

资产负债表

单位:广州证券股份有限公司

日期:2016-12-31

会证01表
单位:元

资产	期末余额	年初余额	负债及所有者权益	期末余额	年初余额
资产			负 债:		
货币资金	9,654,302,995.70	13,314,353,923.77	短期借款	-	
其中: 客户存款	6,099,966,592.62	8,103,021,673.15	应付短期融资款	-	200,000,000.00
结算备付金	1,606,009,661.94	2,693,702,401.89	拆入资金	500,000,000.00	
其中: 客户备付金	983,578,645.48	1,710,267,806.23	交易性金融负债	1,951,446,160.00	1,162,323,140.00
拆出资金	-		衍生金融负债	-	12,040,349.42
融出资金	3,283,292,337.96	3,921,805,213.08	卖出回购金融资产款	7,514,493,852.67	10,526,084,117.86
交易性金融资产	3,337,913,753.40	3,006,673,277.71	代理买卖证券款	6,710,073,765.86	9,423,546,763.87
衍生金融资产	75,928,943.87	-	代理承销证券款	-	
买入返售金融资产	9,966,255,339.59	1,729,896,764.66	应付职工薪酬	628,834,078.74	568,012,954.91
应收帐款	198,787,441.34	60,978,242.21	应交税费	112,843,877.11	174,694,832.02
内部清算	-	-	应付利息	369,296,747.78	130,135,766.26
内部往来	-	-	应付款项	295,953,553.15	118,331,383.76
应收利息	471,110,759.40	369,966,096.14	预计负债	510,000.00	-
存出保证金	253,756,086.08	108,380,674.80	长期借款	-	
可供出售金融资产	9,576,406,150.24	13,323,807,196.90	应付债券	8,070,967,081.62	6,394,640,897.91
持有至到期投资	-		递延所得税负债	63,064,205.82	254,071,110.05
长期股权投资	1,496,629,041.96	1,065,318,000.15	其他负债	3,131,427,931.71	361,876,987.67
投资性房地产	-		负债合计	29,348,911,254.46	29,325,758,303.73
固定资产	75,127,088.06	66,683,364.33		-	
在建工程	-		所有者权益(或股东权益):	-	
无形资产	50,404,538.90	35,868,546.88	实收资本(或股本)	5,360,456,852.00	5,360,456,852.00
递延所得税资产	92,140,485.77	65,395,261.47	资本公积	3,685,227,615.12	3,685,227,615.12
其他资产	318,049,727.16	737,841,273.42	减: 库存股	-	
货币兑换	-		盈余公积	139,745,739.90	139,745,739.90
待转承销费用	-		一般风险准备	564,264,586.56	564,264,586.56
	-		其他综合收益	149,356,640.68	697,385,974.77
	-		未分配利润	1,208,151,662.65	727,831,165.33
	-		营运资金	-	
	-		外币报表折算差额	-	
	-		所有者权益(或股东权益)合计	11,107,203,096.91	11,174,911,933.68
	-			-	
资产总计	40,456,114,351.37	40,500,670,237.41	负债及所有者权益(或股东权益)总计	40,456,114,351.37	40,500,670,237.41

受托客户资产管理业务披露表

会证12表
单位:元

资产项目	期末余额	年初余额	负债项目	期末余额	年初余额
受托管理资金存款	615,909,764.60	509,084,928.46	受托管理资金	226,770,519,296.93	100,507,863,014.47
客户结算备付金	128,404,925.91	16,028,673.63	应付款项	15,957,054,477.35	8,403,186,971.21
应收款项	2,438,329,731.09	2,326,118,503.61			
受托投资	239,544,929,352.68	106,059,817,879.98			
其中: 投资成本	241,500,788,796.06	107,552,849,158.03			
已实现未结算损益	-1,955,859,443.38	-1,493,031,278.05			
合计	242,727,573,774.28	108,911,049,985.68	合计	242,727,573,774.28	108,911,049,985.68

会计主管: 苏声宏

法定代表人:

本月港币汇率: 0.89451
年初港币汇率: 0.83778

复核: 李国桥

主管会计工作负责人:

