.04 亿元，全年实现利润总额 3,823.39 万元，净利润 2,885.40 万元。

(4) 东吴创新资本管理有限责任公司，注册资本为 20 亿元人民币，为公司全资子公司，经营范围为：资产管理、投资管理，投资咨询；项目投资、实业投资、股权投资；贵金属、金属材料、食用农产品、化工原料及产品（不含危险化学品）销售。截止 2015 年 12 月 31 日，东吴创新资本总资产 21.52 亿元，净资产 14.76 亿元，全年实现利润总额 11,820.69 万元，净利润 8,860.91 万元。

(5) 东吴证券中新（新加坡）有限公司，注册资本为 1000 万新加坡元，为公司控股子公司，经营范围为：资产管理。2015 年 8 月 31 日，东吴新加坡在新加坡办理完成注册手续，并于 9 月 3 日收到新加坡会计与企业管理局（ACRA）颁发的公司注册证书。

## **(八) 公司控制的结构化主体情况**

本公司根据准则 33 号(2014)纳入公司合并报表范围的结构化产品共 30 只（其中有 5 只产品已于 2015 年度清算）。具体详见财务报表附注 6.04 纳入合并范围的结构化主体。

本公司合并的结构化主体指本公司作为管理人或投资者的资产管理计划。本公司综合评估本公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬是否将使本公司面临可变回报的影响重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。

截至 2015 年 12 月 31 日，合并资产管理计划的总资产为人民币 10,145,669,707.57 元。本公司持有在上述合并资产管理计划中的权益体现在资产负债表中可供出售金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的总金额为人民币 2,849,459,626.00 元。

## **三、公司关于公司未来发展的讨论与分析**

### **(一) 行业竞争格局和发展趋势**

2016 年是“十三五”开局之年，也是推进供给侧结构性改革的攻坚之年，同样是资本市场改革攻坚关键年。证券行业 2015 年经历了较大的机遇与挑战，未来随着国家供给侧改革的战略方针，

金融业整体将持续打造适宜的市场以服务实体经济，证券行业仍处于有利发展环境。人民币国际化、资本账户开放、国有企业改革等多维改革全面推进，资本市场迎来历史发展新机遇。从证券行业发展环境来看，行业壁垒逐渐缩小、业内竞争日益加剧，将倒逼券商业务转型，证券行业将真正迎来混业、跨界、跨境的全竞争时代。行业竞争格局目前主要表现在以下几方面：

#### 1、互联网金融加速证券行业的渗透和融合

随着“一人一户”放开以及互联网的快速发展、竞争加剧倒逼券商经纪业务从原有的线下网点扩张向“线上+线下”结合的竞争模式转变，经纪业务将从“通道”向“入口”转变。凭借对客户需求的深入理解和多元化的业务平台，部分证券公司加快互联网获客入口的建设及大数据应用平台的搭建。与此同时各券商经纪业务同质化较强，低佣金的互联网开户带来佣金率的持续下滑。券商通过互联网经纪业务打开线上渠道，开展资产管理服务，发挥证券公司的综合服务能力。

#### 2、金融服务实体经济，资本市场融资功能逐渐凸显

在中国实体经济结构转型和国家供给侧改革的战略中，资本市场可以发挥改善资源配置的重要作用，金融将回归服务实体经济。“十三五规划”中明确提出了“加快金融体制改革，提高金融服务实体经济效率”、“积极培育多层次资本市场，推进股票和债券发行交易制度改革，提高直接融资比重，降低杠杆率”。通过多层次资本市场的建立和相关制度的不断完善，资本市场将更好的为不同成长阶段的企业解决融资需求，盘活存量资产创造新的价值。

#### 3、券商牌照逐步放松，金融混业经营是长期趋势

金融混业经营的大趋势下，银行、保险、信托、互联网公司等其他领域各类机构通过收购、参股等方式延伸业务至证券领域，一方面与传统券商业务已经形成直接或间接的竞争关系，另一方面也将拓宽券商的业务范围。另外证监会提出了进一步放开证券业务牌照的政策导向，在券商牌照逐步放松的情况下，未来其他金融机构、非金融企业、海外大型投行等都将在证券领域分一杯羹。传统券商需要通过发挥各业务间的协同效应、打造差异化核心优势等提升竞争力。

#### 4、深港通、沪伦通将继续推进，为国际化扩张提供政策支持

我国经济的全球地位的不不断提升，但我国金融的国际地位远远落后。“一带一路”的推进、人民币加入SDR将助力中国金融在全球话语权的提升。在中国大国崛起背景下，中国亟需构建与大国经济相匹配的“大国金融”，未来证券公司的国际化发展势在必行。未来通过深港通、沪伦通的推进，国内资本市场将继续接轨国际市场，为中国证券行业国际化发展提供政策支持。



## (二) 公司发展战略

国企改革、金融改革的推进为公司的发展提供了新机遇。站在新的历史起点上，公司将抢抓机遇、加快转型，以服务实体经济为宗旨，不断提高综合金融服务能力，全面提升公司核心竞争力，有效服务供给侧结构性改革，加快建成以互联网财富管理为核心的现代证券控股集团。

1、坚持国有主体地位与市场化导向相结合。在发挥国有企业制度性优势和市场化激励功能上下功夫，促进企业做强做优。切实加强国有企业党的建设，规范决策行为，提高决策水平，防范决策风险。以客户需求为中心推进组织流程的进化，激发业务一线的活力，以市场竞争效果调整分支机构设置，加大市场化考核力度。

2、坚持“根据地”战略与“走出去”战略相结合。一方面，坚持“做熟、做透、做深、做细”苏州市场，进一步加强对地方经济发展服务力度，为实体经济提供多样化投融资解决方案；一方面，加快“走出去”战略实施步伐，加大北京、上海、深圳业务布局力度，加快海外业务拓展，加速形成老东吴、新东吴、洋东吴三足鼎立格局。

3、坚持人才要素与资本要素相结合。灵活运用多种方式进行资本补充，积极完善流动性管理、加强资金缺口预测，提升负债管理能力、对大类资产配置进行优化。大力推进后备干部队伍建设与青年人才培养工作，强化能上能下的用人机制，激发干部队伍活力。推进机制创新，加快形成具有市场吸引力的人才激励机制。

4、坚持风险控制与业务创新相结合。积极推进业务创新，不断培育新的增长点。在继续推动互联网金融业务的基础上，2016年力争在PB业务上取得突破性发展。始终突出风控合规工作，牢固树立底线思维，强化风险监控，坚决防范和制止利益冲突等违规行为。

## (三) 经营计划

2016年，公司将坚持“根据地”战略与“走出去”战略相结合，坚持人才要素与资本要素相结合，坚持业务创新与风险控制相结合，突出改革转型主线、突出协调共享理念、突出争先进位导向、突出从严管理要求，积极服务实体经济、努力满足理财需求，全面推进建设以互联网财富管理为核心的现代证券控股集团。具体经营计划如下：

一、突出改革转型主线，进一步激发体制机制活力。

全面推进分公司转型。将分公司定位调整为“小型券商”，强化分公司综合经营职能。改革配套考核机制，加快完善传统分公司“造血”功能，打造综合业务团队、发挥地缘优势、扎紧流量入口、拓展客户资源。落实研究所子公司审批事项，全面提升公司研究支撑能力。

加快完善业务布局。牢牢抓住核心市场。以苏州为根据地，明确江浙地区为公司的核心市场，以全面推进分公司转型为抓手，全力提升核心区域各项业务市场份额。全面推进“走出去”战略。做大做强上海、北京、深圳区域业务，积极拓展海外业务，加快新加坡子公司业务拓展步伐，积极筹建香港子公司。

提高集团化运作能力。提高集团化运作的整体效率和竞争力，支持子公司自主经营，积极推进商业模式创新，创建高效运作的集团控股管理模式。

## 二、突出协调共享理念，进一步推进业务融合发展

以改善服务供给引领融合，提升金融服务供给水平和质量。聚焦核心客户，实施全业务链服务。大力推行标准化服务、差异化服务、定制化服务，构建完善多层次服务体系。

以力推互联网金融催化融合。搭建客户服务集中化处理的互联网金融“大后台”，积极采取有效措施推动传统营业部普通客户向线上迁移。

以健全信息技术体系支撑融合。瞄准先进、通盘考虑、加大投入，围绕整合利用公司客户流、资金流、信息流、风控流，以全局的眼光定位、规划和实施信息技术体系建设。

## 三、突出争先进位导向，进一步加大业务拓展力度

重点拓展 PB 业务。集聚公司资源，成立私募引导基金，加强与优秀私募基金机构的交流合作，提供一站式服务。加强与地方政府的合作，继续推进“私募基金集聚区”建设工作。以 PB 业务的快速发展有效提升公司经纪业务市占率和融资融券业务周转率。全力抢抓投行业务机遇。抓住有利时机做大做强并购业务，积极拓展海外并购业务，服务实体经济转型升级。不断巩固新三板业务优势，抢抓债券发行加速机遇，加快推进资产证券化业务。

积极拓展证券金融业务。在控制风险的前提下，进一步发展信用交易业务。主动把握当前债市投资机遇，加强对汇率市场、利率市场的学习和研究，积极探索 FICC 业务。

努力提升资管产品开发与销售能力。做大做强主动管理资产规模，加大资管产品创新力度，提升资管产品销售能力。

稳步推进证券投资业务。坚持绝对收益投资理念，客观对待市场指数的涨跌，保持定力、捕捉机会。积极开展期权做市商业业务，推进场外衍生品业务，不断拓展投资领域。

#### 四、突出从严管理要求，进一步提升保障发展能力

构建全方位监督管理体系。加强内部审计，提高财务管理能力，严格员工执业行为管理，加大问责力度。提升全面风险管理能力。进一步完善业务制度和风控流程，全面推动信用风险、市场风险、总量风险等管理系统的应用，加快操作风险、流动性风险管理系统的建设，增强风险管理的前瞻性。

推进干部人才队伍建设。全面推进干部轮岗交流工作，扎实推进后备干部培养计划，推进实施 MD 专业序列职级体系，不断完善绩效考核工作，加强对绩效评价、绩效结果的应用。

报告期内，公司通过发行公司债券、次级债券、短期融资券、收益凭证、开展收益权转让等进行融资。公司将根据《2015-2017 年资本规划》，灵活运用股权融资和债权融资手段，补充公司资本金，增强公司资本实力。

#### (四) 可能面对的风险及应对措施

公司在报告期间的业务主要面临市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、合规风险等。公司主要采取了如下措施对各项风险进行控制：

##### (一) 市场风险的控制

市场风险指因证券价格、利率、汇率等的变动而导致所持有的金融资产产生潜在损失的风险。公司的市场风险主要源于权益类投资、固定收益类投资、衍生品投资等，主要集中于公司投资总部、固定收益总部和资产管理总部等业务部门。主要表现为权益类、固定收益类证券价格下降引起的投资损失的可能性等。

目前，公司主要从风险评估、流程控制、风险对冲与隔离、创新业务风险控制三个方面来控制公司的市场风险：

1、风险评估：公司主要采取敏感性分析和压力测试等方式定期或不定期对公司的市场风险承受能力进行测试，针对市场大幅波动带来的风险，加大测算频率，确保公司在风险可控的情况下开展相应业务。

2、流程控制：主要通过规模控制、授权管理和止盈止损控制等三个方面措施来控制。规模控制方面，公司董事会每年根据风险评估的结果确定自营、固定收益等的年度规模，确保在风险可承受的范围内开展业务；授权管理方面，公司对投资决策委员会、投资决策小组按照投资规模和投资期限分级授权，并且在投资策略、投资具体品种的决策方面相分离，确保业务开展中的权利有效制衡；止盈止损控制方面，公司通过止盈止损控制单项投资的风险，避免单项投资亏损过大情况的出现，同时通过设定总的风险容忍度来规避系统性市场风险。

3、风险对冲与隔离：公司积极研究数量化投资等中性投资策略，加强对创新业务的研究，灵活使用数量化模型与金融衍生品对冲系统性市场风险；公司还通过建立隔离墙制度，对公司各业务的人员、信息、物理、财务账户等进行隔离，防止市场风险蔓延到公司其他业务模块。

4、创新业务风险控制：报告期内，公司持续促进业务创新活动，推动公司新业务、新产品、服务及管理。公司在开展新三板做市、资产证券化、期权投资与做市、衍生品交易、场外柜台业务、PB 业务等创新业务的同时，制定相应的风险管理制度，设置定性、风险控制指标，涉及市场风险实施逐日盯市，业务开展后纳入公司全面风险管理体系统一管理。

## （二）信用风险的控制

信用风险是指证券公司在开展业务时，由于合同的一方不履行或在其结算过程中交易对手的违约，或由于交易对手的信用等级下降，给证券公司带来损失的风险。公司的信用风险主要源于固定收益投资、融资融券业务、约定式购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务、合同履行等方面。主要表现为固定收益类违约、客户违约等对造成公司的损失的可能性等。

目前，公司主要采取信用评估、交易对手管理、尽职调查、规模控制、指标监测、合同管理等方式控制信用风险：

1、信用评估：在融资融券业务、约定式购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务等信用交易业务中，重点加强客户适当性管理，通过征信评级全面了解客户资信水平和风险承受能力，

综合确定客户信用评级及授信额度；在固定收益投资中，尝试建立数量化信用风险评估模型，量化信用风险。

2、交易对手管理：在固定收益投资中，选择资本实力强，盈利状况好，管理和运作规范、信用良好的交易对手进行交易，减少不良交易对手产生的风险；对融资融券等信用交易业务客户，建立客户准入和征信标准，通过对客户的身份特征、资产情况、投资偏好、投资能力、资信状况进行评价，严格执行信用授信和跟踪管理，建立失信客户黑名单制度等。

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

4、规模控制：在固定收益投资中，债券持有量严格控制在公司及监管机构规定的范围内，尽可能减少发行人的偿付风险；在信用交易业务中，通过规模、集中度等控制，减少单一品种、单一业务或单一客户的信用风险。

5、指标监测：针对市场大幅波动带来的系统性风险，公司及时调整监测指标与阈值，并进一步加强融出资券履约保障比例的监控，发现异常时及时与客户沟通反馈，避免客户违约给公司造成损失。

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

### （三）操作风险的控制

操作风险是指操作规程不当或操作失误对公司造成的风险，如操作流程设计不当或矛盾，操作执行发生疏漏、内部控制未落实等。公司的操作风险涉及公司的各个业务。主要表现为系统故障、人员违规操作等给公司造成损失的可能性。

公司主要通过下列措施进行控制操作风险：

1、制度流程：对传统业务与创新业务，公司建立和完善各项业务制度、操作流程和对应的业务表单，梳理各业务的操作风险点，制定相应的控制措施并通过流程予以固化。

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

3、系统建设：完善信息系统风险管理，确保设备、数据、系统的安全，防范信息技术风险，建立应急风险处置预案并定期演练。

4、内部培训：建立内部控制管理学习培训体系，组织各项内控制度的培训，加强员工职业道德教育。

#### （四）合规风险的控制

合规风险是指因公司或员工的经营管理或执业行为违反法律、法规和准则而使公司受到法律制裁、被采取监管措施、遭受财产损失或声誉损失的风险。

公司主要采取加强合规培训、强化合规管理、加大合规问责的力度来控制合规风险。

1、加强合规培训：公司通过制定合规手册、签订合规承诺书、举办合规风控知识竞赛、开展合规风控建议征集活动、组织合规培训等方式在内部构建起“人人主动合规、合规创造价值”的东吴证券合规文化，培养每一个员工的红线意识、规避意识和报告意识。

2、强化合规管理：公司通过设立合规总监、风险合规总部、内控经理专门履行合规职能，发挥其在制度梳理、合规咨询、合规审查、合规监督、合规检查、合规培训、隔离墙、反洗钱方面的职能，确保公司的各项业务合规开展。

3、加大问责力度：公司通过实施人力资源优化项目，明确合规的考核标准，加大合规在绩效考核中的力度，并且综合发挥意见建议书、合规要求通知、事项处理书在合规管理及问责中的作用，从而加大合规问责的力度。

#### （五）流动性风险的控制

流动性风险，指公司不能以合理的价格迅速卖出或将该工具转手而使公司遭受损失的风险，以及资金不足、资金周转出现问题而产生的风险。

公司主要通过、流动性日常管理、风险控制指标监测、健全财务管理制度等措施控制流动性风险：

1、流动性日常管理：每日编制资金头寸表、汇总短期资金预约表、进行日间资金盯市、完成自营业务交收工作；按月计算和报送流动性覆盖率、净稳定资金率；编制公司现金流预测表，关注资金缺口并进行资金预警；定期分析公司资金使用状况，流动比率、资产错配比率等指标。

2、风控指标监测：为有效防范证券投资带来的流动性风险，公司严格按照监管部门风险控制指标中有关规定比例进行证券投资，并设定了更为严格的公司预警指标，对达到公司预警指标的投资及时跟踪和处置。此外，定期开展流动性风险的监测分析、压力测试和情景分析，监测流动性风险限额执行情况。

3、建立健全财务管理制度和资金管理制度：实行全面预算管理制度，健全财务指标考核体系；对重要分支机构财务人员实行委派制度；严格执行资金调拨、资金运用的授权审批制度，加强资金筹集的规模、结构、方式的计划管理

## **(五) 内部控制实施情况**

### **1、公司动态风险控制指标监控和补足机制建立情况**

根据中国证监会《证券公司风险控制指标管理办法》等相关规定，公司制定了动态风险控制指标监控和补足相关制度，明确了有关风险控制指标的动态监控和补足机制、压力测试机制，相关机制全部建立并已实际运作。

公司对净资本相关的风险控制指标进行动态监控，及时掌握指标的变动情况，定期对净资本监控系统进行数据核对和逻辑校验，不断完善风控指标动态监控系统。公司加强净资本等风险控制指标和流动性风险指标的管理，动态监控各项风控指标、优化资产负债结构、实施资本补充、建立资本补足应对措施，有效落实了风险控制指标补足机制。公司对重大业务及可能影响风险控制指标的情况进行了多次压力测试，并不定期实施了综合压力测试。

公司每月按规定完成净资本计算表、风险控制指标监管报表、风险资本准备计算表、流动性覆盖率计算表、净稳定资金率计算表的编制工作并及时向监管机构报送。公司每季度对风险控制指标动态监控系统运营情况进行有效性评估，每半年公司董事会提交公司风险控制指标的执行情况报告，确保系统稳定、安全、高效运行。

### **2、报告期内公司风险控制指标触及预警标准、不符合规定标准的情况及采取的整改措施、整改效果**

报告期内公司各项业务发展稳健，各项主要风险控制指标均未触及预警标准且符合监管规定标准，整体风控指标运行情况良好。

#### 四、公司因不适用准则规定或特殊原因，未按准则披露的情况和原因说明

适用 不适用

## 第五节 重要事项

### 一、普通股利润分配或资本公积金转增预案

#### (一) 现金分红政策的制定、执行或调整情况

公司历来重视对股东的合理投资回报，执行持续、稳定的利润分配政策。在公司盈利、符合净资本等监管要求及公司正常经营和长期发展的前提下，公司将积极采取现金方式分配股利。

公司《章程》第一百九十九条明确了公司利润分配政策，第二百条明确了公司股利分配具体方案的决策程序及公司调整利润分配政策的决策程序。

公司现金分红政策的制定、执行或调整情况符合相关法律法规的规定；分红标准和比例明确清晰；相关的决策程序和机制完备；中小股东有充分表达意见和诉求的机会，中小股东的合法权益得到了充分保护。

报告期内，公司实施了 2014 年度利润分配方案：以 27 亿股为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利 1.25 元（含税），共计派发现金红利 337,500,000 元（含税）。

#### (二) 公司近三年（含报告期）的普通股利润分配方案或预案、资本公积金转增股本方案或预案

单位：元 币种：人民币

| 分红年度   | 每 10 股送红股数（股） | 每 10 股派息数（元）（含税） | 每 10 股转增数（股） | 现金分红的数额（含税） | 分红年度合并报表中归属于上市公司股东的净利润 | 占合并报表中归属于上市公司股东的净利润的比率（%） |
|--------|---------------|------------------|--------------|-------------|------------------------|---------------------------|
| 2015 年 | 0             | 3                | 0            | 900,000,000 | 2,708,494,901.88       | 33.23                     |
| 2014 年 | 0             | 1.25             | 0            | 337,500,000 | 1,115,452,050.88       | 30.26                     |
| 2013 年 | 0             | 0.6              | 0            | 120,000,000 | 392,166,585.94         | 30.60                     |

根据《中华人民共和国公司法》、《公司章程》有关规定，公司拟订了 2015 年度利润分配方案，具体情况如下：



经天衡会计师事务所（特殊普通合伙）审计，公司2015年度合并报表中归属于母公司所有者的净利润为2,708,494,901.88元，母公司2015年度净利润为2,658,682,072.90元。

根据《公司法》、《证券法》、《金融企业财务规则》及中国证监会发布的《关于证券公司2007年年度报告工作的通知》（证监机构字[2007]320号）、《上市公司监管指引第3号——上市公司现金分红》等相关规定，母公司分配当年净利润时应分别提取法定公积金、交易风险准备金和一般风险准备金，具体为：

1、根据《公司法》第166条之规定，按10%提取法定公积金265,868,207.29元；

2、根据《证券法》第135条和证监机构字[2007]320号文之规定，按10%提取交易风险准备金265,868,207.29元；根据《金融企业财务规则》第44条和证监机构字[2007]320号文之规定，按10%提取一般风险准备金265,868,207.29元；提取的一般风险准备和交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算。

三项合计金额为797,604,621.87元，因此母公司2015年当年实现的未分配利润为1,861,077,451.03元，加上年初未分配利润1,239,611,705.37元，减去2015年年度已分配的现金股利337,500,000.00元，年末累计未分配利润为2,763,189,156.40元。

根据证监会（证监机构字[2007]320号）有关规定，证券公司未分配利润中公允价值变动收益部分不得用于向股东进行现金分配。扣除2015年度公允价值变动收益288,693,548.82元对未分配利润的影响，2015年当年母公司可供股东现金分配的利润为1,572,383,902.21元，2015年末累计可供股东现金分配的利润为2,474,495,607.58元。

综合考虑公司长远发展和投资者利益，2015年度公司利润分配方案为：

公司2015年12月31日总股本为27亿股，2016年1月定向增发新增股本3亿股，截至2015年度董事会召开之日，公司总股本为30亿股。公司拟以30亿股为基数，向全体股东每10股派送现金红利3元（含税），共派送现金红利9亿元，占当年母公司可供股东现金分配的利润比例为57.24%，占当年合并报表中归属于母公司所有者的净利润比例为33.23%。本次分配后，母公司剩余未分配利润1,574,495,607.58元，转入下一年度。

(三) 报告期内盈利且母公司可供普通股股东分配利润为正，但未提出普通股现金利润分配预案的，公司应当详细披露原因以及未分配利润的用途和使用计划

适用 不适用

## 二、承诺事项履行情况

适用 不适用

(一) 公司、股东、实际控制人、收购人、董事、监事、高级管理人员或其他关联方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

| 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 | 是否及时严格履行 |
|--------------|--------|--------------|---|-----------------------|---------|----------|
| 与首次公开发行相关的承诺 | 解决同业竞争 | 苏州国际发展集团有限公司 | 苏州国际发展集团有限公司出具了《有关消除或避免同业竞争的承诺函》，承诺苏州国际发展集团有限公司及其附属公司、参股公司：将不会在中国境内单独或与他人，以任何形式（包括但不限于投资、并购、联营、合资、合作、合伙、承包或租赁经营、购买上市公司股票或参股）直接或间接从事或参与或协助从事或参与任何与前述本公司开展的业务构成竞争或可能构成竞争的业务或活动。目前及将来不会利用在发行人的控股股东地位，损害发行人及其他发行人股东的利益。 | 永久有效                  | 否       | 是        |
| 与再融资相关的承诺    | 股份限售   | 苏州国际发展集团有限公司 | 苏州国际发展集团有限公司承诺对于所认购的公司非公开增发的新股10,900万股，自持有之日起60个月不转让。   | 自2014年8月5日起60个月       | 是       | 是        |
| 其他承诺         | 其他     | 苏州国际发展集团有限公司 | 在2015年年内不减持所持东吴证券的股票。   | 2015年7月8日-2015年12月31日 | 是       | 是        |
| 其他承诺         | 其他     | 苏州国际发展集团有限公司 | 通过证券公司定向资产管理方式增持公司股份，增持金额不低于10600万元，并自增持之日起6个月内不减持。   | 2015年7月8日             | 否       | 是        |

### 三、报告期内资金被占用情况及清欠进展情况

适用 不适用

### 四、董事会对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

#### (一) 董事会、监事会对会计师事务所“非标准审计报告”的说明

适用 不适用

#### (二) 董事会对会计政策、会计估计或核算方法变更的原因和影响的分析说明

适用 不适用

#### (三) 董事会对重要前期差错更正的原因及影响的分析说明

适用 不适用

### 五、聘任、解聘会计师事务所情况

单位：万元 币种：人民币

|               |                  |    | 现聘任              |
|---------------|------------------|----|------------------|
| 聘任、解聘会计师事务所情况 |                  |    | 天衡会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 境内会计师事务所报酬    |                  |    | 90               |
| 境内会计师事务所审计年限  |                  |    | 4                |
|               | 名称               | 报酬 |                  |
| 内部控制审计会计师事务所  | 天衡会计师事务所（特殊普通合伙） | 40 |                  |
| 保荐人           | 西部证券股份有限公司       | -  |                  |

聘任、解聘会计师事务所的情况说明

适用 不适用

2015年9月8日，公司2015年度第三次临时股东大会审议通过了《关于续聘审计机构的议案》，续聘天衡会计师事务所（特殊普通合伙）为公司2015年度审计机构，对公司财务状况和内部控制进行审计。天衡会计师事务所已连续四年为公司提供年度财务报表审计服务。

### 六、面临暂停上市风险的情况

#### (一) 导致暂停上市的原因以及公司采取的消除暂停上市情形的措施

不适用

### 七、破产重整相关事项

适用 不适用

**八、重大诉讼、仲裁事项**

√适用□不适用

**(一) 临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况**

√适用□不适用

单位:元 币种:人民币

| 报告期内:           |                        |                 |                |   |   |                                       |                        |                               |                          |
|-----------------|------------------------|-----------------|----------------|---|---|---------------------------------------|------------------------|-------------------------------|--------------------------|
| 起诉<br>(申请)<br>方 | 应诉<br>(被申<br>请)方       | 承担连<br>带责任<br>方 | 诉讼<br>仲裁<br>类型 | 诉讼(仲<br>裁)基本<br>情况  | 诉讼<br>(仲裁)<br>涉及金<br>额                      | 诉讼<br>(仲裁)<br>是否形<br>成预计<br>负债及<br>金额 | 诉讼<br>(仲裁)<br>进展情<br>况 | 诉讼<br>(仲裁)<br>审理结<br>果及影<br>响 | 诉讼<br>(仲裁)<br>判决执<br>行情况 |
| 公司              | 广州博<br>融投资<br>有限公<br>司 | 无               | 民事<br>诉讼       | 博融投<br>资股票<br>质押式<br>回购业<br>务违约,<br>公司在<br>苏州中<br>院提起<br>诉讼 | 本金<br>2.1亿<br>元及相<br>应利息<br>、罚息<br>、费用<br>等 | -                                     | 一审判<br>决公司<br>胜诉       | -                             | -                        |

截止目前,苏州市中级人民法院一审判决公司胜诉,博融投资有限公司提起上诉,江苏省高级人民法院作出终审裁定,案件按广州博融投资有限公司自动撤回上诉处理。

**(二) 公司本年度被处罚和公开谴责的情况**

公司本年度未被证券期货监管机构、相关自律组织采取行政处罚或公开谴责,亦未被财税、外汇和审计等部门处罚。

**九、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人、收购人处罚及整改情况**

□适用√不适用

**十、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明**

公司及控股股东、实际控制人在披露报告期内不存在未履行法院生效判决、不存在所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

**十一、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励情况及其影响**

□适用√不适用

## 十二、重大关联交易

适用 不适用

报告期内，公司无重大关联交易。公司其它日常关联交易等事项详见财务报告附注中有关内容。

## 十三、重大合同及其履行情况

### (一) 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

### (二) 担保情况

适用 不适用

## 十四、其他重大事项及期后事项

适用 不适用

### 1、设立新加坡子公司事项

2014年7月11日，公司第二届董事会第十五次（临时）会议审议通过了《关于设立新加坡子公司的议案》，公司拟与中新苏州工业园区开发集团股份有限公司共同出资在新加坡设立子公司，从事资产管理业务及监管部门核准的其他证券业务（具体业务范围以监管部门核准为准）（详见2014年7月12日公告）。2014年8月22日，公司2014年第一次临时股东大会审议通过了该议案。

2015年5月8日，中国证监会以《关于核准东吴证券股份有限公司在新加坡设立东吴证券中新（新加坡）有限公司的批复》（证监许可[2015]857号），核准公司以自有资金出资，在新加坡设立东吴证券中新（新加坡）有限公司，注册资本为新加坡元1000万元，其中，公司出资为新加坡元750万元。2015年8月28日，东吴证券中新（新加坡）有限公司办理完成注册手续。2016年1月27日，东吴新加坡获得了新加坡金融管理局颁发的业务牌照，批准业务：Fund Management。

### 2、东吴创新资本管理有限责任公司增资

2015年2月26日，公司子公司东吴创新资本管理有限责任公司完成增资事项，注册资本由“100,000万元整”变更为人民币“200,000万元整”，并完成了相关工商变更事宜。

### 3、收购苏州市民卡有限公司部分股权事项

2015 年 11 月 16 日，公司召开第二届董事会第三十二次（临时）会议审议通过了《关于向公司控股股东收购苏州市民卡有限公司部分股权暨关联交易的议案》，同意公司以自有资金不超过人民币 3,342.86 万元向国发集团收购其持有的苏州市民卡有限公司 20% 的股份（详见 2015 年 11 月 17 日公司公告）。截止报告期末，上述收购事项尚待中国人民银行等监管部门批准。

#### 4、分公司、营业部新设、处置、迁址

2015 年 7 月 29 日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立福建分公司的批复》（苏证监机构字[2015]194 号），公司获准在福建省福州市设立一家分公司，业务范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。信息系统建设模式为 C 型。截止本报告披露日，福建分公司已设立并营运。

2015 年 5 月 25 日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立 3 家分支机构的批复》（苏证监机构字[2015]132 号），公司获准在河南省郑州市、江苏省宜兴市、黑龙江省哈尔滨市各设立 1 家 C 型证券营业部，共计 3 家证券营业部。证券营业部的营业范围为：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。截止本报告披露日，上述营业部已完成设立。

公司第二届董事会第十九次（临时）会议审议通过了《关于撤销广西南宁朝阳路证券营业部的议案》，同意公司撤销南宁朝阳路证券营业部。2015 年 3 月 11 日，公司收到广西证监局《关于核准东吴证券股份有限公司撤销 1 家分支机构的批复》（桂证监许可（2015）6 号），广西证监局核准公司撤销南宁朝阳路证券营业部。2015 年 7 月 10 日，该营业部正式撤销。

报告期内，公司完成了张家港杨舍镇沙中中路证券营业部、嘉善体育南路证券营业部、重庆聚贤岩广场证券营业部的同城迁址工作，并向证监局备案。

#### 5、东吴创业投资有限公司增资

2016 年 1 月 5 日，东吴创投完成增资事项，注册资本由“60,000 万元整”变更为人民币“120,000 万元整”，并完成了相关工商变更事宜。

#### 6、监事、高级管理人员变动情况

2016年1月12日，公司监事会主席林峰先生辞去职工监事及监事会主席职务。公司工会召开第三届工会会员（职工）代表大会第四次会议，选举方敏女士为公司第二届监事会职工监事。2016年1月15日，第二届监事会第十三次（临时）会议通过议案，选举方敏女士为公司第二届监事会主席。

2016年1月，因工作调整，刘辉先生向董事会辞去副总裁职务，张剑宏先生向董事会辞去合规总监职务，辞任后均在公司继续担任其他职务。2016年1月15日公司召开第二届董事会第三十四次（临时）会议，审议通过了《关于聘任公司高级管理人员的议案》，同意聘任任少华先生为公司副总裁，聘任张剑宏先生为公司首席风险官，聘任朱卫国先生为公司合规总监，任期至第二届董事会届满之日止。2016年2月14日，江苏证监局出具《关于朱卫国拟任东吴证券股份有限公司合规负责人的无异议函》（苏证监函[2016]57号），朱卫国先生正式出任公司合规总监。

#### 7、收购东吴期货部分股权事项

2015年8月25日，公司与苏州工业园区华都物资贸易有限公司（以下简称“华都物贸”）签订了《股权转让协议书》，拟收购华都物贸持有的东吴期货4%股权，转让价格以国资管理部门备案后的评估价格为准，即为人民币3003.17万元。2015年12月18日，东吴期货收到了中国证监会《关于核准东吴期货有限公司变更股权的批复》（证监许可〔2015〕2982号），核准东吴期货股权变更。2016年1月14日，东吴期货办理完成股权的工商变更手续，变更完成后，公司持有东吴期货93.8%的股权。

#### 8、完成非公开发行股票事项

2016年1月13日，公司完成了非公开发行股票工作，发行数量为3亿股，发行价格11.80元/股，募集资金总额为3.54亿元，并于2016年1月20日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完毕新增股份登记托管手续。发行完成后，公司总股本由27亿上升至30亿。公司于2016年2月5日完成了工商变更手续，公司注册资本有27亿元变更为30亿元。

#### 9、获批新设营业部

2016年2月3日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立3家分支机构的批复》（苏证监机构字[2016]35号），公司获准在云南省昆明市、浙江省台州市、北京市各设立1家C型证券营业部，共计3家证券营业部。截止本报告披露日，上述营业部尚在筹建中。

## 十五、积极履行社会责任的工作情况

### (一) 社会责任工作情况

公司将在披露2015年年度报告的同时，披露《东吴证券2015年度社会责任报告》，详见上海证券交易所网站（[http:// www. sse. com. cn](http://www.sse.com.cn)）。

### (二) 属于国家环境保护部门规定的重污染行业的上市公司及其子公司的环保情况说明

报告期内，公司不存在重大环境问题或其他重大社会安全问题。

## 十六、可转换公司债券情况

适用 不适用

## 十七、报告期内，公司单项业务资格变化情况

参加本报告的“第二节公司简介和主要财务指标”

## 十八、公司无可能影响财务状况和经营成果的表外项目

## 第六节 普通股股份变动及股东情况

### 一、普通股股本变动情况

#### (一) 普通股股份变动情况表

##### 1、普通股股份变动情况表

单位：股

|            | 本次变动前       |        | 本次变动增减（+，-） |    |       |              |              | 本次变动后       |       |
|------------|-------------|--------|-------------|----|-------|--------------|--------------|-------------|-------|
|            | 数量          | 比例（%）  | 发行新股        | 送股 | 公积金转股 | 其他           | 小计           | 数量          | 比例（%） |
| 一、有限售条件股份  | 700,000,000 | 25.93% | 0           | 0  | 0     | -591,000,000 | -591,000,000 | 109,000,000 | 4.04% |
| 1、国家持股     | 0           | 0      | 0           | 0  | 0     | 0            | 0            | 0           | 0     |
| 2、国有法人持股   | 449,000,000 | 16.63% | 0           | 0  | 0     | -340,000,000 | -340,000,000 | 109,000,000 | 4.04% |
| 3、其他内资持股   | 251,000,000 | 9.30%  | 0           | 0  | 0     | -251,000,000 | -251,000,000 | 0           | 0     |
| 其中：境内非国有法人 | 251,000,000 | 9.30%  | 0           | 0  | 0     | -251,000,000 | -251,000,000 | 0           | 0     |



|            |               |        |   |   |   |             |             |               |        |
|------------|---------------|--------|---|---|---|-------------|-------------|---------------|--------|
| 持股         |               |        |   |   |   |             |             |               |        |
| 境内自然人持股    | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 4、外资持股     | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 其中：境外法人持股  | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 境外自然人持股    | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 二、无限售条件流通股 | 2,000,000,000 | 74.07% | 0 | 0 | 0 | 591,000,000 | 591,000,000 | 2,591,000,000 | 95.96% |
| 1、人民币普通股   | 2,000,000,000 | 74.07% | 0 | 0 | 0 | 591,000,000 | 591,000,000 | 2,591,000,000 | 95.96% |
| 2、境内上市的外资股 | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 3、境外上市的外资股 | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 4、其他       | 0             | 0      | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 0             | 0      |
| 三、普通股股份总数  | 2,700,000,000 | 100%   | 0 | 0 | 0 | 0           | 0           | 2,700,000,000 | 100%   |

## 2、普通股股份变动情况说明

报告期内，公司普通股股份总数及股本结构未发生变化。

### (二) 限售股份变动情况

√适用□不适用

单位：万股

| 股东名称                         | 年初限售股数 | 本年解除限售股数 | 本年增加限售股数 | 年末限售股数 | 限售原因    | 解除限售日期    |
|------------------------------|--------|----------|----------|--------|---------|-----------|
| 苏州国际发展集团有限公司                 | 10,900 | 0        | 0        | 10,900 | 非公开增发限售 | 2019年8月5日 |
| 中国人寿保险（集团）公司-传统-普通保险产品       | 13,000 | 13,000   | 0        | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 华富基金-浦发银行-华富基金稳健成长定向增发资产管理计划 | 12,100 | 12,100   | 0        | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 中新苏州工业园区城市投资运营有限公司           | 7,000  | 7,000    | 0        | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 苏州高新区国有资产经营公司                | 7,000  | 7,000    | 0        | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 苏州交通投资有限责任公司                 | 7,000  | 7,000    | 0        | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |

|                  |        |        |   |        |         |           |
|------------------|--------|--------|---|--------|---------|-----------|
| 张家港市直属公有资产经营有限公司 | 7,000  | 7,000  | 0 | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 中船投资发展有限公司       | 3,000  | 3,000  | 0 | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 苏州风景园林投资发展集团有限公司 | 3,000  | 3,000  | 0 | 0      | 非公开增发限售 | 2015年8月5日 |
| 合计               | 70,000 | 59,100 | 0 | 10,900 | /       | /         |

## 二、证券发行与上市情况

### (一) 截至报告期内证券发行情况

单位：股 币种：人民币

| 股票及其衍生证券的种类          | 发行日期       | 发行价格(或利率) | 发行数量  | 上市日期       | 获准上市交易数量 | 交易终止日期     |
|----------------------|------------|-----------|-------|------------|----------|------------|
| 可转换公司债券、分离交易可转债、公司债类 |            |           |       |            |          |            |
| 2015 年次级债券(第一期)      | 2015-3-23  | 5.90%     | 30 亿元 | 2015-4-22  | 30 亿元    | 2018-03-22 |
| 2015 年次级债券(第二期)      | 2015-04-17 | 5.90%     | 30 亿元 | 2015-05-29 | 30 亿元    | 2018-04-16 |
| 2015 年次级债券(第三期)一期    | 2015-06-01 | 5.70%     | 20 亿  | 2015-07-02 | 20 亿元    | 2018-05-31 |
| 2015 年次级债券(第三期)二期    | 2015-06-04 | 5.70%     | 20 亿  | 2015-07-02 | 20 亿元    | 2018-06-03 |
| 2015 年公司债券           | 2015-11-10 | 4.15%     | 25 亿元 | 2015-12-08 | 25 亿元    | 2020-11-09 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP001  | 2015-01-22 | 4.93%     | 5 亿   | 2015-01-26 | 5 亿      | 2015-04-24 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP002  | 2015-03-04 | 5.1%      | 10 亿  | 2015-03-06 | 10 亿     | 2015-06-04 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP003  | 2015-06-05 | 3.20%     | 10 亿  | 2015-06-09 | 10 亿     | 2015-09-07 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP004  | 2015-06-25 | 3.80%     | 10 亿  | 2015-06-29 | 10 亿     | 2015-09-25 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP005  | 2015-11-04 | 2.89%     | 5 亿   | 2015-11-06 | 5 亿      | 2016-02-04 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP006  | 2015-11-24 | 3.20%     | 10 亿  | 2015-11-26 | 10 亿     | 2016-02-24 |
| 短期融资券 15 东吴证券 CP007  | 2015-12-11 | 3.13%     | 10 亿  | 2015-12-15 | 10 亿     | 2016-03-11 |

截至报告期内证券发行情况的说明（存续期内利率不同的债券，请分别说明）：

2015年1月7日，公司2015年第一次临时股东大会审议通过了《关于公司发行次级债券的议案》，同意公司以非公开方式，根据业务需要分期发行次级债券，总规模不超过人民币100亿元（含），用于补充公司营运资金。

公司2015年次级债券（第一期）已于2015年3月23日发行完毕。本期次级债券发行规模为人民币30亿元，期限为3年期，本期次级债券票面利率为5.90%。

公司2015年次级债券（第二期）于2015年4月17日发行完毕。本期次级债券发行规模为人民币30亿元，期限为3年期，票面利率为5.90%。

公司2015年次级债券（第三期）分两期发行，其中第一期于2015年6月1日发行完毕，发行规模为人民币20亿元，期限为3年期，票面利率为5.70%；第二期于2015年6月4日发行完毕。发行规模为人民币20亿元，期限为3年期，票面利率为5.70%。

2015年11月10日，公司完成公开发行公司债券，发行总额为人民币25亿元，发行价格为每张人民币100元，为5年期单一期限品种，票面利率4.15%，并于2015年12月8日起在上交所挂牌交易，债券简称“15东吴债”，代码“136022”。

报告期内，公司共完成了7期，累计60亿元人民币的短期融资券的发行工作。

## (二) 公司普通股股份总数及股东结构变动及公司资产和负债结构的变动情况

报告期内，公司普通股股份总数无变化。

### 三、股东和实际控制人情况

#### (一) 股东总数

|                         |         |
|-------------------------|---------|
| 截止报告期末普通股股东总数(户)        | 103,520 |
| 年度报告披露日前上一月末的普通股股东总数(户) | 115,192 |

#### (二) 截止报告期末前十名股东、前十名流通股股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

| 前十名股东持股情况    |            |            |           |                     |                  |    |          |
|--------------|------------|------------|-----------|---------------------|------------------|----|----------|
| 股东名称<br>(全称) | 报告期内<br>增减 | 期末持股<br>数量 | 比例<br>(%) | 持有有限<br>售条件股<br>份数量 | 质押或冻结情<br>况      |    | 股东<br>性质 |
|              |            |            |           |                     | 股<br>份<br>状<br>态 | 数量 |          |
|              |            |            |           |                     |                  |    |          |

|                        |             |             |       |             |    |             |         |
|------------------------|-------------|-------------|-------|-------------|----|-------------|---------|
| 苏州国际发展集团有限公司           | -20,035,905 | 693,371,528 | 25.68 | 109,000,000 | 质押 | 323,500,000 | 国有法人    |
| 中国人寿保险(集团)公司-传统-普通保险产品 | 0           | 130,000,000 | 4.81  | 0           | 无  | 0           | 境内非国有法人 |
| 苏州高新区国有资产经营公司          | 0           | 70,000,000  | 2.59  | 0           | 无  | 0           | 国有法人    |
| 张家港市直属公有资产经营有限公司       | 0           | 70,000,000  | 2.59  | 0           | 无  | 0           | 国有法人    |
| 中新苏州工业园区城市投资运营有限公司     | 0           | 70,000,000  | 2.59  | 0           | 无  | 0           | 国有法人    |
| 苏州交通投资有限责任公司           | -226,800    | 69,773,200  | 2.58  | 0           | 质押 | 35,000,000  | 国有法人    |
| 苏州市营财投资集团公司            | 0           | 64,578,554  | 2.39  | 0           | 质押 | 32,289,277  | 国有法人    |
| 苏州工业园区国有资产控股发展有限公司     | 0           | 61,832,770  | 2.29  | 0           | 无  | 0           | 国有法人    |
| 中国证券金融股份有限公司           | 60,907,846  | 60,907,846  | 2.26  | 0           | 无  | 0           | 未知      |
| 苏州信托有限公司               | 0           | 53,120,000  | 1.97  | 0           | 无  | 0           | 国有法人    |

## 前十名无限售条件股东持股情况

| 股东名称                   | 持有无限售条件流通股的数量 | 股份种类及数量 |             |
|------------------------|---------------|---------|-------------|
|                        |               | 种类      | 数量          |
| 苏州国际发展集团有限公司           | 584,371,528   | 人民币普通股  | 584,371,528 |
| 中国人寿保险(集团)公司-传统-普通保险产品 | 130,000,000   | 人民币普通股  | 130,000,000 |
| 苏州高新区国有资产经营公司          | 70,000,000    | 人民币普通股  | 70,000,000  |
| 张家港市直属公有资产经营有限公司       | 70,000,000    | 人民币普通股  | 70,000,000  |
| 中新苏州工业园区城市投资运营有限公司     | 70,000,000    | 人民币普通股  | 70,000,000  |
| 苏州交通投资有限责任公司           | 69,773,200    | 人民币普通股  | 69,773,200  |
| 苏州市营财投资集团公司            | 64,578,554    | 人民币普通股  | 64,578,554  |
| 苏州工业园区国有资产控股发展有限公司     | 61,832,770    | 人民币普通股  | 61,832,770  |
| 中国证券金融股份有限公司           | 60,907,846    | 人民币普通股  | 60,907,846  |
| 苏州信托有限公司               | 53,120,000    | 人民币普通股  | 53,120,000  |

## 上述股东关联关系或一致行动的说明

苏州国际发展集团有限公司和苏州市营财投资集团公司、苏州信托有限公司之间为存在控制关系的关联方。苏州国际发展集团有限公司持有苏州市营财投资集团公司 100% 的股权，同时持有苏州信托有限公司 70.01% 的股权，因此，苏州国际发展集团有限公司、苏州市营财投资集团公司和苏州信托有限公司为一致行动人。

未发现上述其他股东之间存在关联关系，也未发现上述其他股东属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。

## 前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位：股

| 序号 | 有限售条件股东名称 | 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 | 限售条件 |
|----|-----------|--------------|----------------|------|
|----|-----------|--------------|----------------|------|

|   |              |             | 可上市交易时间   | 新增可上市交易股份数量 |              |
|---|--------------|-------------|-----------|-------------|--------------|
| 1 | 苏州国际发展集团有限公司 | 109,000,000 | 2019年8月5日 | 0           | 持有之日起60个月不转让 |

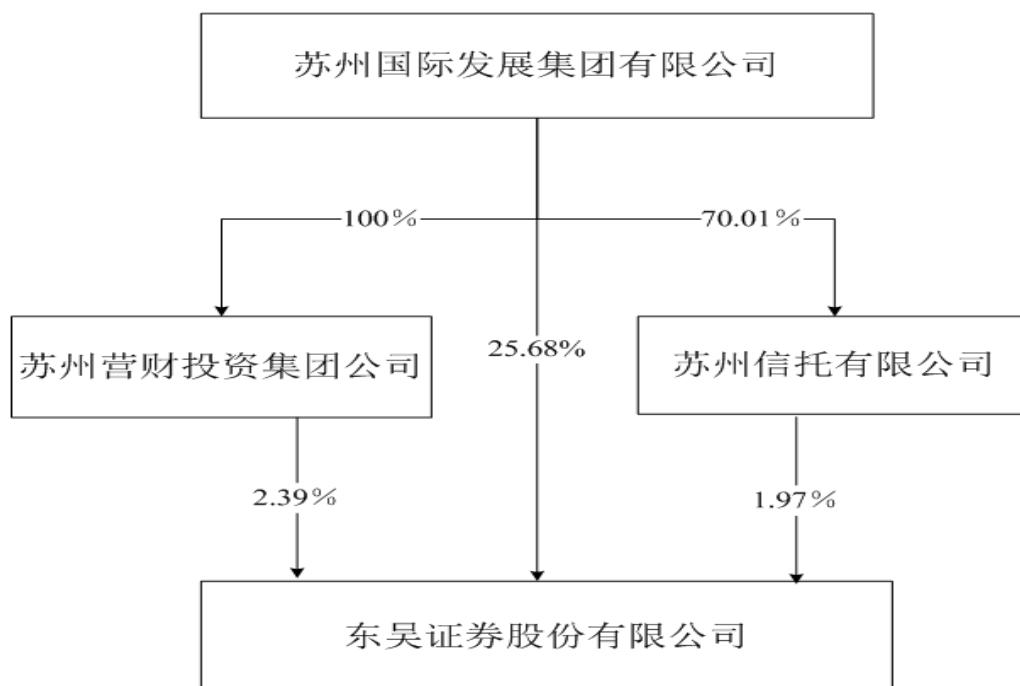
#### 四、控股股东及实际控制人情况

##### (一) 控股股东情况

###### 1 法人

|                          |   |
|--------------------------|---|
| 名称                       | 苏州国际发展集团有限公司  |
| 单位负责人或法定代表人              | 黄建林   |
| 成立日期                     | 1995年8月3日   |
| 主要经营业务                   | 授权范围内的国有资产经营管理,国内商业、物资供销业(国家规定的专营、专项审批商品除外),提供各类咨询服务。 |
| 报告期内控股和参股的其他境内外上市公司的股权情况 | 无   |

###### 2 公司与控股股东之间的产权及控制关系的方框图

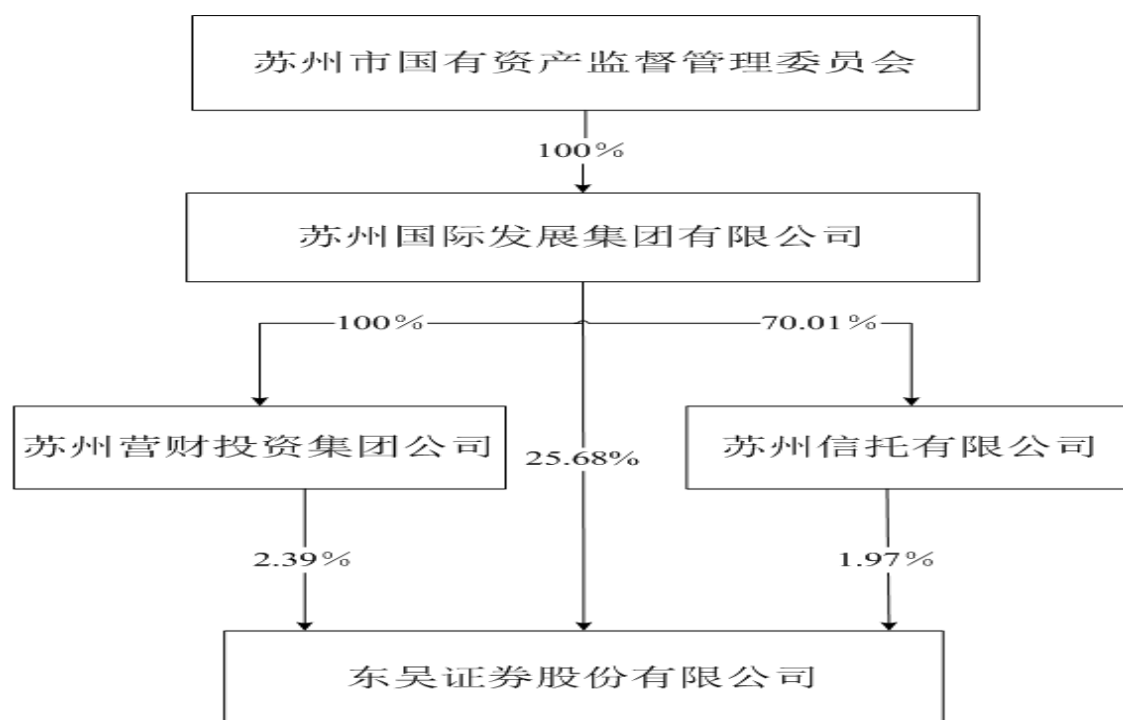


##### (二) 实际控制人情况

###### 1 法人

|    |                |
|----|----------------|
| 名称 | 苏州市国有资产监督管理委员会 |
|----|----------------|

## 2 公司与实际控制人之间的产权及控制关系的方框图



## 五、其他持股在百分之十以上的法人股东

截止本报告期末公司无其他持股在百分之十以上的法人股东。

## 六、股份限制减持情况说明

适用 不适用

## 第七节 优先股相关情况

适用 不适用

## 第八节 董事、监事、高级管理人员和员工情况

### 一、持股变动情况及报酬情况

#### (一) 现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动及报酬情况

√适用□不适用

单位：股

| 姓名  | 职务(注)     | 性别 | 年龄 | 任期起始日期     | 任期终止日期     | 年初持股数 | 年末持股数 | 年度内股份增减变动量 | 增减变动原因 | 报告期内从公司获得的税前报酬总额(万元) | 是否在公司关联方获取报酬 |
|-----|-----------|----|----|------------|------------|-------|-------|------------|--------|----------------------|--------------|
| 范力  | 董事长       | 男  | 49 | 2014-01-18 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 97.20                | 否            |
|     | 总裁        |    |    | 2012-03-13 |            |       |       |            |        |                      |              |
| 朱剑  | 董事        | 男  | 52 | 2015-09-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 宋子洲 | 董事        | 男  | 55 | 2014-11-18 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 钱晓红 | 董事        | 女  | 46 | 2010-05-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 朱建根 | 董事        | 男  | 52 | 2015-09-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 张统  | 董事        | 男  | 44 | 2013-05-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 马震亚 | 职工董事      | 男  | 49 | 2011-03-01 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 131.70               | 否            |
|     | 副总裁       |    |    | 2008-06-16 |            |       |       |            |        |                      |              |
|     | 财务负责人     |    |    | 2010-05-08 |            |       |       |            |        |                      |              |
| 金德环 | 独立董事      | 男  | 62 | 2014-4-16  | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 12                   | 否            |
| 杨瑞龙 | 独立董事      | 男  | 58 | 2011-10-08 | 2015-12-25 | 0     | 0     | 0          | -      | 12                   | 否            |
| 韩晓梅 | 独立董事      | 女  | 40 | 2011-10-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 12                   | 否            |
| 黄祖严 | 独立董事      | 男  | 71 | 2011-10-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 12                   | 否            |
| 徐旭珠 | 董事(离任)    | 女  | 56 | 2008-08-22 | 2015-07-31 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 方敏  | 监事会主席     | 女  | 52 | 2016-01-15 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 否            |
|     | 职工监事      |    |    | 2016-01-12 |            |       |       |            |        |                      |              |
| 林峰  | 监事会主席(离任) | 男  | 57 | 2014-11-14 | 2016-01-12 | 0     | 0     | 0          | -      | 100.40               | 否            |
| 袁维静 | 董事(离任)    | 女  | 52 | 2005-11-06 | 2015-09-08 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
|     | 监事        |    |    | 2015-09-08 | 2016-05-07 |       |       |            |        |                      |              |
| 唐烨  | 监事        | 男  | 51 | 2010-05-08 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |
| 陆春喜 | 监事        | 男  | 53 | 2004-03-25 | 2016-05-07 | 0     | 0     | 0          | -      | 0                    | 是            |

|     |  |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |
|-----|--|---|----|------------|------------|---|---|---|---|----------|---|
| 马晓  | 监事   | 男 | 49 | 2013-05-08 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 0        | 是 |
| 杭五一 | 职工监事   | 女 | 53 | 2008-08-22 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 165.20   | 否 |
| 朱立教 | 监事(离任)   | 女 | 55 | 2008-07-26 | 2015-07-31 | 0 | 0 | 0 | - | 0        | 是 |
| 任少华 | 副总裁  | 男 | 50 | 2016-01-15 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 0        | 否 |
| 李齐兵 | 副总裁  | 男 | 49 | 2011-05-18 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 131.40   | 否 |
| 孙中心 | 副总裁  | 男 | 46 | 2012-05-17 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 112.90   | 否 |
| 魏纯  | 副总裁  | 女 | 36 | 2012-05-14 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 111.14   | 否 |
|     | 董事会秘书  |   |    | 2008-06-25 |            |   |   |   |   |          |   |
| 刘辉  | 副总裁(离任)  | 男 | 45 | 2012-12-26 | 2016-01-15 | 0 | 0 | 0 | - | 111.70   | 否 |
| 张剑宏 | 合规总监(离任)   | 男 | 50 | 2013-11-26 | 2016-02-13 | 0 | 0 | 0 | - | 101.44   | 否 |
|     | 首席风险官  |   |    | 2016-01-15 | 2016-05-07 |   |   |   |   |          |   |
| 朱卫国 | 合规总监   | 男 | 53 | 2016-02-14 | 2016-05-07 | 0 | 0 | 0 | - | 0        | 否 |
| 合计  | /  | / | /  | /          | /          | 0 | 0 | 0 | / | 1,111.08 | / |
| 姓名  | 主要工作经历   |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |
| 范力  | 范力先生，中国国籍，1966年12月出生；硕士，高级经济师。现任公司党委书记、董事长、总裁、苏州国际发展集团有限公司副董事长、江苏省第十二届人民代表大会代表。1989年7月至1997年11月在共青团苏州市委员会历任常委、办公室主任兼事业部部长。1997年11月至2002年4月在苏州证券历任投资部副经理、办公室主任、人事部经理、总裁助理；2002年4月至2012年3月在东吴证券历任董事会秘书、经纪分公司总经理、副总裁、董事、常务副总裁；2012年3月至2013年5月在东吴证券任总裁、董事；2013年5月至2014年1月在东吴证券任总裁、副董事长。2014年1月至今任公司党委书记、董事长、总裁。  |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |
| 朱剑  | 朱剑先生，中国国籍，1963年12月出生，本科。现任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事，苏州国发置业发展有限公司董事长，苏州企业征信服务有限公司董事长，公司董事。1982年6月至1996年8月历任苏州市财政局办事员、科员、副科长、科长；1996年9月至2002年2月任苏州丝绸集团公司总会计师；2002年3月至2008年6月任苏州工业投资有限公司总会计师；2008年7月至今任苏州国际发展集团有限公司党委委员、董事。   |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |
| 宋子洲 | 宋子洲先生，中国国籍，1960年1月出生；大学学历，学士学位。现任中国人寿资产管理有限公司副总裁，国寿财富管理有限公司董事，公司董事。1984年8月参加工作，曾在对外经济贸易合作部办公厅、中国对外贸易运输(集团)总公司工作，1999年11月起历任中国人寿保险公司稽核部制度处处长、资金运用部财会监督处处长、资金运用中心副总经理，2004年8月至2007年8月任中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总监，2007年8月至2013年3月任中国人寿资产管理有限公司首席风险管理执行官，2013年3月至今任中国人寿资产管理有限公司副总裁。  |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |
| 钱晓红 | 钱晓红女士，中国国籍，1969年3月出生；硕士，高级会计师、正高级经济师。现任园区国控董事长、总裁，园区发展董事长，元禾控股董事长，中新苏州工业园区市市政公用发展集团有限公司副董事长，苏州物流中心有限公司董事，苏州纳米科技发展有限公司董事，苏州广融实业有限公司董事，苏州三星电子液晶显示科技有限公司副董事长，苏州银行董事，苏州财融产业投资有限公司董事长，苏州文化博览中心有限公司董事，江苏省苏州宿迁工业园区开发有限公司董事长，公司董事。1991年7月至1999年9月在苏州大学财经学院任会计系教师。1999年10月至2001年3月在苏州工业园区国有资产经营公司任财务科员。2001年4月至2002年10月在苏州工业园区经济发展有限公司任财务部总经理助理。2002年10月至2004年7月在苏州工业园区金鸡湖大酒店有限公司任财务经理。2004年8月至2005年2月在苏州工业园区教育发展有限公司任财务总监。2005年3月至2006年5月在园区国控任审计部总经理。2006年6月至2014年3月任园区国控副总裁。2014年4月起任园区国控董事长、总裁，2009年9月起兼任园区发展董事长。 |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |
| 朱建根 | 朱建根先生，中国国籍，1963年6月出生，本科。现任苏州市营财投资集团公司总经理，苏州国发创业投资控股有限公司董事，苏州市国润发小额贷款股份有限公司董事，苏州企业征信服务有限公司董事，苏州市基础设施投资管理有限公司董事，紫金财产保险股份有限公司董事，苏州市信用再担保有限公司监事长，苏州工业园区股份有限公司监事，公司董事。1983年8月至1993年8月任职于苏州市总工会财务科；1993年9月至1996年10月任苏州市财政局所属江苏省  |   |    |            |            |   |   |   |   |          |   |



|     |   |
|-----|---|
|     | 高新技术风险投资公司苏州分公司总经理助理；1996年11月至今历任苏州市营财投资集团公司投资部职员、投资部经理、公司副总经理、总经理。   |
| 张 统 | 张统先生，中国国籍，1971年4月出生；本科，注册会计师。现任苏州国际发展集团有限公司监事、资产管理部经理，江苏东吴保险经纪有限公司董事，公司董事。1993年8月至2000年3月在苏州丝绸印花厂任生产计划科科长、染整车间副主任、成品车间主任；2000年4月至2006年4月在江苏公证会计师事务所任审计、评估师、项目经理、高级经理；2006年4月起历任苏州国际发展集团有限公司资产管理部副经理、经理。   |
| 马震亚 | 马震亚先生，中国国籍，1966年10月出生；硕士，会计师；高级经济师。现任公司董事、副总裁、财务负责人。1988年10月至2000年2月在苏州市审计局任科员、副主任科员。2000年3月至2002年4月在苏州证券历任财务部副总经理（主持工作）、总经理；2002年4月至2010年5月在东吴证券有限责任公司历任财务部总经理、财务总监、副总裁、财务负责人；2010年5月至今历任公司财务负责人、副总裁、董事。2015年5月至今担任中证信用增进股份有限公司监事。   |
| 金德环 | 金德环先生，中国国籍，1953年4月出生；硕士、教授；现任上海财经大学金融学院教授，兼任兴证期货有限公司、海证期货有限公司、光大保德信基金管理有限公司、吴江东方丝绸市场股份有限公司独立董事，公司独立董事。曾任上海财经大学财政系副主任、证券期货学院副院长、金融学院副院长。   |
| 杨瑞龙 | 杨瑞龙先生，中国国籍，1957年5月出生；经济学博士，教授。1982年8月至1984年8月在江苏省委党校经济学教研室任教。1990年至今在中国人民大学经济学院从事经济学、公司治理、制度经济学等方面的教学与研究。兼任北京市经济学总会常务副会长，公司独立董事。  |
| 韩晓梅 | 韩晓梅女士，中国国籍，1975年6月出生；管理学博士，教授。现任南京理工大学经济管理学院教授、博士生导师，江苏省广电有线信息网络股份有限公司独立董事，公司独立董事。1994年8月至2005年4月在南京审计学院审计系任教。2005年4月至今在南京理工大学经济管理学院任教。   |
| 黄祖严 | 黄祖严先生，中国国籍，1944年10月出生；本科，高级审计师。现任公司独立董事。1969年12月至1981年6月历任浙江省新昌丝厂基建会计、主办会计、财务科长，1981年7月至1983年12月历任江苏沙洲县财政局办事员、副股长，1984年1月至2004年12月历任江苏省张家港市审计局股长、科长、副局长。2005年1月至2012年1月任苏州海陆重工股份有限公司内部审计人员。   |
| 方 敏 | 方敏 女士 中国国籍，1963年4月出生，大学本科学历、硕士学位。历任昆山市木材建材公司财务科会计；昆山市财政局人事秘书科科长；昆山市信托投资公司副总经理；东吴证券昆山前进中路证券营业部总经理、太仓城厢证券营业部总经理、昆山总部总监、昆山分公司总经理、东吴证券总裁助理兼昆山分公司总经理。现任公司监事会主席。  |
| 袁维静 | 袁维静女士，中国国籍，1963年7月出生；本科，高级会计师。现任国发集团董事、党委委员、总会计师，苏州信托董事长、江苏银行监事、苏州国发中小企业担保投资有限公司董事、苏州国发创业投资控股有限公司董事，公司监事。1981年10月至1994年3月在苏州市财政局任工交企财处科员。1994年3月至1996年11月在苏州财政局所属江苏省高新技术风险投资公司苏州分公司任副总经理；1996年11月至1997年3月在苏州市财政局所属苏州市营财发展集团总公司任副总经理。1997年3月至2002年3月在苏州市工业发展有限公司任副总经理。2002年3月至2004年6月在营财投资任副总经理、总经理、党支部书记。2004年7月起在国发集团历任副总会计师、总会计师、董事、党委委员。2014年9月起兼任苏州信托有限公司董事长。 |
| 唐 烨 | 唐烨先生，中国国籍，1964年6月出生；本科。现任昆山市创业控股有限公司总裁，昆山市国科创业投资公司董事长，昆山市创业投资有限公司董事长，公司监事。1984年至1992年在昆山市变压器配件厂任技术员、副厂长。1992年至1994年在昆山市乡镇工业局任办公室秘书。1994年至2000年在昆山市信托投资公司任业务部经理。2000年起至今任昆山创业任副总裁、总裁。  |
| 陆春喜 | 陆春喜先生，中国国籍，1962年1月出生；大专，会计师、高级经济师。现任隆力奇集团副总裁，隆力奇生物副总裁兼金融投资部总经理，公司监事。1980年11月至1983年8月任解放军某部五团一连文书，1986年7月至1995年3月在西山矿务局工程三处、财务处任主管。1995年4月至1996年9月在上海抽纺公司一厂任财务经理。1996年10月至今在隆力奇集团历任财务经理、财务总监、副总裁，其中，1996年10月至1997年11月任苏州东方蛇园有限公司财务经理，1997年12月至2002年12月任苏州东方蛇园有限公司副总裁兼财务总监，2003年1月至2005年4月，任隆力奇生物任副总裁兼财务总监，2005年5月至今任隆力奇生物副总裁兼金融投资部总经理。                             |
| 马 晓 | 马晓先生，中国国籍，1966年12月出生；大专。现任国发集团财务部经理，公司监事。1986年7月至1994年12月任苏州光明纺织厂统计、会计；1994年12月至1999年8月任苏盘投资咨询公司会计；1999年8月至今在苏州国际发展集团有限公司任财务部会计、财务部副经理、财务部经理。   |
| 杭五一 | 杭五一女士，中国国籍，1962年4月出生；本科，高级经济师。现任本公司工会副主席、职工监事。1979年12月至1991年1月在苏州刺绣研究所任所长室秘   |

|     |  |
|-----|--|
|     | 书。1991年1月至1997年12月在苏州市工艺局组织处任科员、副处长。1998年1月至2002年3月在苏州市商业银行人事教育处任副处长、处长。2002年4月至2010年5月在东吴证券有限责任公司任党委办公室主任、人力资源部副总经理、工会副主席、职工监事。2010年5月至2015年6月任任公司党委办公室主任、工会副主席、职工监事。2015年6月至今任公司工会副主席、职工监事。  |
| 任少华 | 任少华 先生 中国国籍 1965年4月出生；博士。历任苏州市人民检察院助理检察员；苏州中辰期货经纪有限公司总经理助理；苏州证券投资部总经理、资产管理部总经理、副总经济师；东吴证券有限责任公司副总经济师、资产管理总部总经理、总裁助理、总经济师、副总裁；东吴证券股份有限公司副总裁、兼任东吴期货有限公司董事长、东吴创新资本管理有限公司董事长、总经理；东吴基金管理有限公司总裁。现任东吴证券股份有限公司副总裁。   |
| 李齐兵 | 李齐兵先生，中国国籍，1966年9月出生；大学，硕士，会计师、审计师、注册会计师（非执业会员）。现任本公司副总裁。1988年8月至2000年10月在南京市审计局历任科员、副主任科员、主任科员。2000年10月至2002年9月在中国证监会南京特派员办事处稽查处任主任科员。2002年9月至2010年5月在江苏证监局机构监管处历任副处长、处长。2010年6月至2011年5月在国发集团任副总经理。2011年5月至2013年6月任公司副总裁。2013年7月至11月任公司副总裁、合规总监；2013年11月至今任公司副总裁。 |
| 孙中心 | 孙中心 先生，中国国籍，1969年5月出生；硕士。现任本公司副总裁。1990年8月至1994年11月在上海铁路分局苏州电务段工作；1994年11月至2002年4月历任苏州证券狮山路营业部电脑部经理、总经理助理、网上交易部总经理；2002年4月至2010年5月历任东吴证券有限责任公司网上交易部总经理、经纪分公司（筹）副总经理、狮山路证券营业部总经理、总裁助理兼苏州新区总部总经理、总裁助理兼苏州分公司总经理；2010年5月至2012年5月任总裁助理兼苏州分公司总经理；2012年5月至今任公司副总裁。         |
| 魏 纯 | 魏纯 女士 中国国籍，1979年1月出生；硕士。现任本公司副总裁、董事会秘书。2001年7月至2002年4月任苏州证券研究员，2002年4月至2010年5月在东吴证券有限责任公司历任研究员、办公室秘书、办公室副主任、董事会办公室主任、总裁办公室主任、董事会秘书。2010年5月至2012年5月在东吴证券股份有限公司任董事会秘书、董事会办公室主任、总裁办公室主任。2012年5月至今在公司任董事会秘书、副总裁。   |
| 张剑宏 | 张剑宏 先生，中国国籍 1965年3月出生；硕士。1988年毕业于中国社会科学院研究生院；历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险合规总部总经理、合规总监兼首席风险官。现任东吴证券股份有限公司首席风险官。  |
| 朱卫国 | 朱卫国 先生 中国国籍 1962年12月出生；硕士。本科毕业于复旦大学哲学系，EMBA毕业于西安交通大学。曾任上海市政府智力开发研究所研究人员；苏州铁道师范学院教师；东吴证券营业部总经理、研究所所长、总裁助理兼经纪业务事业部总经理、东吴期货董事长等职务。现任东吴证券合规总监。   |

#### 其它情况说明

- 注： 1、2015年12月25日，杨瑞龙先生辞去独立董事职务，在公司股东大会选举产生新的独立董事前，杨瑞龙先生仍将履行独立董事职责。
- 2、任少华先生、方敏女士、朱卫国先生报告期后担任公司高管、监事，报告期内未以高管、监事身份在公司领取薪酬。
- 3、2016年1月15日，张剑宏先生辞去公司合规总监职务。
- 4、公司董事长、监事会主席、高级管理人员及职工监事薪酬总额仍在确认过程中，其余部分待确认发放后再另行披露。
- 5、根据《证券公司治理准则》，公司对相关人员的绩效实行延期支付。
- 6、公司董事、监事及高级管理人员不存在非现金薪酬的情况。

#### (二) 董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

## 二、现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员的任职情况

### (一) 在股东单位任职情况

√适用□不适用

| 任职人员姓名 | 股东单位名称             | 在股东单位担任的职务   |
|--------|--------------------|--------------|
| 范力     | 苏州国际发展集团有限公司       | 副董事长         |
| 朱剑     | 苏州国际发展集团有限公司       | 党委委员、董事      |
| 钱晓红    | 苏州工业园区经济发展有限公司     | 董事长          |
|        | 苏州工业园区国有资产控股发展有限公司 | 董事长、总裁       |
|        | 苏州元禾控股股份有限公司       | 董事长          |
| 朱建根    | 苏州市营财投资集团公司        | 总经理          |
| 张统     | 苏州国际发展集团有限公司       | 资产管理部经理      |
| 袁维静    | 苏州国际发展集团有限公司       | 董事、党委委员、总会计师 |
|        | 苏州信托有限公司           | 董事长          |
| 唐焯     | 昆山市创业控股有限公司        | 总裁           |
| 陆春喜    | 江苏隆力奇集团有限公司        | 副总裁          |
| 马晓     | 苏州国际发展集团有限公司       | 计划财务部经理      |

### (二) 在其他单位任职情况

√适用□不适用

| 任职人员姓名 | 其他单位名称               | 在其他单位担任的职务 |
|--------|----------------------|------------|
| 范力     | 东吴基金管理有限公司           | 董事长        |
|        | 东吴证券中新（新加坡）有限公司      | 董事长        |
| 朱剑     | 苏州国发置业发展有限公司         | 董事长        |
|        | 苏州企业征信服务有限公司         | 董事长        |
| 宋子洲    | 中国人寿资产管理有限公司         | 副总裁        |
|        | 国寿财富管理有限公司           | 董事         |
| 钱晓红    | 中新苏州工业园区市政公用发展集团有限公司 | 副董事长       |
|        | 苏州物流中心有限公司           | 董事         |
|        | 苏州纳米科技发展有限公司         | 董事         |
|        | 苏州广融实业有限公司           | 董事         |

|     |                    |              |
|-----|--------------------|--------------|
|     | 苏州三星电子液晶显示科技有限公司   | 副董事长         |
|     | 苏州财融产业投资有限公司       | 董事长          |
|     | 苏州文化博览中心有限公司       | 董事           |
|     | 江苏省苏州宿迁工业园区开发有限公司  | 董事长          |
|     | 苏州银行股份有限公司         | 董事           |
| 朱建根 | 苏州国发创业投资控股有限公司     | 董事           |
|     | 苏州市国润发小额贷款股份有限公司   | 董事           |
|     | 苏州企业征信服务有限公司       | 董事           |
|     | 苏州市基础设施投资管理有限公司    | 董事           |
|     | 苏州市信用再担保有限公司       | 监事长          |
|     | 苏州工业园区股份有限公司       | 监事           |
|     | 紫金财产保险股份有限公司       | 董事           |
| 张 统 | 江苏东吴保险经纪有限公司       | 董事           |
| 马震亚 | 东吴创业投资有限公司         | 董事长          |
|     | 中证信用增进股份有限公司       | 监事           |
| 杨瑞龙 | 中国人民大学经济学院         | 教授           |
| 金德环 | 上海财经大学金融学院         | 教授           |
|     | 上海交大昂立股份有限公司       | 独立董事         |
|     | 江苏吴江中国东方丝绸市场股份有限公司 | 独立董事         |
|     | 光大保德信基金管理公司        | 独立董事         |
|     | 兴证期货有限公司           | 独立董事         |
|     | 海证期货有限公司           | 独立董事         |
| 韩晓梅 | 南京理工大学经济管理学院       | 教授           |
|     | 江苏省广电有线信息网络股份有限公司  | 独立董事         |
| 袁维静 | 江苏银行股份有限公司         | 监事           |
|     | 苏州国发中小企业担保投资有限公司   | 董事           |
|     | 苏州国发创业投资控股有限公司     | 董事           |
| 唐 焯 | 昆山市国科创业投资公司        | 董事长          |
| 陆春喜 | 江苏隆力奇生物科技股份有限公司    | 副总裁兼金融投资部总经理 |
| 李齐兵 | 东吴创新资本管理有限责任公司     | 董事长          |

|     |                |    |
|-----|----------------|----|
| 张剑宏 | 东吴创业投资有限公司     | 监事 |
| 朱卫国 | 苏州股权交易中心有限公司   | 董事 |
|     | 苏州金融资产交易中心有限公司 | 董事 |

### 三、董事、监事、高级管理人员报酬情况

|                             |  |
|-----------------------------|--|
| 董事、监事、高级管理人员报酬的决策程序         | 公司董事、监事的报酬由董事会、监事会审议通过后，报股东大会审议决定。公司高级管理人员报酬由薪酬、考核和提名委员会审议后，再提交公司董事会审议决定。  |
| 董事、监事、高级管理人员报酬确定依据          | 公司外部董事、监事不在公司领取报酬，公司独立董事报酬在参考同行业上市公司的平均水平后确定；公司内部董事、监事和高级管理人员的报酬由公司薪酬考核体系决定。   |
| 董事、监事和高级管理人员报酬的实际支付情况       | 公司外部董事、监事不在公司领取除津贴以外的其他薪酬。公司高级管理人员薪酬由基本工资和年度奖金构成，基本工资按月发放，年度奖金根据公司经营目标完成情况提取，结合高级管理人员绩效考核情况进行分配发放。2015 年度高级管理人员基本工资均已按月全额发放，年度奖金按照相关规定分配并预留，预留部分奖金分三年递延发放。 |
| 报告期末全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计 | 报告期内，全体董事、监事和高级管理人员实际获得的报酬合计 1111.08 万元。   |

### 四、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

| 姓名  | 担任的职务 | 变动情形 | 变动原因   |
|-----|-------|------|--|
| 袁维静 | 董事    | 离任   | 2015 年 7 月 31 日，袁维静女士因工作原因，辞去第二届董事会董事职务。       |
| 徐旭珠 | 董事    | 离任   | 2015 年 7 月 31 日，徐旭珠女士因工作原因，辞去第二届董事会董事职务。       |
| 朱剑  | 董事    | 聘任   | 2015 年 9 月 8 日，公司 2015 年第三次临时股东大会选举朱剑先生为公司董事。  |
| 朱建根 | 董事    | 聘任   | 2015 年 9 月 8 日，公司 2015 年第三次临时股东大会选举朱建根先生为公司董事。 |
| 朱立教 | 监事    | 离任   | 2015 年 7 月 31 日，朱立教女士因工作原因，辞去第二届监事会监事职务。       |
| 袁维静 | 监事    | 聘任   | 2015 年 9 月 8 日，公司 2015 年第三次临时股东大会选举袁维静女士为公司监事。 |

### 五、近三年受证券监管机构处罚的情况说明

适用 不适用

## 六、母公司和主要子公司的员工情况

### (一) 员工情况

|                        |        |
|------------------------|--------|
| 母公司在职员工的数量             | 1,947  |
| 主要子公司在职员工的数量           | 389    |
| 在职员工的数量合计              | 2,336  |
| 母公司及主要子公司需承担费用的离退休职工人数 | 4      |
| 专业构成                   |        |
| 专业构成类别                 | 专业构成人数 |
| 经纪业务人员                 | 1,250  |
| 投行人员                   | 324    |
| 投资人员                   | 49     |
| 资产管理业务人员               | 111    |
| 财务人员                   | 115    |
| 研究人员                   | 73     |
| 风险合规及稽核人员              | 44     |
| 信息技术人员                 | 156    |
| 其他管理及行政人员              | 214    |
| 合计                     | 2,336  |
| 教育程度                   |        |
| 教育程度类别                 | 数量(人)  |
| 博士                     | 26     |
| 硕士                     | 590    |
| 本科                     | 1,339  |
| 大专及以下                  | 381    |
| 合计                     | 2,336  |

### (二) 薪酬政策

公司以符合行业运营、服务于公司战略发展要求、以调动全体员工的积极性和创造性，推进公司的持续、快速发展，实现公司价值与员工个人价值发展的一体化为目标、以按岗付薪、按能力付薪、按绩效付薪的理念制定了公司整体薪酬政策。

公司员工的薪酬由基本工资、绩效工资、社保福利构成，基本工资以公司岗位工资体系为基础，并依据员工所任职岗位的职责、重要性、市场水平等因素综合确定，绩效工资总额与公司当年度各业务的经营业绩挂钩，并按董事会审议批准的比例提取，员工的绩效工资是依据其工作业绩并经过考核后确定。

公司和员工按照国家法律法规的规定缴纳各项法定社会保险及公积金，并按属地化原则进行管理。

### (三) 培训计划

2015 年公司举行各类培训共计 80 场次，参加培训人员 1800 人次，共计 74000 课时，人均培训达 40 课时。结合公司全面转型创新发展战略，突出教育培训的全面化、多样化、网络化，对公

司员工开展大规模、全方位、多途径的教育培训工作，开展了公司新员工培训、员工后续教育、员工应知应会学习、员工业务技能和管理技能培训以及协会组织的各类培训。

2016 年将继续基于微信的“东吴秀财学苑”，开发微课程、开展微培训，为员工提供了更优异的培训体验。重点以后备干部培训、管理技能培训、业务技能培训等培训内容为主，同时依托证券业协会，组织员工参加外部培训，借鉴先进经验，开阔视野、增长见识，确保培训内容的丰富、多样，满足员工开展各项业务所需要的知识与技能，提高员工的整体素质，为公司快速发展及战略目标的实现提供强有力的人才保障。

#### (四) 劳务外包情况

|             |            |
|-------------|------------|
| 劳务外包的工时总数   | 132,066 小时 |
| 劳务外包支付的报酬总额 | 721.77 万元  |

#### 七、经纪人情况

截止 2015 年 12 月底，公司下属共 52 家营业部取得了证券经纪人制度的实施资格，证券经纪人总数达到 902 人。

公司严格按照证监会《证券经纪人暂行管理规定》以及公司制定的十三项管理办法和细则对证券经纪人实施分级管理模式，即公司总部对人员录用、执业资格申请、证书申请、信息登记、经纪关系添加、绩效计算、后续培训以及风险监控等进行集中统一管理。而分公司与营业部则在公司授权的范围内，通过设立管理、风控、回访、投诉等专岗，负责具体的人员招聘、提成设置、培训考核、风险监控等管理事项。

2015 年公司证券经纪人制度运行平稳，整体状况良好，公司总部未接到任何涉及有关证券经纪人的投诉。

## 第九节 公司治理

### 一、公司治理相关情况说明

公司历来重视各个层面的规范治理工作，根据《公司法》、《证券法》、《证券公司治理准则》、《上市公司治理准则》等法律、法规和规范性文件的规定，不断加强和完善公司治理。本公司建立了由股东大会、董事会、监事会和经营管理层组成的公司治理架构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范的相互协调和相互制衡机制，均衡有效的公司治理结构确保了公司的规范运作。

#### (一) 股东和股东大会

股东大会是公司的最高权力机构，公司依据《公司章程》、《公司治理准则》及相关法律法规制订了《股东大会议事规则》，确保了股东大会的召集、提案与通知、召开等程序合法合规，

确保公司股东大会的规范运作。公司股东能够按照法律、法规及《公司章程》的规定行使权利，未超越股东大会干预公司的经营管理活动，在人员、资产、财务、机构和业务方面与公司明确分离。报告期内，公司严格按照相关规定召集、召开股东大会，确保包括中小股东在内的全体股东能够充分行使自己的权利，享受公司章程规定的合法权益。

## （二）董事与董事会

董事会是公司的常设决策机构，向股东大会负责并报告工作。公司严格依据《公司章程》及相关法律法规的规定制订了《董事会议事规则》，对董事会会议东吴证券股份有限公司公开发行公司债券募集说明书的提案、召集、召开、董事出席、审议程序、表决、决议的执行等均进行了明确、详细的规定，确保董事会的规范运作。

公司董事会下设四个专门委员会，包括：战略委员会、风险控制委员会、审计委员会及薪酬、考核与提名委员会。各委员会分工明确，权责分明，有效运作，对董事会决策功能的强化、确保董事会对管理层的有效监督、完善公司治理结构起到了重要的作用。

公司董事会现由 11 名董事组成，人数和构成符合法律法规的要求，其中股东单位董事6名、职工董事1名、独立董事4名，所有董事均具有担任证券公司和上市公司董事的任职资格。公司董事尽职尽责，认真履行董事的职责，对董事会的各项议案充分审议和表决，维护了公司和全体股东的权益。

## （三）监事与监事会

公司设监事会，为公司经营活动的监督机构，对公司董事、高级管理人员及公司财务进行监督和检查，对股东大会负责。公司监事会会议的召集、召开、议事方式和表决程序严格按照《监事会议事规则》执行，确保监事会运作规范。公司监事会现由6名监事组成，其中职工监事2名，通过职工代表大会选举产生，股东代表监事4名。公司各监事均具有担任证券公司和上市公司监事的任职资格，在职期间，勤勉尽责，维护了公司和全体股东的权益。

## （四）经营管理层

公司经营管理层负责公司日常经营工作。公司经营管理层人员由董事会聘任，对董事会负责。公司制定了《总经理工作细则》，明确规定了公司管理层的职责和权力。截止报告期末，公司有高级管理人员7名，包括总裁1名，副总裁5名，其中一名副总裁兼任财务负责人、一名副总裁兼任董事会秘书，合规总监兼首席风险官1名。公司各高级管理人员均具有担任上市公司和证券公司高级管理人员的任职资格。公司经营管理层严格执行董事会制定的经营方针，诚信、谨慎、勤勉地行使职权，努力实现公司效益和社会效益的最大化。经营管理层设三级决策架构，即领导决策层、业务决策层、执行决策层。领导决策层由领导办公会、资产负债管理委员会、风险管理委员会构成。业务决策层设六个委员会，其中，经纪业务决策委员会是公司经纪业务的最高决策机构；投



资银行业务决策委员会是公司投行业务的最高决策机构；投资决策委员会是公司投资业务的最高决策机构；客户资产管理决策委员会是公司资产管理业务的最高决策机构；信用交易决策委员会构成是公司融资融券和股票质押回购等业务的最高决策机构；网络金融业务决策会是公司互联网金融业务的最高决策机构。执行决策层下设若干个委员会。

公司治理与中国证监会相关规定的要求是否存在重大差异；如有重大差异，应当说明原因

公司治理结构完善，与《公司法》和中国证监会相关规定的要求不存在差异。

## 二、股东大会情况简介

| 会议届次            | 召开日期      | 会议议题  | 决议情况 | 决议刊登的指定网站的查询索引 | 决议刊登的披露日期 |
|-----------------|-----------|---|------|----------------|-----------|
| 2015 年第一次临时股东大会 | 2015-1-7  | 关于公司发行次级债券的议案                                 | 通过   | 上海证券交易所网站      | 2015-1-8  |
| 2014 年年度股东大会    | 2015-5-15 | 1、关于 2014 年度董事会工作报告的议案                        | 通过   | 上海证券交易所网站      | 2015-5-16 |
|                 |           | 2、关于 2014 年度监事会工作报告的议案                        |      |                |           |
|                 |           | 3、关于 2014 年年度报告及其摘要的议案                        |      |                |           |
|                 |           | 4、关于 2014 年度财务决算报告的议案                         |      |                |           |
|                 |           | 5、关于 2014 年度利润分配方案的议案                         |      |                |           |
|                 |           | 6、关于确认 2014 年日常关联交易及预计 2015 年日常关联交易的议案        |      |                |           |
|                 |           | 7、关于公司董事 2014 年度报酬总额的议案                       |      |                |           |
|                 |           | 8、关于公司监事 2014 年度报酬总额的议案                       |      |                |           |
|                 |           | 9、关于 2015 年度自营投资额度的议案                         |      |                |           |
|                 |           | 10、关于办理期权业务所需手续的议案                            |      |                |           |
|                 |           | 11、2014 年度独立董事述职报告(非审议事项)                     |      |                |           |
| 2015 年第二次临时股东大会 | 2015-7-13 | 1、关于公司符合非公开发行股票条件的议案                          | 通过   | 上海证券交易所网站      | 2015-7-14 |
|                 |           | 2、关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案                        |      |                |           |
|                 |           | 3、关于公司非公开发行 A 股股票预案的议案                        |      |                |           |
|                 |           | 4、关于公司非公开发行 A 股股票募集资金使用的可行性报告的议案              |      |                |           |
|                 |           | 5、关于公司前次募集资金使用情况报告的议案                         |      |                |           |
|                 |           | 6、关于提请股东大会授权董事会及董事会转授权经营层全权办理本次非公开发行股票具体事宜的议案 |      |                |           |
|                 |           | 7、关于公司非公开发行股票后填补被摊薄即期回报措施的议案                  |      |                |           |
|                 |           | 8、关于设立研究所子公司的议案                               |      |                |           |
|                 |           | 9、关于再次就公司发行短期融资券进行授权的议案                       |      |                |           |
| 2015 年第三次临时股东大会 | 2015-9-8  | 1、关于公司聘请会计师事务所的议案                             | 通过   | 上海证券交易所网站      | 2015-9-9  |
|                 |           | 2、关于公司发行次级债券的议案                               |      |                |           |
|                 |           | 3、关于东吴证券股份有限公司未来三年股东回报规划(2015-2017 年)的议案      |      |                |           |
|                 |           | 4、关于补选第二届监事会监事的议案                             |      |                |           |
|                 |           | 5、关于补选第二届董事会董事的议案                             |      |                |           |
|                 |           | 6、关于公司符合非公开发行股票条件的议案                          |      |                |           |

|                 |            |  |    |           |            |
|-----------------|------------|--|----|-----------|------------|
|                 |            | 7、关于调整公司非公开发行 A 股股票方案的议案                       |    |           |            |
|                 |            | 8、关于调整公司非公开发行 A 股股票预案的议案                       |    |           |            |
|                 |            | 9、关于调整公司非公开发行 A 股股票募集资金使用的可行性报告的议案             |    |           |            |
|                 |            | 10、关于调整公司非公开发行股票后填补被摊薄即期回报措施的议案                |    |           |            |
|                 |            | 11、关于提请股东大会授权董事会及董事会转授权经营层全权办理本次非公开发行股票具体事宜的议案 |    |           |            |
| 2015 年第四次临时股东大会 | 2015-11-16 | 1、关于公司符合非公开发行股票条件的议案                           | 通过 | 上海证券交易所网站 | 2015-11-17 |
|                 |            | 2、关于调整公司非公开发行 A 股股票方案(第二次修订)的议案                |    |           |            |
|                 |            | 3、关于调整公司非公开发行 A 股股票预案(第二次修订)的议案                |    |           |            |
|                 |            | 4、关于调整公司非公开发行 A 股股票募集资金使用的可行性报告(第二次修订)的议案      |    |           |            |
|                 |            | 5、关于调整公司非公开发行股票后填补被摊薄即期回报措施(第二次修订)的议案          |    |           |            |
|                 |            | 6、关于提请股东大会授权董事会及董事会转授权经营层全权办理本次非公开发行股票具体事宜的议案  |    |           |            |
|                 |            | 7、关于设立香港子公司的议案                                 |    |           |            |

### 三、董事履行职责情况

#### (一) 董事参加董事会和股东大会的情况

| 董事姓名 | 是否独立董事 | 参加董事会情况    |        |           |        |      |               | 参加股东大会情况  |
|------|--------|------------|--------|-----------|--------|------|---------------|-----------|
|      |        | 本年应参加董事会次数 | 亲自出席次数 | 以通讯方式参加次数 | 委托出席次数 | 缺席次数 | 是否连续两次未亲自参加会议 | 出席股东大会的次数 |
| 范力   | 否      | 14         | 14     | 2         | 0      | 0    | 否             | 5         |
| 袁维静  | 否      | 7          | 6      | 2         | 1      | 0    | 否             | 3         |
| 朱剑   | 否      | 5          | 5      | 0         | 0      | 0    | 否             | 2         |
| 宋子洲  | 否      | 14         | 14     | 10        | 0      | 0    | 否             | 0         |
| 钱晓红  | 否      | 14         | 13     | 2         | 1      | 0    | 否             | 4         |
| 徐旭珠  | 否      | 7          | 5      | 2         | 2      | 0    | 否             | 2         |
| 朱建根  | 否      | 5          | 5      | 0         | 0      | 0    | 否             | 2         |
| 张统   | 否      | 14         | 12     | 2         | 2      | 0    | 否             | 4         |
| 马震亚  | 否      | 14         | 14     | 2         | 0      | 0    | 否             | 5         |
| 杨瑞龙  | 是      | 14         | 13     | 7         | 1      | 0    | 否             | 4         |
| 金德环  | 是      | 14         | 12     | 7         | 2      | 0    | 否             | 3         |
| 韩晓梅  | 是      | 14         | 13     | 6         | 1      | 0    | 否             | 4         |
| 黄祖严  | 是      | 14         | 14     | 5         | 0      | 0    | 否             | 5         |

连续两次未亲自出席董事会会议的说明

报告期内，未有董事连续两次未亲自参加董事会会议。

|                |    |
|----------------|----|
| 年内召开董事会会议次数    | 14 |
| 其中：现场会议次数      | 3  |
| 通讯方式召开会议次数     | 2  |
| 现场结合通讯方式召开会议次数 | 9  |

## (二) 独立董事对公司有关事项提出异议的情况

报告期内，公司独立董事未对公司本年度的董事会议案及其他非董事会议案事项提出异议。

## (三) 其他

### (一) 董事会会议情况

2015 年度，董事会共召开会议 14 次，审议议案 72 项，全部议案表决通过，具体如下表：

| 会议时间      | 会议名称             | 会议议题                                   |
|-----------|------------------|--|
| 2015-1-22 | 第二届董事会第二十次（临时）会议 | 1、关于开展股票期权业务的议案                        |
|           |                  | 2、关于提高信用交易业务总规模的议案                     |
|           |                  | 3、关于调整内部机构设置的议案                        |
|           |                  | 4、公司 2015 年度经营管理计划（非审议事项）              |
| 2015-4-16 | 第二届董事会第二十一次会议    | 1、关于 2014 年度董事会工作报告的议案                 |
|           |                  | 2、关于 2014 年年度报告及其摘要的议案                 |
|           |                  | 3、关于 2014 年度财务决算报告的议案                  |
|           |                  | 4、关于 2014 年度利润分配预案的议案                  |
|           |                  | 5、关于 2014 年度合规报告的议案                    |
|           |                  | 6、关于 2014 年度内部控制评价报告的议案                |
|           |                  | 7、关于 2014 年度社会责任报告的议案                  |
|           |                  | 8、关于确认 2014 年日常关联交易及预计 2015 年日常关联交易的议案 |
|           |                  | 9、关于公司董事 2014 年度报酬总额的议案                |
|           |                  | 10、关于公司高级管理人员 2014 年度报酬总额的议案           |
|           |                  | 11、关于公司 2014 年度募集资金存放与使用情况专项报告的议案      |
|           |                  | 12、关于 2015 年度自营投资额度的议案                 |
|           |                  | 13、关于公司会计估计变更的议案                       |
|           |                  | 14、关于修订公司风险管理基本制度的议案                   |
|           |                  | 15、关于公司 2015 年度风险偏好体系的议案               |
|           |                  | 16、关于调整委派参股公司董事的议案                     |
|           |                  | 17、关于参与发起设立中证信用增进股份有限公司的议案             |
|           |                  | 18、关于办理期权业务所需手续的议案                     |
|           |                  | 19、2014 年度经营管理工作报告（非表决事项）              |
|           |                  | 20、2014 年度独立董事述职报告（非表决事项）              |
|           |                  | 21、审计委员会 2014 年履职情况报告（非表决事项）           |
|           |                  | 22、2014 年度全面风险管理工作报告（非表决事项）            |
|           |                  | 23、关于召开年度股东大会的议案                       |

|            |                       |   |
|------------|-----------------------|---|
| 2015-4-27  | 第二届董事会第二十二次<br>(临时)会议 | 1、关于 2015 年第一季度报告的议案                          |
| 2015-5-29  | 第二届董事会第二十三次<br>(临时)会议 | 1、关于公司符合非公开发行股票条件的议案                          |
|            |                       | 2、关于公司非公开发行 A 股股票方案的议案                        |
|            |                       | 3、关于公司非公开发行 A 股股票预案的议案                        |
|            |                       | 4、关于公司非公开发行 A 股股票募集资金使用的可行性报告的议案              |
|            |                       | 5、关于公司前次募集资金使用情况报告的议案                         |
|            |                       | 6、关于提请股东大会授权董事会及董事会转授权经营层全权办理本次非公开发行股票具体事宜的议案 |
|            |                       | 7、关于公司非公开发行股票后填补被摊薄即期回报措施的议案                  |
|            |                       | 8、关于设立研究所子公司的议案                               |
|            |                       | 9、关于完善员工绩效薪酬方案的议案                             |
|            |                       | 10、关于设立福建分公司的议案                               |
|            |                       | 11、关于再次就公司发行短期融资券进行授权的议案                      |
|            |                       | 12、关于召开 2015 年第二次临时股东大会的议案                    |
|            |                       | 13、关于向中证信用增进股份有限公司提名监事的报告(非审议事项)              |
| 2015-6-9   | 第二届董事会第二十四次<br>(临时)会议 | 1、关于提高信用交易业务总规模的议案                            |
| 2015-7-6   | 第二届董事会第二十五次<br>(临时)会议 | 1、关于公司参与出资购买蓝筹股 ETF 的议案                       |
| 2015-7-10  | 第二届董事会第二十六次<br>(临时)会议 | 1、关于调整公司自营权益类证券投资额度的议案                        |
| 2015-8-11  | 第二届董事会第二十七次<br>会议     | 1、关于公司聘请会计师事务所的议案                             |
|            |                       | 2、关于公司发行次级债券的议案                               |
|            |                       | 3、关于提名第二届董事会董事候选人的议案                          |
|            |                       | 4、关于东吴证券股份有限公司未来三年股东回报规划(2015-2017 年)的议案      |
|            |                       | 5、关于董事会授权经营管理层相关事项的议案                         |
|            |                       | 6、关于 2015 年半年度报告及其摘要的议案                       |
|            |                       | 7、关于 2015 年上半年度合规报告的议案                        |
|            |                       | 8、听取 2015 年上半年度风险控制指标执行情况报告                   |
| 2015-8-18  | 第二届董事会第二十八次<br>(临时)会议 | 1、关于公司符合非公开发行股票条件的议案                          |
|            |                       | 2、关于调整公司非公开发行 A 股股票方案的议案                      |
|            |                       | 3、关于调整公司非公开发行 A 股股票预案的议案                      |
|            |                       | 4、关于调整公司非公开发行 A 股股票募集资金使用的可行性报告的议案            |
|            |                       | 5、关于调整公司非公开发行股票后填补被摊薄即期回报措施的议案                |
|            |                       | 6、关于提请股东大会授权董事会及董事会转授权经营层全权办理本次非公开发行股票具体事宜的议案 |
| 2015-9-8   | 第二届董事会第二十九次<br>(临时)会议 | 1、关于调整董事会专门委员会组成方案的议案                         |
| 2015-10-22 | 第二届董事会第三十次(临          | 1、关于公司符合非公开发行股票条件的议案                          |

|            |                   |   |
|------------|-------------------|---|
|            | 时)会议              | 2、关于调整公司非公开发行 A 股股票方案（第二次修订）的议案<br>3、关于调整公司非公开发行 A 股股票预案（第二次修订）的议案<br>4、关于调整非公开发行 A 股股票募集资金使用的可行性研究报告（第二次修订）的议案<br>5、关于调整关于非公开发行股票后填补被摊薄即期回报措施（第二次修订）的议案<br>6、关于提请股东大会授权董事会及董事会转授权经营层全权办理本次非公开发行股票具体事宜的议案 |
| 2015-10-28 | 第二届董事会第三十一次（临时）会议 | 1、关于 2015 年第三季度报告的议案<br>2、关于确定公司员工基本薪酬总额的议案<br>3、关于设立香港子公司的议案<br>4、关于召开 2015 年第四次临时股东大会的议案  |
| 2015-11-16 | 第二届董事会第三十二次（临时）会议 | 1、关于向公司控股股东收购苏州市民卡有限公司部分股权暨关联交易的议案  |
| 2015-12-28 | 第二届董事会第三十三次（临时）会议 | 1、关于向东吴创业投资有限公司增资的议案  |

#### （二）监事会情况

2015 年度，监事会共召开会议 4 次，审议议案 12 项，全部议案表决通过，具体如下表：

| 会议时间       | 会议名称             | 会议议题                             |
|------------|------------------|----------------------------------|
| 2015-4-16  | 第二届监事会第九次会议      | 1、关于 2014 年度监事会工作报告的议案           |
|            |                  | 2、关于 2014 年年度报告及其摘要的议案           |
|            |                  | 3、关于 2014 年度利润分配预案的议案            |
|            |                  | 4、关于公司监事 2014 年度报酬总额的议案          |
|            |                  | 5、关于 2014 年度内部控制评价报告的议案          |
|            |                  | 6、关于公司 2014 年度募集资金存放与使用情况专项报告的议案 |
|            |                  | 7、关于公司会计估计变更的议案                  |
|            |                  | 8、2014 年度稽核审计工作报告（非审议事项）         |
| 2015-4-27  | 第二届监事会第十次（临时）会议  | 1、关于 2015 年第一季度报告的议案             |
| 2015-8-11  | 第二届监事会第十一次会议     | 1、关于提名第二届监事会监事候选人的议案             |
|            |                  | 2、关于 2015 年半年度报告及其摘要的议案          |
| 2015-10-28 | 第二届监事会第十二次（临时）会议 | 1、关于 2015 年第三季度报告的议案             |

#### 四、董事会下设专门委员会在报告期内履行职责时所提出的重要意见和建议，存在异议事项的，应当披露具体情况

| 名称          | 成员                           |
|-------------|------------------------------|
| 战略委员会       | 范力（主任）；朱剑；宋子洲；钱晓红；杨瑞龙、金德环。   |
| 风险控制委员会     | 金德环（主任）；韩晓梅；黄祖严；张统；马震亚。      |
| 审计委员会       | 韩晓梅（主任）；杨瑞龙、黄祖严；朱建根；钱晓红；马震亚。 |
| 薪酬、考核与提名委员会 | 杨瑞龙（主任）；金德环；韩晓梅；朱剑；马震亚。      |

报告期内，公司董事会战略委员会共召开会议 1 次，薪酬、考核与提名委员会召开会议 4 次，审计委员会召开会议 6 次，风险控制委员会召开会议 2 次。公司董事会专业委员会根据公司章程、公司董事会议事规则及各委员会工作细则的规定，分别对公司战略、高管提名、薪酬考核、财务审计、内控审计、风险控制等提出了建议，为公司规范运作发挥了重要作用。

## 五、监事会发现公司存在风险的说明

报告期内，公司监事会严格按照有关法律法规及公司《章程》的规定，对公司相关事项进行了检查监督，监事会对报告期内的监督事项无异议。

## 六、公司就其与控股股东在业务、人员、资产、机构、财务等方面存在的不能保证独立性、不能保持自主经营能力的情况说明

报告期内，公司与控股股东在业务、人员、资产、机构、财务等方面均能够保持独立性，不存在影响公司自主经营的情况。

## 七、报告期内对高级管理人员的考评机制，以及激励机制的建立、实施情况

公司继续执行《东吴证券股份有限公司董事监事薪酬管理制度》及《东吴证券股份有限公司高级管理人员管薪酬和绩效管理办法》，通过公正透明的董事、监事、及高级管理人员的绩效考核制度，并以年度公司及各项业务实现的经营业绩对公司高级管理人员进行绩效评价，依据考核结果实施薪酬分配。薪酬分配中将高级管理人员个人收入与公司整体经营业绩、个人分管业务业绩紧密挂钩，激励与约束相结合，发挥正向激励作用。

## 八、是否披露内部控制自我评价报告

适用 不适用

公司内部控制评价报告同日披露于上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)。

报告期内内部控制存在重大缺陷情况的说明

适用 不适用

## 九、内部控制审计报告的相关情况说明

天衡会计师事务所出具了《内部控制审计报告》报告，认为公司于 2015 年 12 月 31 日按照《企业内部控制基本规范》和相关规定在所有重大方面保持了有效的财务报告内部控制。《公司内部控制审计报告》详见上交所网站 (<http://www.sse.com.cn>)

是否披露内部控制审计报告：是

## 十、内部控制责任声明及内部控制制度建设情况

### （一）内部控制责任声明

公司董事会对建立和维护充分的财务报告相关内部控制制度负责。财务报告相关内部控制的目标是保证财务报告信息真实完整和可靠、防范重大错报风险。由于内部控制存在固有局限性，因此仅能对上述目标提供合理保证。

公司董事会已按照《企业内部控制基本规范》要求对财务报告相关内部控制进行了评价，并认为其在 2015 年 12 月 31 日有效。公司在内部控制自我评价过程中未发现与非财务报告相关的内部控制存在重大缺陷。

### （二）建立财务报告内部控制的依据

公司依据《企业内部控制基本规范》、《证券公司内部控制指引》、《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等相关规定，按照“全面性、重要性、制衡性、适应性、成本效益”的原则，建立了财务报告内部控制机制。

### （三）内部控制制度建设情况

报告期内，公司依据监管要求、经营环境变化及创新业务发展需要，对证券金融业务、私募基金综合托管业务、收益互换业务等内部控制制度进行了新增或修订。

## 十一、公司合规管理体系建设情况，合规、稽核部门报告期内完成的检查稽核情况

### （一）公司合规管理体系建设及运行情况

公司的合规管理组织架构由董事会、合规总监、风险合规总部、各部门及分支机构内控经理等四个层级构成。

报告期内，公司以“培育风险合规管理核心竞争力”为中心，将“加强合规风控工作”作为公司年度专项重点工作来推进，以加强合规培训与员工执业行为管理、建立风控合规激励机制为重点，不断提升合规管理水平，有效防范了公司合规风险，公司合规态势整体平稳、良好。

### （二）检查稽核情况

报告期内，公司风险合规总部开展了融资融券业务、资产管理业务、股票质押回购业务、经纪业务、新三板业务等内控合规检查，稽核审计部还进行了营业部负责人离任审计、强制休假审计及其他专项审计、评估等。2015 年共完成业务部门年度审计、分支机构负责人离任审计、强制休假审计及专项审计等 33 项。此外，按照监管部门的要求开展了合规管理有效性评估工作。

## 第十节 公司债券相关情况

√适用 □不适用

### 一、公司债券基本情况

单位:亿元 币种:人民币

| 债券名称                     | 简称     | 代码     | 发行日        | 到期日        | 债券余额 | 利率    | 还本付息方式                          | 交易所     |
|--------------------------|--------|--------|------------|------------|------|-------|---------------------------------|---------|
| 东吴证券股份有限公司<br>2013 年公司债券 | 13 东吴债 | 122288 | 2013-11-18 | 2018-11-18 | 30   | 6.18% | 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。 | 上海证券交易所 |
| 东吴证券股份有限公司<br>2015 年公司债券 | 15 东吴债 | 136022 | 2015-11-9  | 2020-11-9  | 25   | 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。 | 上海证券交易所 |

### 二、公司债券受托管理联系人、联系方式及资信评级机构联系方式

|                 |      |                                 |
|-----------------|------|---------------------------------|
| “13 东吴债”债券受托管理人 | 名称   | 瑞信方正证券有限责任公司                    |
|                 | 办公地址 | 中国北京市西城区金融大街甲 9 号金融街中心南楼 15 层   |
|                 | 联系人  | 杨帆、陈万里                          |
|                 | 联系电话 | 010-66538666                    |
| “15 东吴债”债券受托管理人 | 名称   | 东海证券股份有限公司                      |
|                 | 办公地址 | 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层        |
|                 | 联系人  | 宋维平                             |
|                 | 联系电话 | 021-20333333                    |
| “13 东吴债”资信评级机构  | 名称   | 鹏元资信评估有限公司                      |
|                 | 办公地址 | 深圳市深南大道 7008 号阳光高尔夫大厦三楼         |
| “15 东吴债”资信评级机构  | 名称   | 上海新世纪资信评估投资服务有限公司               |
|                 | 办公地址 | 上海市杨浦区控江路 1555 号 A 座 103 室 K-22 |

### 三、公司债券募集资金使用情况

公司发行的公司债券募集资金扣除发行等相关费用后,均用于补充公司营运资金,满足公司中长期业务发展需求。资金主要用于与公司主营业务相关的用途,以支持公司的长期发展及核心竞争力的培育,与募集说明书中约定的资金运用安排保持一致。



#### 四、公司债券资信评级机构情况

公司聘请鹏元资信评估有限公司对“13 东吴债”进行评级，并邀请上海新世纪资信评估投资服务有限公司对“15 东吴债”进行评级。根据两家资信评级机构为上述债券分别出具的《信用评级报告》，两家资信评级机构将对上述债券在存续期内进行跟踪评级并在各自的官方网站上分别进行披露。根据交易所对于跟踪评级报告披露时间的要求，预计上述债券的跟踪评级报告将于 2016 年 6 月 30 日前披露，提请投资者关注。

#### 五、报告期内公司债券增信机制、偿债计划及其他相关情况

公司将按时履行各期公司债券和次级债券年度付息及到期还本付息义务。公司偿债能力良好。公司偿债资金将主要来源于公司日常的盈利积累及经营活动所产生的现金流。公司的收入规模和盈利积累，较大程度上保证了公司按期偿本付息的能力。

#### 六、公司债券持有人会议召开情况

2015 年度，公司未发生需召开债券持有人会议的事项，未召开债券持有人会议。

#### 七、公司债券受托管理人履职情况

公司 2013 年公司债券受托管理人为瑞信方正证券有限责任公司，瑞信方正于 2015 年 6 月 15 日出具了《东吴证券 2013 年公司债券受托管理事务报告(2014 年度)》，具体内容详见公司于 2015 年 6 月 17 日在上交所网站披露的相关公告。

公司 2015 年公司债券受托管理人为东海证券，因 2015 年公司债券于 2015 年 11 月 10 日发行完毕，东海证券尚未出具受托管理事务报告，根据《债券受托管理协议》，预计债券的 2015 年度债券受托管理报告将于 2016 年 6 月 30 日前披露。

#### 八、截至报告期末公司近 2 年的会计数据和财务指标

单位:元 币种:人民币

| 主要指标          | 2015 年            | 2014 年            | 本期比上年同期增减 (%) | 变动原因                    |
|---------------|-------------------|-------------------|---------------|-------------------------|
| 息税折旧摊销前利润     | 5,789,841,791.80  | 2,209,712,086.23  | 162.02        | 本期公司业绩增长                |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -261,507,863.61   | -157,187,681.11   | -             |                         |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | 14,194,144,284.80 | 7,954,478,124.94  | 78.44         | 主要是本期发行债券收到的现金增加        |
| 期末现金及现金等价物余额  | 28,181,391,000.34 | 16,053,451,825.17 | 75.55         | 主要是本期期末银行存款增加           |
| 流动比率          | 1.66              | 1.45              | 14.48         |                         |
| 速动比率          | 1.66              | 1.45              | 14.48         |                         |
| 资产负债率         | 70.38%            | 67.56%            | 2.82%         |                         |
| EBITDA 全部债务比  | 19.04%            | 8.99%             | 111.79        | 主要是本期公司业绩增长，EBITDA 指标提升 |
| 利息保障倍数        | 2.82              | 3.22              | -12.42        |                         |

|               |      |      |        |   |
|---------------|------|------|--------|---|
| 现金利息保障倍数      | 0.34 | 3.10 | -89.03 | 主要是本期经营活动产生的现金流量净额减少。公司利息保障倍数、EBITDA 利息保障倍数较高，债务偿付能力不存在问题 |
| EBITDA 利息保障倍数 | 2.87 | 3.39 | -15.34 |   |
| 贷款偿还率         | 100% | 100% |        |   |
| 利息偿付率         | 100% | 100% |        |   |

## 九、报告期末公司资产情况

截至2015年12月31日，公司资产总额805.89亿元，归属于母公司的净资产165.40亿元，资产负债率为70.38%。公司资产质量优良，对各项存在减值情形的资产已按照会计准则的规定谨慎地提取了减值准备，且公司自有现金流较为充裕，整体保持了很强的偿债能力，不存在偿债风险。具体情况详见第四节 二、（三）资产、负债情况分析。