制表: 许旭玲

会计机构负责人:

本月美元汇率: 6.93700
年初美元汇率: 6.49360

利 润 表

单位: 广州证券股份有限公司

日期: 2016-12-31

会证02表

单位: 元

项 目	本期金额	本年累计金额
一、营业收入	349,712,210.49	2,755,952,857.45
手续费及佣金净收入	287,755,720.63	1,957,343,533.37
其中: 经纪业务手续费净收入	28,608,448.06	413,484,812.95
投资银行业务手续费净收入	44,553,199.40	770,518,946.16
资产管理业务手续费净收入	207,060,328.81	708,625,278.89
利息净收入	30,418,649.27	101,876,188.91
投资收益(损失以“-”号填列)	9,627,764.25	726,916,354.16
其中: 对联营企业和合营企业的投资收益	4,648,513.66	17,639,999.99
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	21,512,448.80	-33,633,515.80
汇兑收益(损失以“-”号填列)	397,790.16	3,445,249.17
其他业务收入	-162.62	5,047.64
二、营业支出	240,821,461.92	1,545,742,706.54
营业税金及附加	2,423,692.10	81,825,038.03
业务及管理费	231,770,002.22	1,441,868,514.07
资产减值损失	6,627,767.60	22,049,154.44
其他业务成本	-	-
三、营业利润(亏损以“-”号填列)	108,890,748.57	1,210,210,150.91
加: 营业外收入	12,555,779.97	14,916,529.26
减: 营业外支出	2,507,141.61	3,364,273.58
四、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	118,939,386.93	1,221,762,406.59
减: 所得税费用	28,329,759.98	296,328,957.81
五、净利润(净亏损以“-”号填列)	90,609,626.95	925,433,448.78
六、其他综合收益	-138,395,409.56	-548,029,334.09
七、综合收益总额	-47,785,782.61	377,404,114.69

其他综合收益披露表

项 目	本期金额	本年累计金额
1、可供出售金融资产公允价值变动净额	-184,527,212.75	-730,394,101.20
加: 当期利得(损失)金额	-133,528,022.30	-320,828,586.63
减: 前期计入其他综合收益当期转入利润的金额	50,999,190.45	409,565,514.57
2、按照权益法核算的在被投资单位其他综合收益中所享有的份额		
3、现金流量套期工具		
加: 当期利得(损失)金额		
减: 前期转为其他综合收益当期转入利润的金额		
当期转为被套期项目初始确认金额的调整额		
4、境外经营外币折算差额		
5、与计入其他综合收益项目相关的所得税影响	46,131,803.19	182,598,525.29
6、其他	-	-233,758.18
合 计	-138,395,409.56	-548,029,334.09

会计主管: 苏声宏

法定代表人:

主管会计工作负责人:

复核: 李国桥

制表: 许旭玲

会计机构负责人:

证券公司净资本计算表

编制单位：广州证券股份有限公司

2016 年 12 月 31 日

单位：元

项 目	行次	期初余额	期末余额	扣减比例	应计算的金额	
					期初余额	期末余额
净资产	1	11,154,988,879.52	11,107,203,096.91		11,154,988,879.52	11,107,203,096.91
减：优先股及永续次级债等	2			100%		-
减：资产项目的风险调整合计	3	2,057,838,125.96	2,065,915,850.83		1,899,949,726.58	1,907,315,560.41
存出保证金	4	247,454,426.68	254,567,036.08		89,566,027.30	95,966,745.66
其中：履约保证金	5			10%	-	-
期货保证金注1	6	89,566,027.30	95,966,745.66	100%	89,566,027.30	95,966,745.66
其他存出保证金	7				-	-
长期股权投资	8	1,522,180,528.30	1,526,829,041.96	100%	1,522,180,528.30	1,526,829,041.96
投资性房地产、固定资产注2	9	74,766,131.98	75,127,088.06	100%	74,766,131.98	75,127,088.06
其他注3	10	213,437,039.00	209,392,684.73	100%	213,437,039.00	209,392,684.73
减：或有负债的风险调整合计	11				-	-
对外担保金额及担保承诺注4	12			100%	-	-
其他或有负债注5	13			100%	-	-
加：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计注6	14				-	-
母公司提供的担保承诺	15			100%	-	-
其他项目	16				-	-
减：中国证监会认定或核准的其他调整项目合计注6	17				-	-
所有权受限等无法变现的资产（如被冻结）	18			100%	-	-
其他项目	19				-	-
核心净资本	20	9,097,150,753.56	9,041,287,246.08		9,255,039,152.94	9,199,887,536.50
加：附属净资本注7	21	3,220,117,267.80	3,070,117,267.80		3,220,117,267.80	3,070,117,267.80
借入的次级债（含永续次级债）注8	22	3,220,117,267.80	3,070,117,267.80		3,220,117,267.80	3,070,117,267.80
中国证监会认定或核准的其他调整项目注9	23					
净资本注10	24				12,475,156,420.74	12,270,004,804.30
附1：期末或有事项						
附2：其他需要特别说明的事项						