## 十、公司其他债券和债务融资工具的付息兑付情况

2015年，公司其他债务融资工具有：次级债、短期融资券、融资业务债权收益权转让、收益凭证、证金公司转融资、同业拆借。各项融资均按时兑付本金及利息。

## 十一、公司报告期内的银行授信情况

2015年，公司银行授信总额增加537亿元，年末授信总额达804亿元，授信银行30家。

## 十二、公司报告期内执行公司债券募集说明书相关约定或承诺的情况

公司在报告期内严格执行公司债券募集说明书中的相关约定或承诺。

## 十三、公司发生重大事项及对公司经营情况和偿债能力的影响

2015年度，公司累计新增发行债券185亿元，包括公司债券、次级债券与短期融资券；其他累计新增借款122.04亿元，包括公司及子公司的短期借款、收益凭证、资产收益权转让融入资金及转融通融入资金、同业拆借等方式，公司新增借款累计超过上年末净资产的20%。

上述新增借款是依据公司业务开展需要发生的，公司保持了合理的资产负债率水平，未对公司的经营情况和偿债能力产生重大不利影响。

## 第十一节 财务报告

### 审计报告

√适用□不适用

天衡审字（2016）00727 号

东吴证券股份有限公司全体股东：

我们审计了后附的东吴证券股份有限公司（以下简称“东吴证券”）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的合并及母公司资产负债表，2015 年度的合并及母公司利润表、合并及母公司现金流量表、合并及母公司所有者权益变动表以及财务报表附注。

#### 一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是东吴证券管理层的责任，这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）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报导致的重大错报。

#### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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、审计意见

我们认为，东吴证券财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东吴证券 2015 年 12 月 31 日的合并及母公司财务状况以及 2015 年度的合并及母公司经营成果和现金流量。

天衡会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师： 谈建忠

中国·南京

中国注册会计师： 陆德忠

2016 年 4 月 18 日

## 财务报表

合并资产负债表  
2015 年 12 月 31 日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 附注   | 期末余额              | 期初余额              |
|------------------------|------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>             |      |                   |                   |
| 货币资金                   | 5.01 | 23,454,179,048.36 | 10,249,789,646.59 |
| 其中：客户存款                |      | 19,694,206,086.62 | 8,182,244,138.44  |
| 结算备付金                  | 5.02 | 4,827,905,019.84  | 5,896,568,026.69  |
| 其中：客户备付金               |      | 4,174,930,818.95  | 4,764,284,994.96  |
| 拆出资金                   |      |                   |                   |
| 融出资金                   | 5.03 | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 5.04 | 14,222,827,510.80 | 17,315,854,448.80 |
| 衍生金融资产                 | 5.05 | 3,620.00          |                   |
| 买入返售金融资产               | 5.06 | 8,923,142,748.05  | 6,582,668,335.27  |
| 应收款项                   | 5.07 | 333,743,476.04    | 44,871,017.11     |
| 应收利息                   | 5.08 | 357,047,813.24    | 235,740,507.88    |
| 存出保证金                  | 5.09 | 1,012,776,896.33  | 1,216,607,357.01  |
| 可供出售金融资产               | 5.10 | 14,337,888,888.16 | 5,962,900,341.44  |
| 持有至到期投资                | 5.12 | 45,804,161.79     | 53,195,487.59     |
| 长期股权投资                 | 5.13 | 122,232,522.20    | 10,483,110.25     |
| 投资性房地产                 |      |                   |                   |
| 固定资产                   | 5.14 | 810,769,001.69    | 821,583,378.87    |
| 在建工程                   | 5.15 | 751,888.44        |                   |
| 无形资产                   | 5.16 | 163,071,501.98    | 147,174,439.44    |
| 商誉                     | 5.17 | 235,685,139.34    | 235,685,139.34    |
| 递延所得税资产                | 5.18 | 167,302,236.93    | 59,595,719.83     |
| 其他资产                   | 5.19 | 698,598,724.37    | 739,463,262.05    |
| 资产总计                   |      | 80,589,136,533.56 | 57,461,111,012.63 |
| <b>负债：</b>             |      |                   |                   |
| 短期借款                   | 5.21 | 93,684,509.36     |                   |
| 应付短期融资款                | 5.22 | 4,567,350,000.00  | 3,313,738,000.00  |
| 拆入资金                   | 5.23 | 350,000,000.00    | 1,918,000,000.00  |
| 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                 | 5.05 | 5,704,972.15      |                   |
| 卖出回购金融资产款              | 5.24 | 8,926,452,635.46  | 16,361,955,658.47 |
| 代理买卖证券款                | 5.25 | 24,025,978,380.26 | 13,579,472,286.92 |
| 代理承销证券款                |      |                   |                   |
| 应付职工薪酬                 | 5.26 | 1,505,489,727.11  | 651,274,014.09    |
| 应交税费                   | 5.27 | 401,483,551.42    | 304,415,837.08    |
| 应付款项                   | 5.28 | 70,405,540.42     | 70,417,113.89     |
| 应付利息                   | 5.29 | 536,703,397.67    | 97,768,819.16     |
| 预计负债                   |      |                   |                   |

|                      |      |                   |                   |
|----------------------|------|-------------------|-------------------|
| 长期借款                 |      |                   |                   |
| 应付债券                 | 5.30 | 16,466,882,811.73 | 2,975,791,937.06  |
| 递延所得税负债              | 5.18 | 9,617,062.63      | 2,689,891.59      |
| 其他负债                 | 5.31 | 6,877,015,079.34  | 3,952,206,040.35  |
| 负债合计                 |      | 63,836,767,667.55 | 43,227,729,598.61 |
| <b>所有者权益（或股东权益）：</b> |      |                   |                   |
| 实收资本（或股本）            | 5.32 | 2,700,000,000.00  | 2,700,000,000.00  |
| 资本公积                 | 5.33 | 8,564,676,213.93  | 8,564,676,213.93  |
| 减：库存股                |      |                   |                   |
| 其他综合收益               | 5.34 | 345,269,489.80    | 255,204,488.79    |
| 盈余公积                 | 5.35 | 518,669,879.51    | 252,801,672.22    |
| 一般风险准备               | 5.36 | 1,364,956,056.45  | 820,738,196.95    |
| 未分配利润                | 5.37 | 3,046,345,459.70  | 1,485,436,624.61  |
| 外币报表折算差额             |      |                   |                   |
| 归属于母公司所有者权益（或股东权益）合计 |      | 16,539,917,099.39 | 14,078,857,196.50 |
| 少数股东权益               | 5.38 | 212,451,766.62    | 154,524,217.52    |
| 所有者权益（或股东权益）合计       |      | 16,752,368,866.01 | 14,233,381,414.02 |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计    |      | 80,589,136,533.56 | 57,461,111,012.63 |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

### 母公司资产负债表

2015年12月31日

编制单位：东吴证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 附注    | 期末余额              | 期初余额              |
|------------------------|-------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>             |       |                   |                   |
| 货币资金                   |       | 21,827,877,826.47 | 8,526,988,470.45  |
| 其中：客户存款                |       | 18,599,561,502.00 | 7,113,030,076.78  |
| 结算备付金                  |       | 4,745,490,997.69  | 5,891,832,292.17  |
| 其中：客户备付金               |       | 4,178,454,731.32  | 4,764,284,994.96  |
| 拆出资金                   |       |                   |                   |
| 融出资金                   |       | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 |       | 10,938,449,917.30 | 13,289,838,165.30 |
| 衍生金融资产                 |       | 3,620.00          |                   |
| 买入返售金融资产               |       | 3,939,971,198.05  | 4,552,646,889.77  |
| 应收款项                   | 15.01 | 248,448,188.51    | 31,284,847.72     |
| 应收利息                   |       | 220,941,972.04    | 134,928,901.00    |
| 存出保证金                  |       | 442,192,492.84    | 408,761,242.15    |
| 可供出售金融资产               |       | 13,215,748,503.52 | 6,479,027,528.43  |
| 持有至到期投资                |       |                   |                   |

|                        |       |                   |                   |
|------------------------|-------|-------------------|-------------------|
| 长期股权投资                 | 15.02 | 2,863,196,035.71  | 2,357,577,285.71  |
| 投资性房地产                 |       |                   |                   |
| 固定资产                   |       | 766,136,947.84    | 775,402,466.20    |
| 在建工程                   |       | 751,888.44        |                   |
| 无形资产                   |       | 144,502,832.85    | 129,706,746.51    |
| 商誉                     |       | 11,749,999.80     | 11,749,999.80     |
| 递延所得税资产                |       | 159,744,426.74    | 46,162,959.09     |
| 其他资产                   | 15.03 | 122,825,643.51    | 96,696,294.85     |
| 资产总计                   |       | 70,523,438,827.31 | 50,621,534,883.62 |
| <b>负债：</b>             |       |                   |                   |
| 短期借款                   |       |                   |                   |
| 应付短期融资款                |       | 4,000,000,000.00  | 3,313,738,000.00  |
| 拆入资金                   |       | 350,000,000.00    | 1,918,000,000.00  |
| 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                 |       | 4,245,522.15      |                   |
| 卖出回购金融资产款              |       | 8,321,817,684.26  | 15,629,722,312.09 |
| 代理买卖证券款                |       | 22,621,633,084.67 | 11,851,331,967.28 |
| 代理承销证券款                |       |                   |                   |
| 应付职工薪酬                 |       | 1,413,860,035.04  | 589,524,747.69    |
| 应交税费                   |       | 377,690,536.76    | 260,508,925.70    |
| 应付款项                   |       | 33,035,400.59     | 5,627,101.86      |
| 应付利息                   |       | 536,643,200.34    | 97,559,443.32     |
| 预计负债                   |       | 1,004,000.00      | 8,544,879.45      |
| 长期借款                   |       |                   |                   |
| 应付债券                   |       | 16,466,882,811.73 | 2,975,791,937.06  |
| 递延所得税负债                |       |                   |                   |
| 其他负债                   |       | 157,862,283.96    | 163,363,778.49    |
| 负债合计                   |       | 54,284,674,559.50 | 36,813,713,092.94 |
| <b>所有者权益（或股东权益）：</b>   |       |                   |                   |
| 实收资本（或股本）              |       | 2,700,000,000.00  | 2,700,000,000.00  |
| 资本公积                   |       | 8,563,640,848.19  | 8,563,640,848.19  |
| 减：库存股                  |       |                   |                   |
| 其他综合收益                 |       | 410,093,725.87    | 300,333,321.64    |
| 盈余公积                   |       | 518,669,879.51    | 252,801,672.22    |
| 一般风险准备                 |       | 1,283,170,657.84  | 751,434,243.26    |
| 未分配利润                  |       | 2,763,189,156.40  | 1,239,611,705.37  |
| 外币报表折算差额               |       |                   |                   |
| 所有者权益（或股东权益）合计         |       | 16,238,764,267.81 | 13,807,821,790.68 |
| 负债和所有者权益（或股东权益）总计      |       | 70,523,438,827.31 | 50,621,534,883.62 |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

**合并利润表**  
2015 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

| 项目                                 | 附注   | 本期发生额            | 上期发生额            |
|------------------------------------|------|------------------|------------------|
| 一、营业收入                             |      | 6,830,161,925.32 | 3,240,982,527.87 |
| 手续费及佣金净收入                          | 5.39 | 3,821,609,158.46 | 1,678,372,503.40 |
| 其中: 经纪业务手续费净收入                     |      | 2,646,254,123.37 | 1,047,928,710.47 |
| 投资银行业务手续费净收入                       |      | 757,556,414.50   | 468,393,502.38   |
| 资产管理业务手续费净收入                       |      | 206,675,731.33   | 109,442,468.81   |
| 利息净收入                              | 5.40 | 286,555,551.49   | 142,354,207.83   |
| 投资收益(损失以“-”号填列)                    | 5.41 | 2,383,976,752.02 | 1,332,045,196.37 |
| 其中: 对联营企业和合营企业的投资收益                |      | 2,643,966.52     | 7,202,544.72     |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)                | 5.42 | 306,628,570.68   | 73,847,954.88    |
| 汇兑收益(损失以“-”号填列)                    |      | 1,162,645.34     | 34,513.68        |
| 其他业务收入                             | 5.43 | 30,229,247.33    | 14,328,151.71    |
| 二、营业支出                             |      | 3,106,021,314.08 | 1,810,381,759.33 |
| 营业税金及附加                            | 5.44 | 414,691,579.49   | 179,059,507.04   |
| 业务及管理费                             | 5.45 | 2,656,099,023.42 | 1,579,192,330.95 |
| 资产减值损失                             | 5.46 | 22,797,025.87    | 52,129,921.34    |
| 其他业务成本                             |      | 12,433,685.30    | -                |
| 三、营业利润(亏损以“-”号填列)                  |      | 3,724,140,611.24 | 1,430,600,768.54 |
| 加: 营业外收入                           | 5.47 | 18,900,229.51    | 22,117,533.93    |
| 减: 营业外支出                           | 5.48 | 85,774,425.93    | 3,927,403.75     |
| 四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)                |      | 3,657,266,414.82 | 1,448,790,898.72 |
| 减: 所得税费用                           | 5.49 | 923,973,390.23   | 324,231,545.03   |
| 五、净利润(净亏损以“-”号填列)                  |      | 2,733,293,024.59 | 1,124,559,353.69 |
| 其中: 归属于母公司所有者(或股东)的净利润             |      | 2,708,494,901.88 | 1,115,452,050.88 |
| 少数股东损益                             |      | 24,798,122.71    | 9,107,302.81     |
| 六、其他综合收益的税后净额                      |      | 90,185,067.40    | 255,447,836.03   |
| 归属母公司所有者的其他综合收益的税后净额               | 5.50 | 90,065,001.01    | 255,200,596.45   |
| (一)以后不能重分类进损益的其他综合收益               |      |                  |                  |
| 1.重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动             |      |                  |                  |
| 2.权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额  |      |                  |                  |
| (二)以后将重分类进损益的其他综合收益                |      | 90,065,001.01    | 255,200,596.45   |
| 1.权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 |      |                  |                  |
| 2.可供出售金融资产公允价值变动损益                 |      | 89,950,510.04    | 255,200,596.45   |
| 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                       |      | 114,490.97       |                  |
| 6.其他                               |      |                  |                  |
| 归属于少数股东的其他综合收益的税后净额                |      | 120,066.39       | 247,239.58       |

|                  |      |                  |                  |
|------------------|------|------------------|------------------|
| 额                |      |                  |                  |
| 七、综合收益总额         |      | 2,823,478,091.99 | 1,380,007,189.72 |
| 归属于母公司所有者的综合收益总额 |      | 2,798,559,902.89 | 1,370,652,647.33 |
| 归属于少数股东的综合收益总额   |      | 24,918,189.10    | 9,354,542.39     |
| 八、每股收益：          |      |                  |                  |
| （一）基本每股收益(元/股)   | 5.51 | 1.00             | 0.49             |
| （二）稀释每股收益(元/股)   | 5.51 | 1.00             | 0.49             |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

**母公司利润表**  
2015 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                                 | 附注    | 本期发生额            | 上期发生额            |
|------------------------------------|-------|------------------|------------------|
| 一、营业收入                             |       | 6,282,781,739.63 | 2,746,251,786.19 |
| 手续费及佣金净收入                          | 15.04 | 3,627,018,864.30 | 1,598,425,673.45 |
| 其中：经纪业务手续费净收入                      |       | 2,577,600,916.69 | 984,972,252.52   |
| 投资银行业务手续费净收入                       |       | 757,556,414.50   | 468,393,502.38   |
| 资产管理业务手续费净收入                       |       | 254,425,174.20   | 132,156,432.36   |
| 利息净收入                              |       | 283,890,756.38   | 161,455,824.04   |
| 投资收益（损失以“－”号填列）                    | 15.05 | 2,114,401,606.17 | 959,036,867.09   |
| 其中：对联营企业和合营企业的投资收益                 |       |                  | 6,635,940.33     |
| 公允价值变动收益（损失以“－”号填列）                | 15.06 | 251,315,092.33   | 21,315,420.14    |
| 汇兑收益（损失以“－”号填列）                    |       | 1,162,645.34     | 34,513.68        |
| 其他业务收入                             |       | 4,992,775.11     | 5,983,487.79     |
| 二、营业支出                             |       | 2,736,566,684.83 | 1,605,425,680.52 |
| 营业税金及附加                            |       | 385,952,277.72   | 165,356,703.50   |
| 业务及管理费                             |       | 2,327,817,381.24 | 1,403,300,455.68 |
| 资产减值损失                             |       | 22,797,025.87    | 36,768,521.34    |
| 其他业务成本                             |       |                  |                  |
| 三、营业利润（亏损以“－”号填列）                  |       | 3,546,215,054.80 | 1,140,826,105.67 |
| 加：营业外收入                            |       | 5,429,243.23     | 16,516,345.34    |
| 减：营业外支出                            |       | 64,497,011.86    | 7,323,272.59     |
| 四、利润总额（亏损总额以“－”号填列）                |       | 3,487,147,286.17 | 1,150,019,178.42 |
| 减：所得税费用                            |       | 828,465,213.27   | 270,129,146.86   |
| 五、净利润（净亏损以“－”号填列）                  |       | 2,658,682,072.90 | 879,890,031.56   |
| 六、其他综合收益的税后净额                      |       | 109,760,404.23   | 291,090,846.55   |
| （一）以后不能重分类进损益的其他综合收益               |       |                  |                  |
| 1. 重新计量设定受益计划净负债或净资产的变动            |       |                  |                  |
| 2. 权益法下在被投资单位不能重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 |       |                  |                  |
| （二）以后将重分类进损益的其他综合收益                |       | 109,760,404.23   | 291,090,846.55   |



|                                     |  |                  |                  |
|-------------------------------------|--|------------------|------------------|
| 1. 权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 |  |                  |                  |
| 2. 可供出售金融资产公允价值变动损益                 |  | 109,760,404.23   | 291,090,846.55   |
| 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                       |  |                  |                  |
| 6. 其他                               |  |                  |                  |
| 七、综合收益总额                            |  | 2,768,442,477.13 | 1,170,980,878.11 |
| 八、每股收益：                             |  |                  |                  |
| （一）基本每股收益(元/股)                      |  |                  |                  |
| （二）稀释每股收益(元/股)                      |  |                  |                  |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 合并现金流量表

2015 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                           | 附注      | 本期发生额             | 上期发生额             |
|------------------------------|---------|-------------------|-------------------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b>        |         |                   |                   |
| 处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额  |         |                   |                   |
| 收取利息、手续费及佣金的现金               |         | 6,905,224,108.02  | 2,654,477,226.54  |
| 拆入资金净增加额                     |         |                   | 1,762,000,000.00  |
| 回购业务资金净增加额                   |         |                   | 9,869,775,187.67  |
| 融出资金净减少额                     |         |                   |                   |
| 代理买卖证券收到的现金净额                |         | 10,446,506,093.34 | 7,258,965,052.52  |
| 收到其他与经营活动有关的现金               | 5.52(1) | 3,190,545,131.00  | 3,471,627,234.37  |
| 经营活动现金流入小计                   |         | 20,542,275,332.36 | 25,016,844,701.10 |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额 |         | 2,622,360,488.73  | 14,925,423,020.02 |
| 融出资金净增加额                     |         | 2,992,460,462.45  | 5,494,785,474.94  |
| 代理买卖证券支付的现金净额                |         |                   |                   |
| 支付利息、手续费及佣金的现金               |         | 1,810,617,661.40  | 645,871,780.12    |
| 拆入资金净减少额                     |         | 1,568,000,000.00  |                   |
| 回购业务资金净减少额                   |         | 9,989,836,203.86  |                   |
| 支付给职工以及为职工支付的现金              |         | 1,081,561,871.73  | 670,834,350.05    |
| 支付的各项税费                      |         | 1,359,674,500.52  | 419,314,713.92    |
| 支付其他与经营活动有关的现金               | 5.52(2) | 923,776,689.66    | 1,854,148,027.59  |
| 经营活动现金流出小计                   |         | 22,348,287,878.35 | 24,010,377,366.64 |
| 经营活动产生的现金流量净额                |         | -1,806,012,545.99 | 1,006,467,334.46  |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>        |         |                   |                   |
| 收回投资收到的现金                    |         |                   |                   |
| 取得投资收益收到的现金                  |         |                   |                   |

|                           |         |                   |                   |
|---------------------------|---------|-------------------|-------------------|
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额       |         |                   |                   |
| 收到其他与投资活动有关的现金            | 5.52(3) | 624,092.67        | 8,119,051.60      |
| 投资活动现金流入小计                |         | 624,092.67        | 8,119,051.60      |
| 投资支付的现金                   |         |                   |                   |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金   |         | 153,026,510.85    | 96,846,595.31     |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额       |         | 109,105,445.43    | 68,460,137.40     |
| 支付其他与投资活动有关的现金            |         |                   |                   |
| 投资活动现金流出小计                |         | 262,131,956.28    | 165,306,732.71    |
| 投资活动产生的现金流量净额             |         | -261,507,863.61   | -157,187,681.11   |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>     |         |                   |                   |
| 吸收投资收到的现金                 |         | 36,375,360.00     | 5,117,000,000.00  |
| 其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金       |         | 36,375,360.00     |                   |
| 取得借款收到的现金                 |         | 80,000,000.00     |                   |
| 发行债券收到的现金                 |         | 22,667,350,000.00 | 3,313,738,000.00  |
| 收到其他与筹资活动有关的现金            | 5.52(4) | 13,684,509.36     |                   |
| 筹资活动现金流入小计                |         | 22,797,409,869.36 | 8,430,738,000.00  |
| 偿还债务支付的现金                 |         | 7,913,738,000.00  |                   |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金         |         | 666,634,920.19    | 358,589,875.06    |
| 其中：子公司支付给少数股东的股利、利润       |         | 3,366,000.00      | 4,163,798.40      |
| 支付其他与筹资活动有关的现金            | 5.52(5) | 22,892,664.37     | 117,670,000.00    |
| 筹资活动现金流出小计                |         | 8,603,265,584.56  | 476,259,875.06    |
| 筹资活动产生的现金流量净额             |         | 14,194,144,284.80 | 7,954,478,124.94  |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b> |         | 1,315,299.97      | 34,513.68         |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>     |         | 12,127,939,175.17 | 8,803,792,291.97  |
| 加：期初现金及现金等价物余额            |         | 16,053,451,825.17 | 7,249,659,533.20  |
| <b>六、期末现金及现金等价物余额</b>     | 5.53    | 28,181,391,000.34 | 16,053,451,825.17 |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 母公司现金流量表

2015 年 1—12 月

单位：元 币种：人民币

| 项目                          | 附注 | 本期发生额 | 上期发生额 |
|-----------------------------|----|-------|-------|
| <b>一、经营活动产生的现金流量：</b>       |    |       |       |
| 处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额 |    |       |       |

|                              |                   |                   |
|------------------------------|-------------------|-------------------|
| 收取利息、手续费及佣金的现金               | 6,348,719,245.46  | 2,545,293,281.59  |
| 拆入资金净增加额                     |                   | 1,762,000,000.00  |
| 回购业务资金净增加额                   |                   | 11,212,758,702.64 |
| 融出资金净减少额                     |                   | -                 |
| 代理买卖证券收到的现金净额                | 10,770,301,117.39 | 6,541,296,867.06  |
| 收到其他与经营活动有关的现金               | 30,183,401.61     | 17,996,365.21     |
| 经营活动现金流入小计                   | 17,149,203,764.46 | 22,079,345,216.50 |
| 处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产净减少额 | 2,131,024,563.56  | 13,035,854,965.67 |
| 融出资金净增加额                     | 2,992,460,462.45  | 5,494,785,474.94  |
| 代理买卖证券支付的现金净额                |                   |                   |
| 支付利息、手续费及佣金的现金               | 1,773,305,083.55  | 518,145,277.92    |
| 拆入资金净减少额                     | 1,568,000,000.00  |                   |
| 回购业务资金净减少额                   | 6,900,339,481.11  |                   |
| 支付给职工以及为职工支付的现金              | 929,451,054.42    | 601,773,322.27    |
| 支付的各项税费                      | 1,243,541,922.65  | 396,381,664.50    |
| 支付其他与经营活动有关的现金               | 502,660,141.11    | 616,517,439.02    |
| 经营活动现金流出小计                   | 18,040,782,708.85 | 20,663,458,144.32 |
| 经营活动产生的现金流量净额                | -891,578,944.39   | 1,415,887,072.18  |
| <b>二、投资活动产生的现金流量：</b>        |                   |                   |
| 收回投资收到的现金                    |                   |                   |
| 取得投资收益收到的现金                  | 184,634,000.00    | 70,836,201.60     |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额          |                   |                   |
| 收到其他与投资活动有关的现金               | 398,750.23        | 6,210,649.11      |
| 投资活动现金流入小计                   | 185,032,750.23    | 77,046,850.71     |
| 投资支付的现金                      |                   |                   |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金      | 139,848,832.06    | 88,894,099.86     |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额          | 505,618,750.00    | 1,188,000,000.00  |
| 支付其他与投资活动有关的现金               |                   |                   |
| 投资活动现金流出小计                   | 645,467,582.06    | 1,276,894,099.86  |
| 投资活动产生的现金流量净额                | -460,434,831.83   | -1,199,847,249.15 |
| <b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>        |                   |                   |
| 吸收投资收到的现金                    |                   | 5,117,000,000.00  |
| 取得借款收到的现金                    |                   |                   |
| 发行债券收到的现金                    | 22,100,000,000.00 | 3,313,738,000.00  |
| 收到其他与筹资活动有关的现金               |                   |                   |
| 筹资活动现金流入小计                   | 22,100,000,000.00 | 8,430,738,000.00  |
| 偿还债务支付的现金                    | 7,913,738,000.00  |                   |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金            | 657,970,143.21    | 354,426,076.66    |
| 支付其他与筹资活动有关的现金               | 22,892,664.37     | 117,670,000.00    |
| 筹资活动现金流出小计                   | 8,594,600,807.58  | 472,096,076.66    |
| 筹资活动产生的现金流量净额                | 13,505,399,192.42 | 7,958,641,923.34  |
| <b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>    | 1,162,645.34      | 34,513.68         |
| <b>五、现金及现金等价物净增加额</b>        | 12,154,548,061.54 | 8,174,716,260.05  |
| 加：期初现金及现金等价物余额               | 14,418,820,762.62 | 6,244,104,502.57  |

---

|                |       |                   |                   |
|----------------|-------|-------------------|-------------------|
| 六、期末现金及现金等价物余额 | 15.07 | 26,573,368,824.16 | 14,418,820,762.62 |
|----------------|-------|-------------------|-------------------|

法定代表人：范力 主管会计工作负责人：马震亚 会计机构负责人：王菁

**合并所有者权益变动表**  
2015 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

| 项目                    | 本期               |                  |       |                |      |                |                |                   |                |                   |
|-----------------------|------------------|------------------|-------|----------------|------|----------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
|                       | 归属于母公司所有者权益      |                  |       |                |      |                |                |                   | 少数股东权益         | 所有者权益合计           |
|                       | 股本               | 资本公积             | 减:库存股 | 其他综合收益         | 专项储备 | 盈余公积           | 一般风险准备         | 未分配利润             |                |                   |
| 一、上年期末余额              | 2,700,000,000.00 | 8,564,676,213.93 |       | 255,204,488.79 |      | 252,801,672.22 | 820,738,196.95 | 1,485,436,624.61  | 154,524,217.52 | 14,233,381,414.02 |
| 加:会计政策变更              |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                |                   |
| 前期差错更正                |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                |                   |
| 同一控制下企业合并             |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                |                   |
| 其他                    |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                |                   |
| 二、本年期初余额              | 2,700,000,000.00 | 8,564,676,213.93 |       | 255,204,488.79 |      | 252,801,672.22 | 820,738,196.95 | 1,485,436,624.61  | 154,524,217.52 | 14,233,381,414.02 |
| 三、本期增减变动金额(减少以“—”号填列) |                  |                  |       | 90,065,001.01  |      | 265,868,207.29 | 544,217,859.50 | 1,560,908,835.09  | 57,927,549.10  | 2,518,987,451.99  |
| (一)综合收益总额             |                  |                  |       | 90,065,001.01  |      |                |                | 2,708,494,901.88  | 24,918,189.10  | 2,823,478,091.99  |
| (二)所有者投入和减少资本         |                  |                  |       |                |      |                |                |                   | 36,375,360.00  | 36,375,360.00     |
| 1.股东投入的普通股            |                  |                  |       |                |      |                |                |                   | 36,375,360.00  | 36,375,360.00     |
| 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               |                  |                  |       |                |      | 265,868,207.29 | 544,217,859.50 | -1,147,586,066.79 | -3,366,000.00  | -340,866,000.00   |
| 1.提取盈余公积              |                  |                  |       |                |      | 265,868,207.29 |                | -265,868,207.29   |                |                   |
| 2.提取一般风险准备            |                  |                  |       |                |      |                | 544,217,859.50 | -544,217,859.50   |                |                   |
| 3.对所有者(或股东)的分配        |                  |                  |       |                |      |                |                | -337,500,000.00   | -3,366,000.00  | -340,866,000.00   |
| 4.其他                  |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                |                   |

|                  |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
|------------------|------------------|------------------|--|----------------|--|----------------|------------------|------------------|----------------|-------------------|
| (四) 所有者权益内部结转    |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 1. 资本公积转增资本(或股本) |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本) |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 3. 盈余公积弥补亏损      |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 4. 其他            |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| (五) 专项储备         |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 1. 本期提取          |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 2. 本期使用          |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| (六) 其他           |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                |                   |
| 四、本期期末余额         | 2,700,000,000.00 | 8,564,676,213.93 |  | 345,269,489.80 |  | 518,669,879.51 | 1,364,956,056.45 | 3,046,345,459.70 | 212,451,766.62 | 16,752,368,866.01 |

| 项目                    | 上期               |                  |       |                |      |                |                |                  |               |                  |
|-----------------------|------------------|------------------|-------|----------------|------|----------------|----------------|------------------|---------------|------------------|
|                       | 归属于母公司所有者权益      |                  |       |                |      |                |                |                  | 少数股东权益        | 所有者权益合计          |
|                       | 股本               | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益         | 专项储备 | 盈余公积           | 一般风险准备         | 未分配利润            |               |                  |
| 一、上年期末余额              | 2,000,000,000.00 | 4,265,546,752.75 |       | 3,892.34       |      | 164,812,669.06 | 581,797,909.76 | 816,913,864.08   | 68,069,941.22 | 7,897,145,029.21 |
| 加：会计政策变更              |                  |                  |       |                |      |                |                |                  |               |                  |
| 前期差错更正                |                  |                  |       |                |      |                |                |                  |               |                  |
| 同一控制下企业合并             |                  |                  |       |                |      |                |                |                  |               |                  |
| 其他                    |                  |                  |       |                |      |                |                |                  |               |                  |
| 二、本年期初余额              | 2,000,000,000.00 | 4,265,546,752.75 |       | 3,892.34       |      | 164,812,669.06 | 581,797,909.76 | 816,913,864.08   | 68,069,941.22 | 7,897,145,029.21 |
| 三、本期增减变动金额(减少以“－”号填列) | 700,000,000.00   | 4,299,129,461.18 |       | 255,200,596.45 |      | 87,989,003.16  | 238,940,287.19 | 668,522,760.53   | 86,454,276.30 | 6,336,236,384.81 |
| (一) 综合收益总额            |                  |                  |       | 255,200,596.45 |      |                |                | 1,115,452,050.88 | 9,354,542.39  | 1,380,007,189.72 |
| (二) 所有者投入和减少资本        | 700,000,000.00   | 4,299,129,461.18 |       |                |      |                |                |                  | 81,263,532.31 | 5,080,392,993.49 |
| 1. 股东投入的普通股           | 700,000,000.00   | 4,298,580,000.00 |       |                |      |                |                |                  |               | 4,998,580,000.00 |

|                   |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
|-------------------|------------------|------------------|--|----------------|--|----------------|----------------|------------------|----------------|-------------------|
| 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             |                  | 549,461.18       |  |                |  |                |                |                  | 81,263,532.31  | 81,812,993.49     |
| (三) 利润分配          |                  |                  |  |                |  | 87,989,003.16  | 238,940,287.19 | -446,929,290.35  | -4,163,798.40  | -124,163,798.40   |
| 1. 提取盈余公积         |                  |                  |  |                |  | 87,989,003.16  |                | -87,989,003.16   |                |                   |
| 2. 提取一般风险准备       |                  |                  |  |                |  |                | 238,940,287.19 | -238,940,287.19  |                |                   |
| 3. 对所有者(或股东)的分配   |                  |                  |  |                |  |                |                | -120,000,000.00  | -4,163,798.40  | -124,163,798.40   |
| 4. 其他             |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| (四) 所有者权益内部结转     |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 1. 资本公积转增资本(或股本)  |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本)  |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 3. 盈余公积弥补亏损       |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 4. 其他             |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| (五) 专项储备          |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 1. 本期提取           |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 2. 本期使用           |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| (六) 其他            |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                |                   |
| 四、本期期末余额          | 2,700,000,000.00 | 8,564,676,213.93 |  | 255,204,488.79 |  | 252,801,672.22 | 820,738,196.95 | 1,485,436,624.61 | 154,524,217.52 | 14,233,381,414.02 |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

**母公司所有者权益变动表**  
2015 年 1—12 月

单位:元 币种:人民币

| 项目                    | 本期               |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
|-----------------------|------------------|------------------|-------|----------------|------|----------------|----------------|-------------------|-------------------|
|                       | 股本               | 资本公积             | 减:库存股 | 其他综合收益         | 专项储备 | 盈余公积           | 一般风险准备         | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、上年期末余额              | 2,700,000,000.00 | 8,563,640,848.19 |       | 300,333,321.64 |      | 252,801,672.22 | 751,434,243.26 | 1,239,611,705.37  | 13,807,821,790.68 |
| 加: 会计政策变更             |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 前期差错更正                |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 其他                    |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 二、本年期初余额              | 2,700,000,000.00 | 8,563,640,848.19 |       | 300,333,321.64 |      | 252,801,672.22 |                | 1,239,611,705.37  | 13,807,821,790.68 |
| 三、本期增减变动金额(减少以“-”号填列) |                  |                  |       | 109,760,404.23 |      | 265,868,207.29 | 531,736,414.58 | 1,523,577,451.03  | 2,430,942,477.13  |
| (一)综合收益总额             |                  |                  |       | 109,760,404.23 |      |                |                | 2,658,682,072.90  | 2,768,442,477.13  |
| (二)所有者投入和减少资本         |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 1. 股东投入的普通股           |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 2. 其他权益工具持有者投入资本      |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 3. 股份支付计入所有者权益的金额     |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 4. 其他                 |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| (三)利润分配               |                  |                  |       |                |      | 265,868,207.29 | 531,736,414.58 | -1,135,104,621.87 | -337,500,000.00   |
| 1. 提取盈余公积             |                  |                  |       |                |      | 265,868,207.29 |                | -265,868,207.29   |                   |
| 2. 提取一般风险准备           |                  |                  |       |                |      |                | 531,736,414.58 | -531,736,414.58   |                   |
| 3. 对所有者(或股东)的分配       |                  |                  |       |                |      |                |                | -337,500,000.00   | -337,500,000.00   |
| 4. 其他                 |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| (四)所有者权益内部结转          |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 1. 资本公积转增资本(或股本)      |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 2. 盈余公积转增资本(或股本)      |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |
| 3. 盈余公积弥补亏损           |                  |                  |       |                |      |                |                |                   |                   |



|          |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                   |
|----------|------------------|------------------|--|----------------|--|----------------|------------------|------------------|-------------------|
| 4. 其他    |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                   |
| (五) 专项储备 |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                   |
| 1. 本期提取  |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                   |
| 2. 本期使用  |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                   |
| (六) 其他   |                  |                  |  |                |  |                |                  |                  |                   |
| 四、本期期末余额 | 2,700,000,000.00 | 8,563,640,848.19 |  | 410,093,725.87 |  | 518,669,879.51 | 1,283,170,657.84 | 2,763,189,156.40 | 16,238,764,267.81 |

| 项目                    | 上期               |                  |       |                |      |                |                |                 |                  |
|-----------------------|------------------|------------------|-------|----------------|------|----------------|----------------|-----------------|------------------|
|                       | 股本               | 资本公积             | 减：库存股 | 其他综合收益         | 专项储备 | 盈余公积           | 一般风险准备         | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、上年期末余额              | 2,000,000,000.00 | 4,265,060,848.19 |       | 9,242,475.09   |      | 164,812,669.06 | 575,456,236.94 | 743,688,683.29  | 7,758,260,912.57 |
| 加：会计政策变更              |                  |                  |       |                |      |                |                |                 |                  |
| 前期差错更正                |                  |                  |       |                |      |                |                |                 |                  |
| 其他                    |                  |                  |       |                |      |                |                |                 |                  |
| 二、本年期初余额              | 2,000,000,000.00 | 4,265,060,848.19 |       | 9,242,475.09   |      | 164,812,669.06 | 575,456,236.94 | 743,688,683.29  | 7,758,260,912.57 |
| 三、本期增减变动金额（减少以“－”号填列） | 700,000,000.00   | 4,298,580,000.00 |       | 291,090,846.55 |      | 87,989,003.16  | 175,978,006.32 | 495,923,022.08  | 6,049,560,878.11 |
| （一）综合收益总额             |                  |                  |       | 291,090,846.55 |      |                |                | 879,890,031.56  | 1,170,980,878.11 |
| （二）所有者投入和减少资本         | 700,000,000.00   | 4,298,580,000.00 |       |                |      |                |                |                 | 4,998,580,000.00 |
| 1. 股东投入的普通股           | 700,000,000.00   | 4,298,580,000.00 |       |                |      |                |                |                 | 4,998,580,000.00 |
| 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               |                  |                  |       |                |      | 87,989,003.16  | 175,978,006.32 | -383,967,009.48 | -120,000,000.00  |
| 1. 提取盈余公积             |                  |                  |       |                |      | 87,989,003.16  |                | -87,989,003.16  |                  |
| 2. 提取一般风险准备           |                  |                  |       |                |      |                | 175,978,006.32 | -175,978,006.32 |                  |
| 3. 对所有者（或股东）的分配       |                  |                  |       |                |      |                |                | -120,000,000.00 | -120,000,000.00  |
| 4. 其他                 |                  |                  |       |                |      |                |                |                 |                  |
| （四）所有者权益内部结转          |                  |                  |       |                |      |                |                |                 |                  |

|                  |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
|------------------|------------------|------------------|--|----------------|--|----------------|----------------|------------------|-------------------|
| 1. 资本公积转增资本（或股本） |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| 2. 盈余公积转增资本（或股本） |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| 3. 盈余公积弥补亏损      |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| 4. 其他            |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| （五）专项储备          |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| 1. 本期提取          |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| 2. 本期使用          |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| （六）其他            |                  |                  |  |                |  |                |                |                  |                   |
| 四、本期期末余额         | 2,700,000,000.00 | 8,563,640,848.19 |  | 300,333,321.64 |  | 252,801,672.22 | 751,434,243.26 | 1,239,611,705.37 | 13,807,821,790.68 |

法定代表人：范力

主管会计工作负责人：马震亚

会计机构负责人：王菁

## 附注 1、公司基本情况

### 1. 公司概况

东吴证券股份有限公司（原名苏州证券公司、苏州证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司，以下简称“本公司”或“公司”）成立于 1993 年 4 月 10 日，1998 年 1 月 9 日经中国人民银行江苏省分行苏银复（1998）30 号批复同意增资改制，注册资本增至 10,400 万元，公司名称变更登记为苏州证券有限责任公司，2001 年 12 月 19 日经中国证监会证监机构字（2001）308 号“关于苏州证券有限责任公司增资扩股并更名的批复”，注册资本由 10,400 万增至 100,000 万元人民币，公司更名为东吴证券有限责任公司。

2008 年 6 月 23 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]831 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更注册资本的批复”，增加注册资本人民币 50,000 万元，变更后的注册资本为人民币 150,000 万元。

2009 年 12 月 8 日经公司 2009 年度第二次临时股东会决议并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]310 号“关于核准东吴证券有限责任公司变更为股份有限公司的批复”批准，本公司整体变更为东吴证券股份有限公司，变更后，公司的注册资本为人民币 150,000 万元，由全体股东以截至 2009 年 9 月 30 日经审计后的公司净资产折股。

2011 年 1 月 25 日经公司 2011 年第一次临时股东大会决议并经中国证券监督管理委员会“证监许可[2011]1887 号”文核准，公司首次公开发行 50,000 万股新股。公司股票于 2011 年 12 月 12 日起在上海证券交易所上市交易，注册资本变更为人民币 200,000 万元。

2013 年 9 月 9 日经公司 2013 年第二次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2014 年 2 月 13 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票批复》（证监许可[2014]200 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 70,000 万股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 70,000 万元，变更后公司注册资本为人民币 270,000 万元。

公司住所：苏州工业园区星阳街 5 号。

2016 年 2 月 5 日，取得由苏州市工商行政管理局核准变更登记的新企业法人营业执照，统一社会信用代码：91320000137720519P。

经营范围：许可经营项目：证券经纪；证券投资咨询；与证券投资交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。

截至 2015 年 12 月 31 日止，本公司设立了 16 家分公司，并拥有证券营业部 101 家，均为经批准设立的分公司及证券营业部。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司（包括纳入合并范围内子公司）在职员工 2336 人，其中母公司高级管理人员 7 人。

本财务报告经本公司董事会于 2016 年 4 月 18 日批准报出。

## 2. 合并财务报表范围

本公司 2015 年度纳入合并财务报表范围的子公司共 13 户，具有控制权的结构化主体 30 只；有关子公司及结构化主体的情况参见本附注七“在其他主体中的权益”。因新设子公司，本年度合并范围比上年度增加 4 家子公司，详见本附注 6“合并范围的变更”。

## 附注 2、财务报表的编制基础

### 1. 编制基础

#### (1) 财务报表的编制方法

本公司财务报表以下属各营业部、总部各业务部门等个别会计报表及其他资料为基础汇总编制；汇总时，本公司内部之间重大交易及其余额已相互抵销。

#### (2) 财务报表的编制基础

本公司以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》及具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定进行确认和计量，在此基础上编制财务报表。

此外，本公司的财务报表同时符合证监会 2014 年修订的《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》有关财务报表及其附注的披露要求。

### 2. 持续经营

本公司已评价自报告期末起至少 12 个月的持续经营能力，本公司管理层相信公司能自本财务报表批准日后不短于 12 个月的可预见未来期间内持续经营。因此，本公司以持续经营为基础编制截至 2015 年 12 月 31 日止的财务报表。

## 附注 3、重要会计政策、会计估计

具体会计政策和会计估计提示：

本公司金融工具的核算、承销证券业务的核算、融资融券的核算、转融通业务的核算、收入的确认和计量、资产减值准备等交易和事项的会计政策和会计估计，是按照公司实际业务特点制定的，详见本附注 3 之相关描述。

### 1. 遵循企业会计准则的声明

本公司声明：本公司编制的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了公司的财务状况，经营成果和现金流量等有关信息。

### 2. 会计期间

本公司的会计期间分为年度和中期，会计年度为自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日，中期包括月度、季度和半年度。

### 3. 营业周期

本公司为金融企业，不具有明显可识别的营业周期。

#### 4. 记账本位币

本公司采用人民币为记账本位币。

#### 5. 同一控制下和非同一控制下企业合并的会计处理方法

##### (1) 同一控制下企业合并

参与合并的各方在合并前后均受同一方或相同的多方最终控制且该控制并非暂时性的，为同一控制下企业合并。合并方在企业合并中取得的资产和负债，以被合并方的资产、负债（包括最终控制方收购被合并方而形成的商誉）在最终控制方合并财务报表中的账面价值为基础，进行相关会计处理。合并方取得的净资产账面价值与支付的合并对价账面价值（或发行股份面值总额）的差额，调整资本公积（股本溢价），资本公积（股本溢价）不足以冲减的，调整留存收益。合并日为合并方实际取得对被合并方控制权的日期。

通过多次交易分步实现的同一控制下企业合并，合并方在取得被合并方控制权之前持有的长期股权投资，在取得原股权之日与合并方和被合并方同处于同一方最终控制之日孰晚日与合并日之间已确认有关损益、其他综合收益和其他所有者权益变动，分别冲减比较报表期间的期初留存收益或当期损益。

##### (2) 非同一控制下企业合并

参与合并的各方在合并前后不受同一方或相同的多方最终控制的，为非同一控制下企业合并。购买方支付的合并成本是为取得被购买方控制权而支付的资产、发生或承担的负债以及发行的权益性证券在购买日的公允价值之和。购买方为企业合并发生的审计、法律服务、评估咨询等中介费用以及其他相关管理费用，于发生时计入当期损益；购买方作为合并对价发行的权益性证券或债务性证券的交易费用，计入权益性证券或债务性证券的初始确认金额。付出资产的公允价值与其账面价值的差额，计入当期损益。购买日是指购买方实际取得对被购买方控制权的日期。购买方在购买日对合并成本进行分配，确认所取得的被购买方各项可辨认资产、负债及或有负债的公允价值。合并成本大于合并中取得的被购买方可辨认净资产公允价值份额的差额，确认为商誉（参见附注 3: 3. 22）；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。

通过多次交易分步实现的非同一控制下企业合并时，对于购买日之前持有的被购买方的股权，按照该股权在购买日的公允价值进行重新计量，公允价值与其账面价值的差额计入当期投资收益；购买日之前持有的被购买方的股权涉及其他综合收益以及其他所有者权益变动的，与其相关的其他综合收益、其他所有者权益变动转为购买日所属当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

#### 6. 合并财务报表的编制方法

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的子公司（指被本公司控制的主体，包括企业、被投资单位中可分割部分、以及企业所控制的结构化主体等）。控制，是指拥

有对被投资单位的权力，通过参与被投资单位的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资单位的权力影响其回报金额。子公司的经营成果、财务状况和现金流量由控制开始日起至控制结束日止包含于合并财务报表中。

本公司通过同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，视同被合并子公司在本公司最终控制方对其实施控制时纳入合并范围，并对合并财务报表的期初数以及前期比较报表进行相应调整。

本公司通过非同一控制下企业合并取得的子公司，在编制合并当期财务报表时，以购买日确定的各项可辨认资产、负债的公允价值为基础对子公司的财务报表进行调整，并自购买日起将被合并子公司纳入合并范围。

子公司所采用的会计期间或会计政策与本公司不一致时，在编制合并财务报表时按本公司的会计期间或会计政策对子公司的财务报表进行必要的调整。合并范围内企业之间所有重大交易、余额以及未实现损益在编制合并财务报表时予以抵消。内部交易发生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则不予抵消。

子公司少数股东应占的权益、损益和综合收益总额分别在合并资产负债表的股东权益中和合并利润表的净利润及综合收益总额项目后单独列示。如果子公司少数股东分担的当期亏损超过了少数股东在该子公司期初所有者权益中所享有的份额的，其余额仍冲减少数股东权益。

对于购买子公司少数股权或因处置部分股权投资但没有丧失对该子公司控制权的交易，作为权益性交易核算，调整归属于母公司所有者权益和少数股东权益的账面价值以反映其在子公司中相关权益的变化。少数股东权益的调整额与支付/收到对价的公允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。

因处置部分股权投资或其他原因丧失了对原有子公司控制权的，对于剩余股权，按照其在丧失控制权日的公允价值进行重新计量。处置股权取得的对价与剩余股权公允价值之和，减去按原持股比例计算应享有原有子公司自购买日开始持续计算的净资产的份额之间的差额，计入丧失控制权当期的投资收益，同时冲减商誉。与原有子公司股权投资相关的其他综合收益、其他所有者权益变动，在丧失控制权时转为当期投资收益，由于被投资方重新计量设定受益计划净负债或净资产变动而产生的其他综合收益除外。

通过多次交易分步处置对子公司股权投资直至丧失控制权的，需考虑各项交易是否构成一揽子交易，处置对子公司股权投资的各项交易的条款、条件以及经济影响符合以下一种或多种情况，表明应将多次交易事项作为一揽子交易进行会计处理：（1）这些交易是同时或者在考虑了彼此影响的情况下订立的；（2）这些交易整体才能达成一项完整的商业结果；（3）一项交易的发生取决于其他至少一项交易的发生；（4）一项交易单独看是不经济的，但是和其他交易一并考虑时是经济的。

不属于一揽子交易的，对其中每一项交易分别按照前述进行会计处理；若各项交易属于一揽子交易的，将各项交易作为一项处置子公司并丧失控制权的交易进行会计处理；但是，在丧失控制权之前每一次处置价款与处置投资对应的享有该子公司净资产份额的差额，在合并财务报表中确认为其他综合收益，在丧失控制权时一并转入丧失控制权当期的损益。

## 7. 合营安排分类及共同经营会计处理方法

合营安排分为共同经营和合营企业。共同经营，是指合营方享有该安排相关资产且承担该安排相关负债的合营安排。合营企业，是指合营方仅对该安排的净资产享有权利的合营安排。

共同经营的合营方应当确认其与共同经营中利益份额相关的下列项目，并按照相关企业会计准则的规定进行会计处理：（一）确认单独所持有的资产，以及按其份额确认共同持有的资产；（二）确认单独所承担的负债，以及按其份额确认共同承担的负债；（三）确认出售其享有的共同经营产出份额所产生的收入；（四）按其份额确认共同经营因出售产出所产生的收入；（五）确认单独所发生的费用，以及按其份额确认共同经营发生的费用。

合营方向共同经营投出或出售资产等（该资产构成业务的除外），在该资产等由共同经营出售给第三方之前，应当仅确认因该交易产生的损益中归属于共同经营其他参与方的部分。投出或出售的资产发生符合《企业会计准则第 8 号——资产减值》等规定的资产减值损失的，合营方应当全额确认该损失。

合营方自共同经营购买资产等（该资产构成业务的除外），在将该资产等出售给第三方之前，应当仅确认因该交易产生的损益中归属于共同经营其他参与方的部分。购入的资产发生符合《企业会计准则第 8 号——资产减值》等规定的资产减值损失的，合营方应当按其承担的份额确认该部分损失。

对共同经营不享有共同控制的参与方，如果享有该共同经营相关资产且承担该共同经营相关负债的，应当按照前述规定进行会计处理。

## 8. 现金及现金等价物的确定标准

现金及现金等价物包括库存现金、可以随时用于支付的存款以及持有期限短、流动性强、易于转换为已知金额现金、价值变动风险很小的投资。

## 9. 外币业务和外币报表折算

### （1）外币交易的会计处理

发生外币交易时，采用交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。于资产负债表日，外币货币性项目采用资产负债表日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，除根据借款费用核算方法应予资本化的，计入当期损益。以历史成本计量的外币非货币性项目，于资产负债表日仍采用交易发生日的即期汇率折算。

### （2）外币财务报表的折算

境外经营的资产负债表中的资产和负债项目，采用资产负债表日的即期汇率折算，股东权益项目除未分配利润项目外，其他项目采用发生时的即期汇率折算。境外经营的利润表中的收入和费用项目，采用年平均汇率折算。上述折算产生的外币报表折算差额，在其他综合收益中单独列示。

## 10. 金融工具

### （1）金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时，按照公司取得金融资产的目的，划分为下列四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，包括交易性金融资产和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；持有至到期投资；贷款和应收款项以及可供出售金融资产。

金融负债在初始确认时划分为下列两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；其他金融负债。

#### 1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债

包括交易性金融资产和交易性金融负债，以及公司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和金融负债。

交易性金融资产和金融负债包括：公司为了近期内出售、回购或赎回而持有的金融资产或承担的金融负债；衍生工具，但是被指定且为有效套期工具的衍生工具、属于财务担保合同的衍生工具、与在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生工具除外。

只有符合以下条件之一的金融资产或金融负债，才可在初始确认时被直接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或金融负债：

①该指定可以消除或明显减少由于该金融工具的计量基础不同所导致的相关利得或损失在确认或计量方面不一致的情况。

②风险管理或投资策略的正式书面文件已载明，该金融工具组合以公允价值为基础进行管理、评价并向关键管理人员报告。

③混合金融工具，除非嵌入衍生工具对混合工具的现金流量没有重大改变，或所嵌入的衍生工具明显不应当从相关混合工具中分拆。

④包含需要分拆但无法在取得时或后续的资产负债表日对其进行单独计量的嵌入衍生工具的混合工具。

#### 2、持有至到期投资

持有至到期投资，是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且公司有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

如公司将尚未到期的某项持有至到期投资在本会计年度内出售或重分类为可供出售金融资产，其金额占全部持有至到期投资在出售或重分类前总额的 5%时，其剩余部分也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得再将该金融资产划分为持有至到期投资。但是，下列情况除外：

①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。

②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。

③出售或重分类是由于公司无法控制、预期不会重复发生且难以合理预计的独立事项所引起。



### 3、贷款和应收款项

贷款和应收款项，是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### 4、可供出售金融资产

可供出售金融资产，是指初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产，以及除划分为贷款和应收款项、持有至到期投资、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的其他金融资产。

### 5、其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的非衍生金融负债。

#### (2) 金融资产和金融负债的确认、终止确认和计量方法

##### 1、确认和终止确认：

公司成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

##### 2、初始计量：

初始确认的金融资产或金融负债，按照公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

企业取得金融资产所支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的债券利息或现金股利，应当单独确认为应收项目进行处理。

##### 3、后续计量：

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，公允价值变动形成的利得或损失，计入当期损益；持有期间实现的利息或现金股利计入投资收益；处置时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应当确认为投资收益，同时调整公允价值变动损益。

②持有至到期投资在持有期间按摊余成本和实际利率确认利息收入，计入投资收益；处置该项金融资产时，应将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益。

③贷款和应收款项按摊余成本计量，占用期间按实际利率法确认收益。

④可供出售金融资产公允价值变动形成的利得或损失，除减值损失和外币货币性金融资产形成的汇兑差额外，计入其他综合收益；可供出售金融资产持有期间实现的利息或现金股利计入当期损益；处置该金融资产时，应将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益，同时将原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

⑤其他金融负债，以实际利率法计算的摊余成本进行后续计量。在其终止确认或摊销时产生的利得或损失，均计入当期损益。

⑥在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产或金融负债，按照成本计量。

### （3）金融资产和金融负债公允价值的确定

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产或者转移一项负债所需支付的价格。公司以主要市场的价格计量相关资产或负债的公允价值；不存在主要市场的，以最有利市场的价格计量相关资产或负债的公允价值。在确定公允价值时，公司采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

#### 1、公允价值确定的基本原则：

①对存在活跃市场的金融资产或金融负债，采用活跃市场中的报价确定其公允价值。如估值日有市价，以估值日收盘价作为公允价值。如估值日无成交价、且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日收盘价作为公允价值；如估值日无成交价、且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，在谨慎原则的基础上采用适当的估值技术，审慎确定公允价值。

②对不存在活跃市场的金融资产或金融负债，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。

公司使用的估值技术主要包括市场法、收益法和成本法。估值技术的应用中，公司优先使用相关可观察输入值，只有在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

对于以公允价值计量的金融负债，公司已考虑不履约风险，并假定不履约风险在负债转移前后保持不变。不履约风险是指企业不履行义务的风险，包括但不限于企业自身信用风险。

#### 2、公允价值层次：

公司对于以公允价值计量的资产和负债，按照其公允价值计量所使用的输入值分为以下三个层次：

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

第二层次：输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

### （4）金融资产减值

公司在资产负债表日对以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以外的金融资产的账面价值进行检查，判定是否发生减值：