法定代表人：

郭三贵

复核：胡艳

主管会计工作负责人：

制表：许旭玲

凌宇华

会计机构负责人：

薛永

证券公司风险资本准备计算表

编制单位：广州证券股份有限公司

2016 年 12 月 31 日

单位：元

项目	行次	期初余额	期末余额	分类计算标准	风险资本准备	
					期初余额	期末余额
1. 市场风险资本准备	1	16,079,829,093.87	14,353,796,912.34		2,684,488,110.86	2,402,362,868.46
其中：（1）权益类证券及其衍生品规模注1	2	2,387,160,088.10	1,864,271,913.33		718,616,862.36	579,616,773.31
上海180指数、深圳100指数、沪深300指数成分股	3	131,139,901.78	-	15%	19,670,985.27	-
一般上市股票注2	4	2,087,368,010.02	1,751,499,271.06	30%	626,210,403.01	525,449,781.32
流通受限的股票注2	5	118,469,927.57	106,255,986.65	50%	59,234,963.79	53,127,993.33
其他股票注2	6	-	-	80%	-	-
权益类基金注3	7	8,434,080.44	4,955,324.62	10%	843,408.04	495,532.46
其中：分级基金中的非优先级基金	8	40,399,800.00	-	30%	12,119,940.00	-
股指期货、权益互换及卖出期权注4	9	1,014,007.55	1,272,331.00	20%	202,801.51	254,466.20
买入期权注4	10	334,360.74	289,000.00	100%	334,360.74	289,000.00
其他	11	-	-	-	-	-
（2）非权益类证券及其衍生品规模注1	12	13,692,669,005.77	12,489,524,999.01		1,965,871,248.50	1,822,746,095.15
国债、中央银行票据、国开债	13	1,604,506,290.00	1,954,824,340.00	0%	-	-
政策性金融债、政府支持机构债券注5	14	621,475,860.00	437,551,070.00	2%	12,429,517.20	8,751,021.40
地方政府债注5	15	1,771,118,510.00	1,301,198,690.00	5%	88,555,925.50	65,059,934.50
信用评级AAA级的信用债券注5	16	1,114,113,317.88	1,007,463,301.07	10%	111,411,331.79	100,746,330.11
信用评级AAA级以下，AA级（含）以上的信用债券注5	17	5,763,078,629.64	5,221,934,445.26	15%	864,461,794.45	783,290,166.79
信用评级AA级以下，BBB级（含）以上的信用债券注5	18	55,050,535.00	5,084,115.00	50%	27,525,267.50	2,542,057.50
信用评级BBB级以下的信用债券注5	19	40,000,000.00	110,000,000.00	80%	32,000,000.00	88,000,000.00
非权益类基金注6	20	-	-	10%	-	-
其中：货币基金	21	457,469,585.48	8,397,819.87	5%	22,873,479.27	419,890.99
国债期货、债券远期及利率互换注4	22	1,064,593,505.00	1,469,158,982.50	20%	212,918,701.00	293,831,796.50
集合及信托等产品注6	23	345,146,082.00	215,219,790.17	-	165,783,041.00	100,853,820.09
其中：未约定先行承担亏损	24	27,160,000.00	27,024,300.00	25%	6,790,000.00	6,756,075.00
约定先行承担亏损	25	317,986,082.00	188,195,490.17	50%	158,993,041.00	94,097,745.09
定向产品注6	26	855,629,508.77	758,375,294.14	50%	427,814,754.39	379,187,647.07
大宗商品现货（含黄金）	27	-	-	8%	-	-
大宗商品衍生品注4	28	487,182.00	317,151.00	20%	97,436.40	63,430.20
其他	29	-	-	-	-	-