#### 1、可供出售金融资产：

股票等权益类：资产负债表日，如果单个可供出售金融资产公允价值下跌幅度超过其持有成本的50%，或持续下跌时间在一年以上，预期这种下降趋势属于非暂时性的，可以认定该可供出售金融资产已发生减值。

债券等固定收益类：如果单个可供出售金融资产出现以下减值迹象，可以认定该可供出售金融资产已发生减值：

- ① 发行方或债务人发生严重财务困难；
- ② 债务人违反了合同条款，如偿付利息或本金发生违约或逾期等；
- ③ 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- ④ 因发行方发生重大财务困难，该金融资产无法在活跃市场继续交易；
- ⑤ 其他表明金融资产发生减值的客观证据。

可供出售金融资产发生减值时，即使该金融资产没有终止确认，原直接计入所有者权益（其他综合收益）的因公允价值下降形成的累计损失，应当予以转出，计入当期损益。该转出的累计损失，为可供出售金融资产的初始取得成本扣除已收回本金和已摊销金额、当前公允价值和原已计入损益的减值损失后的余额。

对于已确认减值损失的可供出售债务工具，在随后的会计期间公允价值已上升且客观上与确认原减值损失确认后发生的事项有关的，原确认的减值损失应当予以转回，计入当期损益。

可供出售权益工具投资发生的减值损失，不得通过损益转回。但是在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，或与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产发生的减值损失，不得转回。

## 2、以摊余成本计量的金融资产：

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，将该金融资产的账面价值减记至预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益。

对以摊余成本计量的金融资产确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关（如债务人的信用评级已提高等），原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。具体减值方法如下：

① 应收款项减值的方法，参见附注 3：3.11。

② 持有至到期投资、贷款的减值测试采用未来现金流折现法，资产负债表日，对于持有至到期投资、贷款，收集债务人的经营和信用状况，如果按合同或协议没有收到款项或利息，或债务人发生财务困难的，将根据其账面价值与预计未来现金流量现值之间差额计算确认减值损失。

③ 以成本计量的金融资产：在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的金融资产投资，或与该金融资产挂钩并须通过交付该金融资产结算的衍生金融资产发生减值时，应当将该金融资产投资或衍生金融资产的账面价值，与按照类似金融资产当时市场收益率对未来现金流量折现确定的现值之间的差额，确认为减值损失，计入当期损益。

## (5) 金融资产转移的确认依据和计量方法

公司发生金融资产转移时，如已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方，则终止确认该金融资产；如保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，则不终止确认该金融资产。在判断金融资产转移是否满足企业准则规定的金融资产终止确认条件时，采用实质重于形式的原则。公司将金融资产转移区分为金融资产整体转移和部分转移。

1、金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：

①所转移金融资产的账面价值；

②因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益（其他综合收益）的公允价值变动累计额（涉及转移的金融资产为可供出售金融资产的情形）之和。

2、金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和未终止确认部分之间，按照各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项的差额计入当期损益：

①终止确认部分的账面价值；

②终止确认部分的对价，与原直接计入所有者权益（其他综合收益）的公允价值变动累计额所对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为可供出售金融资产的情形）之和。

金融资产转移不满足终止确认条件的，继续确认该金融资产，所收到的对价确认为一项金融负债。

#### （6）金融资产和金融负债的抵销

当具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

金融资产和金融负债在本公司成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

## 11. 应收款项

| 单项金额重大的判断依据或金额标准     | 余额超过 1,000 万元确认为重大  |
|----------------------|---|
| 单项金额重大并单项计提坏账准备的计提方法 | 公司对于单项金额重大（余额超过 1,000 万元确认为重大）的应收款项，单独进行减值测试。有客观证据表明其发生了减值的，公司根据其未来现金流量现值低于其账面价值的差额，确认减值损失，计提坏账准备。短期应收款项的预计未来现金流量与其现值相差很小的，在确定相关减值损失时，可不对其预计未来现金流量进行折现。 |

对于单项金额非重大的应收款项可以单独进行减值测试，确定减值损失，计提坏账准备；也可以与经单独测试后未减值的应收款项一起按类似信用风险特征划分为若干组合，再按这些应收款项组合在资产负债表日余额的一定比例计提确定减值损失，计提坏账准备。根据应收款项组合余额的一定比例计算确定的坏账准备，应当反映各项目实际发生的减值损失，即各项组合的账面价值超过其未来现金流量现值的金额。

公司一般性应收款项坏账损失的核算方法：坏账损失采用备抵法核算，根据债务单位的财务状况、现金流量等情况，每年年度终了时对应收款项按账龄分析法结合个别认定计提坏账准备，坏账准备的计提比例列示如下：

| 账 龄  | 计提比例 |
|------|------|
| 三年以上 | 70%  |

## 12. 客户交易结算资金的核算

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

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

## 13. 承销证券业务的核算

(1) 公司承销证券时，在证券发行日根据承销合同确认的证券发行总额，按承销价款，在备查簿中记录承销证券的情况。

(2) 承销证券结束，将承销证券款交付委托单位并确认承销手续费。

(3) 承销期结束，如有未售出证券、采用余额包销方式承销证券的，按合同规定由公司认购，应按承销价款转为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或可供出售金融资产等科目。

## 14. 买入返售和卖出回购业务的核算

买入返售交易按照合同或协议的约定，以一定的价格向交易对手买入相关资产（包括股票、债券、票据等），合同或协议到期日，再以约定价格返售相同之金融产品。

卖出回购交易按照合同或协议的约定，以一定的价格将相关资产（包括股票、债券、票据等）出售给交易对手，合同或协议到期日，再以约定价格回购相同之金融产品。

买入返售及卖出回购业务按发生时实际支付或收到的款项入账，并在资产负债表中确认；买入返售的标的资产在表外作备查登记，卖出回购的标的资产仍在资产负债表中确认。买入返售及卖出回购业务分别按合同利率在返售或回购期间内确认为利息收入和利息支出。

## 15. 融资融券业务的核算

融资融券业务，是指证券公司向客户出借资金供其买入上市证券或者出借上市证券供其卖出，并收取担保物的经营活动。融资融券业务类型主要包括融资业务和融券业务。

融资业务：公司将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。融出资金按借给客户资金的本金计量。

融券业务：将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，此项业务融出的证券不满足终止确认条件，继续确认该金融资产，计入融出证券。

融资融券利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等按期确认利息收入。

证券公司对客户融资融券并代理客户买卖证券时，作为证券经纪业务进行会计处理。

## 16. 信用交易业务风险准备计提办法

公司信用交易业务，包括融资融券业务、约定购回业务和股票质押回购业务。资产负债表日对信用交易业务按比例法结合个别认定法计提风险准备，比例法按信用交易业务的类别分别计提，计

提标准为融资融券业务规模(包括融出资金余额和融出证券成本)的 0.2%、约定购回业务规模的 0.3%、股票质押回购业务规模的 0.5%。

### 17. 转融通业务核算办法

转融通业务包括转融资业务和转融券业务。转融资业务是指中国证券金融股份有限公司(以下简称证金公司)将自有或者依法筹集的资金出借给证券公司,供其办理融资业务的经营。转融券业务是指证金公司将自有或者融入的证券出借给证券公司,供其办理融券业务的经营。

转融资业务:对于融入的资金,证券公司在资产负债表内确认为资产,同时确认一项对出借方的负债,计入“拆入资金”科目,并在“利息支出”科目核算转融通业务产生的利息费用。

转融券业务:对于融入的证券,由于其主要收益或风险不由证券公司享有或承担,公司不将其计入资产负债表,但在财务报表附注“其他需要说明的重要事项”中披露转融通融入的证券期末市值和转融通融入后拆借给客户的证券期末市值,未融出证券期末市值等信息。

### 18. 长期股权投资

#### (1) 控制、共同控制、重大影响的判断标准

控制是指投资方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。共同控制是指按照相关约定对某项安排所共有的控制,并且该安排的相关活动必须经过分享控制权的参与方一致同意后才能决策。重大影响是指对被投资方的财务和经营政策有参与决策的权力,但并不能够控制或者与其他方一起共同控制这些政策的制定。在确定能否对被投资单位实施控制或施加重大影响时,已考虑投资方和其他方持有的被投资单位当期可转换公司债券、当期可执行认股权证等潜在表决权因素。

#### (2) 投资成本确定

##### ①企业合并形成的长期股权投资,按以下方法确定投资成本:

A、对于同一控制下企业合并形成的对子公司投资,以在合并日取得被合并方所有者权益在最终控制方合并财务报表中账面价值的份额作为长期股权投资的投资成本。

分步实现的同一控制下企业合并,在合并日根据合并后应享有被合并方净资产在最终控制方合并财务报表中的账面价值的份额,确定长期股权投资的初始投资成本;初始投资成本与达到合并前长期股权投资账面价值加上合并日进一步取得股份新支付对价的账面价值之和的差额,调整资本公积(资/股本溢价),资本公积不足冲减的,冲减留存收益。合并日之前持有的股权投资,因采用权益法核算或金融工具确认和计量准则核算而确认的其他综合收益暂不进行会计处理,直至处置该项投资时采用与投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理;因采用权益法核算而确认的被投资单位净资产总除净损益、其他综合收益和利润分配以外的所有者权益其他变动,暂不进行会计处理,直至处置该项投资时转入当期损益。其中,处置后的剩余股权根据本准则采用成本法或权益法核算的,其他综合收益和其他所有者权益应按比例结转,处置后的剩余股权改按金融工具确认和计量准则进行会计处理的,其他综合收益和其他所有者权益应全部结转。

B、对于非同一控制下企业合并形成的对子公司投资,以企业合并成本作为投资成本。

追加投资能够对非同一控制下的被投资单位实施控制的，以购买日之前所持被购买方的股权投资的账面价值与购买日新增投资成本之和，作为改按成本法核算的初始投资成本；购买日之前持有的被购买方的股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，在处置该项投资时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。购买日之前持有的股权投资按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》有关规定进行会计处理的，原计入其他综合收益的累计公允价值变动应当在改按成本法核算时转入当期损益。

②除企业合并形成的长期股权投资以外，其他方式取得的长期股权投资，按以下方法确定投资成本：

A、以支付现金取得的长期股权投资，按实际支付的购买价款作为投资成本。

B、以发行权益性证券取得的长期股权投资，按发行权益性证券的公允价值作为投资成本。

③因追加投资等原因，能够对被投资单位单位施加重大影响或实施共同控制但不构成控制的，应当按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》确定的原持有股权的公允价值加上新增投资成本之和，作为改按权益法核算的初始投资成本。原持有的股权投资分类为可供出售金融资产的，其公允价值与账面价值之间的差额，以及原计入其他综合收益的累计公允价值变动应当转入改按权益法核算的当期损益。

### （3）后续计量及损益确认方法

#### ①对子公司投资

在合并财务报表中，对子公司投资按附注 3：3.05 进行处理。

在母公司财务报表中，对子公司投资采用成本法核算，在被投资单位宣告分派的现金股利或利润时，确认投资收益。

#### ②对合营企业投资和对联营企业投资

对合营企业投资和对联营企业投资采用权益法核算，具体会计处理包括：

对于初始投资成本大于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额包含在长期股权投资成本中；对于初始投资成本小于投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值份额的，其差额计入当期损益，同时调整长期股权投资成本。

取得对合营企业投资和对联营企业投资后，按照应享有或应分担的被投资单位实现的净损益和其他综合收益的份额，分别确认投资损益和其他综合收益并调整长期股权投资的账面价值；按照被投资单位宣告分派的现金股利或利润应分得的部分，相应减少长期股权投资的账面价值。

在计算应享有或应分担的被投资单位实现的净损益的份额时，以取得投资时被投资单位可辨认净资产的公允价值为基础确定，对于被投资单位的会计政策或会计期间与本公司不同的，权益法核算时按照本公司的会计政策或会计期间对被投资单位的财务报表进行必要调整。与合营企业和联营企业之间内部交易产生的未实现损益按照持股比例计算归属于本公司的部分，在权益法核算时予以抵消。内部交易产生的未实现损失，有证据表明该损失是相关资产减值损失的，则全额确认该损失。

对合营企业或联营企业发生的净亏损，除本公司负有承担额外损失义务外，以长期股权投资的账面价值以及其他实质上构成对被投资单位净投资的长期权益减记至零为限。被投资企业以后实现净利润的，在收益分享额弥补未确认的亏损分担额后，恢复确认收益分享额。

对于被投资单位除净损益、其他综合收益和利润分配以外所有者权益的其他变动，调整长期股权投资的账面价值并计入资本公积。处置该项投资时，将原计入资本公积的部分按相应比例转入当期损益。

减值方法及减值准备计提方法参见附注 3：3.24。

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

因处置部分权益性投资等原因丧失了对被投资单位共同控制或重大影响的，处置后的剩余股权按《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》核算，其在丧失共同控制或重大影响之日的公允价值与账面价值间的差额计入当期损益。原股权投资因采用权益法核算而确认的其他综合收益，应当在终止采用权益法核算时采用与被投资单位直接处置相关资产或负债相同的基础进行会计处理。

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

## 19. 固定资产

### (1). 确认条件

固定资产是指为提供劳务、出租或经营管理而持有的并且使用年限超过一年的有形资产。固定资产在取得时，按取得时的成本入账。与购买或建造固定资产有关的一切直接或间接成本，在所购建资产达到预定可使用状态前所发生的，全部资本化为固定资产的成本。固定资产折旧采用直线法平均计算，并按固定资产的原值扣除残值和其预计使用年限制定折旧率。

### (2). 折旧方法

| 类别      | 折旧方法      | 折旧年限(年) | 残值率(%) | 年折旧率(%)   |
|---------|-----------|---------|--------|-----------|
| 房屋建筑物   | 采用直线法平均计算 | 30~35   | 3~5    | 2.71~3.23 |
| 运输设备    | 采用直线法平均计算 | 5~10    | 3~5    | 9.5~19.4  |
| 办公设备及其他 | 采用直线法平均计算 | 5       | 3~5    | 19~19.4   |

减值测试方法及会计处理方法参见附注 3：3.24。

当固定资产处于处置状态或预期通过使用或处置不能产生经济利益时，终止确认该固定资产。固定资产出售、转让、报废或毁损的处置收入扣除其账面价值和相关税费后的差额计入当期损益。

## 20. 在建工程

在建工程按实际成本计量，实际成本包括在建期间发生的各项工程支出、工程达到预定可使用状态前的资本化的借款费用以及其他相关费用等。在建工程不计提折旧。



当所建工程项目达到预定可使用状态时，转入固定资产核算；尚未办理竣工决算的，按估计价值转帐，待办理竣工决算手续后再作调整。

在建工程减值方法及会计处理方法参见附注 3：3.24。

## 21. 无形资产

无形资产是指本公司拥有或者控制的没有实物形态的可辨认非货币性资产。

无形资产按照成本进行初始计量。

使用寿命有限的无形资产，自其可供使用时起在使用寿命内采用年限平均法摊销，计入当期损益；摊销年限分别为：土地使用权 40 年、交易席位费 10 年和软件 5 年。每年年度终了，对其使用寿命及摊销方法进行复核，若与以前估计不同的，改变摊销期限和摊销方法。

使用寿命不确定的无形资产不摊销；在每个会计期间对其使用寿命进行复核，如果有证据表明其使用寿命是有限的，估计其使用寿命并按上述方法进行摊销。截至资产负债表日，公司无使用寿命不确定的无形资产。

## 22. 商誉的核算办法

因非同一控制下企业合并形成的商誉，其初始成本是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。对商誉不摊销，以其成本扣除累计减值准备后的金额计量。商誉在其相关资产组或资产组组合处置时予以转出，计入当期损益。商誉的减值方法及会计处理方法参见附注 3、24。

## 23. 长期待摊费用的核算方法

长期待摊费用按实际发生额入账，按费用项目的受益期限采用直线法平均摊销。公司对以经营租赁方式租入的固定资产改良支出，其发生符合资本化条件的各项支出，计入本项目，按剩余租赁期与 5 年两者中较短的期限平均摊销。如果 5 年内同一经营租入固定资产又发生类似改良支出，将上次未摊完的长期待摊费用余额一次性计入当期损益。

## 24. 除金融资产外的其他资产减值

在资产负债表日检查长期股权投资、固定资产、在建工程及使用寿命确定的无形资产是否存在可能发生减值的迹象；如果该等资产存在减值迹象，则估计其可收回金额。使用寿命不确定的无形资产，无论是否存在减值迹象，每年均进行减值测试。

估计资产的可收回金额以单项资产为基础，如果难以对单项资产的可收回金额进行估计的，则以该资产所属的资产组为基础确定资产组的可收回金额。可收回金额为资产或者资产组的公允价值减去处置费用后的净额与其预计未来现金流量的现值两者之中的较高者。如果资产的可收回金额低于其账面价值，按其差额计提资产减值准备，并计入当期损益。

商誉至少在每年年度终了进行减值测试。对商誉进行减值测试时，结合与其相关的资产组或者资产组组合进行。即，自购买日起将商誉的账面价值按照合理的方法分摊到能够从企业合并的协同效应中受益的资产组或资产组组合，如包含分摊的商誉的资产组或资产组组合的可收回金额低于其账面价值的，确认相应的减值损失。减值损失金额首先抵减分摊到该资产组或资产组组合的商誉的

账面价值，再根据资产组或资产组组合中除商誉以外的其他各项资产的账面价值所占比重，按比例抵减其他各项资产的账面价值。

上述资产减值损失一经确认，在以后会计期间不予转回。

## 25. 职工薪酬

职工薪酬包括短期薪酬、离职后福利、辞退福利和其他长期职工福利。公司在职工提供服务的会计期间，将应付的职工薪酬确认为负债。

公司按规定参加由政府机构设立的职工社会保障体系，包括基本养老保险、医疗保险、住房公积金及其他社会保障制度，相应的支出于发生时计入相关资产成本或当期损益。

在职工劳动合同到期之前解除与职工的劳动关系，或为鼓励职工自愿接受裁减而提出给予补偿的建议，本公司在下列两者孰早日确认辞退福利产生的职工薪酬负债，并计入当期损益：本公司不能单方面撤回因解除劳动关系计划或裁减建议所提供的辞退福利时；本公司确认与涉及支付辞退福利的重组相关的成本或费用时。

## 26. 预计负债

(1) 与或有事项相关的义务同时满足下列条件的，应当确认为预计负债：

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

(2) 预计负债按照履行相关现时义务所需支出的最佳估计数进行初始计量。

如所需支出存在一个连续范围，且该范围内各种结果发生的可能性相同的，最佳估计数按照该范围内的中间值确定。

在其他情况下，最佳估计数分别下列情况处理：

- ①或有事项涉及单个项目的，按照最可能发生金额确定。
- ②或有事项涉及多个项目的，按照各种可能结果及相关概率计算确定。

## 27. 收入

(1) 手续费及佣金收入

代理客户买卖证券业务：在与客户办理买卖证券款清算时确认收入。其中，出租交易单元租金收入、代销金融产品佣金收入按双方确认的金额，在收到价款或取得收取价款的凭证时确认收入。

证券承销业务：按证券发行方式分别确认。A、全额包销方式，将证券转售给投资者时，按发行价格抵减承购价确认为发行收入；B、余额包销、代销方式，代发行证券的手续费收入在发行期结束后，与发行人结算发行价款时确认；C、有合同约定的按相关条款确认收入。

保荐业务：按照提供劳务收入确认条件，在提供劳务交易的结果能够可靠估计时确认。

财务顾问业务和投资咨询服务业务：按照提供劳务收入确认条件，在提供劳务交易的结果能够可靠估计时确认。

资产管理业务：于受托投资管理合同到期，与委托人结算时，公司按合同规定的比例计算应由公司享有的管理费收益，确认为当期收益；或合同中规定公司按约定比例收取管理费和业绩报酬，则在合同期内分期确认管理费和业绩报酬收益。

期货经纪业务：按照与客户签订的期货合约中有关手续费收取标准向客户收取的相关手续费，在扣除上缴给交易所的手续费后，公司按其净额确认手续费收入。

基金管理业务：在相关服务提供后，按合同约定方式确认当期收入。

## （2）投资收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，公允价值变动形成的利得或损失，计入当期损益；持有期间实现的利息或现金股利计入投资收益；处置该金融资产时取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益，同时调整公允价值变动收益。

可供出售金融资产公允价值变动形成的利得或损失，除减值损失和外币货币性金融资产形成的汇兑差额外，计入其他综合收益；可供出售金融资产持有期间实现的利息或现金股利计入当期损益；处置该金融资产时，取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益，同时将原直接计入资本公积的公允价值变动累计额对应处置部分的金额转出，计入投资收益。

持有至到期投资在持有期间按摊余成本和实际利率确认利息收入，计入投资收益；处置该项金融资产时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资收益。

采用成本法核算的长期股权投资，被投资单位宣告分配的现金股利或利润，确认为当期投资收益；采用权益法核算的长期股权投资，根据被投资单位实现的净利润或经调整的净利润计算应享有的份额确定投资收益。

## （3）利息收入

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

买入返售证券收入：在当期到期返售的，按返售价格与买入成本价格的差额，确认为当期收入；在当期没有到期的，期末按摊余成本和实际利率计提利息确认为当期收入。实际利率与合同约定利率差别较小的，按合同约定利率确认为当期收入。

融资融券业务利息收入：根据融资融券业务中与客户协议确定的融资融券金额（额度）、期限、利率等按期确认利息收入。

（4）其他业务收入：以合同签订并执行到期时、劳务已提供、资产已转让并收到价款或取得收取价款的凭证时确认收入。

## 28. 政府补助

政府补助是指本公司从政府无偿取得货币性资产和非货币性资产，不包括政府作为所有者投入的资本。政府补助分为与资产相关的政府补助和与收益相关的政府补助。本公司将所取得的用于购

建或以其他方式形成长期资产的政府补助界定为与资产相关的政府补助；其余政府补助界定为与收益相关的政府补助。

政府补助为货币性资产的，按照收到或应收的金额计量。政府补助为非货币性资产的，按照公允价值计量；公允价值不能够可靠取得的，按照名义金额计量。

政府补助同时满足下列条件的，予以确认：（1）企业能够满足政府补助所附条件；（2）企业能够收到政府补助。

与收益相关的政府补助，如果用于补偿本公司以后期间的相关费用或损失的，确认为递延收益，并在确认相关费用的期间，计入当期损益；如果用于补偿本公司已发生的相关费用或损失的，直接计入当期损益。

与资产相关的政府补助，确认为递延收益，并在相关资产使用寿命内平均分配，计入当期损益。但是，按照名义金额计量的政府补助，直接计入当期损益。

## 29. 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会计处理。

除与直接计入股东权益的交易或事项有关的所得税影响计入股东权益外，当期所得税费用和递延所得税费用（或收益）计入当期损益。

当期所得税费用是按本年度应纳税所得额和税法规定的税率计算的预期应交所得税，加上对以前年度应交所得税的调整。

资产负债表日，如果纳税主体拥有以净额结算的法定权利并且意图以净额结算或取得资产、清偿负债同时进行，那么当期所得税资产及当期所得税负债以抵销后的净额列示。

递延所得税资产和递延所得税负债分别根据可抵扣暂时性差异和应纳税暂时性差异确定，按照预期收回资产或清偿债务期间的适用税率计量。暂时性差异是指资产或负债的账面价值与其计税基础之间的差额，包括能够结转以后年度抵扣的亏损和税款递减。递延所得税资产的确认以很可能取得用来抵扣暂时性差异的应纳税所得额为限。

对于既不影响会计利润也不影响应纳税所得额（或可抵扣亏损）的非企业合并交易中产生的资产或负债初始确认形成的暂时性差异，不确认递延所得税。商誉的初始确认导致的暂时性差异也不产生递延所得税。

资产负债表日，根据递延所得税资产和负债的预期收回或结算方式，依据已颁布的税法规定，按照预期收回该资产或清偿该负债期间的适用税率计量该递延所得税资产和负债的账面金额。

资产负债表日，递延所得税资产及递延所得税负债在同时满足以下条件时以抵销后的净额列示：

（1）纳税主体拥有以净额结算当期所得税资产及当期所得税负债的法定权利；

（2）递延所得税资产及递延所得税负债是与同一税收征管部门对同一纳税主体征收的所得税相关或者是对不同的纳税主体相关，但在未来每一具有重要性的递延所得税资产及负债转回的期间内，涉及的纳税主体意图以净额结算当期所得税资产和负债或是同时取得资产、清偿负债。

### 30. 经营租赁

#### 经营租赁的会计处理方法

##### (1) 租入资产

经营租赁租入资产的租金费用在租赁期内按直线法确认为相关资产成本或费用。或有租金在实际发生时计入当期损益。

##### (2) 租出资产

经营租赁租出资产所产生的租金收入在租赁期内按直线法确认为收入。经营租赁租出资产发生的初始直接费用，直接计入当期损益。或有租金在实际发生时计入当期损益。

### 31. 利润分配

当年实现的税后利润于弥补以前年度亏损后，公司根据《公司法》的规定，按照当年税后利润的 10% 足额提取法定盈余公积金，但公司法定盈余公积金累计额达到公司注册资本的 50% 时，可不再提取；根据《金融企业财务规则》的要求，按照税后利润的 10% 足额提取一般风险准备；根据《证券法》的要求，按不低于税后利润的 10% 提取交易风险准备金。经股东大会批准，公司可从税后利润中提取任意盈余公积金。

公司提取的一般风险准备金及交易风险准备金计入“一般风险准备”项目核算，用于弥补证券交易的损失。经股东大会批准，公司提取的法定盈余公积金和任意盈余公积金可用于弥补公司的亏损或者转增股本，但法定盈余公积金转为股本时，所留存的该项公积金不得少于转增前公司注册资本的 25%。

公司资本公积金不得用于弥补公司的亏损。

公司可供分配利润中公允价值变动收益部分，不得用于向股东进行现金分配。以前年度未分配利润，可并入当年度未分配利润向股东分配。

### 32. 分部信息

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本公司内满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 公司管理层能够定期评价该组成部分的经营业绩，以决定向其分配资源、评价业绩；(3) 能够取得该部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相同或相类似的经济特征，并且满足一定条件，本公司将其合并为一个经营分部。

### 33. 运用会计政策过程中所作的重要判断和会计估计所采用的关键假设和不确定因素

运用上述会计政策过程中，由于经营活动内在的不确定性，公司需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入及费用的金额产生影响。公司管理层对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计

估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。导致出现重大调整风险的重要会计估计和关键假设如下：

(1) 应用会计政策过程中所作的重要判断

1、金融资产的分类

公司需要在金融资产初始确认时根据其性质及持有意图对金融资产进行分类，由于不同金融资产类别的后续计量方法存在差异，金融资产的分类对公司的财务状况和经营成果将产生影响。

2、合并范围的确定

评估本公司是否作为投资者控制被投资企业时须考虑所有事实及情况。控制的定义包含以下三项要素：①拥有对被投资者的权力；②通过参与被投资者的相关活动而享有可变回报；③有能力运用对被投资者的权力影响其回报的金额。倘若有事实及情况显示上述一项或多项要素发生了变化，则公司需要重新评估其是否对被投资企业构成控制。对于公司管理并投资的结构化主体(如资产管理计划和基金等)，公司会评估其所持有结构化主体连同其管理人报酬所产生的可变回报的最大风险敞口是否足够重大以致表明本集团对结构化主体拥有控制权。在评估时，公司需要估计结构化主体收益率、管理费、业绩报酬以及持有份额等可变因素，进而测算本公司享有的可变回报及回报的可变性，以分析评估本公司是否达到控制标准。若公司对管理的结构化主体拥有控制权，则将结构化主体纳入合并财务报表的合并范围。

(2) 会计估计中采用的关键假设和不确定因素

1、金融资产的公允价值

对于缺乏活跃交易市场的金融工具，公司运用估值方法确定其公允价值。在估值时，公司需对诸如自身和交易对手的信用风险、市场波动率和相关性等方面进行估计，这些相关因素假设的变化会对金融工具的公允价值产生影响。

2、金融资产的减值

①可供出售金融资产的减值：在确定是否存在客观证据表明可供出售金融资产已发生减值时，公司需定期评估上述资产是否出现了公允价值严重或非暂时性低于其成本或账面价值，或者被投资方的财务状况和商业前景(例如行业前景、技术变革以及经营和融资现金流量)表明上述资产已发生减值的客观证据。这要求管理层运用大量判断，而判断会影响因此确认的减值损失的金额。

②应收款项的坏账准备：公司在资产负债表日对应收款项评估是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。减值的客观证据包括显示个别应收款项预计未来现金流量出现大幅下降的可观察数据、显示个别或组合应收款项中债务人财务状况出现重大负面变动的可观察数据等事项。如果有证据表明该应收款项的价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，则将原确认的减值损失或组合予以转回。

③信用交易业务风险准备：本公司在资产负债表日，对已形成风险的融资类业务所形成的债权(含融出资金、融出证券和买入返售金融资产等科目)，先按照个别认定法，单独进行减值测试，计提相应的减值准备。单独测试未发生减值的融资类债权，本公司参考同业风险事项影响及监管要求，

按照融资融券业务规模(包括融出资金余额和融出证券成本)的 0.2%、约定购回业务规模的 0.3%、股票质押回购业务规模的 0.5%计提减值准备。本公司将定期复核计提比例。

### 3、商誉减值

本公司每年对商誉进行减值测试。在进行减值测试时，需要将商誉分配到相应的资产组或资产组组合，并预计资产组或者资产组组合未来产生的现金流量，同时选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

### 4、除金融资产和商誉以外的其他资产减值

如附注 3: 3.24 所述，公司于资产负债表日对除金融资产和商誉之外的其他资产(固定资产、在建工程等)判断是否存在可能发生减值的迹象。在进行减值测试时，当资产或资产组的账面价值高于可收回金额，表明发生了减值。预计未来现金流量现值时，管理层必须估计该项资产或资产组的预计未来现金流量，并选择恰当的折现率确定未来现金流量的现值。

### 5、所得税

在正常的经营活动中，涉及的很多交易和事项的最终税务处理都存在不确定性，本公司根据相关税法法规谨慎判断交易对应的所得税影响并相应计提所得税。递延所得税资产只有在未来有足够纳税所得并可用于抵销有关暂时性差异时才可确认。对此需要就某些交易的税务处理作出重大判断。如果这些税务事项的最终认定结果与最初入账的金额存在差异，该差异将对作出上述最终认定期间的所得税费用和递延所得税的金额产生影响。

## 34. 重要会计政策和会计估计的变更

### (1)、重要会计政策变更

适用 不适用

公司本年度无重要会计政策变更事项。

### (2)、重要会计估计变更

适用 不适用

公司本年度无重要会计估计变更事项

## 附注 4、税项

### 1. 主要税种及税率

| 税种  | 计税依据  | 税率 |
|-----|---|----|
| 增值税 | 按应税收入的 6%计提销项税。   | 6% |
| 营业税 | 按应纳税营业额缴纳营业税，营业税税率为 5%。营业税实行就地缴纳的办法，本公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳营业税。根据财政部、国家税务总局财税[2006]172 号《关于证券投资保护基金有关营业税问题的通知》，准许证券公司上缴的证券投资基金投资者保护基金从其营业税计 | 5% |

|               | 税营业额中扣除。  |     |
|---------------|---|-----|
| 城市维护建设税       | 按流转税额的 7% 计征。城建税实行就地缴纳的办法，本公司所属各分支机构向当地税务部门申报缴纳城建税。 | 7%  |
| 企业所得税         | 按应纳税所得额计征。  | 25% |
| 教育费附加及地方教育费附加 | 按流转税额的 5% 计征。                                       | 5%  |

## 附注 5、合并财务报表项目注释

（下列项目如无特殊说明，均以 2015 年 12 月 31 日为截止日，金额以人民币元为货币单位）

### 1、货币资金

（1）按类别列示

| 项 目     | 期末余额                  | 期初余额                  |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 库存现金    | 138, 113. 95          | 282, 960. 09          |
| 银行存款    | 23, 393, 173, 557. 02 | 10, 219, 474, 795. 12 |
| 其中：客户存款 | 19, 694, 206, 086. 62 | 8, 182, 244, 138. 44  |
| 公司存款    | 3, 698, 967, 470. 40  | 2, 037, 230, 656. 68  |
| 其他货币资金  | 60, 867, 377. 39      | 30, 031, 891. 38      |
| 合 计     | 23, 454, 179, 048. 36 | 10, 249, 789, 646. 59 |

（2）按币种列示

单位：元

| 项目      | 期末               |         |                       | 期初               |         |                       |
|---------|------------------|---------|-----------------------|------------------|---------|-----------------------|
|         | 外币金额             | 折算率     | 折人民币金额                | 外币金额             | 折算率     | 折人民币金额                |
| 现金：     | /                | /       | 138, 113. 95          | /                | /       | 282, 960. 09          |
| 人民币     | /                | /       | 138, 113. 95          | /                | /       | 282, 960. 09          |
| 银行存款：   | /                | /       | 23, 393, 173, 557. 02 | /                | /       | 10, 219, 474, 795. 12 |
| 其中：自有资金 | /                | /       | 3, 698, 967, 470. 40  | /                | /       | 2, 037, 230, 656. 68  |
| 人民币     | /                | /       | 3, 676, 423, 262. 32  | /                | /       | 2, 023, 055, 743. 25  |
| 美元      | 3, 135, 054. 42  | 6. 4936 | 20, 357, 789. 38      | 2, 122, 836. 67  | 6. 1190 | 12, 989, 637. 58      |
| 港元      | 2, 609, 714. 37  | 0. 8378 | 2, 186, 418. 70       | 1, 502, 441. 18  | 0. 7889 | 1, 185, 275. 85       |
| 客户资金    | /                | /       | 19, 694, 206, 086. 62 | /                | /       | 8, 182, 244, 138. 44  |
| 人民币     | /                | /       | 19, 500, 917, 625. 87 | /                | /       | 8, 098, 874, 243. 82  |
| 美元      | 26, 487, 453. 90 | 6. 4936 | 171, 998, 930. 65     | 11, 710, 978. 81 | 6. 1190 | 71, 659, 479. 36      |
| 港元      | 25, 411, 231. 93 | 0. 8378 | 21, 289, 530. 10      | 14, 843, 979. 29 | 0. 7889 | 11, 710, 415. 26      |
| 其他货币资金： | /                | /       | 60, 867, 377. 39      | /                | /       | 30, 031, 891. 38      |
| 人民币     | /                | /       | 60, 867, 377. 39      | /                | /       | 30, 031, 891. 38      |
| 合 计     | /                | /       | 23, 454, 179, 048. 36 | /                | /       | 10, 249, 789, 646. 59 |

其中，融资融券业务：

√适用 □不适用

单位：元

| 项目 | 期末 | 期初 |
|----|----|----|
|----|----|----|



|        | 外币金额 | 折算率 | 折人民币<br>金额       | 外币金额 | 折算率 | 折人民币<br>金额     |
|--------|------|-----|------------------|------|-----|----------------|
| 自有信用资金 | /    | /   | 198,042,477.17   | /    | /   | 262,099,840.78 |
| 人民币    | /    | /   | 198,042,477.17   | /    | /   | 262,099,840.78 |
| 客户信用资金 | /    | /   | 1,818,730,526.67 | /    | /   | 673,596,486.07 |
| 人民币    | /    | /   | 1,818,730,526.67 | /    | /   | 673,596,486.07 |

### (3) 使用受限制的货币资金

使用受限制的货币资金为纳入合并范围内的子公司东吴基金管理有限公司和上海新东吴优胜资产管理有限责任公司计提的一般风险准备金和保证金。截至 2015 年 12 月 31 日，上述风险准备金和保证金余额为人民币 100,693,067.86 元。

## 2、 结算备付金

### (1) 按类别列示

| 项 目   | 期末余额             | 期初余额             |
|-------|------------------|------------------|
| 客户备付金 | 4,174,930,818.95 | 4,764,284,994.96 |
| 公司备付金 | 652,974,200.89   | 1,132,283,031.73 |
| 合 计   | 4,827,905,019.84 | 5,896,568,026.69 |

### (2) 按币种列示

单位：元

| 项目          | 期末           |        |                  | 期初           |        |                  |
|-------------|--------------|--------|------------------|--------------|--------|------------------|
|             | 外币金额         | 折算率    | 折人民币金额           | 外币金额         | 折算率    | 折人民币金额           |
| 自有备付金：      | /            | /      | 652,974,200.89   | /            | /      | 1,132,283,031.73 |
| 人民币         | /            | /      | 652,974,200.89   | /            | /      | 1,132,283,031.73 |
| 客户备付金：      | /            | /      | 4,174,930,818.95 | /            | /      | 4,764,284,994.96 |
| 人民币         | /            | /      | 4,115,386,467.22 | /            | /      | 4,731,149,491.50 |
| 美元          | 8,312,086.67 | 6.4936 | 53,975,366.00    | 4,647,509.62 | 6.1190 | 28,438,111.36    |
| 港元          | 6,647,154.13 | 0.8378 | 5,568,985.73     | 5,954,356.82 | 0.7889 | 4,697,392.10     |
| 其中：客户信用备付金： | /            | /      | 690,569,579.49   | /            | /      | 301,433,011.09   |
| 人民币         | /            | /      | 690,569,579.49   | /            | /      | 301,433,011.09   |
| 合 计         | /            | /      | 4,827,905,019.84 | /            | /      | 5,896,568,026.69 |

## 3、 融出资金

√适用□不适用

### (1) 按类别列示

| 项 目 | 期末余额 | 期初余额 |
|-----|------|------|
|-----|------|------|

|            |                   |                  |
|------------|-------------------|------------------|
| 融资融券业务融出资金 | 10,897,200,737.47 | 7,904,740,275.02 |
| 减：风险准备     | 21,794,401.47     | 15,809,480.55    |
| 融出资金净值     | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47 |

## (2) 按账龄分析

| 账 龄    | 期末余额              |        |               |        |
|--------|-------------------|--------|---------------|--------|
|        | 账面余额              |        | 风险准备          |        |
|        | 金 额               | 比例 (%) | 金 额           | 比例 (%) |
| 1-3 个月 | 2,819,584,063.00  | 25.87  | 5,639,168.13  | 0.20   |
| 3-6 个月 | 8,077,616,674.47  | 74.13  | 16,155,233.34 | 0.20   |
| 6 个月以上 | -                 | -      | -             | -      |
| 合 计    | 10,897,200,737.47 | 100.00 | 21,794,401.47 | 0.20   |

(续上表)

| 账 龄    | 期初余额             |        |               |        |
|--------|------------------|--------|---------------|--------|
|        | 账面余额             |        | 风险准备          |        |
|        | 金 额              | 比例 (%) | 金 额           | 比例 (%) |
| 1-3 个月 | 3,940,290,693.41 | 49.85  | 7,880,581.39  | 0.20   |
| 3-6 个月 | 3,964,449,581.61 | 50.15  | 7,928,899.16  | 0.20   |
| 6 个月以上 | -                | -      | -             | -      |
| 合 计    | 7,904,740,275.02 | 100.00 | 15,809,480.55 | 0.20   |

## (3) 按开户性质分

单位：元 币种：人民币

| 项目  | 期末账面余额            | 期初账面余额           |
|-----|-------------------|------------------|
| 个人  | 10,540,671,009.34 | 7,641,597,665.00 |
| 机构  | 334,735,326.66    | 247,333,129.47   |
| 合 计 | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47 |

## (4) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况：

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 担保物类别 | 期末公允价值            | 期初公允价值            |
|-------|-------------------|-------------------|
| 资金    | 1,071,539,549.47  | 475,328,208.48    |
| 股票    | 27,969,366,018.97 | 17,202,903,328.32 |
| 基金    | 32,642,403.93     | -                 |
| 合 计   | 29,073,547,972.37 | 17,678,231,536.80 |

(5) 截至 2015 年 12 月 31 日，本公司将上述融资融券业务中的部分债权收益权进行了质押式回购（参见附注 5：5.24）。

## 4、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

√适用□不适用

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

| 期末余额 |                   |                         |                   |                   |                         |                   |
|------|-------------------|-------------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|-------------------|
| 项目   | 公允价值              |                         |                   | 初始投资成本            |                         |                   |
|      | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计            | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 初始投资成本合计          |
| 债券   | 9,163,822,561.02  |                         | 9,163,822,561.02  | 8,866,375,897.81  |                         | 8,866,375,897.81  |
| 基金   | 3,090,530,405.63  |                         | 3,090,530,405.63  | 3,062,034,745.21  |                         | 3,062,034,745.21  |
| 股票   | 1,429,284,465.98  |                         | 1,429,284,465.98  | 1,354,467,835.35  |                         | 1,354,467,835.35  |
| 其他   | 539,190,078.17    |                         | 539,190,078.17    | 542,750,000.00    |                         | 542,750,000.00    |
| 合计   | 14,222,827,510.80 |                         | 14,222,827,510.80 | 13,825,628,478.37 |                         | 13,825,628,478.37 |
| 期初余额 |                   |                         |                   |                   |                         |                   |
| 项目   | 公允价值              |                         |                   | 初始投资成本            |                         |                   |
|      | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 公允价值合计            | 为交易目的而持有的金融资产     | 指定以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 初始投资成本合计          |
| 债券   | 15,280,600,319.73 |                         | 15,280,600,319.73 | 15,224,003,057.13 |                         | 15,224,003,057.13 |
| 基金   | 808,158,310.11    |                         | 808,158,310.11    | 803,677,844.47    |                         | 803,677,844.47    |
| 股票   | 641,067,740.91    |                         | 641,067,740.91    | 593,933,248.60    |                         | 593,933,248.60    |
| 其他   | 586,028,078.05    |                         | 586,028,078.05    | 587,500,000.00    |                         | 587,500,000.00    |
| 合计   | 17,315,854,448.80 |                         | 17,315,854,448.80 | 17,209,114,150.20 |                         | 17,209,114,150.20 |

(2) 明细分类

| 项目 | 期末账面余额           | 期末初始成本           | 期初账面余额            | 期初初始成本            |
|----|------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 债券 | 9,163,822,561.02 | 8,866,375,897.81 | 15,280,600,319.73 | 15,224,003,057.13 |
| 基金 | 3,090,530,405.63 | 3,062,034,745.21 | 808,158,310.11    | 803,677,844.47    |

|         |                   |                   |                   |                   |
|---------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 股票      | 1,429,284,465.98  | 1,354,467,835.35  | 641,067,740.91    | 593,933,248.60    |
| 信托计划    | -                 | -                 | 469,500,000.00    | 469,500,000.00    |
| 理财产品    | 429,765,098.17    | 442,750,000.00    | 116,528,078.05    | 118,000,000.00    |
| 资产证券化产品 | 109,424,980.00    | 100,000,000.00    | -                 | -                 |
| 合计      | 14,222,827,510.80 | 13,825,628,478.37 | 17,315,854,448.80 | 17,209,114,150.20 |

(3)截至 2015 年 12 月 31 日,公司持有的由公司及其子公司作为管理人的结构化产品情况如下:

| 项 目                        | 数量             | 初始成本             | 期末净值             |
|----------------------------|----------------|------------------|------------------|
| 东吴货币市场证券投资基金-东吴货币 B        | 853,191,138.04 | 853,191,138.04   | 853,191,138.04   |
| 嘉兴天然气收费收益权资产支持专项计划         | 800,000.00     | 80,000,000.00    | 88,031,440.00    |
| 东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金      | 4,990,519.96   | 5,000,000.00     | 4,990,519.96     |
| 新东吴优胜镇江交产 2 号专项资产管理计划      | 10,000,000.00  | 10,000,000.00    | 10,000,000.00    |
| 东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金         | 15,491,092.18  | 20,000,000.00    | 22,493,065.84    |
| 东吴鼎利分级债券型证券投资基金-鼎利进取       | 65,046,125.00  | 65,000,000.00    | 80,722,241.14    |
| 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) | 6,303,909.21   | 5,000,000.00     | 8,365,287.53     |
| 东吴优信稳健债券型证券投资基金-东吴优信 A     | 7,915,099.94   | 8,000,000.00     | 9,274,914.11     |
| 合计                         | 963,737,884.33 | 1,046,191,138.04 | 1,077,068,606.62 |

(4)截至 2015 年 12 月 31 日,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物,期末公允价值为 4,614,329,120.80 元,质押到期日为 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 3 月 28 日。

截至 2015 年 12 月 31 日,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无被用作转融通业务的担保物。

(5)截至 2015 年 12 月 31 日,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无融出证券。

(6)上述以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东作为发起人的金融资产。

## 5、衍生金融工具

√适用□不适用

单位:元 币种:人民币

| 类别            | 期末   |      |    |              |      |    | 期初   |      |    |       |      |    |
|---------------|------|------|----|--------------|------|----|------|------|----|-------|------|----|
|               | 套期工具 |      |    | 非套期工具        |      |    | 套期工具 |      |    | 非套期工具 |      |    |
|               | 名义金额 | 公允价值 |    | 名义金额         | 公允价值 |    | 名义金额 | 公允价值 |    | 名义金额  | 公允价值 |    |
|               |      | 资产   | 负债 |              | 资产   | 负债 |      | 资产   | 负债 |       | 资产   | 负债 |
| 利率衍生工具(按类别列示) |      |      |    | 3,027,100.00 | -    | -  |      |      |    |       |      |    |

|               |  |  |  |               |          |              |  |  |  |                |  |  |
|---------------|--|--|--|---------------|----------|--------------|--|--|--|----------------|--|--|
| 其中：国债期货       |  |  |  | 3,027,100.00  | -        | -            |  |  |  |                |  |  |
| 权益衍生工具(按类别列示) |  |  |  | 4,378,035.00  | 3,620.00 | 5,704,972.15 |  |  |  | 296,322,360.00 |  |  |
| 其中：股指期货       |  |  |  | 2,799,600.00  | -        | -            |  |  |  | 296,322,360.00 |  |  |
| 股票期权          |  |  |  | 1,578,435.00  | 3,620.00 | 1,459,450.00 |  |  |  |                |  |  |
| 权益收益互换        |  |  |  | -             | -        | 4,245,522.15 |  |  |  |                |  |  |
| 其他衍生工具(按类别列示) |  |  |  | 7,045,082.50  | -        | -            |  |  |  |                |  |  |
| 其中：商品期货       |  |  |  | 7,045,082.50  | -        | -            |  |  |  |                |  |  |
| 合计            |  |  |  | 14,450,217.50 | 3,620.00 | 5,704,972.15 |  |  |  | 296,322,360.00 |  |  |

#### 衍生金融工具的说明：

[注 1] 本公司进行的国债期货、股指期货和商品期货交易为每日无负债结算。于 2015 年 12 月 31 日，本公司持有的用于非套期的未到期国债期货、股指期货和商品期货合约的公允价值与本公司因参与该国债期货、股指期货和商品期货交易所确认的相关金融资产或负债相互抵销。

[注 2] 权益收益互换的合同本金已实际交付，因而期末嵌入衍生工具的名义金额为人民币 0 元。

## 6、买入返售金融资产

√适用□不适用

### (1) 按金融资产种类

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 期末账面余额           | 期初账面余额           |
|--------------|------------------|------------------|
| 股票           | 7,961,211,637.37 | 5,953,112,634.79 |
| 债券           | 977,824,758.87   | 650,338,803.67   |
| 其中：交易所标准券    | 285,001,550.00   | 271,001,447.50   |
| 企业债          | 642,823,208.87   | 379,337,356.17   |
| 其他           | 50,000,000.00    | -                |
| 减：减值准备       | 15,893,648.19    | 20,783,103.19    |
| 买入返售金融资产账面价值 | 8,923,142,748.05 | 6,582,668,335.27 |

## (2) 约定购回、质押回购融出资金按剩余期限分类披露

单位：元 币种：人民币

| 期限       | 期末账面余额           | 期初账面余额           |
|----------|------------------|------------------|
| 一个月内     | 1,028,369,349.39 | 1,472,621,445.50 |
| 一个月至三个月内 | 900,609,207.56   | 199,229,375.96   |
| 三个月至一年内  | 4,982,924,630.42 | 3,185,263,260.83 |
| 一年以上     | 1,384,310,000.00 | 1,419,000,000.00 |
| 合计       | 8,296,213,187.37 | 6,276,114,082.29 |

## (3) 按业务类别列示

| 项目        | 期末余额             | 期末减值准备        | 期初账面余额           | 期初减值准备        |
|-----------|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 约定购回式证券   | 210,780,000.00   | 632,340.00    | 87,680,000.00    | 263,040.00    |
| 股票质押式回购   | 7,750,431,637.37 | 15,261,308.19 | 5,865,432,634.79 | 20,520,063.19 |
| 债券质押式回购   | 335,001,550.00   | -             | 323,001,447.50   | -             |
| 买断式回购融出资金 | 642,823,208.87   | -             | 327,337,356.17   | -             |
| 合计        | 8,939,036,396.24 | 15,893,648.19 | 6,603,451,438.46 | 20,783,103.19 |

## (4) 按交易对手分类

| 项目      | 期末余额             | 期初余额             |
|---------|------------------|------------------|
| 银行金融机构  | 50,000,000.00    | -                |
| 非银行金融机构 | 642,823,208.87   | 379,337,356.17   |
| 证券交易所   | 8,230,319,539.18 | 6,203,330,979.10 |
| 合计      | 8,923,142,748.05 | 6,582,668,335.27 |

## (5) 买入返售业务的担保物情况

| 担保物类别 | 期末公允价值            | 期初公允价值            |
|-------|-------------------|-------------------|
| 债券    | 981,699,240.00    | 644,884,273.50    |
| 股票    | 38,085,726,312.17 | 16,775,749,547.54 |
| 合计    | 39,067,425,552.17 | 17,420,633,821.04 |

注：期末买入返售业务的担保物受限情况参见附注 11：11.03 或有事项的相关描述。

(6) 期末买入返售金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物，期末公允价值为 321,449,700.00 元，质押到期日为 2016 年 1 月 6 日至 2017 年 8 月 19 日。

## 7、应收款项

## (1) 按明细列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 期末余额           | 期初余额          |
|---------------|----------------|---------------|
| 应收清算款         | 111,432,701.44 | 26,058,803.56 |
| 应收基金业务管理费     | 11,539,739.24  | 10,870,403.27 |
| 应收资产管理业务产品管理费 | 13,804,565.07  | 6,062,172.20  |
| 其他            | 218,748,223.07 | 1,879,638.08  |
| 合计            | 355,525,228.82 | 44,871,017.11 |
| 减：减值准备        | 21,781,752.78  |               |
| 应收款项账面价值      | 333,743,476.04 | 44,871,017.11 |

[注]期末其他主要系广州博融投资有限公司股票质押回购到期转入，详见附注 14：14.08。

## (2) 按账龄分析

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 账龄    | 期末余额           |        |               |        | 期初余额          |        |      |        |
|-------|----------------|--------|---------------|--------|---------------|--------|------|--------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |        | 账面余额          |        | 坏账准备 |        |
|       | 金额             | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) | 金额            | 比例 (%) | 金额   | 比例 (%) |
| 1 年以内 | 354,693,571.52 | 99.77  | 21,781,752.78 | 6.14   | 44,871,017.11 | 100.00 |      |        |
| 1-2 年 | 831,657.30     | 0.23   |               |        |               |        |      |        |
| 2-3 年 |                |        |               |        |               |        |      |        |
| 3 年以上 |                |        |               |        |               |        |      |        |
| 合计    | 355,525,228.82 | 100.00 | 21,781,752.78 | 6.13   | 44,871,017.11 | 100.00 |      |        |

## (3) 应收款项余额中前五名单位名称/性质情况

| 单位名称                | 金额             | 账龄    | 占应收款项总额比例 (%) | 款项性质          |
|---------------------|----------------|-------|---------------|---------------|
| 广州博融投资有限公司          | 210,000,000.00 | 1 年以内 | 59.07         | 股票质押回购业务      |
| 证券清算款               | 111,432,701.44 | 1 年以内 | 31.34         | 应收证券清算款       |
| 东吴汇利 7 号集合资产管理计划    | 1,672,445.26   | 1 年以内 | 0.47          | 应收资产管理业务产品管理费 |
| 东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 | 1,274,908.66   | 1 年以内 | 0.36          | 应收基金业务管理费     |
| 东吴汇信 18 号集合资产管理计划   | 1,159,854.17   | 1 年以内 | 0.33          | 应收资产管理业务产品管理费 |
| 合计                  | 325,539,909.53 |       | 91.57         |               |

(4) 应收款项余额中无应收持有本公司 5%(含 5%)以上股份的股东及其他关联方的款项。

## (5) 按评估方式列示

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 账龄       | 期末余额 |        |      |        | 期初余额 |        |      |        |
|----------|------|--------|------|--------|------|--------|------|--------|
|          | 账面余额 |        | 坏账准备 |        | 账面余额 |        | 坏账准备 |        |
|          | 金额   | 比例 (%) | 金额   | 比例 (%) | 金额   | 比例 (%) | 金额   | 比例 (%) |
| 单项计提减值准备 |      |        |      |        |      |        |      |        |

|          |                |        |               |      |               |        |  |  |
|----------|----------------|--------|---------------|------|---------------|--------|--|--|
| 组合计提减值准备 | 355,525,228.82 | 100.00 | 21,781,752.78 | 6.13 | 44,871,017.11 | 100.00 |  |  |
| 合计       | 355,525,228.82 | 100.00 | 21,781,752.78 | 6.13 | 44,871,017.11 | 100.00 |  |  |

## 8、 应收利息

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目     | 期末余额           | 期初余额           |
|--------|----------------|----------------|
| 债券投资   | 197,485,280.57 | 152,482,135.46 |
| 存放金融同业 | 13,790,017.80  | 12,868,659.83  |
| 融资融券   | 57,271,513.43  | 25,367,208.97  |
| 买入返售   | 69,810,121.19  | 40,104,689.50  |
| 其他     | 18,690,880.25  | 4,917,814.12   |
| 合计     | 357,047,813.24 | 235,740,507.88 |

## 9、 存出保证金

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 期末账面余额           | 期初账面余额           |
|-----------|------------------|------------------|
| 交易保证金     | 676,087,931.03   | 731,143,474.07   |
| 信用保证金     | 49,430,420.51    | 8,566,988.91     |
| 履约保证金     | 277,258,544.79   | 466,896,894.03   |
| 期货业务结算担保金 | 10,000,000.00    | 10,000,000.00    |
| 合计        | 1,012,776,896.33 | 1,216,607,357.01 |

其中：外币保证金

| 项目     | 期末余额         |        |              | 期初余额       |        |              |
|--------|--------------|--------|--------------|------------|--------|--------------|
|        | 外币金额         | 折算率    | 人民币金额        | 外币金额       | 折算率    | 人民币金额        |
| 交易保证金： |              |        |              |            |        |              |
| 美元     | 270,000.00   | 6.4936 | 1,753,272.00 | 270,000.00 | 6.1190 | 1,652,130.00 |
| 港币     | 1,000,000.00 | 0.8378 | 837,800.00   | 700,000.00 | 0.7889 | 552,230.00   |
| 合计     |              |        | 2,591,072.00 |            |        | 2,204,360.00 |

## 10、 可供出售金融资产

√适用□不适用

### (1) 可供出售金融资产情况

单位：元 币种：人民币

| 项目名称 | 期末               |                |      |                  | 期初               |               |           |                  |
|------|------------------|----------------|------|------------------|------------------|---------------|-----------|------------------|
|      | 初始成本             | 公允价值变动         | 减值准备 | 账面价值             | 初始成本             | 公允价值变动        | 减值准备      | 账面价值             |
| 债券   | 4,615,152,894.27 | 197,123,767.95 | -    | 4,812,276,662.22 | 2,812,803,480.61 | 25,681,165.55 | -         | 2,838,484,646.16 |
| 基金   | 32,241,446.71    | 6,381,546.49   | 8.31 | 38,622,984.89    | 182,728,934.32   | 80,046,113.22 | 31,691.19 | 262,743,356.35   |



|            |                      |                 |            |                      |                      |                |              |                      |
|------------|----------------------|-----------------|------------|----------------------|----------------------|----------------|--------------|----------------------|
| 股票         | 2,562,817.84<br>1.98 | 233,940,878.37  | 441,119.95 | 2,796,317.60<br>0.40 | 1,114,301.72<br>3.07 | 209,366,711.38 | 512,605.90   | 1,323,155.82<br>8.55 |
| 证券公司理财产品   | 863,442,925.03       | -55,405,689.78  | 453,686.69 | 807,583,548.56       | 424,717,577.39       | 5,568,967.38   | 1,157,064.58 | 429,129,480.19       |
| 基金理财产品     | 1,066,296.06<br>3.75 | 241,009,222.45  | -          | 1,307,305.28<br>6.20 | 415,000,000.00       | 19,974,152.62  | -            | 434,974,152.62       |
| 信托计划       | 798,450,000.00       | 6,228,000.00    | -          | 804,678,000.00       | 302,000,000.00       | -              | -            | 302,000,000.00       |
| 证券公司收益互换产品 | 3,059,420.00<br>0.00 | -151,757,696.68 | -          | 2,907,662.30<br>3.32 |                      |                |              |                      |
| 按成本计量：     |                      |                 |            |                      |                      |                |              |                      |
| 权益工具 [注]   | 863,442,502.57       | -               | -          | 863,442,502.57       | 372,412,877.57       | -              | -            | 372,412,877.57       |
| 合计         | 13,861,263,674.31    | 477,520,028.80  | 894,814.95 | 14,337,888,888.16    | 5,623,964,592.96     | 340,637,110.15 | 1,701,361.67 | 5,962,900,341.44     |

[注]权益工具系不具有控制、共同控制或重大影响的股权投资，明细列示如下：

| 项 目                | 股权比例    | 期初余额          | 本期增加           | 本期减少          | 期末余额           |
|--------------------|---------|---------------|----------------|---------------|----------------|
| 江苏银行股份有限公司         | 0.07%   | 5,225,180.00  | -              | -             | 5,225,180.00   |
| 江苏股权交易中心           | 12.00%  | 24,000,000.00 | -              | -             | 24,000,000.00  |
| 苏州金融资产交易中心有限公司     | 15.00%  | 7,500,000.00  | -              | -             | 7,500,000.00   |
| 证通股份有限公司           | 0.9926% | 25,000,000.00 | -              | -             | 25,000,000.00  |
| 中证机构间报价系统股份有限公司    | 0.66%   | -             | 50,000,000.00  | -             | 50,000,000.00  |
| 中证信用增进股份有限公司       | 4.878%  | -             | 200,000,000.00 | -             | 200,000,000.00 |
| 期货会员资格投资           | -       | 1,400,000.00  | -              | -             | 1,400,000.00   |
| ——上海期货交易所资格投资      | -       | 500,000.00    | -              | -             | 500,000.00     |
| ——郑州商品交易所资格投资      | -       | 400,000.00    | -              | -             | 400,000.00     |
| ——大连商品交易所资格投资      | -       | 500,000.00    | -              | -             | 500,000.00     |
| 昆山华元嘉润股权投资企业(有限合伙) | 10.95%  | 5,000,000.00  | 2,500,000.00   | -             | 7,500,000.00   |
| 北京农信通科技有限责任公司      | 16.77%  | 25,000,000.00 | -              | -             | 25,000,000.00  |
| 辽宁国美农牧集团有限公司       | 6.69%   | 20,000,000.00 | -              | -             | 20,000,000.00  |
| 厦门优传供应链有限公         | 10.39%  | 40,000,000.00 | -              | 40,000,000.00 | -              |

| 项 目   | 股权比例   | 期初余额           | 本期增加           | 本期减少          | 期末余额           |
|---|--------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 司   |        |                |                |               |                |
| 四川华体照明科技股份有限公司                                  | 6.85%  | 23,933,697.57  | -              | -             | 23,933,697.57  |
| 成都支付通新信息技术服务有限公司                                | 9.38%  | 4,904,000.00   | -              | -             | 4,904,000.00   |
| 重庆乌江实业(集团)股份有限公司                                | 0.85%  | 20,000,000.00  | -              | -             | 20,000,000.00  |
| 重庆东吴创业投资有限公司                                    | 15.00% | 16,500,000.00  | -              | -             | 16,500,000.00  |
| 上海东吴创业投资有限公司                                    | 15.00% | 15,000,000.00  | -              | -             | 15,000,000.00  |
| 四川伊顿农业科技开发有限公司                                  | 13.10% | 23,950,000.00  | -              | -             | 23,950,000.00  |
| 广东安信德摩牙科产业股权投资合伙企业(有限合伙)                        | 13.27% | 15,000,000.00  | -              | -             | 15,000,000.00  |
| 苏州毅达创新创业投资合伙企业(有限合伙)                            | 9.00%  | -              | 5,400,000.00   | -             | 5,400,000.00   |
| 北京道行思科技有限公司                                     | 20.00% | -              | 12,000,000.00  | -             | 12,000,000.00  |
| 苏州金茂赢联股权投资基金合伙企业(有限合伙)                          | 18.87% | -              | 20,000,000.00  | -             | 20,000,000.00  |
| 苏州东吴高新城乡一体化建设发展基金合伙企业(有限合伙)                     | 0.26%  | -              | 1,000,000.00   | -             | 1,000,000.00   |
| Sanpower International Healthcare Group Limited | 1.25%  | -              | 24,029,250.00  | -             | 24,029,250.00  |
| 安康通控股有限公司                                       | 1.25%  | -              | 8,100,375.00   | -             | 8,100,375.00   |
| 苏州市吴中产业优化基金发展有限公司                               | 25.00% | 100,000,000.00 | -              | -             | 100,000,000.00 |
| 苏州市东吴城乡一体化建设引导基金合伙企业(有限合伙)                      | 15.20% | -              | 201,000,000.00 | -             | 201,000,000.00 |
| 吴江市七都庙港污水处理厂                                    | 5.00%  | -              | 2,000,000.00   | -             | 2,000,000.00   |
| 苏州股权交易中心  | 10.00% | -              | 5,000,000.00   | -             | 5,000,000.00   |
| 合 计   |        | 373,812,877.57 | 531,029,625.00 | 40,000,000.00 | 864,842,502.57 |

(2) 截至报告期末可供出售金融资产的成本(摊余成本)、公允价值、累计计入其他综合收益的公允价值变动金额, 以及已计提减值金额

√适用□不适用

单位: 元 币种: 人民币

| 可供出售金融资产分类 | 可供出售权益工具 | 可供出售债务工具 | 合计 |
|------------|----------|----------|----|
|            |          |          |    |

|                         |                  |                  |                   |
|-------------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 权益工具的成本/债务工具<br>的摊余成本   | 9,246,110,780.04 | 4,615,152,894.27 | 13,861,263,674.31 |
| 公允价值                    | 9,525,612,225.94 | 4,812,276,662.22 | 14,337,888,888.16 |
| 累计计入其他综合收益的<br>公允价值变动金额 | 218,587,249.20   | 147,842,825.96   | 366,430,075.16    |
| 已计提减值金额                 | 894,814.95       | -                | 894,814.95        |

### (3) 报告期内可供出售金融资产减值的变动情况

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 可供出售金融资产分类        | 可供出售权益工具     | 可供出售债务工具 | 合计           |
|-------------------|--------------|----------|--------------|
| 期初已计提减值金额         | 1,701,361.67 |          | 1,701,361.67 |
| 本年计提              | -80,192.83   | -        | -80,192.83   |
| 其中：从其他综合收益转入      | -            | -        | -            |
| 本年减少              | 726,353.89   | -        | 726,353.89   |
| 其中：期后公允价值回升<br>转回 | /            | -        | -            |
| 期末已计提减值金额         | 894,814.95   | -        | 894,814.95   |

### (4) 按投资品种类别列示

| 项 目           | 期末余额              | 期初余额             |
|---------------|-------------------|------------------|
| 债券            | 4,812,276,662.22  | 2,838,484,646.16 |
| 基金            | 38,622,993.20     | 262,775,047.54   |
| 股票            | 2,796,758,720.35  | 1,323,668,434.45 |
| 证券公司理财产品      | 808,037,235.25    | 430,286,544.77   |
| 基金理财产品        | 1,307,305,286.20  | 434,974,152.62   |
| 信托计划          | 804,678,000.00    | 302,000,000.00   |
| 证券公司收益互换产品[注] | 2,907,662,303.32  | -                |
| 其他            | 863,442,502.57    | 372,412,877.57   |
| 减：减值准备        | 894,814.95        | 1,701,361.67     |
| 可供出售金融资产账面价值  | 14,337,888,888.16 | 5,962,900,341.44 |

[注]系本公司向中国证券金融期货股份有限公司（以下简称证金公司）的专户投资。为了维持证券市场的稳定发展及履行作为主要市场参与者的社会责任，本公司与其他证券公司共同投资于证金公司设立的专户进行统一运作。上述投资于2015年7月及2015年9月分两次进行。根据相关合约，各家证券公司按投资比例分担投资风险分享投资收益。于2015年12月31日，本公司根据证金公司提供的资产报告确定年末账面价值。

### (5) 可供出售金融资产中已融出证券情况

| 项 目 | 期末余额       | 期初余额          |
|-----|------------|---------------|
| 股票  | 4,288.40   | 28,846,315.63 |
| 基金  | 169,874.70 | 17,682,164.89 |
| 合 计 | 174,163.10 | 46,528,480.52 |

## (6) 客户因融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

| 项 目 | 期末公允价值     | 期初公允价值         |
|-----|------------|----------------|
| 资金  | 415,007.08 | 68,564,839.80  |
| 股票  | 510,341.10 | 56,090,480.04  |
| 基金  | 223.20     | -              |
| 合 计 | 925,571.38 | 124,655,319.84 |

(7) 截至 2015 年 12 月 31 日，公司持有的由公司作为管理人的东吴集合资产管理计划情况如下：

| 项 目                  | 数量             | 初始成本           | 期末净值           |
|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| 东吴财富 1 号集合资产管理计划（展期） | 2,874,337.23   | 1,738,111.72   | 3,272,720.37   |
| 东吴财富 2 号基金优选集合资产管理计划 | 3,044,877.07   | 3,044,877.07   | 3,082,024.57   |
| 东吴康得新 1 号集合资产管理计划    | 50,000,000.00  | 50,000,000.00  | 50,180,000.00  |
| 东吴三力士 1 号集合资产管理计划    | 25,000,000.00  | 25,000,000.00  | 25,057,500.00  |
| 东吴汇信 10 号集合资产管理计划    | 28,000,000.00  | 28,000,000.00  | 28,008,400.00  |
| 合 计                  | 108,919,214.30 | 107,782,988.79 | 109,600,644.94 |

## (8) 存在限售条件的可供出售金融资产明细

| 股票名称 | 证券代码   | 限售期截至日           | 锁定数量       | 期末公允价值         |
|------|--------|------------------|------------|----------------|
| 金智科技 | 002090 | 2018 年 07 月 12 日 | 8,382,229  | 134,450,953.16 |
| 双钱股份 | 600623 | 2016 年 12 月 02 日 | 691,909    | 9,299,256.96   |
| 雷曼股份 | 300162 | 2016 年 12 月 11 日 | 1,190,438  | 28,403,850.68  |
| 合 计  |        |                  | 10,264,576 | 172,154,060.80 |

(9) 截至 2015 年 12 月 31 日, 可供出售金融资产中部分债券被用作卖出回购等业务的质押物, 期末公允价值为 3,842,286,197.23 元, 质押到期日为 2016 年 1 月 4 日至 2016 年 3 月 28 日。

截至 2015 年 12 月 31 日, 可供出售金融资产中无被用作转融通业务的担保物。

(10) 可供出售金融资产中股票市值是根据资产负债表基准日证券交易所公布的收盘价确定, 债券的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债估值价格计算, 开放式基金采用基金公司公布的净值计算。

(11) 上述可供出售金融资产中无持有本公司 5% (含 5%) 以上表决权股份的股东作为发起人的金融资产。

## 11、 融券业务情况

√适用□不适用

(1) 按来源分

单位: 元 币种: 人民币

| 项目        | 期末公允价值     | 期初公允价值        |
|-----------|------------|---------------|
| 融出证券      | 174,163.10 | 46,528,480.52 |
| —可供出售金融资产 | 174,163.10 | 46,528,480.52 |
| 其中: 股票    | 4,288.40   | 28,846,315.63 |
| 基金        | 169,874.70 | 17,682,164.89 |
| —转融通融入证券  |            |               |
| 转融通融入证券总额 |            |               |

(2) 本期融券业务无违约情况。

## 12、 持有至到期投资

√适用□不适用

(1) 持有至到期投资情况

单位: 元 币种: 人民币

| 项目         | 期末账面余额        | 期初账面余额        | 期末公允价值        |
|------------|---------------|---------------|---------------|
| 债券         | 34,700,915.22 | 35,021,268.42 | 35,488,064.12 |
| 其中(按类别列示): |               |               |               |
| 企业债券       | 6,562,820.19  | 6,588,632.19  | 6,909,486.80  |
| 公司债券       | 28,138,095.03 | 28,432,636.23 | 28,578,577.32 |
| 其他         | 11,103,246.57 | 18,174,219.17 | 11,103,246.57 |

|               |               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 持有至到期投资合计     | 45,804,161.79 | 53,195,487.59 | 46,591,310.69 |
| 减：持有至到期投资减值准备 | -             |               |               |
| 持有至到期投资账面价值   | 45,804,161.79 | 53,195,487.59 | 46,591,310.69 |

(2) 本期公司无出售但尚未到期的持有至到期投资情况。

(3) 期末持有至到期投资为子公司东吴期货有限公司和东吴基金管理有限公司持有，无被用作卖出回购等业务质押物。

### 13、长期股权投资

√适用□不适用

(1) 长期股权投资明细情况

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位                             | 期初余额          | 本期增减变动         |      |               |          |        |             |        |               | 期末余额           | 减值准备期末余额 |
|-----------------------------------|---------------|----------------|------|---------------|----------|--------|-------------|--------|---------------|----------------|----------|
|                                   |               | 追加投资           | 减少投资 | 权益法下确认的投资损益   | 其他综合收益调整 | 其他权益变动 | 宣告发放现金股利或利润 | 计提减值准备 | 其他            |                |          |
| 一、合营企业                            |               |                |      |               |          |        |             |        |               |                |          |
| 小计                                |               |                |      |               |          |        |             |        |               |                |          |
| 二、联营企业                            |               |                |      |               |          |        |             |        |               |                |          |
| 1. 许昌市绿野农业科技有限<br>公司[注 1]         | 6,551,829.33  | -              | -    | -233.25       | -        | -      | -           | -      | -             | 6,551,596.08   | -        |
| 2. 华元恒道(上海)投资管理<br>有限公司[注 2]      | 3,931,280.92  | 36,600,000.00  | -    | 6,885,650.24  | -        | -      | -           | -      | -7,494,554.57 | 39,922,376.59  | -        |
| 3. 东吴在线(苏州)互联网金融科技服<br>务有限公司[注 3] | -             | 80,000,000.00  | -    | -4,241,450.47 | -        | -      | -           | -      | -             | 75,758,549.53  | -        |
| 小计                                | 10,483,110.25 | 116,600,000.00 | -    | 2,643,966.52  | -        | -      | -           | -      | -7,494,554.57 | 122,232,522.20 | -        |

|    |               |                |   |              |   |   |   |   |               |                |   |
|----|---------------|----------------|---|--------------|---|---|---|---|---------------|----------------|---|
| 合计 | 10,483,110.25 | 116,600,000.00 | - | 2,643,966.52 | - | - | - | - | -7,494,554.57 | 122,232,522.20 | - |
|----|---------------|----------------|---|--------------|---|---|---|---|---------------|----------------|---|

[注 1] 许昌市绿野农业科技有限公司、华元恒道（上海）投资管理有限公司系由本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资。

[注 2] 根据华元恒道（上海）投资管理有限公司 2015 年 11 月 30 日的股东会决议，以 2015 年 6 月 30 日的未分配利润按原股东持股比例转增资本同时采取不溢价增资方式引入新股东，增资后东吴创业投资有限公司持股比例由原来的 34% 下降为 19.51%，东吴创业投资有限公司对该公司继续委派董事，仍对华元恒道（上海）投资管理有限公司具有重大影响。

[注 3] 东吴在线（苏州）互联网金融科技服务有限公司系由本公司全资子公司东吴创新资本管理有限公司投资。

## （2）按类别列示

| 项 目    | 期末余额           | 期初余额          |
|--------|----------------|---------------|
| 联营企业   | 122,232,522.20 | 10,483,110.25 |
| 合营企业   | -              | -             |
| 小 计    | 122,232,522.20 | 10,483,110.25 |
| 减：减值准备 | -              | -             |
| 合 计    | 122,232,522.20 | 10,483,110.25 |

## （3）联营企业基本情况

| 被投资单位                    | 企业类型 | 注册地 | 法定代表人 | 业务性质                  | 注册资本      | 本企业持股比例 (%) | 本企业在被投资单位表决权比例 (%) | 期末资产总额    | 期末负债总额    | 期末净资产总额   | 本期营业收入总额 | 本期净利润    |
|--------------------------|------|-----|-------|-----------------------|-----------|-------------|--------------------|-----------|-----------|-----------|----------|----------|
| 1. 许昌市绿野农业科技有限公司         | 有限公司 | 许昌  | 吴桐    | 农产品的种植及销售<br>(不含粮油销售) | 1,590.00  | 35.00       | 35.00              | 1,584.42  | -0.19     | 1,584.61  | -        | -0.07    |
| 2. 华元恒道(上海)投资管理有限公司      | 有限公司 | 上海  | 曲直    | 股权投资管理                | 20,500.00 | 19.51       | 19.51              | 20,830.10 | 119.89    | 20,710.21 | 4,602.13 | 2,255.26 |
| 3. 东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司 | 有限公司 | 苏州  | 李健    | 网络技术服务                | 20,000.00 | 40.00       | 40.00              | 34,866.56 | 17,820.98 | 17,045.58 | -        | -954.42  |

联营企业的重要会计政策、会计估计与公司的会计政策、会计估计无重大差异。

## 14、固定资产

### (1). 固定资产情况

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 房屋及建筑物         | 运输工具          | 办公设备及其他        | 合计               |
|-----------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 一、账面原值：   |                |               |                |                  |
| 1. 期初余额   | 707,071,313.37 | 26,017,335.23 | 344,088,102.29 | 1,077,176,750.89 |
| 2. 本期增加金额 | -              | 276,000.00    | 69,150,549.31  | 69,426,549.31    |
| (1) 购置    | -              | 276,000.00    | 60,933,472.45  | 61,209,472.45    |
| (2) 其他增加  | -              | -             | 8,217,076.86   | 8,217,076.86     |
| 3. 本期减少金额 | -              | 1,566,793.95  | 28,290,510.91  | 29,857,304.86    |
| (1) 处置或报废 | -              | 1,566,793.95  | 28,290,510.91  | 29,857,304.86    |
| 4. 期末余额   | 707,071,313.37 | 24,726,541.28 | 384,948,140.69 | 1,116,745,995.34 |
| 二、累计折旧    |                |               |                |                  |
| 1. 期初余额   | 62,893,673.32  | 11,787,447.74 | 180,912,250.96 | 255,593,372.02   |
| 2. 本期增加金额 | 22,446,287.88  | 2,448,145.75  | 53,225,150.18  | 78,119,583.81    |
| (1) 计提    | 22,446,287.88  | 2,448,145.75  | 51,718,686.36  | 76,613,119.99    |
| (2) 其他增加  | -              | -             | 1,506,463.82   | 1,506,463.82     |
| 3. 本期减少金额 | -              | 1,093,492.14  | 26,642,470.04  | 27,735,962.18    |



|           |                |               |                |                |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 4. 期末余额   | 85,339,961.20  | 13,142,101.35 | 207,494,931.10 | 305,976,993.65 |
| 三、减值准备    |                |               |                |                |
| 1. 期初余额   | -              | -             | -              | -              |
| 2. 本期增加金额 | -              | -             | -              | -              |
| 3. 本期减少金额 | -              | -             | -              | -              |
| 4. 期末余额   | -              | -             | -              | -              |
| 四、账面价值    |                |               |                |                |
| 1. 期末账面价值 | 621,731,352.17 | 11,584,439.93 | 177,453,209.59 | 810,769,001.69 |
| 2. 期初账面价值 | 644,177,640.05 | 14,229,887.49 | 163,175,851.33 | 821,583,378.87 |

## (2) 账面价值

| 项 目        | 期末余额             | 期初余额             |
|------------|------------------|------------------|
| 固定资产原价     | 1,116,745,995.34 | 1,077,176,750.89 |
| 减：累计折旧     | 305,976,993.65   | 255,593,372.02   |
| 固定资产减值准备   | -                | -                |
| 固定资产账面价值合计 | 810,769,001.69   | 821,583,378.87   |

(3) 固定资产期末余额中无可变现净值低于账面净值的情况，无需计提固定资产减值准备。

(4) 期末固定资产无抵押担保情况。

(5) 本期减少固定资产主要原因为清理报废设备。

(6) 本期增加的固定资产中无借款费用资本化金额。

(7) 期末无暂时闲置的固定资产。

(8) 期末无通过融资租赁租入的固定资产。

(9) 期末通过经营租赁租出的固定资产情况如下表:

| 项目    | 账面原值         | 累计折旧         | 账面净值         |
|-------|--------------|--------------|--------------|
| 房屋建筑物 | 4,752,574.75 | 2,721,277.13 | 2,031,297.62 |

(10) 期末无持有待售的固定资产。

(11) 期末无未办妥产权证书的固定资产情况。

## 15、在建工程

√适用□不适用

### (1). 在建工程情况

单位：元 币种：人民币

| 项目   | 期末余额       |      |            | 期初余额 |      |      |
|------|------------|------|------------|------|------|------|
|      | 账面余额       | 减值准备 | 账面价值       | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 装修工程 | 751,888.44 | -    | 751,888.44 | -    | -    | -    |
| 合计   | 751,888.44 | -    | 751,888.44 | -    | -    | -    |

### (2). 重要在建工程项目本期变动情况

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目名称 | 期初余额 | 本期增加金额     | 本期转入固定资产金额 | 本期其他减少金额 | 期末余额       | 资金来源 |
|------|------|------------|------------|----------|------------|------|
| 装修工程 |      | 751,888.44 |            |          | 751,888.44 | 自筹   |
| 合计   |      | 751,888.44 |            |          | 751,888.44 | /    |

### (3). 本期计提在建工程减值准备情况:

□适用√不适用

## 其他说明

(4) 截至 2015 年 12 月 31 日，上述装修工程已完工 95%，工程资金来源均为自筹。

(5) 公司在建工程本期发生额中无利息资本化支出。

## 16、无形资产

## (1). 无形资产情况

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 土地使用权          | 计算机软件          | 交易席位费         | 卫星建站费      | 合计             |
|-----------|----------------|----------------|---------------|------------|----------------|
| 一、账面原值    |                |                |               |            |                |
| 1. 期初余额   | 104,423,670.70 | 113,396,352.70 | 14,965,005.38 | 415,600.00 | 233,200,628.78 |
| 2. 本期增加金额 | -              | 39,024,432.12  | -             | -          | 39,024,432.12  |
| (1) 购置    | -              | 39,024,432.12  | -             | -          | 39,024,432.12  |
| (2) 其他增加  | -              | -              | -             | -          | -              |
| 3. 本期减少金额 | -              | 230,740.00     | -             | -          | 230,740.00     |
| (1) 处置    | -              | 230,740.00     | -             | -          | 230,740.00     |
| (2) 其他减少  | -              | -              | -             | -          | -              |
| 4. 期末余额   | 104,423,670.70 | 152,190,044.82 | 14,965,005.38 | 415,600.00 | 271,994,320.90 |
| 二、累计摊销    |                |                |               |            |                |
| 1. 期初余额   | 16,146,409.85  | 54,970,007.42  | 14,494,172.07 | 415,600.00 | 86,026,189.34  |
| 2. 本期增加金额 | 2,610,591.84   | 20,456,265.50  | 50,000.04     | -          | 23,116,857.38  |
| (1) 计提    | 2,610,591.84   | 20,456,265.50  | 50,000.04     | -          | 23,116,857.38  |
| (2) 其他增加  | -              | -              | -             | -          | -              |
| 3. 本期减少金额 | -              | 220,227.80     | -             | -          | 220,227.80     |

|           |               |               |               |            |                |
|-----------|---------------|---------------|---------------|------------|----------------|
| (1) 处置    | -             | 220,227.80    | -             | -          | 220,227.80     |
| (2) 其他减少  | -             | -             | -             | -          | -              |
| 4. 期末余额   | 18,757,001.69 | 75,206,045.12 | 14,544,172.11 | 415,600.00 | 108,922,818.92 |
| 三、减值准备    |               |               |               |            |                |
| 1. 期初余额   | -             | -             | -             | -          | -              |
| 2. 本期增加金额 | -             | -             | -             | -          | -              |
| 3. 本期减少金额 | -             | -             | -             | -          | -              |
| 4. 期末余额   | -             | -             | -             | -          | -              |
| 四、账面价值    |               |               |               |            |                |
| 1. 期末账面价值 | 85,666,669.01 | 76,983,999.70 | 420,833.27    | -          | 163,071,501.98 |
| 2. 期初账面价值 | 88,277,260.85 | 58,426,345.28 | 470,833.31    | -          | 147,174,439.44 |

(2) 期末无形资产无抵押担保情况。

## 17、商誉

√适用□不适用

### (1). 商誉账面原值

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位名称或形成商誉的事项 | 期初余额           | 本期增加    |    | 本期减少 |    | 期末余额           |
|-----------------|----------------|---------|----|------|----|----------------|
|                 |                | 企业合并形成的 | 其他 | 处置   | 其他 |                |
| 购买营业部商誉 [注1]    | 11,749,999.80  |         |    |      |    | 11,749,999.80  |
| 购买子公司商誉[注2]     | 239,296,539.54 |         |    |      |    | 239,296,539.54 |
| 合计              | 251,046,539.34 |         |    |      |    | 251,046,539.34 |

[注 1]系受让营业部形成的商誉，于 2006 年 12 月 31 日停止摊销，每年定期进行减值测试。

[注 2] 公司 2014 年度通过非同一控制下企业合并取得东吴基金管理有限公司 70% 股权，确定取得的东吴基金管理有限公司资产并购日（2014 年 9 月 30 日）可辨认净资产的公允价值份额为 165,362,214.77 元，与公司合并成本 396,666,666.67 元的差额 231,304,451.90 元确认为商誉。

## (2). 商誉减值准备

单位：元 币种：人民币

| 被投资单位名称或形成商誉的事项    | 期初余额          | 本期增加 |    | 本期减少 |    | 期末余额          |
|--------------------|---------------|------|----|------|----|---------------|
|                    |               | 计提   | 其他 | 处置   | 其他 |               |
| 重组商誉               | -             | -    | -  | -    | -  | -             |
| 非同一控制下企业合并形成的商誉[注] | 15,361,400.00 | -    | -  | -    | -  | 15,361,400.00 |
| 合计                 | 15,361,400.00 |      |    |      |    | 15,361,400.00 |

[注] 公司期末对因非同一控制下企业合并形成的商誉进行了减值测试，估计其可收回金额。各资产组的可收回金额根据预计未来现金流量现值的方法确定，公司根据管理层批准的最近未来 5 年财务预算和相应的折现率预计资产组的未来现金流量现值，超过 5 年财务预算之后年份的现金流量均保持稳定。公司期末对子公司东吴基金管理有限公司的可收回金额进行的估计结果表明，其可收回金额高于其账面价值，故本年度无需计提商誉减值准备。

## 18、递延所得税资产/递延所得税负债

### (1). 未经抵销的递延所得税资产

√适用 □不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 期末余额          |               | 期初余额          |              |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|
|                        | 可抵扣暂时性差异      | 递延所得税资产       | 可抵扣暂时性差异      | 递延所得税资产      |
| 资产减值准备                 | 60,364,617.39 | 15,091,154.36 | 38,293,945.41 | 9,573,486.36 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | -             | -             | 3,096.38      | 774.10       |

|           |                  |                |                |                |
|-----------|------------------|----------------|----------------|----------------|
| 尚未支付的职工薪酬 | 1,457,787,928.10 | 364,446,982.02 | 636,283,486.04 | 159,070,871.53 |
| 衍生金融工具    | 4,345,610.15     | 1,086,402.54   | 20,400,240.00  | 5,100,060.00   |
| 其他        | 39,122,758.93    | 9,780,689.74   | 30,469,782.32  | 7,617,445.58   |
| 合计        | 1,561,620,914.57 | 390,405,228.66 | 725,450,550.15 | 181,362,637.57 |

## (2). 未经抵销的递延所得税负债

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 期末余额           |                | 期初余额           |                |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|                        | 应纳税暂时性差异       | 递延所得税负债        | 应纳税暂时性差异       | 递延所得税负债        |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 313,713,246.83 | 78,428,311.72  | 66,786,764.46  | 16,696,691.10  |
| 可供出售金融资产公允价值变动         | 477,520,028.80 | 111,089,953.64 | 340,637,110.15 | 85,159,277.57  |
| 衍生金融工具                 | 115,207.00     | 28,801.75      | -              | -              |
| 其他                     | 140,234,520.81 | 43,172,987.25  | 90,403,362.69  | 22,600,840.66  |
| 合计                     | 931,583,003.44 | 232,720,054.36 | 497,827,237.30 | 124,456,809.33 |

## (3). 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债：

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 递延所得税资产和负债期末互抵金额 | 抵销后递延所得税资产或负债期末余额 | 递延所得税资产和负债期初互抵金额 | 抵销后递延所得税资产或负债期初余额 |
|---------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|
| 递延所得税资产 | 223,102,991.73   | 167,302,236.93    | 121,766,917.74   | 59,595,719.83     |
| 递延所得税负债 | 223,102,991.73   | 9,617,062.63      | 121,766,917.74   | 2,689,891.59      |

## 19、其他资产

(1) 按类别列示

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 期末账面价值         | 期初账面价值         |
|---------|----------------|----------------|
| 其他应收款   | 68,892,306.83  | 52,403,031.02  |
| 应收股利    | 363,127.74     | 542,590.00     |
| 待摊费用    | 9,038,703.09   | 9,543,106.03   |
| 长期待摊费用  | 28,487,140.99  | 46,974,535.00  |
| 应收款项类投资 | 400,000,000.00 | 575,000,000.00 |
| 其他长期资产  | 182,776,608.00 | 55,000,000.00  |
| 其他      | 9,040,837.72   | -              |
| 合计      | 698,598,724.37 | 739,463,262.05 |

## (2) 其他应收款

## ①按明细列示

| 项目      | 期末余额          | 期初余额          |
|---------|---------------|---------------|
| 其他应收款余额 | 68,892,306.83 | 52,403,031.02 |
| 减：坏账准备  | -             | -             |
| 其他应收款净值 | 68,892,306.83 | 52,403,031.02 |

## ②其他应收款按种类分析

| 种类                    | 期末余额          |        |      |        | 账面价值          |
|-----------------------|---------------|--------|------|--------|---------------|
|                       | 账面余额          |        | 坏账准备 |        |               |
|                       | 金额            | 比例 (%) | 金额   | 比例 (%) |               |
| 单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款 | 36,041,500.00 | 52.32  | -    | -      | 36,041,500.00 |
| 按组合计提坏账准备的其他应收款       |               |        |      |        |               |
| 组合一                   | 32,083,692.57 | 46.57  | -    | -      | 32,083,692.57 |
| 组合小计                  | 32,083,692.57 | 46.57  | -    | -      | 32,083,692.57 |

|                        |               |        |   |   |               |
|------------------------|---------------|--------|---|---|---------------|
| 单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款 | 767,114.26    | 1.11   | - | - | 767,114.26    |
| 合 计                    | 68,892,306.83 | 100.00 | - | - | 68,892,306.83 |

(续上表)

| 种 类                    | 期初余额          |        |      |        |               |
|------------------------|---------------|--------|------|--------|---------------|
|                        | 账面余额          |        | 坏账准备 |        | 账面价值          |
|                        | 金 额           | 比例 (%) | 金 额  | 比例 (%) |               |
| 单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款  | 36,041,500.00 | 68.78  | -    | -      | 36,041,500.00 |
| 按组合计提坏账准备的其他应收款        |               |        |      |        |               |
| 组合一                    | 15,649,612.22 | 29.86  | -    | -      | 15,649,612.22 |
| 组合小计                   | 15,649,612.22 | 29.86  | -    | -      | 15,649,612.22 |
| 单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款 | 711,918.80    | 1.36   | -    | -      | 711,918.80    |
| 合 计                    | 52,403,031.02 | 100.00 | -    | -      | 52,403,031.02 |

③组合中，按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款：

| 项 目   | 期末余额          |      |          |
|-------|---------------|------|----------|
|       | 其他应收款         | 坏账准备 | 计提比例 (%) |
| 1 年以内 | 28,108,672.94 | -    | -        |
| 1-2 年 | 2,679,174.14  | -    | -        |
| 2-3 年 | 1,295,845.49  | -    | -        |
| 3 年以上 | -             | -    | -        |
| 合 计   | 32,083,692.57 | -    | -        |

(续上表)



| 项 目   | 期初余额          |      |          |
|-------|---------------|------|----------|
|       | 其他应收款         | 坏账准备 | 计提比例 (%) |
| 1 年以内 | 12,614,981.22 | -    | -        |
| 1-2 年 | 1,723,211.66  | -    | -        |
| 2-3 年 | 1,311,419.34  | -    | -        |
| 3 年以上 | -             | -    | -        |
| 合 计   | 15,649,612.22 | -    | -        |

## ④期末其他应收款中主要项目

| 单位名称               | 金额            | 账龄    | 占其他应收款总额比例 (%) | 款项性质  |
|--------------------|---------------|-------|----------------|-------|
| 张家港市中昊房地产有限公司      | 36,041,500.00 | 2-3 年 | 52.32          | 预付购房款 |
| 上海陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司 | 3,111,877.77  | 1 年以内 | 4.52           | 房租押金  |
| 江苏省电力公司苏州供电公司      | 1,357,975.54  | 1 年以内 | 1.97           | 预付电费  |
| 陈郁萍、陈启中、陈怡翔        | 1,230,000.00  | 1-2 年 | 1.79           | 房租押金  |
| 北京鑫景通达置业有限公司       | 959,293.20    | 1 年以内 | 1.39           | 房租押金  |
| 合 计                | 42,700,646.51 |       | 61.99          |       |

⑤期末其他应收款中无持有本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款情况。

## (3) 待摊费用

| 项 目   | 期末余额         | 期初余额         |
|-------|--------------|--------------|
| 房租    | 8,239,219.19 | 9,029,446.53 |
| 数据线路费 | -            | 91,343.78    |
| 咨询费   | 79,532.50    | -            |
| 其他    | 719,951.40   | 422,315.72   |

|     |              |              |
|-----|--------------|--------------|
| 合 计 | 9,038,703.09 | 9,543,106.03 |
|-----|--------------|--------------|

## (4) 长期待摊费用

2015 年度增减变动:

| 项目   | 取得方式 | 原始金额          | 期初余额          | 本期增加         | 本期减少          |              | 期末余额          |
|------|------|---------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|
|      |      |               |               |              | 本期摊销          | 其他减少         |               |
| 装修费  | 购入   | 60,644,666.19 | 31,864,436.77 | 5,578,161.03 | 13,982,262.58 | -            | 23,460,335.22 |
| 网络工程 | 购入   | 5,842,092.19  | 2,814,581.19  | 503,658.50   | 1,562,228.46  | -            | 1,756,011.23  |
| 办公家具 | 购入   | 6,699,220.97  | 10,415,838.01 | 69,758.00    | 1,403,794.04  | 6,786,502.04 | 2,295,299.93  |
| 水电扩容 | 购入   | 1,447,923.72  | 536,193.86    | -            | 354,755.76    | -            | 181,438.10    |
| 消防工程 | 购入   | 2,986,713.23  | 1,343,485.17  | 56,462.40    | 605,891.06    | -            | 794,056.51    |
| 合计   |      | 77,620,616.30 | 46,974,535.00 | 6,208,039.93 | 17,908,931.90 | 6,786,502.04 | 28,487,140.99 |

## (5) 其他长期资产

| 项 目             | 期末余额          | 期初余额          |
|-----------------|---------------|---------------|
| 河南金利福珠宝有限公司     | 40,000,000.00 | 40,000,000.00 |
| 江阴盛凯环保设备有限公司    | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 成都支付通新信息有限公司    | 20,300,000.00 | 5,000,000.00  |
| 山东联创节能新材料股份有限公司 | 50,000,000.00 | -             |
| 苏州名城信息港发展有限公司   | 4,546,608.00  | -             |
| 苏州奥杰汽车技术股份有限公司  | 850,000.00    | -             |
| 湘村高科农业股份有限公司    | 9,630,000.00  | -             |

| 项 目                | 期末余额           | 期初余额          |
|--------------------|----------------|---------------|
| 深圳市联赢激光股份有限公司      | 5,000,000.00   | -             |
| 成都好房通科技有限公司        | 3,000,000.00   | -             |
| 安徽白兔湖动力股份有限公司      | 2,200,000.00   | -             |
| 浙江东阳中广影视文化有限公司     | 9,000,000.00   | -             |
| 江苏国贸酝领智能科技股份有限公司   | 4,100,000.00   | -             |
| 武汉颂大教育科技股份有限公司     | 13,500,000.00  | -             |
| 盘古基因生物工程（南京）股份有限公司 | 4,950,000.00   | -             |
| 广州优蜜移动科技股份有限公司     | 5,700,000.00   | -             |
| 合 计                | 182,776,608.00 | 55,000,000.00 |

上述款项为公司母公司及子公司支付的增资预付款。

## 20、资产减值准备变动表

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 期初余额          | 本期增加          | 本期减少         |            | 期末余额          |
|--------------|---------------|---------------|--------------|------------|---------------|
|              |               |               | 转回           | 转销         |               |
| 买入返售金融资产减值准备 | 20,783,103.19 | -             | 4,889,455.00 | -          | 15,893,648.19 |
| 坏账准备         | -             | 21,781,752.78 | -            | -          | 21,781,752.78 |
| 可供出售金融资产减值准备 | 1,701,361.67  | -             | 80,192.83    | 726,353.89 | 894,814.95    |
| 融出资金         | 15,809,480.55 | 5,984,920.92  | -            | -          | 21,794,401.47 |
| 商誉减值准备       | 15,361,400.00 | -             | -            | -          | 15,361,400.00 |
| 合计           | 53,655,345.41 | 27,766,673.70 | 4,969,647.83 | 726,353.89 | 75,726,017.39 |

## 21、短期借款

√适用□不适用

## (1). 短期借款分类

单位：元 币种：人民币

| 项目       | 期末余额          | 期初余额 |
|----------|---------------|------|
| 保证借款[注1] | 50,000,000.00 |      |
| 信用借款     | 30,000,000.00 |      |
| 质押借款[注2] | 13,684,509.36 |      |
| 合计       | 93,684,509.36 |      |

[注 1]由苏州市农业担保有限公司对子公司东吴创新资本管理有限责任公司向中国民生银行股份有限公司苏州分行 5000 万元借款进行担保。

[注 2]系子公司东吴期货有限公司、上海东吴玖盈投资管理有限公司的质押借款。

## 22、应付短期融资款

√适用□不适用

## (1) 分类情况

| 项目         | 期末余额             | 期初余额             |
|------------|------------------|------------------|
| 短期融资券[注 1] | 2,500,000,000.00 | 2,900,000,000.00 |
| 收益凭证[注 2]  | 2,067,350,000.00 | 413,738,000.00   |
| 合计         | 4,567,350,000.00 | 3,313,738,000.00 |

[注 1]2015 年中国人民银行以“银发[2015]139 号”《中国人民银行关于东吴证券股份有限公司发行短期融资券的通知》核定本公司待偿还短期融资券的最高余额为人民币 30 亿元，有效期 2015 年 5 月 7 日至 2016 年 4 月 30 日。在有效期内，本公司可自主发行短期融资券。

[注 2]本公司于本年度共发行 23 期期限小于一年的收益凭证，未到期产品的收益率 3.95%至 6.00%。

## (2) 短期融资券明细

| 债券名称 | 发行日期 | 到期日期 | 票面利率 |
|------|------|------|------|
|------|------|------|------|

| 债券名称          | 发行日期             | 到期日期             | 票面利率  |
|---------------|------------------|------------------|-------|
| 14 东吴证券 CP004 | 2014 年 10 月 21 日 | 2015 年 01 月 21 日 | 4.60% |
| 14 东吴证券 CP005 | 2014 年 11 月 14 日 | 2015 年 02 月 16 日 | 4.14% |
| 14 东吴证券 CP006 | 2014 年 12 月 19 日 | 2015 年 03 月 23 日 | 6.49% |
| 14 东吴证券 CP007 | 2014 年 12 月 26 日 | 2015 年 03 月 30 日 | 5.49% |
| 15 东吴证券 CP001 | 2015 年 01 月 22 日 | 2015 年 04 月 24 日 | 4.93% |
| 15 东吴证券 CP002 | 2015 年 03 月 04 日 | 2015 年 06 月 04 日 | 5.10% |
| 15 东吴证券 CP003 | 2015 年 06 月 05 日 | 2015 年 09 月 07 日 | 3.20% |
| 15 东吴证券 CP004 | 2015 年 06 月 25 日 | 2015 年 09 月 25 日 | 3.80% |
| 15 东吴证券 CP005 | 2015 年 11 月 04 日 | 2016 年 02 月 04 日 | 2.89% |
| 15 东吴证券 CP006 | 2015 年 11 月 24 日 | 2016 年 02 月 24 日 | 3.20% |
| 15 东吴证券 CP007 | 2015 年 12 月 11 日 | 2016 年 03 月 11 日 | 3.13% |
| 合 计           |                  |                  |       |

(续上表)

| 债券名称          | 期初余额             | 本期增加             | 本期减少             | 期末余额 |
|---------------|------------------|------------------|------------------|------|
| 14 东吴证券 CP004 | 500,000,000.00   | -                | 500,000,000.00   | -    |
| 14 东吴证券 CP005 | 1,000,000,000.00 | -                | 1,000,000,000.00 | -    |
| 14 东吴证券 CP006 | 1,000,000,000.00 | -                | 1,000,000,000.00 | -    |
| 14 东吴证券 CP007 | 400,000,000.00   | -                | 400,000,000.00   | -    |
| 15 东吴证券 CP001 | -                | 500,000,000.00   | 500,000,000.00   | -    |
| 15 东吴证券 CP002 | -                | 1,000,000,000.00 | 1,000,000,000.00 | -    |
| 15 东吴证券 CP003 | -                | 1,000,000,000.00 | 1,000,000,000.00 | -    |

| 债券名称          | 期初余额             | 本期增加             | 本期减少             | 期末余额             |
|---------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 15 东吴证券 CP004 | -                | 1,000,000,000.00 | 1,000,000,000.00 | -                |
| 15 东吴证券 CP005 | -                | 500,000,000.00   | -                | 500,000,000.00   |
| 15 东吴证券 CP006 | -                | 1,000,000,000.00 | -                | 1,000,000,000.00 |
| 15 东吴证券 CP007 | -                | 1,000,000,000.00 | -                | 1,000,000,000.00 |
| 合 计           | 2,900,000,000.00 | 6,000,000,000.00 | 6,400,000,000.00 | 2,500,000,000.00 |

## (3) 收益凭证明细

| 债券名称              | 起息日              | 到期日              | 票面利率       |
|-------------------|------------------|------------------|------------|
| 东吴证券收益凭证赢财 1 号    | 2014 年 11 月 18 日 | 2015 年 03 月 05 日 | 1.8%or8.8% |
| 东吴证券收益凭证赢财 2 号    | 2014 年 11 月 18 日 | 2015 年 03 月 05 日 | 1.8%or8.8% |
| 东吴证券固定收益凭证安心 1 号  | 2014 年 12 月 19 日 | 2015 年 06 月 17 日 | 6.00%      |
| 东吴证券固定收益凭证安心 2 号  | 2014 年 12 月 19 日 | 2015 年 03 月 19 日 | 5.40%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 1 号  | 2014 年 12 月 01 日 | 2015 年 06 月 01 日 | 6.00%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 2 号  | 2014 年 12 月 25 日 | 2015 年 12 月 21 日 | 6.05%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 3 号  | 2014 年 12 月 31 日 | 2015 年 07 月 01 日 | 6.00%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 4 号  | 2015 年 01 月 08 日 | 2015 年 07 月 09 日 | 6.00%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 5 号  | 2015 年 04 月 18 日 | 2015 年 07 月 16 日 | 5.50%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 6 号  | 2015 年 04 月 18 日 | 2015 年 10 月 16 日 | 5.60%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 7 号  | 2015 年 04 月 08 日 | 2015 年 10 月 07 日 | 5.60%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 9 号  | 2015 年 04 月 21 日 | 2016 年 04 月 19 日 | 6.00%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 10 号 | 2015 年 04 月 24 日 | 2015 年 10 月 22 日 | 5.60%      |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 12 号 | 2015 年 05 月 07 日 | 2015 年 11 月 05 日 | 5.80%      |

| 债券名称                  | 起息日              | 到期日              | 票面利率  |
|-----------------------|------------------|------------------|-------|
| 东吴证券固定收益凭证双喜 15 号     | 2015 年 08 月 12 日 | 2016 年 02 月 10 日 | 5.00% |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 16 号     | 2015 年 10 月 29 日 | 2016 年 10 月 24 日 | 4.80% |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 17 号     | 2015 年 12 月 10 日 | 2016 年 06 月 07 日 | 4.60% |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 18 号     | 2015 年 12 月 17 日 | 2016 年 06 月 14 日 | 4.40% |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 19 号     | 2015 年 12 月 24 日 | 2016 年 06 月 21 日 | 4.50% |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 20 号     | 2015 年 12 月 24 日 | 2016 年 12 月 23 日 | 4.30% |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201503]号 | 2015 年 06 月 26 日 | 2015 年 09 月 24 日 | 5.55% |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201504]号 | 2015 年 12 月 03 日 | 2016 年 04 月 07 日 | 4.38% |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201505]号 | 2015 年 12 月 25 日 | 2016 年 02 月 02 日 | 3.95% |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201501]号 | 2015 年 10 月 30 日 | 2016 年 05 月 09 日 | 5.00% |
| 东吴创新固定收益凭证稳信[201501]号 | 2015 年 11 月 19 日 | 2016 年 06 月 01 日 | 5.00% |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201502]号 | 2015 年 11 月 24 日 | 2016 年 05 月 09 日 | 4.80% |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201503]号 | 2015 年 11 月 24 日 | 2016 年 05 月 24 日 | 4.80% |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201504]号 | 2015 年 11 月 24 日 | 2016 年 08 月 15 日 | 5.10% |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201505]号 | 2015 年 12 月 24 日 | 2016 年 08 月 29 日 | 5.00% |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201506]号 | 2015 年 12 月 25 日 | 2016 年 09 月 12 日 | 4.90% |

(续上表)

| 债券名称             | 期初余额          | 本期增加 | 本期减少          | 期末余额 |
|------------------|---------------|------|---------------|------|
| 东吴证券收益凭证赢财 1 号   | 15,000,000.00 | -    | 15,000,000.00 | -    |
| 东吴证券收益凭证赢财 2 号   | 15,000,000.00 | -    | 15,000,000.00 | -    |
| 东吴证券固定收益凭证安心 1 号 | 19,992,000.00 | -    | 19,992,000.00 | -    |

| 债券名称                  | 期初余额           | 本期增加           | 本期减少           | 期末余额           |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 东吴证券固定收益凭证安心 2 号      | 13,746,000.00  | -              | 13,746,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 1 号      | 200,000,000.00 | -              | 200,000,000.00 | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 2 号      | 100,000,000.00 | -              | 100,000,000.00 | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 3 号      | 50,000,000.00  | -              | 50,000,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 4 号      | -              | 30,000,000.00  | 30,000,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 5 号      | -              | 30,000,000.00  | 30,000,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 6 号      | -              | 20,000,000.00  | 20,000,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 7 号      | -              | 50,000,000.00  | 50,000,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 9 号      | -              | 100,000,000.00 | -              | 100,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 10 号     | -              | 70,000,000.00  | 70,000,000.00  | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 12 号     | -              | 300,000,000.00 | 300,000,000.00 | -              |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 15 号     | -              | 150,000,000.00 | -              | 150,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 16 号     | -              | 200,000,000.00 | -              | 200,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 17 号     | -              | 200,000,000.00 | -              | 200,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 18 号     | -              | 200,000,000.00 | -              | 200,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 19 号     | -              | 200,000,000.00 | -              | 200,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证双喜 20 号     | -              | 100,000,000.00 | -              | 100,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201503]号 | -              | 600,000,000.00 | 600,000,000.00 | -              |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201504]号 | -              | 300,000,000.00 | -              | 300,000,000.00 |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201505]号 | -              | 50,000,000.00  | -              | 50,000,000.00  |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201501]号 | -              | 50,050,000.00  | -              | 50,050,000.00  |
| 东吴创新固定收益凭证稳信[201501]号 | -              | 14,300,000.00  | -              | 14,300,000.00  |



| 债券名称                  | 期初余额           | 本期增加             | 本期减少             | 期末余额             |
|-----------------------|----------------|------------------|------------------|------------------|
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201502]号 | -              | 100,000,000.00   | -                | 100,000,000.00   |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201503]号 | -              | 100,000,000.00   | -                | 100,000,000.00   |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201504]号 | -              | 100,000,000.00   | -                | 100,000,000.00   |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201505]号 | -              | 103,000,000.00   | -                | 103,000,000.00   |
| 东吴创新固定收益凭证稳盈[201506]号 | -              | 100,000,000.00   | -                | 100,000,000.00   |
| 合计                    | 413,738,000.00 | 3,167,350,000.00 | 1,513,738,000.00 | 2,067,350,000.00 |

### 23、拆入资金

√适用□不适用

(1) 分类情况

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 期末账面余额         | 期初账面余额           |
|------------|----------------|------------------|
| 银行拆入款项     | 100,000,000.00 |                  |
| 转融通融入款项[注] | 250,000,000.00 | 1,918,000,000.00 |
| 合计         | 350,000,000.00 | 1,918,000,000.00 |

[注]截至 2015 年 12 月 31 日，上述拆入资金系转融通业务拆入资金，公司相对应存出的转融通保证金为 259,601,152.29 元。

(2) 其中转融通融入资金情况

| 项目       | 期末余额           | 利率    | 期初余额           | 利率    |
|----------|----------------|-------|----------------|-------|
| 一个月内     | -              |       | -              | -     |
| 一个月至三个月内 | 250,000,000.00 | 6.30% | 250,000,000.00 | 5.80% |

| 项目      | 期末余额           | 利率 | 期初余额             | 利率    |
|---------|----------------|----|------------------|-------|
| 三个月至一年内 | -              |    | 1,668,000,000.00 | 5.80% |
| 一年以上    | -              |    | -                | -     |
| 合计      | 250,000,000.00 |    | 1,918,000,000.00 |       |

## 24、卖出回购金融资产款

√适用□不适用

### (1) 按金融资产种类

单位：元 币种：人民币

| 项目    | 期末账面余额           | 期初账面余额            |
|-------|------------------|-------------------|
| 债券    | 6,706,452,635.46 | 8,791,955,658.47  |
| 资产收益权 | 2,220,000,000.00 | 7,570,000,000.00  |
| 合计    | 8,926,452,635.46 | 16,361,955,658.47 |

### (2) 报价回购融入资金按剩余期限分类

单位：元 币种：人民币

| 期限       | 期末账面余额         | 利率区间      | 期初账面余额         | 利率区间      |
|----------|----------------|-----------|----------------|-----------|
| 一个月内     | 141,936,000.00 | 1.2%-2.0% | 231,582,000.00 | 1.9%-3.2% |
| 一个月至三个月内 | 4,975,000.00   |           | 5,368,000.00   |           |
| 三个月至一年内  | -              |           | -              |           |
| 一年以上     | -              |           | -              |           |
| 合计       | 146,911,000.00 |           | 236,950,000.00 |           |

### (3) 按业务类别列示

| 项目       | 期末余额           | 期初余额           |
|----------|----------------|----------------|
| 报价回购融入资金 | 146,911,000.00 | 236,950,000.00 |

| 项 目       | 期末余额             | 期初余额              |
|-----------|------------------|-------------------|
| 质押式回购融入资金 | 6,716,324,951.20 | 13,870,173,346.38 |
| 买断式回购融入资金 | 2,063,216,684.26 | 2,254,832,312.09  |
| 合 计       | 8,926,452,635.46 | 16,361,955,658.47 |

## (4) 按交易对手列示

| 项 目     | 期末余额             | 期初余额              |
|---------|------------------|-------------------|
| 银行金融机构  | 3,523,356,631.79 | 8,669,497,218.32  |
| 非银行金融机构 | 2,634,049,523.07 | 3,039,374,458.77  |
| 证券交易所   | 2,769,046,480.60 | 4,653,083,981.38  |
| 合 计     | 8,926,452,635.46 | 16,361,955,658.47 |

## (5) 卖出回购金融资产款的担保物信息

| 项 目                           | 期末余额              | 质押到期日                   |
|-------------------------------|-------------------|-------------------------|
| 卖出回购证券协议                      | 8,926,452,635.46  |                         |
| 质押品价值                         | 10,409,127,568.85 |                         |
| 其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中的债券 | 4,614,329,120.80  | 2016年01月04日至2016年03月28日 |
| 可供出售金融资产中的债券                  | 3,842,286,197.23  | 2016年01月04日至2016年03月28日 |
| 买入返售金融资产                      | 321,449,700.00    | 2016年01月06日至2017年08月19日 |
| 融资融券收益权                       | 1,631,062,550.82  | 2016年01月29日至2017年06月26日 |

## 25、代理买卖证券款

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目 | 期末账面余额            | 期初账面余额            |
|----|-------------------|-------------------|
| 个人 | 21,038,335,118.66 | 12,126,233,945.12 |
| 机构 | 2,987,643,261.6   | 1,453,238,341.80  |
| 合计 | 24,025,978,380.26 | 13,579,472,286.92 |

代理买卖证券款的说明：

(1) 按客户列示

| 项目     | 期末余额              | 期初余额              |
|--------|-------------------|-------------------|
| 普通经纪业务 | 21,767,247,853.59 | 12,655,875,800.85 |
| 个人     | 18,803,680,307.97 | 11,211,069,593.59 |
| 机构     | 2,963,567,545.62  | 1,444,806,207.26  |
| 信用业务   | 2,258,730,526.67  | 923,596,486.07    |
| 个人     | 2,234,654,810.69  | 915,164,351.53    |
| 机构     | 24,075,715.98     | 8,432,134.54      |
| 合计     | 24,025,978,380.26 | 13,579,472,286.92 |