（3）已对冲风险的权益类证券及其衍生品注7	30	-	-	-	-	-
权益类证券	31	-	-	5%	-	-
权益类衍生品	32	-	-	5%	-	-
（4）已对冲风险的非权益类证券及其衍生品注7	33	-	-	-	-	-
非权益类证券	34	-	-	1%	-	-
非权益类衍生品	35	-	-	1%	-	-
2. 信用风险资本准备	36	13,381,059,101.62	13,723,046,828.11		1,981,077,178.76	2,040,021,880.46
融资类业务注8	37	10,733,493,791.39	10,789,676,336.03		1,779,506,486.69	1,829,296,303.10
其中：场内融资业务	38	3,671,922,715.95	3,286,389,641.04	10%	367,192,271.60	328,638,964.10
其中：股票质押回购	39	7,061,571,075.44	7,503,286,694.99	20%	1,412,314,215.09	1,500,657,339.00
场外融资业务	40	-	-	30%	-	-
应收账款	41	396,683,204.20	466,648,020.48		179,061,871.01	186,058,352.64
其中：账龄一年以内（含一年）	42	241,801,481.32	311,766,297.60	10%	24,180,148.13	31,176,629.76
账龄一年以上、应收股东及其关联公司款项	43	154,881,722.88	154,881,722.88	100%	154,881,722.88	154,881,722.88
其他	44	2,250,882,106.03	2,466,722,471.60		22,508,821.06	24,667,224.72
3. 操作风险资本准备注9	45	2,951,343,770.34	2,951,343,770.34		472,850,587.82	472,850,587.82
证券经纪业务净收入	46	741,585,628.44	741,585,628.44	12%	88,990,275.41	88,990,275.41
证券投资咨询业务净收入	47	16,733,002.41	16,733,002.41	12%	2,007,960.29	2,007,960.29
证券承销与保荐业务、财务顾问业务净收入	48	261,526,076.30	261,526,076.30	15%	39,228,911.45	39,228,911.45
证券资产管理业务净收入	49	168,213,023.29	168,213,023.29	15%	25,231,953.49	25,231,953.49
证券自营业务净收入	50	1,347,113,199.62	1,347,113,199.62	18%	242,480,375.93	242,480,375.93
融资类业务及其他业务净收入	51	416,172,840.28	416,172,840.28	18%	74,911,111.25	74,911,111.25
4. 特定风险资本准备	52	119,485,932,994.75	162,588,802,945.69		935,096,780.99	1,300,869,864.07
证券公司资产管理业务注10	53	119,485,932,994.75	162,588,802,945.69		935,096,780.99	1,300,869,864.07
其中：结构化集合资管计划	54	3,139,902,580.23	640,600,970.43	1%	31,399,025.80	6,406,009.70
投资非标资产的定向资管计划	55	79,724,002,523.08	120,379,280,837.17	0.9%	717,516,022.71	1,083,413,527.53
各类私募投资基金（含各类直投基金）注11	56	1,535,796,509.58	1,602,860,576.03	0.7%	10,750,575.57	11,220,024.03
其他定向资管计划	57	35,086,231,381.86	39,966,060,562.06	0.5%	175,431,156.91	199,830,302.81
分类调整前的各项风险资本准备合计注12	58	151,898,164,960.58	193,616,990,456.48		6,073,512,658.43	6,216,105,200.81
分类调整后的各项风险资本准备合计注13	59	151,898,164,960.58	193,616,990,456.48		5,466,161,392.59	5,594,494,680.73
附：其他需要特别说明的事项	60					