(2) 按币种列示

| 项目     | 期末余额          |                   | 期初余额          |                   |
|--------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|
|        | 外币金额          | 折人民币金额            | 外币金额          | 折人民币金额            |
| 普通经纪业务 | -             | 21,767,247,853.59 | -             | 12,655,875,800.85 |
| 人民币    | -             | 21,511,823,969.13 | -             | 12,537,166,042.77 |
| 美元     | 35,069,540.57 | 227,727,568.64    | 16,628,488.44 | 101,749,720.74    |
| 港币     | 33,058,386.06 | 27,696,315.82     | 21,498,336.11 | 16,960,037.34     |
| 信用业务   | -             | 2,258,730,526.67  | -             | 923,596,486.07    |
| 人民币    | -             | 2,258,730,526.67  | -             | 923,596,486.07    |
| 美元     | -             | -                 | -             | -                 |
| 港币     | -             | -                 | -             | -                 |

| 项 目 | 期末余额 |                   | 期初余额 |                   |
|-----|------|-------------------|------|-------------------|
|     | 外币金额 | 折人民币金额            | 外币金额 | 折人民币金额            |
| 合 计 | -    | 24,025,978,380.26 | -    | 13,579,472,286.92 |

(3) 上述代理买卖证券款中无持有本公司 5%（含 5%）以上表决权股份的股东单位存入的款项。

## 26、应付职工薪酬

### (1). 应付职工薪酬列示:

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目             | 期初余额           | 本期增加             | 本期减少             | 期末余额             |
|----------------|----------------|------------------|------------------|------------------|
| 一、短期薪酬         | 639,154,643.41 | 1,872,055,913.62 | 1,007,901,895.24 | 1,503,308,661.79 |
| 二、离职后福利-设定提存计划 | 12,119,370.68  | 66,734,868.08    | 76,673,173.44    | 2,181,065.32     |
| 三、辞退福利         | -              | 432,525.18       | 432,525.18       | -                |
| 四、一年内到期的其他福利   |                |                  |                  |                  |
| 合计             | 651,274,014.09 | 1,939,223,306.88 | 1,085,007,593.86 | 1,505,489,727.11 |

### (2). 短期薪酬列示:

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 期初余额           | 本期增加             | 本期减少           | 期末余额             |
|---------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
| 一、工资、奖金、津贴和补贴 | 634,608,882.99 | 1,787,754,814.11 | 927,234,838.12 | 1,495,128,858.98 |
| 二、职工福利费       | -              | 5,928,565.40     | 5,928,565.40   | -                |
| 三、社会保险费       | 389,749.92     | 28,093,756.77    | 28,078,219.00  | 405,287.69       |
| 其中：医疗保险费      | 336,366.67     | 24,433,385.61    | 24,417,965.15  | 351,787.13       |
| 工伤保险费         | 26,660.83      | 2,553,495.23     | 2,550,022.09   | 30,133.97        |
| 生育保险费         | 26,722.42      | 1,106,875.93     | 1,110,231.76   | 23,366.59        |
| 四、住房公积金       | 456,883.00     | 33,773,992.94    | 33,792,323.94  | 438,552.00       |
| 五、工会经费和职工教育经费 | 3,699,127.50   | 16,504,784.40    | 12,867,948.78  | 7,335,963.12     |
| 六、短期带薪缺勤      |                |                  |                |                  |

|            |                |                  |                  |                  |
|------------|----------------|------------------|------------------|------------------|
| 七、短期利润分享计划 |                |                  |                  |                  |
| 合计         | 639,154,643.41 | 1,872,055,913.62 | 1,007,901,895.24 | 1,503,308,661.79 |

**(3). 设定提存计划列示**

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目       | 期初余额          | 本期增加          | 本期减少          | 期末余额         |
|----------|---------------|---------------|---------------|--------------|
| 1、基本养老保险 | 881,491.51    | 53,937,664.92 | 53,900,562.00 | 918,594.43   |
| 2、失业保险费  | 57,879.17     | 3,862,203.16  | 3,857,611.44  | 62,470.89    |
| 3、企业年金缴费 | 11,180,000.00 | 8,935,000.00  | 18,915,000.00 | 1,200,000.00 |
| 合计       | 12,119,370.68 | 66,734,868.08 | 76,673,173.44 | 2,181,065.32 |

(4) 期末应付职工薪酬中无拖欠性质的款项。

(5) 应付职工薪酬期末余额将按照公司相关制度规定考核后，于满足条件年度发放。

(6) 本公司 2015 年度实际发放的高级管理人员薪酬为人民币 797.48 万元。

**27、应交税费**

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 期末余额           | 期初余额           |
|---------|----------------|----------------|
| 营业税     | 41,796,932.34  | 39,786,558.42  |
| 城市维护建设税 | 2,955,753.38   | 2,717,909.96   |
| 教育费附加   | 2,150,741.89   | 1,986,047.05   |
| 企业所得税   | 326,737,359.50 | 216,744,272.84 |
| 个人所得税   | 27,026,109.97  | 38,719,084.47  |

|       |                |                |
|-------|----------------|----------------|
| 股民利息税 | 349,083.45     | 135,471.81     |
| 其他税费  | 467,570.89     | 4,326,492.53   |
| 合计    | 401,483,551.42 | 304,415,837.08 |

## 28、应付款项

√适用□不适用

### 应付款项列示

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 期末余额          | 期初余额          |
|------------|---------------|---------------|
| 应付清算款      | 453,732.14    | 41,891,704.93 |
| 应付佣金       | 23,541,770.76 | 19,569,698.44 |
| 应付第三方存管费   | 18,690,142.00 | 5,628,502.59  |
| 应付收益互换业务款项 | 19,793,068.49 | -             |
| 其他         | 7,926,827.03  | 3,327,207.93  |
| 合计         | 70,405,540.42 | 70,417,113.89 |

其他说明

## 29、应付利息

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 期末账面余额         | 期初账面余额        |
|------------|----------------|---------------|
| 客户资金       | 2,545,451.01   | 1,464,774.19  |
| 拆入资金       | 4,725,000.00   | 21,478,527.77 |
| 其中：转融通融入资金 | 4,725,000.00   | 21,478,527.77 |
| 应付债券       | 471,987,148.96 | 22,349,589.24 |
| 卖出回购       | 39,197,334.63  | 38,980,219.87 |
| 应付短期融资款    | 18,248,463.07  | 13,495,708.09 |

|    |                |               |
|----|----------------|---------------|
| 合计 | 536,703,397.67 | 97,768,819.16 |
|----|----------------|---------------|

### 30、应付债券

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 债券类型                       | 面值                | 发行日期             | 到期日期             | 票面利率  | 发行金额              |
|----------------------------|-------------------|------------------|------------------|-------|-------------------|
| 13 东吴债                     | 3,000,000,000.00  | 2013 年 11 月 18 日 | 2018 年 11 月 17 日 | 6.18% | 3,000,000,000.00  |
| 15 东吴债[注 1]                | 2,500,000,000.00  | 2015 年 11 月 09 日 | 2020 年 11 月 09 日 | 4.15% | 2,500,000,000.00  |
| 15 东吴 01 证券次级债[注 2]        | 3,000,000,000.00  | 2015 年 03 月 23 日 | 2018 年 03 月 22 日 | 5.90% | 3,000,000,000.00  |
| 15 东吴 02 证券次级债             | 3,000,000,000.00  | 2015 年 04 月 17 日 | 2018 年 04 月 16 日 | 5.90% | 3,000,000,000.00  |
| 15 东吴 03 证券次级债一期           | 2,000,000,000.00  | 2015 年 06 月 01 日 | 2018 年 05 月 31 日 | 5.70% | 2,000,000,000.00  |
| 15 东吴 03 证券次级债二期           | 2,000,000,000.00  | 2015 年 06 月 04 日 | 2018 年 06 月 03 日 | 5.70% | 2,000,000,000.00  |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201501]号[注 3] | 500,000,000.00    | 2015 年 05 月 14 日 | 2017 年 05 月 15 日 | 6.35% | 500,000,000.00    |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201502]号      | 500,000,000.00    | 2015 年 05 月 15 日 | 2016 年 05 月 16 日 | 6.05% | 500,000,000.00    |
| 合计                         | 16,500,000,000.00 |                  |                  |       | 16,500,000,000.00 |

(续上表)

| 债券名称             | 期初余额             | 本期净增加            | 折溢价摊销        | 本期偿还 | 期末余额             |
|------------------|------------------|------------------|--------------|------|------------------|
| 13 东吴债           | 2,975,791,937.06 | -                | 5,593,387.56 | -    | 2,981,385,324.62 |
| 15 东吴债           | -                | 2,492,000,000.00 | 233,800.74   | -    | 2,492,233,800.74 |
| 15 东吴 01 证券次级债   | -                | 2,994,000,000.00 | 1,554,743.80 | -    | 2,995,554,743.80 |
| 15 东吴 02 证券次级债   | -                | 2,997,000,000.00 | 708,942.57   | -    | 2,997,708,942.57 |
| 15 东吴 03 证券次级债一期 | -                | 2,000,000,000.00 | -            | -    | 2,000,000,000.00 |



| 债券名称                  | 期初余额             | 本期净增加             | 折溢价摊销        | 本期偿还 | 期末余额              |
|-----------------------|------------------|-------------------|--------------|------|-------------------|
| 15 东吴 03 证券次级债二期      | -                | 2,000,000,000.00  | -            | -    | 2,000,000,000.00  |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201501]号 | -                | 500,000,000.00    | -            | -    | 500,000,000.00    |
| 东吴证券固定收益凭证融通[201502]号 | -                | 500,000,000.00    | -            | -    | 500,000,000.00    |
| 合计                    | 2,975,791,937.06 | 13,483,000,000.00 | 8,090,874.67 | -    | 16,466,882,811.73 |

[注 1]经中国证券监督管理委员会《关于核准东吴证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复》（证监许可[2015]1211 号）核准，在批复自核准发行之日（2015 年 6 月 10 日）起 6 个月内，公司向合格投资者公开发行面值总额不超过 25 亿元的公司债券。公司于 2015 年 11 月 9 日发行了 5 年期单一期限品种公司债，并在上海证券交易所挂牌交易，公司本项债券无担保，发行金额为 25 亿元。

[注 2]2015 年 1 月 7 日，公司召开 2015 年第一次临时股东大会，审议通过了《关于公司发行次级债券的议案》，同意公司根据业务需要分期发行总额不超过人民币 100 亿元（含）、期限不超过 5 年的次级债券；本公司于本期共发行了 4 期 3 年期次级债券，总规模为 100 亿元。

[注 3]公司于本期共发行 2 期期限大于一年的收益凭证，产品收益率为 6.35%、6.05%。

### 31、其他负债

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目             | 期末账面余额           | 期初账面余额           |
|----------------|------------------|------------------|
| 预提费用           | 59,596,382.62    | 36,254,859.67    |
| 期货风险准备金        | 29,252,292.36    | 25,698,152.76    |
| 其他应付款          | 107,715,945.41   | 136,861,963.41   |
| 应付期货投资者保障基金    | 283,118.75       | 744,959.02       |
| 合并结构化主体形成的其他负债 | 6,668,165,287.03 | 3,732,327,013.39 |
| 股权转让预收款        | 9,375,000.00     | 20,300,000.00    |
| 代理兑付证券款        | 19,092.10        | 19,092.10        |

|    |                  |                  |
|----|------------------|------------------|
| 其他 | 2,607,961.07     | -                |
| 合计 | 6,877,015,079.34 | 3,952,206,040.35 |

其他负债的说明：

(1) 预提费用

| 项 目          | 期末余额          | 期初余额          |
|--------------|---------------|---------------|
| 证券投资者保护基金[注] | 26,975,665.72 | 12,696,343.57 |
| 广告费          | 19,250,000.00 | -             |
| 证券经纪人报酬      | 10,704,703.13 | 9,350,404.56  |
| 三方存管费        | 1,353,150.42  | 6,451,608.53  |
| 房租           | 715,302.35    | 380,396.66    |
| 其他           | 597,561.00    | 7,376,106.35  |
| 合 计          | 59,596,382.62 | 36,254,859.67 |

[注]证券投资者保护基金系公司根据中国证监会证监发[2007]50号文《关于印发〈证券公司缴纳证券投资者保护基金实施办法(试行)〉的通知》、中国证监会机构部部函[2007]268号文《关于发布实施〈证券公司分类监管工作指引(试行)〉的通知》按营业收入的一定比例计提,2015年和2014年计提比例分别为1.00%和0.75%。

(2) 期货风险准备金按期货手续费收入的5%计提。

(3) 其他应付款

| 项 目       | 期末余额           |        | 期初余额           |        |
|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
|           | 金额             | 比例(%)  | 金额             | 比例(%)  |
| 其他应付款     | 107,715,945.41 | 100.00 | 136,861,963.41 | 100.00 |
| 其中:逾期应付款项 | -              | -      | -              | -      |
| 合 计       | 107,715,945.41 | 100.00 | 136,861,963.41 | 100.00 |

期末其他应付款主要明细：

| 内 容             | 金 额           | 账 龄  | 款项性质      |
|-----------------|---------------|------|-----------|
| 员工风险金[注]        | 29,266,155.25 | 三年以内 | 员工风险金     |
| 经纪人风险金          | 12,130,629.87 | 一至二年 | 经纪人风险金    |
| 上海华东电脑系统工程有 限公司 | 7,701,027.72  | 二至三年 | 数据中心智能化系统 |
| 中国银行客户维护费       | 3,260,348.76  | 一年以内 | 客户维护费     |
| 恒生电子股份有限公司      | 1,730,829.06  | 二年以内 | 系统服务费     |
| 合 计             | 54,088,990.66 |      |           |

[注]员工风险金将按照公司相关制度规定考核后于满足条件年度返还。

(4) 期末其他应付款中无持有本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款情况。

(5) 应付期货投资者保障基金

| 项 目            | 期初余额       | 本期增加         | 本期减少         | 期末余额       |
|----------------|------------|--------------|--------------|------------|
| 应付期货投资者保障基金[注] | 744,959.02 | 2,679,235.37 | 3,141,075.64 | 283,118.75 |
| 合 计            | 744,959.02 | 2,679,235.37 | 3,141,075.64 | 283,118.75 |

[注]应付期货投资者保障基金 2015 年 1-2 月按代理交易额的千万分之七计提，3 月起按代理交易额的千万分之六点五计提。

### 32、股本

单位：元 币种：人民币

|      | 期初余额             | 本次变动增减（+、-） |    |       |    |    | 期末余额             |
|------|------------------|-------------|----|-------|----|----|------------------|
|      |                  | 发行新股        | 送股 | 公积金转股 | 其他 | 小计 |                  |
| 股份总数 | 2,700,000,000.00 | -           | -  | -     | -  | -  | 2,700,000,000.00 |

其他说明：

| 项 目       | 期初余额             | 本期变动增 (+) 减 (-) |                |    | 期末余额             |
|-----------|------------------|-----------------|----------------|----|------------------|
|           |                  | 本期增加            | 本期减少           | 小计 |                  |
| 一、有限售条件股份 |                  |                 |                |    |                  |
| 1、国有法人股   | 449,000,000.00   | -               | 340,000,000.00 | -  | 109,000,000.00   |
| 2、社会法人股   | 251,000,000.00   | -               | 251,000,000.00 | -  | -                |
| 小 计       | 700,000,000.00   | -               | 591,000,000.00 | -  | 109,000,000.00   |
| 二、无限售条件股份 |                  |                 |                |    |                  |
| 1、人民币普通股  | 2,000,000,000.00 | 591,000,000.00  | -              | -  | 2,591,000,000.00 |
| 小 计       | 2,000,000,000.00 | 591,000,000.00  | -              | -  | 2,591,000,000.00 |
| 合 计       | 2,700,000,000.00 | 591,000,000.00  | 591,000,000.00 | -  | 2,700,000,000.00 |

### 33、资本公积

单位：元 币种：人民币

| 项目         | 期初余额             | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额             |
|------------|------------------|------|------|------------------|
| 资本溢价（股本溢价） | 8,563,640,848.19 | -    | -    | 8,563,640,848.19 |
| 其他资本公积     | 1,035,365.74     | -    | -    | 1,035,365.74     |
| 合计         | 8,564,676,213.93 | -    | -    | 8,564,676,213.93 |

### 34、其他综合收益

√适用□不适用

| 项 目              | 期初余额           | 本期发生金额         |                    |               |               |            |               | 期末余额           |
|------------------|----------------|----------------|--------------------|---------------|---------------|------------|---------------|----------------|
|                  |                | 本期所得税前发生额      | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 减：所得税费用       | 税后归属于母公司      | 税后归属于少数股东  | 其他            |                |
| 以后将重分类进损益的其他综合收益 | 255,204,488.79 | 416,222,081.21 | 209,389,880.95     | 95,727,303.11 | 90,065,001.01 | 120,066.39 | 20,919,829.75 | 345,269,489.80 |

| 项目                                  | 期初余额           | 本期发生金额         |                    |               |               |            |               | 期末余额           |
|-------------------------------------|----------------|----------------|--------------------|---------------|---------------|------------|---------------|----------------|
|                                     |                | 本期所得税前发生额      | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 减：所得税费用       | 税后归属于母公司      | 税后归属于少数股东  | 其他            |                |
| 其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 | -              | -              | -                  | -             | -             | -          | -             | -              |
| 可供出售金融资产公允价值变动损益                    | 255,204,488.79 | 416,069,426.58 | 209,389,880.95     | 95,727,303.11 | 89,950,510.04 | 81,902.73  | 20,919,829.75 | 345,154,998.83 |
| 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益               | -              | -              | -                  | -             | -             | -          | -             | -              |
| 现金流量套期损益的有效部分                       | -              | -              | -                  | -             | -             | -          | -             | -              |
| 外币财务报表折算差额                          | -              | 152,654.63     | -                  | -             | 114,490.97    | 38,163.66  | -             | 114,490.97     |
| 其他综合收益合计                            | 255,204,488.79 | 416,222,081.21 | 209,389,880.95     | 95,727,303.11 | 90,065,001.01 | 120,066.39 | 20,919,829.75 | 345,269,489.80 |

(续上表)

| 项目                                  | 期初余额     | 上期发生金额         |                    |               |                |            | 期末余额           |
|-------------------------------------|----------|----------------|--------------------|---------------|----------------|------------|----------------|
|                                     |          | 本期所得税前发生额      | 减：前期计入其他综合收益当期转入损益 | 减：所得税费用       | 税后归属于母公司       | 税后归属于少数股东  |                |
| 以后将重分类进损益的其他综合收益                    | 3,892.34 | 368,973,282.36 | 21,282,125.72      | 92,243,320.61 | 255,200,596.45 | 247,239.58 | 255,204,488.79 |
| 其中：权益法下在被投资单位以后将重分类进损益的其他综合收益中享有的份额 | -        | -              | -                  | -             | -              | -          | -              |
| 可供出售金融资产公允价值变动损益                    | 3,892.34 | 368,973,282.36 | 21,282,125.72      | 92,243,320.61 | 255,200,596.45 | 247,239.58 | 255,204,488.79 |
| 持有至到期投资重分类为可供出售金融资产损益               | -        | -              | -                  | -             | -              | -          | -              |
| 现金流量套期损益的有效部分                       | -        | -              | -                  | -             | -              | -          | -              |
| 外币财务报表折算差额                          | -        | -              | -                  | -             | -              | -          | -              |
| 其他综合收益合计                            | 3,892.34 | 368,973,282.36 | 21,282,125.72      | 92,243,320.61 | 255,200,596.45 | 247,239.58 | 255,204,488.79 |

## 35、 盈余公积

单位：元 币种：人民币

| 项目     | 期初余额           | 本期增加           | 本期减少 | 期末余额           |
|--------|----------------|----------------|------|----------------|
| 法定盈余公积 | 252,801,672.22 | 265,868,207.29 | -    | 518,669,879.51 |
| 合计     | 252,801,672.22 | 265,868,207.29 | -    | 518,669,879.51 |

## 36、 一般风险准备

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目     | 期初余额           | 本期增加           | 本期减少 | 期末余额             |
|--------|----------------|----------------|------|------------------|
| 一般风险准备 | 453,103,052.03 | 278,349,652.21 | -    | 731,452,704.24   |
| 交易风险准备 | 367,635,144.92 | 265,868,207.29 | -    | 633,503,352.21   |
| 合计     | 820,738,196.95 | 544,217,859.50 | -    | 1,364,956,056.45 |

注：计提标准详见本附注 5：5.37 中注 1。

## 37、 未分配利润

单位：元 币种：人民币

| 项目                    | 本期               | 上期               |
|-----------------------|------------------|------------------|
| 调整前上期末未分配利润           | 1,485,436,624.61 | 816,913,864.08   |
| 调整期初未分配利润合计数（调增+，调减-） | -                | -                |
| 调整后期初未分配利润            | 1,485,436,624.61 | 816,913,864.08   |
| 加：本期归属于母公司所有者的净利润     | 2,708,494,901.88 | 1,115,452,050.88 |
| 减：提取法定盈余公积[注1]        | 265,868,207.29   | 87,989,003.16    |

|              |                  |                  |
|--------------|------------------|------------------|
| 提取一般风险准备[注1] | 544,217,859.50   | 238,940,287.19   |
| 应付普通股股利[注2]  | 337,500,000.00   | 120,000,000.00   |
| 期末未分配利润      | 3,046,345,459.70 | 1,485,436,624.61 |

[注 1]依据《公司法》、《金融企业财务规则》、《证券法》以及本公司章程，本公司税后净利润在弥补以前年度未弥补亏损后，按 10%分别提取法定盈余公积、一般风险准备和交易风险准备，剩余可供股东分配的利润由董事会提出利润分配预案报股东大会批准后实施。本公司提取的一般风险准备，用于弥补尚未识别的可能性损失；提取的交易风险准备，用于弥补证券交易的损失；盈余公积用于弥补本公司的亏损、扩大本公司生产经营或者转为增加股本。法定盈余公积转为股本时，所留存的该项盈余公积不得少于转增前本公司注册资本的 25%。

一般风险准备还包括本公司下属子公司根据所属行业或所属地区适用法规提取的一般风险准备和交易风险准备中归属于母公司所有者的份额。

[注 2]2015 年 5 月 15 日，公司 2014 年年度股东大会决议通过 2014 年度利润分配方案：以审计后的净利润为基准，按 10%的比例计提法定盈余公积、按 10%的比例计提交易风险准备、按 10%的比例计提一般风险准备、按每 10 股派送 1.25 元现金红利（含税）。

### 38、 少数股东权益

| 项目             | 本期发生额          | 上期发生额          |
|----------------|----------------|----------------|
| 期初少数股东权益       | 154,524,217.52 | 68,069,941.22  |
| 加：所有者投入资本      | 36,375,360.00  | 81,263,532.31  |
| 归属于少数股东的净利润    | 24,798,122.71  | 9,107,302.81   |
| 归属于少数股东的其他综合收益 | 120,066.39     | 247,239.58     |
| 减：利润分配         | 3,366,000.00   | 4,163,798.40   |
| 期末少数股东权益       | 212,451,766.62 | 154,524,217.52 |

## 39、手续费及佣金净收入

## (1) 手续费及佣金净收入情况

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 本期发生额            | 上期发生额            |
|-------------|------------------|------------------|
| 手续费及佣金收入    | 4,629,644,638.37 | 1,952,656,621.55 |
| 证券经纪业务      | 3,356,030,532.30 | 1,216,557,224.14 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 3,290,889,176.15 | 1,185,731,731.22 |
| 交易单元席位租赁    | 53,878,036.36    | 16,417,701.92    |
| 代销金融产品业务    | 11,263,319.79    | 14,407,791.00    |
| 期货经纪业务      | 71,082,792.11    | 65,445,766.19    |
| 投资银行业务      | 765,676,414.50   | 501,739,502.38   |
| 其中：证券承销业务   | 460,931,235.93   | 319,145,236.00   |
| 证券保荐业务      | 35,375,000.00    | 42,139,140.00    |
| 财务顾问业务      | 269,370,178.57   | 140,455,126.38   |
| 资产管理业务      | 211,023,414.19   | 110,997,700.06   |
| 基金管理业务      | 131,468,141.60   | 26,998,822.98    |
| 投资咨询业务      | 61,119,237.42    | 15,194,550.37    |
| 其他          | 33,244,106.25    | 15,723,055.43    |
| 手续费及佣金支出    | 808,035,479.91   | 274,284,118.15   |
| 证券经纪业务      | 780,859,201.04   | 234,074,279.86   |
| 其中：代理买卖证券业务 | 780,859,201.04   | 234,074,279.86   |
| 交易单元席位租赁    |                  |                  |
| 代销金融产品业务    |                  |                  |
| 期货经纪业务      |                  |                  |
| 投资银行业务      | 8,120,000.00     | 33,346,000.00    |
| 其中：证券承销业务   | 4,250,000.00     | 33,346,000.00    |
| 证券保荐业务      |                  |                  |
| 财务顾问业务      | 3,870,000.00     |                  |
| 资产管理业务      | 4,347,682.86     | 1,555,231.25     |
| 基金管理业务      |                  |                  |



|                       |                  |                  |
|-----------------------|------------------|------------------|
| 投资咨询业务                |                  |                  |
| 其他                    | 14,708,596.01    | 5,308,607.04     |
| 手续费及佣金净收入             | 3,821,609,158.46 | 1,678,372,503.40 |
| 其中：财务顾问业务净收入          | 265,500,178.57   | 140,455,126.38   |
| —并购重组财务顾问业务净收入—境内上市公司 | 25,610,000.00    | 52,600,000.00    |
| —并购重组财务顾问业务净收入—其他     |                  |                  |
| —其他财务顾问业务净收入          | 239,890,178.57   | 87,855,126.38    |

## (2) 代理销售金融产品业务

单位：元 币种：人民币

| 代销金融产品业务 | 本期                |               | 上期                |               |
|----------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|
|          | 销售总金额             | 销售总收入         | 销售总金额             | 销售总收入         |
| 基金       | 4,375,388,805.42  | 5,780,225.80  | 2,030,091,447.21  | 3,442,091.00  |
| 资产管理计划   | 64,367,588,850.93 | 5,483,093.99  | 32,396,149,939.39 | 10,965,700.00 |
| 合计       | 68,742,977,656.35 | 11,263,319.79 | 34,426,241,386.60 | 14,407,791.00 |

## (3) 资产管理业务

单位：元 币种：人民币

| 项目        | 集合资产管理业务         | 定向资产管理业务           | 专项资产管理业务          |
|-----------|------------------|--------------------|-------------------|
| 期末产品数量    | 34.00            | 211.00             | 139.00            |
| 期末客户数量    | 3,925.00         | 211.00             | 1,917.00          |
| 其中：个人客户   | 3,875.00         | 15.00              | 1,746.00          |
| 机构客户      | 50.00            | 196.00             | 171.00            |
| 期初受托资金    | 2,606,829,602.36 | 117,660,809,199.47 | 22,533,354,300.33 |
| 其中：自有资金投入 | 98,667,871.30    |                    | 18,000,000.00     |
| 个人客户      | 2,143,984,519.46 |                    | 3,785,456,341.31  |
| 机构客户      | 364,177,211.60   | 117,660,809,199.47 | 18,729,897,959.02 |
| 期末受托资金    | 5,460,097,246.25 | 190,886,608,584.47 | 34,853,297,636.01 |
| 其中：自有资金投入 | 100,419,214.30   | -                  | 113,000,000.00    |
| 个人客户      | 3,722,509,959.57 | 296,800,000.00     | 5,058,025,923.68  |
| 机构客户      | 1,637,168,072.38 | 190,589,808,584.47 | 29,682,271,712.33 |

|              |                  |                    |                   |
|--------------|------------------|--------------------|-------------------|
| 期末主要受托资产初始成本 | 5,515,988,208.86 | 175,251,253,036.01 | 33,843,112,412.02 |
| 其中：股票        | 625,372,729.56   | 1,789,116,669.55   | 1,653,675,312.20  |
| 国债           | 29,323,199.79    | -                  | -                 |
| 其他债券         | 833,262,098.89   | 609,307,580.96     | 169,331,073.31    |
| 基金           | 255,026,429.77   | 738,766,658.98     | 724,973,423.33    |
| 信托           | 3,302,080,000.00 | 34,398,318,155.56  | -                 |
| 票据           | -                | 2,787,532,720.92   | -                 |
| 理财           | -                | 11,101,145,964.22  | -                 |
| 买入返售         | 63,402,952.00    | 12,639,964,897.83  | 434,000,000.00    |
| 委托贷款         | -                | 29,522,636,000.00  | -                 |
| 收益权          | -                | 65,014,745,093.88  | 1,180,000,000.00  |
| 协议或定期存款      | 233,622,166.85   | 2,614,810,000.00   | -                 |
| 信贷资产         | -                | 14,034,909,294.11  | -                 |
| 其他           | 173,898,632.00   | -                  | 29,681,132,603.18 |
| 当期资产管理业务净收入  | 59,430,282.52    | 83,569,945.64      | 63,675,503.17     |

#### 40、利息净收入

单位：元 币种：人民币

| 项目            | 本期发生额            | 上期发生额          |
|---------------|------------------|----------------|
| 利息收入          | 2,399,648,330.19 | 825,805,711.08 |
| 存放金融同业利息收入    | 667,146,513.79   | 234,063,711.17 |
| 其中：自有资金存款利息收入 | 189,893,762.10   | 90,674,509.51  |
| 客户资金存款利息收入    | 477,252,751.69   | 142,497,149.77 |
| 融资融券利息收入      | 1,033,083,498.19 | 307,941,904.20 |
| 买入返售金融资产利息收入  | 672,126,805.90   | 261,406,879.97 |
| 其中：约定购回利息收入   | 25,581,442.57    | 12,362,913.11  |
| 股权质押回购利息收入    | 309,454,219.36   | 236,204,721.43 |
| 拆出资金利息收入      |                  | 2,100,000.00   |

|              |                  |                |
|--------------|------------------|----------------|
| 其他           | 27,291,512.31    | 20,293,215.74  |
| 利息支出         | 2,113,092,778.70 | 683,451,503.25 |
| 客户资金存款利息支出   | 98,156,310.99    | 32,141,065.85  |
| 卖出回购金融资产利息支出 | 779,712,802.23   | 249,742,286.96 |
| 其中：报价回购利息支出  | 4,803,399.82     | 9,120,270.38   |
| 短期借款利息支出     | 4,118,197.94     |                |
| 拆入资金利息支出     | 101,775,889.34   | 55,448,088.87  |
| 其中：转融通利息支出   | 100,574,794.43   | 55,240,033.32  |
| 应付债券利息支出     | 643,337,704.39   | 190,597,894.66 |
| 应付短期融资款利息支出  | 122,613,628.19   | 49,016,806.66  |
| 其他           | 363,378,245.62   | 106,505,360.25 |
| 利息净收入        | 286,555,551.49   | 142,354,207.83 |

#### 41、投资收益

√适用□不适用

(1) 投资收益明细情况

单位：元 币种：人民币

| 项目                      | 本期发生额            | 上期发生额            |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 权益法核算的长期股权投资收益          | 2,643,966.52     | 7,202,544.72     |
| 处置长期股权投资产生的投资收益         |                  |                  |
| 金融工具投资收益                | 2,381,332,785.50 | 1,160,303,270.69 |
| 其中：持有期间取得的收益            | 704,217,093.41   | 348,553,639.86   |
| —以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 320,150,168.67   | 195,027,804.64   |
| —持有至到期投资                | 19,489,687.43    | 2,994,372.68     |
| —可供出售金融资产               | 364,577,237.31   | 150,531,462.54   |
| 处置金融工具取得的收益             | 1,677,115,692.09 | 811,749,630.83   |
| —以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 862,794,632.20   | 645,863,359.82   |
| —持有至到期投资                |                  |                  |

|                   |                  |                  |
|-------------------|------------------|------------------|
| —可供出售金融资产         | 841,871,006.19   | 217,755,841.77   |
| —衍生金融工具           | -27,549,946.30   | -51,869,570.76   |
| 追加投资取得子公司而产生的投资收益 |                  | 164,539,380.96   |
| 合计                | 2,383,976,752.02 | 1,332,045,196.37 |

## (2) 对联营企业和合营企业的投资收益

| 被投资单位                 | 本期发生额         | 上期发生额        | 本期比上期增减变动的原因          |
|-----------------------|---------------|--------------|-----------------------|
| 东吴基金管理有限公司            | -             | 6,635,940.33 | 2014年9月收购部分股权转让为子公司核算 |
| 许昌绿野农业科技有限公司          | -233.25       | -1,131.67    | 被投资单位利润增加             |
| 华元恒道(上海)投资管理有限公司      | 6,885,650.24  | 567,736.06   | 被投资单位利润增加             |
| 东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司 | -4,241,450.47 | -            | 本期新增的联营企业             |
| 合计                    | 2,643,966.52  | 7,202,544.72 |                       |

(3) 公司投资收益汇回无重大限制情况。

## 42、公允价值变动收益 / (损失)

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 本期发生额          | 上期发生额          |
|------------------------|----------------|----------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 290,458,733.83 | 94,369,994.88  |
| 衍生金融工具                 | 16,169,836.85  | -20,522,040.00 |
| 合计                     | 306,628,570.68 | 73,847,954.88  |

## 43、其他业务收入、成本

| 项目 | 本期发生额 | 上期发生额 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

| 项 目           | 本期发生额         | 上期发生额         |
|---------------|---------------|---------------|
| <b>其他业务收入</b> |               |               |
| 其中：出租收入       | 3,176,362.86  | 4,114,835.28  |
| 投资咨询收入        | 7,141,085.62  | 4,844,662.32  |
| 贸易收入          | 12,318,085.61 | -             |
| 其他            | 7,593,713.24  | 5,368,654.11  |
| 合 计           | 30,229,247.33 | 14,328,151.71 |
| <b>其他业务成本</b> |               |               |
| 其中：贸易成本       | 12,433,685.30 | -             |
| 合 计           | 12,433,685.30 | -             |

#### 44、 营业税金及附加

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 本期发生额          | 上期发生额          | 计缴标准       |
|---------|----------------|----------------|------------|
| 营业税     | 370,216,237.31 | 159,990,013.11 | 参见本附注 4.01 |
| 城市维护建设税 | 25,719,727.31  | 11,049,757.41  | 参见本附注 4.03 |
| 教育费附加   | 18,594,711.25  | 7,986,870.35   | 参见本附注 4.04 |
| 其他      | 160,903.62     | 32,866.17      |            |
| 合 计     | 414,691,579.49 | 179,059,507.04 |            |

#### 45、 业务及管理费

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 本期发生额            | 上期发生额          |
|---------|------------------|----------------|
| 1. 职工工资 | 1,787,754,814.11 | 920,897,238.45 |

|             |                  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
| 2. 社会保险费    | 94,053,624.85    | 21,421,542.92    |
| 3. 固定资产折旧费  | 76,613,119.99    | 73,330,461.06    |
| 4. 租赁费及物业费  | 72,745,000.65    | 60,886,110.47    |
| 5. 投资者保护基金  | 65,164,112.59    | 22,548,215.78    |
| 6. 宣传广告费    | 55,213,664.90    | 6,393,443.67     |
| 7. 业务营销费    | 54,024,830.17    | 49,089,943.29    |
| 8. 咨询费      | 39,047,011.76    | 38,109,285.92    |
| 9. 住房公积金    | 33,773,992.94    | 26,024,612.34    |
| 10. 交易所会员年费 | 30,016,839.97    | 7,862,460.64     |
| 11. 其他      | 347,692,011.49   | 352,629,016.41   |
| 合计          | 2,656,099,023.42 | 1,579,192,330.95 |

#### 46、资产减值损失

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目             | 本期发生额         | 上期发生额         |
|----------------|---------------|---------------|
| 一、坏账损失         | 21,781,752.78 | -280,006.61   |
| 二、存货跌价损失       |               |               |
| 三、可供出售金融资产减值损失 | -             | 375,316.86    |
| 四、持有至到期投资减值损失  |               |               |
| 五、长期股权投资减值损失   |               |               |
| 六、投资性房地产减值损失   |               |               |
| 七、固定资产减值损失     |               |               |
| 八、工程物资减值损失     |               |               |
| 九、在建工程减值损失     |               |               |
| 十、生产性生物资产减值损失  |               |               |
| 十一、油气资产减值损失    |               |               |
| 十二、无形资产减值损失    |               |               |
| 十三、商誉减值损失      |               | 15,361,400.00 |

|                |               |               |
|----------------|---------------|---------------|
| 十四、信用交易风险准备[注] | 1,015,273.09  | 36,673,211.09 |
| 合计             | 22,797,025.87 | 52,129,921.34 |

[注]本期融出资金计提减值准备 5,984,920.92 元，融出证券转回减值准备 80,192.83 元，买入返售金融资产转回减值准备 4,889,455.00 元，本期合计计提信用交易风险准备 1,015,273.09 元。

#### 47、营业外收入

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 本期发生额         | 计入当期非经常性损益的金额 | 上期发生额         |
|-------------|---------------|---------------|---------------|
| 非流动资产处置利得合计 | 120,365.63    | 120,365.63    | 4,522,049.38  |
| 其中：固定资产处置利得 | 120,365.63    | 120,365.63    | 4,522,049.38  |
| 政府补助        | 18,492,164.47 | 18,492,164.47 | 16,974,400.00 |
| 其他          | 287,699.41    | 287,699.41    | 621,084.55    |
| 合计          | 18,900,229.51 | 18,900,229.51 | 22,117,533.93 |

计入当期损益的政府补助

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 补助项目                   | 本期发生金额       | 上期发生金额       |
|------------------------|--------------|--------------|
| 中关村科技园区管理委员会划入改制上市券商补助 | 200,000.00   | -            |
| 徐州市财政局财政经费补助新三板挂牌奖励资金  | 400,000.00   | -            |
| 南通苏通科技产业园区管理委员会房租综合补贴  | 284,000.00   | -            |
| 常州新北区财政局金融产业发展基金       | 539,000.00   | 2,346,000.00 |
| 苏州市园区国库支付金融产业扶持基金      | 3,000,000.00 | 3,000,000.00 |
| 上海市黄浦区财政局产业扶持资金        | 3,380,000.00 | 4,340,000.00 |

|                              |               |               |
|------------------------------|---------------|---------------|
| 相城经济开发区财政局奖励                 | -             | 500,000.00    |
| 徐州市财政局金融业专项补贴                | 500,000.00    | 3,500,000.00  |
| 北京市西城区财政局给予西城区金融大街驻地金融单位房租补贴 | -             | 478,000.00    |
| 苏州市国库支付中心金融工作办苏州指数费用         | -             | 500,000.00    |
| 税收返还                         | 319,164.47    | 1,565,600.00  |
| 昆山花桥经济开发区入驻奖励                | 9,730,000.00  | -             |
| 其他                           | 140,000.00    | 744,800.00    |
| 合计                           | 18,492,164.47 | 16,974,400.00 |

#### 48、营业外支出

单位：元 币种：人民币

| 项目          | 本期发生额         | 计入当期非经常性损益的金额 | 上期发生额        |
|-------------|---------------|---------------|--------------|
| 非流动资产处置损失合计 | 1,628,127.84  | 1,628,127.84  | 1,790,077.20 |
| 其中：固定资产处置损失 | 1,628,127.84  | 1,628,127.84  | 1,790,077.20 |
| 对外捐赠        | 1,589,730.00  | 1,589,730.00  | 1,032,240.00 |
| 预计负债        | 81,754,000.00 | -             | -            |
| 计提各项基金及其他支出 | 802,568.09    | 802,568.09    | 1,105,086.55 |
| 合计          | 85,774,425.93 | 4,020,425.93  | 3,927,403.75 |

#### 49、所得税费用

##### (1) 所得税费用表

单位：元 币种：人民币

| 项目      | 本期发生额            | 上期发生额          |
|---------|------------------|----------------|
| 当期所得税费用 | 1,045,829,538.29 | 402,843,810.86 |
| 递延所得税费用 | -121,856,148.06  | -78,612,265.83 |
| 合计      | 923,973,390.23   | 324,231,545.03 |



## (2) 会计利润与所得税费用调整过程:

单位: 元 币种: 人民币

| 项目                             | 本期发生额            |
|--------------------------------|------------------|
| 利润总额                           | 3,657,266,414.82 |
| 按法定/适用税率计算的所得税费用               | 914,316,603.71   |
| 子公司适用不同税率的影响                   | -                |
| 调整以前期间所得税的影响                   | -899,947.90      |
| 非应税收入的影响                       | -5,995,696.67    |
| 不可抵扣的成本、费用和损失的影响               | 7,243,739.56     |
| 使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响        | -                |
| 本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响 | -                |
| 其他                             | 9,308,691.53     |
| 所得税费用                          | 923,973,390.23   |

## 50、其他综合收益

详见本附注 5: 5.34。

## 51、每股收益

## (1) 基本每股收益

| 项目                | 2015 年度          | 2014 年度          |
|-------------------|------------------|------------------|
| 归属于本公司普通股股东的合并净利润 | 2,708,494,901.88 | 1,115,452,050.88 |
| 本公司发行在外普通股的加权平均数  | 2,700,000,000.00 | 2,291,666,666.67 |
| 基本每股收益 (元/股)      | 1.00             | 0.49             |

## (2) 稀释每股收益

本公司不存在稀释性潜在普通股，因此稀释每股收益的计算过程与基本每股收益的计算过程相同。

## 52、现金流量表项目

## (1). 收到的其他与经营活动有关的现金:

单位: 元 币种: 人民币

| 项目                  | 本期发生额            | 上期发生额            |
|---------------------|------------------|------------------|
| 纳入合并的结构化产品收到其他投资者投入 | 2,692,912,490.62 | 3,433,724,688.85 |
| 政府补助                | 18,492,164.47    | 16,974,400.00    |
| 存出保证金减少             | 203,830,460.68   | -                |
| 其他                  | 275,310,015.23   | 20,928,145.52    |
| 合计                  | 3,190,545,131.00 | 3,471,627,234.37 |

## (2). 支付的其他与经营活动有关的现金:

单位: 元 币种: 人民币

| 项目        | 本期发生额          | 上期发生额            |
|-----------|----------------|------------------|
| 存出保证金增加   | -              | 632,131,619.29   |
| 应收款项类投资   | 50,000,000.00  | 575,000,000.00   |
| 支付的业务及管理费 | 525,575,603.74 | 373,018,688.48   |
| 投资者保护基金   | 51,346,630.71  | 14,242,562.64    |
| 其他        | 296,854,455.21 | 259,755,157.18   |
| 合计        | 923,776,689.66 | 1,854,148,027.59 |

## (3). 收到的其他与投资活动有关的现金

单位: 元 币种: 人民币

| 项目           | 本期发生额      | 上期发生额        |
|--------------|------------|--------------|
| 处置固定资产收到的现金  | 624,092.67 | 6,346,901.43 |
| 合并结构化主体收到的现金 | -          | 1,772,150.17 |
| 合计           | 624,092.67 | 8,119,051.60 |

## (4). 收到的其他与筹资活动有关的现金

单位：元 币种：人民币

| 项目   | 本期发生额         | 上期发生额 |
|------|---------------|-------|
| 仓单质押 | 13,684,509.36 | -     |
| 合计   | 13,684,509.36 |       |

## (5). 支付的其他与筹资活动有关的现金

单位：元 币种：人民币

| 项目           | 本期发生额         | 上期发生额          |
|--------------|---------------|----------------|
| 支付的定向增发费用    | -             | 117,520,000.00 |
| 支付的短期融资券发行费用 | 22,892,664.37 | 150,000.00     |
| 合计           | 22,892,664.37 | 117,670,000.00 |

## 53、现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

单位：元 币种：人民币

| 补充资料                             | 本期金额             | 上期金额             |
|----------------------------------|------------------|------------------|
| <b>1. 将净利润调节为经营活动现金流量：</b>       |                  |                  |
| 净利润                              | 2,733,293,024.59 | 1,124,559,353.69 |
| 加：资产减值准备                         | 22,797,025.87    | 52,129,921.34    |
| 固定资产折旧、油气资产折耗、生产性生物资产折旧          | 76,613,119.99    | 73,330,461.06    |
| 无形资产摊销                           | 23,116,857.38    | 15,089,398.66    |
| 长期待摊费用摊销                         | 17,908,931.90    | 21,190,890.39    |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“－”号填列） | 1,507,762.21     | -2,731,972.18    |
| 固定资产报废损失（收益以“－”号填列）              | -                | -                |
| 公允价值变动损失（收益以“－”号填列）              | -                | -                |
| 利息支出                             | 770,087,464.22   | 239,580,187.64   |
| 投资损失（收益以“－”号填列）                  | -2,643,966.52    | -171,741,925.68  |

|                              |                    |                    |
|------------------------------|--------------------|--------------------|
| 递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）         | -107,706,517.10    | 3,774,674.32       |
| 递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）         | 6,927,171.04       | 2,689,891.59       |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产减少     | -                  | -                  |
| 经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）        | -10,785,689,297.87 | -28,433,998,324.62 |
| 经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）        | 5,437,775,878.30   | 28,082,594,778.25  |
| 其他                           | -                  | -                  |
| 经营活动产生的现金流量净额                | -1,806,012,545.99  | 1,006,467,334.46   |
| <b>2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动：</b> |                    |                    |
| 债务转为资本                       | -                  | -                  |
| 一年内到期的可转换公司债券                | -                  | -                  |
| 融资租入固定资产                     | -                  | -                  |
| <b>3. 现金及现金等价物净变动情况：</b>     |                    |                    |
| 现金的期末余额                      | 28,181,391,000.34  | 16,053,451,825.17  |
| 减：现金的期初余额                    | 16,053,451,825.17  | 7,249,659,533.20   |
| 加：现金等价物的期末余额                 | -                  | -                  |
| 减：现金等价物的期初余额                 | -                  | -                  |
| 现金及现金等价物净增加额                 | 12,127,939,175.17  | 8,803,792,291.97   |

## (2) 现金和现金等价物的构成

单位：元 币种：人民币

| 项目                          | 期末余额              | 期初余额              |
|-----------------------------|-------------------|-------------------|
| 一、现金                        | 28,181,391,000.34 | 16,053,451,825.17 |
| 其中：库存现金                     | 138,113.95        | 282,960.09        |
| 可随时用于支付的银行存款                | 23,292,480,489.16 | 10,126,568,947.01 |
| 可随时用于支付的其他货币资金              | 60,867,377.39     | 30,031,891.38     |
| 结算备付金                       | 4,827,905,019.84  | 5,896,568,026.69  |
| 二、现金等价物                     | -                 | -                 |
| 三、期末现金及现金等价物余额              | 28,181,391,000.34 | 16,053,451,825.17 |
| 其中：母公司或集团内子公司使用受限制的现金和现金等价物 | -                 | -                 |

## 54、外币货币性项目

√适用□不适用

## (1). 外币货币性项目：

单位：元

| 项目      | 期末外币余额        | 折算汇率   | 期末折算人民币<br>余额  |
|---------|---------------|--------|----------------|
| 货币资金    |               |        |                |
| 其中：美元   | 29,622,508.32 | 6.4936 | 192,356,720.03 |
| 港币      | 28,020,946.30 | 0.8378 | 23,475,948.80  |
| 结算备付金   |               |        |                |
| 其中：美元   | 8,312,086.67  | 6.4936 | 53,975,366.00  |
| 港币      | 6,647,154.13  | 0.8378 | 5,568,985.73   |
| 存出保证金   |               |        |                |
| 其中：美元   | 270,000.00    | 6.4936 | 1,753,272.00   |
| 港币      | 1,000,000.00  | 0.8378 | 837,800.00     |
| 代理买卖证券款 |               |        |                |
| 其中：美元   | 35,069,540.57 | 6.4936 | 227,727,568.64 |
| 港元      | 33,058,386.06 | 0.8378 | 27,696,315.82  |

| 项 目  | 期初余额 |     |       |
|------|------|-----|-------|
|      | 外币金额 | 折算率 | 人民币金额 |
| 货币资金 |      |     |       |

| 项 目     | 期初余额          |        |                |
|---------|---------------|--------|----------------|
|         | 外币金额          | 折算率    | 人民币金额          |
| 其中：美元   | 13,833,815.48 | 6.1190 | 84,649,116.94  |
| 港元      | 16,346,420.47 | 0.7889 | 12,895,691.11  |
| 其他      | -             | -      | -              |
| 结算备付金   |               |        |                |
| 其中：美元   | 4,647,509.62  | 6.1190 | 28,438,111.36  |
| 港元      | 5,954,356.82  | 0.7889 | 4,697,392.10   |
| 其他      | -             | -      | -              |
| 存出保证金   |               |        |                |
| 其中：美元   | 270,000.00    | 6.1190 | 1,652,130.00   |
| 港元      | 700,000.00    | 0.7889 | 552,230.00     |
| 其他      | -             | -      | -              |
| 代理买卖证券款 |               |        |                |
| 其中：美元   | 16,628,488.44 | 6.1190 | 101,749,720.74 |
| 港元      | 21,498,336.11 | 0.7889 | 16,960,037.34  |
| 其他      | -             | -      | -              |

## 附注 6、合并范围的变更

### 1、非同一控制下企业合并

适用 不适用

### 2、同一控制下企业合并

适用 不适用

### 3、 报告期新设子公司纳入合并范围的主体

| 名称                 | 归属母公司权益比例 | 期末净资产          | 本期净利润        | 备注                    |
|--------------------|-----------|----------------|--------------|-----------------------|
| 上海东吴玖盈投资管理有限公司     | 100.00%   | 107,042,050.56 | 6,602,900.73 | 公司子公司东吴期货有限公司本期投资设立   |
| 昆山东吴阳澄投资管理有限公司     | 80.00%    | 983,562.33     | -16,437.67   | 公司子公司东吴创业投资有限公司本期投资设立 |
| 东吴证券中新（新加坡）有限公司    | 75.00%    | 45,192,308.76  | -676,455.87  | 公司本期投资设立的子公司          |
| 昆山东吴阳澄创业投资中心（有限合伙） | 50.50%    | 50,055,348.77  | 55,348.77    | 昆山东吴阳澄投资管理有限公司本期投资设立  |

### 4、 纳入合并范围的结构化主体

本公司根据准则 33 号(2014)，对于本公司同时作为管理人和投资人，且综合评估本公司因持有投资份额而享有的回报以及作为结构化主体管理人的管理人报酬将使本公司面临可变回报的影响重大的结构化主体进行了合并，本期纳入公司合并报表范围的结构化产品共 30 只（其中有 5 只产品已于 2015 年度清算）。

## 附注 7、在其他主体中权益的披露

## 1、在子公司中的权益

√适用□不适用

## (1). 企业集团的构成

| 子公司名称          | 主要经营地 | 注册地                         | 业务性质            | 持股比例 (%) |          | 表决权比例    | 注册资本             | 取得方式 |
|----------------|-------|-----------------------------|-----------------|----------|----------|----------|------------------|------|
|                |       |                             |                 | 直接       | 间接       |          |                  |      |
| 东吴期货有限公司       | 苏州    | 上海市黄浦区西藏南路 1208 号东吴证券大厦 6 楼 | 期货经纪、投资咨询       | 89.80 %  | -        | 89.80 %  | 500,000,000.00   | 购买   |
| 东吴基金管理有限公司     | 上海    | 上海浦东源深路 279 号               | 基金募集、销售、管理      | 70.00 %  | -        | 70.00 %  | 100,000,000.00   | 购买   |
| 上海东吴玖盈投资管理有限公司 | 上海    | 上海市黄浦区普安路 128 号 703 室 H8 座  | 投资管理及其咨询, 实物投资等 | -        | 100.00 % | 100.00 % | 100,000,000.00   | 设立   |
| 东              | 苏     | 昆山花桥经济开发区商银路                | 创               | 100.0    | -        | 100.0    | 1,200,000,000.00 | 设    |



|                 |    |                          |           |         |        |         |                  |    |
|-----------------|----|--------------------------|-----------|---------|--------|---------|------------------|----|
| 吴创业投资有限公司       | 州  | 538 号国际金融大厦              | 业投资、投资咨询  | 0%      |        | 0%      |                  | 立  |
| 东吴创新资本管理有限责任公司  | 苏州 | 昆山花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦 | 投资管理、投资咨询 | 100.00% | -      | 100.00% | 2,000,000,000.00 | 设立 |
| 上海新东吴优胜资产管理有限公司 | 上海 | 上海市黄浦区九江路 769 号 1806-3 室 | 资产管理      | -       | 70.00% | 70.00%  | 20,000,000.00    | 设立 |
| 苏州业联投资          | 苏州 | 吴江区松陵镇人民路 300 号          | 创业投资、投资   | -       | 51.00% | 51.00%  | 40,000,000.00    | 设立 |

|                  |    |                                   |           |   |         |         |                |    |
|------------------|----|-----------------------------------|-----------|---|---------|---------|----------------|----|
| 管理有限公司           |    |                                   | 咨询        |   |         |         |                |    |
| 东吴创业投资（徐州）有限责任公司 | 徐州 | 徐州市泉山区建国西路 75 号锦绣嘉园 8 号楼 1-2309 室 | 创业投资、投资咨询 | - | 100.00% | 100.00% | 10,000,000.00  | 设立 |
| 东吴并购资本管理（上海）有限公司 | 上海 | 上海市黄埔区西藏南路 1208 号 18 层 A 室        | 投资管理、投资咨询 | - | 100.00% | 100.00% | 20,000,000.00  | 设立 |
| 东吴并购股权投资         | 上海 | 上海市黄埔区西藏中路 336 号 1807-7 室         | 投资管理、投资咨询 | - | 100.00% | 100.00% | 100,000,000.00 | 设立 |

|                            |     |   |       |         |         |         |                         |    |
|----------------------------|-----|---|-------|---------|---------|---------|-------------------------|----|
| 基金<br>(上海)<br>合伙<br>(有限合伙) |     |   |       |         |         |         |                         |    |
| 昆山东吴阳澄投资管理有限公司             | 昆山  | 昆山市玉山镇前进西路 1899 号 1 号房                            | 投资管理  | -       | 80.00 % | 80.00 % | 1,000,000.00            | 设立 |
| 东吴证券中新(新加坡)有限公司            | 新加坡 | Robinson Road, #17-00, AIATower, Singapore 048542 | 投资管理  | 75.00 % | -       | 75.00 % | 10,000,000.00<br>(新加坡元) | 设立 |
| 昆山东吴                       | 昆山  | 昆山市玉山镇前进西路 1899 号 1 号房                            | 投资管理、 | -       | 50.50 % | 50.50 % | 50,000,000.00           | 设立 |

|                |  |  |      |  |  |  |  |  |  |
|----------------|--|--|------|--|--|--|--|--|--|
| 阳澄创业投资中心（有限合伙） |  |  | 投资咨询 |  |  |  |  |  |  |
|----------------|--|--|------|--|--|--|--|--|--|

## (2). 重要的非全资子公司

单位:元 币种:人民币

| 子公司名称           | 少数股东持股比例 | 少数股东的表决权比例 | 本期归属于少数股东的损益  | 本期向少数股东宣告分派的股利 | 期末少数股东权益余额     |
|-----------------|----------|------------|---------------|----------------|----------------|
| 东吴期货有限公司        | 10.20%   | 10.20%     | 4,797,993.31  | 3,366,000.00   | 63,131,205.24  |
| 东吴证券中新(新加坡)有限公司 | 25.00%   | 25.00%     | -169,113.97   | -              | 11,294,409.69  |
| 东吴基金管理有限公司      | 30.00%   | 30.00%     | 19,866,792.93 | -              | 107,441,139.54 |