复核：胡艳

法定代表人：

主管会计工作负责人：

制表：许旭玲

会计机构负责人：

证券公司风险控制指标监管报表

编制单位: 广州证券股份有限公司

2016 年 12 月 31 日

单位: 元

项 目	行次	期初	期末	预警标准	监管标准	备注
核心净资本	1	9,255,039,152.94	9,199,887,536.50			-0.60%
附属净资本	2	3,220,117,267.80	3,070,117,267.80			-4.66%
净资本	3	12,475,156,420.74	12,270,004,804.30			-1.64%
净资产	4	11,154,988,879.52	11,107,203,096.91			-0.43%
各项风险资本准备之和	5	5,466,161,392.59	5,594,494,680.73			2.35%
表内外资产总额	6	35,629,873,665.38	35,677,811,345.58			0.13%
风险覆盖率注1	7	228.23%	219.32%	≥120%	≥100%	-3.90%
资本杠杆率注2	8	25.98%	25.79%	≥9.6%	≥8%	-0.73%
流动性覆盖率注3	9	715.98%	146.96%	≥120%	≥100%	-79.47%
净稳定资金率注4	10	134.12%	136.15%	≥120%	≥100%	1.51%
净资本/净资产	11	111.83%	110.47%	≥24%	≥20%	-1.22%
净资本/负债	12	54.34%	54.20%	≥9.6%	≥8%	-0.26%
净资产/负债	13	48.59%	49.06%	≥12%	≥10%	0.97%
自营权益类证券及证券衍生品注5/净资本	14	19.14%	15.19%	≤80%	≤100%	-20.60%
自营非权益类证券及其衍生品注6/净资本	15	109.76%	101.79%	≤400%	≤500%	-7.26%
持有一种权益类证券的成本与净资本的比例前五名	16			≤24%	≤30%	
其中:						
委托证券公司理财	17	10.79%	10.97%			
天坛生物	18	0.47%	0.38%			
达瑞生物	19	0.20%	0.21%			
轩轹网络	20	0.17%	0.17%			
龙蛙农业	21	0.16%	0.16%			
持有一种权益类证券的市值与其总市值的比例前五名注7	22			≤4%	≤5%	
其中:						
远方动力	23	3.60%	3.60%			
龙蛙农业	24	2.98%	2.98%			
丰兆新材	25	3.00%	2.49%			
宝中海洋	26	2.27%	2.27%			
数维翔图	27	1.75%	1.75%			
持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例前五名注8	28			≤16%	≤20%	
其中:						
PR梵投债	29	28.88%	28.88%			
14河源润业债	30	25.56%	25.56%			
12中山兴中债	31	21.43%	21.43%			
15云城投MTN001	32	20.00%	20.00%			
PR冶城投	33	20.00%	20.00%			
融资(含融券)的金额/净资本注9	34	86.04%	87.94%	≤320%	≤400%	
对单一客户融资(含融券)业务规模与净资本的比例前五名注10	35			≤4%	≤5%	
其中:						
上海龙宇控股有限公司	36	3.33%	3.39%			
广东永裕恒丰投资有限公司、永裕恒丰投资管理有限公司	37	3.21%	3.26%			
马鸿	38	3.21%	3.26%			
上海灏轩投资管理有限公司	39	3.21%	3.26%			
京基集团有限公司	40	3.21%	3.26%			
接受单只担保股票市值与该股票总市值比例前五名注11	41			≤16%	≤20%	
其中:						
600416湘电股份	42	1.50%	1.44%			
000537广宇发展	43	1.27%	1.07%			
002405四维图新	44	0.79%	1.03%			
002102冠福股份	45	0.99%	0.99%			
600868梅雁吉祥	46	1.01%	0.99%			

注: 1. 风险覆盖率=净资本/各项风险资本准备之和×100%

2. 资本杠杆率=核心净资本/表内外资产总额×100%, 此处核心净资本不扣除担保等或有负债的风险调整。

3. 流动性覆盖率=优质流动性资产/未来30日内现金净流出×100%

4. 净稳定资金率=可用稳定资金/所需稳定资金×100%

5. “自营权益类证券及其衍生品”包括: 股票、权益类基金、股指期货、权益互换、期权等。其中, 自营权益类证券按照其市值计算; 股指期货投资规模按照合约名义价值总额的15%计算; 权益互换投资规模按照合约名义价值总额的10%计算; 买入期权投资规模按照买入股票期权和买入场外期权的权利金价格之和计算; 卖出股票期权投资规模按照Delta金额的15%计算; 卖出场外期权投资规模按照该期权在给定压力情形下的最大损失的5倍计算, 且不低于名义金额的5%; 给定压力情形为期权标的证券价格以当前价格为基础上下波动20%。

对于已有效对冲风险的投资组合, 按投资规模总额的5%计算, 投资规模为多头规模的绝对值与空头规模的绝对值之和。

6. “自营非权益类证券及其衍生品”包括: 债券、非权益类基金、国债期货、债券远期、利率互换、外汇衍生品、定向、集合及信托等产品。其中, 自营非权益类证券按照其市值计算; 国债期货、债券远期投资规模分别按照合约名义价值总额的5%和50%计算; 利率互换、外汇衍生品投资规模按照合约名义价值总额的3%计算。对于已有效对冲风险的投资组合, 按投资规模总额的1%计算, 投资规模为多头规模的绝对值与空头规模的绝对值之和。

7. 因包销、中国证监会认可的做市业务以及股票质押违约处理等导致的情形及中国证监会另有认定的除外。

8. 不含同业存单。因包销等导致的情形及中国证监会另有认定的除外。证券公司委托其他证券公司、基金公司、信托公司等机构进行的一对一投资不必填报。

9. 融资(含融券)的金额指证券公司开展融资融券业务、约定式购回交易、股票质押式回购交易等融资类业务融出(含融券)金额总计。

10. 单一客户融资(含融券)业务指客户参与融资融券业务、约定式购回交易、股票质押式回购交易等融资类业务。

11. 指证券公司开展融资融券业务接受的担保股票。

12. 表中有关前五名的期初数据, 是指期末前五名情形所对应的期初数。

备注: 1、月末因股转系统做市业务, 持有2只股票市值占比超5%, 分别是轩轹网络8.86%、普金科技6.83%, 特此说明;

复核: 胡艳

制表: 许旭玲

法定代表人:

主管会计工作负责人:

会计机构负责人:

证券公司表内外资产总额计算表

编制单位：广州证券股份有限公司

2016 年 12 月 31 日

单位：元

项 目	行次	期末	转换系数	计算结果
表内资产总额注1	1	40,456,114,351.37	100%	40,456,114,351.37
减：表内资产扣除项	2	6,710,073,765.86		6,710,073,765.86
1. 客户资金	3	6,710,073,765.86		6,710,073,765.86
代理买卖证券款、信用交易代理买卖证券款、代理承销证券款	4	6,706,833,496.65	100%	6,706,833,496.65
其它	5	3,240,269.21		3,240,269.21
表内资产余额	6	33,746,040,585.51		33,746,040,585.51
1. 证券衍生产品注2	7	1,471,037,464.50		1,471,037,464.50
国债期货、债券远期及利率互换	8	1,469,158,982.50	100%	1,469,158,982.50
股指期货、权益互换及卖出股票期权	9	1,272,331.00	100%	1,272,331.00
大宗商品衍生品	10	317,151.00	100%	317,151.00
卖出场外期权	11	-	100%	-
其他	12	289,000.00		289,000.00
2. 资产管理业务注3	13	230,366,647,786.10	0.2%	460,733,295.57
3. 其他表外项目	14	-		-
转融通融入证券注4	15	-	10%	-
股票再融资承销承诺注5	16	-	15%	-
股票IPO承销承诺注5	17	-	10%	-
债券承销承诺注5	18	-	5%	-
对外担保金额及担保承诺注6	19	-	100%	-
其它或有事项注7	20	-	100%	-
表外项目余额注8	21	231,837,685,250.60		1,931,770,760.07
表内外资产总额注9	22	265,583,725,836.11		35,677,811,345.58

复核：胡艳

制表：许旭玲

法定代表人：

主管会计工作负责人：

会计机构负责人：

邵三发

廖家华

张华