## (3). 重要非全资子公司的主要财务信息

单位:元 币种:人民币

| 子公司名称    | 期末余额         |                |                  |                  |            |                  | 期初余额             |                |                  |                  |       |                  |
|----------|--------------|----------------|------------------|------------------|------------|------------------|------------------|----------------|------------------|------------------|-------|------------------|
|          | 流动资产         | 非流动资产          | 资产合计             | 流动负债             | 非流动负债      | 负债合计             | 流动资产             | 非流动资产          | 资产合计             | 流动负债             | 非流动负债 | 负债合计             |
| 东吴期货有限公司 | 1,866,138.01 | 255,903,718.57 | 2,122,041,732.63 | 1,508,486,215.18 | 33,892,033 | 1,508,520,107.21 | 2,199,260,090.12 | 242,827,897.69 | 2,442,087,987.81 | 1,843,383,595.47 |       | 1,843,383,595.47 |

|                 |                |               |                |                 |                |               |                |                |                |               |  |               |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|-----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|--|---------------|
| 公司              |                |               |                |                 |                |               |                |                |                |               |  |               |
| 东吴证券中新(新加坡)有限公司 | 45,233,596.26  | -             | 45,233,596.26  | 41,287.50       | -              | 41,287.50     |                |                |                |               |  |               |
| 东吴基金管理有限公司      | 299,853,450.70 | 81,634,663.56 | 381,488,114.26 | 73,429,317.37   | -              | 73,429,317.37 | 250,893,277.88 | 77,110,512.29  | 328,003,790.17 | 71,944,326.63 |  | 71,944,326.63 |
| 子公司名称           | 本期发生额          |               |                |                 | 上期发生额          |               |                |                |                |               |  |               |
|                 | 营业收入           | 净利润           | 综合收益总额         | 经营活动现金流量        | 营业收入           | 净利润           | 综合收益总额         | 经营活动现金流量       |                |               |  |               |
| 东吴期货有限公司        | 188,635,445.74 | 47,014,265.16 | 47,014,265.16  | -141,804,536.75 | 121,243,782.11 | 14,895,184.15 | 15,826,676.86  | 198,292,499.10 |                |               |  |               |
| 东吴证券中新(新加坡)有限公司 | -              | -676,455.87   | -523,801.24    | -1,082,209.42   |                |               |                |                |                |               |  |               |
| 东吴基金管理有限公司      | 259,371,991.04 | 51,999,333.35 | 51,999,333.35  | -923,491.11     | 209,421,064.65 | 28,857,911.94 | 28,857,911.94  | 34,491,370.25  |                |               |  |               |

**(4). 向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供的财务支持或其他支持:**

本期公司未向纳入合并财务报表范围的结构化主体提供财务支持或其他支持。

**2、在合营企业或联营企业中的权益**

√适用□不适用

**(1). 不重要的合营企业和联营企业的汇总财务信息**

单位：元 币种：人民币

|                       | 期末余额/ 本期发生额    | 期初余额/ 上期发生额   |
|-----------------------|----------------|---------------|
| 联营企业:                 |                |               |
| 许昌市绿野农业科技有限公司         | 6,551,596.08   | 6,551,829.33  |
| 河南华元恒道投资管理有限公司        | 39,922,376.59  | 3,931,280.92  |
| 东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司 | 75,758,549.53  | -             |
| 投资账面价值合计              | 122,232,522.20 | 10,483,110.25 |
| 下列各项按持股比例计算的合计数       | -              |               |
| --净利润                 | 2,643,966.52   | 566,604.39    |
| --其他综合收益              | -              |               |
| --综合收益总额              | 2,643,966.52   | 566,604.39    |

**(2). 合营企业或联营企业发生的超额亏损**

不存在联营企业发生的超额亏损。

**3、在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益**

本公司作为结构化主体的管理者，在报告期间对资产管理计划拥有管理权。除已于附注 7：7.04 所述本公司已合并的结构化主体外，本公司因在结构化主体中拥有的权益而享有可变回报并不重大，因此，本公司并未合并该等结构化主体。

截至 2015 年 12 月 31 日，上述由本公司管理的未合并结构化主体的资产总额为人民币 8,290,714,818.37 元。

2015 年度，本公司在上述结构化主体中的投资和获得的收入并不重大。

#### 4、 本公司在合并的结构化主体中的权益

本公司合并的结构化主体指本公司作为管理人或投资者的资产管理计划。本公司综合评估本公司因持有的份额而享有的回报以及作为资产管理计划管理人的管理人报酬是否将使本公司面临可变回报的影响重大，并据此判断本公司是否为资产管理计划的主要责任人。

截至 2015 年 12 月 31 日，合并资产管理计划的总资产为人民币 10,145,669,707.57 元。本公司持有在上述合并资产管理计划中的权益体现在资产负债表中可供出售金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的总金额为人民币 2,849,459,626.00 元。

#### 5、 本公司在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

本公司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，这些结构化主体未纳入本公司的合并财务报表范围，主要包括信托计划、基金与其他理财产品。这些结构化主体的性质和目的主要是管理投资者的资产并赚取管理费，其融资方式是向投资者发行投资产品。

截至 2015 年 12 月 31 日，合并资产负债表中上述投资的账面金额等同于本公司因持有第三方机构发行的未合并结构化主体而可能存在的最大风险敞口，详情列示如下：

| 项 目    | 可供出售金融资产         | 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 合 计              |
|--------|------------------|------------------------|------------------|
| 信托计划   | 509,228,000.00   | 22,281,916.54          | 531,509,916.54   |
| 基金     | 434,424,536.11   | 235,714,845.79         | 670,139,381.90   |
| 其他理财产品 | 1,343,545,653.70 | 123,050,252.38         | 1,466,595,906.08 |
| 合 计    | 2,287,198,189.81 | 381,047,014.71         | 2,668,245,204.52 |

截至 2015 年 12 月 31 日，本公司因投资上述信托计划、基金与其他理财产品而可能遭受损失的最大风险敞口为其在报告日的公允价值。

### 附注 8、与金融工具相关的风险

√适用□不适用

#### 1、风险管理政策及组织架构

##### (1) 风险管理政策

为增强公司核心竞争力，保障公司持续、健康、稳定发展，公司注重对风险的防范与控制，严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了与公司自身发展战略相适应的全面风险管理体系，包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人

才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化，以保证公司各类风险可测、可控和可承受，保障公司稳健经营和各项业务创新发展。

本公司董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。

## **(2) 风险管理组织架构**

公司建立由董事会及其风险控制委员会、公司经营管理层及其风险管理委员会、风险管理职能部门、各部门及分支机构组成的四层级全面风险管理组织架构。

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责对公司风险管理进行监督与指导，将公司总体风险控制在合理的范围内，以确保公司能够对经营活动中的风险控制实施有效的管理。董事会设立的风险控制委员会按照公司章程和工作细则的相关规定，可在董事会授权范围内履行和协助董事会履行风险管理职责。

经营管理层负责管理公司经营过程中的各类风险，推动公司全面风险管理体系的规划、建设与执行。公司经营管理层下设风险管理委员会，在经营管理层授权范围内开展公司风险管理工作。

公司设首席风险官，负责公司全面风险管理工作。风险管理职能部门在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。

各业务部门、分支机构在日常工作中应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险。

公司各子公司根据所在地法律法规和监管要求，按照公司管理政策和要求，有效开展风险管理。子公司董事长和总经理对子公司风险管理的有效性承担主要责任。

## **3、公司面临的主要风险及应对措施**

在日常管理中，本公司面临的主要风险包括：流动性风险、信用风险、市场风险和操作风险。公司通过明确风险管理的各个环节和实施内容，采用目标设定、事件识别、风险评估、风险应对、控制活动、信息沟通与报告等的全面风险管理基本工作方法，科学有效地开展公司的风险管理工作。

### **(1) 流动性风险管理**

流动性风险是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。



主要包括两个方面：一是资产的流动性风险，是指由于资产不能及时变现或变现成本过高，导致自营投资及客户资产造成损失的风险；二是负债的流动性风险，是指公司缺乏现金不能按时支付债务或正常营业支出的风险。

本公司已建立并健全了资金业务的风险评估和监测制度，重点做好自有资金的合理安排，严格控制资金流动性风险，使各项资金比例严格控制在公司可承受风险范围之内。在资金需求方面，主要体现为日常运营资金需求、自营股票投资需求、固定资产采购与对外投资、债券投资和债券回购等，报告期内公司密切关注市场变化，动态调整资产配置，合理控制各品种证券的投资规模和持仓集中度，剩余期限分布合理，流动性风险不大。同时，公司的融资渠道主要有短期融资券、质押回购、拆入资金等，能够满足公司日常运营所需资金以及融资融券等资本密集型业务快速增长所需要的资金，因此有能力支付可预见的到期债务或承诺。

随着融资融券、约定购回式证券交易、股票质押式回购交易等资本密集型行业迅速发展，以及未来柜台业务的发展壮大等将对流动性提出更高要求。为满足上述情况带来的挑战，公司将不断完善流动性管理的制度建设、风险防范机制，在监管允许范围之内，努力拓宽融资渠道，合理安排负债结构，努力保持较强的偿债能力，积极提高各项业务的盈利水平和可持续发展能力。

于资产负债表日，本公司各项金融负债以未折现的合同现金流量按到期日列示如下：

| 金融负债       | 2015 年 12 月 31 日  |                   |                  |                  |                   |       |     |                   |
|------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|-------|-----|-------------------|
|            | 即期偿还              | 1 个月内             | 1 个月至 3 个月       | 3 个月至 1 年        | 1 年至 5 年          | 5 年以上 | 无期限 | 合计                |
| 短期借款       | -                 | 12,297,171.99     | 80,087,185.85    | 1,778,307.89     | -                 | -     | -   | 94,162,665.73     |
| 应付短期融资款    | -                 | 14,882,760.27     | 2,720,375,890.41 | 1,889,920,020.55 | -                 | -     | -   | 4,625,178,671.23  |
| 拆入资金       | -                 | 101,386,986.30    | 251,855,479.45   | -                | -                 | -     | -   | 353,242,465.75    |
| 卖出回购金融资产款  | -                 | 5,730,231,052.30  | 2,014,029,465.89 | 61,826,027.40    | 1,248,781,589.04  | -     | -   | 9,054,868,134.63  |
| 代理买卖证券款    | 24,025,978,380.26 | -                 | -                | -                | -                 | -     | -   | 24,025,978,380.26 |
| 应付款项       | 70,405,540.42     | -                 | -                | -                | -                 | -     | -   | 70,405,540.42     |
| 应付债券       | -                 | 79,095,002.94     | 153,087,102.46   | 1,182,670,452.48 | 17,491,621,110.47 | -     | -   | 18,906,473,668.35 |
| 其他负债（金融负债） | 208,849,792.31    | 4,150,224,411.62  | 1,581,320,400.35 | 605,562,682.63   | 331,057,792.43    | -     | -   | 6,877,015,079.34  |
| 合计         | 24,305,233,712.99 | 10,088,117,385.42 | 6,800,755,524.41 | 3,741,757,490.95 | 19,071,460,491.94 | -     | -   | 64,007,324,605.71 |

| 金融负债       | 2014 年 12 月 31 日  |                  |                  |                  |                  |       |     |                   |
|------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------|-----|-------------------|
|            | 即期偿还              | 1 个月内            | 1 个月至 3 个月       | 3 个月至 1 年        | 1 年至 5 年         | 5 年以上 | 无期限 | 合计                |
| 应付短期融资款    | -                 | 505,813,888.89   | 2,476,825,432.11 | 384,241,898.89   | -                | -     | -   | 3,366,881,219.89  |
| 拆入资金       | -                 | 250,000,000.00   | 1,675,330,555.56 | 48,909,466.67    | -                | -     | -   | 1,974,240,022.23  |
| 卖出回购金融资产款  | -                 | 9,011,591,191.94 | 122,029,706.46   | 6,828,873,055.56 | 944,987,500.00   | -     | -   | 16,907,481,453.96 |
| 代理买卖证券款    | 13,579,472,286.92 | -                | -                | -                | -                | -     | -   | 13,579,472,286.92 |
| 应付款项       | 70,417,113.89     | -                | -                | -                | -                | -     | -   | 70,417,113.89     |
| 应付债券       | -                 | -                | -                | 185,400,000.00   | 3,531,991,937.06 | -     | -   | 3,717,391,937.06  |
| 其他负债（金融负债） | 809,379,869.04    | -                | 220,532,199.99   | -                | 2,922,293,971.32 | -     | -   | 3,952,206,040.35  |
| 合计         | 14,459,269,269.85 | 9,767,405,080.83 | 4,494,717,894.12 | 7,447,424,421.12 | 7,399,273,408.38 | -     | -   | 43,568,090,074.30 |

## (2) 信用风险管理

信用风险是指本公司客户（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工具价值，从而给本公司带来损失的风险。

本公司的货币资金主要存放在国有商业银行或资产充足率符合规定的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。

报告期内，公司面临的信用风险主要体现在债券投资、融资融券等类贷款业务上，具体表现为：一是投资对象的违约或评级下降；二是交易对手的违约。

为避免信用风险，公司以债券发行人主体信用状况与债项增信措施的综合分析为基础，建立公司债券信用评级体系，对重点持仓债券进行调研，严控所投债券的品质，密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，研究完善交易对手池，以实现规避债券违约风险的目标。公司固定收益类自营业务主要投资对象为国债、短期融资券、中期票据、公司债及企业债。公司对信用类固定收益证券投资注重分散投资，并密切跟踪投资对象的经营情况和信用评级变化，投资标的信用风险控制良好。另外，公司在银行间市场开展债券交易时始终坚持按规定选择使用合适的结算方式，并采用 DVP 结算控制，交易对手结算违约而产生的信用风险。

在融资融券业务、约定购回式证券交易业务、股票质押式回购交易业务方面，为防范此类业务客户的信用风险，公司设置风险控制指标和预警阈值，强化内控机制，建立逐日盯市制度，对交易进行实时监控、主动预警，公司通过客户资信审核、授信审核、客户账户监控、及时提示交易规则等措施，严格控制融资融券业务的各个风险因素。针对股票质押式回购交易业务，公司设计了业务准入标准，还专门建立了严格的尽职调查、项目审核、盯市、项目跟踪和平仓等制度，从业务开展的各阶段严格控制风险。

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，代表本公司在资产负债表日最大风险敞口的金额如下：

| 项目                     | 期末余额              | 期初余额              |
|------------------------|-------------------|-------------------|
| 银行存款及其他货币资金            | 23,454,040,934.41 | 10,249,506,686.50 |
| 其中：客户资金存款              | 19,694,206,086.62 | 8,182,244,138.44  |
| 结算备付金                  | 4,827,905,019.84  | 5,896,568,026.69  |
| 其中：客户备付金               | 3,484,361,239.46  | 4,764,284,994.96  |
| 融出资金                   | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 9,163,822,561.02  | 15,280,600,319.73 |
| 衍生金融资产                 |                   | -                 |
| 买入返售金融资产               | 8,923,142,748.05  | 6,582,668,335.27  |

| 项目       | 期末余额              | 期初余额              |
|----------|-------------------|-------------------|
| 应收款项     | 333,743,476.04    | 44,871,017.11     |
| 应收利息     | 357,047,813.24    | 235,740,507.88    |
| 存出保证金    | 1,012,776,896.33  | 1,216,607,357.01  |
| 可供出售金融资产 | 4,812,450,825.32  | 2,885,013,126.68  |
| 其中：融出证券  | 174,163.10        | 46,528,480.52     |
| 其他       | 652,078,093.97    | 583,085,175.02    |
| 最大信用风险敞口 | 64,412,414,704.22 | 50,863,591,346.36 |

### (3) 市场风险管理

市场风险是指利率、汇率以及其他市场因素变动而引起金融工具的价值变化，进而对未来收益或者未来现金流量可能造成潜在损失的风险。影响本公司业务的市场风险主要包括市场价格风险、利率风险。

#### ① 市场价格风险

市场价格风险是指本公司所持有的金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本公司该项风险主要表现为投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券等，所面临的最大的市场风险为公允价值的变动。公司根据风险敞口制定相关的投资规模限额和风险限额并分解到各投资部门，通过投资交易控制、风险价值、敏感性分析、压力测试等监控的综合使用来管理市场风险。

对于子公司的价格风险，主要采用证券价格波动对报告期内净利润及归属于母公司所有者的其他综合收益的影响进行分析。

报告期内本公司持有的以公允价值计价的项目如下：

| 项目                     | 期末余额              | 占净资产% | 期初余额              | 占净资产%  |
|------------------------|-------------------|-------|-------------------|--------|
|                        | 公允价值              |       | 公允价值              |        |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 14,113,402,530.80 | 85.33 | 17,315,854,448.80 | 122.99 |
| 债券                     | 9,163,822,561.02  | 55.40 | 15,280,600,319.73 | 108.54 |
| 基金                     | 3,090,530,405.63  | 18.69 | 808,158,310.11    | 5.74   |
| 股票                     | 1,429,284,465.98  | 8.64  | 641,067,740.91    | 4.55   |
| 信托计划                   | -                 | -     | 469,500,000.00    | 3.33   |
| 理财产品                   | 429,765,098.17    | 2.60  | 116,528,078.05    | 0.83   |
| 可供出售金融资产               | 10,566,784,082.27 | 63.88 | 5,590,487,463.87  | 39.72  |

| 项目       | 期末余额              | 占净资产%  | 期初余额              | 占净资产%  |
|----------|-------------------|--------|-------------------|--------|
|          | 公允价值              |        | 公允价值              |        |
| 债券       | 4,812,276,662.22  | 29.09  | 2,838,484,646.16  | 20.16  |
| 基金       | 38,622,984.89     | 0.23   | 262,743,356.35    | 1.87   |
| 股票       | 2,796,317,600.40  | 16.91  | 1,323,155,828.55  | 9.40   |
| 信托计划     | 804,678,000.00    | 4.87   | 302,000,000.00    | 2.15   |
| 证券公司理财产品 | 807,583,548.56    | 4.88   | 429,129,480.19    | 3.05   |
| 基金理财产品   | 1,307,305,286.20  | 7.90   | 434,974,152.62    | 3.09   |
| 合计       | 24,680,186,613.07 | 149.21 | 22,906,341,912.67 | 162.71 |

## ②利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本公司持有的利率敏感性资产主要是银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资与买入返售金融资产等，利率敏感性负债主要为应付短期融资券、拆入资金、代理买卖证券款、卖出回购金融资产款等。

本公司通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法来衡量上述持有资产的利率风险。

下表列示于各资产负债表日本公司的利率风险。

A. 表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

| 金融资产                   | 2015年12月31日       |                  |                   |                   |                  |                   |                   |
|------------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------|-------------------|
|                        | 1个月内              | 1个月至3个月          | 3个月至1年            | 1年至5年             | 5年以上             | 不计息               | 合计                |
| 货币资金                   | 23,454,179,048.36 | -                | -                 | -                 | -                | -                 | 23,454,179,048.36 |
| 结算备付金                  | 4,827,905,019.84  | -                | -                 | -                 | -                | -                 | 4,827,905,019.84  |
| 融出资金                   | 455,978,994.78    | 736,197,238.23   | 9,705,024,504.46  | -                 | -                | -                 | 10,897,200,737.47 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 116,595,675.80    | 331,964,032.33   | 977,902,462.58    | 5,700,069,512.55  | 2,037,290,877.75 | 5,059,004,949.79  | 14,222,827,510.80 |
| 买入返售金融资产               | 634,032,558.26    | 1,807,619,207.56 | 5,661,384,630.42  | 836,000,000.00    | -                | -                 | 8,939,036,396.24  |
| 应收款项                   | -                 | -                | -                 | -                 | -                | 355,525,228.82    | 355,525,228.82    |
| 存出保证金                  | 1,012,776,896.33  | -                | -                 | -                 | -                | -                 | 1,012,776,896.33  |
| 可供出售金融资产               | 36,228,000.00     | 40,203,320.00    | 384,315,986.78    | 3,888,907,305.44  | 1,267,300,050.00 | 8,720,934,225.94  | 14,337,888,888.16 |
| 持有至到期投资                | -                 | -                | 36,169,505.99     | 9,634,655.80      | -                | -                 | 45,804,161.79     |
| 其他资产(金融资产)             | 50,000,000.00     | -                | 350,000,000.00    | -                 | -                | 252,032,042.57    | 652,032,042.57    |
| 合计                     | 30,587,696,193.37 | 2,915,983,798.12 | 17,114,797,090.23 | 10,434,611,473.79 | 3,304,590,927.75 | 14,387,496,447.12 | 78,745,175,930.38 |

(续上表)

| 金融负债       | 2015年12月31日       |                  |                  |                   |      |                |                   |
|------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|------|----------------|-------------------|
|            | 1个月内              | 1个月至3个月          | 3个月至1年           | 1年至5年             | 5年以上 | 不计息            | 合计                |
| 短期借款       | 11,914,059.36     | 80,000,000.00    | 1,770,450.00     | -                 | -    | -              | 93,684,509.36     |
| 应付短期融资款    | -                 | 2,700,000,000.00 | 1,867,350,000.00 | -                 | -    | -              | 4,567,350,000.00  |
| 拆入资金       | 100,000,000.00    | 250,000,000.00   | -                | -                 | -    | -              | 350,000,000.00    |
| 卖出回购金融资产款  | 5,709,523,303.65  | 1,996,929,331.81 | -                | 1,220,000,000.00  | -    | -              | 8,926,452,635.46  |
| 代理买卖证券款    | 24,025,978,380.26 | -                | -                | -                 | -    | -              | 24,025,978,380.26 |
| 应付账款       | -                 | -                | -                | -                 | -    | 70,405,540.42  | 70,405,540.42     |
| 应付债券       | -                 | -                | 500,000,000.00   | 15,966,882,811.73 | -    | -              | 16,466,882,811.73 |
| 其他负债(金融负债) | 4,150,224,411.62  | 1,581,320,400.35 | 605,562,682.63   | 331,057,792.43    | -    | 208,849,792.31 | 6,877,015,079.34  |
| 合计         | 33,997,640,154.89 | 6,608,249,732.16 | 2,974,683,132.63 | 17,517,940,604.16 | -    | 279,255,332.73 | 61,377,768,956.57 |

|     |  |  |  |  |  |  |                   |
|-----|--|--|--|--|--|--|-------------------|
| 净头寸 |  |  |  |  |  |  | 17,367,406,973.81 |
|-----|--|--|--|--|--|--|-------------------|

| 金融资产                   | 2014 年 12 月 31 日  |                  |                  |                   |                  |                  |                   |
|------------------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|
|                        | 1 个月内             | 1 个月至 3 个月       | 3 个月至 1 年        | 1 年至 5 年          | 5 年以上            | 不计息              | 合计                |
| 货币资金                   | 10,249,789,646.59 | -                | -                | -                 | -                | -                | 10,249,789,646.59 |
| 结算备付金                  | 5,896,568,026.69  | -                | -                | -                 | -                | -                | 5,896,568,026.69  |
| 融出资金                   | 3,940,290,693.41  | 3,964,449,581.61 | -                | -                 | -                | -                | 7,904,740,275.02  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 80,324,788.00     | 272,981,817.60   | 1,986,069,451.52 | 6,642,818,830.69  | 6,437,905,431.92 | 1,895,754,129.07 | 17,315,854,448.80 |
| 买入返售金融资产               | 1,522,688,774.27  | 199,229,375.96   | 3,185,263,260.83 | 1,696,270,027.40  | -                | -                | 6,603,451,438.46  |
| 应收款项                   | -                 | -                | -                | -                 | -                | 44,871,017.11    | 44,871,017.11     |
| 存出保证金                  | 1,216,607,357.01  | -                | -                | -                 | -                | -                | 1,216,607,357.01  |
| 可供出售金融资产               | -                 | -                | 591,094,426.74   | 1,167,059,039.41  | 1,382,331,180.01 | 2,822,415,695.28 | 5,962,900,341.44  |
| 持有至到期投资                | -                 | 5,141,780.82     | 5,012,328.76     | 43,041,378.01     | -                | -                | 53,195,487.59     |
| 其他资产（金融资产）             | -                 | -                | -                | 575,000,000.00    | -                | 55,542,590.00    | 630,542,590.00    |
| 合计                     | 22,906,269,285.97 | 4,441,802,555.99 | 5,767,439,467.85 | 10,124,189,275.51 | 7,820,236,611.93 | 4,818,583,431.46 | 55,878,520,628.71 |

(续上表)

| 金融负债       | 2014 年 12 月 31 日  |                  |                  |                  |       |               |                   |
|------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|-------|---------------|-------------------|
|            | 1 个月内             | 1 个月至 3 个月       | 3 个月至 1 年        | 1 年至 5 年         | 5 年以上 | 不计息           | 合计                |
| 应付短期融资款    | 500,000,000.00    | 2,443,746,000.00 | 369,992,000.00   | -                | -     | -             | 3,313,738,000.00  |
| 拆入资金       | 250,000,000.00    | 1,668,000,000.00 | -                | -                | -     | -             | 1,918,000,000.00  |
| 卖出回购金融资产款  | 8,986,587,658.47  | 5,368,000.00     | 6,500,000,000.00 | 870,000,000.00   | -     | -             | 16,361,955,658.47 |
| 代理买卖证券款    | 13,579,472,286.92 | -                | -                | -                | -     | -             | 13,579,472,286.92 |
| 应付账款       | -                 | -                | -                | -                | -     | 70,417,113.89 | 70,417,113.89     |
| 应付债券       | -                 | -                | -                | 2,975,791,937.06 | -     | -             | 2,975,791,937.06  |
| 其他负债（金融负债） | 809,379,869.04    | 220,532,199.99   | -                | 2,922,293,971.32 | -     | -             | 3,952,206,040.35  |
| 合计         | 24,125,439,814.43 | 4,337,646,199.99 | 6,869,992,000.00 | 6,768,085,908.38 | 0.00  | 70,417,113.89 | 42,171,581,036.69 |

|     |  |  |  |  |  |  |                   |
|-----|--|--|--|--|--|--|-------------------|
| 净头寸 |  |  |  |  |  |  | 13,706,939,592.02 |
|-----|--|--|--|--|--|--|-------------------|

B. 市场利率的波动主要影响本公司持有的以公允价值计量的生息资产的估值。假设收益率曲线平行移动 100 个基点，对本公司各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

| 项 目               | 2015 年末/2015 年度 |                 | 2014 年末/2014 年度 |                 |
|-------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                   | 股东权益            | 净利润             | 股东权益            | 净利润             |
| 收益率曲线向上平移 100 个基点 | -267,534,781.30 | -170,447,099.63 | -398,412,226.85 | -344,856,408.17 |
| 收益率曲线向下平移 100 个基点 | 267,534,781.30  | 170,447,099.63  | 398,412,226.85  | 344,856,408.17  |

#### (4) 操作风险管理

操作风险是指由公司内部流程设置不完善、员工操作失误或未严格执行流程、信息系统故障或不完善，以及外部事件等导致公司损失的风险。

公司操作风险管理应包括操作风险的识别与评估、操作风险监测、操作风险控制、操作风险报告、操作风险处置等流程。风险管理部门负责公司整体操作风险的管理，对公司总体操作风险实施评估、量化，并对各部门操作风险管理的情况和制度执行情况进行监督；合规管理部门从合规管理工作角度、操作风险专业角度以及内部控制有效性相关角度，协同开展工作；各业务部门、支持部门等按照职能分工，分别执行本业务领域的操作风险管控，并不断完善的制度流程，确保其能覆盖业务操作的各个环节。

报告期内，公司对内部控制评价、合规有效性评价等定期评价以及各业务内部控制检查等不定期检查外，主要针对新业务、重大新产品的开发、IT 系统的重大变更、重大事件及隐患、重要部门岗位变化、行业监管要求变化等进行专项操作风险识别与评估。公司结合业务重点，开展了融资类业务自查、“两遏制、两加强”专项自查、两融业务风险评估、新三板（做市、经纪）业务自查、经纪业务检查、违规从事非法证券业务账户清理和外接信息系统规范自查等风控合规检查，通过检查发现操作风险隐患并及时对问题进行了整改。



## 附注 9、公允价值的披露

√适用□不适用

## 1、截至 2015 年 12 月 31 日，合并报表以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

单位：元 币种：人民币

| 项目                       | 期末公允价值                  |                          |            |                          |
|--------------------------|-------------------------|--------------------------|------------|--------------------------|
|                          | 第一层次公允价值计量              | 第二层次公允价值计量               | 第三层次公允价值计量 | 合计                       |
| <b>一、持续的公允价值计量</b>       |                         |                          |            |                          |
| (一)以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产 | 1,719,354,432.60        | 12,503,473,078.20        | -          | 14,222,827,510.80        |
| 1. 交易性金融资产               | 1,719,354,432.60        | 12,503,473,078.20        | -          | 14,222,827,510.80        |
| (1) 债务工具投资               | 256,952,261.71          | 8,906,870,299.31         | -          | 9,163,822,561.02         |
| (2) 权益工具投资               | 1,462,402,170.89        | 3,596,602,778.89         | -          | 5,059,004,949.78         |
| (二) 可供出售金融资产             | 2,624,163,539.60        | 10,850,282,845.99        | -          | 13,474,446,385.59        |
| (1) 债务工具投资               |                         | 4,812,276,662.22         | -          | 4,812,276,662.22         |
| (2) 权益工具投资               | 2,624,163,539.60        | 6,038,006,183.77         | -          | 8,662,169,723.37         |
| (三) 衍生金融资产               | 3,620.00                | -                        |            | 3,620.00                 |
| <b>持续以公允价值计量的资产总额</b>    | <b>4,343,521,592.20</b> | <b>23,353,755,924.19</b> | <b>-</b>   | <b>27,697,277,516.39</b> |
| (四) 衍生金融负债               | 1,459,450.00            | 4,245,522.15             | -          | 5,704,972.15             |
| <b>持续以公允价值计量的负债总额</b>    | <b>1,459,450.00</b>     | <b>4,245,522.15</b>      | <b>-</b>   | <b>5,704,972.15</b>      |

## 2、截至 2015 年 12 月 31 日，母公司以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

| 项目        | 期末公允价值     |            |            |    |
|-----------|------------|------------|------------|----|
|           | 第一层次公允价值计量 | 第二层次公允价值计量 | 第三层次公允价值计量 | 合计 |
| 持续的公允价值计量 |            |            |            |    |

| 项 目                        | 期末公允价值           |                   |            |                   |
|----------------------------|------------------|-------------------|------------|-------------------|
|                            | 第一层次公允价值计量       | 第二层次公允价值计量        | 第三层次公允价值计量 | 合计                |
| (一) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 1,463,747,939.67 | 9,474,701,977.63  | -          | 10,938,449,917.30 |
| 1、交易性金融资产                  | 1,463,747,939.67 | 9,474,701,977.63  | -          | 10,938,449,917.30 |
| (1) 债务工具投资                 | 183,270,158.80   | 5,962,641,733.42  | -          | 6,145,911,892.22  |
| (2) 权益工具投资                 | 1,280,477,780.87 | 3,512,060,244.21  | -          | 4,792,538,025.08  |
| 2、指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | -                | -                 | -          | -                 |
| (1) 债务工具投资                 | -                | -                 | -          | -                 |
| (2) 权益工具投资                 | -                | -                 | -          | -                 |
| (二) 可供出售金融资产               | 2,624,163,539.60 | 10,279,859,783.92 | -          | 12,904,023,323.52 |
| (1) 债务工具投资                 |                  | 4,809,150,485.60  | -          | 4,809,150,485.60  |
| (2) 权益工具投资                 | 2,624,163,539.60 | 5,470,709,298.32  | -          | 8,094,872,837.92  |
| (三) 衍生金融资产                 | 3,620.00         | -                 | -          | 3,620.00          |
| 持续以公允价值计量的资产总额             | 4,087,915,099.27 | 19,754,561,761.55 | -          | 23,842,476,860.82 |
| (四) 衍生金融负债                 | -                | 4,245,522.15      | -          | 4,245,522.15      |
| 持续以公允价值计量的负债总额             | -                | 4,245,522.15      | -          | 4,245,522.15      |

### 3、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

对于存在活跃市场的以公允价值计量且其变动计入当期损益的资产及负债、可供出售金融资产，其公允价值是按资产负债表日的市场报价确定的。活跃市场，是指相关资产或负债的交易量和交易频率足以持续提供定价信息的市场。

#### 4、持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中的债券投资的公允价值是采用相关债券登记结算机构估值系统的报价。相关报价机构在形成报价过程中采用了反映市场状况的可观察输入值。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产中不存在公开市场的债务及权益工具投资，如管理人定期对相应结构化主体的净值进行报价，则其公允价值以未来现金流折现的方法确定。所采用的折现率为报告期末相关的可观察收益率曲线。

权益互换合约中嵌入的衍生工具的公允价值是采用相关证券交易所报价计算的相关权益证券回报率来确定的。场外期权的公允价值是通过期权定价模型来确定的，标的权益工具的波动率反映了对应期权的可观察输入值。

#### 5、持续的公允价值计量项目，本期内发生各层级之间转换的，转换的原因及确定转换时点的政策

本期内未发生各层级之间的转换。

#### 6、本期内发生的估值技术变更及变更原因

本期内未发生估值技术变更。

#### 7、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

本公司管理层认为，期末不以公允价值计量的金融资产及金融负债的账面价值接近该等资产及负债的公允价值。

### 附注 10、关联方关系及其交易

#### 1、关联方关系

(1) 控股股东持股情况如下

(单位：人民币万股)

| 关联方名称 | 关联方关系 | 期末  |      |       | 期初  |      |       |
|-------|-------|-----|------|-------|-----|------|-------|
|       |       | 持股数 | 持股比例 | 表决权比例 | 持股数 | 持股比例 | 表决权比例 |
|       |       |     |      |       |     |      |       |

|              |    |           |        |        |           |        |        |
|--------------|----|-----------|--------|--------|-----------|--------|--------|
| 苏州国际发展集团有限公司 | 股东 | 69,337.15 | 25.68% | 25.68% | 71,340.74 | 26.42% | 26.42% |
|--------------|----|-----------|--------|--------|-----------|--------|--------|

### 本公司控股股东概况

| 关联方名称        | 注册地  | 主营业务   | 与公司关系 | 经济性质 | 法定代表人 | 存在控制关系的期间 |
|--------------|------|--|-------|------|-------|-----------|
| 苏州国际发展集团有限公司 | 中国苏州 | 授权范围的国有资产经营管理,国内商业、物资供销业(国家规定的专营、专项审批商品除外),提供各类咨询服务。 | 控股股东  | 有限责任 | 黄建林   | 2006年起    |

### 报告期本公司的控股股东注册资本及其变化

| 企业名称         | 期初余额       | 本期增加 | 本期减少 | 期末余额       |
|--------------|------------|------|------|------------|
| 苏州国际发展集团有限公司 | 100,000 万元 | -    | -    | 100,000 万元 |

### 受本公司控股股东控制的其他股东所持公司股份或权益及其变化

| 企业名称        | 期末余额        |       |       | 期初余额        |       |       |
|-------------|-------------|-------|-------|-------------|-------|-------|
|             | 金额          | 持股比例  | 表决权比例 | 金额          | 持股比例  | 表决权比例 |
| 苏州市营财投资集团公司 | 6,457.86 万股 | 2.39% | 2.39% | 6,457.86 万股 | 2.39% | 2.39% |
| 苏州信托有限公司    | 5,312.00 万股 | 1.97% | 1.97% | 5,312.00 万股 | 1.97% | 1.97% |

苏州国际发展集团有限公司及其控制的其他股东合计持有公司 30.04%股份。

### (2) 本公司的子公司

| 公司名称     | 注册地址              | 主营业务                                 | 注册资本      | 实际投资额     | 持股比例   | 表决权比例  | 是否合并 |
|----------|-------------------|--------------------------------------|-----------|-----------|--------|--------|------|
| 东吴期货有限公司 | 上海市黄浦区西藏南路1208号东吴 | 商品期货经纪,金融期货经纪,期货投资咨询(涉及行政许可的凭许可证经营)。 | 50,000 万元 | 44,900 万元 | 89.80% | 89.80% | 是    |

| 公司名称                | 注册地址                        | 主营业务   | 注册资本       | 实际投资额         | 持股比例    | 表决权比例   | 是否合并 |
|---------------------|-----------------------------|--|------------|---------------|---------|---------|------|
|                     | 证券大厦 6 楼                    |  |            |               |         |         |      |
| 东吴创业投资有限公司          | 花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦      | 创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。 | 120,000 万元 | 65,000 万元     | 100.00% | 100.00% | 是    |
| 东吴创新资本管理有限责任公司      | 昆山花桥经济开发区商银路 538 号国际金融大厦    | 项目投资、实业投资、股权投资，投资管理，投资信息咨询业务。  | 200,000 万元 | 142,132.80 万元 | 100.00% | 100.00% | 是    |
| 苏州业联创业投资有限公司        | 吴江区松陵镇人民路 300 号             | 创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。                 | 4,000 万元   | 612 万元        | 51.00%  | 51.00%  | 是    |
| 东吴基金管理有限公司          | 上海浦东源深路 279 号               | 基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。                                    | 10,000 万元  | 7,000 万元      | 70.00%  | 70.00%  | 是    |
| 上海新东吴优胜资产管理有限公<br>司 | 上海市黄浦区九江路 769 号<br>1806-3 室 | 为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。   | 2,000 万元   | 1,400 万元      | 70.00%  | 70.00%  | 是    |

| 公司名称                   | 注册地址   | 主营业务  | 注册资本               | 实际投资额            | 持股比例    | 表决权比例   | 是否合并 |
|------------------------|--|---|--------------------|------------------|---------|---------|------|
| 东吴创业投资<br>(徐州) 有限责任公司  | 徐州市泉山区<br>建国西路 75<br>号锦绣嘉园 8<br>号楼 1-2309<br>室 | 创业投资业务；代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构 | 1,000 万元           | 100 万元           | 100.00% | 100.00% | 是    |
| 东吴并购资本管理(上海)有限公司       | 上海市黄浦区<br>西藏南路<br>1208 号 18 层 A<br>室           | 资产管理，股权投资管理，投资咨询，财务咨询（不得从事代理记账）   | 2,000 万元           | 2,000 万元         | 100.00% | 100.00% | 是    |
| 东吴并购股权投资基金(上海)合伙(有限合伙) | 上海 上海市<br>黄浦区西藏中<br>路 336 号<br>1807-7 室        | 股权投资，股权投资管理，实业投资，资产管理，投资咨询，企业管理咨询，商务信息咨询，企业形象策划，市场营销策划                        | 10,000 万元          | 10,000 万元        | 100.00% | 100.00% | 是    |
| 上海东吴玖盈投资管理有限公司         | 上海市黄浦区<br>普安路 128 号<br>703 室 H8 座              | 投资管理及咨询，实物投资等   | 10,000 万元          | 10,000 万元        | 100.00% | 100.00% | 是    |
| 昆山东吴阳澄投资管理有限公司         | 昆山市玉山镇<br>前进西路<br>1899 号 1 号房                  | 股权投资管理  | 100 万元             | 80 万元            | 80%     | 80%     | 是    |
| 东吴证券中新<br>(新加坡) 有限     | Robinson<br>Road, #17-00,                      | 资产管理业务及监管部门核准的其他证券业务(具体   | 1,000 万元<br>(新加坡元) | 750 万元<br>(新加坡元) | 75%     | 75%     | 是    |

| 公司名称               | 注册地址                        | 主营业务   | 注册资本     | 实际投资额    | 持股比例   | 表决权比例  | 是否合并 |
|--------------------|-----------------------------|--|----------|----------|--------|--------|------|
| 公司                 | AIA Tower, Singapore 048542 | 业务范围以监管部门核准为准)   |          |          |        |        |      |
| 昆山东吴阳澄创业投资中心(有限合伙) | 昆山市玉山镇前进西路1899号1号房          | 创业投资业务;代理其他创业投资企业等机构或个人的创业投资业务;创业投资咨询业务;为创业企业提供创业管理服务业务;参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构。 | 5,000 万元 | 2,525 万元 | 50.50% | 50.50% | 是    |

## (3) 本公司联营企业

间接持有:

| 公司名称                  | 注册地址                  | 主营业务              | 注册资本      | 实际投资额     | 持股比例   | 表决权比例  | 是否合并 |
|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------|-----------|--------|--------|------|
| 许昌市绿野农业科技有限公司         | 许昌市魏都民营科技园区管委会办公楼     | 农产品的种植及销售(不含粮油销售) | 1,590 万元  | 656.88 万元 | 35.00% | 35.00% | 否    |
| 华元恒道(上海)投资管理有限公司      | 上海市黄浦区南苏州路381号405D03室 | 股权投资管理            | 20,500 万元 | 4,000 万元  | 19.51% | 19.51% | 否    |
| 东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司 | 苏州高新区科创路18号           | 网络技术服务            | 20,000 万元 | 8,000 万元  | 40.00% | 40.00% | 否    |

[注]许昌市绿野农业科技有限公司和华元恒道(上海)投资管理有限公司为本公司全资子公司东吴创业投资有限公司投资的联营企业,东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司为本公司全资子公司东吴创新资本管理有限责任公司投资的联营企业。

## (4) 其他关联企业

| 企业名称        | 与本公司关系         | 注册号             |
|-------------|----------------|-----------------|
| 光大保德信基金管理公司 | 本公司独立董事担任独立董事  | 310000400379940 |
| 江苏隆力奇集团有限公司 | 本公司监事任副总裁,公司股东 | 320581000066369 |

| 企业名称               | 与本公司关系                   | 注册号             |
|--------------------|--------------------------|-----------------|
| 江苏隆力奇生物科技股份有限公司    | 本公司监事任副总裁兼金融投资部总经理       | 320000000018416 |
| 江苏省广电有线信息网络股份有限公司  | 本公司独立董事担任独立董事            | 320000000075251 |
| 昆山市创业控股有限公司        | 本公司监事任总裁，公司股东            | 320583000008825 |
| 苏州工业园区国有资产控股发展有限公司 | 本公司董事任董事长、总裁，公司股东        | 320594000000909 |
| 苏州工业园区经济发展有限公司     | 本公司董事任董事长，公司股东           | 320594000004244 |
| 苏州国发创业投资控股有限公司     | 国发集团直接或间接控制的公司、本公司董事担任董事 | 320500000059879 |
| 苏州国发高新创业投资管理有限公司   | 国发集团直接或间接控制的公司           | 320512000091268 |
| 苏州国发中小企业担保投资有限公司   | 本公司监事任董事                 | 320500000006459 |
| 苏州凯风进取创业投资有限公司     | 过去十二个月内构成公司关联方           | 320594000139139 |
| 苏州市国发物业管理有限公司      | 国发集团间接持股 100%            | 320502000127783 |
| 苏州市基础设施投资管理有限公司    | 本公司董事担任董事                | 320500000005503 |
| 苏州市民卡有限公司          | 国发集团董事任董事长               | 320500000008127 |
| 苏州文化博览中心有限公司       | 本公司董事担任董事                | 320594000002923 |
| 苏州吴中国发创业投资管理有限公司   | 国发集团直接或间接控制的公司           | 320506000147812 |
| 苏州相城高新创业投资有限公司     | 本公司董事担任董事                | 320507000099000 |
| 苏州银行股份有限公司         | 本公司董事担任董事                | 320500000039152 |
| 苏州元风创业投资有限公司       | 过去十二个月内构成公司关联方           | 320594000004978 |
| 苏州元禾控股股份有限公司       | 本公司董事担任董事、公司股东           | 320594000005323 |
| 中新苏州工业园区创业投资有限公司   | 过去十二个月内构成公司关联方           | 320594000001311 |
| 重若（苏州）资产管理有限公司     | 东吴在线全资子公司                | 320512000250927 |
| 弦高（苏州）资产管理有限公司     | 东吴在线全资子公司                | 320512000250935 |
| 东吴人寿保险股份有限公司       | 国发集团董事长任董事长              | 320500000080562 |



## 2、与关联方的交易事项

## (1) 代买卖证券款

| 企业名称               | 本期金额          |       | 上期金额         |       |
|--------------------|---------------|-------|--------------|-------|
|                    | 金额            | 比例    | 金额           | 比例    |
| 苏州信托有限公司           | 1,910,792.07  | 0.01% | 5,363.73     | 0.00% |
| 苏州市营财投资集团公司        | -             | -     | 12.87        | 0.00% |
| 苏州工业园区经济发展有限公司     | 935,553.63    | 0.00% | -            | -     |
| 苏州国发创业投资控股有限公司     | 172.20        | 0.00% | 171.59       | 0.00% |
| 苏州国发高新创业投资管理有限公司   | 3,916.00      | 0.00% | 3,902.17     | 0.00% |
| 苏州吴中国发创业投资管理有限公司   | 356.23        | 0.00% | 354.98       | 0.00% |
| 苏州国发中小企业担保投资有限公司   | -             | -     | 6,554.59     | 0.00% |
| 江苏隆力奇集团有限公司        | 13,066,102.92 | 0.05% | 8,846,311.43 | 0.07% |
| 江苏隆力奇生物科技股份有限公司    | 1,652.42      | 0.00% | 1,646.59     | 0.00% |
| 昆山市创业控股有限公司        | 1,851,909.06  | 0.01% | 2,398,753.36 | 0.02% |
| 中新苏州工业园区创业投资有限公司   | 93,857.66     | 0.00% | 529,807.51   | 0.00% |
| 苏州元风创业投资有限公司       | 227.40        | 0.00% | 226.60       | 0.00% |
| 苏州相城高新创业投资有限公司     | 8,913.47      | 0.00% | 88,394.18    | 0.00% |
| 苏州市基础设施投资管理有限公司    | -             | -     | 0.05         | 0.00% |
| 苏州工业园区国有资产控股发展有限公司 | 7,742,477.67  | 0.03% | -            | -     |
| 苏州凯风进取创业投资有限公司     | 2,293.14      | 0.00% | -            | -     |

| 企业名称                  | 本期金额          |       | 上期金额          |       |
|-----------------------|---------------|-------|---------------|-------|
|                       | 金额            | 比例    | 金额            | 比例    |
| 东吴在线（苏州）互联网金融科技服务有限公司 | 107.71        | 0.00% | -             | -     |
| 弦高（苏州）资产管理有限公司        | 3,537.26      | 0.00% | -             | -     |
| 重若（苏州）资产管理有限公司        | 100,513.97    | 0.00% | -             | -     |
| 合计                    | 25,722,382.81 | 0.10% | 11,881,499.65 | 0.09% |

## (2) 手续费及佣金收入

| 企业名称                  | 本期金额         |       | 上期金额       |       |
|-----------------------|--------------|-------|------------|-------|
|                       | 金额           | 比例    | 金额         | 比例    |
| 苏州国际发展集团有限公司          | 1,059,913.34 | 0.02% | 697,091.59 | 0.04% |
| 苏州市营财投资集团公司           | -            | -     | 335.49     | 0.00% |
| 苏州信托有限公司              | 72,766.85    | 0.00% | 28,017.36  | 0.00% |
| 苏州工业园区经济发展有限公司        | -            | -     | 598,038.27 | 0.04% |
| 苏州元禾控股股份有限公司          | -            | -     | 186,201.12 | 0.01% |
| 江苏隆力奇集团有限公司           | 207,176.20   | 0.00% | 248,497.32 | 0.01% |
| 江苏隆力奇生物科技股份有限公司       | -            | -     | 21,820.32  | 0.00% |
| 中新苏州工业园区创业投资有限公司      | 171,200.93   | 0.00% | 128,558.26 | 0.01% |
| 昆山市创业控股有限公司           | 192,141.57   | 0.00% | 66.11      | 0.00% |
| 苏州相城高新创业投资有限公司        | -            | -     | 3,167.51   | 0.00% |
| 苏州凯风进取创业投资有限公司        | 255,470.07   | 0.01% | -          | -     |
| 苏州相城高新创业投资有限公司        | 34,778.40    | 0.00% | -          | -     |
| 东吴在线（苏州）互联网金融科技服务有限公司 | 1,814.70     | 0.00% | -          | -     |
| 弦高（苏州）资产管理有限公司        | 1,020.78     | 0.00% | -          | -     |
| 重若（苏州）资产管理有限公司        | 206.98       | 0.00% | -          | -     |

|     |              |       |              |       |
|-----|--------------|-------|--------------|-------|
| 合 计 | 1,996,489.82 | 0.03% | 1,911,793.35 | 0.11% |
|-----|--------------|-------|--------------|-------|

## (3) 利息支出

| 企业名称                  | 本期金额       |       | 上期金额       |       |
|-----------------------|------------|-------|------------|-------|
|                       | 金额         | 比例    | 金额         | 比例    |
| 苏州国际发展集团有限公司          | 6,058.22   | 0.00% | 6,148.34   | 0.00% |
| 苏州市营财投资集团公司           | 10.81      | 0.00% | 2,749.84   | 0.00% |
| 苏州信托有限公司              | 1,477.50   | 0.00% | 5,193.28   | 0.00% |
| 苏州国发创业投资控股有限公司        | 0.61       | 0.00% | 0.61       | 0.00% |
| 苏州国发高新创业投资管理有限公司      | 13.83      | 0.00% | 13.89      | 0.00% |
| 苏州吴中国发创业投资管理有限公司      | 1.25       | 0.00% | 1.26       | 0.00% |
| 苏州元禾控股股份有限公司          | -          | -     | 9,081.45   | 0.00% |
| 苏州国发中小企业担保投资有限公司      | 17.42      | 0.00% | 23.33      | 0.00% |
| 苏州工业园区经济发展有限公司        | 1,621.25   | 0.00% | 1,647.60   | 0.00% |
| 江苏隆力奇集团有限公司           | 32,941.18  | 0.00% | 63,317.14  | 0.01% |
| 江苏隆力奇生物科技股份有限公司       | 5.83       | 0.00% | 1,646.59   | 0.00% |
| 昆山市创业控股有限公司           | 29,750.90  | 0.00% | 2,991.82   | 0.00% |
| 中新苏州工业园区创业投资有限公司      | 7,526.17   | 0.00% | 6,365.91   | 0.00% |
| 苏州元风创业投资有限公司          | 0.80       | 0.00% | 0.81       | 0.00% |
| 苏州相城高新创业投资有限公司        | 2,402.36   | 0.00% | 894.18     | 0.00% |
| 苏州工业园区国有资产控股发展有限公司    | 13,381.42  | 0.00% | -          | -     |
| 苏州凯风进取创业投资有限公司        | 32,301.50  | 0.00% | -          | -     |
| 东吴在线(苏州)互联网金融科技服务有限公司 | 391.59     | 0.00% | -          | -     |
| 弦高(苏州)资产管理有限公司        | 66.77      | 0.00% | -          | -     |
| 重若(苏州)资产管理有限公司        | 110.67     | 0.00% | -          | -     |
| 合 计                   | 128,080.08 | 0.00% | 100,076.05 | 0.02% |

## (4) 收取财务顾问费及咨询费

| 企业名称         | 本期金额         |       | 上期金额         |       |
|--------------|--------------|-------|--------------|-------|
|              | 金额           | 比例    | 金额           | 比例    |
| 苏州信托有限公司     | 2,172,960.00 | 0.81% | 2,084,194.79 | 1.37% |
| 苏州银行股份有限公司   | -            | -     | 75,000.00    | 0.05% |
| 苏州元禾控股股份有限公司 | 450,000.00   | 0.17% | -            | -     |
| 合 计          | 2,622,960.00 | 0.98% | 2,159,194.79 | 1.42% |

## (5) 支付房屋租赁费

| 企业名称          | 本期金额         | 上期金额         |
|---------------|--------------|--------------|
| 苏州市国发物业管理有限公司 | 693,062.00   | 686,200.00   |
| 昆山市创业控股有限公司   | 1,400,000.00 | 1,221,300.00 |
| 合 计           | 2,093,062.00 | 1,907,500.00 |

## (6) 购买产品

| 企业名称              | 本期金额       | 上期金额       |
|-------------------|------------|------------|
| 苏州市民卡有限公司         | -          | 440,000.00 |
| 江苏省广电有线信息网络股份有限公司 | 649,876.00 | -          |
| 苏州文化博览中心有限公司      | 19,024.00  | -          |
| 合 计               | 668,900.00 | 440,000.00 |

## (7) 购买关联方东吴人寿保险有限公司发行的寿险产品

| 项 目    | 本期金额          | 上期金额       |
|--------|---------------|------------|
| 企业团体年金 | 30,791,780.00 | 264,550.00 |

|         |               |            |
|---------|---------------|------------|
| 团体意外伤害险 | 656,200.00    | 411,554.00 |
| 合 计     | 31,447,980.00 | 676,104.00 |

## (8) 期末持有由公司作为管理人募集设立的集合资产管理计划

| 企业名称             | 项 目               | 数量 (份)        | 期末净值          |
|------------------|-------------------|---------------|---------------|
| 重若 (苏州) 资产管理有限公司 | 东吴汇信 33 号集合资产管理计划 | 20,000,000.00 | 20,472,000.00 |
| 合 计              |                   | 20,000,000.00 | 20,472,000.00 |

## (9) 期末持有由公司作为管理人募集设立的定向资产管理计划

| 企业名称       | 项 目                   | 期末管理规模            | 本期管理费金额      |
|------------|-----------------------|-------------------|--------------|
| 苏州信托有限公司   | 东吴-招行-汇赢 40 号定向资产管理计划 | 2,500,000,000.00  | 781,333.34   |
| 苏州信托有限公司   | 东吴-江苏-涌金 26 号定向资产管理计划 | 150,000,000.00    | 60,833.82    |
| 苏州银行股份有限公司 | 东吴-光大-苏银 1 号定向资产管理计划  | 4,454,000,000.00  | 2,152,729.14 |
| 苏州银行股份有限公司 | 东吴-宁波-苏银 2 号定向资产管理计划  | 8,411,056,000.00  | 3,506,198.21 |
| 合 计        |                       | 15,515,056,000.00 | 6,501,094.51 |

## (10) 期末持有由关联方作为管理人募集设立的信托计划

| 企业名称     | 项 目           | 数量 (份)       | 期末净值         |
|----------|---------------|--------------|--------------|
| 苏州信托有限公司 | 恒信 J1505 信托计划 | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |
| 合 计      |               | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |

## (11) 现券买卖

| 企业名称          | 项 目             | 数量 (份)        | 本期金额          |
|---------------|-----------------|---------------|---------------|
| 光大保德信基金管理有限公司 | 岁末红利纯债债券型证券投资基金 | 10,000,000.00 | 10,269,340.87 |
| 合 计           |                 | 10,000,000.00 | 10,269,340.87 |

## (12) 转让定向资产管理计划

| 企业名称             | 项目              | 数量 (份)        | 本期金额          |
|------------------|-----------------|---------------|---------------|
| 重若 (苏州) 资产管理有限公司 | 瑞信 16 号定向资产管理计划 | 19,300,000.00 | 19,725,625.00 |
| 合 计              |                 | 19,300,000.00 | 19,725,625.00 |

## (13) 同业资金拆借

| 企业名称       | 本期金额           | 上期金额 |
|------------|----------------|------|
| 苏州银行股份有限公司 | 200,000,000.00 | -    |
| 合 计        | 200,000,000.00 | -    |

## (14) 支付利息

| 企业名称       | 本期金额       | 上期金额 |
|------------|------------|------|
| 苏州银行股份有限公司 | 136,666.67 | -    |
| 合 计        | 136,666.67 | -    |

## (15) 高级管理人员薪酬

| 2015 年度 |              | 2014 年度 |               |
|---------|--------------|---------|---------------|
| 人数      | 金额           | 人数      | 金额            |
| 7       | 7,974,800.00 | 7       | 13,760,000.00 |

根据中国证监会 2012 年下发的《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》(第 88 号令), 公司高级管理人员包括总裁、副总裁、财务负责人、合规总监、董事会秘书等。

本公司 2015 年度计提的高级管理人员任职期间薪酬总额为人民币 797.48 万元, 实际发放人民币 797.48 万元。

(16) 本公司与关联方的交易主要参考市场价格确定。

## 附注 11、或有事项

√适用□不适用

### 11.01 截至 2015 年 12 月 31 日，本公司的未决诉讼事项

(1) 公司南京中山南路证券营业部客户黄云程起诉公司一案，由南京市秦淮区人民法院受理，客户于 2014 年 11 月向法院提起诉讼，以南京中山南路证券营业部为第一被告，公司为第二被告，要求营业部赔偿其损失 666,000.00 元及相应利息，公司承担连带赔偿责任。

2015 年 10 月 16 日，南京市秦淮区人民法院作出一审判决，驳回原告诉讼请求。

(2) 徐浩诉东吴证券股份有限公司一案，2015 年 11 月，公司客户徐浩向苏州工业园区人民法院提起诉讼，主要诉讼请求为要求公司赔偿损失 43.41 万元、操作反弹机会利益 13.63 万元。苏州工业园区人民法院已开庭质证，尚未判决。

### 11.02 截至 2015 年 12 月 31 日，本公司控股子公司东吴期货有限公司的未决诉讼事项

东吴期货有限公司大连客户徐健军与公司合同纠纷一案，由大连仲裁委员会受理，客户 2010 年 3 月申请仲裁要求返还 100 万元保证金，另索赔 30 万元，东吴期货有限公司返还了 33.35 万元保证金。大连仲裁委员会于 2012 年 2 月 17 日开庭审理了本案，未做判决，东吴期货有限公司也未收到大连仲裁委有关下一步审理进程的信息。原告之前的一个重要证据在 2013 年初，被新证据证明无效，该案基本失去了存在的基石，正常情况下该案导致东吴期货有限公司败诉或面临重大损失的可能性不大。

东吴期货有限公司吴江客户王炎锋与公司合同纠纷一案，客户 2015 年 7 月向苏州中级人民法院起诉要求公司赔偿其 2012 年 7 月至 2012 年 11 月的损失 196 万余元。2015 年 12 月 16 日开庭审理，截至 2015 年底法院尚未做出裁决。

### 11.03 股票质押回购的担保物司法冻结

2014 年 9 月 17 日，本公司与客户张跃飞签订股票质押式回购业务协议（以下简称“协议”），张跃飞质押给公司 1,020.00 万股（大写：壹仟零贰拾万股）限售流通股积成电子（002339），借款 5,000.00 万元人民币（大写：伍仟万元整），期限 12 个月，利率：8.2%/年（截止 2016 年 4 月 15 日质押股份市值 18,513 万元）。2015

年 3 月 3 日，积成电子股份有限公司发布公告，声称股东张跃飞先生因涉嫌非法吸收公众存款罪被东阳市人民检察院批准逮捕。公司根据协议约定向张跃飞发送还款通知书要求其提前购回股票质押交易。2015 年 9 月 17 日，由东阳市人民政府协调并支付张跃飞股票质押利息 3,097,777.78 元，并根据其申请将张跃飞股票质押交易延期至 2015 年 12 月 16 日到期。到期日客户未正常购回该笔交易，该笔交易已处于已逾期状态，当前公司正与相关各方协商后续还款及付息事宜。

## 附注 12、承诺事项

√适用□不适用

存在于 2015 年 12 月 31 日各项承诺事项如下：

### 12.01 资本性支出承诺事项

截至 2015 年 12 月 31 日，公司证券大厦正在履行的基建合同总额为 6.657 亿元，已支付工程建造款 6.12 亿元。

### 12.02 经营租赁承诺事项

1、根据已签订的不可撤销的经营性租赁合同，本公司未来最低应支付租金汇总如下：

| 项 目   | 本期发生额          |
|-------|----------------|
| 1 年以内 | 29,903,466.08  |
| 1-2 年 | 41,811,446.52  |
| 2-3 年 | 24,639,448.97  |
| 3 年以上 | 14,560,772.78  |
| 合 计   | 110,915,134.35 |

2、本公司下属子公司——东吴期货有限公司就不可撤销之营业场所及办公楼租赁协议未来需缴付的最低租金为 4,355,224.76 元。

3、本公司下属子公司——东吴基金管理有限公司就不可撤销之营业场所及办公楼租赁协议未来需缴付的最低租金为 1,845,000.00 元。



### 12.03 对外资产质押承诺

本公司部分债券（其中包含买断式回购的债券）被用作卖出回购等业务的质押物，本期末质押品及到期日情况如下：

| 项 目                           | 期末余额              | 质押到期日                   |
|-------------------------------|-------------------|-------------------------|
| 卖出回购证券协议                      | 8,926,452,635.46  | -                       |
| 质押品价值                         | 10,409,127,568.85 | -                       |
| 其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中的债券 | 4,614,329,120.80  | 2016年1月4日至2016年3月28日    |
| 可供出售金融资产中的债券                  | 3,842,286,197.23  | 2016年1月4日至2016年3月28日    |
| 买入返售金融资产                      | 321,449,700.00    | 2016年1月6日至2017年8月19日    |
| 融资融券收益权                       | 1,631,062,550.82  | 2016年01月29日至2017年06月26日 |

### 12.04 对外资产担保承诺

本公司部分股票被用作转融通业务的担保物存放于中国证券金融股份有限公司，本期末担保物情况如下：

| 项 目            | 期末余额           |
|----------------|----------------|
| 转融通融入资金        | 250,000,000.00 |
| 担保物价值          | 259,601,152.29 |
| 其中：存出保证金中的担保资金 | 259,601,152.29 |

## 附注 13、资产负债表日后事项的非调整事项

### 13.01 非公开发行股票

根据公司 2015 年 5 月 29 日第二届董事会第二十三次临时会议和 2015 年 11 月 16 日第四次临时股东大会决议以及中国证券监督管理委员会 2015 年 12 月 23 日出具的《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》（证监许可[2015]3035 号），公司获准非公开发行人民币普通股股票不超过 300,000,000 股，每股面值 1 元，由于上述非公开发行股票方案的实施，新增注册资本人民币 300,000,000.00 元。

截至 2016 年 1 月 13 日，公司已非公开发行人民币普通股股票 300,000,000 股，募集资金总额为人民币 3,540,000,000.00 元，扣除发行费用 146,998,000.00 元，实际募集资金净额 3,393,002,000.00 元，其中新增股本人民币 300,000,000.00 元，资本公积人民币 3,093,002,000.00 元。公司变更后的累计注册资本实收金额为人民币 3,000,000,000.00 元。

### 13.02 购买子公司——东吴期货有限公司少数股权事项

根据东吴期货有限公司（以下简称“东吴期货”）2015 年 8 月 24 日的股东会第三十一次会议决议，本公司收购苏州工业园区华都物资贸易有限公司持有的东吴期货 4% 股权，收购完成后本公司持有东吴期货 93.80% 股权。本次股权变更于 2016 年 1 月 14 日完成工商变更登记。

### 13.03 获准新设营业部情况

2016 年 2 月 3 日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立 3 家分支机构的批复》（苏证监机构字[2016]35 号），公司获准在云南省昆明市、浙江省台州市、北京市各设立一家证券营业部。截至报告日，上述 3 家营业部尚在筹建中。

截至报告日，除上述事项外，本公司无需披露的其他资产负债表日后非调整事项。

## 附注 14、其他重要事项

### 1、分部信息

√适用□不适用

本公司以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，在经营分部的基础上本公司确定了经纪及财富管理业务、投资银行业务、投资与交易业务、资管及基金管理业务、信用交易业务、公司总部及其他等 6 个报告分部。分部信息相关的会计政策参见附注 3：3.32。

本公司各个报告分部提供的主要服务分别如下：

- 经纪及财富管理业务分部从事于代理客户(包括通过互联网)买卖股票、基金、债券、期货等，同时也提供专业化研究服务，协助投资者作出投资决策。
- 投资银行业务分部向机构客户提供企业金融服务，包含股票承销与保荐、债券承销、并购重组其他财务顾问、金融创新服务。
- 投资与交易业务分部以公司自有资金和依法筹集的资金进行权益性证券、固定收益证券、衍生工具及其他另类金融产品的投资交易。
- 资管及基金管理业务分部提供传统资产管理业务、基金管理业务，根据资产规模及客户需求开发资产管理产品和服务。
- 信用交易业务分部包含融资融券、股票质押式回购、约定购回等业务。

公司总部及其他分部系总部运营及除上述主营业务外的其他业务。

## 2015 年度报告分部的财务信息

| 项 目           | 经纪及财富管理业务         | 投资银行业务         | 投资与交易业务           | 资管及基金管理业务      | 信用交易业务            | 公司总部及其他           | 合并抵销              | 合计                |
|---------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 一、营业收入        | 3,025,988,863.82  | 806,570,370.75 | 1,778,531,955.89  | 430,205,335.90 | 695,660,177.68    | 1,062,886,593.13  | -969,681,371.85   | 6,830,161,925.32  |
| 其中：手续费及佣金净收入  | 2,639,036,117.08  | 757,556,414.50 | 10,712,788.29     | 484,451,725.87 | -791,002.20       | 50,186,034.56     | -119,542,919.64   | 3,821,609,158.46  |
| 投资收益          | -                 | -              | 2,160,257,478.35  | -              | -                 | 484,095,494.13    | -260,376,220.46   | 2,383,976,752.02  |
| 其他收入（含公允价值变动） | 386,952,746.74    | 49,013,956.25  | -392,438,310.75   | -54,246,389.97 | 696,451,179.88    | 528,605,064.44    | -589,762,231.75   | 624,576,014.84    |
| 二、营业支出        | 1,125,216,918.35  | 468,563,237.90 | 361,987,538.10    | 305,870,536.21 | 147,196,596.05    | 710,382,329.99    | -13,195,842.52    | 3,106,021,314.08  |
| 三、营业利润（亏损）    | 1,900,771,945.47  | 338,007,132.85 | 1,416,544,417.79  | 124,334,799.69 | 548,463,581.63    | 352,504,263.14    | -956,485,529.33   | 3,724,140,611.24  |
| 四、利润总额        | 1,900,154,273.44  | 338,184,545.75 | 1,327,897,849.09  | 149,889,695.36 | 548,288,366.63    | 355,873,093.33    | -963,021,408.78   | 3,657,266,414.82  |
| 五、资产总额        | 26,978,882,915.78 | 507,700,790.97 | 30,211,382,016.39 | 683,069,638.90 | 14,444,620,893.78 | 13,267,909,761.58 | -5,504,429,483.84 | 80,589,136,533.56 |
| 递延所得税资产       | 6,130,203.15      | -              | 4,650,705.16      | 102,073.73     | -                 | 156,419,254.89    | -                 | 167,302,236.93    |
| 六、负债总额        | 24,404,763,121.28 | 174,386,250.41 | 30,717,852,056.36 | 156,799,533.44 | 37,332,991.64     | 1,693,877,453.37  | 6,651,756,261.05  | 63,836,767,667.55 |
| 递延所得税负债       | -1,396,215.05     | -              | 9,704,341.99      | -              | -                 | -                 | 1,308,935.69      | 9,617,062.63      |
| 七、补充信息        |                   |                |                   |                |                   |                   |                   |                   |
| 1. 折旧与摊销费用    | 51,509,594.36     | 1,897,727.59   | 1,160,675.00      | 10,104,727.43  | 1,431,787.40      | 51,534,397.49     | -                 | 117,638,909.27    |
| 2. 资本性支出      | 78,798,276.55     | 587,013.00     | 2,731,083.00      | 9,639,056.75   | 766,470.00        | 14,671,933.64     | -                 | 107,193,832.94    |
| 3. 资产减值损失     | -                 | -              | 22,797,025.87     | -              | -                 | -                 | -                 | 22,797,025.87     |

## 2014 年度报告分部的财务信息

| 项 目           | 经纪及财富管理业务         | 投资银行业务         | 投资与交易业务           | 资管及基金管理业务      | 信用交易业务            | 公司总部及其他           | 合并抵销              | 合计                |
|---------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 一、营业收入        | 1,194,340,503.42  | 473,933,353.32 | 766,339,791.81    | 186,269,549.28 | 360,415,011.69    | 416,119,494.85    | -156,435,176.50   | 3,240,982,527.87  |
| 其中：手续费及佣金净收入  | 1,049,631,288.44  | 468,393,502.38 | 3,017,316.58      | 189,951,377.59 | -520,958.87       | 14,221,058.47     | -46,321,081.19    | 1,678,372,503.40  |
| 投资收益          | -                 | -              | 1,011,760,838.17  | -              | -                 | 195,828,774.76    | 124,455,583.44    | 1,332,045,196.37  |
| 其他收入（含公允价值变动） | 144,709,214.98    | 5,539,850.94   | -248,438,362.94   | -3,681,828.31  | 360,935,970.56    | 206,069,661.62    | -234,569,678.75   | 230,564,828.10    |
| 二、营业支出        | 653,056,765.57    | 290,951,868.02 | 223,152,886.38    | 176,445,385.25 | 91,977,819.51     | 369,374,114.97    | 5,422,919.63      | 1,810,381,759.33  |
| 三、营业利润（亏损）    | 541,283,737.85    | 182,981,485.30 | 543,186,905.43    | 9,824,164.03   | 268,437,192.18    | 46,745,379.88     | -161,858,096.13   | 1,430,600,768.54  |
| 四、利润总额        | 541,324,297.27    | 183,331,485.30 | 547,870,067.14    | 6,459,098.41   | 268,437,192.18    | 59,766,368.35     | -158,397,609.93   | 1,448,790,898.72  |
| 五、资产总额        | 15,154,939,510.01 | 272,572,188.82 | 22,106,254,143.76 | 399,758,581.72 | 12,176,071,093.84 | 11,405,257,903.66 | -4,053,742,409.18 | 57,461,111,012.63 |
| 递延所得税资产       | 3,922,730.02      | -              | 6,373,621.54      | 12,115,668.43  | -                 | 37,183,699.84     | -                 | 59,595,719.83     |
| 六、负债总额        | 13,843,316,028.76 | 78,331,708.08  | 24,162,571,095.96 | 175,780,216.43 | 46,464,395.75     | 1,264,838,313.75  | 3,656,427,839.88  | 43,227,729,598.61 |
| 递延所得税负债       | -                 | -              | 2,689,891.59      | -              | -                 | -                 | -                 | 2,689,891.59      |
| 七、补充信息        |                   |                |                   |                |                   |                   |                   |                   |
| 1. 折旧与摊销费用    | 53,147,339.15     | 1,760,796.04   | 982,494.84        | 3,690,964.32   | 1,342,096.48      | 48,687,059.28     | -                 | 109,610,750.11    |
| 2. 资本性支出      | 21,273,050.47     | 2,031,966.52   | 478,619.09        | 2,030,630.74   | 421,350.00        | 31,157,070.37     | -                 | 57,392,687.19     |
| 3. 资产减值损失     | -                 | -              | 37,048,527.95     | -              | -                 | -280,006.61       | 15,361,400.00     | 52,129,921.34     |

## 2、以公允价值计量的资产和负债

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                                 | 期初金额              | 本期公允价值变动损益     | 计入权益的累计公允价值变动  | 本期计提的减值 | 期末金额              |
|------------------------------------|-------------------|----------------|----------------|---------|-------------------|
| <b>金融资产</b>                        |                   |                |                |         |                   |
| 1、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产（不含衍生金融资产） | 17,315,854,448.80 | 290,458,733.83 | -              | -       | 14,222,827,510.80 |
| 2、衍生金融资产                           | -                 | 20,406,182.00  | -              | -       | 3,620.00          |
| 3、可供出售金融资产                         | 5,590,487,463.87  |                | 477,520,028.80 | -       | 13,474,446,385.59 |
| 金融资产小计                             | 22,906,341,912.67 | 310,864,915.83 | 477,520,028.80 | -       | 27,697,277,516.39 |
| 投资性房地产                             | -                 | -              | -              | -       | -                 |
| 上述合计                               | 22,906,341,912.67 | 310,864,915.83 | 477,520,028.80 | -       | 27,697,277,516.39 |
| 金融负债                               | -                 | -4,236,345.15  | -              | -       | 5,704,972.15      |

## 3、融资融券业务

公司将资金借给客户，形成一项应收客户的债权确认为融出资金。公司将自有的证券借给客户，约定到期后客户需归还相同数量的同种证券，继续确认该金融资产，计入融出证券。截至 2015 年 12 月 31 日，本公司融出资金余额为 10,875,406,336.00 元，融出证券余额为 174,163.10 元。客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况如下：

| 担保物类别 | 期末公允价值            | 期初公允价值            |
|-------|-------------------|-------------------|
| 资金    | 1,071,954,556.55  | 923,596,486.07    |
| 股票    | 27,969,876,360.07 | 18,414,585,912.80 |
| 基金    | 32,642,627.13     | -                 |
| 合计    | 29,074,473,543.75 | 19,338,182,398.87 |

## 4、转融通融入业务

本年度公司无转融通融入证券情况。

## 5、公益性投入

本年度公司在公益广告、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等公益性方面的投入金额共计 158.97 万元，其中教育资助方面投入 36.50 万元，慈善捐赠方面投入 122.47 万元。

## 6、新设证券营业部

2015 年 5 月 25 日，根据江苏证监局《关于核准东吴证券股份有限公司设立 3 家分支机构的批复》（苏证监机构字[2015]132 号），公司获准在河南省郑州市、江苏省宜兴市、黑龙江省哈尔滨市各设立一家证券营业部。截至 2015 年 12 月 31 日，上述 3 家营业部已设立完成并开业。

## 7、所有权或使用权受到限制的资产

√适用□不适用

单位：元 币种：人民币

| 项目                     | 期末账面价值           | 期初账面价值           |
|------------------------|------------------|------------------|
| 货币资金                   | 100,693,067.86   | 92,905,848.11    |
| 融出资金                   | 1,631,062,550.82 | 7,270,409,166.67 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 4,614,329,120.80 | 9,385,493,397.56 |
| 买入返售金融资产               | 321,449,700.00   | 270,000,000.00   |
| 可供出售金融资产               | 4,124,215,066.07 | 2,186,314,701.85 |

## 8、重大诉讼进展情况

公司诉广州博融投资有限公司（以下简称：“博融投资”）一案，公司与博融投资签订股票质押式回购业务协议，博融投资质押给公司 3,100.00 万股零七股份（000007）股票，借款 21,000.00 万元。2015 年 1 月 23 日该笔交易到期，博融投资未按约定到期购回交易，根据协议约定均构成违约。

2015 年 8 月 4 日，经苏州市中级人民法院立案受理，公司对博融投资提起诉讼，案号为（2015）苏中商初字第 177 号。公司主要诉讼请求为：①要求博融投资支付购回款项 216,142,500 元并承担延期利息和违约金直至欠款结清之日，②要求博融投资承担本案律师费和诉讼费用。2015 年 12 月 14 日，苏州市中级人民法院作出一审判决公司胜诉，博融投资有限公司提起上诉，截止报告日，江苏省高级人民法院已作出终审裁定，案件按广州博融投资有限公司自动撤回上诉处理。

## 附注 15、母公司财务报表主要项目注释

（下列项目如无特殊说明，均以 2015 年 12 月 31 日为截止日，金额以人民币元为货币单位）

### 15.01 应收款项

（1）按明细列示

| 项目      | 期末余额          | 期初余额          |
|---------|---------------|---------------|
| 应收证券清算款 | 45,643,623.44 | 24,427,684.93 |
| 应收资产管理费 | 13,804,565.07 | 6,062,172.20  |

|          |                |               |
|----------|----------------|---------------|
| 其他       | 210,781,752.78 | 794,990.59    |
| 减：减值准备   | 21,781,752.78  | -             |
| 应收款项账面价值 | 248,448,188.51 | 31,284,847.72 |

## (2) 按账龄分析

| 项 目   | 期末余额           |        |               |        |
|-------|----------------|--------|---------------|--------|
|       | 账面余额           |        | 坏账准备          |        |
|       | 金 额            | 比例 (%) | 金 额           | 比例 (%) |
| 1 年以内 | 269,398,283.99 | 99.69  | 21,781,752.78 | 8.09   |
| 1-2 年 | 831,657.30     | 0.31   | -             | -      |
| 2-3 年 | -              | -      | -             | -      |
| 3 年以上 | -              | -      | -             | -      |
| 合 计   | 270,229,941.29 | 100.00 | 21,781,752.78 | 8.06   |

(续上表)

| 项 目   | 期初余额          |        |      |        |
|-------|---------------|--------|------|--------|
|       | 账面余额          |        | 坏账准备 |        |
|       | 金 额           | 比例 (%) | 金 额  | 比例 (%) |
| 1 年以内 | 31,284,847.72 | 100.00 | -    | -      |
| 1-2 年 | -             | -      | -    | -      |
| 2-3 年 | -             | -      | -    | -      |
| 3 年以上 | -             | -      | -    | -      |
| 合 计   | 31,284,847.72 | 100.00 | -    | -      |

## (3) 按评估方式列示

| 种 类      | 期末余额           |        |               |        |
|----------|----------------|--------|---------------|--------|
|          | 账面余额           |        | 坏账准备          |        |
|          | 金 额            | 比例 (%) | 金 额           | 比例 (%) |
| 单项计提减值准备 | -              | -      | -             | -      |
| 组合计提减值准备 | 270,229,941.29 | 100.00 | 21,781,752.78 | 8.06   |
| 合 计      | 270,229,941.29 | 100.00 | 21,781,752.78 | 8.06   |

(续上表)

| 项 目      | 期初余额          |        |      |        |
|----------|---------------|--------|------|--------|
|          | 账面余额          |        | 坏账准备 |        |
|          | 金 额           | 比例 (%) | 金 额  | 比例 (%) |
| 单项计提减值准备 | -             | -      | -    | -      |
| 组合计提减值准备 | 31,284,847.72 | 100.00 | -    | -      |
| 合 计      | 31,284,847.72 | 100.00 | -    | -      |

## (4) 应收款项余额中前五单位名称/性质情况



| 单位名称              | 金额             | 账龄    | 占应收款项总额比例 (%) | 款项性质        |
|-------------------|----------------|-------|---------------|-------------|
| 广州博融投资有限公司        | 210,000,000.00 | 1 年以内 | 77.71         | 股票质押回购业务    |
| 证券清算款             | 42,214,400.00  | 1 年以内 | 15.62         | 应收证券清算款     |
| 东吴汇利 7 号集合资产管理计划  | 1,672,445.26   | 1 年以内 | 0.62          | 资产管理业务产品管理费 |
| 东吴汇信 18 号集合资产管理计划 | 1,159,854.17   | 1 年以内 | 0.43          | 资产管理业务产品管理费 |
| 东吴汇信 31 号集合资产管理计划 | 1,069,925.32   | 1 年以内 | 0.40          | 资产管理业务产品管理费 |
| 合计                | 256,116,624.75 |       | 94.78         |             |

(5) 应收款项余额中无应收持有本公司 5%(含 5%)以上股份的股东及其他关联方的款项。

## 15.02 长期股权投资

(1) 按类别列示

| 项目     | 期末余额             | 期初余额             |
|--------|------------------|------------------|
| 子公司    | 2,863,196,035.71 | 2,357,577,285.71 |
| 联营企业   | -                | -                |
| 合营企业   | -                | -                |
| 其他股权投资 | -                | -                |
| 小计     | 2,863,196,035.71 | 2,357,577,285.71 |
| 减：减值准备 | -                | -                |
| 合计     | 2,863,196,035.71 | 2,357,577,285.71 |

## (2) 长期股权投资明细情况

## 子公司投资情况

| 被投资单位             | 核算方法 | 投资成本             | 期初余额             | 增减变动           | 期末余额             | 在被投资单位持股比例 (%) | 在被投资单位表决权比例 (%) | 在被投资单位持股比例与表决权比例不一致的说明 | 减值准备 | 本期计提减值准备 | 本期现金红利         |
|-------------------|------|------------------|------------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|------------------------|------|----------|----------------|
| 1、东吴期货有限公司        | 成本法  | 525,450,000.00   | 525,450,000.00   | -              | 525,450,000.00   | 89.80          | 89.80           | -                      | -    | -        | 29,634,000.00  |
| 2、东吴创业投资有限公司      | 成本法  | 650,000,000.00   | 600,000,000.00   | 50,000,000.00  | 650,000,000.00   | 100.00         | 100.00          | -                      | -    | -        | 33,000,000.00  |
| 3、东吴创新资本管理有限公司    | 成本法  | 1,421,328,000.00 | 1,000,000,000.00 | 421,328,000.00 | 1,421,328,000.00 | 100.00         | 100.00          | -                      | -    | -        | 122,000,000.00 |
| 4、东吴基金管理有限公司      | 成本法  | 232,127,285.71   | 232,127,285.71   | -              | 232,127,285.71   | 70.00          | 70.00           | -                      | -    | -        | -              |
| 5、东吴证券中新(新加坡)有限公司 | 成本法  | 34,290,750.00    | -                | 34,290,750.00  | 34,290,750.00    | 75.00          | 75.00           | -                      | -    | -        | -              |
| 合计                |      | 2,863,196,035.71 | 2,357,577,285.71 | 505,618,750.00 | 2,863,196,035.71 | -              | -               | -                      | -    | -        | 184,634,000.00 |

报告期内被投资单位经营正常，近期内不会出现可收回金额低于账面价值的情况，无需计提长期投资减值准备。

## 15.03 其他资产

按类别列示

| 项 目    | 期末余额           | 期初余额          |
|--------|----------------|---------------|
| 其他应收款  | 64,591,512.56  | 44,412,556.00 |
| 待摊费用   | 7,543,600.37   | 8,057,578.20  |
| 长期待摊费用 | 25,463,922.58  | 44,226,160.65 |
| 其他长期资产 | 25,226,608.00  | -             |
| 合 计    | 122,825,643.51 | 96,696,294.85 |

## (1) 其他应收款

## ①按明细列示

| 项 目     | 期末余额          | 期初余额          |
|---------|---------------|---------------|
| 其他应收款余额 | 64,591,512.56 | 44,412,556.00 |
| 减：坏账准备  | -             | -             |
| 其他应收款净值 | 64,591,512.56 | 44,412,556.00 |

## ②其他应收款按种类分析

| 种 类                   | 期末余额          |        |      |        | 账面价值          |
|-----------------------|---------------|--------|------|--------|---------------|
|                       | 账面余额          |        | 坏账准备 |        |               |
|                       | 金 额           | 比例 (%) | 金 额  | 比例 (%) |               |
| 单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款 | 36,041,500.00 | 55.80  | -    | -      | 36,041,500.00 |
| 按组合计提坏账准备的其他应收款       |               |        |      |        |               |
| 组合一                   | 27,782,898.30 | 43.01  | -    | -      | 27,782,898.30 |

| 种 类                    | 期末余额          |        |      |        |               |
|------------------------|---------------|--------|------|--------|---------------|
|                        | 账面余额          |        | 坏账准备 |        | 账面价值          |
|                        | 金 额           | 比例 (%) | 金 额  | 比例 (%) |               |
| 组合小计                   | 27,782,898.30 | 43.01  | -    | -      | 27,782,898.30 |
| 单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款 | 767,114.26    | 1.19   | -    | -      | 767,114.26    |
| 合 计                    | 64,591,512.56 | 100.00 | -    | -      | 64,591,512.56 |

(续上表)

| 种 类                    | 期初余额          |        |      |        |               |
|------------------------|---------------|--------|------|--------|---------------|
|                        | 账面余额          |        | 坏账准备 |        | 账面价值          |
|                        | 金 额           | 比例 (%) | 金 额  | 比例 (%) |               |
| 单项金额重大并单独计提坏账准备的其他应收款  | 36,041,500.00 | 81.15  | -    | -      | 36,041,500.00 |
| 按组合计提坏账准备的其他应收款        |               |        |      |        |               |
| 组合一                    | 7,659,137.20  | 17.25  | -    | -      | 7,659,137.20  |
| 组合小计                   | 7,659,137.20  | 17.25  | -    | -      | 7,659,137.20  |
| 单项金额不重大但单独计提坏账准备的其他应收款 | 711,918.80    | 1.60   | -    | -      | 711,918.80    |
| 合 计                    | 44,412,556.00 | 100.00 | -    | -      | 44,412,556.00 |

③组合中，按账龄分析法计提坏账准备的其他应收款：

| 项 目   | 期末余额          |      |      |
|-------|---------------|------|------|
|       | 其他应收款         | 坏账准备 | 计提比例 |
| 1 年以内 | 25,478,168.24 | -    | -    |
| 1-2 年 | 1,021,022.97  | -    | -    |
| 2-3 年 | 1,283,707.09  | -    | -    |

| 项 目   | 期末余额          |      |      |
|-------|---------------|------|------|
|       | 其他应收款         | 坏账准备 | 计提比例 |
| 3 年以上 | -             | -    | -    |
| 合 计   | 27,782,898.30 | -    | -    |

(续上表)

| 项 目   | 期初余额         |      |      |
|-------|--------------|------|------|
|       | 其他应收款        | 坏账准备 | 计提比例 |
| 1 年以内 | 4,862,425.85 | -    | -    |
| 1-2 年 | 1,485,292.01 | -    | -    |
| 2-3 年 | 1,311,419.34 | -    | -    |
| 3 年以上 | -            | -    | -    |
| 合 计   | 7,659,137.20 | -    | -    |

## ④期末其他应收款中主要项目

| 单位名称               | 金额            | 账龄    | 占其他应收款总额比例 (%) | 款项性质    |
|--------------------|---------------|-------|----------------|---------|
| 张家港市中昊房地产有限公司      | 36,041,500.00 | 2-3 年 | 55.80          | 预付购房款   |
| 上海陆家嘴金融贸易区开发股份有限公司 | 3,111,877.77  | 1 年以内 | 4.82           | 房租押金    |
| 江苏省电力公司苏州供电公司      | 1,357,975.54  | 1 年以内 | 2.10           | 预付电费    |
| 北京鑫景通达置业有限公司       | 959,293.20    | 1 年以内 | 1.49           | 房屋租赁保证金 |
| 刘美展                | 888,567.42    | 1 年以内 | 1.38           | 房租押金    |
| 合 计                | 42,359,213.93 |       | 65.59          |         |

⑤期末其他应收款中无持有本公司 5%（含 5%）以上股份的股东单位欠款情况。

## (2) 待摊费用

| 项 目   | 期末余额         | 期初余额         |
|-------|--------------|--------------|
| 房租    | 7,266,549.55 | 7,947,080.45 |
| 数据线路费 | -            | 91,343.78    |
| 其他    | 277,050.82   | 19,153.97    |
| 合 计   | 7,543,600.37 | 8,057,578.20 |

## (3) 长期待摊费用

## 2015 年度增减变动情况

| 项 目  | 取得方式 | 原始金额          | 期初余额          | 本期增加         | 本期减少          |              | 期末余额          |
|------|------|---------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|
|      |      |               |               |              | 本期摊销          | 其他减少         |               |
| 装修费  | 购入   | 50,955,192.13 | 29,264,424.47 | 3,422,668.99 | 12,179,076.15 | -            | 20,508,017.31 |
| 网络工程 | 购入   | 5,842,092.19  | 2,814,581.19  | 503,658.50   | 1,562,228.46  | -            | 1,756,011.23  |
| 办公家具 | 购入   | 6,699,220.97  | 10,415,838.01 | 69,758.00    | 1,403,794.04  | 6,786,502.04 | 2,295,299.93  |
| 水电增容 | 购入   | 941,784.32    | 428,163.00    | -            | 302,292.24    | -            | 125,870.76    |
| 消防工程 | 购入   | 2,752,694.89  | 1,303,153.98  | 56,462.40    | 580,893.03    | -            | 778,723.35    |
| 合 计  |      | 67,190,984.50 | 44,226,160.65 | 4,052,547.89 | 16,028,283.92 | 6,786,502.04 | 25,463,922.58 |

## (4) 其他长期资产

| 项 目            | 期末余额         | 期初余额 |
|----------------|--------------|------|
| 苏州名城信息港发展有限公司  | 4,546,608.00 | -    |
| 苏州奥杰汽车技术股份有限公司 | 850,000.00   | -    |

| 项 目           | 期末余额          | 期初余额 |
|---------------|---------------|------|
| 湘村高科农业股份有限公司  | 9,630,000.00  | -    |
| 深圳市联赢激光股份有限公司 | 5,000,000.00  | -    |
| 成都好房通科技有限公司   | 3,000,000.00  | -    |
| 安徽白兔湖动力股份有限公司 | 2,200,000.00  | -    |
| 合 计           | 25,226,608.00 | -    |

上述款项为本公司支付的增资预付款。

#### 15.04 手续费及佣金净收入

##### (1) 项目明细

| 项 目         | 本期发生额            | 上期发生额            |
|-------------|------------------|------------------|
| 手续费及佣金收入    |                  |                  |
| 1. 经纪业务收入   | 3,358,460,117.73 | 1,219,046,532.38 |
| 其中：证券经纪业务收入 | 3,358,460,117.73 | 1,219,046,532.38 |
| 其中：代理买卖证券业务 | 3,293,318,761.58 | 1,187,754,042.76 |
| 交易单元席位租赁    | 53,878,036.36    | 16,884,698.62    |
| 代销金融产品业务    | 11,263,319.79    | 14,407,791.00    |
| 期货经纪业务收入    | -                | -                |
| 2. 投资银行业务收入 | 765,676,414.50   | 501,739,502.38   |
| 其中：证券承销业务   | 460,931,235.93   | 319,145,236.00   |
| 保荐服务业务      | 35,375,000.00    | 42,139,140.00    |
| 财务顾问业务      | 269,370,178.57   | 140,455,126.38   |
| 3. 投资咨询服务收入 | 50,256,449.13    | 12,177,233.79    |

| 项 目                    | 本期发生额            | 上期发生额            |
|------------------------|------------------|------------------|
| 4. 资产管理业务收入            | 258,772,857.06   | 133,711,663.61   |
| 5. 其他                  | 1,888,505.79     | 6,034,859.44     |
| 手续费及佣金收入小计             | 4,435,054,344.21 | 1,872,709,791.60 |
| 手续费及佣金支出               |                  |                  |
| 1. 经纪业务支出              | 780,859,201.04   | 234,074,279.86   |
| 其中：证券经纪业务              | 780,859,201.04   | 234,074,279.86   |
| 其中：代理买卖证券业务            | 780,859,201.04   | 234,074,279.86   |
| 交易单元席位租赁               | -                | -                |
| 代销金融产品业务               | -                | -                |
| 期货经纪业务支出               | -                | -                |
| 2. 投资银行业务支出            | 8,120,000.00     | 33,346,000.00    |
| 其中：证券承销业务              | 4,250,000.00     | 33,346,000.00    |
| 保荐服务业务                 | -                | -                |
| 财务顾问业务                 | 3,870,000.00     | -                |
| 3. 投资咨询服务支出            | -                | -                |
| 4. 资产管理业务支出            | 4,347,682.86     | 1,555,231.25     |
| 5. 其他                  | 14,708,596.01    | 5,308,607.04     |
| 手续费及佣金支出小计             | 808,035,479.91   | 274,284,118.15   |
| 手续费及佣金净收入              | 3,627,018,864.30 | 1,598,425,673.45 |
| 其中：财务顾问业务净收入           | 265,500,178.57   | 140,455,126.38   |
| ——并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司 | 25,610,000.00    | 52,600,000.00    |
| ——并购重组财务顾问业务净收入-其他     | -                | -                |
| ——其他财务顾问业务净收入          | 239,890,178.57   | 87,855,126.38    |



## 15.05 投资收益

## (1) 投资收益明细情况

| 项 目                      | 本期发生额            | 上期发生额          |
|--------------------------|------------------|----------------|
| 1. 权益法确认的收益              | -                | 6,635,940.33   |
| 2. 成本法确认的收益              | 184,634,000.00   | 70,836,201.60  |
| 3. 金融工具持有期间取得的分红和利息      | 354,653,116.70   | 208,547,692.41 |
| ——以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 24,947,112.90    | 58,882,577.45  |
| ——持有至到期投资                | -                | -              |
| ——可供出售金融资产               | 329,706,003.80   | 149,665,114.96 |
| 4. 处置收益                  | 1,575,114,489.47 | 673,017,032.75 |
| ——长期股权投资                 | -                | -              |
| ——以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 641,904,093.19   | 518,203,917.67 |
| ——衍生金融工具                 | -36,046,446.84   | -54,138,388.55 |
| ——持有至到期投资                | -                | -              |
| ——可供出售金融资产               | 969,256,843.12   | 208,951,503.63 |
| 5. 其他                    | -                | -              |
| 合 计                      | 2,114,401,606.17 | 959,036,867.09 |

## (2) 按联营企业和合营企业的投资收益

| 被投资单位      | 本期发生额 | 上期发生额        | 本期比上期增减变动的原因            |
|------------|-------|--------------|-------------------------|
| 东吴基金管理有限公司 | -     | 6,635,940.33 | 2014年9月30日收购部分股权转为子公司核算 |
| 合 计        | -     | 6,635,940.33 |                         |

## (3) 按成本法核算的长期股权投资收益

| 被投资单位        | 本期发生额          | 上期发生额         | 本期比上期增减变动的原因 |
|--------------|----------------|---------------|--------------|
| 东吴创业投资有限公司   | 33,000,000.00  | 15,000,000.00 | 本期分红增加       |
| 东吴创新资本管理有限公司 | 122,000,000.00 | 30,000,000.00 | 本期分红增加       |
| 东吴期货有限公司     | 29,634,000.00  | 25,836,201.60 | 本期分红增加       |
| 合 计          | 184,634,000.00 | 70,836,201.60 |              |

(4) 公司投资收益汇回无重大限制情况。

## 15.06 公允价值变动收益

| 产生公允价值变动收益的来源          | 本期发生额          | 上期发生额          |
|------------------------|----------------|----------------|
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 235,154,432.48 | 41,837,460.14  |
| 衍生金融工具                 | 16,160,659.85  | -20,522,040.00 |
| 合 计                    | 251,315,092.33 | 21,315,420.14  |

## 15.07 现金流量表补充资料

## (1) 现金流量表补充资料

| 项 目                | 本期发生额            | 上期发生额          |
|--------------------|------------------|----------------|
| 1、将净利润调节为经营活动现金流量： |                  |                |
| 净利润                | 2,658,682,072.90 | 879,890,031.56 |
| 加：资产减值准备           | 22,797,025.87    | 36,768,521.34  |
| 固定资产折旧             | 70,665,528.40    | 69,890,534.36  |
| 无形资产摊销             | 17,779,875.46    | 13,506,012.26  |
| 长期待摊费用摊销           | 16,028,283.92    | 19,629,273.29  |

|                             |                   |                    |
|-----------------------------|-------------------|--------------------|
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失(减:收益) | 1,547,608.79      | -2,774,915.53      |
| 固定资产报废损失                    | -                 | -                  |
| 公允价值变动损失                    | -                 | -                  |
| 利息支出                        | 764,788,687.24    | 239,580,187.64     |
| 投资损失(减:收益)                  | -184,634,000.00   | -77,472,141.93     |
| 递延所得税资产减少(减:增加)             | -113,581,467.65   | 4,298,255.56       |
| 递延所得税负债增加(减:减少)             | -                 | -                  |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产减少    | -                 | -                  |
| 经营性应收项目的减少(减:增加)            | -7,094,707,129.74 | -23,703,027,544.23 |
| 经营性应付项目的增加(减:减少)            | 2,949,054,570.42  | 23,935,598,857.86  |
| 其他                          | -                 | -                  |
| 经营活动产生的现金流量净额               | -891,578,944.39   | 1,415,887,072.18   |
| 2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动:        |                   |                    |
| 债务转为资本                      | -                 | -                  |
| 一年内到期的可转换公司债券               | -                 | -                  |
| 融资租入固定资产                    | -                 | -                  |
| 3、现金及现金等价物净变动情况:            |                   |                    |
| 现金的期末余额                     | 26,573,368,824.16 | 14,418,820,762.62  |
| 减: 现金的期初余额                  | 14,418,820,762.62 | 6,244,104,502.57   |
| 加: 现金等价物的期末余额               | -                 | -                  |
| 减: 现金等价物的期初余额               | -                 | -                  |
| 现金及现金等价物净增加额                | 12,154,548,061.54 | 8,174,716,260.05   |

## (2) 现金及现金等价物的构成

| 项 目            | 本期发生额             | 上期发生额             |
|----------------|-------------------|-------------------|
| 一、现金           | 26,573,368,824.16 | 14,418,820,762.62 |
| 其中：库存现金        | 69,503.33         | 214,711.17        |
| 可随时用于支付的银行存款   | 21,777,808,333.18 | 8,496,773,759.28  |
| 可随时用于支付的结算备付金  | 4,745,490,997.69  | 5,891,832,292.17  |
| 其他货币资金         | 49,999,989.96     | 30,000,000.00     |
| 二、现金等价物        | -                 | -                 |
| 三、期末现金及现金等价物余额 | 26,573,368,824.16 | 14,418,820,762.62 |

## 附注 16、补充资料

### 1、当期非经常性损益明细表

单位：元 币种：人民币

| 项目   | 金额            | 说明 |
|--|---------------|----|
| 非流动资产处置损益  | -1,507,762.21 |    |
| 越权审批或无正式批准文件的税收返还、减免                                 |               |    |
| 计入当期损益的政府补助（与企业业务密切相关，按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外）        | 18,492,164.47 |    |
| 计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费                                |               |    |
| 企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益 |               |    |
| 非货币性资产交换损益   |               |    |
| 委托他人投资或管理资产的损益                                       |               |    |
| 因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备                          |               |    |
| 债务重组损益   |               |    |
| 企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等                                |               |    |
| 交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益                            |               |    |
| 同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益                          |               |    |

|   |               |  |
|---|---------------|--|
| 与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益   |               |  |
| 除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益 |               |  |
| 单独进行减值测试的应收款项减值准备转回   |               |  |
| 对外委托贷款取得的损益   |               |  |
| 采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益  |               |  |
| 根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响  |               |  |
| 受托经营取得的托管费收入  |               |  |
| 除上述各项之外的其他营业外收入和支出  | -2,104,598.68 |  |
| 其他符合非经常性损益定义的损益项目   |               |  |
| 所得税影响额  | -3,719,950.90 |  |
| 少数股东权益影响额   | -858,921.57   |  |
| 合计  | 10,300,931.11 |  |

对公司根据《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》定义界定的非经常性损益项目，以及把《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》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

本公司持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、衍生金融工具产生的公允价值变动损益，持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和可供出售金融资产、贷款和应收款项期间取得的投资收益，以及处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、衍生金融工具和可供出售金融资产取得的投资收益不作为非经常性损益项目，而界定为经常性损益项目的原因：本公司作为证券经营机构，上述业务均属于本公司的正常经营业务。

## 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 |
| 归属于公司普通股股东的净利润       | 17.69          | 1.00   | 1.00   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的 | 17.62          | 1.00   | 1.00   |

|                        |            |  |             |        |
|------------------------|------------|--|-------------|--------|
| 净利润                    |            |  |             |        |
| 2014 年度                | 净资产收益率 (%) |  | 每股收益 (人民币元) |        |
|                        | 加权平均       |  | 基本每股收益      | 稀释每股收益 |
| 归属于母公司所有者的净利润          | 10.60      |  | 0.49        | 0.49   |
| 扣除非经常性损益后归属于母公司所有者的净利润 | 9.05       |  | 0.42        | 0.42   |

## (1) 加权平均净资产收益率计算过程

| 项目名称                           | 序号      | 2015 年度           | 2014 年度          |
|--------------------------------|---------|-------------------|------------------|
| 归属于公司普通股股东的净利润                 | P0 (NP) | 2,708,494,901.88  | 1,115,452,050.88 |
| 扣除所得税影响后归属于母公司的非经常性净损益         |         | 10,300,931.11     | 162,658,545.27   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润        | P0      | 2,698,193,970.77  | 952,793,505.61   |
| 归属于公司普通股股东的期初净资产               | E0      | 14,078,857,196.50 | 7,829,075,087.99 |
| 报告期发行新股或债转股等新增的、归属于公司普通股股东的净资产 | Ei      | -                 | 4,998,580,000.00 |
| 新增净资产次月起至报告期期末的累计月数            | Mi      | -                 | 5.00             |
| 报告期月份数                         | M0      | 12.00             | 12.00            |
| 报告期回购或现金分红等减少的、归属于公司普通股股东的净资产  | Ej      | 337,500,000.00    | 120,000,000.00   |
| 减少净资产次月起至报告期期末的累计月数            | Mj      | 6.00              | 7.00             |
| 因其他交易或事项引起的、归属于公司普通股股东的净资产增减变动 | Ek      | 90,065,001.01     | 255,750,057.63   |
| 发生其他净资产增减变动次月起至报告期期末的累计月数      | Mk      | 6.00              | 6.00             |
| 扣除非经常性损益前加权平均净资产收益率 (%) ※1     |         | 17.69%            | 10.60%           |
| 扣除非经常性损益后加权平均净资产收益率 (%) ※1     |         | 17.62%            | 9.05%            |

※1 加权平均净资产收益率 =  $P0 / (E0 + NP \div 2 + Ei \times Mi \div M0 - Ej \times Mj \div M0 \pm Ek \times Mk \div M0)$

## (2) 每股收益的计算过程

| 项目名称                           | 项目号       | 2015 年度          | 2014 年度          |
|--------------------------------|-----------|------------------|------------------|
| 归属于公司普通股股东的净利润                 | P0 ( I )  | 2,708,494,901.88 | 1,115,452,050.88 |
| 扣除所得税影响后归属于母公司的非经常性净损益         |           | 10,300,931.11    | 162,658,545.27   |
| 扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润        | P0 ( II ) | 2,698,193,970.77 | 952,793,505.61   |
| 发行在外的普通股加权平均数                  | S         | 2,700,000,000.00 | 2,291,666,666.67 |
| 期初股份总数                         | S0        | 2,700,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| 报告期因公积金转增股本或股票股利分配等增加股份数       | S1        | -                | -                |
| 报告期因发行新股或债转股等增加股份数             | Si        | -                | 700,000,000.00   |
| 报告期因回购等减少股份数                   | Sj        | -                | -                |
| 报告期缩股数                         | Sk        | -                | -                |
| 报告期月份数                         | M0        | 12.00            | 12.00            |
| 增加股份次月起至报告期期末的累计月数             | Mi        | -                | 5.00             |
| 减少股份次月起至报告期期末的累计月数             | Mj        | -                | -                |
| 扣除非经常性损益前每股收益※1                |           | 1.00             | 0.49             |
| 扣除非经常性损益后每股收益※1                |           | 1.00             | 0.42             |
| 已确认为费用的稀释性潜在普通股股利              |           | -                | -                |
| 所得税税率                          |           | 25.00%           | 25.00%           |
| 转换费用                           |           | -                | -                |
| 可转换公司债券、认股权证、股份期权等转换或行权而增加的股份数 |           | -                | -                |
| 扣除非经常性损益前稀释每股收益※2              |           | 1.00             | 0.49             |
| 扣除非经常性损益后稀释每股收益※2              |           | 1.00             | 0.42             |

※1 基本每股收益= $P0 \div S$  (其中  $S=S0+S1+Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk$ )

※2 稀释每股收益= $P1 / (S0+S1+Si \times Mi \div M0 - Sj \times Mj \div M0 - Sk + \text{认股权证、股份期权、可转换债券等增加的普通股加权平均数})$

(其中 P1 为归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润，并考虑稀释性潜在普通股对其影响，按《企业会计准则》及有关规定进行调整。公司在计算稀释每股收益时，考虑所有稀释性潜在普通股对归属于公司普通股股东的净利润或扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润和加权平均股数的影响，按照其稀释程度从大到小的顺序计入稀释每股收益，直至稀释每股收益达到最小值。)

### 3、主要会计报表项目的异常情况及原因

#### 3.01 资产负债表项目

单位：人民币元

| 项目        | 期末余额              | 期初余额              | 增减金额              | 增减比例    | 变动原因 |
|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---------|------|
| 货币资金      | 23,454,179,048.36 | 10,249,789,646.59 | 13,204,389,401.77 | 128.83% | 注 1  |
| 融出资金      | 10,875,406,336.00 | 7,888,930,794.47  | 2,986,475,541.53  | 37.86%  | 注 2  |
| 买入返售金融资产  | 8,923,142,748.05  | 6,582,668,335.27  | 2,340,474,412.78  | 35.56%  | 注 3  |
| 可供出售金融资产  | 14,337,888,888.16 | 5,962,900,341.44  | 8,374,988,546.72  | 140.45% | 注 4  |
| 应付短期融资款   | 4,567,350,000.00  | 3,313,738,000.00  | 1,253,612,000.00  | 37.83%  | 注 5  |
| 卖出回购金融资产款 | 8,926,452,635.46  | 16,361,955,658.47 | -7,435,503,023.01 | -45.44% | 注 6  |
| 代理买卖证券款   | 24,025,978,380.26 | 13,579,472,286.92 | 10,446,506,093.34 | 76.93%  | 注 7  |
| 应付债券      | 16,466,882,811.73 | 2,975,791,937.06  | 13,491,090,874.67 | 453.36% | 注 8  |
| 其他负债      | 6,877,015,079.34  | 3,952,206,040.35  | 2,924,809,038.99  | 74.00%  | 注 9  |

注 1：货币资金增加主要是由于本期股市交易活跃，客户资金存款增加所致。

注 2：融出资金增加主要是由于本期公司融资融券业务规模大幅度增加所致。

注 3：买入返售金融资产增加主要是由于公司股权质押回购业务规模大幅度增加所致。

注 4：可供出售金融资产增加主要是由于期末持有的债券及股票较期初大幅增加所致。



注 5：应付短期融资款增加是由于公司本期新发行的短期融资券及收益凭证较期初增加所致。

注 6：卖出回购金融资产款减少主要是由于卖出回购金融资产业务规模减少所致。

注 7：代理买卖证券款增加主要是由于本期股市交易活跃，客户资金增加所致。

注 8：应付债券增加主要是由于本期发行次级债增加所致。

注 9：其他负债增加主要是由于本期纳入合并范围的结构化主体中应付其他投资者的负债增加所致。

### 3.02 利润表项目

单位：人民币元

| 项目            | 本期金额             | 上期金额             | 增减金额             | 增减比例    | 变动原因 |
|---------------|------------------|------------------|------------------|---------|------|
| 手续费及佣金净收入     | 3,821,609,158.46 | 1,678,372,503.40 | 2,143,236,655.06 | 127.70% | 注 1  |
| 其中：经纪业务手续费净收入 | 2,646,254,123.37 | 1,047,928,710.47 | 1,598,325,412.90 | 152.52% | 注 2  |
| 投资银行业务手续费净收入  | 757,556,414.50   | 468,393,502.38   | 289,162,912.12   | 61.74%  | 注 3  |
| 投资收益          | 2,383,976,752.02 | 1,332,045,196.37 | 1,051,931,555.65 | 78.97%  | 注 4  |
| 业务及管理费        | 2,656,099,023.42 | 1,579,192,330.95 | 1,076,906,692.47 | 68.19%  | 注 5  |
| 所得税费用         | 923,973,390.23   | 324,231,545.03   | 599,741,845.20   | 184.97% | 注 6  |

注 1：手续费及佣金净收入增加主要是由于经纪业务和投资银行业务净收入较上期大幅增加所致。

注 2：经纪业务手续费净收入增加主要是由于本期股市交易活跃，经纪交易量增加所致。

注 3：投资银行业务手续费净收入增加主要是由于本期公司承销、保荐及财务顾问业务收入增加所致。

注 4：投资收益增加主要是由于本期公司金融工具处置收入较上期大幅增加所致。

注 5：业务及管理费增加主要是本期业务规模增长导致运营成本增长，同时各条线收入增长带动了相关人力成本增加所致。

注 6：所得税费用增加主要是由于本期税前利润大幅度增长所致。

## 第十二节 备查文件目录

|        |                                       |
|--------|---------------------------------------|
| 备查文件目录 | 载有公司法定代表人签名的年度报告文本。                   |
| 备查文件目录 | 载有公司法定代表人、主管会计工作负责人及会计机构负责人签名盖章的财务报告。 |
| 备查文件目录 | 载有会计师事务所盖章、注册会计师签名盖章的审计报告文本。          |
| 备查文件目录 | 报告期内中国证监会指定报纸上公开披露过的所有公司文件的正本及公告原稿。   |
| 备查文件目录 | 其他有关资料。                               |

董事长：范力

董事会批准报送日期：2016 年 4 月 18 日

### 修订信息

| 报告版本号 | 更正、补充公告发布时间 | 更正、补充公告内容 |
|-------|-------------|-----------|
|       |             |           |
|       |             |           |

## 第十三节 证券公司信息披露

### 一、公司重大行政许可事项的相关情况

√适用□不适用

| 时间        | 行政许可批复名称                               | 行政许可批复文号          |
|-----------|--|-------------------|
| 2015-1-23 | 关于东吴证券股份有限公司成为上海证券交易所股票期权交易参与人的通知      | 上证函[2015]135 号    |
| 2015-1-28 | 关于开通股票期权自营交易权限的通知                      | 上证函[2015]197 号    |
| 2015-3-3  | 关于同意开展互联网证券业务试点的函                      | 中证协函【2015】115 号   |
| 2015-3-11 | 关于核准东吴证券股份有限公司撤销 1 家分支机构的批复            | 桂证监许可【2015】6 号    |
| 2015-5-8  | 关于核准东吴证券股份有限公司在新加坡设立东吴证券中新（新加坡）有限公司的批复 | 证监许可[2015]857 号   |
| 2015-5-25 | 关于核准东吴证券股份有限公司设立 3 家分支机构的批复            | 苏证监机构字[2015]132 号 |
| 2015-6-1  | 关于东吴证券单项视频开户创新方案的无异议函                  | 中国结算办字[2015]451 号 |

|            |                                 |                    |
|------------|---------------------------------|--------------------|
| 2015-6-1   | 关于东吴证券 H5 引流开户方案的无异议函           | 中国结算办字[2015]457 号  |
| 2015-6-10  | 关于核准东吴证券股份有限公司向合格投资者公开发行公司债券的批复 | 证监许可 [2015] 1211 号 |
| 2015-7-21  | 关于核准朱建根证券公司董事任职资格的批复            | 苏证监机构字[2015]190 号  |
| 2015-8-5   | 关于核准朱剑证券公司董事任职资格的批复             | 苏证监机构字[2015]199 号  |
| 2015-12-23 | 关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复        | 证监许可[2015]3035 号   |

## 二、 监管部门对公司的分类结果

√适用□不适用

公司在 2013 年、2014 年、2015 年分类评价结果分别为 A 类 A 级、B 类 BBB 级、A 类 A 级。